



**Geprüfter Jahresbericht  
zum 31. Dezember 2022**

# **Charisma Sicav**

Investmentgesellschaft mit variablem Kapital  
luxemburgischen Rechts

R.C.S. Luxembourg B 72 483

Verwaltungsgesellschaft



R.C.S. Luxembourg B 82 112

---

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

---

## Inhaltsverzeichnis

<b>Management und Verwaltung</b> .....	<b>1</b>
<b>Allgemeine Informationen</b> .....	<b>4</b>
<b>Geschäftsbericht</b> .....	<b>6</b>
<b>Prüfungsvermerk</b> .....	<b>9</b>
<b>Charisma Sicav</b> .....	<b>12</b>
<i>Zusammengefasste Vermögensübersicht</i> .....	12
<i>Zusammengefasste Ertrags- und Aufwandsrechnung</i> .....	13
<i>Zusammengefasste Entwicklung des Fondsvermögens</i> .....	14
<b>Charisma Sicav - AHM DACH</b> .....	<b>15</b>
<i>Vermögensübersicht</i> .....	15
<i>Vermögensaufstellung</i> .....	16
<i>Ertrags- und Aufwandsrechnung</i> .....	21
<i>Entwicklung des Teilfondsvermögens</i> .....	22
<b>Charisma Sicav - Multi Asset IP</b> .....	<b>23</b>
<i>Vermögensübersicht</i> .....	23
<i>Vermögensaufstellung</i> .....	24
<i>Ertrags- und Aufwandsrechnung</i> .....	28
<i>Entwicklung des Teilfondsvermögens</i> .....	29
<b>Erläuterungen zum Jahresbericht (Anhang)</b> .....	<b>30</b>

## **Management und Verwaltung**

### **Sitz der Gesellschaft**

Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft mit variablem Kapital  
15, rue de Flaxweiler  
L-6776 GREVENMACHER

### **Verwaltungsrat der Investmentgesellschaft**

#### **Vorsitzender**

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

#### **Mitglieder**

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

Sven ULBRICH  
Geschäftsführender Gesellschafter  
fund2seed GmbH, D-SPIESHEIM

### **Verwaltungsgesellschaft**

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

Eigenkapital per 31. Dezember 2021  
EUR 3.357.034

### **Aufsichtsrat der Verwaltungsgesellschaft<sup>1</sup>**

#### **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

---

<sup>1</sup> Siehe Erläuterung 13

**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Vorstand  
der Verwaltungsgesellschaft<sup>2</sup>**

Vorsitzender	Stefan SCHNEIDER
Mitglieder	Pierre GIRARDET Armin CLEMENS

**Verwahr- und  
Zahlstelle**

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

**Zentralverwaltung /  
Register- und Transferstelle**

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

**Informationsstelle**

Bundesrepublik Deutschland:  
  
Marcard, Stein & Co AG  
Ballindamm 36  
D-20095 HAMBURG

**Abschlussprüfer der  
Investmentgesellschaft**

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

**Portfolioverwalter**

für den Teilfonds Charisma Sicav – AHM DACH

Segment 1:  
Rothschild & Co Vermögensverwaltung GmbH  
Börsenstraße 2-4  
D-60313 FRANKFURT AM MAIN

Segment 2:  
FAM Frankfurt Asset Management AG  
Tausanstraße 1  
D-60329 FRANKFURT AM MAIN

---

<sup>2</sup> Siehe Erläuterung 11

**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

Segment 3:  
Axxion S.A.  
15, rue de Flaxweiler  
L-6776 GREVENMACHER

für den Teilfonds Charisma Sicav – Multi Asset IP

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

Segment 3:  
Axxion S.A.  
15, rue de Flaxweiler  
L-6776 GREVENMACHER

**Anlageberater**

für den Teilfonds Charisma Sicav – AHM DACH

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

für den Teilfonds Charisma Sicav – Multi Asset IP

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

## **Allgemeine Informationen**

Die Investmentgesellschaft Charisma Sicav (die „Sicav“) wurde am 19. November 1999 auf unbestimmte Zeit gegründet. Ihre Satzung wurde am 28. Dezember 1999 im „Mémorial, Recueil des Sociétés et Associations“ („Mémorial“) veröffentlicht. Eine überarbeitete Satzung trat am 13. Februar 2004 in Kraft und wurde am 5. März 2004 ebendort veröffentlicht. Eine weitere Überarbeitung der Satzung wurde am 29. September 2007 im „Mémorial “ veröffentlicht und trat am 19. Juli 2007 in Kraft.

Die Sicav unterliegt den Bedingungen gemäß Teil I des abgeänderten Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen und wurde in der Form eines Umbrella-Fonds mit einem oder mehreren Teilfonds auf unbestimmte Dauer errichtet.

Es werden derzeit Aktien der folgenden Teilfonds angeboten:

Charisma Sicav – AHM DACH in EUR  
(im Folgenden „AHM DACH“ genannt)

Charisma Sicav – Multi Asset IP in EUR  
(im Folgenden „Multi Asset IP“ genannt)

Werden weitere Teilfonds hinzugefügt, wird der Verkaufsprospekt entsprechend ergänzt.

Die Sicav kann beschließen, innerhalb eines Teilfonds verschiedene Aktienklassen auszugeben, die sich in ihren Merkmalen und Rechten nach der Art der Verwendung ihrer Erträge, nach der Gebührenstruktur oder anderen spezifischen Merkmalen und Rechten unterscheiden.

Die Sicav hat die Verwaltung gemäß Richtlinie 2009/65/EG an die Axxion S.A. übertragen.

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 die Sicav und ihre Teilfonds erfolgt in Euro.

Der Nettoinventarwert pro Aktie wird von der Investmentgesellschaft oder einem von ihr Beauftragten an jedem Bankarbeitstag in Luxemburg mit Ausnahme des 24. Dezember („Bewertungstag“) berechnet, sofern dies im betreffenden Anhang zum Verkaufsprospekt nicht abweichend geregelt ist. Als Bewertungstag gilt jeder Freitag mit Ausnahme des 24. Dezember. Falls dieser Tag kein Luxemburger Bankarbeitstag ist, ist der nächstfolgende Bankarbeitstag in Luxemburg der Bewertungstag.

Der Nettoinventarwert pro Aktie wird zusätzlich am letzten Bankarbeitstag eines Monats berechnet („indikativer Bewertungstag“). Bei diesem Bewertungstag handelt es sich um eine indikative Bewertung, welche nur zu Informationszwecken zur Verfügung gestellt wird. Anleger können zu diesem indikativen Bewertungstag keine Aktien des jeweiligen Teilfonds zeichnen, umtauschen oder zurückgeben.

Das Geschäftsjahr der Investmentgesellschaft beginnt am 1. Januar und endet am 31. Dezember eines jeden Jahres.

Die Investmentgesellschaft veröffentlicht jährlich innerhalb von vier Monaten nach Ablauf eines Geschäftsjahres in der Währung des betreffenden Teilfonds einen Jahresbericht, der den geprüften Jahresabschluss der Investmentgesellschaft und den Prüfungsvermerk enthält. Darüber hinaus

**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

veröffentlicht die Investmentgesellschaft innerhalb von zwei Monaten nach Ablauf eines jeden Halbjahres einen ungeprüften Halbjahresbericht.

Die jeweils gültigen Ausgabe- und Rücknahmepreise der einzelnen Teilfonds sowie alle sonstigen, für die Aktionäre bestimmten Informationen können jederzeit am Sitz der Investmentgesellschaft, der Verwaltungsgesellschaft, der Verwahrstelle sowie bei den Zahl- und Vertriebsstellen erfragt werden. Dort sind auch der Verkaufsprospekt und Anhänge in der jeweils aktuellen Fassung sowie die Jahres- und Halbjahresberichte kostenlos erhältlich; ferner kann hier die Satzung der Investmentgesellschaft eingesehen werden.

Die Satzung der Verwaltungsgesellschaft kann an deren Sitz eingesehen werden. Die wesentlichen Anlegerinformationen (Key Investor Information Document) können auf der Internetseite ([www.axxion.lu](http://www.axxion.lu)) heruntergeladen werden. Ferner wird auf Anfrage eine Papierversion seitens der Verwaltungsgesellschaft oder der Vertriebsstellen zur Verfügung gestellt.

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

Aktuell werden Ausgabe- und Rücknahmepreise auf der Internetseite [www.axxion.lu](http://www.axxion.lu) veröffentlicht. Hier können auch der aktuelle Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen (Key Investor Information Document) sowie die Jahresberichte und Halbjahresberichte der Investmentgesellschaft zur Verfügung gestellt werden.

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

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



## **Geschäftsbericht**

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

das Berichtsjahr vom 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022 war reich an Nachrichten. Eine Reihe von Ereignissen sorgte für eine dynamische und volatile Entwicklung an den Kapitalmärkten.

Zu Beginn des Kalenderjahres konnten flächendeckend neue Rekordkurse vermeldet werden. Die Rallye wurde jedoch jäh gestoppt, als der aufkeimende Russland-Ukraine-Konflikt für Beunruhigung an den Kapitalmärkten sorgte, bevor dieser im Worst-Case-Szenario eines weiterhin anhaltenden russischen Angriffskriegs gipfelte und eine humanitäre Katastrophe in der Ukraine auslöste. Zudem folgte die weitere Entfremdung zwischen „dem Westen“ und den kommunistisch geprägten Ländern, allen voran Russland.

Die auch durch den Krieg entfachte Inflation und die daraus resultierenden weltweiten Zinserhöhungen führten zu einer hohen Volatilität an den Kapitalmärkten. Auch fielen im Zuge der Zinserhöhungen die weltweiten Rentenmärkte über die Frühlings- und Sommermonate deutlich. Im Sommer besuchte Nancy Pelosi, Sprecherin des Repräsentantenhauses der Vereinigten Staaten, Taiwan. Dies wurde von China als Provokation aufgefasst und mit umfassenden Militärübungen rund um Taiwan gekontert. Die daraus resultierenden Spannungen sind bis zum Ende des Berichtszeitraums noch nicht abgeklungen.

Zu den Inflations- und Zinsanstiegssorgen kommen zusätzlich globale Wachstumssorgen hinzu, da sich die Konjunktur verlangsamt und die Angst vor einer Rezession zunimmt. Zumindest für Europa ist diese bereits weitgehend eingepreist. Getrieben von steigenden Energiepreisen wurde z.B. mit Blick auf die Eurozone für den Oktober 2022 eine Rekordinflation von 10,6% zum Vorjahresmonat vermeldet, bevor diese im November und Dezember überraschend auf 10,1% und dann auf 9,2% zurückging und damit erstmals seit knapp eineinhalb Jahren gesunken ist.

In UK überraschte die neue Regierung im Herbst 2022 mit Konjunkturplänen, welche kurzzeitig zu Kursverlusten führten und das Pfund abstürzen ließen. Nach nur sechs Wochen an der Spitze verkündete Liz Truss schließlich ihren Rücktritt. Ihr Nachfolger Rishi Sunak, der dritte Tory-Premier innerhalb weniger Monate, lässt auf eine weniger turbulente Phase hoffen.

Die durch den anhaltenden Ukraine-Kriege ausgelösten geopolitischen Spannungen sind weiterhin hoch und bieten weiter das Potential für kurzfristige Verwerfungen am Kapitalmarkt. Ein Blick auf die wichtigsten Leitindizes verdeutlicht diese Entwicklung im Berichtsjahr:

DAX	EuroStoxx	DJIA	EUR/USD	Nikkei	HangSeng	MSCI World Index
-12,35%	-12,42%	-8,78%	-5,9%	-10,95%	-15,00%	-17,73%

Der deutsche Leitindex DAX startete im Januar oberhalb der 16.000 Punkte-Marke, bevor der Russland-Ukraine Krieg für Kursverluste sorgte. Der Krieg mit all seinen Konsequenzen führte im DAX zu einer volatilen Abwärtsbewegung. Zum Ende des Berichtsjahres waren deutliche Erholungstendenzen ersichtlich und der DAX ging am 30. Dezember 2022 mit 13.923,59 Punkten aus dem Geschäftsjahr. Dies bedeutet für das Kalenderjahr ein Minus von 12,4%.

Die Performance in den USA war im vergangenen Geschäftsjahr ebenfalls negativ. Wesentlicher Faktor ist auch hier der Krieg in der Ukraine. Im Zuge dessen hob die FED die Zinsen von nahe 0% in mehreren Sitzungen auf eine Bandbreite von 4,25% bis 4,5% an. Die mit der Wahl Joe Bidens zum US-Präsidenten verbundenen Hoffnungen auf eine sich weiter entspannende Außenpolitik im Handelsstreit mit China wurden spätestens mit dem Besuch Pelosis in Taiwan zunichte gemacht. Auch hier konnten zu Beginn des neuen Geschäftsjahres zunächst Kursgewinne verbucht werden, bevor Corona-bedingte Kursverluste einsetzten, welche bis zum Kalenderjahresende jedoch als Kaufgelegenheiten wahrgenommen wurden. Auch der Dow-Jones konnte im Januar 2022 bei 36.799,65 einen neuen Höchststand vermelden. Jedoch musste auch die US-Wirtschaft im Kalenderjahr deutliche Rückschläge verkraften und die Aktienmärkte Verluste vermelden.

## **Charisma Sicav Investmentgesellschaft (SICAV)**

Diese waren jedoch, auch aufgrund des beherzten Eingreifens der FED, nicht ganz so umfangreich wie in Europa. Zum Ende des Kalenderjahres liegt der Dow-Jones bei 33.147,25 Punkten, was ein Rückgang für das bisherige Kalenderjahr von 8,78% (in USD) bedeutet. Aufgrund der US-Dollar-Stärke sind die Verluste in EUR gerechnet deutlich geringer.

Für die Anleihemärkte zeigte sich im Berichtsjahr ein besonders negatives Bild. Die Inflation und der weltweite, starke Zinsanstieg führten flächendeckend zu Renditeanstiegen in allen Bereichen der Rentenmärkten. Bis in den Sommer hinein waren die Kursverluste auf der Anleienseite so extrem, dass zu hohe Ausfallraten eingepreist wurden. Über die Sommermonate konnten sich die Kurse wieder etwas erholen, bevor diese im Zuge weiterer Zinserhöhungen erneut einknickten.

In dem krisenbedingten Umfeld zeigte sich der Wechselkurs zwischen EUR und USD weiterhin volatil. Das beherzte Eingreifen der FED mit starken Zinserhöhungen im Vergleich zur EZB und der stärkeren US-Wirtschaft im Vergleich zur europäischen Wirtschaft, verlieh dem US-Dollar Rückenwind bis in den Herbst 2022 und führte zu einer Aufwertung des US-Dollars nicht nur gegenüber dem Euro. Zum Ende des Berichtsjahres konnte sich der Euro jedoch deutlich erholen und der Wechselkurs notiert bei 1,0703 USD/EUR. Das entspricht einem Rückgang von 5,9% im Geschäftsjahr.

Nach dem deutlichen Preisanstieg beim Ölpreis in 2021 führten in 2022 die Ukraine-Krise und der Boykott von russischem Öl erneut zu einer Preisexplosion anderer Ölsorten und katapultierten den Ölpreis bis in den Juni über die 120 USD-Marke. Im zweiten Halbjahr 2022 war ein deutlicher Rückgang erkennbar und der Ölpreis (WTI) pendelte sich bei ca. 80 USD ein.

### **Ausblick**

Der derzeitige Mix aus belastend wirkenden politischen Störfaktoren wird wohl auch im kommenden Berichtsjahr noch anhalten. So nimmt die Spannung zwischen den USA und China, welche sicherlich mit dem Thema Taiwan weiteres Konfliktpotential hinzugewonnen hat, wieder zu. Insgesamt scheint sich das wirtschaftliche Geschehen deutlich einzutrüben. Eine Rezession gilt inzwischen als eingepreist. Unternehmen sind insbesondere im Westen skeptischer. Dies lässt sich unter anderem an dem Rückgang des ifo Geschäftsklimaindex sowie des europäischen Einkaufsmanagerindizes ablesen. Die dazukommende Energieknappheit und die außergewöhnlichen Preissteigerungen führen ebenfalls zu Irritation an den Märkten, insbesondere sobald diese als endgültig dauerhaft interpretiert werden.

Sollte die Phase der Lieferengpässe und Preissteigerungen jedoch weit bis ins neue Berichtsjahr anhalten, könnte es im Zuge erster schlechter Quartalszahlen im Jahr 2023 zu Verwerfungen an den Kapitalmärkten kommen. Auch in China entwickelt sich die Wirtschaft deutlich unter den von der Führung in Peking angestrebten Zielen. Bleibt abzuwarten, ob die Lockerung der Null-Covid Strategie durch die chinesische Regierung eine wirtschaftliche Wiederbelebung im Hinblick auf Nachfrage und Beschäftigung nach sich zieht. Angesichts hoher Inflation und den wahrscheinlich noch weiter steigenden Zinsen zeigt sich das aktuelle Umfeld insbesondere für Growth-Titel als herausfordernd. Kurzfristig wird das Hauptaugenmerk sicherlich weiter dem russischen Angriffskrieg gelten. Von einer diplomatischen Lösung wird von nahezu keinem Beobachter mehr ausgegangen, sodass mit einer länger anhaltenden, kriegerischen Auseinandersetzung zu rechnen ist, welche sich unter Umständen negativ auf die Kapitalmärkte auswirken wird. Insbesondere dann, wenn erneut eine nukleare Bedrohung wahrgenommen werden sollte.

### **Charisma Sicav - AHM DACH**

Der Teilfonds war in diesem Geschäftsjahr weiterhin schwerpunktmäßig in Renten investiert; zusätzlich wurden Put-Optionen auf der Aktienseite eingesetzt, um Prämieinnahmen zu generieren. Vor dem Hintergrund der negativen Marktentwicklungen in der ersten Jahreshälfte zeigte der Teilfonds eine Abwärtsbewegung; er konnte sich davon in Teilen erholen und schloss das Jahr mit einer Performance von -9,22% ab.

## **Charisma Sicav Investmentgesellschaft (SICAV)**

### **Charisma Sicav - Multi Asset IP**

Anfang der Berichtsperiode war dieser Teilfonds noch nahezu vollständig in Rententitel investiert. Im Laufe des ersten Quartals wurde das Aktien-Exposure jedoch etwas ausgebaut; darüber hinaus wurden weiterhin Put-Optionen eingesetzt, um Prämieinnahmen zu generieren. Vom Tiefststand in der Performanceentwicklung per Ende September konnte sich der Teilfonds im vierten Quartal erholen und beendete das Jahr mit einem Ergebnis von -6,79%.

### **Mögliche Auswirkungen der COVID-19-Pandemie**

Die Ausbreitung von COVID-19 hat weltweit zu massiven Einschnitten in das öffentliche Leben mit erheblichen Folgen u.a. für die Wirtschaft und deren Unternehmen geführt, die sich derzeit noch nicht abschätzen lassen. Vor diesem Hintergrund lassen sich die mit den Investitionen dieses Fonds verbundenen Risiken derzeit nicht abschließend absehen. Es besteht die Möglichkeit, dass sich die bestehenden Risiken verstärkt und kumuliert realisieren und sich negativ auf das Ergebnis des Fonds auswirken könnten. Im Lauf des Geschäftsjahres war die Liquidität des Fonds aufgrund der COVID-19-Pandemie nicht eingeschränkt.

Nach aktuellen Informationen hat der Verwaltungsrat der SICAV keine Kenntnis von wesentlichen negativen Auswirkungen der COVID-19-Pandemie auf den Fonds zum Geschäftsjahresende.

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

Auf Basis der aktuellen Entwicklungen in Bezug auf COVID-19 geht der Verwaltungsrat der SICAV davon aus, dass die Unternehmensfortführung der Charisma Sicav und ihrer Teilfonds sichergestellt ist.

Grevenmacher, im März 2023

Der Verwaltungsrat der SICAV



## Prüfungsvermerk

An die Aktionäre der  
**Charisma Sicav**

---

### 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 der Charisma Sicav (der „Fonds“) und ihrer jeweiligen Teilfonds zum 31. Dezember 2022 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 2022;
- der Vermögensaufstellung der Teilfonds zum 31. Dezember 2022;
- 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 Verwaltungsrat des Fonds 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 Verwaltungsrats des Fonds für den Abschluss**

Der Verwaltungsrat des Fonds ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur 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 Verwaltungsrat des Fonds 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 Verwaltungsrat des Fonds 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 Verwaltungsrat des Fonds angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und den entsprechenden Anhangsangaben;
- schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Tätigkeit durch den Verwaltungsrat des Fonds 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 (abgesehen von Charisma Sicav - Multi Asset IP, für den die Entscheidung vorliegt zur Liquidation) 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, 5. April 2023

Andreas Drossel

**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav**

**Zusammengefasste Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022**

	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>54.046.752,21</b>	<b>100,09</b>
1. Aktien	7.848.565,37	14,54
Bundesrep. Deutschland	1.337.929,88	2,48
Frankreich	1.010.572,00	1,87
Großbritannien	205.761,32	0,38
Irland	397.567,50	0,74
Kanada	278.629,35	0,52
Niederlande	219.153,00	0,41
Schweiz	616.242,56	1,14
Spanien	273.250,00	0,51
USA	3.509.459,76	6,50
2. Anleihen	32.469.344,82	60,13
< 1 Jahr	2.513.873,34	4,66
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	15.457.415,70	28,63
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	9.078.409,60	16,81
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	4.198.757,90	7,78
>= 10 Jahre	1.220.888,28	2,26
3. Zertifikate	734.074,08	1,36
Euro	734.074,08	1,36
4. Sonstige Beteiligungswertpapiere	802.074,39	1,49
US-Dollar	802.074,39	1,49
5. Investmentanteile	9.653.258,67	17,88
Euro	8.478.320,34	15,70
US-Dollar	1.174.938,33	2,18
6. Derivate	-886.441,67	-1,64
7. Bankguthaben	3.195.809,17	5,92
8. Sonstige Vermögensgegenstände	230.067,38	0,43
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-50.542,61</b>	<b>-0,09</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>53.996.209,60</b>	<b>100,00</b>

**Charisma Sicav**  
**Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav**

**Zusammengefasste Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)  
für den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022**

**I. Erträge**

1. Dividenden	EUR	166.311,30
2. Zinsen aus Wertpapieren	EUR	538.749,16
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen	EUR	20.181,86
4. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	131.816,32
5. Abzug Quellensteuer	EUR	-42.390,49
6. Bestandsprovisionen	EUR	468,15

**Summe der Erträge** **EUR 815.136,30**

**II. Aufwendungen**

1. Verwaltungsvergütung	EUR	-188.325,76
2. Verwahrstellenvergütung	EUR	-17.332,60
3. Register- und Transferstellenvergütung	EUR	-3.106,90
4. Betreuungsgebühr	EUR	-44.255,01
5. Zentralverwaltungsgebühr	EUR	-57.651,08
6. Prüfungskosten	EUR	-18.656,86
7. Taxe d'Abonnement	EUR	-13.260,58
8. Zinsaufwand aus Geldanlagen	EUR	-12.312,62
9. Sonstige Aufwendungen (siehe Erläuterung 2)	EUR	-46.240,69

**Summe der Aufwendungen** **EUR -401.142,10**

**III. Ordentlicher Nettoertrag** **EUR 413.994,20**

**IV. Veräußerungsgeschäfte**

1. Realisierte Gewinne	EUR	1.572.575,08
2. Realisierte Verluste	EUR	-2.093.692,41

**Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften** **EUR -521.117,33**

**V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres** **EUR -107.123,13**

**VI. Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres** **EUR -6.502.718,27**

**VII. Ergebnis des Geschäftsjahres** **EUR -6.609.841,40**



**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav**

**Zusammengefasste Entwicklung des Fondsvermögens**

			2022
<b>I. Wert des Fondsvermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>			<b>EUR 77.806.160,33</b>
1. Mittelzufluss / -abfluss (netto)			EUR -15.034.922,15
a) Mittelzuflüsse aus Aktiengeschäften	EUR	139.988.346,04	
b) Mittelabflüsse aus Aktiengeschäften	EUR	-155.023.268,19	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			EUR -2.165.187,18
3. Ergebnis des Geschäftsjahres			EUR -6.609.841,40
<b>II. Wert des Fondsvermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>			<b>EUR 53.996.209,60</b>

**Charisma Sicav - AHM DACH**

**Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022**

	Tageswert in EUR	% Anteil am Teilfondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>24.403.957,50</b>	<b>100,11</b>
1. Aktien	7.848.565,37	32,20
Bundesrep. Deutschland	1.337.929,88	5,49
Frankreich	1.010.572,00	4,15
Großbritannien	205.761,32	0,84
Irland	397.567,50	1,63
Kanada	278.629,35	1,14
Niederlande	219.153,00	0,90
Schweiz	616.242,56	2,53
Spanien	273.250,00	1,12
USA	3.509.459,76	14,40
2. Anleihen	7.919.527,23	32,49
< 1 Jahr	828.221,75	3,40
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	1.592.991,70	6,53
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	2.649.159,10	10,87
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	1.628.266,40	6,68
>= 10 Jahre	1.220.888,28	5,01
3. Zertifikate	734.074,08	3,01
Euro	734.074,08	3,01
4. Sonstige Beteiligungswertpapiere	802.074,39	3,29
US-Dollar	802.074,39	3,29
5. Investmentanteile	5.554.298,99	22,78
Euro	4.379.360,66	17,96
US-Dollar	1.174.938,33	4,82
6. Derivate	-564.338,34	-2,31
7. Bankguthaben	2.012.139,07	8,25
8. Sonstige Vermögensgegenstände	97.616,71	0,40
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-26.996,36</b>	<b>-0,11</b>
<b>III. Teilfondsvermögen</b>	<b>24.376.961,14</b>	<b>100,00</b>

**Charisma Sicav**  
**Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav - AHM DACH**

**Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022**

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens	
							<b>EUR</b>	<b>22.858.540,06</b>	<b>93,77</b>	
<b>Bestandspositionen</b>										
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>12.514.915,65</b>	<b>51,34</b>	
<b>Aktien</b>										
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350		STK	2.500			CHF	107,1400	271.333,93	1,11
Roche Holding AG Inhaber-Aktien SF 1	CH0012032113		STK	950	950		CHF	358,4000	344.908,63	1,41
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005		STK	1.100		350	EUR	200,9000	220.990,00	0,91
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215		STK	435	110		EUR	503,8000	219.153,00	0,90
BioNTech SE Nam.-Akt.(sp.ADRs)1/o.N.	US09075V1026		STK	130	130		EUR	143,0000	18.590,00	0,08
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	DE0005810055		STK	1.650	400		EUR	161,4000	266.310,00	1,09
EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	FR0000121667		STK	1.150			EUR	169,2000	194.580,00	0,80
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14		STK	25.000	25.000		EUR	10,9300	273.250,00	1,12
Kerry Group PLC Registered Shares A EO -,125	IE0004906560		STK	2.000	2.000		EUR	84,2400	168.480,00	0,69
Linde PLC Registered Shares EO 0,001	IE00BZ12WP82		STK	750		200	EUR	305,4500	229.087,50	0,94
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	FR0000121014		STK	400	25	75	EUR	679,9000	271.960,00	1,11
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026		STK	850	150	150	EUR	304,0000	258.400,00	1,06
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578		STK	3.000		850	EUR	89,8400	269.520,00	1,11
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600		STK	2.250	750	1.500	EUR	96,3900	216.877,50	0,89
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972		STK	2.100	250	250	EUR	130,7200	274.512,00	1,13
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101		STK	2.350	350		EUR	129,6400	304.654,00	1,25
Diageo PLC Reg. Shares LS -,28935185	GB0002374006		STK	5.000		1.000	GBP	36,5000	205.761,32	0,84
Alphabet Inc. Reg. Shs Cl. A DL-,001	US02079K3059		STK	2.500	2.510	110	USD	88,2300	206.792,29	0,85
Apple Inc. Registered Shares o.N.	US0378331005		STK	1.600		250	USD	129,9300	194.898,05	0,80
Atmos Energy Corp. Registered Shares o.N.	US0495601058		STK	1.750	2.150	400	USD	112,0700	183.867,72	0,75
BioNTech SE Nam.-Akt.(sp.ADRs)1/o.N.	US09075V1026		STK	370	73		USD	150,2200	52.108,38	0,21
Canadian National Railway Co. Registered Shares o.N.	CA1363751027		STK	2.500			USD	118,8800	278.629,35	1,14
Cisco Systems Inc. Registered Shares DL-,001	US17275R1023		STK	5.600	600		USD	47,6400	250.113,91	1,03
Danaher Corp. Registered Shares DL -,01	US2358511028		STK	1.250			USD	265,4200	311.043,92	1,28
Deere & Co. Registered Shares DL 1	US2441991054		STK	475	475		USD	428,7600	190.935,17	0,78
Johnson & Johnson Registered Shares DL 1	US4781601046		STK	1.000	1.000		USD	176,6500	165.611,96	0,68
JPMorgan Chase & Co. Registered Shares DL 1	US46625H1005		STK	1.450	500	900	USD	134,1000	182.295,04	0,75
McDonald's Corp. Registered Shares DL-,01	US5801351017		STK	900		250	USD	263,5300	222.356,91	0,91
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	US5949181045		STK	1.550	200	200	USD	239,8200	348.493,88	1,43
Moderna Inc. Registered Shares DL-,0001	US60770K1079		STK	473	188		USD	179,6200	79.651,49	0,33
Morgan Stanley Registered Shares DL -,01	US6174464486		STK	2.250			USD	85,0200	179.341,86	0,74
NIKE Inc. Registered Shares Class B o.N.	US6541061031		STK	2.200	450		USD	117,0100	241.336,90	0,99
PepsiCo Inc. Registered Shares DL -,0166	US7134481081		STK	1.750		400	USD	180,6600	296.399,94	1,22
Thermo Fisher Scientific Inc. Registered Shares DL 1	US8835561023		STK	450			USD	550,6900	232.325,97	0,95
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	US92826C8394		STK	1.150		200	USD	207,7600	223.994,75	0,92
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>										
2,5000 % HOCHDORF Holding AG SF-FLR Anl. 2017(23/Und.)	CH0391647986		CHF	285			%	30,0000	86.612,10	0,36
4,2726 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 04(09/Und.)	XS0188935174		EUR	140			%	95,8950	134.253,00	0,55
0,7500 % Bank of America Corp. EO-Medium-Term Nts 2016(17/23)	XS1458405898		EUR	200			%	99,0190	198.038,00	0,81
0,7500 % Barclays PLC EO-FLR Med.-Term Nts 19(19/25)	XS2082324364		EUR	200	200		%	94,8620	189.724,00	0,78
0,1250 % Bayerische Landesbank Med.Term.Inh.-Schv.21(28)	DE000BLB6JJ0		EUR	200			%	82,3800	164.760,00	0,68
0,7500 % Berkshire Hathaway Inc. EO-Notes 2015(15/23)	XS1200670955		EUR	200	200		%	99,6540	199.308,00	0,82
1,7500 % Blackstone Private Credit Fund EO-Notes 2021(21/26) Reg.S	XS2403519601		EUR	100	100		%	82,0790	82.079,00	0,34
2,7500 % Bque ouest-afr.developmt -BOAD EO-Bonds 2021(32/33) Reg.S	XS2288824969		EUR	150			%	74,9810	112.471,50	0,46
1,2500 % Cellnex Finance Company S.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	XS2300292963		EUR	200			%	80,2210	160.442,00	0,66
4,3750 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35416 v.22(26)	DE000A30WV11		EUR	200	200		%	96,2550	192.510,00	0,79
0,3750 % Emirates Telecommunic. Grp Co. EO-Med.-T. Notes 2021(28/28)	XS2339427747		EUR	200			%	84,3390	168.678,00	0,69
2,1250 % Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG IHS v.2020 (2027/2027)	XS2198879145		EUR	100			%	89,4150	89.415,00	0,37
6,7500 % Heimstaden AB EO-FLR Notes 21(21/Und.)	SE0016278352		EUR	200			%	45,6910	91.382,00	0,37
0,5000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-Medium-T. Notes 2019(19/26)	XS2081615473		EUR	300			%	87,9030	263.709,00	1,08
5,6250 % Iliad Holding S.A.S. EO-Notes 2021(21/28) Reg.S	XS2397781944		EUR	200	200		%	91,1500	182.300,00	0,75

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav - AHM DACH**

**Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022**

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
3,6250 % Infineon Technologies AG Sub.-FLR-Nts.v.19(28/Unb.)	XS2056730679		EUR	100		%	89,6550	89.655,00	0,37
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN.v.2019 (2024)	DE000A2LQSP7		EUR	200	200	%	96,5670	193.134,00	0,79
6,0120 % Oriflame Investment Hold. PLC EO-FLR Notes 2021(26) Reg.S	XS2337349265		EUR	135	135	%	59,3890	80.175,15	0,33
7,3500 % OTP Bank Nyrt. EO-FLR Preferred MTN 22(25/26)	XS2560693181		EUR	120	120	%	99,6760	119.611,20	0,49
5,7500 % Sigma Holdco B.V. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1813504666		EUR	300		%	72,3020	216.906,00	0,89
5,3020 % Südzucker Intl Finance B.V. EO-FLR Bonds 2005(15/Und.)	XS0222524372		EUR	100		%	81,4050	81.405,00	0,33
5,0560 % TDC Net A/S EO-Medium-Term Nts 2022(22/28)	XS2484502823		EUR	200	200	%	98,4850	196.970,00	0,81
1,0000 % Telefonaktiebolaget L.M.Erics. EO-Med.-Term Nts 2021(21/29)	XS2345996743		EUR	200		%	75,5160	151.032,00	0,62
3,8750 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2018(26/Und.)	XS1795406658		EUR	200		%	90,8300	181.660,00	0,74
0,1250 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2019(19/25)	XS2058556296		EUR	200		%	93,2500	186.500,00	0,76
3,0000 % Tikehau Capital S.C.A. EO-Obl. 2017(17/23)	FR0013298890		EUR	100		%	99,1030	99.103,00	0,41
0,5000 % Vodafone Group PLC EO-Med.-Term Notes 2016(24)	XS1499604905		EUR	200		%	97,2140	194.428,00	0,80
3,0000 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG Med.Term Notes v.20(25)	XS2152062209		EUR	200		%	97,7300	195.460,00	0,80
2,0000 % Norwegen, Königreich NK-Anl. 2012(23)	NOK010646813		NOK	1.000		%	99,5870	94.697,75	0,39
1,5000 % Norwegen, Königreich NK-Anl. 2016(26)	NOK010757925		NOK	1.000		%	95,3270	90.646,90	0,37
5,6500 % Network i2i Ltd. DL-FLR Secs 2019(25/Und.)Reg.S	USV6703DAA29		USD	200		%	95,6170	179.284,68	0,73
							<b>EUR</b>	<b>4.697.157,92</b>	<b>19,27</b>
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>									
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
4,1250 % Adler Pelzer Holding GmbH Notes v.17(20/24) Reg.S	XS1533914591		EUR	120	120	%	85,8720	103.046,40	0,42
0,8000 % AGCO International Holdings BV EO-Notes 2021(21/28)	XS2393323071		EUR	200		%	81,8960	163.792,00	0,67
2,8750 % AT & T Inc. EO-FLR Pref.Secs 2020(25/Und.)	XS2114413565		EUR	200		%	89,9760	179.952,00	0,74
1,7500 % CECONOMY AG Anleihe v.2021(2021/2026)	XS2356316872		EUR	100	100	%	63,3420	63.342,00	0,26
4,7500 % Coty Inc. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1801788305		EUR	100	100	%	94,4740	94.474,00	0,39
6,0000 % Douglas GmbH IHS v.2021(2023/2026) REG S	XS2326497802		EUR	150		%	84,0400	126.060,00	0,52
2,7500 % Faurecia SE EO-Notes 2021(21/27)	XS2405483301		EUR	250	250	%	84,5540	211.385,00	0,87
2,2500 % Grifols S.A. EO-Notes 2019(19/27) Reg.S	XS2077646391		EUR	200		%	87,6120	175.224,00	0,72
3,5000 % Grupo Antolin Irausa S.A. EO-Notes 2021(21/28) Reg.S	XS2355632584		EUR	200	200	%	71,3720	142.744,00	0,59
3,0000 % Indra Sistemas S.A. EO-Bonds 2018(18/24)	XS1809245829		EUR	100		%	98,2670	98.267,00	0,40
5,7500 % Lenzing AG EO-FLR Notes 2020(20/Und.)	XS2250987356		EUR	100		%	84,2130	84.213,00	0,35
7,7980 % Mutares SE & Co. KGaA FLR-Bonds v.20(20/24)	NO0010872864		EUR	100		%	98,0000	98.000,00	0,40
4,5000 % Norican A/S EO-Bonds 2017(17/23)	XS1577963058		EUR	250	100	%	94,8300	237.075,00	0,97
3,2500 % PPF Telecom Group B.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/27)	XS2238777374		EUR	200		%	90,0000	180.000,00	0,74
3,8750 % Tele Columbus AG Notes v.2018(2021/2025) RegS	XS1814546013		EUR	120	120	%	75,9440	91.132,80	0,37
4,5000 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2018(18/25)	XS1813724603		EUR	150	150	%	96,1610	144.241,50	0,59
5,0000 % UniCredit Bank AG HVB Bonitaet 14(24) ARRB	DE000HV5LXH8		EUR	100		%	99,0580	99.058,00	0,41
3,3000 % Amazon.com Inc. DL-Notes 2022(22/27)	US023135CF19		USD	200	200	%	95,0580	178.236,53	0,73
4,5000 % CCO Hldgs LLC/Capital Corp. DL-Notes 2020(20/30) 144A	US1248EPCE15		USD	200		%	82,8720	155.387,43	0,64
5,5000 % Seaspan Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	US81254UAK25		USD	200		%	75,8180	142.160,97	0,58
1,1250 % United States of America DL-Notes 2021(26)	US91282CDG33		USD	200	200	%	89,4492	167.719,91	0,69
3,1250 % United States of America DL-Notes 2022(27) S.AC-2027	US91282CFH97		USD	250	250	%	96,2109	225.497,91	0,92
<b>Zertifikate</b>									
Ardilla Segur S.A. NTS 28.12.40 Fund	XS0599782686		STK	3		EUR	54.330,3600	162.991,08	0,67
Guardian Segur S.A. Zertifikate 30.12.33	XS0980340136		STK	380		EUR	1.502,8500	571.083,00	2,34
<b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>									
Ardilla Segur S.A. Inh.Gen. 2014/2029 DL 1000	LU1072258111		STK	595		USD	1.437,8700	802.074,39	3,29
							<b>EUR</b>	<b>92.167,50</b>	<b>0,38</b>
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>									
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
6,2500 % Standard ProfilAutomotive GmbH Anleihe v.21(21/26) Reg.S	XS2339015047		EUR	150	150	%	61,4450	92.167,50	0,38

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav - AHM DACH**

**Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022**

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens	
<b>Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>5.554.298,99</b>	<b>22,78</b>	
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>										
Alegra High Grade ABS Portfol. Inhaber-Anteile o.N.	LI0027320568		ANT	180		180	EUR	1.485,8500	267.453,00	1,10
Capitulum Weltzins-Invest Unvl Inhaber-Anteilsklasse I	DE000A2H7NU1		ANT	2.903	222		EUR	81,7300	237.262,19	0,97
iShare.Nikkei 225 UCITS ETF DE Inhaber-Anteile	DE000A0H08D2		ANT	7.610			EUR	18,4680	140.541,48	0,58
iShares Core DAX UCITS ETF DE Inhaber-Anteile EUR Acc.	DE0005933931		ANT	4.570			EUR	117,4000	536.518,00	2,20
iShs MSCI EM U.ETF USD (D) Registered Shares o.N.	IE00B0M63177		ANT	6.000			EUR	34,5000	207.000,00	0,85
iShsV-Gold Producers.UCITS ETF Registered Shares USD (Acc) oN	IE00B6R52036		ANT	7.700			EUR	11,8360	91.137,20	0,37
PAYDEN GBL-Pay.Gbl Em.Mkts Bd Registered Shs. Class EUR o.N.	IE00B04NLM33		ANT	7.109		4.862	EUR	17,3046	123.014,35	0,50
SPDR Bl.Em.Mkts Loc.Bd UETF Registered Shares (Dist)o.N.	IE00B4613386		ANT	1.500			EUR	52,1340	78.201,00	0,32
Zantke EO Corporate Bonds AMI Inhaber-Anteile S(a)	DE000A2PPHN8		ANT	6.666			EUR	98,0100	653.334,66	2,68
Zantke Euro High Yield AMI Inhaber-Anteile S(a)	DE000A2PPHP3		ANT	6.055			EUR	105,3900	638.136,45	2,62
Zantke Global Credit AMI Inhaber-Anteile S(a)	DE000A2PPHQ1		ANT	13.609			EUR	103,3700	1.406.762,33	5,77
Fidelity Fds-Asian Bond Fund Reg. Sh. I Acc. USD o.N.	LU1322385458		ANT	16.677	1.247		USD	11,3000	176.674,73	0,72
FISCH-Bd EM Corporates Dyn. Act.Nom. LD USD Acc. oN	LU2466185779		ANT	1.320	1.320		USD	95,7200	118.455,35	0,49
iShs VII-MSCI EM Asia U.ETF Reg. Shares USD (Acc) o.N.	IE00B5L8K969		ANT	1.100			USD	148,8500	153.503,96	0,63
N.I.F.(L.)J-L.S.Sh.T.E.Mkts Bd Nam.-Ant.S/A (USD)o.N.	LU0980588346		ANT	2.274	18		USD	114,9200	244.998,90	1,01
PAYDEN GBL-Pay.Gbl Em.Mkts Bd Registered Shs. Class USD o.N.	IE0030928885		ANT	3.751		2.549	USD	31,0326	109.129,78	0,45
Schroder ISF-Asian Loc.Curr.Bd Namens-Anteile C Acc. USD o.N.	LU0358730231		ANT	1.354	65		USD	144,5828	183.532,66	0,75
UBS L.Eq. - All China DL Act. Nom. I-A1 USD Acc. oN	LU1867708205		ANT	1.920			USD	104,8000	188.642,95	0,77
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>22.858.540,06</b>	<b>93,77</b>	
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-564.338,34</b>	<b>-2,31<sup>2)</sup></b>	
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>-25.369,14</b>	<b>-0,10</b>	
<b>Wertpapier-Optionsrechte</b>										
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>										
Alphabet Inc PUT 77.00 15.09.2023 (Cl. A)	CBOE	-122.690	STK	-15		15	USD	5,3000	-7.453,24	-0,03
Meta Platforms Inc PUT 125.00 16.06.2023	CBOE	-111.264	STK	-10		10	USD	19,1100	-17.915,90	-0,07
<b>Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-538.969,20</b>	<b>-2,21</b>	
<b>Optionsrechte</b>										
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>										
DAX Index CALL 5000.00 15.12.2023	EUREX	-487.326	STK	-7		7	EUR	9.142,9000	-320.001,50	-1,31
EURO STOXX 50 Index PUT 2500.00 15.12.2023	EUREX	-569.043	STK	-15		15	EUR	42,0000	-6.300,00	-0,03
EURO STOXX 50 Index PUT 2800.00 17.03.2023	EUREX	-644.915	STK	-17		17	EUR	6,1000	-1.037,00	0,00
EURO STOXX 50 Index PUT 2900.00 15.09.2023	EUREX	-569.043	STK	-15		15	EUR	57,6000	-8.640,00	-0,04
EURO STOXX 50 Index PUT 3025.00 16.06.2023	EUREX	-569.043	STK	-15		15	EUR	43,3000	-6.495,00	-0,03
EURO STOXX 50 Index PUT 3050.00 15.12.2023	EUREX	-569.043	STK	-15		15	EUR	102,3000	-15.345,00	-0,06
EURO STOXX 50 Index PUT 3050.00 17.11.2023	EUREX	-531.107	STK	-14		14	EUR	92,6000	-12.964,00	-0,05
EURO STOXX 50 Index PUT 3100.00 15.12.2023	EUREX	-531.107	STK	-14		14	EUR	110,6000	-15.484,00	-0,06
EURO STOXX 50 Index PUT 3200.00 15.03.2024	EUREX	-531.107	STK	-14		14	EUR	152,7000	-21.378,00	-0,09
EURO STOXX 50 Index PUT 3250.00 15.12.2023	EUREX	-531.107	STK	-14		14	EUR	139,3000	-19.502,00	-0,08
EURO STOXX 50 Index PUT 3250.00 17.03.2023	EUREX	-569.043	STK	-15			EUR	22,4000	-3.360,00	-0,01

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav - AHM DACH**

**Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022**

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
EURO STOXX 50 Index PUT 3300.00 15.03.2024	EUREX	-531.107	STK	-14		14	EUR 175,0000	-24.500,00	-0,10
EURO STOXX 50 Index PUT 3300.00 16.06.2023	EUREX	-531.107	STK	-14			EUR 80,4000	-11.256,00	-0,05
EURO STOXX 50 Index PUT 3300.00 21.06.2024	EUREX	-531.107	STK	-14		14	EUR 211,4000	-29.596,00	-0,12
EURO STOXX 50 Index PUT 3525.00 16.06.2023	EUREX	-531.107	STK	-14			EUR 132,0000	-18.480,00	-0,08
EURO STOXX 50 Index PUT 3750.00 17.03.2023	EUREX	-493.171	STK	-13			EUR 123,3000	-16.029,00	-0,07
S&P 500 Index PUT 3200.00 15.09.2023	CBOE	-359.959	STK	-1		1	USD 91,7500	-8.601,70	-0,04
<b>Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>2.012.139,07</b>	<b>8,25</b>
<b>Kassenbestände</b>							<b>EUR</b>	<b>2.012.139,07</b>	<b>8,25</b>
Verwahrstelle									
			CHF	239.119,55				242.229,78	0,99
			DKK	80.714,33				10.853,81	0,04
			EUR	881.150,69				881.150,69	3,61
			GBP	47.368,99				53.406,61	0,22
			JPY	627.535,00				4.455,34	0,02
			NOK	106.020,54				10.081,54	0,04
			SEK	13.898,67				1.249,81	0,01
			USD	862.612,12				808.711,49	3,32
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>97.616,71</b>	<b>0,40</b>
Zinsansprüche								95.628,24	0,39
Dividendenansprüche								1.988,47	0,01
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-26.996,36</b>	<b>-0,11</b>
Verwaltungsvergütung								EUR -8.988,61	-0,04
Betreuungsgebühr								EUR -1.647,59	-0,01
Zentralverwaltungsvergütung								EUR -1.490,46	-0,01
Verwahrstellenvergütung								EUR -966,25	0,00
Register- und Transferstellenvergütung								EUR -125,00	0,00
Taxe d'Abonnement								EUR -2.933,45	-0,01
Prüfungskosten								EUR -10.845,00	-0,04
<b>Teilfondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>24.376.961,14</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>
<b>Charisma Sicav - AHM DACH P</b>									
Anzahl Aktien								STK 12.963,866	
Aktienwert								EUR 1.880,38	

**Fußnoten:**

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

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

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

**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav - AHM DACH**

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

**Devisenkurse (in Mengennote)**

		per 30.12.2022	
Schweizer Franken	(CHF)	0,9871600	= 1 Euro (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,4365000	= 1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,8869500	= 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	140,8500000	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	10,5163000	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	11,1206000	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,0666500	= 1 Euro (EUR)

**Marktschlüssel**

**Terminbörsen**

EUREX	Eurex Deutschland
CBOE	Chicago - CBOE Opt. Ex.

**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav - AHM DACH**

**Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)  
für den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022**

**I. Erträge**

1. Dividenden	EUR	166.311,30
2. Zinsen aus Wertpapieren	EUR	278.242,30
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen	EUR	16.641,13
4. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	87.201,20
5. Abzug Quellensteuer	EUR	-38.945,82
6. Bestandsprovisionen	EUR	441,53

<b>Summe der Erträge</b>	<b>EUR</b>	<b>509.891,64</b>
--------------------------	------------	-------------------

**II. Aufwendungen**

1. Verwaltungsvergütung	EUR	-108.149,30
2. Verwahrstellenvergütung	EUR	-7.815,39
3. Register- und Transferstellenvergütung	EUR	-1.848,03
4. Betreuungsgebühr	EUR	-21.142,99
5. Zentralverwaltungsgebühr	EUR	-30.916,25
6. Prüfungskosten	EUR	-10.313,69
7. Taxe d'Abonnement	EUR	-11.707,66
8. Zinsaufwand aus Geldanlagen	EUR	-5.528,76
9. Sonstige Aufwendungen (siehe Erläuterung 2)	EUR	-23.710,84

<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>EUR</b>	<b>-221.132,91</b>
-------------------------------	------------	--------------------

<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>EUR</b>	<b>288.758,73</b>
--------------------------------------	------------	-------------------

**IV. Veräußerungsgeschäfte**

1. Realisierte Gewinne	EUR	1.165.011,49
2. Realisierte Verluste	EUR	-713.633,16

<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>EUR</b>	<b>451.378,33</b>
--	------------	-------------------

<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>740.137,06</b>
---	------------	-------------------

<b>VI. Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>-3.214.789,17</b>
--	------------	----------------------

<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>-2.474.652,11</b>
--	------------	----------------------



**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav - AHM DACH**

**Entwicklung des Teilfondsvermögens**

		2022
<b>I. Wert des Teilfondsvermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>EUR 26.850.251,01</b>
1. Mittelzufluss / -abfluss (netto)		EUR 1.369,10
a) Mittelzuflüsse aus Aktiengeschäften	EUR 3.296,04	
b) Mittelabflüsse aus Aktiengeschäften	EUR -1.926,94	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		EUR -6,86
3. Ergebnis des Geschäftsjahres		EUR -2.474.652,11
<b>II. Wert des Teilfondsvermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>EUR 24.376.961,14</b>

**Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre**

Geschäftsjahr	Umlaufende Aktien am Ende des Geschäftsjahres		Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Aktienwert am Ende des Geschäftsjahres	
31.12.2020	Stück	12.669,383	EUR	23.093.163,08	EUR	1.822,75
31.12.2021	Stück	12.963,145	EUR	26.850.251,01	EUR	2.071,28
31.12.2022	Stück	12.963,866	EUR	24.376.961,14	EUR	1.880,38

**Charisma Sicav - Multi Asset IP**  
**Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022**

	Tageswert in EUR	% Anteil am Teilfondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>29.642.794,71</b>	<b>100,08</b>
1. Anleihen	24.549.817,59	82,88
< 1 Jahr	1.685.651,59	5,69
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	13.864.424,00	46,81
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	6.429.250,50	21,70
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	2.570.491,50	8,68
2. Investmentanteile	4.098.959,68	13,84
Euro	4.098.959,68	13,84
3. Derivate	-322.103,33	-1,09
4. Bankguthaben	1.183.670,10	4,00
5. Sonstige Vermögensgegenstände	132.450,67	0,45
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-23.546,25</b>	<b>-0,08</b>
<b>III. Teilfondsvermögen</b>	<b>29.619.248,46</b>	<b>100,00</b>

**Charisma Sicav**  
**Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav - Multi Asset IP**  
**Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022**

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens	
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>28.648.777,27</b>	<b>96,72</b>	
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>17.499.000,59</b>	<b>59,08</b>	
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>										
0,2500 % AT & T Inc. EO-Notes 2019(19/26)	XS2051361264		EUR	500	2.000	1.500	%	89,6120	448.060,00	1,51
3,5000 % Banijay Entertainment S.A.S. EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2112340679		EUR	200	200		%	94,4610	188.922,00	0,64
0,7500 % Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/27)	XS2199266003		EUR	500			%	88,3880	441.940,00	1,49
0,1250 % Bayerische Landesbank Med.Term.Inh.-Schv.21(28)	DE000BLB6JJ0		EUR	300			%	82,3800	247.140,00	0,83
0,0000 % Berkshire Hathaway Inc. EO-Notes 2020(20/25)	XS2133056114		EUR	250	5.300	5.050	%	92,7350	231.837,50	0,78
0,0000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2280845491		EUR	750	2.000	1.250	%	90,8800	681.600,00	2,30
1,8760 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2020(24)	XS2135797202		EUR	200	1.000	800	%	98,2180	196.436,00	0,66
1,2500 % Cellnex Finance Company S.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	XS2300292963		EUR	400			%	80,2210	320.884,00	1,08
0,0000 % CNH Industrial Finance Euro.SA EO-Medium-Term Nts 2020(24/24)	XS2264980363		EUR	200	500	800	%	95,7110	191.422,00	0,65
2,7500 % Coca Cola HBC Finance B.V. EO-Med.-Term Nts 2022(22/25)	XS2533012790		EUR	100	100		%	97,3460	97.346,00	0,33
0,7500 % Deutsche Bahn Finance GmbH EO-Medium-Term Notes 2016(26)	XS1372911690		EUR	250	3.000	2.750	%	93,2570	233.142,50	0,79
1,3750 % DS Smith PLC EO-Medium-Term Nts 2017(17/24)	XS1652512457		EUR	100	600	900	%	96,6520	96.652,00	0,33
1,7500 % DSV A/S EO-Anl. 2017(17/24)	DK0030403993		EUR	150	850	700	%	96,5560	144.834,00	0,49
0,1250 % E.ON SE Medium Term Notes v.22(25/26)	XS2433244089		EUR	750	1.000	250	%	90,5100	678.825,00	2,29
0,3750 % Emirates Telecommun. Grp Co. EO-Med.-T. Notes 2021(28/28)	XS2339427747		EUR	500			%	84,3390	421.695,00	1,42
0,3750 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/28)	XS2344735811		EUR	250		500	%	82,5670	206.417,50	0,70
1,6590 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2018(18/24)	XS1811024543		EUR	200			%	88,8640	177.728,00	0,60
0,1250 % Euronext N.V. EO-Notes 2021(21/26)	DK0030485271		EUR	750	1.500	1.250	%	87,9340	659.505,00	2,23
1,5000 % Ferrari N.V. EO-Notes 2016(16/23)	XS1380394806		EUR	200	1.400	1.200	%	99,7210	199.442,00	0,67
4,2500 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2022/2026)	XS259580548		EUR	200	200		%	98,4210	196.842,00	0,66
1,6940 % General Motors Financial Co. EO-Med.-Term Nts 2018(18/25)	XS1792505866		EUR	200	500	600	%	94,6880	189.376,00	0,64
0,7500 % GN Store Nord AS EO-Medium-Term Nts 2019(19/23)	XS2090786943		EUR	200	500	600	%	94,5560	189.112,00	0,64
0,1250 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-Medium-Term Nts 2019(24)	XS2043678841		EUR	750	1.500	1.250	%	94,9460	712.095,00	2,40
1,3750 % Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) EO-Bonds 2017(17/24)	BE0002280494		EUR	100	100		%	97,5040	97.504,00	0,33
1,5000 % HeidelbergCement AG Medium Term Notes v.16(16/25)	XS1529515584		EUR	200	2.500	2.300	%	95,9380	191.876,00	0,65
0,5000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-Medium-T. Notes 2019(19/26)	XS2081615473		EUR	500			%	87,9030	439.515,00	1,48
2,3750 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-Medium-T. Notes 2020(20/25)	XS2156244043		EUR	200	1.200	1.000	%	97,0130	194.026,00	0,65
1,6250 % Huhtamäki Oyj EO-Notes 2017(24/24)	FI4000282801		EUR	150	150		%	95,5450	143.317,50	0,48
0,7500 % Iliad S.A. EO-Obl. 2021(21/24)	FR0014001YE4		EUR	700	900	1.300	%	96,2090	673.463,00	2,27
1,7500 % Intl Flavors & Fragrances Inc. EO-Notes 2016(16/24)	XS1319817323		EUR	100	100		%	97,7570	97.757,00	0,33
4,7500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2008(23)	IT0004356843		EUR	230	230		%	101,1690	232.688,70	0,79
0,3890 % JPMorgan Chase & Co. EO-FLR Med.-T. Nts 2020(20/28)	XS2123320033		EUR	500			%	85,5990	427.995,00	1,44
0,2500 % LeasePlan Corporation N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2305244241		EUR	500		300	%	87,0310	435.155,00	1,47
0,5000 % LG Chem Ltd. EO-Notes 2019(23) Reg.S	XS1972557737		EUR	200	1.000	800	%	99,2270	198.454,00	0,67
1,0000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2018(25)	DE000A190NE4		EUR	750	2.000	1.250	%	94,0290	705.217,50	2,38
3,2050 % Mowi ASA EO-FLR Notes 2020(23/25)	NO0010874050		EUR	200		500	%	98,6550	197.310,00	0,67
3,1250 % OI European Group B.V. EO-Notes 2016(16/24) Reg.S	XS1405765907		EUR	200	600	400	%	97,2320	194.464,00	0,66
0,5000 % POSCO Holdings Inc. EO-Notes 2020(24) Reg.S	XS2103230152		EUR	200		600	%	95,8660	191.732,00	0,65
2,3750 % Renault S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/26)	FR0014000NZ4		EUR	500			%	90,3470	451.735,00	1,53
0,3750 % Repsol Europe Finance EO-Medium-Term Nts 2021(29/29)	XS2361358299		EUR	300			%	80,4820	241.446,00	0,82
1,2500 % Securitas AB EO-Med.-Term Nts 2018(24/25)26	XS1788605936		EUR	100	700	600	%	93,7160	93.716,00	0,32
0,3750 % Shell International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2016(25)	XS1476654238		EUR	750	3.000	2.250	%	94,1770	706.327,50	2,38
2,1250 % SoftBank Group Corp. EO-Notes 2021(21/24)	XS2361253862		EUR	200	1.000	1.800	%	94,3070	188.614,00	0,64
4,4000 % Spanien EO-Bonos 2013(23)	ES00000123X3		EUR	230	230		%	101,4540	233.344,20	0,79
0,2500 % Stryker Corp. EO-Notes 2019(19/24)	XS2087622069		EUR	500	2.500	2.000	%	94,0460	470.230,00	1,59
0,1250 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2019(19/25)	XS2058556296		EUR	600	3.300	2.700	%	93,2500	559.500,00	1,89
1,6250 % Tikehau Capital S.C.A. EO-Obl. 2021(21/29)	FR0014002PC4		EUR	500			%	75,4660	377.330,00	1,27
0,0000 % Toyota Motor Finance (Neth.)BV EO-Medium-Term Notes 2021(25)	XS2400997131		EUR	100	1.500	1.700	%	91,0280	91.028,00	0,31
0,1250 % TRATON Finance Luxembourg S.A. EO-Med.-Term Nts 2021(24/24)	DE000A3KYMA6		EUR	200	1.000	1.300	%	92,6460	185.292,00	0,63
0,1250 % TRATON Finance Luxembourg S.A. EO-Med.-Term Nts 2021(25/25)	DE000A3KNP88		EUR	800	1.500	1.200	%	91,1780	729.424,00	2,46
1,2890 % Ubisoft Entertainment S.A. EO-Bonds 2018(18/23)	FR0013313186		EUR	100	500	800	%	99,8470	99.847,00	0,34
0,0000 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG Med.Term Notes v.21(25)	XS2374595127		EUR	750	2.000	1.250	%	91,7900	688.425,00	2,32

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

**Charisma Sicav**  
**Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav - Multi Asset IP**  
**Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022**

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfondsvermögens
0,2500 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG Med.Term Notes v.22(25)	XS2438615606		EUR	300	700	400 %	92,7500	278.250,00	0,94
1,2500 % ZF Europe Finance B.V. EO-Notes 2019(19/23)	XS2010040124		EUR	200	700	1.000 %	97,6570	195.314,00	0,66
1,0000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE LS-Medium-Term Notes 20(20/23)	FR0013482858		GBP	300		%	99,7670	337.449,69	1,14
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>7.050.817,00</b>	<b>23,80</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
0,7500 % ABB Finance B.V. EO-Medium-T. Notes 2017(17/24)	XS1613121422		EUR	100	800	700 %	96,6660	96.666,00	0,33
0,6250 % ABB Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/24)	XS2463974571		EUR	100	100	%	96,8860	96.886,00	0,33
0,8000 % AGCO International Holdings BV EO-Notes 2021(21/28)	XS2393323071		EUR	400		500 %	81,8960	327.584,00	1,11
0,7500 % American Medical Syst.Eu. B.V. EO-Notes 2022(22/25)	XS2454766473		EUR	200	800	600 %	93,8240	187.648,00	0,63
1,0000 % Berry Global Inc. EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2093880735		EUR	200	1.200	1.000 %	94,4140	188.828,00	0,64
0,1000 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2021(21/25)	XS2308321962		EUR	750	1.000	1.250 %	92,5290	693.967,50	2,34
0,0000 % Comcast Corp. EO-Notes 2021(21/26)	XS2385397901		EUR	750	1.200	1.250 %	87,3380	655.035,00	2,21
2,2500 % DIC Asset AG Anleihe v.2021(2021/2026)	XS2388910270		EUR	100		300 %	57,6740	57.674,00	0,19
0,6250 % Digital Dutch Finco B.V. EO-Notes 2020(20/25)	XS2100663579		EUR	100		300 %	89,5410	89.541,00	0,30
2,6250 % Faurecia SE EO-Notes 2018(18/25)	XS1785467751		EUR	1.000	1.500	1.000 %	91,2820	912.820,00	3,08
1,6250 % Grifols S.A. EO-Notes 2019(19/25) Reg.S	XS2076836555		EUR	950	1.100	850 %	95,0350	902.832,50	3,05
0,2140 % Mizuho Financial Group Inc. EO-Medium-Term Notes 2020(25)	XS2241387252		EUR	500	1.000	1.000 %	91,3240	456.620,00	1,54
0,8750 % P3 Group S.a.r.l. EO-Medium-Term Nts 2022(22/26)	XS2436807866		EUR	100	800	700 %	83,4380	83.438,00	0,28
2,3750 % PHOENIX PIB Dutch Finance B.V. EO-Notes 2020(25/25)	XS2212959352		EUR	600	900	1.200 %	94,1470	564.882,00	1,91
3,5000 % PPF Telecom Group B.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/24)	XS2176872849		EUR	200		200 %	98,6150	197.230,00	0,67
3,2500 % PPF Telecom Group B.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/27)	XS2238777374		EUR	400		%	90,0000	360.000,00	1,21
2,6250 % Sigma Alimentos S.A. EO-Notes 2017(17/24) Reg.S	XS1562623584		EUR	150		150 %	97,8430	146.764,50	0,49
4,5000 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2018(18/25)	XS1813724603		EUR	350	350	%	96,1610	336.563,50	1,14
1,6250 % VGP N.V. EO-Notes 2022(22/27)	BE6332786449		EUR	800	800	%	75,8480	606.784,00	2,05
0,3750 % Viterra Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/25)	XS2389688107		EUR	100		400 %	89,0530	89.053,00	0,30
<b>Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>4.098.959,68</b>	<b>13,84</b>
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>									
Quoniam F.S.-Global Eq.MinRisk Inhaber-Ant.EUR hed.I o.N.	LU1120174617		ANT	3.352	6.984	3.632 EUR	1.222,8400	4.098.959,68	13,84
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>28.648.777,27</b>	<b>96,72</b>
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-322.103,33</b>	<b>-1,09<sup>2)</sup></b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-322.103,33</b>	<b>-1,09</b>
<b>Optionsrechte</b>									
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>									
SWISS MARKET Index PUT 7000.00 16.06.2023	EUREX	-5.434.479	STK	-50		50 CHF	19,0000	-9.623,57	-0,03
SWISS MARKET Index PUT 7000.00 20.12.2024	EUREX	-5.434.479	STK	-50		50 CHF	132,2000	-66.959,76	-0,23
EURO STOXX 50 Index PUT 2000.00 15.12.2023	EUREX	-13.277.670	STK	-350		190 EUR	18,3000	-64.050,00	-0,22
EURO STOXX 50 Index PUT 2000.00 20.12.2024	EUREX	-7.587.240	STK	-200		200 EUR	50,1000	-100.200,00	-0,34
EURO STOXX 50 Index PUT 2000.00 21.06.2024	EUREX	-7.587.240	STK	-200		200 EUR	34,8000	-69.600,00	-0,23
EURO STOXX 50 Index PUT 2200.00 17.03.2023	EUREX	-6.828.516	STK	-180	120	155 EUR	1,4000	-2.520,00	-0,01
EURO STOXX 50 Index PUT 2400.00 16.06.2023	EUREX	-2.845.215	STK	-75	55	EUR	12,2000	-9.150,00	-0,03

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav - Multi Asset IP  
Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022**

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens
<b>Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten</b>							EUR	1.183.670,10	4,00
<b>Kassenbestände</b>							EUR	1.183.670,10	4,00
Verwahrstelle									
			CHF	1.527,74				1.547,61	0,01
			EUR	1.166.826,28				1.166.826,28	3,94
			GBP	4.417,42				4.980,46	0,02
			USD	11.003,29				10.315,75	0,03
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							EUR	132.450,67	0,45
Zinsansprüche			EUR	132.450,67				132.450,67	0,45
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							EUR	-23.546,25	-0,08
Verwaltungsvergütung			EUR	-7.253,80				-7.253,80	-0,02
Betreuungsgebühr			EUR	-1.991,10				-1.991,10	-0,01
Zentralverwaltungsvergütung			EUR	-1.662,21				-1.662,21	-0,01
Verwahrstellenvergütung			EUR	-1.562,12				-1.562,12	-0,01
Register- und Transferstellenvergütung			EUR	-125,00				-125,00	0,00
Taxe d'Abonnement			EUR	-638,02				-638,02	0,00
Prüfungskosten			EUR	-10.314,00				-10.314,00	-0,03
<b>Teilfondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>29.619.248,46</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>
<b>Charisma Sicav - Multi Asset IP I</b>									
Anzahl Aktien							STK	306.895,000	
Aktienwert							EUR	96,51	

**Fußnoten:**

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

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

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

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav - Multi Asset IP**

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

**Devisenkurse (in Mengennotiz)**

Schweizer Franken	(CHF)	per 30.12.2022	
Britische Pfund	(GBP)	0,9871600	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	0,8869500	= 1 Euro (EUR)
		1,0666500	= 1 Euro (EUR)

**Marktschlüssel**

**Terminbörsen**

EUREX	Eurex Deutschland
-------	-------------------

**Charisma Sicav**  
**Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav - Multi Asset IP**

**Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)  
für den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022**

**I. Erträge**

1. Zinsen aus Wertpapieren	EUR	260.506,86
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen	EUR	3.540,73
3. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	44.615,12
4. Abzug Quellensteuer	EUR	-3.444,67
5. Bestandsprovisionen	EUR	26,62

<b>Summe der Erträge</b>	<b>EUR</b>	<b>305.244,66</b>
--------------------------	------------	-------------------

**II. Aufwendungen**

1. Verwaltungsvergütung	EUR	-80.176,46
2. Verwahrstellenvergütung	EUR	-9.517,21
3. Register- und Transferstellenvergütung	EUR	-1.258,87
4. Betreuungsgebühr	EUR	-23.112,02
5. Zentralverwaltungsgebühr	EUR	-26.734,83
6. Prüfungskosten	EUR	-8.343,17
7. Taxe d'Abonnement	EUR	-1.552,92
8. Zinsaufwand aus Geldanlagen	EUR	-6.783,86
9. Sonstige Aufwendungen (siehe Erläuterung 2)	EUR	-22.529,85

<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>EUR</b>	<b>-180.009,19</b>
-------------------------------	------------	--------------------

<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>EUR</b>	<b>125.235,47</b>
--------------------------------------	------------	-------------------

**IV. Veräußerungsgeschäfte**

1. Realisierte Gewinne	EUR	407.563,59
2. Realisierte Verluste	EUR	-1.380.059,25

<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>EUR</b>	<b>-972.495,66</b>
--	------------	--------------------

<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>-847.260,19</b>
---	------------	--------------------

<b>VI. Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>-3.287.929,10</b>
--	------------	----------------------

<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>-4.135.189,29</b>
--	------------	----------------------

**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

**Charisma Sicav - Multi Asset IP**

**Entwicklung des Teilfondsvermögens**

		2022	
<b>I. Wert des Teilfondsvermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>50.955.909,32</b>	
1. Mittelzufluss / -abfluss (netto)	EUR	-15.036.291,25	
a) Mittelzuflüsse aus Aktiengeschäften	EUR	139.985.050,00	
b) Mittelabflüsse aus Aktiengeschäften	EUR	-155.021.341,25	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR	-2.165.180,32	
3. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-4.135.189,29	
<b>II. Wert des Teilfondsvermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>29.619.248,46</b>	

**Vergleichende Übersicht seit Auflegung**

Geschäftsjahr		Umlaufende Aktien am Ende des Geschäftsjahres		Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Aktienwert am Ende des Geschäftsjahres
31.12.2020 *)	Stück	1.026.850,000	EUR	105.987.583,55	EUR	103,22
31.12.2021	Stück	492.150,000	EUR	50.955.909,32	EUR	103,54
31.12.2022	Stück	306.895,000	EUR	29.619.248,46	EUR	96,51

\*) Auflagendatum 08.05.2020



**Erläuterungen zum Jahresbericht (Anhang)**  
zum 31. Dezember 2022

**Erläuterung 1 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze**

a) Darstellung der Finanzberichte

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

b) Bewertung des Wertpapierbestandes und der Geldmarktinstrumente

Wertpapiere, die an einer Wertpapierbörse notiert sind, werden zum letzten verfügbaren Kurs bewertet. Soweit Wertpapiere an mehreren Wertpapierbörsen notiert sind, ist der zuletzt verfügbare Kurs jener Börse maßgebend, die der Hauptmarkt für dieses Wertpapier ist.

Wertpapiere, die nicht an einer Wertpapierbörse notiert sind, die aber an einem geregelten Markt gehandelt werden, werden 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 Investmentgesellschaft 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 Investmentgesellschaft sieht vor, dass diese Festgelder zu jeder Zeit kündbar sind und dass im Falle einer Kündigung ihr Realisierungswert diesem Renditekurs entspricht.

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

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

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

c) Realisierter Nettogewinn/-verlust aus Wertpapierverkäufen

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

d) Transaktionskosten

Für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 belaufen sich diese Kosten auf:

Charisma Sicav - AHM DACH	EUR	12.525,01
Charisma Sicav - Multi Asset IP	EUR	22.461,67

## **Charisma Sicav Investmentgesellschaft (SICAV)**

Bei Transaktionen, welche nicht direkt mit der Verwahrstelle abgeschlossen werden, werden die Abwicklungskosten dem jeweiligen Teilfonds monatlich gebündelt belastet. Diese Kosten sind in dem Konto „Sonstige Aufwendungen“ enthalten.

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

### e) Umrechnung von Fremdwährungen

Alle nicht auf die jeweilige Teilfondswährung lautenden Vermögenswerte werden zum letzten Devisenmittelkurs in die entsprechende 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 Vermögensübersicht erfasst.

### k) Bewertung der Verbindlichkeiten

Die zum Berichtsstichtag bestehenden Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

### l) Verkauf von herausgegebenen Optionen

Beim Verkauf einer herausgegebenen Option wird die erhaltene Prämie als Verbindlichkeit verbucht und anschließend zum Marktkurs bewertet.

### m) 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 Aktienpreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nicht realisierten Gewinne einfließt, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nicht realisierten Verluste einfließt und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

n) Gründungskosten

Die Gründungskosten der Investmentgesellschaft können innerhalb der ersten fünf Jahre ab Gründung vollständig abgeschrieben werden. Werden nach Gründung der Investmentgesellschaft zusätzliche Teilfonds eröffnet, können entstandene Gründungskosten, die noch nicht vollständig abgeschrieben sind, diesen anteilig in Rechnung gestellt werden.

o) Zusätzliche Informationen zum Bericht

Dieser Bericht wurde auf Basis des Nettoinventarwertes zum 30. Dezember 2022 mit den letzten verfügbaren Kursen zum 30. Dezember 2022 und unter Berücksichtigung aller Ereignisse, die sich auf die Rechnungslegung zum Berichtsstichtag am 31. Dezember 2022 beziehen, erstellt.

### **Erläuterung 2 – Gebühren und Aufwendungen**

Angaben zu Gebühren und Aufwendungen können dem aktuellen Verkaufsprospekt sowie den wesentlichen Anlegerinformationen („Key Investor Information Document“) entnommen werden.

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“)**

Die Sicav unterliegt gemäß den Luxemburger Gesetzen einer jährlichen Kapitalsteuer von 0,05% p.a. des Nettovermögens der Sicav, welche vierteljährlich zu zahlen ist und auf der Grundlage des Nettovermögens jedes Teilfonds am letzten Tag des jeweiligen Quartals berechnet wird. Sofern ein Teilfonds oder eine Aktienklasse für die Zeichnung durch institutionelle Anleger beschränkt ist, wird das Nettovermögen dieses Teilfonds bzw. dieser Aktienklasse mit einer reduzierten „taxe d'abonnement“ von 0,01% besteuert.

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

### **Erläuterung 4 – Ertragsverwendung**

Die vereinnahmten Dividenden- und Zinserträge sowie sonstige ordentliche Erträge werden für den Teilfonds Charisma Sicav – AHM DACH grundsätzlich ausgeschüttet und für den Teilfonds Charisma Sicav – Multi Asset IP thesauriert.

Zur Ausschüttung können neben den ordentlichen Nettoerträgen die realisierten Kapitalgewinne, die Erlöse aus dem Verkauf von Bezugsrechten und/oder die sonstigen Erträge nicht wiederkehrender Art sowie sonstige Aktiva gelangen, sofern das Netto-Fondsvermögen aufgrund der Ausschüttung nicht unter die Mindestgrenze nach Artikel 11 der Satzung sinkt.

Sofern im jeweiligen 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, sofern das Netto-Fondsvermögen aufgrund der Ausschüttung nicht unter die Mindestgrenze nach Artikel 11 der Satzung fällt.

Sofern im jeweiligen Anhang zum Verkaufsprospekt eines Teilfonds eine Ausschüttung der Erträge vorgesehen ist, kann abweichend hiervon auf gesonderten Beschluss der Verwaltungsgesellschaft auch eine Thesaurierung der Erträge vorgenommen 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 die einzelnen Teilfonds in Anteile eines anderen Investmentfonds (Zielfonds) investieren, können für die erworbenen Zielfondsanteile zusätzliche Verwaltungsgebühren anfallen. Im Fall des Teilfonds Charisma Sicav – AHM DACH betragen diese Verwaltungsgebühren maximal 3,00%.

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

#### **Erläuterung 7 – Wertpapierbestandsveränderungen**

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

#### **Erläuterung 8 – Risikomanagement (ungeprüft)**

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

#### **Erläuterung 9 – 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.

**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 (Zeitraum vom 1. Januar 2021 bis zum 31. Dezember 2021) der Axxion S.A. gezahlten Mitarbeitervergütung:

davon feste Vergütung:	TEUR	3.796
davon variable Vergütung:	TEUR	450
Gesamtsumme:	TEUR	4.246

Durchschnittliche Zahl der Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft: 50 (inkl. Vorstände)

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 (Zeitraum vom 1. Januar 2021 bis zum 31. Dezember 2021) der Axxion S.A. gezahlten Vergütungen an Risk Taker:

Vergütung:	TEUR	2.073
davon Führungskräfte:	TEUR	2.073

Die Vergütungsrichtlinie der Gesellschaft wurde im Jahr 2021 aktualisiert, weitere Einzelheiten der aktuellen Vergütungsrichtlinie können kostenlos auf der Internetseite der Kapitalverwaltungsgesellschaft [www.axxion.lu](http://www.axxion.lu) unter der Rubrik Anlegerinformationen abgerufen werden.

Die Axxion S.A. hat das Portfoliomanagement des Fonds an die FAM Frankfurt Asset Management AG, die Rothschild & Co Vermögensverwaltung GmbH sowie an die Zantke & Cie. Asset Management GmbH ausgelagert.

*Angaben zur Vergütung des delegierten Portfoliomanagers*

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

Gesamtbetrag der Vergütung:	TEUR	13.261
Gesamtbetrag der fixen Vergütung:	TEUR	10.748
Gesamtbetrag der variablen Vergütung:	TEUR	2.513
Anzahl der Mitarbeiter, die eine variable Vergütung erhalten haben:		64

*Quellen zu den Angaben zur Vergütung des delegierten Portfoliomanagers*

Zantke & Cie. Asset Management GmbH: gemäß Auskunft der Zantke & Cie. Asset Management GmbH für das Geschäftsjahr 2021; Rothschild & Co Vermögensverwaltung GmbH: gemäß Vergütungsbericht der Rothschild & Co Vermögensverwaltung GmbH für das Geschäftsjahr 2021; FAM Frankfurt Asset Management AG: gemäß Auskunft der FAM Frankfurt Asset Management GmbH für das Geschäftsjahr 2022.

**Erläuterung 10 – Angaben zu den Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 (ungeprüft)**

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

**Erläuterung 11 – 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 12 – Zusätzliche Informationen zum Wertpapierbestand**

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

Zum 31. Dezember 2022 war der Teilfonds Charisma Sicav – AHM DACH mit 0,67% seines Vermögens in das Zertifikat investiert.

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

*Guardian Segur S.A. Zertifikate 30.12.33 (XS0980340136)*

Zum 31. Dezember 2022 war der Teilfonds Charisma Sicav – AHM DACH mit 2,34% seines Vermögens in das Zertifikat investiert.

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. 2014/2029 DL 1000 (LU1072258111)*

Zum 31. Dezember 2022 war der Teilfonds Charisma Sicav – AHM DACH mit 3,29% seines Vermögens in das Zertifikat investiert.

Bei diesem Genussschein handelt es sich um ein Zertifikat auf den Fonds „Swiss ALP CCY Diversified MAC-1“. Der Fonds investiert in eine weite Spannbreite von Factoring-Geschäften, die primär in den USA lokalisiert sind.

Auf Basis der vorliegenden Informationen sowie der durchgeführten Analysen und Validierungshandlungen kommt der Verwaltungsrat zu der Erkenntnis, dass die COVID-19-Pandemie keinen signifikanten Einfluss auf die Performance der Zertifikate zum Geschäftsjahresende hatte.

Der Verwaltungsrat geht davon aus, dass die zum Jahresultimo 2021 ausgewiesenen Bewertungskurse nach Treu und Glauben dem wahrscheinlichsten Veräußerungskurs entspricht. Unbeschadet dessen können die tatsächlichen Veräußerungspreise der Wertpapiere von diesen Preisen abweichen.

### **Erläuterung 13 – Weitere Informationen**

#### *Mögliche Auswirkungen der COVID-19-Pandemie*

Angesichts der jüngsten Entwicklungen in Bezug auf COVID-19 sind die Mitglieder des Verwaltungsrates der SICAV davon überzeugt, dass die Pläne zur Aufrechterhaltung des Geschäftsbetriebs die laufenden operationellen Risiken berücksichtigen.

Der Verwaltungsrat der SICAV hat dafür gesorgt, dass alle erforderlichen Maßnahmen getroffen werden, um sicherzustellen, dass die Aktivitäten der Gesellschaft nicht gestört werden. Auf Basis der aktuellen Entwicklungen in Bezug auf COVID-19 geht der Verwaltungsrat der SICAV davon aus, dass die Unternehmensfortführung sowohl finanziell als auch personell sichergestellt ist. Eine fortlaufende Überwachung der Wertentwicklung, sowie der Risiken – insbesondere in Bezug auf die Markt- sowie Liquiditätsrisiken – erfolgt durch das Risikomanagement der Verwaltungsgesellschaft.

Die aktuellen Entwicklungen und damit einhergehenden volatilen Märkte können sich entsprechend der Investitionen auf die Charisma Sicav auswirken. Nach aktuellen Informationen hat der Verwaltungsrat der SICAV keine Kenntnis von wesentlichen negativen Auswirkungen der COVID-19-Pandemie auf den Fonds zum Geschäftsjahresende.

Auf Basis der aktuellen Entwicklungen in Bezug auf COVID-19 geht der Verwaltungsrat der SICAV davon aus, dass die Unternehmensfortführung der Charisma Sicav und ihrer Teilfonds sichergestellt ist.

#### *Mögliche Auswirkungen des Ukraine-Konfliktes*

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

#### *Änderung in den Gesellschaftsgremien der Verwaltungsgesellschaft Axxion S.A.*

Mit Wirkung zum 1. Januar 2022 ist der bisherige Vorstandsvorsitzende Herr Thomas Amend aus dem Vorstand der Verwaltungsgesellschaft Axxion S.A. ausgeschieden und in den Aufsichtsrat der Axxion S.A. gewechselt. Der Vorstand der Axxion S.A. setzt sich seither zusammen aus Herrn Stefan Schneider (Vorsitzender des Vorstands), Herrn Pierre Girardet und Herrn Armin Clemens, der zum 1. Januar 2022 in den Vorstand aufgerückt ist. Dem Aufsichtsrat der Gesellschaft gehören neben Herrn Thomas Amend auch weiterhin die bisherigen Aufsichtsratsmitglieder Herr Dr. Burkhard Wittek, Herr Martin Stürner und Frau Constanze Hintze an.

### **Erläuterung 14 – Ereignisse nach dem Stichtag**

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat gemäß Artikel 9 der Satzung beschlossen, den Teilfonds „Charisma Sicav – Multi Asset IP unter Wahrung der Interessen der Aktionäre mit Wirkung zum 9. März 2023 in Liquidation zu setzen. Der Abschluss der Liquidation erfolgte mit Wirkung zum 17. März 2023

Gemäß Artikel 9 der Satzung wurden Ausgaben und Rücknahmen von Aktien ebenfalls zu diesem Datum eingestellt.



**Charisma Sicav  
Investmentgesellschaft (SICAV)**

Die Liquidation erfolgte, indem die dem Teilfonds zuzuordnenden Vermögenswerte veräußert sowie die dem Teilfonds zuzuordnenden Verbindlichkeiten getilgt wurden. Die Liquidationskosten wurden dem Nettoteilfondsvermögen vollständig belastet.

Nach Abschluss des Liquidationsverfahrens wurde der Liquidationserlös an die Aktionäre ausgekehrt.

Nicht abgeforderte Liquidationserlöse wurden bei der „Caisse de Consignation“ in Luxemburg hinterlegt, wo dieser Betrag verfällt, soweit er nicht innerhalb der gesetzlichen Frist von dreißig Jahren dort angefordert wird.