

Halbjahresbericht

Kölner Nachhaltigkeitsfonds

zum 30. Juni 2020

Halbjahresbericht des Kölner Nachhaltigkeitsfonds

ZUM 30. JUNI 2020

■ 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	12.141.430,89	100,07
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	210.977,06	1,74
7. Sonstige Vermögensgegenstände	11.930.453,83	98,33
Zielfondsanteile	11.930.453,83	98,33
Indexfonds	11.930.453,83	98,33
II. Verbindlichkeiten	-8.623,50	-0,07
Sonstige Verbindlichkeiten	-8.623,50	-0,07
III. Fondsvermögen	12.132.807,39	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 30.06.2020	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Investmentanteile								11.930.453,83	98,33
Gesellschaftsfremde Investmentanteile									
Euro								4.813.976,45	39,68
BNP P.EASY-ECPI CIRC.ECON.L.	LU1953136527		ANT	116.400	116.400	-	EUR 10,470	1.218.708,00	10,04
LYXOR WORLD WATER UCITS	FR0010527275		ANT	28.875	3.500	-	EUR 39,510	1.140.851,25	9,40
MUF-LYXOR NEW EN.UCITS	FR0010524777		ANT	42.100	1.750	-	EUR 30,060	1.265.526,00	10,43
THINK SUSTAINABLE WORLD NAM.	NL0010408704		ANT	14.140	2.265	-	EUR 84,080	1.188.891,20	9,80
US-Dollar								7.116.477,38	58,65
ISHARESII-S&P GL.WATER	IE00B1TXK627		ANT	28.460	2.660	-	USD 44,011	1.115.205,10	9,19
ISHARESII-S&P GL CLEAN EN.	IE00B1XNHC34		ANT	181.700	6.800	17.500	USD 7,154	1.157.429,00	9,54
JPM ICAV-GL.RES.ENH.IND.EQ.	IE00BF4G6Y48		ANT	50.580	6.830	-	USD 26,855	1.209.367,80	9,97
MUL-LYX.MSCI W.ESG TR.L.U.E.	LU1792117779		ANT	60.445	8.045	-	USD 22,491	1.210.411,13	9,98
UBS-ETF-MSCI WLD.SO.R. 'A-DIS'	LU0629459743		ANT	13.535	1.810	-	USD 100,904	1.215.984,40	10,02
XTR.(IE)-ESG MSCI WORLD '1C'	IE00BZ02LR44		ANT	57.800	7.050	-	USD 23,475	1.208.079,95	9,96
Summe Wertpapiervermögen								11.930.453,83	98,33
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								210.977,06	1,74
Bankguthaben								210.977,06	1,74
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	210.977,06			% 100,000	210.977,06	1,74
Sonstige Verbindlichkeiten								-8.623,50	-0,07
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-8.623,50				-8.623,50	-0,07
Fondsvermögen							EUR	12.132.807,39	100,00*

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

Kölner Nachhaltigkeitsfonds A	
ISIN	DE000A2PEMJ0
Fondsvermögen (EUR)	3.937.842,12
Anteilwert (EUR)	50,71
Umlaufende Anteile (STK)	77.649,2660

Kölner Nachhaltigkeitsfonds I	
ISIN	DE000A2PEMH4
Fondsvermögen (EUR)	8.194.965,27
Anteilwert (EUR)	102,21
Umlaufende Anteile (STK)	80.181,0010

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.06.2020 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2020

US-Dollar	(USD)	1,12315 = 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
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

Investmentanteile

Gesellschaftsfremde Investmentanteile

US-Dollar

LYXOR IF-L.G.L.GEN. LU1691909508	ANT	-	106.600	
EQUALITY				
DR				

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen 98,33 %

Bestand der Derivate am Fondsvermögen 0,00 %

Sonstige Angaben

Kölner Nachhaltigkeitsfonds A

ISIN	DE000A2PEMJ0
Fondsvermögen (EUR)	3.937.842,12
Anteilwert (EUR)	50,71
Umlaufende Anteile (STK)	77.649,2660
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)	8.194.965,27
Anteilwert (EUR)	102,21
Umlaufende Anteile (STK)	80.181,0010
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⁾
BNP P.Easy-ECPI Circ.Econ.L.	0,18000 % p.a.
iSharesII-S&P Gl Clean En.	0,65000 % p.a.
iSharesII-S&P Gl.Water	0,65000 % p.a.
JPM ICAV-Gl.Res.Enh.Ind.Eq.	0,25000 % p.a.
Lyxor IF-L.Gl.Gen.Equality DR	0,20000 % p.a.
Lyxor World Water UCITS	0,60000 % p.a.
MUF-Lyxor New En.UCITS	0,60000 % p.a.
MUL-Lyx.MSCI W.ESG Tr.L.U.E.	0,30000 % p.a.
Think Sustainable World Nam.	0,30000 % p.a.
UBS-ETF-MSCI Wld.So.R. 'A-dis'	0,25000 % 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 Rücknahmeabschlüsse gezahlt.

