

**Halbjahresbericht
zum 30. Juni 2020**

Daidalos

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 K256

Verwaltungsgesellschaft


AXXION S.A.
R.C.S. Luxembourg B 82 112

Keine Zeichnung darf auf der Grundlage dieses Berichtes entgegengenommen werden. Zeichnungen können nur auf Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes zusammen mit dem Zeichnungsantragsformular, den jeweils gültigen wesentlichen Anlegerinformationen („*Key Investor Information Document*“), dem letzten Jahresbericht und gegebenenfalls dem letzten Halbjahresbericht, falls Letzterer ein späteres Datum als der Jahresbericht trägt, erfolgen.

Inhaltsverzeichnis

Management und Verwaltung	1
Allgemeine Informationen	4
Daidalos.....	6
<i>Konsolidierte Vermögensübersicht.....</i>	<i>6</i>
Daidalos - Multi Asset VI.....	7
<i>Vermögensübersicht.....</i>	<i>7</i>
<i>Vermögensaufstellung.....</i>	<i>8</i>
<i>Wertpapierkurse bzw. Marktsätze</i>	<i>13</i>
<i>Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte.....</i>	<i>14</i>
Daidalos - Multi Asset BP	16
<i>Vermögensübersicht.....</i>	<i>16</i>
<i>Vermögensaufstellung.....</i>	<i>17</i>
<i>Wertpapierkurse bzw. Marktsätze</i>	<i>25</i>
<i>Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte.....</i>	<i>26</i>
Erläuterungen zum Halbjahresbericht	27

Management und Verwaltung

Verwaltungsgesellschaft

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

Eigenkapital per 31. Dezember 2019
EUR 2.749.058

Aufsichtsrat der Verwaltungsgesellschaft¹

Vorsitzender

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

Mitglieder

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

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

Vorstand der Verwaltungsgesellschaft¹

Thomas AMEND
Geschäftsführender Gesellschafter
fo.con S.A., L-GREVENMACHER

Pierre GIRARDET
Mitglied des Vorstands
Axxion S.A., L-GREVENMACHER

Stefan SCHNEIDER
Mitglied des Vorstands
Axxion S.A., L-GREVENMACHER

Abschlussprüfer

KPMG Luxembourg, Société coopérative
39, Avenue John F. Kennedy
L-1855 LUXEMBURG

Verwahrstelle

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

¹ Siehe Erläuterung 9

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Zentralverwaltung /
Register- und Transferstelle

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

Portfoliooverwalter

für den Teilfonds Daidalos – Multi Asset VI

Segment 1:
FAM Frankfurt Asset Management AG
Taunusanlage 1
D-60329 FRANKFURT AM MAIN

Segment 2:
Zantke & Cie. Asset Management GmbH
Marienstraße 43
D-70178 STUTTGART

für den Teilfonds Daidalos – Multi Asset BP

Segment 1:
Fürstlich Castell'sche Bank
Credit-Casse AG
Marktplatz 1
D-97070 WÜRZBURG

Segment 2:
Rothschild & Co. Vermögensverwaltungs-GmbH
Börsenstraße 2-4
D-60313 FRANKFURT AM MAIN

Segment 4:
Diem Client Partner AG
Limmatquai 50
CH-8001 ZÜRICH

Segment 5:
Zantke & Cie. Asset Management GmbH
Marienstraße 43
D-70178 STUTTGART

Anlageberater

für den Teilfonds Daidalos – Multi Asset BP

Segment 3:
FONTIS Advisory Office GmbH
Löffelstraße 4
D-70597 STUTTGART

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

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

Allgemeine Informationen

Der Investmentfonds Daidalos (nachfolgend als „Fonds“ bezeichnet) ist ein nach Luxemburger Recht als Umbrellafonds mit der Möglichkeit der Auflegung verschiedener Tealfonds in der Form eines „Fonds commun de placement à compartiments multiples“ errichtetes Sondervermögen aus Wertpapieren und sonstigen Vermögenswerten. Der Fonds unterliegt den Bedingungen gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen.

Es werden derzeit Anteile der folgenden Teilfonds angeboten:

Daidalos – Multi Asset VI in EUR (im Folgenden „Multi Asset VI“ genannt)

Daidalos – Multi Asset BP (im Folgenden „Multi Asset BP“ genannt) in EUR

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 20. Februar 2020 im „Registre de Commerce et des Sociétés (RCS)“ veröffentlicht.

Die Rechnungslegung für den Fonds und seine Teilfonds erfolgt in Euro.

Gemäß Artikel 7 des Verwaltungsreglements wird der Nettoinventarwert 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 ist eine abweichende Regelung getroffen. Abweichend hiervon gilt für beide Teifonds als Bewertungstag jeder Freitag mit Ausnahme des 24. Dezember; falls dieser Tag kein Luxemburger Bankarbeitstag ist, ist der nächstfolgende Bankarbeitstag in Luxemburg der Bewertungstag.

Das Geschäftsjahr des Fonds beginnt grundsätzlich jeweils am 1. Januar und endet am 31. Dezember des gleichen Jahres. Das erste verlängerte Geschäftsjahr endete am 31. Dezember 2014 und umfasste den Zeitraum vom 4. November 2013 (Datum der Fondsgründung) bis zum 31. Dezember 2014. Der erste geprüfte Jahresbericht wurde zum 31. Dezember 2014 und der erste ungeprüfte Halbjahresbericht wurde zum 30. Juni 2014 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- und Informationsstellen 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.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Die wesentlichen Anlegerinformationen („Key Investor Information Document“) können auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft (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) veröffentlicht werden.

Aktuell werden Ausgabe- und Rücknahmepreise auf der Internetseite www.axxion.lu veröffentlicht. Hier können auch der aktuelle Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen („Key Investor Information Document“) 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 veröffentlicht. Darüber hinaus werden in gesetzlich vorgeschriebenen Fällen für das Großherzogtum Luxemburg Mitteilungen auch auf der elektronischen Plattform „Luxembourg Business Register“ (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.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos

Konsolidierte Vermögensübersicht zum 30. Juni 2020

	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	77.150.308,20	100,08
1. Aktien		
Belgien	20.491.316,55	26,58
Bundesrep. Deutschland	300.840,00	0,39
Frankreich	5.581.096,00	7,24
Großbritannien	3.389.366,10	4,39
Irland	561.824,63	0,73
Kaimaninseln	280.933,75	0,36
Kanada	213.419,66	0,28
Luxemburg	692.085,37	0,90
Niederlande	17.016,00	0,02
Schweiz	783.615,83	1,02
Spanien	946.083,24	1,23
USA	28.218,00	0,04
	7.696.817,97	9,98
2. Anleihen	32.459.424,64	42,11
< 1 Jahr	460.508,81	0,60
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	3.846.294,25	4,99
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	5.406.886,04	7,01
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	13.096.762,42	16,99
>= 10 Jahre	9.648.973,12	12,52
3. Zertifikate	1.699.338,80	2,20
Euro	1.699.338,80	2,20
4. Sonstige Beteiligungswertpapiere	2.628.376,37	3,41
Euro	223.571,00	0,29
Schweizer Franken	899.819,33	1,17
US-Dollar	1.504.986,04	1,95
5. Investmentanteile	15.030.620,00	19,50
Britische Pfund	117.279,98	0,15
Euro	14.131.144,96	18,33
US-Dollar	782.195,06	1,02
6. Derivate	-1.063.219,99	-1,38
7. Bankguthaben	5.580.053,24	7,24
8. Sonstige Vermögensgegenstände	324.398,59	0,42
II. Verbindlichkeiten	-64.412,03	-0,08
III. Fondsvermögen	77.085.896,17	100,00

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2020

	Tageswert in EUR	% Anteil am Teilfondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	16.368.859,62	100,11
1. Aktien		
Bundesrep. Deutschland	1.210.738,76	7,40
Frankreich	615.117,50	3,76
Niederlande	116.468,10	0,71
Schweiz	355.990,33	2,18
	123.162,83	0,75
2. Anleihen	11.232.853,16	68,70
< 1 Jahr	61.556,74	0,38
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	1.418.349,19	8,68
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	2.681.956,92	16,40
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	4.379.172,20	26,78
>= 10 Jahre	2.691.818,11	16,46
3. Zertifikate	655.166,30	4,01
Euro	655.166,30	4,01
4. Sonstige Beteiligungswertpapiere	1.569.007,04	9,60
Euro	64.021,00	0,39
US-Dollar	1.504.986,04	9,21
5. Investmentanteile	1.855.943,62	11,35
Euro	1.855.943,62	11,35
6. Derivate	-463.089,06	-2,83
7. Bankguthaben	208.467,40	1,27
8. Sonstige Vermögensgegenstände	99.772,40	0,61
II. Verbindlichkeiten	-18.176,80	-0,11
III. Teilfondsvermögen	16.350.682,82	100,00

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
Bestandspositionen									
Amtlich gehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Swatch Group AG, The Inhaber-Aktien SF 2,25	CH0012255151	STK	700	700			EUR	16.523.708,88	101,06
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005	STK	1.000	1.000			EUR		
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628	STK	6.255	6.255			EUR	180.2200	1,10
BASF SE Namens-Aktien o.N.	DE000BASF111	STK	2.500				EUR	18,6200	0,71
Bayer AG Namens-Aktien o.N.	DE000BAY0017	STK	2.525				EUR	50,1300	0,77
HUGO BOSS AG Namens-Aktien o.N.	DE000A1PHFF7	STK	3.000				EUR	66,9000	1,03
thyssenkrupp AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007500001	STK	10.000				EUR	26,3500	0,48
Unilever N.V. Aandelen op naam EO -16	NL0000388619	STK	2.300	2.300			EUR	6,1600	0,38
trivago N.V. Aand.op n.A (Sp.ADS)/1 EO,-06	US89686D1054	STK	139.700				USD	47,8300	0,67
								1,9800	245.981,33
Verzinsliche Wertpapiere									
3,6250 % Nestlé Holdings Inc. AD-Medium-Term Notes 2014(20)	XS1130303305	AUD	100				%	101,0300	61.556,74
0,7750 % Cellnex Telecom S.A. SF-Med.-Term Notes 2020(27)	CH0506071148	CHF	50	50			%	97,5870	45.677,39
2,5000 % HOCHDORF Holding AG SF-FLR Anl. 2017(23/Und.)	CH0391647986	CHF	165	165			%	65,3500	100.941,29
1,8000 % AT & T Inc. EO-Notes 2019(19/39)	XS2051362312	EUR	100				%	94,0680	94.068,00
3,5000 % Banijay Entertainment S.A.S. EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2112340679	EUR	100	100			%	95,5360	95.536,00
0,8000 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2017(17/22)	XS1577747782	EUR	200				%	100,4690	200.938,00
1,5000 % Ceske Dravy AS EO-Notes 2019(19/26)	XS1991190361	EUR	100				%	100,4630	100.463,00
1,2500 % Citycon Treasury B.V. EO-Notes 2016(16/26)	XS1485608118	EUR	100				%	84,3670	84.367,00
0,5000 % Colgate-Palmolive Co. EO-Bonds 2019(19/26)	XS1958646082	EUR	300				%	102,3440	307.032,00
0,8750 % DS Smith PLC EO-Medium-Term Nts 2019(19/26)	XS2051777873	EUR	100				%	96,5910	96.591,00
1,6250 % Elis S.A. EO-Med.-Term Nts 2019(19/28)	FR0013449998	EUR	100				%	91,4830	91.483,00
4,1960 % Eramet S.A. EO-Obl. 2017(17/24)	FR0013284643	EUR	200				%	88,1250	176.250,00
4,8750 % Eurofins Scientific S.E. EO-FLR Notes 2015(23/Und.)	XS1224953882	EUR	200				%	103,4680	206.936,00
1,8750 % G4S International Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2018(25/25)	XS1824462896	EUR	100				%	97,3770	97.377,00
1,5000 % Iliad S.A. EO-Obl. 2017(17/24)	FR0013287273	EUR	100				%	98,4290	98.429,00
3,6250 % Infineon Technologies AG Sub.-FLR-Nts.v.19(28/unb.)	XS2056730679	EUR	100				%	99,7520	99.752,00
1,5000 % Internat. Cons. Airl. Group SA EO-Bonds 2019(19/27)	XS2020581752	EUR	200				%	76,2430	152.486,00
2,8750 % Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2019(2029/2079)	XS2011260705	EUR	200				%	104,4020	208.804,00
2,2500 % Neopost S.A. EO-Obl. 2020(20/25)	FR0013478849	EUR	100	100			%	95,7970	95.797,00
2,1250 % NGG Finance PLC EO-FLR Notes 2019(27/28)	XS2010045511	EUR	100				%	98,4970	98.497,00
0,5000 % Novartis Finance S.A. EO-Notes 2018(18/23)	XS1769040111	EUR	300				%	101,7430	305.229,00
1,7500 % O2 Telefónica Dtd. Finanzier. Anleihe v.2018(2018/2025)	XS1851313863	EUR	200				%	105,1090	210.218,00
6,2500 % OMV AG EO-FLR Notes 2015(25/Und.)	XS1294343337	EUR	100				%	117,3200	117.320,00
0,8000 % Philip Morris Internat. Inc. EO-Notes 2019(19/31)	XS2035474126	EUR	100				%	95,2610	95.261,00
2,5000 % RCS & RDS SA EO-Bonds 2020(20/25) Reg.S	XS2107451069	EUR	100	100			%	95,8600	95.860,00
3,8750 % SAZKA Group AS EO-Bonds 2020(20/27)Reg.S	XS2113253210	EUR	100	100			%	90,6790	90.679,00
1,5000 % SEB S.A. EO-Notes 2017(17/24)	FR0013259116	EUR	100				%	101,2710	101.271,00
5,6250 % SES S.A. EO-FLR Notes 2016(24/Und.)	XS1405765659	EUR	100				%	102,8760	102.876,00
3,0000 % SGL CARBON SE Wandelschuldv.v.18(23)	DE000A2C8VX7	EUR	100	100			%	64,5000	64.500,00
5,7500 % Sigma Holdco B.V. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1813504666	EUR	150				%	97,9340	146.901,00
6,5000 % Stichting AK Rabobank Cert. EO-FLR Certs 2014(UND.)	XS1002121454	EUR	100				%	106,0820	106.082,00
2,6970 % Südzucker Intl Finance B.V. EO-FLR Bonds 2005(15/Und.)	XS0222524372	EUR	100				%	79,6240	79.624,00
4,1250 % Tereos Finance Groupe I EO-Obl. 2016(23/23)	FR0013183571	EUR	100	100			%	87,1150	87.115,00
0,1250 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2019(19/25)	XS2058556296	EUR	200				%	98,6890	197.378,00
2,8750 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-FLR Bonds 2018(26/Und.)	FR0013330537	EUR	100				%	88,8150	88.815,00
0,8750 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2019(19/32)	XS2052320954	EUR	150				%	98,4300	147.645,00
2,7500 % Wienerberger AG EO-Schuldv. 2020(20/25)	AT0000A2GLA0	EUR	100	100			%	101,8000	101.800,00
2,0000 % ZF Europe Finance B.V. EO-Notes 2019(19/26)	XS2010039381	EUR	100				%	92,7490	92.749,00
1,7500 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. LS-Medium-Term Nts 2017(17/25)	BE6295391914	GBP	100				%	103,2750	112.670,60
4,2500 % BP Capital Markets PLC LS-FLR Notes 2020(27/Und.)	XS2193663619	GBP	100	100			%	100,4310	109.567,86

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
1,6250 % Daimler Intl Finance B.V. LS-Medium-Term Notes 2019(24)	XS2078691636	GBP	100			%	99,4230	108.468,16	0,66
1,8750 % ESB Finance DAC LS-Medium-Term Nts 2020(20/35)	XS2105811116	GBP	100	100		%	106,6730	116.377,74	0,71
3,2500 % Pinewood FinCo PLC LS-Notes 2019(21/25) Reg.S	XS2052466815	GBP	100			%	98,8940	107.891,03	0,66
2,2500 % Prologis L.P. LS-Notes 2017(17/29)	XS1577961862	GBP	100			%	105,6050	115.212,58	0,70
3,8750 % TalkTalk Telecom Group PLC LS-Bonds 2020(22/25)	XS2121167345	GBP	100	100		%	96,4540	105.229,05	0,64
1,5000 % Norwegen, Königreich NK-Anl. 2016(26)	NO0010757925	NOK	2.000			%	105,9830	194.501,69	1,19
4,8750 % Anglo American Capital PLC DL-Notes 2015(15/25) Reg.S	USG0446NAJ30	USD	200			%	111,1020	197.602,49	1,21
4,7500 % Fresenius Med.C.US Fin.II Inc. DL-Notes 2014(14/24) Reg.S	USU31434AE08	USD	100			%	109,2020	97.111,61	0,59
5,6500 % Network i2i Ltd. DL-FLR Secs 2019(25/Und.)Reg.S	USV6703DAA29	USD	200			%	96,9890	172.501,56	1,06
6,2500 % Vodafone Group PLC DL-FLR Cap.Sec. 2018(24/78)	XS1888180640	USD	200			%	107,4060	191.028,90	1,17
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	6.644.700,81	40,64	
Verzinsliche Wertpapiere									
1,6250 % Albemarle New Holding GmbH Bonds v.19(19/28)Reg.S	XS2083147343	EUR	100			%	95,7150	95.715,00	0,59
2,0000 % Ashland Services B.V. EO-Notes 2020(20/28) Reg.S	XS2103218538	EUR	100	100		%	93,4780	93.478,00	0,57
2,8750 % AT & T Inc. EO-FLR Pref.Secs 2020(25/Und.)	XS2114413565	EUR	200	200		%	95,0970	190.194,00	1,16
5,2500 % CMA CGM S.A. EO-Notes 2017(17/25) Reg.S	XS1730365620	EUR	250			%	82,6620	206.655,00	1,26
1,7500 % CNAC (HK) Finbridge Co. Ltd. EO-Notes 2018(18/22)	XS1791704189	EUR	200			%	99,6370	199.274,00	1,22
7,0000 % DKT Finance ApS EO-Bonds 2018(18/23) Reg.S	XS1841967356	EUR	150	150		%	99,8480	149.772,00	0,92
1,7500 % DXC Technology Co. EO-Notes 2018(18/26)	XS1883245331	EUR	100			%	98,5800	98.580,00	0,60
1,6980 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2019(19/26)	XS2034622048	EUR	100			%	98,8780	98.878,00	0,60
4,2500 % Huntsman International LLC EO-Notes 2016(16/25)	XS1395182683	EUR	100			%	106,4320	106.432,00	0,65
3,0000 % Indra Sistemas S.A. EO-Bonds 2018(18/24)	XS1809245829	EUR	100			%	101,7170	101.717,00	0,62
3,6250 % James Hardie Intl Finance DAC EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1888221261	EUR	100			%	102,3430	102.343,00	0,63
1,7500 % Mohawk Capital Finance S.A. EO-Notes 2020(20/27)	XS2177443343	EUR	100	100		%	103,0410	103.041,00	0,63
2,8750 % Ol European Group B.V. EO-Notes 2019(19/25) Reg.S	XS2077666316	EUR	100			%	96,6280	96.628,00	0,59
2,5000 % Otto (GmbH & Co KG) MTN v.2016(2016/2023)	XS1433512891	EUR	100			%	100,3470	100.347,00	0,61
3,1250 % PPF Telecom Group B.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/26)	XS1969645255	EUR	100			%	99,9800	99.980,00	0,61
2,0000 % Q-Part Holding I B.V. EO-Notes 2020(20/27) Reg.S	XS2115190451	EUR	100	100		%	93,2870	93.287,00	0,57
1,5000 % Smurfit Kappa Treasury PUC EO-Notes 2019(19/27)	XS2050968333	EUR	100			%	95,8920	95.892,00	0,59
2,2500 % Standard Industries Inc. EO-Notes 2019(19/26) Reg.S	XS2080766475	EUR	100	100		%	94,2640	94.264,00	0,58
2,0000 % Techem Verwaltungsges.675 mbH Sen.Notes v.20(22/25)Reg.S	XS2090816526	EUR	100	100		%	95,8030	95.803,00	0,59
1,3750 % Telia Company AB EO-FLR Securities 2020(26/81)	XS2082429890	EUR	100	100		%	94,4620	94.462,00	0,58
4,4000 % UniCredit Bank AG HVB Bonitaet 14(21) ARRB	DE000HV5LXE5	EUR	200			%	100,6100	201.220,00	1,23
3,1250 % United Group B.V. EO-Bonds 2020(20/26)	XS2111946930	EUR	100	100		%	94,8490	94.849,00	0,58
4,1250 % Vallourec S.A. EO-Conv. Bonds 2017(22)	FR0013285046	EUR	13.000	13.000		%	4,5010	58.513,00	0,36
0,8400 % Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/25)	XS2054209833	EUR	200			%	95,0150	190.030,00	1,16
1,8230 % Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/31)	XS2050579904	EUR	100			%	94,1150	94.115,00	0,58
3,3750 % Zigg Bond Co. B.V. EO-Notes 2020(20/30) Reg.S	XS2116386132	EUR	100	100		%	94,5250	94.525,00	0,58
2,0000 % 3M Co. DL-Notes 2019(19/25)	US88579YBH36	USD	30		70	%	105,3400	28.103,16	0,17
2,3000 % Adobe Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US00724PAD15	USD	100	100		%	108,3830	96.383,28	0,59
2,4500 % Amgen Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US031162CU27	USD	200	200		%	105,6850	187.967,99	1,15
2,6500 % Avery Dennison Corp. DL-Notes 2020(20/30)	US053611AK55	USD	100	100		%	102,3000	90.973,77	0,56
5,5000 % Barry Callebaut Services N.V. DL-Notes 2013(23) Reg.S	BE6254003252	USD	200			%	108,0920	192.249,00	1,18
4,8750 % Berry Global Escrow Corp. DL-Notes 2019(19/26) Reg.S	USU0740VAA18	USD	100			%	101,0200	89.835,48	0,55
2,7000 % eBay Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US278642AW32	USD	100	100		%	105,1860	93.540,24	0,57
3,5500 % Hasbro Inc. DL-Notes 2019(19/26)	US418056AY31	USD	100			%	105,3620	93.696,75	0,57
2,2000 % HP Inc. DL-Notes 2020(20/25)	US40434LA435	USD	100	100		%	103,3560	91.912,85	0,56
3,6250 % MSCI Inc. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USU5521TAG77	USD	200	200		%	99,4900	176.949,76	1,08
1,5000 % United States of America DL-Notes 2019(22)	US912828YF19	USD	250			%	102,9688	228.921,19	1,40
Zertifikate									
Ardilla Segur S.A. NTS 28.12.40 Fund	XS0599782686	STK	5			EUR	63.108,5500	315.542,75	1,93
Guardian Segur S.A. Zertifikate 30.12.33	XS0980340136	STK	315			EUR	1.078,1700	339.623,55	2,08

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens	
Sonstige Beteiligungswertpapiere										
Ardilla Segur S.A. Inh.Gen. 2014/2024 EO 1000	LU1114452144	STK	100				EUR	640,2100	64.021,00	
Ardilla Segur S.A. Inh.Gen. 2014/2029 DL 1000	LU1072258111	STK	1.360				USD	1.244,3800	1.504.986,04	
Neuemissionen										
Zulassung zum Börsenhandel vorgesehen										
Verzinsliche Wertpapiere										
1,5000 % Comcast Corp. LS-Notes 2020(20/29)	XS2114853299	GBP	100	100			%	102,6180	111.953,83	
Nichtnotierte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
12,0000 % Allg.Ges.f.Verbrief.SA Comp.11 EO-FLR Nts12(25)'LUPUS CLO' 2,5650 % Otis Worldwide Corp. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	XS0828893700 USU68356AF86	STK USD	100 200		200		EUR %	1.405,3200 105,3500	140.532,00 187.372,17	
Investmentanteile										
Gruppeneigene Investmentanteile										
Rothschild & Co WM - Aktien Actions au Porteur I o.N.	LU1272153831	ANT	2.050	4.100	2.050	EUR		135,8200	278.431,00	
Gruppenfremde Investmentanteile										
AGIF-Allianz Credit Opportuni. Inhaber-Anteile WT9 (EUR) o.N. Alegria High Grade ABS Portfol. Inhaber-Anteile o.N. iShare.Nikkei 225 UCITS ETF DE Inhaber-Anteile PAYDEN GBL-Pay.Gbl Em.Mkts Bd Registered Shs. Class EUR o.N.	LU1797226666 LI0027320568 DE000A0H08D2 IE00B04NLM33	ANT ANT ANT ANT	8 368 6.420 5.436	8 368 368	368	EUR EUR EUR EUR		102.232,3200 1.445,7600 18,5120 20,0102	817.858,56 532.039,68 118.847,04 108.767,34	
Summe Wertpapiervermögen										
						EUR			16.523.708,88	
									101,06	
Derivate										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)							EUR		-463.089,06	
									-2,83	
Derivate auf einzelne Wertpapiere										
Wertpapier-Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktien										
Cie Financiere Richemont SA PUT 60.00 18.12.2020 Straumann Holding AG PUT 640.00 18.12.2020 Chr Hansen Holding A/S PUT 460.00 18.12.2020 Allianz SE CALL 165.00 18.09.2020 AXA SA PUT 18.00 18.09.2020 BASF SE PUT 56.00 18.12.2020 Bayer AG PUT 62.00 18.12.2020 Bayerische Motoren Werke AG PUT 46.00 18.09.2020 Continental AG PUT 88.00 18.12.2020	EUREX EUREX XCSE EUREX EUREX EUREX EUREX EUREX EUREX	-101.777 -188.632 -226.956 -180.220 -139.650 -100.260 -167.250 -147.446 -113.386	STK STK STK STK STK STK STK STK STK	-18 -25 -25 -10 -75 -20 -25 -26 -13		18 25 25 10 75 20 26 26 13	CHF CHF DKK EUR EUR EUR EUR EUR	5,8500 21.8300 6,2000 21.4200 1.3100 8.1800 4.2900 1.2700 11.9500	-9.857,52 -5.108,97 -0,03 -21.420,00 -9.825,00 -16.360,00 -10.725,00 -3.302,00 -15.535,00	-0,06 -0,03 -0,01 -0,13 -0,06 -0,10 -0,07 -0,02 -0,09

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Verpflichtung	Stück bzw.	Bestand	Käufe /	Verkäufe /	Kurs	Kurswert	% des
	Markt		Anteile bzw.	30.06.2020	Zugänge	Abgänge		in EUR	Teilfonds-
			Whg. in 1.000		im Berichtszeitraum				vermögens
Kering SA PUT 380.00 19.03.2021	EUREX	-144.375	STK	-3			3 EUR	23,4100	-7.023,00
SAP SE PUT 88.00 18.12.2020	EUREX	-208.148	STK	-17			EUR	2,1500	-3.655,00
Technogym SpA PUT 9.00 18.12.2020	EUREX	-90.688	STK	-25			25 EUR	1,7678	-22.097,50
Unilever NV CALL 50.00 18.12.2020	EUREX	-110.009	STK	-23			23 EUR	1,7100	-3.933,00
BP PLC PUT 4.80 18.09.2020	XLON	-92.758	STK	-27			27 GBP	1,6950	-49.928,54
Burberry Group PLC PUT 12.00 19.03.2021	XLON	-138.161	STK	-8			8 GBP	0,7250	-6.327,66
Acuity Brands Inc PUT 90.00 18.12.2020	CBOE	-79.440	STK	-10			10 USD	12,5000	-11.116,05
Alphabet Inc PUT 1100.00 18.06.2021 (Cl. C)	CBOE	-124.052	STK	-1			1 USD	66,0000	-5.869,28
Barrick Gold Corp PUT 18.00 15.01.2021	CBOE	-151.040	STK	-65			65 USD	0,6450	-3.728,32
Berkshire Hathaway Inc PUT 145.00 15.01.2021	CBOE	-141.815	STK	-9			9 USD	4,7000	-3.761,67
Carnival Corp PUT 15.00 16.10.2020	CBOE	-150.714	STK	-101			101 USD	3,4000	-30.538,02
Cisco Systems Inc PUT 40.00 18.09.2020	CBOE	-164.162	STK	-40			USD	1,1700	-4.161,85
Facebook Inc PUT 170.00 18.09.2020	CBOE	-176.590	STK	-9			USD	3,2000	-2.561,14
Newmont Corp PUT 45.00 18.12.2020	CBOE	-158.844	STK	-30			30 USD	1,8100	-4.828,81
Aktienindex-Derivate							EUR		-188.908,10
Optionsrechte									-1,16
Optionsrechte auf Aktienindices									
DAX Index PUT 10500.00 18.12.2020	EUREX	-428.124	STK	-7			7 EUR	478,4000	-16.744,00
DAX Index PUT 9000.00 18.12.2020	EUREX	-366.964	STK	-6			6 EUR	241,6000	-7.248,00
EURO STOXX 50 Index PUT 20000.00 19.03.2021	EUREX	-517.123	STK	-16			16 EUR	41,0000	-6.560,00
EURO STOXX 50 Index PUT 23000.00 18.06.2021	EUREX	-226.241	STK	-7			7 EUR	87,9000	-6.153,00
EURO STOXX 50 Index PUT 24000.00 18.12.2020	EUREX	-452.483	STK	-14			14 EUR	58,1000	-8.134,00
EURO STOXX 50 Index PUT 24000.00 19.03.2021	EUREX	-387.842	STK	-12			12 EUR	81,1000	-9.732,00
EURO STOXX 50 Index PUT 25000.00 18.06.2021	EUREX	-387.842	STK	-12			12 EUR	119,3000	-14.316,00
EURO STOXX 50 Index PUT 28000.00 18.09.2020	EUREX	-452.483	STK	-14			EUR	64,8000	-9.072,00
EURO STOXX 50 Index PUT 29000.00 18.12.2020	EUREX	-387.842	STK	-12			EUR	142,6000	-17.112,00
EURO STOXX 50 Index PUT 30000.00 18.06.2021	EUREX	-420.163	STK	-13			13 EUR	244,9000	-31.837,00
EURO STOXX 50 Index PUT 30000.00 18.12.2020	EUREX	-420.163	STK	-13			13 EUR	169,3000	-22.009,00
S&P 500 Index PUT 2100.00 17.12.2021	CBOE	-543.040	STK	-2			2 USD	115,0000	-20.453,53
S&P 500 Index PUT 2300.00 18.06.2021	CBOE	-543.040	STK	-2			2 USD	109,8500	-19.537,57
Devisen-Derivate							EUR		-20.437,93
Devisenterminkontrakte									
Offene Positionen									
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC		Kauf-	Kauf-	Verkauf-	Verkauf-			
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC		währung	betrag	währung	betrag			
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC		EUR	1.800.000,00	USD	-2.022.440,40			
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC			800.000,00	USD	-902.424,80			
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC			968.115,82	USD	-1.080.000,00			
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC			1.989.585,00	EUR	-1.800.000,00			
							Fälligkeit		
							21.09.2020	4.702,44	0,03
							01.10.2020	-885,35	0,00
							30.09.2020	9.612,79	0,06
							21.09.2020	-33.867,81	-0,21

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten									
							EUR	208.467,40	1,27
Kassenbestände							EUR	208.467,40	1,27
Verwahrstelle									
			AUD	1.027,55				626,08	0,00
			CHF	-2.984,59				-2.793,98	-0,02
			CNY	110,96				13,93	0,00
			EUR	168.682,39				168.682,39	1,03
			GBP	6.817,80				7.438,06	0,05
			JPY	73.046,00				602,94	0,00
			NOK	30.181,19				2.769,45	0,02
			NZD	810,45				462,08	0,00
			SEK	8.355,08				798,12	0,01
			USD	33.586,94				29.868,33	0,18
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	99.772,40			EUR	99.772,40	0,61
								99.772,40	0,61
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verwaltungsvergütung			EUR	-8.182,18			EUR	-18.176,80	-0,11
Betreuungsgebühr			EUR	-1.090,21				-8.182,18	-0,05
Zentralverwaltungsvergütung			EUR	-1.045,11				-1.090,21	-0,01
Verwahrstellenvergütung			EUR	-529,76				-1.045,11	-0,01
Register- und Transferstellenvergütung			EUR	-125,00				-529,76	0,00
Taxe d'Abonnement			EUR	-1.907,04				-125,00	0,00
Prüfungskosten			EUR	-4.915,00				-1.907,04	-0,01
Sonstige Kosten			EUR	-382,50				-4.915,00	-0,03
								-382,50	0,00
Teilfondsvermögen									
Daidalos - Multi Asset VI P							EUR	16.350.682,82	100,00 ¹⁾
Anzahl Anteile							STK	146.160,000	
Anteilwert							EUR	111,87	

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.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI
Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 29.06.2020	
Australische Dollar	(AUD)	1,6412500	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	1,0682200	= 1 Euro (EUR)
Yuan Renminbi	(CNY)	7,9627000	= 1 Euro (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,4530000	= 1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,9166100	= 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	121,1500000	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	10,8979000	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland-Dollar	(NZD)	1,7539000	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	10,4684000	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,1245000	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

EUREX	Eurex Deutschland
CBOE	Chicago - CBOE Opt. Ex.
XCSE	Nasdaq Kopenhagen A/S
XLON	London - Stock Exchange

OTC

Over-the-Counter

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldcheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Amtlich gehandelte Wertpapiere				
Aktien				
CompuGroup Medical SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0005437305	STK	3.000	3.000
GAM Holding AG Nam.-Aktien SF -,05	CH0102659627	STK	26.700	26.700
Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06	FI0009000681	STK		17.500
SES S.A. Bearer FDRs (rep.Shs A) o.N.	LU0088087324	STK	15.300	15.300
United Internet AG Namens-Aktien o.N.	DE0005089031	STK		3.000
Verzinsliche Wertpapiere				
1,2500 % AbbVie Inc. EO-Notes 2019(19/31)	XS2055647213	EUR		100
4,1500 % Anheuser-Busch InBev Ww Inc. DL-Notes 2019(19/25)	US03523TBX54	USD		100
2,2500 % ArcelorMittal S.A. EO-Medium-Term Notes 19(19/24)	XS1936308391	EUR		100
0,6250 % Bayer Capital Corp. B.V. EO-Notes 2018(18/22)	XS1840614900	EUR		200
0,7500 % Berkshire Hathaway Inc. EO-Notes 2015(15/23)	XS1200670955	EUR		300
0,5000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/22)	XS1637332856	EUR		200
1,1250 % Bureau Veritas SA EO-Notes 2019(19/27)	FR0013460607	EUR		100
2,1250 % Celanese US Holdings LLC EO-Notes 2018(18/27)	XS1901137361	EUR		200
0,8750 % CK Hutchison Fin. (16) II Ltd. EO-Notes 2016(24)	XS1497312295	EUR		200
0,8750 % Covestro AG Medium Term Notes v.20(25/26)	XS2188805688	EUR	100	100
1,7500 % Danone S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 17(23/Und.)	FR0013292828	EUR		100
0,7500 % DH Europe Finance II S.à r.l. EO-Notes 2019(19/31)	XS2050406094	EUR		100
1,7500 % DSV Panalpina A/S EO-Anl. 2017(17/24)	DK0030403993	EUR		100
2,5000 % Dufry One B.V. EO-Notes 2017(17/24)	XS1699848914	EUR	100	100
1,7000 % EDP - Energias de Portugal SA EO-FLR Securities 2020(25/80)	PTEDPLOM0017	EUR	100	100
1,1250 % EnBW Energie Baden-Württem. AG FLR-Anleihe v.19(24/79)	XS2035564975	EUR		100
2,1250 % Eurofins Scientific S.E. EO-Notes 2017(17/24)	XS1651444140	EUR		200
1,5000 % G4S International Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2016(23)4	XS1515216650	EUR		100
1,5000 % Grekne Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2018(23)	XS1910851242	EUR		150
1,1250 % Heimstaden Bostad AB EO-Medium-Term Nts 2020(20/26)	XS2105772201	EUR	100	100
1,2500 % HOCHTIEF AG MTN v.2019(2031/2031)	DE000A2YN2V0	EUR		100
2,0000 % JAB Holdings B.V. EO-Notes 2017(28)	DE000A19HCX8	EUR		100
4,0000 % Louis Dreyfus Company B.V. EO-Notes 2013(20)	XS1000918018	EUR		100
1,5000 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2019(19/39)	XS2020670936	EUR		200
1,4000 % Omnicom Finance Holdings PLC EO-Notes 2019(19/31)	XS2019815062	EUR		100
1,8750 % PerkinElmer Inc. EO-Notes 2016(16/26)	XS1405780617	EUR		100
1,3750 % Procter & Gamble Co., The LS-Notes 2017(17/25)	XS1608101066	GBP		100
1,0000 % Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB EO-Med.-Term Notes 2020(20/27)	XS2114871945	EUR	100	100
1,6250 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2016(16/28)	XS1439749364	EUR		200
4,1000 % Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/46)	US88167AAF84	USD		60
0,8750 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2019(19/31)	XS2058556619	EUR		100
1,4500 % Transurban Finance Co. Pty Ltd EO-Medium-Term Nts 2019(19/29)	XS1997077364	EUR		100
1,2890 % Ubisoft Entertainment S.A. EO-Bonds 2018(18/23)	FR0013313186	EUR		100
2,6250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Notes 2018(27)	XS1910948162	EUR		200
1,1640 % Zimmer Biomet Holdings Inc. EO-Notes 2019(19/27)	XS2079105891	EUR		100

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere			
4,6250 % Entertainment One Ltd. LS-Notes 2019(19/26) Reg.S	XS1843434520	GBP	100
1,0000 % Hamburg Commercial Bank AG Oster-MarktZins Cap 15(20)	DE000HSH4YE6	EUR	200
4,2500 % Hikma Pharmaceuticals PLC DL-Notes 2015(20)	XS1213834978	USD	200
8,7500 % Kirk Beauty One GmbH IHS v.2015(2018/2023) REG S	XS1251078694	EUR	100

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldverschreibungen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
1,6250 % LYB International Fin. II B.V. EO-Notes 2019(19/31)	XS2052313827	EUR		100
4,2500 % Nestlé Holdings Inc. AD-Medium-Term Notes 2014(20)	XS1045934293	AUD		100
2,6250 % PepsiCo Inc. DL-Notes 2019(19/29)	US713448EL82	USD		100
2,1250 % PPF Telecom Group B.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/25)	XS2078976805	EUR		150
2,2500 % Standard Industries Inc. EO-Nts 2020(20/26) Reg.S Tr.2	XS2105737394	EUR	100	100
4,7500 % Total Capital Intl S.A. ND-Medium-Term Notes 2014(20)	XS1116262277	NZD		200

Investmentanteile

Gruppenfremde Investmentanteile

CONVERTINVEST Gl.Conv.Property. Inhaber-Anteile I A F o.N.

AT0000A1EKN2	ANT	5.000
--------------	-----	-------

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2020

	Tageswert in EUR	% Anteil am Teilfondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	60.781.448,58	100,08
1. Aktien		
Belgien	19.280.577,79	31,75
Bundesrep. Deutschland	300.840,00	0,50
Frankreich	4.965.978,50	8,18
Großbritannien	3.272.898,00	5,39
Irland	561.824,63	0,93
Kaimaninseln	280.933,75	0,46
Kanada	213.419,66	0,35
Luxemburg	692.085,37	1,14
Niederlande	17.016,00	0,03
Schweiz	427.625,50	0,70
Spanien	822.920,41	1,35
USA	28.218,00	0,05
	7.696.817,97	12,67
2. Anleihen	21.226.571,48	34,95
< 1 Jahr	398.952,07	0,66
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	2.427.945,06	4,00
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	2.724.929,12	4,49
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	8.717.590,22	14,35
>= 10 Jahre	6.957.155,01	11,45
3. Zertifikate	1.044.172,50	1,72
Euro	1.044.172,50	1,72
4. Sonstige Beteiligungswertpapiere	1.059.369,33	1,74
Euro	159.550,00	0,26
Schweizer Franken	899.819,33	1,48
5. Investmentanteile	13.174.676,38	21,69
Britische Pfund	117.279,98	0,19
Euro	12.275.201,34	20,21
US-Dollar	782.195,06	1,29
6. Derivate	-600.130,93	-0,99
7. Bankguthaben	5.371.585,84	8,85
8. Sonstige Vermögensgegenstände	224.626,19	0,37
II. Verbindlichkeiten	-46.235,23	-0,08
III. Teilfondsvermögen	60.735.213,35	100,00

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
Bestandspositionen									
Amtlich gehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien SF 1	CH0210483332	STK	5.000	5.000			EUR	55.785.367,48	91,85
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350	STK	4.500				CHF	282.713,30	0,47
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005	STK	4.200	1.500			CHF	441.987,61	0,73
Amadeus IT Group S.A. Acciones Port. EO 0,01	ES0109067019	STK	600				EUR	180.2200	1,25
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251	STK	6.900	1.000			EUR	756.924,00	0,05
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628	STK	17.000	17.000			EUR	47.0300	28.218,00
BASF SE Namens-Aktien o.N.	DE000BASF111	STK	9.000				EUR	43.6000	300.840,00
Continental AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0005439004	STK	400				EUR	18.6200	0,50
Daimler AG Namens-Aktien o.N.	DE0007100000	STK	8.000				EUR	50.1300	316.540,00
Danone S.A. Actions Port. EO -,25	FR0000120644	STK	5.000				EUR	451.170,00	0,52
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	DE0005552004	STK	2.500				EUR	87.2200	0,74
Eiffage S.A. Actions Port. EO 4	FR0000130452	STK	400				EUR	31.8700	34.888,00
Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0005785802	STK	7.500				EUR	85.9100	0,06
Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0005785604	STK	5.500				EUR	287.280,00	0,47
Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N	DE0006048432	STK	3.000				EUR	62.1000	0,51
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	DE0006231004	STK	17.500				EUR	31.8700	0,13
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011821202	STK	6.000				EUR	81.7200	0,05
Kering S.A. Actions Port. EO 4	FR0000121485	STK	100				EUR	571.650,00	0,94
Koninklijke DSM N.V. Aandelen op naam EO 1,50	NL0000009827	STK	450				EUR	44.2100	0,40
LANXESS AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0005474045	STK	1.400				EUR	245.460,00	0,40
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	FR0000121014	STK	850				EUR	81.8200	0,59
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026	STK	2.000				EUR	20.5350	0,09
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350	STK	1.000				EUR	359.362,50	0,13
Orange S.A. Actions Port. EO 4	FR0000133308	STK	20.000				EUR	481.2500	0,08
Royal Dutch Shell Reg. Shares Class A EO -,07	GB00B03MLX29	STK	10.000				EUR	122.7500	0,09
RTL Group S.A. Actions au Porteur o.N.	LU0061462528	STK	600				EUR	6.2630	0,28
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578	STK	5.000	5.000			EUR	241.2500	0,06
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600	STK	6.900				EUR	48.1250	0,03
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972	STK	6.000				EUR	10.6850	0,35
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101	STK	4.500				EUR	213.7000	0,24
Siemens Healthineers AG Namens-Aktien o.N.	DE000SHL1006	STK	2.000				EUR	14.8620	0,03
thyssenkrupp AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007500001	STK	3.000				EUR	17.016,00	0,03
Total S.A. Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271	STK	7.400				EUR	6.1600	0,03
Unilever N.V. Aandelen op naam EO -,16	NL0000388619	STK	7.000				EUR	18.480,00	0,03
VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	FR0000125486	STK	5.000				EUR	34.5500	0,42
Vivendi S.A. Actions Port. EO 5,5	FR0000127771	STK	13.000	13.000			EUR	331.075,00	0,55
Ashtead Group PLC Registered Shares LS -,10	GB0000536739	STK	1.500				EUR	457.700,00	0,75
Aviva PLC Registered Shares LS -,25	GB0002162385	STK	10.000				EUR	88.310,00	0,75
Diageo PLC Reg. Shares LS -,28935185	GB0002374006	STK	11.500				EUR	322.7000	0,56
Alibaba Group Holding Ltd. Reg.Shs (sp.ADRs)/8 DL-,000025	US01609W1027	STK	270				EUR	413.700,00	0,68
Alphabet Inc. Reg. Shs Cap.Stk Cl. C DL-,001	US02079K1079	STK	40				EUR	464.650,00	0,09
Alphabet Inc. Reg. Shs Cl. A DL-,001	US02079K3059	STK	350				EUR	51.627,75	0,04
American Water Works Co. Inc. Registered Shares DL -,01	US0304201033	STK	4.500				USD	1.394.9700	0,08
Apple Inc. Registered Shares o.N.	US0378331005	STK	500				USD	434.868,39	0,72
Baidu Inc. R.Shs A(Sp.ADRs)1/10/DL-,00005	US0567521085	STK	1.500	1.500			USD	501.702,98	0,83
Berkshire Hathaway Inc. Reg.Shares B New DL -,00333	US0846707026	STK	1.000				USD	338.810,94	0,27
Booking Holdings Inc. Registered Shares DL-,008	US09857L1089	STK	200	200			USD	125.3700	0,27
Canadian National Railway Co. Registered Shares o.N.	CA1363751027	STK	7.000				USD	361.7800	0,27
Church & Dwight Co. Inc. Registered Shares DL 1	US1713401024	STK	6.500				USD	160.862,61	0,27
Cisco Systems Inc. Registered Shares DL-,001	US17275R1023	STK	27.500	1.000			USD	443.468,21	0,73
Comcast Corp. Reg. Shares Class A DL -,01	US20030N1019	STK	8.500	8.500			USD	1.128.612,72	0,48

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens	
Danaher Corp. Registered Shares DL -,01	US2358511028	STK	4.000				USD	172,3800	613.179,19	1,01
DuPont de Nemours Inc. Registered Shares o.N.	US26614N1028	STK	6.000	6.000			USD	52,4700	279.964,43	0,46
Gilead Sciences Inc. Registered Shares DL -,001	US3755581036	STK	3.000	1.300			USD	74,5600	198.915,07	0,33
Intel Corp. Registered Shares DL -,001	US4581401001	STK	8.500		1.000	USD	58,2700	440.457,98	0,73	
McDonald's Corp. Registered Shares DL -,01	US5801351017	STK	2.900			USD	182,8000	471.427,30	0,78	
Medtronic PLC Registered Shares DL -,0001	IE00BTN1Y115	STK	3.500			USD	90,2600	280.933,75	0,46	
Microsoft Corp. Registered Shares DL -,000000625	US5949181045	STK	3.500		1.000	USD	198,4400	617.643,40	1,02	
NIKE Inc. Registered Shares Class B o.N.	US6541061031	STK	600			USD	95,8700	51.153,40	0,08	
Otis Worldwide Corp. Registered Shares DL -,01	US68902V1070	STK	7.500	7.500			USD	56,5700	377.301,02	0,62
PayPal Holdings Inc. Reg. Shares DL -,0001	US70450Y1038	STK	650			USD	168,3500	97.312,14	0,16	
PepsiCo Inc. Registered Shares DL -,0166	US7134481081	STK	3.500			USD	131,0800	407.985,77	0,67	
Procter & Gamble Co., The Registered Shares o.N.	US7427181091	STK	2.500	2.500		USD	117,6600	261.582,93	0,43	
Suncor Energy Inc. Registered Shares o.N.	CA8672241079	STK	10.000	10.000		USD	16,9600	150.822,59	0,25	
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	US92826C8394	STK	2.500			USD	191,3800	425.477,99	0,70	
Verzinsliche Wertpapiere										
4,5325 % Alpiq Holding AG SF-FLR Anl. 2013(18/Und.)	CH0212184037	CHF	300	100		%	96,1420	270.006,18	0,44	
0,7750 % Cellnex Telecom S.A. SF-Med.-Term Notes 2020(27)	CH0506071148	CHF	250	250		%	97,5870	228.386,94	0,38	
2,5000 % HOCHDÖRF Holding AG SF-FLR Anl. 2017(23/Und.)	CH0391647986	CHF	600			%	65,3500	367.059,22	0,60	
0,7500 % Kon. Luchtvaart Mij. N.V. SF-FLR Anl. 1985(95/Undated)	CH0005362055	CHF	500	495		%	30,5000	142.760,85	0,24	
2,1250 % Siegfried Holding AG SF-FLR Anl. 2016(21/Und.)	CH0340677837	CHF	200			%	99,2390	185.802,55	0,31	
4,2500 % Achmea B.V. EO-FLR Med.-T. Nts 15(25/Und.)	XS1180651587	EUR	200			%	104,4610	208.922,00	0,34	
6,0000 % Achmea B.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2013(23/43)	XS0911388675	EUR	200	200		%	109,7220	219.444,00	0,36	
4,0000 % AEGON N.V. EO-FLR Med.T.Nts 2014(24/44)	XS1061711575	EUR	200			%	105,2620	210.524,00	0,35	
0,0463 % AEGON N.V. EO-FLR Nts 2004(14/Und.)	NL00000116150	EUR	300	100		%	67,9370	203.811,00	0,34	
4,7500 % Allianz SE FLR-Med.Ter.Nts.v.13(23/unb.)	DE000A1YCQ29	EUR	100			%	109,9250	109.925,00	0,18	
2,7500 % Arkema S.A. EO-FLR Med.-T.Nts 2019(24/Und)	FR0013425170	EUR	100		100	%	100,3650	100.365,00	0,17	
3,5000 % Banijay Entertainment S.A.S. EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2112340679	EUR	100	100		%	95,5360	95.536,00	0,16	
3,7500 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2014(2024/2074)	DE000A11QR73	EUR	200			%	103,8970	207.794,00	0,34	
2,8750 % Bolloré S.A. EO-Obl. 2015(15/21)	FR0012872174	EUR	100			%	101,3750	101.375,00	0,17	
0,1000 % Bundesrepub.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.12(23)	DE0001030542	EUR	200			%	101,9250	221.307,71	0,36	
0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.15(26)	DE0001030567	EUR	200	200		%	106,9190	225.949,78	0,37	
1,2500 % Citycon Treasury B.V. EO-Notes 2016(16/26)	XS1485608118	EUR	100			%	84,3670	84.367,00	0,14	
4,0000 % CNP Assurances S.A. EO-FLR Notes 2014(24/Und.)	FR0012317758	EUR	200			%	106,8140	213.628,00	0,35	
1,7500 % Danone S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 17(23/Und.)	FR0013292828	EUR	100		100	%	99,5080	99.508,00	0,16	
0,1250 % Dassault Systemes SE EO-Notes 2019(19/26)	FR0013444544	EUR	100			%	99,1590	99.159,00	0,16	
0,5380 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.17(22)	DE000DL19TQ2	EUR	200			%	97,7160	195.432,00	0,32	
2,8750 % Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.FLR-MTN R35281 17(22/27)	XS1637926137	EUR	300			%	95,8610	287.583,00	0,47	
0,4500 % DH Europe Finance II S.à r.l. EO-Notes 2019(19/28)	XS2050404800	EUR	100			%	97,8900	97.890,00	0,16	
0,8750 % DS Smith PLC EO-Medium-Term Nts 2019(19/26)	XS2051777873	EUR	200			%	96,5910	193.182,00	0,32	
4,0000 % Electricité de France (E.D.F.) EO-FLR Notes 2018(24/Und.)	FR0013367612	EUR	200			%	102,0820	204.164,00	0,34	
1,6250 % Elis S.A. EO-Med.-Term Nts 2019(19/28)	FR0013449998	EUR	100			%	91,4830	91.483,00	0,15	
0,3750 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/27)	XS2066706909	EUR	100			%	98,9900	98.990,00	0,16	
2,0450 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2019(19/28)	XS2062490649	EUR	200			%	97,1630	194.326,00	0,32	
2,1250 % Eurofins Scientific S.E. EO-Notes 2017(17/24)	XS1651444140	EUR	200			%	100,1220	200.244,00	0,33	
1,8750 % FFP S.A. EO-Obl. 2019(19/26)	FR0013457405	EUR	100			%	94,0830	94.083,00	0,15	
1,5140 % Ford Motor Credit Co. LLC EO-Medium Term Notes 2019(23)	XS2013574202	EUR	150			%	94,2570	141.385,50	0,23	
2,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA EO-Notes 2013(13/20) Reg.S	XS0873432511	EUR	100			%	100,0900	100.090,00	0,16	
1,8750 % G4S International Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2018(25/25)	XS1824462896	EUR	100			%	97,3770	97.377,00	0,16	
1,5000 % G4S International Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2016(23/4)	XS1515216650	EUR	200			%	99,2820	198.564,00	0,33	
3,1250 % Gaz Capital S.A. EO-M.T.LPN 16(23)GAZPROM Reg.S	XS1521039054	EUR	100			%	104,5620	104.562,00	0,17	
2,2500 % Gaz Capital S.A. EO-M.T.LPN 17(24) GAZPROM	XS1721463500	EUR	200			%	101,8470	203.694,00	0,34	
0,2220 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 2017(22/23)	XS1691349523	EUR	200			%	98,6000	197.200,00	0,32	
0,8750 % Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2017(22)	XS1678629186	EUR	100			%	98,5510	98.551,00	0,16	
3,5000 % Griechenland EO-Notes 2017(23)	GR0114030555	EUR	100			%	108,0270	108.027,00	0,18	
3,3750 % Hannover Rück SE Sub.-FLR-Bonds.v.14(25/unb.)	XS1109836038	EUR	100			%	107,8410	107.841,00	0,18	

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
2,1250 % Heimstaden Bostad AB EO-Medium-Term Nts 2019(19/23)	XS1958655745	EUR	100			%	102,4150	102,415,00	0,17
1,1250 % Heimstaden Bostad AB EO-Medium-Term Nts 2020(20/26)	XS210572201	EUR	100	100		%	97,4720	97,472,00	0,16
3,0000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-FLR Notes 2019(24/Und.)	XS1713466495	EUR	150			%	100,5980	150,897,00	0,25
1,5000 % Iliad S.A. EO-Obl. 2017(17/24)	FR0013287273	EUR	100			%	98,4290	98,429,00	0,16
0,3500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(25)	IT0005366245	EUR	150	150		%	98,8020	148,203,00	0,24
3,1250 % La Poste EO-FLR Notes 2018(26/Und.)	FR0013331949	EUR	100			%	103,1210	103,121,00	0,17
4,5000 % LANXESS AG FLR-Sub.Anl. v.2016(2023/2076)	XS1405763019	EUR	100			%	104,3190	104,319,00	0,17
3,6250 % LKQ European Holdings B.V. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1799640666	EUR	100			%	102,0950	102,095,00	0,17
1,6250 % Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2019(2024/2079)	XS2011260531	EUR	100			%	99,6260	99,626,00	0,16
2,7500 % Metsä Board Oyj EO-Notes 2017(17/27)	FI4000282629	EUR	200			%	107,1690	214,338,00	0,35
1,6000 % Mowi ASA EO-FLR Notes 2020(23/25)	NO0010874050	EUR	200	200		%	99,7380	199,476,00	0,33
2,2500 % Neopost S.A. EO-Obl. 2020(20/25)	FR0013478849	EUR	100	100		%	95,7970	95,797,00	0,16
1,6250 % NGG Finance PLC EO-FLR Notes 2019(24/79)	XS2010044977	EUR	150			%	98,3690	147,553,50	0,24
4,3750 % NN Group N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 14(24/Und.)	XS1076781589	EUR	200			%	107,3320	214,664,00	0,35
2,8750 % Portugal, Republik EO-Obr. 2016(26)	PTOTETO0012	EUR	120			%	117,6130	141,135,60	0,23
3,1250 % PVH Corp. EO-Notes 2017(17/27) Reg.S	XS1734066811	EUR	100			%	96,5890	96,589,00	0,16
1,1250 % RCI Banque S.A. EO-Med.-Term Nts 2020(26/27)	FR0013476090	EUR	100	100		%	94,1570	94,157,00	0,16
2,5000 % RCS & RDS SA EO-Bonds 2020(20/25) Reg.S	XS2107451069	EUR	100	100		%	95,8600	95,860,00	0,16
1,0000 % Samhällsbyggnadsbola.I Nord AB EO-Med.-Term Notes 2020(20/27)	XS12114871945	EUR	100	100		%	92,6330	92,633,00	0,15
3,8750 % SAZKA Group AS EO-Bonds 2020(20/27)Reg.S	XS2113253210	EUR	100	100		%	90,6790	90,679,00	0,15
5,6250 % SES S.A. EO-FLR Notes 2016(24/Und.)	XS1405765659	EUR	100			%	102,8760	102,876,00	0,17
0,1250 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2019(29)	XS2049616621	EUR	100			%	97,6120	97,612,00	0,16
1,1250 % Sixt SE Anleihe v.2016(2016/2022)	DE000A2BPDU2	EUR	100			%	98,0220	98,022,00	0,16
2,5000 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2017(17/27)	XS1624344542	EUR	200			%	103,5860	207,172,00	0,34
2,6250 % Total S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 15(25/Und.)	XS1195202822	EUR	200			%	102,1490	204,298,00	0,34
2,7080 % Total S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 16(23/Und.)	XS1501167164	EUR	100			%	101,6790	101,679,00	0,17
3,3690 % Total S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 16(26/Und.)	XS1501166869	EUR	100			%	106,3810	106,381,00	0,18
2,8750 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-FLR Bonds 2018(26/Und.)	FR0013330537	EUR	100			%	88,8150	88,815,00	0,15
4,2000 % Vodafone Group PLC EO-FLR Cap.Sec. 2018(28/78)	XS1888179550	EUR	150			%	108,7050	163,057,50	0,27
4,6250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2014(26/Und.)	XS1048428442	EUR	100			%	104,3580	104,358,00	0,17
2,5000 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2015(22/Und.)	XS1206540806	EUR	150			%	98,1010	147,151,50	0,24
2,7000 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2017(22/Und.)	XS1629658755	EUR	200			%	98,0030	196,006,00	0,32
1,7500 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. LS-Medium-Term Nts 2017(17/25)	BE6295391914	GBP	150			%	103,2750	169,005,90	0,28
4,2500 % BP Capital Markets PLC LS-FLR Notes 2020(27/Und.)	XS2193663619	GBP	100	100		%	100,4310	109,567,86	0,18
4,1250 % CRH Finance (U.K.) PLC LS-Med.-T. Nts 2015(15/29)	XS1328187627	GBP	100			%	118,0340	128,772,32	0,21
1,6250 % Daimler Intl Finance B.V. LS-Medium-Term Notes 2019(24)	XS2078691636	GBP	100			%	99,4230	108,468,16	0,18
1,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau LS-Med.Term Nts. v.16(21)	XS1346200055	GBP	100			%	100,7530	109,919,16	0,18
1,0000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE LS-Medium-Term Notes 20(20/23)	FR0013482858	GBP	300	300		%	100,9480	330,395,70	0,54
2,3750 % National Express Group PLC LS-Medium-Term Nts 2019(19/28)	XS2081477817	GBP	100			%	96,0840	104,825,39	0,17
1,3750 % National Grid Gas PLC LS-Med.-Term Notes 2020(20/31)	XS2112228676	GBP	200	200		%	101,5130	221,496,60	0,36
3,2500 % Pinewood FinCo PLC LS-Notes 2019(21/25) Reg.S	XS2052466815	GBP	150			%	98,8940	161,836,55	0,27
1,7500 % Reckitt Benck.Treas.Ser.(NL)BV LS-Notes 2020(20/32) Reg.S	XS2177006983	GBP	100	100		%	104,6060	114,122,69	0,19
0,6464 % Royal Bank of Canada LS-FLR Mortg.Cov.MTN 2019(24)	XS2060621005	GBP	100			%	100,0710	109,175,11	0,18
3,8750 % Talk Talk Telecom Group PLC LS-Bonds 2020(22/25)	XS2121167345	GBP	200	200		%	96,4540	210,458,10	0,35
1,7800 % Avinor AS NK-FLR Med.-T.Nts 2020(26/26)	NO0010881246	NOK	2.000	2.000		%	102,2270	187,608,62	0,31
5,5000 % Allianz SE Subord. Bond v.12(18/unb.)	XS0857872500	USD	200			%	100,4790	178,708,76	0,29
2,7000 % Sinopec Grp Ov.Dev.(2018) Ltd. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USG82016AP45	USD	250	250		%	103,0590	229,121,83	0,38
5,2500 % Svenska Handelsbanken AB DL-FLR Med.-T. Nts 15(21/Und.)	XS1194054166	USD	400			%	99,9720	355,614,05	0,59
Zertifikate									
Deut. Börse Commodities GmbH Xetra-Gold IHS 2007(09/Und)	DE000A0S9GB0	STK	2.500			EUR	50,6750	126,687,50	0,21
Sonstige Beteiligungswertpapiere									
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	CH0012032048	STK	2.900			CHF	331,4500	899,819,33	1,48
Bertelsmann SE & Co. KGaA Genußscheine 2001	DE0005229942	EUR	50			%	319,1000	159,550,00	0,26

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
1,6250 % Albemarle New Holding GmbH Bonds v.19(19/28)Reg.S	XS2083147343	EUR	200			%	95,7150	191.430,00	0,31	
1,8750 % Arena Luxembourg Fin. SARL EO-Notes 2020(20/28) Reg.S	XS2111944133	EUR	100	100		%	91,6920	91.692,00	0,15	
2,0000 % Ashland Services B.V. EO-Notes 2020(20/28) Reg.S	XS2103218538	EUR	200	200		%	93,4780	186.956,00	0,31	
1,5000 % Ball Corp. EO-Notes 2019(19/27)	XS2080318053	EUR	200			%	96,1090	192.218,00	0,32	
3,3750 % Belden Inc. EO-Notes 2017(22/27) Reg.S	XS1640668940	EUR	100			%	96,7380	96.738,00	0,16	
1,5000 % Berry Global Inc. EO-Notes 2020(20/27) Reg.S	XS2093881030	EUR	200			%	94,5130	189.026,00	0,31	
0,9500 % Deutsche Bahn Finance GmbH Sub.-FLR-Nts.v.19(25/unb.)	XS2010039035	EUR	100	100		%	96,6340	96.634,00	0,16	
1,6250 % Engie S.A. EO-FLR Notes 2019(25/Und.)	FR0013431244	EUR	200			%	97,5090	195.018,00	0,32	
1,2500 % Fastighets AB Balder EO-Medium-Term Notes 20(20/28)	XS2109608724	EUR	200	200		%	93,4410	186.882,00	0,31	
5,2500 % HSBC Holdings PLC EO-FLR Cap.Notes 2014(22/Und.)	XS1111123987	EUR	200			%	99,6300	199.260,00	0,33	
2,1000 % HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Indexanleihe v.18(20)SX5E	DE000TR6CN04	EUR	100	100		%	99,4000	99.400,00	0,16	
4,2500 % Huntsman International LLC EO-Notes 2016(16/25)	XS1395182683	EUR	100			%	106,4320	106.432,00	0,17	
1,8750 % Iberdrola International B.V. EO-FLR Notes 2017(23/Und.)	XS1721244371	EUR	100			%	100,0860	100.086,00	0,16	
3,6250 % James Hardie Intl Finance DAC EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1888221261	EUR	100			%	102,3430	102.343,00	0,17	
3,3750 % Levi Strauss & Co. EO-Notes 2017(17/27)	XS1602130947	EUR	100			%	101,1840	101.184,00	0,17	
0,8750 % Mölnlycke Holding AB EO-Medium-Term Nts 2019(19/29)	XS2049769297	EUR	100			%	95,0030	95.003,00	0,16	
2,8750 % Ol European Group B.V. EO-Notes 2019(19/25) Reg.S	XS2077666316	EUR	200			%	96,6280	193.256,00	0,32	
2,1250 % PPF Telecom Group B.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/25)	XS2078976805	EUR	100			%	97,4280	97.428,00	0,16	
3,1250 % PPF Telecom Group B.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/26)	XS1969645255	EUR	150			%	99,9800	149.970,00	0,25	
2,0000 % Q-Park Holding I B.V. EO-Notes 2020(20/27) Reg.S	XS2115190451	EUR	200	200		%	93,2870	186.574,00	0,31	
2,6240 % Samhallsbyggnadsbolag Nord AB EO-FLR Cap. 2020(25/Und.)	XS2010032618	EUR	100	100		%	92,3880	92.388,00	0,15	
2,8750 % Smurfit Kappa Acquis. Uni. Co. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1849518276	EUR	100			%	103,6670	103.667,00	0,17	
2,2500 % Standard Industries Inc. EO-Notes 2019(19/26) Reg.S	XS2080766475	EUR	200			%	94,2640	188.528,00	0,31	
2,0000 % Techem Verwaltungsges.675 mbH Sen.Notes v.20(22/25)Reg.S	XS2090816526	EUR	100	100		%	95,8030	95.803,00	0,16	
1,3750 % Telia Company AB EO-FLR Securities 2020(26/81)	XS2082429890	EUR	100	100		%	94,4620	94.462,00	0,15	
3,1250 % United Group B.V. EO-Bonds 2020(20/26)	XS2111946930	EUR	150	150		%	94,8490	142.273,50	0,23	
1,3320 % Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/28)	XS2054210252	EUR	200			%	94,1360	188.272,00	0,31	
3,3750 % Ziggo Bond Co. B.V. EO-Notes 2020(20/30) Reg.S	XS2116386132	EUR	100	100		%	94,5250	94.525,00	0,15	
1,5000 % Comcast Corp. LS-Notes 2020(20/29)	XS2114853299	GBP	150	150		%	102,6180	167.930,74	0,28	
5,0000 % Virgin Media Secured Fin. PLC LS-Notes 2017(17/27) Reg.S	XS1555173019	GBP	100			%	104,0170	113.480,11	0,19	
2,3750 % 3M Co. DL-Notes 2019(19/29)	US88579YBJ91	USD	300			%	107,7700	287.514,45	0,47	
2,0500 % Air Products & Chemicals Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US009158BC97	USD	100	100		%	105,0350	93.405,96	0,15	
2,6000 % Alcon Finance Corp. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USU01386AD00	USD	100	100		%	102,9920	91.589,15	0,15	
2,9000 % Apple Inc. DL-Notes 2017(17/27)	US037833DB33	USD	250			%	111,6290	248.174,74	0,41	
2,6250 % Bank of America Corp. DL-Notes 2015(20)	US06051GFT13	USD	100			%	100,6910	89.542,91	0,15	
5,5000 % Barry Callebaut Services N.V. DL-Notes 2013(23) Reg.S	BE6254003252	USD	400	200		%	108,0920	384.498,00	0,63	
2,2500 % Biogen Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US09062XAH61	USD	150	150		%	101,1050	134.866,61	0,22	
5,4500 % Dell Intern. LLC/EMC Corp. DL-Notes 2016(16/23) 144A	US25272KAG85	USD	200			%	109,3590	194.502,45	0,32	
2,7000 % eBay Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US278642AW32	USD	200	200		%	105,1860	187.080,48	0,31	
3,3750 % Eli Lilly and Company DL-Notes 2019(19/29)	US532457BV93	USD	200			%	115,9510	206.226,77	0,34	
4,0000 % Grupo Bimbo S.A.B. de C.V. DL-Notes 2019(19/49) Reg.S	USP4949BAP96	USD	200			%	101,6140	180.727,43	0,30	
3,5500 % Hasbro Inc. DL-Notes 2019(19/26)	US418056AY31	USD	200			%	105,3620	187.393,51	0,31	
2,2000 % HP Inc. DL-Notes 2020(20/25)	US40434LAA35	USD	100	100		%	103,3560	91.912,85	0,15	
3,6250 % MSCI Inc. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USU5521TAG77	USD	150	150		%	99,4900	132.712,32	0,22	
2,6250 % PepsiCo Inc. DL-Notes 2019(19/29)	US713448EL82	USD	300			%	110,9270	295.936,86	0,49	
5,5000 % Pershing Square Holdings Ltd. DL-Bonds 2015(15/22) Reg.S	XS1242956966	USD	250			%	105,6460	234.873,28	0,39	
2,3000 % Stanley Black & Decker Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US854502AL57	USD	200	200		%	104,9540	186.667,85	0,31	
2,6000 % Thermo Fisher Scientific Inc. DL-Notes 2019(19/29)	US883556BZ47	USD	200			%	108,3970	192.791,46	0,32	
Zertifikate										
BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbh R.C.BOZ 22.10.20 DAX	DE000PX90FF4	STK	4.300	4.300			EUR	52,9200	227.556,00	0,37
BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbh DISC.Z 02.07.20 ESTX50 3600	DE000PX3U2B1	STK	7.100				EUR	32,2500	228.975,00	0,38
DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z 02.10.20 DAX 8800	DE000DF3EES9	STK	3.400	3.400			EUR	87,1100	296.174,00	0,49
DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z 28.08.20 ESTX50 1500	DE000DFA9480	STK	11.000	11.000			EUR	14,9800	164.780,00	0,27

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
Nichtnotierte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
2,1000 % CNH Ind.Capit.Austr.Pty Ltd. AD-Medium-Term Notes 2019(22)	AU3CB0267474	AUD	200				%	99,3050	121.011,42
Investmentanteile									
Gruppenfremde Investmentanteile									
Alegria High Grade ABS Portfol. Inhaber-Anteile o.N.	LI0027320568	ANT	1.595	345			EUR	1.445,7600	2.305.987,20
ART Top 50 Convertibles UI Inhaber-Anteilsklasse I T	DE000A2DTNK0	ANT	325				EUR	1.010,6400	328.458,00
BNPP InstiCash-EUR 1D S.T VNAV Namens-Anteile I Cap.o.N.	LU0094219127	ANT	13.693	2.165	2.887	EUR	138,4063	1.895.189,04	
Capitulum Weltzins-Invest Unvl Inhaber-Anteilsklasse I	DE000A2H7NU1	ANT	2.249	2.249		EUR	88,9600	200.071,04	
CONVERTIBLE GLB.DIVERSIFIED UI Inhaber-Anteile	DE000A0M9995	ANT	7.150			EUR	153,3600	1.096.524,00	
DWS Instl-ESG EO Money Market Inhaber-Anteile IC o.N.	LU0099730524	ANT	108			EUR	13.864,3700	1.496.022,37	
Fidelity Fds-Pacific Fund Registered Shs Y Acc. EUR o.N.	LU0951203180	ANT	11.000			EUR	17,2600	189.860,00	
FS Exponential Technologies Namens-Anteile I EUR o.N.	LU1575871618	ANT	138	138		EUR	1.132,1600	156.238,08	
FS Exponential Technologies Namens-Anteile X EUR (INE)o.N.	LU1575872186	ANT	128	128		EUR	1.220,2600	156.193,28	
iSh.ST.Eu.600 Oil&Gas U.ETF DE Inhaber-Anlageaktien	DE000AOH08M3	ANT	4.000			EUR	21,9450	87.780,00	
iShare.EURO STOXX UCITS ETF DE Inhaber-Anteile	DE000AO0D8Q07	ANT	12.000			EUR	35,2700	423.240,00	
iShs ESTX Banks 30-15 UC.ETF Inhaber-Anteile	DE0006289309	ANT	14.000			EUR	6,1760	86.464,00	
iShs MSCI EM U.ETF USD (D) Registered Shares o.N.	IE00B0M63177	ANT	2.200			EUR	34,1850	75.207,00	
iShs MSCI Japan U.ETF USD (D) Registered Shares o.N.	IE00B02KXH56	ANT	10.000			EUR	12,5340	125.340,00	
iShsII-\$Hgh Yld Corp Bd U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B4PY7Y77	ANT	1.000			EUR	85,0600	85.060,00	
iShsIII-iSh.JPM EM L.G.B.U.ETF Registered Shares USD o.N.	IE00B5M4WH52	ANT	2.000			EUR	49,8410	99.682,00	
iShsV-Eu.Co.Bd In.Ra.Hdg U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B6X2VY59	ANT	4.000	4.000		EUR	93,8200	375.280,00	
M.U.L.-Lyxor Nasdaq-100 UC.ETF Namens-Anteil Acc o.N	LU1829221024	ANT	3.500			EUR	34,7270	121.544,50	
MUL-Lyxc.MSCI EM Asia UCITS ETF Inhaber-Anteile Acc o.N.	LU1781541849	ANT	60.600			EUR	8,5650	519.039,00	
PAYDEN GBL-Pay.Gbl Em.Mkts Bd Registered Shs. Class EUR o.N.	IE00B04NLM33	ANT	6.610		25.055	EUR	20,0102	132.267,42	
SSL-St.Street EUR Liquid.LVNAV Registered Shares Prem.Sh.o.N.	IE00BBT33858	ANT	901		1.108	EUR	992,9494	894.230,37	
Therma Special Situations Fund Inhaber-Anteile	DE000A2H6764	ANT	10.260			EUR	96,8800	993.988,80	
UnilInstit.Convertibles Protect Act. au Port. LA EUR Dis. o.N	LU2103221169	ANT	9.530	31.787	22.256	EUR	45,2800	431.535,24	
Vanguard FTSE 250 UCITS ETF Registered Shares GBP Dis.o.N	IE00BKX55Q28	ANT	4.000			GBP	26,8750	117.279,98	
Danske Invest SICAV - Russia Namens-Anteile I o.N.	LU0495011370	ANT	2.500			USD	20,6090	45.818,14	
Fidelity Fds-Asian Bond Fund Reg. Sh. Y Acc. USD o.N.	LU0605512606	ANT	9.445	9.445		USD	15,8800	133.380,70	
MainFir.-Em.Mark.Cred.Opp.Fd. Namens-Anteile C USD o.N.	LU1061984545	ANT	993	993		USD	114,0300	100.695,23	
N.I.F.(L.)-L.S.Sh.T.E.Mkts Bd Nam.-Ant. I/A USD o.N.	LU0980583388	ANT	1.856	1.856		USD	121,7100	200.883,73	
PAYDEN GBL-Pay.Gbl Em.Mkts Bd Registered Shs. Class USD o.N.	IE0030928885	ANT	5.480		8.770	USD	34,3259	167.279,62	
Schroder ISF-Asian Loc.Curr.Bd Namens-Anteile C Acc. USD o.N.	LU0358730231	ANT	1.017	1.017		USD	148,3164	134.137,64	
Summe Wertpapiervermögen									
							EUR	55.785.367,48	91,85

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens	
Derivate										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaupte Positionen.)										
Derivate auf einzelne Wertpapiere										
Wertpapier-Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktien										
Cie Financiere Richemont SA CALL 68.00 18.12.2020	EUREX	-282.713	STK	-50		50	CHF	2,0300	-9.501,79	-0,02
Novartis AG PUT 80.00 18.09.2020	EUREX	-195.114	STK	-25		25	CHF	2,2700	-5.312,58	-0,01
Allianz SE CALL 210.00 18.12.2020	EUREX	-270.330	STK	-15		15	EUR	4,5600	-6.840,00	-0,01
Anheuser-Busch InBev SA/NV CALL 60.00 18.12.2020	EUREX	-261.600	STK	-60		60	EUR	0,9200	-5.520,00	-0,01
AXA SA CALL 22.00 19.03.2021	EUREX	-316.540	STK	-170		170	EUR	0,4400	-7.480,00	-0,01
Danone SA CALL 68.00 18.12.2020	EUREX	-310.500	STK	-50		50	EUR	1,0500	-5.250,00	-0,01
Fresenius SE & Co KGaA CALL 44.00 18.12.2020	EUREX	-243.155	STK	-55		55	EUR	3,6800	-20.240,00	-0,03
Henkel AG & Co KGaA CALL 88.00 18.12.2020 (VZ)	EUREX	-245.460	STK	-30		30	EUR	2,9800	-8.940,00	-0,01
Kering SA PUT 520.00 18.09.2020	EUREX	-144.375	STK	-3		3	EUR	57,7400	-17.322,00	-0,03
Orange SA CALL 12.00 18.12.2020	EUREX	-213.700	STK	-200		200	EUR	0,2700	-5.400,00	-0,01
Royal Dutch Shell PLC CALL 21.00 18.09.2020	EUREX	-148.620	STK	-100		100	EUR	0,0300	-300,00	0,00
TOTAL SA CALL 40.00 18.12.2020	EUREX	-207.300	STK	-60		60	EUR	1,0100	-6.060,00	-0,01
Unilever NV CALL 52.00 18.12.2020	EUREX	-334.810	STK	-70		70	EUR	1,0800	-7.560,00	-0,01
Vivendi SA CALL 25.00 18.12.2020	EUREX	-301.600	STK	-130		130	EUR	0,8600	-11.180,00	-0,02
Alexion Pharmaceuticals Inc PUT 105.00 15.01.2021	CBOE	-296.719	STK	-30		30	USD	9,7500	-26.011,56	-0,04
Alphabet Inc PUT 1400.00 15.01.2021 (Cl. A)	CBOE	-372.744	STK	-3		3	USD	131,7000	-35.135,62	-0,06
Baidu Inc CALL 140.00 15.01.2021	CBOE	-161.792	STK	-15		15	USD	7,0000	-9.337,48	-0,02
Booking Holdings Inc CALL 1700.00 15.01.2021	CBOE	-283.365	STK	-2		2	USD	168,5500	-29.977,77	-0,05
Broadcom Inc PUT 280.00 15.01.2021	CBOE	-413.224	STK	-15		15	USD	25,8000	-34.415,30	-0,06
Cisco Systems Inc CALL 50.00 15.01.2021	CBOE	-369.364	STK	-90		90	USD	2,3000	-18.408,18	-0,03
DuPont de Nemours Inc CALL 55.00 15.01.2021	CBOE	-279.964	STK	-60		60	USD	5,4500	-29.079,59	-0,05
Facebook Inc PUT 200.00 18.09.2020	CBOE	-392.423	STK	-20		20	USD	9,3500	-16.629,61	-0,03
Gilead Sciences Inc CALL 80.00 15.01.2021	CBOE	-198.915	STK	-30		30	USD	5,0200	-13.392,62	-0,02
Gilead Sciences Inc PUT 67.50 15.01.2021	CBOE	-430.983	STK	-65		65	USD	4,7500	-27.456,65	-0,05
International Business Machine PUT 150.00 15.01.2021	CBOE	-266.229	STK	-25		25	USD	35,0750	-77.979,10	-0,13
Johnson & Johnson PUT 145.00 15.01.2021	CBOE	-309.115	STK	-25		25	USD	14,8000	-32.903,51	-0,05
Medtronic PLC PUT 90.00 15.01.2021	CBOE	-321.067	STK	-40		40	USD	9,2000	-32.725,66	-0,05
Microsoft Corp PUT 160.00 15.01.2021	CBOE	-441.174	STK	-25		25	USD	6,8200	-15.162,29	-0,02
NVIDIA Corp PUT 290.00 18.12.2020	CBOE	-261.805	STK	-8		8	USD	18,2500	-12.983,55	-0,02
Starbucks Corp PUT 67.50 15.01.2021	CBOE	-196.034	STK	-30		30	USD	5,9000	-15.740,33	-0,03
Suncor Energy Inc CALL 23.00 15.01.2021	CBOE	-150.823	STK	-100		100	USD	0,7050	-6.269,45	-0,01
Verizon Communications Inc PUT 60.00 18.09.2020	CBOE	-267.492	STK	-55			USD	6,3000	-30.813,69	-0,05
Walt Disney Co/The PUT 140.00 18.09.2020	CBOE	-198.346	STK	-20		20	USD	29,2500	-52.023,12	-0,09
Aktienindex-Derivate										
Aktienindex-Terminkontrakte										
DAX INDEX FUTURE Sep20	EUREX	-611.606	STK	-2		2	EUR	12.246,5000	10.450,00	0,02
Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktienindizes										
S&P 500 Index PUT 2400.00 18.12.2020	CBOE	-543.040	STK	-2		2	USD	74,9800	-13.335,70	-0,02
S&P 500 Index PUT 3000.00 18.12.2020	CBOE	1.086.079	STK	4		4	USD	223,5000	79.502,00	0,13

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
Devisen-Derivate									
Devisenterminkontrakte									
Offene Positionen									
Banque de Luxembourg CHF/EUR	OTC	Kauf- währung	Kauf- betrag	Verkauf- währung	Verkauf- betrag	Fälligkeit			
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC	EUR	328.488,90	CHF	-350.000,00	30.11.2020	458,41	0,00	
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC	EUR	1.560.000,00	USD	-1.759.728,36	01.10.2020	-1.726,44	0,00	
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC	USD	2.873.845,00	EUR	-2.600.000,00	21.09.2020	-48.920,17	-0,08	
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC	EUR	2.600.000,00	USD	-2.921.302,80	21.09.2020	6.792,42	0,01	
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten									
Kassenbestände									
Verwahrstelle		AUD	4.306,68				2.624,02	0,00	
		CAD	5.536,43				3.594,15	0,01	
		CHF	64.693,40				60.561,87	0,10	
		DKK	33.568,53				4.504,03	0,01	
		EUR	3.646.573,39				3.646.573,39	6,00	
		GBP	98.123,73				107.050,69	0,18	
		JPY	127,00				1.05	0,00	
		NOK	1.895.700,96				173.951,03	0,29	
		USD	1.306.180,78				1.161.565,83	1,91	
Marginkonten									
Initial Margin Banque de Luxembourg S.A.		EUR	106.609,78				106.609,78	0,18	
Variation Margin für Future		EUR	-10.450,00				-10.450,00	-0,02	
Cash Collateral									
Cash Collateral Banque de Luxembourg S.A.		EUR	115.000,00				115.000,00	0,19	
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche		EUR	209.583,36				209.583,36	0,35	
Dividendenansprüche		EUR	15.043,86				15.043,86	0,02	
Gründungskosten		EUR	-1,03				-1,03	0,00	

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verwaltungsvergütung			EUR	-25.105,58			EUR	-46.235,23	-0,08
Betreuungsgebühr			EUR	-3.878,76				-25.105,58	-0,04
Zentralverwaltungsvergütung			EUR	-2.984,83				-3.878,76	-0,01
Verwahrstellenvergütung			EUR	-1.948,38				-2.984,83	-0,01
Register- und Transferstellenvergütung			EUR	-125,00				-1.948,38	0,00
Taxe d'Abonnement			EUR	-6.895,20				-125,00	0,00
Prüfungskosten			EUR	-4.915,00				-6.895,20	-0,01
Sonstige Kosten			EUR	-382,48				-4.915,00	-0,01
Teilfondsvermögen									
Daidalos - Multi Asset BP P									
Anzahl Anteile							STK	545.529,000	
Anteilwert							EUR	111,33	

Fußnoten:

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

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP
Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 29.06.2020
Australische Dollar	(AUD)	1,6412500 = 1 Euro (EUR)
Kanadische Dollar	(CAD)	1,5404000 = 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	1,0682200 = 1 Euro (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,4530000 = 1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,9166100 = 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	121,1500000 = 1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	10,8979000 = 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,1245000 = 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

EUREX

CBOE

OTC

Eurex Deutschland
Chicago - CBOE Opt. Ex.

Over-the-Counter

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldverschreibungen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

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

Amtlich gehandelte Wertpapiere

Aktien				
Amazon.com Inc. Registered Shares DL -,01	US0231351067	STK	50	
Atmos Energy Corp. Registered Shares o.N.	US0495601058	STK	3.500	
Constellation Software Inc. Registered Shares o.N.	CA21037X1006	STK	300	
KION GROUP AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000KGX8881	STK	5.500	
New Jersey Resources Corp. Registered Shares DL 2,50	US6460251068	STK	1.000	
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,50	CH0012005267	STK	5.000	
SAFRAN Actions Port. EO -,20	FR0000073272	STK	3.500	
Wirecard AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007472060	STK	1.500	4.000

Verzinsliche Wertpapiere

2,4000 % Apple Inc. DL-Notes 2013(13/23)	US037833AK68	USD	200	
1,8000 % AT & T Inc. EO-Notes 2019(19/39)	XS2051362312	EUR	200	
1,1250 % B.A.T. Capital Corp. EO-Med.-Term Nts 2017(23/23)	XS1664644710	EUR	200	
2,5000 % Dufry One B.V. EO-Notes 2017(17/24)	XS1699848914	EUR	100	
1,7000 % EDP - Energias de Portugal SA EO-FLR Securities 2020(25/80)	PTEDPLOM0017	EUR	100	100
2,8750 % Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2019(2029/2079)	XS2011260705	EUR	200	
2,8750 % OMV AG EO-FLR Notes 2018(24/Uнд.)	XS1713462403	EUR	100	

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere				
3,6000 % AbbVie Inc. DL-Notes 2015(15/25)	US00287YAQ26	USD	350	
2,3000 % Adobe Inc. DL-Notes 2020(30/30)	US00724PAD15	USD	200	200
2,6000 % Amgen Inc. DL-Notes 2016(16/26)	US031162CJ71	USD	250	
1,7500 % Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.09(20)	DE0001030526	EUR	300	
0,3000 % Chubb INA Holdings Inc. EO-Notes 2019(19/24)	XS2091604715	EUR	200	
0,7500 % Crown European Holdings S.A. EO-Notes 2019(19/23) Reg.S	XS2071622216	EUR	100	
3,7500 % Loxam S.A.S. EO-Notes 2019(19/26) Reg.S	XS2031871069	EUR	100	
2,7500 % Nestlé Holdings Inc. NK-Medium-Term Notes 2014(20)	XS1055430182	NOK	1.500	
1,8750 % SIG Combibloc PurchaseCo SARL EO-Notes 2020(20/23) Reg.S	XS2189592889	EUR	100	100

Zertifikate

Commerzbank AG CL.DIZ 27.03.20 DAX 12700	DE000CJ7MQ84	STK	1.700	
Société Générale Effekten GmbH CL.DIZ 26.06.20 S&P500 3100	DE000CU4RX15	STK	10.000	
Société Générale Effekten GmbH DISC.Z 27.03.20 S&P500 3000	DE000ST5CBL6	STK	8.000	

Investmentanteile

Gruppenfremde Investmentanteile				
iShs DL Corp Bond UCITS ETF Registered Shares o.N.	IE0032895942	ANT	1.500	
iShs-EO Corp Bd Lar.Cap U.ETF Registered Shares o.N.	IE0032523478	ANT	1.100	
Unilnstit.Convertibles Protect Inhaber-Anteile o.N.	LU0200666799	ANT	19.475	
Zantke EO Corporate Bonds AMI Inhaber-Anteile I(a)	DE000A0Q8HQ0	ANT	7.185	
Zantke Euro High Yield AMI Inhaber-Anteile I(a)	DE000A0YAX49	ANT	9.800	
Zantke Global Credit AMI Inhaber-Anteile I (a)	DE000A1J3AJ9	ANT	11.785	

Erläuterungen zum Halbjahresbericht
zum 30. Juni 2020

Erläuterung 1 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze

a) Darstellung der Jahresberichte

Die Jahresberichte des Fonds sind gemäß den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen über Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) und gemäß dem Prinzip der Unternehmensfortführung 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 amtlich 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 amtlich 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 vorstehend genannten 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) Realisierte Nettogewinne/-verluste aus Wertpapierverkäufen

Der realisierte Nettogewinn/-verlust aus Wertpapierverkäufen wird auf der Grundlage des Mittelkurses der verkauften Wertpapiere berechnet.

d) 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.

e) Umrechnung von Fremdwährungen

Alle nicht auf die jeweilige Teilfondswährung lautenden Vermögenswerte werden zum letzten Devisenmittelkurs 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.

f) Konsolidierter Abschluss

Der konsolidierte Abschluss erfolgt in Euro und stellt die zusammengefasste Finanzlage aller Teilfonds zum Berichtsdatum dar.

g) 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.

h) Dividendenerträge

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

i) Bewertung der Devisentermingeschäfte

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

j) Bewertung der Terminkontrakte

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

k) Bewertung der Verbindlichkeiten

Die zum Berichtsstichtag bestehenden Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

l) 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.

m) 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.

n) **Verfügbare liquide Mittel**

Die in der Vermögensaufstellung angegebene Position „Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten“ beinhaltet neben den liquiden Mitteln des 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 verändert sich daher um die als Variation Margin verbuchten Beträge und weicht in entsprechender Höhe von der genannten Gesamtsumme der „Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten“ ab.

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

Daidalos – Multi Asset BP	EUR	5.267.035,84
---------------------------	-----	--------------

o) **Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht**

Dieser Bericht wurde auf Basis des Nettoinventarwertes zum 30. Juni 2020 mit den letzten verfügbaren Kursen zum 29. Juni 2020 und unter Berücksichtigung aller Ereignisse, die sich auf die Rechnungslegung zum Berichtsstichtag am 30. Juni 2020 beziehen, erstellt.

Erläuterung 2 – Gebühren und Aufwendungen

Angaben zu Gebühren und Aufwendungen können dem aktuellen Verkaufsprospekt sowie den wesentlichen Anlegerinformationen („Key Investor Information Document“) 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 Netto-Teilfondsvermögen zahlbar ist. Sofern ein Teilfonds oder eine Anteilsklasse für die Zeichnung durch institutionelle Anleger beschränkt ist, wird das Nettovermögen dieses Teilfonds bzw. dieser Anteilsklasse mit einer reduzierten „taxe d'abonnement“ von jährlich 0,01% besteuert.

Gemäß Artikel 175 (a) des 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 grundsätzlich thesauriert.

Sofern im Anhang zum Verkaufsprospekt eine Thesaurierung der Erträge vorgesehen ist, können auf gesonderten Beschluss der Verwaltungsgesellschaft 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.

Erläuterung 5 – Rückerstattung von Gebühren

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

Erläuterung 6 – Verwaltungsgebühren von Zielfonds

Sofern ein Teifonds in Anteile eines anderen Investmentfonds (Zielfonds) investiert, können für die erworbenen Zielfondsanteile zusätzliche Verwaltungsgebühren anfallen. Im Fall des Teifonds Daidalos – Multi Asset BP betragen diese Kosten maximal 3,50%.

Im Berichtszeitraum war das Nettovermögen des Teifonds Daidalos - Multi Asset VI unter anderem in von Axxion S.A. verwalteten Investmentfonds (Zielfonds) investiert. Hierbei wurde in Zielfonds investiert, deren maximale jährliche Verwaltungsvergütungssätze aus der nachfolgenden Aufstellung ersichtlich sind. Daneben können andere Kosten und Gebühren auf der Ebene der Zielfonds entstanden sein. Generell wurden für die Investition in Zielfonds keine Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge erhoben.

Währung	Bezeichnung	Verwaltungsvergütungssatz
EUR	Rothschild & Co WM - Aktien Actions au Porteur I o.N.	0,75%

Erläuterung 7 – Angaben zur Mitarbeitervergütung der Verwaltungsgesellschaft

Die Verwaltungsgesellschaft verfügt über ein Vergütungssystem, das sowohl die regulatorischen Anforderungen erfüllt, als auch das verantwortungsvolle und risikobewusste Verhalten der Mitarbeiter fördert. Das System ist so gestaltet, dass es mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar ist und nicht zur Übernahme von Risiken ermutigt. Das Vergütungssystem wird mindestens einmal jährlich durch einen Vergütungsausschuss auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller rechtlichen Vorgaben überprüft.

Ziel der Gesellschaft ist es, mit einer markt- und leistungsgerechten Vergütung die Interessen des Unternehmens, der Gesellschafter und der Mitarbeiter gleichermaßen zu berücksichtigen und die nachhaltige und positive Entwicklung der Gesellschaft zu unterstützen. Die Vergütung der Mitarbeiter setzt sich aus einem angemessenen Jahresfestgehalt sowie einer möglichen variablen leistungs- und ergebnisorientierten Vergütung zusammen.

Für die Vorstände und Mitarbeiter, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben gelten besondere Regelungen.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2019 (Zeitraum vom 1. Januar 2019 bis zum 31. Dezember 2019) der Axxion S.A. gezahlten Mitarbeitervergütung:

davon feste Vergütung:	TEUR 2.771
davon variable Vergütung:	TEUR 210
Gesamtsumme:	TEUR 2.981
Durchschnittliche Zahl der Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft:	43 (inkl. Vorstände)

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2019 (Zeitraum vom 1. Januar 2019 bis zum 31. Dezember 2019) der Axxion S.A. gezahlten Vergütungen an Risk Taker:

Vergütung:	TEUR 1.354
davon Führungskräfte:	TEUR 1.354

Die Vergütungsrichtlinie der Gesellschaft ist gegenüber dem Vorjahr unverändert, weitere Einzelheiten der aktuellen Vergütungsrichtlinie können kostenlos auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft www.axxion.lu unter der Rubrik Anlegerinformationen abgerufen werden.

Die Axxion S.A. hat das Portfoliomanagement des Fonds an die Diem Client Partner AG, die FAM Frankfurt Asset Management AG, die Zantke & Cie. Asset Management GmbH, die Fürstlich Castell'sche Bank und die Rothschild Vermögensverwaltungs-GmbH ausgelagert.

Angaben zur Vergütung der delegierten Portfoliomanager

Gesamtbetrag der kumulierten Vergütungen, unterteilt in fixe und variable Vergütung und die Anzahl der Begünstigten der variablen Vergütung:

Gesamtbetrag der Vergütung:	24.596 TEUR
Gesamtbetrag der fixen Vergütung:	21.230 TEUR
Gesamtbetrag der variablen Vergütung:	3.366 TEUR
Anzahl der Mitarbeiter:	253

Quellen zu den Angaben zur Vergütung der delegierten Portfoliomanager

Diem Client Partner AG: gemäß Auskunft der Diem Client Partner AG für das Geschäftsjahr 2018; FAM Frankfurt Asset Management AG: Da die Gesellschaft im zurückliegenden Geschäftsjahr neu gegründet wurde und noch kein geprüfter Jahresabschluss vorliegt, können keine Informationen zur Vergütung bereitgestellt werden.; Zantke & Cie. Asset Management GmbH: gemäß Auskunft der Zantke & Cie. Asset Management GmbH für das Geschäftsjahr 2018; Fürstlich Castell'sche Bank: gemäß Auskunft der Fürstlich Castell'sche Bank für das Geschäftsjahr 2018; Rothschild Vermögensverwaltungs-GmbH: gemäß Auskunft der Rothschild Vermögensverwaltungs-GmbH für das Geschäftsjahr 2018.

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

Änderung der Gesellschaftsstruktur der Verwaltungsgesellschaft Axxion S.A.

Mit Wirkung zum 24. Januar 2020 wurde die Gesellschaftsstruktur der Verwaltungsgesellschaft Axxion S.A. von einer monistischen Struktur auf eine dualistische Struktur umgestellt. An die Stelle der bisherigen Organe „Geschäftsführung“ und „Verwaltungsrat“ treten seither die Gremien „Vorstand“ und „Aufsichtsrat“. Die bisherigen Verwaltungsräte Martin Stürner und Constanze Hintze bilden zusammen mit Dr. Burkhard Wittek den Aufsichtsrat. Zum Vorstand der Axxion S.A. wurden Thomas Amend, bisher Verwaltungsrat und zukünftig Vorstandsvorsitzender, Pierre Girardet und Stefan Schneider bestellt.

Mögliche Auswirkungen der COVID-19-Pandemie

Angesichts der jüngsten Entwicklungen in Bezug auf COVID-19 sind die Mitglieder des Vorstands der Verwaltungsgesellschaft davon überzeugt, dass die Pläne zur Aufrechterhaltung des Geschäftsbetriebs die laufenden operationellen Risiken berücksichtigen. Der Vorstand hat dafür gesorgt, dass alle erforderlichen Maßnahmen getroffen werden, um sicherzustellen, dass die Aktivitäten der Gesellschaft nicht gestört werden. Auf Basis der aktuellen Entwicklungen in Bezug auf COVID-19 geht die Gesellschaft davon aus, dass die Unternehmensfortführung sowohl finanziell als auch personell sichergestellt ist.

Eine fortlaufende Überwachung der Risiken – insbesondere in Bezug auf Markt- sowie Liquiditätsrisiken – erfolgt durch das Risikomanagement der Verwaltungsgesellschaft.

Auf Basis der aktuellen Entwicklungen in Bezug auf COVID-19 geht die Gesellschaft davon aus, dass die Unternehmensfortführung des Teilfonds sichergestellt ist.