

Halbjahresbericht zum 30. Juni 2023

DCP

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 K255

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 Basisinformationsblättern, dem letzten Jahresbericht und gegebenenfalls dem letzten Halbjahresbericht, falls Letzterer ein späteres Datum als der Jahresbericht trägt, erfolgen.

Inhaltsverzeichnis

Management und Verwaltung	1
Allgemeine Informationen	3
DCP	5
<i>Zusammengefasste Vermögensübersicht</i>	<i>5</i>
DCP - 4Plus	6
<i>Vermögensübersicht</i>	<i>6</i>
<i>Vermögensaufstellung</i>	<i>7</i>
DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)	12
<i>Vermögensübersicht</i>	<i>12</i>
<i>Vermögensaufstellung</i>	<i>13</i>
DCP - Prämienstrategie Europa (fusioniert)	14
<i>Vermögensübersicht</i>	<i>14</i>
<i>Vermögensaufstellung</i>	<i>15</i>
DCP - Global Opportunities Fund	20
<i>Vermögensübersicht</i>	<i>20</i>
<i>Vermögensaufstellung</i>	<i>21</i>
Erläuterungen zum Halbjahresbericht (Anhang)	24

Management und Verwaltung

Verwaltungsgesellschaft

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

Eigenkapital per 31. Dezember 2022
EUR 4.030.882

Aufsichtsrat der Verwaltungsgesellschaft

Vorsitzender

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

Mitglieder

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

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

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

Vorstand der Verwaltungsgesellschaft

Vorsitzender

Stefan SCHNEIDER

Mitglieder

Pierre GIRARDET

Armin CLEMENS

Abschlussprüfer

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

Verwahrstelle

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

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

**Zentralverwaltung /
Register- und Transferstelle**

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

Portfolioverwalter

Diem Client Partner AG
Limmatquai 50
CH-8001 ZÜRICH

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

für den Teilfonds DCP – Hybrid Income
(ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)

Österreich

Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG
Am Belvedere 1
A-1100 WIEN

Allgemeine Informationen

Der Investmentfonds DCP (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. Er unterliegt den Bedingungen gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen und erfüllt die Anforderungen der Richtlinie des Rates der Europäischen Gemeinschaften Nr. 2009/65/EG vom 13. Juli 2009.

Es werden derzeit Anteile der folgenden Teilfonds angeboten:

DCP – 4Plus in CHF
(im Folgenden „4Plus“ genannt)

DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“) in CHF
(im Folgenden „Hybrid Income“ genannt)

DCP – Global Opportunities Fund in USD
(im Folgenden „Global Opportunities Fund“ genannt)

Mit Wirkung zum 1. Januar 2023 wurde der Teilfonds „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“ in „DCP – Hybrid Income“ umbenannt.

Darüber hinaus wurde mit Wirkung zum 15. April 2023 der Teilfonds DCP – Prämienstrategie Europa (fusioniert) auf Basis der letzten Fondspreisermittlung per 14. April 2023 in den Teilfonds DCP – 4Plus verschmolzen.

Das Umtauschverhältnis der Fusion lautete:

		Umtauschverhältnis
DCP – Prämienstrategie Europa R (fusioniert) ISIN: LU1928471090	in	DCP – 4Plus P ISIN: LU112680704
		0,805434854

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 Schweizer Franken (CHF).

Der Nettoinventarwert wird 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 des jeweiligen Teilfonds ist eine abweichende Regelung getroffen. Für den Teilfonds DCP – Prämienstrategie Europa gilt abweichend davon als Bewertungstag jeder Freitag mit Ausnahme des 24. Dezember.

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

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. Beim ersten Geschäftsjahr handelte es sich um ein überlanges Geschäftsjahr, welches am 31. Dezember 2015 endete.

Der erste geprüfte Jahresbericht wurde zum 31. Dezember 2015 und der erste ungeprüfte Halbjahresbericht wurde zum 30. Juni 2015 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-, Informations- und Vertriebsstellen erfragt werden.

Dort sind auch der Verkaufsprospekt mit Verwaltungsreglement und Anhängen in der jeweils aktuellen Fassung sowie die Jahres- und Halbjahresberichte kostenlos erhältlich; die Satzung der Verwaltungsgesellschaft kann an deren Sitz eingesehen werden. Die Basisinformationsblätter können auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft (www.axxion.lu) heruntergeladen werden.

Ferner wird auf Anfrage eine Papierversion seitens der Verwaltungsgesellschaft, der Vertriebsstellen oder der Informationsstellen zur Verfügung gestellt.

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

Aktuell werden Ausgabe- und Rücknahmepreise auf der Internetseite www.axxion.lu veröffentlicht. Hier können auch der aktuelle Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter sowie die Jahresberichte und Halbjahresberichte des Fonds zur Verfügung gestellt werden.

Informationen, insbesondere Mitteilungen an die Anleger, werden ebenfalls auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft www.axxion.lu veröffentlicht. Darüber hinaus werden in gesetzlich vorgeschriebenen Fällen für das Großherzogtum Luxemburg Mitteilungen auch auf der elektronischen Plattform „Luxembourg Business Registers“ (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.

DCP
Investmentfonds (F.C.P.)

DCP

Zusammengefasste Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023

	Tageswert in CHF	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	169.179.091,54	100,10
1. Aktien	20.104.009,00	11,90
Belgien	455.367,74	0,27
Bundesrep. Deutschland	1.580.062,38	0,94
Frankreich	493.234,81	0,29
Großbritannien	558.893,65	0,33
Irland	786.477,87	0,47
Italien	481.696,13	0,29
Kaimaninseln	208.793,42	0,12
Niederlande	850.094,04	0,50
Schweiz	908.500,00	0,54
USA	13.780.888,95	8,15
2. Anleihen	133.659.402,27	79,08
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	4.565.447,26	2,70
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	4.442.967,10	2,63
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	5.107.977,16	3,02
>= 10 Jahre	119.543.010,75	70,73
3. Sonstige Beteiligungswertpapiere	355.550,00	0,21
Schweizer Franken	355.550,00	0,21
4. Investmentanteile	4.391.606,12	2,60
Euro	673.396,03	0,40
Schweizer Franken	1.491.611,21	0,88
US-Dollar	2.226.598,88	1,32
5. Derivate	-2.542.154,06	-1,50
6. Bankguthaben	11.092.110,60	6,56
7. Sonstige Vermögensgegenstände	2.118.567,61	1,25
II. Verbindlichkeiten	-169.460,35	-0,10
III. Fondsvermögen	169.009.631,19	100,00

DCP
Investmentfonds (F.C.P.)

DCP - 4Plus

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023

	Tageswert in CHF	% Anteil am Teilfondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	23.947.190,48	100,23
1. Aktien	18.054.199,05	75,56
Belgien	354.175,12	1,48
Bundesrep. Deutschland	1.464.509,89	6,13
Frankreich	493.234,81	2,06
Großbritannien	419.170,52	1,75
Irland	786.477,87	3,29
Italien	481.696,13	2,02
Kaimaninseln	111.853,62	0,47
Niederlande	850.094,04	3,56
Schweiz	908.500,00	3,80
USA	12.184.487,05	51,00
2. Sonstige Beteiligungswertpapiere	355.550,00	1,49
Schweizer Franken	355.550,00	1,49
3. Investmentanteile	2.165.007,24	9,06
Euro	673.396,03	2,82
Schweizer Franken	1.491.611,21	6,24
4. Derivate	-2.128.362,21	-8,91
5. Bankguthaben	5.496.510,49	23,01
6. Sonstige Vermögensgegenstände	4.285,91	0,02
II. Verbindlichkeiten	-53.916,68	-0,23
III. Teilfondsvermögen	23.893.273,80	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DCP
Investmentfonds (F.C.P.)

DCP - 4Plus

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in CHF	% des Teilfonds- vermögens
Bestandspositionen							CHF	20.574.756,29	86,11
Amtlich gehandelte Wertpapiere							CHF	18.409.749,05	77,05
Aktien									
Alcon AG Namens-Aktien SF -,04	CH0432492467		STK	5.000	5.000		CHF 74,1000	370.500,00	1,55
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350		STK	5.000	5.000	6.000	CHF 107,6000	538.000,00	2,25
adidas AG Namens-Aktien o.N.	DE000A1EWWW0		STK	3.000			EUR 177,7800	520.646,51	2,18
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251		STK	7.000			EUR 51,8300	354.175,12	1,48
Bayer AG Namens-Aktien o.N.	DE000BAY0017		STK	6.000			EUR 50,6700	296.784,32	1,24
Danone S.A. Actions Port. EO-,25	FR0000120644		STK	9.000	3.000		EUR 56,1400	493.234,81	2,06
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	DE0005810055		STK	1.800	1.800		EUR 169,1000	297.135,76	1,24
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0003128367		STK	80.000			EUR 6,1680	481.696,13	2,02
Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0005785604		STK	7.000			EUR 25,3700	173.363,36	0,73
Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder EO 0,20	NL0000009538		STK	22.982	982		EUR 19,8080	444.393,04	1,86
Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	NL0013654783		STK	2.000		2.500	EUR 67,1100	131.025,56	0,55
Unilever PLC Registered Shares LS -,031111	GB00B10RZP78		STK	9.000	3.000		EUR 47,7100	419.170,52	1,75
Vitesco Technologies Group AG Namens-Aktien o.N.	DE000VTSC017		STK	500			EUR 75,4500	36.827,15	0,15
Vonovia SE Namens-Aktien o.N.	DE000A1ML7J1		STK	8.000			EUR 17,8950	139.752,79	0,58
AbbVie Inc. Registered Shares DL -,01	US0231351067		STK	3.000			USD 134,7300	361.608,58	1,51
Adobe Inc. Registered Shares o.N.	US00724F1012		STK	1.000			USD 488,9900	437.474,90	1,83
Alibaba Group Holding Ltd. Reg.Shs (sp.ADRs)/8 DL-,000025	US01609W1027		STK	1.500			USD 83,3500	111.853,62	0,47
Amazon.com Inc. Registered Shares DL -,01	US0231351067		STK	6.800			USD 130,3600	793.060,70	3,32
American Electric Power Co.Inc Registered Shares DL 6,50	US0255371017		STK	5.000	1.500		USD 84,2000	376.647,65	1,58
Apple Inc. Registered Shares o.N.	US0378331005		STK	6.500			USD 193,9700	1.127.979,19	4,72
Bank of America Corp. Registered Shares DL 0,01	US0605051046		STK	6.000			USD 28,6900	154.005,05	0,64
Citigroup Inc. Registered Shares DL -,01	US1729674242		STK	11.000			USD 46,0400	453.086,55	1,90
Coca-Cola Co., The Registered Shares DL -,25	US1912161007		STK	6.000	6.000		USD 60,2200	323.254,94	1,35
Colgate-Palmolive Co. Registered Shares DL 1	US1941621039		STK	3.500	3.500		USD 77,0400	241.233,43	1,01
Danaher Corp. Registered Shares DL -,01	US2358511028		STK	1.000	1.000		USD 240,0000	214.716,00	0,90
Eaton Corporation PLC Registered Shares DL -,01	IE00B8KQ827		STK	2.400			USD 201,1000	431.793,88	1,81
Electronic Arts Inc. Registered Shares DL -,01	US2855121099		STK	3.500			USD 129,7000	406.126,37	1,70
Hasbro Inc. Registered Shares DL -,50	US4180561072		STK	4.500			USD 64,7700	260.759,16	1,09
Honeywell International Inc. Registered Shares DL 1	US4385161066		STK	1.200	1.200		USD 207,5000	222.767,85	0,93
Intercept Pharmaceuticals Inc. Registered Shares DL -,001	US45845P1084		STK	2.100			USD 11,0600	20.779,14	0,09
Johnson & Johnson Registered Shares DL 1	US4781601046		STK	3.000			USD 165,5200	444.247,40	1,86
JPMorgan Chase & Co. Registered Shares DL 1	US46625H1005		STK	4.000			USD 145,4400	520.471,58	2,18
Marriott International Inc. Reg. Shares Class A DL -,01	US5719032022		STK	300			USD 183,6900	49.301,48	0,21
Medtronic PLC Registered Shares DL -,0001	IE00BTN1Y115		STK	4.500	1.500		USD 88,1000	354.683,99	1,48
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	US5949181045		STK	3.000	3.000	3.500	USD 340,5400	913.992,33	3,82
Mondelez International Inc. Registered Shares Class A o.N.	US6092071058		STK	3.000	3.000		USD 72,9400	195.767,31	0,82
Newmont Corp. Registered Shares DL 1,60	US6516391066		STK	7.000			USD 42,6600	267.160,38	1,12
Nextera Energy Inc. Registered Shares DL -,01	US65339F1012		STK	3.300	3.300		USD 74,2000	219.064,00	0,92
NXP Semiconductors NV Aandelen aan toonder EO -,20	NL0009538784		STK	1.500			USD 204,8000	274.675,44	1,15
PepsiCo Inc. Registered Shares DL -,0166	US7134481081		STK	2.000	2.000		USD 185,2200	331.414,15	1,39
Pioneer Natural Resources Co. Registered Shares DL -,01	US7237871071		STK	2.000	2.000		USD 207,1800	370.707,17	1,55
Rockwell Automation Inc. Registered Shares DL 1	US7739031091		STK	1.400			USD 329,4500	412.639,42	1,73
ServiceNow Inc. Registered Shares DL-,001	US81762P1021		STK	1.000			USD 561,9700	502.766,46	2,10
Snap Inc. Registered Shares A DL -,00001	US83304A1060		STK	17.000			USD 11,8400	180.075,15	0,75
Splunk Inc. Registered Shares DL -,001	US8486371045		STK	5.200	1.200		USD 106,0900	493.549,78	2,07
Texas Instruments Inc. Registered Shares DL 1	US8825081040		STK	2.000	2.000		USD 180,0200	322.109,79	1,35
Thermo Fisher Scientific Inc. Registered Shares DL 1	US8835561023		STK	700	200		USD 521,7500	326.748,55	1,37
UnitedHealth Group Inc. Registered Shares DL -,01	US91324P1021		STK	1.100	1.100		USD 480,6400	473.005,03	1,98
V.F. Corp. Registered Shares o.N.	US9182041080		STK	6.000			USD 19,0900	102.473,21	0,43
Verizon Communications Inc. Registered Shares DL -,10	US92343V1044		STK	14.000	4.000		USD 37,1900	465.808,47	1,95
Walt Disney Co., The Registered Shares DL -,01	US2546871060		STK	2.500			USD 89,2800	199.685,88	0,84

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DCP
Investmentfonds (F.C.P.)

DCP - 4Plus

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in CHF	% des Teilfonds- vermögens
Sonstige Beteiligungswertpapiere									
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	CH0012032048		STK	1.300			CHF 273,5000	355.550,00	1,49
							CHF	2.165.007,24	9,06
Investmentanteile									
Gruppenfremde Investmentanteile									
Swisscanto(LU)MM-Res. CHF Nam.-Anteile FT o.N.	LU0141249424		ANT	10.619			CHF 140,4700	1.491.611,21	6,24
BNPP InstiCash-EUR 1D Namens-Anteile I Cap.o.N.	LU0094219127		ANT	4.963			EUR 138,9828	673.396,03	2,82
Summe Wertpapiervermögen							CHF	20.574.756,29	86,11
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)							CHF	-2.128.362,21	-8,91 ²⁾
Derivate auf einzelne Wertpapiere							CHF	-1.773.537,09	-7,43
Wertpapier-Optionsrechte									
Optionsrechte auf Aktien									
Alcon Inc CALL 64.00 15.09.2023	EUREX	-370.500	STK	-50	50	CHF	10,7400	-53.700,00	-0,23
Nestle SA CALL 110.00 15.09.2023	EUREX	-538.000	STK	-50	50	CHF	1,3200	-6.600,00	-0,03
adidas AG CALL 160.00 15.12.2023	EUREX	-546.343	STK	-30	30	EUR	27,4800	-80.477,93	-0,34
Anheuser-Busch InBev SA/NV CALL 56.00 15.12.2023	EUREX	-371.655	STK	-70	70	EUR	1,6700	-11.411,78	-0,05
ASML Holding NV PUT 600.00 15.12.2023	EUREX	-543.331	STK	-8	8	EUR	24,1300	-18.844,56	-0,08
Bayer AG CALL 60.00 15.09.2023	EUREX	-311.432	STK	-60	60	EUR	0,1700	-995,72	0,00
Danone SA CALL 56.00 15.09.2023	EUREX	-517.578	STK	-90	90	EUR	1,9200	-16.868,74	-0,07
Deutsche Boerse AG CALL 180.00 15.09.2023	EUREX	-311.801	STK	-18	18	EUR	1,6300	-2.864,17	-0,01
Fresenius SE & Co KGaA CALL 28.00 21.07.2023	EUREX	-181.920	STK	-70	70	EUR	0,0300	-205,00	0,00
Heineken NV PUT 92.00 15.12.2023	EUREX	-318.371	STK	-33	33	EUR	3,4000	-10.952,96	-0,05
Merck KGaA PUT 150.00 15.09.2023	EUREX	-263.916	STK	-17	17	EUR	5,8400	-9.691,71	-0,04
Prosus NV CALL 68.00 15.09.2023	EUREX	-137.492	STK	-20	20	EUR	3,8200	-7.458,17	-0,03
Unilever PLC CALL 50.00 15.09.2023	EUREX	-439.859	STK	-90	90	EUR	0,3000	-2.635,74	-0,01
AbbVie Inc CALL 155.00 17.11.2023	CBOE	-451.786	STK	-30	30	USD	0,8700	-2.335,04	-0,01
Adobe Inc CALL 330.00 20.10.2023	CBOE	-546.571	STK	-10	10	USD	165,8250	-148.355,34	-0,62
Agnico Eagle Mines Ltd PUT 50.00 17.11.2023	CBOE	-369.698	STK	-50	50	USD	3,8700	-17.311,48	-0,07
Alibaba Group Holding Ltd PUT 80.00 18.08.2023	CBOE	-232.912	STK	-25	25	USD	3,2000	-7.157,20	-0,03
Alphabet Inc PUT 120.00 15.12.2023 (Cl. A)	CBOE	-695.736	STK	-52	52	USD	7,6000	-35.356,57	-0,15
Amazon.com Inc CALL 105.00 20.10.2023	CBOE	-990.832	STK	-68	68	USD	28,7000	-174.599,89	-0,73
Analog Devices Inc PUT 160.00 15.09.2023	CBOE	-326.625	STK	-15	15	USD	0,8800	-1.180,94	0,00
Apple Inc CALL 130.00 15.12.2023	CBOE	-650.433	STK	-30	30	USD	65,8500	-176.738,11	-0,74
Apple Inc CALL 165.00 15.09.2023	CBOE	-758.839	STK	-35	35	USD	31,1500	-97.539,22	-0,41
Arista Networks Inc PUT 125.00 15.09.2023	CBOE	-452.859	STK	-25	25	USD	1,0500	-2.348,46	-0,01
Autodesk Inc PUT 190.00 21.07.2023	CBOE	-320.186	STK	-14	14	USD	0,7600	-951,91	0,00
Citigroup Inc CALL 47.50 15.09.2023	CBOE	-566.076	STK	-110	110	USD	1,3200	-12.990,32	-0,05
Coca-Cola Co/The CALL 60.00 17.11.2023	CBOE	-403.867	STK	-60	60	USD	2,6700	-14.332,29	-0,06
Colgate-Palmolive Co CALL 75.00 17.11.2023	CBOE	-301.392	STK	-35	35	USD	4,7000	-14.716,99	-0,06
Danaher Corp CALL 250.00 15.12.2023	CBOE	-268.261	STK	-10	10	USD	13,0000	-11.630,45	-0,05
Dollar General Corp PUT 145.00 17.11.2023	CBOE	-322.613	STK	-17	17	USD	2,5750	-3.916,33	-0,02
Eaton Corp PLC CALL 160.00 21.07.2023	CBOE	-539.474	STK	-24	24	USD	42,1600	-90.524,27	-0,38
Electronic Arts Inc CALL 130.00 15.09.2023	CBOE	-507.405	STK	-35	35	USD	5,5000	-17.222,01	-0,07
Gilead Sciences Inc PUT 75.00 17.11.2023	CBOE	-301.509	STK	-35	35	USD	2,9400	-9.205,95	-0,04
Habro Inc CALL 62.50 21.07.2023	CBOE	-325.787	STK	-45	45	USD	3,2900	-13.245,29	-0,06

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DCP
Investmentfonds (F.C.P.)

DCP - 4Plus

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in CHF	% des Teilfonds- vermögens
Honeywell International Inc CALL 210.00 15.09.2023	CBOE	-278.321	STK	-12		12	USD 5,7100	-6.130,14	-0,03
JPMorgan Chase & Co CALL 130.00 15.09.2023	CBOE	-650.265	STK	-40		40	USD 17,2700	-61.802,42	-0,26
Microsoft Corp CALL 245.00 17.11.2023	CBOE	-1.141.921	STK	-30		30	USD 101,7250	-273.024,81	-1,14
Mondelez International Inc CALL 65.00 15.09.2023	CBOE	-244.587	STK	-30		30	USD 8,8000	-23.618,76	-0,10
Newmont Corp CALL 57.50 15.09.2023	CBOE	-333.784	STK	-70		70	USD 0,1050	-657,57	0,00
NextEra Energy Inc CALL 77.50 15.09.2023	CBOE	-273.694	STK	-33		33	USD 1,3900	-4.103,76	-0,02
NIKE Inc PUT 115.00 21.07.2023 (Cl. B)	CBOE	-271.407	STK	-22		22	USD 5,1000	-10.037,97	-0,04
NXP Semiconductors NV CALL 175.00 21.07.2023	CBOE	-343.173	STK	-15		15	USD 30,4000	-40.796,04	-0,17
Pan American Silver Corp PUT 15.00 21.07.2023	CBOE	-195.563	STK	-120		120	USD 0,7000	-7.515,06	-0,03
PepsiCo Inc CALL 185.00 20.10.2023	CBOE	-414.061	STK	-20		20	USD 7,0000	-12.525,10	-0,05
Pioneer Natural Resources Co CALL 260.00 15.09.2023	CBOE	-463.153	STK	-20		20	USD 0,6250	-1.118,31	0,00
Rockwell Automation Inc CALL 270.00 21.07.2023	CBOE	-515.542	STK	-14		14	USD 60,5000	-75.776,86	-0,32
Salesforce Inc PUT 210.00 17.11.2023	CBOE	-354.206	STK	-15		15	USD 12,5000	-16.774,69	-0,07
Schlumberger NV PUT 42.50 18.08.2023	CBOE	-247.069	STK	-45		45	USD 0,4100	-1.650,63	-0,01
ServiceNow Inc CALL 440.00 17.11.2023	CBOE	-628.145	STK	-10		10	USD 139,4500	-124.758,94	-0,52
Texas Instruments Inc CALL 180.00 21.07.2023	CBOE	-402.437	STK	-20		20	USD 3,8000	-6.799,34	-0,03
Thermo Fisher Scientific Inc CALL 590.00 15.12.2023	CBOE	-408.232	STK	-7		7	USD 10,1500	-6.356,49	-0,03
UnitedHealth Group Inc CALL 500.00 15.12.2023	CBOE	-590.962	STK	-11		11	USD 21,8000	-21.453,71	-0,09
Walt Disney Co/The CALL 100.00 20.10.2023	CBOE	-249.483	STK	-25		25	USD 1,9100	-4.271,95	-0,02
							CHF	-282.788,84	-1,18
Aktienindex-Derivate									
Aktienindex-Terminkontrakte									
EURO STOXX 50 Sep23	EUREX	-5.407.609,10	STK	-120	40	160	EUR 4.427,0000	-48.907,62	-0,20
S&P500 EMINI FUT Sep23	CME	-13.928.423,41	STK	-56		56	USD 4.488,2500	-253.789,84	-1,06
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Aktienindices									
DAX Index PUT 15200.00 15.09.2023	EUREX	2.729.362	STK	33	33		EUR 123,6000	19.908,62	0,08
							CHF	31.402,22	0,13
Sonstige Derivate									
Sonstige Optionsrechte									
CBOE Volatility Index CALL 25.00 18.10.2023	CBOE	592.422	STK	39.000	390		USD 1,5100	52.685,94	0,22
CBOE Volatility Index CALL 40.00 18.10.2023	CBOE	-592.422	STK	-39.000		390	USD 0,6100	-21.283,72	-0,09
							CHF	-103.438,50	-0,43
Devisen-Derivate									
Devisenterminkontrakte									
Offene Positionen									
Banque de Luxembourg EUR/CHF	OTC		Kauf- währung CHF	Kauf- betrag 4.370.908,50	Verkauf- währung EUR	Verkauf- betrag -4.500.000,00	Fälligkeit 24.11.2023	13.405,50	0,06
Banque de Luxembourg USD/CHF	OTC		CHF	10.454.892,00	USD	-12.000.000,00	24.11.2023	-116.844,00	-0,49

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

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

DCP - 4Plus

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in CHF	% des Teilfonds- vermögens
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten							CHF	5.496.510,49	23,01
Kassenbestände							CHF	3.979.560,29	16,66
Verwahrstelle									
			CHF	942.436,47				942.436,47	3,95
			EUR	726.961,57				709.659,88	2,97
			USD	2.366.466,14				2.117.158,93	8,86
Baader Bank AG			EUR	251.868,06				245.873,60	1,03
			USD	-39.756,99				-35.568,59	-0,15
Marginkonten							CHF	1.516.950,20	6,35
Initial Margin Baader Bank AG			EUR	453.499,88				442.706,58	1,86
			USD	862.400,00				771.546,16	3,23
Variation Margin für Future			EUR	50.100,00				48.907,62	0,20
			USD	283.675,00				253.789,84	1,06
Sonstige Vermögensgegenstände							CHF	4.285,91	0,02
Dividendenansprüche			CHF	4.285,91				4.285,91	0,02
Sonstige Verbindlichkeiten							CHF	-53.916,68	-0,23
Verwaltungsvergütung			CHF	-12.927,36				-12.927,36	-0,05
Betreuungsgebühr			CHF	-3.182,17				-3.182,17	-0,01
Zentralverwaltungsvergütung			CHF	-1.836,82				-1.836,82	-0,01
Verwahrstellenvergütung			CHF	-1.540,03				-1.540,03	-0,01
Register- und Transferstellenvergütung			CHF	-244,05				-244,05	0,00
Taxe d'Abonnement			CHF	-2.716,37				-2.716,37	-0,01
Prüfungskosten			CHF	-8.670,26				-8.670,26	-0,04
Sonstige Kosten			CHF	-22.799,62				-22.799,62	-0,10
Teilfondsvermögen							CHF	23.893.273,80	100,00¹⁾
DCP - 4Plus P									
Anzahl Anteile							STK	192.842,306	
Anteilwert							CHF	123,90	

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.

DCP Investmentfonds (F.C.P.)

DCP - 4Plus

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

Euro	(EUR)	per 30.06.2023	1,0243802 : 1 Schweizer Franken (CHF)
US-Dollar	(USD)		1,1177555 : 1 Schweizer Franken (CHF)

Marktschlüssel

Terminbörsen

EUREX	Eurex Deutschland
CME	Chicago Merc. Ex.
CBOE	Chicago - CBOE Opt. Ex.
OTC	Over-the-Counter

DCP
Investmentfonds (F.C.P.)

DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023

	Tageswert in CHF	% Anteil am Teilfondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	140.657.019,34	100,07
1. Anleihen	133.659.402,27	95,09
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	4.565.447,26	3,25
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	4.442.967,10	3,16
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	5.107.977,16	3,63
>= 10 Jahre	119.543.010,75	85,05
2. Derivate	-332.217,87	-0,24
3. Bankguthaben	5.215.597,08	3,71
4. Sonstige Vermögensgegenstände	2.114.237,86	1,51
II. Verbindlichkeiten	-100.553,58	-0,07
III. Teilfondsvermögen	140.556.465,76	100,00

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

DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in CHF	% des Teilfonds- vermögens
Bestandspositionen							CHF	133.659.402,27	95,09
Amtlich gehandelte Wertpapiere							CHF	114.393.047,65	81,38
Verzinsliche Wertpapiere									
4,5325 % Alpiq Holding AG SF-FLR Anl. 2013(18/Und.)	CH0212184037		CHF	4.300	1.100	%	94,1000	4.046.300,00	2,88
2,2000 % Baloise Leben AG SF-Var. Anl. 2017(28/48)	CH0379611004		CHF	1.800		%	94,9500	1.709.100,00	1,22
4,0000 % Helvetia Schweiz. Versicherung SF-FLR Notes 2014(24/44)	CH0255893098		CHF	2.300		%	101,4040	2.332.292,00	1,66
5,0000 % Hero SF-FLR Notes 2023(28/Und.)	CH1268922171		CHF	4.000	4.000	%	100,6770	4.027.080,00	2,86
2,5000 % HOCHDORF Holding AG SF-FLR Anl. 2017(23/Und.)	CH0391647986		CHF	3.215		%	27,0000	868.050,00	0,62
3,5000 % Holcim Helvetia Finance AG SF-FLR Anl. 2018(24/Und.)	CH0398633724		CHF	2.000	340	%	99,7730	1.995.460,00	1,42
4,3750 % Swiss Life AG SF-Var. Anl. 2016(26/46)	CH0316994653		CHF	2.900		%	102,4500	2.971.050,00	2,11
2,0000 % Swiss Life AG SF-Var. Anl. 2018(24/Und.)	CH0404311729		CHF	1.650		%	98,0500	1.617.825,00	1,15
2,6250 % Swiss Life AG SF-Var. Anl. 2018(28/48)	CH0406990801		CHF	1.205		%	94,2500	1.135.712,50	0,81
1,5000 % Zürich Versicherungs-Gesell. AG SF-FLR Med.-Term Nts 22(32/52)	CH1151526204		CHF	2.200	400	%	83,8220	1.844.084,00	1,31
4,3750 % ACCOR S.A. EO-FLR Bonds 2019(24/Und.)	FR0013399177		EUR	300		%	98,8470	289.483,32	0,21
4,2500 % Achmea B.V. EO-FLR Med.-T. Nts 15(25/Und.)	XS1180651587		EUR	3.650		%	97,3150	3.467.459,96	2,47
3,5000 % AG Insurance S.A. EO-FLR Notes 2015(27/47)	BE6277215545		EUR	2.000		%	91,9210	1.794.665,60	1,28
3,2500 % AGEAS SA/NV EO-FLR Notes 2019(29/49)	BE0002644251		EUR	300		%	85,5510	250.544,66	0,18
4,6310 % Ageasfinlux S.A. EO-Conv.FLR Nts 02(Und.) Reg.S	XS0147484074		EUR	2.500		%	82,6780	2.017.756,59	1,43
4,2520 % Allianz SE FLR-Sub.MTN.v.2022(2032/2052)	DE000A30VJZ6		EUR	800	800	%	93,0380	726.589,56	0,52
5,2560 % American International Grp Inc EO-FLR Med.-T.Nts 2007(07/67)	XS0291642154		EUR	1.000		%	91,7640	895.800,17	0,64
2,1250 % Arountown SA EO-FLR Notes 2018(24/Und.)	XS1752984440		EUR	1.400		%	34,2250	467.746,23	0,33
3,3750 % Arountown SA EO-FLR Notes 2019(24/Und.)	XS2055106210		EUR	800	400	%	42,2690	330.103,98	0,23
4,5960 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-FLR Med.-T. Nts 14(25/Und.)	XS1140860534		EUR	400		%	97,4010	380.331,42	0,27
5,5000 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 15(27/47)	XS1311440082		EUR	1.000		%	100,9310	985.288,42	0,70
5,0000 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 16(28/48)	XS1428773763		EUR	800		%	100,1070	781.795,63	0,56
7,0780 % ATF Netherlands B.V. EO-FLR Notes 2016(23/Und.)	XS1508392625		EUR	1.400		%	43,1200	589.312,42	0,42
3,1290 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 03(08/Und.)	XS0181369454		EUR	1.000		%	79,7840	778.851,41	0,55
3,5400 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 03(13/Und.)	XS0179060974		EUR	1.200		%	80,5860	944.016,64	0,67
3,1390 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 04(09/Und.)	XS0203470157		EUR	700		%	81,1130	554.277,57	0,39
4,7740 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Obl. 2007(27/Und.)	ES0214974075		EUR	1.000		%	90,9790	888.137,00	0,63
2,5000 % Bank of Scotland PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2005(35)	XS0211568331		EUR	1.479		%	87,7290	1.266.631,13	0,90
3,9670 % Barclays Bank PLC EO-FLR Med.-Term Nts 2001(40)	XS0122679243		EUR	1.000		%	73,7070	719.527,73	0,51
1,8750 % BAWAG Group AG EO-FLR Med.-Term Nts 20(25/30)	XS2230264603		EUR	800		%	82,2380	642.245,88	0,46
6,0000 % Bqe International à Luxembourg EO-FLR Med.-Term Nts 23(28/33)	XS2582360330		EUR	600	600	%	92,4720	541.627,00	0,38
3,0730 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-FLR Med.-T. Nts 04(14/Und.)	XS0207764712		EUR	1.500		%	77,9310	1.141.143,63	0,81
3,1000 % CNP Assurances S.A. EO-FLR Notes 2004(09/Und.)	FR0010093328		EUR	4.400	400	%	81,4340	3.497.818,32	2,49
3,7281 % CNP Assurances S.A. EO-FLR Notes 2005(11/Und.)	FR0010167247		EUR	2.445		%	94,3970	2.253.076,09	1,60
4,2500 % Crédit Agricole Assurances SA EO-FLR Notes 2015(25/Und.)	FR0012444750		EUR	2.900	700	%	97,5910	2.762.781,69	1,97
3,0690 % Crédit Mutuel Arkéa EO-FLR Notes 2004(14/Und.)	FR0010096826		EUR	1.100	1.100	%	80,6780	866.336,50	0,62
1,2500 % Deutsche Börse AG FLR-Sub.Anl.v.2020(2027/2047)	DE000A289N78		EUR	900		%	88,3080	775.856,43	0,55
2,0000 % Deutsche Börse AG FLR-Sub.Anl.v.2022(2022/2048)	DE000A3MQQV5		EUR	300	300	%	87,9030	257.432,73	0,18
4,6790 % Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.FLR-MTN R35281 17(22/27)	XS1637926137		EUR	1.700		%	78,7200	1.306.389,89	0,93
4,6000 % Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.MTN Reihe 35274 v.17(27)	DE000A2DASM5		EUR	1.100	200	%	78,5170	843.131,25	0,60
3,3750 % ELM B.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2017(27/47)	XS1587893451		EUR	1.000		%	90,3380	881.879,56	0,63
4,5000 % ELM B.V. EO-FLR Med.-T.Nts 16(27/Und.)	XS1492580516		EUR	400		%	95,3950	372.498,40	0,26
1,6250 % EnBW Energie Baden-Württem. AG FLR-Anleihe v.19(27/79)	XS2035564629		EUR	100		%	85,3730	83.341,12	0,06
3,0000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-FLR Notes 2019(24/Und.)	XS1713466495		EUR	1.600	300	%	97,3630	1.520.732,17	1,08
3,6250 % Infineon Technologies AG Sub.-FLR-Nts.v.19(28/unb.)	XS2056730679		EUR	600		%	91,4860	535.851,80	0,38
3,1250 % Landsbankinn hf. EO-FLR Med.-T. Nts 2018(23/28)	XS1876547420		EUR	1.000		%	94,7520	924.969,02	0,66
1,6250 % Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2020(2026/2080)	XS2218405772		EUR	500	500	%	89,4420	436.566,40	0,31
2,8500 % NIBC Bank N.V. EO-FLR Med.T.Nts 2005(35/40)	XS0210781828		EUR	2.307		%	58,5050	1.317.587,24	0,94
4,5000 % NN Group N.V. EO-FLR Bonds 2014(26/Und.)	XS1028950290		EUR	2.500	400	%	96,8890	2.364.576,05	1,68
4,3750 % NN Group N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 14(24/Und.)	XS1076781589		EUR	2.800		%	98,6850	2.697.416,32	1,92
6,2500 % OMV AG EO-FLR Notes 2015(25/Und.)	XS1294343337		EUR	2.600		%	102,8550	2.610.583,33	1,86
5,0000 % Orange S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 14(26/Und.)	XS1115498260		EUR	700		%	99,7860	681.877,65	0,48

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

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

DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in CHF	% des Teilfonds- vermögens
2,2500 % Orsted A/S EO-FLR Secs 2017(2024/3017)	XS1720192696		EUR	1.000	1.000	%	95,8760	935.941,51	0,67
4,2470 % Repsol Intl Finance B.V. EO-FLR Notes 2020(28/Und.)	XS2186001314		EUR	2.900	300	%	90,2410	2.554.704,66	1,82
4,5000 % Repsol Intl Finance B.V. EO-FLR Securities 2015(25/75)	XS1207058733		EUR	1.450		%	98,3340	1.391.907,94	0,99
3,1700 % Rothschild&Co Cont.Finance PLC EO-FLR Notes 2004(14/Und.)	XS0197703118		EUR	5.500		%	69,2690	3.719.121,88	2,65
3,8750 % SCOR SE EO-FLR Notes 2014(25/Und.)	FR0012199123		EUR	200		%	95,1020	185.677,14	0,13
5,8690 % Solvay Finance S.A. EO-FLR Notes 2015(24/Und.)	XS1323897725		EUR	2.500		%	100,1880	2.445.088,14	1,74
3,1250 % SSE PLC EO-FLR Notes 2020(27/Und.)	XS2195190520		EUR	1.000		%	90,9930	888.273,67	0,63
3,8750 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2018(26/Und.)	XS1795406658		EUR	1.800		%	92,6270	1.627.604,59	1,16
2,8800 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Notes 2021(28/Und.)	XS2410367747		EUR	900	900	%	84,3800	741.345,80	0,53
3,3690 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 16(26/Und.)	XS1501166869		EUR	900		%	94,1310	827.016,14	0,59
1,6250 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 21(21/Und.)	XS2290960520		EUR	100		%	83,3430	81.359,44	0,06
2,0000 % TotalEnergies SE EO-FLR Notes 20(30/Und.)	XS2224632971		EUR	1.600	600	%	77,0610	1.203.631,17	0,86
2,2500 % Veolia Environnement S.A. EO-FLR Notes 2020(26/Und.)	FR00140007K5		EUR	1.500	1.500	%	90,6850	1.327.900,46	0,94
3,0000 % Vodafone Group PLC EO-FLR Cap.Sec. 2020(30/80)	XS2225204010		EUR	3.400	600	%	80,9140	2.685.600,39	1,91
2,0200 % Zürcher Kantonalbank EO-FLR Notes 2022(27/28)	CH1170565753		EUR	1.000		%	90,7430	885.833,17	0,63
1,4250 % AEGON N.V. FL-FLR Anleihe 1996(08/Und.)	NL0000121416		NLG	9.400		%	72,2800	3.009.749,55	2,14
0,4960 % AEGON N.V. FL-FLR-Anleihe 1996(11/Und.)	NL0000120889		NLG	4.800	1.300	%	64,3460	1.368.192,33	0,97
3,5150 % AEGON N.V. DL-FLR Nts 2004(14/Und.)	NL0000116168		USD	2.000		400 %	76,0830	1.361.353,12	0,97
3,8750 % Allianz SE DL-Subord. MTN v.16(22/unb.)	XS1485742438		USD	2.600		%	70,1560	1.631.891,70	1,16
5,5250 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. DL-FLR-Notes 1986(91/Und.)	GB0040024555		USD	1.000	1.000	800 %	92,4190	826.826,58	0,59
3,3940 % AXA S.A. DL-FLR Med.-T. Nts 04(09/Und.)	XS0185672291		USD	3.600		%	83,0250	2.674.019,39	1,90
5,5000 % HSBC Bank PLC DL-FLR-Notes 1985(90/Und.)	XS0015190423		USD	1.500		%	95,6150	1.336.808,40	0,95
3,5000 % KBC Ifima S.A. DL-FLR Med.-Term Nts 2005(25)	XS0210976329		USD	5.400		%	94,5010	4.565.447,26	3,25
0,0000 % Lloyds Bank PLC DL-Medium-Term Notes 2012(32)	XS0767581407		USD	800		%	62,4130	446.702,32	0,32
3,7150 % NIBC Bank N.V. DL-FLR Med.T.Nts 2005(15/Und.)	XS0215294512		USD	1.700	1.700	%	77,4540	1.178.001,76	0,84
4,8750 % Prudential PLC DL-Med.-Term Nts 2017(23/Und.)	XS1700429480		USD	4.000		%	87,5070	3.131.525,50	2,23
5,5000 % Rothschilds Continuation Fin. DL-FLR-Notes 1986(91/Und.)	GB0047524268		USD	2.000	400	%	76,5960	1.370.532,23	0,97
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							CHF	19.266.354,62	13,71
Verzinsliche Wertpapiere									
4,6250 % Achmea B.V. EO-FLR Notes 2019(29/Und.)	XS2056490423		EUR	1.500		%	77,8090	1.139.357,19	0,81
4,0320 % BNP Paribas Cardif S.A. EO-FLR Notes 2014(25/Und.)	FR0012329845		EUR	800		%	96,5930	754.352,69	0,54
5,5470 % BNP Paribas Fortis S.A. EO-FLR Conv.Nts 2007(Und.)	BE0933899800		EUR	5.750		%	85,4640	4.797.222,52	3,41
3,7500 % ELM B.V. EO-FLR M.-T. Nts 2020(25/Und.)	XS2182055009		EUR	500	500	%	95,8330	467.760,87	0,33
2,6000 % ELM B.V. EO-FLR Med.-T.Nts 15(25/Und.)	XS1209031019		EUR	500		%	93,1480	454.655,39	0,32
2,2500 % Iberdrola International B.V. EO-FLR Notes 2020(20/Und.)	XS2244941147		EUR	500		%	82,3740	402.067,49	0,29
3,2500 % Iberdrola International B.V. EO-FLR Securit. 2019(24/Und.)	XS1890845875		EUR	400		%	97,2870	379.886,28	0,27
4,1250 % Sogecap S.A. EO-FLR Notes 2014(26/Und.)	FR0012383982		EUR	2.700	400	%	95,3470	2.513.099,02	1,79
4,0000 % Ulmost Group PLC LS-Bonds 2021(31/31)	XS2384717703		GBP	500		%	72,4440	412.025,25	0,29
6,3790 % AXA S.A. DL-FLR Nts 2006(06/Und.) Reg.S	USF0609NAQ19		USD	1.500		%	106,4310	1.428.277,41	1,02
6,1703 % HSB Group Inc. DL-FLR Debts 1997(07/27) Ser.B	US40428NAC39		USD	1.700		%	92,5510	1.407.612,79	1,00
4,8000 % La Mondiale DL-FLR Notes 2018(28/48)	XS1751476679		USD	2.100		%	90,4770	1.699.850,21	1,21
3,2500 % Pershing Square Holdings Ltd. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	XS2250902389		USD	1.100		%	78,4680	772.215,36	0,55
4,2500 % Swiss Re Finance (Lux) S.A. DL-FLR Notes 2019(24/Und.)	XS2049422343		USD	3.200	800	%	92,1440	2.637.972,15	1,88
Summe Wertpapiervermögen							CHF	133.659.402,27	95,09

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

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

DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in CHF	% des Teilfonds- vermögens
Derivate							CHF	-332.217,87	-0,24
<small>(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)</small>									
Devisen-Derivate							CHF	-332.217,87	-0,24
Devisenterminkontrakte									
Offene Positionen			Kauf- währung	Kauf- betrag	Verkauf- währung	Verkauf- betrag	Fälligkeit		
Banque de Luxembourg EUR/CHF	OTC		EUR	47.068.000,00	CHF	-46.199.030,58	11.07.2023	-269.370,16	-0,19
Banque de Luxembourg EUR/CHF	OTC		CHF	83.047.261,50	EUR	-85.500.000,00	24.11.2023	254.704,50	0,18
Banque de Luxembourg EUR/CHF	OTC		EUR	4.691.080,33	CHF	-4.583.232,39	17.07.2023	-7.153,89	0,00
Banque de Luxembourg EUR/CHF	OTC		EUR	8.734.373,21	CHF	-8.557.650,64	20.07.2023	-38.841,76	-0,03
Banque de Luxembourg USD/CHF	OTC		USD	3.492.187,38	CHF	-3.130.267,56	11.07.2023	-8.468,56	-0,01
Banque de Luxembourg USD/CHF	OTC		CHF	23.523.318,00	USD	-27.000.000,00	24.11.2023	-263.088,00	-0,19
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten							CHF	5.215.597,08	3,71
Kassenbestände							CHF	5.215.597,08	3,71
Verwahrstelle									
			CHF	3.967.918,28				3.967.918,28	2,82
			EUR	258.247,90				252.101,60	0,18
			GBP	41.278,42				46.954,20	0,03
			USD	1.060.328,62				948.623,00	0,68
Sonstige Vermögensgegenstände							CHF	2.114.237,86	1,51
Zinsansprüche			CHF	2.114.237,86				2.114.237,86	1,51
Sonstige Verbindlichkeiten							CHF	-100.553,58	-0,07
Verwaltungsvergütung			CHF	-41.069,59				-41.069,59	-0,03
Betreuungsgebühr			CHF	-18.577,48				-18.577,48	-0,01
Zentralverwaltungsvergütung			CHF	-4.650,82				-4.650,82	0,00
Verwahrstellenvergütung			CHF	-7.871,51				-7.871,51	-0,01
Register- und Transferstellenvergütung			CHF	-244,05				-244,05	0,00
Taxe d'Abonnement			CHF	-17.571,74				-17.571,74	-0,01
Prüfungskosten			CHF	-8.670,26				-8.670,26	-0,01
Sonstige Kosten			CHF	-1.898,13				-1.898,13	0,00
Teilfondsvermögen							CHF	140.556.465,76	100,00 ¹⁾
DCP - Hybrid Income IS Acc - CHF									
Anzahl Anteile							STK	747.248,039	
Anteilwert							CHF	94,04	

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

DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“)

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in CHF	% des Teilfonds- vermögens
DCP - Hybrid Income IS Dis hedged - EUR (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund IS Dis hedged - EUR“)									
Anzahl Anteile							STK	536.227,021	
Anteilwert							EUR	89,50	
DCP - Hybrid Income IS Acc hedged - USD (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund IS Acc hedged - USD“)									
Anzahl Anteile							STK	35.757,442	
Anteilwert							USD	99,26	
DCP - Hybrid Income I Acc - CHF (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund I Acc - CHF“)									
Anzahl Anteile							STK	81.140,895	
Anteilwert							CHF	89,93	
DCP - Hybrid Income I Dis hedged - EUR (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund I Dis hedged - EUR“)									
Anzahl Anteile							STK	96.411,155	
Anteilwert							EUR	88,68	
DCP - Hybrid Income I Acc hedged - EUR (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund I Acc hedged - EUR“)									
Anzahl Anteile							STK	47.115,000	
Anteilwert							EUR	100,39	

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.

DCP
Investmentfonds (F.C.P.)

DCP - Prämienstrategie Europa (fusioniert)
Vermögensübersicht zum 14. April 2023 (Datum der Fusion)

	Tageswert in CHF	% Anteil am Teilfondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	814.965,38	103,41
1. Bankguthaben	814.965,38	103,41
II. Verbindlichkeiten	-26.840,99	-3,41
III. Teilfondsvermögen	788.124,39	100,00

DCP
Investmentfonds (F.C.P.)

DCP - Prämienstrategie Europa (fusioniert)
Vermögensaufstellung zum 14. April 2023 (Datum der Fusion)

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 14.04.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in CHF	% des Teilfonds- vermögens
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten							CHF	814.965,38	103,41
Kassenbestände							CHF	814.965,38	103,41
Verwahrstelle			CHF	814.965,38				814.965,38	103,41
Sonstige Verbindlichkeiten							CHF	-26.840,99	-3,41
Verwaltungsvergütung			CHF	-77,74				-77,74	-0,01
Betreuungsgebühr			CHF	-918,13				-918,13	-0,12
Zentralverwaltungsvergütung			CHF	-868,23				-868,23	-0,11
Verwahrstellenvergütung			CHF	-523,33				-523,33	-0,07
Register- und Transferstellenvergütung			CHF	-57,39				-57,39	-0,01
Taxe d'Abonnement			CHF	-100,79				-100,79	-0,01
Prüfungskosten			CHF	-20.740,18				-20.740,18	-2,63
Sonstige Kosten			CHF	-3.555,20				-3.555,20	-0,45
Teilfondsvermögen							CHF	788.124,39	100,00¹⁾
DCP - Prämienstrategie Europa R (fusioniert)									
Anzahl Anteile							STK	7.800,000	
Anteilwert							CHF	101,04	

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.

DCP - Global Opportunities Fund

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023

	Tageswert in USD	% Anteil am Teilfondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	5.113.599,20	100,33
1. Aktien	2.291.186,34	44,96
Belgien	113.108,61	2,22
Bundesrep. Deutschland	129.159,43	2,53
Großbritannien	156.176,30	3,07
Kaimaninseln	108.355,00	2,13
USA	1.784.387,00	35,01
2. Investmentanteile	2.488.793,15	48,83
US-Dollar	2.488.793,15	48,83
3. Derivate	-91.179,77	-1,79
4. Bankguthaben	424.750,48	8,33
5. Sonstige Vermögensgegenstände	49,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-16.755,25	-0,33
III. Teilfondsvermögen	5.096.843,95	100,00

DCP
Investmentfonds (F.C.P.)

DCP - Global Opportunities Fund

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in USD	% des Teilfondsvermögens	
Bestandspositionen							USD	4.779.979,49	93,79	
Amtlich gehandelte Wertpapiere							USD	2.291.186,34	44,96	
Aktien										
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251		STK	2.000	2.000		EUR	51,8300	113.108,61	2,22
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	DE0005810055		STK	700	700		EUR	169,1000	129.159,43	2,54
Unilever PLC Registered Shares LS -,031111	GB00B10RZP78		STK	3.000	3.000		EUR	47,7100	156.176,30	3,06
AbbVie Inc. Registered Shares DL -,01	US00287Y1091		STK	800	800		USD	134,7300	107.784,00	2,12
Alibaba Group Holding Ltd. Reg.Shs (sp.ADRs)/8 DL-,000025	US01609W1027		STK	1.300	1.300		USD	83,3500	108.355,00	2,13
American Electric Power Co.Inc Registered Shares DL 6,50	US0255371017		STK	1.500	1.500		USD	84,2000	126.300,00	2,48
Cisco Systems Inc. Registered Shares DL-,001	US17275R1023		STK	3.000	3.000		USD	51,7400	155.220,00	3,05
Coca-Cola Co., The Registered Shares DL -,25	US1912161007		STK	2.500	2.500		USD	60,2200	150.550,00	2,95
Colgate-Palmolive Co. Registered Shares DL 1	US1941621039		STK	2.000	2.000		USD	77,0400	154.080,00	3,02
Gilead Sciences Inc. Registered Shares DL -,001	US3755581036		STK	1.900	1.900		USD	77,0700	146.433,00	2,87
Johnson & Johnson Registered Shares DL 1	US4781601046		STK	900	900		USD	165,5200	148.968,00	2,92
Newmont Corp. Registered Shares DL 1,60	US6516391066		STK	2.500	2.500		USD	42,6600	106.650,00	2,09
Thermo Fisher Scientific Inc. Registered Shares DL 1	US8835561023		STK	200	200		USD	521,7500	104.350,00	2,05
UnitedHealth Group Inc. Registered Shares DL -,01	US91324P1021		STK	300	300		USD	480,6400	144.192,00	2,83
Verizon Communications Inc. Registered Shares DL -,10	US92343V1044		STK	4.000	4.000		USD	37,1900	148.760,00	2,92
Walmart Inc. Registered Shares DL -,10	US9311421039		STK	1.000	1.000		USD	157,1800	157.180,00	3,08
Walt Disney Co., The Registered Shares DL -,01	US2546871060		STK	1.500	1.500		USD	89,2800	133.920,00	2,63
Investmentanteile							USD	2.488.793,15	48,83	
Gruppenfremde Investmentanteile										
BNPP InstiCash USD 1D S.T.VNAV Namens-Anteile I Cap. o.N.	LU0090884072		ANT	4.997	4.997		USD	165,9716	829.407,39	16,27
ICS-BlackRock ICS USD Liquid. Reg. Shares (Acc.) o.N.	IE0004810143		ANT	5.203	5.203		USD	159,3957	829.288,01	16,27
iShs VII-Core S&P 500 U.ETF Reg. Shares USD (Acc) o.N.	IE00B5BMR087		ANT	1.795	2.245	450	USD	462,4500	830.097,75	16,29
Summe Wertpapiervermögen							USD	4.779.979,49	93,79	
Derivate							USD	-91.179,77	-1,79²⁾	
<small>(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)</small>										
Derivate auf einzelne Wertpapiere							USD	-71.039,77	-1,39	
Wertpapier-Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktien										
Anheuser-Busch InBev SA/NV CALL 56.00 15.09.2023	EUREX	-95.001	STK	-20		20	EUR	0,6900	-1.505,79	-0,03
Deutsche Boerse AG CALL 180.00 15.09.2023	EUREX	-108.482	STK	-7		7	EUR	1,6300	-1.245,00	-0,02
Unilever PLC CALL 48.00 15.09.2023	EUREX	-131.174	STK	-30		30	EUR	0,9800	-3.207,98	-0,06
Alibaba Group Holding Ltd CALL 90.00 15.09.2023	CBOE	-108.355	STK	-13		13	USD	4,0500	-5.265,00	-0,10
American Electric Power Co Inc CALL 92.50 17.11.2023	CBOE	-126.300	STK	-15		15	USD	1,1000	-1.650,00	-0,03
Cisco Systems Inc CALL 50.00 15.09.2023	CBOE	-155.220	STK	-30		30	USD	3,0000	-9.000,00	-0,18
Coca-Cola Co/The CALL 62.50 21.07.2023	CBOE	-150.550	STK	-25		25	USD	0,0800	-200,00	0,00
Colgate-Palmolive Co CALL 75.00 17.11.2023	CBOE	-154.080	STK	-20		20	USD	4,7000	-9.400,00	-0,19
Gilead Sciences Inc CALL 80.00 18.08.2023	CBOE	-146.433	STK	-19		19	USD	1,1900	-2.261,00	-0,05
Johnson & Johnson CALL 160.00 20.10.2023	CBOE	-148.968	STK	-9		9	USD	9,1000	-8.190,00	-0,16
Newmont Corp CALL 47.50 20.10.2023	CBOE	-106.650	STK	-25		25	USD	1,2300	-3.075,00	-0,06
Thermo Fisher Scientific Inc CALL 590.00 15.12.2023	CBOE	-104.350	STK	-2		2	USD	10,1500	-2.030,00	-0,04

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

DCP
Investmentfonds (F.C.P.)

DCP - Global Opportunities Fund

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Gattungsbezeichnung	ISIN Markt	Verpflichtung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in USD	% des Teilfonds- vermögens	
UnitedHealth Group Inc CALL 500.00 15.12.2023	CBOE	-144.192	STK	-3		3	USD 21,8000	-6.540,00	-0,13	
Verizon Communications Inc CALL 39.00 20.10.2023	CBOE	-148.760	STK	-40		40	USD 0,6200	-2.480,00	-0,05	
Walmart Inc CALL 145.00 15.09.2023	CBOE	-157.180	STK	-10		10	USD 14,4500	-14.450,00	-0,28	
Walt Disney Co/The CALL 95.00 21.07.2023	CBOE	-133.920	STK	-15		15	USD 0,3600	-540,00	-0,01	
Aktienindex-Derivate							USD	-20.140,00	-0,40	
Aktienindex-Terminkontrakte										
S&P500 EMINI FUT Sep23	CME	-890.076	STK	-4	1	5	USD 4.488,2500	-20.140,00	-0,40	
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten							USD	424.750,48	8,33	
Kassenbestände							USD	355.330,48	6,97	
Verwahrstelle										
			EUR	25.628,44				27.964,47	0,55	
			USD	327.366,01				327.366,01	6,42	
Marginkonten							USD	69.420,00	1,36	
Initial Margin Banque de Luxembourg S.A.										
			USD	49.280,00				49.280,00	0,96	
Variation Margin für Future										
			USD	20.140,00				20.140,00	0,40	
Sonstige Vermögensgegenstände							USD	49,00	0,00	
Dividendenansprüche										
			USD	49,00				49,00	0,00	
Sonstige Verbindlichkeiten							USD	-16.755,25	-0,33	
Verwaltungsvergütung										
			USD	-3.384,94				-3.384,94	-0,07	
Betreuungsgebühr										
			USD	-676,99				-676,99	-0,01	
Zentralverwaltungsvergütung										
			USD	-1.151,28				-1.151,28	-0,02	
Verwahrstellenvergütung										
			USD	-317,83				-317,83	-0,01	
Register- und Transferstellenvergütung										
			USD	-272,79				-272,79	-0,01	
Taxe d'Abonnement										
			USD	-533,50				-533,50	-0,01	
Prüfungskosten										
			USD	-10.417,92				-10.417,92	-0,20	
Teilfondsvermögen							USD	5.096.843,95	100,00¹⁾	
DCP - Global Opportunities Fund IS Dis - USD										
Anzahl Anteile							STK	50.100,000		
Anteilwert							USD	101,73		

Fußnoten:

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

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

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

DCP
Investmentfonds (F.C.P.)

DCP - Global Opportunities Fund

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

Euro	(EUR)	per 30.06.2023 0,9164643	= 1 US-Dollar (USD)
------	-------	-----------------------------	---------------------

Marktschlüssel

Terminbörsen

EUREX	Eurex Deutschland
CME	Chicago Merc. Ex.
CBOE	Chicago - CBOE Opt. Ex.

Erläuterungen zum Halbjahresbericht (Anhang)
zum 30. Juni 2023

Erläuterung 1 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze

a) Darstellung der Finanzberichte

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

b) Bewertung des Wertpapierbestandes und der Geldmarktinstrumente

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

c) Realisierter Nettogewinn/-verlust aus Wertpapierverkäufen

Die aus Wertpapierverkäufen realisierten Gewinne und Verluste werden auf der Grundlage der Methode der Durchschnittskosten der verkauften Wertpapiere berechnet.

d) Swing Pricing

Das Swing Pricing-Verfahren ist ein Mechanismus, der auf eine Anpassung des Nettoinventarwerts um einen bestimmten Swing Faktor bei den Anteilen eines Teilfonds abzielt.

DCP Investmentfonds (F.C.P.)

Die Anpassung verfolgt den Zweck, die erwarteten Preise, zu denen für den Teilfonds Vermögenswerte gekauft und verkauft werden, sowie die geschätzten Transaktionskosten im Nettoinventarwert angemessen widerzuspiegeln.

Unter normalen Marktbedingungen wird der anzuwendende maximale Swing Faktor 2% des ursprünglichen Nettoinventarwertes je Anteil nicht übersteigen. Bei ungewöhnlichen Marktbedingungen (bspw. in einem Marktumfeld mit extremer Illiquidität oder hoher Marktvolatilität) kann die Verwaltungsgesellschaft die Swing Pricing-Anpassung auf mehr als 2% des ursprünglichen Nettoinventarwertes erhöhen.

Das Swing Pricing-Verfahren, einschließlich der für jeden Teilfonds anwendbaren Swing Faktoren und Schwellenwerte, wird von der Verwaltungsgesellschaft festgelegt.

Im Berichtszeitraum kamen Swing Pricing-Verfahren in Form von Partial Swing Pricing Methoden im Teilfonds DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“) zum Einsatz.

e) Transaktionskosten

Bei Transaktionen, welche nicht direkt mit der Verwahrstelle abgeschlossen werden, werden die Abwicklungskosten dem Teilfonds monatlich gebündelt belastet.

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

f) 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.

g) Zusammengefasster Abschluss

Der zusammengefasste Abschluss erfolgt in Schweizer Franken und stellt die zusammengefasste Finanzlage aller Teilfonds zum Berichtsdatum dar.

h) 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.

i) Dividendenerträge

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

j) Bewertung der Devisentermingeschäfte

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

k) Bewertung der Verbindlichkeiten

Die zum Berichtsstichtag bestehenden Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

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

l) Verkauf von herausgegebenen Optionen

Beim Verkauf von herausgegebenen Optionen werden die erhaltenen Prämien als Verbindlichkeit in der Vermögensaufstellung verbucht und anschließend zum Marktkurs bewertet. Wird eine herausgegebene „Call-Option“ ausgeübt, so werden die erhaltene Prämie in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und die anderen Veränderungen des Nettovermögens als realisierte Werterhöhung aus Optionen ausgewiesen.

m) Bewertung der Terminkontrakte

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

n) 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.

o) 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; ebenso tragen die Teilfonds ihre jeweiligen spezifischen Lancierungskosten. Auch diese können über eine Periode von längstens fünf Jahren nach Lancierungsdatum abgeschrieben werden.

p) 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 in entsprechender Höhe 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:

DCP – 4Plus	CHF	5.212.002,49
-------------	-----	--------------

q) Zusätzliche Informationen zum Bericht

Dieser Bericht wurde auf Basis des Nettoinventarwertes zum 30. Juni 2023 mit den letzten verfügbaren Kursen zum 30. Juni 2023 und unter Berücksichtigung aller Ereignisse, die sich auf die Rechnungslegung zum Berichtsstichtag am 30. Juni 2023 beziehen, erstellt.

Erläuterung 2 – Gebühren und Aufwendungen

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

Erläuterung 3 – Kapitalsteuer („taxe d’abonnement“)

Das Fondsvermögen unterliegt im Großherzogtum Luxemburg einer Steuer („taxe d’abonnement“) von 0,05% p.a., die vierteljährlich auf das jeweils am Quartalsende ausgewiesene Teilfondsvermögen zahlbar ist. Sofern ein Teilfonds oder eine Anteilklasse für die Zeichnung durch institutionelle Anleger beschränkt ist, wird das Nettovermögen dieses Teilfonds bzw. dieser Anteilklasse mit einer reduzierten „taxe d’abonnement“ von jährlich 0,01% besteuert.

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

Erläuterung 4 – Ertragsverwendung

Die vereinnahmten Dividenden- und Zinserträge sowie sonstige ordentliche Erträge werden nach Maßgabe der Verwaltungsgesellschaft für die Anteilklasse „P“ des Teilfonds DCP – 4Plus, für die Anteilklassen „IS Dis hedged – EUR“ und „I Dis hedged – EUR“ des Teilfonds DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“) und für die Anteilklasse „IS Dis – USD“ des Teilfonds DCP – Global Opportunities Fund grundsätzlich ausgeschüttet. Für die Anteilklassen „IS Acc – CHF“, „IS Acc hedged – USD“, „I Acc – CHF“ und „I Acc hedged – EUR“ des Teilfonds DCP – Hybrid Income (ehemals „DCP – Hybrid Income Sustainable Fund“) ist dagegen eine Thesaurierung vorgesehen.

Nach Maßgabe der Verwaltungsgesellschaft können neben den ordentlichen Nettoerträgen die realisierten Kapitalgewinne, die Erlöse aus dem Verkauf von Bezugsrechten und/oder die sonstigen Erträge nicht wiederkehrender Art sowie sonstige Aktiva, jederzeit ganz oder teil-ausgeschüttet werden.

Sofern eine Ausschüttung der Erträge vorgesehen ist, kann abweichend hiervon auf gesonderten Beschluss der Verwaltungsgesellschaft auch eine Thesaurierung der Erträge vorgenommen werden. Sofern eine Thesaurierung der Erträge vorgesehen ist, kann abweichend hiervon auf gesonderten Beschluss der Verwaltungsgesellschaft auch eine Ausschüttung der Erträge vorgenommen werden.

Erläuterung 5 – Rückerstattung von Gebühren

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

Erläuterung 6 – Verwaltungsvergütung von Zielfonds

Sofern der Teilfonds in Anteile eines anderen Investmentfonds (Zielfonds) investiert, können für die erworbenen Zielfondsanteile zusätzliche Verwaltungsvergütungen anfallen.

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

Erläuterung 7 – Wertpapierbestandsveränderungen

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

Erläuterung 8 – Angaben zu den Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365

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

Erläuterung 9 – Weitere Informationen

Mögliche Auswirkungen des Ukraine-Konfliktes

Die Entwicklungen hinsichtlich des Konfliktes im Osten Europas führten auf den globalen Finanzmärkten teilweise zu signifikanten Abschlügen 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.