

**Geprüfter Jahresbericht
zum 31. Dezember 2023**

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



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

Inhaltsverzeichnis

Management und Verwaltung	1
Allgemeine Informationen	4
Geschäftsbericht	6
Prüfungsvermerk	9
Daidalos	12
<i>Zusammengefasste Vermögensübersicht</i>	12
<i>Zusammengefasste Ertrags- und Aufwandsrechnung</i>	13
<i>Zusammengefasste Entwicklung des Fondsvermögens</i>	14
Daidalos - Multi Asset VI	15
<i>Vermögensübersicht</i>	15
<i>Vermögensaufstellung</i>	16
<i>Ertrags- und Aufwandsrechnung</i>	20
<i>Entwicklung des Teilfondsvermögens</i>	21
Daidalos - Multi Asset BP	22
<i>Vermögensübersicht</i>	22
<i>Vermögensaufstellung</i>	23
<i>Ertrags- und Aufwandsrechnung</i>	31
<i>Entwicklung des Teilfondsvermögens</i>	32
Erläuterungen zum Jahresbericht (Anhang)	33

Management und Verwaltung

Verwaltungsgesellschaft

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

Eigenkapital per 31. Dezember 2022
EUR 4.030.882

Aufsichtsrat der Verwaltungsgesellschaft

Vorsitzender

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

Mitglieder

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

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

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

Vorstand der Verwaltungsgesellschaft

Vorsitzender

Stefan SCHNEIDER

Mitglieder

Pierre GIRARDET

Armin CLEMENS

Abschlussprüfer

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

Verwahrstelle

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

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

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

Werden weitere Teilfonds hinzugefügt, wird der Verkaufsprospekt entsprechend ergänzt.

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

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

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

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

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.

Die Basisinformationsblätter 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.

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

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 Basisinformationsblätter sowie die Jahresberichte und Halbjahresberichte des Fonds zur Verfügung gestellt werden.

Informationen, insbesondere Mitteilungen an die Anleger, werden ebenfalls auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft www.axxion.lu 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.

Geschäftsbericht

Der Portfolioverwalter berichtet im Auftrag der Verwaltungsgesellschaft:

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

das Berichtsjahr vom 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023 war erneut geprägt von einer dynamischen und volatilen Entwicklung an den Kapitalmärkten: Während die weltweiten Rentenmärkte über das gesamte Berichtsjahr eine volatile Seitwärtsbewegung zeigten, startete an den Aktienmärkten mit deutlich zweistelligen Zugewinnen eine Aufholjagd nach den herben Verlusten im ersten Halbjahr 2022.

In Europa sorgte im März 2023 die Entwicklung bei der Crédit Suisse für Unruhe im Bankensektor. Nachdem einer der wichtigsten Hauptaktionäre, die Saudi National Bank, öffentlich bekannt gab, bei einer Kapitalerhöhung kein weiteres Kapital zur Verfügung zu stellen, brach der Aktienkurs ein. Nach der Pleite der Silicon Valley Bank in den USA wenige Tage zuvor führten auch die stabilisierenden Maßnahmen der schweizerischen Aufsicht und Nationalbank nicht zum gewünschten Ergebnis, so dass auf Drängen von Politik und Aufsichtsbehörden die Übernahme durch die UBS die Folge war.

Positiven Einfluss auf die Kapitalmärkte hatte Anfang 2023 die Lockerung der Null-Covid Strategie durch die chinesische Regierung, die Aufhebung von Corona-Restriktionen sowie die fiskalischen und geldpolitischen Unterstützungen, die Peking in Aussicht stellte.

Die mit der Wahl Joe Bidens zum US-Präsidenten verbundenen Hoffnungen auf eine sich entspannende Außenpolitik im Handelsstreit mit China wurden allerdings durch den Besuch der Sprecherin des US-Repräsentantenhauses, Nancy Pelosi, in Taiwan im Sommer 2022 oder den Abschuss eines mutmaßlichen chinesischen "Spionageballon" durch ein US-Kampfflugzeug im Februar 2023 gedämpft. Beim G7-Gipfel im Sommer versuchten die Teilnehmer dann die geopolitischen Spannungen etwas zu lösen, indem man sich vom „Decoupling“ von China distanzierte, um stattdessen auf ein „De-Risking“ zu setzen, das heißt den Abbau von Risiken durch einseitige Abhängigkeiten. Das lang ausstehende Treffen der Präsidenten Biden und Xi im November 2023 machte deutlich, dass die Beziehungen zwischen den beiden Weltmächten zwar angespannt sind, aber eine militärische Auseinandersetzung klar verhindert werden soll.

Im Juni 2023 konnte mittels Schuldengesetz die drohende Zahlungsunfähigkeit der USA in letzter Minute abgewendet werden: dazu wurde – bei gleichzeitiger Kürzung der geplanten Staatsausgaben – die Schuldenobergrenze für 2 Jahre bis 2025 ausgesetzt. Der parteiübergreifende Kompromiss war dringend erforderlich, um weitere Auswirkungen auf die Kreditwürdigkeit des Landes, einen erheblichen Vertrauensverlust und Verunsicherungen an den Finanzmärkten zu verhindern.

Ein Blick auf die wichtigsten Leitindizes verdeutlicht die oben genannten Entwicklungen im Berichtsjahr. Negative Nachrichten führten lediglich zu Dämpfern und Rücksetzern, konnten den allgemeinen Aufwärtstrend jedoch nicht stoppen:

Der deutsche Leitindex DAX startete im Januar 2023 bei 14.069,26 Punkten. Bis in den Sommer 2023 konnte erheblich Performance im Vergleich zum Vorjahr aufgeholt werden, bevor ein Rücksetzer folgte, der allerdings erneut wettgemacht werden konnte. Nach einer Jahresend rally beendete der DAX das Geschäftsjahr mit 16.751,64 Punkten, was ein Plus von 19,07% bedeutet.

Die Performance in den USA war im vergangenen Geschäftsjahr ebenfalls im zweistellig positiven Bereich. Zum Ende des Kalenderjahres liegt der Dow Jones bei 37.689,54 Punkten, was ein Zugewinn von 13,74% (in USD) bedeutet. Die Fed hob die Zinsen von nahe 0% Anfang 2022 in mehreren Sitzungen auf eine Bandbreite von 5% bis 5,25% an, während die Inflationsraten seit Juni 2022 wieder gefallen waren.

Daidalos Investmentfonds (F.C.P.)

DAX	Dow Jones	EuroStoxx 50	MSCI World	Nikkei	Hang Seng	EUR / USD
19,07%	13,74%	17,25%	21,55%	30,13%	-15,38%	3,48%

Quelle: finanzen.net, Abfragezeitraum 01.01.2023 - 31.12.2023

Für die Anleihemärkte jedoch war das Geschäftsjahr leider negativ behaftet: Getrieben von steigenden Energiepreisen wurde mit Blick auf die Eurozone für den Oktober 2022 eine Rekordinflation von 10,6% zum Vorjahresmonat vermeldet. Die im Anschluss zwar fallende, aber dennoch hartnäckige Kerninflation und der weltweite, anhaltende Zinsanstieg führten flächendeckend zu Renditeanstiegen in allen Bereichen der Rentenmärkte. In den USA erreichten die Renditen im Oktober 2023 den höchsten Stand aus den vergangenen 15 Jahren und führten zu einem Abverkauf bei US-Staatsanleihen.

Der Wechselkurs zwischen EUR und USD zeigte sich im Berichtsjahr recht volatil. Nach der klaren Aufwertung des US-Dollars im Vorjahr – im Zuge des beherzten Eingreifens der Fed mit starken Zinserhöhungen im Vergleich zur EZB und der stärkeren US-Wirtschaft im Vergleich zur europäischen Wirtschaft – konnte sich der Euro aber seit Herbst 2022 wieder deutlich erholen und notierte im Frühjahr und Sommer sogar zeitweise über der Marke von 1,10 USD/EUR. Ende Dezember notiert der Wechselkurs bei 1,1037 USD/EUR, was einem Plus von 3,48% im Geschäftsjahr entspricht.

Nach dem deutlichen Preisanstieg des Ölpreises bis zum Hochpunkt bei über 120 USD nach Ausbruch des Ukraine-Kriegs und dem anschließenden Boykott von russischem Öl war in diesem Berichtsjahr zunächst eine Seitwärtsbewegung bei hoher Volatilität zu verzeichnen. Die Bemühungen der Produzenten in Saudi-Arabien und Russland, das Angebot zu verknappen, sowie die höhere Nachfrage aus USA und China in Folge robuster Wirtschaftsdaten bzw. zur Stimulierung der Konjunktur trieben den Ölpreis seit Sommer 2023 wieder vorübergehend in die Höhe. Ende Dezember liegt der Ölpreis (WTI) bei 71,65 USD.

Ausblick

Durch den Überfall der Hamas auf Israel Anfang Oktober ist im Nahen Osten ein weiterer geopolitischer Krisenherd ausgebrochen, dessen politische und wirtschaftliche Folgen noch schwer abschätzbar sind. An den Finanzmärkten sorgten sie zunächst für etwas Unruhe: Flucht in Sicherheit durch Kauf von Bundesanleihen oder US-Staatsanleihen, Anstieg des Goldpreises und gestärkter Dollar-Kurs waren die Folge, allerdings in moderatem Ausmaß. Auch der Anstieg des Ölpreises fiel moderat aus.

Mit Blick auf die Inflation ist in den kommenden Monaten eher von einem weiteren Rückgang sowohl in den USA als auch in Europa auszugehen und mit Blick auf die Zinspolitik von einer anhaltenden Zinspause oder gar Zinssenkungen im kommenden Jahr. Frühindikatoren wie der ifo Geschäftsklimaindex und der europäische Einkaufsmanagerindex zeigen kleinere Schwankungen nach oben und unten, was auf eine Stabilisierung der Wirtschaft, wenn auch auf niedrigem Niveau, hindeutet.

Der Mix aus belastend wirkenden politischen Störfaktoren – insbesondere da ohne Aussicht auf eine schnelle Lösung – und die Sorgen um die Auswirkungen des hohen Zinsniveaus auf die Wirtschaft wird auch in den kommenden Monaten noch anhalten und zu erhöhter Volatilität an den Kapitalmärkten führen.

Fondsergebnis

Diese Berichtsperiode brachte dem Teilfonds Daidalos – Multi Asset BP ein gutes Ergebnis von 9,25%. Die Entwicklungen an den Kapitalmärkten zeichneten sich auch in der Performance des Portfolios deutlich ab: zunächst konstanter Zuwachs aufgrund der positiven Entwicklungen im Aktienbereich, Einbruch im Herbst und finale Jahresendrally. Der Teilfonds war dabei vornehmlich in Aktien- und Rententiteln allokiert. Hybride und alternative Investments sowie Rohstoffe stellten nur einen kleinen Anteil am Portfolio.

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

Der Schwerpunkt des Teilfonds Daidalos – Multi Asset VI lag auch in dieser Berichtsperiode auf der Rentenseite und im Euro-Raum; daneben wurde in alternative Anlagen und Aktien investiert. Nach einem moderaten Anstieg sowie einer Seitwärtsbewegung in den ersten drei Quartalen konnten Ende des Jahres noch einige Prozentpunkte gut gemacht werden, so dass in der Berichtsperiode in Summe eine Performance von 5,32% zu verzeichnen war.

Grevenmacher, im April 2024

Der Vorstand der Axxion S.A.



Prüfungsvermerk

An die Anteilhaber des
Daidalos

Unser Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Abschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Abschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des Daidalos (der „Fonds“) und seiner jeweiligen Teilfonds zum 31. Dezember 2023 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Was wir geprüft haben

Der Abschluss des Fonds besteht aus:

- der zusammengefassten Vermögensübersicht des Fonds und der Vermögensübersicht der Teilfonds zum 31. Dezember 2023;
- der Vermögensaufstellung der Teilfonds zum 31. Dezember 2023;
- der zusammengefassten Ertrags- und Aufwandsrechnung des Fonds und der Ertrags- und Aufwandsrechnung der Teilfonds für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr;
- der zusammengefassten Entwicklung des Fondsvermögens des Fonds und der Entwicklung des Teilfondsvermögens der Teilfonds für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr; und
- dem Anhang, einschließlich einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über die Prüfungstätigkeit (Gesetz vom 23. Juli 2016) und nach den für Luxemburg von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ (CSSF) angenommenen internationalen Prüfungsstandards (ISAs) durch. Unsere Verantwortung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs wird im Abschnitt „Verantwortung des „Réviseur d’entreprises agréé“ für die Abschlussprüfung“ weitergehend beschrieben.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Wir sind unabhängig von dem Fonds in Übereinstimmung mit dem „International Code of Ethics for Professional Accountants, including International Independence Standards“, herausgegeben vom „International Ethics Standards Board for Accountants“ (IESBA Code) und für Luxemburg von der CSSF angenommen, sowie den beruflichen Verhaltensanforderungen, die wir im Rahmen der Abschlussprüfung einzuhalten haben und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt.

Sonstige Informationen

Der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Informationen beinhalten die Informationen, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch beinhalten sie nicht den Abschluss und unseren Prüfungsvermerk zu diesem Abschluss.

Unser Prüfungsurteil zum Abschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben keinerlei Sicherheit jedweder Art auf diese Informationen.

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Abschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Abschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnenen Erkenntnissen besteht oder auch ansonsten die sonstigen Informationen wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Arbeiten schlussfolgern, dass sonstige Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Verantwortung des Vorstandes der Verwaltungsgesellschaft für den Abschluss

Der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Abschlusses, und für die internen Kontrollen, die er als notwendig erachtet, um die Aufstellung des Abschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Abschlusses ist der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds und seiner Teilfonds zur Fortführung der Tätigkeit und, sofern einschlägig, Angaben zu Sachverhalten zu machen, die im Zusammenhang mit der Fortführung der Tätigkeit stehen, und die Annahme der Unternehmensfortführung als Rechnungslegungsgrundsatz zu nutzen, sofern nicht der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren oder einen seiner Teilfonds zu schließen, die Geschäftstätigkeit einzustellen, oder keine andere realistische Alternative mehr hat, als so zu handeln.

Verantwortung des „Réviseur d'entreprises agréé“ für die Abschlussprüfung

Die Zielsetzung unserer Prüfung ist es, eine hinreichende Sicherheit zu erlangen, ob der Abschluss als Ganzes frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist, und darüber einen Prüfungsvermerk, der unser Prüfungsurteil enthält, zu erteilen. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Grad an Sicherheit, ist aber keine Garantie dafür, dass eine Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs stets eine wesentliche falsche Darstellung, falls vorhanden, aufdeckt. Unzutreffende Angaben können entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass diese individuell oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.



Im Rahmen einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs üben wir unser pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen falschen Darstellungen im Abschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können;
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben;
- beurteilen wir die Angemessenheit der von dem Vorstand der Verwaltungsgesellschaft angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und den entsprechenden Anhangsangaben;
- schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Tätigkeit durch den Vorstand der Verwaltungsgesellschaft sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds oder eines seiner Teilfonds zur Fortführung der Tätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Prüfungsvermerk auf die dazugehörigen Anhangsangaben zum Abschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Prüfungsvermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds seine Tätigkeit nicht mehr fortführen kann;
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Abschlusses einschließlich der Anhangsangaben, und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem den geplanten Prüfungsumfang und Zeitraum sowie wesentliche Prüfungsfeststellungen einschließlich wesentlicher Schwächen im internen Kontrollsystem, die wir im Rahmen der Prüfung identifizieren.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Vertreten durch

Luxemburg, 30. April 2024

Carsten Brengel

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos

Zusammengefasste Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2023

	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	83.105.618,01	100,10
1. Aktien	37.264.486,24	44,89
Belgien	280.416,00	0,34
Bermuda	51.204,05	0,06
Bundesrep. Deutschland	3.786.573,85	4,56
Dänemark	889.716,93	1,07
Frankreich	5.423.844,60	6,53
Großbritannien	1.577.590,12	1,90
Irland	1.511.627,15	1,82
Italien	96.162,70	0,12
Japan	313.115,27	0,38
Kanada	616.579,58	0,74
Niederlande	2.016.903,68	2,43
Schweiz	2.425.614,10	2,92
Spanien	979.215,67	1,18
USA	17.295.922,54	20,84
2. Anleihen	31.002.096,32	37,34
< 1 Jahr	4.007.483,04	4,82
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	5.643.570,50	6,80
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	4.650.268,42	5,60
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	6.192.305,86	7,46
>= 10 Jahre	10.508.468,50	12,66
3. Zertifikate	842.731,33	1,02
Euro	842.731,33	1,02
4. Sonstige Beteiligungswertpapiere	290.143,11	0,35
Euro	25.839,00	0,03
US-Dollar	264.304,11	0,32
5. Investmentanteile	10.870.643,73	13,09
Euro	7.947.874,62	9,57
US-Dollar	2.922.769,11	3,52
6. Derivate	-435.933,09	-0,53
7. Bankguthaben	2.859.920,17	3,44
8. Sonstige Vermögensgegenstände	411.530,20	0,50
II. Verbindlichkeiten	-84.868,87	-0,10
III. Fondsvermögen	83.020.749,14	100,00

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos

Zusammengefasste Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)
für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

I. Erträge

1. Dividenden	EUR	857.436,31
2. Zinsen aus Wertpapieren	EUR	1.029.581,55
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen	EUR	128.004,70
4. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	55.133,30
5. Abzug Quellensteuer	EUR	-167.090,94
6. Bestandsprovisionen	EUR	9.735,93

Summe der Erträge **EUR 1.912.800,85**

II. Aufwendungen

1. Verwaltungsvergütung	EUR	-408.156,45
2. Verwahrstellenvergütung	EUR	-25.061,18
3. Register- und Transferstellenvergütung	EUR	-2.909,07
4. Betreuungsgebühr	EUR	-59.918,97
5. Zentralverwaltungsgebühr	EUR	-87.660,44
6. Vertriebs-, Informations- und Zahlstellengebühr	EUR	-3.354,51
7. Prüfungskosten	EUR	-32.307,61
8. Taxe d'Abonnement	EUR	-38.478,92
9. Zinsaufwand aus Geldanlagen	EUR	-5.671,82
10. Sonstige Aufwendungen (siehe Erläuterung 2)	EUR	-64.608,11

Summe der Aufwendungen **EUR -728.127,08**

III. Ordentlicher Nettoertrag **EUR 1.184.673,77**

IV. Veräußerungsgeschäfte

1. Realisierte Gewinne	EUR	3.017.783,57
2. Realisierte Verluste	EUR	-3.321.305,23

Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften **EUR -303.521,66**

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres **EUR 881.152,11**

VI. Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres **EUR 5.898.059,10**

VII. Ergebnis des Geschäftsjahres **EUR 6.779.211,21**

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

**Daidalos
Zusammengefasste Entwicklung des Fondsvermögens**

		2023
I. Wert des Fondsvermögens am Beginn des Geschäftsjahres		EUR 80.439.137,14
1. Ausschüttung		EUR -334.478,25
2. Mittelzufluss / -abfluss (netto)		EUR -3.901.284,20
a) Mittelzuflüsse aus Anteilscheingeschäften	EUR 551.755,50	
b) Mittelabflüsse aus Anteilscheingeschäften	EUR -4.453.039,70	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		EUR 38.163,24
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		EUR 6.779.211,21
II. Wert des Fondsvermögens am Ende des Geschäftsjahres		EUR 83.020.749,14

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

Daidalos - Multi Asset VI

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2023

	Tageswert in EUR	% Anteil am Teilfondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	10.487.343,48	100,22
1. Aktien	61.703,94	0,59
Niederlande	61.703,94	0,59
2. Anleihen	7.669.505,35	73,29
< 1 Jahr	935.258,80	8,94
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	1.812.372,55	17,32
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	1.625.883,42	15,53
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	1.845.852,01	17,64
>= 10 Jahre	1.450.138,57	13,86
3. Zertifikate	423.431,33	4,05
Euro	423.431,33	4,05
4. Sonstige Beteiligungswertpapiere	290.143,11	2,77
Euro	25.839,00	0,25
US-Dollar	264.304,11	2,52
5. Investmentanteile	1.349.296,18	12,90
Euro	1.349.296,18	12,90
6. Bankguthaben	590.230,06	5,64
7. Sonstige Vermögensgegenstände	103.033,51	0,98
II. Verbindlichkeiten	-23.185,49	-0,22
III. Teilfondsvermögen	10.464.157,99	100,00

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	9.794.079,91	93,60
Amtlich gehandelte Wertpapiere							EUR	4.073.470,43	38,93
Aktien									
trivago N.V. Aand.op n.A (Sp.ADS)/5 EO-.06	US89686D3035		STK	27.940	27.940		USD 2,4400	61.703,94	0,59
Verzinsliche Wertpapiere									
0,7750 % Cellnex Telecom S.A. SF-Med.-Term Notes 2020(27)	CH0506071148		CHF	50			% 96,6030	51.953,30	0,50
2,5000 % HOCHDORF Holding AG SF-FLR Anl. 2017(23/Und.)	CH0391647986		CHF	235			% 29,1000	73.555,19	0,70
0,1250 % Bayerische Landesbank Med.Term.Inh.-Schv.21(28)	DE000BLB6J00		EUR	200			% 86,9920	173.984,00	1,66
2,7500 % Bque ouest-afr.developmt -BOAD EO-Bonds 2021(32/33) Reg.S	XS2288824969		EUR	100			% 76,9110	76.911,00	0,74
1,2500 % Cellnex Finance Company S.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	XS2300292963		EUR	100			% 89,5050	89.505,00	0,86
1,5000 % Ceske Drahy AS EO-Notes 2019(19/26)	XS1991190361		EUR	100			% 94,5640	94.564,00	0,90
0,4250 % Dongfeng Motor(HK)Intl Co.Ltd. EO-Bonds 2021(21/24)	XS2394012103		EUR	100			% 96,6650	96.665,00	0,92
4,5000 % DS Smith PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	XS2654098222		EUR	100	100		% 104,2130	104.213,00	1,00
0,3750 % Emirates Telecommun. Grp Co. EO-Med.-T. Notes 2021(28/28)	XS2339427747		EUR	125			% 88,0320	110.040,00	1,05
4,5000 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Medium-Term Notes 23(23/43)	XS2589260996		EUR	100	200	100	% 103,3470	103.347,00	0,99
1,8160 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2021(21/31)	XS2304675791		EUR	100			% 77,8630	77.863,00	0,74
2,0000 % Eutelsat S.A. EO-Bonds 2018(18/25)	FR0013369493		EUR	100	100		% 94,5470	94.547,00	0,90
6,7500 % Heimstaden AB EO-FLR Notes 21(21/Und.)	SE0016278352		EUR	100			% 21,7970	21.797,00	0,21
4,2500 % Huhtamäki Oyj EO-Notes 2022(22/27)	FI4000523550		EUR	100			% 100,4580	100.458,00	0,96
5,6250 % Iliad Holding S.A.S. EO-Notes 2021(21/28) Reg.S	XS2397781944		EUR	100			% 100,6510	100.651,00	0,96
3,6250 % Infineon Technologies AG Sub.-FLR-Nts.v.19(28/unb.)	XS2056730679		EUR	100			% 96,1170	96.117,00	0,92
4,1250 % LSEG Netherlands B.V. EO-Medium-Term Notes 23(23/26)	XS2679903950		EUR	100	100		% 102,6330	102.633,00	0,98
7,5000 % Nidda Healthcare Holding GmbH Anleihe v.22(22/26) Reg.S	XS2550063478		EUR	100	100		% 103,2080	103.208,00	0,99
6,2500 % OMV AG EO-FLR Notes 2015(25/Und.)	XS1294343337		EUR	80		20	% 103,7450	82.996,00	0,79
0,6250 % Procter & Gamble Co., The EO-Bonds 2018(18/24)	XS1900750107		EUR	100	100		% 97,5250	97.525,00	0,93
5,7500 % Sarens Finance Company N.V. EO-Notes 2020(20/27)	BE6318634548		EUR	100	100		% 92,8440	92.844,00	0,89
5,7500 % Sigma Holdco B.V. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1813504666		EUR	150			% 89,6320	134.448,00	1,29
3,5000 % Statnett SF EO-Med.-Term Notes 2023(23/33)	XS2631835332		EUR	100	100		% 104,2760	104.276,00	1,00
7,0250 % Südzucker Intl Finance B.V. EO-FLR Bonds 2005(15/Und.)	XS0225254372		EUR	100			% 96,6100	96.610,00	0,92
5,0560 % TDC Net A/S EO-Medium-Term Nts 2022(22/28)	XS2484502823		EUR	100			% 104,1710	104.171,00	1,00
5,6250 % TDF Infrastructure SAS EO-Obl. 2023(23/28)	FR001400J861		EUR	100	100		% 105,1680	105.168,00	1,01
0,7500 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2016(16/24)	XS1405775708		EUR	100	100		% 97,8920	97.892,00	0,94
1,6250 % Tikehau Capital S.C.A. EO-Obl. 2021(21/29)	FR0014002PC4		EUR	100			% 87,2040	87.204,00	0,83
2,0000 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 22(22/Und.)	XS2432130610		EUR	100			% 92,4580	92.458,00	0,88
3,4000 % Unilever Capital Corp. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33)	XS2632655135		EUR	100	100		% 103,1980	103.198,00	0,99
4,2500 % BP Capital Markets PLC LS-FLR Notes 2020(27/Und.)	XS2193663619		GBP	200			% 94,1140	217.105,16	2,07
1,5000 % Comcast Corp. LS-Notes 2020(20/29)	XS2114853299		GBP	100			% 88,3340	101.885,83	0,97
2,7480 % Ford Motor Credit Co. LLC LS-Medium Term Notes 2020(24)	XS2272365078		GBP	100			% 98,6080	113.736,03	1,09
3,2500 % Pinewood FinCo PLC LS-Notes 2019(21/25) Reg.S	XS2052466815		GBP	100			% 97,3640	112.301,18	1,07
0,7500 % Toyota Motor Credit Corp. LS-Med.-Term Nts 2020(26)	XS2260426288		GBP	100			% 90,5940	104.492,55	1,00
4,5000 % VMED O2 UK Financing I PLC LS-Notes 2021(21/31) Reg.S	XS2358483258		GBP	100			% 86,8090	100.126,88	0,96
5,5500 % ConocoPhillips Company DL-Notes 2023(23/54)	US20826FBG00		USD	50	50		% 106,5910	48.237,77	0,46
4,7500 % Fresenius Med.C.US Fin.II Inc. DL-Notes 2014(14/24) Reg.S	USU31434AE08		USD	100			% 98,5840	89.228,40	0,85
0,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau DL-Anl.v.2021 (2024)	US500769JP02		USD	40	40		% 96,8250	35.054,53	0,33
5,4500 % McDonald's Corp. DL-Medium-Term Nts 2023(23/53)	US58013MFW91		USD	50	50		% 106,6990	48.286,65	0,46
1,6250 % Saudi Arabian Oil Co. DL-Med.-T.Nts 2020(25/25)Reg.S	XS2262853000		USD	200			% 94,1940	170.510,02	1,63
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	4.130.302,39	39,47
Verzinsliche Wertpapiere									
9,5000 % Adler Pelzer Holding GmbH Notes v.23(27) Reg.S	XS2623604233		EUR	100	100		% 100,0310	100.031,00	0,96
0,8000 % AGCO International Holdings BV EO-Notes 2021(21/28)	XS2393323071		EUR	100			% 87,8080	131.712,00	1,26
2,8750 % AT & T Inc. EO-FLR Pref.Secs 2020(25/Und.)	XS2114413565		EUR	200			% 96,3510	192.702,00	1,84

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens	
1,7500 % CECONOMY AG Anleihe v.2021(2021/2026)	XS2356316872		EUR	100		%	87,3250	87.325,00	0,83	
4,7500 % Coty Inc. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1801788305		EUR	200		%	100,1570	200.314,00	1,91	
2,2500 % Grifols S.A. EO-Notes 2019(19/27) Reg.S	XS2077646391		EUR	100		%	94,6710	94.671,00	0,91	
4,2500 % Huntsman International LLC EO-Notes 2016(16/25)	XS1395182683		EUR	100		%	99,5700	99.570,00	0,95	
3,0000 % Indra Sistemas S.A. EO-Bonds 2018(18/24)	XS1809245829		EUR	100		%	99,2340	99.234,00	0,95	
6,6250 % INEOS Finance PLC EO-Notes 2023(23/28) Reg.S	XS2587558474		EUR	150	150	%	102,8690	154.303,50	1,47	
5,7500 % Lenzing AG EO-FLR Notes 2020(20/Und.)	XS2250987356		EUR	200	100	%	87,6410	175.282,00	1,68	
2,3750 % MAHLE GmbH Medium Term Notes v.21(28/28)	XS2341724172		EUR	100	100	%	85,9060	85.906,00	0,82	
4,3750 % Robert Bosch GmbH MTN v.2023(2023/2043)	XS2629470761		EUR	100	100	%	107,3940	107.394,00	1,03	
2,0000 % SPCM S.A. EO-Notes 2020(20/26) Reg.S	XS2234515786		EUR	100		%	96,7420	96.742,00	0,92	
7,8750 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2023(23/31)	XS2592804194		EUR	100	100	%	113,5430	113.543,00	1,09	
4,3000 % Apple Inc. DL-Notes 2023(23/33)	US037833EV87		USD	150	150	%	101,6170	137.960,36	1,32	
1,4500 % Berkshire Hathaway Fin. Corp. DL-Notes 2020(20/30)	US084664CW92		USD	100		%	84,4060	76.395,89	0,73	
4,8750 % Berry Global Escrow Corp. DL-Notes 2019(19/26) Reg.S	USU0740VAA18		USD	100		%	98,6380	89.277,28	0,85	
5,0000 % Broadcom Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US11135FBD24		USD	50	50	%	101,6970	46.022,99	0,44	
7,6250 % Carnival Corp. DL-Notes 2020(20/26) Reg.S	USP2121VAJ37		USD	50		%	101,8410	46.088,16	0,44	
2,7000 % eBay Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US278642AW32		USD	100		%	89,1700	80.707,79	0,77	
2,6000 % Estée Lauder Compan. Inc., The DL-Notes 2020(20/30)	US29736RAQ39		USD	50	50	%	88,7210	40.150,70	0,38	
3,5500 % Hasbro Inc. DL-Notes 2019(19/26)	US418056AY31		USD	100		%	94,9490	85.938,36	0,82	
2,8750 % Microsoft Corp. DL-Notes 2017(17/24)	US594918BX11		USD	190	240	50	99,8170	171.654,34	1,64	
3,6250 % MSCI Inc. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USU5521TAG77		USD	200		%	90,6140	164.029,51	1,57	
5,5500 % Nasdaq Inc. DL-Notes 2023(23/34)	US63111XAJ00		USD	100	100	%	104,1330	94.250,80	0,90	
4,2500 % Nestlé Holdings Inc. DL-Notes 2022(22/29) Reg.S	USU74078CT83		USD	150		%	99,9930	135.755,53	1,30	
2,7500 % PepsiCo Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US713448ES36		USD	50		%	91,9270	41.601,57	0,40	
5,5000 % Seaspan Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	US81254UAK25		USD	100		%	83,9930	76.022,08	0,73	
2,5000 % United States of America DL-Notes 2022(24)	US91282CER88		USD	150	150	%	98,8984	134.269,50	1,28	
3,1250 % United States of America DL-Notes 2022(27) S.AC-2027	US91282CFH97		USD	250		%	97,2227	219.990,62	2,10	
2,9500 % V.F. Corp. DL-Notes 2020(20/30)	US918204BC10		USD	50	50	%	83,7100	37.882,97	0,36	
Zertifikate										
Ardilla Segur S.A. NTS 28.12.40 Fund	XS0599782686		STK	5		EUR	43.386,9400	216.934,70	2,07	
Guardian Segur S.A. Zertifikate 30.12.33	XS0980340136		STK	111		EUR	1.860,3300	206.496,63	1,97	
Sonstige Beteiligungswertpapiere										
Ardilla Segur S.A. Inh.Gen. 2014/2024 EO 1000	LU1114452144		STK	100		EUR	258,3900	25.839,00	0,25	
Ardilla Segur S.A. Inh.Gen. 2014/2029 DL 1000	LU1072258111		STK	312		USD	935,9500	264.304,11	2,53	
							EUR	241.010,91	2,30	
Nichtnotierte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
12,0000 % Allg. Ges.f. Verbrief.SA Comp.11 EO-FLR Nts12(25)LUPUS CLO'	XS0828893700		STK	100		EUR	1.904,1400	190.414,00	1,82	
7,3780 % Yara International ASA DL-Notes 2022(22/32) Reg.S	USR9900CAT38		USD	50		%	111,8040	50.596,91	0,48	
							EUR	1.349.296,18	12,90	
Investmentanteile										
Gruppeneigene Investmentanteile										
Rothschild & Co WM - Aktien Actions au Porteur I o.N.	LU1272153831		ANT	5.900		1.493	EUR	189,8900	1.120.424,49	10,71
Gruppenfremde Investmentanteile										
BNPP InstiCash-EUR 1D Namens-Anteile I Cap.o.N.	LU0094219127		ANT	228	20.464	20.236	EUR	141,6695	32.229,29	0,31
iShare.Nikkei 225 UCITS ETF DE Inhaber-Anteile	DE000A0H08D2		ANT	6.420			EUR	21,4200	137.516,40	1,31
iShsV-Gold Producers.UCITS ETF Registered Shares USD (Acc) oN	IE00B6R52036		ANT	4.700			EUR	12,5800	59.126,00	0,57
							EUR	9.794.079,91	93,60	

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten							EUR	590.230,06	5,64
Kassenbestände							EUR	590.230,06	5,64
Verwahrstelle									
			CAD	9,31				6,39	0,00
			CHF	1.459,32				1.569,65	0,01
			EUR	562.617,66				562.617,66	5,38
			GBP	13.904,41				16.037,57	0,15
			JPY	766.665,00				4.919,25	0,05
			NOK	3.677,50				327,80	0,00
			NZD	1,28				0,73	0,00
			SEK	0,21				0,02	0,00
			USD	5.249,13				4.750,99	0,05
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	103.033,51	0,98
Zinsansprüche			EUR	103.033,51				103.033,51	0,98
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-23.185,49	-0,22
Verwaltungsvergütung			EUR	-5.838,61				-5.838,61	-0,06
Betreuungsgebühr			EUR	-681,18				-681,18	-0,01
Zentralverwaltungsvergütung			EUR	-823,92				-823,92	-0,01
Verwahrstellenvergütung			EUR	-418,82				-418,82	0,00
Register- und Transferstellenvergütung			EUR	-120,83				-120,83	0,00
Taxe d'Abonnement			EUR	-1.151,15				-1.151,15	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-13.734,98				-13.734,98	-0,13
Sonstige Kosten			EUR	-416,00				-416,00	0,00
Teilfondsvermögen							EUR	10.464.157,99	100,00¹⁾
Daidalos - Multi Asset VI P									
Anzahl Anteile							STK	86.215,000	
Anteilwert							EUR	121,37	

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 Mengennoteiz)

Kanadische Dollar	(CAD)	per 29.12.2023	
Schweizer Franken	(CHF)	1,4566600	= 1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,9297100	= 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	0,8669900	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	155,8500000	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland-Dollar	(NZD)	11,2189000	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	1,7458000	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	11,1324000	= 1 Euro (EUR)
		1,1048500	= 1 Euro (EUR)

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)
für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

I. Erträge

1. Dividenden	EUR	70.053,93
2. Zinsen aus Wertpapieren	EUR	289.383,06
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen	EUR	12.910,71
4. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	14.920,46
5. Abzug Quellensteuer	EUR	-1.542,91
6. Bestandsprovisionen	EUR	5.009,58

Summe der Erträge	EUR	390.734,83
--------------------------	------------	-------------------

II. Aufwendungen

1. Verwaltungsvergütung	EUR	-67.214,26
2. Verwahrstellenvergütung	EUR	-3.204,53
3. Register- und Transferstellenvergütung	EUR	-1.386,52
4. Betreuungsgebühr	EUR	-8.164,85
5. Zentralverwaltungsgebühr	EUR	-17.433,30
6. Vertriebs-, Informations- und Zahlstellengebühr	EUR	-1.614,50
7. Prüfungskosten	EUR	-14.799,00
8. Taxe d'Abonnement	EUR	-4.355,25
9. Zinsaufwand aus Geldanlagen	EUR	-230,75
10. Sonstige Aufwendungen (siehe Erläuterung 2)	EUR	-30.535,80

Summe der Aufwendungen	EUR	-148.938,76
-------------------------------	------------	--------------------

III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR	241.796,07
--------------------------------------	------------	-------------------

IV. Veräußerungsgeschäfte

1. Realisierte Gewinne	EUR	534.373,47
2. Realisierte Verluste	EUR	-400.113,17

Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	134.260,30
--	------------	-------------------

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	376.056,37
---	------------	-------------------

VI. Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres	EUR	239.515,20
--	------------	-------------------

VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	615.571,57
--	------------	-------------------

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

Daidalos - Multi Asset VI
Entwicklung des Teilfondsvermögens

		2023
I. Wert des Teilfondsvermögens am Beginn des Geschäftsjahres		EUR 14.259.871,53
1. Mittelzufluss / -abfluss (netto)		EUR -4.453.039,70
a) Mittelzuflüsse aus Anteilscheingeschäften	EUR 0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilscheingeschäften	EUR -4.453.039,70	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		EUR 41.754,59
3. Ergebnis des Geschäftsjahres		EUR 615.571,57
II. Wert des Teilfondsvermögens am Ende des Geschäftsjahres		EUR 10.464.157,99

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
31.12.2021	Stück	136.665,000	EUR	17.247.446,90	EUR	126,20
31.12.2022	Stück	123.745,000	EUR	14.259.871,53	EUR	115,24
31.12.2023	Stück	86.215,000	EUR	10.464.157,99	EUR	121,37

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2023

	Tageswert in EUR	% Anteil am Teilfondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	72.618.274,53	100,09
1. Aktien	37.202.782,30	51,27
Belgien	280.416,00	0,39
Bermuda	51.204,05	0,07
Bundesrep. Deutschland	3.786.573,85	5,22
Dänemark	889.716,93	1,23
Frankreich	5.423.844,60	7,48
Großbritannien	1.577.590,12	2,17
Irland	1.511.627,15	2,08
Italien	96.162,70	0,13
Japan	313.115,27	0,43
Kanada	616.579,58	0,85
Niederlande	1.955.199,74	2,69
Schweiz	2.425.614,10	3,34
Spanien	979.215,67	1,35
USA	17.295.922,54	23,84
2. Anleihen	23.332.590,97	32,16
< 1 Jahr	3.072.224,24	4,23
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	3.831.197,95	5,28
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	3.024.385,00	4,17
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	4.346.453,85	5,99
>= 10 Jahre	9.058.329,93	12,48
3. Zertifikate	419.300,00	0,58
Euro	419.300,00	0,58
4. Investmentanteile	9.521.347,55	13,12
Euro	6.598.578,44	9,09
US-Dollar	2.922.769,11	4,03
5. Derivate	-435.933,09	-0,60
6. Bankguthaben	2.269.690,11	3,13
7. Sonstige Vermögensgegenstände	308.496,69	0,43
II. Verbindlichkeiten	-61.683,38	-0,09
III. Teilfondsvermögen	72.556.591,15	100,00

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens	
Bestandspositionen							EUR	70.476.020,82	97,13	
Amtlich gehandelte Wertpapiere							EUR	53.001.049,13	73,05	
Aktien										
Manulife Financial Corp. Registered Shares o.N.	CA56501R1064		STK	2.390		2.390	CAD	29,2800	48.040,86	0,07
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350		STK	10.300	1.550	750	CHF	97,5100	1.080.286,33	1,49
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,49	CH0012005267		STK	4.000		7.500	CHF	84,8700	365.146,12	0,50
Sika AG Namens-Aktien SF 0,01	CH0418792922		STK	1.950	1.950		CHF	273,7000	574.066,11	0,79
Swiss Re AG Namens-Aktien SF -,10	CH0126881561		STK	2.000	330	1.330	CHF	94,5600	203.418,27	0,28
UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10	CH0244767585		STK	2.490			CHF	26,1000	69.902,44	0,10
Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10	CH0011075394		STK	190	190		CHF	439,6000	89.838,77	0,12
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK 0,1	DK0062498333		STK	9.500	9.500		DKK	698,1000	889.716,93	1,23
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005		STK	4.720	570	1.000	EUR	241,9500	1.142.004,00	1,57
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251		STK	4.800		1.200	EUR	58,4200	280.416,00	0,39
Arkema S.A. Actions au Porteur EO 10	FR0010313833		STK	400	400		EUR	103,0000	41.200,00	0,06
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215		STK	1.750	500		EUR	681,7000	1.192.975,00	1,64
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628		STK	1.790			EUR	29,4900	52.787,10	0,07
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	DE0005190003		STK	510			EUR	100,7800	51.397,80	0,07
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	FR0000131104		STK	1.800	600		EUR	62,5900	112.662,00	0,16
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	DE0005552004		STK	1.110	15.500	15.500	EUR	44,8550	49.789,05	0,07
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	DE0005557508		STK	3.320			EUR	21,7500	72.210,00	0,10
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0003128367		STK	6.040	6.040		EUR	6,7300	40.649,20	0,06
EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	FR0000121667		STK	3.000		250	EUR	181,6000	544.800,00	0,75
Heineken N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60	NL0000009165		STK	480	480		EUR	91,9400	44.131,20	0,06
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14		STK	79.141	14.141		EUR	11,8700	939.403,67	1,29
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011821202		STK	48.000	58.500	10.500	EUR	13,5260	649.248,00	0,89
Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000072618		STK	21.000	21.000		EUR	2,6435	55.513,50	0,08
Kerry Group PLC Registered Shares A EO -,125	IE0004906560		STK	5.500			EUR	78,6600	432.630,00	0,60
L'Oréal S.A. Actions Port. EO 0,2	FR0000120321		STK	1.950	1.950		EUR	450,6500	878.767,50	1,21
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	FR0000121014		STK	1.250	350	175	EUR	733,6000	917.000,00	1,26
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026		STK	1.950		300	EUR	375,1000	731.445,00	1,01
Repsol S.A. Acciones Port. EO 1	ES0173516115		STK	2.960			EUR	13,4500	39.812,00	0,06
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578		STK	7.020	250	4.150	EUR	89,7600	630.115,20	0,87
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600		STK	7.600	2.100	4.000	EUR	139,4800	1.060.048,00	1,46
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972		STK	5.000		550	EUR	181,7800	908.900,00	1,25
Shell PLC Reg. Shares Class EO -,07	GB00BP6MXD84		STK	10.000			EUR	29,8000	298.000,00	0,41
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101		STK	4.000		2.500	EUR	169,9200	679.680,00	0,94
TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271		STK	10.000	10.000	1.400	EUR	61,6000	616.000,00	0,85
Unilever PLC Registered Shares LS -,031111	GB00B10RZP78		STK	6.500		970	EUR	43,8550	285.057,50	0,39
Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0000124141		STK	1.380	1.380		EUR	28,5600	39.412,80	0,05
VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	FR0000125486		STK	6.000	6.000		EUR	113,7000	682.200,00	0,94
AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25	GB0009895292		STK	490	140		GBP	106,0000	59.908,42	0,08
BP PLC Registered Shares DL -,25	GB0007980591		STK	6.390		2.680	GBP	4,6615	34.356,78	0,05
Diageo PLC Reg. Shares LS -,28935185	GB0002374006		STK	16.000	2.000		GBP	28,5600	527.064,90	0,73
InterContinental Hotels Group Reg.Shares LS -,208521303	GB00BHJYC057		STK	720			GBP	70,9000	58.879,57	0,08
Reckitt Benckiser Group Registered Shares LS -,10	GB00B24CGK77		STK	640	640	550	GBP	54,2000	40.009,69	0,06
Honda Motor Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3854600008		STK	5.310	5.310	1.770	JPY	1.466,0000	49.948,41	0,07
Mitsubishi Corp. Registered Shares o.N.	JP3898400001		STK	3.630	4.840	1.210	JPY	2.253,5000	52.487,68	0,07
Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. Registered Shares o.N.	JP3902900004		STK	6.090	6.090		JPY	1.211,5000	47.340,62	0,07
Mizuho Financial Group Inc. Registered Shares o.N.	JP3885780001		STK	2.730	2.730		JPY	2.412,5000	42.259,38	0,06
Sumitomo Corp. Registered Shares o.N.	JP3404600003		STK	2.440	2.440		JPY	3.076,0000	48.158,10	0,07
Tokyo Electron Ltd. Registered Shares o.N.	JP3571400005		STK	450	450	150	JPY	25.255,0000	72.921,08	0,10
3M Co. Registered Shares DL -,01	US88579Y1010		STK	1.700		100	USD	109,3200	168.207,45	0,23
Abbott Laboratories Registered Shares o.N.	US0028241000		STK	420	420		USD	110,0700	41.842,24	0,06
Adobe Inc. Registered Shares o.N.	US00724F1012		STK	130	130	700	USD	596,6000	70.197,76	0,10
Alphabet Inc. Reg. Shs Cap.Stk Cl. C DL-,001	US02079K1079		STK	1.210	210		USD	140,9300	154.342,49	0,21

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens	
Alphabet Inc. Reg. Shs Cl. A DL-,001	US02079K3059		STK	9.250	2.500		USD	139,6900	1.169.509,44	1,61
Amazon.com Inc. Registered Shares DL -,01	US0231351067		STK	2.500			USD	151,9400	343.802,33	0,47
Apple Inc. Registered Shares o.N.	US0378331005		STK	5.330			USD	192,5300	928.800,20	1,28
Applied Materials Inc. Registered Shares o.N.	US0382221051		STK	780	390		USD	162,0700	114.417,88	0,16
Astrazeneca PLC Reg.Shs (Spons.ADRs) 1/DL-,25	US0463531089		STK	4.500	4.500		USD	67,3500	274.313,26	0,38
Bank of America Corp. Registered Shares DL 0,01	US0605051046		STK	2.360	2.360		USD	33,6700	71.920,35	0,10
Bristol-Myers Squibb Co. Registered Shares DL -,10	US1101221083		STK	1.170			USD	51,3100	54.335,61	0,07
Canadian National Railway Co. Registered Shares o.N.	CA1363751027		STK	5.000	500	2.000	USD	125,6300	568.538,72	0,78
Chevron Corp. Registered Shares DL-,75	US1667641005		STK	500			USD	149,1600	67.502,38	0,09
Chubb Ltd. Registered Shares SF 24,15	CH0044328745		STK	210	210		USD	226,0000	42.956,06	0,06
Cisco Systems Inc. Registered Shares DL-,001	US17275R1023		STK	14.410	1.970	10.540	USD	50,5200	658.906,82	0,91
Coca-Cola Co., The Registered Shares DL -,25	US1912161007		STK	4.500	3.000		USD	58,9300	240.019,01	0,33
Costco Wholesale Corp. Registered Shares DL -,005	US22160K1051		STK	1.100	1.100		USD	660,0800	657.182,42	0,91
Danaher Corp. Registered Shares DL -,01	US2358511028		STK	3.600	350	250	USD	231,3400	753.789,20	1,04
Deere & Co. Registered Shares DL 1	US2441991054		STK	1.680	250		USD	399,8700	608.029,69	0,84
Dominion Energy Inc. Registered Shares o.N.	US25746U1097		STK	770	770		USD	47,0000	32.755,58	0,05
Emerson Electric Co. Registered Shares DL -,50	US2910111044		STK	610			USD	97,3300	53.736,98	0,07
Everest Group Ltd. Registered Shares DL -,01	BMG3223R1088		STK	160			USD	353,5800	51.204,05	0,07
General Mills Inc. Registered Shares DL -,10	US3703341046		STK	650			USD	65,1400	38.322,85	0,05
Gilead Sciences Inc. Registered Shares DL -,001	US3755581036		STK	790		290	USD	81,0100	57.924,51	0,08
Goldman Sachs Group Inc., The Registered Shares DL -,01	US38141G1040		STK	140			USD	385,7700	48.882,47	0,07
Hershey Co., The Registered Shares DL 1,-	US4278661081		STK	180	180		USD	186,4400	30.374,44	0,04
Johnson & Johnson Registered Shares DL 1	US4781601046		STK	4.500	500	2.000	USD	156,7400	638.394,35	0,88
JPMorgan Chase & Co. Registered Shares DL 1	US46625H1005		STK	690		4.000	USD	170,1000	106.230,71	0,15
Kraft Heinz Co., The Registered Shares DL -,01	US5007541064		STK	1.210			USD	36,9800	40.499,43	0,06
Linde plc Registered Shares EO -,001	IE000S9YS762		STK	2.000	2.000		USD	410,7100	743.467,44	1,02
Lowe's Companies Inc. Registered Shares DL -,50	US5486611073		STK	230			USD	222,5500	46.328,91	0,06
Lyondellbasell Industries NV Registered Shares A EO -,04	NL0009434992		STK	800			USD	95,0800	68.845,54	0,09
McDonald's Corp. Registered Shares DL-,01	US5801351017		STK	2.820	170		USD	296,5100	756.806,99	1,04
Medtronic PLC Registered Shares DL -,0001	IE00BTN1Y115		STK	4.500			USD	82,3800	335.529,71	0,46
Merck & Co. Inc. Registered Shares DL-,01	US58933Y1055		STK	990			USD	109,0200	97.687,29	0,13
Meta Platforms Inc. Reg.Shares Cl.A DL-,00000625	US330303M1027		STK	1.200		300	USD	353,9600	384.443,14	0,53
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	US5949181045		STK	5.070	500	2.050	USD	376,0400	1.725.594,24	2,38
Morgan Stanley Registered Shares DL -,01	US6174464486		STK	6.250	750	650	USD	93,2500	527.503,73	0,73
Mosaic Co., The Registered Shares DL -,01	US61945C1036		STK	1.180			USD	35,7300	38.160,29	0,05
MSCI Inc. Registered Shares A DL -,01	US55354G1004		STK	1.500	1.500		USD	565,6500	767.954,93	1,06
NIKE Inc. Registered Shares Class B o.N.	US6541061031		STK	8.360	2.360		USD	108,5700	821.509,89	1,13
NVIDIA Corp. Registered Shares DL-,001	US67066G1040		STK	240			USD	495,2200	107.573,70	0,15
Oracle Corp. Registered Shares DL -,01	US68389X1054		STK	2.300	2.300		USD	105,4300	219.476,85	0,30
PayPal Holdings Inc. Reg. Shares DL -,0001	US70450Y1038		STK	3.000			USD	61,4100	166.746,62	0,23
PepsiCo Inc. Registered Shares DL -,0166	US7134481081		STK	4.750			USD	169,8400	730.180,57	1,01
Phinia Inc. Registered Shs o.N.	US71880K1016		STK	256	256		USD	30,2900	7.018,36	0,01
Procter & Gamble Co., The Registered Shares o.N.	US7427181091		STK	500		4.500	USD	146,5400	66.316,69	0,09
QUALCOMM Inc. Registered Shares DL -,0001	US7475251036		STK	340	340		USD	144,6300	44.507,58	0,06
Salesforce Inc. Registered Shares DL -,001	US79466L3024		STK	540	540	2.000	USD	263,1400	128.610,76	0,18
Synopsys Inc. Registered Shares DL -,01	US8716071076		STK	1.550	1.550		USD	514,9100	722.370,00	1,00
T-Mobile US Inc. Registered Shares DL-,00001	US8725901040		STK	320			USD	160,3300	46.436,71	0,06
Thermo Fisher Scientific Inc. Registered Shares DL 1	US8835561023		STK	1.650	500		USD	530,7900	792.689,96	1,09
United Parcel Service Inc. Reg. Shares Class B DL -,01	US9113121068		STK	610			USD	157,2300	86.808,44	0,12
UnitedHealth Group Inc. Registered Shares DL -,01	US91324P1021		STK	600	780	180	USD	526,4700	285.904,87	0,39
Verizon Communications Inc. Registered Shares DL -,10	US92343V1044		STK	7.240			USD	37,7000	247.045,30	0,34
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	US92826C8394		STK	4.770		600	USD	260,3500	1.124.016,38	1,55
Walt Disney Co., The Registered Shares DL -,01	US2546871060		STK	2.500	400		USD	90,2900	204.303,75	0,28
Verzinsliche Wertpapiere										
3,2500 % Coca-Cola Co., The AD-Notes 2016(24)	AU3CB0237907		AUD	200		%		99,3950	122.726,54	0,17
6,2541 % Alpiq Holding AG SF-FLR Anl. 2013(18/Und.)	CH0212184037		CHF	350	100	%		101,8500	383.426,01	0,53

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens	
0,7750 % Cellnex Telecom S.A. SF-Med.-Term Notes 2020(27)	CH0506071148		CHF	250		%	96,6030	259.766,49	0,36	
2,5000 % HOCHDORF Holding AG SF-FLR Anl. 2017(23/Und.)	CH0391647986		CHF	600		%	29,1000	187.800,50	0,26	
4,3750 % Swiss Life AG SF-Var. Anl. 2016(26/46)	CH0316994653		CHF	140		%	104,3500	157.135,02	0,22	
0,1925 % Verizon Communications Inc. SF-Anl. 2021(28)	CH1105672658		CHF	100		%	94,6180	101.771,52	0,14	
4,2500 % Achmea B.V. EO-FLR Med.-T. Nts 15(25/Und.)	XS1180651587		EUR	200		%	99,2770	198.554,00	0,27	
4,0000 % AEGON Ltd. EO-FLR Med.T.Nts 2014(24/44)	XS1061711575		EUR	200		%	99,5720	199.144,00	0,27	
3,2521 % AEGON Ltd. EO-FLR Nts 2004(14/Und.)	NL0000116150		EUR	300		%	77,9490	233.847,00	0,32	
4,8750 % Aeroporti di Roma S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2023(33/33)	XS2644240975		EUR	100	100	%	105,4470	105.447,00	0,15	
5,3060 % Ageasfinlux S.A. EO-Conv.FLR Nts 02(Und.) Reg.S	XS0147484074		EUR	250		%	85,6480	214.120,00	0,30	
4,0000 % Air Products & Chemicals Inc. EO-Notes 2023(23/35)	XS2595036554		EUR	200	200	%	105,8000	211.600,00	0,29	
3,3750 % Allianz SE FLR-Med.Ter.Nts.v.14(24/unb.)	DE000A13R7Z7		EUR	200	200	%	99,0510	198.102,00	0,27	
2,7500 % Arkema S.A. EO-FLR Med.-T.Nts 2019(24/Und)	FR0013425170		EUR	100		%	99,1140	99.114,00	0,14	
3,1190 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 03(08/Und.)	XS0181369454		EUR	200		%	79,8300	159.660,00	0,22	
1,8750 % BAWAG Group AG EO-FLR Med.-Term Nts 20(25/30)	XS2230264603		EUR	200		%	89,8660	179.732,00	0,25	
7,0000 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2023(2031/2083)	XS2684846806		EUR	200	200	%	103,4320	206.864,00	0,29	
2,6250 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2014(24)	XS1015217703		EUR	110		%	99,9550	109.950,50	0,15	
5,6250 % Ceske Drahly AS EO-Notes 2022(22/27)	XS2495084621		EUR	150		%	105,6060	158.409,00	0,22	
0,5000 % Chanel Ceres PLC EO-Notes 2020(20/26)	XS2239845097		EUR	150		%	93,2610	139.891,50	0,19	
3,7281 % CNP Assurances S.A. EO-FLR Notes 2005(11/Und.)	FR0010167247		EUR	150		%	93,6180	140.427,00	0,19	
1,2500 % Compagnie Plastic Omnium S.A. EO-Obl. 2017(17/24)	FR0013264066		EUR	200		%	98,5520	197.104,00	0,27	
2,7500 % ContourGlobal Power Hldgs S.A. EO-Notes 2020(20/26) Reg.S	XS2274815369		EUR	100		%	95,9440	95.944,00	0,13	
4,2500 % Crédit Agricole Assurances SA EO-FLR Notes 2015(25/Und.)	FR0012444750		EUR	200		%	99,6850	199.370,00	0,27	
4,6790 % Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.FLR-MTN R35281 17(22/27)	XS1637926137		EUR	300		%	73,6710	221.013,00	0,30	
0,8750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1557096267		EUR	110		%	99,7790	109.756,90	0,15	
2,0000 % Dometic Group AB EO-Medium-Term Nts 2021(21/28)	XS2391403354		EUR	200		%	87,4250	174.850,00	0,24	
0,4250 % Dongfeng Motor(HK)Intl Co.Ltd. EO-Bonds 2021(21/24)	XS2394012103		EUR	200		%	96,6650	193.330,00	0,27	
4,5000 % DS Smith PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	XS2654098222		EUR	200	200	%	104,2130	208.426,00	0,29	
1,7500 % DSV A/S EO-Anl. 2017(17/24)	DK0030403993		EUR	150	150	%	98,2910	147.436,50	0,20	
4,0000 % Electricité de France (E.D.F.) EO-FLR Notes 2018(24/Und.)	FR0013367612		EUR	200		%	99,4310	198.862,00	0,27	
3,3750 % ELM B.V. EO-LPN FLR MTN 2017(27/47)	XS1587893451		EUR	200	200	%	95,6270	286.881,00	0,40	
4,5000 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Medium-Term Notes 23(23/43)	XS2589260996		EUR	300	400	200	%	103,3470	206.694,00	0,29
4,5000 % Engie S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/42)	FR001400KH16		EUR	100	100	%	107,8930	107.893,00	0,15	
1,8160 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2021(21/31)	XS2304675791		EUR	150		%	77,8630	116.794,50	0,16	
1,0000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2022(32)	EU000A3K4DD8		EUR	200	200	%	88,0930	176.186,00	0,24	
4,5000 % Ferrovie dello Stato Ital.SpA EO-Medium-Term Notes 2023(33)	XS2627121507		EUR	100	100	%	104,9080	104.908,00	0,14	
0,8750 % GN Store Nord AS EO-Medium-Term Nts 2021(21/24)	XS2412258522		EUR	200		%	95,8060	191.612,00	0,26	
1,1250 % Hannover Rück SE FLR-Sub.Anl.v.2019(2029/2039)	XS2063350925		EUR	100	100	%	85,1860	85.186,00	0,12	
4,1250 % Heineken N.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/35)	XS2599169922		EUR	200	200	%	107,3960	214.792,00	0,30	
3,0000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-FLR Notes 2019(24/Und.)	XS1713466495		EUR	150		%	99,3120	148.968,00	0,21	
5,1250 % Huhtamäki Oyj EO-Notes 2023(23/28)	FI4000562202		EUR	100	100	%	104,3840	104.384,00	0,14	
4,3750 % IHG Finance LLC EO-Med.-Term Nts 2023(23/29)	XS2723593187		EUR	100	100	%	103,7180	103.718,00	0,14	
1,8750 % Iliad S.A. EO-Obl. 2021(27/28)	FR0014001YB0		EUR	100		%	92,0010	92.001,00	0,13	
3,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR NTS. 2020(25/Und.)	XS2124979753		EUR	250	250	%	94,5870	236.467,50	0,33	
1,1250 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2016(16/24)	XS1375841233		EUR	110		%	98,2240	108.046,40	0,15	
0,3500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(25)	IT0005386245		EUR	150		%	97,0110	145.516,50	0,20	
0,6250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2017 (2027)	DE000A2DAR65		EUR	200	200	%	94,7120	189.424,00	0,26	
4,1250 % LSEG Netherlands B.V. EO-Medium-Term Notes 23(23/26)	XS2679903950		EUR	150	150	%	102,6330	153.949,50	0,21	
3,5000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2023(26)	DE000A3LH6T7		EUR	200	300	100	%	101,1340	202.268,00	0,28
1,6250 % Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2020(2026/2080)	XS2218405772		EUR	100		%	93,1860	93.186,00	0,13	
5,5480 % Mowi ASA EO-FLR Notes 2020(23/25)	NO0010874050		EUR	200		%	100,6960	201.392,00	0,28	
4,2750 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2023(23/35)	XS2576067081		EUR	100	100	%	103,5790	103.579,00	0,14	
4,3750 % NN Group N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 14(24/Und.)	XS1076781589		EUR	200		%	99,8420	199.684,00	0,28	
0,0000 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Notes 2021(21/24)	XS2348030268		EUR	200	200	%	98,4070	196.814,00	0,27	
3,1250 % PVH Corp. EO-Notes 2017(17/27) Reg.S	XS1734066811		EUR	100		%	98,2600	98.260,00	0,14	
2,2500 % Quadiant S.A. EO-Obl. 2020(20/25)	FR0013478849		EUR	100		%	97,3970	97.397,00	0,13	
4,2470 % Repsol Intl Finance B.V. EO-FLR Notes 2020(28/Und.)	XS2186001314		EUR	270		%	97,7800	264.006,00	0,36	
3,6500 % Rothschild&Co Cont.Finance PLC EO-FLR Notes 2004(14/Und.)	XS0197703118		EUR	300		%	68,7910	206.373,00	0,28	

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
0,6250 % Sanoma Oyj EO-Notes 2021(21/24)	FI4000490602		EUR	100		%	99,2830	99.283,00	0,14
3,5000 % Statnett SF EO-Med.-Term Notes 2023(23/33)	XS2631835332		EUR	200	200	%	104,2760	208.552,00	0,29
4,0000 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/26)	XS2629062568		EUR	150	150	%	101,2250	151.837,50	0,21
4,3750 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2019(25/Und.)	XS1933828433		EUR	200	100	%	99,5030	199.006,00	0,27
2,3760 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2021(29/Und.)	XS2293060658		EUR	100		%	87,0160	87.016,00	0,12
3,3690 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 16(26/Und.)	XS1501166869		EUR	100		%	97,6590	97.659,00	0,13
2,0000 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 22(22/Und.)	XS2432130610		EUR	270	170	%	92,4580	249.636,60	0,34
3,1250 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN-OPF S.2140 v.23(25)	DE000HV2AZG5		EUR	100	100	%	100,2340	100.234,00	0,14
3,4000 % Unilever Capital Corp. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33)	XS2632655135		EUR	100	200	100 %	103,1980	103.198,00	0,14
5,5000 % Var Energi ASA EO-Medium-Term Nts 2023(23/29)	XS2599156192		EUR	200	200	%	107,2330	214.466,00	0,30
1,3750 % Vilmorin & Cie S.A. EO-Obl. 2021(21/28)	FR0014002KP7		EUR	100		%	84,3060	84.306,00	0,12
4,2000 % Vodafone Group PLC EO-FLR Cap.Sec. 2018(28/78)	XS1888179550		EUR	150		%	97,6660	146.499,00	0,20
2,6250 % Vodafone Group PLC EO-FLR Cap.Sec. 2020(26/80)	XS2225157424		EUR	230		%	95,1120	218.757,60	0,30
3,5000 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(25/Und.)	XS2187689034		EUR	200	200	%	97,4370	194.874,00	0,27
3,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(29/Und.)	XS2187689380		EUR	100		%	91,9570	91.957,00	0,13
0,0000 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/25)	DE000A3MP4T1		EUR	100		%	93,3360	93.336,00	0,13
3,7500 % WP/AP Telecom Holdings IV B.V. EO-Notes 2021(21/29) Reg.S	XS2417090789		EUR	100		%	95,2350	95.235,00	0,13
4,2500 % BP Capital Markets PLC LS-FLR Notes 2020(27/Und.)	XS2193663619		GBP	300		%	94,1140	325.657,74	0,45
1,5000 % Comcast Corp. LS-Notes 2020(20/29)	XS2114853299		GBP	150		%	88,3340	152.828,75	0,21
4,1250 % CRH Finance (U.K.) PLC LS-Med.-T. Nts 2015(15/29)	XS1328187627		GBP	100		%	97,3090	112.237,74	0,15
2,3750 % Mobico Group PLC LS-Medium-Term Nts 2019(19/28)	XS2081477817		GBP	100		%	87,8340	101.309,13	0,14
0,6250 % Nestlé Holdings Inc. LS-Med.-T. Nts 2021(21/25)Tr.A	XS2354271095		GBP	100		%	93,5690	107.923,97	0,15
3,2500 % Pinewood FinCo PLC LS-Notes 2019(21/25) Reg.S	XS2052466815		GBP	150		%	97,3640	168.451,77	0,23
0,7500 % Toyota Motor Credit Corp. LS-Med.-Term Nts 2020(26)	XS2260426288		GBP	150		%	90,5940	156.738,83	0,22
4,5000 % VMED O2 UK Financing I PLC LS-Notes 2021(21/31) Reg.S	XS2358483258		GBP	100		%	86,8090	100.126,88	0,14
3,8750 % Allianz SE DL-Subord. MTN v.16(22/unb.)	XS1485742438		USD	200	200	%	70,4360	127.503,28	0,18
5,5500 % ConocoPhillips Company DL-Notes 2023(23/54)	US20826FBG00		USD	200	200	%	106,5910	192.951,08	0,27
8,7500 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. DL-Notes 2000(30)	US25156PAC77		USD	200		%	120,6370	218.377,16	0,30
1,7500 % Henkel AG & Co. KGaA DL-Med. Term Nts. v.21(21/26)	XS2407954002		USD	200		%	91,9390	166.428,02	0,23
4,7000 % John Deere Capital Corp. DL-Medium-Term Notes 2023(30)	US24422EWZ86		USD	250	250	%	101,6740	230.062,90	0,32
0,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau DL-Anl.v.2021 (2024)	US500769JP02		USD	200	200	%	96,8250	175.272,66	0,24
5,4500 % McDonald's Corp. DL-Medium-Term Nts 2023(23/53)	US58013MFW91		USD	150	150	%	106,6990	144.859,94	0,20
4,8750 % Prudential PLC DL-Med.-Term Nts 2017(23/Und.)	XS1700429480		USD	250		%	83,6340	189.242,88	0,26
2,2500 % Saudi Arabian Oil Co. DL-Med.-T.Nts 2020(30/30)Reg.S	XS2262853265		USD	200		%	86,0830	155.827,49	0,21
1,2500 % TSMC Global Ltd. DL-Notes 2021(21/26) Reg.S	USG91139AF57		USD	200		%	92,4500	167.353,03	0,23
Zertifikate									
Deut. Börse Commodities GmbH Xetra-Gold IHS 2007(09/Und)	DE000A0S9GB0		STK	7.000		EUR	59,9000	419.300,00	0,58
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR		7.801.833,40	10,75
Verzinsliche Wertpapiere									
7,0000 % Banijay Entertainment S.A.S. EO-Notes 2023(23/29) Reg.S	XS2690055996		EUR	150	150	%	105,7390	158.608,50	0,22
3,3750 % Belden Inc. EO-Notes 2017(22/27) Reg.S	XS1640668940		EUR	100		%	96,9210	96.921,00	0,13
1,0000 % Berry Global Inc. EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2093880735		EUR	150		%	97,1210	145.681,50	0,20
5,9200 % BNP Paribas Fortis S.A. EO-FLR Conv.Nts 2007(Und.)	BE0933899800		EUR	250		%	86,0270	215.067,50	0,30
4,5000 % Deutsche Bank AG FLR-Nachr.Anl.v.21(26/unb.)	DE000DL19V55		EUR	200	200	%	83,4060	166.812,00	0,23
3,7500 % ELM B.V. EO-FLR M.-T. Nts 2020(25/Und.)	XS2182055009		EUR	200		%	98,1850	196.370,00	0,27
4,2500 % Huntsman International LLC EO-Notes 2016(16/25)	XS1395182683		EUR	200		%	99,5700	199.140,00	0,27
6,6250 % INEOS Finance PLC EO-Notes 2023(23/28) Reg.S	XS2587558474		EUR	100	100	%	102,8690	102.869,00	0,14
4,1250 % JDE Peet's N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/30)	XS2728561098		EUR	100	100	%	102,9060	102.906,00	0,14
3,3750 % Levi Strauss & Co. EO-Notes 2017(17/27)	XS1602130947		EUR	100		%	99,1040	99.104,00	0,14
2,5000 % Nomad Foods BondCo PLC EO-Notes 2021(21/28) Reg.S	XS2355604880		EUR	150		%	94,2200	141.330,00	0,20
2,8750 % OI European Group B.V. EO-Notes 2019(19/25) Reg.S	XS2077666316		EUR	200		%	98,9570	197.914,00	0,27
1,1250 % PepsiCo Inc. EO-Notes 2019(19/31)	XS1963555617		EUR	200		%	89,2860	178.572,00	0,25

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens	
0,2500 % PepsiCo Inc. EO-Notes 2020(20/24)	XS2168625460		EUR	200	400	200	%	98,7490	197.498,00	0,27
2,1250 % PPF Telecom Group B.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/25)	XS2078976805		EUR	100			%	98,0000	98.000,00	0,14
3,1250 % PPF Telecom Group B.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/26)	XS1969645255		EUR	150			%	98,3300	147.495,00	0,20
4,3750 % Public Power Corporation S.A. EO-Notes 2021(21/26) Reg.S	XS2314265237		EUR	100			%	100,0120	100.012,00	0,14
4,3750 % Robert Bosch GmbH MTN v.2023(2023/2043)	XS2629470761		EUR	200	200		%	107,3940	214.788,00	0,30
2,0000 % SPCM S.A. EO-Notes 2020(20/26) Reg.S	XS2234515786		EUR	100			%	96,7420	96.742,00	0,13
0,7390 % Experian Finance PLC LS-Medium-Term Nts 2020(20/25)	XS2237991240		GBP	200			%	93,4060	215.471,92	0,30
5,0000 % Virgin Media Secured Fin. PLC LS-Notes 2017(17/27) Reg.S	XS1555173019		GBP	100			%	97,6210	112.597,61	0,16
2,6000 % Alcon Finance Corp. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USU01386AD00		USD	100			%	86,7400	78.508,39	0,11
2,9000 % Apple Inc. DL-Notes 2017(17/27)	US037833DB33		USD	250			%	95,7730	216.710,41	0,30
1,2000 % Apple Inc. DL-Notes 2021(21/28)	US037833EC07		USD	200			%	89,0550	161.207,40	0,22
4,3000 % Apple Inc. DL-Notes 2023(23/33)	US037833EV87		USD	150	150		%	101,6170	137.960,36	0,19
5,0000 % Broadcom Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US11135FBD24		USD	200	200		%	101,6970	184.091,96	0,25
2,7000 % eBay Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US278642AW32		USD	200			%	89,1700	161.415,58	0,22
2,6000 % Estée Lauder Compan. Inc., The DL-Notes 2020(20/30)	US29736RAQ39		USD	200	100		%	88,7210	160.602,80	0,22
3,5500 % Hasbro Inc. DL-Notes 2019(19/26)	US418056AY31		USD	100			%	94,9490	85.938,36	0,12
4,8000 % La Mondiale DL-FLR Notes 2018(28/48)	XS1751476679		USD	400			%	91,1140	329.869,21	0,45
2,8750 % Microsoft Corp. DL-Notes 2017(17/24)	US594918BX11		USD	650	650		%	99,8170	587.238,54	0,81
4,0000 % MSCI Inc. DL-Notes 2019(19/29) Reg.S	USU5521TAE20		USD	100			%	94,1090	85.178,08	0,12
3,6250 % MSCI Inc. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USU5521TAG77		USD	150			%	90,6140	123.022,13	0,17
5,5500 % Nasdaq Inc. DL-Notes 2023(23/34)	US63111XAJ00		USD	200	200		%	104,1330	188.501,61	0,26
3,5500 % Procter & Gamble Co., The DL-Notes 2020(20/40)	US742718FJ38		USD	200	200		%	89,5420	162.088,97	0,22
5,2650 % Roche Holdings Inc. DL-Notes 2023(23/26) Reg.S	USU75000CE49		USD	200	200		%	102,5760	185.683,12	0,26
2,9000 % S&P Global Inc. DL-Notes 2023(23/32)	US78409VBK98		USD	200	200		%	89,4420	161.907,95	0,22
1,2000 % Siemens Finan.maatschappij NV DL-Notes 2021(21/26) Reg.S	USN82008AX66		USD	250			%	93,0100	210.458,43	0,29
4,2500 % Swiss Re Finance (Lux) S.A. DL-FLR Notes 2019(24/Und.)	XS2049422343		USD	200			%	98,0430	177.477,49	0,24
4,9500 % T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2023(23/28)	US87264ACZ66		USD	200	200		%	101,6140	183.941,71	0,25
3,3000 % Take-Two Interactive Softw.Inc DL-Notes 2022(22/24)	US874054AE98		USD	8		192	%	99,4460	7.200,69	0,01
1,2500 % United States of America DL-Notes 2021(28)	US91282CBZ32		USD	400			%	89,5508	324.209,73	0,45
2,2500 % United States of America DL-Notes 2022(24)	US91282CEG24		USD	700			%	99,2715	628.954,51	0,87
2,9500 % V.F. Corp. DL-Notes 2020(20/30)	US918204BC10		USD	100	100		%	83,7100	75.765,94	0,10
Nichtnotierte Wertpapiere							EUR	151.790,74	0,21	
Verzinsliche Wertpapiere										
7,3780 % Yara International ASA DL-Notes 2022(22/32) Reg.S	USR9900CAT38		USD	150			%	111,8040	151.790,74	0,21
Investmentanteile							EUR	9.521.347,55	13,12	
Gruppeneigene Investmentanteile										
FAM Convex Opportunities Inhaber-Anteile S	DE000A3E3Z03		ANT	786	786		EUR	1.037,2500	815.278,50	1,12
Gruppenfremde Investmentanteile										
ART Top 50 Smart ESG Conver.UI Inhaber-Anteile AK ITP	DE000A3DQ2H0		ANT	2.999	2.999		EUR	103,6200	310.732,34	0,43
Capitulum Weltzins-Invest Unrvl Inhaber-Anteilsklasse I	DE000A2H7NU1		ANT	2.272			EUR	81,5700	185.327,04	0,26
CONVERTIBLE GLB.DIVERSIFIED UI Inhaber-Anteile	DE000A0M9995		ANT	9.323			EUR	163,0400	1.520.021,92	2,09
Empureon Volatility One Fund Inhaber-Anteile F	DE000A3D9GM1		ANT	790	790		EUR	1.035,3400	817.918,60	1,13
Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Reg. Shares Y Dis. EUR o.N.	LU0951203347		ANT	6.000	6.000		EUR	18,4100	110.460,00	0,15
FS Exponential Technologies Act. Nom. F EUR Dis. oN	LU2181639712		ANT	326			EUR	1.308,8500	426.685,10	0,59
iShs VII-Co.EO STOXX 50 U.ETF Reg. Shares EUR (Acc) o.N.	IE00B53L3W79		ANT	5.000	3.200		EUR	162,9800	814.900,00	1,12
iShsIV-MSCI JPN ESG.Enh.U.ETF Reg. Shs USD Dis. oN	IE00BHJPJ346		ANT	15.000	15.000		EUR	5,4270	81.405,00	0,11
PAYDEN GBL-Pay.Gbl Em.Mkts Bd Registered Shs. Class EUR o.N.	IE00B04NLM33		ANT	5.799			EUR	18,8637	109.390,60	0,15
Themis Special Situations Fund Inhaber-Anteile EUR T	DE000A2H6764		ANT	14.066			EUR	99,9900	1.406.459,34	1,94

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
Fidelity Fds-Asian Bond Fund Reg. Sh. I Acc. USD o.N.	LU1322385458		ANT	22.246		USD	11,8700	239.000,79	0,33
FISCH-Bd EM Corporates Dyn. Act.Nom. LD USD Acc. oN	LU2466185779		ANT	1.148		USD	104,9600	109.059,22	0,15
iShs VII-Core S&P 500 U.ETF Reg. Shares USD (Acc) o.N.	IE00B5BMR087		ANT	2.700	200	USD	502,0000	1.226.772,87	1,69
iShsIII-MSCI EM U.ETF USD(Acc) Registered Shs Acc. USD o.N.	IE00B4L5YC18		ANT	28.062	28.062	USD	36,2700	921.218,93	1,27
N.I.F.(L.)-L.S.Sh.T.E.Mkts Bd Nam.-Ant.S/A (USD)o.N.	LU0980588346		ANT	1.877		USD	122,4000	207.942,07	0,29
PAYDEN GBL-Pay.Gbl Em.Mkts Bd Registered Shs. Class USD o.N.	IE0030928885		ANT	3.518		USD	34,6377	110.291,38	0,15
Schroder ISF-Asian Loc.Curr.Bd Namens-Anteile C Acc. USD o.N.	LU0358730231		ANT	793		USD	151,1455	108.483,85	0,15
Summe Wertpapiervermögen						EUR		70.476.020,82	97,13
Derivate						EUR		-435.933,09	-0,60 ²⁾
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Derivate auf einzelne Wertpapiere						EUR		-352.956,98	-0,49
Wertpapier-Optionsrechte									
Optionsrechte auf Aktien									
Novartis AG CALL 92.00 15.03.2024	EUREX	-365.146	STK	-40	40	CHF	0,3500	-1.505,85	0,00
Swiss Re AG CALL 104.00 21.06.2024	EUREX	-203.418	STK	-20	20	CHF	0,9500	-2.043,65	0,00
Allianz SE CALL 230.00 21.06.2024	EUREX	-314.535	STK	-13	13	EUR	19,7300	-25.649,00	-0,04
Anheuser-Busch InBev SA/NV CALL 60.00 15.03.2024	EUREX	-280.416	STK	-48	48	EUR	1,5700	-7.536,00	-0,01
ASML Holding NV CALL 640.00 15.03.2024	EUREX	-340.850	STK	-5	5	EUR	62,0800	-31.040,00	-0,04
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitt CALL 800.00 21.06.2024	EUREX	-220.080	STK	-3	3	EUR	27,0300	-8.109,00	-0,01
SAP SE CALL 145.00 21.06.2024	EUREX	-292.908	STK	-21	21	EUR	5,9600	-12.516,00	-0,02
Shell PLC CALL 32.00 20.09.2024	EUREX	-298.000	STK	-100	100	EUR	1,1200	-11.200,00	-0,02
3M Co CALL 100.00 19.04.2024	CBOE	-168.207	STK	-17	17	USD	12,0700	-18.571,75	-0,03
Alphabet Inc CALL 145.00 19.04.2024 (Cl. A)	CBOE	-316.084	STK	-25	25	USD	6,6500	-15.047,29	-0,02
Amazon.com Inc CALL 140.00 15.03.2024	CBOE	-343.802	STK	-25	25	USD	17,2000	-38.919,31	-0,05
AstraZeneca PLC CALL 72.50 19.04.2024	CBOE	-274.313	STK	-45	45	USD	1,1200	-4.561,71	-0,01
Coca-Cola Co/The CALL 62.50 17.05.2024	CBOE	-160.013	STK	-30	30	USD	0,9300	-2.525,23	0,00
Meta Platforms Inc CALL 300.00 15.03.2024	CBOE	-384.443	STK	-12	12	USD	62,6500	-68.045,44	-0,09
Microsoft Corp CALL 350.00 19.04.2024	CBOE	-442.460	STK	-13	13	USD	39,6100	-46.606,33	-0,07
Oracle Corp CALL 115.00 21.06.2024	CBOE	-219.477	STK	-23	23	USD	4,7000	-9.784,13	-0,01
Thermo Fisher Scientific Inc CALL 550.00 21.06.2024	CBOE	-240.209	STK	-5	5	USD	33,9200	-15.350,50	-0,02
UnitedHealth Group Inc CALL 510.00 19.01.2024	CBOE	-47.651	STK	-1	1	USD	22,2200	-2.011,13	0,00
UnitedHealth Group Inc CALL 530.00 19.01.2024	CBOE	-238.254	STK	-5	5	USD	9,4300	-4.267,55	-0,01
Verizon Communications Inc CALL 38.00 19.04.2024	CBOE	-187.673	STK	-55	55	USD	1,3400	-6.670,59	-0,01
Visa Inc CALL 260.00 21.06.2024	CBOE	-329.900	STK	-14	14	USD	16,5700	-20.996,52	-0,03
Aktienindex-Derivate						EUR		-105.345,96	-0,14
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Aktienindices									
EURO STOXX 50 Index CALL 4400.00 16.02.2024	EUREX	-180.866	STK	-4	4	EUR	167,8000	-6.712,00	-0,01
EURO STOXX 50 Index CALL 4400.00 19.01.2024	EUREX	-361.732	STK	-8	8	EUR	135,8000	-10.864,00	-0,01
EURO STOXX 50 Index CALL 4500.00 19.04.2024	EUREX	-271.299	STK	-6	6	EUR	158,9000	-9.534,00	-0,01
S&P 500 Index CALL 4500.00 19.01.2024	CBOE	-1.295.152	STK	-3	3	USD	288,1300	-78.235,96	-0,11

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
Devisen-Derivate							EUR	22.369,85	0,03
Devisenterminkontrakte									
Offene Positionen			Kauf- währung	Kauf- betrag	Verkauf- währung	Verkauf- betrag	Fälligkeit		
Banque de Luxembourg CHF/EUR	OTC		EUR	419.459,13	CHF	-400.000,00	24.05.2024	-14.578,07	-0,02
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC		EUR	2.453.378,98	USD	-2.700.000,00	24.05.2024	24.098,05	0,03
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC		EUR	1.997.082,44	USD	-2.200.000,00	27.03.2024	12.849,87	0,02
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten							EUR	2.269.690,11	3,13
Kassenbestände							EUR	2.269.690,11	3,13
Verwahrstelle									
			AUD	88.563,02				54.675,96	0,08
			CAD	122.648,04				84.198,12	0,12
			CHF	27.521,69				29.602,44	0,04
			CNY	2.662,91				339,47	0,00
			DKK	75.167,11				10.084,13	0,01
			EUR	904.530,25				904.530,25	1,25
			GBP	382.297,36				440.947,83	0,61
			JPY	1.380.662,00				8.858,92	0,01
			NOK	1.746,50				155,68	0,00
			SEK	33.699,77				3.027,18	0,00
			SGD	-3.430,51				-2.353,69	0,00
			USD	812.753,98				735.623,82	1,01
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	308.496,69	0,43
Zinsansprüche									
			EUR	287.556,26				287.556,26	0,40
Dividendenansprüche									
			EUR	20.940,43				20.940,43	0,03
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-61.683,38	-0,09
Verwaltungsvergütung									
			EUR	-28.543,44				-28.543,44	-0,04
Betreuungsgebühr									
			EUR	-4.298,12				-4.298,12	-0,01
Zentralverwaltungsvergütung									
			EUR	-3.205,39				-3.205,39	-0,01
Verwahrstellenvergütung									
			EUR	-2.719,25				-2.719,25	0,00
Register- und Transferstellenvergütung									
			EUR	-120,83				-120,83	0,00
Taxe d'Abonnement									
			EUR	-8.821,36				-8.821,36	-0,01
Prüfungskosten									
			EUR	-13.734,98				-13.734,98	-0,02
Sonstige Kosten									
			EUR	-240,01				-240,01	0,00
Teilfondsvermögen							EUR	72.556.591,15	100,00 ¹⁾
Daidalos - Multi Asset BP P									
Anzahl Anteile							STK	548.325.000	
Anteilwert							EUR	132,32	

Fußnoten:

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

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

Sodern 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 Mengennotiz)

		per 29.12.2023	
Australische Dollar	(AUD)	1,6197800	= 1 Euro (EUR)
Kanadische Dollar	(CAD)	1,4566600	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,9297100	= 1 Euro (EUR)
Yuan Renminbi	(CNY)	7,8443000	= 1 Euro (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,4540000	= 1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,8669900	= 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	155,8500000	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	11,2189000	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	11,1324000	= 1 Euro (EUR)
Singapur-Dollar	(SGD)	1,4575000	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,1048500	= 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

**Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)
für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023**

I. Erträge

1. Dividenden	EUR	787.382,38
2. Zinsen aus Wertpapieren	EUR	740.198,49
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen	EUR	115.093,99
4. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	40.212,84
5. Abzug Quellensteuer	EUR	-165.548,03
6. Bestandsprovisionen	EUR	4.726,35

Summe der Erträge	EUR	1.522.066,02
--------------------------	------------	---------------------

II. Aufwendungen

1. Verwaltungsvergütung	EUR	-340.942,19
2. Verwahrstellenvergütung	EUR	-21.856,65
3. Register- und Transferstellenvergütung	EUR	-1.522,55
4. Betreuungsgebühr	EUR	-51.754,12
5. Zentralverwaltungsgebühr	EUR	-70.227,14
6. Vertriebs-, Informations- und Zahlstellengebühr	EUR	-1.740,01
7. Prüfungskosten	EUR	-17.508,61
8. Taxe d'Abonnement	EUR	-34.123,67
9. Zinsaufwand aus Geldanlagen	EUR	-5.441,07
10. Sonstige Aufwendungen (siehe Erläuterung 2)	EUR	-34.072,31

Summe der Aufwendungen	EUR	-579.188,32
-------------------------------	------------	--------------------

III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR	942.877,70
--------------------------------------	------------	-------------------

IV. Veräußerungsgeschäfte

1. Realisierte Gewinne	EUR	2.483.410,10
2. Realisierte Verluste	EUR	-2.921.192,06

Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	-437.781,96
--	------------	--------------------

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	505.095,74
---	------------	-------------------

VI. Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres	EUR	5.658.543,90
--	------------	---------------------

VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	6.163.639,64
--	------------	---------------------

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

Daidalos - Multi Asset BP
Entwicklung des Teilfondsvermögens

		2023	
I. Wert des Teilfondsvermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR	66.179.265,61	
1. Ausschüttung	EUR	-334.478,25	
2. Mittelzufluss / -abfluss (netto)	EUR	551.755,50	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilscheingeschäften	EUR	551.755,50	
b) Mittelabflüsse aus Anteilscheingeschäften	EUR	0,00	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR	-3.591,35	
4. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	6.163.639,64	
II. Wert des Teilfondsvermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR	72.556.591,15	

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr		Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
31.12.2021	Stück	550.140,000	EUR	74.027.687,61	EUR	134,56
31.12.2022	Stück	543.875,000	EUR	66.179.265,61	EUR	121,68
31.12.2023	Stück	548.325,000	EUR	72.556.591,15	EUR	132,32

**Erläuterungen zum Jahresbericht
zum 31. Dezember 2023**

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.

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

d) Transaktionskosten

Für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 belaufen sich diese Kosten für die folgenden Teilfonds auf:

Daidalos – Multi Asset VI	EUR	5.799,64
Daidalos – Multi Asset BP	EUR	47.452,77

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) Zusammengefasster Abschluss

Der zusammengefasste 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

Daidalos Investmentfonds (F.C.P.)

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) Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht

Dieser Bericht wurde auf Basis des Nettoinventarwertes zum 29. Dezember 2023 mit den letzten verfügbaren Kursen zum 29. Dezember 2023 und unter Berücksichtigung aller Ereignisse, die sich auf die Rechnungslegung zum Berichtsstichtag am 31. Dezember 2023 beziehen, erstellt.

Erläuterung 2 – Gebühren und Aufwendungen

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

Die in der Ertrags- und Aufwandsrechnung aufgeführten sonstigen Aufwendungen beinhalten insbesondere Veröffentlichungsgebühren, Gebühren für Aufsichtsbehörden, Transaktionskosten, Marketing- und Druckkosten sowie Lizenzgebühren.

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. Die Verwaltungsgebühren der von den Teilfonds erworbenen Zielfondsanteile betragen maximal 3,50% p.a.

Im Berichtszeitraum war das Nettovermögen der Teilfonds Daidalos - Multi Asset VI und Daidalos - Multi Asset BP 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%
EUR	FAM Convex Opportunities Inhaber-Anteile S	0,53%

Erläuterung 7 – Wertpapierbestandsveränderungen

Eine Aufstellung über die während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen, ist auf Anforderung kostenlos bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

Erläuterung 8 – Zusätzliche Informationen zum Wertpapierbestand

Guardian Segur S.A. Zertifikate 30.12.33 (XS0980340136)

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds Daidalos - Multi Asset VI wie folgt in dieses Zertifikat investiert:

Daidalos - Multi Asset VI 1,97%

Bei diesem Wertpapier handelt es sich um ein 1:1-Zertifikat auf die Si S.A., die wiederum ausschließlich in die beiden ABS-Fonds „Alegra ABS I“ und „Alegra ABS Two“ investiert ist.

Ardilla Segur S.A. Inh.Gen. 2014/2024 EO 1000 (LU1114452144)

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds Daidalos - Multi Asset VI wie folgt in dieses Zertifikat investiert:

Daidalos - Multi Asset VI 0,25%

Bei diesem Zertifikat handelt es sich um eine Verbriefung des Equilibrium Special Situations Fund II L.P. und des Rockap German Equity Income Fund.

Daidalos Investmentfonds (F.C.P.)

Der Equilibrium Special Situations Fund II L.P. hat eine begrenzte Laufzeit bis zum 24. März 2024. Die Verwaltungsgesellschaft wurde darüber informiert, dass die Laufzeit des Zertifikates um drei Jahre verlängert werden soll. In diesem Zuge werden die verbleibenden Vermögenswerte des Fonds auf eine Holdinggesellschaft übertragen. Diese Holdinggesellschaft wird zukünftig im Zertifikat verbrieft.

Ardilla Segur S.A. NTS 28.12.40 Fund (XS0599782686)

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds Daidalos - Multi Asset VI wie folgt in dieses Zertifikat investiert:

Daidalos - Multi Asset VI 2,07%

Bei diesem Zertifikat handelt es sich um ein 1:1-Zertifikat auf den Film Finanzierungs-Fonds „Silver Reel Entertainment Notes“.

Ardilla Segur S.A. Inh.Gen. 2014/2029 DL 1000 (LU1072258111)

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds Daidalos - Multi Asset VI wie folgt in dieses Zertifikat investiert:

Daidalos - Multi Asset VI 2,53%

Bei diesem Zertifikat handelte es sich um ein Zertifikat auf den Fonds „Swiss ALP CCY Diversified MAC-1“.

12,0000 % Allg.Ges.f.Verbrief.SA Comp.11 EO-FLR Nts12(25)'LUPUS CLO' (XS0828893700)

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds Daidalos - Multi Asset VI wie folgt in dieses Zertifikat investiert:

Daidalos - Multi Asset VI 1,82%

Bei diesem Zertifikat handelt es sich um ein 1:1 Zertifikat auf ein Portfolio von nicht öffentlich bepreisten Anleihen.

Da die Bewertung der vorstehend genannten Zertifikate aufgrund des geringen Handelsvolumens nicht über Marktpreise sichergestellt werden kann, wird eine Modellbewertung zum Fair Value durchgeführt. Im Rahmen des Risikomanagementprozesses für die einzelnen Teilfonds werden im Hinblick auf die Zielinvestments die Risikotreiber anhand einer Durchschau bis auf die unterste Ebene der Verbriefungsstruktur identifiziert und ihr Risikobeitrag anhand von externen Dokumenten validiert.

Die Verwaltungsgesellschaft geht davon aus, dass die zum Jahresultimo 2023 ausgewiesenen Bewertungskurse nach Treu und Glauben dem wahrscheinlichsten Veräußerungskurs entsprechen. Unbeschadet dessen können die tatsächlichen Veräußerungspreise der Wertpapiere von diesen Preisen abweichen.

Erläuterung 9– Risikomanagement (ungeprüft)

In Bezug auf das Risikomanagement hat der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft den Commitment Approach als Methode zur Bestimmung des Gesamtrisikos gewählt.

Erläuterung 10 – Angaben zur Mitarbeitervergütung der Verwaltungsgesellschaft (ungeprüft)

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 2022 (Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022) der Axxion S.A. gezahlten Mitarbeitervergütung:

davon feste Vergütung:	TEUR	4.488
davon variable Vergütung:	TEUR	480
Gesamtsumme:	TEUR	4.968

Durchschnittliche Zahl der Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft: 58 (inkl. Vorstände)

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2022 (Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022) der Axxion S.A. gezahlten Vergütungen an Risk Taker:

Vergütung:	TEUR	1.729
davon Führungskräfte:	TEUR	1.729

Die Vergütungsrichtlinie der Gesellschaft wurde im Jahr 2022 aktualisiert, 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 und die Rothschild & Co. 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:	17.820 TEUR
Gesamtbetrag der fixen Vergütung:	13.441 TEUR
Gesamtbetrag der variablen Vergütung:	4.379 TEUR
Anzahl der Mitarbeiter:	102

Quellen zu den Angaben zur Vergütung der delegierten Portfoliomanager

Diem Client Partner AG: gemäß Auskunft der Diem Client Partner AG für das Geschäftsjahr 2022; FAM Frankfurt Asset Management AG: gemäß Auskunft der FAM Frankfurt Asset Management AG für das Geschäftsjahr 2022; Zantke & Cie. Asset Management GmbH: gemäß Auskunft der Zantke & Cie. Asset Management GmbH für das Geschäftsjahr 2022; Rothschild & Co. Vermögensverwaltungs-GmbH: gemäß Auskunft der Rothschild & Co. Vermögensverwaltungs-GmbH für das Geschäftsjahr 2022.

Erläuterung 11 – Angaben zu den Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 (ungeprüft)

Zum Berichtszeitpunkt und während des Geschäftsjahres hat der Fonds bzw. haben die 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 12 – Pflichtangaben gemäß EU-Offenlegungsverordnung und EU-Taxonomie-Verordnung (ungeprüft)

Angaben gemäß Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

Die Teilfonds berücksichtigen Nachhaltigkeitsrisiken bei den Investitionsentscheidungen gemäß Artikel 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Angabe gemäß Verordnung (EU) 2020/852 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen („Taxonomie-Verordnung“)

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

Erläuterung 13 – Weitere Informationen

Mögliche Auswirkungen des Ukraine-Konflikts

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