

Halbjahresbericht

Monega Global Bond

zum 31. März 2022

Halbjahresbericht des Monega Global Bond

ZUM 31. MÄRZ 2022

■ 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

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	26.873.664,45	103,99
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	24.720.682,31	95,66
Regierungsanleihen	12.577.665,62	48,67
Versorgungswerte	1.976.482,39	7,65
Banking/Bankwesen	1.138.496,35	4,41
Gesundheitswesen	1.129.413,04	4,37
Finanzsektor	1.113.450,76	4,31
Gebietskörperschaften	1.099.263,17	4,25
Medien	999.747,73	3,87
Investitionsgüter	851.548,62	3,30
Handel	834.656,68	3,23
Konsumgüter	789.124,11	3,05
Energiewerte	679.814,28	2,63
Anleihen supranationaler Organisationen	622.653,93	2,41
Staatlich garantierte Anlagen	400.280,00	1,55
Automobil	281.486,97	1,09
Versicherungen	226.598,66	0,88
3. Derivate	-6.598,30	-0,03
Devisen-Derivate	-6.598,30	-0,03
4. Forderungen	1.196.975,30	4,63
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	962.605,14	3,73
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-1.031.929,79	-3,99
Sonstige Verbindlichkeiten	-1.031.929,79	-3,99
III. Fondsvermögen	25.841.734,66	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 31.03.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								13.043.957,90	50,48
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								3.783.828,45	14,64
0,3750 % INVESTOR MTN V.20-35	XS2250024010		EUR	350.000	-	-	% 82,571	288.997,03	1,12
0,5000 % ELI LILLY V.21-33	XS2386186063		EUR	200.000	-	-	% 89,456	178.912,72	0,69
0,6250 % A2A MTN V.21-31	XS2364001078		EUR	300.000	-	-	% 87,509	262.527,81	1,02
0,7500 % MERCEDES-B.GR. MTN V.19-30	DE000A2YNZX6		EUR	300.000	-	-	% 93,829	281.486,97	1,09
1,0000 % ESB FIN. MTN V.22-34	XS2432544349		EUR	300.000	300.000	-	% 92,009	276.027,57	1,07
1,2500 % CARREFOUR MTN V.15-25	XS1179916017		EUR	300.000	-	-	% 99,766	299.297,94	1,16
1,2500 % KFW MTN V.16-36	DE000A168Y48		EUR	400.000	-	-	% 100,070	400.280,00	1,55
1,6500 % JOHNSON&J. V.16-35	XS1412266907		EUR	200.000	-	-	% 101,679	203.358,32	0,79
1,9500 % SPANIEN V.15-30	ES00000127A2		EUR	350.000	-	-	% 106,167	371.584,50	1,44
2,0000 % ITALIEN B.T.P. V.18-28	IT0005323032		EUR	500.000	-	-	% 103,190	515.950,00	2,00
2,0000 % VESTAS W.SYS.FIN. MTN V.22-34	XS2449929517		EUR	401.000	401.000	-	% 98,326	394.288,22	1,53
2,7500 % B.A.T.INT.FIN. MTN V.13-25	XS0909359332		EUR	300.000	-	-	% 103,706	311.117,37	1,20
US-Dollar								2.990.114,49	11,57
2,9500 % VIRGINIA ELEC.&POW. V.16-26	US927804FV18		USD	250.000	-	-	% 98,960	222.352,04	0,86
3,2000 % INTER-AMER.DEV.BK. MTN V.12-42	US4581X0BX51		USD	300.000	-	-	% 104,902	282.843,12	1,09
3,2000 % NSTAR ELEC. V.17-27	US67021CAM91		USD	300.000	-	-	% 100,091	269.870,85	1,04
3,6000 % PEPSICO V.12-42	US713448CC02		USD	250.000	-	-	% 101,968	229.111,13	0,89
3,7500 % INDIANA MICHIGAN POW. V.17-47	US454889AR79		USD	300.000	-	-	% 95,772	258.226,76	1,00
3,8750 % CITIGROUP V.13-23	US172967HD63		USD	500.000	-	-	% 102,269	459.572,87	1,78
4,1250 % FLORIDA POW.& LIGHT V.11-42	US341081FF99		USD	200.000	-	-	% 105,766	190.115,49	0,74
4,8750 % EIB V.06-36	US298785DV50		USD	50.000	-	-	% 125,540	56.414,87	0,22
4,9000 % ANHEUSER-BUSCH FIN. V.16-46	US035242AN64		USD	250.000	-	-	% 110,773	248.895,61	0,96
5,3000 % KINDER MORGAN V.14-34	US49456BAG68		USD	225.000	-	-	% 109,424	221.278,08	0,86
6,0000 % PROGRESS EN. V.09-39	US743263AP08		USD	250.000	-	-	% 119,293	268.037,73	1,04
7,3750 % ADB V.93-23	XS0043037505		USD	300.000	-	-	% 105,107	283.395,94	1,10
Norwegische Kronen								1.298.886,83	5,03
1,3750 % NORWEGEN V.20-30	NO0010875230		NOK	3.000.000	-	-	% 91,060	280.789,39	1,09
1,7500 % NORWEGEN V.15-25	NO0010732555		NOK	10.100.000	5.000.000	-	% 98,070	1.018.097,44	3,94
Tschechische Kronen								1.330.785,45	5,15
0,9500 % TSCHECHIEN V.15-30	CZ0001004477		CZK	6.500.000	-	-	% 80,370	213.876,89	0,83
1,0000 % TSCHECHIEN V.15-26	CZ0001004469		CZK	6.500.000	-	-	% 87,380	232.531,58	0,90
2,4000 % TSCHECHIEN V.14-25	CZ0001004253		CZK	13.000.000	13.000.000	-	% 93,280	496.464,76	1,92
4,8500 % TSCHECHIEN V.07-57	CZ0001002059		CZK	8.500.000	-	-	% 111,470	387.912,22	1,50
Japanische Yen								3.219.574,68	12,46
0,1000 % JAPAN NO.342	JP1103421G35		JPY	300.000.000	-	-	% 100,416	2.230.675,19	8,63
0,3000 % JAPAN V.19-39	JP1201691K75		JPY	140.000.000	-	-	% 95,392	988.899,49	3,83
Zloty								420.768,00	1,63
2,5000 % POLEN V.16-27	PL0000109427		PLN	2.250.000	-	-	% 86,710	420.768,00	1,63

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								11.676.724,41	45,19
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								859.462,68	3,33
0,3750 % DANFOSS FIN. V.21-28	XS2332689681		EUR	500.000	-	-	% 91,452	457.260,40	1,77
1,5460 % SUMI.MITSUI FIN.GR. V.16-26	XS1426022536		EUR	400.000	-	-	% 100,551	402.202,28	1,56
US-Dollar								9.717.998,56	37,61
0,2500 % USA TREA. V.20-25	US912828ZW33		USD	650.000	650.000	-	% 92,914	542.795,48	2,10
0,2500 % USA TREA. V.21-23	US91282CDA62		USD	460.000	460.000	-	% 97,234	401.993,57	1,56
1,5000 % USA TREA. V.19-24	US912828YV68		USD	1.100.000	-	-	% 97,430	963.219,87	3,73
1,6250 % USA TREA. V.16-26	US912828P469		USD	2.200.000	-	-	% 96,688	1.911.764,71	7,40
2,1250 % USA TREA. V.16-23	US912828U576		USD	1.100.000	-	-	% 99,875	987.394,96	3,82
3,0000 % METRO.P.L.GL.FD.I MTN V.13-23	US59217HAE71		USD	250.000	-	-	% 100,850	226.598,66	0,88
3,5000 % MEDTRONIC V.14-25	US585055BS43		USD	143.000	-	-	% 102,018	131.115,22	0,51
3,6250 % MCDONALD'S MTN V.13-43	US58013MER16		USD	200.000	-	-	% 94,420	169.721,53	0,66
3,7000 % GILEAD SCIEN. V.14-24	US375558AW38		USD	250.000	-	-	% 101,783	228.694,23	0,88
3,8500 % STARBUCKS V.13-23	US855244AD16		USD	400.000	-	-	% 101,707	365.637,21	1,41
3,8750 % MORGAN STANLEY V.14-24	US61746BDQ68		USD	600.000	-	-	% 101,943	549.733,14	2,13
3,8750 % USA TREA. V.10-40	US912810QK79		USD	570.000	-	-	% 119,648	612.947,57	2,37
4,0000 % GOLDMAN S. V.14-24	US38141GVM31		USD	300.000	-	-	% 101,889	274.720,59	1,06
4,0000 % SCHLUMBERGER HOLD. V.15-25	USU8066LAE49		USD	500.000	-	-	% 102,038	458.536,20	1,77
4,1250 % BK.AMERICA MTN V.14-24	US06051GFB05		USD	300.000	-	-	% 102,631	276.721,20	1,07
4,2500 % COMCAST V.13-33	US20030NBH35		USD	450.000	-	-	% 107,024	432.849,57	1,68
4,3000 % CVS HLTH. V.18-28	US126650CX62		USD	150.000	-	-	% 104,837	141.334,41	0,55
4,4500 % SOUTH.CAL.GAS V.14-44	US842434CL46		USD	250.000	-	-	% 102,063	229.324,14	0,89
4,8000 % COX COMM. V.14-35	USU22018AR30		USD	600.000	-	-	% 105,127	566.898,16	2,19
4,8750 % CVS HLTH. V.15-35	US126650CM08		USD	250.000	-	-	% 109,484	245.998,14	0,95
Canadische Dollar								1.099.263,17	4,25
5,5000 % NEW BRUNSWICK V.04-34	CA642866FR32		CAD	230.000	-	-	% 121,800	201.575,82	0,78
6,0000 % HYDRO-QUÉBEC V.99-31	CA448814GY37		CAD	225.000	-	-	% 123,490	199.929,84	0,77
6,2000 % ONTARIO V.00-31	CA683234NM69		CAD	170.000	-	-	% 125,230	153.186,54	0,59
6,3000 % MANITOBA MTN V.00-31	CA56344ZCG24		CAD	175.000	-	-	% 124,810	157.163,16	0,61
6,5500 % NEUFUNDLAND&LABRADOR V.00-30	CA651333EZ54		CAD	215.000	-	-	% 124,360	192.390,00	0,74
6,6000 % NOVA SCOTIA V.01-31	CA669827EW37		CAD	210.000	-	-	% 129,060	195.017,81	0,75
Summe Wertpapiervermögen								24.720.682,31	95,66
Derivate								-6.598,30	-0,03
Devisen-Derivate									
Devisenterminkontrakte								-6.598,30	-0,03
CZK/EUR 11.000.000,00		OTC						-26.536,26	-0,10
PLN/EUR 2.000.000,00		OTC						-26.433,20	-0,10
USD/EUR 4.350.000,00		OTC						46.371,16	0,18

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.03.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								962.770,15	3,73
Bankguthaben								962.770,15	3,73
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
HSBC TRINKAUS & BURKHARDT AG			EUR	962.770,15			% 100,000	962.770,15	3,73
Sonstige Vermögensgegenstände								1.196.975,30	4,63
ZINSANSPRÜCHE			EUR	179.875,31				179.875,31	0,70
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	1.017.099,99				1.017.099,99	3,94
Kurzfristige Verbindlichkeiten								-165,01	0,00
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen									
HSBC TRINKAUS & BURKHARDT AG			USD	-183,60			100,000	-165,01	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten								-1.031.929,79	-3,99
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-1.017.099,99				-1.017.099,99	-3,94
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-14.829,80				-14.829,80	-0,06
Fondsvermögen							EUR	25.841.734,66	100,00*

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

Monega Global Bond (I)

ISIN	DE000A1143J5
Fondsvermögen (EUR)	10.362.927,56
Anteilwert (EUR)	100,05
Umlaufende Anteile (STK)	103.577,00

Monega Global Bond (R)

ISIN	DE000A1J5W06
Fondsvermögen (EUR)	15.478.807,10
Anteilwert (EUR)	48,55
Umlaufende Anteile (STK)	318.802,00

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 31.03.2022 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.03.2022

Canadische Dollar	(CAD)	1,38975 = 1 (EUR)
Tschechische Kronen	(CZK)	24,42550 = 1 (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	135,04790 = 1 (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	9,72900 = 1 (EUR)
Polnische Zloty	(PLN)	4,63670 = 1 (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,11265 = 1 (EUR)

■ Marktschlüssel

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

Euro

0,7500 % BERKSHIRE HATHAWAY V.15-23	XS1200670955	EUR	-	200.000
0,7500 % KONINKLIJKE DSM MTN V.16-26	XS1495373505	EUR	-	300.000
0,8750 % CK HUTCH.FIN.(16) II V.16-24	XS1497312295	EUR	-	200.000
2,5000 % ABERTIS INFRASTR. V.14-25	ES0211845294	EUR	-	200.000

US-Dollar

3,5000 % WELLS FARGO MTN V.12-22	US94974BFC90	USD	-	51.000
----------------------------------	--------------	-----	---	--------

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

US-Dollar

2,8750 % USA TREA. V.18-21	US9128285F31	USD	-	670.000
----------------------------	--------------	-----	---	---------

Investmentanteile

Gesellschaftsfremde Investmentanteile

US-Dollar

ISH.IV-ISH.CHINA C.B.U.	IE00BYPC1H27	ANT	-	380.000
-------------------------	--------------	-----	---	---------

■ 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

Devisenterminkontrakte (Verkauf)	EUR	3.851
USD/EUR	EUR	3.851

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	95,66 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-0,03 %

Sonstige Angaben

Monega Global Bond (I)

ISIN	DE000A1143J5
Fondsvermögen (EUR)	10.362.927,56
Anteilwert (EUR)	100,05
Umlaufende Anteile (STK)	103.577,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%, derzeit 0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,50%, derzeit 0,40%
Mindestanlagesumme (EUR)	250.000,00
Ertragsverwendung	Ausschüttung

Monega Global Bond (R)

ISIN	DE000A1JSW06
Fondsvermögen (EUR)	15.478.807,10
Anteilwert (EUR)	48,55
Umlaufende Anteile (STK)	318.802,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%, derzeit 3,50%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,50%, derzeit 0,75%
Mindestanlagesumme (EUR)	keine
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.

Angaben zur Transparenz

Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile:

Investmentanteile	Verwaltungsvergütung ¹⁾
iSh.IV-iSh.China C.B.U.	0,35000 % p.a.

¹⁾ Von anderen Kapitalverwaltungsgegesellschaften bzw. ausländischen Investmentgesellschaften berechnete Verwaltungsvergütung.

Bei den Angaben zu Verwaltungsvergütungen handelt es sich um den von den Gesellschaften maximal belasteten Prozentsatz.
Quelle: WM Datenservice, Verkaufsprospekte

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge gezahlt.
Im Berichtszeitraum wurden keine Rücknahmeabschläge gezahlt.

