

S3

ISIN (A): AT0000664784

ISIN (T): AT0000664792

Halbjahresbericht vom 01.09.2021 – 28.02.2022

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 www.macquarieinvestmentmanagement.at
Gründung	11. Oktober 2006 (Konzessionierung als KAG)
Gesellschafter	Unmittelbar: Macquarie Investment Management Holdings (Austria) GmbH Mittelbar: Macquarie Group Limited, Sydney
Aufsichtsrat	Megan Aubrey (Vorsitzende) Mag. Heribert Geistler (stellvertretender Vorsitzender) John Leonard (stellvertretender Vorsitzender) 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	PwC Wirtschaftsprüfung GmbH
Depotbank	Liechtensteinische Landesbank (Österreich) AG

HALBJAHRESBERICHT

des S3 Miteigentumsfonds gemäß InvFG 2011 idgF für das Halbjahr vom 1. September 2021 bis 28. Februar 2022

1. Anzahl der umlaufenden Anteile

zu Rechnungsjahresbeginn 82.488
zu Halbjahresende 82.480

2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil (AT0000664784) betrug EUR 92,63
der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil (AT0000664792) betrug EUR 133,47

3. Zusammensetzung des Fondsvermögens

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	BESTAND	KÄUFE	VERKÄUFE	KURS	KURSWERT IN EUR	% - ANTEIL AM FONDS- VERMÖGEN
			28.02.2022 STK./NOM.	ZUGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	ABGÄNGE			
Amtlicher Handel und organisierte Märkte								
Obligationen								
0 Bundesanleihe 02.11.2016-15.07.2023	AT0000A1PE50	EUR	60.000	0	0	100,6580	60.394,80	0,55
0 Bundesobligation 10.07.2020-10.10.2025	DE0001141828	EUR	325.000	0	0	100,6260	327.034,50	2,98
0 Bundesobligation 15.01.2021-10.04.2026	DE0001141836	EUR	385.000	200.000	0	100,4720	386.817,20	3,53
0 Bundesrep. Deutschland 25.01.2019-05.04.2024	DE0001141794	EUR	250.000	0	0	100,8450	252.112,50	2,30
0 Bundesrep. Deutschland 02.02.2018-14.04.2023	DE0001141778	EUR	590.000	0	0	100,6420	593.787,80	5,42
0 BRD 31.01.2020-11.04.2025	DE0001141810	EUR	455.000	0	0	100,7180	458.266,90	4,18
0 Frankreich 20.04.2020-25.02.2026	FR0013508470	EUR	525.000	0	0	99,7140	523.498,50	4,78
0 Frankreich 24.04.2019-25.03.2025	FR0013415627	EUR	1.185.000	0	0	100,2390	1.187.832,15	10,84
0 Frankreich 25.09.2017-25.03.2023	FR0013283686	EUR	925.000	0	0	100,6330	930.855,25	8,50
0 Italien 01.03.2021-01.04.2026	IT0005437147	EUR	360.000	0	0	96,6310	347.871,60	3,17
0 Spanien 20.10.2020-31.01.2026	ES0000012G91	EUR	330.000	0	0	98,4980	325.043,40	2,97
0 Spanien 25.02.2020-31.01.2025	ES0000012F92	EUR	425.000	0	0	99,6020	423.308,50	3,86
0,2 Königreich Belgien 06.05.16-22.10.23	BE0000339482	EUR	305.000	60.000	0	101,0380	308.165,90	2,81
0,25 Niederlande 26.03.15-15.07.2025	NL0011220108	EUR	30.000	0	0	101,1940	30.358,20	0,28
0,35 Bonos Y Oblig del Estado 22.5.2018-30.7.2023	ES0000012B62	EUR	340.000	190.000	0	100,8710	342.961,40	3,13
0,35 Buoni Poliennali del Tes 01.10.2019-01.02.25	IT0005386245	EUR	465.000	0	0	99,6380	463.316,70	4,23
0,5 Belgien 14.02.17-22.10.24	BE0000342510	EUR	95.000	0	0	101,8920	96.797,40	0,88
0,5 Finnland, Republik 08.03.2016-15.04.2026	FI4000197959	EUR	25.000	0	0	101,7800	25.445,00	0,23
0,5 Italien 01.09.2020-01.02.2026	IT0005419848	EUR	250.000	0	0	99,0040	247.510,00	2,26
0,5 Niederlande 24.03.2016-15.07.2026	NL0011819040	EUR	100.000	0	0	102,1250	102.125,00	0,93
0,6 Italien 16.03.2020-15.06.2023	IT0005405318	EUR	375.000	0	0	101,2140	379.552,50	3,46
0,8 Belgien, Königreich 14.01.2015-22.06.2025	BE0000334434	EUR	50.000	0	0	102,9410	51.470,50	0,47
0,875 Finnland, Republik 01.09.2015-15.09.2025	FI4000167317	EUR	50.000	0	0	103,2260	51.613,00	0,47
0,95 Buoni Poliennali Del Tes 15.03.16-15.03.23	IT0005172322	EUR	425.000	0	0	101,3830	430.877,75	3,93
1 Belgien Königreich 20.01.2016-22.06.2026	BE0000337460	EUR	100.000	0	0	103,9650	103.965,00	0,95
1 Irish Treasury 14.01.2016-15.05.2026	IE00B6X95919	EUR	50.000	0	0	103,8730	51.936,50	0,47
1,2 Republic of Austria 23.06.2015-20.10.2025	AT0000A1FAP5	EUR	125.000	0	0	104,5290	130.661,25	1,19
1,65 Bundesanleihe 04.06.2014-15.10.2024	AT0000A185T1	EUR	130.000	0	0	105,0820	136.606,60	1,25
1,75 Buoni Poliennali del Tes 01.04.19-01.07.24	IT0005367492	EUR	350.000	0	0	103,3070	361.574,50	3,30
1,75 Netherlands Government 22.03.2013-15.07.2023	NL0010418810	EUR	125.000	0	0	103,2340	129.042,50	1,18
1,85 Republik Italien 28.04.2020-01.07.2025	IT0005408502	EUR	300.000	0	0	104,0940	312.282,00	2,85
2 Niederlande 28.03.2014-15.07.2024	NL0010733424	EUR	150.000	0	0	105,5000	158.250,00	1,44
2 Republik Finnland 04.02.2014-15.04.2024	FI4000079041	EUR	100.000	30.000	0	105,0720	105.072,00	0,96
2,75 Bonos Y Oblig del Estado 20.06.14-31.10.2024	ES00000126B2	EUR	385.000	0	0	107,2960	413.089,60	3,77
2,875 Obrigaçoos do Tesouro 20.01.2015-15.09.2025	PTOTETOE00011	EUR	75.000	0	0	109,5850	82.188,75	0,75
2,875 Obrigaçoos do Tesouro 21.01.16-21.07.2026	PTOTETOE00012	EUR	50.000	0	0	111,0700	55.535,00	0,51
3,4 Irish Treasury 14.01.2014-18.03.2024	IE00B6X95919	EUR	105.000	55.000	0	107,5850	112.964,25	1,03
4,95 Obrigaçoos Do Tesouro 10.06.2008-25.10.2023	PTOTETOE00021	EUR	170.000	125.000	0	108,7850	184.934,50	1,69
5,4 Ireland Treasury Bonds 13.10.2009-13.03.2025	IE00B4TV0D44	EUR	50.000	0	0	116,6600	58.330,00	0,53
							10.743.448,90	98,05
Summe amtlicher Handel und organisierte Märkte						EUR	10.743.448,90	98,05
Summe Wertpapiervermögen						EUR	10.743.448,90	98,05

Bankguthaben					
EUR-Guthaben Kontokorrent					
	EUR	195.794,82		195.794,82	1,79
Summe der Bankguthaben			EUR	195.794,82	1,79
Sonstige Vermögensgegenstände					
Zinsansprüche aus Wertpapieren					
	EUR	27.832,09		27.832,09	0,25
Spesen Zinsertrag					
	EUR	-161,78		-161,78	0,00
Verwaltungsgebühren					
	EUR	-913,96		-913,96	-0,01
Depotgebühren					
	EUR	-134,46		-134,46	0,00
Depotbankgebühren					
	EUR	-137,09		-137,09	0,00
Rückstellungen für Prüfungskosten und sonstige Gebühren					
	EUR	-8.640,00		-8.640,00	-0,08
Summe sonstige Vermögensgegenstände			EUR	17.844,80	0,16
FONDSVERMÖGEN				EUR	10.957.088,52
Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000664784		EUR	92,63	
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000664784		STK	1.265,00000	
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000664792		EUR	133,47	
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000664792		STK	81.215,86810	

Anteilswertermittlung und Wertpapierbewertung

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Investmentfonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der Anteile. Der Gesamtwert des Investmentfonds 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, welcher bei der letzten Preisberechnung vor dem Stichtag verwendet wurde.
- 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.

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

Berechnung des Gesamtrisikos

Die Berechnung des Gesamtrisikos erfolgt nach dem 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 Irish Treasury 11.10.2017-18.10.2022	IE00BDHDPQ37	EUR	0	55.000
0,45 Spanien 10.10.2017-31.10.2022	ES0000012A97	EUR	0	190.000
1,625 Finnland, Republik 04.09.2012-15.09.2022	FI4000047089	EUR	0	30.000
2,2 Obrigacoes do Tesouro 09.09.2015-17.10.2022	PTOTESOE0013	EUR	0	125.000
4,25 Belgien Kingdom 24.01.2012-28.09.2022	BE0000325341	EUR	0	60.000

Wien, am 12. April 2022
Macquarie Investment Management Austria Kapitalanlage AG
Der Vorstand