

S3

ISIN (A): AT0000664784

ISIN (T): AT0000664792

Halbjahresbericht vom 01.09.2022 – 28.02.2023

Allgemeines zur Macquarie Investment Management Austria Kapitalanlage AG

Die Gesellschaft	Macquarie Investment Management Austria Kapitalanlage AG Kärntner Straße 28, 1010 Wien Tel: 01/ 90400-0; Fax: 01/ 90400-54100
Gründung	11. Oktober 2006 (Konzessionierung als KAG)
Gesellschafter	Unmittelbar: Macquarie Investment Management Holdings (Austria) GmbH Mittelbar: Macquarie Group Limited, Sydney
Aufsichtsrat	John Leonard (Vorsitzender) Mag. Heribert Geistler (Vorsitzender-Stellvertreter) John Pickard (Vorsitzender-Stellvertreter) Dkfm. Reinhard Pinzer Dr. Marie-Agnes Arlt
Vorstand	Mag. Gerhard Aigner Mag. Konrad Kontriner Dr. Rene Kreisl
Prokuristen	Christian Raudner Mag. Stefan Löwenthal Mag. Martin Tschiedel
Staatskommissäre	Ministerialrat Mag. Martin Sailer Mag. Ilse Tantinger
Bankprüfer	PwC Wirtschaftsprüfung GmbH
Prüfer des Fonds	BDO Assurance GmbH Wirtschaftsprüfungs- und Steuerberatungsgesellschaft
Depotbank	Liechtensteinische Landesbank (Österreich) AG

HALBJAHRESBERICHT

des S3 Miteigentumsfonds gemäß InvFG 2011 idgF für das Halbjahr vom
1. September 2022 bis 28. Februar 2023

1. Anzahl der umlaufenden Anteile

zu Rechnungsjahresbeginn 82.262,75160
zu Halbjahresende 69.382,75160

2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil (AT0000664784) betrug EUR 88,25
der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil (AT0000664792) betrug EUR 127,16

3. Zusammensetzung des Fondsvermögens

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	BESTAND 28.02.2023 STK./NOM.	KÄUFE ZUGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	VERKÄUFE ABGÄNGE	KURS	KURSWERT IN EUR	%-ANTEIL AM FONDS- VERMÖGEN
Amtlicher Handel und organisierte Märkte								
Obligationen								
0 Bundesanleihe 02.11.2016-15.07.2023	AT0000A1PE50	EUR	60.000	0	0	98,9430	59.365,80	0,68
0 Bundesobligation 10.07.2020-10.10.2025	DE0001141828	EUR	325.000	0	0	92,8280	301.691,00	3,44
0 Bundesrep. Deutschland 25.01.2019-05.04.2024	DE0001141794	EUR	250.000	0	0	96,6800	241.700,00	2,75
0 Bundesrep. Deutschland 02.02.2018-14.04.2023	DE0001141778	EUR	590.000	0	0	99,7160	588.324,40	6,71
0 BRD 31.01.2020-11.04.2025	DE0001141810	EUR	455.000	0	0	93,9630	427.531,65	4,87
0 Frankreich 20.04.2020-25.02.2026	FR0013508470	EUR	525.000	0	0	91,4370	480.044,25	5,47
0 Frankreich 25.09.2017-25.03.2023	FR0013283686	EUR	925.000	0	0	99,8420	923.538,50	10,53
0 Italien 01.03.2021-01.04.2026	IT0005437147	EUR	360.000	0	0	89,2660	321.357,60	3,66
0 Spanien 20.10.2020-31.01.2026	ES0000012G91	EUR	330.000	0	0	90,9910	300.270,30	3,42
0 Spanien 25.02.2020-31.01.2025	ES0000012F92	EUR	125.000	0	300.000	94,0860	117.607,50	1,34
0,2 Königreich Belgien 06.05.16-22.10.23	BE0000339482	EUR	305.000	0	0	98,1380	299.320,90	3,41
0,25 Niederlande 26.03.15-15.07.2025	NL0011220108	EUR	30.000	0	0	93,7190	28.115,70	0,32
0,35 Bonos Y Oblig del Estado 22.5.2018-30.7.2023	ES0000012B62	EUR	340.000	0	0	98,9240	336.341,60	3,83
0,35 Buoni Poliennali del Tes 01.10.2019-01.02.25	IT0005386245	EUR	465.000	0	0	94,0270	437.225,55	4,98
0,5 Belgien 14.02.17-22.10.24	BE0000342510	EUR	95.000	0	0	95,8840	91.089,80	1,04
0,5 Finnland, Republik 08.03.2016-15.04.2026	FI4000197959	EUR	25.000	0	0	92,7530	23.188,25	0,26
0,5 Italien 01.09.2020-01.02.2026	IT0005419848	EUR	250.000	0	0	91,2390	228.097,50	2,60
0,5 Niederlande 24.03.2016-15.07.2026	NL0011819040	EUR	100.000	0	0	92,2690	92.269,00	1,05
0,6 Italien 16.03.2020-15.06.2023	IT0005405318	EUR	725.000	0	0	99,3630	720.381,75	8,21
0,8 Belgien, Königreich 14.01.2015-22.06.2025	BE0000334434	EUR	50.000	0	0	95,0280	47.514,00	0,54
0,875 Finnland, Republik 01.09.2015-15.09.2025	FI4000167317	EUR	50.000	0	0	94,7890	47.394,50	0,54
1 Belgien Königreich 20.01.2016-22.06.2026	BE0000337460	EUR	100.000	0	0	93,8670	93.867,00	1,07
1 Irish Treasury 14.01.2016-15.05.2026	IE00BV8C9418	EUR	50.000	0	0	94,2580	47.129,00	0,54
1,2 Republic of Austria 23.06.2015-20.10.2025	AT0000A1FAP5	EUR	125.000	0	0	95,5420	119.427,50	1,36
1,65 Bundesanleihe 04.06.2014-15.10.2024	AT0000A185T1	EUR	130.000	0	0	97,6900	126.997,00	1,45
1,75 Buoni Poliennali del Tes 01.04.19-01.07.24	IT0005367492	EUR	350.000	0	0	97,6540	341.789,00	3,90
1,75 Netherlands Government 22.03.2013-15.07.2023	NL0010418810	EUR	325.000	200.000	0	99,5940	323.680,50	3,69
2 Niederlande 28.03.2014-15.07.2024	NL0010733424	EUR	150.000	0	0	98,4910	147.736,50	1,68
2 Republik Finnland 04.02.2014-15.04.2024	FI4000079041	EUR	100.000	0	0	98,7780	98.778,00	1,13
2,75 Bonos Y Oblig del Estado 20.06.14-31.10.2024	ES00000126B2	EUR	385.000	0	0	99,2990	382.301,15	4,36
2,875 Obrigacoes do Tesouro 20.01.2015-15.10.2025	PTOTEKOE0011	EUR	75.000	0	0	99,4790	74.609,25	0,85
2,875 Obrigacoes do Tesouro 21.01.16-21.07.2026	PTOTETOEO012	EUR	50.000	0	0	99,3430	49.671,50	0,57
3,4 Irish Treasury 14.01.2014-18.03.2024	IE00B6X95T99	EUR	105.000	0	0	100,3750	105.393,75	1,20
4,95 Obrigacoes Do Tesouro 10.06.2008-25.10.2023	PTOTEAOEO021	EUR	170.000	0	0	101,1390	171.936,30	1,96
5,4 Ireland Treasury Bonds 13.10.2009-13.03.2025	IE00B4TV0D44	EUR	50.000	0	0	104,6340	52.317,00	0,60
							8.248.003,00	94,01
Summe amtlicher Handel und organisierte Märkte						EUR	8.248.003,00	94,01
Summe Wertpapiervermögen						EUR	8.248.003,00	94,01

Bankguthaben					
EUR-Guthaben Kontokorrent					
	EUR	497.287,25		497.287,25	5,67
Summe der Bankguthaben			EUR	497.287,25	5,67
Sonstige Vermögensgegenstände					
Zinsansprüche aus Kontokorrentguthaben					
	EUR	1.603,81		1.603,81	0,02
Zinsansprüche aus Wertpapieren					
	EUR	27.725,62		27.725,62	0,32
Verwaltungsgebühren					
	EUR	-731,25		-731,25	-0,01
Depotgebühren					
	EUR	-103,11		-103,11	0,00
Depotbankgebühren					
	EUR	-109,69		-109,69	0,00
Summe sonstige Vermögensgegenstände			EUR	28.385,38	0,32
FONDSVERMÖGEN			EUR	8.773.675,63	100,00
Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000664784		EUR	88,25	
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000664784		STK	1.265,00000	
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000664792		EUR	127,16	
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000664792		STK	68.117,75160	

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

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gem. VO (EU) 2015/2365

In den Fondsbestimmungen des Investmentfonds werden Angaben zu unter diese Verordnung fallende Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Pensionsgeschäfte und Wertpapierleihegeschäfte) gemacht, sodass grundsätzlich die Möglichkeit besteht, derartige Geschäfte für den Investmentfonds zu tätigen. Die derzeitige Strategie des Investmentfonds sieht jedoch weder die Durchführung von Pensions- oder Wertpapierleihegeschäften noch den Abschluss von Total Return Swaps (Gesamtrenditeswaps) oder vergleichbaren Derivatgeschäften vor. Mangels Anwendung der vorgenannten Techniken erfolgen daher keine Angaben gem. Art 13 iVm Abschnitt A des Anhangs zu VO (EU) 2015/2365.

Angaben zu Derivaten

Die Verwaltungsgesellschaft ist berechtigt, für Rechnung des Investmentfonds derivative Produkte zur Absicherung zu erwerben. Die derzeitige Strategie des Investmentfonds sieht dies jedoch nicht vor und wird folglich diese Technik nicht angewendet. Somit liegen auch keine berichtspflichtigen Geschäftsfälle gemäß delegierter Verordnung (EU) Nr. 2016/2251 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012, bezüglich Derivate, zum Stichtag vor.

Die Macquarie Investment Management Austria Kapitalanlage AG berücksichtigt den Code of Conduct der österreichischen Investmentfondsindustrie 2012.

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

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	KÄUFE ZUGÄNGE	VERKÄUFE ABGÄNGE
Ausschüttungsäquivalent				
Amtlicher Handel und organisierte Märkte				
Obligationen				
0 Bundesobligation 15.01.2021-10.04.2026	DE0001141836	EUR	0	385.000
0 Frankreich 24.04.2019-25.03.2025	FR0013415627	EUR	0	1.185.000
0,5 Bundesrep. Deutschland 15.01.2016-15.02.2026	DE0001102390	EUR	400.000	400.000
1,85 Republik Italien 28.04.2020-01.07.2025	IT0005408502	EUR	0	300.000

Wien, am 28. März 2023

Macquarie Investment Management Austria Kapitalanlage AG
Der Vorstand