

Halbjahresbericht

nordIX European Consumer Credit Fonds

zum 30. September 2022

Halbjahresbericht des nordIX European Consumer Credit Fonds

ZUM 30. SEPTEMBER 2022

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind	5
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	6

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	66.627.291,03	100,08
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	56.212.729,90	84,43
Asset Backed	56.212.729,90	84,43
3. Derivate	50.940,44	0,08
Devisen-Derivate	50.940,44	0,08
4. Forderungen	568.640,55	0,85
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	9.794.980,14	14,71
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-51.513,61	-0,08
Sonstige Verbindlichkeiten	-51.513,61	-0,08
III. Fondsvermögen	66.575.777,42	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 30.09.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								56.212.729,90	84,43	
Andere Wertpapiere										
Euro								41.511.716,34	62,35	
3,0000 % OPUS-CHARTER.I.C.35 16-24 ABS ¹⁾	DE000A3KZPM1		EUR	15.200.000	5.000.000	-	%	99,630	15.143.760,00	22,75
4,0000 % OPUS-CHARTER.I.C.239 21-28 ABS ¹⁾	DE000A3KPTW3		EUR	3.300.000	-	15.200.000	%	91,090	2.848.156,58	4,28
4,0000 % OPUS-CHARTER.I.C.317 21-28 ABS ¹⁾	DE000A3KS559		EUR	12.500.000	8.500.000	-	%	100,360	12.545.000,00	18,84
4,0000 % OPUS-CHARTER.I.C.335 21-28 ABS ¹⁾	DE000A3KWK58		EUR	5.500.000	500.000	-	%	100,270	5.514.850,00	8,28
4,0000 % OPUS-CHARTER.I.C.370 V.21-28 ¹⁾	DE000A3GV106		EUR	3.000.000	-	-	%	99,760	1.995.299,76	3,00
4,0000 % OPUS-CHARTER.I.C.388 22-29 ABS	DE000A3K0P88		EUR	3.500.000	3.500.000	-	%	98,990	3.464.650,00	5,20
Schweizer Franken								6.190.943,79	9,30	
4,0000 % OPUS-CHARTER.I.C.299 21-28 ABS ¹⁾	DE000A3KPTV5		CHF	6.140.000	1.140.000	-	%	97,220	6.190.943,79	9,30
Schwedische Kronen								8.510.069,77	12,78	
4,0000 % OPUS-CHARTER.I.C.422 22-25 ABS ¹⁾	DE000A3K5H42		SEK	92.500.000	92.500.000	-	%	100,020	8.510.069,77	12,78
Summe Wertpapiervermögen								56.212.729,90	84,43	
Derivate								50.940,44	0,08	
Devisen-Derivate										
Devisenterminkontrakte								50.940,44	0,08	
CHF/EUR 1.050.000,00			OTC						-34.257,55	-0,05
CHF/EUR 6.073.000,00			OTC						-50.250,94	-0,08
SEK/EUR 92.800.000,00			OTC						135.448,93	0,20
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								9.794.980,14	14,71	
Bankguthaben								9.794.980,14	14,71	
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle										
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F			EUR	9.496.712,53			%	100,000	9.496.712,53	14,26
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen										
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F			SEK	17.659,84			%	100,000	1.624,39	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F			CHF	286.023,39			%	100,000	296.643,22	0,45
Sonstige Vermögensgegenstände								568.640,55	0,85	
ZINSANSPRÜCHE			EUR	568.640,22					568.640,22	0,85
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	0,33					0,33	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten								-51.513,61	-0,08	
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-0,32					-0,32	0,00

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-44.834,02				-44.834,02	-0,07
VERBINDLICHKEITEN AUS FX-SPOT-GESCHÄFTEN			EUR	-6.679,27				-6.679,27	-0,01
Fondsvermögen						EUR		66.575.777,42	100,00^{*)}

Anteilwert	EUR	100,98
Umlaufende Anteile	STK	659.293,00

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

¹⁾ Bei diesen Wertpapieren handelt es sich um Poolfaktoranleihen, deren Kurswert auch durch Teilrückzahlung oder Teilzinskaptalisierung beeinflusst wird.

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.09.2022 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.09.2022

Schweizer Franken	(CHF)	0,96420 = 1 (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	10,87165 = 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
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Andere Wertpapiere

Euro

4,0000 % OPUS-CHAR DE000A3GZFN8 TER.I.C.422 22-25 ABS	EUR	3.000.000	5.000.000
---	-----	-----------	-----------

Neuemissionen

Zulassung oder Einbeziehung in organisierte Märkte vorgesehen

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

4,0000 % OPUS-CHAR DE000A3GZFN8 TER.I.C.422 22-25 ABS	EUR	2.000.000	-
---	-----	-----------	---

■ **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	11.844
CHF/EUR	EUR	10.345
SEK/EUR	EUR	1.499

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	84,43 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,08 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	100,98
Umlaufende Anteile (STK)	659.293,00

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 gleichartig).

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.

