

Apollo Nachhaltig Global Bond

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht

für das Halbjahr

vom 1. Oktober 2023 bis 31. März 2024

Security Kapitalanlage Aktiengesellschaft, Graz

Burgring 16, A-8010 Graz

+43 316 8071-0; office@securitykag.at; 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

MMag. Paul Swoboda

Vorstand

Mag. Wolfgang Ules (Vorsitzender)

Alfred Kober, MBA

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 Global Bond, Miteigentumsfonds gemäß InvFG
für das Halbjahr vom 1. Oktober 2023 bis 31. März 2024

Sehr geehrte Anteilssinhaber,

die Security Kapitalanlage Aktiengesellschaft legt hiermit den Halbjahresbericht
des Apollo Nachhaltig Global
Bond über die erste Hälfte des Rechnungsjahres 2023 / 2024 vor.

1. Anzahl der umlaufenden Anteile

zu Rechnungsjahresbeginn	11.711
zu Halbjahresende	84.927

2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil (AT0000A13JZ6) betrug	EUR	95.031,11
der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil (AT0000A13JV5) betrug	EUR	9,21
der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil (AT0000A13JW3) betrug	EUR	9,72
der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil (AT0000A1NQV3) betrug	EUR	86,47
der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil (AT0000A1UXN1) betrug	EUR	93,12
der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil (AT0000A2UX26) betrug	EUR	9,14

3. Zusammensetzung des Fondsvermögens

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WHG	BESTAND	KÄUFE	VERKÄUFE	KURS	KURSWERT IN EUR	% ANTEIL AM FV
			31.03.2024	ZUGÄNGE	ABGÄNGE			
			STK./NOM.	IM BERICHTSZEITRAUM				
Amtlicher Handel und organisierte Märkte								
Obligationen								
3.2% MTN Kred Wiederaufbau 2016-11.09.26	AU000KFVHAE5	AUD	6.791.000			97,7920	4.000.635,37	0,84
4.25% MTN FMO-Niederlandse 2014-8.7.25	AU3CB0222354	AUD	1.100.000			99,4520	659.019,28	0,14
4.25% MTN Ldkr Baden-W-Foerd 2014-7.8.25 Unsubord.	AU3CB0223097	AUD	2.000.000		2.500.000	99,6040	1.200.048,19	0,25
3.3% MTN BEI 2017-03.02.28	AU3CB0245884	AUD	3.748.000			96,8880	2.187.567,61	0,46
3.3% MTN BNG 2018-26.04.29	AU3CB0258028	AUD	3.000.000	3.000.000		94,9770	1.716.451,81	0,36
3.35% Nts Eurofima Basel 2018-21.05.29	AU3CB0258598	AUD	2.500.000	2.500.000		94,5850	1.424.472,89	0,30
1.6% Bonds NRW.BANK 2019-31.07.24	AU3CB0265288	AUD	3.000.000			98,9900	1.788.975,90	0,38
1.05% MTN NRW.BANK 2021-31.03.26	AU3CB0279081	AUD	3.775.000			93,5340	2.127.053,31	0,45
1.95% MTN Ldkr Baden-W-Foerd 2022-21.01.27	AU3CB0285880	AUD	11.900.000	4.900.000		93,4660	6.700.273,49	1,41
5.30% MTN CAF 2024-19.02.29	AU3CB0306678	AUD	7.000.000	7.000.000		100,3140	4.230.108,43	0,89
0% Regd.EMTN EBRD 1998-10.2.28 Sr	XS0084124725	AUD	10.300.000			84,3940	5.236.495,18	1,10
							31.271.101,46	6,57
0.75% Zuercher KB 2015-28.10.30 Serie 135	CH0299297280	CHF	8.000.000			96,1000	7.836.102,33	1,65
0.25% Bonds Ct de Geneve 2017-29.11.27 Reg S	CH0387879031	CHF	5.485.000		1.050.000	96,7000	5.406.171,64	1,14
1.75% Obligation Basler KB 2022-21.09.29 Guarant.Series 1	CH1193213076	CHF	6.500.000	2.500.000		102,2000	6.770.971,36	1,42
2.0125% Covered Bonds Nationwide Build 2023-23.01.30 Guarant.Reg S	CH1236363417	CHF	6.000.000			103,4500	6.326.572,21	1,33
1.845% KHFC 2024-01.02.30	CH1314941415	CHF	1.000.000	1.000.000		101,9000	1.038.630,11	0,22
							27.378.447,65	5,75
1.65% Obligation Raif Lbk Oberoest 2016-23.08.46 Serie 97	AT0000A1N9T9	EUR	2.500.000	2.500.000		76,1190	1.902.975,00	0,40
EMTN Erste Grp Bk 2023-16.01.31 Serie 30 Tranche 1	AT0000A32562	EUR	400.000			102,8080	411.232,00	0,09
4% EMTN HYPO NOE 2023-01.02.27	AT0000A32HA3	EUR	1.700.000		400.000	100,4710	1.708.007,00	0,36
5.375% EMTN Slovenska Sporitel 2023-04.10.28	AT0000A377W8	EUR	2.500.000			103,2140	2.580.350,00	0,54
EMTN Erste&Steiermark bk 2024-31.01.29 Fixed/FR	AT0000A39UM6	EUR	400.000	400.000		101,8100	407.240,00	0,09
3.5% EMTN Social Bonds Region Wallonne 2023-15.03.43 Reg S	BE0002923044	EUR	2.100.000	2.100.000		98,7730	2.074.233,00	0,44
3.75% EMTN Social Bonds Commun Francaise 2023-22.06.33	BE0002933142	EUR	4.000.000		2.000.000	104,3610	4.174.440,00	0,88
3.75% EMTN Region Wallonne 2023-22.04.39 Reg S	BE0002956374	EUR	5.200.000	3.000.000		103,2630	5.369.676,00	1,13
3.625% EMTN Flemish Commun.2023-22.06.32 Reg S	BE0002965466	EUR	7.100.000	5.000.000		103,9620	7.381.302,00	1,55
0.01% Obligation Stadt Bochum 2020-18.11.30	DE000A289FM3	EUR	1.200.000			81,6740	980.088,00	0,21
1.95% Anleihe Gemein NRW Kom 2022-24.08.32 Serie 7	DE000A30VKNO	EUR	4.000.000			92,6090	3.704.360,00	0,78
1.375% Mortgage Covered Nts Aareal Bank 2022-01.02.29 Program 6500 Series 243	DE000AAR0330	EUR	4.500.000	4.500.000		91,3420	4.110.390,00	0,86
2.375% Mortgage Covered Nts Aareal Bank 2022-14.09.29 Series 251 Program 6500	DE000AAR0363	EUR	2.500.000	2.500.000		95,4210	2.385.525,00	0,50
0.375% EMTN Berlin Hyp 2021-21.04.31	DE000BHY0SL9	EUR	2.100.000	2.100.000		78,9520	1.657.992,00	0,35
4.875% Bonds Hamb Comm Bank 2023-30.03.27 Serie 2762	DE000HCB0BZ1	EUR	2.500.000	2.500.000		100,8100	2.520.250,00	0,53
0.375% EMTN Ldbk Baden-Wuertt 2021-21.02.31	DE000LB2CW16	EUR	1.500.000	1.000.000		78,9660	1.184.490,00	0,25
0.714% Bonds Comunidad Canarias 2021-31.10.31	ES0000093452	EUR	3.600.000		1.000.000	83,2790	2.998.044,00	0,63
1.75% Bonds Banco Sabadell 2022-30.05.29	ES0413860802	EUR	3.000.000	6.000.000	8.000.000	93,0920	2.792.760,00	0,59
3.375% Mortgage Covered Bonds Cajamar 2023-16.02.28	ES0422714172	EUR	9.000.000	3.600.000	2.000.000	99,7190	8.974.710,00	1,88
3.625% EMTN Act Log Serv 2023-25.05.43 Reg S	FR001400FT11	EUR	7.100.000	7.100.000		100,0730	7.105.183,00	1,49
4% Bonds Ville de Paris 2023-02.11.37	FR001400LQ50	EUR	10.000.000	10.000.000		106,7130	10.671.300,00	2,24
3.2% EMTN Region Ile de FR 2024-25.05.34	FR001400NHX9	EUR	7.000.000	7.000.000		100,5690	7.039.830,00	1,48
3.125% Nts Societ Nat SNCF 2024-25.05.34	FR001400OR98	EUR	1.700.000	1.700.000		100,0400	1.700.680,00	0,36
0,125% Cov Bonds CA Italia 2021-15.03.33 Extendibl until 15.03.34 Gtd 16 1 Reg S	IT0005437733	EUR	11.000.000		2.000.000	76,3010	8.393.110,00	1,76
0.375% Covered Bonds CA Italia 2022-20.01.32 Secured	IT0005481046	EUR	2.300.000			80,8960	1.860.608,00	0,39
4% Buoni del Tesoro Poliennali Green Italia 2022-30.04.35 Unitary	IT0005508590	EUR	12.100.000	9.100.000		103,3150	12.501.115,00	2,63
4% Covered Bonds BP Alto Adige 2023-27.09.28	IT0005565988	EUR	9.100.000	3.500.000		102,6500	9.341.150,00	1,96
3.25% Buoni del Tesoro Poliennali BP Sondrio 24-22.07.29 Reg S	IT0005580276	EUR	2.500.000	2.500.000		99,5340	2.488.350,00	0,52
2.4% Government Bonds Lithuania 2022-15.12.29	LT0000670069	EUR	1.500.000		2.500.000	94,0700	1.411.050,00	0,30
3.75% Government Stock Malta 2023-17.08.33	MT0000013749	EUR	600.000		1.600.000	103,5780	621.468,00	0,13
3.35% Bonds Malta 2024-27.11.29	MT0000013889	EUR	1.300.000	1.300.000		99,3280	1.291.264,00	0,27
5.7% CP Portugal 2010-5.3.2030	PTCFPBOM0001	EUR	2.000.000			111,2370	2.224.740,00	0,47
3% Bonds Rep of Slovenia 2024-10.03.34	SI0002104576	EUR	1.900.000	1.900.000		99,4220	1.889.018,00	0,40
3.5% EMTN Slovenska Sporitel 2022-05.04.28 Secured	SK4000021820	EUR	5.200.000	2.000.000	800.000	100,6420	5.233.384,00	1,10
(0% Min) EMTN Tatra Banka 2023-17.02.26 Fixed/FR	SK4000022505	EUR	1.900.000			100,8130	1.915.447,00	0,40
3.875% Covered Bonds Slovenska Sporitel 2023-30.09.27	SK4000023636	EUR	3.000.000			101,6490	3.049.470,00	0,64
4.383% EMTN Auto Reg Sardinia 2004-20.12.34 Series 1	XS0208374628	EUR	4.000.000			99,5620	2.075.964,03	0,44
4.019% Nts Comune di Milano 2005-29.6.35 Sr	XS0223484345	EUR	3.500.000			99,6460	3.487.610,00	0,73
3.31% Euro-MTN CAF 2013-12.12.28 Series 28 Sr	XS1003743827	EUR	2.000.000			98,2130	1.964.260,00	0,41
0.83% Nts Chile 2019-02.07.31	XS1843433639	EUR	3.500.000			82,3740	2.883.090,00	0,61
0.125% Bonds SID Banka 2019-24.06.26 Guarant.	XS2012087008	EUR	500.000			92,2300	461.150,00	0,10
0.375% EMTN Raiff Bank Int 2019-25.09.26	XS2055627538	EUR	1.800.000			91,8740	1.653.732,00	0,35
0.625% MTN Corp Andina Fomento 2019-20.11.26 Series 85 Tranche 1	XS2081543204	EUR	6.800.000			92,4260	6.284.968,00	1,32
0.555% Bonds Chile 2021-21.01.29 Glob	XS2388560604	EUR	1.400.000			87,4270	1.223.978,00	0,26
(0% - 0.8%) Nts World Bank 2021-07.10.31 Series 101411 Tranche 1 Step Up	XS2392596008	EUR	3.000.000	3.000.000		84,9730	2.549.190,00	0,54
2,25% Cov Nat Build 2022-16.05.37 Guar.Glob Secd 2022-01 Tr 1 Reg S (118937707)	XS2480519656	EUR	4.900.000			90,8490	4.451.601,00	0,93
2.125% EMTN Lithuania 2022-01.06.32 Series 13 Tranche 1 Reg S	XS2487342649	EUR	4.500.000		1.500.000	91,0830	4.098.735,00	0,86
3% Covered EMTN Islandsbanki 2022-20.09.27 Series 2	XS2530443659	EUR	7.000.000		800.000	97,9800	6.858.600,00	1,44
3.125% Cov Bds UniCre Bk Cz Sk 2022-11.10.27 2022-01 Tr 1 Reg S Leg Mat 11.10.28	XS2541314584	EUR	5.000.000			98,8670	4.943.350,00	1,04
Sr Pfd Bonds Raiff Bank Int 2023-26.01.27 Fixed/FR	XS2579606927	EUR	2.000.000			100,9100	2.018.200,00	0,42

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WHG	BESTAND	KÄUFE	VERKÄUFE	KURS	KURSWERT IN EUR	% ANTEIL AM FV
			31.03.2024	ZUGÄNGE	ABGÄNGE			
			STK./NOM.	IM BERICHTSZEITRAUM				
4% EMTN Lbk Hessen-Thuring 2023-04.02.30	XS2582195207	EUR	1.500.000	1.500.000		102,0260	1.530.390,00	0,32
3.875% EMTN Lithuania 2023-14.06.33	XS2604821228	EUR	10.750.000			103,2880	11.103.460,00	2,33
3.375% EMTN Raiff Bank Int 2023-25.09.27	XS2626022656	EUR	5.000.000			100,0330	5.001.650,00	1,05
3.75% Covered Bonds UniCre Bk Cz Sk 2023-20.06.2028	XS2637445276	EUR	6.000.000			101,0400	6.062.400,00	1,27
3.7075% Covered Bonds Bank of New Zealand 2023-28.12.28 Guarant.	XS2638490354	EUR	6.500.000	3.000.000		102,0130	6.630.845,00	1,39
4.375% EMTN Bayerische Ldbk 2023-21.09.28	XS2721113160	EUR	2.000.000	2.000.000		102,5670	2.051.340,00	0,43
4% EMTN DeutschBahnFin 2023-23.11.43	XS2722190795	EUR	7.200.000	7.200.000		107,3250	7.727.400,00	1,62
3.375% EMTN DeutschBahnFin 2024-29.01.38 Guarant.	XS2755487076	EUR	800.000	800.000		99,6740	797.392,00	0,17
3.625% Nts CAF 2024-13.02.30	XS2763029571	EUR	5.100.000	5.100.000		100,3230	5.116.473,00	1,07
3.5% EMTN Lithuania 2024-13.02.34 Series 16 Tranche 1 Reg S	XS2765498717	EUR	1.650.000	1.650.000		99,4900	1.641.585,00	0,34
3.5% Nts Iceland 2024-21.03.34	XS2788435050	EUR	1.800.000	1.800.000		102,1500	1.838.700,00	0,39
4.625% EMTN Islandsbanki 2024-27.03.28 Series 50 Tranche 1	XS2792180197	EUR	1.000.000	1.000.000		99,8870	998.870,00	0,21
							231.510.164,03	48,62
6% EMTN Italy 1998-4.8.28 Series 1	XS0089572316	GBP	1.000.000			103,3880	1.205.437,93	0,25
							1.205.437,93	0,25
2.6% City of Oslo 2015-12.11.25	NO0010752124	NOK	15.000.000			96,7360	1.242.062,91	0,26
2.25% Bonds City of Oslo 2017-07.06.27	NO0010811235	NOK	20.000.000			93,6190	1.602.722,02	0,34
2.17% Covered Bonds Ndea Eiendomskr 2019-22.05.26 Extendible until 22.05.27	NO0010852650	NOK	22.000.000		24.000.000	95,4020	1.796.570,94	0,38
2.05% Bonds City of Oslo 2019-31.10.24	NO0010867575	NOK	40.000.000			98,4140	3.369.621,23	0,71
1.32% Bonds City of Oslo 2020-16.02.28	NO0010907033	NOK	60.000.000			89,3220	4.587.477,00	0,96
							12.598.454,10	2,65
2% Bonds SCBC 2017-17.06.26 Secured Series 147	SE0009383664	SEK	25.000.000		55.000.000	97,3270	2.114.701,03	0,44
0.25% Nts Kommuninv I Sve 2020-26.11.27 Guarant.Series 2279 Tranche 1	XS2259127269	SEK	45.000.000			90,5500	3.541.413,18	0,74
							5.656.114,21	1,18
2.875% EMTN Belgium 2014-18.9.24 Reg S	BE6271706747	USD	3.800.000		3.000.000	98,8010	3.471.188,98	0,73
1% EMTN Belgium 2020-28.05.30 Series 1 Tranche 1 Reg S	BE6322164920	USD	7.708.000	1.408.000		81,4160	5.802.094,38	1,22
2.7% MTN BPCE 2019-01.10.29 Reg S	US05578BAN64	USD	1.500.000	1.500.000		88,7790	1.231.217,64	0,26
4.2% Bonds Brit Columbia 2023-06.07.33 Series BCUSG-13	US11070TAM09	USD	1.200.000	1.200.000		97,2360	1.078.801,78	0,23
Covered Bonds CIBC 2023-07.06.28 Series CBL50 -144A-	US13607GSE51	USD	2.900.000	2.900.000		98,7230	2.646.973,93	0,56
1.14% MTN CABEI 2021-09.02.26 Reg S	US15238RA674	USD	1.000.000			92,8770	858.700,07	0,18
4.95% Bonds Chile 2023-05.01.36	US168863DZ80	USD	3.295.508	700.000		96,9420	2.953.708,73	0,62
0.875% Nts BEI 2020-17.05.30 Glob	US298785JE71	USD	5.000.000	5.000.000		81,7600	3.779.585,80	0,79
3.625% Bonds EIB 2023-15.07.30	US298785JW79	USD	2.000.000			96,3450	1.781.527,37	0,37
2.25% MTN Inter-Am Dev Bk 2019-18.06.29	US4581X0DG01	USD	2.500.000			90,4700	2.091.115,01	0,44
1.125% MTN Inter-Am Dev Bk 2021-13.01.31 Glob	US4581X0DS49	USD	2.000.000	2.000.000		81,4450	1.506.009,62	0,32
0.875% Nts World Bank 2020-14.05.30	US459058JC89	USD	6.352.000	1.352.000		81,6210	4.793.422,63	1,01
2.875% Bonds Italia 2019-17.10.29	US465410BY32	USD	4.900.000			88,8480	4.025.103,55	0,85
1.75% MTN Kred Wiederaufbau 2019-14.09.29 Class B	US500769JD71	USD	2.500.000		1.000.000	87,7820	2.028.984,84	0,43
3.625% Nts Oest Kontrollbk 2022-09.09.27 Glob	US676167CF49	USD	1.500.000			97,3580	1.350.194,16	0,28
1.9% Bonds Prov Quebec 2021-21.04.31 Glob	US748149AR21	USD	1.500.000			84,4100	1.170.626,85	0,25
4.414% Bonds CIBC 2023-08.06.28	USC17988AA17	USD	3.000.000	3.000.000		98,7230	2.738.248,89	0,58
5.6% Nts CDP Finl 2009-25.11.39 Sr Reg S	USC23264AC59	USD	2.400.000	2.400.000		105,5550	2.342.196,75	0,49
1% Nts CDP Finl 2021-26.05.26 Reg S	USC23264AL58	USD	3.000.000		3.000.000	92,3570	2.561.677,14	0,54
1.75% MTN CDP Finl 2022-01.02.27 Reg S	USC23264AN15	USD	1.590.000		3.000.000	92,4330	1.358.806,12	0,29
2.9% Bonds Natl Bk Canada 2022-06.04.27 Series CBL18 Tranche 1 Reg S	USC60191BF63	USD	3.000.000			94,7680	2.628.550,30	0,55
1.25% Nts Ontario Teach 2020-27.09.30 Gtd Reg S	USC69798AG87	USD	15.000.000	4.000.000		81,2770	11.271.773,30	2,37
3.301% Covered Bonds Toronto Dominion Bk 20.04.27 Glob CBL 35 Tranche 1 Reg S	USC8888MTC21	USD	12.000.000			95,8570	10.635.022,19	2,23
5.141% Bonds Toronto Dominion Bk 2023-13.09.28 Reg S	USC8920GAA97	USD	6.300.000	4.000.000		101,4590	5.909.686,58	1,24
5.264% Bonds Nationwide Build 2023-10.11.26 Reg S	USG6398ADD66	USD	490.000	490.000		100,9720	457.436,02	0,10
3.65% Nts METRO 2020-07.05.30 Reg S	USP37466AR35	USD	1.500.000			91,6640	1.271.227,81	0,27
5.125% EMTN Portugal 2014-15.10.24 Reg-S Series 17	XS1085735899	USD	3.251.000		2.000.000	99,8190	3.000.291,87	0,63
2% Bonds CABEI 2020-06.05.25 Reg S	XS2158595251	USD	10.575.000	975.000	2.500.000	96,3580	9.421.096,99	1,98
1% Bonds NWB 2020-28.05.30 Reg S	XS2180643889	USD	3.800.000			81,6970	2.870.271,82	0,60
1.125% Bonds Kommunalbanken A/S 2020-14.06.30 Reg S	XS2189767515	USD	9.000.000	1.500.000	3.700.000	81,9490	6.818.981,14	1,43
1.375% MTN CADES 2021-20.01.31 Glob Series 27 Tranche 1	XS2287909159	USD	12.400.000	2.900.000		82,0930	9.411.549,56	1,98
4% Nts NWB 2023-01.06.28	XS2630112287	USD	8.200.000	3.000.000		98,2780	7.450.809,91	1,56
5% Nts Rep of Slovenia 2023-19.09.33	XS2635185437	USD	15.000.000	8.000.000		100,4410	13.929.502,59	2,93
4.125% Nts Muni Fin 2023-15.12.27 Reg S	XS2635195311	USD	4.000.000	4.000.000		98,8730	3.656.545,86	0,77
							138.302.930,18	29,04
Summe amtlicher Handel und organisierte Märkte							447.922.649,56	94,06
Nicht notierte Wertpapiere								
Obligationen								
3.3% Nts BNG 2018-17.07.28	AU3CB0249928	AUD	4.623.000			95,9700	2.672.706,69	0,56
1.5% MTN BPCE 2021-20.04.26	AU3CB0279503	AUD	1.000.000			93,1140	560.927,71	0,12
1.1% Nts ING Bank (Aust) 2021-19.08.26 Secd	AU3CB0282358	AUD	7.000.000			92,1750	3.886.897,59	0,82
4.5% Nts ING Bank (Aust) 2022-26.05.29 Secd	AU3CB0289551	AUD	9.300.000			97,8450	5.481.677,71	1,15
							12.602.209,70	2,65
0.75% Covered Bonds Kommuninv I Sve 2020-12.05.28 Guarant.Series K2805	SE0015660139	SEK	100.000.000			91,4970	7.952.111,94	1,67
							7.952.111,94	1,67
Summe nicht notierte Wertpapiere							20.554.321,64	4,32
Summe Wertpapiervermögen							468.476.971,20	98,38

BEZEICHNUNG	WP-NR.	WHG	BESTAND 31.03.2024 STK./NOM.	KÄUFE ZUGÄNG IM BERICHTSZEITRAUM	VERKÄUF E	KURS	KURSWERT IN EUR	%-ANTEIL AM FV
Währungskurssicherungsgeschäfte								
Absicherung von Beständen								
Verkauf von Devisen auf Termin								
Offene Position								
DH AUD/EUR 12.06.2024		AUD	-71.000.000			1,6622	69.344,60	0,01
DH CHF/EUR 12.06.2024		CHF	-26.420.000			0,9761	597.679,79	0,13
DH GBP/EUR 01.07.2024		GBP	-950.000			0,8605	-1.377,54	0,00
DH NOK/EUR 03.07.2024		NOK	-145.000.000			11,7062	74.571,06	0,02
DH SEK/EUR 12.06.2024		SEK	-207.000.000			11,5086	482.456,28	0,10
DH USD/EUR 12.06.2024		USD	-150.270.000			1,0849	-1.316.923,78	-0,28
DH USD/EUR 12.06.2024		USD	-12.000.000			1,0849	-22.177,51	0,00
DH SEK/EUR 12.06.2024		SEK	55.000.000			11,5086	-98.199,20	-0,02
DH USD/EUR 12.06.2024		USD	15.800.000			1,0849	113.191,33	0,02
Summe Währungskurssicherungsgeschäfte							-101.434,97	-0,02
Bankguthaben								
EUR-Guthaben Kontokorrent								
		EUR	3.040.472,48				3.040.472,48	0,64
Guthaben Kontokorrent in sonstigen EU-Währungen								
		SEK	127.256,11				11.059,98	0,00
Guthaben Kontokorrent in nicht EU-Währungen								
		AUD	8.310,13				5.006,10	0,00
		CHF	955,77				974,18	0,00
		GBP	8.981,73				10.472,12	0,00
		NOK	3.168,75				271,24	0,00
		USD	97.973,82				90.582,30	0,02
EUR-Guthaben Geldmarkt								
		EUR	-200.000,00				-200.000,00	-0,04
Summe Bankguthaben							2.958.838,40	0,62
Sonstige Vermögensgegenstände								
Zinsansprüche aus Kontokorrentguthaben								
		AUD	3.758,59				2.264,21	0,00
		CHF	742,50				756,80	0,00
		EUR	31.083,24				31.083,24	0,01
		GBP	23,20				27,05	0,00
		NOK	1.143,49				97,88	0,00
		SEK	811,23				70,50	0,00
		USD	9.943,52				9.193,34	0,00
Zinsansprüche aus Wertpapieren								
		AUD	415.743,20				250.447,72	0,05
		CHF	113.342,88				115.526,33	0,02
		EUR	3.306.638,06				3.306.638,06	0,69
		GBP	39.000,00				45.471,50	0,01
		NOK	1.338.487,33				114.571,99	0,02
		SEK	1.086.736,11				94.449,51	0,02
		USD	1.111.910,20				1.028.023,50	0,22
Depotgebühren								
		EUR	-14.597,49				-14.597,49	0,00
Verwaltungsgebühren								
		EUR	-130.651,98				-130.651,98	-0,03
Depotbankgebühren								
		EUR	-6.250,00				-6.250,00	0,00
Summe sonstige Vermögensgegenstände							4.847.122,16	1,02
FONDSVERMÖGEN							476.181.496,79	100,00
Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000A13JZ6					EUR	95.031,11	
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A13JZ6					STK	4.592.00000	
Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000A13JV5					EUR	9,21	
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A13JV5					STK	537.531,00000	
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000A13JW3					EUR	9,72	
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A13JW3					STK	1.626.222,00000	

Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000A1N3V3	EUR	86,47
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1N3V3	STK	170.489,00000
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000A1UXN1	EUR	93,12
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1UXN1	STK	46.092,00000
Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000A2UX26	EUR	9,14
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A2UX26	STK	1,00000

Umrechnungskurse/Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Währung zu den Devisen/Umrechnungskursen per 27.03.2024 in EUR umgerechnet

Währung		Einheit in EUR	Kurs
US Dollar	USD	1 = EUR	1,081600
Britische Pfund	GBP	1 = EUR	0,857680
Schweizer Franken	CHF	1 = EUR	0,981100
Norwegische Krone	NOK	1 = EUR	11,682500
Australische Dollar	AUD	1 = EUR	1,660000
Schwedische Krone	SEK	1 = EUR	11,506000

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG AUFSCHEINEN:

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	KÄUFE ZUGÄNGE	VERKÄUFE ABGÄNGE
Obligationen				
4.2% Nts Prov Quebec 2014-10.3.25	AU3CB0223774	AUD		400.000
0.01% Cov Bonds Bank of New Zealand 2021-15.06.28 Gtd Secd	XS2353483733	EUR		2.000.000
0.25% EMTN Auckland Co 2021-17.11.31	XS2407197545	EUR	2.500.000	10.600.000
0.75% MTN Aareal Bank 2021-18.04.28 Series 314	DE000AAR0322	EUR		2.200.000
0.95% Buoni del Tesoro Poliennali Italia 2021-01.06.32 Reg S	IT0005466013	EUR		4.700.000
0.95% EMTN Cyprus 2022-20.01.32 Reg S	XS2434393968	EUR		700.000
1.723% Bonds Comunidad Madrid 2022-30.04.32	ES0000101012	EUR	1.500.000	2.800.000
2.375% Nts Corp Andina Fomento 2022-13.07.27	XS2495583978	EUR	1.000.000	3.400.000
2.875% Pfandbrief Erste Grp Bk 2024-09.01.31	AT0000A39GD4	EUR	1.800.000	1.800.000
3.125% Hyp-Pfandbrief Oberbank 2024-19.01.32	AT0000A39P66	EUR	1.100.000	1.100.000
3.125% Hyp-Pfandbrief RaiffeisenvSalz 2024-24.01.29	AT0000A39UG8	EUR	1.600.000	1.600.000
3.25% EMTN Social Bonds Region Wallonne 2023-22.06.33 Reg	BE0002922038	EUR		5.000.000
3.5% EMTN UniCredit 2023-31.07.30	IT0005549370	EUR	500.000	6.700.000
3.625% Bonds DeutschBahnFin 2023-18.12.37 Garant.	XS2577042893	EUR		6.100.000
3.625% Obligation Oberoest Landesbk 2023-31.03.28	AT0000A38HF9	EUR	2.600.000	2.600.000
3.714% Covered Bonds KHFC 2023-11.04.27 Secured Series 2023-5 Tranche 1 Reg S	XS2545732484	EUR		9.000.000
3.75% Covered Bonds KEB Hana Bank 2023-04.05.26 Covered	XS2594123585	EUR	2.000.000	8.700.000
4.125% EMTN Cyprus 2023-13.04.33	XS2610236445	EUR		4.000.000
EMTN Ceska Sporitelna 2021-13.09.28 Series 12 Tranche 1 Fixed/FR	AT0000A2STV4	EUR		4.400.000
Nts Ceska Sporitelna 2023-08.03.28 Fixed/Variable Rate	XS2676413235	EUR		800.000
2.35% City of Oslo 2015-4.9.24	NO0010752702	NOK		18.000.000
0.625% EMTN Int-Americ Invnt 2021-10.02.26	XS2297244878	USD		900.000
1.3% Bonds Brit Columbia 2021-29.01.31 Class B Glob	US110709AE21	USD		2.000.000
2.375% Bonds Italia 2019-17.10.24	US465410BX58	USD		3.600.000
3.25% Nts BPCE 2018-11.01.28 -144A-	US05578AAJ79	USD		2.100.000
4.625% Bonds Tokyo Metro Gov 2023-01.06.26	XS2621004642	USD		7.000.000
4.75% Nts METRO 2014-4.2.24 Sr Reg S	USP37466AJ19	USD		3.200.000

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, von der Depotbank zu ermitteln.

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

- a) 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.

- b) 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.

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 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.

Informationen zur allfälligen Verrechnung einer variablen Vergütung (Performancegebühr, erfolgsabhängige Vergütung) sind im Rechenschaftsbericht des Fonds, unter 2.3, ersichtlich. Der gegenständliche Fonds verrechnet keine Performancefee.

Graz, im Mai 2024

Security Kapitalanlage Aktiengesellschaft

Der Vorstand