

Halbjahresbericht

Kölner Nachhaltigkeitsfonds

zum 30. Juni 2024

Halbjahresbericht des Kölner Nachhaltigkeitsfonds

ZUM 30. JUNI 2024

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

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	22.317.403,79	100,08
1. Aktien	20.618.633,97	92,46
Industriewerte	5.518.275,99	24,75
Technologie	4.258.860,51	19,10
Finanzwerte	3.308.923,94	14,84
Gesundheitswesen	3.128.899,14	14,03
Versorgungsunternehmen	2.023.388,23	9,07
Verbraucher-Dienstleistungen	1.512.895,45	6,78
Konsumgüter	641.710,65	2,88
Telekommunikation	225.680,06	1,01
2. Anleihen	0,00	0,00
3. Derivate	0,00	0,00
4. Forderungen	16.878,16	0,08
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	1.681.891,66	7,54
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-17.457,93	-0,08
Sonstige Verbindlichkeiten	-17.457,93	-0,08
III. Fondsvermögen	22.299.945,86	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 30.06.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								20.618.633,97	92,46
Aktien									
Euro								3.096.995,35	13,89
ASML HOLD. NAM.	NL0010273215	STK	259	259	57	374	EUR 964,200	249.727,80	1,12
IBERDROLA	ES0144580Y14	STK	56.073	56.073	21.895	24.886	EUR 12,115	679.324,40	3,05
MÜNCH.RÜCK. VINK.NAM.	DE0008430026	STK	1.013	1.013	1.013	-	EUR 467,000	473.071,00	2,12
PROSUS	NL0013654783	STK	13.015	13.015	13.015	-	EUR 33,260	432.878,90	1,94
SAP	DE0007164600	STK	1.835	1.835	2.600	765	EUR 189,520	347.769,20	1,56
SCHNEIDER ELEC.	FR0000121972	STK	2.034	2.034	-	1.932	EUR 223,850	455.310,90	2,04
VERBUND 'A'	AT0000746409	STK	6.231	6.231	1.298	6.084	EUR 73,650	458.913,15	2,06
US-Dollar								11.579.611,73	51,93
ADOBE	US00724F1012	STK	768	768	294	392	USD 555,540	398.091,64	1,79
ALPHABET 'A'	US02079K3059	STK	4.579	4.579	-	2.354	USD 182,150	778.227,06	3,49
ARCH CAP.GR.	BMG0450A1053	STK	5.002	5.002	5.002	-	USD 100,890	470.867,07	2,11
AUTO.DATA PROC.	US0530151036	STK	1.408	1.408	-	1.434	USD 238,690	313.576,41	1,41
BOOKING HOLD.	US09857L1089	STK	129	129	169	40	USD 3.961,500	476.821,55	2,14
BROADCOM	US11135F1012	STK	261	261	445	184	USD 1.605,530	390.989,81	1,75
CENCORA	US03073E1055	STK	969	969	969	-	USD 225,300	203.700,21	0,91
CHUBB	CH0044328745	STK	1.860	1.860	3.437	1.577	USD 255,080	442.686,07	1,99
CIGNA GR.	US1255231003	STK	1.895	1.895	606	1.870	USD 330,570	584.492,79	2,62
CLEAN HARBORS	US1844961078	STK	2.196	2.196	2.196	-	USD 226,150	463.378,03	2,08
CRH	IE0001827041	STK	5.527	5.527	8.757	3.230	USD 74,530	384.350,91	1,72
ELI LILLY	US5324571083	STK	428	428	-	396	USD 905,380	361.560,66	1,62
FERGUSON	JE00BJVNSS43	STK	2.095	2.095	-	668	USD 193,650	378.536,74	1,70
FISERV	US3377381088	STK	3.000	3.000	4.430	1.430	USD 149,040	417.186,84	1,87
FLOWERVE	US34354P1057	STK	4.856	4.856	4.856	-	USD 48,100	217.936,65	0,98
HOME DEPOT	US4370761029	STK	987	987	-	496	USD 344,240	317.018,78	1,42
LAM RESE.	US5128071082	STK	239	239	239	-	USD 1.064,850	237.461,30	1,06
MASTERCARD 'A'	US57636Q1040	STK	528	528	-	1.199	USD 441,160	217.338,45	0,97
MERCK & CO. (NEW)	US58933Y1055	STK	3.595	3.595	3.595	-	USD 123,800	415.265,69	1,86
MICROSOFT	US5949181045	STK	2.131	2.131	-	579	USD 446,950	888.687,15	3,99
NVIDIA	US67066G1040	STK	2.810	2.810	63	542	USD 123,540	323.907,07	1,45
QUALCOMM	US7475251036	STK	1.136	1.136	1.136	-	USD 199,180	211.120,58	0,95
REPUBLIC SERV.	US7607591002	STK	2.326	2.326	2.326	-	USD 194,340	421.772,65	1,89
TESLA	US88160R1014	STK	1.343	1.343	-	405	USD 197,880	247.961,60	1,11
TETRA TECH	US88162G1031	STK	1.800	1.800	1.800	-	USD 204,480	343.423,37	1,54
TRANE TECHN.	IE00BK9ZQ967	STK	2.318	2.318	-	1.650	USD 328,930	711.415,67	3,19
VERIZON COMM.	US92343V1044	STK	5.865	5.865	11.483	5.618	USD 41,240	225.680,06	1,01
VISA 'A'	US92826C8394	STK	1.680	1.680	154	1.396	USD 262,470	411.429,53	1,84
XYLEM	US98419M1009	STK	2.566	2.566	2.566	-	USD 135,630	324.727,39	1,46
Schweizer Franken								1.834.255,93	8,23
ABB NAM.	CH0012221716	STK	13.843	13.843	13.843	-	CHF 49,920	717.556,26	3,22
NOVARTIS NAM.	CH0012005267	STK	2.259	2.259	2.259	-	CHF 96,170	225.583,33	1,01
ROCHE HOLD.	CH0012032113	STK	1.582	1.582	1.582	-	CHF 273,800	449.770,62	2,02
SWISS RE NAM.	CH0126881561	STK	3.812	3.812	3.812	-	CHF 111,500	441.345,72	1,98
Dänische Kronen								781.022,36	3,50
NOVO-NORDISK NAM. 'B'	DK0062498333	STK	5.792	5.792	-	1.624	DKK 1.005,600	781.022,36	3,50

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Englische Pfund								1.220.307,65	5,47
GSK	GB00BN7SWP63		STK	17.251	22.218	4.967	GBP 15,295	311.203,69	1,40
RELX	GB00B2B0DG97		STK	10.976	-	14.925	GBP 36,390	471.093,52	2,11
UNILEVER	GB00B10RZP78		STK	8.547	8.547	-	GBP 43,450	438.010,44	1,96
Japanische Yen								2.106.440,95	9,45
MITSUB.ELEC.	JP3902400005		STK	42.000	42.000	-	JPY 2.567,500	625.486,87	2,80
SUMIT.MITSUI FIN.GR.	JP3890350006		STK	11.600	11.600	-	JPY 10.725,000	721.628,62	3,24
TOKIO MARINE HOLD.	JP3910660004		STK	21.800	21.800	-	JPY 6.005,000	759.325,46	3,41
Summe Wertpapiervermögen								20.618.633,97	92,46
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								1.681.891,66	7,54
Bankguthaben								1.681.891,66	7,54
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	1.681.891,66			% 100,000	1.681.891,66	7,54
Sonstige Vermögensgegenstände								16.878,16	0,08
DIVIDENDENANSPRÜCHE									
			EUR	14.141,12				14.141,12	0,06
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN									
			EUR	2.737,04				2.737,04	0,01
Sonstige Verbindlichkeiten								-17.457,93	-0,08
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN									
			EUR	-1.085,70				-1.085,70	0,00
KOSTENABGRENZUNGEN									
			EUR	-16.372,23				-16.372,23	-0,07
Fondsvermögen						EUR		22.299.945,86	100,00*)

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

Kölner Nachhaltigkeitsfonds A

ISIN	DE000A2PEMJ0
Fondsvermögen (EUR)	7.463.668,58
Anteilwert (EUR)	77,39
Umlaufende Anteile (STK)	96.444,3960

Kölner Nachhaltigkeitsfonds I

ISIN	DE000A2PEMH4
Fondsvermögen (EUR)	14.836.277,28
Anteilwert (EUR)	160,73
Umlaufende Anteile (STK)	92.307,0000

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 28.06.2024 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.06.2024

Schweizer Franken	(CHF)	0,96305 = 1 (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,45745 = 1 (EUR)
Englische Pfund	(GBP)	0,84785 = 1 (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	172,40170 = 1 (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,07175 = 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 Schuldscheinanleihen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Aktien

US-Dollar

APPLE	US0378331005	STK	1.064	4.955
APPLIED MAT.	US0382221051	STK	-	3.223
ARISTA NETW.	US0404131064	STK	812	812
BRISTOL-MYERS	US1101221083	STK	8.996	8.996
CARDINAL HEALTH	US14149Y1082	STK	-	7.545
CISCO SYS.	US17275R1023	STK	-	17.086
IBM	US4592001014	STK	-	4.449
INTEL	US4581401001	STK	14.514	14.514
INTUIT	US4612021034	STK	-	1.739
PALO ALTO NETW.	US6974351057	STK	-	2.747
PAYPAL HOLD.	US70450Y1038	STK	6.975	6.975
ROCKWELL AUTOM.	US7739031091	STK	648	648
TJX CO.	US8725401090	STK	-	10.396
UBER TECHN.	US90353T1007	STK	9.396	9.396
WALT DISNEY	US2546871060	STK	2.962	2.962
WASTE MANAG.	US94106L1098	STK	2.150	2.150
WATTS WATER TECHN. 'A'	US9427491025	STK	2.016	2.016

Canadische Dollar

STANTEC	CA85472N1096	STK	2.518	2.518
---------	--------------	-----	-------	-------

Dänische Kronen

VESTAS WIND SYS. NAM.	DK0061539921	STK	6.625	6.625
-----------------------	--------------	-----	-------	-------

Japanische Yen

HONDA MOTOR	JP3854600008	STK	28.000	28.000
NINTENDO	JP3756600007	STK	4.500	4.500
NOMURA MICRO SCIEN.	JP3762950008	STK	2.900	2.900
ORGANO	JP3201600008	STK	7.700	7.700
SUMITOMO MITSUI TR.HOLD.	JP3892100003	STK	-	47.000
TOYOTA MOTOR	JP3633400001	STK	18.500	18.500

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Aktien

US-Dollar

CARRIER GL.	US14448C1045	STK	-	16.684
-------------	--------------	-----	---	--------

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	92,46 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,00 %

Sonstige Angaben

Kölner Nachhaltigkeitsfonds A

ISIN	DE000A2PEMJ0
Fondsvermögen (EUR)	7.463.668,58
Anteilwert (EUR)	77,39
Umlaufende Anteile (STK)	96.444,3960
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)	14.836.277,28
Anteilwert (EUR)	160,73
Umlaufende Anteile (STK)	92.307,0000
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

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 zum Bewertungsverfahren gemäß §§ 26-31 und 34 KARBV

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 gleichtäglich).

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.

