



# Apollo Nachhaltig New World

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht für das Halbjahr  
vom 1. September 2022 bis 28. Februar 2023

## **Security Kapitalanlage Aktiengesellschaft, Graz**

Burgring 16, A-8010 Graz  
+43 316 8071-0; [office@securitykag.at](mailto:office@securitykag.at); [www.securitykag.at](http://www.securitykag.at)

### **Aktionär**

Schelhammer Capital Bank AG, Wien

### **Staatskommissäre**

MR Mag. Hans-Jürgen Gaugl, MSc  
Mag. Barbara Pichler

### **Aufsichtsrat**

Dr. Othmar Ederer (Vorsitzender)  
Mag. Klaus Scheitegel (Vorsitzender Stellvertreter)  
Dr. Gernot Reiter  
Mag. Berthold Troiß (ab 12.9.2022)  
MMag. Paul Swoboda (ab 12.9.2022)

### **Vorstand**

MMag. DDr. Hans Peter Ladreiter  
Alfred Kober, MBA (ab 1.1.2023)  
Mag. Wolfgang Ules (ab 1.1.2023)  
Stefan Winkler, MSc

### **Depotbank**

Liechtensteinische Landesbank (Österreich) AG, Wien

### **Vertriebspartner**

Schelhammer Capital Bank AG, Wien

### **Abschlussprüfer**

Ernst & Young Wirtschaftsprüfungsgesellschaft m.b.H., Wien

# HALBJAHRESBERICHT

## des Apollo Nachhaltig New World, Miteigentumsfonds gemäß InvFG, für das Halbjahr vom 1. September 2022 bis 28. Februar 2023

Sehr geehrter Anteilinhaber,

die Security Kapitalanlage Aktiengesellschaft legt hiermit den Halbjahresbericht des Apollo Nachhaltig New World über die erste Hälfte des Rechnungsjahres 2022 / 2023 vor.

### 1. Anzahl der umlaufenden Anteile

zu Rechnungsjahresbeginn	4.193.126
zu Halbjahresende	4.154.907

### 2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil ( AT0000A1XFG6 ) betrug	EUR 8,79
der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil ( AT0000A1XFH4 ) betrug	EUR 90.543,77
der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil ( AT0000A1XFJ0 ) betrug	EUR 90,35
der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil ( AT0000A2UX42 ) betrug	EUR 8,82
der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil ( AT0000A1XFK8 ) betrug	EUR 9,45

### 3. Zusammensetzung des Fondsvermögens

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	BESTAND	KÄUFE	VERKÄUFE	KURS	KURSWERT IN EUR	% - ANTEIL AM FONDS- VERMÖGEN
			28.02.2023 STK./NOM.	ZUGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	ABGÄNGE			
<b>Amtlicher Handel und organisierte Märkte</b>								
<b>Obligationen</b>								
0,375 Ungarn 09.06.2021-09.06.2026	XS2348280707	EUR	3.500.000	3.500.000	0	84,9760	2.974.160,00	0,99
0,555 Republic of Chile 21.09.2021-21.01.2029	XS2388560604	EUR	10.000.000	10.000.000	0	81,5190	8.151.900,00	2,71
0,625 Corporacion Andina Fomento 20.11.19-20.11.26	XS2081543204	EUR	10.500.000	0	0	87,5860	9.196.530,00	3,06
0,65 Italien 28.10.2019-28.10.2027	IT0005388175	EUR	3.600.000	0	0	99,0707	3.566.546,64	1,19
0,83 Republik of Chile 02.07.2019-2031	XS1843433639	EUR	6.200.000	0	600.000	77,4790	4.803.698,00	1,60
1,00 Republik Serbien 23.09.2021-23.09.2028	XS2388561677	EUR	10.800.000	800.000	0	76,0270	8.210.916,00	2,73
1,25 Republic of Peru 11.03.2021-2033	XS2314020806	EUR	7.000.000	7.000.000	0	70,1970	4.913.790,00	1,63
1,375 Hungarian Development Bank 24.06.2020-2025	XS2010030752	EUR	1.500.000	1.500.000	0	91,8000	1.377.000,00	0,46
1,625 CPI Property Group SA 28.10.2019-23.04.2027	XS2069407786	EUR	2.300.000	0	0	76,4600	1.758.580,00	0,58
1,625 Nordmazedonien 10.03.2021-10.03.2028	XS2310118893	EUR	7.800.000	1.500.000	0	77,7960	6.068.088,00	2,02
1,875 Republik of Latvia 19.02.2019-19.02.2049	XS1953056253	EUR	780.000	0	0	70,5030	549.923,40	0,18
10,75 Nova Ljubljanska B. 28.11.2022-28.11.2032	XS2413677464	EUR	1.500.000	1.500.000	0	106,8510	1.602.765,00	0,53
2,00 Marokko, Königreich 30.09.2020-30.09.2030	XS2239829216	EUR	9.200.000	0	0	79,7180	7.334.056,00	2,44
2,00 NE Property B.V. 20.01.2022-20.01.2030	XS2434763483	EUR	3.700.000	0	0	72,8420	2.695.154,00	0,90
2,00 Polen, Republik 07.03.2019-08.03.2049	XS1960361720	EUR	3.700.000	0	0	68,1810	2.522.697,00	0,84
2,125 Litauen, Republik 01.06.2022-01.06.2032	XS2487342649	EUR	7.500.000	2.500.000	0	87,2130	6.540.975,00	2,17
2,55 Republic of Montenegro 03.10.2019-03.10.2029	XS2050982755	EUR	2.400.000	0	0	73,5650	1.765.560,00	0,59
2,625 Atrium Finance Issuer BV 05.02.21-05.09.27	XS2294495838	EUR	1.700.000	0	0	74,5710	1.267.707,00	0,42
2,75 Banque Ouest Afr.Dev. 22.01.2021-22.01.2033	XS2288824969	EUR	500.000	0	0	75,6500	378.250,00	0,13
2,875 Republic of Montenegro 16.12.2020-16.12.2027	XS2270576700	EUR	4.895.000	0	250.000	79,5270	3.892.846,65	1,29
3,00 Arcelik A.S. 27.05.2021-27.05.2026	XS2346972263	EUR	3.200.000	1.000.000	0	90,6340	2.900.288,00	0,96
3,00 Bank Gospodarstwa Krajowego 31.5.2022-30.5.2029	XS2486282358	EUR	2.700.000	2.700.000	0	90,9970	2.456.919,00	0,82
3,088 Region of Lazio 05.12.2017-31.03.2043	XS1731657497	EUR	7.300.000	0	0	72,8184	5.315.743,20	1,77
3,25 San Marino Gov. Bond 24.02.2021-24.02.2024	XS2239061927	EUR	140.000	0	2.500.000	97,8570	136.999,80	0,05
3,375 NE Property BV 14.07.2020-14.07.2027	XS2203802462	EUR	1.120.000	0	0	89,9800	1.007.776,00	0,34
3,50 Albanien Republik 23.11.2021-23.11.2031	XS2406936075	EUR	6.600.000	0	0	82,1430	5.421.438,00	1,80
3,624 Romania 26.05.2020-26.05.2030	XS2178857954	EUR	10.100.000	0	0	83,7950	8.463.295,00	2,81
3,675 Mazedonien 03.06.2020-2026	XS2181690665	EUR	800.000	0	0	91,5840	732.672,00	0,24
4,00 Estonia, Republik 12.10.2022-12.10.2032	XS2532370231	EUR	3.000.000	3.500.000	500.000	102,2170	3.066.510,00	1,02
4,019 Comune die Milano 29.06.2005-29.06.2035	XS0223484345	EUR	2.500.000	0	0	97,0000	2.425.000,00	0,81
4,125 Republik Bugarien 23.09.2023-23.09.2029	XS2536817211	EUR	2.000.000	2.000.000	0	98,0590	1.961.180,00	0,65
4,25 Polen, Republik 14.02.2023-14.02.2043	XS2586944147	EUR	1.400.000	1.400.000	0	96,8260	1.355.564,00	0,45

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	BESTAND	KÄUFE	VERKÄUFE	KURS	KURSWERT IN EUR	% - ANTEIL AM FONDS- VERMÖGEN
			28.02.2023 STK./NOM.	ZUGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	ABGÄNGE			
4,50 Republik Bulgarien 27.01.2023-27.01.2033	XS2579483319	EUR	2.200.000	2.200.000	0	97,3590	2.141.898,00	0,71
4,625 Republik Bulgarien 23.09.2022-23.09.2034	XS2536817484	EUR	4.200.000	4.200.000	0	97,8510	4.109.742,00	1,37
4,75 Republic of Srpska 27.04.2021-27.04.2026	XS2332900682	EUR	5.300.000	0	0	94,3360	4.999.808,00	1,66
4,75 Republik Senegal 13.03.2018-13.03.2028	XS1790104530	EUR	6.250.000	0	0	86,1540	5.384.625,00	1,79
	*)							
4,875 Ivory Coast 01.12.2020-30.01.2032	XS2264871828	EUR	750.000	500.000	0	77,5890	581.917,50	0,19
	*)							
5,125 Bank Gospodarstwa Krajow. 22.2.2023-22.2.2033	XS2589727168	EUR	1.700.000	1.700.000	0	100,5860	1.709.962,00	0,57
5,625 PKO Bank Polski S.A. FRN 01.2.2023-01.2.2026	XS2582358789	EUR	2.700.000	2.700.000	0	100,1740	2.704.698,00	0,90
5,75 Italien, Republik 18.03.2002-01.02.2033	IT0003256820	EUR	2.000.000	1.500.000	1.300.000	111,2400	2.224.800,00	0,74
5,875 Ivory Coast 17.10.19-17.10.31	XS2064786754	EUR	9.400.000	500.000	0	84,3200	7.926.080,00	2,64
5,952 Tatra Banka AS 17.02.2023-17.02.2026	SK4000022505	EUR	1.000.000	1.000.000	0	99,2140	992.140,00	0,33
6,625 Romania 27.09.2022-27.09.2029	XS2538441598	EUR	4.800.000	4.800.000	0	102,1400	4.902.720,00	1,63
7,50 BOI Finance BV 16.02.2022-2027	XS2348767083	EUR	3.100.000	0	0	79,8850	2.476.435,00	0,82
							<b>154.969.353,19</b>	<b>51,53</b>
1,14 Central American Bank 09.02.2021-2026	US15238RAG74	USD	4.250.000	0	0	88,6460	3.569.693,95	1,19
10,75 Istanbul Metropolitan 12.04.2022-12.04.2027	XS2468421248	USD	6.000.000	1.000.000	0	97,7510	5.557.191,59	1,85
2,00 Central American Bank 06.05.2020-06.05.2025	XS2158595251	USD	9.650.000	0	0	92,7940	8.484.575,52	2,82
2,375 SK Hynix Inc. 19.01.2021-19.01.2031	USY8085FBD16	USD	2.800.000	0	0	74,0470	1.964.483,61	0,65
2,40 Corp Financiera de Desar 28.09.2020-28.09.2027	USP3R94GAY57	USD	2.500.000	0	0	85,9130	2.035.081,49	0,68
2,50 Korea 19.06.2019-19.06.2029	US50064FAQ72	USD	1.500.000	0	0	89,5890	1.273.294,49	0,42
2,75 Republik Georgien 22.04.2021-22.04.2026	XS2334109423	USD	2.800.000	0	0	91,2430	2.420.697,37	0,80
2,875 Republic of Italy 17.10.2019-2029	US465410BY32	USD	1.000.000	0	0	85,3050	808.271,75	0,27
3,125 Africa Finance Corp. 16.06.2020-2025	XS2189425122	USD	2.000.000	0	2.000.000	92,4460	1.751.866,59	0,58
3,125 Asian Development Bank 26.09.2018-2028	US045167EJ82	USD	6.536.000	0	0	94,0490	5.824.372,41	1,94
3,125 Republic of Colombia 04.06.2020-15.04.2031	US195325DS19	USD	4.700.000	4.700.000	0	73,0189	3.251.741,80	1,08
3,50 Republik Korea 20.09.2018-20.09.2028	US50064FAP99	USD	1.000.000	0	0	94,9070	899.251,47	0,30
3,65 Empresa De Transporte 07.05.2020-07.05.2030	USP37466AR35	USD	4.300.000	0	0	90,1710	3.892.823,19	1,22
3,835 Indian Railway Finance 13.12.17-13.12.27	XS1733877762	USD	4.200.000	0	0	92,5180	3.681.785,11	1,22
4,00 Republik Georgien 17.06.2021-17.06.2028	XS2340149439	USD	2.000.000	0	0	88,5240	1.677.544,06	0,56
4,125 East. & South. Afr. Trd. & Dev. BK 30.06.21-28	XS2356571559	USD	2.400.000	0	0	85,5340	1.945.059,69	0,65
4,125 JSW Hydro Energy Ltd. 18.05.2021-18.05.2031	USY4S71YAA27	USD	2.700.000	0	0	72,9789	1.866.997,81	0,62
	*)							
4,20 Rumo Luxembourg Sarl 22.09.2021-18.01.2032	USL79090AD51	USD	600.000	0	0	80,1660	455.747,58	0,15
4,25 Mexico City Airport Trust 29.09.16-31.10.26	USP6629MAA01	USD	4.695.000	0	0	93,9430	4.179.101,62	1,39
4,375 Africa Finance Corp. 17.04.2019-17.04.2026	XS1983289791	USD	3.400.000	0	0	94,0900	3.031.135,11	1,01
4,50 Coca-Cola Icecek A.S. 20.01.2022-20.01.2029	XS2434515313	USD	2.000.000	0	0	86,6490	1.642.012,51	0,55
4,50 Dominican Republic 30.01.2020-30.01.2030	USP3579ECF27	USD	5.100.000	500.000	0	86,2590	4.168.285,96	1,39
4,50 Republic of Colombia 12.10.2018-15.03.2029	US195325DP79	USD	3.100.000	0	4.000.000	86,2344	2.532.941,44	0,84
4,50 Republik von Bolivien 20.03.2017-20.03.2028	USP37878AC26	USD	6.600.000	0	0	71,9390	4.498.743,60	1,50
	*)							
4,50 10 Renew Power Sub. 14.04.2021-14.07.2028	USY7280PAA13	USD	3.000.000	0	0	83,0040	2.359.408,75	0,78
4,85 Republic of South Africa 27.09.17-27.09.27	US836205AW44	USD	2.700.000	0	0	94,6010	2.420.150,65	0,80
4,85 Republic of South Africa 30.09.2019-2029	US836205BA15	USD	6.300.000	0	0	88,7870	5.299.963,05	1,76
4,875 Dominican Republic 23.9.2020-23.9.2032	USP3579ECH82	USD	2.000.000	2.000.000	0	83,9610	1.591.074,47	0,53
4,875 Eastern & Southern Africa 23.05.2019-2024	XS1827041721	USD	2.300.000	0	0	97,4130	2.122.890,85	0,71
4,875 Klabin Finance SA 19.09.2017-19.09.2027	USL5828LAB55	USD	2.500.000	0	0	96,9380	2.296.238,39	0,76
4,95 Colombia Telecom 17.07.2020-17.07.2030	USP28768AC69	USD	3.000.000	0	0	78,9900	2.245.309,84	0,75
5,00 African Development Bank 27.07.2017-27.07.2027	XS1650033571	USD	3.000.000	0	0	95,5000	2.714.610,57	0,90
5,125 Mongolia Intl. Bond 07.10.2020-07.04.2026	USY6142NAC21	USD	4.200.000	2.000.000	0	91,7500	3.651.222,29	1,21
5,25 Republic of Guatemala 10.08.2022-10.08.2029	USP5015VAP15	USD	3.500.000	0	0	96,1530	3.188.700,97	1,06
5,25 Republic of Namibia 29.10.2015-29.10.2025	XS1311099540	USD	5.900.000	0	600.000	94,6210	5.289.595,41	1,76
5,25 Rumo Luxembourg Sarl 10.07.2020-10.01.2028	USL79090AC78	USD	1.600.000	0	0	91,6710	1.389.744,17	0,46
5,50 Republic of Ecuador FRN 31.08.2020-31.07.2030	XS2214237807	USD	6.000.000	0	0	49,7690	2.829.391,70	0,94
5,625 Honduras Government 24.06.2020-2030	USP5178RAD00	USD	3.300.000	0	0	80,3030	2.510.895,40	0,83
6,00 Natura & Co Lux. Holdings 19.04.2022-19.04.2029	USL6S52VAA02	USD	2.000.000	0	0	83,7540	1.587.151,79	0,53
6,125 Costa Rica, Republik 19.11.2019-19.02.2031	USP3699PGK77	USD	5.900.000	0	0	97,0920	5.427.731,67	1,80
6,25 Honduras Government 19.01.2017-19.01.2027	USP5178RAC27	USD	3.800.000	400.000	0	87,5760	3.153.200,68	1,05
6,25 Invest Energy Res. Ltd. 26.04.2021-26.04.2029	US46143NAB64	USD	2.000.000	0	0	90,6810	1.718.419,56	0,57
6,75 Instituto Costarricense 07.10.2021-07.10.2031	USP56226AV89	USD	3.000.000	0	0	96,1340	2.732.632,18	0,91
6,875 Turk Telekomunikasyon AS 28.02.19-28.02.25	XS1955059420	USD	3.300.000	0	0	94,7890	2.963.840,25	0,99
6,95 Ulker Biskuvi Sanayi AS 30.10.2020-30.10.2025	XS2241387500	USD	2.195.000	0	0	86,0350	1.789.338,88	0,59
7,875 Republic of Uruguay 29.5.03-15.1.2033	US917288BA96	USD	500.000	0	3.000.000	123,2203	583.761,13	0,19
	*)							

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	BESTAND	KÄUFE	VERKÄUFE	KURS	KURSWERT	% - ANTEIL
			28.02.2023 STK./NOM.	ZUGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	ABGÄNGE			
8,625 Republic of Dominican 20.03.2006-20.04.2027	USP3579EAG28 **)	USD	1.600.000	0	0	104,5830	1.585.491,76	0,53
8,75 Mongolia Intl Bond 09.03.17-09.03.24	USY6142NAA64	USD	2.300.000	0	0	100,2330	2.184.346,22	0,73
8,75 Republic of Peru 21.11.2003-21.11.2033	US715638AP79	USD	3.198.000	0	3.600.000	124,0100	3.757.665,15	1,25
9,375 Republic of Panama 31.3.99-01.04.2029	US698299AK07	USD	1.600.000	0	0	120,3023	1.823.798,37	0,61
							<b>140.410.273,87</b>	<b>46,69</b>
<b>Summe amtlicher Handel und organisierte Märkte</b>						<b>EUR</b>	<b>295.379.627,06</b>	<b>98,21</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>295.379.627,06</b>	<b>98,21</b>
<b>Währungskurssicherungsgeschäfte</b>								
<b>Absicherung von Beständen</b>								
<b>Verkauf von Devisen auf Termin</b>								
<b>Offene Position</b>								
DH USD/EUR 14.06.2023		USD	67.700.000,00			1,0640	-935.134,44	-0,31
<b>Geschlossene Position</b>								
DH USD/EUR 14.06.2023		USD	2.800.000,00			1,0738	-14.499,00	0,00
DH USD/EUR 14.06.2023		USD	10.000.000,00			1,0994	164.631,66	0,05
<b>Summe der Währungskurssicherungsgeschäfte</b>						<b>EUR</b>	<b>-785.001,78</b>	<b>-0,26</b>
<b>Bankguthaben</b>								
<b>EUR-Guthaben Kontokorrent</b>								
		EUR	1.459.300,03				1.459.300,03	0,49
<b>Guthaben Kontokorrent in nicht EU-Währungen</b>								
		USD	81.901,84				77.602,65	0,03
<b>Summe der Bankguthaben</b>						<b>EUR</b>	<b>1.536.902,68</b>	<b>0,51</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								
<b>Zinsansprüche aus Kontokorrentguthaben</b>								
		EUR	3.227,54				3.227,54	0,00
		USD	2.636,11				2.497,74	0,00
<b>Zinsansprüche aus Wertpapieren</b>								
		EUR	2.573.338,01				2.573.338,01	0,86
		USD	2.301.472,41				2.180.663,64	0,73
<b>Sollzinsen aus Kontokorrentüberziehungen</b>								
		EUR	-483,17				-483,17	0,00
<b>Verwaltungsgebühren</b>								
		EUR	-116.377,89				-116.377,89	-0,04
<b>Depotgebühren</b>								
		EUR	-9.847,51				-9.847,51	0,00
<b>Depotbankgebühren</b>								
		EUR	-4.583,33				-4.583,33	0,00
<b>Summe sonstige Vermögensgegenstände</b>						<b>EUR</b>	<b>4.628.435,03</b>	<b>1,54</b>
<b>FONDSVERMÖGEN</b>						<b>EUR</b>	<b>300.759.962,99</b>	<b>100,00</b>

Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XFG6	EUR	8,79
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XFG6	STK	448.033,00000
Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XFH4	EUR	90.543,77
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XFH4	STK	2.467,00000
Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XFJ0	EUR	90,35
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XFJ0	STK	474.961,00000
Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000A2UX42	EUR	8,82
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A2UX42	STK	768,00000
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XFK8	EUR	9,45
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XFK8	STK	3.228.678,00000

#### Umrechnungskurse/Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Währung wurden zu den Umrechnungskursen/Devisenkursen per 27.02.2023 in EUR umgerechnet:

Währung	Einheiten	Kurs	
US-Dollar	1 EUR =	1,05540	USD

**HINWEIS:** Für den Fonds wird keine variable Vergütung (Performancegebühr, erfolgsabhängige Vergütung) verrechnet.

#### Bewertungsgrundsätze

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Kapitalanlagefonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der Anteile. Der Gesamtwert des Kapitalanlagefonds ist aufgrund der jeweiligen Kurswerte der zu ihm gehörigen Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Bezugsrechte zuzüglich des Wertes der zum Fonds gehörenden Finanzanlagen, Geldbeträge, Guthaben, Forderungen und sonstigen Rechte abzüglich Verbindlichkeiten, zu ermitteln.

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

- Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird grundsätzlich auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt.
- Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für einen Vermögenswert, welcher an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, der Kurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, wird auf die Kurse zuverlässiger Datenprovider oder alternativ auf Marktpreise gleichartiger Wertpapiere oder andere anerkannte Bewertungsmethoden zurückgegriffen.

Es besteht das Risiko, dass aufgrund von Kursbildungen auf illiquiden Märkten die Bewertungskurse bestimmter Wertpapiere von ihren tatsächlichen Veräußerungspreisen abweichen können (Bewertungsrisiko).

#### Berechnungsmethode des Gesamtrisikos: Commitment Approach

##### Total Return Swaps oder vergleichbare derivative Instrumente

Ein Total Return Swap ist ein Kreditderivat, bei dem die Erträge und Wertschwankungen des zu Grunde liegenden Finanzinstruments (Basiswert oder Referenzaktivum) gegen fest vereinbarte Zinszahlungen getauscht werden.

Im Berichtszeitraum wurden keine Total Return Swaps oder vergleichbare derivative Instrumente eingesetzt.

##### Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrenditeswaps

Der Fonds setzte im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps ein (im Sinne der Verordnung des Europäischen Parlaments und des Rates über die Meldung und Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften, Verordnung (EU) 2015/2365).

Wertpapierleihegeschäfte und Pensionsgeschäfte sind lt. Fondsbestimmungen nicht zulässig, deshalb wurden im Berichtszeitraum keine derartigen Geschäfte eingesetzt.

Für die im Berichtszeitraum etwaig veranlagten OTC-Derivate können Sicherheiten ("Collateral") in Form von Sichteinlagen bzw. Anleihen zwecks Reduzierung des Gegenpartei-Risikos (Ausfallrisiko) bereitgestellt werden.

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung aufscheinen:

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	KÄUFE ZUGÄNGE	VERKÄUFE ABGÄNGE
<b>Amtlicher Handel und organisierte Märkte</b>				
<b>Obligationen</b>				
0,375 Republik Bulgarien 23.09.2020-2030	XS2234571425	EUR	1.800.000	1.800.000
0,95 Buoni Poliennali del Tes 1.11.2021-1.6.2032	IT0005466013	EUR	0	2.500.000
1,50 Hellenic Republic 18.06.2020-2030	GR0124036709	EUR	0	2.000.000
1,50 Kroatien, Republik 17.06.2020-17.06.2031	XS2190201983	EUR	1.000.000	1.000.000
2,00 Romania 28.01.2020-28.01.2032	XS2109812508	EUR	0	1.000.000
2,25 Slowenien, Republik 03.03.2016-03.03.2032	SI0002103602	EUR	2.500.000	2.500.000
3,00 Bulgarien 21.03.2016-21.03.2028	XS1382696398	EUR	0	700.000
0,75 African Development Bank 3.4.2020-3.4.2023	US008281BC08	USD	0	2.000.000
10,75 Republic of Ghana 14.10.2015-2030	XS1297557412	USD	0	4.000.000
2,25 Inter-American Dev. Bank 18.06.2019-18.06.2019	US4581X0DG01	USD	0	1.500.000
2,55 Republik of Chile 27.01.2020-27.01.2032	US168863DN50	USD	0	6.200.000
2,75 Republik of Chile 31.01.2022-31.01.2027	US168863DX33	USD	0	1.100.000
3,00 Bancolombia S.A. 29.01.2020-29.01.2025	US05968LAM46	USD	0	1.400.000
4,75 Corp Financiera de Desar 15.07.2015-2025	USP3R94GAK53	USD	0	800.000
4,95 Republik Paraguay 28.04.2020-28.04.2031	USP75744AJ47**	USD	0	1.500.000
5,00 Arcelik A.S. 03.04.2013-2023	XS0910932788	USD	0	800.000
6,875 Dominican Republic 29.01.2016-29.01.2026	USP3579EBK21	USD	0	1.500.000
8,875 Panama 26.9.97-30.9.2027	US698299AD63	USD	0	5.800.000
<b>Neuemissionen</b>				
<b>Zulassung zum Amtlichen Handel vorgesehen</b>				
<b>Obligationen</b>				
3,625 Slowenien, Republik 11.01.2023-11.03.2033	SI0002104303	EUR	600.000	600.000

\*\*Faktorwertpapier

Graz, im April 2023

Security Kapitalanlage Aktiengesellschaft

Der Vorstand