



Halbjahresbericht ➤ Monega Dänische Covered Bonds LD

zum 30. Juni 2021

Halbjahresbericht des Monega Dänische Covered Bonds LD

ZUM 30. JUNI 2021

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind	7
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8
■ Zusätzliche Informationen für Anleger in der Republik Österreich	9

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	476.913.376,42	100,05
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	473.814.618,19	99,40
Gedekte Schuldverschreibungen	399.336.418,45	83,78
Regierungsanleihen	52.203.126,58	10,95
Agency	22.275.073,16	4,67
3. Derivate	-314.221,08	-0,07
Devisen-Derivate	-41.721,08	-0,01
Zins-Derivate	-272.500,00	-0,06
4. Forderungen	1.734.895,69	0,36
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	1.678.083,62	0,35
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-245.734,88	-0,05
Sonstige Verbindlichkeiten	-245.734,88	-0,05
III. Fondsvermögen	476.667.641,54	100,00^{*)}

^{*)} Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens	
Börsengehandelte Wertpapiere								473.814.618,19	99,40	
Verzinsliche Wertpapiere										
Dänische Kronen								473.814.618,19	99,40	
0,1000 % KOMMUNEKREDIT V.20-33	DK0008931611		DKK	50.000.000	-	-	%	95,542	6.424.071,27	1,35
0,2500 % DÄNEMARK V.18-22	DK0009923997		DKK	385.000.000	390.000.000	5.000.000	%	100,830	52.203.126,58	10,95
0,5000 % DLR KRED. PFE V.19-40	DK0006348677		DKK	187.345.981	30.000.000	51.207.753	%	95,933	24.169.027,13	5,07
0,5000 % JYSKE REALKR. HYP.-PFE V.19-40	DK0009397812		DKK	28.373.571	14.500.000	626.429	%	96,044	3.664.642,77	0,77
0,5000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.19-40	DK0002044635		DKK	40.691.452	-	22.664.508	%	96,140	5.260.806,55	1,10
0,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50	DK0009525081		DKK	20.538.833	-	356.343	%	92,508	2.555.053,81	0,54
0,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50	DK0009525321		DKK	29.969.542	-	23.958	%	91,715	3.696.305,60	0,78
0,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE S.27S	DK0004613262		DKK	9.967.970	-	13.903	%	92,357	1.238.010,46	0,26
0,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.19-50	DK0004613189		DKK	13.717.754	-	239.303	%	92,524	1.706.810,91	0,36
0,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.20-43	DK0004616364		DKK	20.000.000	20.000.000	-	%	95,190	2.560.150,82	0,54
1,0000 % DLR KRED. PFE V.19-50	DK0006348164		DKK	169.360.877	48.000.000	81.526.762	%	96,172	21.903.209,00	4,60
1,0000 % DLR KRED. PFE V.19-50	DK0006348750		DKK	109.805.641	-	1.065.193	%	94,917	14.015.648,03	2,94
1,0000 % DLR KREDIT PFE V.20-53	DK0006350574		DKK	20.000.000	20.000.000	-	%	93,755	2.521.566,65	0,53
1,0000 % JYSKE REALKR. HYP.-PFE V.19-50	DK0009397069		DKK	19.040.916	20.000.000	959.084	%	96,349	2.467.065,61	0,52
1,0000 % JYSKE REALKR. HYP.-PFE V.19-50	DK0009397739		DKK	111.054.004	16.059.549	3.480.004	%	95,356	14.240.636,54	2,99
1,0000 % JYSKE REALKR. PFE V.20-53	DK0009403131		DKK	19.952.789	-	10.047.211	%	93,939	2.520.559,11	0,53
1,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.19-50	DK0002044551		DKK	9.380.575	2.171.178	31.159.228	%	96,374	1.215.718,80	0,26
1,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.19-50	DK0002044718		DKK	209.658.701	-	8.082.344	%	95,338	26.879.684,15	5,64
1,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.20-53	DK0002047224		DKK	1.264.746	4.935.073	13.667.012	%	95,342	162.156,67	0,03
1,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.20-53	DK0002047307		DKK	361.387.333	-	612.667	%	93,957	45.661.076,69	9,58
1,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.17-40	DK0009515017		DKK	20.000.000	20.000.000	-	%	99,882	2.686.345,07	0,56
1,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50	DK0009522815		DKK	161.684.598	-	41.598.366	%	96,407	20.961.631,89	4,40
1,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50	DK0009524431		DKK	384.633.719	43.855.451	117.763.637	%	95,221	49.252.269,60	10,33
1,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.20-43	DK0009529315		DKK	35.000.000	35.000.000	-	%	98,596	4.640.582,61	0,97
1,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.20-53	DK0009527293		DKK	4.906.897	4.000.000	10.089.649	%	95,281	628.725,24	0,13
1,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.20-53	DK0009527376		DKK	0	-	29.997.830	%	93,895	0,00	0,00
1,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.19-50	DK0004612454		DKK	144.140.968	113.000.000	110.549.292	%	96,234	18.653.659,13	3,91
1,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.19-50	DK0004612884		DKK	429.710.691	105.000.000	11.750.568	%	95,216	55.021.726,75	11,54
1,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.20-53	DK0004616018		DKK	11.067.820	-	100.232.180	%	93,884	1.397.339,64	0,29
1,5000 % DLR KRED. PFE V.17-40	DK0006342712		DKK	0	-	-	%	102,516	0,00	0,00

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens	
1,5000 % DLR KRED. PFE V.18-50	DK0006346465		DKK	14.397.008	16.000.000	1.602.992	%	100,037	1.936.772,99	0,41
1,5000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.21-53	DK0002050368		DKK	12.400.000	12.400.000	-	%	99,368	1.656.969,09	0,35
1,5000 % NORDEA KREDIT PFE V.19-50	DK0002044122		DKK	30.465.503	-	6.531.165	%	99,442	4.074.024,21	0,85
1,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.17-50	DK0009513152		DKK	30.197.909	-	7.010.348	%	100,026	4.061.948,34	0,85
1,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50	DK0009521254		DKK	63.843.578	38.000.000	7.178.828	%	99,414	8.535.118,86	1,79
1,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.20-53	DK0009528424		DKK	40.000.000	40.000.000	-	%	98,130	5.278.475,43	1,11
1,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.17-50	DK0004608189		DKK	27.633.053	7.000.000	6.703.817	%	100,026	3.716.955,35	0,78
1,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.19-50	DK0004611803		DKK	30.238.864	35.000.000	4.761.136	%	99,403	4.042.131,92	0,85
1,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE. V.21-53	DK0004619384		DKK	79.000.000	79.000.000	-	%	98,142	10.426.230,87	2,19
1,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.21-53	DK0004619467		DKK	31.000.000	31.000.000	-	%	99,335	4.141.045,55	0,87
2,0000 % JYSKE REALKR. PFE V.15-47	DK0009387698		DKK	0	-	13.792.977	%	103,216	0,04	0,00
2,0000 % KOMMUNEKREDIT V.03-24	DK0008923196		DKK	94.000.000	-	-	%	107,719	13.616.521,77	2,86
2,0000 % KOMMUNEKREDIT V.15-47	DK0008928823		DKK	87.672	-	1.329	%	103,100	12.155,24	0,00
2,0000 % KOMMUNEKREDIT V.17-50	DK0008929557		DKK	15.853.594	-	287.471	%	102,675	2.188.963,25	0,46
2,0000 % NORDEA KR. HYP.-PFE 17-50 IOH	DK0002039049		DKK	66.952.631	60.000.000	3.405.276	%	102,025	9.185.909,63	1,93
2,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.14-37	DK0002030766		DKK	0	-	-	%	104,618	0,00	0,00
2,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.15-47	DK0002032978		DKK	0	-	-	%	103,224	0,00	0,00
2,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.17-50	DK0009513582		DKK	45.138.912	69.000.000	23.861.088	%	102,536	6.224.070,29	1,31
2,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.17-50	DK0009515876		DKK	38.032.773	41.000.000	8.139.531	%	102,030	5.218.327,94	1,09
2,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.17-50	DK0004606134		DKK	2.603.197	-	1.040.742	%	102,575	359.082,79	0,08
2,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.17-50	DK0004606563		DKK	2.972.823	-	1.535.737	%	102,062	408.019,11	0,09
2,0000 % REALKR.DANM. PFE V.15-47	DK0009297194		DKK	1.300.258	-	473.726	%	103,310	180.641,40	0,04
2,0000 % REALKR.DANM. PFE V.15-47	DK0009297350		DKK	1.520.079	-	615.407	%	102,872	210.285,41	0,04
2,5000 % KOMMUNEKREDIT V.12-41	DK0008927858		DKK	237.119	-	5.232	%	104,625	33.361,63	0,01
Summe Wertpapiervermögen								473.814.618,19	99,40	
Derivate								-314.221,08	-0,07	
Zins-Derivate										
Zinsterminkontrakte								-272.500,00	-0,06	
EURO-BUND-FUTURE 09/21		EUREX	STK	-30.000.000			EUR	-272.500,00	-0,06	
Devisen-Derivate										
Devisenterminkontrakte								-41.721,08	-0,01	
DKK/EUR 371.835.500,00		OTC						936,74	0,00	

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
DKK/EUR 557.771.250,00		OTC						-1.346,91	0,00
DKK/EUR 744.080.000,00		OTC						-53.326,85	-0,01
DKK/EUR 825.513.660,00		OTC						-2.338,33	0,00
DKK/EUR 995.070.600,00		OTC						14.354,27	0,00
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								1.678.083,62	0,35
Bankguthaben								1.678.083,62	0,35
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F			EUR	1.498.177,77			% 100,000	1.498.177,77	0,31
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F			DKK	1.337.824,87			% 100,000	179.905,85	0,04
Sonstige Vermögensgegenstände								1.734.895,69	0,36
ZINSANSPRÜCHE			EUR	1.351.885,69				1.351.885,69	0,28
FORDERUNGEN AUS CASH COLLATERAL			EUR	10.000,00				10.000,00	0,00
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	100.510,00				100.510,00	0,02
GELEISTETE VARIATION MARGIN			EUR	272.500,00				272.500,00	0,06
Sonstige Verbindlichkeiten								-245.734,88	-0,05
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-162.388,87				-162.388,87	-0,03
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-83.346,01				-83.346,01	-0,02
Fondsvermögen							EUR	476.667.641,54	100,00*

*) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Monega Dänische Covered Bonds LD (R)

ISIN	DE000A2JQL59
Fondsvermögen (EUR)	10.909.029,13
Anteilwert (EUR)	48,41
Umlaufende Anteile (STK)	225.324,00

Monega Dänische Covered Bonds LD (I)

ISIN	DE000A141WH1
Fondsvermögen (EUR)	465.758.612,41
Anteilwert (EUR)	100,78
Umlaufende Anteile (STK)	4.621.493,00

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.06.2021 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2021

Dänische Kronen	(DKK)	7,43625 = 1 (EUR)
-----------------	-------	-------------------

■ Marktschlüssel

b) Terminbörsen

EUREX	Frankfurt/Zürich - Eurex (Eurex DE/Eurex Zürich)
-------	--

c) OTC	Over-the-Counter
--------	------------------

Im Berichtszeitraum haben gegebenenfalls Kapitalmaßnahmen und eventuelle unterjährige Änderungen der Stammdaten eines Wertpapiers stattgefunden. Diese Kapitalmaßnahmen und die Umbuchungen aufgrund von Stammdatenänderungen sind ohne Umsatzzahlen in der „Vermögensaufstellung“ und in den „Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen“ enthalten.

■ **Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind**

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Dänische Kronen

0,5000 % DÄNEMARK DK0009923567 V.16-27		DKK	-100.000.000	
0,5000 % DÄNEMARK DK0009923807 V.19-29		DKK	108.000.000	379.500.000
1,0000 % JYSKE REALKR. HYP.-PFE V.17-40	DK0009393902	DKK	- 16.731.239	
1,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE 20-53	DK0004616794	DKK	70.000.000	280.000.000
1,0000 % REALKR.DANM.PFE. V.21-43	DK0004619111	DKK	15.000.000	15.000.000
2,0000 % DLR KREDIT PFE V.17-50	DK0006342985	DKK	- 9.177.359	

■ **Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen**

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
---------------------	------------------------------	------------------

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte

EUR

50.889

Basiswerte: (EURO-BUND-FUTURE 06/21)

Devisenterminkontrakte (Verkauf)

EUR

427.800

DKK/EUR

EUR

427.800

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	99,40 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-0,07 %

Sonstige Angaben

Monega Dänische Covered Bonds LD (R)

ISIN	DE000A2JQL59
Fondsvermögen (EUR)	10.909.029,13
Anteilwert (EUR)	48,41
Umlaufende Anteile (STK)	225.324,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 3,00%, derzeit 1,50%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 0,50%, derzeit 0,35%
Mindestanlagesumme (EUR)	keine
Ertragsverwendung	Ausschüttung

Monega Dänische Covered Bonds LD (I)

ISIN	DE000A141WH1
Fondsvermögen (EUR)	465.758.612,41
Anteilwert (EUR)	100,78
Umlaufende Anteile (STK)	4.621.493,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 3,00%, derzeit 0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 0,50%, derzeit 0,17%
Mindestanlagesumme (EUR)	500.000,00
Ertragsverwendung	Ausschüttung

Angaben zum Bewertungsverfahren gemäß §§ 26-31 und 34 KARBV

Das im Folgenden dargestellte Vorgehen bei der Bewertung der Vermögensgegenstände des Sondervermögens findet auch in Zeiten ggf. auftretender Marktverwerfungen i.Z.m. den Auswirkungen der Covid-19 Pandemie Anwendung. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

Alle Vermögensgegenstände, die zum Handel an einer Börse oder einem anderem organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, werden mit dem zuletzt verfügbaren Preis bewertet, der aufgrund von fest definierten Kriterien als handelbar eingestuft werden kann und der eine verlässliche Bewertung sicherstellt (§§ 27, 34 KARBV).

Die verwendeten Preise sind Börsenpreise, Notierungen auf anerkannten Informationssystemen oder Kurse aus emittentenunabhängigen Bewertungssystemen (§§ 28, 34 KARBV). Anteile an Investmentvermögen werden mit ihrem zuletzt verfügbaren veröffentlichten Rücknahmekurs der jeweiligen Kapitalverwaltungsgesellschaft bewertet.

Bankguthaben werden zum Nennwert zuzüglich zugeflossener Zinsen, kündbare Festgelder zum Verkehrswert und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet (§§ 29, 34 KARBV). Die Bewertung erfolgt grundsätzlich zum letzten gehandelten Preis gemäß festgelegtem Bewertungszeitpunkt (Vortag oder gleichtäglich).

Vermögensgegenstände, die nicht zum Handel an einem organisierten Markt zugelassen sind oder für die keine handelbaren Kurse festgestellt werden können, werden mit Hilfe von anerkannten Bewertungsmodellen auf Basis beobachtbarer Marktdaten bewertet. Ist keine Bewertung auf Basis von Modellen möglich, erfolgt eine Bewertung durch andere geeignete Verfahren zur Preisfeststellung (§§ 28, 34 KARBV). Andere

geeignete Verfahren kann die Verwendung eines von einem Dritten ermittelten Preises sein und unterliegt einer Plausibilitätsprüfung durch die KVG.

Optionen und Futures, die zum Handel an einer Börse zugelassen oder in einem organisierten Markt einbezogen sind, werden zu dem jeweils verfügbaren handelbaren Kurs (Settlementpreis der jeweiligen Börse), der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet.

■ Zusätzliche Informationen für Anleger in der Republik Österreich

Der Vertrieb der Anteile der Investmentfonds

Monega Dänische Covered Bonds LD (I)

(ISIN DE000A141WH1)

Monega Dänische Covered Bonds LD (R)

(ISIN DE000A2JQL59)

in der Republik Österreich ist gemäß der gültigen Fassung des Investment-Fonds-Gesetzes (InvFG) der Finanzmarktaufsicht, Wien, angezeigt worden.

Zahlstelle sowie Vertriebsstelle in Österreich

Hypo Vorarlberg Bank AG

Hypo-Passage 1

A-6900 Bregenz

Bei der österreichischen Zahlstelle können Rücknahmeanträge für Anteile des oben genannten Fonds eingereicht und die Rücknahmeerlöse, etwaige Ausschüttungen sowie sonstige Zahlungen durch die österreichische Zahlstelle an die Anteilinhaber ausgezahlt werden.

Ebenfalls bei der österreichischen Zahlstelle sind alle erforderlichen Informationen für die Anleger kostenlos erhältlich wie z.B.

- ___ die Vertragsbedingungen (= Fondsbestimmungen)
- ___ der Verkaufsprospekt
- ___ die wesentlichen Anlegerinformationen
- ___ die Jahres- und Halbjahresberichte
- ___ die Ausgabe- und Rücknahmepreise.

Die aktuellen Ausgabe- und Rücknahmepreise für die Fondsanteile werden in der österreichischen Zeitung „Der Standard“ veröffentlicht.

Bestellung des steuerlichen Vertreters

Als steuerlicher Vertreter im Sinne des § 186 Abs. 2 Z.2 InvFG

wird die folgende Kanzlei bestellt:

Dr. Helmut Moritz LLM, Steuerberater

A-1010 Wien, Schottenbastei 6/8

