



APOLLO NACHHALTIG NEW WORLD

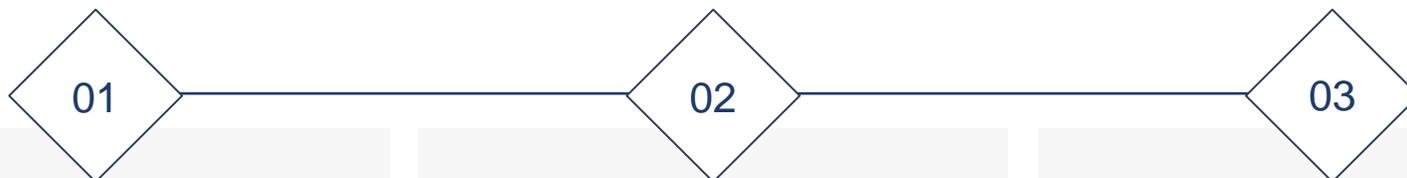
Strategie | Eckdaten & Portfoliodetails

APOLLO NACHHALTIG NEW WORLD

Bausteine im Überblick



APOLLO NACHHALTIG NEW WORLD



Strategie

Einsatz FIXIS-Emerging Markets Strategie

Maximierung der Ertragserwartung, frei von Marktprognosen, unter Berücksichtigung der Kosten und Ausfallwahrscheinlichkeiten durch Anwendung innovativer quantitativer Methoden

Systematische Optimierung durch Auswertung der jeweiligen Zins- und Spreadkurvenform

Ertragserwartung p.a.: 5,28%

Portfolio

Systematische Diversifizierung

Breite Emittentenstreuung, fixe Emittentengewichtung basierend auf Ausfallwahrscheinlichkeiten

Fokus auf Hard-Currency
Schwellenländeranleihen nachhaltiger Emittenten

Duration-Band: 4,5 – 5,5

Volatilität p.a.: 5,37%

Besonderheit

Vollständige ESG-Integration & FX-Exposure

ESG-Ansatz auf
Einzeltitel- und Portfolioebene
Zusammenarbeit mit rfu

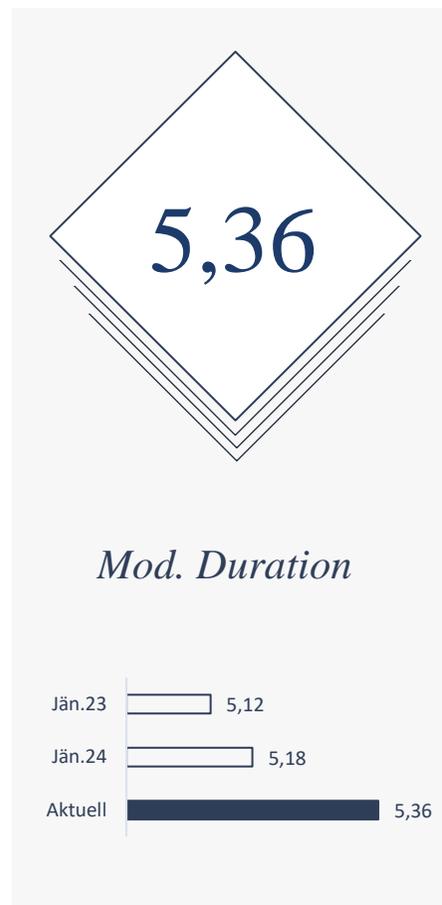
Definierte Teilabsicherung des USD
Währungsrisikos zur Optimierung der
Sharpe-Ratio

EE / Volatilität: 0.98

*Berechnung Volatilität: 5 Jahre Wochendaten
Quelle: Security KAG, 15/03/2024

KENNZAHLEN DES FONDSPORTFOLIOS

Apollo Nachhaltig New World

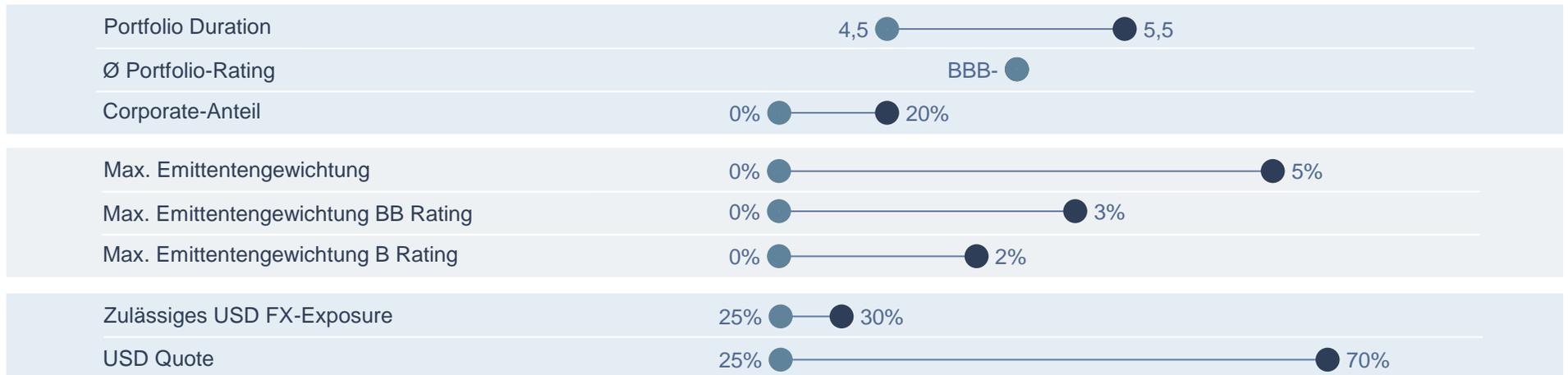


Quelle: Security KAG, 15/03/2024

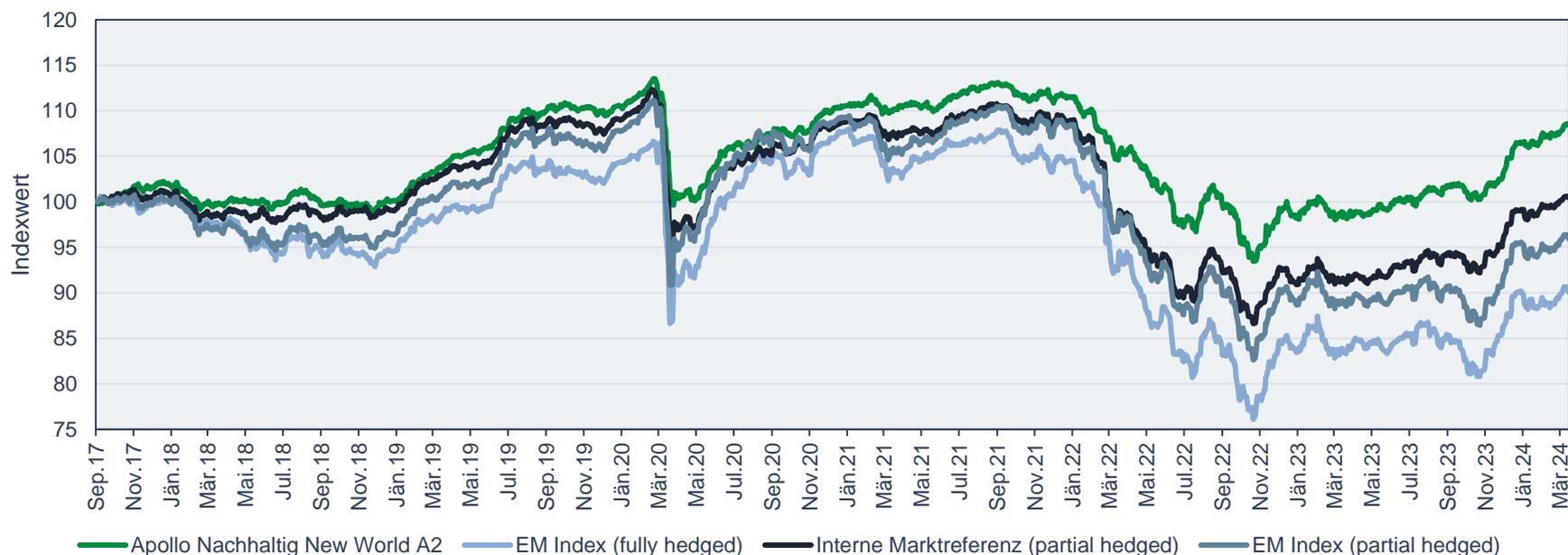
AUFBAU DER INVESTMENTSTRATEGIE

Die Erstellung max. effizienter Portfolios erfordert eine exakte Definition der Investmentstrategie mittels interner Richtlinien [# ~5000].

Asset Allocation	Internes Emerging Markets Regelset
Nachhaltigkeit	ÖGUT Zertifiziert
Gewichtung Emittenten	Systematisiert – auf Ausfallwahrscheinlichkeit basierende Gewichtung
Sonstiges	Einhaltung BMSVG



WERTENTWICKLUNG SEIT FONDSAUFLAGE



	YTD	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017 (seit Sep.)
Apollo Nachhaltig New World	1.87%	8.25%	-11.85%	0.88%	0.03%	10.30%	-1.62%	1.82%
Marktreferenz (partial hedged)	1.29%	9.09%	-16.53%	0.12%	-0.20%	10.06%	-1.71%	0.73%
EM Index (fully hedged)	-0.11%	8.06%	-20.17%	-3.06%	3.39%	10.33%	-5.52%	0.07%
EM Index (partial hedged)	0.39%	7.79%	-18.21%	-0.76%	1.40%	11.80%	-3.63%	-0.02%

Annualisierte Netto Performance, 15/03/2024