

# HALBJAHRESBERICHT

Vom 01. April 2023 bis 30. September 2023

für den

## Faktorstrategie Anleihen Global

**Miteigentumsfonds gem. InvFG 2011**

Thesaurierer: ISIN AT0000A1VNZ4 (Retail Tranche)

Thesaurierer: ISIN AT0000A1VNY7 (Institutionelle Tranche)

der

**MASTERINVEST KAPITALANLAGE GMBH**

Landstraßer Hauptstraße 1, Top 27

1030 Wien



## ANGABEN ZUM FAKTORSTRATEGIE ANLEIHEN GLOBAL

<b>ANTEILSGATTUNGEN</b>	Thesaurierer / AT0000A1VNZ4 / Retail Tranche Thesaurierer / AT0000A1VNY7 / Institutionelle Tranche
<b>VERWALTUNGSGESELLSCHAFT</b>	MASTERINVEST Kapitalanlage GmbH, Landstraßer Hauptstraße 1, Top 27, 1030 Wien, Österreich
<b>DEPOTBANK / VERWAHRSTELLE</b>	Hypo Vorarlberg Bank AG, Hypo-Passage 1, 6900 Bregenz, Österreich
<b>FONDSMANAGEMENTGESELLSCHAFT</b>	Hypo Tirol Bank AG, Meraner Straße 8, 6020 Innsbruck, Österreich

Bei dem Fonds handelt es sich gemäß VO (EU) 2019/2088 („Offenlegungsverordnung“) um einen Artikel 6 Fonds.

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

		BEGINN HALBJAHR	ENDE HALBJAHR
<b>FONDSVERMÖGEN IN EUR</b>		65.429.370,10	68.737.831,94
<b>ERRECHNETER WERT JE ANTEIL IN EUR</b>			
Thesaurierer (R)	AT0000A1VNZ4	9,02	9,08
Thesaurierer (I)	AT0000A1VNY7	9.152,67	9.233,03
<b>ANTEILE IM UMLAUF</b>			
Thesaurierer (R)	AT0000A1VNZ4	114.251,0900	115.343,0900
Thesaurierer (I)	AT0000A1VNY7	7.036,0800	7.331,2900

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. September 2023

### EINSCHLIESSLICH VERÄNDERUNGEN IM WERTPAPIERVERMÖGEN VOM 01. April 2023 BIS 30. September 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>66.860.498,19</b>	<b>97,27</b>
<b>Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>66.860.498,19</b>	<b>97,27</b>
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>66.860.498,19</b>	<b>97,27</b>
AIS-Am.USD FL.Rate Corp.Bd ESG Nam.-Ant.U.ETF DR H EUR o.N.	LU1681041031	ANT		144.750,00	-	-	50,91	7.369.106,70	10,72
AIS-Amundi EUR F.R.Corp.Bd ESG Nam.-Ant.U.CITS ETF DR-EUR C oN	LU1681041114	ANT		77.500,00	7.500	-	102,57	7.949.461,75	11,56
iShsIII-EO Govt Bd 3-5yr U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B1FZS681	ANT		46.495,00	1.500	-	156,60	7.281.117,00	10,59
iShsIII-EO Gov.Bd 5-7yr U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B4WXJG34	ANT		70.801,00	1.750	-	138,32	9.793.194,32	14,25
Lyxor IF-Lyx.Sma.Overn.Return Act.Nom.UCITS ETF C EUR o.N.	LU1190417599	ANT		69.500,00	6.500	-	100,28	6.969.460,00	10,14
UBAM-Global High Yield Solut. Inhaber-Ant. IH Cap.EUR o.N.	LU0569863755	ANT		49.000,00	-	-	169,99	8.329.510,00	12,12
Xtr.II Eurozone Gov.Bond 5-7 Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0290357176	ANT		46.275,00	750	-	212,02	9.811.225,50	14,27
iShsII-J.P.M.\$ EM Bond U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B2NPKV68	ANT		38.546,00	3.000	-	81,15	2.954.853,49	4,30
MUL-Lyxor Fed Fds USD C.U. ETF Namens-Anteile Acc o.N.	LU1233598447	ANT		43.000,00	-	-	111,22	4.517.721,52	6,57
SPDR Bl.Em.Mkts Loc.Bd UETF Registered Shares (Dist)o.N.	IE00B4613386	ANT		36.950,00	-	-	54,00	1.884.847,91	2,74
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>66.860.498,19</b>	<b>97,27</b>
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>1.874.575,63</b>	<b>2,73</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>1.874.575,63</b>	<b>2,73</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>									
Hypo Vorarlberg Bank AG		EUR		1.266.583,38		%	100,00	1.266.583,38	1,84
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:</b>									
Hypo Vorarlberg Bank AG		USD		643.620,60		%	100,00	607.992,25	0,88
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>10.392,50</b>	<b>0,02</b>
Zinsansprüche		EUR		10.392,50				10.392,50	0,02
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-7.634,38</b>	<b>-0,01</b>
Verwaltungsvergütung		EUR		-5.968,04				-5.968,04	-0,01
Verwahrstellenvergütung		EUR		-1.110,89				-1.110,89	0,00
Lagerstellenkosten		EUR		-555,45				-555,45	0,00
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>68.737.831,94</b>	<b>100,00</b>
<b>Faktorstrategie Anleihen Global (R)</b>									
Anteilwert							EUR	9,08	
Ausgabepreis							EUR	9,08	
Rücknahmepreis							EUR	9,08	
Anzahl Anteile							STK	115.343,0900	
<b>Faktorstrategie Anleihen Global (I)</b>									
Anteilwert							EUR	9.233,03	
Ausgabepreis							EUR	9.233,03	
Rücknahmepreis							EUR	9.233,03	
Anzahl Anteile							STK	7.331,2900	
<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>									<b>97,27</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>									<b>-</b>

Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. September 2023

### EINSCHLIESSLICH VERÄNDERUNGEN IM WERTPAPIERVERMÖGEN VOM 01. April 2023 BIS 30. September 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
---------------------	------	-------	---	-----------------------	---	-----------------------	------	--------------------	------------------------------

#### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.  
Die Bewertung von Vermögenswerten in wenig liquiden Märkten kann von ihren tatsächlichen Veräußerungspreisen abweichen.  
Die Regeln für die Vermögensbewertung finden Sie für OGAW Fonds im Prospekt (Punkt 1.13.) bzw. für AIF Fonds in den Informationen für Anleger gem. § 21 AIFMG (Punkt 1.12.).

#### Devisenkurse (in Mengennotiz)

USD	(USD)	per 29.09.2023 1,0586000 = 1 EUR (EUR)
-----	-------	---

Es liegen keine berichtspflichtigen Geschäftsfälle gemäß delegierter Verordnung (EU) Nr. 2016/2251 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012, bezüglich OTC-Derivate zum Stichtag vor.

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Pensionsgeschäfte, Wertpapierleihe) und Gesamtrendite-Swaps (Total Return Swaps) im Sinne der Verordnung (EU) 2015/2365 wurden, insoweit sie laut Fondsbestimmungen bei Direktinvestitionen zulässig sind, im Berichtszeitraum nicht eingesetzt. Sofern die Anlagepolitik es gestattet, kann es bei Investitionen in Investmentfonds (Aktien-, Anleihen-, Misch-, Geldmarkt-, Index-, Rohstofffonds usw.) zur Anwendung von derartigen Geschäften kommen.

## WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES GETÄTIGTE KÄUFE UND VERKÄUFE SOWEIT SIE NICHT IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG GENANNT SIND

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Während des Berichtszeitraumes wurden keine Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen getätigt, die nicht in der Vermögensaufstellung genannt sind.

Wien, im November 2023

MASTERINVEST Kapitalanlage GmbH  
Die Geschäftsführung



DI Andreas Müller



Mag. Georg Rixinger