

**Geprüfter Jahresbericht
zum 31. Dezember 2022**

Daidalos

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

R.C.S. Luxembourg K256

Verwaltungsgesellschaft



R.C.S. Luxembourg B 82 112

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

Inhaltsverzeichnis

Management und Verwaltung	1
Allgemeine Informationen	4
Geschäftsbericht	6
Bericht des Réviseur d'entreprises agréé	9
Daidalos	12
<i>Konsolidierte Vermögensübersicht</i>	12
<i>Konsolidierte Ertrags- und Aufwandsrechnung</i>	13
<i>Konsolidierte Entwicklung des Fondsvermögens</i>	14
Daidalos - Multi Asset VI	15
<i>Vermögensübersicht</i>	15
<i>Vermögensaufstellung</i>	16
<i>Wertpapierkurse bzw. Marktsätze</i>	20
<i>Ertrags- und Aufwandsrechnung</i>	21
<i>Entwicklung des Teilfondsvermögens</i>	22
<i>Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre</i>	22
Daidalos - Multi Asset BP	23
<i>Vermögensübersicht</i>	23
<i>Vermögensaufstellung</i>	24
<i>Wertpapierkurse bzw. Marktsätze</i>	32
<i>Ertrags- und Aufwandsrechnung</i>	33
<i>Entwicklung des Teilfondsvermögens</i>	34
<i>Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre</i>	34
Erläuterungen zum Jahresbericht	35

Management und Verwaltung

Verwaltungsgesellschaft

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

Eigenkapital per 31. Dezember 2021
EUR 3.357.034

Aufsichtsrat der Verwaltungsgesellschaft¹

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 Verwaltungsgesellschaft¹

Vorsitzender

Stefan SCHNEIDER

Mitglieder

Pierre GIRARDET
Armin CLEMENS

Abschlussprüfer

KPMG Audit S.à r.l.
39, Avenue John F. Kennedy
L-1855 LUXEMBURG

Verwahrstelle

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

¹ Siehe Erläuterung 8

**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. Das erste verlängerte Geschäftsjahr endete am 31. Dezember 2014 und umfasste den Zeitraum vom 4. November 2013 (Datum der Fondsgründung) bis zum 31. Dezember 2014. Der erste geprüfte Jahresbericht wurde zum 31. Dezember 2014 und der erste ungeprüfte Halbjahresbericht wurde zum 30. Juni 2014 erstellt.

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

Dort sind auch der Verkaufsprospekt mit Verwaltungsreglement und Anhängen in der jeweils aktuellen Fassung sowie die Jahres- und Halbjahresberichte kostenlos erhältlich; die Satzung der Verwaltungsgesellschaft kann an deren Sitz eingesehen werden.

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

Die wesentlichen Anlegerinformationen („Key Investor Information Document“) können auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft (www.axxion.lu) heruntergeladen werden. Ferner wird auf Anfrage eine Papierversion seitens der Verwaltungsgesellschaft, der Vertriebsstellen oder der Informationsstellen zur Verfügung gestellt.

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

Aktuell werden Ausgabe- und Rücknahmepreise auf der Internetseite www.axxion.lu veröffentlicht. Hier können auch der aktuelle Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen („Key Investor Information Document“) sowie die Jahresberichte und Halbjahresberichte des Fonds zur Verfügung gestellt werden.

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

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

Geschäftsbericht

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

das Berichtsjahr vom 1. Januar 2022 bis zum 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 Großbritannien 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.

Daidalos Investmentfonds (F.C.P.)

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 einen 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 Anleihen-Seite 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 Einkaufsmanagerindex 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.

Daidalos - Multi Asset VI

Der Schwerpunkt des Teilfonds lag auch in dieser Berichtsperiode auf der Rentenseite und im Euro-Raum; daneben wurde in alternative Anlagen und Aktien investiert. Im vierten Quartal 2022 wurde die Beimischung von Optionen auf der Aktienseite jedoch aufgelöst. Der Abwärtstrend in der ersten Jahreshälfte konnte nur in Teilen wieder aufgeholt werden, so dass nach einer vornehmlichen Seitwärtsbewegung Ende der Berichtsperiode eine Performance von -8,69% zu verzeichnen war.

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

Daidalos - Multi Asset BP

Diese Berichtsperiode brachte dem Teilfonds ein Ergebnis von -9,57%. Die Reaktionen am Kapitalmarkt auf Ereignisse wie den Ukraine-Krieg, der Anstieg der Inflation und eine drohende Rezession zeichneten sich auch in der Performanceentwicklung des Portfolios deutlich ab. Im letzten Quartal konnte erfreulicherweise eine Erholung verzeichnet werden. Der Teilfonds war dabei vornehmlich in Aktien- und Rententitel allokiert. Hybride und alternative Investments stellten nur einen kleinen Anteil am Portfolio.

Grevenmacher, im Januar 2023

Der Vorstand der Axxion S.A.



KPMG Audit S.à r.l.
39, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

Tel.: +352 22 51 51 1
Fax: +352 22 51 71
E-mail: info@kpmg.lu
Internet: www.kpmg.lu

An die Anteilhaber des
Daidalos
15, rue de Flaxweiler
L-6776 Grevenmacher

BERICHT DES „REVISEUR D'ENTREPRISES AGREÉ“

Bericht über die Jahresabschlussprüfung

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresabschluss des Daidalos und seiner jeweiligen Teilfonds („der Fonds“), bestehend aus der Vermögensaufstellung, dem Wertpapierbestand und den sonstigen Nettovermögenswerten zum 31. Dezember 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr sowie den Erläuterungen mit einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden, geprüft.

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des Daidalos und seiner jeweiligen Teilfonds zum 31. Dezember 2022 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz 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 („ISA“) durch. Unsere Verantwortung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den ISA-Standards, wie sie in Luxemburg von der CSSF angenommen wurden, wird im Abschnitt „Verantwortung des „réviseur d'entreprises agréé“ für die Jahresabschlussprüfung“ weitergehend beschrieben. Wir sind auch unabhängig von dem Fonds in Übereinstimmung mit dem für Luxemburg von der CSSF angenommenen „International Code of Ethics for Professional Accountants, including International Independence Standards“, herausgegeben vom „International Ethics Standards Board for Accountants“ („IESBA Code“), zusammen mit den beruflichen Verhaltensanforderungen, welche wir im Rahmen der Jahresabschlussprüfung einzuhalten haben, und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

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 Jahresabschluss oder unseren Bericht des „réviseur d'entreprises agréé“ zu diesem Jahresabschluss.

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



Im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Jahresabschluss 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 Vorstands der Verwaltungsgesellschaft und der für die Überwachung Verantwortlichen für den Jahresabschluss

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

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

Die für die Überwachung Verantwortlichen sind verantwortlich für die Überwachung des Jahresabschlusserrstellungsprozesses.

Verantwortung des „réviseur d'entreprises agréé“ für die Jahresabschlussprüfung

Die Zielsetzung unserer Prüfung ist es, eine hinreichende Sicherheit zu erlangen, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen, beabsichtigten oder unbeabsichtigten, falschen Darstellungen ist und darüber einen Bericht des „réviseur d'entreprises agréé“, welcher 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. Falsche Darstellungen 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 Jahresabschlusses 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 Jahresabschluss 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 das 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 vom Vorstand der Verwaltungsgesellschaft angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und der entsprechenden Erläuterungen.
- Schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Unternehmenstätigkeit 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 und seiner jeweiligen Teilfonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Bericht des „réviseur d’entreprises agréé“ auf die dazugehörigen Erläuterungen zum Jahresabschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Berichts des „réviseur d’entreprises agréé“ erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einzelne seiner Teilfonds die Unternehmenstätigkeit nicht mehr fortführen können.
- Beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresabschlusses einschließlich den Erläuterungen 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, welche wir im Rahmen der Prüfung identifizieren.

Luxemburg, 2. Mai 2023

KPMG Audit S.à r.l.
Cabinet de révision agréé

Jan Jansen

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

Daidalos

Konsolidierte Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022

	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	80.517.912,67	100,10
1. Aktien	33.088.599,19	41,14
Australien	41.264,97	0,05
Belgien	337.620,00	0,42
Bermuda	87.105,61	0,11
Bundesrep. Deutschland	4.387.101,76	5,45
Finnland	44.934,40	0,06
Frankreich	3.475.369,75	4,32
Großbritannien	1.489.451,96	1,85
Irland	1.447.923,87	1,80
Japan	192.325,95	0,24
Kaimaninseln	82.585,67	0,10
Kanada	892.915,46	1,11
Niederlande	965.536,30	1,20
Schweiz	3.309.489,29	4,12
Spanien	754.406,00	0,94
USA	15.580.568,20	19,37
2. Anleihen	30.535.621,29	37,96
< 1 Jahr	1.121.679,80	1,40
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	6.476.740,81	8,05
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	6.663.451,58	8,28
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	7.294.556,49	9,07
>= 10 Jahre	8.979.192,61	11,16
3. Zertifikate	1.128.614,55	1,40
Euro	1.128.614,55	1,40
4. Sonstige Beteiligungswertpapiere	751.899,04	0,94
Euro	30.559,00	0,04
Schweizer Franken	41.199,00	0,05
US-Dollar	680.141,04	0,85
5. Investmentanteile	11.287.616,07	14,03
Euro	9.515.177,28	11,83
US-Dollar	1.772.438,79	2,20
6. Derivate	152.861,37	0,19
7. Bankguthaben	3.215.304,61	4,00
8. Sonstige Vermögensgegenstände	357.396,55	0,44
II. Verbindlichkeiten	-78.775,53	-0,10
III. Fondsvermögen	80.439.137,14	100,00

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

Daidalos

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

I. Erträge

1. Dividenden	EUR	704.105,17
2. Zinsen aus Wertpapieren	EUR	903.715,79
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen	EUR	27.305,97
4. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	64.041,90
5. Abzug Quellensteuer	EUR	-155.476,10
6. Bestandsprovisionen	EUR	10.896,13

Summe der Erträge **EUR 1.554.588,86**

II. Aufwendungen

1. Verwaltungsvergütung	EUR	-420.310,94
2. Verwahrstellenvergütung	EUR	-25.919,20
3. Register- und Transferstellenvergütung	EUR	-2.918,32
4. Betreuungsgebühr	EUR	-64.405,09
5. Zentralverwaltungsgebühr	EUR	-89.719,64
6. Vertriebs-, Informations- und Zahlstellengebühr	EUR	-3.320,70
7. Prüfungskosten	EUR	-19.014,49
8. Taxe d'Abonnement	EUR	-37.348,91
9. Zinsaufwand aus Geldanlagen	EUR	-17.311,71
10. Sonstige Aufwendungen (siehe Erläuterung 2)	EUR	-53.972,20

Summe der Aufwendungen **EUR -734.241,20**

III. Ordentlicher Nettoertrag **EUR 820.347,66**

IV. Veräußerungsgeschäfte

1. Realisierte Gewinne	EUR	5.170.227,35
2. Realisierte Verluste	EUR	-4.046.281,69

Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften **EUR 1.123.945,66**

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres **EUR 1.944.293,32**

VI. Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres **EUR -10.597.944,02**

VII. Ergebnis des Geschäftsjahres **EUR -8.653.650,70**

Daidalos Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos

Konsolidierte Entwicklung des Fondsvermögens

		2022
I. Wert des Fondsvermögens am Beginn des Geschäftsjahres		EUR 91.275.134,51
1. Mittelzufluss / -abfluss (netto)		EUR -2.219.860,15
a) Mittelzuflüsse aus Anteilscheingeschäften	EUR 3.580.128,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilscheingeschäften	EUR -5.799.988,15	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		EUR 37.513,48
3. Ergebnis des Geschäftsjahres		EUR -8.653.650,70
II. Wert des Fondsvermögens am Ende des Geschäftsjahres		EUR 80.439.137,14

Daidalos - Multi Asset VI

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022

	Tageswert in EUR	% Anteil am Teilfondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	14.281.609,55	100,15
1. Aktien	176.810,58	1,24
Niederlande	176.810,58	1,24
2. Anleihen	10.090.182,30	70,76
< 1 Jahr	393.584,14	2,76
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	2.362.041,58	16,56
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	2.938.826,70	20,61
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	2.564.064,95	17,98
>= 10 Jahre	1.831.664,93	12,85
3. Zertifikate	745.049,55	5,22
Euro	745.049,55	5,22
4. Sonstige Beteiligungswertpapiere	710.700,04	4,98
Euro	30.559,00	0,21
US-Dollar	680.141,04	4,77
5. Investmentanteile	2.110.248,53	14,80
Euro	2.016.920,07	14,15
US-Dollar	93.328,46	0,65
6. Bankguthaben	329.181,28	2,31
7. Sonstige Vermögensgegenstände	119.437,27	0,84
II. Verbindlichkeiten	-21.738,02	-0,15
III. Teilfondsvermögen	14.259.871,53	100,00

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

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
Bestandspositionen							EUR	13.832.991,00	97,00
Amtlich gehandelte Wertpapiere							EUR	5.627.117,29	39,46
Aktien									
trivago N.V. Aand.op n.A (Sp.ADS)/1 EO-.06	US89686D1054		STK	139.700			USD 1,3500	176.810,58	1,24
Verzinsliche Wertpapiere									
0,7750 % Cellnex Telecom S.A. SF-Med.-Term Notes 2020(27)	CH0506071148		CHF	50			% 91,4080	46.298,47	0,32
0,2000 % Digital Intrepid Holding B.V. SF-Notes 2021(26/26)	CH1121837236		CHF	50			% 88,6640	44.908,63	0,31
2,5000 % HOCHDORF Holding AG SF-FLR Anl. 2017(23/Und.)	CH0391647986		CHF	235			% 30,0000	71.416,99	0,50
1,0000 % Teva Pharmac.Fin.NL IV B.V. SF-Schuldversch. 2016(25)	CH0333827506		CHF	50	50		% 89,5110	45.337,64	0,32
0,1250 % Bayerische Landesbank Med.Term.Inh.-Schv.21(28)	DE000BLB6JJO		EUR	200			% 82,3800	164.760,00	1,16
2,7500 % Bque ouest-afr.developmt -BOAD EO-Bonds 2021(32/33) Reg.S	XS2288824969		EUR	100			% 74,9810	74.981,00	0,53
1,2500 % Cellnex Finance Company S.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	XS2300292963		EUR	100			% 80,2210	80.221,00	0,56
1,5000 % Ceske Drahy AS EO-Notes 2019(19/26)	XS1991190361		EUR	100			% 88,5240	88.524,00	0,62
0,5000 % Colgate-Palmolive Co. EO-Bonds 2019(19/26)	XS1958646082		EUR	300			% 91,7270	275.181,00	1,93
0,4250 % Dongfeng Motor(HK)Intl Co.Ltd. EO-Bonds 2021(21/24)	XS2394012103		EUR	100			% 92,5150	92.515,00	0,65
0,3750 % Emirates Telecommunic. Grp Co. EO-Med.-T. Notes 2021(28/28)	XS2339427747		EUR	125			% 84,3390	105.423,75	0,74
1,8160 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2021(21/31)	XS2304675791		EUR	100	100		% 65,3040	65.304,00	0,46
5,0000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2022/2029)	XS2559501429		EUR	100	100		% 96,8930	96.893,00	0,68
6,7500 % Heimstaden AB EO-FLR Notes 21(21/Und.)	SE0016278352		EUR	100			% 45,6910	45.691,00	0,32
0,5000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-Medium-T. Notes 2021(21/30)	XS2384273715		EUR	100	100		% 75,2660	75.266,00	0,53
4,2500 % Huhtamäki Oyj EO-Notes 2022(22/27)	FI4000523550		EUR	100	100		% 97,9470	97.947,00	0,69
5,6250 % Iliad Holding S.A.S. EO-Notes 2021(21/28) Reg.S	XS2397781944		EUR	100	100		% 91,1500	91.150,00	0,64
3,6250 % Infineon Technologies AG Sub.-FLR-Nts.v.19(28/unb.)	XS2056730679		EUR	100			% 89,6550	89.655,00	0,63
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN.v.2019 (2024)	DE000A2LQSP7		EUR	200	200		% 96,5670	193.134,00	1,35
1,7500 % O2 Telefónica Dtd. Finanzier. Anleihe v.2018(2018/2025)	XS1851313863		EUR	200			% 94,8370	189.674,00	1,33
6,2500 % OMV AG EO-FLR Notes 2015(25/Und.)	XS1294343337		EUR	100			% 103,4360	103.436,00	0,72
6,0120 % Oriflame Investment Hold. PLC EO-FLR Notes 2021(26) Reg.S	XS2337349265		EUR	100	100		% 59,3890	59.389,00	0,42
5,2500 % Orsted A/S EO-FLR Notes 2022(22/3022)	XS2563353361		EUR	100	100		% 101,8570	101.857,00	0,71
2,2500 % Quadient S.A. EO-Obl. 2020(20/25)	FR0013478849		EUR	100			% 92,5680	92.568,00	0,65
5,6250 % SES S.A. EO-FLR Notes 2016(24/Und.)	XS1405765659		EUR	100			% 97,6900	97.690,00	0,68
5,7500 % Sigma Holdco B.V. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1813504666		EUR	150			% 72,3020	108.453,00	0,76
5,3020 % Südzucker Intl Finance B.V. EO-FLR Bonds 2005(15/Und.)	XS0222524372		EUR	100			% 81,4050	81.405,00	0,57
5,0560 % TDC Net A/S EO-Medium-Term Nts 2022(22/28)	XS2484502823		EUR	100	100		% 98,4850	98.485,00	0,69
1,0000 % Telefonaktiebolaget L.M.Erics. EO-Med.-Term Nts 2021(21/29)	XS2345996743		EUR	200			% 75,5160	151.032,00	1,06
0,1250 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2019(19/25)	XS2058556296		EUR	200	100	100	% 93,2500	186.500,00	1,31
1,6250 % Tikehau Capital S.C.A. EO-Obl. 2021(21/29)	FR0014002PC4		EUR	100			% 75,4660	75.466,00	0,53
2,0000 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 22(22/Und.)	XS2432130610		EUR	100	100		% 85,6550	85.655,00	0,60
4,6250 % Veolia Environnement S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/28)	FR001400DQ84		EUR	100	100		% 101,0550	101.055,00	0,71
4,3750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(30)	XS2554489513		EUR	100	100		% 97,0250	97.025,00	0,68
5,0000 % Vonovia SE Medium Term Notes v.22(22/30)	DE000A30VQB2		EUR	100	100		% 98,1050	98.105,00	0,69
3,0000 % ZF Finance GmbH MTN v.2020(2020/2025)	XS2231715322		EUR	100	100		% 92,3540	92.354,00	0,65
4,2500 % BP Capital Markets PLC LS-FLR Notes 2020(27/Und.)	XS2193663619		GBP	200			% 88,3520	199.226,56	1,40
1,5000 % Comcast Corp. LS-Notes 2020(20/29)	XS2114853299		GBP	100			% 82,3200	92.812,45	0,65
2,7480 % Ford Motor Credit Co. LLC LS-Medium Term Notes 2020(24)	XS2272365078		GBP	100	100		% 94,7260	106.799,71	0,75
0,7500 % Großbritannien LS-Treasury Stock 2017(23)	GB00BFOHZ991		GBP	50	50		% 98,6690	55.622,64	0,39
3,2500 % Pinewood FinCo PLC LS-Notes 2019(21/25) Reg.S	XS2052466815		GBP	100			% 92,3820	104.156,94	0,73
2,2500 % Prologis L.P. LS-Notes 2017(17/29)	XS1577961862		GBP	100			% 83,9380	94.636,68	0,66
5,8750 % Telecom Italia S.p.A. LS-Medium-Term Nts 2006(23)	XS0254907388		GBP	50	50		% 99,3640	56.014,43	0,39
0,7500 % Toyota Motor Credit Corp. LS-Med.-Term Nts 2020(26)	XS2260426288		GBP	100			% 85,7220	96.648,06	0,68
4,5000 % VMED O2 UK Financing I PLC LS-Notes 2021(21/31) Reg.S	XS2358483258		GBP	100			% 76,9690	86.779,41	0,61
1,5000 % Norwegen, Königreich NK-Anl. 2016(26)	NO0010757925		NOK	2.000			% 95,3270	181.293,80	1,27
5,6250 % Electricité de France (E.D.F.) DL-FLR Nts 2014(24/Und.) Reg.S	USF2893TAM83		USD	100			% 95,1920	89.243,89	0,63
4,7500 % Fresenius Med.C.US Fin.II Inc. DL-Notes 2014(14/24) Reg.S	USU31434AE08		USD	100			% 98,1470	92.014,25	0,64
5,6500 % Network i2i Ltd. DL-FLR Secs 2019(25/Und.)Reg.S	USV6703DAA29		USD	200			% 95,6170	179.284,68	1,26

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI

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
1,6250 % Saudi Arabian Oil Co. DL-Med.-T.Nts 2020(25/25)Reg.S	XS2262853000		USD	200		%	91,2620	171.118,92	1,20
6,2500 % Vodafone Group PLC DL-FLR Cap.Sec. 2018(24/78)	XS1888180640		USD	200		%	95,9440	179.897,81	1,26
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	5.856.320,11	41,07
Verzinsliche Wertpapiere									
4,1250 % Adler Pelzer Holding GmbH Notes v.17(20/24) Reg.S	XS1533914591		EUR	150	150	%	85,8720	128.808,00	0,90
0,8000 % AGCO International Holdings BV EO-Notes 2021(21/28)	XS2393323071		EUR	150		%	81,8960	122.844,00	0,86
2,8750 % AT & T Inc. EO-FLR Pref.Secs 2020(25/Und.)	XS2114413565		EUR	200		%	89,9760	179.952,00	1,26
3,8750 % Belden Inc. EO-Notes 2018(18/28) Reg.S	XS1789515134		EUR	100	100	%	91,6340	91.634,00	0,64
4,7500 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2022(22/34)	XS2555221246		EUR	100	100	%	101,4450	101.445,00	0,71
1,7500 % CECONOMY AG Anleihe v.2021(2021/2026)	XS2356316872		EUR	100	100	%	63,3420	63.342,00	0,44
4,7500 % Coty Inc. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1801788305		EUR	200	200	%	94,4740	188.948,00	1,32
6,0000 % Douglas GmbH IHS v.2021(2023/2026) REG S	XS2326497802		EUR	100		%	84,0400	84.040,00	0,59
2,7500 % Faurecia SE EO-Notes 2021(21/27)	XS2405483301		EUR	150	150	%	84,5540	126.831,00	0,89
2,2500 % Grifols S.A. EO-Notes 2019(19/27) Reg.S	XS2077646391		EUR	100		%	87,6120	87.612,00	0,61
3,5000 % Grupo Antolin Irausa S.A. EO-Notes 2021(21/28) Reg.S	XS2355632584		EUR	100	100	%	71,3720	71.372,00	0,50
4,2500 % Huntsman International LLC EO-Notes 2016(16/25)	XS1395182683		EUR	100		%	96,5370	96.537,00	0,68
3,0000 % Indra Sistemas S.A. EO-Bonds 2018(18/24)	XS1809245829		EUR	100		%	98,2670	98.267,00	0,69
5,7500 % Lenzing AG EO-FLR Notes 2020(20/Und.)	XS2250987356		EUR	100		%	84,2130	84.213,00	0,59
2,8750 % Loxam S.A.S. EO-Notes 2019(19/26) Reg.S	XS1975699569		EUR	100	100	%	89,3420	89.342,00	0,63
3,8750 % Netflix Inc. EO-Notes 2019(19/29) Reg.S	XS1989380172		EUR	100	100	%	93,5330	93.533,00	0,66
4,5000 % Norican A/S EO-Bonds 2017(17/23)	XS1577963058		EUR	200	100	%	94,8300	189.660,00	1,33
2,8750 % OI European Group B.V. EO-Notes 2019(19/25) Reg.S	XS2077666316		EUR	100		%	96,3720	96.372,00	0,68
0,8750 % P3 Group S.a.r.l. EO-Medium-Term Nts 2022(22/26)	XS2436807866		EUR	100	100	%	83,4380	83.438,00	0,59
3,1250 % PPF Telecom Group B.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/26)	XS1969645255		EUR	100		%	93,7930	93.793,00	0,66
3,2500 % PPF Telecom Group B.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/27)	XS2238777374		EUR	100		%	90,0000	90.000,00	0,63
2,0000 % SPCM S.A. EO-Notes 2020(20/26) Reg.S	XS2234515786		EUR	100		%	92,6410	92.641,00	0,65
3,8750 % Tele Columbus AG Notes v.2018(2021/2025) RegS	XS1814546013		EUR	100	100	%	75,9440	75.944,00	0,53
4,5000 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2018(18/25)	XS1813724603		EUR	150	150	%	96,1610	144.241,50	1,01
1,6250 % Thermo Fisher Scient.(Fin.I)BV EO-Notes 2021(21/41)	XS2366415201		EUR	100	100	%	66,6150	66.615,00	0,47
6,6250 % All.Univ.Holdco LLC/Fin.Corp. DL-Notes 2019(19/26) Reg.S	USU0201TAA89		USD	50	50	%	91,9430	43.098,95	0,30
6,3750 % Aramark Services Inc. DL-Notes 2020(20/25) Reg.S	USU0389LAF86		USD	50	50	%	99,1910	46.496,51	0,33
4,0000 % Ball Corp. DL-Notes 2013(13/23)	USO58498AS54		USD	100	100	%	98,4380	92.287,07	0,65
5,5000 % Bausch Health Companies Inc. DL-Notes 2017(17/25) Reg.S	USC94143AL56		USD	50	50	%	85,5470	40.100,78	0,28
1,4500 % Berkshire Hathaway Fin. Corp. DL-Notes 2020(20/30)	USO84664CW92		USD	100		%	79,8190	74.831,48	0,52
4,8750 % Berry Global Escrow Corp. DL-Notes 2019(19/26) Reg.S	USU0740VAA18		USD	100		%	96,6360	90.597,67	0,64
7,6250 % Carnival Corp. DL-Notes 2020(20/26) Reg.S	USP2121VAJ37		USD	50	50	%	80,0120	37.506,21	0,26
5,3750 % DCP Midstream Operating L.P. DL-Notes 2018(18/25)	US23311VAG23		USD	50	50	%	99,1210	46.463,69	0,33
2,7000 % eBay Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US278642AW32		USD	100		%	85,1390	79.819,06	0,56
3,5500 % Hasbro Inc. DL-Notes 2019(19/26)	US418056AY31		USD	100		%	93,8880	88.021,38	0,62
3,6250 % MSCI Inc. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USU5521TAG77		USD	200		%	83,4570	156.484,32	1,10
4,2500 % Nestlé Holdings Inc. DL-Notes 2022(22/29) Reg.S	USU74078CT83		USD	150	150	%	97,8050	137.540,43	0,96
6,7500 % New Fortress Energy Inc. DL-Notes 2020(20/25) Reg.S	USU6422PAA67		USD	50	50	%	94,9270	44.497,73	0,31
2,7500 % PepsiCo Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US713448ES36		USD	50	50	%	88,5560	41.511,27	0,29
5,5000 % Seaspan Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	US81254JAK25		USD	100		%	75,8180	71.080,49	0,50
5,7500 % Stena International S.A.R.L. DL-Notes 2014(14/24) Reg.S	USL62788AA99		USD	200	200	%	95,0070	178.140,91	1,25
2,6250 % United States of America DL-Notes 2022(27)	US91282CET45		USD	300	300	%	94,2813	265.170,16	1,86
3,1250 % United States of America DL-Notes 2022(27) S.AC-2027	US91282CFH97		USD	250	250	%	96,2109	225.497,91	1,58
Zertifikate									
Ardilla Segur S.A. NTS 28.12.40 Fund	XS0599782686		STK	5		EUR	54.330,3600	271.651,80	1,91
Guardian Segur S.A. Zertifikate 30.12.33	XS0980340136		STK	315		EUR	1.502,8500	473.397,75	3,32

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

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

Daidalos - Multi Asset VI

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	
Sonstige Beteiligungswertpapiere										
Ardilla Segur S.A. Inh.Gen. 2014/2024 EO 1000	LU1114452144		STK	100			EUR	305,5900	30.559,00	0,21
Ardilla Segur S.A. Inh.Gen. 2014/2029 DL 1000	LU1072258111		STK	532		165	USD	1.363,6700	680.141,04	4,77
							EUR	239.305,07	1,67	
Nichtnotierte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
12,0000 % Allg.Ges.f.Verbrief.SA Comp.11 EO-FLR Nts12(25)LUPUS CLO	XS0828893700		STK	100			EUR	1.507,2400	150.724,00	1,05
5,2500 % DISH DBS Corp. DL-Notes 2021(21/26) Reg.S	USU25486AQ11		USD	50	50		%	84,4370	39.580,46	0,28
7,3780 % Yara International ASA DL-Notes 2022(22/32) Reg.S	USR9900CAT38		USD	50	50		%	104,5330	49.000,61	0,34
							EUR	2.110.248,53	14,80	
Investmentanteile										
Gruppeneigene Investmentanteile										
Rothschild & Co WM - Aktien Actions au Porteur I o.N.	LU1272153831		ANT	7.394	1.144		EUR	175,0100	1.293.995,41	9,08
Gruppenfremde Investmentanteile										
Alegria High Grade ABS Portfol. Inhaber-Anteile o.N.	LI0027320568		ANT	306			EUR	1.485,8500	454.670,10	3,19
iShare.Nikkei 225 UCITS ETF DE Inhaber-Anteile	DE000A0H08D2		ANT	6.420			EUR	18,4680	118.564,56	0,83
iShsV-Gold Producers.UCITS ETF Registered Shares USD (Acc) oN	IE00B6R52036		ANT	4.700			EUR	11,8360	55.629,20	0,39
PAYDEN GBL-Pay.Gbl Em.Mkts Bd Registered Shs. Class EUR o.N.	IE00B04NLM33		ANT	5.436			EUR	17,3046	94.060,80	0,66
FISCH-Bd EM Corporates Dyn. Act.Nom. LD USD Acc. oN	LU2466185779		ANT	1.040	1.040		USD	95,7200	93.328,46	0,65
							EUR	13.832.991,00	97,00	
Summe Wertpapiervermögen										
							EUR	329.181,28	2,31	
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten										
							EUR	329.181,28	2,31	
Kassenbestände										
Verwahrstelle										
			CAD	9,19				6,36	0,00	
			CHF	63.508,56				64.334,62	0,45	
			EUR	214.994,60				214.994,60	1,51	
			GBP	754,52				850,69	0,00	
			JPY	529.325,00				3.758,08	0,03	
			NOK	90.880,44				8.641,87	0,06	
			NZD	1,28				0,76	0,00	
			SEK	0,21				0,02	0,00	
			USD	39.033,29				36.594,28	0,26	
							EUR	119.437,27	0,84	
Sonstige Vermögensgegenstände										
Zinsansprüche			EUR	119.437,27				119.437,27	0,84	

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

Daidalos - Multi Asset VI

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
							EUR	-21.738,02	-0,15
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verwaltungsvergütung			EUR	-7.182,00				-7.182,00	-0,05
Betreuungsgebühr			EUR	-975,12				-975,12	-0,01
Zentralverwaltungsvergütung			EUR	-987,56				-987,56	-0,01
Verwahrstellenvergütung			EUR	-584,63				-584,63	0,00
Register- und Transferstellenvergütung			EUR	-125,00				-125,00	0,00
Taxe d'Abonnement			EUR	-1.613,90				-1.613,90	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-10.014,81				-10.014,81	-0,07
Sonstige Kosten			EUR	-255,00				-255,00	0,00
Teilfondsvermögen							EUR	14.259.871,53	100,00¹⁾
Daidalos - Multi Asset VI P									
Anzahl Anteile							STK	123.745,000	
Anteilwert							EUR	115,24	

Fußnoten:

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

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

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

Daidalos Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset VI Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennoteiz)		per 30.12.2022	
Kanadische Dollar	(CAD)	1,4459000	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,9871600	= 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)
Neuseeland-Dollar	(NZD)	1,6872000	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	11,1206000	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,0666500	= 1 Euro (EUR)

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

Daidalos - Multi Asset VI

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

I. Erträge

1. Zinsen aus Wertpapieren	EUR	341.851,64
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen	EUR	2.341,58
3. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	1.435,83
4. Abzug Quellensteuer	EUR	-3.686,94
5. Bestandsprovisionen	EUR	6.060,85

Summe der Erträge	EUR	348.002,96
--------------------------	------------	-------------------

II. Aufwendungen

1. Verwaltungsvergütung	EUR	-84.688,93
2. Verwahrstellenvergütung	EUR	-4.631,55
3. Register- und Transferstellenvergütung	EUR	-1.451,15
4. Betreuungsgebühr	EUR	-13.993,79
5. Zentralverwaltungsgebühr	EUR	-21.716,61
6. Vertriebs-, Informations- und Zahlstellengebühr	EUR	-1.671,99
7. Prüfungskosten	EUR	-9.451,77
8. Taxe d'Abonnement	EUR	-6.472,01
9. Zinsaufwand aus Geldanlagen	EUR	-3.054,00
10. Sonstige Aufwendungen (siehe Erläuterung 2)	EUR	-17.913,15

Summe der Aufwendungen	EUR	-165.044,95
-------------------------------	------------	--------------------

III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR	182.958,01
--------------------------------------	------------	-------------------

IV. Veräußerungsgeschäfte

1. Realisierte Gewinne	EUR	776.074,77
2. Realisierte Verluste	EUR	-753.325,23

Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	22.749,54
--	------------	------------------

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	205.707,55
---	------------	-------------------

VI. Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres	EUR	-1.679.185,55
--	------------	----------------------

VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-1.473.478,00
--	------------	----------------------

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

Daidalos - Multi Asset VI

Entwicklung des Teilfondsvermögens

		2022
I. Wert des Teilfondsvermögens am Beginn des Geschäftsjahres		EUR 17.247.446,90
1. Mittelzufluss / -abfluss (netto)		EUR -1.511.889,30
a) Mittelzuflüsse aus Anteilscheingeschäften	EUR 0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilscheingeschäften	EUR -1.511.889,30	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		EUR -2.208,07
3. Ergebnis des Geschäftsjahres		EUR -1.473.478,00
II. Wert des Teilfondsvermögens am Ende des Geschäftsjahres		EUR 14.259.871,53

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres	Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
31.12.2020	Stück 146.160,000	EUR 17.326.951,88	EUR 118,55
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

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

Daidalos - Multi Asset BP

Vermögensübersicht zum 31. Dezember 2022

	Tageswert in EUR	% Anteil am Teilfondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	66.236.303,12	100,09
1. Aktien	32.911.788,61	49,73
Australien	41.264,97	0,06
Belgien	337.620,00	0,51
Bermuda	87.105,61	0,13
Bundesrep. Deutschland	4.387.101,76	6,63
Finnland	44.934,40	0,07
Frankreich	3.475.369,75	5,25
Großbritannien	1.489.451,96	2,25
Irland	1.447.923,87	2,19
Japan	192.325,95	0,29
Kaimaninseln	82.585,67	0,13
Kanada	892.915,46	1,35
Niederlande	788.725,72	1,19
Schweiz	3.309.489,29	5,00
Spanien	754.406,00	1,14
USA	15.580.568,20	23,54
2. Anleihen	20.445.438,99	30,90
< 1 Jahr	728.095,66	1,10
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	4.114.699,23	6,22
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	3.724.624,88	5,63
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	4.730.491,54	7,15
>= 10 Jahre	7.147.527,68	10,80
3. Zertifikate	383.565,00	0,58
Euro	383.565,00	0,58
4. Sonstige Beteiligungswertpapiere	41.199,00	0,06
Schweizer Franken	41.199,00	0,06
5. Investmentanteile	9.177.367,54	13,87
Euro	7.498.257,21	11,33
US-Dollar	1.679.110,33	2,54
6. Derivate	152.861,37	0,23
7. Bankguthaben	2.886.123,33	4,36
8. Sonstige Vermögensgegenstände	237.959,28	0,36
II. Verbindlichkeiten	-57.037,51	-0,09
III. Teilfondsvermögen	66.179.265,61	100,00

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

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	
Bestandspositionen							EUR	62.959.359,14	95,14	
Amtlich gehandelte Wertpapiere							EUR	45.976.546,55	69,48	
Aktien										
National Australia Bank Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000NAB4		STK	2.160	2.160		AUD	30,0600	41.264,97	0,06
Canadian Tire Corp. Ltd. Registered Shares Class A o.N.	CA1366812024		STK	330	330		CAD	141,5000	32.294,76	0,05
Manulife Financial Corp. Registered Shares o.N.	CA56501R1064		STK	4.780	4.780		CAD	24,1500	79.837,47	0,12
Royal Bank of Canada Registered Shares o.N.	CA7800871021		STK	640	640		CAD	127,3000	56.346,91	0,09
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350		STK	9.500	4.000		CHF	107,1400	1.031.068,92	1,56
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,50	CH0012005267		STK	11.500	7.500	2.700	CHF	83,5900	973.788,44	1,47
Roche Holding AG Inhaber-Aktien SF 1	CH0012032113		STK	2.750	2.750		CHF	358,4000	998.419,71	1,51
Swiss Re AG Namens-Aktien SF -,10	CH0126881561		STK	3.000	1.000	500	CHF	86,4800	262.814,54	0,40
UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10	CH0244767585		STK	2.490	2.490		CHF	17,2050	43.397,68	0,07
ABN AMRO Bank N.V. Aand.op naam Dep.Rec./EO 1	NL0011540547		STK	3.890	3.890		EUR	12,9250	50.278,25	0,08
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005		STK	5.150	1.250		EUR	200,9000	1.034.635,00	1,56
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251		STK	6.000		600	EUR	56,2700	337.620,00	0,51
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215		STK	1.250	400		EUR	503,8000	629.750,00	0,95
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628		STK	1.790	1.790		EUR	26,0550	46.638,45	0,07
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	DE0005190003		STK	510	510		EUR	83,3800	42.523,80	0,06
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	FR0000131104		STK	1.200	1.200		EUR	53,2500	63.900,00	0,10
Danone S.A. Actions Port. EO-,25	FR0000120644		STK	6.000		1.000	EUR	49,2300	295.380,00	0,45
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	DE0005810055		STK	4.750	2.000		EUR	161,4000	766.650,00	1,16
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	DE0005552004		STK	1.110		390	EUR	35,1800	39.049,80	0,06
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	DE0005557508		STK	3.320	3.320		EUR	18,6380	61.878,16	0,09
EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	FR0000121667		STK	3.250	600		EUR	169,2000	549.900,00	0,83
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14		STK	65.000	65.000		EUR	10,9300	710.450,00	1,07
Kerry Group PLC Registered Shares A EO -,125	IE0004906560		STK	5.500	5.500		EUR	84,2400	463.320,00	0,70
Linde PLC Registered Shares EO 0,001	IE00BZ12WP82		STK	2.150	700	350	EUR	305,4500	656.717,50	0,99
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	FR0000121014		STK	1.075	425	500	EUR	679,9000	730.892,50	1,10
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026		STK	2.250	650	400	EUR	304,0000	684.000,00	1,03
Nordea Bank Abp Registered Shares o.N.	FI4000297767		STK	4.480	4.480		EUR	10,0300	44.934,40	0,07
Repsol S.A. Acciones Port. EO 1	ES0173516115		STK	2.960	2.960		EUR	14,8500	43.956,00	0,07
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578		STK	10.920	3.420	1.000	EUR	89,8400	981.052,80	1,48
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600		STK	9.500	7.500	9.400	EUR	96,3900	915.705,00	1,38
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972		STK	5.550	1.550		EUR	130,7200	725.496,00	1,10
Shell PLC Reg. Shares Class EO -,07	GB00BP6MXD84		STK	10.000	16.000	6.000	EUR	26,4800	264.800,00	0,40
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101		STK	6.500	2.500	500	EUR	129,6400	842.660,00	1,27
Stellantis N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL00150001Q9		STK	3.500			EUR	13,2640	46.424,00	0,07
TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271		STK	1.400		5.000	EUR	58,6500	82.110,00	0,12
Unilever PLC Registered Shares LS -,031111	GB00B10RZP78		STK	7.470	1.470	1.000	EUR	46,8700	350.118,90	0,53
Anglo American PLC Registered Shares DL -,54945	GB00B1XZS820		STK	900	900		GBP	32,3650	32.841,20	0,05
AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25	GB0009895292		STK	350	350		GBP	112,1800	44.267,43	0,07
BP PLC Registered Shares DL -,25	GB0007980591		STK	9.070	9.070		GBP	4,7490	48.563,54	0,07
Diageo PLC Reg. Shares LS -,28935185	GB0002374006		STK	14.000	2.500		GBP	36,5000	576.131,69	0,87
InterContinental Hotels Group Reg.Shares LS -,208521303	GB00BHJYC057		STK	720	720		GBP	47,4400	38.510,40	0,06
NatWest Group PLC Registered Shares LS 1,0769	GB00BM8PJY71		STK	19.300	19.300		GBP	2,6520	57.707,42	0,09
Reckitt Benckiser Group Registered Shares LS -,10	GB00B24CGK77		STK	550	550		GBP	57,5400	35.680,70	0,05
Vodafone Group PLC Registered Shares DL 0,2095238	GB00BH4HKS39		STK	42.990	42.990		GBP	0,8424	40.830,68	0,06
Honda Motor Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3854600008		STK	1.770	1.770		JPY	3.032,0000	38.101,81	0,06
Isuzu Motors Ltd. Registered Shares o.N.	JP3137200006		STK	3.630	3.630		JPY	1.547,0000	39.869,44	0,06
Ono Pharmaceutical Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3197600004		STK	1.780	1.780		JPY	3.083,0000	38.961,59	0,06
Tokyo Electron Ltd. Registered Shares o.N.	JP3571400005		STK	150	150		JPY	38.880,0000	41.405,75	0,06
Toshiba Corp. Registered Shares o.N.	JP3592200004		STK	1.040	1.040		JPY	4.603,0000	33.987,36	0,05
3M Co. Registered Shares DL -,01	US88579Y1010		STK	1.800		200	USD	119,9200	202.368,16	0,31
Adobe Inc. Registered Shares o.N.	US00724F1012		STK	700			USD	336,5300	220.851,26	0,33
Alibaba Group Holding Ltd. Reg.Shs (sp.ADRs)/8 DL-,000025	US01609W1027		STK	1.000		270	USD	88,0900	82.585,67	0,12

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

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	
Alphabet Inc. Reg. Shs Cap.Stk Cl. C DL-,001	US02079K1079		STK	1.000	1.010	50	USD	88,7300	83.185,67	0,13
Alphabet Inc. Reg. Shs Cl. A DL-,001	US02079K3059		STK	6.750	6.820	270	USD	88,2300	558.339,19	0,84
Amazon.com Inc. Registered Shares DL -,01	US0231351067		STK	2.500	2.500	100	USD	84,0000	196.878,08	0,30
Apple Inc. Registered Shares o.N.	US0378331005		STK	5.330	750	1.920	USD	129,9300	649.254,11	0,98
Applied Materials Inc. Registered Shares o.N.	US0382221051		STK	390	390		USD	97,3800	35.605,12	0,05
Atmos Energy Corp. Registered Shares o.N.	US0495601058		STK	4.500	5.000	500	USD	112,0700	472.802,70	0,71
Berkshire Hathaway Inc. Reg.Shares B New DL -,00333	US0846707026		STK	220	80	860	USD	308,9000	63.711,62	0,10
Booking Holdings Inc. Registered Shares DL-,008	US09857L1089		STK	20	20		USD	2.015,2800	37.787,09	0,06
BorgWarner Inc. Registered Shares DL -,01	US0997241064		STK	1.690	1.690		USD	40,2500	63.772,09	0,10
Bristol-Myers Squibb Co. Registered Shares DL -,10	US1101221083		STK	1.170	1.170		USD	71,9500	78.921,39	0,12
Bunge Ltd. Registered Shares DL -,01	BMG169621056		STK	400	400		USD	99,7700	37.414,33	0,06
Canadian National Railway Co. Registered Shares o.N.	CA1363751027		STK	6.500	1.000		USD	118,8800	724.436,32	1,09
Chevron Corp. Registered Shares DL-,75	US1667641005		STK	500	500		USD	179,4900	84.137,25	0,13
Cisco Systems Inc. Registered Shares DL-,001	US17275R1023		STK	22.980	11.980		USD	47,6400	1.026.360,29	1,55
Coca-Cola Co., The Registered Shares DL -,25	US1912161007		STK	1.500			USD	63,6100	89.452,96	0,14
Corning Inc. Registered Shares DL -,50	US2193501051		STK	1.250	1.250		USD	31,9400	37.430,27	0,06
Cummins Inc. Registered Shares DL 2,50	US2310211063		STK	310	310		USD	242,2900	70.416,63	0,11
Danaher Corp. Registered Shares DL -,01	US2358511028		STK	3.500	850		USD	265,4200	870.922,98	1,32
Deere & Co. Registered Shares DL 1	US2441991054		STK	1.430	1.250		USD	428,7600	574.815,36	0,87
eBay Inc. Registered Shares DL -,001	US2786421030		STK	1.180	1.180		USD	41,4700	45.876,90	0,07
Emerson Electric Co. Registered Shares DL -,50	US2910111044		STK	610	610		USD	96,0600	54.935,17	0,08
Everest Reinsurance Group Ltd. Registered Shares DL -,01	BMG3223R1088		STK	160	160		USD	331,2700	49.691,28	0,08
Gen Digital Inc. Registered Shares DL -,01	US6687711084		STK	2.200	2.200		USD	21,4300	44.200,07	0,07
General Mills Inc. Registered Shares DL -,10	US3703341046		STK	650	650		USD	83,8500	51.096,89	0,08
Gilead Sciences Inc. Registered Shares DL -,001	US3755581036		STK	1.080	1.080	6.000	USD	85,8500	86.924,48	0,13
Goldman Sachs Group Inc., The Registered Shares DL -,01	US38141G1040		STK	140	140		USD	343,3800	45.069,33	0,07
Hewlett Packard Enterprise Co. Registered Shares DL -,01	US42824C1099		STK	4.390	4.390		USD	15,9600	65.686,40	0,10
Intl Business Machines Corp. Registered Shares DL -,20	US4592001014		STK	550	550	2.200	USD	140,8900	72.647,54	0,11
Johnson & Johnson Registered Shares DL 1	US4781601046		STK	6.000	3.000	400	USD	176,6500	993.671,78	1,50
JPMorgan Chase & Co. Registered Shares DL 1	US46625H1005		STK	4.690	4.440	4.250	USD	134,1000	589.630,15	0,89
Kraft Heinz Co., The Registered Shares DL -,01	US5007541064		STK	1.210		390	USD	40,7100	46.181,13	0,07
Lowe's Companies Inc. Registered Shares DL -,50	US5486611073		STK	230	230		USD	199,2400	42.961,80	0,06
Lyondellbasell Industries NV Registered Shares A EO -,04	NL0009434992		STK	800	800		USD	83,0300	62.273,47	0,09
McDonald's Corp. Registered Shares DL-,01	US5801351017		STK	2.650	300	550	USD	263,5300	654.717,57	0,99
Medtronic PLC Registered Shares DL -,0001	IE00BTN1Y115		STK	4.500	1.900		USD	77,7200	327.886,37	0,50
Merck & Co. Inc. Registered Shares DL-,01	US58933Y1055		STK	990	990		USD	110,9500	102.977,08	0,16
Meta Platforms Inc. Reg.Shares Cl.A DL-,000006	US30303M1027		STK	1.500	1.500		USD	120,3400	169.230,77	0,26
Micron Technology Inc. Registered Shares DL -,10	US5951121038		STK	630	630		USD	49,9800	29.519,90	0,04
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	US5949181045		STK	6.620	3.620		USD	239,8200	1.488.406,13	2,25
Morgan Stanley Registered Shares DL -,01	US6174464486		STK	6.150	1.300		USD	85,0200	490.201,10	0,74
Mosaic Co., The Registered Shares DL -,01	US61945C1036		STK	1.180	1.180		USD	43,8700	48.531,95	0,07
NIKE Inc. Registered Shares Class B o.N.	US66541061031		STK	6.000	2.250	600	USD	117,0100	658.191,53	0,99
NVIDIA Corp. Registered Shares DL-,001	US67066G1040		STK	240	240		USD	146,1400	32.882,01	0,05
PayPal Holdings Inc. Reg. Shares DL -,0001	US70450Y1038		STK	3.000	1.700	650	USD	71,2200	200.309,38	0,30
PepsiCo Inc. Registered Shares DL -,0166	US7134481081		STK	4.750	750	2.000	USD	180,6600	804.514,13	1,22
Pfizer Inc. Registered Shares DL -,05	US7170811035		STK	1.660	560		USD	51,2400	79.743,50	0,12
Procter & Gamble Co., The Registered Shares o.N.	US7427181091		STK	5.000	4.500		USD	151,5600	710.448,60	1,07
Salesforce Inc. Registered Shares DL -,001	US79466L3024		STK	2.000			USD	132,5900	248.610,13	0,38
T-Mobile US Inc. Registered Shares DL-,00001	US8725901040		STK	320	320		USD	140,0000	42.000,66	0,06
Thermo Fisher Scientific Inc. Registered Shares DL 1	US8835561023		STK	1.150	200		USD	550,6900	593.721,93	0,90
U.S. Bancorp Registered Shares DL -,01	US9029733048		STK	1.280	1.280		USD	43,6100	52.332,82	0,08
United Parcel Service Inc. Reg. Shares Class B DL -,01	US9113121068		STK	610	280		USD	173,8400	99.416,30	0,15
Verizon Communications Inc. Registered Shares DL -,10	US92343V1044		STK	7.240	1.840		USD	39,4000	267.431,68	0,40
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	US92826C8394		STK	5.370		630	USD	207,7600	1.045.958,09	1,58
Walt Disney Co., The Registered Shares DL -,01	US2546871060		STK	2.100	2.100	400	USD	86,8800	171.047,67	0,26
Whirlpool Corp. Registered Shares DL 1	US9633201069		STK	260	260		USD	141,4600	34.481,41	0,05

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

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
Verzinsliche Wertpapiere									
3,2500 % Coca-Cola Co., The AD-Notes 2016(24)	AU3CB0237907		AUD	200	200	%	98,4750	125.168,42	0,19
4,5325 % Alpiq Holding AG SF-FLR Anl. 2013(18/Und.)	CH0212184037		CHF	250	30	80 %	92,7500	234.891,00	0,36
0,7750 % Cellnex Telecom S.A. SF-Med.-Term Notes 2020(27)	CH0506071148		CHF	250		%	91,4080	231.492,36	0,35
0,2000 % Digital Intrepid Holding B.V. SF-Notes 2021(26/26)	CH1121837236		CHF	150		%	88,6640	134.725,88	0,20
2,5000 % HOCHDORF Holding AG SF-FLR Anl. 2017(23/Und.)	CH0391647986		CHF	600		%	30,0000	182.341,26	0,28
4,3750 % Swiss Life AG SF-Var. Anl. 2016(26/46)	CH0316994653		CHF	140		%	101,4500	143.877,39	0,22
0,1925 % Verizon Communications Inc. SF-Anl. 2021(28)	CH1105672658		CHF	100		%	89,0570	90.215,37	0,14
4,2500 % Achmea B.V. EO-FLR Med.-T. Nts 15(25/Und.)	XS1180651587		EUR	200		%	98,1000	196.200,00	0,30
4,0000 % AEGON N.V. EO-FLR Med.-T.Nts 2014(24/44)	XS1061711575		EUR	200		%	98,3550	196.710,00	0,30
2,7415 % AEGON N.V. EO-FLR Nts 2004(14/Und.)	NL0000116150		EUR	300		%	82,5720	247.716,00	0,37
3,0820 % Ageasfinlux S.A. EO-Conv.FLR Nts 02(Und.) Reg.S *	XS0147484074		EUR	250		%	81,7510	204.377,50	0,31
4,7500 % Allianz SE FLR-Med.Ter.Nts.v.13(23/unb.)	DE000A1YQCQ9		EUR	200	200	%	99,4430	198.886,00	0,30
2,7500 % Arkema S.A. EO-FLR Med.-T.Nts 2019(24/Und)	FR0013425170		EUR	100		%	93,3490	93.349,00	0,14
2,8420 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 03(08/Und.)	XS0181369454		EUR	200		%	79,6910	159.382,00	0,24
1,8750 % BAWAG Group AG EO-FLR Med.-Term Nts 20(25/30)	XS2230264603		EUR	200	200	%	83,7270	167.454,00	0,25
3,7500 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2014(2024/2074)	DE000A11QR73		EUR	200		%	96,3110	192.622,00	0,29
2,6250 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2014(24)	XS1015217703		EUR	110	110	%	100,1880	110.206,80	0,17
5,3750 % Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/42)	FR001400DNF5		EUR	100	100	%	102,6810	102.681,00	0,16
5,6250 % Ceske Drah AS EO-Notes 2022(22/27)	XS2495084621		EUR	150	150	%	99,5960	149.394,00	0,23
0,5000 % Chanel Ceres PLC EO-Notes 2020(20/26)	XS2239845097		EUR	150		%	88,4010	132.601,50	0,20
3,1919 % CNP Assurances S.A. EO-FLR Notes 2005(11/Und.)	FR0010167247		EUR	150		%	97,8340	146.751,00	0,22
1,2500 % Compagnie Plastic Omnium S.A. EO-Obl. 2017(17/24)	FR0013264066		EUR	200	200	%	94,3430	188.686,00	0,29
2,7500 % ContourGlobal Power Hldgs S.A. EO-Notes 2020(20/26) Reg.S	XS2274815369		EUR	100		%	89,1600	89.160,00	0,13
4,2500 % Crédit Agricole Assurances SA EO-FLR Notes 2015(25/Und.)	FR0012444750		EUR	200		%	97,5960	195.192,00	0,30
1,6250 % Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2023/2023)	XS2408458227		EUR	100		%	97,8250	97.825,00	0,15
4,6790 % Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.FLR-MTN R35281 17(22/27)	XS1637926137		EUR	300		%	86,2480	258.744,00	0,39
0,8750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1557096267		EUR	110	110	%	97,8810	107.669,10	0,16
2,0000 % Dometic Group AB EO-Medium-Term Nts 2021(21/28)	XS2391403354		EUR	200		%	79,6630	159.326,00	0,24
0,4250 % Dongfeng Motor(HK)Intl Co.Ltd. EO-Bonds 2021(21/24)	XS2394012103		EUR	200	200	200 %	92,5150	185.030,00	0,28
4,0000 % Electricité de France (E.D.F.) EO-FLR Notes 2018(24/Und.)	FR0013367612		EUR	200		%	94,0730	188.146,00	0,28
3,3750 % ELM B.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2017(27/47)	XS1587893451		EUR	100	100	%	90,4950	90.495,00	0,14
1,8160 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2021(21/31)	XS2304675791		EUR	150	150	%	65,3040	97.956,00	0,15
2,1240 % Ferroviaal Netherlands B.V. EO-FLR Notes 2017(23/Und.)	XS1716927766		EUR	150		%	79,9050	119.857,50	0,18
5,0000 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2022/2029)	XS2559501429		EUR	200	200	%	96,8930	193.786,00	0,29
0,0000 % Gaz Capital S.A. EO-M.T.LPN 16(23)GAZPROM Reg.S	XS1521039054		EUR	100		%	75,7310	75.731,00	0,11
0,0000 % Gaz Capital S.A. EO-M.T.LPN 17(24)GAZPROM	XS1721463500		EUR	200		%	73,6770	147.354,00	0,22
0,8750 % GN Store Nord AS EO-Medium-Term Nts 2021(21/24)	XS2412258522		EUR	200	200	%	90,0310	180.062,00	0,27
3,0000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-FLR Notes 2019(24/Und.)	XS1713466495		EUR	150	150	%	96,4730	144.709,50	0,22
1,8750 % Iliad S.A. EO-Obl. 2021(27/28)	FR0014001YB0		EUR	100		%	82,8390	82.839,00	0,13
1,1250 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2016(16/24)	XS1375841233		EUR	110	110	%	96,4240	106.066,40	0,16
0,3500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(25)	IT0005386245		EUR	150		%	93,9790	140.968,50	0,21
4,5000 % LANXESS AG FLR-Sub.Anl. v.2016(2023/2076)	XS1405763019		EUR	100		%	98,1030	98.103,00	0,15
1,6250 % Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2020(2026/2080)	XS2218405772		EUR	100		%	89,0600	89.060,00	0,13
3,2050 % Mowi ASA EO-FLR Notes 2020(23/25)	NO0010874050		EUR	200		%	98,6550	197.310,00	0,30
0,4100 % National Grid North Amer. Inc. EO-Med.-Term Nts 2022(22/26)	XS2434710799		EUR	100	100	%	90,1170	90.117,00	0,14
4,3750 % NN Group N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 14(24/Und.)	XS1076781589		EUR	200		%	98,9130	197.826,00	0,30
5,2500 % Orsted A/S EO-FLR Notes 2022(22/3022)	XS2563353361		EUR	100	100	%	101,8570	101.857,00	0,15
1,8750 % Peugeot Invest S.A. EO-Obl. 2019(19/26)	FR0013457405		EUR	100		%	82,1070	82.107,00	0,12
3,1250 % PVH Corp. EO-Notes 2017(17/27) Reg.S	XS1734066811		EUR	100		%	91,4600	91.460,00	0,14
2,2500 % Quadiant S.A. EO-Obl. 2020(20/25)	FR0013478849		EUR	100		%	92,5680	92.568,00	0,14
4,2470 % Repsol Intl Finance B.V. EO-FLR Notes 2020(28/Und.)	XS2186001314		EUR	270		%	89,4720	241.574,40	0,37
3,1100 % Rothschild&Co Cont.Finance PLC EO-FLR Notes 2004(14/Und.)	XS0197703118		EUR	300		%	69,7540	209.262,00	0,32
0,6250 % Sanoma Oyj EO-Notes 2021(21/24)	FI4000490602		EUR	100	100	%	95,7600	95.760,00	0,14
5,6250 % SES S.A. EO-FLR Notes 2016(24/Und.)	XS1405765659		EUR	100		%	97,6900	97.690,00	0,15
2,1250 % SoftBank Group Corp. EO-Notes 2021(21/24)	XS2361253862		EUR	200		%	94,3070	188.614,00	0,29
5,8690 % Solvay Finance S.A. EO-FLR Notes 2015(24/Und.)	XS1323897725		EUR	150	150	%	100,5390	150.808,50	0,23

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

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
5,1250 % Südzucker Intl Finance B.V. EO-Notes 2022(22/27)	XS2550868801		EUR	100	100	%	101,7810	101.781,00	0,15
4,3750 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2019(25/Und.)	XS1933828433		EUR	100		%	95,6420	95.642,00	0,14
2,3760 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2021(29/Und.)	XS2293060658		EUR	100		%	75,2310	75.231,00	0,11
3,3690 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 16(26/Und.)	XS1501166869		EUR	100		%	93,6700	93.670,00	0,14
2,0000 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 22(22/Und.)	XS2432130610		EUR	100	100	%	85,6550	85.655,00	0,13
4,6250 % Veolia Environnement S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/28)	FR001400DQ84		EUR	100	100	%	101,0550	101.055,00	0,15
4,0000 % Vier Gas Transport GmbH Med.Term.Notes v.2022(22/27)	XS2535724772		EUR	100	100	%	98,8820	98.882,00	0,15
1,3750 % Vilmorin & Cie S.A. EO-Obl. 2021(21/28)	FR0014002KP7		EUR	100		%	73,8100	73.810,00	0,11
4,2000 % Vodafone Group PLC EO-FLR Cap.Sec. 2018(28/78)	XS1888179550		EUR	150		%	90,9370	136.405,50	0,21
2,6250 % Vodafone Group PLC EO-FLR Cap.Sec. 2020(26/80)	XS2225157424		EUR	230	230	%	88,1050	202.641,50	0,31
3,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(29/Und.)	XS2187689380		EUR	100	100	%	83,2680	83.268,00	0,13
4,3750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(30)	XS2554489513		EUR	200	200	%	97,0250	194.050,00	0,29
0,0000 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/25)	DE000A3MP4T1		EUR	100	100	%	87,6670	87.667,00	0,13
5,0000 % Vonovia SE Medium Term Notes v.22(22/30)	DE000A3VQB2		EUR	100	100	%	98,1050	98.105,00	0,15
3,7500 % WP/AP Telecom Holdings IV B.V. EO-Notes 2021(21/29) Reg.S	XS2417090789		EUR	100		%	87,7330	87.733,00	0,13
4,2500 % BP Capital Markets PLC LS-FLR Notes 2020(27/Und.)	XS2193663619		GBP	300	200	%	88,3520	298.839,84	0,45
1,5000 % Comcast Corp. LS-Notes 2020(20/29)	XS2114853299		GBP	150		%	82,3200	139.218,67	0,21
4,1250 % CRH Finance (U.K.) PLC LS-Med.-T. Nts 2015(15/29)	XS1328187627		GBP	100		%	91,0570	102.663,06	0,16
0,7500 % Großbritannien LS-Treasury Stock 2017(23)	GB00BF0HZ991		GBP	150	300	150	98,6690	166.867,92	0,25
1,0000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE LS-Medium-Term Notes 20(20/23)	FR0013482858		GBP	200		%	99,7670	224.966,46	0,34
2,3750 % National Express Group PLC LS-Medium-Term Nts 2019(19/28)	XS2081477817		GBP	100		%	82,8440	93.403,24	0,14
0,6250 % Nestlé Holdings Inc. LS-Med.-T. Nts 2021(21/25)Tr.A	XS2354271095		GBP	100		%	90,0230	101.497,27	0,15
3,2500 % Pinewood FinCo PLC LS-Notes 2019(21/25) Reg.S	XS2052466815		GBP	150		%	92,3820	156.235,41	0,24
5,8750 % Telecom Italia S.p.A. LS-Medium-Term Nts 2006(23)	XS0254907388		GBP	100	100	%	99,3640	112.028,86	0,17
0,7500 % Toyota Motor Credit Corp. LS-Med.-Term Nts 2020(26)	XS2260426288		GBP	150		%	85,7220	144.972,10	0,22
4,5000 % VMED O2 UK Financing I PLC LS-Notes 2021(21/31) Reg.S	XS2358483258		GBP	100		%	76,9690	86.779,41	0,13
8,7500 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. DL-Notes 2000(30)	US25156PAC77		USD	200	200	%	118,1900	221.609,71	0,33
5,6250 % Electricité de France (E.D.F.) DL-FLR Nts 2014(24/Und.) Reg.S	USF2893TAM83		USD	200		%	95,1920	178.487,79	0,27
1,7500 % Henkel AG & Co. KGaA DL-Med. Term Nts. v.21(21/26)	XS2407954002		USD	200		%	88,8030	166.508,23	0,25
4,8750 % Prudential PLC DL-Med.-Term Nts 2017(23/Und.)	XS1700429480		USD	250	250	%	82,9710	194.466,32	0,29
2,2500 % Saudi Arabian Oil Co. DL-Med.-T.Nts 2020(30/30)Reg.S	XS2262853265		USD	200		%	82,5120	154.712,42	0,23
1,2500 % TSMC Global Ltd. DL-Notes 2021(21/26) Reg.S	USG91139AF57		USD	200		%	88,7340	166.378,85	0,25
Zertifikate									
Deut. Börse Commodities GmbH Xetra-Gold IHS 2007(09/Und)	DE000A0S9GB0		STK	7.000		1.300 EUR	54,7950	383.565,00	0,58
Sonstige Beteiligungswertpapiere									
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	CH0012032048		STK	140		2.560 CHF	290,5000	41.199,00	0,06
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR		7.399.285,11	11,18
Verzinsliche Wertpapiere									
3,3750 % Belden Inc. EO-Notes 2017(22/27) Reg.S	XS1640668940		EUR	100		%	91,6210	91.621,00	0,14
3,8750 % Belden Inc. EO-Notes 2018(18/28) Reg.S	XS1789515134		EUR	100	100	%	91,6340	91.634,00	0,14
1,0000 % Berry Global Inc. EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2093880735		EUR	150	150	%	94,4140	141.621,00	0,21
4,0620 % BNP Paribas Fortis S.A. EO-FLR Conv.Nts 2007(Und.)	BE0933899800		EUR	250	250	%	79,1700	197.925,00	0,30
4,7500 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2022(22/34)	XS2555221246		EUR	200	200	%	101,4450	202.890,00	0,31
2,2500 % DIC Asset AG Anleihe v.2021(2021/2026)	XS2388910270		EUR	100		%	57,6740	57.674,00	0,09
3,7500 % ELM B.V. EO-FLR M.-T. Nts 2020(25/Und.)	XS2182055009		EUR	200		%	95,2700	190.540,00	0,29
0,5000 % Fomento Econom.Mexica.SAB D.CV EO-Notes 2021(21/28)	XS2337285519		EUR	200	200	%	81,7820	163.564,00	0,25
4,2500 % Huntsman International LLC EO-Notes 2016(16/25)	XS1395182683		EUR	200	100	%	96,5370	193.074,00	0,29
3,6250 % James Hardie Intl Finance DAC EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1888221261		EUR	100		%	93,5700	93.570,00	0,14
3,3750 % Levi Strauss & Co. EO-Notes 2017(17/27)	XS1602130947		EUR	100		%	94,0740	94.074,00	0,14
2,8750 % Loxam S.A.S. EO-Notes 2019(19/26) Reg.S	XS1975699569		EUR	100	100	%	89,3420	89.342,00	0,14
3,0000 % McDonald's Corp. EO-Medium-Term Nts 2022(22/34)	XS2486285377		EUR	200	200	%	91,6540	183.308,00	0,28

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

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	
3,8750 % Netflix Inc. EO-Notes 2019(19/29) Reg.S	XS1989380172		EUR	100	100	%	93,5330	93.533,00	0,14	
2,5000 % Nomad Foods BondCo PLC EO-Notes 2021(21/28) Reg.S	XS2355604880		EUR	150		%	85,1070	127.660,50	0,19	
2,8750 % OI European Group B.V. EO-Notes 2019(19/25) Reg.S	XS2077666316		EUR	200		%	96,3720	192.744,00	0,29	
0,8750 % P3 Group S.a.r.l. EO-Medium-Term Nts 2022(22/26)	XS2436807866		EUR	100	100	%	83,4380	83.438,00	0,13	
1,1250 % PepsiCo Inc. EO-Notes 2019(19/31)	XS1963555617		EUR	200	200	%	83,7040	167.408,00	0,25	
2,1250 % PPF Telecom Group B.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/25)	XS2078976805		EUR	100		%	94,5480	94.548,00	0,14	
3,1250 % PPF Telecom Group B.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/26)	XS1969645255		EUR	150		%	93,7930	140.689,50	0,21	
3,8750 % Public Power Corporation S.A. EO-Notes 2021(21/26) Reg.S	XS2314265237		EUR	100		%	93,5380	93.538,00	0,14	
2,6240 % Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB EO-FLR Cap. 2020(25/Und.)	XS2010032618		EUR	100		%	39,6290	39.629,00	0,06	
2,8750 % Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB EO-FLR Nts 2021(26/Und.)	XS2010028186		EUR	100		%	39,8210	39.821,00	0,06	
2,0000 % SPCM S.A. EO-Notes 2020(20/26) Reg.S	XS2234515786		EUR	100		%	92,6410	92.641,00	0,14	
1,6250 % Thermo Fisher Scient.(Fin.I)BV EO-Notes 2021(21/41)	XS2366415201		EUR	200	200	%	66,6150	133.230,00	0,20	
0,7390 % Experian Finance PLC LS-Medium-Term Nts 2020(20/25)	XS2237991240		GBP	200		%	89,4670	201.740,80	0,31	
4,6250 % Toyota Motor Finance (Neth.)BV LS-Medium-Term Notes 2022(26)	XS2562996665		GBP	150	150	%	99,0660	167.539,32	0,25	
5,0000 % Virgin Media Secured Fin. PLC LS-Notes 2017(17/27) Reg.S	XS1555173019		GBP	100		%	89,5540	100.968,49	0,15	
2,6000 % Alcon Finance Corp. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USU01386AD00		USD	100		%	85,1000	79.782,50	0,12	
6,6250 % All.Univ.Holdco LLC/Fin.Corp. DL-Notes 2019(19/26) Reg.S	USU0201TAA89		USD	100	100	%	91,9430	86.197,91	0,13	
2,9000 % Apple Inc. DL-Notes 2017(17/27)	US037833DB33		USD	250		%	93,4710	219.076,08	0,33	
1,2000 % Apple Inc. DL-Notes 2021(21/28)	US037833EC07		USD	200		%	84,9860	159.351,24	0,24	
5,5000 % Bausch Health Companies Inc. DL-Notes 2017(17/25) Reg.S	USC94143AL56		USD	100	100	%	85,5470	80.201,57	0,12	
3,4500 % Coca-Cola Co., The DL-Notes 2020(20/30)	US191216CT51		USD	100	100	%	93,0010	87.189,80	0,13	
5,4500 % Dell Intern. LLC/EMC Corp. DL-Notes 2016(16/23)	US24703TAA43		USD	54		%	100,1000	50.676,42	0,08	
2,7000 % eBay Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US278642AW32		USD	200		%	85,1390	159.638,12	0,24	
2,6000 % Estée Lauder Compan. Inc., The DL-Notes 2020(20/30)	US29736RAQ39		USD	100	100	%	86,2240	80.836,26	0,12	
3,5500 % Hasbro Inc. DL-Notes 2019(19/26)	US418056AY31		USD	100		%	93,8880	88.021,38	0,13	
4,8000 % La Mondiale DL-FLR Notes 2018(28/48)	XS1751476679		USD	400		%	87,4170	327.818,87	0,50	
4,0000 % MSCI Inc. DL-Notes 2019(19/29) Reg.S	USU5521TAE20		USD	100	100	%	87,6240	82.148,78	0,12	
3,6250 % MSCI Inc. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USU5521TAG77		USD	150		%	83,4570	117.363,24	0,18	
4,2500 % Nestlé Holdings Inc. DL-Notes 2022(22/29) Reg.S	USU74078CT83		USD	200	200	%	97,8050	183.387,24	0,28	
2,3000 % Oracle Corp. DL-Notes 2021(21/28)	US68389XCD57		USD	150		%	86,7870	122.046,13	0,18	
2,7500 % PepsiCo Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US713448ES36		USD	100	100	%	88,5560	83.022,55	0,13	
2,9000 % S&P Global Inc. DL-Notes 2022(22/32) Reg.S	USU75091AQ88		USD	200	200	%	85,4240	160.172,50	0,24	
1,2000 % Siemens Finan.maatschappij NV DL-Notes 2021(21/26) Reg.S	USN82008AX66		USD	250		%	89,0650	208.749,36	0,32	
2,3000 % Stanley Black & Decker Inc. DL-Notes 2020(20/30)	US854502AL57		USD	200		%	82,3980	154.498,66	0,23	
4,2500 % Swiss Re Finance (Lux) S.A. DL-FLR Notes 2019(24/Und.)	XS2049422343		USD	200	200	%	87,3020	163.693,81	0,25	
3,3000 % Take-Two Interactive Softw.Inc DL-Notes 2022(22/24)	US874054AE98		USD	200	200	%	97,6690	183.132,24	0,28	
1,2500 % United States of America DL-Notes 2021(28)	US91282CBZ32		USD	400		200 %	86,8086	325.537,31	0,49	
2,2500 % United States of America DL-Notes 2022(24)	US91282CEG24		USD	700	700	%	97,0313	636.777,53	0,96	
Nichtnotierte Wertpapiere							EUR	406.159,94	0,61	
Verzinsliche Wertpapiere										
5,2500 % DISH DBS Corp. DL-Notes 2021(21/26) Reg.S	USU25486AQ11		USD	100	100	%	84,4370	79.160,92	0,12	
4,6250 % OCI N.V. DL-Notes 2020(22/25) Reg.S	USN6667AAV54		USD	200	200	%	95,9970	179.997,19	0,27	
7,3780 % Yara International ASA DL-Notes 2022(22/32) Reg.S	USR9900CAT38		USD	150	150	%	104,5330	147.001,83	0,22	
Investmentanteile							EUR	9.177.367,54	13,87	
Gruppenfremde Investmentanteile										
AIS-AMUND.MSCI EM ASIA SRI PAB Act. Nom. U.E.D.Uh USD Dis. oN	LU2300294589		ANT	10.000	20.000	10.000	EUR	33,4350	334.350,00	0,50
ART Top 50 Convertibles UI Inhaber-Anteilsklasse I T	DE000A2DTNKO		ANT	325			EUR	937,4700	304.677,75	0,46
Capitulum Weltzins-Invest Unvnl Inhaber-Anteilsklasse I	DE000A2H7NU1		ANT	2.272	23		EUR	81,7300	185.690,56	0,28
CONVERTIBLE GLB.DIVERSIFIED UI Inhaber-Anteile	DE000A0M9995		ANT	9.323			EUR	156,4200	1.458.303,66	2,20

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

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

Daidalos - Multi Asset BP

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	
FS Exponential Technologies Act. Nom. F EUR Dis. oN	LU2181639712		ANT	326			EUR	995,3200	324.474,32	0,49
iShs VII-\$ Trsy Bd 3-7yr U.ETF Registered Shs EUR DIS.Hgd o.N	IE00BGPP6473		ANT	43.000			EUR	4,4144	189.819,20	0,29
iShs VII-Co.EO STOXX 50 U.ETF Reg. Shares EUR (Acc) o.N.	IE00B53L3W79		ANT	1.800	1.800		EUR	133,0600	239.508,00	0,36
iShsIV-MSCI J.SRIEURH.U.ETF(A) Registered Shares EUR o.N.	IE00BYVJRQ85		ANT	14.000	14.000	6.500	EUR	7,3340	102.676,00	0,16
iShsV-Eu.Co.Bd I.R.Hdg ESG UE Registered Shares o.N.	IE00B6X2VY59		ANT	4.000			EUR	92,6900	370.760,00	0,56
ÖkoWorld - Growing Markets 2.0 Inh.-Anteile D Dis. EUR o.N.	LU0800346289		ANT	3.970			EUR	230,9500	916.871,50	1,39
OptoFlex Nam.-An.I o. N.	LU0834815101		ANT	1.050			EUR	1.406,1000	1.476.405,00	2,23
PAYDEN GBL-Pay.Gbl Em.Mkts Bd Registered Shs. Class EUR o.N.	IE00B04NLM33		ANT	5.799		811	EUR	17,3046	100.349,38	0,15
Themis Special Situations Fund Inhaber-Anteile EUR T	DE000A2H6764		ANT	14.066			EUR	106,2400	1.494.371,84	2,26
Fidelity Fds-Asian Bond Fund Reg. Sh. I Acc. USD o.N.	LU1322385458		ANT	22.246		89	USD	11,3000	235.672,24	0,36
FISCH-Bd EM Corporates Dyn. Act.Nom. LD USD Acc. oN	LU2466185779		ANT	1.148	1.148		USD	95,7200	103.020,26	0,16
iShs VII-Core S&P 500 U.ETF Reg. Shares USD (Acc) o.N.	IE00B5BMR087		ANT	2.500	900		USD	396,0900	928.350,44	1,40
N.I.F.(L.)I-L.S.Sh.T.E.Mkts Bd Nam.-Ant.S/A (USD)o.N.	LU0980588346		ANT	1.877		27	USD	114,9200	202.226,45	0,31
PAYDEN GBL-Pay.Gbl Em.Mkts Bd Registered Shs. Class USD o.N.	IE0030928885		ANT	3.518		1.962	USD	31,0326	102.350,99	0,15
Schroder ISF-Asian Loc.Curr.Bd Namens-Anteile C Acc. USD o.N.	LU0358730231		ANT	793		224	USD	144,5828	107.489,95	0,16
Summe Wertpapiervermögen							EUR	62.959.359,14	95,14	
Derivate							EUR	152.861,37	0,23 ²⁾	
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
Derivate auf einzelne Wertpapiere							EUR	-35.362,73	-0,06	
Wertpapier-Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktien										
Novartis AG CALL 88.00 17.03.2023	EUREX	-340.654	STK	-40	15	55	CHF	0,7500	-3.039,02	-0,01
Allianz SE CALL 220.00 17.03.2023	EUREX	-321.440	STK	-16		16	EUR	1,3600	-2.176,00	0,00
Anheuser-Busch InBev SA/NV CALL 60.00 17.03.2023	EUREX	-338.580	STK	-60		60	EUR	1,0300	-6.180,00	-0,01
SAP SE CALL 102.00 20.01.2023	EUREX	-337.365	STK	-35		35	EUR	0,5100	-1.785,00	0,00
Shell PLC CALL 28.00 17.03.2023	EUREX	-264.800	STK	-100	10	110	EUR	0,6800	-6.800,00	-0,01
Unilever PLC CALL 50.00 17.03.2023	EUREX	-304.655	STK	-65		65	EUR	0,3900	-2.535,00	-0,01
3M Co CALL 130.00 20.01.2023	CBOE	-202.140	STK	-18	2	20	USD	0,2500	-421,88	0,00
Adobe Inc CALL 400.00 20.01.2023	CBOE	-218.997	STK	-7		7	USD	0,2600	-170,63	0,00
Cisco Systems Inc CALL 50.00 20.01.2023	CBOE	-332.302	STK	-75		75	USD	0,1600	-1.125,02	0,00
Johnson & Johnson CALL 180.00 20.01.2023	CBOE	-495.444	STK	-30		30	USD	1,5400	-4.331,32	-0,01
Microsoft Corp CALL 270.00 17.02.2023	CBOE	-446.594	STK	-20		20	USD	2,3000	-4.312,57	-0,01
PayPal Holdings Inc CALL 125.00 20.01.2023	CBOE	-85.958	STK	-13		13	USD	0,0100	-12,19	0,00
Visa Inc CALL 220.00 20.01.2023	CBOE	-387.981	STK	-20	5	25	USD	0,9100	-1.706,28	0,00
Walt Disney Co/The CALL 115.00 17.03.2023	CBOE	-168.915	STK	-21		21	USD	0,3900	-767,82	0,00
Aktienindex-Derivate							EUR	11.257,13	0,02	
Aktienindex-Terminkontrakte										
EURO STOXX 50 Mar23	EUREX	-1.138.086	STK	-30		30	EUR	3.785,0000	45.450,00	0,07

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

Daidalos
Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP

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	
Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktienindices										
EURO STOXX 50 Index CALL 4000.00 17.03.2023	EUREX	-75.872	STK	-2		2	EUR	46,4000	-928,00	0,00
EURO STOXX 50 Index CALL 4100.00 17.03.2023	EUREX	-227.617	STK	-6		6	EUR	24,0000	-1.440,00	0,00
S&P 500 Index CALL 4100.00 17.03.2023	CBOE	-1.079.876	STK	-3		3	USD	50,9200	-14.321,47	-0,02
S&P 500 Index PUT 4025.00 20.01.2023	CBOE	-359.959	STK	-1		1	USD	186,7000	-17.503,40	-0,03
							EUR	176.966,97	0,27	
Devisen-Derivate										
Devisenterminkontrakte										
Offene Positionen										
			Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufwährung	Verkaufbetrag	Fälligkeit			
Banque de Luxembourg CHF/EUR	OTC		EUR	915.239,66	CHF	-900.000,00	28.04.2023	-753,58	0,00	
Banque de Luxembourg CHF/EUR	OTC		CHF	500.000,00	EUR	-510.371,78	28.04.2023	-1.486,65	0,00	
Banque de Luxembourg JPY/EUR	OTC		EUR	200.686,69	JPY	-28.000.000,00	28.03.2023	766,72	0,00	
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC		EUR	1.402.027,71	USD	-1.500.000,00	28.03.2023	4.011,59	0,00	
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC		EUR	3.432.850,02	USD	-3.500.000,00	28.04.2023	177.190,52	0,27	
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC		USD	500.000,00	EUR	-465.701,98	28.04.2023	-607,77	0,00	
Banque de Luxembourg USD/EUR	OTC		USD	200.000,00	EUR	-188.191,55	28.04.2023	-2.153,86	0,00	
							EUR	2.886.123,33	4,36	
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten										
Kassenbestände										
Verwahrstelle										
			AUD	18.346,16				11.659,60	0,02	
			CAD	100.754,88				69.683,16	0,10	
			CHF	22.477,36				22.769,72	0,03	
			CNY	2.662,91				361,86	0,00	
			DKK	33.455,08				4.498,77	0,01	
			EUR	1.944.053,62				1.944.053,62	2,94	
			GBP	109.776,60				123.768,64	0,19	
			JPY	30.401.920,00				215.846,08	0,33	
			NOK	1.689,61				160,66	0,00	
			SEK	32.628,42				2.934,05	0,00	
			USD	444.194,63				416.438,97	0,63	
							EUR	73.948,20	0,11	
Marginkonten										
Initial Margin Banque de Luxembourg S.A.										
			EUR	119.398,20				119.398,20	0,18	
Variation Margin für Future										
			EUR	-45.450,00				-45.450,00	-0,07	
							EUR	237.959,28	0,36	
Sonstige Vermögensgegenstände										
Zinsansprüche										
			EUR	227.090,78				227.090,78	0,34	
Dividendenansprüche										
			EUR	10.868,50				10.868,50	0,02	

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

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

Daidalos - Multi Asset BP

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
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-57.037,51	-0,09
Verwaltungsvergütung			EUR	-28.622,36				-28.622,36	-0,04
Betreuungsgebühr			EUR	-4.320,03				-4.320,03	-0,01
Zentralverwaltungsvergütung			EUR	-3.242,24				-3.242,24	-0,01
Verwahrstellenvergütung			EUR	-2.729,44				-2.729,44	0,00
Register- und Transferstellenvergütung			EUR	-125,00				-125,00	0,00
Taxe d'Abonnement			EUR	-7.810,82				-7.810,82	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-9.932,63				-9.932,63	-0,02
Sonstige Kosten			EUR	-254,99				-254,99	0,00
Teilfondsvermögen							EUR	66.179.265,61	100,00¹⁾
Daidalos - Multi Asset BP P									
Anzahl Anteile							STK	543.875,000	
Anteilwert							EUR	121,68	

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.

Daidalos Investmentfonds (F.C.P.)

Daidalos - Multi Asset BP Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.12.2022	
Australische Dollar	(AUD)	1,5734800	= 1 Euro (EUR)
Kanadische Dollar	(CAD)	1,4459000	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,9871600	= 1 Euro (EUR)
Yuan Renminbi	(CNY)	7,3589000	= 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.
OTC	Over-the-Counter

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

Daidalos - Multi Asset BP

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

I. Erträge

1. Dividenden	EUR	704.105,17
2. Zinsen aus Wertpapieren	EUR	561.864,15
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen	EUR	24.964,39
4. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	62.606,07
5. Abzug Quellensteuer	EUR	-151.789,16
6. Bestandsprovisionen	EUR	4.835,28

Summe der Erträge	EUR	1.206.585,90
--------------------------	------------	---------------------

II. Aufwendungen

1. Verwaltungsvergütung	EUR	-335.622,01
2. Verwahrstellenvergütung	EUR	-21.287,65
3. Register- und Transferstellenvergütung	EUR	-1.467,17
4. Betreuungsgebühr	EUR	-50.411,30
5. Zentralverwaltungsgebühr	EUR	-68.003,03
6. Vertriebs-, Informations- und Zahlstellengebühr	EUR	-1.648,71
7. Prüfungskosten	EUR	-9.562,72
8. Taxe d'Abonnement	EUR	-30.876,90
9. Zinsaufwand aus Geldanlagen	EUR	-14.257,71
10. Sonstige Aufwendungen (siehe Erläuterung 2)	EUR	-36.059,05

Summe der Aufwendungen	EUR	-569.196,25
-------------------------------	------------	--------------------

III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR	637.389,65
--------------------------------------	------------	-------------------

IV. Veräußerungsgeschäfte

1. Realisierte Gewinne	EUR	4.394.152,58
2. Realisierte Verluste	EUR	-3.292.956,46

Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	1.101.196,12
--	------------	---------------------

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	1.738.585,77
---	------------	---------------------

VI. Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres	EUR	-8.918.758,47
--	------------	----------------------

VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-7.180.172,70
--	------------	----------------------

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

Daidalos - Multi Asset BP
Entwicklung des Teilfondsvermögens

		2022
I. Wert des Teilfondsvermögens am Beginn des Geschäftsjahres		EUR 74.027.687,61
1. Mittelzufluss / -abfluss (netto)		EUR -707.970,85
a) Mittelzuflüsse aus Anteilscheingeschäften	EUR 3.580.128,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilscheingeschäften	EUR -4.288.098,85	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		EUR 39.721,55
3. Ergebnis des Geschäftsjahres		EUR -7.180.172,70
II. Wert des Teilfondsvermögens am Ende des Geschäftsjahres		EUR 66.179.265,61

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020	Stück	545.529.000	EUR	64.511.584,35	EUR	118,26
2021	Stück	550.140.000	EUR	74.027.687,61	EUR	134,56
2022	Stück	543.875.000	EUR	66.179.265,61	EUR	121,68

**Erläuterungen zum Jahresbericht
zum 31. Dezember 2022**

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 2022 bis zum 31. Dezember 2022 belaufen sich diese Kosten für die folgenden Teilfonds auf:

Daidalos – Multi Asset VI	EUR	7.105,46
Daidalos – Multi Asset BP	EUR	56.289,54

Bei Transaktionen, welche nicht direkt mit der Verwahrstelle abgeschlossen werden, werden die Abwicklungskosten dem 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 -minderungen inbegriffen sind.

e) Umrechnung von Fremdwährungen

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

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

f) Konsolidierter Abschluss

Der konsolidierte Abschluss erfolgt in Euro und stellt die konsolidierte 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.

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

l) Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste

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

m) Gründungskosten

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

n) Verfügbare liquide Mittel

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

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

Daidalos – Multi Asset BP	EUR	2.931.573,33
---------------------------	-----	--------------

o) Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht

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“)

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.

Daidalos Investmentfonds (F.C.P.)

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

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

Erläuterung 7 – Performance Fee

Im Berichtszeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 sind folgende Performance Fees angefallen:

	Performance Fee	in %
Daidalos - Multi Asset VI P	0,00 EUR	0,00%

Daidalos Investmentfonds (F.C.P.)

Bei der Angabe der Performance Fee wurde ein ggfs. anfallender Ertragsausgleich nicht berücksichtigt. Die Ermittlung des prozentualen Wertes erfolgt auf Basis des durchschnittlichen Fondsvolumens der jeweiligen Anteilklasse im Berichtszeitraum.

Weitergehende Informationen zur Performance Fee und ihrer Berechnung können dem aktuellen Verkaufsprospekt sowie den wesentlichen Anlegerinformationen („Key Investor Information Document“) entnommen werden.

Erläuterung 8 – Weitere Informationen

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.

Mögliche Auswirkungen der COVID-19-Pandemie

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

Der Vorstand hat dafür gesorgt, dass alle erforderlichen Maßnahmen getroffen werden, um sicherzustellen, dass die Aktivitäten der Gesellschaft nicht gestört werden. Auf Basis der aktuellen Entwicklungen in Bezug auf COVID-19 geht die Gesellschaft davon aus, dass die Unternehmensfortführung sowohl finanziell als auch personell sichergestellt ist. Eine fortlaufende Überwachung der 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 den Daidalos auswirken. Nach aktuellen Informationen hat die Verwaltungsgesellschaft 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 die Gesellschaft davon aus, dass die Unternehmensfortführung des Daidalos und seiner Teilfonds sichergestellt ist.

Mögliche Auswirkungen des Ukraine-Konfliktes

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.

Erläuterung 9 – 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 10 – Risikomanagement (ungeprüft)

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

Erläuterung 11 – 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 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 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.

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

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:	14.791 TEUR
Gesamtbetrag der fixen Vergütung:	12.090 TEUR
Gesamtbetrag der variablen Vergütung:	2.701 TEUR
Anzahl der Mitarbeiter:	79

Quellen zu den Angaben zur Vergütung der delegierten Portfoliomanager

Diem Client Partner AG: gemäß Auskunft der Diem Client Partner AG für das Geschäftsjahr 2021; 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 2021; Rothschild & Co. Vermögensverwaltungs-GmbH: gemäß Auskunft der Rothschild & Co. Vermögensverwaltungs-GmbH für das Geschäftsjahr 2021.

Erläuterung 12 – 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 13 – 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.