

# Halbjahresbericht

## Kölner Nachhaltigkeitsfonds

zum 30. Juni 2023

---

# Halbjahresbericht des Kölner Nachhaltigkeitsfonds

ZUM 30. JUNI 2023

■ 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
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>21.379.569,89</b>	<b>100,07</b>
<b>1. Aktien</b>	<b>18.910.236,57</b>	<b>88,52</b>
Gesundheitswesen	5.351.044,34	25,05
Industriewerte	3.946.263,27	18,47
Versorgungsunternehmen	2.449.909,50	11,47
Konsumgüter	2.196.986,93	10,28
Telekommunikation	1.700.154,46	7,96
Technologie	1.646.173,93	7,71
Verbraucher-Dienstleistungen	858.242,73	4,02
Rohstoffe	761.461,41	3,56
<b>2. Anleihen</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>3. Derivate</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>4. Forderungen</b>	<b>598.663,12</b>	<b>2,80</b>
<b>5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>6. Bankguthaben</b>	<b>1.870.670,20</b>	<b>8,76</b>
<b>7. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-15.754,06</b>	<b>-0,07</b>
Sonstige Verbindlichkeiten	-15.754,06	-0,07
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>21.363.815,83</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

<sup>\*)</sup> Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

## ■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>18.910.236,57</b>	<b>88,52</b>
<b>Aktien</b>									
<b>Euro</b>								<b>5.739.183,20</b>	<b>26,86</b>
ENEL	IT0003128367	STK	117.000	117.000	-	EUR	6,168	721.656,00	3,38
IBERDROLA	ES0144580Y14	STK	72.600	72.600	-	EUR	11,950	867.570,00	4,06
INFINEON TECHN. NAM.	DE0006231004	STK	21.180	21.180	-	EUR	37,785	800.286,30	3,75
KON.AHOLD DELHAIZE	NL0011794037	STK	28.450	28.450	-	EUR	31,260	889.347,00	4,16
ORANGE	FR0000133308	STK	78.700	78.700	-	EUR	10,702	842.247,40	3,94
SCHNEIDER ELEC.	FR0000121972	STK	4.550	4.550	-	EUR	166,460	757.393,00	3,55
VEOLIA ENVIR.	FR0000124141	STK	29.730	3.230	-	EUR	28,950	860.683,50	4,03
<b>US-Dollar</b>								<b>7.103.733,47</b>	<b>33,25</b>
CIGNA GR.	US1255231003	STK	3.425	3.425	-	USD	280,600	880.893,68	4,12
CISCO SYS.	US17275R1023	STK	18.090	18.090	-	USD	51,740	857.907,06	4,02
EDISON INT.	US2810201077	STK	10.800	10.800	-	USD	69,450	687.497,71	3,22
GEN.MILLS	US3703341046	STK	8.820	8.820	-	USD	76,700	620.067,83	2,90
JOHNSON&J.	US4781601046	STK	4.650	4.650	-	USD	165,520	705.470,21	3,30
LINDE	IE000S9YS762	STK	2.180	-	-	USD	381,080	761.461,41	3,56
MERCK & CO. (NEW)	US58933Y1055	STK	8.140	8.140	-	USD	115,390	860.929,97	4,03
MICROSOFT	US5949181045	STK	2.710	-	140	USD	340,540	845.887,63	3,96
XYLEM	US98419M1009	STK	8.560	8.560	-	USD	112,620	883.617,97	4,14
<b>Schweizer Franken</b>								<b>712.906,10</b>	<b>3,34</b>
ROCHE HOLD.	CH0012032113	STK	2.370	2.370	-	CHF	293,600	712.906,10	3,34
<b>Dänische Kronen</b>								<b>705.770,52</b>	<b>3,30</b>
NOVO-NORDISK NAM. 'B'	DK0060534915	STK	4.780	4.780	-	DKK	1.099,400	705.770,52	3,30
<b>Englische Pfund</b>								<b>2.235.659,26</b>	<b>10,46</b>
ASTRAZENECA	GB0009895292	STK	5.250	5.250	-	GBP	112,760	689.844,43	3,23
RELX	GB00B2B0DG97	STK	28.100	28.100	-	GBP	26,210	858.242,73	4,02
UNILEVER	GB00B10RZP78	STK	14.400	14.400	-	GBP	40,975	687.572,10	3,22
<b>Japanische Yen</b>								<b>2.412.984,02</b>	<b>11,29</b>
KEYENCE	JP3236200006	STK	1.700	1.700	-	JPY	67.850,000	731.477,47	3,42
ORGANO	JP3201600008	STK	33.000	33.000	-	JPY	4.235,000	886.277,12	4,15
TAKEDA PHARMA.CO. LTD.	JP3463000004	STK	27.700	27.700	-	JPY	4.527,000	795.229,43	3,72
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>18.910.236,57</b>	<b>88,52</b>
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>								<b>1.870.670,20</b>	<b>8,76</b>
<b>Bankguthaben</b>								<b>1.870.670,20</b>	<b>8,76</b>
<b>EUR-Guthaben bei:</b>									
<b>Verwahrstelle</b>									
KREISSPARKASSE KÖLN		EUR	1.870.670,20			%	100,000	1.870.670,20	8,76
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>598.663,12</b>	<b>2,80</b>
DIVIDENDENANSPRÜCHE		EUR	3.812,60					3.812,60	0,02
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN		EUR	594.850,52					594.850,52	2,78

## ■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>-15.754,06</b>	<b>-0,07</b>
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-15.754,06				-15.754,06	-0,07
<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>		<b>21.363.815,83</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

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

### Kölner Nachhaltigkeitsfonds A

ISIN	DE000A2PEMJ0
Fondsvermögen (EUR)	9.386.725,73
Anteilwert (EUR)	65,15
Umlaufende Anteile (STK)	144.073,3590

### Kölner Nachhaltigkeitsfonds I

ISIN	DE000A2PEMH4
Fondsvermögen (EUR)	11.977.090,10
Anteilwert (EUR)	134,48
Umlaufende Anteile (STK)	89.062,0000

## ■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:  
Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.06.2023 oder letztbekannte.

### Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2023

Schweizer Franken	(CHF)	0,97605 = 1 (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,44595 = 1 (EUR)
Englische Pfund	(GBP)	0,85815 = 1 (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	157,68770 = 1 (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,09100 = 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
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

### Börsengehandelte Wertpapiere

#### Aktien

##### Euro

ANDRITZ	AT0000730007	STK	11.700	11.700
CRH	IE0001827041	STK	16.000	16.000
NORDEX	DE000A0D6554	STK	48.000	48.000

##### US-Dollar

ALBEMARLE	US0126531013	STK	2.885	2.885
FERGUSON	JE00BJVNSS43	STK	4.940	4.940
FIRST SOLAR	US3364331070	STK	1.110	1.110
JOHNSON CONTR.INT.	IE00BY7QL619	STK	11.525	11.525
JPMORGAN	US46625H1005	STK	5.115	5.115
PENTAIR	IE00BLS09M33	STK	13.000	13.000
SOLAREEDGE TECHN.	US83417M1045	STK	600	600
WATTS WATER TECHN. 'A'	US9427491025	STK	4.345	4.345

##### Australische Dollar

FORTESCUE METALS GR.	AU000000FMG4	STK	44.000	44.000
----------------------	--------------	-----	--------	--------

##### Canadische Dollar

BK.NOVA SCOTIA	CA0641491075	STK	13.500	13.500
----------------	--------------	-----	--------	--------

##### Schweizer Franken

GEBERIT NAM. (DISP.)	CH0030170408	STK	1.285	1.285
----------------------	--------------	-----	-------	-------

##### Dänische Kronen

VESTAS WIND SYS. NAM.	DK0061539921	STK	25.970	25.970
-----------------------	--------------	-----	--------	--------

### An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

#### Aktien

##### Euro

LINDE	IE00BZ12WP82	STK	2.180	-
-------	--------------	-----	-------	---

##### US-Dollar

BADGER METER	US0565251081	STK	6.140	6.140
--------------	--------------	-----	-------	-------

#### Investmentanteile

##### Gesellschaftsfremde Investmentanteile

##### Euro

BNP P.EASY-ECPI CIRC.ECON.L.	LU1953136527	ANT	106.000	106.000
VANECK SUST.WLD.EQ.	NL0010408704	ANT	59.500	59.500

##### US-Dollar

INVESCOM2-IQS GL.EQ.	IE00BJQRDN15	ANT	-	34.750
----------------------	--------------	-----	---	--------

## ■ 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
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

ISH.4-MSCI WO.VA.F.E.UCITS	IE000H1H16W5	ANT	-	370.000
ISH.IV-MSCI WLD.M.F.E.U.	IE000L5NW549	ANT	-	425.850
ISH.IV-MSCI WLD.SRIE00BDZZTM54 UCITS		ANT	-	230.000
ISH.VI-EDG.MSCI WLD.M.V.E	IE00BKVL7778	ANT	-	275.000
ISH.V-MSCI W.H.C.S.ESG U.	IE00BJ5JNZ06	ANT	-	240.000
ISHARESII-S&P GL.WATER	IE00B1TXX627	ANT	-	29.500
L&G ETF-L&G CLEAN EN.	IE00BK5BCH80	ANT	-	146.000
XTR.(IE)-ESG MSCI WORLD '1C'	IE00BZ02LR44	ANT	-	56.980

## ■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

**Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen** **88,52 %**

**Bestand der Derivate am Fondsvermögen** **0,00 %**

### Sonstige Angaben

#### Kölner Nachhaltigkeitsfonds A

ISIN	DE000A2PEMJ0
Fondsvermögen (EUR)	9.386.725,73
Anteilwert (EUR)	65,15
Umlaufende Anteile (STK)	144.073,3590
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)	11.977.090,10
Anteilwert (EUR)	134,48
Umlaufende Anteile (STK)	89.062,0000
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%, derzeit 0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,35%, derzeit 0,75%
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 <sup>1)</sup>
BNP P.Easy-ECPI Circ.Econ.L.	0,18000 % p.a.
InvescoM2-IQS Gl.Eq.	0,60000 % p.a.
iSharesII-S&P Gl.Water	0,65000 % p.a.
iSh.IV-MSCI WLD.M.F.E.U.	0,30000 % p.a.
iSh.IV-MSCI Wld.SRI UCITS	0,20000 % p.a.
iSh.VI-Edg.MSCI Wld.M.V.E	0,30000 % p.a.
iSh.V-MSCI W.H.C.S.ESG U.	0,25000 % p.a.
iSh.4-MSCI Wo.Va.F.E.UCITS	0,30000 % p.a.
L&G ETF-L&G Clean En.	0,49000 % p.a.
VanEck Sust.Wld.Eq.	0,30000 % p.a.
Xtr.(IE)-ESG MSCI World '1C'	0,10000 % p.a.

<sup>1)</sup> 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 Rücknahmeabschlüsse gezahlt.

