

**Halbjahresbericht  
zum 30. Juni 2023  
für die Schweiz**

**DCP**

Investmentfonds mit Sondervermögenscharakter  
als Umbrellafonds (Fonds commun de placement à compartiments multiples)  
gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010  
über Organismen für gemeinsame Anlagen

R.C.S. Luxembourg K255

Verwaltungsgesellschaft



R.C.S. Luxembourg B 82 112

**Der Herkunftsstaat des Fonds ist Luxemburg.**

**Der Vertreter in der Schweiz ist ACOLIN Fund Services AG, Leutschenbachstraße 50, CH-8050 Zürich.**

**Die Zahlstelle in der Schweiz ist die InCore Bank AG, Fonds/Zahlstellen, Wiesenstraße 17, CH-8952 Schlieren/Zürich.**

**Der Prospekt, die Basisinformationsblätter bzw. die wesentlichen Informationen für den Anleger, die Satzung, die Aufstellung der Käufe und Verkäufe, sowie die Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos beim Vertreter bezogen werden.**

**Die ausländische kollektive Kapitalanlagen betreffenden Publikationen erfolgen in der Schweiz auf der elektronischen Plattform [www.fundpublications.com](http://www.fundpublications.com).**

**Die Ausgabe- und Rücknahmepreise bzw. die Inventarwerte mit dem Hinweis „exklusive Kommissionen“ aller Anteilklassen werden bei jeder Ausgabe und Rücknahme von Anteilen auf der elektronischen Plattform [www.fundpublications.com](http://www.fundpublications.com) publiziert. Die Preise werden täglich veröffentlicht.**

**Für die in der Schweiz und von der Schweiz aus vertriebenen Anteile sind Erfüllungsort und Gerichtsstand am Sitz des Vertreters in der Schweiz begründet.**

**Für einen Teilfonds des Umbrella-Fonds DCP besteht keine Genehmigung zum Vertrieb in oder von der Schweiz.**

**Daher werden keine Informationen in Bezug auf diesen Teilfonds in diesem Halbjahresbericht erwähnt. Anleger werden jedoch auf die Tatsache aufmerksam gemacht, dass bestimmte Informationen im Halbjahresbericht auf konsolidierter Grundlage zum Ausdruck gebracht werden und der Halbjahresbericht infolgedessen auch Informationen über den Teilfonds enthält, welcher nicht zum Vertrieb in der Schweiz zugelassen ist.**

---

Keine Zeichnung darf auf der Grundlage dieses Berichtes entgegengenommen werden. Zeichnungen können nur auf Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes zusammen mit dem Zeichnungsantragsformular, den Basisinformationsblättern, dem letzten Jahresbericht und gegebenenfalls dem letzten Halbjahresbericht, falls Letzterer ein späteres Datum als der Jahresbericht trägt, erfolgen.

---

## Inhaltsverzeichnis

|                                                                                   |           |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-----------|
| <b>Management und Verwaltung.....</b>                                             | <b>1</b>  |
| <b>Allgemeine Informationen .....</b>                                             | <b>3</b>  |
| <b>DCP.....</b>                                                                   | <b>5</b>  |
| <i>Zusammengefasste Vermögensübersicht.....</i>                                   | <i>5</i>  |
| <b>DCP - 4Plus .....</b>                                                          | <b>6</b>  |
| <i>Vermögensübersicht .....</i>                                                   | <i>6</i>  |
| <i>Vermögensaufstellung .....</i>                                                 | <i>7</i>  |
| <i>Ertrags- und Aufwandsrechnung.....</i>                                         | <i>12</i> |
| <b>DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“) .....</b> | <b>13</b> |
| <i>Vermögensübersicht .....</i>                                                   | <i>13</i> |
| <i>Vermögensaufstellung .....</i>                                                 | <i>14</i> |
| <i>Ertrags- und Aufwandsrechnung.....</i>                                         | <i>19</i> |
| <b>Erläuterungen zum Halbjahresbericht (Anhang) .....</b>                         | <b>20</b> |

## **Management und Verwaltung**

**Verwaltungsgesellschaft**

Axxion S.A.  
15, rue de Flaxweiler  
L-6776 GREVENMACHER

Eigenkapital per 31. Dezember 2022  
EUR 4.030.882

**Aufsichtsrat  
der Verwaltungsgesellschaft**

**Vorsitzender**

Martin STÜRNER  
Mitglied des Vorstands  
PEH Wertpapier AG, D-FRANKFURT AM MAIN

**Mitglieder**

Thomas AMEND  
Geschäftsführer  
Trivium S.A., L-GREVENMACHER

Constanze HINTZE  
Geschäftsführerin  
Svea Kuschel + Kolleginnen  
Finanzdienstleistungen für Frauen GmbH, D-MÜNCHEN

Dr. Burkhard WITTEK  
Geschäftsführer  
FORUM Family Office GmbH, D-MÜNCHEN

**Vorstand  
der Verwaltungsgesellschaft**

**Vorsitzender**

Stefan SCHNEIDER

**Mitglieder**

Pierre GIRARDET

Armin CLEMENS

**Abschlussprüfer**

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
2, rue Gerhard Mercator  
B.P. 1443  
L-1014 LUXEMBURG

**Verwahrstelle**

Banque de Luxembourg S.A.  
14, Boulevard Royal  
L-2449 LUXEMBURG

**DCP**  
**Investmentfonds (F.C.P.)**

**Zentralverwaltung /  
Register- und Transferstelle**

navAXX S.A.  
17, rue de Flaxweiler  
L-6776 GREVENMACHER

**Portfolioverwalter**

Diem Client Partner AG  
Limmatquai 50  
CH-8001 ZÜRICH

**Zahlstelle**

Großherzogtum Luxemburg  
  
Banque de Luxembourg S.A.  
14, Boulevard Royal  
L-2449 LUXEMBURG

**Informationsstelle**

Bundesrepublik Deutschland

Fondsinform GmbH  
Rudi-Schillings-Straße 9  
D-54296 TRIER

für den Teilfonds DCP – Hybrid Income  
(ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)

Österreich

Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG  
Am Belvedere 1  
A-1100 WIEN

## **Allgemeine Informationen**

Der Investmentfonds DCP (nachfolgend als „Fonds“ bezeichnet) ist ein nach Luxemburger Recht als Umbrellafonds mit der Möglichkeit der Auflegung verschiedener Teilfonds in der Form eines „Fonds commun de placement à compartiments multiples“ errichtetes Sondervermögen aus Wertpapieren und sonstigen Vermögenswerten. Er unterliegt den Bedingungen gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen und erfüllt die Anforderungen der Richtlinie des Rates der Europäischen Gemeinschaften Nr. 2009/65/EG vom 13. Juli 2009.

Es werden derzeit Anteile der folgenden Teilfonds angeboten:

DCP – 4Plus in CHF  
(im Folgenden „4Plus“ genannt)

DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“) in CHF  
(im Folgenden „Hybrid Income“ genannt)

Mit Wirkung zum 1. Januar 2023 wurde der Teilfonds „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“ in „DCP – Hybrid Income“ umbenannt.

Darüber hinaus wurde mit Wirkung zum 15. April 2023 der Teilfonds DCP – Prämienstrategie Europa (fusioniert) auf Basis der letzten Fondspreisermittlung per 14. April 2023 in den Teilfonds DCP – 4Plus verschmolzen.

Das Umtauschverhältnis der Fusion lautete:

|                                                                    |                                        | Umtauschverhältnis |
|--------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|--------------------|
| DCP – Prämienstrategie Europa R (fusioniert)<br>ISIN: LU1928471090 | in DCP – 4Plus P<br>ISIN: LU1112680704 | 0,805434854        |

Werden weitere Teilfonds hinzugefügt, wird der Verkaufsprospekt entsprechend ergänzt.

Die Verwaltungsgesellschaft kann beschließen, innerhalb eines Teilfonds zwei oder mehrere Anteilklassen vorzusehen. Die Anteilklassen können sich in ihren Merkmalen und Rechten nach Art der Verwendung ihrer Erträge, nach der Gebührenstruktur oder anderen spezifischen Merkmalen und Rechten unterscheiden.

Der Fonds wird von der Axxion S.A. verwaltet.

Die Verwaltungsgesellschaft wurde am 17. Mai 2001 als Aktiengesellschaft unter luxemburgischem Recht für eine unbestimmte Dauer gegründet. Sie hat ihren Sitz in Grevenmacher. Die Satzung der Verwaltungsgesellschaft ist im „Mémorial C, Recueil des Sociétés et Associations“ vom 15. Juni 2001 veröffentlicht und ist beim Handels- und Gesellschaftsregister des Bezirksgerichtes Luxemburg hinterlegt, wo die Verwaltungsgesellschaft unter Registernummer B-82112 eingetragen ist. Eine Änderung der Satzung trat letztmalig mit Wirkung zum 24. Januar 2020 in Kraft. Die Hinterlegung der geänderten Satzung beim Handels- und Gesellschaftsregister von Luxemburg wurde am 18. Februar 2020 im „Registre de Commerce et des Sociétés (RCS)“ veröffentlicht.

Die Rechnungslegung für den Fonds und seine Teilfonds erfolgt in Schweizer Franken (CHF).

Der Nettoinventarwert wird unter Aufsicht der Verwahrstelle von der Verwaltungsgesellschaft oder einem von ihr beauftragten Dritten an jedem Bankarbeitstag in Luxemburg mit Ausnahme des 24. Dezember berechnet („Bewertungstag“), es sei denn, im Anhang zum Verkaufsprospekt des jeweiligen Teilfonds ist eine abweichende Regelung getroffen. Falls dieser Tag kein Luxemburger Bankarbeitstag ist, ist der nächstfolgende Bankarbeitstag in Luxemburg der Bewertungstag.

**DCP  
Investmentfonds (F.C.P.)**

Das Geschäftsjahr des Fonds beginnt grundsätzlich jeweils am 1. Januar und endet am 31. Dezember des gleichen Jahres. Beim ersten Geschäftsjahr handelte es sich um ein überlanges Geschäftsjahr, welches am 31. Dezember 2015 endete.

Der erste geprüfte Jahresbericht wurde zum 31. Dezember 2015 und der erste ungeprüfte Halbjahresbericht wurde zum 30. Juni 2015 erstellt.

Die jeweils gültigen Ausgabe- und Rücknahmepreise der einzelnen Teilfonds sowie alle sonstigen für die Anteilinhaber bestimmten Informationen können jederzeit am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, der Verwahrstelle sowie bei den Zahl-, Informations- und Vertriebsstellen erfragt werden.

Dort sind auch der Verkaufsprospekt mit Verwaltungsreglement und Anhängen in der jeweils aktuellen Fassung sowie die Jahres- und Halbjahresberichte kostenlos erhältlich; die Satzung der Verwaltungsgesellschaft kann an deren Sitz eingesehen werden. Die Basisinformationsblätter können auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft ([www.axxion.lu](http://www.axxion.lu)) heruntergeladen werden.

Ferner wird auf Anfrage eine Papierversion seitens der Verwaltungsgesellschaft, der Vertriebsstellen oder der Informationsstellen zur Verfügung gestellt.

Die Verwaltungsgesellschaft kann bestimmen, dass Ausgabe- und Rücknahmepreis nur auf der Internetseite ([www.axxion.lu](http://www.axxion.lu)) veröffentlicht werden.

Aktuell werden Ausgabe- und Rücknahmepreise auf der Internetseite [www.axxion.lu](http://www.axxion.lu) veröffentlicht. Hier können auch der aktuelle Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter sowie die Jahresberichte und Halbjahresberichte des Fonds zur Verfügung gestellt werden.

Informationen, insbesondere Mitteilungen an die Anleger, werden ebenfalls auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft [www.axxion.lu](http://www.axxion.lu) veröffentlicht. Darüber hinaus werden in gesetzlich vorgeschriebenen Fällen für das Großherzogtum Luxemburg Mitteilungen auch auf der elektronischen Plattform „Luxembourg Business Registers“ ([www.lbr.lu](http://www.lbr.lu)) offengelegt und im „Tageblatt“ sowie, falls erforderlich, in einer weiteren Tageszeitung mit hinreichender Auflage publiziert.

Die jeweils gültigen Ausgabe- und Rücknahmepreise sowie alle sonstigen Informationen werden in den jeweils erforderlichen Medien eines jeden Vertriebslandes veröffentlicht.

**DCP**

**Zusammengefasste Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023**

|                                     | Tageswert<br>in CHF   | % Anteil am<br>Fondsvermögen |
|-------------------------------------|-----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>      | <b>169.179.091,54</b> | <b>100,10</b>                |
| 1. Aktien                           | 20.104.009,00         | 11,90                        |
| Belgien                             | 455.367,74            | 0,27                         |
| Bundesrep. Deutschland              | 1.580.062,38          | 0,94                         |
| Frankreich                          | 493.234,81            | 0,29                         |
| Großbritannien                      | 558.893,65            | 0,33                         |
| Irland                              | 786.477,87            | 0,47                         |
| Italien                             | 481.696,13            | 0,29                         |
| Kaimaninseln                        | 208.793,42            | 0,12                         |
| Niederlande                         | 850.094,04            | 0,50                         |
| Schweiz                             | 908.500,00            | 0,54                         |
| USA                                 | 13.780.888,95         | 8,15                         |
| 2. Anleihen                         | 133.659.402,27        | 79,08                        |
| >= 1 Jahr bis < 3 Jahre             | 4.565.447,26          | 2,70                         |
| >= 3 Jahre bis < 5 Jahre            | 4.442.967,10          | 2,63                         |
| >= 5 Jahre bis < 10 Jahre           | 5.107.977,16          | 3,02                         |
| >= 10 Jahre                         | 119.543.010,75        | 70,73                        |
| 3. Sonstige Beteiligungswertpapiere | 355.550,00            | 0,21                         |
| Schweizer Franken                   | 355.550,00            | 0,21                         |
| 4. Investmentanteile                | 4.391.606,12          | 2,60                         |
| Euro                                | 673.396,03            | 0,40                         |
| Schweizer Franken                   | 1.491.611,21          | 0,88                         |
| US-Dollar                           | 2.226.598,88          | 1,32                         |
| 5. Derivate                         | -2.542.154,06         | -1,50                        |
| 6. Bankguthaben                     | 11.092.110,60         | 6,56                         |
| 7. Sonstige Vermögensgegenstände    | 2.118.567,61          | 1,25                         |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>        | <b>-169.460,35</b>    | <b>-0,10</b>                 |
| <b>III. Fondsvermögen</b>           | <b>169.009.631,19</b> | <b>100,00</b>                |

Wir weisen die Anleger darauf hin, dass diese zusammengefassten Angaben sowohl Angaben zu in der Schweiz zum Vertrieb zugelassenen, als auch zu nicht zugelassenen Teilfonds enthalten

**DCP**  
**Investmentfonds (F.C.P.)**

**DCP - 4Plus**

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023

|                                     | Tageswert<br>in CHF  | % Anteil am<br>Teilfondsvermögen |
|-------------------------------------|----------------------|----------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>      | <b>23.947.190,48</b> | <b>100,23</b>                    |
| 1. Aktien                           | 18.054.199,05        | 75,56                            |
| Belgien                             | 354.175,12           | 1,48                             |
| Bundesrep. Deutschland              | 1.464.509,89         | 6,13                             |
| Frankreich                          | 493.234,81           | 2,06                             |
| Großbritannien                      | 419.170,52           | 1,75                             |
| Irland                              | 786.477,87           | 3,29                             |
| Italien                             | 481.696,13           | 2,02                             |
| Kaimaninseln                        | 111.853,62           | 0,47                             |
| Niederlande                         | 850.094,04           | 3,56                             |
| Schweiz                             | 908.500,00           | 3,80                             |
| USA                                 | 12.184.487,05        | 51,00                            |
| 2. Sonstige Beteiligungswertpapiere | 355.550,00           | 1,49                             |
| Schweizer Franken                   | 355.550,00           | 1,49                             |
| 3. Investmentanteile                | 2.165.007,24         | 9,06                             |
| Euro                                | 673.396,03           | 2,82                             |
| Schweizer Franken                   | 1.491.611,21         | 6,24                             |
| 4. Derivate                         | -2.128.362,21        | -8,91                            |
| 5. Bankguthaben                     | 5.496.510,49         | 23,01                            |
| 6. Sonstige Vermögensgegenstände    | 4.285,91             | 0,02                             |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>        | <b>-53.916,68</b>    | <b>-0,23</b>                     |
| <b>III. Teilfondsvermögen</b>       | <b>23.893.273,80</b> | <b>100,00</b>                    |

# DCP Investmentfonds (F.C.P.)

## DCP - 4Plus

### Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

| Gattungsbezeichnung                                        | ISIN<br>Markt | Verpflichtung | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2023 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs         | Kurswert<br>in CHF   | % des<br>Teilfonds-<br>vermögens |
|------------------------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------|-----------------------|--------------|----------------------|----------------------------------|
| <b>Bestandspositionen</b>                                  |               |               |                                             |                       |                                           |                       | <b>CHF</b>   | <b>20.574.756,29</b> | <b>86,11</b>                     |
| <b>Amtlich gehandelte Wertpapiere</b>                      |               |               |                                             |                       |                                           |                       | <b>CHF</b>   | <b>18.409.749,05</b> | <b>77,05</b>                     |
| <b>Aktien</b>                                              |               |               |                                             |                       |                                           |                       |              |                      |                                  |
| Alcon AG Namens-Aktien SF -,04                             | CH0432492467  |               | STK                                         | 5.000                 | 5.000                                     |                       | CHF 74,1000  | 370.500,00           | 1,55                             |
| Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10                          | CH0038863350  |               | STK                                         | 5.000                 | 5.000                                     | 6.000                 | CHF 107,6000 | 538.000,00           | 2,25                             |
| adidas AG Namens-Aktien o.N.                               | DE000A1EWWW0  |               | STK                                         | 3.000                 |                                           |                       | EUR 177,7800 | 520.646,51           | 2,18                             |
| Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.       | BE0974293251  |               | STK                                         | 7.000                 |                                           |                       | EUR 51,8300  | 354.175,12           | 1,48                             |
| Bayer AG Namens-Aktien o.N.                                | DE000BAY0017  |               | STK                                         | 6.000                 |                                           |                       | EUR 50,6700  | 296.784,32           | 1,24                             |
| Danone S.A. Actions Port. EO-,25                           | FR0000120644  |               | STK                                         | 9.000                 | 3.000                                     |                       | EUR 56,1400  | 493.234,81           | 2,06                             |
| Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.                       | DE0005810055  |               | STK                                         | 1.800                 | 1.800                                     |                       | EUR 169,1000 | 297.135,76           | 1,24                             |
| ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1                               | IT0003128367  |               | STK                                         | 80.000                |                                           |                       | EUR 6,1680   | 481.696,13           | 2,02                             |
| Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.                | DE0005785604  |               | STK                                         | 7.000                 |                                           |                       | EUR 25,3700  | 173.363,36           | 0,73                             |
| Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder EO 0,20      | NL0000009538  |               | STK                                         | 22.982                | 982                                       |                       | EUR 19,8080  | 444.393,04           | 1,86                             |
| Prosus N.V. Registered Shares EO -,05                      | NL0013654783  |               | STK                                         | 2.000                 |                                           | 2.500                 | EUR 67,1100  | 131.025,56           | 0,55                             |
| Unilever PLC Registered Shares LS -,031111                 | GB00B10RZP78  |               | STK                                         | 9.000                 | 3.000                                     |                       | EUR 47,7100  | 419.170,52           | 1,75                             |
| Vitesco Technologies Group AG Namens-Aktien o.N.           | DE000VTS0017  |               | STK                                         | 500                   |                                           |                       | EUR 75,4500  | 36.827,15            | 0,15                             |
| Vonovia SE Namens-Aktien o.N.                              | DE000A1ML7J1  |               | STK                                         | 8.000                 |                                           |                       | EUR 17,8950  | 139.752,79           | 0,58                             |
| AbbVie Inc. Registered Shares DL -,01                      | US00287Y1091  |               | STK                                         | 3.000                 |                                           |                       | USD 134,7300 | 361.608,58           | 1,51                             |
| Adobe Inc. Registered Shares o.N.                          | US00724F1012  |               | STK                                         | 1.000                 |                                           |                       | USD 488,9900 | 437.474,90           | 1,83                             |
| Alibaba Group Holding Ltd. Reg.Shs (sp.ADRs)/8 DL-,000025  | US01609W1027  |               | STK                                         | 1.500                 |                                           |                       | USD 83,3500  | 111.853,62           | 0,47                             |
| Amazon.com Inc. Registered Shares DL -,01                  | US0231351067  |               | STK                                         | 6.800                 |                                           |                       | USD 130,3600 | 793.060,70           | 3,32                             |
| American Electric Power Co.Inc Registered Shares DL 6,50   | US0255371017  |               | STK                                         | 5.000                 | 1.500                                     |                       | USD 84,2000  | 376.647,65           | 1,58                             |
| Apple Inc. Registered Shares o.N.                          | US0378331005  |               | STK                                         | 6.500                 |                                           |                       | USD 193,9700 | 1.127.979,19         | 4,72                             |
| Bank of America Corp. Registered Shares DL 0,01            | US0605051046  |               | STK                                         | 6.000                 |                                           |                       | USD 28,6900  | 154.005,05           | 0,64                             |
| Citigroup Inc. Registered Shares DL -,01                   | US1729674242  |               | STK                                         | 11.000                |                                           |                       | USD 46,0400  | 453.086,55           | 1,90                             |
| Coca-Cola Co., The Registered Shares DL -,25               | US1912161007  |               | STK                                         | 6.000                 | 6.000                                     |                       | USD 60,2200  | 323.254,94           | 1,35                             |
| Colgate-Palmolive Co. Registered Shares DL 1               | US1941621039  |               | STK                                         | 3.500                 | 3.500                                     |                       | USD 77,0400  | 241.233,43           | 1,01                             |
| Danaher Corp. Registered Shares DL -,01                    | US2358511028  |               | STK                                         | 1.000                 | 1.000                                     |                       | USD 240,0000 | 214.716,00           | 0,90                             |
| Eaton Corporation PLC Registered Shares DL -,01            | IE00B8KQ827   |               | STK                                         | 2.400                 |                                           |                       | USD 201,1000 | 431.793,88           | 1,81                             |
| Electronic Arts Inc. Registered Shares DL -,01             | US2855121099  |               | STK                                         | 3.500                 |                                           |                       | USD 129,7000 | 406.126,37           | 1,70                             |
| Hasbro Inc. Registered Shares DL -,50                      | US4180561072  |               | STK                                         | 4.500                 |                                           |                       | USD 64,7700  | 260.759,16           | 1,09                             |
| Honeywell International Inc. Registered Shares DL 1        | US4385161066  |               | STK                                         | 1.200                 | 1.200                                     |                       | USD 207,5000 | 222.767,85           | 0,93                             |
| Intercept Pharmaceuticals Inc. Registered Shares DL -,001  | US45845P1084  |               | STK                                         | 2.100                 |                                           |                       | USD 11,0600  | 20.779,14            | 0,09                             |
| Johnson & Johnson Registered Shares DL 1                   | US4781601046  |               | STK                                         | 3.000                 |                                           |                       | USD 165,5200 | 444.247,40           | 1,86                             |
| JPMorgan Chase & Co. Registered Shares DL 1                | US46625H1005  |               | STK                                         | 4.000                 |                                           |                       | USD 145,4400 | 520.471,58           | 2,18                             |
| Marriott International Inc. Reg. Shares Class A DL -,01    | US5719032022  |               | STK                                         | 300                   |                                           |                       | USD 183,6900 | 49.301,48            | 0,21                             |
| Medtronic PLC Registered Shares DL -,0001                  | IE00BTN1Y115  |               | STK                                         | 4.500                 | 1.500                                     |                       | USD 88,1000  | 354.683,99           | 1,48                             |
| Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625             | US5949181045  |               | STK                                         | 3.000                 | 3.000                                     | 3.500                 | USD 340,5400 | 913.992,33           | 3,82                             |
| Mondelez International Inc. Registered Shares Class A o.N. | US6092071058  |               | STK                                         | 3.000                 | 3.000                                     |                       | USD 72,9400  | 195.767,31           | 0,82                             |
| Newmont Corp. Registered Shares DL 1,60                    | US6516391066  |               | STK                                         | 7.000                 |                                           |                       | USD 42,6600  | 267.160,38           | 1,12                             |
| Nextera Energy Inc. Registered Shares DL -,01              | US65339F1012  |               | STK                                         | 3.300                 | 3.300                                     |                       | USD 74,2000  | 219.064,00           | 0,92                             |
| NXP Semiconductors NV Aandelen aan toonder EO -,20         | NL0009538784  |               | STK                                         | 1.500                 |                                           |                       | USD 204,6800 | 274.675,44           | 1,15                             |
| PepsiCo Inc. Registered Shares DL -,0166                   | US7134481081  |               | STK                                         | 2.000                 | 2.000                                     |                       | USD 185,2200 | 331.414,15           | 1,39                             |
| Pioneer Natural Resources Co. Registered Shares DL -,01    | US7237871071  |               | STK                                         | 2.000                 | 2.000                                     |                       | USD 207,1800 | 370.707,17           | 1,55                             |
| Rockwell Automation Inc. Registered Shares DL 1            | US7739031091  |               | STK                                         | 1.400                 |                                           |                       | USD 329,4500 | 412.639,42           | 1,73                             |
| ServiceNow Inc. Registered Shares DL-,001                  | US81762P1021  |               | STK                                         | 1.000                 |                                           |                       | USD 561,9700 | 502.766,46           | 2,10                             |
| Snap Inc. Registered Shares A DL -,00001                   | US83304A1060  |               | STK                                         | 17.000                |                                           |                       | USD 11,8400  | 180.075,15           | 0,75                             |
| Splunk Inc. Registered Shares DL -,001                     | US8486371045  |               | STK                                         | 5.200                 | 1.200                                     |                       | USD 106,0900 | 493.549,78           | 2,07                             |
| Texas Instruments Inc. Registered Shares DL 1              | US8825081040  |               | STK                                         | 2.000                 | 2.000                                     |                       | USD 180,0200 | 322.109,79           | 1,35                             |
| Thermo Fisher Scientific Inc. Registered Shares DL 1       | US8835561023  |               | STK                                         | 700                   | 200                                       |                       | USD 521,7500 | 326.748,55           | 1,37                             |
| UnitedHealth Group Inc. Registered Shares DL -,01          | US91324P1021  |               | STK                                         | 1.100                 | 1.100                                     |                       | USD 480,6400 | 473.005,03           | 1,98                             |
| V.F. Corp. Registered Shares o.N.                          | US9182041080  |               | STK                                         | 6.000                 |                                           |                       | USD 19,0900  | 102.473,21           | 0,43                             |
| Verizon Communications Inc. Registered Shares DL -,10      | US92343V1044  |               | STK                                         | 14.000                | 4.000                                     |                       | USD 37,1900  | 465.808,47           | 1,95                             |
| Walt Disney Co., The Registered Shares DL -,01             | US2546871060  |               | STK                                         | 2.500                 |                                           |                       | USD 89,2800  | 199.685,88           | 0,84                             |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

# DCP Investmentfonds (F.C.P.)

## DCP - 4Plus

### Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

| Gattungsbezeichnung                                                                     | ISIN<br>Markt | Verpflichtung | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2023 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs     | Kurswert<br>in CHF   | % des<br>Teilfonds-<br>vermögens |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------|-----------------------|----------|----------------------|----------------------------------|
| <b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>                                                 |               |               |                                             |                       |                                           |                       |          |                      |                                  |
| Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.                                              | CH0012032048  |               | STK                                         | 1.300                 |                                           | CHF                   | 273,5000 | 355.550,00           | 1,49                             |
| <b>Investmentanteile</b>                                                                |               |               |                                             |                       |                                           | CHF                   |          | <b>2.165.007,24</b>  | <b>9,06</b>                      |
| <b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>                                                  |               |               |                                             |                       |                                           |                       |          |                      |                                  |
| Swisscanto(LU)MM-Res. CHF Nam.-Anteile FT o.N.                                          | LU0141249424  |               | ANT                                         | 10.619                |                                           | CHF                   | 140,4700 | 1.491.611,21         | 6,24                             |
| BNPP InstiCash-EUR 1D Namens-Anteile I Cap.o.N.                                         | LU00094219127 |               | ANT                                         | 4.963                 |                                           | EUR                   | 138,9828 | 673.396,03           | 2,82                             |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>                                                         |               |               |                                             |                       |                                           | CHF                   |          | <b>20.574.756,29</b> | <b>86,11</b>                     |
| <b>Derivate</b>                                                                         |               |               |                                             |                       |                                           | CHF                   |          | <b>-2.128.362,21</b> | <b>-8,91 <sup>2)</sup></b>       |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) |               |               |                                             |                       |                                           |                       |          |                      |                                  |
| <b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>                                                |               |               |                                             |                       |                                           | CHF                   |          | <b>-1.773.537,09</b> | <b>-7,43</b>                     |
| <b>Wertpapier-Optionsrechte</b>                                                         |               |               |                                             |                       |                                           |                       |          |                      |                                  |
| <b>Optionsrechte auf Aktien</b>                                                         |               |               |                                             |                       |                                           |                       |          |                      |                                  |
| Alcon Inc CALL 64.00 15.09.2023                                                         | EUREX         | -370.500      | STK                                         | -50                   | 50                                        | CHF                   | 10,7400  | -53.700,00           | -0,23                            |
| Nestle SA CALL 110.00 15.09.2023                                                        | EUREX         | -538.000      | STK                                         | -50                   | 50                                        | CHF                   | 1,3200   | -6.600,00            | -0,03                            |
| adidas AG CALL 160.00 15.12.2023                                                        | EUREX         | -546.343      | STK                                         | -30                   | 30                                        | EUR                   | 27,4800  | -80.477,93           | -0,34                            |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV CALL 56.00 15.12.2023                                        | EUREX         | -371.655      | STK                                         | -70                   | 70                                        | EUR                   | 1,6700   | -11.411,78           | -0,05                            |
| ASML Holding NV PUT 600.00 15.12.2023                                                   | EUREX         | -543.331      | STK                                         | -8                    | 8                                         | EUR                   | 24,1300  | -18.844,56           | -0,08                            |
| Bayer AG CALL 60.00 15.09.2023                                                          | EUREX         | -311.432      | STK                                         | -60                   | 60                                        | EUR                   | 0,1700   | -995,72              | 0,00                             |
| Danone SA CALL 56.00 15.09.2023                                                         | EUREX         | -517.578      | STK                                         | -90                   | 90                                        | EUR                   | 1,9200   | -16.868,74           | -0,07                            |
| Deutsche Boerse AG CALL 180.00 15.09.2023                                               | EUREX         | -311.801      | STK                                         | -18                   | 18                                        | EUR                   | 1,6300   | -2.864,17            | -0,01                            |
| Fresenius SE & Co KGaA CALL 28.00 21.07.2023                                            | EUREX         | -181.920      | STK                                         | -70                   | 70                                        | EUR                   | 0,0300   | -205,00              | 0,00                             |
| Heineken NV PUT 92.00 15.12.2023                                                        | EUREX         | -318.371      | STK                                         | -33                   | 33                                        | EUR                   | 3,4000   | -10.952,96           | -0,05                            |
| Merck KGaA PUT 150.00 15.09.2023                                                        | EUREX         | -263.916      | STK                                         | -17                   | 17                                        | EUR                   | 5,8400   | -9.691,71            | -0,04                            |
| Prosus NV CALL 68.00 15.09.2023                                                         | EUREX         | -137.492      | STK                                         | -20                   | 20                                        | EUR                   | 3,8200   | -7.458,17            | -0,03                            |
| Unilever PLC CALL 50.00 15.09.2023                                                      | EUREX         | -439.859      | STK                                         | -90                   | 90                                        | EUR                   | 0,3000   | -2.635,74            | -0,01                            |
| AbbVie Inc CALL 155.00 17.11.2023                                                       | CBOE          | -451.786      | STK                                         | -30                   | 30                                        | USD                   | 0,8700   | -2.335,04            | -0,01                            |
| Adobe Inc CALL 330.00 20.10.2023                                                        | CBOE          | -546.571      | STK                                         | -10                   | 10                                        | USD                   | 165,8250 | -148.355,34          | -0,62                            |
| Agnico Eagle Mines Ltd PUT 50.00 17.11.2023                                             | CBOE          | -369.698      | STK                                         | -50                   | 50                                        | USD                   | 3,8700   | -17.311,48           | -0,07                            |
| Alibaba Group Holding Ltd PUT 80.00 18.08.2023                                          | CBOE          | -232.912      | STK                                         | -25                   | 25                                        | USD                   | 3,2000   | -7.157,20            | -0,03                            |
| Alphabet Inc PUT 120.00 15.12.2023 (Cl. A)                                              | CBOE          | -695.736      | STK                                         | -52                   | 52                                        | USD                   | 7,6000   | -35.356,57           | -0,15                            |
| Amazon.com Inc CALL 105.00 20.10.2023                                                   | CBOE          | -990.832      | STK                                         | -68                   | 68                                        | USD                   | 28,7000  | -174.599,89          | -0,73                            |
| Analog Devices Inc PUT 160.00 15.09.2023                                                | CBOE          | -326.625      | STK                                         | -15                   | 15                                        | USD                   | 0,8800   | -1.180,94            | 0,00                             |
| Apple Inc CALL 130.00 15.12.2023                                                        | CBOE          | -650.433      | STK                                         | -30                   | 30                                        | USD                   | 65,8500  | -176.738,11          | -0,74                            |
| Apple Inc CALL 165.00 15.09.2023                                                        | CBOE          | -758.839      | STK                                         | -35                   | 35                                        | USD                   | 31,1500  | -97.539,22           | -0,41                            |
| Arista Networks Inc PUT 125.00 15.09.2023                                               | CBOE          | -452.859      | STK                                         | -25                   | 25                                        | USD                   | 1,0500   | -2.348,46            | -0,01                            |
| Autodesk Inc PUT 190.00 21.07.2023                                                      | CBOE          | -320.186      | STK                                         | -14                   | 14                                        | USD                   | 0,7600   | -951,91              | 0,00                             |
| Citigroup Inc CALL 47.50 15.09.2023                                                     | CBOE          | -566.076      | STK                                         | -110                  | 110                                       | USD                   | 1,3200   | -12.990,32           | -0,05                            |
| Coca-Cola Co/The CALL 60.00 17.11.2023                                                  | CBOE          | -403.867      | STK                                         | -60                   | 60                                        | USD                   | 2,6700   | -14.332,29           | -0,06                            |
| Colgate-Palmolive Co CALL 75.00 17.11.2023                                              | CBOE          | -301.392      | STK                                         | -35                   | 35                                        | USD                   | 4,7000   | -14.716,99           | -0,06                            |
| Danaher Corp CALL 250.00 15.12.2023                                                     | CBOE          | -268.261      | STK                                         | -10                   | 10                                        | USD                   | 13,0000  | -11.630,45           | -0,05                            |
| Dollar General Corp PUT 145.00 17.11.2023                                               | CBOE          | -322.613      | STK                                         | -17                   | 17                                        | USD                   | 2,5750   | -3.916,33            | -0,02                            |
| Eaton Corp PLC CALL 160.00 21.07.2023                                                   | CBOE          | -539.474      | STK                                         | -24                   | 24                                        | USD                   | 42,1600  | -90.524,27           | -0,38                            |
| Electronic Arts Inc CALL 130.00 15.09.2023                                              | CBOE          | -507.405      | STK                                         | -35                   | 35                                        | USD                   | 5,5000   | -17.222,01           | -0,07                            |
| Gilead Sciences Inc PUT 75.00 17.11.2023                                                | CBOE          | -301.509      | STK                                         | -35                   | 35                                        | USD                   | 2,9400   | -9.205,95            | -0,04                            |
| Hasbro Inc CALL 62.50 21.07.2023                                                        | CBOE          | -325.787      | STK                                         | -45                   | 45                                        | USD                   | 3,2900   | -13.245,29           | -0,06                            |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

# DCP Investmentfonds (F.C.P.)

## DCP - 4Plus

### Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

| Gattungsbezeichnung                                 | ISIN<br>Markt | Verpflichtung  | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2023 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs | Kurswert<br>in CHF | % des<br>Teilfonds-<br>vermögens |       |
|-----------------------------------------------------|---------------|----------------|---------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------|-----------------------|------|--------------------|----------------------------------|-------|
| Honeywell International Inc CALL 210.00 15.09.2023  | CBOE          | -278.321       | STK                                         | -12                   |                                           | 12                    | USD  | 5,7100             | -6.130,14                        | -0,03 |
| JPMorgan Chase & Co CALL 130.00 15.09.2023          | CBOE          | -650.265       | STK                                         | -40                   |                                           | 40                    | USD  | 17,2700            | -61.802,42                       | -0,26 |
| Microsoft Corp CALL 245.00 17.11.2023               | CBOE          | -1.141.921     | STK                                         | -30                   |                                           | 30                    | USD  | 101,7250           | -273.024,81                      | -1,14 |
| Mondelez International Inc CALL 65.00 15.09.2023    | CBOE          | -244.587       | STK                                         | -30                   |                                           | 30                    | USD  | 8,8000             | -23.618,76                       | -0,10 |
| Newmont Corp CALL 57.50 15.09.2023                  | CBOE          | -333.784       | STK                                         | -70                   |                                           | 70                    | USD  | 0,1050             | -657,57                          | 0,00  |
| NextEra Energy Inc CALL 77.50 15.09.2023            | CBOE          | -273.694       | STK                                         | -33                   |                                           | 33                    | USD  | 1,3900             | -4.103,76                        | -0,02 |
| NIKE Inc PUT 115.00 21.07.2023 (Cl. B)              | CBOE          | -271.407       | STK                                         | -22                   |                                           | 22                    | USD  | 5,1000             | -10.037,97                       | -0,04 |
| NXP Semiconductors NV CALL 175.00 21.07.2023        | CBOE          | -343.173       | STK                                         | -15                   |                                           | 15                    | USD  | 30,4000            | -40.796,04                       | -0,17 |
| Pan American Silver Corp PUT 15.00 21.07.2023       | CBOE          | -195.563       | STK                                         | -120                  |                                           | 120                   | USD  | 0,7000             | -7.515,06                        | -0,03 |
| PepsiCo Inc CALL 185.00 20.10.2023                  | CBOE          | -414.061       | STK                                         | -20                   |                                           | 20                    | USD  | 7,0000             | -12.525,10                       | -0,05 |
| Pioneer Natural Resources Co CALL 260.00 15.09.2023 | CBOE          | -463.153       | STK                                         | -20                   |                                           | 20                    | USD  | 0,6250             | -1.118,31                        | 0,00  |
| Rockwell Automation Inc CALL 270.00 21.07.2023      | CBOE          | -515.542       | STK                                         | -14                   |                                           | 14                    | USD  | 60,5000            | -75.776,86                       | -0,32 |
| Salesforce Inc PUT 210.00 17.11.2023                | CBOE          | -354.206       | STK                                         | -15                   |                                           | 15                    | USD  | 12,5000            | -16.774,69                       | -0,07 |
| Schlumberger NV PUT 42.50 18.08.2023                | CBOE          | -247.069       | STK                                         | -45                   |                                           | 45                    | USD  | 0,4100             | -1.650,63                        | -0,01 |
| ServiceNow Inc CALL 440.00 17.11.2023               | CBOE          | -628.145       | STK                                         | -10                   |                                           | 10                    | USD  | 139,4500           | -124.758,94                      | -0,52 |
| Texas Instruments Inc CALL 180.00 21.07.2023        | CBOE          | -402.437       | STK                                         | -20                   |                                           | 20                    | USD  | 3,8000             | -6.799,34                        | -0,03 |
| Thermo Fisher Scientific Inc CALL 590.00 15.12.2023 | CBOE          | -408.232       | STK                                         | -7                    |                                           | 7                     | USD  | 10,1500            | -6.356,49                        | -0,03 |
| UnitedHealth Group Inc CALL 500.00 15.12.2023       | CBOE          | -590.962       | STK                                         | -11                   |                                           | 11                    | USD  | 21,8000            | -21.453,71                       | -0,09 |
| Walt Disney Co/The CALL 100.00 20.10.2023           | CBOE          | -249.483       | STK                                         | -25                   |                                           | 25                    | USD  | 1,9100             | -4.271,95                        | -0,02 |
| Aktienindex-Derivate                                |               |                |                                             |                       |                                           |                       | CHF  | -282.788,84        | -1,18                            |       |
| Aktienindex-Terminkontrakte                         |               |                |                                             |                       |                                           |                       |      |                    |                                  |       |
| EURO STOXX 50 Sep23                                 | EUREX         | -5.407.609,10  | STK                                         | -120                  | 40                                        | 160                   | EUR  | 4.427,0000         | -48.907,62                       | -0,20 |
| S&P500 EMINI FUT Sep23                              | CME           | -13.928.423,41 | STK                                         | -56                   |                                           | 56                    | USD  | 4.488,2500         | -253.789,84                      | -1,06 |
| Optionsrechte                                       |               |                |                                             |                       |                                           |                       |      |                    |                                  |       |
| Optionsrechte auf Aktienindices                     |               |                |                                             |                       |                                           |                       |      |                    |                                  |       |
| DAX Index PUT 15200.00 15.09.2023                   | EUREX         | 2.729.362      | STK                                         | 33                    | 33                                        |                       | EUR  | 123,6000           | 19.908,62                        | 0,08  |
| Sonstige Derivate                                   |               |                |                                             |                       |                                           |                       | CHF  | 31.402,22          | 0,13                             |       |
| Sonstige Optionsrechte                              |               |                |                                             |                       |                                           |                       |      |                    |                                  |       |
| CBOE Volatility Index CALL 25.00 18.10.2023         | CBOE          | 592.422        | STK                                         | 39.000                | 390                                       |                       | USD  | 1,5100             | 52.685,94                        | 0,22  |
| CBOE Volatility Index CALL 40.00 18.10.2023         | CBOE          | -592.422       | STK                                         | -39.000               |                                           | 390                   | USD  | 0,6100             | -21.283,72                       | -0,09 |
| Devisen-Derivate                                    |               |                |                                             |                       |                                           |                       | CHF  | -103.438,50        | -0,43                            |       |
| Devisenterminkontrakte                              |               |                |                                             |                       |                                           |                       |      |                    |                                  |       |
| Offene Positionen                                   |               |                |                                             |                       |                                           |                       |      |                    |                                  |       |
|                                                     |               |                | Kauf-<br>währung                            | Kauf-<br>betrag       | Verkauf-<br>währung                       | Verkauf-<br>betrag    |      | Fälligkeit         |                                  |       |
| Banque de Luxembourg EUR/CHF                        | OTC           |                | CHF                                         | 4.370.908,50          | EUR                                       | -4.500.000,00         |      | 24.11.2023         | 13.405,50                        | 0,06  |
| Banque de Luxembourg USD/CHF                        | OTC           |                | CHF                                         | 10.454.892,00         | USD                                       | -12.000.000,00        |      | 24.11.2023         | -116.844,00                      | -0,49 |

# DCP Investmentfonds (F.C.P.)

## DCP - 4Plus

### Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

| Gattungsbezeichnung                         | ISIN<br>Markt | Verpflichtung | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2023 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in CHF   | % des<br>Teilfonds-<br>vermögens |
|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------|-----------------------|------------|----------------------|----------------------------------|
| <b>Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten</b> |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF        | <b>5.496.510,49</b>  | <b>23,01</b>                     |
| <b>Kassenbestände</b>                       |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF        | <b>3.979.560,29</b>  | <b>16,66</b>                     |
| Verwahrstelle                               |               |               | CHF                                         | 942.436,47            |                                           |                       |            | 942.436,47           | 3,95                             |
|                                             |               |               | EUR                                         | 726.961,57            |                                           |                       |            | 709.659,88           | 2,97                             |
|                                             |               |               | USD                                         | 2.366.466,14          |                                           |                       |            | 2.117.158,93         | 8,86                             |
| Baader Bank AG                              |               |               | EUR                                         | 251.868,06            |                                           |                       |            | 245.873,60           | 1,03                             |
|                                             |               |               | USD                                         | -39.756,99            |                                           |                       |            | -35.568,59           | -0,15                            |
| <b>Marginkonten</b>                         |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF        | <b>1.516.950,20</b>  | <b>6,35</b>                      |
| Initial Margin Baader Bank AG               |               |               | EUR                                         | 453.499,88            |                                           |                       |            | 442.706,58           | 1,86                             |
|                                             |               |               | USD                                         | 862.400,00            |                                           |                       |            | 771.546,16           | 3,23                             |
| Variation Margin für Future                 |               |               | EUR                                         | 50.100,00             |                                           |                       |            | 48.907,62            | 0,20                             |
|                                             |               |               | USD                                         | 283.675,00            |                                           |                       |            | 253.789,84           | 1,06                             |
| <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>        |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF        | <b>4.285,91</b>      | <b>0,02</b>                      |
| Dividendenansprüche                         |               |               | CHF                                         | 4.285,91              |                                           |                       |            | 4.285,91             | 0,02                             |
| <b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>           |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF        | <b>-53.916,68</b>    | <b>-0,23</b>                     |
| Verwaltungsvergütung                        |               |               | CHF                                         | -12.927,36            |                                           |                       |            | -12.927,36           | -0,05                            |
| Betreuungsgebühr                            |               |               | CHF                                         | -3.182,17             |                                           |                       |            | -3.182,17            | -0,01                            |
| Zentralverwaltungsvergütung                 |               |               | CHF                                         | -1.836,82             |                                           |                       |            | -1.836,82            | -0,01                            |
| Verwahrstellenvergütung                     |               |               | CHF                                         | -1.540,03             |                                           |                       |            | -1.540,03            | -0,01                            |
| Register- und Transferstellenvergütung      |               |               | CHF                                         | -244,05               |                                           |                       |            | -244,05              | 0,00                             |
| Taxe d'Abonnement                           |               |               | CHF                                         | -2.716,37             |                                           |                       |            | -2.716,37            | -0,01                            |
| Prüfungskosten                              |               |               | CHF                                         | -8.670,26             |                                           |                       |            | -8.670,26            | -0,04                            |
| Sonstige Kosten                             |               |               | CHF                                         | -22.799,62            |                                           |                       |            | -22.799,62           | -0,10                            |
| <b>Teilfondsvermögen</b>                    |               |               |                                             |                       |                                           |                       | <b>CHF</b> | <b>23.893.273,80</b> | <b>100,00 <sup>1)</sup></b>      |
| <b>DCP - 4Plus P</b>                        |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                      |                                  |
| Anzahl Anteile                              |               |               |                                             |                       |                                           |                       | STK        | 192.842,306          |                                  |
| Anteilwert                                  |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF        | 123,90               |                                  |

#### Fußnoten:

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

2) Maximales Marktexposure der Derivate unter Annahme eines Delta von 1.

Sofern das Sondervermögen im Berichtszeitraum andere Investmentanteile ("Zielfonds") hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene der Zielfonds angefallen sein.

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

## DCP Investmentfonds (F.C.P.)

### DCP - 4Plus

#### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

##### Devisenkurse (in Mengennote)

|           |       |                                                         |
|-----------|-------|---------------------------------------------------------|
| Euro      | (EUR) | per 30.06.2023<br>1,0243802 : 1 Schweizer Franken (CHF) |
| US-Dollar | (USD) | 1,1177555 : 1 Schweizer Franken (CHF)                   |

##### Marktschlüssel

##### Terminbörsen

|       |                         |
|-------|-------------------------|
| EUREX | Eurex Deutschland       |
| CME   | Chicago Merc. Ex.       |
| CBOE  | Chicago - CBOE Opt. Ex. |
| OTC   | Over-the-Counter        |

**DCP**  
**Investmentfonds (F.C.P.)**

**DCP - 4Plus**

**Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)**  
**für den Zeitraum vom 01.01.2023 bis 30.06.2023**

**I. Erträge**

|                                                  |            |                   |
|--------------------------------------------------|------------|-------------------|
| 1. Dividenden ausländischer Aussteller (vor QSt) | CHF        | 251.154,45        |
| 2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland      | CHF        | 43.476,13         |
| 3. Abzug ausländischer Quellensteuer             | CHF        | -51.286,89        |
| 4. Sonstige Erträge                              | CHF        | 2.840,37          |
| <b>Summe der Erträge</b>                         | <b>CHF</b> | <b>246.184,06</b> |

**II. Aufwendungen**

|                                                    |            |                    |
|----------------------------------------------------|------------|--------------------|
| 1. Verwaltungsvergütung                            | CHF        | -78.416,12         |
| 2. Verwahrstellenvergütung                         | CHF        | -7.581,38          |
| 3. Register- und Transferstellenvergütung          | CHF        | -1.702,72          |
| 4. Betreuungsgebühr                                | CHF        | -15.961,94         |
| 5. Zentralverwaltungsgebühr                        | CHF        | -21.402,31         |
| 6. Vertriebs-, Informations- und Zahlstellengebühr | CHF        | -3.244,98          |
| 7. Prüfungskosten                                  | CHF        | -7.950,87          |
| 8. Taxe d'Abonnement                               | CHF        | -5.420,92          |
| 9. Zinsaufwand aus Geldanlagen                     | CHF        | -2.081,00          |
| 10. Sonstige Aufwendungen (siehe Erläuterung 2)    | CHF        | -25.838,14         |
| <b>Summe der Aufwendungen</b>                      | <b>CHF</b> | <b>-169.600,39</b> |

**III. Ordentlicher Nettoertrag**

**CHF 76.583,68**

**IV. Veräußerungsgeschäfte**

|                                            |            |                    |
|--------------------------------------------|------------|--------------------|
| 1. Realisierte Gewinne                     | CHF        | 2.765.686,35       |
| 2. Realisierte Verluste                    | CHF        | -3.616.548,88      |
| <b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b> | <b>CHF</b> | <b>-850.862,53</b> |

**V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres**

**CHF -774.278,85**

|                                                     |     |              |
|-----------------------------------------------------|-----|--------------|
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne  | CHF | -414.897,82  |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | CHF | 1.030.346,74 |

**VI. Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres**

**CHF 615.448,92**

**VII. Ergebnis des Geschäftsjahres**

**CHF -158.829,93**

**DCP**  
**Investmentfonds (F.C.P.)**

**DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)**

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023

|                                  | Tageswert<br>in CHF   | % Anteil am<br>Teilfondsvermögen |
|----------------------------------|-----------------------|----------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>   | <b>140.657.019,34</b> | <b>100,07</b>                    |
| 1. Anleihen                      | 133.659.402,27        | 95,09                            |
| >= 1 Jahr bis < 3 Jahre          | 4.565.447,26          | 3,25                             |
| >= 3 Jahre bis < 5 Jahre         | 4.442.967,10          | 3,16                             |
| >= 5 Jahre bis < 10 Jahre        | 5.107.977,16          | 3,63                             |
| >= 10 Jahre                      | 119.543.010,75        | 85,05                            |
| 2. Derivate                      | -332.217,87           | -0,24                            |
| 3. Bankguthaben                  | 5.215.597,08          | 3,71                             |
| 4. Sonstige Vermögensgegenstände | 2.114.237,86          | 1,51                             |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>     | <b>-100.553,58</b>    | <b>-0,07</b>                     |
| <b>III. Teilfondsvermögen</b>    | <b>140.556.465,76</b> | <b>100,00</b>                    |

**DCP**  
**Investmentfonds (F.C.P.)**

**DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)**

**Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023**

| Gattungsbezeichnung                                                    | ISIN<br>Markt | Verpflichtung | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2023 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in CHF    | % des<br>Teilfonds-<br>vermögens |
|------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------|-----------------------|------------|-----------------------|----------------------------------|
| <b>Bestandspositionen</b>                                              |               |               |                                             |                       |                                           |                       | <b>CHF</b> | <b>133.659.402,27</b> | <b>95,09</b>                     |
| <b>Amtlich gehandelte Wertpapiere</b>                                  |               |               |                                             |                       |                                           |                       | <b>CHF</b> | <b>114.393.047,65</b> | <b>81,38</b>                     |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>                                        |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
| 4,5325 % Alpiq Holding AG SF-FLR Anl. 2013(18/Und.)                    | CH0212184037  |               | CHF                                         | 4.300                 | 1.100                                     | %                     | 94,1000    | 4.046.300,00          | 2,88                             |
| 2,2000 % Baloise Leben AG SF-Var. Anl. 2017(28/48)                     | CH0379611004  |               | CHF                                         | 1.800                 |                                           | %                     | 94,9500    | 1.709.100,00          | 1,22                             |
| 4,0000 % Helvetia Schweiz. Versicherung SF-FLR Notes 2014(24/44)       | CH0255893098  |               | CHF                                         | 2.300                 |                                           | %                     | 101,4040   | 2.332.292,00          | 1,66                             |
| 5,0000 % Hero SF-FLR Notes 2023(28/Und.)                               | CH1268922171  |               | CHF                                         | 4.000                 | 4.000                                     | %                     | 100,6770   | 4.027.080,00          | 2,86                             |
| 2,5000 % HOCHDORF Holding AG SF-FLR Anl. 2017(23/Und.)                 | CH0391647986  |               | CHF                                         | 3.215                 |                                           | %                     | 27,0000    | 868.050,00            | 0,62                             |
| 3,5000 % Holcim Helvetia Finance AG SF-FLR Anl. 2018(24/Und.)          | CH0398633724  |               | CHF                                         | 2.000                 | 340                                       | %                     | 99,7730    | 1.995.460,00          | 1,42                             |
| 4,3750 % Swiss Life AG SF-Var. Anl. 2016(26/46)                        | CH0316994653  |               | CHF                                         | 2.900                 |                                           | %                     | 102,4500   | 2.971.050,00          | 2,11                             |
| 2,0000 % Swiss Life AG SF-Var. Anl. 2018(24/Und.)                      | CH0404311729  |               | CHF                                         | 1.650                 |                                           | %                     | 98,0500    | 1.617.825,00          | 1,15                             |
| 2,6250 % Swiss Life AG SF-Var. Anl. 2018(28/48)                        | CH0406990801  |               | CHF                                         | 1.205                 |                                           | %                     | 94,2500    | 1.135.712,50          | 0,81                             |
| 1,5000 % Zürich Versicherungs-Gesell.AG SF-FLR Med.-Term Nts 22(32/52) | CH1151526204  |               | CHF                                         | 2.200                 | 400                                       | %                     | 83,8220    | 1.844.084,00          | 1,31                             |
| 4,3750 % ACCOR S.A. EO-FLR Bonds 2019(24/Und.)                         | FR0013399177  |               | EUR                                         | 300                   |                                           | %                     | 98,8470    | 289.483,32            | 0,21                             |
| 4,2500 % Achmea B.V. EO-FLR Med.-T. Nts 15(25/Und.)                    | XS1180651587  |               | EUR                                         | 3.650                 |                                           | %                     | 97,3150    | 3.467.459,96          | 2,47                             |
| 3,5000 % AG Insurance S.A. EO-FLR Notes 2015(27/47)                    | BE6277215545  |               | EUR                                         | 2.000                 |                                           | %                     | 91,9210    | 1.794.665,60          | 1,28                             |
| 3,2500 % AGEAS SA/NV EO-FLR Notes 2019(29/49)                          | BE0002644251  |               | EUR                                         | 300                   |                                           | %                     | 85,5510    | 250.544,66            | 0,18                             |
| 4,6310 % Ageasfinlux S.A. EO-Conv.FLR Nts 02(Und.) Reg.S               | XS0147484074  |               | EUR                                         | 2.500                 |                                           | %                     | 82,6780    | 2.017.756,59          | 1,43                             |
| 4,2520 % Allianz SE FLR-Sub.MTN.v.2022(2032/2052)                      | DE000A30VJZ6  |               | EUR                                         | 800                   | 800                                       | %                     | 93,0380    | 726.589,56            | 0,52                             |
| 5,2560 % American International Grp Inc EO-FLR Med.-T.Nts 2007(07/67)  | XS0291642154  |               | EUR                                         | 1.000                 |                                           | %                     | 91,7640    | 895.800,17            | 0,64                             |
| 2,1250 % Aaroundtown SA EO-FLR Notes 2018(24/Und.)                     | XS1752984440  |               | EUR                                         | 1.400                 |                                           | %                     | 34,2250    | 467.746,23            | 0,33                             |
| 3,3750 % Aaroundtown SA EO-FLR Notes 2019(24/Und.)                     | XS2055106210  |               | EUR                                         | 800                   | 400                                       | %                     | 42,2690    | 330.103,98            | 0,23                             |
| 4,5960 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-FLR Med.-T. Nts 14(25/Und.)  | XS1140860534  |               | EUR                                         | 400                   |                                           | %                     | 97,4010    | 380.331,42            | 0,27                             |
| 5,5000 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 15(27/47)  | XS1311440082  |               | EUR                                         | 1.000                 |                                           | %                     | 100,9310   | 985.288,42            | 0,70                             |
| 5,0000 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 16(28/48)  | XS1428773763  |               | EUR                                         | 800                   |                                           | %                     | 100,1070   | 781.795,63            | 0,56                             |
| 7,0780 % ATF Netherlands B.V. EO-FLR Notes 2016(23/Und.)               | XS1508392625  |               | EUR                                         | 1.400                 |                                           | %                     | 43,1200    | 589.312,42            | 0,42                             |
| 3,1290 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 03(08/Und.)                       | XS0181369454  |               | EUR                                         | 1.000                 |                                           | %                     | 79,7840    | 778.851,41            | 0,55                             |
| 3,5400 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 03(13/Und.)                       | XS0179060974  |               | EUR                                         | 1.200                 |                                           | %                     | 80,5860    | 944.016,64            | 0,67                             |
| 3,1390 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 04(09/Und.)                       | XS0203470157  |               | EUR                                         | 700                   |                                           | %                     | 81,1130    | 554.277,57            | 0,39                             |
| 4,7740 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Obl. 2007(27/Und.)        | ES0214974075  |               | EUR                                         | 1.000                 |                                           | %                     | 90,9790    | 888.137,00            | 0,63                             |
| 2,5000 % Bank of Scotland PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2005(35)              | XS0211568331  |               | EUR                                         | 1.479                 |                                           | %                     | 87,7290    | 1.266.631,13          | 0,90                             |
| 3,9670 % Barclays Bank PLC EO-FLR Med.-Term Nts 2001(40)               | XS0122679243  |               | EUR                                         | 1.000                 |                                           | %                     | 73,7070    | 719.527,73            | 0,51                             |
| 1,8750 % BAWAG Group AG EO-FLR Med.-Term Nts 20(25/30)                 | XS2230264603  |               | EUR                                         | 800                   |                                           | %                     | 82,2380    | 642.245,88            | 0,46                             |
| 6,0000 % Bqe International à Luxembourg EO-FLR Med.-Term Nts 23(28/33) | XS2582360330  |               | EUR                                         | 600                   | 600                                       | %                     | 92,4720    | 541.627,00            | 0,38                             |
| 3,0730 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-FLR Med.-T. Nts 04(14/Und.)  | XS0207764712  |               | EUR                                         | 1.500                 |                                           | %                     | 77,9310    | 1.141.143,63          | 0,81                             |
| 3,1000 % CNP Assurances S.A. EO-FLR Notes 2004(09/Und.)                | FR0010093328  |               | EUR                                         | 4.400                 | 400                                       | %                     | 81,4340    | 3.497.818,32          | 2,49                             |
| 3,7281 % CNP Assurances S.A. EO-FLR Notes 2005(11/Und.)                | FR0010167247  |               | EUR                                         | 2.445                 |                                           | %                     | 94,3970    | 2.253.076,09          | 1,60                             |
| 4,2500 % Crédit Agricole Assurances SA EO-FLR Notes 2015(25/Und.)      | FR0012444750  |               | EUR                                         | 2.900                 | 700                                       | %                     | 97,5910    | 2.762.781,69          | 1,97                             |
| 3,0690 % Crédit Mutuel Arkéa EO-FLR Notes 2004(14/Und.)                | FR0010096826  |               | EUR                                         | 1.100                 | 1.100                                     | %                     | 80,6780    | 866.336,50            | 0,62                             |
| 1,2500 % Deutsche Börse AG FLR-Sub.Anl.v.2020(2027/2047)               | DE000A289N78  |               | EUR                                         | 900                   |                                           | %                     | 88,3080    | 775.856,43            | 0,55                             |
| 2,0000 % Deutsche Börse AG FLR-Sub.Anl.v.2022(2022/2048)               | DE000A3MQQV5  |               | EUR                                         | 300                   | 300                                       | %                     | 87,9030    | 257.432,73            | 0,18                             |
| 4,6790 % Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.FLR-MTN R35281 17(22/27)     | XS1637926137  |               | EUR                                         | 1.700                 |                                           | %                     | 78,7200    | 1.306.389,89          | 0,93                             |
| 4,6000 % Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.MTN Reihe 35274 v.17(27)     | DE000A2DASM5  |               | EUR                                         | 1.100                 | 200                                       | %                     | 78,5170    | 843.131,25            | 0,60                             |
| 3,3750 % ELM B.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2017(27/47)                       | XS1587893451  |               | EUR                                         | 1.000                 |                                           | %                     | 90,3380    | 881.879,56            | 0,63                             |
| 4,5000 % ELM B.V. EO-FLR Med.-T.Nts 16(27/Und.)                        | XS1492580516  |               | EUR                                         | 400                   |                                           | %                     | 95,3950    | 372.498,40            | 0,26                             |
| 1,6250 % EnBW Energie Baden-Württem. AG FLR-Anleihe v.19(27/79)        | XS2035564629  |               | EUR                                         | 100                   |                                           | %                     | 85,3730    | 83.341,12             | 0,06                             |
| 3,0000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-FLR Notes 2019(24/Und.)      | XS1713466495  |               | EUR                                         | 1.600                 | 300                                       | %                     | 97,3630    | 1.520.732,17          | 1,08                             |
| 3,6250 % Infineon Technologies AG Sub.-FLR-Nts.v.19(28/unb.)           | XS2056730679  |               | EUR                                         | 600                   |                                           | %                     | 91,4860    | 535.851,80            | 0,38                             |
| 3,1250 % Landsbankinn hf. EO-FLR Med.-T. Nts 2018(23/28)               | XS1876547420  |               | EUR                                         | 1.000                 |                                           | %                     | 94,7520    | 924.969,02            | 0,66                             |
| 1,6250 % Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2020(2026/2080)                     | XS2218405772  |               | EUR                                         | 500                   | 500                                       | %                     | 89,4420    | 436.566,40            | 0,31                             |
| 2,8500 % NIBC Bank N.V. EO-FLR Med.T.Nts 2005(35/40)                   | XS0210781828  |               | EUR                                         | 2.307                 |                                           | %                     | 58,5050    | 1.317.587,24          | 0,94                             |
| 4,5000 % NN Group N.V. EO-FLR Bonds 2014(26/Und.)                      | XS1028950290  |               | EUR                                         | 2.500                 | 400                                       | %                     | 96,8890    | 2.364.576,05          | 1,68                             |
| 4,3750 % NN Group N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 14(24/Und.)                  | XS1076781589  |               | EUR                                         | 2.800                 |                                           | %                     | 98,6850    | 2.697.416,32          | 1,92                             |
| 6,2500 % OMV AG EO-FLR Notes 2015(25/Und.)                             | XS1294343337  |               | EUR                                         | 2.600                 |                                           | %                     | 102,8550   | 2.610.583,33          | 1,86                             |
| 5,0000 % Orange S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 14(26/Und.)                    | XS1115498260  |               | EUR                                         | 700                   |                                           | %                     | 99,7860    | 681.877,65            | 0,48                             |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

**DCP**  
**Investmentfonds (F.C.P.)**

**DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)**

**Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023**

| Gattungsbezeichnung                                                        | ISIN<br>Markt | Verpflichtung | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2023 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs     | Kurswert<br>in CHF | % des<br>Teilfonds-<br>vermögens |      |
|----------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------|-----------------------|----------|--------------------|----------------------------------|------|
| 2,2500 % Orsted A/S EO-FLR Secs 2017(2024/3017)                            | XS1720192696  |               | EUR                                         | 1.000                 | 1.000                                     | %                     | 95,8760  | 935.941,51         | 0,67                             |      |
| 4,2470 % Repsol Intl Finance B.V. EO-FLR Notes 2020(28/Und.)               | XS2186001314  |               | EUR                                         | 2.900                 | 300                                       | %                     | 90,2410  | 2.554.704,66       | 1,82                             |      |
| 4,5000 % Repsol Intl Finance B.V. EO-FLR Securities 2015(25/75)            | XS1207058733  |               | EUR                                         | 1.450                 |                                           | %                     | 98,3340  | 1.391.907,94       | 0,99                             |      |
| 3,1700 % Rothschild&Co Cont.Finance PLC EO-FLR Notes 2004(14/Und.)         | XS0197703118  |               | EUR                                         | 5.500                 |                                           | %                     | 69,2690  | 3.719.121,88       | 2,65                             |      |
| 3,8750 % SCOR SE EO-FLR Notes 2014(25/Und.)                                | FR0012199123  |               | EUR                                         | 200                   |                                           | %                     | 95,1020  | 185.677,14         | 0,13                             |      |
| 5,8690 % Solvay Finance S.A. EO-FLR Notes 2015(24/Und.)                    | XS1323897725  |               | EUR                                         | 2.500                 |                                           | %                     | 100,1880 | 2.445.088,14       | 1,74                             |      |
| 3,1250 % SSE PLC EO-FLR Notes 2020(27/Und.)                                | XS2195190520  |               | EUR                                         | 1.000                 |                                           | %                     | 90,9930  | 888.273,67         | 0,63                             |      |
| 3,8750 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2018(26/Und.)                 | XS1795406658  |               | EUR                                         | 1.800                 |                                           | %                     | 92,6270  | 1.627.604,59       | 1,16                             |      |
| 2,8800 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Notes 2021(28/Und.)                 | XS2410367747  |               | EUR                                         | 900                   | 900                                       | %                     | 84,3800  | 741.345,80         | 0,53                             |      |
| 3,3690 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 16(26/Und.)                   | XS1501166869  |               | EUR                                         | 900                   |                                           | %                     | 94,1310  | 827.016,14         | 0,59                             |      |
| 1,6250 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 21(21/Und.)                   | XS2290960520  |               | EUR                                         | 100                   |                                           | %                     | 83,3430  | 81.359,44          | 0,06                             |      |
| 2,0000 % TotalEnergies SE EO-FLR Notes 20(30/Und.)                         | XS2224632971  |               | EUR                                         | 1.600                 | 600                                       | %                     | 77,0610  | 1.203.631,17       | 0,86                             |      |
| 2,2500 % Veolia Environnement S.A. EO-FLR Notes 2020(26/Und.)              | FR00140007K5  |               | EUR                                         | 1.500                 | 1.500                                     | %                     | 90,6850  | 1.327.900,46       | 0,94                             |      |
| 3,0000 % Vodafone Group PLC EO-FLR Cap.Sec. 2020(30/80)                    | XS2225204010  |               | EUR                                         | 3.400                 | 600                                       | %                     | 80,9140  | 2.685.600,39       | 1,91                             |      |
| 2,0200 % Zürcher Kantonalbank EO-FLR Notes 2022(27/28)                     | CH1170565753  |               | EUR                                         | 1.000                 |                                           | %                     | 90,7430  | 885.833,17         | 0,63                             |      |
| 1,4250 % AEGON N.V. FL-FLR Anleihe 1996(08/Und.)                           | NL0000121416  |               | NLG                                         | 9.400                 |                                           | %                     | 72,2800  | 3.009.749,55       | 2,14                             |      |
| 0,4960 % AEGON N.V. FL-FLR-Anleihe 1996(11/Und.)                           | NL0000120889  |               | NLG                                         | 4.800                 | 1.300                                     | %                     | 64,3460  | 1.368.192,33       | 0,97                             |      |
| 3,5150 % AEGON N.V. DL-FLR Nts 2004(14/Und.)                               | NL0000116168  |               | USD                                         | 2.000                 |                                           | 400                   | %        | 76,0830            | 1.361.353,12                     | 0,97 |
| 3,8750 % Allianz SE DL-Subord. MTN v.16(22/unb.)                           | XS1485742438  |               | USD                                         | 2.600                 |                                           | %                     | 70,1560  | 1.631.891,70       | 1,16                             |      |
| 5,5250 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. DL-FLR-Notes 1986(91/Und.)         | GB0040024555  |               | USD                                         | 1.000                 | 1.000                                     | 800                   | %        | 92,4190            | 826.826,58                       | 0,59 |
| 3,3940 % AXA S.A. DL-FLR Med.-T. Nts 04(09/Und.)                           | XS0185672291  |               | USD                                         | 3.600                 |                                           | %                     | 83,0250  | 2.674.019,39       | 1,90                             |      |
| 5,5000 % HSBC Bank PLC DL-FLR-Notes 1985(90/Und.)                          | XS0015190423  |               | USD                                         | 1.500                 |                                           | %                     | 99,6150  | 1.336.808,40       | 0,95                             |      |
| 3,5000 % KBC Ifima S.A. DL-FLR Med.-Term Nts 2005(25)                      | XS0210976329  |               | USD                                         | 5.400                 |                                           | %                     | 94,5010  | 4.565.447,26       | 3,25                             |      |
| 0,0000 % Lloyds Bank PLC DL-Medium-Term Notes 2012(32)                     | XS0767581407  |               | USD                                         | 800                   |                                           | %                     | 62,4130  | 446.702,32         | 0,32                             |      |
| 3,7150 % NIBC Bank N.V. DL-FLR Med.T.Nts 2005(15/Und.)                     | XS0215294512  |               | USD                                         | 1.700                 | 1.700                                     | %                     | 77,4540  | 1.178.001,76       | 0,84                             |      |
| 4,8750 % Prudential PLC DL-Med.-Term Nts 2017(23/Und.)                     | XS1700429480  |               | USD                                         | 4.000                 |                                           | %                     | 87,5070  | 3.131.525,50       | 2,23                             |      |
| 5,5000 % Rothschilds Continuation Fin. DL-FLR-Notes 1986(91/Und.)          | GB0047524268  |               | USD                                         | 2.000                 | 400                                       | %                     | 76,5960  | 1.370.532,23       | 0,97                             |      |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF      | 19.266.354,62      | 13,71                            |      |
| Verzinsliche Wertpapiere                                                   |               |               |                                             |                       |                                           |                       |          |                    |                                  |      |
| 4,6250 % Achmea B.V. EO-FLR Notes 2019(29/Und.)                            | XS2056490423  |               | EUR                                         | 1.500                 |                                           | %                     | 77,8090  | 1.139.357,19       | 0,81                             |      |
| 4,0320 % BNP Paribas Cardif S.A. EO-FLR Notes 2014(25/Und.)                | FR0012329845  |               | EUR                                         | 800                   |                                           | %                     | 96,5930  | 754.352,69         | 0,54                             |      |
| 5,5470 % BNP Paribas Fortis S.A. EO-FLR Conv.Nts 2007(Und.)                | BE0933899800  |               | EUR                                         | 5.750                 |                                           | %                     | 85,4640  | 4.797.222,52       | 3,41                             |      |
| 3,7500 % ELM B.V. EO-FLR M.-T. Nts 2020(25/Und.)                           | XS2182055009  |               | EUR                                         | 500                   | 500                                       | %                     | 95,8330  | 467.760,87         | 0,33                             |      |
| 2,6000 % ELM B.V. EO-FLR Med.-T.Nts 15(25/Und.)                            | XS1209031019  |               | EUR                                         | 500                   |                                           | %                     | 93,1480  | 454.655,39         | 0,32                             |      |
| 2,2500 % Iberdrola International B.V. EO-FLR Notes 2020(20/Und.)           | XS2244941147  |               | EUR                                         | 500                   |                                           | %                     | 82,3740  | 402.067,49         | 0,29                             |      |
| 3,2500 % Iberdrola International B.V. EO-FLR Securit. 2019(24/Und.)        | XS1890845875  |               | EUR                                         | 400                   |                                           | %                     | 97,2870  | 379.886,28         | 0,27                             |      |
| 4,1250 % Sogecap S.A. EO-FLR Notes 2014(26/Und.)                           | FR0012383982  |               | EUR                                         | 2.700                 | 400                                       | %                     | 95,3470  | 2.513.099,02       | 1,79                             |      |
| 4,0000 % Utmost Group PLC LS-Bonds 2021(31/31)                             | XS2384717703  |               | GBP                                         | 500                   |                                           | %                     | 72,4440  | 412.025,25         | 0,29                             |      |
| 6,3790 % AXA S.A. DL-FLR Nts 2006(06/Und.) Reg.S                           | USF0609NAQ19  |               | USD                                         | 1.500                 |                                           | %                     | 106,4310 | 1.428.277,41       | 1,02                             |      |
| 6,1703 % HSB Group Inc. DL-FLR Debts 1997(07/27) Ser.B                     | US40428NAC39  |               | USD                                         | 1.700                 |                                           | %                     | 92,5510  | 1.407.612,79       | 1,00                             |      |
| 4,8000 % La Mondiale DL-FLR Notes 2018(28/48)                              | XS1751476679  |               | USD                                         | 2.100                 |                                           | %                     | 90,4770  | 1.699.850,21       | 1,21                             |      |
| 3,2500 % Pershing Square Holdings Ltd. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S          | XS2250902389  |               | USD                                         | 1.100                 |                                           | %                     | 78,4680  | 772.215,36         | 0,55                             |      |
| 4,2500 % Swiss Re Finance (Lux) S.A. DL-FLR Notes 2019(24/Und.)            | XS2049422343  |               | USD                                         | 3.200                 | 800                                       | %                     | 92,1440  | 2.637.972,15       | 1,88                             |      |
| Summe Wertpapiervermögen                                                   |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF      | 133.659.402,27     | 95,09                            |      |

**DCP**  
**Investmentfonds (F.C.P.)**

**DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)**

**Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023**

| Gattungsbezeichnung                                                                     | ISIN<br>Markt | Verpflichtung | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2023 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in CHF    | % des<br>Teilfonds-<br>vermögens |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------|-----------------------|------------|-----------------------|----------------------------------|
| <b>Derivate</b>                                                                         |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF        | -332.217,87           | -0,24                            |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
| <b>Devisen-Derivate</b>                                                                 |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF        | -332.217,87           | -0,24                            |
| <b>Devisenterminkontrakte</b>                                                           |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
| <b>Offene Positionen</b>                                                                |               |               | Kauf-<br>währung                            | Kauf-<br>betrag       | Verkauf-<br>währung                       | Verkauf-<br>betrag    | Fälligkeit |                       |                                  |
| Banque de Luxembourg EUR/CHF                                                            | OTC           |               | EUR                                         | 47.068.000,00         | CHF                                       | -46.199.030,58        | 11.07.2023 | -269.370,16           | -0,19                            |
| Banque de Luxembourg EUR/CHF                                                            | OTC           |               | CHF                                         | 83.047.261,50         | EUR                                       | -85.500.000,00        | 24.11.2023 | 254.704,50            | 0,18                             |
| Banque de Luxembourg EUR/CHF                                                            | OTC           |               | EUR                                         | 4.691.080,33          | CHF                                       | -4.583.232,39         | 17.07.2023 | -7.153,89             | 0,00                             |
| Banque de Luxembourg EUR/CHF                                                            | OTC           |               | EUR                                         | 8.734.373,21          | CHF                                       | -8.557.650,64         | 20.07.2023 | -38.841,76            | -0,03                            |
| Banque de Luxembourg USD/CHF                                                            | OTC           |               | USD                                         | 3.492.187,38          | CHF                                       | -3.130.267,56         | 11.07.2023 | -8.468,56             | -0,01                            |
| Banque de Luxembourg USD/CHF                                                            | OTC           |               | CHF                                         | 23.523.318,00         | USD                                       | -27.000.000,00        | 24.11.2023 | -263.088,00           | -0,19                            |
| <b>Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten</b>                                             |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF        | 5.215.597,08          | 3,71                             |
| <b>Kassenbestände</b>                                                                   |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF        | 5.215.597,08          | 3,71                             |
| Verwahrstelle                                                                           |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
|                                                                                         |               |               | CHF                                         | 3.967.918,28          |                                           |                       |            | 3.967.918,28          | 2,82                             |
|                                                                                         |               |               | EUR                                         | 258.247,90            |                                           |                       |            | 252.101,60            | 0,18                             |
|                                                                                         |               |               | GBP                                         | 41.278,42             |                                           |                       |            | 46.954,20             | 0,03                             |
|                                                                                         |               |               | USD                                         | 1.060.328,62          |                                           |                       |            | 948.623,00            | 0,68                             |
| <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>                                                    |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF        | 2.114.237,86          | 1,51                             |
| Zinsansprüche                                                                           |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
|                                                                                         |               |               | CHF                                         | 2.114.237,86          |                                           |                       |            | 2.114.237,86          | 1,51                             |
| <b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>                                                       |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF        | -100.553,58           | -0,07                            |
| Verwaltungsvergütung                                                                    |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
|                                                                                         |               |               | CHF                                         | -41.069,59            |                                           |                       |            | -41.069,59            | -0,03                            |
| Betreuungsgebühr                                                                        |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
|                                                                                         |               |               | CHF                                         | -18.577,48            |                                           |                       |            | -18.577,48            | -0,01                            |
| Zentralverwaltungsvergütung                                                             |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
|                                                                                         |               |               | CHF                                         | -4.650,82             |                                           |                       |            | -4.650,82             | 0,00                             |
| Verwahrstellenvergütung                                                                 |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
|                                                                                         |               |               | CHF                                         | -7.871,51             |                                           |                       |            | -7.871,51             | -0,01                            |
| Register- und Transferstellenvergütung                                                  |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
|                                                                                         |               |               | CHF                                         | -244,05               |                                           |                       |            | -244,05               | 0,00                             |
| Taxe d'Abonnement                                                                       |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
|                                                                                         |               |               | CHF                                         | -17.571,74            |                                           |                       |            | -17.571,74            | -0,01                            |
| Prüfungskosten                                                                          |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
|                                                                                         |               |               | CHF                                         | -8.670,26             |                                           |                       |            | -8.670,26             | -0,01                            |
| Sonstige Kosten                                                                         |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
|                                                                                         |               |               | CHF                                         | -1.898,13             |                                           |                       |            | -1.898,13             | 0,00                             |
| <b>Teilfondsvermögen</b>                                                                |               |               |                                             |                       |                                           |                       | <b>CHF</b> | <b>140.556.465,76</b> | <b>100,00 <sup>1)</sup></b>      |
| <b>DCP - Hybrid Income IS Acc - CHF</b>                                                 |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
| Anzahl Anteile                                                                          |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
|                                                                                         |               |               |                                             |                       |                                           |                       | STK        | 747.248,039           |                                  |
| Anteilwert                                                                              |               |               |                                             |                       |                                           |                       |            |                       |                                  |
|                                                                                         |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF        | 94,04                 |                                  |

**DCP**  
**Investmentfonds (F.C.P.)**

**DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)**

**Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023**

| Gattungsbezeichnung                                                                                                 | ISIN<br>Markt | Verpflichtung | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2023 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs | Kurswert<br>in CHF | % des<br>Teilfonds-<br>vermögens |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------|-----------------------|------|--------------------|----------------------------------|
| <b>DCP - Hybrid Income IS Dis hedged - EUR (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund IS Dis hedged - EUR“)</b> |               |               |                                             |                       |                                           |                       |      |                    |                                  |
| Anzahl Anteile                                                                                                      |               |               |                                             |                       |                                           |                       | STK  | 536.227,021        |                                  |
| Anteilwert                                                                                                          |               |               |                                             |                       |                                           |                       | EUR  | 89,50              |                                  |
| <b>DCP - Hybrid Income IS Acc hedged - USD (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund IS Acc hedged - USD“)</b> |               |               |                                             |                       |                                           |                       |      |                    |                                  |
| Anzahl Anteile                                                                                                      |               |               |                                             |                       |                                           |                       | STK  | 35.757,442         |                                  |
| Anteilwert                                                                                                          |               |               |                                             |                       |                                           |                       | USD  | 99,26              |                                  |
| <b>DCP - Hybrid Income I Acc - CHF (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund I Acc - CHF“)</b>                 |               |               |                                             |                       |                                           |                       |      |                    |                                  |
| Anzahl Anteile                                                                                                      |               |               |                                             |                       |                                           |                       | STK  | 81.140,895         |                                  |
| Anteilwert                                                                                                          |               |               |                                             |                       |                                           |                       | CHF  | 89,93              |                                  |
| <b>DCP - Hybrid Income I Dis hedged - EUR (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund I Dis hedged - EUR“)</b>   |               |               |                                             |                       |                                           |                       |      |                    |                                  |
| Anzahl Anteile                                                                                                      |               |               |                                             |                       |                                           |                       | STK  | 96.411,155         |                                  |
| Anteilwert                                                                                                          |               |               |                                             |                       |                                           |                       | EUR  | 88,68              |                                  |
| <b>DCP - Hybrid Income I Acc hedged - EUR (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund I Acc hedged - EUR“)</b>   |               |               |                                             |                       |                                           |                       |      |                    |                                  |
| Anzahl Anteile                                                                                                      |               |               |                                             |                       |                                           |                       | STK  | 47.115,000         |                                  |
| Anteilwert                                                                                                          |               |               |                                             |                       |                                           |                       | EUR  | 100,39             |                                  |

**Fußnoten:**

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.  
Sofern das Sondervermögen im Berichtszeitraum andere Investmentanteile ("Zielfonds") hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene der Zielfonds angefallen sein.

**DCP**  
**Investmentfonds (F.C.P.)**

**DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)**

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

**Devisenkurse (in Mengennote)**

|                        |       |                |                                       |
|------------------------|-------|----------------|---------------------------------------|
| Euro                   | (EUR) | per 30.06.2023 | 1,0243802 : 1 Schweizer Franken (CHF) |
| Britische Pfund        | (GBP) |                | 0,8791209 : 1 Schweizer Franken (CHF) |
| Niederländische Gulden | (NLG) |                | 2,2574370 : 1 Schweizer Franken (CHF) |
| US-Dollar              | (USD) |                | 1,1177555 : 1 Schweizer Franken (CHF) |

**Marktschlüssel**

|     |                  |
|-----|------------------|
| OTC | Over-the-Counter |
|-----|------------------|

**DCP**  
**Investmentfonds (F.C.P.)**

**DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)**

**Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)**  
**für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis 30. Juni 2023**

**I. Erträge**

|                                  |            |                     |
|----------------------------------|------------|---------------------|
| 1. Zinsen aus Wertpapieren       | CHF        | 2.731.247,94        |
| 2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen | CHF        | 41.518,68           |
| 3. Abzug Quellensteuer           | CHF        | -78.743,15          |
| <b>Summe der Erträge</b>         | <b>CHF</b> | <b>2.694.023,47</b> |

**II. Aufwendungen**

|                                                    |            |                    |
|----------------------------------------------------|------------|--------------------|
| 1. Verwaltungsvergütung                            | CHF        | -245.027,79        |
| 2. Verwahrstellenvergütung                         | CHF        | -37.189,71         |
| 3. Register- und Transferstellenvergütung          | CHF        | -5.457,79          |
| 4. Betreuungsgebühr                                | CHF        | -79.551,78         |
| 5. Zentralverwaltungsgebühr                        | CHF        | -33.381,14         |
| 6. Vertriebs-, Informations- und Zahlstellengebühr | CHF        | -1.656,69          |
| 7. Prüfungskosten                                  | CHF        | -8.049,30          |
| 8. Taxe d'Abonnement                               | CHF        | -34.634,66         |
| 9. Zinsaufwand aus Geldanlagen                     | CHF        | -3.732,10          |
| 10. Sonstige Aufwendungen (siehe Erläuterung 2)    | CHF        | -28.194,06         |
| <b>Summe der Aufwendungen</b>                      | <b>CHF</b> | <b>-476.875,02</b> |

**III. Ordentlicher Nettoertrag**

**CHF 2.217.148,45**

**IV. Veräußerungsgeschäfte**

|                         |     |               |
|-------------------------|-----|---------------|
| 1. Realisierte Gewinne  | CHF | 3.482.186,14  |
| 2. Realisierte Verluste | CHF | -1.269.777,51 |

**Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften**

**CHF 2.212.408,63**

**V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres**

**CHF 4.429.557,08**

**VI. Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres**

**CHF -1.094.079,42**

**VII. Ergebnis des Geschäftsjahres**

**CHF 3.335.477,66**

**Erläuterungen zum Halbjahresbericht (Anhang)**  
zum 30. Juni 2023

**Erläuterung 1 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze**

a) Darstellung der Finanzberichte

Die Finanzberichte des Fonds sind gemäß den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen über Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) erstellt.

b) Bewertung des Wertpapierbestandes und der Geldmarktinstrumente

Wertpapiere, die an einer Börse notiert sind, werden zum letzten verfügbaren bezahlten Kurs bewertet. Soweit Wertpapiere an mehreren Börsen notiert sind, ist der letzte verfügbare bezahlte Kurs des entsprechenden Wertpapiers an der Börse maßgeblich, die Hauptmarkt für dieses Wertpapier ist.

Wertpapiere, die nicht an einer Börse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, werden grundsätzlich zu einem Kurs bewertet, der nicht geringer als der Geldkurs und nicht höher als der Briefkurs zur Zeit der Bewertung sein darf und den die Verwaltungsgesellschaft für den bestmöglichen Kurs hält, zu dem die Wertpapiere verkauft werden können.

Die flüssigen Mittel werden zu ihrem Nennwert zuzüglich Zinsen bewertet. Festgelder mit einer Ursprungslaufzeit von mehr als 60 Tagen können mit dem jeweiligen Renditekurs bewertet werden, vorausgesetzt, ein entsprechender Vertrag zwischen dem Kredit- oder Finanzinstitut, welches die Festgelder verwahrt, und der Verwaltungsgesellschaft sieht vor, dass diese Festgelder zu jeder Zeit kündbar sind und dass im Falle einer Kündigung ihr Realisierungswert diesem Renditekurs entspricht.

Anteile an OGAWs, OGAs und sonstigen Investmentfonds bzw. Sondervermögen werden zum letzten festgestellten verfügbaren Nettoinventarwert bewertet, der von der jeweiligen Verwaltungsgesellschaft, dem Anlagevehikel selbst oder einer vertraglich bestellten Stelle veröffentlicht wurde. Sollte ein Anlagevehikel zusätzlich an einer Börse notiert sein, kann die Verwaltungsgesellschaft auch den letzten verfügbaren bezahlten Börsenkurs des Hauptmarktes heranziehen.

Exchange Traded Funds (ETFs) werden zum letzten verfügbaren bezahlten Kurs des Hauptmarktes bewertet. Die Verwaltungsgesellschaft kann auch den letzten verfügbaren von der jeweiligen Verwaltungsgesellschaft, dem Anlagevehikel selbst oder einer vertraglich bestellten Stelle veröffentlichten Kurs heranziehen.

Falls für die vorgenannten Wertpapiere bzw. Anlageinstrumente keine Kurse festgelegt werden oder die Kurse nicht marktgerecht bzw. unsachgerecht sind, werden diese Wertpapiere bzw. Anlageinstrumente ebenso wie alle anderen Vermögenswerte zum jeweiligen Verkehrswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben festlegt.

c) Realisierter Nettogewinn/-verlust aus Wertpapierverkäufen

Die aus Wertpapierverkäufen realisierten Gewinne und Verluste werden auf der Grundlage der Methode der Durchschnittskosten der verkauften Wertpapiere berechnet.

d) Swing Pricing

Das Swing Pricing-Verfahren ist ein Mechanismus, der auf eine Anpassung des Nettoinventarwerts um einen bestimmten Swing Faktor bei den Anteilen eines Teilfonds abzielt.

**DCP  
Investmentfonds (F.C.P.)**

Die Anpassung verfolgt den Zweck, die erwarteten Preise, zu denen für den Teilfonds Vermögenswerte gekauft und verkauft werden, sowie die geschätzten Transaktionskosten im Nettoinventarwert angemessen widerzuspiegeln.

Unter normalen Marktbedingungen wird der anzuwendende maximale Swing Faktor 2% des ursprünglichen Nettoinventarwertes je Anteil nicht übersteigen. Bei ungewöhnlichen Marktbedingungen (bspw. in einem Marktumfeld mit extremer Illiquidität oder hoher Marktvolatilität) kann die Verwaltungsgesellschaft die Swing Pricing-Anpassung auf mehr als 2% des ursprünglichen Nettoinventarwertes erhöhen.

Das Swing Pricing-Verfahren, einschließlich der für jeden Teilfonds anwendbaren Swing Faktoren und Schwellenwerte, wird von der Verwaltungsgesellschaft festgelegt.

Im Berichtszeitraum kamen Swing Pricing-Verfahren in Form von Partial Swing Pricing Methoden im Teilfonds DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“) zum Einsatz.

e) Transaktionskosten

Bei Transaktionen, welche nicht direkt mit der Verwahrstelle abgeschlossen werden, werden die Abwicklungskosten dem Teilfonds monatlich gebündelt belastet.

Jedoch enthalten die Transaktionspreise der Wertpapiere separat in Rechnung gestellte Kosten, die in den realisierten und nicht realisierten Werterhöhungen oder -minderungen inbegriffen sind.

f) Umrechnung von Fremdwährungen

Alle nicht auf die jeweilige Teilfondswährung lautenden Vermögenswerte werden zum letzten Devisenmittelskurs in diese Teilfondswährung umgerechnet.

Die Transaktionen, Erträge und Aufwendungen in anderen Währungen als die des jeweiligen Teilfonds, werden zu dem Wechselkurs verbucht, der am Tag der Transaktion gültig ist.

g) Zusammengefasster Abschluss

Der zusammengefasste Abschluss erfolgt in Schweizer Franken und stellt die zusammengefasste Finanzlage aller Teilfonds zum Berichtsdatum dar.

h) Einstandswert der Wertpapiere im Bestand

Für Wertpapiere, die auf andere Währungen als die Währung des jeweiligen Teilfonds lauten, wird der Einstandswert auf der Grundlage der am Kauftag gültigen Wechselkurse errechnet.

i) Dividendenerträge

Dividenden werden am Ex-Datum gebucht. Dividendenerträge werden vor Abzug von Quellensteuer ausgewiesen.

j) Bewertung der Devisentermingeschäfte

Nicht realisierte Gewinne oder Verluste, welche sich zum Berichtszeitpunkt aus der Bewertung von offenen Devisentermingeschäften ergeben, werden zum Berichtsdatum aufgrund der Terminkurse für die restliche Laufzeit bestimmt und sind in der Vermögensaufstellung ausgewiesen.

k) Bewertung der Verbindlichkeiten

Die zum Berichtsstichtag bestehenden Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

**l) Verkauf von herausgegebenen Optionen**

Beim Verkauf von herausgegebenen Optionen werden die erhaltenen Prämien als Verbindlichkeit in der Vermögensaufstellung verbucht und anschließend zum Marktkurs bewertet. Wird eine herausgegebene „Call-Option“ ausgeübt, so werden die erhaltene Prämie in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und die anderen Veränderungen des Nettovermögens als realisierte Werterhöhung aus Optionen ausgewiesen.

**m) Bewertung der Terminkontrakte**

Die Terminkontrakte werden zum letzten verfügbaren Kurs bewertet. Die nicht realisierten Werterhöhungen/Wertminderungen werden in der Vermögensaufstellung erfasst.

**n) Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste**

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilpreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nicht realisierten Gewinne einfließt, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nicht realisierten Verluste einfließt und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

**o) Gründungskosten**

Die Gründungskosten des Fonds können innerhalb der ersten fünf Jahre ab Gründung vollständig abgeschrieben werden. Werden nach Gründung des Fonds zusätzliche Teilfonds eröffnet, können entstandene Gründungskosten, die noch nicht vollständig abgeschrieben wurden, diesen anteilig in Rechnung gestellt werden; ebenso tragen die Teilfonds ihre jeweiligen spezifischen Lancierungskosten. Auch diese können über eine Periode von längstens fünf Jahren nach Lancierungsdatum abgeschrieben werden.

**p) Verfügbare liquide Mittel**

Die in der Vermögensaufstellung angegebene Position „Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten“ beinhaltet neben den liquiden Mitteln der Teilfonds auch die im Rahmen des Handels mit Derivaten zu leistenden Variation Margin-Zahlungen. Diese Beträge werden jeweils als rechnerische Größe in der Position der „Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten“ mitgeführt. Das frei verfügbare, bei der Verwahrstelle hinterlegte Bankguthaben weicht in entsprechender Höhe von der genannten Gesamtsumme der „Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten“ ab.

Das frei verfügbare Bankguthaben der einzelnen Teilfonds beläuft sich nach Abzug der Variation Margin daher auf die folgenden Beträge:

|             |     |              |
|-------------|-----|--------------|
| DCP – 4Plus | CHF | 5.212.002,49 |
|-------------|-----|--------------|

**q) Zusätzliche Informationen zum Bericht**

Dieser Bericht wurde auf Basis des Nettoinventarwertes zum 30. Juni 2023 mit den letzten verfügbaren Kursen zum 30. Juni 2023 und unter Berücksichtigung aller Ereignisse, die sich auf die Rechnungslegung zum Berichtsstichtag am 30. Juni 2023 beziehen, erstellt.

**Erläuterung 2 – Gebühren und Aufwendungen**

Angaben zu Gebühren und Aufwendungen können dem aktuellen Verkaufsprospekt sowie den Basisinformationsblättern entnommen werden.

### **Erläuterung 3 – Kapitalsteuer („taxe d’abonnement“)**

Das Fondsvermögen unterliegt im Großherzogtum Luxemburg einer Steuer („taxe d’abonnement“) von 0,05% p.a., die vierteljährlich auf das jeweils am Quartalsende ausgewiesene Teilfondsvermögen zahlbar ist. Sofern ein Teilfonds oder eine Anteilklasse für die Zeichnung durch institutionelle Anleger beschränkt ist, wird das Nettovermögen dieses Teilfonds bzw. dieser Anteilklasse mit einer reduzierten „taxe d’abonnement“ von jährlich 0,01% besteuert.

Gemäß Artikel 175 (a) des geänderten Gesetzes vom 17. Dezember 2010 ist der Teil des Nettovermögens, der in OGAW angelegt ist, die bereits zur Zahlung der Kapitalsteuer verpflichtet sind, von dieser Steuer befreit.

### **Erläuterung 4 – Ertragsverwendung**

Die vereinnahmten Dividenden- und Zinserträge sowie sonstige ordentliche Erträge werden nach Maßgabe der Verwaltungsgesellschaft für die Anteilklasse „P“ des Teilfonds DCP – 4Plus sowie für die Anteilklassen „IS Dis hedged – EUR“ und „I Dis hedged – EUR“ des Teilfonds DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“) grundsätzlich ausgeschüttet. Für die Anteilklassen „IS Acc – CHF“, „IS Acc hedged – USD“, „I Acc – CHF“ und „I Acc hedged – EUR“ des Teilfonds DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“) ist dagegen eine Thesaurierung vorgesehen.

Nach Maßgabe der Verwaltungsgesellschaft können neben den ordentlichen Nettoerträgen die realisierten Kapitalgewinne, die Erlöse aus dem Verkauf von Bezugsrechten und/oder die sonstigen Erträge nicht wiederkehrender Art sowie sonstige Aktiva, jederzeit ganz oder teil-ausgeschüttet werden. Sofern eine Ausschüttung der Erträge vorgesehen ist, kann abweichend hiervon auf gesonderten Beschluss der Verwaltungsgesellschaft auch eine Thesaurierung der Erträge vorgenommen werden. Sofern eine Thesaurierung der Erträge vorgesehen ist, kann abweichend hiervon auf gesonderten Beschluss der Verwaltungsgesellschaft auch eine Ausschüttung der Erträge vorgenommen werden.

### **Erläuterung 5 – Rückerstattung von Gebühren**

Rückerstattungen von Gebühren eines Zielfonds werden dem Teilfonds unter Abzug einer Bearbeitungsgebühr gutgeschrieben.

### **Erläuterung 6 – Verwaltungsvergütung von Zielfonds**

Sofern der Teilfonds in Anteile eines anderen Investmentfonds (Zielfonds) investiert, können für die erworbenen Zielfondsanteile zusätzliche Verwaltungsgebühren anfallen.

Im Berichtszeitraum war das Nettovermögen der Teilfonds in keine von Axxion S.A. verwalteten Investmentfonds (Zielfonds) investiert.

### **Erläuterung 7 – Wertpapierbestandsveränderungen**

Die Aufstellung der Wertpapierbestandsveränderungen betreffend den Zeitraum dieses Berichts ist kostenlos am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, der Verwahrstelle, sowie bei den Zahl- und Informationsstellen in den verschiedenen Ländern mit einer Vertriebszulassung erhältlich.

## **Erläuterung 8 – Angaben zu den Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365**

Zum Berichtszeitpunkt und während der Berichtsperiode hat der Fonds bzw. Teilfonds keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte entsprechend der Verordnung (EU) 2015/2365 des europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 abgeschlossen.

## **Erläuterung 9 – Weitere Informationen**

### *Mögliche Auswirkungen des Ukraine-Konfliktes*

Die Entwicklungen hinsichtlich des Konfliktes im Osten Europas führten auf den globalen Finanzmärkten teilweise zu signifikanten Abschlüssen und starken Schwankungen. Mittelfristig werden die Rahmenbedingungen der globalen Wirtschaft und damit verbunden die Entwicklung an den Finanzmärkten von erhöhter Unsicherheit geprägt sein. Damit einher geht eine steigende Volatilität an den Finanzplätzen. Insofern unterliegt auch die zukünftige Wertentwicklung des Fonds erhöhten Schwankungsrisiken.

## **Erläuterung 10 – Total Expense Ratio (TER)**

|                                                                                                                 | Gesamtkostenquote<br>(TER) |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|
| DCP – 4Plus P                                                                                                   | 1,32%                      |
| DCP – Hybrid Income IS ACC – CHF<br>(ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund IS ACC – CHF“)               | 0,61%                      |
| DCP – Hybrid Income IS Dis hedged – EUR<br>(ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund IS Dis hedged – EUR“) | 0,66%                      |
| DCP – Hybrid Income IS Acc hedged – USD<br>(ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund IS Acc hedged – USD“) | 0,67%                      |
| DCP – Hybrid Income I Acc – CHF<br>(ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund I Acc – CHF“)                 | 0,81%                      |
| DCP – Hybrid Income I Dis hedged – EUR<br>(ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund I Dis hedged – EUR“)   | 0,87%                      |
| DCP – Hybrid Income I Acc hedged – EUR<br>(ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund I Acc hedged – EUR“)   | 0,87%                      |

Die Gesamtkostenquote drückt die Summe der Kosten und Gebühren als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvolumens innerhalb eines Geschäftsjahres aus. Sie beinhaltet keine Nebenkosten und Kosten, die beim Erwerb und der Veräußerung von Vermögensgegenständen entstehen (Transaktionskosten).

Die Gesamtkostenquote (TER) wurde gemäß der aktuell gültigen „Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen“ der Asset Management Association Switzerland (AMAS) berechnet.