

**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



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

Portfolioverwalter

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

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	20.491.316,55	26,58
Belgien	300.840,00	0,39
Bundesrep. Deutschland	5.581.096,00	7,24
Frankreich	3.389.366,10	4,39
Großbritannien	561.824,63	0,73
Irland	280.933,75	0,36
Kaimaninseln	213.419,66	0,28
Kanada	692.085,37	0,90
Luxemburg	17.016,00	0,02
Niederlande	783.615,83	1,02
Schweiz	946.083,24	1,23
Spanien	28.218,00	0,04
USA	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 - Multi Asset VI

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2020

	Tageswert in EUR	% Anteil am Teilfondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	16.368.859,62	100,11
1. Aktien	1.210.738,76	7,40
Bundesrep. Deutschland	615.117,50	3,76
Frankreich	116.468,10	0,71
Niederlande	355.990,33	2,18
Schweiz	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							EUR	16.523.708,88	101,06	
Amtlich gehandelte Wertpapiere							EUR	7.583.206,45	46,38	
Aktien										
Swatch Group AG, The Inhaber-Aktien SF 2,25	CH0012255151		STK	700	700		CHF	187,9500	123.162,83	0,75
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005		STK	1.000	1.000		EUR	180,2200	180.220,00	1,10
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628		STK	6.255	6.255		EUR	18,6200	116.468,10	0,71
BASF SE Namens-Aktien o.N.	DE000BASF111		STK	2.500			EUR	50,1300	125.325,00	0,77
Bayer AG Namens-Aktien o.N.	DE000BAY0017		STK	2.525			EUR	66,9000	168.922,50	1,03
HUGO BOSS AG Namens-Aktien o.N.	DE000A1PHFF7		STK	3.000			EUR	26,3500	79.050,00	0,48
thyssenkrupp AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007500001		STK	10.000			EUR	6,1600	61.600,00	0,38
Unilever N.V. Aandelen op naam EO -,16	NL0000388619		STK	2.300	2.300		EUR	47,8300	110.009,00	0,67
trivago N.V. Aand.op n.A (Sp.ADS)/1 EO-,06	US89686D1054		STK	139.700			USD	1,9800	245.981,33	1,50
Verzinsliche Wertpapiere										
3,6250 % Nestlé Holdings Inc. AD-Medium-Term Notes 2014(20)	XS1130303305		AUD	100			%	101,0300	61.556,74	0,38
0,7750 % Cellnex Telecom S.A. SF-Med.-Term Notes 2020(27)	CH0506071148		CHF	50	50		%	97,5870	45.677,39	0,28
2,5000 % HOCHDORF Holding AG SF-FLR Anl. 2017(23/Und.)	CH0391647986		CHF	165	165		%	65,3500	100.941,29	0,62
1,8000 % AT & T Inc. EO-Notes 2019(19/39)	XS2051362312		EUR	100			%	94,0680	94.068,00	0,58
3,5000 % Banijay Entertainment S.A.S. EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2112340679		EUR	100	100		%	95,5360	95.536,00	0,58
0,8000 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2017(17/22)	XS1577747782		EUR	200			%	100,4690	200.938,00	1,23
1,5000 % Ceske Drah AS EO-Notes 2019(19/26)	XS1991190361		EUR	100			%	100,4630	100.463,00	0,61
1,2500 % Citycon Treasury B.V. EO-Notes 2016(16/26)	XS1485608118		EUR	100			%	84,3670	84.367,00	0,52
0,5000 % Colgate-Palmolive Co. EO-Bonds 2019(19/26)	XS1958646082		EUR	300			%	102,3440	307.032,00	1,88
0,8750 % DS Smith PLC EO-Medium-Term Nts 2019(19/26)	XS2051777873		EUR	100			%	96,5910	96.591,00	0,59
1,6250 % Elis S.A. EO-Med.-Term Nts 2019(19/28)	FR0013449998		EUR	100			%	91,4830	91.483,00	0,56
4,1960 % Eramet S.A. EO-Obl. 2017(17/24)	FR0013284643		EUR	200			%	88,1250	176.250,00	1,08
4,8750 % Eurofins Scientific S.E. EO-FLR Notes 2015(23/Und.)	XS1224953882		EUR	200			%	103,4680	206.936,00	1,27
1,8750 % G4S International Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2018(25/25)	XS1824462896		EUR	100			%	97,3770	97.377,00	0,60
1,5000 % Iliad S.A. EO-Obl. 2017(17/24)	FR0013287273		EUR	100			%	98,4290	98.429,00	0,60
3,6250 % Infineon Technologies AG Sub.-FLR-Nts.v.19(28/unb.)	XS2056730679		EUR	100			%	99,7520	99.752,00	0,61
1,5000 % Internat. Cons. Airl. Group SA EO-Bonds 2019(19/27)	XS2020581752		EUR	200			%	76,2430	152.486,00	0,93
2,8750 % Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2019(2029/2079)	XS2011260705		EUR	200			%	104,4020	208.804,00	1,28
2,2500 % Neopost S.A. EO-Obl. 2020(20/25)	FR0013478849		EUR	100	100		%	95,7970	95.797,00	0,59
2,1250 % NGG Finance PLC EO-FLR Notes 2019(27/82)	XS2010045511		EUR	100			%	98,4970	98.497,00	0,60
0,5000 % Novartis Finance S.A. EO-Notes 2018(18/23)	XS1769040111		EUR	300			%	101,7430	305.229,00	1,87
1,7500 % O2 Telefónica Dtdl. Finanzier. Anleihe v.2018(2018/2025)	XS1851313863		EUR	200			%	105,1090	210.218,00	1,29
6,2500 % OMV AG EO-FLR Notes 2015(25/Und.)	XS1294343337		EUR	100			%	117,3200	117.320,00	0,72
0,8000 % Philip Morris Internat. Inc. EO-Notes 2019(19/31)	XS2035474126		EUR	100			%	95,2610	95.261,00	0,58
2,5000 % RCS & RDS SA EO-Bonds 2020(20/25) Reg.S	XS2107451069		EUR	100	100		%	95,8600	95.860,00	0,59
3,8750 % SAZKA Group AS EO-Bonds 2020(20/27)Reg.S	XS2113253210		EUR	100	100		%	90,6790	90.679,00	0,55
1,5000 % SEB S.A. EO-Notes 2017(17/24)	FR0013259116		EUR	100			%	101,2710	101.271,00	0,62
5,6250 % SES S.A. EO-FLR Notes 2016(24/Und.)	XS1405765659		EUR	100			%	102,8760	102.876,00	0,63
3,0000 % SGL CARBON SE Wandelschuld.v.18(23)	DE000A2G8VX7		EUR	100	100		%	64,5000	64.500,00	0,39
5,7500 % Sigma Holdco B.V. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1813504666		EUR	150			%	97,9340	146.901,00	0,90
6,5000 % Stichting AK Rabobank Cert. EO-FLR Certs 2014(Und.)	XS1002121454		EUR	100			%	106,0820	106.082,00	0,65
2,6970 % Südzucker Intl Finance B.V. EO-FLR Bonds 2005(15/Und.)	XS0222524372		EUR	100			%	79,6240	79.624,00	0,49
4,1250 % Tereos Finance Groupe I EO-Obl. 2016(23/23)	FR0013183571		EUR	100	100	100	%	87,1150	87.115,00	0,53
0,1250 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2019(19/25)	XS2058556296		EUR	200			%	98,6890	197.378,00	1,21
2,8750 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-FLR Bonds 2018(26/Und.)	FR0013330537		EUR	100			%	88,8150	88.815,00	0,54
0,8750 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2019(19/32)	XS2052320954		EUR	150			%	98,4300	147.645,00	0,90
2,7500 % Wienerberger AG EO-Schuld.v. 2020(20/25)	AT0000A2GLA0		EUR	100	100		%	101,8000	101.800,00	0,62
2,0000 % ZF Europe Finance B.V. EO-Notes 2019(19/26)	XS2010039381		EUR	100			%	92,7490	92.749,00	0,57
1,7500 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. LS-Medium-Term Nts 2017(17/25)	BE6295391914		GBP	100			%	103,2750	112.670,60	0,69
4,2500 % BP Capital Markets PLC LS-FLR Notes 2020(27/Und.)	XS2193663619		GBP	100	100		%	100,4310	109.567,86	0,67

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 % Talk Talk 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	XS1703065620		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 % OI 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-Park 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)	XS2055079904		EUR	100		%	94,1150	94.115,00	0,58
3,3750 % Ziggo 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)	US40434LAA35		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	0,39
Ardilla Segur S.A. Inh.Gen. 2014/2029 DL 1000	LU1072258111		STK	1.360			USD	1.244,3800	1.504.986,04	9,20
Neuemissionen							EUR	111.953,83	0,68	
Zulassung zum Börsenhandel vorgesehen										
Verzinsliche Wertpapiere										
1,5000 % Comcast Corp. LS-Notes 2020(20/29)	XS2114853299		GBP	100	100		%	102,6180	111.953,83	0,68
Nichtnotierte Wertpapiere							EUR	327.904,17	2,01	
Verzinsliche Wertpapiere										
12,0000 % Allg.Ges.f.Verbrief.SA Comp.11 EO-FLR Nts12(25)'LUPUS CLO'	XS0828893700		STK	100			EUR	1.405,3200	140.532,00	0,86
2,5650 % Otis Worldwide Corp. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USU68356AF86		USD	200	200		%	105,3500	187.372,17	1,15
Investmentanteile							EUR	1.855.943,62	11,35	
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	1,70
Gruppenfremde Investmentanteile										
AGIF-Allianz Credit Opportuni. Inhaber-Anteile WT9 (EUR) o.N.	LU1797226666		ANT	8	8		EUR	102.232,3200	817.858,56	5,00
Alegra High Grade ABS Portfol. Inhaber-Anteile o.N.	LI0027320568		ANT	368	368	368	EUR	1.445,7600	532.039,68	3,25
iShare.Nikkei 225 UCITS ETF DE Inhaber-Anteile	DE000A0H08D2		ANT	6.420			EUR	18,5120	118.847,04	0,73
PAYDEN GBL-Pay.Gbl Em.Mkts Bd Registered Shs. Class EUR o.N.	IE00B04NLM33		ANT	5.436			EUR	20,0102	108.767,34	0,67
Summe Wertpapiervermögen							EUR	16.523.708,88	101,06	
Derivate							EUR	-463.089,06	-2,83	
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
Derivate auf einzelne Wertpapiere							EUR	-253.743,03	-1,55	
Wertpapier-Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktien										
Cie Financiere Richemont SA PUT 60.00 18.12.2020	EUREX	-101.777	STK	-18		18	CHF	5,8500	-9.857,52	-0,06
Straumann Holding AG PUT 640.00 18.12.2020	EUREX	-188.632	STK	-25		25	CHF	21,8300	-5.108,97	-0,03
Chr Hansen Holding A/S PUT 460.00 18.12.2020	XCSE	-226.956	STK	-25		25	DKK	6,2000	-2.079,70	-0,01
Allianz SE CALL 165.00 18.09.2020	EUREX	-180.220	STK	-10		10	EUR	21,4200	-21.420,00	-0,13
AXA SA PUT 18.00 18.09.2020	EUREX	-139.650	STK	-75		75	EUR	1,3100	-9.825,00	-0,06
BASF SE PUT 56.00 18.12.2020	EUREX	-100.260	STK	-20		20	EUR	8,1800	-16.360,00	-0,10
Bayer AG PUT 62.00 18.12.2020	EUREX	-167.250	STK	-25			EUR	4,2900	-10.725,00	-0,07
Bayerische Motoren Werke AG PUT 46.00 18.09.2020	EUREX	-147.446	STK	-26		26	EUR	1,2700	-3.302,00	-0,02
Continental AG PUT 88.00 18.12.2020	EUREX	-113.386	STK	-13		13	EUR	11,9500	-15.535,00	-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 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	
Kering SA PUT 380.00 19.03.2021	EUREX	-144.375	STK	-3		3	EUR	23,4100	-7.023,00	-0,04
SAP SE PUT 88.00 18.12.2020	EUREX	-208.148	STK	-17			EUR	2,1500	-3.655,00	-0,02
Technogym SpA PUT 9.00 18.12.2020	EUREX	-90.688	STK	-25		25	EUR	1,7678	-22.097,50	-0,13
Unilever NV CALL 50.00 18.12.2020	EUREX	-110.009	STK	-23		23	EUR	1,7100	-3.933,00	-0,02
BP PLC PUT 4.80 18.09.2020	XLON	-92.758	STK	-27		27	GBP	1,6950	-49.928,54	-0,31
Burberry Group PLC PUT 12.00 19.03.2021	XLON	-138.161	STK	-8		8	GBP	0,7250	-6.327,66	-0,04
Acuity Brands Inc PUT 90.00 18.12.2020	CBOE	-79.440	STK	-10		10	USD	12,5000	-11.116,05	-0,07
Alphabet Inc PUT 1100.00 18.06.2021 (Cl. C)	CBOE	-124.052	STK	-1		1	USD	66,0000	-5.869,28	-0,04
Barrick Gold Corp PUT 18.00 15.01.2021	CBOE	-151.040	STK	-65		65	USD	0,6450	-3.728,32	-0,02
Berkshire Hathaway Inc PUT 145.00 15.01.2021	CBOE	-141.815	STK	-9		9	USD	4,7000	-3.761,67	-0,02
Carnival Corp PUT 15.00 16.10.2020	CBOE	-150.714	STK	-101		101	USD	3,4000	-30.538,02	-0,19
Cisco Systems Inc PUT 40.00 18.09.2020	CBOE	-164.162	STK	-40			USD	1,1700	-4.161,85	-0,03
Facebook Inc PUT 170.00 18.09.2020	CBOE	-176.590	STK	-9			USD	3,2000	-2.561,14	-0,02
Newmont Corp PUT 45.00 18.12.2020	CBOE	-158.844	STK	-30		30	USD	1,8100	-4.828,81	-0,03
							EUR	-188.908,10	-1,16	
Aktienindex-Derivate										
Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktienindices										
DAX Index PUT 10500.00 18.12.2020	EUREX	-428.124	STK	-7		7	EUR	478,4000	-16.744,00	-0,10
DAX Index PUT 9000.00 18.12.2020	EUREX	-366.964	STK	-6		6	EUR	241,6000	-7.248,00	-0,04
EURO STOXX 50 Index PUT 2000.00 19.03.2021	EUREX	-517.123	STK	-16		16	EUR	41,0000	-6.560,00	-0,04
EURO STOXX 50 Index PUT 2300.00 18.06.2021	EUREX	-226.241	STK	-7		7	EUR	87,9000	-6.153,00	-0,04
EURO STOXX 50 Index PUT 2400.00 18.12.2020	EUREX	-452.483	STK	-14		14	EUR	58,1000	-8.134,00	-0,05
EURO STOXX 50 Index PUT 2400.00 19.03.2021	EUREX	-387.842	STK	-12		12	EUR	81,1000	-9.732,00	-0,06
EURO STOXX 50 Index PUT 2500.00 18.06.2021	EUREX	-387.842	STK	-12		12	EUR	119,3000	-14.316,00	-0,09
EURO STOXX 50 Index PUT 2800.00 18.09.2020	EUREX	-452.483	STK	-14			EUR	64,8000	-9.072,00	-0,06
EURO STOXX 50 Index PUT 2900.00 18.12.2020	EUREX	-387.842	STK	-12			EUR	142,6000	-17.112,00	-0,10
EURO STOXX 50 Index PUT 3000.00 18.06.2021	EUREX	-420.163	STK	-13		13	EUR	244,9000	-31.837,00	-0,20
EURO STOXX 50 Index PUT 3000.00 18.12.2020	EUREX	-420.163	STK	-13		13	EUR	169,3000	-22.009,00	-0,13
S&P 500 Index PUT 2100.00 17.12.2021	CBOE	-543.040	STK	-2		2	USD	115,0000	-20.453,53	-0,13
S&P 500 Index PUT 2300.00 18.06.2021	CBOE	-543.040	STK	-2		2	USD	109,8500	-19.537,57	-0,12
							EUR	-20.437,93	-0,12	
Devisen-Derivate										
Devisenterminkontrakte										
Offene Positionen										
			Kauf- währung	Kauf- betrag	Verkauf- währung	Verkauf- betrag	Fälligkeit			
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC		EUR	1.800.000,00	USD	-2.022.440,40	21.09.2020	4.702,44	0,03	
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC		EUR	800.000,00	USD	-902.424,80	01.10.2020	-885,35	0,00	
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC		EUR	968.115,82	USD	-1.080.000,00	30.09.2020	9.612,79	0,06	
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC		USD	1.989.585,00	EUR	-1.800.000,00	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							EUR	99.772,40	0,61
Zinsansprüche			EUR	99.772,40				99.772,40	0,61
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-18.176,80	-0,11
Verwaltungsvergütung			EUR	-8.182,18				-8.182,18	-0,05
Betreuungsgebühr			EUR	-1.090,21				-1.090,21	-0,01
Zentralverwaltungsvergütung			EUR	-1.045,11				-1.045,11	-0,01
Verwahrstellenvergütung			EUR	-529,76				-529,76	0,00
Register- und Transferstellenvergütung			EUR	-125,00				-125,00	0,00
Taxe d'Abonnement			EUR	-1.907,04				-1.907,04	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-4.915,00				-4.915,00	-0,03
Sonstige Kosten			EUR	-382,50				-382,50	0,00
Teilfondsvermögen							EUR	16.350.682,82	100,00 ¹⁾
Daidalos - Multi Asset VI P									
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.

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DAIDALOS Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennoteiz)

Australische Dollar	(AUD)	per 29.06.2020 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 Schuldscheindarlehen (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 % Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2018(23)	XS1910851242	EUR		150
1,1250 % Heimstadten 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 % Samhallsbyggnadsbol. 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)	US88167AAAF84	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 Schuldscheindarlehen (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.Propert. Inhaber-Anteile I A F o.N.	AT0000A1EKN2	ANT		5.000
---	--------------	-----	--	-------

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	19.280.577,79	31,75
Belgien	300.840,00	0,50
Bundesrep. Deutschland	4.965.978,50	8,18
Frankreich	3.272.898,00	5,39
Großbritannien	561.824,63	0,93
Irland	280.933,75	0,46
Kaimaninseln	213.419,66	0,35
Kanada	692.085,37	1,14
Luxemburg	17.016,00	0,03
Niederlande	427.625,50	0,70
Schweiz	822.920,41	1,35
Spanien	28.218,00	0,05
USA	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							EUR	55.785.367,48	91,85
Amtlich gehandelte Wertpapiere							EUR	34.012.918,25	56,00
Aktien									
Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien SF 1	CH0210483332		STK	5.000	5.000		CHF 60,4000	282.713,30	0,47
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350		STK	4.500			CHF 104,9200	441.987,61	0,73
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005		STK	4.200	1.500		EUR 180,2200	756.924,00	1,25
Amadeus IT Group S.A. Acciones Port. EO 0,01	ES0109067019		STK	600			EUR 47,0300	28.218,00	0,05
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251		STK	6.900	1.000		EUR 43,6000	300.840,00	0,50
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628		STK	17.000	17.000		EUR 18,6200	316.540,00	0,52
BASF SE Namens-Aktien o.N.	DE000BASF111		STK	9.000			EUR 50,1300	451.170,00	0,74
Continental AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0005439004		STK	400			EUR 87,2200	34.888,00	0,06
Daimler AG Namens-Aktien o.N.	DE0007100000		STK	8.000			EUR 35,9100	287.280,00	0,47
Danone S.A. Actions Port. EO-,25	FR0000120644		STK	5.000			EUR 62,1000	310.500,00	0,51
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	DE0005552004		STK	2.500			EUR 31,8700	79.675,00	0,13
Eiffage S.A. Actions Port. EO 4	FR0000130452		STK	400			EUR 81,7200	32.688,00	0,05
Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0005785802		STK	7.500			EUR 76,2200	571.650,00	0,94
Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0005785604		STK	5.500			EUR 44,2100	243.155,00	0,40
Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N	DE0006048432		STK	3.000		4.500	EUR 81,8200	245.460,00	0,40
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	DE0006231004		STK	17.500			EUR 20,5350	359.362,50	0,59
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011821202		STK	6.000			EUR 6,2630	37.578,00	0,06
Kering S.A. Actions Port. EO 4	FR0000121485		STK	100			EUR 481,2500	48.125,00	0,08
Koninklijke DSM N.V. Aandelen op naam EO 1,50	NL0000009827		STK	450			EUR 122,7500	55.237,50	0,09
LANXESS AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0005470405		STK	1.400			EUR 47,6700	66.598,00	0,11
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	FR0000121014		STK	850			EUR 389,5000	331.075,00	0,55
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026		STK	2.000			EUR 227,2000	454.400,00	0,75
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350		STK	1.000			EUR 98,2195	98.219,50	0,16
Orange S.A. Actions Port. EO 4	FR0000133308		STK	20.000			EUR 10,6850	213.700,00	0,35
Royal Dutch Shell Reg. Shares Class A EO -,07	GB00B03MLX29		STK	10.000			EUR 14,8620	148.620,00	0,24
RTL Group S.A. Actions au Porteur o.N.	LU0061462528		STK	600			EUR 28,3600	17.016,00	0,03
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578		STK	5.000	5.000		EUR 91,5400	457.700,00	0,75
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600		STK	6.900			EUR 122,4400	844.836,00	1,39
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972		STK	6.000			EUR 98,6000	591.600,00	0,97
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101		STK	4.500			EUR 103,7000	466.650,00	0,77
Siemens Healthineers AG Namens-Aktien o.N.	DE000SHL1006		STK	2.000			EUR 42,7250	85.450,00	0,14
thyssenkrupp AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007500001		STK	3.000			EUR 6,1600	18.480,00	0,03
Total S.A. Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271		STK	7.400			EUR 34,5500	255.670,00	0,42
Unilever N.V. Aandelen op naam EO -,16	NL0000388619		STK	7.000			EUR 47,8300	334.810,00	0,55
VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	FR0000125486		STK	5.000			EUR 82,7400	413.700,00	0,68
Vivendi S.A. Actions Port. EO 5,5	FR0000127771		STK	13.000	13.000		EUR 23,2000	301.600,00	0,50
Ashtead Group PLC Registered Shares LS -,10	GB0000536739		STK	1.500			GBP 27,2000	44.511,84	0,07
Aviva PLC Registered Shares LS -,25	GB0002162385		STK	10.000			GBP 2,7390	29.881,85	0,05
Diageo PLC Reg. Shares LS -,28935185	GB0002374006		STK	11.500			GBP 27,0050	338.810,94	0,56
Alibaba Group Holding Ltd. Reg.Shs (sp.ADRs)/8 DL-,000025	US01609W1027		STK	270			USD 215,0200	51.627,75	0,09
Alphabet Inc. Reg. Shs Cap.Stk Cl. C DL-,001	US02079K1079		STK	40			USD 1.394,9700	49.620,99	0,08
Alphabet Inc. Reg. Shs Cl. A DL-,001	US02079K3059		STK	350			USD 1.397,1700	434.868,39	0,72
American Water Works Co. Inc. Registered Shares DL -,01	US0304201033		STK	4.500			USD 125,3700	501.702,98	0,83
Apple Inc. Registered Shares o.N.	US0378331005		STK	500			USD 361,7800	160.862,61	0,27
Baidu Inc. R.Shs A(Sp.ADRs)/10/DL-,00005	US0567521085		STK	1.500	1.500		USD 121,2900	161.791,91	0,27
Berkshire Hathaway Inc. Reg.Shares B New DL -,00333	US0846707026		STK	1.000			USD 177,1900	157.572,25	0,26
Booking Holdings Inc. Registered Shares DL-,008	US09857L1089		STK	200	200		USD 1.593,2200	283.365,05	0,47
Canadian National Railway Co. Registered Shares o.N.	CA1363751027		STK	7.000			USD 86,9500	541.262,78	0,89
Church & Dwight Co. Inc. Registered Shares DL 1	US1713401024		STK	6.500			USD 76,7200	443.468,21	0,73
Cisco Systems Inc. Registered Shares DL-,001	US17275R1023		STK	27.500	1.000		USD 46,1500	1.128.612,72	1,86
Comcast Corp. Reg. Shares Class A DL -,01	US20030N1019		STK	8.500	8.500		USD 38,9400	294.344,15	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 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
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-,00000625	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 % HOCHDORF 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.)	NL0000116150		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 % Bundesrep.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.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)	XS2105772201		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)	IT0005386245		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)	PTOTETOEO012		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 % Samhallsbyggnadsbol. I Nord AB EO-Med.-Term Notes 2020(20/27)	XS2114871945		EUR	100	100	%	92,6330	92.633,00	0,15
3,8750 % SAKKA 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

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							EUR	8.476.761,43	13,96
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 % Samhallsbyggnadsbol. I Nord AB EO-FLR Cap. 2020(25/Und.)	XS2010032618		EUR	100	100	%	92,3880	92.388,00	0,15
2,8750 % Smurfit Kappa Acquis. Unl. 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		%	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.Handelslg.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.Handelslg.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
							EUR	121.011,42	0,20

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							EUR	-600.130,93	-0,99
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Derivate auf einzelne Wertpapiere							EUR	-633.351,45	-1,05
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							EUR	76.616,30	0,13
Aktienindex-Terminkontrakte									
DAX INDEX FUTURE Sep20	EUREX	-611.606	STK	-2	2	EUR	12.246,5000	10.450,00	0,02
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Aktienindices									
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						EUR		-43.395,78	-0,07
Devisenterminkontrakte									
Offene Positionen			Kauf- währung	Kauf- betrag	Verkauf- währung	Verkauf- betrag	Fälligkeit		
Banque de Luxembourg CHF/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						EUR		5.371.585,84	8,85
Kassenbestände						EUR		5.160.426,06	8,50
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						EUR		96.159,78	0,16
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						EUR		115.000,00	0,19
Cash Collateral Banque de Luxembourg S.A.									
			EUR	115.000,00				115.000,00	0,19
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR		224.626,19	0,37
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

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							EUR	-46.235,23	-0,08
Verwaltungsvergütung			EUR	-25.105,58				-25.105,58	-0,04
Betreuungsgebühr			EUR	-3.878,76				-3.878,76	-0,01
Zentralverwaltungsvergütung			EUR	-2.984,83				-2.984,83	-0,01
Verwahrstellenvergütung			EUR	-1.948,38				-1.948,38	0,00
Register- und Transferstellenvergütung			EUR	-125,00				-125,00	0,00
Taxe d'Abonnement			EUR	-6.895,20				-6.895,20	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-4.915,00				-4.915,00	-0,01
Sonstige Kosten			EUR	-382,48				-382,48	0,00
Teilfondsvermögen							EUR	60.735.213,35	100,00 ¹⁾
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) hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene der Zielfonds angefallen sein.

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DAIDALOS Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennoteiz)

Australische Dollar	(AUD)	per 29.06.2020 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	Eurex Deutschland
CBOE	Chicago - CBOE Opt. Ex.

OTC	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 Schuldscheindarlehen (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/Und.)	XS1713462403	EUR		100
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
3,6000 % AbbVie Inc. DL-Notes 2015(15/25)	US00287YQA26	USD		350
2,3000 % Adobe Inc. DL-Notes 2020(20/30)	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.	LU020066799	ANT		19.475
Zantke EO Corporate Bonds AMI Inhaber-Anteile I(a)	DE000AQ8HQ0	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

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

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 Teilfonds unter Abzug einer Bearbeitungsgebühr gutgeschrieben.

Erläuterung 6 – Verwaltungsgebühren von Zielfonds

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

Im Berichtszeitraum war das Nettovermögen des Teilfonds 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.

DAIDALOS
Investmentfonds (F.C.P.)

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.