KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:

Universal Investment

nordIX Basis

JAHRESBERICHT

ZUM 31. DEZEMBER 2022

VERWAHRSTELLE:

DONNER & REUSCHEL
PRIVATBANK SEIT 1798

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:

nordIX
fixed income & derivatives

Jahresbericht
nordIX Basis

Tätigkeitsbericht
für den Berichtszeitraum vom 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022

Anlageziele und Anlagepolitik zur Erreichung der Anlageziele

Der Fonds setzt sich zu mindestens 51 % aus Anleihen zusammen. Der Fonds investiert in festverzinsliche Wertpapiere verschiedener Emittenten und sichert gleichzeitig das Risiko der Zahlungsunfähigkeit des Anleihenschuldners durch entsprechende Kreditsicherungsgeschäfte ab. Investitionen werden dann getätigt, wenn die Kosten der Absicherung geringer als die Rendite der zugrundeliegenden Anleihe sind. Durch diese sogenannten „negative Basis Geschäfte“ wird die Realisierung einer weitgehend risikofreien Rendite angestrebt. Zusätzlich zur Absicherung des Ausfallrisikos des Emittenten durch einen „Credit Default Swap (CDS)“ kann zur Absicherung des Zinsänderungsrisikos ein Zinsswap abgeschlossen werden, bei Fremdwährungsgeschäften soll das Währungsrisiko in der Regel durch entsprechende Devisentermingeschäfte eliminiert werden.

Struktur des Portfolios und wesentliche Veränderungen im Berichtszeitraum

Fondsstruktur

	31.12.2022		31.12.2021	
	Kurswert	**% Anteil Fondsvermögen**	**Kurswert**	**% Anteil Fondsvermögen**
Renten	60.870.924,08	88,58	106.911.674,80	90,84
DTG	505.271,37	0,74	280.560,19	0,24
Swaps	3.982.341,60	5,80	-7.848.307,19	-6,67
Bankguthaben	2.632.664,24	3,83	17.533.743,53	14,90
Zins- und Dividendenansprüche	1.112.118,26	1,62	1.703.106,28	1,45
Ford./Verbindlichkeiten Swaps	-259.775,07	-0,38	-596.228,74	-0,51
Sonstige Ford./Verbindlichkeiten	-127.170,25	-0,19	-290.338,11	-0,25
Fondsvermögen	68.716.374,23	100,00	117.694.210,76	100,00

Jahresbericht
nordIX Basis

Im Geschäftsjahr 2022 gab es keine Änderungen an der bisherigen Anlagestrategie des nordIX Basis. Bei Erwerb einer Anleihe wurde das Adressenausfallrisiko zeitgleich durch Abschluss eines Kreditsicherungsgeschäftes (Credit Default Swap) auf den Anleiheemittenten abgesichert. Potenzielle Zinsänderungsrisiken aus festverzinslichen Wertpapieren wurden konsequent durch Derivateeinsatz (Zinsswaps) eliminiert. Ebenso wurden Fremdwährungsrisiken aus nicht in EUR-denominierten Anleihen über Devisentermingeschäfte abgesichert.
Das Fondsvolumen nahm im Geschäftsjahresverlauf um knapp über 41 Prozent ab. Ursächlich für diese Entwicklung waren Desinvestitionen seitens institutioneller Anleger und teilweise Umschichtungen in Spezialfonds der nordIX AG mit derselben Strategie. Das geringere Fondsvolumen resultierte in einem Abbau von Positionen, die innerhalb des allgemeinen Marktumfeldes bereits das Potenzial ausgeschöpft hatten. So beendete der nordIX Basis das Geschäftsjahr mit insgesamt 16 Positionen. Anleihe und Credit Default Swap werden hierbei als eine Position verstanden. Das Engagement verteilte sich gleichmäßig zwischen EUR- und USD-Positionen. Auf das Fondsvermögen gerechnet, betrug der Anteil an EUR-Anleihen 47,17 Prozent. USD-Anleihen machten 43,03 Prozent aus. Die Sektorallokation war folgendermaßen: Industrieunternehmen (64,09 Prozent), Finanzunternehmen exkl. Banken (14,62 Prozent) und Staaten (11,49 Prozent). Die Restlaufzeit des Portfolios betrug zum Geschäftsjahresende 4,47 Jahre und war somit geringfügig höher als im Vorjahr (4,64 Jahre).
Im Laufe des Geschäftsjahres wurde die Anzahl der Kontrahenten reduziert, was zu einer verringerten Kostenbelastung für den Fonds resultierte.

Wesentliche Risiken

Allgemeine Marktpreisrisiken
Die Kurs- oder Marktwertentwicklung von Finanzprodukten hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird. Auf die allgemeine Kursentwicklung, insbesondere an einer Börse, können auch irrationale Faktoren wie Stimmungen, Meinungen und Gerüchte einwirken.
Für die Kurs- oder Marktwertentwicklung stellten die Entwicklungen aufgrund von COVID 19 im abgelaufenen Geschäftsjahr einen besonderen Aspekt der Unsicherheit dar.

Die Ukraine-Krise und die dadurch ausgelösten Marktturbulenzen und Sanktionen der Industrienationen gegenüber Russland haben eine Vielzahl an unterschiedlichen Auswirkungen auf die Finanzmärkte im Allgemeinen und auf Fonds (Sondervermögen) im Speziellen. Die Bewegungen an den Börsen werden sich entsprechend auch im Fondsvermögen (Wert des Sondervermögens) widerspiegeln. Zusätzlich belasten Unsicherheiten über den weiteren Verlauf des Konflikts sowie die wirtschaftlichen Folgen der diversen Sanktionen die Märkte.

Zinsänderungsrisiken
Mit der Investition in festverzinsliche Wertpapiere ist die Möglichkeit verbunden, dass sich das Marktzinsniveau, das im Zeitpunkt der Begebung eines Wertpapiers besteht, ändern kann. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen in der Regel die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere. Fällt dagegen der Marktzins, so steigt der Kurs festverzinslicher Wertpapiere. Diese Kursentwicklung führt dazu, dass die aktuelle Rendite der festverzinslichen Wertpapiere in etwa dem aktuellen Marktzins entspricht. Diese Kursentwicklungen fallen jedoch je nach Laufzeit der festverzinslichen Wertpapiere unterschiedlich aus. Festverzinsliche Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten haben geringere Zinsänderungs-/Kursrisiken als festverzinsliche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten.

Adressenausfallrisiken / Emittentenrisiken
Durch den Ausfall eines Ausstellers oder Kontrahenten können Verluste für das Sondervermögen entstehen. Das Ausstellerrisiko beschreibt die Auswirkung der besonderen Entwicklungen des jeweiligen Ausstellers, die neben den allgemeinen Tendenzen der Kapitalmärkte auf den Kurs eines Wertpapiers einwirken. Auch bei sorgfältiger Auswahl der Wertpapiere kann nicht ausgeschlossen werden, dass Verluste durch Vermögensverfall von Ausstellern eintreten. Das Kontrahentenrisiko beinhaltet das Risiko der Partei eines gegenseitigen Vertrages, mit der eigenen Forderung teilweise oder vollständig auszufallen. Dies gilt für alle Verträge, die für Rechnung eines Sondervermögens geschlossen werden.

Bonitätsrisiken
Bei Anleihen kann es zu einer Ratingveränderung des Schuldners kommen. Je nachdem, ob die Bonität steigt oder fällt, kann es zu Kursveränderungen des Wertpapiers kommen.

Risiken im Zusammenhang mit Derivategeschäften
Die Gesellschaft darf für Rechnung des Sondervermögens sowohl zu Absicherungszwecken als auch zu Investitionszwecken Geschäfte mit Derivaten tätigen. Die Absicherungsgeschäfte dienen dazu, das Gesamtrisiko des Sondervermögens zu verringern, können jedoch ggf. auch die Renditechancen schmälern.
Kauf und Verkauf von Optionen sowie der Abschluss von Terminkontrakten oder Swaps sind mit folgenden Risiken verbunden:
- Kursänderungen des Basiswertes können den Wert eines Optionsrechts oder Terminkontraktes bis hin zur Wertlosigkeit vermindern. Durch Wertänderungen des einem Swap zugrunde liegenden Vermögenswertes kann das Sondervermögen ebenfalls Verluste erleiden.
- Der gegebenenfalls erforderliche Abschluss eines Gegengeschäfts (Glattstellung) ist mit Kosten verbunden.
- Durch die Hebelwirkung von Optionen kann der Wert des Sondervermögens stärker beeinflusst werden, als dies beim unmittelbaren Erwerb der Basiswerte der Fall ist.
- Der Kauf von Optionen birgt das Risiko, dass die Option nicht ausgeübt wird, weil sich die Preise der Basiswerte nicht wie erwartet entwickeln, so dass die vom Sondervermögen gezahlte Optionsprämie verfällt. Beim Verkauf von Optionen besteht die Gefahr, dass das Sondervermögen zur Abnahme / Lieferung von Vermögenswerten zu einem abweichenden Preis als dem aktuellen Marktpreis verpflichtet ist.
- Auch bei Terminkontrakten besteht das Risiko, dass das Sondervermögen infolge unerwarteter Entwicklungen der Marktpreise bei Fälligkeit Verluste erleidet.

Währungsrisiken
Sofern Vermögenswerte eines Sondervermögens in anderen Währungen als der jeweiligen Fondswährung angelegt sind, erhält es die Erträge, Rückzahlungen und Erlöse aus solchen Anlagen in der jeweiligen Währung. Fällt der Wert dieser Währung gegenüber der Fondswährung, so reduziert sich der Wert des Sondervermögens.

Fondsergebnis
Die wesentlichen Quellen des negativen Veräußerungsergebnisses während des Berichtszeitraums waren realisierte Verluste aus verkauften Devisen auf Termin.

Wertentwicklung im Berichtszeitraum (1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022)[1]
Anteilklasse R: -0,27%
Anteilklasse I: -0,16%

[1] Eigene Berechnung nach der BVI-Methode (ohne Berücksichtigung von Ausgabeaufschlägen). Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zu. Diese ist nicht prognostizierbar.

Jahresbericht
nordIX Basis

Vermögensübersicht zum 31.12.2022

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	**69.785.740,33**	**101,56**
1. Anleihen	60.870.924,08	88,58
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	14.332.667,87	20,86
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	15.913.981,85	23,16
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	30.624.274,36	44,57
2. Derivate	4.487.612,97	6,53
3. Bankguthaben	2.462.664,24	3,58
4. Sonstige Vermögensgegenstände	1.964.539,04	2,86
II. Verbindlichkeiten	**-1.069.366,10**	**-1,56**
III. Fondsvermögen	**68.716.374,23**	**100,00**

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Bestandspositionen							**EUR**		**60.870.924,08**	**88,58**
Börsengehandelte Wertpapiere							**EUR**		**22.655.044,37**	**32,97**
Verzinsliche Wertpapiere							**EUR**		**22.655.044,37**	**32,97**
5,6250 % Ägypten, Arabische Republik EO-Med.-Term Nts 2018(30)Reg.S	XS1807305328		EUR	5.000	0	0	%	69,684	3.484.200,00	5,07
2,2500 % B.A.T. Intl Finance PLC EO-Medium-Term Nts 2017(29/30)	XS1664644983		EUR	5.000	5.000	0	%	81,177	4.058.850,00	5,91
5,3750 % Picard Bondco S.A. EO-Notes 2021(21/27) Reg.S	XS2361344315		EUR	5.000	0	0	%	81,244	4.062.200,00	5,91
3,6240 % Rumänien EO-Med.-Term Nts 2020(30)Reg.S	XS2178857954		EUR	5.000	5.000	0	%	82,013	4.100.650,00	5,97
5,0000 % SoftBank Group Corp. EO-Notes 2018(18/28)	XS1793255941		EUR	3.000	3.000	5.000	%	85,535	2.566.050,00	3,73
3,9000 % FirstEnergy Corp. DL-Notes 2017(17/27) Ser.B	US337932AH00		USD	5.000	5.000	0	%	93,544	4.383.094,37	6,38
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							**EUR**		**38.215.879,71**	**55,61**
Verzinsliche Wertpapiere							**EUR**		**38.215.879,71**	**55,61**
1,8750 % Atlantia S.p.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/28)	XS2301390089		EUR	3.000	3.000	0	%	83,457	2.503.710,00	3,64
4,3750 % EG Global Finance PLC EO-Notes 2019(21/25) Reg.S	XS1992087996		EUR	3.000	3.000	0	%	87,121	2.613.630,00	3,80
4,2500 % Huntsman International LLC EO-Notes 2016(16/25)	XS1395182683		EUR	4.000	0	0	%	96,537	3.861.480,00	5,62
3,1250 % Matterhorn Telecom S.A. EO-Notes 2019(19/26) Reg.S	XS2052290439		EUR	5.000	0	0	%	90,911	4.545.550,00	6,61
5,2500 % Block Financial LLC DL-Notes 2015(15/25)	US093662AG97		USD	5.000	0	0	%	99,789	4.675.709,87	6,80
7,1000 % Enel Finance America LLC DL-FLR Notes 2022(22/27) 144A	US29280HAA05		USD	3.000	3.000	0	%	103,976	2.923.137,48	4,25
4,5000 % Iron Mountain Inc. DL-Notes 2020(20/31) 144A	US46284VAN10		USD	6.000	0	0	%	82,501	4.638.796,74	6,75
5,2500 % MGIC Investment Corp. DL-Notes 2020(20/28)	US552848AG81		USD	6.000	0	0	%	92,452	5.198.313,19	7,56
4,8750 % Nova Chemicals Corp. DL-Notes 2017(17/24) Reg.S	USC67111AH49		USD	3.500	0	1.500	%	97,010	3.181.848,00	4,63
4,0000 % Sirius XM Radio Inc. DL-Notes 2021(21/28) 144A	US82967NBJ63		USD	5.000	0	0	%	86,941	4.073.704,43	5,93
Summe Wertpapiervermögen 2)							**EUR**		**60.870.924,08**	**88,58**

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Derivate							**EUR**		**4.487.612,97**	**6,53**
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
Devisen-Derivate							**EUR**		**505.271,37**	**0,74**
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Devisenterminkontrakte (Verkauf)							**EUR**		**505.271,37**	**0,74**
Offene Positionen										
JPY/EUR 58,0 Mio.		OTC							-10.826,19	-0,02
USD/EUR 32,3 Mio.		OTC							516.097,56	0,75
Swaps							**EUR**		**3.982.341,60**	**5,80**
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Zinsswaps							**EUR**		**4.200.324,58**	**6,11**
SWAP 0.0000% FIX / 02.11.2018/15.02.2023		OTC	EUR	2.500.000					6.001,96	0,01
SWAP 0.0000% FIX / 03.04.2018/15.02.2023		OTC	EUR	2.000.000					4.255,78	0,01
SWAP 1.8600% FIX / 04.07.2022/04.07.2027		OTC	EUR	2.000.000					109.478,26	0,16
SWAP 0.0325% FIX / 04.10.2021/06.04.2030		OTC	EUR	2.000.000					401.206,83	0,58
SWAP 2.6370% FIX / 06.10.2022/06.10.2027		OTC	EUR	2.000.000					43.665,03	0,06
SWAP 5.6250% FIX / 07.04.2017/17.02.2024		OTC	EUR	1.500.000					50.516,96	0,07
SWAP 1.5440% FIX / 20.05.2022/20.01.2030		OTC	EUR	4.000.000					401.968,74	0,58
SWAP 0.6790% FIX / 21.02.2022/22.05.2030		OTC	EUR	4.000.000					645.909,49	0,94
SWAP -0.4570% FIX / 21.08.2020/21.02.2025		OTC	EUR	5.000.000					384.126,06	0,56
SWAP 0.0000% FIX / 21.09.2017/15.05.2023		OTC	EUR	1.000.000					8.224,28	0,01
SWAP 2.8500% FIX / 21.12.2022/21.06.2028		OTC	EUR	2.000.000					31.368,41	0,05
SWAP 5.8750% FIX / 26.01.2018/01.02.2024		OTC	EUR	1.500.000					45.098,30	0,07
SWAP -0.3770% FIX / 30.09.2021/30.09.2024		OTC	EUR	4.000.000					249.904,03	0,36
SWAP 0.0000% FIX / 05.09.2017/15.01.2024		OTC	USD	2.000.000					60.868,13	0,09
SWAP 1.5545% FIX / 07.02.2022/07.02.2031		OTC	USD	3.000.000					393.874,94	0,57
SWAP 0.0000% FIX / 09.11.2017/01.05.2023		OTC	USD	1.500.000					12.832,42	0,02

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
SWAP 0.0000% FIX / 10.08.2018/15.05.2023		OTC	USD	1.000.000					6.612,14	0,01
SWAP 8.3750% FIX / 13.12.2017/15.03.2023		OTC	USD	2.565.000					12.486,47	0,02
SWAP 5.8750% FIX / 14.06.2019/15.11.2024		OTC	USD	1.163.000					55.810,84	0,08
SWAP 6.0000% FIX / 15.02.2018/15.03.2023		OTC	USD	2.000.000					8.201,98	0,01
SWAP 4.8750% FIX / 15.05.2018/01.06.2024		OTC	USD	1.500.000					39.365,59	0,06
SWAP 5.2500% FIX / 15.08.2019/15.04.2023		OTC	USD	5.000.000					44.165,21	0,06
SWAP 2.5950% FIX / 16.05.2022/16.09.2028		OTC	USD	5.000.000					261.408,16	0,38
SWAP 4.8750% FIX / 17.05.2018/15.09.2024		OTC	USD	2.000.000					56.748,51	0,08
SWAP 5.2500% FIX / 18.01.2019/01.10.2025		OTC	USD	5.000.000					209.941,52	0,31
SWAP 1.1620% FIX / 21.06.2021/01.09.2027		OTC	USD	5.000.000					569.199,89	0,83
SWAP 0.0000% FIX / 22.11.2017/15.01.2024		OTC	USD	2.000.000					54.671,79	0,08
SWAP 0.0000% FIX / 25.07.2017/01.11.2023		OTC	USD	1.500.000					35.520,91	0,05
SWAP 4.0900% FIX / 26.10.2022/26.10.2027		OTC	USD	3.000.000					-31.756,78	-0,05
SWAP 0.0000% FIX / 28.06.2017/15.05.2023		OTC	USD	1.500.000					15.456,83	0,02
SWAP 7.0000% FIX / 28.08.2019/15.03.2023		OTC	USD	2.000.000					12.955,53	0,02
SWAP 5.2500% FIX / 30.11.2017/01.04.2023		OTC	USD	2.000.000					12.739,11	0,02
SWAP 8.3750% FIX / 08.05.2019/15.03.2023		OTC	USD	2.565.000					-12.502,74	-0,02
Credit Default Swaps							**EUR**		**-217.982,98**	**-0,32**
Protection Buyer							**EUR**		**-217.982,98**	**-0,32**
Huntsman International LLC DL-Notes 2016(16/22) 20.03.2019/20.06.2024		OTC	EUR	3.650.000					-239.415,39	-0,35
EG Global Finance PLC EO-Notes 2019(21/25) Reg.S 20.06.2022/20.06.2025		OTC	EUR	2.700.000					8.880,27	0,01
B.A.T. Intl Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2012(23) 20.06.2022/20.06.2027		OTC	EUR	4.500.000					10.839,44	0,02
Picard Bondco S.A. EO-Notes 2021(21/27) Reg.S 20.09.2021/20.12.2026		OTC	EUR	5.000.000					402.278,44	0,59
Atlantia S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2017(25) 20.09.2022/20.12.2027		OTC	EUR	2.700.000					168.968,98	0,25
ENEL S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2004(24) 20.09.2022/20.12.2027		OTC	EUR	3.000.000					40.084,24	0,06
Rumänien EO-Med.-Term Nts 2020(26)Reg.S 20.12.2021/20.12.2026		OTC	EUR	5.000.000					247.605,41	0,36
Matterhorn Telecom S.A. EO-Notes 2017(17/27) Reg.S 22.03.2021/20.12.2026		OTC	EUR	4.400.000					-296.811,15	-0,43
SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) 21.06.2022/20.06.2028		OTC	JPY	425.000.000					455.420,38	0,66
Nova Chemicals Corp. DL-Notes 2013(13/23) Reg.S 20.03.2020/20.06.2024		OTC	USD	3.200.000					-125.743,93	-0,18
Block Financial LLC DL-Notes 2012(12/22) 20.09.2019/20.12.2025		OTC	USD	4.200.000					-489.060,45	-0,71
Ägypten, Arabische Republik DL-Med.-Term Nts 2019(23)Reg.S 20.09.2021/20.12.2026		OTC	USD	5.250.000					1.137.983,19	1,66
FirstEnergy Corp. DL-Notes 2001(01/31) Ser.C 20.12.2021/20.12.2026		OTC	USD	5.000.000					-33.295,73	-0,05
MGIC Investment Corp. DL-Notes 2016(16/23) 21.06.2021/20.06.2026		OTC	USD	5.500.000					-557.224,57	-0,81

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A 22.03.2021/20.06.2026		OTC	USD	5.200.000					-510.091,14	-0,74
Sirius XM Radio Inc. DL-Notes 2019(19/29) 144A 22.03.2021/20.06.2026		OTC	USD	4.300.000					-438.400,97	-0,64
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							**EUR**		**2.462.664,24**	**3,58**
Bankguthaben							**EUR**		**2.462.664,24**	**3,58**
EUR - Guthaben bei:										
Donner & Reuschel AG (D)			EUR	2.448.128,31			%	100,000	2.448.128,31	3,56
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:										
Donner & Reuschel AG (D)			JPY	85.224,00			%	100,000	605,36	0,00
Donner & Reuschel AG (D)			USD	14.865,31			%	100,000	13.930,57	0,02
Sonstige Vermögensgegenstände							**EUR**		**1.964.539,04**	**2,86**
Zinsansprüche			EUR	1.790.154,43					1.790.154,43	2,61
Sonstige Forderungen			EUR	252,27					252,27	0,00
Zinsansprüche Swaps			EUR	4.132,34					4.132,34	0,01
Forderungen aus Cash Collateral			EUR	170.000,00					170.000,00	0,25
Sonstige Verbindlichkeiten							**EUR**		**-1.069.366,10**	**-1,56**
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-941.943,58					-941.943,58	-1,37
Verwaltungsvergütung			EUR	-118.115,71					-118.115,71	-0,17
Verwahrstellenvergütung			EUR	-6,81					-6,81	0,00
Prüfungskosten			EUR	-7.500,00					-7.500,00	-0,01
Veröffentlichungskosten			EUR	-1.200,00					-1.200,00	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten			EUR	-600,00					-600,00	0,00
Fondsvermögen								**EUR**	**68.716.374,23**	**100,00** 1)

Jahresbericht
nordIX Basis

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
nordIX Basis R									
Anteilwert							EUR	96,65	
Ausgabepreis							EUR	96,65	
Rücknahmepreis							EUR	96,65	
Anzahl Anteile							STK	31.088	
nordIX Basis I									
Anteilwert							EUR	97,91	
Ausgabepreis							EUR	97,91	
Rücknahmepreis							EUR	97,91	
Anzahl Anteile							STK	671.139	

Fußnoten:

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

2) Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Jahresbericht
nordIX Basis

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.12.2022	
JPY	(JPY)	140,7825000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,0671000	= 1 EUR (EUR)

Marktschlüssel

c) OTC	Over-the-Counter

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
4,7500 % Avis Budget Finance PLC EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1889107931	EUR	0	5.000	
4,4980 % Casino,Guichard-Perrachon S.A. EO-Med.-Term Notes 2014(14/24)	FR0011765825	EUR	0	5.000	
8,7500 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. DL-Notes 2000(30)	US25156PAC77	USD	0	3.000	
3,2500 % K+S Aktiengesellschaft Anleihe v.2018 (2024/2024)	XS1854830889	EUR	0	3.000	
6,7500 % Ukraine EO-Notes 2019(28) Reg.S	XS2015264778	EUR	0	5.000	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
5,7500 % Avient Corp. DL-Notes 2020(20/25)	US73179PAM86	USD	0	5.000	
7,2500 % Bausch Health Companies Inc. DL-Notes 2019(19/29) 144A	US071734AF49	USD	0	5.000	
7,1250 % Bombardier Inc. DL-Notes 2021(21/26) 144A	US097751BV25	USD	0	6.000	
7,5000 % CMA CGM S.A. EO-Notes 2020(20/26) Reg.S	XS2242188261	EUR	0	4.300	
6,2500 % Transdigm Inc. DL-Notes 2019(19/26) 144A	US893647BE67	USD	0	6.000	
6,8750 % United States Steel Corp. DL-Notes 2021(24/29)	US912909AU28	USD	0	6.000	
Nichtnotierte Wertpapiere *)					
Verzinsliche Wertpapiere					
4,8750 % Realogy Grp LLC/Co-Issuer Corp DL-Notes 2016(16/23) 144A	US75606DAE13	USD	0	6.000	

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000

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

Terminkontrakte

Devisenterminkontrakte (Verkauf)

Verkauf von Devisen auf Termin:		
JPY/EUR	EUR	2.276
USD/EUR	EUR	685.768

Devisenterminkontrakte (Kauf)

Kauf von Devisen auf Termin:		
JPY/EUR	EUR	577
USD/EUR	EUR	29.465

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Swaps (in Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)					
Zinsswaps					
(Basiswert(e): Receiver Zinsswap 16.05.22/16.11.23)		EUR			12.476
Credit Default Swaps					
Protection Buyer					
(Basiswert(e): B.A.T. Intl Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2012(23) 21.03.2022/20.06.2027)		EUR			4.500

Die Gesellschaft sorgt dafür, dass eine unangemessene Beeinträchtigung von Anlegerinteressen durch Transaktionskosten vermieden wird, indem unter Berücksichtigung der Anlageziele dieses Sondervermögens ein Schwellenwert für die Transaktionskosten bezogen auf das durchschnittliche Fondsvolumen sowie für eine Portfolioumschlagsrate festgelegt wurde. Die Gesellschaft überwacht die Einhaltung der Schwellenwerte und ergreift im Falle des Überschreitens weitere Maßnahmen.

*) Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)
für den Zeitraum vom 01.01.2022 bis 31.12.2022

				insgesamt	je Anteil
I. Erträge					
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)			EUR	0,00	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)			EUR	0,00	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren			EUR	82,49	0,00
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)			EUR	136.977,69	4,41
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland			EUR	336,41	0,01
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)			EUR	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen			EUR	0,00	0,00
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften			EUR	0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer			EUR	0,00	0,00
10. Abzug ausländischer Quellensteuer			EUR	0,00	0,00
11. Sonstige Erträge			EUR	432,94	0,01
Summe der Erträge			**EUR**	**137.829,52**	**4,43**
II. Aufwendungen					
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen			EUR	-763,14	-0,02
2. Verwaltungsvergütung			EUR	-18.869,44	-0,61
- Verwaltungsvergütung	EUR	-18.869,44			
- Beratungsvergütung	EUR	0,00			
- Asset Management Gebühr	EUR	0,00			
3. Verwahrstellenvergütung			EUR	-1.537,21	-0,05
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten			EUR	-201,51	-0,01
5. Sonstige Aufwendungen			EUR	-5.381,28	-0,17
- Depotgebühren	EUR	-101,69			
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-4.286,59			
- Sonstige Kosten	EUR	-993,00			
- davon Aufwendungen aus negativen Habenzinsen	EUR	-672,49			
Summe der Aufwendungen			**EUR**	**-26.752,58**	**-0,86**
III. Ordentlicher Nettoertrag			**EUR**	**111.076,94**	**3,57**
IV. Veräußerungsgeschäfte					
1. Realisierte Gewinne			EUR	597.249,58	19,21
2. Realisierte Verluste			EUR	-853.516,91	-27,45
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften			**EUR**	**-256.267,33**	**-8,24**

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	**EUR**	**-145.190,39**	**-4,67**
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	179.577,58	5,78
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-96.932,09	-3,12
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	**EUR**	**82.645,49**	**2,66**
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	**EUR**	**-62.544,90**	**-2,01**

Entwicklung des Sondervermögens

				2022
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres			**EUR**	**2.304.043,76**
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr			EUR	0,00
2. Zwischenausschüttungen			EUR	-15.543,56
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)			EUR	720.106,78
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	830.788,80		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-110.682,02		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			EUR	58.546,64
5. Ergebnis des Geschäftsjahres			EUR	-62.544,90
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	179.577,58		
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-96.932,09		
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres			**EUR**	**3.004.608,72**

Verwendung der Erträge des Sondervermögens
Berechnung der Ausschüttung insgesamt und je Anteil

		insgesamt	je Anteil
I. Für die Ausschüttung verfügbar	**EUR**	**738.979,05**	**23,27**
1. Vortrag aus Vorjahr	EUR	454.264,36	14,11
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-145.190,39	-4,67
3. Zuführung aus dem Sondervermögen *)	EUR	429.905,08	13,83
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	**EUR**	**723.435,49**	**22,77**
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	272.744,18	8,77
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR	450.691,31	14,00
III. Gesamtausschüttung	**EUR**	**15.543,56**	**0,50**
1. Zwischenausschüttung **)		15.543,56	0,50
2. Endausschüttung	EUR	0,00	0,00

*) Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten und beruht auf der Annahme einer nach den Anlagebedingungen maximalen Ausschüttung.
**) Der Betrag der Zwischenausschüttung errechnet sich auf Basis der umlaufenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums.

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2019	Stück	8.116	EUR	791.930,65	EUR	97,58
2020	Stück	23.648	EUR	2.305.297,13	EUR	97,48
2021	Stück	23.652	EUR	2.304.043,76	EUR	97,41
2022	Stück	31.088	EUR	3.004.608,72	EUR	96,65

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)
für den Zeitraum vom 01.01.2022 bis 31.12.2022

				insgesamt	je Anteil
I. Erträge					
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)			EUR	0,00	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)			EUR	0,00	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren			EUR	1.801,70	0,00
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)			EUR	2.993.565,89	4,46
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland			EUR	7.353,05	0,01
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)			EUR	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen			EUR	0,00	0,00
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften			EUR	0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer			EUR	0,00	0,00
10. Abzug ausländischer Quellensteuer			EUR	0,00	0,00
11. Sonstige Erträge			EUR	9.464,64	0,01
Summe der Erträge			**EUR**	**3.012.185,28**	**4,48**
II. Aufwendungen					
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen			EUR	-24.373,20	-0,04
2. Verwaltungsvergütung			EUR	-563.900,81	-0,83
- Verwaltungsvergütung	EUR	-563.900,81			
- Beratungsvergütung	EUR	0,00			
- Asset Management Gebühr	EUR	0,00			
3. Verwahrstellenvergütung			EUR	-53.534,83	-0,08
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten			EUR	-8.103,11	-0,01
5. Sonstige Aufwendungen			EUR	136.979,61	0,20
- Depotgebühren	EUR	-2.223,31			
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	167.125,83			
- Sonstige Kosten	EUR	-27.922,91			
Summe der Aufwendungen			**EUR**	**-512.932,33**	**-0,76**
III. Ordentlicher Nettoertrag			**EUR**	**2.499.252,95**	**3,72**
IV. Veräußerungsgeschäfte					
1. Realisierte Gewinne			EUR	12.948.460,20	19,29
2. Realisierte Verluste			EUR	-18.547.799,92	-27,64
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften			**EUR**	**-5.599.339,72**	**-8,35**

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	**EUR**	**-3.100.086,77**	**-4,63**
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	3.451.132,36	5,14
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	846.391,86	1,26
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	**EUR**	**4.297.524,22**	**6,40**
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	**EUR**	**1.197.437,45**	**1,77**

Entwicklung des Sondervermögens

				2022
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres			**EUR**	**115.390.167,00**
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr			EUR	0,00
2. Zwischenausschüttungen			EUR	-335.569,37
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)			EUR	-48.621.911,62
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	8.110.189,01		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-56.732.100,63		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			EUR	-1.918.357,94
5. Ergebnis des Geschäftsjahres			EUR	1.197.437,45
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	3.451.132,36		
davon nicht realisierte Verluste	EUR	846.391,86		
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres			**EUR**	**65.711.765,51**

Verwendung der Erträge des Sondervermögens
Berechnung der Ausschüttung insgesamt und je Anteil

		insgesamt	je Anteil
I. Für die Ausschüttung verfügbar	**EUR**	**16.217.413,95**	**23,65**
1. Vortrag aus Vorjahr	EUR	9.923.369,45	14,28
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-3.100.086,77	-4,63
3. Zuführung aus dem Sondervermögen *)	EUR	9.394.131,28	14,00
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	**EUR**	**15.881.844,58**	**23,15**
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	6.025.079,75	8,98
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR	9.856.764,83	14,17
III. Gesamtausschüttung	**EUR**	**335.569,37**	**0,50**
1. Zwischenausschüttung **)		335.569,37	0,50
2. Endausschüttung	EUR	0,00	0,00

*) Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten und beruht auf der Annahme einer nach den Anlagebedingungen maximalen Ausschüttung.
**) Der Betrag der Zwischenausschüttung errechnet sich auf Basis der umlaufenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums.

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2019	Stück	1.565.966	EUR	154.424.917,63	EUR	98,61
2020	Stück	1.417.283	EUR	139.669.336,95	EUR	98,55
2021	Stück	1.170.613	EUR	115.390.167,00	EUR	98,57
2022	Stück	671.139	EUR	65.711.765,51	EUR	97,91

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)
für den Zeitraum vom 01.01.2022 bis 31.12.2022

				insgesamt
I. Erträge				
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)			EUR	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)			EUR	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren			EUR	1.884,19
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)			EUR	3.130.543,58
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland			EUR	7.689,46
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)			EUR	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen			EUR	0,00
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften			EUR	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer			EUR	0,00
10. Abzug ausländischer Quellensteuer			EUR	0,00
11. Sonstige Erträge			EUR	9.897,58
Summe der Erträge			**EUR**	**3.150.014,80**
II. Aufwendungen				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen			EUR	-25.136,34
2. Verwaltungsvergütung			EUR	-582.770,25
- Verwaltungsvergütung	EUR	-582.770,25		
- Beratungsvergütung	EUR	0,00		
- Asset Management Gebühr	EUR	0,00		
3. Verwahrstellenvergütung			EUR	-55.072,04
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten			EUR	-8.304,62
5. Sonstige Aufwendungen			EUR	131.598,33
- Depotgebühren	EUR	-2.325,00		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	162.839,24		
- Sonstige Kosten	EUR	-28.915,91		
Summe der Aufwendungen			**EUR**	**-539.684,92**
III. Ordentlicher Nettoertrag			**EUR**	**2.610.329,89**
IV. Veräußerungsgeschäfte				
1. Realisierte Gewinne			EUR	13.545.709,78
2. Realisierte Verluste			EUR	-19.401.316,83
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften			**EUR**	**-5.855.607,05**
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres			**EUR**	**-3.245.277,17**
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne			EUR	3.630.709,94
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste			EUR	749.459,77

VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	**EUR**	**4.380.169,71**
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	**EUR**	**1.134.892,54**

Entwicklung des Sondervermögens

				2022
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres			**EUR**	**117.694.210,76**
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr			EUR	0,00
2. Zwischenausschüttungen			EUR	-351.112,93
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)			EUR	-47.901.804,84
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	8.940.977,81		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-56.842.782,65		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			EUR	-1.859.811,30
5. Ergebnis des Geschäftsjahres			EUR	1.134.892,54
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	3.630.709,94		
davon nicht realisierte Verluste	EUR	749.459,77		
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres			**EUR**	**68.716.374,23**

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag bis zu 3,00%, derzeit (Angabe in %)	Verwaltungsvergütung bis zu 1,300% p.a., derzeit (Angabe in % p.a.)	Ertragsverwendung	Währung
nordIX Basis R	keine	0,00	0,750	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR
nordIX Basis I	1.000.000	0,00	0,650	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	**EUR**	**40.090.812,29**

die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte
Barclays Bank Ireland PLC (G) (V) - Dublin
Goldman Sachs Bank Europe SE (G) (V) - Frankfurt
J.P. Morgan SE (Broker) DE
J.P. Morgan SE Frankfurt (V)

		Nominal in Stk. bzw. Whg. in 1.000	Kurswert
Gesamtbetrag der i.Z.m. Derivaten von Dritten gewährten Sicherheiten	**EUR**		**4.190.000,00**
davon			
Bankguthaben	EUR		4.190.000,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	**88,58**
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	**6,53**

Bei der Ermittlung der Auslastung der Marktrisikoobergrenze für diesen Fonds wendet die Gesellschaft seit 01.08.2016 den qualifizierten Ansatz im Sinne der Derivate-Verordnung anhand eines Vergleichsvermögens an. Die Value-at-Risk-Kennzahlen wurden auf Basis der Methode der historischen Simulation mit den Parametern 99 % Konfidenzniveau und 1 Tag Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraums von einem Jahr berechnet. Unter dem Marktrisiko versteht man das Risiko, das sich aus der ungünstigen Entwicklung von Marktpreisen für das Sondervermögen ergibt.

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. § 37 Abs. 4 DerivateV

kleinster potenzieller Risikobetrag	0,09 %
größter potenzieller Risikobetrag	0,39 %
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	0,22 %

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Im Geschäftsjahr erreichte durchschnittliche Hebelwirkung durch Derivategeschäfte: **3,37**

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens zum Berichtsstichtag

FTSE World Broad Investment-Grade Total Return (EUR) hedged (Bloomberg: SBEHC INDEX)	100,00 %

Emittenten oder Garanten, deren Sicherheiten mehr als 20% des Wertes des Fonds ausgemacht haben (§ 37 Abs. 6 DerivateV):
Im Berichtszeitraum wiesen keine Sicherheiten eine erhöhte Emittentenkonzentration nach § 27 Abs. 7 Satz 4 DerivateV auf.

Sonstige Angaben

nordIX Basis R

Anteilwert	EUR	96,65
Ausgabepreis	EUR	96,65
Rücknahmepreis	EUR	96,65
Anzahl Anteile	STK	31.088

nordIX Basis I

Anteilwert	EUR	97,91
Ausgabepreis	EUR	97,91
Rücknahmepreis	EUR	97,91
Anzahl Anteile	STK	671.139

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Die nachfolgend dargestellten Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände decken eventuelle aus der Covid-19 Pandemie resultierenden Marktauswirkungen ab. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

Für Devisen, Aktien, Anleihen und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird der letzte verfügbare handelbare Kurs gemäß § 27 KARBV zugrunde gelegt.

Für Investmentanteile werden die aktuellen Werte, für Bankguthaben und Verbindlichkeiten der Nennwert bzw. Rückzahlungsbetrag gemäß § 29 KARBV zugrunde gelegt.

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gemäß § 28 KARBV i.V.m. § 168 Absatz 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.
Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote

nordIX Basis R

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt	0,84 %

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

nordIX Basis I

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt	0,72 %

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Eine erfolgsabhängige Vergütung ist im gleichen Zeitraum nicht angefallen.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen	EUR	0,00

Hinweis gem. § 101 Abs. 2 Nr. 3 KAGB (Kostentransparenz)
Die Gesellschaft erhält aus dem Sondervermögen die ihr zustehende Verwaltungsvergütung. Ein wesentlicher Teil der Verwaltungsvergütung wird für Vergütungen an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens verwendet. Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen von den an die Verwahrstelle und an Dritte aus dem Sondervermögen geleisteten Vergütungen und Aufwendungserstattungen zu. Sie hat im Zusammenhang mit Handelsgeschäften für das Sondervermögen keine geldwerten Vorteile von Handelspartnern erhalten.

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

nordIX Basis R

Wesentliche sonstige Erträge:	**EUR**	**0,00**
Wesentliche sonstige Aufwendungen:	**EUR**	**0,00**

nordIX Basis I

Wesentliche sonstige Erträge:	**EUR**	**0,00**
Wesentliche sonstige Aufwendungen:	**EUR**	**0,00**

Transaktionskosten (Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände)

Transaktionskosten	EUR	18.472,13

Die Transaktionskosten berücksichtigen sämtliche Kosten, die im Geschäftsjahr für Rechnung des Fonds separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von Vermögensgegenständen stehen.

Angaben zur Mitarbeitervergütung

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung	**in Mio. EUR**	**72,9**
davon feste Vergütung	in Mio. EUR	64,8
davon variable Vergütung	in Mio. EUR	8,1
Zahl der Mitarbeiter der KVG		902
Höhe des gezahlten Carried Interest	in EUR	0
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker	**in Mio. EUR**	**5,7**
davon Geschäftsleiter	in Mio. EUR	4,6
davon andere Risktaker	in Mio. EUR	1,1

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Universal-Investment-Gesellschaft mbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihres Vergütungssystems. Die detaillierte Ausgestaltung hat die Gesellschaft in einer Vergütungsrichtlinie geregelt, deren Ziel es ist, eine nachhaltige Vergütungssystematik unter Berücksichtigung von Sustainable Corporate Governance und unter Vermeidung von Fehlanreizen zur Eingehung übermäßiger Risiken (einschließlich einschlägiger Nachhaltigkeitsrisiken) sicherzustellen.

Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch den Vergütungsausschuss der Universal-Investment auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller rechtlichen sowie interner und externer regulatorischer Vorgaben überprüft. Es umfasst fixe und variable Vergütungselemente. Durch die Festlegung von Bandbreiten für die Gesamtzielvergütung ist gewährleistet, dass keine signifikante Abhängigkeit von der variablen Vergütung sowie ein angemessenes Verhältnis von variabler zu fixer Vergütung besteht. Für die Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und Mitarbeiter, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben (Risk Taker) gelten besondere Regelungen. Risikorelevante Mitarbeiter, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 50 TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt. Wird für risikorelevante Mitarbeiter dieser Schwellenwert überschritten, wird zwingend ein Anteil von 40 % der variablen Vergütung über einen Zeitraum von drei Jahren aufgeschoben. Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während dieses Zeitraums risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters oder der Kapitalverwaltungsgesellschaft insgesamt gekürzt werden. Jeweils am Ende jedes Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar und zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt.

Soweit das Portfolio-Management ausgelagert ist, werden keine Mitarbeitervergütungen direkt aus dem Fonds gezahlt.

Angaben gemäß § 101 Abs. 2 Nr. 5 KAGB

Wesentliche mittel- bis langfristigen Risiken

Die Angaben der wesentlichen mittel- bis langfristigen Risiken erfolgt innerhalb des Tätigkeitsberichts.

Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten

Die Angaben zu der Zusammensetzung des Portfolios erfolgen innerhalb der Vermögensaufstellung.
Die Angaben zu den Portfolioumsätzen erfolgen innerhalb der Vermögensaufstellung und innerhalb der Aufstellung der während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte.
Die Angabe zu den Transaktionskosten erfolgt im Anhang.

Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung

Anlagebedingungen und ggf. Anlagerichtlinien. Eine Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Portfoliogesellschaften erfolgt, wenn diese in den Vertragsbedingungen vorgeschrieben ist.

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Einsatz von Stimmrechtsberatern
Zum Einsatz von Stimmrechtsberatern verweisen wir auf den neuen Mitwirkungsbericht auf der Homepage https://www.universal-investment.com/de/permanent-seiten/compliance/mitwirkungspolitik.

Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten
Ausübung von Aktionärsrechten, verweisen wir auf unsere aktuelle Mitwirkungspolitik auf der Homepage https://www.universal-investment.com/de/permanent-seiten/compliance/mitwirkungspolitik.

Angaben zu nichtfinanziellen Leistungsindikatoren

Konventionelles Produkt Artikel 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungs-Verordnung)

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts PAI) werden im Investitionsprozess auf Gesellschaftsebene berücksichtigt.
Eine Berücksichtigung der PAI auf Ebene des Fonds ist nicht verbindlich und erfolgt insoweit nicht.

Dieser Fonds wird weder als ein Produkt eingestuft, das ökologische oder soziale Merkmale im Sinne der Offenlegungs-Verordnung (Artikel 8) bewirbt, noch als ein Produkt, das nachhaltige Investitionen zum Ziel hat (Artikel 9). Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Frankfurt am Main, den 2. Januar 2023

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

VERMERK DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS

An die Universal-Investment-Gesellschaft mbH, Frankfurt am Main

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens nordIX Basis - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraumes abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang - geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt "Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts" unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Universal-Investment-Gesellschaft mbH unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der Universal-Investment-Gesellschaft mbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.

- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Universal-Investment-Gesellschaft mbH abzugeben.

- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Universal-Investment-Gesellschaft mbH bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.

- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH nicht fortgeführt wird.

- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 11. April 2023

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Schobel
Wirtschaftsprüfer

Neuf
Wirtschaftsprüfer

Anteilklassen im Überblick

Erstausgabedatum	
Anteilklasse I	1. August 2016
Anteilklasse R	1. August 2016
Erstausgabepreise	
Anteilklasse I	€ 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse R	€ 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag
Ausgabeaufschlag	
Anteilklasse I	keiner
Anteilklasse R	keiner
Mindestanlagesumme	
Anteilklasse I	€ 1.000.000,00 für Erstanlage, Folgeanlage keine
Anteilklasse R	keine
Verwaltungsvergütung	
Anteilklasse I	0,65 % p.a.
Anteilklasse R	0,75 % p.a.

Verwahrstellenvergütung	
Anteilklasse I	derzeit 0,05 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 0,05 % p.a.
Erfolgsabhängige Vergütung	
Anteilklasse I	Bis zu 20 % des Betrages, um den der Anteilwert am Ende einer Abrechnungsperiode den Anteilwert am Anfang der Abrechnungsperiode um 1,50 % p.a. als Schwellenwert übersteigt, jedoch höchstens 5,00 % des Durchschnittwerts der Anteilklasse in der Abrechnungsperiode
Anteilklasse R	keine
Ertragsverwendung	
Anteilklasse I	Ausschüttend
Anteilklasse R	Ausschüttend
Wertpapier-Kennnummer / ISIN:	
Anteilklasse I	A2AJHF / DE000A2AJHF9
Anteilklasse R	A2AJHG / DE000A2AJHG7

Kurzübersicht über die Partner

1. Kapitalverwaltungsgesellschaft
Universal-Investment-Gesellschaft mbH

Hausanschrift:
Theodor-Heuss-Allee 70
60486 Frankfurt am Main

Postanschrift:
Postfach 17 05 48
60079 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 710 43-0
Telefax: 069 / 710 43-700
www.universal-investment.com

Gründung: 1968
Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,–
Eigenmittel: EUR 70.241.950,24 (Stand: September 2021)

Geschäftsführer:
Frank Eggloff, München
Mathias Heiß, Langen
Katja Müller, Bad Homburg
Markus Neubauer, Frankfurt am Main
Michael Reinhard, Bad Vilbel
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:
Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Daniel F. Just, Pöcking

2. Verwahrstelle
DONNER & REUSCHEL Aktiengesellschaft

Hausanschrift:
Ballindamm 27
20095 Hamburg

Besucheranschrift:
Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Telefon +49 (0)40 30217-0
Telefax +49 (0)40 30217-5353
www.donner-reuschel.de

Rechtsform: Aktiengesellschaft
Haftendes Eigenkapital: Mio. € 260 (Stand: 31.12.2021)

3. Asset Management-Gesellschaft und Vertrieb
nordIX AG

Postanschrift:
Ludwig-Erhard-Straße 1
20459 Hamburg

Telefon (040) 3099 776 - 0
www.nord-ix.com