

S3

ISIN (A): AT0000664784

ISIN (T): AT0000664792

Halbjahresbericht vom 01.09.2020 – 28.02.2021

## 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 <a href="http://www.macquarieinvestmentmanagement.at">www.macquarieinvestmentmanagement.at</a>
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) (ab 24.9.2020) Dkfm. Reinhard Pinzer Dr. Marie-Agnes Arlt (ab 24.9.2020)
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 2020 bis 28. Februar 2021

## 1. Anzahl der umlaufenden Anteile

zu Rechnungsjahresbeginn 70.729  
zu Halbjahresende 79.187

## 2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil ( AT0000664784 ) betrug EUR 94,26  
der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil ( AT0000664792 ) betrug EUR 135,81

## 3. Zusammensetzung des Fondsvermögens

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	BESTAND 28.02.2021 STK./NOM.	KÄUFE ZUGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	VERKÄUFE ABGÄNGE	KURS	KURSWERT IN EUR	%-ANTEIL AM FONDS- VERMÖGEN	
<b>Amtlicher Handel und organisierte Märkte</b>									
<b>Obligationen</b>									
0 Bundesanleihe 02.11.2016-15.07.2023	AT0000A1PE50	EUR	60.000	0	0	101,3880	60.832,80	0,57	
0 Bundesobligation 05.07.2019-18.10.2024	DE0001141802	EUR	200.000	0	0	102,3050	204.610,00	1,91	
0 Bundesobligation 10.07.2020-10.10.2025	DE0001141828	EUR	225.000	225.000	0	102,6910	231.054,75	2,16	
0 Bundesrep. Deutschland 25.01.2019-05.04.2024	DE0001141794	EUR	250.000	0	0	102,0380	255.095,00	2,38	
0 Bundesrep. Deutschland 02.02.2018-14.04.2023	DE0001141778	EUR	590.000	300.000	0	101,4290	598.431,10	5,59	
0 BRD Bundesobl 22.07.2016-08.10.2021	DE0001141745	EUR	200.000	0	300.000	100,3690	200.738,00	1,88	
0 BRD 31.01.2020-11.04.2025	DE0001141810	EUR	455.000	0	0	102,5070	466.406,85	4,36	
0 France O.A.T 21.11.2016-25.05.2022	FR0013219177	EUR	500.000	225.000	0	100,7650	503.825,00	4,71	
0 Frankreich 25.03.2017-25.03.2023	FR0013283686	EUR	925.000	100.000	0	101,2380	936.451,50	8,75	
0 Frankreich 25.03.2019-25.03.2025	FR0013415627	EUR	1.160.000	375.000	0	101,9450	1.182.562,00	11,05	
0 Irish Treasury 11.10.2017-18.10.2022	IE00BDHDPQ37	EUR	55.000	0	0	100,9130	55.502,15	0,52	
0 Spanien 25.02.2020-31.01.2025	ES0000012F92	EUR	425.000	275.000	0	101,0080	429.284,00	4,01	
0,05 Bonos Y Oblig del Estado 9.10.2018-31.10.2021	ES0000012C46	EUR	175.000	0	0	100,3870	175.677,25	1,64	
0,2 Königreich Belgien 06.05.16-22.10.23	BE0000339482	EUR	245.000	0	0	102,1320	250.223,40	2,34	
0,25 Niederlande 26.03.15-15.07.2025	NL0011220108	EUR	30.000	30.000	0	103,4210	31.026,30	0,29	
0,35 Bonos Y Oblig del Estado 22.5.2018-30.7.2023	ES0000012B62	EUR	150.000	0	0	101,8070	152.710,50	1,43	
0,35 Buoni Poliennali del Tes 01.10.2019-01.02.25	IT0005386245	EUR	465.000	25.000	0	101,3440	471.249,60	4,40	
0,45 Spanien 10.10.2017-31.10.2022	ES0000012A97	EUR	315.000	0	0	101,5360	319.838,40	2,99	
0,5 Belgien 14.02.17-22.10.24	BE0000342510	EUR	95.000	0	0	103,8290	98.637,55	0,92	
0,5 Italien 01.09.2020-01.02.2026	IT0005419848	EUR	75.000	75.000	0	101,6670	76.250,25	0,71	
0,6 Italien 16.03.2020-15.06.2023	IT0005405318	EUR	375.000	45.000	0	101,8850	382.068,75	3,57	
0,8 Belgien, Königreich 14.01.2015-22.06.2025	BE0000334434	EUR	25.000	25.000	0	105,5960	26.399,00	0,25	
0,875 Finnland, Republik 01.09.2015-15.09.2025	FI4000167317	EUR	50.000	50.000	0	106,2630	53.131,50	0,50	
0,95 Buoni Poliennali del Tes 15.03.16-15.03.23	IT0005172322	EUR	550.000	45.000	0	102,4320	563.376,00	5,26	
1 Buoni Poliennali del Tes 15.03.19-15.07.22	IT0005366007	EUR	300.000	0	0	101,8090	305.427,00	2,85	
1,2 Republic of Austria 23.06.2015-20.10.2025	AT0000A1FAP5	EUR	75.000	75.000	0	107,8230	80.867,25	0,76	
1,625 Finnland, Republik 04.09.2012-15.09.2022	FI4000047089	EUR	30.000	0	0	103,5380	31.061,40	0,29	
1,65 Bundesanleihe 04.06.2014-15.10.2024	AT0000A185T1	EUR	130.000	0	0	108,0450	140.458,50	1,31	
1,75 Buoni Poliennali del Tes 01.04.19-01.07.24	IT0005367492	EUR	350.000	70.000	0	106,0440	371.154,00	3,47	
1,75 Netherlands Government 22.03.2013-15.07.2023	NL0010418810	EUR	125.000	0	0	105,7230	132.153,75	1,23	
1,85 Republik Italien 28.04.2020-01.07.2025	IT0005408502	EUR	300.000	250.000	0	107,6390	322.917,00	3,02	
2 Niederlande 28.03.2014-15.07.2024	NL0010733424	EUR	150.000	0	0	108,8550	163.282,50	1,53	
2 Republik Finnland 04.02.2014-15.04.2024	FI4000079041	EUR	70.000	0	0	108,1920	75.734,40	0,71	
2,2 Obrigacoes do Tesouro 09.09.2015-17.10.2022	PTOTESOE0013	EUR	125.000	0	0	104,6360	130.795,00	1,22	
2,25 Netherlands Gov. 10.02.2012-15.07.2022	NL0010060257	EUR	125.000	0	0	103,9840	129.980,00	1,21	
2,3 Buoni Poliennali del Tes 15.10.2018-15.10.2021	IT0005348443	EUR	200.000	0	600.000	101,6900	203.380,00	1,90	
2,75 Bonos Y Oblig del Estado 20.06.14-31.10.2024	ES00000126B2	EUR	410.000	0	0	111,2290	456.038,90	4,26	
2,875 Obrigacoes do Tesouro 20.01.2015-15.10.2025	PTOTEKOE0011	EUR	75.000	75.000	0	114,4900	85.867,50	0,80	
3,4 Irish Treasury 14.01.2014-18.03.2024	IE00B6X95T99	EUR	50.000	0	0	111,9740	55.987,00	0,52	
4,25 Belgien Kingdom 24.01.2012-28.09.2022	BE0000325341	EUR	60.000	0	0	107,7810	64.668,60	0,60	
4,95 Obrigacoes Do Tesouro 10.06.2008-25.10.2023	PTOTEAOE0021	EUR	45.000	0	0	114,6650	51.599,25	0,48	
5,4 Ireland Treasury Bonds 13.10.2009-13.03.2025	IE00B4TV0D44	EUR	50.000	15.000	0	123,7900	61.895,00	0,58	
							<b>10.588.648,70</b>	<b>98,95</b>	
<b>Summe amtlicher Handel und organisierte Märkte</b>							<b>EUR</b>	<b>10.588.648,70</b>	<b>98,95</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>10.588.648,70</b>	<b>98,95</b>

<b>Bankguthaben</b>					
EUR-Guthaben Kontokorrent		EUR	86.844,67	86.844,67	0,81
<b>Summe der Bankguthaben</b>				<b>EUR 86.844,67</b>	<b>0,81</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>					
Zinsansprüche aus Wertpapieren		EUR	27.171,00	27.171,00	0,25
Spesen Zinsertrag		EUR	-152,02	-152,02	0,00
Verwaltungsgebühren		EUR	-893,26	-893,26	-0,01
Depotgebühren		EUR	-123,09	-123,09	0,00
Depotbankgebühren		EUR	-133,99	-133,99	0,00
<b>Summe sonstige Vermögensgegenstände</b>				<b>EUR 25.868,64</b>	<b>0,24</b>
<b>FONDSVERMÖGEN</b>				<b>EUR 10.701.362,01</b>	<b>100,00</b>
Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000664784	EUR	94,26		
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000664784	STK	1.285,00000		
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000664792	EUR	135,81		
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000664792	STK	77.902,00000		

## 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
<b>Ausschüttungsäquivalent</b>				
<b>Amtlicher Handel und organisierte Märkte</b>				
<b>Obligationen</b>				
3,5 Austria Republic 16.01.2006-15.09.2021	AT0000A001X2	EUR	0	110.000
3,5 Republik Finnland 22.02.2011-15.04.2021	FI4000020961	EUR	0	60.000

Wien, am 9. März 2021  
Macquarie Investment Management Austria Kapitalanlage AG  
Der Vorstand