

S3

ISIN (A): AT0000664784

ISIN (T): AT0000664792

Halbjahresbericht vom 01.09.2023 – 29.02.2024

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 (bis 14.12.2023) Mag. Stefan Löwenthal (ab 15.12.2023) Dr. Rene Kreisl
Prokuristen	Christian Raudner Mag. Stefan Löwenthal (bis 14.12.2023) Mag. Jürgen Wurzer (ab 15.12.2023) Mag. Martin Tschiedel
Staatskommissäre	Ministerialrat Mag. Martin Sailer Mag. Ilse Tantinger (Stellvertreterin, bis 30.11.2023) Mag. Elisabeth Klaus (Stellvertreterin, ab 1.3.2024)
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 2023 bis 29. Februar 2024

1. Anzahl der umlaufenden Anteile

zu Rechnungsjahresbeginn 61,270.24450
zu Halbjahresende 55,794.24450

2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil (AT0000664784) betrug EUR 90,84
der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil (AT0000664792) betrug EUR 130,89

3. Zusammensetzung des Fondsvermögens

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WHG	BESTAND 29.02.2024 STK./NOM.	KÄUFE ZUGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	VERKÄUFE ABGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	%-ANTEIL AM FV
Amthlicher Handel und organisierte Märkte								
Obligationen								
1.65% Oesterreich 2014-21.10.24 -144A-	AT0000A185T1	EUR	130,000	0	0	98.8070	128,449.10	1.77
0.8% Obligations Lineaires Belgium 2015-22.6.25 OLO 74 Unitary	BE0000334434	EUR	200,000	100,000	0	96.8410	193,682.00	2.67
1% Obligations Lineaires Belgium 2016-22.06.26 OLO 77 Unitary	BE0000337460	EUR	150,000	0	0	95.7320	143,598.00	1.98
0.5% Obligations Lineaires Belgium 2017-22.10.24 OLO 82 Unitary	BE0000342510	EUR	95,000	0	0	98.0400	93,138.00	1.28
1% Bundesobl DE 2014-15.8.24	DE0001102366	EUR	150,000	0	0	98.7980	148,197.00	2.04
0% Bundesobl DE 2019-05.04.24 Serie 179	DE0001141794	EUR	190,000	0	60,000	99.6400	189,316.00	2.61
0% Bundesobligation DE 2020-11.04.25 Serie 181	DE0001141810	EUR	455,000	0	0	96.4450	438,824.75	6.05
0% Bundesobligation DE 2020-10.10.25 Serie 182	DE0001141828	EUR	275,000	0	0	95.3140	262,113.50	3.61
0% Bubills DE 2023-15.05.24	DE000BU0E055	EUR	950,000	0	0	99.2290	942,675.50	13.00
0% Bubills DE 2023-17.07.24	DE000BU0E071	EUR	500,000	0	0	98.6030	493,015.00	6.80
2.75% Spain 2014-31.10.24	ES00000126B2	EUR	385,000	0	0	99.3820	382,620.70	5.28
0% Nts Spain 2020-31.01.25	ES0000012F92	EUR	325,000	0	0	96.8630	314,804.75	4.34
0% Treasury Bonds Spain 2020-31.01.26	ES0000012G91	EUR	330,000	0	0	94.2540	311,038.20	4.29
2% Finland 2014-15.04.24 Unitary 144A/Reg S	FI4000079041	EUR	100,000	0	0	99.7770	99,777.00	1.38
0.875% Finland 2015-15.9.25	FI4000167317	EUR	200,000	100,000	0	96.6760	193,352.00	2.67
0% Treasury Nts French Republic 2019-25.03.25	FR0013415627	EUR	400,000	0	0	96.4660	385,864.00	5.32
0% Fungible Treasury Nts French Republic 2020-25.02.26 Reg S	FR0013508470	EUR	525,000	0	0	94.3210	495,185.25	6.83
1.75% Buoni del Tesoro Poliennali Italia 2019-01.07.24 Reg S	IT0005367492	EUR	350,000	0	0	99.3030	347,560.50	4.79
0.35% Buoni del Tesoro Poliennali Italia 2019-01.02.25 Reg S	IT0005386245	EUR	465,000	0	0	97.1220	451,617.30	6.23
0.5% Buoni del Tesoro Poliennali Italia 2020-01.02.26 Reg S	IT0005419848	EUR	350,000	100,000	0	94.8370	331,929.50	4.58
0% Buoni del tesoro poliennali Italia 2021-01.04.26 Reg S	IT0005437147	EUR	560,000	100,000	0	93.4610	523,381.60	7.22
2% Netherlands 2014-15.7.24	NL0010733424	EUR	150,000	0	0	99.3700	149,055.00	2.06
0.25% Netherlands 2015-15.07.25 Unitary 144A/Reg S	NL0011220108	EUR	200,000	100,000	0	96.1500	192,300.00	2.65
							7,211,494.65	99.44
Summe amtlicher Handel und organisierte Märkte							7,211,494.65	99.44
Summe Wertpapiervermögen							7,211,494.65	99.44

Bankguthaben					
EUR-Guthaben Kontokorrent		EUR	28,181.03	28,181.03	0.39
Summe Bankguthaben				28,181.03	0.39
Sonstige Vermögensgegenstände					
Zinsansprüche aus Kontokorrentguthaben		EUR	180.04	180.04	0.00
Zinsansprüche aus Wertpapieren		EUR	13,372.24	13,372.24	0.18
Depotgebühren		EUR	-90.31	-90.31	0.00
Verwaltungsgebühren		EUR	-604.37	-604.37	-0.01
Depotbankgebühren		EUR	-90.66	-90.66	0.00
Summe sonstige Vermögensgegenstände				12,766.94	0.17
FONDSVERMÖGEN				7,252,442.62	100.00
Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000664784	EUR	90.84		
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000664784	STK	1,263.00000		
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000664792	EUR	130.89		
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000664792	STK	54,531.24450		

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.

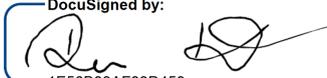
WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG AUFSCHEINEN:

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WHG	KÄUFE ZUGÄNGE	VERKÄUFE ABGÄNGE
Obligation				
0.2% Obligations Lineaires Belgium 2016-22.10.23 OLO 79 Unitary	BE0000339482	EUR	0	205,000
0% Treasury Bills Republiq Francaise 2022-29.11.23	FR0127462911	EUR	0	500,000
3.4% Treasury Bond Ireland 2014-18.3.24	IE00B6X95T99	EUR	0	105,000
4.95% Portugal 2008-25.10.23	PTOTEAOE0021	EUR	0	170,000
5.4% Treasury Bond Ireland 2009-13.3.25	IE00B4TV0D44	EUR	0	50,000

Wien, am 22 April 2024
Macquarie Investment Management Austria Kapitalanlage AG
Der Vorstand

DocuSigned by:

E6646D703394431...

DocuSigned by:

1E56B83AF83D459...

DocuSigned by:

42E34D7579FF419...