

Helvetia Allegra Fonds

Geprüfter Jahresbericht per
31. Dezember 2022



Helvetia Allegra Fonds ist ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" gemäss Bundesgesetz über die kollektiven Kapitalanlagen vom 23. Juni 2006 (KAG), welcher in die folgenden Teilvermögen unterteilt ist:

- Helvetia Allegra ONE
- Helvetia Allegra 30
- Helvetia Allegra 50
- Helvetia Allegra 85

Fondsleitung

CACEIS (Switzerland) SA
Route de Signy 35
CH-1260 Nyon

Depotbank

CACEIS Bank, Montrouge, Zweigniederlassung Nyon / Schweiz
Route de Signy 35
CH-1260 Nyon

Inhaltsverzeichnis

Organisation	3
Allgemeine Angaben zum Umbrella-Fonds bzw. zu den Teilvermögen	4
Bericht des Vermögensverwalters.....	5
Performances.....	6
Vergütungen	7
Berechnung der Nettoinventarwerte.....	10
Mitteilung an die Anleger des Anlagefonds.....	12
Helvetia Allegra ONE.....	14
Helvetia Allegra 30.....	27
Helvetia Allegra 50.....	47
Helvetia Allegra 85.....	66

CACEIS (Switzerland) SA**Verwaltungsrat:**

Pierre **Cimino**
Thies **Clemenz**
Yvar **Mentha**
Jacques **Bourachot**
Jean-François **Deroche**
Philippe **Durand**
Marc-André **Poirier**
Jean-Pierre **Valentini**

Präsident (bis 15.03.2022)
Präsident (vom 15.03.2022)
Vizepräsident
Mitglied
Mitglied (bis 13.12.2022)
Mitglied
Mitglied (vom 13.12.2022)
Mitglied

Geschäftsleitung:

Oscar **Garcia**
Sandra **Czich**
Claude **Marchal**
Lionel **Bauer**

Geschäftsführer
Direktorin (bis 30.11.2022)
Vizedirektor
Vizedirektor

Beauftragter Vermögensverwalter:

Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG,
Dufourstrasse 40, CH- 9001 St. Gallen

Depotbank:

CACEIS Bank, Montrouge, Zweigniederlassung Nyon / Schweiz
Route de Signy 35, CH-1260 Nyon

Prüfgesellschaft:

KPMG AG
Esplanade de Pont-Rouge 6,
1211 Genf

Helvetia Allegra Fonds ist ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" gemäss Bundesgesetz über die kollektiven Kapitalanlagen vom 23. Juni 2006 (KAG), welcher in die folgenden Teilvermögen unterteilt ist:

- Helvetia Allegra ONE
- Helvetia Allegra 30
- Helvetia Allegra 50
- Helvetia Allegra 85

Der Fondsvertrag wurde von der CACEIS (Switzerland) SA als Fondsleitung aufgestellt und mit Zustimmung der CACEIS Bank, Paris, succursale de Nyon / Suisse, als Depotbank aufgestellt und wurde erstmals am 09. Mai 2018 von der Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA (die "FINMA") genehmigt.

Die Teilvermögen basieren auf einem Kollektivanlagevertrag (Fondsvertrag), in dem sich die Fondsleitung verpflichtet, den Anleger¹ nach Massgabe der von ihm erworbenen Fondsanteile am entsprechenden Teilvermögen zu beteiligen und dieses gemäss den Bestimmungen von Gesetz und Fondsvertrag selbständig und im eigenen Namen zu verwalten. Die Depotbank nimmt nach Massgabe der ihr durch Gesetz und Fondsvertrag übertragenen Aufgaben am Fondsvertrag teil.

Zurzeit können für die Teilvermögen Anteilsklassen mit den Bezeichnungen A1, A2, E, H1, H2, R1, R2 und I1 eröffnet werden:

Klasse A1	Anteile der A1 Klasse sind thesaurierende Anteile und stehen der Helvetia Schweizerische Lebensversicherungsgesellschaft AG in Verbindung mit neuen Lebensversicherungsverträgen offen.
Klasse A2	Anteile der A2 Klasse sind thesaurierende Anteile und stehen der Helvetia Schweizerische Lebensversicherungsgesellschaft AG ausschliesslich in Verbindung mit bestehenden Lebensversicherungsverträgen offen.
Klasse E	E Anteile der E Klasse sind thesaurierende Anteile, die sich an professionelle Anleger gemäss Art. 10 Abs. 3 und 3ter KAG in Verbindung mit Helvetia Vorsorgelösungen wenden.
Klasse H1	Anteile der H1 Klasse sind thesaurierende Anteile und stehen ausschliesslich den Gruppengesellschaften der Helvetia Holding AG offen.
Klasse H2	Anteile der H2 Klasse sind thesaurierende Anteile und stehen ausschliesslich den Vorsorgeeinrichtungen der Helvetia Gruppe offen.
Klasse R1	Anteile der R1 Klasse sind thesaurierende Anteile, die sich an das gesamte Anlegerpublikum wenden.
Klasse R2	Anteile der R2 Klasse sind thesaurierende Anteile, die sich an das gesamte Anlegerpublikum ausschliesslich mit bestehenden Verträgen mit der Helvetia Gruppe, wenden.
Klasse I1	Anteile der I1 Klasse sind thesaurierende Anteile und stehen qualifizierten Anlegern gemäss Art. 10 Abs. 3 KAG offen. Die Mindestanlage für diese Klasse ist CHF 10 Millionen.

Die Referenzwährung der Klassen A1, A2, E, H1, H2, R1, R2 und I1 entspricht der Rechnungseinheit des jeweiligen Teilvermögens.

Der Anleger ist nur am Vermögen und am Ertrag desjenigen Teilvermögens berechtigt, an dem er beteiligt ist. Für die auf einem einzelnen Teilvermögen entfallenden Verbindlichkeiten haftet nur das entsprechende Teilvermögen.

Gemäss Fondsvertrag steht der Fondsleitung das Recht zu, mit Zustimmung der Depotbank und Genehmigung der Aufsichtsbehörde für jedes Teilvermögen jederzeit verschiedene Anteilsklassen zu schaffen, aufzuheben oder zu vereinigen.

¹ Aus Gründen der einfacheren Lesbarkeit wird auf die geschlechtsspezifische Differenzierung, z.B. Anlegerinnen und Anleger, verzichtet. Entsprechende Begriffe gelten grundsätzlich für beide Geschlechter.

Bericht des Vermögensverwalters

Das Marktgeschehen im Rückblick

Für die Finanzmärkte war das Jahr 2022 eines der schwächsten in der Geschichte. Die restriktivere Geldpolitik, die geopolitischen Krisen und die konjunkturellen Unsicherheiten belasteten die Aktienmärkte. Das US-Börsenbarometer S&P 500 verlor über 18%, so viel wie seit 2008 nicht mehr. Aber auch der Schweizer SMI (-14.3%) und der EuroStoxx 50 (-8.5%) mussten deutlich Federn lassen. Die ausufernden Inflationsraten und die rasanten Zinserhöhungen führten zu einem Anstieg der Renditen für Staatsanleihen. Die 10-jährigen Renditen stiegen in den USA von 1.5% auf 3.9%, in Deutschland von -0.2% auf 2.6% und in der Schweiz von -0.2% auf 1.6% an. Der rasante Anstieg der Anleihen-Renditen spiegelt sich in einer sehr negativen Wertentwicklung bei den Anleihen. Der globale Anleihen-Index Bloomberg Global Aggregate verlor mit über -16.2% so viel wie noch nie seit seiner Lancierung 1990. Während die Schweizer Immobilienpreise auf dem Transaktionsmarkt grösstenteils noch zulegten, verzeichneten kotierte Immobilien aufgrund des tieferen Ausgabeaufschlags ebenfalls grössere Verluste. Zu den wenigen Gewinnern 2022 zählten die Rohstoffe, die von der Inflation und der erhöhten geopolitischen Unsicherheiten profitierten.

Die Allegra Fonds im Jahr 2022

2022 war ein äusserst schwieriges Marktumfeld, welches auch die Wertentwicklung der Allegra-Fonds belastete. Die Korrelation zwischen Aktien- und Anleihenmärkte war so hoch wie seit 1969 nicht mehr und führte dazu, dass sich die Verluste von konservativen Anlagestrategien in einem Rahmen bewegten, den man sonst nur bei aggressiveren Strategien beobachtet.

Dies war teilweise auch bei der Allegra-Fondspalette zu sehen, obschon den Strategien ihre konservative Ausrichtung zugutekam. In einem schwierigen Marktumfeld profitierten die Allegra-Fonds von einem Übergewicht in defensiven Schweizer Immobilien zu Lasten von Anleihen. Die Aktiengewichtung hat während des Jahres wenig variiert. Asset Allokation (Immobilien übergewichtet, Renten untergewichtet) und Selektionseffekte (Schweizer Aktien, Immobilien und Alternative Anlagen), haben bei den meisten Allegra-Fonds zu einer relativen Outperformance gegenüber den entsprechenden Benchmarks geführt.

Performances

	Lancierung	2021	2022	Seit Lancierung*
Helvetia Allegra ONE Klasse A1	01.07.2019	-1.14%	-10.16%	-10.05%
Helvetia Allegra ONE Klasse A2	01.07.2019	-1.43%	-10.43%	-10.98%
Helvetia Allegra ONE Klasse H1	01.07.2019	-0.98%	-10.03%	-9.54%
Helvetia Allegra ONE Klasse R1	01.07.2019	-1.13%	-10.17%	-10.05%
Helvetia Allegra ONE Klasse E	18.01.2022	N/A	-9.09%	-9.09%
Helvetia Allegra 30 Klasse A1	08.08.2018	4.20%	-13.50%	-2.12%
Helvetia Allegra 30 Klasse A2	08.08.2018	3.88%	-13.77%	-3.36%
Helvetia Allegra 30 Klasse H1	02.07.2018	4.67%	-13.11%	1.23%
Helvetia Allegra 30 Klasse R1	08.08.2018	4.20%	-13.50%	-2.12%
Helvetia Allegra 30 Klasse E	18.01.2022	N/A	-11.92%	-11.92%
Helvetia Allegra 50 Klasse A1	08.08.2018	7.53%	-14.35%	0.92%
Helvetia Allegra 50 Klasse A2	08.08.2018	7.21%	-14.61%	-0.41%
Helvetia Allegra 50 Klasse H1	02.07.2018	8.06%	-13.93%	5.27%
Helvetia Allegra 50 Klasse R1	08.08.2018	7.54%	-14.35%	0.99%
Helvetia Allegra 50 Klasse E	18.01.2022	N/A	-12.50%	-12.50%
Helvetia Allegra 85 Klasse A1	01.07.2019	16.48%	-15.68%	7.08%
Helvetia Allegra 85 Klasse A2	01.07.2019	16.13%	-15.93%	5.91%
Helvetia Allegra 85 Klasse R1	01.07.2019	16.48%	-15.68%	7.07%
Helvetia Allegra 85 Klasse E	18.01.2022	N/A	-13.37%	-13.37%

* : bis 31.12.2022

Vergangene Angaben zur Performance sind kein Hinweis auf noch keine Garantie für die aktuelle oder zukünftige Performance und berücksichtigen weder Ausgabe- noch Rücknahmegebühren oder entsprechende - Kommissionen.

Vergütungen

Vergütungen und Nebenkosten zu Lasten der Anleger (Auszug aus § 18 des Fondsvertrags)

Ausgabekommission zugunsten der Fondsleitung und /oder der Depotbank
höchstens **1.50%**

Rücknahmekommission zugunsten der Fondsleitung und /oder der Depotbank
höchstens **1.50%**

Vergütungen und Nebenkosten zulasten des Fondsvermögens (Auszug aus § 19 des Fondsvertrags)

Verwaltungskommission der Fondsleitung
maximal **1.60%** p.a.

Die Kommission wird verwendet für die Leitung, das Asset Management wie auch für die Entschädigung der Depotbank für die von ihr erbrachten Dienstleistungen wie die Aufbewahrung des Vermögens der Teilvermögen bzw. des Umbrella-Fonds, die Besorgung des Zahlungsverkehrs und die sonstigen in § 4 aufgeführten Aufgaben des Umbrella-Fonds.

Zusätzlich können den Teilvermögens bzw. des Umbrella-Fonds die weiteren in § 19 des Fondsvertrags aufgeführten Vergütungen und Nebenkosten in Rechnung gestellt werden.

Die effektiv angewandten Sätze sind jeweils aus dem Jahres- und Halbjahresbericht ersichtlich.

Effektiv zur Anwendung kommende Vergütungen und Nebenkosten zu Lasten des Vermögens der Teilvermögen

Helvetia Allegra ONE

Für Klasse A1
Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds **0.30%**

Für Klasse A2
Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds **0.60%**

Für Klasse H1
Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds **0.15%**

Für Klasse R1
Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds **0.30%**

Für Klasse E
Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds **0.25%**

Für die Klassen A1, A2, H1, R1 und E
Kommission für die Fondsleitung **0.03%**

Für die Klassen A1, A2, H1, R1 und E
Kommission für die Depotbank **0.03%**

Helvetia Allegra 30

<u>Für Klasse A1</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	0.60%
<u>Für Klasse A2</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	0.90%
<u>Für Klasse H1</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	0.15%
<u>Für Klasse R1</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	0.60%
<u>Für Klasse E</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	0.30%
<u>Für die Klassen A1, A2, H1, R1 und E</u> Kommission für die Fondsleitung	0.03%
<u>Für die Klassen A1, A2, H1, R1 und E</u> Kommission für die Depotbank	0.03%

Helvetia Allegra 50

<u>Für Klasse A1</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	0.70%
<u>Für Klasse A2</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	1.00%
<u>Für Klasse H1</u> Kommission für das Asset Management Einsendeschluss der Klasse am 04.11.2019	0.25%
<u>Für Klasse R1</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	0.70%
<u>Für Klasse E</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	0.35%
<u>Für die Klassen A1, A2, H1, R1 und E</u> Kommission für die Fondsleitung	0.03%
<u>Für die Klassen A1, A2, H1, R1 und E</u> Kommission für die Depotbank	0.03%

Helvetia Allegra 85Für Klasse A1

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.80%Für Klasse A2

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

1.10%Für Klasse R1

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.80%Für Klasse E

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.40%Für die Klassen A1, A2, R1 und E

Kommission für die Fondsleitung

0.03%Für die Klassen A1, A2, R1 und E

Kommission für die Depotbank

0.03%**«Soft Commissions»**

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «Soft Commissions» geschlossen.

Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens der entsprechenden Teilvermögen statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt:
Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Klasse am Verkehrswert des Fondsvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Anlagefonds, die der betreffender Klasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.01 gerundet.

Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, von mindestens oder mehr als 2% des Nettofondsvermögens des Teilvermögens, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des jeweiligen Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing).

7. Die Anpassung beläuft sich auf 0.30% des Bewertungs-Nettoinventarwertes des Helvetia Allegra 30 Teilvermögen und jeweils auf 0.25% des Helvetia Allegra 50 Teilvermögen. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (namentlich marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile des Teilvermögens bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss Satz 1 dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettofondsvermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögens für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional

Mitteilung an die Anleger des Anlagefonds

Die aktuelle Version des Fondsvertrags wurde aktualisiert, um die Änderungen des Bundesgesetzes über Finanzdienstleistungen (FinfraG) und seiner Ausführungsverordnung (FinfraV) zu integrieren.

Der Fondsvertrag wurde am 26. August 2022 bei der FINMA genehmigt und trat am 30. August 2022 in Kraft.

Nettoinventarwert pro Anteil am 31.12.22 :**Helvetia Allegra ONE**

Klasse A1 : CHF 89.50

Klasse A2 : CHF 88.81

Klasse H1 : CHF 89.87

Klasse R1 : CHF 89.50

Klasse E : CHF 90.91

Helvetia Allegra 30

Klasse A1 : CHF 97.14

Klasse A2 : CHF 96.23

Klasse H1 : CHF 99.89

Klasse R1 : CHF 97.15

Klasse E : CHF 88.08

Helvetia Allegra 50

Klasse A1 : CHF 99.95

Klasse A2 : CHF 98.63

Klasse H1 : CHF 104.26

Klasse R1 : CHF 100.02

Klasse E : CHF 87.50

Helvetia Allegra 85

Klasse A1 : CHF 106.43

Klasse A2 : CHF 105.36

Klasse R1 : CHF 106.43

Klasse E : CHF 86.63

Vermögensrechnung

	31.12.22	31.12.21
(Börsenwert)	CHF	CHF
Effekten		
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	31'471'419.75	34'499'412.50
Investmentfondsanteile	14'663'793.80	16'840'287.54
Bankguthaben		
Sichtguthaben	503'705.88	717'673.49
Sonstige Vermögenswerte	140'200.88	142'363.47
Gesamtfondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	46'779'120.31	52'199'737.00
Andere Verbindlichkeiten	-51'909.08	-56'075.47
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	46'727'211.23	52'143'661.53

Veränderung des Nettofondsvermögens

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode	52'143'661.53	53'011'378.62
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	-93'117.99	-116'888.25
Saldo aus dem Anteilverkehr	-34'018.13	-162'727.70
Gesamterfolg	-5'289'314.18	-588'101.14
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	46'727'211.23	52'143'661.53

Entwicklung der Anzahl der Anteile**Klasse A1**

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	38'228.333	64'006.333
Ausgegebene Anteile	0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000	25'778.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	38'228.333	38'228.333

Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*

CHF

89.50

99.80

Klasse A2

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	117'983.894	127'954.894
Ausgegebene Anteile	0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000	9'971.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	117'983.894	117'983.894

Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*

CHF

88.81

99.22

* Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Entwicklung der Anzahl der Anteile

Klasse H1		01.01.22	01.01.21
		31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		312'255.334	312'255.334
Ausgegebene Anteile		0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile		0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		312'255.334	312'255.334
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF	89.87	100.13
Klasse R1			
		01.01.22	01.01.21
		31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		53'666.000	13'041.000
Ausgegebene Anteile		11'397.000	52'850.000
Zurückgenommene Anteile		11'816.000	12'225.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		53'247.000	53'666.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF	89.50	99.81
Klasse R2			
			01.01.21
			16.06.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode			6'559.000
Ausgegebene Anteile			173.000
Zurückgenommene Anteile			6'732.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode			0.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF		0.00
Klasse E			
		18.01.22	
		31.12.22	
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		0.000	
Ausgegebene Anteile		10.000	
Zurückgenommene Anteile		0.000	
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		10.000	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF	90.91	

* Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Erfolgsrechnung	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Erträge		
Erträge der Effekten		
Erträge der Obligationen	230'729.71	235'480.56
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen ¹	205'303.72	241'949.92
Ertrag der Bankguthaben		
Sichtguthaben	2'078.52	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	2'065.79	10'194.58
Total Erträge	440'177.74	487'625.06
Aufwendungen		
Reglementarische Vergütungen		
an die Fondsleitung	-14'588.12	-16'062.58
an die Depotbank	-14'843.12	-16'137.58
an die Verwaltung	-134'866.53	-151'354.84
Prüfaufwand	-11'847.00	-11'847.00
Negativzinsen	-3'397.76	-7'784.04
Passivzinsen	0.00	-255.72
Sonstige Aufwendungen	-2'785.06	-7'029.61
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-2'220.07	-12'266.09
Total Aufwendungen	-184'547.66	-222'737.46
Nettoertrag	255'630.08	264'887.60
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-248'049.28	-98'465.63
Realisierter Erfolg	7'580.80	166'421.97
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-5'296'894.98	-754'523.11
Gesamterfolg	-5'289'314.18	-588'101.14
TER * in % : Klasse A1	0.49	0.49
TER * in % : Klasse A2	0.79	0.79
TER * in % : Klasse H1	0.34	0.33
TER * in % : Klasse R1	0.49	0.48
TER * in % : Klasse E	0.21	N/A

¹ Gemäss Kreisschreiben Nr. 24 der Eidgenössischen Steuerverwaltung vom 20.11.2017, Kap. 2.8

* Synthetische TER

Helvetia Allegra ONE

Verwendung des Erfolgs – Klasse A1

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	17'911.61	18'487.80
Vortrag des Vorjahres	145.05	6.85
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	18'056.66	18'494.65
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	18'055.24	18'349.60
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	6'319.33	6'422.36
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	11'735.91	11'927.24
Vortrag auf neue Rechnung	1.42	145.05

Verwendung des Erfolgs – Klasse A2

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	22'211.84	21'498.38
Vortrag des Vorjahres	1'134.46	873.18
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	23'346.30	22'371.56
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	23'337.21	21'237.10
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	8'168.02	7'432.99
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	15'169.19	13'804.12
Vortrag auf neue Rechnung	9.09	1'134.46

Verwendung des Erfolgs – Klasse H1

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	190'550.17	198'865.29
Vortrag des Vorjahres	314.99	1'293.11
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	190'865.16	200'158.40
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	190'850.46	199'843.41
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	66'797.66	69'945.19
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	124'052.80	129'898.22
Vortrag auf neue Rechnung	14.70	314.99

Helvetia Allegra ONE

Verwendung des Erfolgs – Klasse R1

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	24'949.46	26'036.13
Vortrag des Vorjahres	322.32	45.87
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	25'271.78	26'082.00
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	25'271.03	25'759.68
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	8'844.86	9'015.89
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	16'426.17	16'743.79
Vortrag auf neue Rechnung	0.75	322.32

Verwendung des Erfolgs – Klasse E

	18.01.22
	31.12.22
	CHF
Nettoertrag	7.00
Vortrag des Vorjahres	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	7.00
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	7.00
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	2.45
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	4.55
Vortrag auf neue Rechnung	0.00

Inventar des Vermögens

Zinssatz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Anleihen									
0.050	CIBC 0.05 19-26 15/10A5 19-26 15/10A	15.10.26	300'000	0	0	300'000	91.78	275'338.50	0.59
0.180	CIBC 0.18 21-29 20/04A	20.04.29	150'000	0	0	150'000	85.69	128'529.00	0.27
0.100	ROYAL BANK OF CANADA 0.1 18-23 18/07A	18.07.23	250'000	0	0	250'000	99.24	248'093.75	0.53
Kanada								899'962.50	1.92
0.200	LGT BANK AG 0.20 16-26 12/10A	12.10.26	250'000	0	0	250'000	92.68	231'692.50	0.50
0.500	LGT BANK AG 0.50 17-27 12/05A	12.05.27	250'000	0	0	250'000	92.51	231'271.25	0.49
0.625	LGT BANK AG 0.625 15-25 25/11A	25.11.25	250'000	0	0	250'000	96.04	240'103.75	0.51
1.875	LGT BANK AG 1.875 13-23 08/02A	08.02.23	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
0.125	LIECHTENSTEIN LDBANK 0.125 19-26 28/05A	28.05.26	150'000	0	0	150'000	93.01	139'514.25	0.30
Liechtenstein								842'581.75	1.80
0.500	DH SWITZERLAND FIN 0.50 15-23 08/12A	08.12.23	500'000	0	400'000	100'000	98.78	98'779.50	0.21
Luxemburg								98'779.50	0.21
3.125	RABOBANK 3.125 06-26 15/09A	15.09.26	500'000	0	0	500'000	103.69	518'430.00	1.10
0.875	SHELL INT FIN 0.875 15-28 21/08A	21.08.28	250'000	0	0	250'000	92.67	231'683.75	0.50
0.375	SHELL INTL FINANCE 0.375 15-23 21/08A	21.08.23	1'000'000	0	1'000'000	0	0.00	0.00	0.00
Niederlande								750'113.75	1.60
1.500	SPAREBANK 1 SMN 1.5 22-27 15/06A 15/06A	15.06.27	0	300'000	0	300'000	96.18	288'549.00	0.62
Norwegen								288'549.00	0.62
2.955	BAWAG BK 2.955 22-27 29/11A	29.11.27	0	250'000	0	250'000	101.35	253'370.00	0.54
Österreich								253'370.00	0.54
0.625	AAREKRAFTWERK K 0.6250 19-29 03/08A	03.08.29	250'000	0	0	250'000	88.56	221'411.25	0.47
Schweden								221'411.25	0.47
0.300	ABB LTD 0.3000 19-24 06/08A	06.08.24	250'000	0	0	250'000	97.82	244'558.75	0.52
1.500	AEW ENERGIE AG 1.5 22-29 29/06A	29.06.29	0	200'000	0	200'000	95.57	191'142.00	0.41
1.750	AXPO HLDG 1.75 16-24 29/05A	29.05.24	250'000	0	0	250'000	99.22	248'047.50	0.53
0.125	BANK JULIUS BAER CO 0.125 21-28 27/04A	27.04.28	250'000	0	0	250'000	89.11	222'765.00	0.48
0.100	BANQ CANTONALE 0.1000 21-31 18/04A	18.04.31	250'000	0	0	250'000	83.69	209'212.50	0.45
0.400	BC BERNNOISE 0.4 18-27 03/05A	03.05.27	250'000	0	0	250'000	93.17	232'915.00	0.50
0.625	BELL AG 0.625 16-25 24/03A	24.03.25	250'000	0	0	250'000	96.58	241'446.25	0.52
0.125	BQ CANTONALE DE 0.1250 19-26 23/04A	23.04.26	0	200'000	0	200'000	94.12	188'247.00	0.40
0.418	CEMBRA MONEY BA 0.4175 21-28 15/11A	15.11.28	150'000	0	0	150'000	87.25	130'869.00	0.28
0.750	CIE SUISSE REASSURANCE 0.75 15-27 21/01A	21.01.27	250'000	0	0	250'000	95.01	237'512.50	0.51

Helvetia Allegra ONE

Inventar des Vermögens

Zinssatz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %	
Anleihen										
0.750	COOP GRUPPE GEN 06/06A	0.75 18-25	06.06.25	250'000	0	0	250'000	96.81	242'027.50	0.52
0.500	COOP-GRUPPE 19/05A	0.50 16-26	19.05.26	0	200'000	0	200'000	94.64	189'287.00	0.40
1.500	FLUGHAFEN ZUERICH 23 17/04A	1.50 13-	17.04.23	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
0.375	GIVAUDAN SA 09/04A	0.375 18-25	09.04.25	250'000	0	0	250'000	96.96	242'402.50	0.52
0.375	GIVAUDAN SA 07/06A	0.3750 21-30	07.06.30	200'000	0	0	200'000	86.99	173'985.00	0.37
1.250	KRAFTWERKE LINTH L 24 11/09A	1.25 14-	11.09.24	250'000	0	0	250'000	98.35	245'878.75	0.53
2.000	KRAFTWERKE LINTH L 11/12A	2.00 17-23	11.12.23	250'000	0	0	250'000	99.88	249'696.25	0.53
2.375	KRAFTWERKE LINTH L 26 10/12A	2.375 13-	10.12.26	250'000	0	0	250'000	99.38	248'461.25	0.53
0.125	KRAFTWERKE OBERHAS 21-31 21/02A	0.125	21.02.31	150'000	0	0	150'000	82.37	123'559.50	0.26
0.200	KUEHNE NAGEL INTERN 25 18/06A	0.20 19-	18.06.25	250'000	0	0	250'000	95.66	239'151.25	0.51
0.020	KUEHNE NAGEL INTERNATI 19-22 18/11A	0.02	18.11.22	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
1.250	NANT DE DRANCE SA 27 25/06A	1.2500 20-	25.06.27	250'000	0	0	250'000	95.19	237'967.50	0.51
2.000	NANT DE FRANCE 02/02A	2.00 16-26	02.02.26	250'000	0	0	250'000	99.19	247'973.75	0.53
1.625	NESTLE 07/11A	1.625 22-25	07.11.25	0	500'000	0	500'000	99.74	498'677.50	1.07
1.625	NESTLE 15/07A	1.625 22-26	15.07.26	0	250'000	0	250'000	99.49	248'720.00	0.53
2.125	NESTLE 15/07A	2.125 22-30	15.07.30	0	250'000	0	250'000	100.24	250'603.75	0.54
2.250	NESTLE	2.25 22-29 08/11A	08.11.29	0	500'000	0	500'000	101.21	506'037.50	1.08
2.500	NESTLE	2.5 22-34 14/07A	14.07.34	0	250'000	0	250'000	102.52	256'300.00	0.55
0.750	NESTLE LTD. 28/06A	0.75 18-19	28.06.28	750'000	0	0	750'000	93.65	702'341.25	1.51
0.250	NESTLE SA 28/06A	0.2500 18-24	28.06.24	500'000	0	0	500'000	98.26	491'310.00	1.05
0.625	NOVARTIS 13/11A	0.625 15-29	13.11.29	250'000	0	0	250'000	90.75	226'882.50	0.49
0.250	NOVARTIS AG 13/05A	0.25 15-25	13.05.25	500'000	0	0	500'000	97.04	485'195.00	1.04
1.050	NOVARTIS AG 11/05A	1.05 15-35	11.05.35	250'000	0	0	250'000	86.66	216'642.50	0.46
0.000	PSP SWISS PROPERTY 23 01/09A	0.00 16-	01.09.23	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
0.300	RAIFFEISEN SCHWEIZ 22/04A	0.30 16-25	22.04.25	250'000	0	0	250'000	95.95	239'863.75	0.51
0.750	RAIFFEISEN SCHWEIZ 22/04A	0.75 16-31	22.04.31	250'000	0	0	250'000	85.98	214'958.75	0.46
0.350	RAIFFEISEN SUISSE 16/02A	0.35 18-24	16.02.24	250'000	0	0	250'000	98.19	245'475.00	0.52
2.000	RAIFFEISEN SUISSE 21/09A	2.00 10-23	21.09.23	250'000	0	0	250'000	100.14	250'358.75	0.54
1.500	ROCH KA	1.5 22-26 23/06A	23.06.26	0	350'000	0	350'000	99.16	347'075.75	0.74
2.000	ROCH KA	2.0 22-32 23/09A	23.09.32	0	500'000	0	500'000	98.33	491'657.50	1.05
0.500	ROCHE KAPITALMA 27 25/02A	0.5000 22-	25.02.27	0	250'000	0	250'000	94.66	236'655.00	0.51
0.100	ROCHE KAPITALMARKT 24 23/09A	0.10 17-	23.09.24	250'000	0	0	250'000	97.53	243'825.00	0.52
0.450	ROCHE KAPITALMARKT 29 23/03A	0.45 17-	23.03.29	250'000	0	0	250'000	91.00	227'508.75	0.49
1.000	ROCHE KAPITALMARKT A 37 25/02A	1.0 22-	25.02.37	0	150'000	0	150'000	84.34	126'516.75	0.27
0.250	ROCHE KAPITALMARKT AG 18-25 24/09A	0.25	24.09.25	500'000	0	0	500'000	96.32	481'607.50	1.03
0.750	ROCHE KAPITALMARKT AG 18-30 24/09A	0.75	24.09.30	500'000	0	0	500'000	90.47	452'330.00	0.97
1.625	ROCHE KAPITALMARKT AG 12-22 23/09A	1.625	23.09.22	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
2.625	ROMANDE ENERGIE 37 15/07A	2.625 22-	15.07.37	0	150'000	0	150'000	100.05	150'071.25	0.32
0.250	SCHINDLER HOLDI 05/06A	0.2500 18-23	05.06.23	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
0.250	SGS	0.25 15-23 08/05A	08.05.23	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
1.750	SGS	1.75 14-24 27/02A	27.02.24	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
0.200	SIX GROUP AG 28/09A	0.2000 21-29	28.09.29	250'000	0	0	250'000	86.96	217'410.00	0.46
0.375	SWISS PRIME SIT 11/02A	0.3750 21-28	11.02.28	250'000	0	0	250'000	88.84	222'093.75	0.47
0.650	SWISS PRIME SIT 18/12A	0.65 20-29	18.12.29	250'000	0	0	250'000	86.15	215'367.50	0.46

Helvetia Allegra ONE

Inventar des Vermögens

Zinssatz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %	
Anleihen										
1.250	SWISS PRIME SIT 02/04A	1.2500 19-27	02.04.27	250'000	0	0	250'000	94.54	236'352.50	0.51
0.825	SWISS PRIME SITE A 11/05A	0.825 17-26	11.05.26	250'000	0	0	250'000	94.65	236'632.50	0.51
1.000	SWISSCOM 17/04A	1.00 15-35	17.04.35	250'000	0	0	250'000	84.46	211'152.50	0.45
2.625	SWISSCOM 31/08A	2.625 10-22	31.08.22	500'000	0	500'000	0	0.00	0.00	0.00
1.750	SWISSCOM AG 10/07A	1.75 12-24	10.07.24	250'000	0	0	250'000	100.04	250'091.25	0.53
0.125	SWISSCOM AG 15/09A	0.125 16-32	15.09.32	250'000	0	0	250'000	80.91	202'262.50	0.43
0.375	SWISSCOM AG 31/05A	0.375 17-27	31.05.27	250'000	0	0	250'000	93.57	233'917.50	0.50
1.625	SWISSGRID AG 30/01A	1.625 13-25	30.01.25	250'000	0	0	250'000	99.54	248'851.25	0.53
1.250	UBS GROUP INC 23/02A	1.25 16-26	23.02.26	200'000	0	0	200'000	96.87	193'740.00	0.41
0.500	ZURICH CIE ASS. 18/12A	0.5 18-24	18.12.24	500'000	0	0	500'000	97.66	488'310.00	1.04
1.000	ZURICH COMPAGNIE D'ASSUR 18-28 30/10A	1.000 18-28	30.10.28	250'000	0	0	250'000	93.04	232'587.50	0.50
Schweiz								15'366'488.25	32.86	
0.000	KOREA GAS CORPORATION PCT 2019-2023	0.0 28.11.23		250'000	0	0	250'000	98.24	245'608.75	0.53
Südkorea								245'608.75	0.53	
0.375	APPLE INC 0.375 15-24 25/11A		25.11.24	750'000	0	250'000	500'000	97.64	488'187.50	1.04
1.375	AT&T INC 1.375 14-24 04/12A		04.12.24	250'000	0	0	250'000	99.02	247'555.00	0.53
0.500	CITIGROUP INC 0.50 17-24 22/11A		22.11.24	250'000	0	0	250'000	97.21	243'015.00	0.52
0.750	CITIGROUP INC 0.75 19-26 02/04A		02.04.26	250'000	0	0	250'000	95.52	238'798.75	0.51
0.250	COCA-COLA CO 0.25 15-22 22/12A		22.12.22	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
1.000	COCA-COLA CO 1.00 15-28 02/10A		02.10.28	500'000	0	0	500'000	94.24	471'197.50	1.01
0.150	ELI LILLY & CO 0.15 16-24 24/05A		24.05.24	500'000	0	250'000	250'000	97.98	244'942.50	0.52
0.450	ELI LILLY & CO 0.45 16-28 24/01A		24.05.28	250'000	0	0	250'000	91.76	229'398.75	0.49
0.500	GOLDMAN SACHS GROUP 17-24 04/12A	0.500	04.12.24	250'000	0	0	250'000	97.11	242'770.00	0.52
1.000	GOLDMAN SACHS GROUP 18-25 24/11A	1.0000	24.11.25	250'000	0	0	250'000	96.70	241'757.50	0.52
0.500	JPMORGAN CHASE & CO 23 04/12A	0.50 15-	04.12.23	500'000	0	0	500'000	98.93	494'627.50	1.05
0.450	JPMORGAN CHASE CO 11/11A	0.45 16-26	11.11.26	250'000	0	0	250'000	93.57	233'913.75	0.50
0.170	MCDONALD'S CORP 04/10A	0.17 16-24	04.10.24	250'000	0	0	250'000	97.17	242'931.25	0.52
0.250	NESTLE HOLDINGS INC 27 04/10A	0.25 17-	04.10.27	500'000	0	0	500'000	92.60	462'992.50	0.99
0.125	NEW YORK LIFE G 23/07A	0.1250 21-30	23.07.30	250'000	0	0	250'000	83.33	208'330.00	0.45
0.125	NEW YORK LIFE GLB 11/09A	0.125 20-29	11.09.29	250'000	0	0	250'000	85.53	213'825.00	0.46
1.000	VERIZON COMM 1 17-27 30/11A		30.11.27	250'000	0	0	250'000	93.68	234'205.00	0.50
0.375	VERIZON COMMUNICATION 17-23 31/05A	0.375	31.05.23	500'000	0	500'000	0	0.00	0.00	0.00
0.500	WELLS FARGO 0.50 15-23 02/11A		02.11.23	500'000	0	0	500'000	98.75	493'752.50	1.05
1.250	WELLS FARGO 1.25 14-24 03/09S		03.09.24	250'000	0	0	250'000	98.74	246'845.00	0.53
Vereinigte Staaten von Amerika								5'479'045.00	11.71	
0.250	ANZ NEW ZEALAND INTL 25/10A	0.25 16-23	25.10.23	250'000	0	0	250'000	98.83	247'080.00	0.52
1.000	LLOYDS BANKING GROUP 18-25 04/09A	1.00	04.03.25	250'000	0	0	250'000	97.34	243'337.50	0.52

Inventar des Vermögens

Zins- satz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Anleihen									
0.375	WESTPAC SECURITIES 0.375 16- 24 05/02A	05.02.24	250'000	0	0	250'000	98.27	245'673.75	0.53
	<i>Vereinigtes Königreich</i>							736'091.25	1.57
	Schweizer Franken							31'237'213.50	66.77
Die an einer Börse gehandelten Effekten								31'237'213.50	66.77
0.250	SWISS LIFE HOLD 0.2500 19-23 11/10A	11.10.23	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
0.750	ZURICH INSURANCE 0.75 19-27 24/01A	22.10.27	250'000	0	0	250'000	93.68	234'206.25	0.50
	<i>Schweiz</i>							234'206.25	0.50
	Schweizer Franken							234'206.25	0.50
Nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt, bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern								234'206.25	0.50
Anleihen								31'471'419.75	67.27
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere								31'471'419.75	67.27

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Anteile in Investmentfonds							
ISHARES CORE EUR CORP BD EUR ETF	140'000	10'000	0	150'000	4.63	686'302.44	1.47
SSGA SPDR BLOOM BARCLAYS EU CORPO BD	12'000	2'000	0	14'000	50.75	701'610.87	1.50
<i>Irland</i>						1'387'913.31	2.97
DB X-T II IBOX LIQ CORP -IC	5'000	0	0	5'000	140.67	694'498.27	1.48
<i>Luxemburg</i>						694'498.27	1.48
Euro						2'082'411.58	4.45
UBS - BARCLAYS MSCI US LIQUID CORP SUST	330'000	0	0	330'000	11.66	3'847'800.00	8.23
UBS-BLOOMB BAR MSCI EURO AREA LIQ-A H C	350'000	0	0	350'000	12.26	4'289'425.00	9.17
<i>Luxemburg</i>						8'137'225.00	17.40
Schweizer Franken						8'137'225.00	17.40
CON DBX USD COR -1D- USD	60'000	0	0	60'000	12.60	699'195.09	1.49
ISHARES PLC-ISHARES USD CORP BOND UCIT	150'000	0	0	150'000	5.31	737'152.59	1.58
<i>Irland</i>						1'436'347.68	3.07
US Dollar						1'436'347.68	3.07
Die an einer Börse gehandelten Effekten						11'655'984.26	24.92
SPDR PORTFOLIO CORPORATE BOND ETF	25'000	0	0	25'000	28.38	656'449.54	1.40
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>						656'449.54	1.40
US Dollar						656'449.54	1.40
Die an einem anderen geregelten Markt gehandelt Werden						656'449.54	1.40
HELVETIA CH SWISS PROPERTY FUND	14'800	21'376	14'800	21'376	110.00	2'351'360.00	5.03
<i>Schweiz</i>						2'351'360.00	5.03
Schweizer Franken						2'351'360.00	5.03
Nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt, bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						2'351'360.00	5.03
Anteile in Investmentfonds						14'663'793.80	31.35

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2022	Verkehrswert	in %
Bankguthaben Sichtguthaben			
CACEIS Bank, Montrouge, Zweigniederlassung Nyon / Schweiz	503'705.88	503'705.88	1.08
Bankguthaben Sichtguthaben		503'705.88	1.08

Wechselkurs

1 EUR	=	CHF	0.98745
1 USD	=	CHF	0.92523

Angaben früherer Jahre

Datum	Klasse	Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*		Anteile im Umlauf	Nettofondsvermögen	
31.12.20	A1	CHF	101.17	64'006.333	CHF	6'475'575.02
31.12.21	A1	CHF	99.80	38'228.333	CHF	3'815'378.58
31.12.22	A1	CHF	89.50	38'228.333	CHF	3'421'305.78
31.12.20	A2	CHF	100.77	127'954.894	CHF	12'894'411.20
31.12.21	A2	CHF	99.22	117'983.894	CHF	11'706'547.61
31.12.22	A2	CHF	88.81	117'983.894	CHF	10'477'591.48
31.12.20	H1	CHF	101.39	312'255.334	CHF	31'661'045.84
31.12.21	H1	CHF	100.13	312'255.334	CHF	31'265'425.02
31.12.22	H1	CHF	89.87	312'255.334	CHF	28'061'823.18
31.12.20	R1	CHF	101.17	13'041.000	CHF	1'319'366.33
31.12.21	R1	CHF	99.81	53'666.000	CHF	5'356'310.32
31.12.22	R1	CHF	89.50	53'247.000	CHF	4'765'581.74
31.12.20	R2	CHF	100.77	6'559.000	CHF	660'980.23
31.12.22	E	CHF	90.91	10.000	CHF	909.05

* Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Vermögensrechnung

	31.12.22	31.12.21
(Börsenwert)	CHF	CHF
Effekten		
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	8'323'860.39	8'687'796.40
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	39'748'530.75	38'805'434.25
Investmentfondsanteile	35'593'309.92	32'063'166.39
Strukturierte Produkte	5'003'998.90	6'011'364.12
Derivative Finanzinstrumente	112'669.94	22'642.52
Bankguthaben		
Sichtguthaben	2'085'551.21	4'306'204.87
Sonstige Vermögenswerte	404'721.41	346'252.93
Gesamtfondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	91'272'642.52	90'242'861.48
Andere Verbindlichkeiten	-112'191.30	-99'650.37
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	91'160'451.22	90'143'211.11

Veränderung des Nettofondsvermögens

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode	90'143'211.11	74'120'063.82
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	-184'358.02	-245'857.07
Saldo aus dem Anteilverkehr	14'137'358.61	12'826'114.45
Gesamterfolg	-12'935'760.48	3'442'889.92
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	91'160'451.22	90'143'211.12

Entwicklung der Anzahl der Anteile**Klasse A1**

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	70'150.001	37'467.001
Ausgegebene Anteile	25'570.113	32'683.000
Zurückgenommene Anteile	0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	95'720.114	70'150.001
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF 97.14	112.43

Klasse A2

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	24'542.677	47'402.677
Ausgegebene Anteile	0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile	7'383.187	22'860.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	17'159.490	24'542.677
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF 96.23	111.60

* Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Entwicklung der Anzahl der Anteile

Klasse H1		01.01.22	01.01.21
		31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		472'145.028	472'145.028
Ausgegebene Anteile		0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile		0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		472'145.028	472'145.028
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF	99.89	115.28
Klasse R1			
		01.01.22	01.01.21
		31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		223'109.138	89'387.138
Ausgegebene Anteile		155'176.000	221'392.000
Zurückgenommene Anteile		39'368.000	87'670.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		338'917.138	223'109.138
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF	97.15	112.44
Klasse R2			
			01.01.21
			16.06.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode			28'960.000
Ausgegebene Anteile			456.000
Zurückgenommene Anteile			29'416.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode			0.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF		0.00
Klasse E			
		18.01.22	
		31.12.22	
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		0.000	
Ausgegebene Anteile		1'453.959	
Zurückgenommene Anteile		29.190	
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		1'424.769	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF	88.08	

* Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Erfolgsrechnung	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Erträge		
Erträge der Effekten		
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere	206'181.38	184'928.88
Erträge der Obligationen	317'360.43	267'149.78
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen ¹	606'848.67	396'810.77
Ertrag der Bankguthaben		
Sichtguthaben	8'479.24	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	18'772.09	24'394.56
Total Erträge	1'157'641.81	873'283.99
Aufwendungen		
Reglementarische Vergütungen		
an die Fondsleitung	-27'362.52	-24'738.83
an die Depotbank	-27'497.52	-24'813.83
an die Verwaltung	-330'289.43	-269'478.29
Prüfaufwand	-11'847.00	-11'847.00
Negativzinsen	-15'076.30	-25'352.27
Sonstige Aufwendungen	-3'422.25	-3'864.23
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-4'446.25	-3'870.67
Total Aufwendungen	-419'941.27	-363'965.12
Nettoertrag	737'700.54	509'318.87
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-1'099'470.81	796'541.29
Realisierter Erfolg	-361'770.27	1'305'860.16
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-12'573'990.21	2'137'029.76
Gesamterfolg	-12'935'760.48	3'442'889.92
TER * in % : Klasse A1	0.84	0.80
TER * in % : Klasse A2	1.15	1.11
TER * in % : Klasse H1	0.39	0.36
TER * in % : Klasse R1	0.84	0.80
TER * in % : Klasse E	0.51	N/A

¹ Gemäss Kreisschreiben Nr. 24 der Eidgenössischen Steuerverwaltung vom 20.11.2017, Kap. 2.8

* Synthetische TER

Verwendung des Erfolgs – Klasse A1

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	52'913.35	24'200.79
Vortrag des Vorjahres	525.53	175.74
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	53'438.88	24'376.53
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	53'430.97	23'851.00
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	18'700.84	8'347.85
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	34'730.13	15'503.15
Vortrag auf neue Rechnung	7.91	525.53

Verwendung des Erfolgs – Klasse A2

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	4'158.61	300.84
Vortrag des Vorjahres	169.87	359.89
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	4'328.48	660.73
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	4'327.62	490.85
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	1'514.67	171.80
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	2'812.95	319.05
Vortrag auf neue Rechnung	0.86	169.87

Verwendung des Erfolgs – Klasse H1

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	492'130.10	407'840.05
Vortrag des Vorjahres	4'594.85	2'799.52
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	496'724.95	410'639.57
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	496'696.57	406'044.72
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	173'843.80	142'115.65
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	322'852.77	263'929.07
Vortrag auf neue Rechnung	28.38	4'594.85

Verwendung des Erfolgs – Klasse R1

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	187'370.14	76'977.19
Vortrag des Vorjahres	1'296.57	176.49
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	188'666.71	77'153.68
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	188'641.28	75'857.11
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	66'024.45	26'549.99
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	122'616.83	49'307.12
Vortrag auf neue Rechnung	25.43	1'296.57

Verwendung des Erfolgs – Klasse E

	18.01.22
	31.12.22
	CHF
Nettoertrag	1'128.35
Vortrag des Vorjahres	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'128.35
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	1'128.27
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	394.89
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	733.38
Vortrag auf neue Rechnung	0.08

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere							
AMS-OSRAM AG	3'000	0	3'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Österreich</i>						<i>0.00</i>	<i>0.00</i>
ABB LTD REG SHS	8'000	1'500	0	9'500	28.06	266'570.00	0.29
ACCELLERON INDUSTRIES AG	0	475	475	0	0.00	0.00	0.00
ADECCO REG.SHS	1'200	0	0	1'200	30.46	36'552.00	0.04
ALCON - REGISTERED SHS	3'360	0	0	3'360	63.18	212'284.80	0.23
BACHEM HLDG -B- NAM.AKT	60	0	60	0	0.00	0.00	0.00
BALOISE HOLDING REG.SHS	400	0	0	400	142.70	57'080.00	0.06
BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	30	0	0	30	1'829.00	54'870.00	0.06
BKW AG	0	400	0	400	126.50	50'600.00	0.06
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP PARTIZIPSCH	10	5	0	15	9'430.00	141'450.00	0.15
CIE FINANCIERE RICHEMONT NAMEN AKT	2'600	400	0	3'000	119.90	359'700.00	0.39
CLARIANT NAMEN AKT	3'200	4'800	5'600	2'400	14.65	35'160.00	0.04
CREDIT SUISSE GROUP AG REG SHS	11'700	3'342	0	15'042	2.76	41'576.09	0.05
DKSH HOLDING SA	0	600	0	600	70.20	42'120.00	0.05
EMS-CHEM HOLDINGS-NAMEN ACT.	60	0	60	0	0.00	0.00	0.00
GALÉNICA SA	0	600	0	600	75.55	45'330.00	0.05
GEBERIT AG	200	0	0	200	435.50	87'100.00	0.10
GEORG FISCHER LTD	0	800	0	800	56.60	45'280.00	0.05
GEORG FISCHER REG.	40	0	40	0	0.00	0.00	0.00
GIVAUDAN SA REG.SHS	40	0	0	40	2'833.00	113'320.00	0.12
HOLCIM LTD	3'000	1'000	0	4'000	47.88	191'520.00	0.21
IDORSIA REGISTERED	2'500	0	0	2'500	13.42	33'550.00	0.04
JULIUS BAER GROUP NAMEN AKT	1'300	0	0	1'300	53.86	70'018.00	0.08
KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	450	0	0	450	215.20	96'840.00	0.11
LOGITECH NAMEN AKT	1'300	0	0	1'300	57.06	74'178.00	0.08
LONZA GROUP (CHF)	400	0	0	400	453.10	181'240.00	0.20
NESTLE SA REG SHS	12'700	3'300	0	16'000	107.14	1'714'240.00	1.87
NOVARTIS AG REG SHS	10'800	3'300	700	13'400	83.59	1'120'106.00	1.22
PARTNERS GROUP HLDG NAMEN AKT	100	40	0	140	816.80	114'352.00	0.13
ROCHE HOLDING LTD	3'400	800	0	4'200	290.50	1'220'100.00	1.33
SCHINDLER HOLDING SA	400	0	0	400	173.90	69'560.00	0.08
SGS SA REG SHS	30	0	0	30	2'150.00	64'500.00	0.07
SIG GROUP --- REGISTERED SHS	3'000	0	0	3'000	20.20	60'600.00	0.07
SIKA - REGISTERED SHS	800	0	0	800	221.70	177'360.00	0.19
SONOVA HOLDING NAM-AKT	402	0	102	300	219.30	65'790.00	0.07
STRAUMANN HOLDING LTD	0	700	0	700	105.60	73'920.00	0.08
STRAUMANN HOLDING REG	70	0	70	0	0.00	0.00	0.00
SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	200	60	0	260	476.80	123'968.00	0.14
SWISS RE REGS	1'200	500	0	1'700	86.48	147'016.00	0.16
SWISSCOM SHS NOM	130	80	0	210	506.60	106'386.00	0.12
TECAN GROUP NAM.AKT	0	150	0	150	412.40	61'860.00	0.07
TEMENOS AG NAM.AKT	700	0	0	700	50.74	35'518.00	0.04
THE SWATCH GROUP	300	0	0	300	263.00	78'900.00	0.09
UBS GROUP SA	20'100	0	0	20'100	17.21	345'820.50	0.38
VAT GROUP SA	200	0	0	200	252.80	50'560.00	0.06
VONTOBEL HOLDING	0	600	0	600	61.30	36'780.00	0.04

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere							
ZURICH INSURANCE GROUP NAMEN AKT	750	200	0	950	442.30	420'185.00	0.45
<i>Schweiz</i>						8'323'860.39	9.12
Schweizer Franken						8'323'860.39	9.12
Die an einer Börse gehandelten Effekten						8'323'860.39	9.12
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere						8'323'860.39	9.12
Recht							
PATRIMON SW RE RIGHT	0	3'840	3'840	0	0.00	0.00	0.00
<i>Schweiz</i>						0.00	0.00
Schweizer Franken						0.00	0.00
Die an einer Börse gehandelten Effekten						0.00	0.00
CREDIT SUISSE GROUP AG 08.12.22 RIGHT	0	11'700	11'700	0	0.00	0.00	0.00
<i>Schweiz</i>						0.00	0.00
Schweizer Franken						0.00	0.00
Nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt, bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						0.00	0.00
Recht						0.00	0.00
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte						8'323'860.39	9.12

Inventar des Vermögens

Zinssatz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %	
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere										
Anleihen										
0.293	NATIONAL AUSTRALIA BK 0.2925 22-28 03/02A	03.02.28	0	250'000	0	250'000	90.56	226'401.25	0.25	
0.565	NATIONAL AUSTRALIA BK 0.5650 22-31 03/02A	03.02.31	0	250'000	0	250'000	85.97	214'933.75	0.24	
0.065	NATIONAL AUSTRALIA BK 0.065 20-29 29/01A	29.01.29	0	250'000	0	250'000	86.99	217'485.00	0.24	
0.500	WESTPAC BANKING 0.50 18-28 16/05A	16.05.28	250'000	0	0	250'000	90.81	227'015.00	0.24	
<i>Australien</i>								<i>885'835.00</i>	<i>0.97</i>	
0.100	DEUTSCHE BAHN F 0.1000 21-36 28/01A	28.01.36	200'000	0	0	200'000	75.71	151'412.00	0.17	
1.375	DEUTSCHE BAHN FIN 1.375 13-23 24/07A	24.07.23	250'000	0	0	250'000	100.09	250'231.25	0.27	
1.860	EON SE 1.86 22-25 05/12A	05.12.25	0	250'000	0	250'000	99.14	247'857.50	0.27	
0.200	MUENCHENER HYPO 0.2000 19-31 18/06A	18.06.31	250'000	0	0	250'000	85.22	213'061.25	0.23	
0.250	MUENCHENER HYPO 0.25 20-28 18/09A	18.09.28	250'000	0	0	250'000	87.99	219'978.75	0.24	
0.125	MUENCHENER HYPOTHEKE 0.125 19-27 18/11A	18.11.27	200'000	0	0	200'000	89.52	179'031.00	0.20	
<i>Deutschland</i>								<i>1'261'571.75</i>	<i>1.38</i>	
0.250	NORDEA BANK 0.25 15-23 27/11A	27.11.23	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
<i>Finnland</i>								<i>0.00</i>	<i>0.00</i>	
0.366	BFCM 0.366 18-24 10/10A	10.10.24	250'000	0	0	250'000	97.14	242'837.50	0.27	
<i>Frankreich</i>								<i>242'837.50</i>	<i>0.27</i>	
0.143	BANK OF NOVA SCOTIA 0.1425 21-28 25/10A	25.10.28	200'000	0	0	200'000	86.86	173'716.00	0.19	
0.300	BK OF NOVA SCOTIA 0.30 15-22 16/09A	16.09.22	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
0.125	CIBC 0.125 15-25 22/12A	22.12.25	250'000	0	0	250'000	95.30	238'242.50	0.26	
0.200	PROV OF NEW BRUNSWICK 0.2 16-31 07/11A	07.11.31	150'000	0	0	150'000	84.95	127'426.50	0.14	
0.250	PROV OF NEW BRUNSWICK 0.25 17-29 19/01A	19.01.29	250'000	0	0	250'000	90.44	226'087.50	0.25	
0.125	PROV OF NW BRUNSWICK 0.125 19-32 06/12A	06.12.32	250'000	0	0	250'000	82.30	205'752.50	0.23	
0.250	PROVINCE OF MANITOBA 0.25 19-29 15/03A	15.03.29	250'000	0	0	250'000	90.24	225'587.50	0.25	
1.125	QUEBEC (PROV.OF)EMTN 1.125 13-23 22/02A	22.02.23	250'000	0	0	250'000	100.04	250'107.50	0.27	
<i>Kanada</i>								<i>1'446'920.00</i>	<i>1.59</i>	
0.375	LGT BANK IN LIECHTE 0.375 19-28 05/07A	05.07.28	400'000	0	0	400'000	87.91	351'632.00	0.39	
<i>Liechtenstein</i>								<i>351'632.00</i>	<i>0.39</i>	
0.500	DH SWITZERLAND FIN 0.50 15-23 08/12A	08.12.23	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
<i>Luxemburg</i>								<i>0.00</i>	<i>0.00</i>	

Inventar des Vermögens

Zins- satz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %	
Anleihen										
1.500	AUCKLAND COUNCIL 28/11A	1.5 14-25 28.11.25	250'000	0	0	250'000	99.71	249'286.25	0.27	
	<i>Neuseeland</i>							249'286.25	0.27	
0.545	KBN	0.545 22-28 28/04A 28.04.28	0	200'000	0	200'000	93.72	187'447.00	0.21	
1.500	SPAREBANK 1 SMN 1.5 22-27 15/06A 15/06A	15.06.27	0	200'000	0	200'000	96.18	192'366.00	0.21	
	<i>Norwegen</i>							379'813.00	0.42	
2.955	BAWAG BK	2.955 22-27 29/11A 29.11.27	0	250'000	0	250'000	101.35	253'370.00	0.28	
2.875	OESTER.KONTROLLBK 30 25/02A	2.875 05- 30 25/02A 25.02.30	250'000	0	0	250'000	106.86	267'160.00	0.29	
	<i>Österreich</i>							520'530.00	0.57	
0.875	ASIA DEV BK 13/09U	0.875 22-29 13.09.29	0	250'000	0	250'000	94.32	235'806.25	0.26	
	<i>Philippinen</i>							235'806.25	0.26	
0.875	AARGAUISCHE KANTON 15-30 23/01A	0.875 23.01.30	250'000	0	0	250'000	92.08	230'187.50	0.25	
0.250	ALLGEMEINE BAUGENOSSEN 21-31 30/09A	0.25 30.09.31	0	250'000	0	250'000	82.24	205'610.00	0.23	
0.000	BALOISE HOLDING 25/09A	0.000 19-29 25.09.29	250'000	0	0	250'000	84.70	211'757.50	0.23	
0.125	BANQUE DES LETTRES 30 10/12A	0.125 19- 30 10/12A 10.12.30	200'000	0	0	200'000	85.73	171'456.00	0.19	
0.375	BASEL KANTONALBANK 23 10/08A	0.375 15- 23 10/08A 10.08.23	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
0.010	BASELLANDSCHAFT 33 28/01A	0.0100 21- 33 28/01A 28.01.33	200'000	0	0	200'000	80.04	160'088.00	0.18	
0.050	BASELLANDSCHAFT 31 28/01A	0.0500 20- 31 28/01A 28.01.31	250'000	0	0	250'000	84.51	211'270.00	0.23	
1.600	BASELLANDSCHAFT 32 13/05A	1.6000 22- 32 13/05A 13.05.32	0	250'000	0	250'000	95.02	237'547.50	0.26	
1.750	BASL KA	1.75 22-29 21/09A 21.09.29	0	250'000	0	250'000	97.98	244'951.25	0.27	
0.150	BASLER KANTONAL 27 02/04A	0.1500 19- 27 02/04A 02.04.27	150'000	0	0	150'000	92.82	139'225.50	0.15	
0.000	BASLER KANTONALBAN 34 23/08A	0.00 19- 34 23/08A 23.08.34	150'000	0	0	150'000	77.00	115'495.50	0.13	
0.625	BELL AG	0.625 16-25 24.03.25	100'000	0	0	100'000	96.58	96'578.50	0.11	
0.125	BK CANTONALE GRISONS 18-24 29/05A	0.125 29.05.24	250'000	0	0	250'000	97.83	244'562.50	0.27	
1.500	BQ CANTONALE VAUDOIS 14-24 28/03A	1.50 28.03.24	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00	
2.625	BQE LETTRE	2.625 11-31 14.02.31	200'000	0	0	200'000	104.00	207'998.00	0.23	
1.250	CANTON DE GENEVE 23 22/03A	1.25 13- 23 22/03A 22.03.23	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
1.000	CANTON DE ZURICH 03/12A	1.00 12-25 03.12.25	250'000	0	0	250'000	98.46	246'152.50	0.27	
1.500	CANTON OF BERN 15/05A	1.50 13-29 15.05.29	250'000	0	0	250'000	98.00	244'988.75	0.27	
0.200	CANTON OF BERN 26/11A	0.2000 21-36 26/11A 26.11.36	250'000	0	0	250'000	77.84	194'611.25	0.21	
1.750	CANTON OF GENEVA 34 24/05A	1.75 13- 34 24/05A 24.05.34	250'000	0	0	250'000	97.10	242'757.50	0.27	
0.000	CANTON OF ZURIC 10/11A	0.0000 21-33 10.11.33	200'000	0	0	200'000	81.28	162'562.00	0.18	
0.285	CEMBRA MONEY BA 27 19/08A	0.2850 19- 27 19/08A 19.08.27	250'000	0	0	250'000	89.71	224'272.50	0.25	
0.418	CEMBRA MONEY BA 28 15/11A	0.4175 21- 28 15/11A 15.11.28	300'000	0	0	300'000	87.25	261'738.00	0.29	
0.020	CENTRALE DE LETTRES 40 30/01A	0.02 20- 40 30/01A 30.01.40	250'000	0	0	250'000	69.06	172'647.50	0.19	
0.700	CENTRLETTR 05/03A	0.7 19-39 04.03.39	150'000	0	0	150'000	79.58	119'375.25	0.13	

Inventar des Vermögens

Zinssatz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %	
Anleihen										
0.250	CITY OF ZURICH SWITZER 0.25 19-39 26/05A	26.05.39	150'000	0	0	150'000	74.89	112'330.50	0.12	
0.500	CONFEDERATION SUISSE 0.50 16-58 30/05A	30.05.58	100'000	0	0	100'000	73.40	73'399.50	0.08	
0.750	COOP-GRUPPE 0.7500 20-23 05/05A	05.05.23	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
0.500	COOP-GRUPPE GENOSSEN 0.50 17-27 29/09A	29.09.27	250'000	0	0	250'000	92.07	230'162.50	0.25	
0.375	GIVAUDAN SA 0.3750 21-30 07/06A	07.06.30	300'000	0	0	300'000	86.99	260'977.50	0.29	
0.100	GRAUBUNDNER KAN 0.1000 21-31 07/05A	07.05.31	250'000	0	0	250'000	84.36	210'893.75	0.23	
0.375	GRAUBUNDNER KANTONAL 0.375 19-32 28/05A	28.05.32	150'000	0	0	150'000	84.50	126'753.75	0.14	
0.375	JULIUS BAER GR 0.375 17-24 06/12A	06.12.24	200'000	0	0	200'000	96.85	193'705.00	0.21	
0.125	LAFARGE HOLC HELV FIN 0.125 21-27 26/08A	26.08.27	250'000	0	0	250'000	89.45	223'623.75	0.25	
0.010	LINDT & SPRUENG 0.0100 20-28 06/10A	06.10.28	250'000	0	0	250'000	88.64	221'588.75	0.24	
0.250	MIGROS BANK 0.2500 19-27 10/12A	10.12.27	250'000	0	0	250'000	91.72	229'303.75	0.25	
1.625	NESTLE 1.625 22-25 07/11A	07.11.25	0	300'000	0	300'000	99.74	299'206.50	0.33	
2.125	NESTLE 2.125 22-30 15/07A	15.07.30	0	250'000	0	250'000	100.24	250'603.75	0.27	
2.625	NESTLE 2.625 22-35 08/11A	08.11.35	0	150'000	0	150'000	103.63	155'444.25	0.17	
0.625	NOVARTIS 0.625 15-29 13/11A	13.11.29	250'000	0	0	250'000	90.75	226'882.50	0.25	
0.250	NOVARTIS AG 0.25 15-25 13/05A	13.05.25	200'000	0	0	200'000	97.04	194'078.00	0.21	
1.050	NOVARTIS AG 1.05 15-35 11/05A	11.05.35	200'000	0	0	200'000	86.66	173'314.00	0.19	
1.375	PFANDBR SCHWEIZ HYPO 1.375 13-22 15/08A	15.08.22	300'000	0	300'000	0	0.00	0.00	0.00	
2.250	PFANDBR SCHWEIZ HYPO 2.25 10-32 13/08A	13.08.32	250'000	0	0	250'000	100.93	252'327.50	0.28	
0.625	PFANDBRIEF 0.625 14-25 19/03A	19.03.25	0	200'000	0	200'000	97.78	195'567.00	0.21	
0.750	PFANDBRIEF 0.75 18-33 21/06A	21.06.33	250'000	0	0	250'000	86.72	216'807.50	0.24	
0.625	PFANDBRIEF SCH KANTBK 0.625 17-35 25/01A	25.01.35	250'000	0	0	250'000	83.43	208'581.25	0.23	
0.875	PFANDBRIEF SCH KANTBK 0.875 12-22 20/06A	20.06.22	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
0.375	PFANDBRIEF SCHW 0.375 17-28 24/07A	24.07.28	250'000	0	0	250'000	91.71	229'285.00	0.25	
0.000	PFANDBRIEF SCHW 0.0000 20-25 12/08A	12.08.25	0	300'000	300'000	0	0.00	0.00	0.00	
0.100	PFANDBRIEF SCHW 0.1000 19-31 03/12A	03.12.31	250'000	0	0	250'000	83.61	209'017.50	0.23	
0.100	PFANDBRIEF SCHW 0.1000 20-30 12/06A	12.06.30	350'000	0	0	350'000	86.53	302'844.50	0.33	
0.100	PFANDBRIEF SCHW 0.1000 21-31 03/10A	03.10.31	250'000	0	0	250'000	83.94	209'837.50	0.23	
0.100	PFANDBRIEF SCHW 0.1000 21-32 25/06A	25.06.32	0	100'000	0	100'000	82.53	82'528.00	0.09	
0.125	PFANDBRIEF SCHW 0.1250 20-32 23/03A	23.03.32	250'000	0	0	250'000	83.24	208'091.25	0.23	
0.125	PFANDBRIEF SCHW 0.1250 20-35 03/09A	03.09.35	250'000	0	0	250'000	77.13	192'815.00	0.21	
0.125	PFANDBRIEF SCHW 0.1250 21-31 19/03A	19.03.31	250'000	0	0	250'000	85.25	213'115.00	0.23	
0.625	PFANDBRIEF SCHW 0.6250 18-28 09/10A	09.10.28	250'000	0	0	250'000	92.71	231'781.25	0.25	
0.000	PFANDBRIEF SCHW 0.00 20-30 19/07A	19.07.30	350'000	0	0	350'000	85.63	299'712.00	0.33	
0.250	PFANDBRIEF SCHW KA 0.25 16-28 11/02A	11.02.28	200'000	0	0	200'000	91.92	183'839.00	0.20	
0.300	PFANDBRIEF SCHW KA 0.30 16-31 06/06A	06.06.31	250'000	0	0	250'000	86.12	215'311.25	0.24	
0.500	PFANDBRIEF SCHW KA 0.50 16-34 30/03A	30.03.34	250'000	0	0	250'000	83.23	208'078.75	0.23	
0.600	PFANDBRIEF SCHW KA 0.60 16-35 11/12A	11.12.35	250'000	0	0	250'000	82.05	205'126.25	0.22	
0.750	PFANDBRIEF SCHW KA 0.75 14-24 23/09A	23.09.24	250'000	0	0	250'000	98.53	246'325.00	0.27	
1.500	PFANDBRIEF SCHW KA 1.50 14-29 05/02A	05.02.29	200'000	0	0	200'000	97.21	194'412.00	0.21	
1.750	PFANDBRIEF SCHW KA 1.75 11-26 02/09A	02.09.26	250'000	0	0	250'000	99.81	249'518.75	0.27	
2.000	PFANDBRIEF SCHW KA 2.00 10-25 30/10A	30.10.25	0	250'000	0	250'000	100.74	251'840.00	0.28	

Inventar des Vermögens

Zinssatz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %	
Anleihen										
0.500	PFBRF SCHWZ HYPO 29 15/06A	0.50 15- 15.06.29	250'000	0	0	250'000	90.92	227'302.50	0.25	
0.750	PFBRF SCHWZ HYPO 38 18/10A	0.75 17- 18.10.38	250'000	0	0	250'000	80.53	201'321.25	0.22	
0.250	PFBRF SCHWZ KANTBK 26 12/05A	0.25 17- 12.05.26	250'000	0	0	250'000	95.11	237'763.75	0.26	
0.250	PFBRF SCHWZ KANTBK 27 06/12A	0.25 17- 06.12.27	250'000	0	0	250'000	92.25	230'630.00	0.25	
0.650	PFBRF SCHWZ KANTBK 33 15/02A	0.65 18- 15.02.33	250'000	0	0	250'000	86.27	215'672.50	0.24	
1.000	PFBRF SCHWZ KANTBK 23 13/02A	1.00 12- 13.02.23	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
1.250	PFBRF SCHWZ KANTBK 22 03/22A	1.25 12- 03.02.22	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
1.625	RAIFFEISEN SUISSE 07/02A	1.625 14-22 07.02.22	150'000	0	150'000	0	0.00	0.00	0.00	
1.500	ROCH KA 2.0 22-26 23/06A	1.5 22-26 23/06A 23.06.26	0	400'000	0	400'000	99.16	396'658.00	0.43	
2.000	ROCH KA 2.0 22-32 23/09A	2.0 22-32 23/09A 23.09.32	0	100'000	0	100'000	98.33	98'331.50	0.11	
0.500	ROCHE KAPITALMA 27 25/02A	0.5000 22- 25.02.27	0	300'000	0	300'000	94.66	283'986.00	0.31	
0.750	ROCHE KAPITALMA 31 25/02A	0.7500 22- 25.02.31	0	300'000	0	300'000	89.62	268'849.50	0.29	
0.450	ROCHE KAPITALMARKT 29 23/03A	0.45 17- 23.03.29	100'000	0	0	100'000	91.00	91'003.50	0.10	
0.250	ROCHE KAPITALMARKT AG 18-25 24/09A	0.25 24.09.25	100'000	0	0	100'000	96.32	96'321.50	0.11	
1.750	SGS 1.75 14-24 27/02A	1.75 14-24 27/02A 27.02.24	200'000	0	200'000	0	0.00	0.00	0.00	
0.125	SIX GROUP AG 27/11A	0.125 21-26 27.11.26	250'000	0	0	250'000	92.71	231'776.25	0.25	
0.200	SIX GROUP AG 28/09A	0.2000 21-29 28.09.29	250'000	0	0	250'000	86.96	217'410.00	0.24	
0.375	STADLER RAIL AG 20/11A	0.375 19-26 20.11.26	250'000	0	0	250'000	92.36	230'900.00	0.25	
0.500	SUISSE 0.50 17-55 24/05A	0.50 17-55 24/05A 24.05.55	100'000	0	0	100'000	75.17	75'172.50	0.08	
0.000	SWISS CONFEDERATION 24/07U	-39 24.07.39	250'000	0	0	250'000	76.56	191'391.25	0.21	
1.625	SWISSGRID AG 30/01A	1.625 13-25 30.01.25	100'000	0	0	100'000	99.54	99'540.50	0.11	
0.000	SWITZERLAND 22/06U	0.00 16-29 22.06.29	450'000	50'000	0	500'000	90.79	453'962.50	0.50	
1.250	SWITZERLAND 11/06A	1.25 12-24 11.06.24	500'000	0	0	500'000	100.04	500'210.00	0.54	
1.250	SWITZERLAND 28/05A	1.25 14-26 28.05.26	250'000	250'000	0	500'000	99.61	498'032.50	0.55	
4.000	SWITZERLAND 06/01A	4.00 99-49 06.01.49	100'000	0	0	100'000	151.62	151'624.00	0.17	
0.500	SWITZERLAND 27/06A	0.5000 18-32 27.06.32	300'000	100'000	0	400'000	90.56	362'224.00	0.40	
0.500	SWITZERLAND 0.50 15-30 27/05A	0.50 15-30 27/05A 27.05.30	350'000	0	0	350'000	92.84	324'954.00	0.36	
1.250	SWITZERLAND 1.25 12-37 27/06A	1.25 12-37 27/06A 27.06.37	450'000	0	0	450'000	94.90	427'052.25	0.47	
1.500	SWITZERLAND 1.50 12-42 30/04A	1.50 12-42 30/04A 30.04.42	500'000	0	0	500'000	98.13	490'635.00	0.54	
1.500	SWITZERLAND 1.50 13-25 24/07A	1.50 13-25 24/07A 24.07.25	250'000	200'000	0	450'000	100.51	452'313.00	0.50	
3.500	SWITZERLAND 3.50 03-33 08/04A	3.50 03-33 08/04A 08.04.33	400'000	100'000	0	500'000	117.83	589'165.00	0.64	
4.000	SWITZERLAND 4.00 98-23 11/02A	4.00 98-23 11/02A 11.02.23	500'000	0	0	500'000	100.34	501'680.00	0.54	
4.000	SWITZERLAND 4.00 98-28 08/04A	4.00 98-28 08/04A 08.04.28	500'000	250'000	0	750'000	112.76	845'673.75	0.92	
0.250	SWITZERLAND GOVT BOND 21-35 23/06A	0.25 23.06.35	150'000	50'000	0	200'000	84.45	168'909.00	0.19	
0.500	SWITZERLAND REGS 28/06A	0.50 17-45 28.06.45	250'000	0	0	250'000	79.56	198'898.75	0.22	
0.000	SWITZERLAND 0 19-34 26/06U	0 19-34 26/06U 26.06.34	200'000	0	0	200'000	83.15	166'302.00	0.18	
2.250	SWITZERLAND 2.25 11-31 22/06A	2.25 11-31 22/06A 22.06.31	300'000	100'000	0	400'000	105.45	421'814.00	0.46	
2.500	SWITZERLAND 2.50 06-36 08/03A	2.50 06-36 08/03A 08.03.36	400'000	150'000	0	550'000	110.08	605'453.75	0.65	
3.250	SWITZERLAND 3.25 07-27 27/06A	3.25 07-27 27/06A 27.06.27	250'000	100'000	0	350'000	107.88	377'574.75	0.41	
0.000	ZUERCHER KANTON 30 12/03A	0.0000 20- 30 12/03A	350'000	0	0	350'000	85.99	300'968.50	0.33	
1.400	ZUERCHER KANTON 29 25/07A	1.4000 22- 25.07.29	0	250'000	0	250'000	96.03	240'080.00	0.26	
0.250	ZUERCHER KANTONALB 26 27/01A	0.25 17- 27.01.26	250'000	0	0	250'000	95.40	238'508.75	0.26	
0.100	ZUGER KANTONALB 31 14/10A	0.1000 20- 14.10.31	0	250'000	0	250'000	83.41	208'517.50	0.23	
Schweiz								33'008'132.75	36.15	
0.375	APPLE INC 0.375 15-24 25/11A	0.375 15-24 25/11A 25.11.24	250'000	0	0	250'000	97.64	244'093.75	0.27	

Inventar des Vermögens

Zins- satz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Anleihen									
1.000	COCA-COLA CO 1.00 15-28 02/10A	02.10.28	250'000	0	0	250'000	94.24	235'598.75	0.26
	<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>							479'692.50	0.53
	Schweizer Franken							39'062'057.00	42.80
Die an einer Börse gehandelten Effekten								39'062'057.00	42.80
0.550	PFANDBRIEF 08/02A	0.55 19-31 29.01.31	250'000	0	0	250'000	88.62	221'541.25	0.24
0.300	PFANDBRIEFZENTRALE SC 0.3	19-29 05/03A 09.04.29	250'000	0	0	250'000	90.03	225'077.50	0.25
1.450	PFANDBRIEFZENTRALE SC 1.45	22-30 30/04A 30.04.30	0	250'000	0	250'000	95.94	239'855.00	0.26
	<i>Schweiz</i>							686'473.75	0.75
	Schweizer Franken							686'473.75	0.75
Nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt, bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern								686'473.75	0.75
Anleihen								39'748'530.75	43.55
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere								39'748'530.75	43.55

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Anteile in Investmentfonds							
UBS EUR EQU DEFEN PUTWRITE SF ETF A EU	1'700	0	0	1'700	118.51	198'930.53	0.22
<i>Irland</i>						198'930.53	0.22
Euro						198'930.53	0.22
ISHARES COR GLO AGGRE BOND- H ACC CHF ETF	450'000	90'000	0	540'000	4.53	2'443'500.00	2.68
SPDR BLOOMBERG BARCLAYS GBL AGG BDHDG	78'000	15'500	0	93'500	26.93	2'517'955.00	2.76
<i>Irland</i>						4'961'455.00	5.44
DBXT2 GLOB AGG-4C- CAP ETF	145'000	5'000	0	150'000	15.24	2'286'000.00	2.50
UBS-BLOOMB BAR MSCI EURO AREA LIQ-A H C	275'000	37'000	0	312'000	12.26	3'823'716.00	4.19
<i>Luxemburg</i>						6'109'716.00	6.69
INTERSWISS SCHWEIZ. LIEGENSCHAFTEN	4'040	0	0	4'040	161.80	653'672.00	0.72
ISHS CORE SPIE ETF -A-	3'000	10'450	7'450	6'000	131.50	789'000.00	0.86
PATRIMON SW RE	3'840	0	0	3'840	163.80	628'992.00	0.69
SCHRODER IMM PLUS	3'396	0	0	3'396	137.60	467'289.60	0.51
SWISSINVEST RE INV	5'800	0	0	5'800	181.80	1'054'440.00	1.16
UBS PROPERTY FD SWISS RESIDENTIAL ANFOS	7'750	0	0	7'750	75.50	585'125.00	0.64
UBS SXI RE FD - ANTEILE -(CHF) A- DIS-	0	52'000	0	52'000	8.45	439'400.00	0.48
ZKB GOLD ETF -A CHF-	2'700	0	1'850	850	504.00	428'400.00	0.47
<i>Schweiz</i>						5'046'318.60	5.53
Schweizer Franken						16'117'489.60	17.66
ISHARES CORE MSCI WORLD UCITS ETF USD C	0	55'900	6'000	49'900	72.90	3'365'712.57	3.69
ISHARES III CORE MSCI WLD ETF/CAP	37'900	20'600	58'500	0	0.00	0.00	0.00
ISHARES JP MORGAN EM LOC GOVT BD UCITS D	20'000	28'500	0	48'500	43.79	1'965'013.93	2.15
ISHS JPMORGA EM USD SHS USD ETF	15'000	0	11'800	3'200	84.26	249'471.18	0.27
ISHS MSCI EM USD CAP	11'200	13'300	4'000	20'500	28.64	543'220.09	0.60
UBS EQUIT DEFEN PUTWRITE ST ETF A USD	2'200	0	0	2'200	115.22	234'530.59	0.26
VANGUARD GLB SMALL CAP INX USD C	1'100	0	0	1'100	297.33	302'603.09	0.33
WISDOMTREE ENH CMDTY EX AGRI UCITS ETF	0	44'000	0	44'000	11.85	482'414.08	0.53
XTRACKERS MSCI EMERGING MKTS UCITS 1CC	7'490	0	0	7'490	47.88	331'806.52	0.36
XTRACKERS MSCI WORLD INDEX UCITS-1C CAP	37'040	10'000	47'040	0	0.00	0.00	0.00
XTRACKERS MSCI WORLD UCITS ETF 1C	0	47'040	0	47'040	79.91	3'477'902.43	3.81
<i>Irland</i>						10'952'674.48	12.00

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
UBS ETF BUSDEMS A DIS USD	90'000	0	0	90'000	8.64	719'857.30	0.79
<i>Luxemburg</i>						719'857.30	0.79
US Dollar						11'672'531.78	12.79
Die an einer Börse gehandelten Effekten						27'988'951.91	30.67
LEADENHALL ILS FD PLC CL H2	0	9'524	0	9'524	98.89	871'383.41	0.95
<i>Irland</i>						871'383.41	0.95
BLUEORCHARD MICROFINANCE FUND I USD	0	72	0	72	13'942.85	928'823.09	1.02
GLOBAL SENIOR LOAN FUND EB CAP	0	400	0	400	1'180.13	436'755.91	0.48
<i>Luxemburg</i>						1'365'579.00	1.50
LEADL UCITS ILS -A- USD	0	8'176	8'176	0	0.00	0.00	0.00
<i>Vereinigtes Königreich</i>						0.00	0.00
US Dollar						2'236'962.41	2.45
Die an einem anderen geregelten Markt gehandelt Werden						2'236'962.41	2.45
HELVETIA CH SWISS PROPERTY FUND	26'379	41'205	26'379	41'205	110.00	4'532'550.00	4.97
<i>Schweiz</i>						4'532'550.00	4.97
Schweizer Franken						4'532'550.00	4.97
MORGAN STANLEY INV GLB CONV BD -Z-	0	20'700	0	20'700	43.59	834'845.60	0.91
<i>Luxemburg</i>						834'845.60	0.91
US Dollar						834'845.60	0.91
Nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt, bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						4'532'550.00	4.97
Anteile in Investmentfonds						35'593'309.92	39.00

Inventar des Vermögens

Zins- satz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Strukturierte Produkte									
0.000	CITIGROUP GLOBAL MARKE 0.00 21-22 16/12U	16.12.22	8'600	0	8'600	0	0.00	0.00	0.00
0.000	CITIGROUP GLOBAL MARKE 0.00 22-23 12/12U	12.12.23	0	8'600	0	8'600	318.40	2'533'497.39	2.77
	<i>Luxemburg</i>							2'533'497.39	2.77
0.000	UBS LONDON PERLES 2013 13- XX 31/12U	31.12.99	8'383	0	0	8'383	318.52	2'470'501.51	2.71
	<i>Vereinigtes Königreich</i>							2'470'501.51	2.71
	US Dollar							5'003'998.90	5.48
	Die an einem anderen geregelten Markt gehandelt Werden							5'003'998.90	5.48
	Strukturierte Produkte							5'003'998.90	5.48

Inventar des Vermögens

Derivative Finanzinstrumente

	Kurs	Käufe	Devisen	Verkäufe	Devisen	Verfall	Verkehrswert	in %
Devisentermingeschäfte *								
	1.039	1'347'210.20	CHF	1'400'000.00	USD	15.05.23	71'276.63	0.08
	1.065	2'160'111.70	CHF	2'300'000.00	USD	10.02.23	41'393.31	0.05
	1.020	2'746'030.00	CHF	2'800'000.00	USD	14.11.22	0.00	0.00
	1.096	4'381'108.80	CHF	4'800'000.00	USD	10.08.22	0.00	0.00
	1.083	484'783.43	CHF	525'000.00	USD	13.05.22	0.00	0.00
	1.088	1'172'050.13	CHF	1'275'000.00	USD	11.02.22	0.00	0.00
	1.091	1'168'540.05	CHF	1'275'000.00	USD	13.05.22	0.00	0.00
	0.919	1'275'000.00	USD	1'171'551.60	CHF	11.02.22	0.00	0.00
Devisentermingeschäfte							112'669.94	0.12
Devisentermingeschäfte							112'669.94	0.12
Derivative Finanzinstrumente							112'669.94	0.12

* Identität der Vertragspartner bei OTC-Geschäften: Zürcher Kantonalbank

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2022	Verkehrswert	in %
Bankguthaben Sichtguthaben			
CACEIS Bank, Montrouge, Zweigniederlassung Nyon / Schweiz	2'085'551.21	2'085'551.21	2.28
Bankguthaben Sichtguthaben		2'085'551.21	2.28

Wechselkurs

1 EUR	=	CHF	0.98745
1 USD	=	CHF	0.92523

Derivate unter Anwendung des Commitment-Ansatzes I

Engagement-reduzierende Positionen	
Devisentermingeschäfte	3'423'345.05
Total in CHF	3'423'345.05
Total in % des Nettofondsvermögens	3.76

Angaben früherer Jahre

Datum	Klasse	Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*		Anteile im Umlauf	Nettofondsvermögen	
31.12.20	A1	CHF	108.13	37'467.001	CHF	4'051'378.55
31.12.21	A1	CHF	112.43	70'150.001	CHF	7'887'066.01
31.12.22	A1	CHF	97.14	95'720.114	CHF	9'298'097.33
31.12.20	A2	CHF	107.55	47'402.677	CHF	5'097'979.13
31.12.21	A2	CHF	111.60	24'542.677	CHF	2'738'966.20
31.12.22	A2	CHF	96.23	17'159.490	CHF	1'651'322.33
31.12.20	H1	CHF	110.54	472'145.028	CHF	52'190'371.23
31.12.21	H1	CHF	115.28	472'145.028	CHF	54'430'062.66
31.12.22	H1	CHF	99.89	472'145.028	CHF	47'160'211.08
31.12.20	R1	CHF	108.14	89'387.138	CHF	9'666'615.05
31.12.21	R1	CHF	112.44	223'109.138	CHF	25'087'116.24
31.12.22	R1	CHF	97.15	338'917.138	CHF	32'925'323.24
31.12.20	R2	CHF	107.52	28'960.000	CHF	3'113'719.86
31.12.22	E	CHF	88.08	1'424.769	CHF	125'497.24

* Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Vermögensrechnung

	31.12.22	31.12.21
(Börsenwert)	CHF	CHF
Effekten		
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	23'438'937.80	33'980'251.67
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	44'277'997.25	48'835'535.75
Investmentfondsanteile	74'759'954.92	76'343'925.79
Strukturierte Produkte	15'384'190.70	10'619'285.77
Derivative Finanzinstrumente	267'152.43	90'742.76
Bankguthaben		
Sichtguthaben	2'362'675.85	7'188'227.39
Sonstige Vermögenswerte	639'995.77	665'680.01
Gesamtfondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	161'130'904.72	177'723'649.14
Andere Verbindlichkeiten	-382'992.14	-420'896.15
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	160'747'912.58	177'302'752.99

Veränderung des Nettofondsvermögens

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode	177'302'752.99	159'607'715.79
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	-372'771.31	-502'055.76
Saldo aus dem Anteilverkehr	10'062'024.56	6'258'664.22
Gesamterfolg	-26'244'093.66	11'938'428.74
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	160'747'912.58	177'302'752.99

Entwicklung der Anzahl der Anteile**Klasse A1**

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	551'225.531	506'920.531
Ausgegebene Anteile	75'632.461	44'305.000
Zurückgenommene Anteile	0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	626'857.992	551'225.531

Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*

CHF 99.95 116.95

Klasse A2

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	855'777.952	899'571.952
Ausgegebene Anteile	0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile	48'545.364	43'794.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	807'232.588	855'777.952

Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*

CHF 98.63 115.76

* Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Entwicklung der Anzahl der Anteile

Klasse H1		01.01.22	01.01.21
		31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		10.000	10.000
Ausgegebene Anteile		0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile		0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		10.000	10.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF	104.26	121.41
Klasse R1			
		01.01.22	01.01.21
		31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		117'693.216	22'375.216
Ausgegebene Anteile		79'018.000	117'127.000
Zurückgenommene Anteile		13'925.000	21'809.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		182'786.216	117'693.216
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF	100.02	117.04
Klasse R2			
			01.01.21
			13.07.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode			41'040.000
Ausgegebene Anteile			333.000
Zurückgenommene Anteile			41'373.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode			0.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF		0.00
Klasse E			
		18.01.22	
		31.12.22	
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		0.000	
Ausgegebene Anteile		2'193.113	
Zurückgenommene Anteile		29.891	
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		2'163.222	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF	87.50	

* Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Erfolgsrechnung	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Erträge		
Erträge der Effekten		
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere	611'872.61	615'966.44
Erträge der Obligationen	412'123.86	425'717.42
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen ¹	1'275'377.96	1'048'439.74
Ertrag der Bankguthaben		
Sichtguthaben	11'001.76	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	20'901.24	22'948.95
Total Erträge	2'331'277.43	2'113'072.55
Aufwendungen		
Reglementarische Vergütungen		
an die Fondsleitung	-49'854.39	-50'926.03
an die Depotbank	-50'064.39	-51'001.03
an die Verwaltung	-1'424'958.82	-1'492'325.50
Prüfaufwand	-11'847.00	-11'847.00
Negativzinsen	-12'404.50	-19'223.82
Passivzinsen	-461.28	-332.13
Sonstige Aufwendungen	-3'493.93	-4'511.23
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	1'673.69	-813.26
Total Aufwendungen	-1'551'410.62	-1'630'980.00
Steuerliche Anpassungen wegen Erträgen aus Zielfonds	495'511.15	566'347.19
Nettoertrag	1'275'377.96	1'048'439.74
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-1'844'635.47	3'011'735.49
Realisierter Erfolg	-569'257.51	4'060'175.23
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-25'674'836.15	7'878'253.51
Gesamterfolg	-26'244'093.66	11'938'428.74
TER * in % : Klasse A1	0.96	0.92
TER * in % : Klasse A2	1.26	1.22
TER * in % : Klasse H1	0.48	0.42
TER * in % : Klasse R1	0.96	0.92
TER * in % : Klasse E	0.59	N/A

¹ Gemäss Kreisschreiben Nr. 24 der Eidgenössischen Steuerverwaltung vom 20.11.2017, Kap. 2.8

* Synthetische TER

Helvetia Allegra 50

Verwendung des Erfolgs – Klasse A1	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	497'103.99	381'206.28
Vortrag des Vorjahres	1'952.49	1'091.82
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	499'056.48	382'298.10
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	499'041.65	380'345.62
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	174'664.58	133'120.97
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	324'377.07	247'224.65
Vortrag auf neue Rechnung	14.83	1'952.49

Verwendung des Erfolgs – Klasse A2	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	631'708.02	585'775.43
Vortrag des Vorjahres	6'666.95	2'820.53
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	638'374.97	588'595.96
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	638'359.53	581'929.01
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	223'425.84	203'675.15
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	414'933.69	378'253.85
Vortrag auf neue Rechnung	15.44	6'666.95

Verwendung des Erfolgs – Klasse H1	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	8.27	7.18
Vortrag des Vorjahres	0.08	0.10
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	8.35	7.28
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	8.35	7.20
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	2.92	2.52
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	5.43	4.68
Vortrag auf neue Rechnung	0.00	0.08

Helvetia Allegra 50

Verwendung des Erfolgs – Klasse R1	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	145'055.99	81'450.85
Vortrag des Vorjahres	417.93	175.40
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	145'473.92	81'626.25
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	145'461.27	81'208.32
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	50'911.44	28'422.91
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	94'549.83	52'785.41
Vortrag auf neue Rechnung	12.65	417.93

Verwendung des Erfolgs – Klasse E	18.01.22
	31.12.22
	CHF
Nettoertrag	1'501.70
Vortrag des Vorjahres	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1501.70
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	1'501.49
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	525.52
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	975.97
Vortrag auf neue Rechnung	0.21

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere							
AMS-OSRAM AG	11'000	0	11'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Österreich</i>						<i>0.00</i>	<i>0.00</i>
ABB LTD REG SHS	24'000	0	0	24'000	28.06	673'440.00	0.42
ACCELLERON INDUSTRIES AG	0	1'200	1'200	0	0.00	0.00	0.00
ADECCO REG.SHS	4'200	0	0	4'200	30.46	127'932.00	0.08
ALCON - REGISTERED SHS	10'180	0	680	9'500	63.18	600'210.00	0.37
BACHEM HLDG -B- NAM.AKT	200	0	200	0	0.00	0.00	0.00
BALOISE HOLDING REG.SHS	1'400	0	0	1'400	142.70	199'780.00	0.12
BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	70	0	0	70	1'829.00	128'030.00	0.08
BKW AG	0	1'200	0	1'200	126.50	151'800.00	0.09
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP PARTIZIPSCH	30	15	0	45	9'430.00	424'350.00	0.26
CIE FINANCIERE RICHEMONT NAMEN AKT	8'500	0	0	8'500	119.90	1'019'150.00	0.63
CLARIANT NAMEN AKT	9'800	14'400	17'000	7'200	14.65	105'480.00	0.07
CREDIT SUISSE GROUP AG REG SHS	39'600	11'314	0	50'914	2.76	140'726.30	0.09
DKSH HOLDING SA	0	1'800	0	1'800	70.20	126'360.00	0.08
EMS-CHEM HOLDINGS-NAMEN ACT.	170	0	170	0	0.00	0.00	0.00
GALÉNICA SA	0	1'800	0	1'800	75.55	135'990.00	0.08
GEBERIT AG	550	0	0	550	435.50	239'525.00	0.15
GEORG FISCHER LTD	0	2'400	0	2'400	56.60	135'840.00	0.08
GEORG FISCHER REG.	120	0	120	0	0.00	0.00	0.00
GIVAUDAN SA REG.SHS	130	0	0	130	2'833.00	368'290.00	0.23
HOLCIM LTD	9'000	3'000	0	12'000	47.88	574'560.00	0.36
IDORSIA REGISTERED	8'000	0	0	8'000	13.42	107'360.00	0.07
JULIUS BAER GROUP NAMEN AKT	4'400	0	0	4'400	53.86	236'984.00	0.15
KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	1'200	0	0	1'200	215.20	258'240.00	0.16
LOGITECH NAMEN AKT	3'300	0	0	3'300	57.06	188'298.00	0.12
LONZA GROUP (CHF)	1'200	0	0	1'200	453.10	543'720.00	0.34
NESTLE SA REG SHS	39'400	4'600	0	44'000	107.14	4'714'160.00	2.92
NOVARTIS AG REG SHS	33'700	3'800	0	37'500	83.59	3'134'625.00	1.95
PARTNERS GROUP HLDG NAMEN AKT	400	0	0	400	816.80	326'720.00	0.20
ROCHE HOLDING LTD	10'500	1'300	0	11'800	290.50	3'427'900.00	2.13
SCHINDLER HOLDING SA	950	0	0	950	173.90	165'205.00	0.10
SGS SA REG SHS	90	0	0	90	2'150.00	193'500.00	0.12
SIG GROUP --- REGISTERED SHS	11'000	0	0	11'000	20.20	222'200.00	0.14
SIKA - REGISTERED SHS	2'400	0	0	2'400	221.70	532'080.00	0.33
SONOVA HOLDING NAM-AKT	1'208	0	508	700	219.30	153'510.00	0.10
STRAUMANN HOLDING LTD	0	2'300	0	2'300	105.60	242'880.00	0.15
STRAUMANN HOLDING REG	230	0	230	0	0.00	0.00	0.00
SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	550	200	0	750	476.80	357'600.00	0.22
SWISS RE REGS	4'700	0	0	4'700	86.48	406'456.00	0.25
SWISSCOM SHS NOM	450	0	0	450	506.60	227'970.00	0.14
TECAN GROUP NAM.AKT	0	400	0	400	412.40	164'960.00	0.10
TEMENOS AG NAM.AKT	2'100	0	0	2'100	50.74	106'554.00	0.07
THE SWATCH GROUP	900	0	0	900	263.00	236'700.00	0.15
UBS GROUP SA	56'500	0	0	56'500	17.21	972'082.50	0.60
VAT GROUP SA	600	0	0	600	252.80	151'680.00	0.09
VONTOBEL HOLDING	0	1'800	0	1'800	61.30	110'340.00	0.07

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere							
ZURICH INSURANCE GROUP NAMEN AKT	2'500	0	0	2'500	442.30	1'105'750.00	0.69
<i>Schweiz</i>						23'438'937.80	14.55
Schweizer Franken						23'438'937.80	14.55
Die an einer Börse gehandelten Effekten						23'438'937.80	14.55
BNP PARIBAS ISSUANCE BV	19'900	0	19'900	0	0.00	0.00	0.00
<i>Niederlande</i>						0.00	0.00
US Dollar						0.00	0.00
Nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt, bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						0.00	0.00
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere						23'438'937.80	14.55
Recht							
PATRIMON SW RE RIGHT	0	9'440	9'440	0	0.00	0.00	0.00
<i>Schweiz</i>						0.00	0.00
Schweizer Franken						0.00	0.00
Die an einer Börse gehandelten Effekten						0.00	0.00
CREDIT SUISSE GROUP AG 08.12.22 RIGHT	0	39'600	39'600	0	0.00	0.00	0.00
<i>Schweiz</i>						0.00	0.00
Schweizer Franken						0.00	0.00
Nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt, bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						0.00	0.00
Recht						0.00	0.00
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte						23'438'937.80	14.55

Inventar des Vermögens

Zinssatz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %	
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere										
Anleihen										
0.400	COMMONW BK AUSTRALIA 0.40	25.09.26	250'000	0	0	250'000	94.09	235'221.25	0.15	
	17-26 25/09A									
1.500	COMMONW BK AUSTRALIA 1.50	07.02.22	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
	14-22 07/02A									
0.300	NATIONAL AUSTRALIA BK 0.30	17-25 31/10A	250'000	0	0	250'000	95.28	238'203.75	0.14	
	<i>Australien</i>								473'425.00	0.29
0.100	DEUTSCHE BAHN F 0.1000	21-36 28.01.36	300'000	0	0	300'000	75.71	227'118.00	0.14	
	28/01A									
0.450	DEUTSCHE BAHN FIN 0.45	17-30 08.11.30	250'000	0	0	250'000	88.17	220'425.00	0.14	
	08/11A									
1.375	DEUTSCHE BAHN FIN 1.375	13-23 24.07.23	500'000	0	250'000	250'000	100.09	250'231.25	0.15	
	23 24/07A									
0.250	MUENCHENER HYPOTHEKEN 0.25	19-29 26/02A	250'000	0	0	250'000	89.68	224'207.50	0.14	
	<i>Deutschland</i>								921'981.75	0.57
0.250	NORDEA BANK 0.25	15-23 27/11A	500'000	0	250'000	250'000	98.74	246'847.50	0.15	
	<i>Finnland</i>								246'847.50	0.15
0.366	BFCM 0.366	18-24 10/10A	500'000	0	0	500'000	97.14	485'675.00	0.31	
2.893	BNP PARIBAS SA 2.8925	22-29 27/09A27/09A	0	200'000	0	200'000	98.56	197'123.00	0.12	
3.042	CREDIT AGRICOLE SA 3.042	22-27 29.09.27	0	200'000	0	200'000	100.67	201'331.00	0.12	
	29/09A09A									
1.000	TOTAL CAPITAL INTL 1.00	14-24 29.08.24	250'000	0	0	250'000	98.74	246'837.50	0.16	
	29/08A									
	<i>Frankreich</i>								1'130'966.50	0.71
0.300	BK OF NOVA SCOTIA 0.30	15-22 16.09.22	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
	16/09A									
0.250	CANADA 0.25	17-29 28/06A	300'000	0	0	300'000	89.76	269'281.50	0.18	
0.125	CIBC 0.125	15-25 22/12A	250'000	0	0	250'000	95.30	238'242.50	0.15	
0.200	PROV OF NEW BRUNSWICK 0.2	16-31 07/11A	250'000	0	0	250'000	84.95	212'377.50	0.13	
0.750	QUEBEC (PROV.OF) 0.75	14-24 21.11.24	250'000	0	0	250'000	98.51	246'275.00	0.15	
	21/11A									
1.125	QUEBEC (PROV.OF)EMTN 1.125	13-23 22/02A	500'000	0	500'000	0	0.00	0.00	0.00	
	<i>Kanada</i>								966'176.50	0.61
0.200	LGT BANK IN LIECHTE 0.20	20-30 04.11.30	300'000	0	0	300'000	83.19	249'583.50	0.15	
	04/11A									
0.375	LGT BANK IN LIECHTE 0.375	19-28 05/07A	200'000	0	0	200'000	87.91	175'816.00	0.11	
	<i>Liechtenstein</i>								425'399.50	0.26
1.500	AUCKLAND COUNCIL 1.5	14-25 28.11.25	500'000	0	0	500'000	99.71	498'572.50	0.31	
	28/11A									
	<i>Neuseeland</i>								498'572.50	0.31
0.545	KBN 0.545	22-28 28/04A	0	300'000	0	300'000	93.72	281'170.50	0.17	
	<i>Norwegen</i>								281'170.50	0.17

Helvetia Allegra 50

Inventar des Vermögens

Zinssatz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %	
Anleihen										
0.250	PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.25 17- 27 18/01A	18.01.27	500'000	0	0	500'000	93.85	469'267.50	0.29	
0.375	PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.375 15- 25 15/10A	15.10.25	500'000	0	0	500'000	96.38	481'910.00	0.30	
0.375	PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.375 16- 32 26/01A	26.01.32	350'000	0	0	350'000	85.61	299'649.00	0.19	
0.625	PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.625 15- 34 25/01A	25.01.34	250'000	0	0	250'000	84.71	211'777.50	0.13	
1.375	PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.375 12- 27 13/08A	13.08.27	500'000	0	0	500'000	97.76	488'812.50	0.30	
0.000	PFANDBRIEF SCHWEIZ HYP 0.00 2°-29 26/10A	26.10.29	200'000	0	0	200'000	87.16	174'322.00	0.11	
1.500	PFANDBRIEF SCHWIEZ 1.50 12- 33 02/08A	08.08.33	200'000	0	0	200'000	93.67	187'332.00	0.12	
0.750	PFANDBRIEFZENTRALE 0.75 18- 32 01/10A	01.10.32	200'000	0	0	200'000	87.71	175'425.00	0.11	
1.700	PFANDBRIEFZENTRALE 1.7 22- 32 27/07A	27.07.32	0	200'000	0	200'000	96.20	192'398.00	0.12	
0.500	PFANDBRIEFZENTRALE 0.50 18- 28 19/05A	19.05.28	250'000	0	0	250'000	92.68	231'700.00	0.14	
0.000	PFANDBRIEFZENTRALE S K 0.0 21- 31 25/07A	25.07.31	300'000	0	0	300'000	83.54	250'618.50	0.16	
0.000	PFANDBRIEFZENTRALE SC 0.0 21-28 13/03A	13.03.28	0	300'000	0	300'000	90.51	271'516.50	0.17	
0.500	PFBRF SCHWZ HYPO 0.50 15- 29 15/06A	15.06.29	250'000	0	0	250'000	90.92	227'302.50	0.14	
0.750	PFBRF SCHWZ HYPO 0.75 17- 38 18/10A	18.10.38	250'000	0	0	250'000	80.53	201'321.25	0.12	
0.250	PFBRF SCHWZ KANTBK 0.25 17- 27 06/12A	06.12.27	250'000	0	0	250'000	92.25	230'630.00	0.14	
0.650	PFBRF SCHWZ KANTBK 0.65 18- 33 15/02A	15.02.33	250'000	0	0	250'000	86.27	215'672.50	0.13	
1.000	PFBRF SCHWZ KANTBK 1.00 12- 23 13/02A	13.02.23	500'000	0	500'000	0	0.00	0.00	0.00	
1.250	PFBRF SCHWZ KANTBK 1.25 12- 22 03/22A	03.02.22	500'000	0	500'000	0	0.00	0.00	0.00	
1.625	RAIFFEISEN SUISSE 1.625 14-22 07/02A	07.02.22	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
2.000	ROCH KA 2.0 22-32 23/09A	23.09.32	0	250'000	0	250'000	98.33	245'828.75	0.15	
0.500	ROCHE KAPITALMA 0.5000 22- 27 25/02A	25.02.27	0	300'000	0	300'000	94.66	283'986.00	0.18	
0.750	ROCHE KAPITALMA 0.7500 22- 31 25/02A	25.02.31	0	250'000	0	250'000	89.62	224'041.25	0.14	
0.450	ROCHE KAPITALMARKT 0.45 17- 29 23/03A	23.03.29	250'000	0	0	250'000	91.00	227'508.75	0.14	
2.625	ROMANDE ENERGIE 2.625 22- 37 15/07A	15.07.37	0	100'000	0	100'000	100.05	100'047.50	0.06	
1.750	SGS 1.75 14-24 27/02A	27.02.24	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
0.625	SIKA SA 0.625 18-24 12/07A	12.07.24	250'000	0	0	250'000	98.46	246'155.00	0.15	
0.200	SIX GROUP AG 0.2000 21-29 28/09A	28.09.29	300'000	0	0	300'000	86.96	260'892.00	0.16	
2.000	SUISSE CONFEDERATION 2.00 11-22 25/05A	25.05.22	500'000	0	500'000	0	0.00	0.00	0.00	
0.000	SWISS CONFEDERATION -39 24/07U	24.07.39	250'000	0	0	250'000	76.56	191'391.25	0.12	
0.650	SWISS PRIME SIT 0.65 20-29 18/12A	18.12.29	250'000	0	0	250'000	86.15	215'367.50	0.13	
0.000	SWITZERLAND 0.00 16-29 22/06U	22.06.29	500'000	150'000	0	650'000	90.79	590'151.25	0.36	
1.250	SWITZERLAND 1.25 12-24 11/06A	11.06.24	500'000	0	0	500'000	100.04	500'210.00	0.31	
1.250	SWITZERLAND 1.25 14-26 28/05A	28.05.26	500'000	0	0	500'000	99.61	498'032.50	0.31	
4.000	SWITZERLAND 4.00 99-49 06/01A	06.01.49	250'000	0	0	250'000	151.62	379'060.00	0.24	
0.500	SWITZERLAND 0.5000 18-32 27/06A	27.06.32	250'000	250'000	0	500'000	90.56	452'780.00	0.28	
0.500	SWITZERLAND 0.50 15-30 27/05A	27.05.30	500'000	0	0	500'000	92.84	464'220.00	0.29	
1.250	SWITZERLAND 1.25 12-37 27/06A	27.06.37	500'000	0	0	500'000	94.90	474'502.50	0.29	
1.500	SWITZERLAND 1.50 12-42 30/04A	30.04.42	650'000	0	0	650'000	98.13	637'825.50	0.39	
1.500	SWITZERLAND 1.50 13-25 24/07A	24.07.25	500'000	0	0	500'000	100.51	502'570.00	0.31	
3.500	SWITZERLAND 3.50 03-33 08/04A	08.04.33	500'000	0	0	500'000	117.83	589'165.00	0.37	
4.000	SWITZERLAND 4.00 98-23 11/02A	11.02.23	500'000	0	0	500'000	100.34	501'680.00	0.31	
4.000	SWITZERLAND 4.00 98-28 08/04A	08.04.28	1'000'000	0	0	1'000'000	112.76	1'127'565.00	0.69	
0.250	SWITZERLAND GOVT BOND 0.25 21-35 23/06A	23.06.35	200'000	100'000	0	300'000	84.45	253'363.50	0.16	
0.500	SWITZERLAND REGS 0.50 17-45 28/06A	28.06.45	500'000	0	0	500'000	79.56	397'797.50	0.25	
0.000	SWITZERLAND 0 19-34 26/06U	26.06.34	250'000	0	0	250'000	83.15	207'877.50	0.13	

Inventar des Vermögens

Zinssatz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Anleihen									
2.250	SWITZERLAND 2.25 11-31 22/06A	22.06.31	500'000	0	0	500'000	105.45	527'267.50	0.33
2.500	SWITZERLAND 2.50 06-36 08/03A	08.03.36	500'000	0	0	500'000	110.08	550'412.50	0.34
3.250	SWITZERLAND 3.25 07-27 27/06A	27.06.27	500'000	0	0	500'000	107.88	539'392.50	0.33
0.435	UBS GROUP SA 0.435 21-28 09/11A	09.11.28	200'000	0	0	200'000	88.12	176'242.00	0.11
0.250	ZUERCHER KANTONALB 0.25 17- 26 27/01A	27.01.26	300'000	0	0	300'000	95.40	286'210.50	0.18
<i>Schweiz</i>								37'544'161.25	23.31
0.375	APPLE INC 0.375 15-24 25/11A	25.11.24	250'000	0	0	250'000	97.64	244'093.75	0.15
1.000	COCA-COLA CO 1.00 15-28 02/10A	02.10.28	250'000	0	0	250'000	94.24	235'598.75	0.15
0.250	NESTLE HOLDINGS INC 0.25 17- 27 04/10A	04.10.27	250'000	0	0	250'000	92.60	231'496.25	0.14
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>								711'188.75	0.44
Schweizer Franken								43'720'419.75	27.14
Die an einer Börse gehandelten Effekten								43'720'419.75	27.14
0.300	PFANDBRIEFZENTRALE SC 0.3 19-29 05/03A	09.04.29	0	250'000	0	250'000	90.03	225'077.50	0.14
0.500	PFANDBRIEFZENTRALE SC 0.5 19-34 15.05A	15.05.34	400'000	0	0	400'000	83.13	332'500.00	0.21
<i>Schweiz</i>								557'577.50	0.35
Schweizer Franken								557'577.50	0.35
Nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt, bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern								557'577.50	0.35
Anleihen								44'277'997.25	27.48
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere								44'277'997.25	27.48

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Anteile in Investmentfonds							
UBS EUR EQU DEFEN PUTWRITE SF ETF A EU	4'000	0	0	4'000	118.51	468'071.84	0.29
<i>Irland</i>						468'071.84	0.29
DB X-TRACKERS MSCI EUE SML CAP TRN -1C-	24'200	0	9'000	15'200	49.01	735'527.81	0.46
<i>Luxemburg</i>						735'527.81	0.46
Euro						1'203'599.65	0.75
ISHARES COR GLO AGGRE BOND- H ACC CHF ETF	950'000	0	0	950'000	4.53	4'298'750.00	2.67
SPDR BLOOMBERG BARCLAYS GBL AGG BDHDG	150'000	60'000	0	210'000	26.93	5'655'300.00	3.50
<i>Irland</i>						9'954'050.00	6.17
DBXT2 GLOB AGG-4C- CAP ETF	300'000	0	0	300'000	15.24	4'572'000.00	2.84
UBS-BLOOMB BAR MSCI EURO AREA LIQ-A H C	555'000	0	0	555'000	12.26	6'801'802.50	4.21
<i>Luxemburg</i>						11'373'802.50	7.05
INTERSWISS SCHWEIZ. LIEGENSCHAFTEN	7'260	0	0	7'260	161.80	1'174'668.00	0.73
ISHS CORE SPIE ETF -A-	1'700	16'000	11'400	6'300	131.50	828'450.00	0.51
PATRIMON SW RE	9'440	0	0	9'440	163.80	1'546'272.00	0.96
SCHRODER IMM PLUS	9'289	0	0	9'289	137.60	1'278'166.40	0.79
SWISSINVEST RE INV	8'670	0	0	8'670	181.80	1'576'206.00	0.99
UBS PROPERTY FD SWISS RESIDENTIAL ANFOS	20'550	0	4'500	16'050	75.50	1'211'775.00	0.75
ZKB GOLD ETF -A CHF-	5'750	0	4'150	1'600	504.00	806'400.00	0.50
<i>Schweiz</i>						8'421'937.40	5.23
Schweizer Franken						29'749'789.90	18.45
ISHARES CORE MSCI WORLD UCITS ETF USD C	0	110'700	10'500	100'200	72.90	6'758'404.80	4.19
ISHARES III CORE MSCI WLD ETF/CAP	91'900	29'500	121'400	0	0.00	0.00	0.00
ISHARES JP MORGAN EM LOC GOVT BD UCITS D	35'000	40'400	0	75'400	43.79	3'054'887.64	1.90
ISHS JPMORGA EM USD SHS USD ETF	27'500	0	20'800	6'700	84.26	522'330.29	0.32
ISHS MSCI EM USD CAP	30'100	14'200	9'000	35'300	28.64	935'398.50	0.58
SSGA II WRD SMA ETF USD	41'700	13'900	0	55'600	85.76	4'411'468.61	2.74
UBS EQUIT DEFEN PUTWRITE ST ETF A USD	5'000	0	0	5'000	115.22	533'024.08	0.33
VANGUARD GLB SMALL CAP INX USD C	5'500	0	0	5'500	297.33	1'513'015.44	0.94
WISDOMTREE ENH CMDTY EX AGRI UCITS ETF	0	84'000	0	84'000	11.85	920'972.34	0.57
XTRACKERS MSCI EMERGING MKTS UCITS 1CC	17'990	0	0	17'990	47.88	796'955.84	0.49
XTRACKERS MSCI WORLD INDEX UCITS-1C CAP	93'060	9'000	102'060	0	0.00	0.00	0.00
XTRACKERS MSCI WORLD UCITS ETF 1C	0	91'560	0	91'560	79.91	6'769'488.66	4.21
<i>Irland</i>						26'215'946.20	16.27

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
UBS ETF BUSDEMS A DIS USD	240'000	0	0	240'000	8.64	1'919'619.45	1.19
<i>Luxemburg</i>						1'919'619.45	1.19
ISHARES RUSSEL 2000 ETF FUND	6'350	0	0	6'350	174.36	1'024'399.92	0.64
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>						1'024'399.92	0.64
US Dollar						29'159'965.57	18.10
Die an einer Börse gehandelten Effekten						60'113'355.12	37.30
LEADENHALL ILS FD PLC CL H2	0	17'951	0	17'951	98.89	1'642'453.46	1.02
<i>Irland</i>						1'642'453.46	1.02
BLUEORCHARD MICROFINANCE FUND I USD	0	137	0	137	13'942.85	1'767'343.93	1.10
GLOBAL SENIOR LOAN FUND EB CAP	0	800	0	800	1'180.13	873'511.82	0.54
<i>Luxemburg</i>						2'640'855.75	1.64
LEADL UCITS ILS -A- USD	0	15'411	15'411	0	0.00	0.00	0.00
<i>Vereinigtes Königreich</i>						0.00	0.00
US Dollar						4'283'309.21	2.66
Die an einem anderen geregelten Markt gehandelt Werden						4'283'309.21	2.66
HELVETIA CH SWISS PROPERTY FUND	55'300	79'876	55'300	79'876	110.00	8'786'360.00	5.45
<i>Schweiz</i>						8'786'360.00	5.45
Schweizer Franken						8'786'360.00	5.45
MORGAN STANLEY INV GLB CONV BD -Z-	0	39'100	0	39'100	43.59	1'576'930.59	0.98
<i>Luxemburg</i>						1'576'930.59	0.98
US Dollar						1'576'930.59	0.98
Nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt, bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						8'786'360.00	5.45
Anteile in Investmentfonds						74'759'954.92	46.39

Inventar des Vermögens

Zins- satz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Strukturierte Produkte									
0.000	CITIGROUP GLOBAL MARKE 0.00 21-22 16/12U	16.12.22	10'800	0	10'800	0	0.00	0.00	0.00
0.000	CITIGROUP GLOBAL MARKE 0.00 22-23 12/12U	12.12.23	0	10'800	0	10'800	318.40	3'181'601.37	1.97
	<i>Luxemburg</i>							3'181'601.37	1.97
0.000	BNP PAR ISSUANCE BV 24/02U	22-23 28.02.23	0	22'500	0	22'500	314.50	6'547'224.42	4.06
	<i>Niederlande</i>							6'547'224.42	4.06
0.000	UBS LONDON PERLES 2013 XX 31/12U	13- 31.12.99	19'190	0	0	19'190	318.52	5'655'364.91	3.51
	<i>Vereinigtes Königreich</i>							5'655'364.91	3.51
	US Dollar							15'384'190.70	9.54
	Die an einem anderen geregelten Markt gehandelt Werden							15'384'190.70	9.54
	Strukturierte Produkte							15'384'190.70	9.54

Inventar des Vermögens

Derivative Finanzinstrumente

	Kurs	Käufe	Devisen	Verkäufe	Devisen	Verfall	Verkehrswert	in %
Devisentermingeschäfte *								
	1.039	3'463'779.60	CHF	3'600'000.00	USD	15.05.23	182'800.72	0.11
	1.065	4'506'033.60	CHF	4'800'000.00	USD	10.02.23	84'351.71	0.05
	1.021	9'007'959.20	CHF	9'200'000.00	USD	14.11.22	0.00	0.00
	1.096	9'034'571.70	CHF	9'900'000.00	USD	10.08.22	0.00	0.00
	1.091	4'215'909.20	CHF	4'600'000.00	USD	13.05.22	0.00	0.00
	0.948	474'931.35	CHF	450'000.00	EUR	13.05.22	0.00	0.00
	1.089	4'547'213.55	CHF	4'950'000.00	USD	11.02.22	0.00	0.00
	0.919	4'950'000.00	USD	4'547'485.80	CHF	11.02.22	0.00	0.00
Devisentermingeschäfte							267'152.43	0.17
Devisentermingeschäfte							267'152.43	0.17
Derivative Finanzinstrumente							267'152.43	0.17

* Identität der Vertragspartner bei OTC-Geschäften: Zürcher Kantonalbank

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2022	Verkehrswert	in %
Bankguthaben Sichtguthaben			
CACEIS Bank, Montrouge, Zweigniederlassung Nyon / Schweiz	2'362'675.85	2'362'675.85	1.47
Bankguthaben Sichtguthaben		2'362'675.85	1.47

Wechselkurs

1 EUR	=	CHF	0.98745
1 USD	=	CHF	0.92523

Derivate unter Anwendung des Commitment-Ansatzes I

Engagement-reduzierende Positionen	
Devisentermingeschäfte	7'771'918.49
Total in CHF	7'771'918.49
Total in % des Nettofondsvermögens	4.83

Angaben früherer Jahre

Datum	Klasse	Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*		Anteile im Umlauf	Nettofondsvermögen	
31.12.20	A1	CHF	109.09	506'920.531	CHF	55'298'879.03
31.12.21	A1	CHF	116.95	551'225.531	CHF	64'466'197.51
31.12.22	A1	CHF	99.95	626'857.992	CHF	62'654'703.71
31.12.20	A2	CHF	108.30	899'571.952	CHF	97'420'838.37
31.12.21	A2	CHF	115.76	855'777.952	CHF	99'061'102.00
31.12.22	A2	CHF	98.63	807'232.588	CHF	79'620'119.27
31.12.20	H1	CHF	112.69	10.000	CHF	1'126.86
31.12.21	H1	CHF	121.41	10.000	CHF	1'214.11
31.12.22	H1	CHF	104.26	10.000	CHF	1'042.55
31.12.20	R1	CHF	109.16	22'375.216	CHF	2'442'546.61
31.12.21	R1	CHF	117.04	117'693.216	CHF	13'774'239.37
31.12.22	R1	CHF	100.02	182'786.216	CHF	18'282'774.04
31.12.20	R2	CHF	108.29	41'040.000	CHF	4'444'324.92
31.12.22	E	CHF	87.50	2'163.222	CHF	189'273.01

* Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Vermögensrechnung

	31.12.22	31.12.21
(Börsenwert)	CHF	CHF
Effekten		
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	28'653'077.99	36'456'525.34
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	9'536'037.00	11'178'526.00
Investmentfondsanteile	45'452'463.39	47'602'665.51
Strukturierte Produkte	13'164'322.65	11'286'919.22
Derivative Finanzinstrumente	187'395.91	67'221.11
Bankguthaben		
Sichtguthaben	1'301'030.86	4'761'358.24
Sonstige Vermögenswerte	392'935.01	363'683.48
Gesamtfondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	98'687'262.81	111'716'898.90
Andere Verbindlichkeiten	-247'079.77	-275'624.26
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	98'440'183.04	111'441'274.64

Veränderung des Nettofondsvermögens

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode	111'441'274.64	93'449'121.25
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	-181'162.25	-209'828.74
Saldo aus dem Anteilverkehr	5'156'270.24	2'808'911.85
Gesamterfolg	-17'976'199.59	15'393'070.28
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	98'440'183.04	111'441'274.64

Entwicklung der Anzahl der Anteile**Klasse A1**

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	538'286.787	522'584.787
Ausgegebene Anteile	86'819.476	15'702.000
Zurückgenommene Anteile	0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	625'106.263	538'286.787
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF 106.43	126.43

Klasse A2

	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	291'840.658	300'102.658
Ausgegebene Anteile	0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile	58'388.478	8'262.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	233'452.180	291'840.658
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF 105.36	125.54

* Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Entwicklung der Anzahl der Anteile

Klasse R1		01.01.22	01.01.21
		31.12.22	31.12.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		53'355.000	14'660.000
Ausgegebene Anteile		19'075.000	51'714.000
Zurückgenommene Anteile		4'358.000	13'019.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		68'072.000	53'355.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF	106.43	126.43
Klasse R2			
			01.01.21
			16.06.21
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode			23'146.000
Ausgegebene Anteile			252.000
Zurückgenommene Anteile			23'398.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode			0.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF		0.00
Klasse E			
		18.01.22	
		31.12.22	
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		0.000	
Ausgegebene Anteile		784.117	
Zurückgenommene Anteile		10.000	
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		774.117	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*	CHF	86.63	

* Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Erfolgsrechnung	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Erträge		
Erträge der Effekten		
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere	740'923.68	680'243.47
Erträge der Obligationen	93'517.37	92'043.54
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen ¹	715'060.74	508'118.02
Ertrag der Bankguthaben		
Sichtguthaben	6'300.53	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	19'514.88	5'356.67
Total Erträge	1'575'317.20	1'285'761.70
Aufwendungen		
Reglementarische Vergütungen		
an die Fondsleitung	-31'058.41	-31'178.60
an die Depotbank	-31'163.41	-31'253.60
an die Verwaltung	-922'503.24	-938'984.38
Prüfaufwand	-11'847.00	-11'847.00
Negativzinsen	-8'165.61	-9'089.51
Passivzinsen	0.00	-251.58
Sonstige Aufwendungen	-2'827.01	-6'979.27
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	5'447.29	561.46
Total Aufwendungen	-1'002'117.39	-1'029'022.48
Steuerliche Anpassungen wegen Erträgen aus Zielfonds	141'860.93	251'378.80
Nettoertrag	715'060.74	508'118.02
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-1'558'384.36	2'831'534.69
Realisierter Erfolg	-843'323.62	3'339'652.71
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-17'132'875.97	12'053'417.57
Gesamterfolg	-17'976'199.59	15'393'070.28
TER * in % : Klasse A1	1.06	1.02
TER * in % : Klasse A2	1.36	1.32
TER * in % : Klasse R1	1.06	1.02
TER * in % : Klasse E	0.64	N/A

¹ Gemäss Kreisschreiben Nr. 24 der Eidgenössischen Steuerverwaltung vom 20.11.2017, Kap. 2.8

* Synthetische TER

Helvetia Allegra 85

Verwendung des Erfolgs – Klasse A1	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	483'275.51	310'305.67
Vortrag des Vorjahres	4'730.03	1'247.83
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	488'005.54	331'553.50
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	487'957.95	306'823.47
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	170'785.28	107'388.21
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	317'172.67	199'435.25
Vortrag auf neue Rechnung	47.59	4'730.03

Verwendung des Erfolgs – Klasse A2	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	178'671.28	167'055.02
Vortrag des Vorjahres	151.84	2'364.41
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	178'823.12	169'419.43
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	178'801.02	169'267.58
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	62'580.36	59'243.65
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	116'220.66	110'023.93
Vortrag auf neue Rechnung	22.10	151.84

Verwendung des Erfolgs – Klasse R1	01.01.22	01.01.21
	31.12.22	31.12.21
	CHF	CHF
Nettoertrag	52'626.81	30'757.34
Vortrag des Vorjahres	487.29	142.30
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	53'114.10	30'899.64
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	53'109.77	30'412.35
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	18'588.42	10'644.32
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	34'521.35	19'768.03
Vortrag auf neue Rechnung	4.33	487.29

Verwendung des Erfolgs – Klasse E	18.01.22
	31.12.22
	CHF
Nettoertrag	487.13
Vortrag des Vorjahres	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	487.13
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	487.07
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	170.47
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	316.60
Vortrag auf neue Rechnung	0.06

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere							
AMS-OSRAM AG	12'000	0	12'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Österreich</i>						<i>0.00</i>	<i>0.00</i>
ABB LTD REG SHS	29'500	0	0	29'500	28.06	827'770.00	0.84
ACCELLERON INDUSTRIES AG	0	1'475	1'475	0	0.00	0.00	0.00
ADECCO REG.SHS	4'300	0	0	4'300	30.46	130'978.00	0.13
ALCON - REGISTERED SHS	11'400	0	0	11'400	63.18	720'252.00	0.73
BACHEM HLDG -B- NAM.AKT	240	0	240	0	0.00	0.00	0.00
BALOISE HOLDING REG.SHS	1'400	0	0	1'400	142.70	199'780.00	0.20
BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	90	60	30	120	1'829.00	219'480.00	0.22
BKW AG	0	1'500	0	1'500	126.50	189'750.00	0.19
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP PARTIZIPSCH	35	20	0	55	9'430.00	518'650.00	0.53
CIE FINANCIERE RICHEMONT	10'000	0	0	10'000	119.90	1'199'000.00	1.21
NAMEN AKT							
CLARIANT NAMEN AKT	12'000	16'800	20'400	8'400	14.65	123'060.00	0.12
CREDIT SUISSE GROUP AG REG SHS	40'000	11'428	0	51'428	2.76	142'146.99	0.14
DKSH HOLDING SA	0	2'200	0	2'200	70.20	154'440.00	0.16
EMS-CHEM HOLDINGS-NAMEN ACT.	200	0	200	0	0.00	0.00	0.00
GALÉNICA SA	0	2'400	0	2'400	75.55	181'320.00	0.18
GEBERIT AG	700	0	0	700	435.50	304'850.00	0.31
GEORG FISCHER LTD	0	3'000	0	3'000	56.60	169'800.00	0.17
GEORG FISCHER REG.	150	0	150	0	0.00	0.00	0.00
GIVAUDAN SA REG.SHS	150	0	0	150	2'833.00	424'950.00	0.43
HOLCIM LTD	13'500	0	0	13'500	47.88	646'380.00	0.65
IDORSIA REGISTERED	9'500	0	0	9'500	13.42	127'490.00	0.13
JULIUS BAER GROUP NAMEN AKT	5'500	0	0	5'500	53.86	296'230.00	0.30
KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	1'600	0	0	1'600	215.20	344'320.00	0.35
LOGITECH NAMEN AKT	4'000	0	0	4'000	57.06	228'240.00	0.23
LONZA GROUP (CHF)	1'350	0	0	1'350	453.10	611'685.00	0.62
NESTLE SA REG SHS	49'200	4'600	0	53'800	107.14	5'764'132.00	5.85
NOVARTIS AG REG SHS	43'100	5'400	2'300	46'200	83.59	3'861'858.00	3.91
PARTNERS GROUP HLDG NAMEN AKT	400	0	0	400	816.80	326'720.00	0.33
ROCHE HOLDING LTD	12'600	1'800	0	14'400	290.50	4'183'200.00	4.24
SCHINDLER HOLDING SA	1'050	450	0	1'500	173.90	260'850.00	0.26
SFS GROUP - NAMEN-AKT	0	1'500	1'500	0	0.00	0.00	0.00
SGS SA REG SHS	100	0	0	100	2'150.00	215'000.00	0.22
SIG GROUP --- REGISTERED SHS	12'000	0	0	12'000	20.20	242'400.00	0.25
SIKA - REGISTERED SHS	2'800	0	0	2'800	221.70	620'760.00	0.63
SONOVA HOLDING NAM-AKT	1'057	0	207	850	219.30	186'405.00	0.19
STRAUMANN HOLDING LTD	0	3'000	0	3'000	105.60	316'800.00	0.32
STRAUMANN HOLDING REG	300	0	300	0	0.00	0.00	0.00
SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	800	0	0	800	476.80	381'440.00	0.39
SWISS RE REGS	5'000	1'000	0	6'000	86.48	518'880.00	0.53
SWISSCOM SHS NOM	500	200	0	700	506.60	354'620.00	0.36
TECAN GROUP NAM.AKT	0	500	0	500	412.40	206'200.00	0.21
TEMENOS AG NAM.AKT	2'900	0	0	2'900	50.74	147'146.00	0.15
THE SWATCH GROUP	1'300	0	0	1'300	263.00	341'900.00	0.35
UBS GROUP SA	73'000	0	0	73'000	17.21	1'255'965.00	1.27
VAT GROUP SA	800	0	0	800	252.80	202'240.00	0.20
VONTOBEL HOLDING	0	2'200	0	2'200	61.30	134'860.00	0.14

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere							
ZURICH INSURANCE GROUP NAMEN AKT	2'600	500	0	3'100	442.30	1'371'130.00	1.39
<i>Schweiz</i>						28'653'077.99	29.03
Schweizer Franken						28'653'077.99	29.03
Die an einer Börse gehandelten Effekten						28'653'077.99	29.03
BNP PARIBAS ISSUANCE BV	11'400	0	11'400	0	0.00	0.00	0.00
<i>Niederlande</i>						0.00	0.00
US Dollar						0.00	0.00
Nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt, bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						0.00	0.00
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere						28'653'077.99	29.03
Recht							
PATRIMON SW RE RIGHT	0	5'050	5'050	0	0.00	0.00	0.00
<i>Schweiz</i>						0.00	0.00
Schweizer Franken						0.00	0.00
Die an einer Börse gehandelten Effekten						0.00	0.00
CREDIT SUISSE GROUP AG 08.12.22 RIGHT	0	40'000	40'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Schweiz</i>						0.00	0.00
Schweizer Franken						0.00	0.00
Nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt, bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						0.00	0.00
Recht						0.00	0.00
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte						28'653'077.99	29.03

Inventar des Vermögens

Zinssatz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere									
Anleihen									
0.625	MACQUARIE BANK 0.625 15-23 04/09A	04.09.23	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00
0.300	NATIONAL AUSTRALIA BK 0.30 17- 25 31/10A	31.10.25	100'000	0	0	100'000	95.28	95'281.50	0.10
<i>Australien</i>								95'281.50	0.10
1.375	DEUTSCHE BAHN FIN 1.375 13- 23 24/07A	24.07.23	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00
0.500	MUENCHENER HYPO 0.5000 18- 28 14/06A	14.06.28	100'000	0	0	100'000	92.44	92'435.00	0.09
<i>Deutschland</i>								92'435.00	0.09
0.366	BFCM 0.366 18-24 10/10A	10.10.24	150'000	0	0	150'000	97.14	145'702.50	0.15
<i>Frankreich</i>								145'702.50	0.15
0.300	BK OF NOVA SCOTIA 0.30 15-22 16/09A	16.09.22	150'000	0	150'000	0	0.00	0.00	0.00
0.750	QUEBEC (PROV.OF) 0.75 14-24 21/11A	21.11.24	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Kanada</i>								0.00	0.00
0.500	DH SWITZERLAND FIN 0.50 15-23 08/12A	08.12.23	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Luxemburg</i>								0.00	0.00
1.500	AUCKLAND COUNCIL 1.5 14-25 28/11A	28.11.25	100'000	0	0	100'000	99.71	99'714.50	0.10
<i>Neuseeland</i>								99'714.50	0.10
0.750	BMW INTERNATIONAL INV 0.75 19- 27 03/09A	03.09.27	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Niederlande</i>								0.00	0.00
2.875	OESTER.KONTROLLBK 2.875 05- 30 25/02A	25.02.30	100'000	0	0	100'000	106.86	106'864.00	0.11
<i>Österreich</i>								106'864.00	0.11
0.875	ASIA DEV BK 0.875 22-29 13/09U	13.09.29	0	100'000	0	100'000	94.32	94'322.50	0.10
<i>Philippinen</i>								94'322.50	0.10
0.300	AKADEMISKA HUS 0.30 17-29 08/10A	08.10.29	100'000	0	0	100'000	89.52	89'522.00	0.09
<i>Schweden</i>								89'522.00	0.09
0.875	AARGAUISCHE KANTON 0.875 15-30 23/01A	23.01.30	100'000	0	0	100'000	92.08	92'075.00	0.09
0.250	BALOISE HOLDING 0.25 20-26 16/12A	16.12.26	100'000	0	0	100'000	92.57	92'565.00	0.09

Inventar des Vermögens

Zins- satz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %	
Anleihen										
0.125	PFANDBRIEF SCHWEIZ 28 06/09A	0.125 16- 06.09.28	100'000	0	0	100'000	90.18	90'179.50	0.09	
0.125	PFANDBRIEF SCHWEIZ 25 06/05A	0.125 17- 06.05.25	150'000	0	150'000	0	0.00	0.00	0.00	
0.125	PFANDBRIEF SCHWEIZ 30 02/08A	0.1250 20- 02.08.30	100'000	0	0	100'000	86.44	86'437.50	0.09	
0.250	PFANDBRIEF SCHWEIZ 38 04/08A	0.25 16- 04.08.38	100'000	0	0	100'000	74.03	74'028.00	0.08	
0.250	PFANDBRIEF SCHWEIZ 27 18/01A	0.25 17- 18.01.27	100'000	0	0	100'000	93.85	93'853.50	0.10	
0.375	PFANDBRIEF SCHWEIZ 25 15/10A	0.375 15- 15.10.25	100'000	0	0	100'000	96.38	96'382.00	0.10	
0.875	PFANDBRIEF SCHWEIZ 37 25/06A	0.875 15- 25.06.37	100'000	0	0	100'000	83.44	83'438.00	0.08	
1.375	PFANDBRIEF SCHWEIZ 27 13/08A	1.375 12- 13.08.27	100'000	0	0	100'000	97.76	97'762.50	0.10	
2.125	PFANDBRIEF SCHWEIZ 28 01/12A	2.125 10- 01.12.28	0	200'000	0	200'000	100.81	201'626.00	0.20	
1.500	PFANDBRIEF SCHWIEZ 33 02/08A	1.50 12- 08.08.33	100'000	0	0	100'000	93.67	93'666.00	0.09	
0.250	PFANDBRIEFBANK 12/10A	0.25 17-27 12.10.27	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00	
0.000	PFANDBRIEFZENTR 10/09A	0.00 19-37 10.09.37	100'000	0	0	100'000	72.32	72'316.50	0.07	
0.500	PFANDBRIEFZENTRALE 28 19/05A	0.50 18- 19.05.28	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00	
0.500	PFBRF SCHWZ HYPO 29 15/06A	0.50 15- 15.06.29	100'000	100'000	100'000	100'000	90.92	90'921.00	0.09	
1.375	PFBRF SCHWZ HYPO 29 20/09A	1.375 12- 20.09.29	100'000	0	0	100'000	95.96	95'957.50	0.10	
0.250	PFBRF SCHWZ KANTBK 27 06/12A	0.25 17- 06.12.27	100'000	0	0	100'000	92.25	92'252.00	0.09	
0.650	PFBRF SCHWZ KANTBK 33 15/02A	0.65 18- 15.02.33	100'000	0	0	100'000	86.27	86'269.00	0.09	
1.500	ROCH KA 22-26 23/06A	1.5 22-26 23.06.26	0	250'000	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
2.000	ROCH KA 22-32 23/09A	2.0 22-32 23.09.32	0	150'000	0	150'000	98.33	147'497.25	0.15	
0.500	ROCHE KAPITALMA 27 25/02A	0.5000 22- 25.02.27	0	150'000	0	150'000	94.66	141'993.00	0.14	
0.750	ROCHE KAPITALMA 31 25/02A	0.7500 22- 25.02.31	0	150'000	0	150'000	89.62	134'424.75	0.14	
1.000	ROCHE KAPITALMARKT A 37 25/02A	1.0 22- 25.02.37	0	150'000	0	150'000	84.34	126'516.75	0.13	
1.750	SGS 14-24 27/02A	1.75 14-24 27.02.24	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00	
0.625	ST GALLER KANTONAL 32 23/01A	0.625 17- 23.01.32	100'000	0	0	100'000	87.23	87'234.50	0.09	
0.000	SWISS CONFEDERATION 24/07U	-39 24.07.39	100'000	0	0	100'000	76.56	76'556.50	0.08	
0.000	SWITZERLAND 22/06U	0.00 16-29 22.06.29	150'000	0	0	150'000	90.79	136'188.75	0.14	
1.250	SWITZERLAND 11/06A	1.25 12-24 11.06.24	150'000	0	0	150'000	100.04	150'063.00	0.15	
1.250	SWITZERLAND 28/05A	1.25 14-26 28.05.26	150'000	0	0	150'000	99.61	149'409.75	0.15	
0.500	SWITZERLAND 27/06A	0.5000 18-32 27.06.32	150'000	0	0	150'000	90.56	135'834.00	0.14	
0.500	SWITZERLAND 15-30 27/05A	0.50 15-30 27.05.30	150'000	0	0	150'000	92.84	139'266.00	0.14	
1.250	SWITZERLAND 12-37 27/06A	1.25 12-37 27.06.37	150'000	0	0	150'000	94.90	142'350.75	0.14	
1.500	SWITZERLAND 12-42 30/04A	1.50 12-42 30.04.42	150'000	0	0	150'000	98.13	147'190.50	0.15	
1.500	SWITZERLAND 13-25 24/07A	1.50 13-25 24.07.25	150'000	0	0	150'000	100.51	150'771.00	0.15	
3.500	SWITZERLAND 03-33 08/04A	3.50 03-33 08.04.33	200'000	0	0	200'000	117.83	235'666.00	0.25	
4.000	SWITZERLAND 98-28 08/04A	4.00 98-28 08.04.28	300'000	0	0	300'000	112.76	338'269.50	0.35	
0.000	SWITZERLAND 0 19-34 26/06U	0 19-34 26.06.34	100'000	0	0	100'000	83.15	83'151.00	0.08	
2.250	SWITZERLAND 11-31 22/06A	2.25 11-31 22.06.31	150'000	0	0	150'000	105.45	158'180.25	0.16	
2.500	SWITZERLAND 06-36 08/03A	2.50 06-36 08.03.36	150'000	0	0	150'000	110.08	165'123.75	0.17	
3.250	SWITZERLAND 07-27 27/06A	3.25 07-27 27.06.27	150'000	0	0	150'000	107.88	161'817.75	0.16	
0.250	ZUERCHER KANTONALB 26 27/01A	0.25 17- 26.27.01A	100'000	0	0	100'000	95.40	95'403.50	0.10	
0.500	ZURICH CIE ASS. 18/12A	0.5 18-24 18.12.24	150'000	0	0	150'000	97.66	146'493.00	0.15	
Schweiz								8'301'371.00	8.41	
0.253	BANK OF AMERICA CORP 19-26 12/06A	0.2525 12.06.26	100'000	0	0	100'000	94.02	94'024.00	0.10	

Inventar des Vermögens

Zinssatz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Anleihen									
1.000	COCA-COLA CO 1.00 15-28 02/10A	02.10.28	100'000	0	0	100'000	94.24	94'239.50	0.09
	<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>							188'263.50	0.19
	Schweizer Franken							9'213'476.50	9.34
Die an einer Börse gehandelten Effekten								9'213'476.50	9.34
0.550	PFANDBRIEF 08/02A 0.55 19-31	29.01.31	100'000	0	0	100'000	88.62	88'616.50	0.09
0.300	PFANDBRIEFZENTRALE SC 0.3 19-29 05/03A	09.04.29	100'000	0	0	100'000	90.03	90'031.00	0.09
1.450	PFANDBRIEFZENTRALE SC 1.45 22-30 30/04A	30.04.30	0	150'000	0	150'000	95.94	143'913.00	0.15
	<i>Schweiz</i>							322'560.50	0.33
	Schweizer Franken							322'560.50	0.33
Nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt, bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern								322'560.50	0.33
Anleihen								9'536'037.00	9.66
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere								9'536'037.00	9.66

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Anteile in Investmentfonds							
UBS EUR EQUIT DEFEN PUTWRITE SF ETF A EU	2'200	0	0	2'200	118.51	257'439.51	0.26
<i>Irland</i>						257'439.51	0.26
DB X-TRACKERS MSCI EUE SML CAP TRN -1C-	4'900	0	4'900	0	0.00	0.00	0.00
<i>Luxemburg</i>						0.00	0.00
Euro						257'439.51	0.26
INTERSWISS SCHWEIZ. LIEGENSCHAFTEN	4'890	0	0	4'890	161.80	791'202.00	0.80
ISHS CORE SPIE ETF -A-	10'700	16'500	17'000	10'200	131.50	1'341'300.00	1.35
PATRIMON SW RE	6'050	0	1'000	5'050	163.80	827'190.00	0.84
SCHRODER IMM PLUS	5'357	0	1'000	4'357	137.60	599'523.20	0.61
SWISSINVEST RE INV	5'790	0	0	5'790	181.80	1'052'622.00	1.07
UBS PROPERTY FD SWISS RESIDENTIAL ANFOS	11'700	0	0	11'700	75.50	883'350.00	0.90
ZKB GOLD ETF -A CHF-	3'320	0	2'320	1'000	504.00	504'000.00	0.51
<i>Schweiz</i>						5'999'187.20	6.08
Schweizer Franken						5'999'187.20	6.08
ISHARES CORE MSCI WORLD UCITS ETF USD C	0	97'400	5'500	91'900	72.90	6'198'576.86	6.28
ISHARES III CORE MSCI WLD ETF/CAP	91'100	15'500	106'600	0	0.00	0.00	0.00
ISHS MSCI EM USD CAP	53'950	15'300	0	69'250	28.64	1'835'023.97	1.86
SPDR MSCI WORLD UCITS ETF	281'000	0	0	281'000	26.67	6'932'611.43	7.02
SSGA II WRD SMA ETF USD	38'000	6'500	0	44'500	85.76	3'530'761.75	3.58
UBS EQUIT DEFEN PUTWRITE ST ETF A USD	2'650	0	0	2'650	115.22	282'502.76	0.29
VANGUARD GLB SMALL CAP INX USD C	14'100	0	0	14'100	297.33	3'878'821.40	3.93
WISDOMTREE ENH CMDTY EX AGRI UCITS ETF	0	53'000	0	53'000	11.85	581'089.69	0.59
XTRACKERS MSCI EMERGING MKTS UCITS 1CC	16'300	0	0	16'300	47.88	722'088.95	0.73
XTRACKERS MSCI WORLD INDEX UCITS-1C CAP	78'700	15'500	94'200	0	0.00	0.00	0.00
XTRACKERS MSCI WORLD UCITS ETF 1C	0	87'700	0	87'700	79.91	6'484'099.56	6.57
<i>Irland</i>						30'445'576.37	30.85
ISHARES RUSSEL 2000 ETF FUND	1'200	0	0	1'200	174.36	193'587.39	0.20
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>						193'587.39	0.20
US Dollar						30'639'163.76	31.05
Die an einer Börse gehandelten Effekten						36'895'790.47	37.39
LEADENHALL ILS FD PLC CL H2	0	11'070	0	11'070	98.89	1'012'911.55	1.03
<i>Irland</i>						1'012'911.55	1.03
BLUEORCHARD MICROFINANCE FUND I USD	0	85	0	85	13'942.85	1'096'527.26	1.11

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
GLOBAL SENIOR LOAN FUND EB CAP	0	500	0	500	1'180.13	545'944.89	0.55
<i>Luxemburg</i>						1'642'472.15	1.66
LEADL UCITS ILS -A- USD	0	9'504	9'504	0	0.00	0.00	0.00
<i>Vereinigtes Königreich</i>						0.00	0.00
US Dollar						2'655'383.70	2.69
Die an einem anderen geregelten Markt gehandelt Werden						2'655'383.70	2.69
HELVETIA CH SWISS PROPERTY FUND	30'950	44'702	30'950	44'702	110.00	4'917'220.00	4.98
<i>Schweiz</i>						4'917'220.00	4.98
Schweizer Franken						4'917'220.00	4.98
MORGAN STANLEY INV GLB CONV BD -Z-	0	24'400	0	24'400	43.59	984'069.22	1.00
<i>Luxemburg</i>						984'069.22	1.00
US Dollar						984'069.22	1.00
Nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt, bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						984'069.22	1.00
Anteile in Investmentfonds						45'452'463.39	46.06

Inventar des Vermögens

Zins- satz in %	Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31. Dezember 2021	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 31. Dezember 2022	Kurs	Verkehrswert	in %
Strukturierte Produkte									
0.000	CITIGROUP GLOBAL MARKE 0.00 21-22 16/12U	16.12.22	10'600	0	10'600	0	0.00	0.00	0.00
0.000	CITIGROUP GLOBAL MARKE 0.00 22-23 12/12U	12.12.23	0	10'600	0	10'600	318.40	3'122'682.83	3.16
	SG ISSUER	07.11.23	0	8'894	0	8'894	316.50	2'604'472.58	2.64
	<i>Luxemburg</i>							5'727'155.41	5.80
0.000	BNP PAR ISSUANCE BV 22-23 24/02U	28.02.23	0	13'000	0	13'000	314.50	3'782'840.78	3.83
0.000	JP MORGAN STRUCTURED 0.00 21-22 08/11U	08.11.22	8'894	0	8'894	0	0.00	0.00	0.00
	<i>Niederlande</i>							3'782'840.78	3.83
0.000	UBS LONDON PERLES 2013 13- XX 31/12U	31.12.99	12'400	0	0	12'400	318.52	3'654'326.46	3.70
	<i>Vereinigtes Königreich</i>							3'654'326.46	3.70
	US Dollar							13'164'322.65	13.33
	Die an einem anderen geregelten Markt gehandelt Werden							13'164'322.65	13.33
	Strukturierte Produkte							13'164'322.65	13.33

Inventar des Vermögens**Derivative Finanzinstrumente**

	Kurs	Käufe	Devisen	Verkäufe	Devisen	Verfall	Verkehrswert	in %
Devisentermingeschäfte *								
	1.039	2'670'363.08	CHF	2'775'000.00	USD	15.05.23	141'280.47	0.14
	1.066	2'602'411.65	CHF	2'775'000.00	USD	10.02.23	46'115.44	0.05
	1.021	5'434'149.30	CHF	5'550'000.00	USD	14.11.22	0.00	0.00
	0.956	1'150'570.30	CHF	1'100'000.00	EUR	14.11.22	0.00	0.00
	1.096	5'064'835.66	CHF	5'550'000.00	USD	10.08.22	0.00	0.00
	1.091	2'543'293.05	CHF	2'775'000.00	USD	13.05.22	0.00	0.00
	0.948	949'802.40	CHF	900'000.00	EUR	13.05.22	0.00	0.00
	0.919	2'775'000.00	USD	2'549'348.10	CHF	11.02.22	0.00	0.00
	1.088	2'550'932.63	CHF	2'775'000.00	USD	11.02.22	0.00	0.00
Devisentermingeschäfte							187'395.91	0.19
Devisentermingeschäfte							187'395.91	0.19
Derivative Finanzinstrumente							187'395.91	0.19

* Identität der Vertragspartner bei OTC-Geschäften: Zürcher Kantonalbank

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31. Dezember 2022	Verkehrswert	in %
Bankguthaben Sichtguthaben			
CACEIS Bank, Montrouge, Zweigniederlassung Nyon / Schweiz	1'301'030.86	1'301'030.86	1.32
Bankguthaben Sichtguthaben		1'301'030.86	1.32

Wechselkurs

1 EUR	=	CHF	0.98745
1 USD	=	CHF	0.92523

Derivate unter Anwendung des Commitment-Ansatzes I

Engagement-reduzierende Positionen

Devisentermingeschäfte

5'135'017.56

Total in CHF**5'135'017.56**

Total in % des Nettofondsvermögens

5.22

Angaben früherer Jahre

Datum	Klasse	Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode*		Anteile im Umlauf	Nettofondsvermögen	
31.12.20	A1	CHF	108.80	522'584.787	CHF	56'856'744.69
31.12.21	A1	CHF	126.43	538'286.787	CHF	68'056'745.91
31.12.22	A1	CHF	106.43	625'106.263	CHF	66'531'033.26
31.12.20	A2	CHF	108.26	300'102.658	CHF	32'489'251.36
31.12.21	A2	CHF	125.54	291'840.658	CHF	36'638'778.92
31.12.22	A2	CHF	105.36	233'452.180	CHF	24'597'118.49
31.12.20	R1	CHF	108.80	14'660.000	CHF	1'594'938.60
31.12.21	R1	CHF	126.43	53'355.000	CHF	6'745'749.81
31.12.22	R1	CHF	106.43	68'072.000	CHF	7'244'969.48
31.12.20	R2	CHF	108.36	23'146.000	CHF	2'508'186.60
31.12.22	E	CHF	86.63	774.117	CHF	67'061.81

* Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

KURZBERICHT DER KOLLEKTIVANLAGENGESETZLICHEN PRÜFGESELLSCHAFT

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zur Jahresrechnung des

HELVETIA ALLEGRA FONDS

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnung

Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Anlagefonds HELVETIA ALLEGRA FONDS mit den Teilvermögen

- Helvetia Allegra 30;
- Helvetia Allegra 50;
- Helvetia Allegra 85;
- Helvetia Allegra ONE.

- bestehend aus der Vermögensrechnung zum 31. Dezember 2022, der Erfolgsrechnung für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG) - geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht die beigelegte Jahresrechnung dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt «Verantwortlichkeiten der kollektivanlagen-gesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung» unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

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

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, aber nicht die Jahresrechnung und unseren dazugehörigen Bericht.

Unser Prüfungsurteil zur Jahresrechnung erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir bringen keinerlei Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu zum Ausdruck.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zur Jahresrechnung oder unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf Grundlage der von uns durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung einer Jahresrechnung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt und für die Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung einer Jahresrechnung zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist.

Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnung getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in der Jahresrechnung aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Kontrollsystems des Anlagefonds abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

KPMG AG

Olivier Gauderon
Zugelassener Revisionsexperte
Leitender Prüfer

Santiago Ramos
Zugelassener Revisionsexperte

Genf, 28. April 2023

Beilage:

Jahresrechnung bestehend aus der Vermögensrechnung zum 31. Dezember 2022, der Erfolgsrechnung für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)