

Halbjahresbericht

Kölner Nachhaltigkeitsfonds

zum 30. Juni 2022

Halbjahresbericht des Kölner Nachhaltigkeitsfonds

ZUM 30. JUNI 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	15.515.705,39	100,08
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	0,00	0,00
3. Derivate	0,00	0,00
4. Forderungen	0,00	0,00
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	206.640,49	1,33
7. Sonstige Vermögensgegenstände	15.309.064,90	98,75
Zielfondsanteile	15.309.064,90	98,75
Indexfonds	15.309.064,90	98,75
II. Verbindlichkeiten	-13.046,54	-0,08
Sonstige Verbindlichkeiten	-13.046,54	-0,08
III. Fondsvermögen	15.502.658,85	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 30.06.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens	
Investmentanteile								15.309.064,90	98,75	
Gesellschaftsfremde Investmentanteile										
Euro								1.623.370,00	10,47	
BNP EASY-ECPI GL.ESG INFRASTR.LU1291109293			ANT	24.500	24.500	-	EUR	66,260	1.623.370,00	10,47
US-Dollar								13.685.694,90	88,28	
AM.IDX SOL.-M.WO.CLIP.ALI.PAB	LU2182388400		ANT	29.250	2.750	-	USD	53,854	1.506.755,25	9,72
CSIF(IE)-FTSE EPRA NDGB 'A'	IE00BMDX0K95		ANT	12.750	-	450	USD	114,440	1.395.676,50	9,00
INVESCOMI2 IQS ESG GL.	IE00BJQRDN15		ANT	34.750	2.750	-	USD	47,793	1.588.596,25	10,25
ISH.III-MWSCESGENH.	IE000T9EOCL3		ANT	400.000	400.000	-	USD	3,951	1.511.800,00	9,75
ISH.IV-MSCI WLD.SRI UCITS	IE00BDZZTM54		ANT	230.000	230.000	-	USD	6,785	1.492.706,49	9,63
ISH.VI-EDG.MSCI WLD.M.VE	IE00BKVL7778		ANT	300.000	300.000	-	USD	5,772	1.656.300,00	10,68
ISHARESII-ISHS S&P GL.T.&FOR.	IE00B27YCF74		ANT	60.000	60.000	61.500	USD	26,491	1.520.388,01	9,81
L&G ETF-L&G CLEAN EN.	IE00BK5BCH80		ANT	150.000	150.000	-	USD	10,328	1.481.850,00	9,56
XTR.(IE)-ESG MSCI WORLD '1C'	IE00BZ02LR44		ANT	56.980	6.850	1.870	USD	28,102	1.531.622,40	9,88
Summe Wertpapiervermögen								15.309.064,90	98,75	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								206.640,49	1,33	
Bankguthaben								206.640,49	1,33	
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle										
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	206.640,49			%	100,000	206.640,49	1,33
Sonstige Verbindlichkeiten								-13.046,54	-0,08	
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-13.046,54					-13.046,54	-0,08
Fondsvermögen							EUR	15.502.658,85	100,00 *)	

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

Kölner Nachhaltigkeitsfonds A

ISIN	DE000A2PEMJ0
Fondsvermögen (EUR)	8.190.168,57
Anteilwert (EUR)	64,12
Umlaufende Anteile (STK)	127.732,0050

Kölner Nachhaltigkeitsfonds I

ISIN	DE000A2PEMH4
Fondsvermögen (EUR)	7.312.490,28
Anteilwert (EUR)	131,30
Umlaufende Anteile (STK)	55.691,0000

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.06.2022 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2022

US-Dollar	(USD)	1,04545 = 1 (EUR)
-----------	-------	-------------------

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
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

Investmentanteile

Gesellschaftsfremde Investmentanteile

Euro

DEKA MSCI WORLD C.CH.ESG U.	DE000ETFL581	ANT	-	60.000
VANECK SUST.WLD.EQ.	NL0010408704	ANT	-	53.800

US-Dollar

ISHARESII-S&P GL.WATER	IE00B1TXK627	ANT	27.000	27.000
L&G-L&G CLEAN WATER UCITS	IE00BK5BC891	ANT	-	116.000
LYX.IDX.FD.-SM.CIT.(DR) U.	LU2023679256	ANT	137.500	137.500
LYX.IDX FD-FUT.MOB.(DR) U.	LU2023679090	ANT	-	82.000
MUL-LYX.MSCI W.ESG L.E.U.E.	LU1792117779	ANT	6.500	62.000
UBS(L)FS-MSCI WLD.SOC.R. 'A'	LU0629459743	ANT	14.100	14.100

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen 98,75 %

Bestand der Derivate am Fondsvermögen 0,00 %

Sonstige Angaben

Kölner Nachhaltigkeitsfonds A

ISIN	DE000A2PEMJ0
Fondsvermögen (EUR)	8.190.168,57
Anteilwert (EUR)	64,12
Umlaufende Anteile (STK)	127.732,0050
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%, derzeit 5,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,35%, derzeit 1,35%
Mindestanlagesumme (EUR)	keine
Ertragsverwendung	Ausschüttung

Kölner Nachhaltigkeitsfonds I

ISIN	DE000A2PEMH4
Fondsvermögen (EUR)	7.312.490,28
Anteilwert (EUR)	131,30
Umlaufende Anteile (STK)	55.691,0000
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%, derzeit 0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,35%, derzeit 0,55%
Mindestanlagesumme (EUR)	100.000,00
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 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.

Angaben zur Transparenz

Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile:

Investmentanteile	Verwaltungsvergütung ¹⁾
AM.IDX SOL.-M.WO.CLI.PALI.PAB	0,10000 % p.a.
BNP Easy-ECPI Gl.ESG Infrastr.	0,18000 % p.a.
CSIF(IE)-FTSE EPRA NDGB 'A'	0,25000 % p.a.
Deka MSCI World C.Ch.ESG U.	0,25000 % p.a.
InvescoMI2 IQS ESG Gl.	0,60000 % p.a.
iSharesII-iShs S&P Gl.T.&For.	0,65000 % p.a.
iSharesII-S&P Gl.Water	0,65000 % p.a.
iSh.III-MWSCESGenh.	0,35000 % p.a.
iSh.IV-MSCI Wld.SRI UCITS	0,20000 % p.a.
iSh.VI-Edg.MSCI Wld.M.V.E	0,30000 % p.a.
L&G ETF-L&G Clean En.	0,49000 % p.a.
L&G-L&G Clean Water UCITS	0,49000 % p.a.
Lyx.Idx Fd-Fut.Mob.(DR) U.	0,45000 % p.a.
Lyx.Idx.Fd.-Sm.Cit. (DR) U.	0,45000 % p.a.
MUL-Lyx.MSCI W.ESG L.E.U.E.	0,20000 % p.a.
UBS(L)FS-MSCI Wld.Soc.R. 'A'	0,22000 % p.a.
VanEck Sust.Wld.Eq.	0,30000 % p.a.
Xtr.(IE)-ESG MSCI World '1C'	0,10000 % p.a.

¹⁾ Von anderen Kapitalverwaltungsgesellschaften 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.

