

Halbjahresbericht

nordIX European Consumer Credit Fonds

zum 30. September 2021

Halbjahresbericht des nordIX European Consumer Credit Fonds

ZUM 30. SEPTEMBER 2021

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	6

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	36.333.163,40	100,07
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	17.867.856,05	49,21
Asset Backed	17.867.856,05	49,21
3. Derivate	7.609,23	0,02
Devisen-Derivate	7.609,23	0,02
4. Forderungen	251.441,33	0,69
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	18.206.256,79	50,14
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-23.833,92	-0,07
Sonstige Verbindlichkeiten	-23.833,92	-0,07
III. Fondsvermögen	36.309.329,48	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 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								13.213.800,00	36,39
Andere Wertpapiere									
Euro								13.213.800,00	36,39
4,0000 % OPUS-CHARTER.ISS.C.239 21-28 ¹⁾	DE000A3KPTW3		EUR	10.000.000	10.000.000	-	% 101,940	10.194.000,00	28,08
4,0000 % OPUS-CHARTER.ISS.C.317 21-28 ¹⁾	DE000A3KS559		EUR	3.000.000	3.000.000	-	% 100,660	3.019.800,00	8,32
Neuemissionen								4.654.056,05	12,82
Zulassung oder Einbeziehung in organisierte Märkte vorgesehen									
Andere Wertpapiere									
Schweizer Franken								4.654.056,05	12,82
4,0000 % OPUS-CHARTER.ISS.C.299 21-28 ¹⁾	DE000A3KPTV5		CHF	5.000.000	5.000.000	-	% 100,630	4.654.056,05	12,82
Summe Wertpapiervermögen								17.867.856,05	49,21
Derivate								7.609,23	0,02
Devisen-Derivate									
Devisenterminkontrakte								7.609,23	0,02
CHF/EUR 5.100.000,00		OTC						7.609,23	0,02
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								18.206.256,79	50,14
Bankguthaben								18.206.256,79	50,14
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F			EUR	18.205.798,53			% 100,000	18.205.798,53	50,14
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F			CHF	495,43			% 100,000	458,26	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände								251.441,33	0,69
ZINSANSPRÜCHE			EUR	251.425,21				251.425,21	0,69
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	16,12				16,12	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten								-23.833,92	-0,07
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-798,51				-798,51	0,00
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-23.035,41				-23.035,41	-0,06
Fondsvermögen						EUR	36.309.329,48	100,00^{*)}	
Anteilwert						EUR	100,83		
Umlaufende Anteile						STK	360.100,00		

*) 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 30.09.2021 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.09.2021

Schweizer Franken	(CHF)	1,08110 = 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 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	4.570
CHF/EUR	EUR	4.570

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	49,21 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,02 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	100,83
Umlaufende Anteile (STK)	360.100,00

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.

