Halbjahresbericht

Monega Euro-Bond

zum 28. Februar 2023

MONEGA
DAS ATTRAKTIVE FONDSKONZEPT

Halbjahresbericht des Monega Euro-Bond

zum 28. Februar 2023

- **Vermögensübersicht** 2
- **Vermögensaufstellung** 4
- **Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind** 8
- **Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV** 9

Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	**63.270.205,49**	**100,20**
1. Aktien	**0,00**	**0,00**
2. Anleihen	**62.229.112,06**	**98,55**
Regierungsanleihen	26.194.122,15	41,48
Gedeckte Schuldverschreibungen	12.414.914,59	19,66
Banking/Bankwesen	3.419.551,41	5,42
Agency	2.696.998,80	4,27
Gebietskörperschaften	2.517.137,05	3,99
Finanzsektor	2.447.225,72	3,88
Investitionsgüter	2.182.850,09	3,46
Anleihen supranationaler Organisationen	1.518.571,70	2,40
Anleihen ausländischer Regierungen	1.242.032,70	1,97
Gesundheitswesen	991.958,97	1,57
Immobilien	941.871,42	1,49
Transportwesen	930.053,96	1,47
Konsumgüter	793.611,90	1,26
Versorgungswerte	758.215,19	1,20
Basisindustrie	736.049,69	1,17
Staatlich garantierte Anlagen	621.394,64	0,98
Automobil	483.977,88	0,77
Technologie & Elektronik	466.963,15	0,74
Versicherungen	435.904,55	0,69
Handel	435.706,50	0,69
3. Derivate	**228.036,66**	**0,36**
Swaps	228.036,66	0,36
4. Forderungen	**317.442,68**	**0,50**
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	**0,00**	**0,00**
6. Bankguthaben	**495.614,09**	**0,78**
7. Sonstige Vermögensgegenstände	**0,00**	**0,00**
II. Verbindlichkeiten	**-124.671,13**	**-0,20**
Sonstige Verbindlichkeiten	-124.671,13	-0,20

Vermögensübersicht

III. Fondsvermögen	**63.145.534,36**	**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 28.02.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									**58.314.479,84**	**92,35**
Verzinsliche Wertpapiere										
Euro									**51.691.713,47**	**81,86**
0,0000 % BUND SCHANW. V.22-24	DE0001104875		EUR	4.500.000	-	1.500.000	%	96,858	4.358.610,00	6,90
0,0000 % ITALIEN B.T.P. V.21-24	IT0005454050		EUR	2.000.000	-	-	%	96,850	1.937.000,00	3,07
0,0000 % KAF V.16-32	XS1484645616		EUR	1.000.000	-	-	%	73,253	732.533,30	1,16
0,0000 % LANXESS MTN V.21-27	XS2383886947		EUR	250.000	-	-	%	84,748	211.869,08	0,34
0,0500 % SCHLESW.-H. LSA V.21-31	DE000SHFM808		EUR	1.000.000	-	-	%	77,070	770.700,00	1,22
0,1000 % HSBC CONT.EUR. MTN V.19-27	FR0013444304		EUR	600.000	-	-	%	85,358	512.145,78	0,81
0,1500 % EUROFIMA MTN V.19-34	XS2055744689		EUR	1.000.000	-	-	%	69,192	691.920,20	1,10
0,2500 % SP.BK.1 BOL. HYP-PFE 16-26 MTN	XS1482554075		EUR	1.000.000	-	-	%	89,055	890.551,50	1,41
0,2500 % UNICRED.BK. HYP.-PFE 20-32 MTN	DE000HV2AS10		EUR	1.500.000	-	-	%	76,596	1.148.941,35	1,82
0,3750 % BK.NOVA SC. HYP.-PFE 22-30 MTN	XS2435614693		EUR	2.000.000	-	-	%	80,073	1.601.460,20	2,54
0,3750 % ESSILORLUXOTTICA MTN V.19-27	FR0013463668		EUR	500.000	-	-	%	87,141	435.706,50	0,69
0,3750 % INVESTOR MTN V.20-35	XS2250024010		EUR	500.000	-	-	%	65,601	328.003,30	0,52
0,3750 % LBBW HYP.-PFE V.17-25 MTN	DE000LB1DSM2		EUR	200.000	-	-	%	93,704	187.408,18	0,30
0,3750 % TRANSM.FIN. MTN V.21-28	XS2352405216		EUR	300.000	-	-	%	79,950	239.850,00	0,38
0,5000 % C.FRAN.FIN.LOC. PFE 19-25 MTN	FR0013396355		EUR	1.800.000	-	-	%	94,213	1.695.828,06	2,69
0,5000 % ELI LILLY V.21-33	XS2386186063		EUR	200.000	-	-	%	73,375	146.749,92	0,23
0,5000 % HENKEL MTN V.21-32	XS2407955827		EUR	500.000	-	-	%	76,259	381.297,15	0,60
0,5000 % SYDBANK FRN V.21-26 MTN	XS2405390043		EUR	1.000.000	-	-	%	89,033	890.329,40	1,41
0,5000 % TEMASEK FIN.(I) MTN V.19-31	XS2080785343		EUR	1.000.000	-	-	%	75,700	757.000,00	1,20
0,5000 % VONOVIA FIN. MTN V.19-29	DE000A2R7JD3		EUR	500.000	-	-	%	76,617	383.087,25	0,61
0,6250 % A2A MTN V.21-31	XS2364001078		EUR	700.000	-	-	%	74,052	518.365,19	0,82
0,6250 % GRENKE FIN. MTN V.19-25	XS2078696866		EUR	300.000	300.000	-	%	90,520	271.560,00	0,43
0,7500 % EU MTN V.16-31	EU000A18Z2D4		EUR	1.000.000	-	-	%	82,665	826.651,50	1,31
0,7500 % FINNLAND V.15-31	FI4000148630		EUR	1.000.000	-	-	%	82,969	829.693,30	1,31
0,7500 % MERCEDES-B.GR. MTN V.19-30	DE000A2YNZX6		EUR	350.000	-	-	%	82,080	287.280,60	0,45
0,7500 % PKO BK.HIP. HYP.-PFE 17-24 MTN	XS1690669574		EUR	500.000	-	-	%	95,259	476.296,15	0,75
0,8950 % ANZ NZ (I.) HYP-PFE 22-27 MTN	XS2459053943		EUR	1.000.000	-	-	%	89,461	894.613,90	1,42
0,9000 % IRLAND TREA. V.18-28	IE00BDHDPR44		EUR	900.000	-	-	%	90,088	810.792,00	1,28
1,0000 % C.FRAN.FIN.LOCAL PFE 18-28 MTN	FR0013330693		EUR	1.000.000	-	1.700.000	%	88,187	881.872,00	1,40
1,0000 % CIE D.FIN.FON. PFE V.16-26 MTN	FR0013106630		EUR	1.500.000	-	-	%	92,675	1.390.122,45	2,20
1,0000 % GIVAUDAN FIN.EUR. V.20-27	XS2126169742		EUR	300.000	-	-	%	89,558	268.674,84	0,43
1,1250 % BCO.SANT. N.PREF. 18-25 MTN	XS1751004232		EUR	600.000	-	-	%	94,733	568.395,48	0,90
1,1250 % DEXIA MUNI.AG. PFE V.16-31	FR0013221389		EUR	2.000.000	-	-	%	82,311	1.646.220,80	2,61

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
1,1250 % HANNOVER RÜCK V.18-28	XS1808482746		EUR	500.000	-	-	%	87,181	435.904,55	0,69
1,1250 % RYANAIR MTN V.17-23	XS1565699763		EUR	300.000	-	-	%	98,820	296.460,00	0,47
1,2500 % COCA-COLA V.19-31	XS1955024986		EUR	500.000	200.000	-	%	82,463	412.314,75	0,65
1,2500 % DT.BAHN FIN. MTN V.15-25	XS1309518998		EUR	367.000	-	-	%	94,949	348.462,06	0,55
1,2500 % ITALIEN B.T.P. V.16-26	IT0005210650		EUR	1.500.000	-	1.500.000	%	91,169	1.367.535,00	2,17
1,2500 % KFW MTN V.16-36	DE000A168Y48		EUR	800.000	-	500.000	%	77,674	621.394,64	0,98
1,2500 % SYNGENTA FIN. MTN V.15-27	XS1199954691		EUR	300.000	-	-	%	85,169	255.505,77	0,40
1,3750 % GLAXOSMITHKLINE MTN V.17-29	XS1681520356		EUR	500.000	-	-	%	86,866	434.331,80	0,69
1,4000 % SPANIEN V.18-28	ES0000012B39		EUR	2.200.000	-	-	%	90,825	1.998.150,00	3,16
1,4500 % SPANIEN V.17-27	ES0000012A89		EUR	1.000.000	-	-	%	91,958	919.580,00	1,46
1,5000 % DT.WOHNEN V.20-30	DE000A289NF1		EUR	700.000	200.000	-	%	79,826	558.784,17	0,88
1,6250 % APPLE V.14-26	XS1135337498		EUR	500.000	-	-	%	93,393	466.963,15	0,74
1,6250 % NRW LDSCHANW. R.1333	DE000NRW0F26		EUR	500.000	-	500.000	%	89,287	446.437,05	0,71
1,6500 % ITALIEN B.T.P. V.20-30	IT0005413171		EUR	1.100.000	-	-	%	83,410	917.505,93	1,45
1,6500 % JOHNSON&J. V.16-35	XS1412266907		EUR	500.000	-	-	%	82,175	410.877,25	0,65
1,7500 % MORGAN STANLEY MTN V.15-25	XS1180256528		EUR	600.000	-	-	%	96,168	577.010,82	0,91
1,8000 % ITALIEN B.T.P. V.20-41	IT0005421703		EUR	500.000	100.000	-	%	66,552	332.759,20	0,53
1,9500 % NRW LSA R.1468 MTN	DE000NRW0LC9		EUR	2.000.000	1.000.000	-	%	65,000	1.300.000,00	2,06
1,9500 % PORTUGAL V.19-29	PTOTEXOE0024		EUR	1.000.000	-	-	%	92,513	925.130,00	1,47
2,0000 % ITALIEN B.T.P. V.18-28	IT0005323032		EUR	2.000.000	-	-	%	91,713	1.834.262,80	2,90
2,0000 % VESTAS W.SYS.FIN. MTN V.22-34	XS2449929517		EUR	800.000	800.000	-	%	79,394	635.148,00	1,01
2,1250 % BNP PARIBAS FRN V.19-27 MTN	FR0013398070		EUR	500.000	-	-	%	93,575	467.877,35	0,74
2,6250 % BULGARIEN MTN V.15-27	XS1208855889		EUR	500.000	-	-	%	94,838	474.189,90	0,75
2,7500 % BELGIEN V.22-39	BE0000356650		EUR	1.500.000	1.500.000	-	%	90,520	1.357.799,55	2,15
2,7500 % SVENSK EXPORTKR. MTN V.22-28	XS2559401802		EUR	1.000.000	1.000.000	-	%	96,370	963.698,80	1,53
3,2500 % KNORR-BREMSE MTN V.22-27	XS2534891978		EUR	500.000	500.000	-	%	96,868	484.341,85	0,77
3,2500 % SEB MTN V.22-25	XS2558953621		EUR	1.000.000	1.000.000	-	%	98,080	980.803,40	1,55
3,5000 % MOTABILITY OPER.GR. MTN 23-31	XS2574870759		EUR	250.000	250.000	-	%	96,819	242.048,30	0,38
3,5000 % TEMASEK FIN.(I) MTN V.23-33	XS2586780012		EUR	1.000.000	2.000.000	1.000.000	%	97,630	976.300,00	1,55
3,7500 % NIEDERLANDE V.10-42	NL0009446418		EUR	1.000.000	-	-	%	111,117	1.111.170,00	1,76
4,1250 % GRENKE FIN. MTN V.22-24	XS2469031749		EUR	300.000	300.000	-	%	98,690	296.070,00	0,47
5,1500 % SPANIEN V.13-28	ES00000124C5		EUR	800.000	-	-	%	108,921	871.368,00	1,38
Andere Wertpapiere										
Euro									**6.622.766,37**	**10,49**
0,1000 % BUND INFL. V.21-33	DE0001030583		EUR	1.000.000	1.000.000	-	%	99,864	1.149.484,57	1,82
0,1000 % FRANKREICH INFL.LKD. V.14-25	FR0012558310		EUR	1.000.000	1.000.000	-	%	100,668	1.143.260,66	1,81
0,1000 % FRANKREICH INFL.LKD. V.19-29	FR0013410552		EUR	1.000.000	1.000.000	-	%	98,577	1.138.757,69	1,80
0,1000 % FRANKREICH INFL.LKD. V.20-36	FR0013524014		EUR	1.000.000	1.000.000	-	%	94,475	1.026.503,23	1,63
0,1000 % FRANKREICH INFL.LKD. V.21-32	FR0014003N51		EUR	2.000.000	1.500.000	-	%	99,331	2.164.760,22	3,43

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere									**3.914.632,22**	**6,20**
Verzinsliche Wertpapiere										
Euro									**3.914.632,22**	**6,20**
0,2500 % BSK WÜSTENR. HYP-PFE 22-30 MTN	AT0000A2VCS0		EUR	2.000.000	-	-	%	80,080	1.601.600,00	2,54
0,3750 % DANFOSS FIN. V.21-28	XS2332689681		EUR	400.000	-	-	%	81,157	324.627,76	0,51
0,8300 % CHILE V.19-31	XS1843433639		EUR	1.000.000	-	-	%	76,784	767.842,80	1,22
2,6140 % EAST JAPAN RAILW. MTN V.22-25	XS2526860965		EUR	294.000	294.000	-	%	96,984	285.131,90	0,45
2,6250 % HERAEUS FIN. V.22-27	DE000A30VGD9		EUR	800.000	-	-	%	92,342	738.732,48	1,17
3,2500 % PACCAR FIN.EUR. MTN V.22-25	XS2559453431		EUR	200.000	200.000	-	%	98,349	196.697,28	0,31
Summe Wertpapiervermögen									**62.229.112,06**	**98,55**
Derivate									**228.036,66**	**0,36**
Swaps										
Zinsswaps									**228.036,66**	**0,36**
Payer Swap										
ZINS-SWAP -0.026% VS. EURIBOR EUR 6M 22.2.2031	OTC		EUR	-1.000.000			%		228.036,66	0,36
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									**495.614,09**	**0,78**
Bankguthaben									**495.614,09**	**0,78**
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle										
HSBC TRINKAUS & BURKHARDT GMBH			EUR	495.614,09			%	100,000	495.614,09	0,78
Sonstige Vermögensgegenstände									**317.442,68**	**0,50**
ZINSANSPRÜCHE			EUR	317.442,68					317.442,68	0,50
Sonstige Verbindlichkeiten									**-124.671,13**	**-0,20**
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-93.400,00					-93.400,00	-0,15
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-31.271,13					-31.271,13	-0,05
Fondsvermögen						**EUR**			**63.145.534,36**	**100,00*)**

Anteilwert	EUR	43,94
Umlaufende Anteile	STK	1.437.110,00

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 28.02.2023 oder letztbekannte.

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				
0,3750 % AROUNDTOWN MTN V.21-27	XS2421195848	EUR	-	200.000
0,5000 % BELGIEN V.17-24	BE0000342510	EUR	-	1.500.000
0,5000 % FRANKREICH V.21-72	FR0014001NN8	EUR	-	1.000.000
0,6250 % NESTLÉ FIN.INT. MTN V.21-34	XS2350746215	EUR	-	300.000
1,5000 % FRANKREICH V.15-31	FR0012993103	EUR	-	1.600.000
2,1250 % PORTUGAL V.18-28	PTOTEVOE0018	EUR	-	750.000
2,1500 % SPANIEN V.15-25	ES00000127G9	EUR	-	500.000
3,2500 % FRANKREICH V.12-45	FR0011461037	EUR	-	1.000.000
4,7500 % BUND V.08-40	DE0001135366	EUR	-	1.130.000

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		
Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte	**EUR**	**11.268**
Basiswerte: (EURO-BUND-FUTURE 12/22)		
Verkaufte Kontrakte	**EUR**	**52.119**
Basiswerte: (EURO-BOBL-FUTURE 12/22, EURO-BUND-FUTURE 03/23, EURO-BUND-FUTURE 12/22, EURO-SCHATZ-FUTURE 03/23, EURO-SCHATZ-FUTURE 12/22, LONG EURO-BTP-FUT.12/22)		
Optionsrechte		
Optionrechte auf Zins-Derivate		
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte		
Gekaufte Verkaufsoptionen (put)	**EUR**	**5.460**
Basiswerte: (PUT EURO-BUND-FUT. 136,50 02/23)		
Verkaufte Kaufoptionen (call)	**EUR**	**17.160**
Basiswerte: (CALL EURO-BUND-FUT. 140 12/22, CALL EURO-BUND-FUT. 149 10/22)		
Verkaufte Verkaufoptionen (put)	**EUR**	**27.090**
Basiswerte: (PUT EURO-BUND-FUT. 132 12/22, PUT EURO-BUND-FUT. 135 03/23, PUT EURO-BUND-FUT. 142 10/22, PUT EURO-BUND-FUT.136 03/23)		
Swaps (in Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)		
Credit Default Swaps		
Protection Buyer	**EUR**	**10.000**
Basiswerte: (CDS ITRAXX EUROPE S.38 V.1 (5 Y) 20.12.2027)		

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	**98,55 %**
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	**0,36 %**

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	**43,94**
Umlaufende Anteile (STK)	**1.437.110,00**

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 gleichtägig).

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.