



# Alegra High Grade ABS Fund

Halbjahresbericht per 30.06.2023 (ungeprüft)

---

Kollektivtreuhänderschaft nach liechtensteinischem Recht des Typs  
Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW)

**alegra capital**

## Inhaltsverzeichnis

|   |    |
|---|----|
| Organisation .....                                  | 3  |
| Auf einen Blick .....                               | 4  |
| Alegra High Grade ABS Portfolio .....               | 6  |
| Vermögensrechnung per 30.06.2023 .....              | 6  |
| Erfolgsrechnung vom 01.01.2023 bis 30.06.2023 ..... | 7  |
| 3-Jahres-Vergleich .....                            | 9  |
| Veränderung des Nettovermögens .....                | 10 |
| Anteile im Umlauf .....                             | 11 |
| Vermögensinventar per 30.06.2023 .....              | 12 |
| Derivative Finanzinstrumente .....                  | 14 |
| Ergänzende Angaben .....                            | 15 |

Die Anteile dürfen weder an US-Bürger noch an in den USA domizilierte Personen verkauft werden.

## Organisation

### Verwaltungsgesellschaft

VP Fund Solutions (Liechtenstein) AG  
Aeulestrasse 6  
LI-9490 Vaduz

### Verwaltungsrat

Felix Brill (Vorsitzender), Zürich (CH)  
Michael Jent (Mitglied), Brütten (CH)  
Romain Pierre Moebus (Mitglied), Born (LU)

### Geschäftsleitung

Daniel Siepmann (Vorsitzender),  
Wilten b. Wollerau (CH)  
Martin Jonasch (Mitglied), Schaan (LI)  
Wolfdieter Schnee (Mitglied), Rankweil (AT)

### Portfolio Manager

Alegra Capital (Lie) AG  
Aeulestrasse 45  
LI-9490 Vaduz

### Verwahrstelle

VP Bank AG  
Aeulestrasse 6  
LI-9490 Vaduz

### Wirtschaftsprüfer

Grant Thornton AG  
Bahnhofstrasse 15  
LI-9494 Schaan

### Vertriebsträger

VP Fund Solutions (Luxembourg) SA  
2, rue Edward Steichen  
LU-2540 Luxemburg

### Register- und Transferstelle

VP Bank AG  
Aeulestrasse 6  
LI-9490 Vaduz

### Informationsstelle Deutschland

Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG  
Kaiserstrasse 24  
DE-60311 Frankfurt am Main

### Publikationsorgan Deutschland

fundinfo AG  
Staffelstrasse 12  
CH-8045 Zürich

### Zahlstelle Deutschland

Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG  
Kaiserstrasse 24  
DE-60311 Frankfurt am Main

### Publikationsorgan Liechtenstein

LAFV (Liechtensteinischer Anlagefondsverband)  
Meierhofstrasse 2  
LI-9490 Vaduz

### Publikationsorgan Schweiz

fundinfo AG  
Staffelstrasse 12  
CH-8045 Zürich

### Vertreter Schweiz

PvB Pernet von Ballmoos AG  
Zollikerstrasse 226  
CH-8008 Zürich

### Vertriebsträger Schweiz

Alegra Capital (Lie) AG  
Aeulestrasse 45  
LI-9490 Vaduz

### Zahlstelle Schweiz

Helvetische Bank AG  
Seefeldstrasse 215  
CH-8008 Zürich

## Auf einen Blick

Nettovermögen per 30.06.2023 EUR 29.8 Millionen

### Nettoinventarwert pro Anteil per 30.06.2023

Alegra High Grade ABS Portfolio (CHF) CHF 1'001.46  
Alegra High Grade ABS Portfolio (EUR) EUR 1'605.63

### Rendite<sup>1</sup>

Alegra High Grade ABS Portfolio (CHF) seit 31.12.2022 5.69 %  
Alegra High Grade ABS Portfolio (EUR) 6.69 %

### Liberierung

Alegra High Grade ABS Portfolio (CHF) per 31.05.2017  
Alegra High Grade ABS Portfolio (EUR) 16.10.2006

### Total Expense Ratio (TER)<sup>2</sup>

|                                       | mit Performance Fee | ohne Performance Fee |
|---------------------------------------|---------------------|----------------------|
| Alegra High Grade ABS Portfolio (CHF) | 0.65 %              | 0.65 %               |
| Alegra High Grade ABS Portfolio (EUR) | 0.65 %              | 0.65 %               |

### Portfolio Turnover Rate (PTR)<sup>3</sup>

Alegra High Grade ABS Portfolio 47.36 %

### Erfolgsverwendung

Alegra High Grade ABS Portfolio (CHF) Thesaurierend  
Alegra High Grade ABS Portfolio (EUR) Thesaurierend

### Performance Fee

Alegra High Grade ABS Portfolio (CHF) 20% mit Hurdle Rate (rollierender Durchschnitt 3M SARON Compounded Rate) mit High Watermark

Alegra High Grade ABS Portfolio (EUR) 20% mit Hurdle Rate (rollierender Durchschnitt 3 Monats EURIBOR) mit High Watermark

### Kommissionen/Gebühren

|                                       | Pauschale Entschädigung (max.) |
|---------------------------------------|--------------------------------|
| Alegra High Grade ABS Portfolio (CHF) | 0.650 %                        |
| Alegra High Grade ABS Portfolio (EUR) | 0.650 %                        |

Alegra High Grade ABS Portfolio zuzüglich bis zu (p.a.) CHF 30'000.00

<sup>1</sup> Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

<sup>2</sup> Diese Kennziffer drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Nettofondsvermögens aus.

<sup>3</sup> Diese Kennziffer gibt an, wie viele Transaktionen auf Basis einer jährlichen Berechnung im Vermögen eines Fonds vorgenommen wurden.

|                                       |   |   |
|---------------------------------------|---|---|
|                                       | <b>Ausgabekommission<br/>zugunsten Dritter (max.)</b>   | <b>Ausgabekommission<br/>zugunsten Fonds (max.)</b>   |
| Alegra High Grade ABS Portfolio (CHF) | 3.00 %  | n/a   |
| Alegra High Grade ABS Portfolio (EUR) | 3.00 %  | n/a   |
|                                       | <b>Rücknahmekommission<br/>zugunsten Dritter (max.)</b> | <b>Rücknahmekommission<br/>zugunsten Fonds (max.)</b> |
| Alegra High Grade ABS Portfolio (CHF) | 2.00 %  | n/a   |
| Alegra High Grade ABS Portfolio (EUR) | 2.00 %  | n/a   |
|                                       | <b>Konversionsgebühr<br/>zugunsten Dritter (max.)</b>   | <b>Konversionsgebühr<br/>zugunsten Fonds (max.)</b>   |
| Alegra High Grade ABS Portfolio (CHF) | 0.00 %  | n/a   |
| Alegra High Grade ABS Portfolio (EUR) | 0.00 %  | n/a   |
|                                       | <b>Fondsdomizil</b>                                     | <b>ISIN</b>   |
| Alegra High Grade ABS Portfolio (CHF) | Liechtenstein   | LI0365682298  |
| Alegra High Grade ABS Portfolio (EUR) | Liechtenstein   | LI0027320568  |

# Alegra High Grade ABS Portfolio

## Vermögensrechnung per 30.06.2023

| Alegra High Grade ABS Portfolio     | (in EUR)             |
|-------------------------------------|----------------------|
| Bankguthaben                        |                      |
| Bankguthaben auf Sicht              | 2'315'375.34         |
| Wertpapiere                         |                      |
| Obligationen                        | 27'175'155.00        |
| Derivative Finanzinstrumente        |                      |
| Derivate                            | -26'113.66           |
| Sonstige Vermögenswerte             |                      |
| Forderungen aus Zinsen              | 341'285.42           |
| <b>Gesamtvermögen</b>               | <b>29'805'702.10</b> |
| Verbindlichkeiten                   | -48'933.55           |
| Bankverbindlichkeiten auf Sicht     | -0.55                |
| <b>Gesamtverbindlichkeiten</b>      | <b>-48'934.10</b>    |
| <b>Nettovermögen</b>                | <b>29'756'768.00</b> |
| - davon Anteilklasse CHF            | 5'829'603.45         |
| - davon Anteilklasse EUR            | 23'927'164.55        |
| <b>Anteile im Umlauf</b>            |                      |
| Anteilklasse CHF                    | 5'682                |
| Anteilklasse EUR                    | 14'902               |
| <b>Nettoinventarwert pro Anteil</b> |                      |
| Anteilklasse CHF                    | CHF 1'001.46         |
| Anteilklasse EUR                    | EUR 1'605.63         |

## Erfolgsrechnung vom 01.01.2023 bis 30.06.2023

| Alegra High Grade ABS Portfolio                          | (in EUR)          |
|--|-------------------|
| Erträge der Bankguthaben                                 | 6'538.28          |
| - davon Anteilklasse CHF                                 | 1'263.84          |
| - davon Anteilklasse EUR                                 | 5'274.44          |
| Erträge der Geldmarktinstrumente                         | 4'422.23          |
| - davon Anteilklasse CHF                                 | 836.82            |
| - davon Anteilklasse EUR                                 | 3'585.41          |
| Erträge der Wertpapiere                                  |                   |
| Obligationen   | 917'000.98        |
| - davon Anteilklasse CHF                                 | 174'848.47        |
| - davon Anteilklasse EUR                                 | 742'152.51        |
| Einkauf in laufende Erträge bei der Ausgabe von Anteilen | 13'941.47         |
| - davon Anteilklasse CHF                                 | 0.00              |
| - davon Anteilklasse EUR                                 | 13'941.47         |
| <b>Total Erträge</b>                                     | <b>941'902.96</b> |
| - davon Anteilklasse CHF                                 | 176'949.13        |
| - davon Anteilklasse EUR                                 | 764'953.83        |
| Sollzinsen aus Bankverbindlichkeiten/Negativzinsen       | 249.83            |
| - davon Anteilklasse CHF                                 | 49.03             |
| - davon Anteilklasse EUR                                 | 200.80            |
| Verwaltungsvergütung                                     | 12'492.03         |
| - davon Anteilklasse CHF                                 | 2'841.36          |
| - davon Anteilklasse EUR                                 | 9'650.67          |
| Portfolio Management Gebühr                              | 70'974.30         |
| - davon Anteilklasse CHF                                 | 13'070.20         |
| - davon Anteilklasse EUR                                 | 57'904.10         |
| Verwahrstellenvergütung                                  | 5'961.91          |
| - davon Anteilklasse CHF                                 | 1'136.55          |
| - davon Anteilklasse EUR                                 | 4'825.36          |
| Sonstige Aufwendungen                                    | 7'992.90          |
| - davon Anteilklasse CHF                                 | 1'522.70          |
| - davon Anteilklasse EUR                                 | 6'470.20          |

|   |                     |
|---|---------------------|
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen                                   | 37'991.80           |
| - davon Anteilklasse CHF  | 1'129.68            |
| - davon Anteilklasse EUR  | 36'862.12           |
| <b>Total Aufwendungen</b>   | <b>135'662.77</b>   |
| - davon Anteilklasse CHF  | 19'749.52           |
| - davon Anteilklasse EUR  | 115'913.25          |
| <b>Nettoerfolg</b>  | <b>806'240.19</b>   |
| - davon Anteilklasse CHF  | 157'199.61          |
| - davon Anteilklasse EUR  | 649'040.58          |
| <b>Realisierte Kapitalgewinne/-verluste</b>   | <b>-387'403.30</b>  |
| - davon Anteilklasse CHF  | -50'912.25          |
| - davon Anteilklasse EUR  | -336'491.05         |
| <b>Realisierter Erfolg</b>  | <b>418'836.89</b>   |
| - davon Anteilklasse CHF  | 106'287.36          |
| - davon Anteilklasse EUR  | 312'549.53          |
| <b>Veränderung der nicht realisierten Kapitalgewinne/-verluste seit letztem Geschäftsjahresende</b> | <b>1'490'544.52</b> |
| - davon Anteilklasse CHF  | 272'608.25          |
| - davon Anteilklasse EUR  | 1'217'936.27        |
| <b>Gesamterfolg</b>   | <b>1'909'381.41</b> |
| - davon Anteilklasse CHF  | 378'895.61          |
| - davon Anteilklasse EUR  | 1'530'485.80        |



## 3-Jahres-Vergleich

Alegra High Grade ABS Portfolio

(in EUR)

### Nettovermögen

|                    |               |
|--------------------|---------------|
| 31.12.2021         | 32'682'028.79 |
| - Anteilklasse CHF | 5'480'987.19  |
| - Anteilklasse EUR | 27'201'041.60 |
| 31.12.2022         | 28'946'523.46 |
| - Anteilklasse CHF | 5'500'547.28  |
| - Anteilklasse EUR | 23'445'976.18 |
| 30.06.2023         | 29'756'768.00 |
| - Anteilklasse CHF | 5'829'603.45  |
| - Anteilklasse EUR | 23'927'164.55 |

### Anteile im Umlauf

|                    |        |
|--------------------|--------|
| 31.12.2021         |        |
| - Anteilklasse CHF | 5'432  |
| - Anteilklasse EUR | 16'457 |
| 31.12.2022         |        |
| - Anteilklasse CHF | 5'732  |
| - Anteilklasse EUR | 15'579 |
| 30.06.2023         |        |
| - Anteilklasse CHF | 5'682  |
| - Anteilklasse EUR | 14'902 |

### Nettoinventarwert pro Anteil

|                    |          |
|--------------------|----------|
| 31.12.2021         |          |
| - Anteilklasse CHF | 1'009.02 |
| - Anteilklasse EUR | 1'652.86 |
| 31.12.2022         |          |
| - Anteilklasse CHF | 959.62   |
| - Anteilklasse EUR | 1'504.97 |
| 30.06.2023         |          |
| - Anteilklasse CHF | 1'025.98 |
| - Anteilklasse EUR | 1'605.63 |

## Veränderung des Nettovermögens

Alegra High Grade ABS Portfolio

(in EUR)

|  |                      |
|--|----------------------|
| <b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b> | <b>28'946'523.46</b> |
| - davon Anteilklasse CHF                           | 5'500'547.28         |
| - davon Anteilklasse EUR                           | 23'445'976.18        |
| <b>Ausschüttungen</b>                              | <b>0.00</b>          |
| - davon Anteilklasse CHF                           | 0.00                 |
| - davon Anteilklasse EUR                           | 0.00                 |
| <b>Mittelveränderung aus Anteilsausgaben</b>       | <b>663'166.77</b>    |
| - davon Anteilklasse CHF                           | 0.00                 |
| - davon Anteilklasse EUR                           | 663'166.77           |
| <b>Mittelveränderung aus Anteilsrücknahmen</b>     | <b>-1'786'353.97</b> |
| - davon Anteilklasse CHF                           | -50'969.12           |
| - davon Anteilklasse EUR                           | -1'735'384.85        |
| <b>Ertragsausgleich</b>                            | <b>24'050.33</b>     |
| - davon Anteilklasse CHF                           | 1'129.68             |
| - davon Anteilklasse EUR                           | 22'920.65            |
| <b>Gesamterfolg</b>                                | <b>1'909'381.41</b>  |
| - davon Anteilklasse CHF                           | 378'895.61           |
| - davon Anteilklasse EUR                           | 1'530'485.80         |
| <b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>   | <b>29'756'768.00</b> |
| - davon Anteilklasse CHF                           | 5'829'603.45         |
| - davon Anteilklasse EUR                           | 23'927'164.55        |

## Anteile im Umlauf

### Alegra High Grade ABS Portfolio

---

#### Stand zu Beginn der Berichtsperiode

|                    |        |
|--------------------|--------|
| - Anteilklasse CHF | 5'732  |
| - Anteilklasse EUR | 15'579 |

#### Neu ausgegebene Anteile

|                    |     |
|--------------------|-----|
| - Anteilklasse CHF | 0   |
| - Anteilklasse EUR | 418 |

#### Zurückgenommene Anteile

|                    |        |
|--------------------|--------|
| - Anteilklasse CHF | -50    |
| - Anteilklasse EUR | -1'095 |

#### Stand am Ende der Berichtsperiode

|                    |        |
|--------------------|--------|
| - Anteilklasse CHF | 5'682  |
| - Anteilklasse EUR | 14'902 |

## Vermögensinventar per 30.06.2023

### Alegra High Grade ABS Portfolio

|   | Anfangsbestand<br>01.01.2023 | Käufe <sup>1</sup> | Verkäufe <sup>1</sup> | Endbestand<br>30.06.2023 | Kurs   | Kurswert<br>in EUR | % des<br>NAV |
|---|------------------------------|--------------------|-----------------------|--------------------------|--------|--------------------|--------------|
| <b>Wertpapiere, die an einer Börse gehandelt werden</b>       |                              |                    |                       |                          |        |                    |              |
| <b>Floater Obligationen</b>                                   |                              |                    |                       |                          |        |                    |              |
| <b>Floater Obligationen in EUR</b>                            |                              |                    |                       |                          |        |                    |              |
| Arbour CLO V 31 Var   | 0                            | 1'938'000          | 0                     | 1'938'000                | 90.75  | 1'758'735          | 5.91         |
| Arbour CLO 31 Var   | 1'400'000                    | 405'000            | 0                     | 1'805'000                | 95.00  | 1'714'750          | 5.76         |
| Nth Westerly V 34 Var   | 0                            | 1'600'000          | 0                     | 1'600'000                | 88.92  | 1'422'720          | 4.78         |
| BNPP AM Eur 17 31 Var   | 1'000'000                    | 500'000            | 0                     | 1'500'000                | 93.25  | 1'398'750          | 4.70         |
| Aurium CLO V 34 Var   | 1'500'000                    | 0                  | 0                     | 1'500'000                | 92.34  | 1'385'100          | 4.65         |
| Arbour CLO VII 33 Var   | 1'000'000                    | 500'000            | 0                     | 1'500'000                | 90.86  | 1'362'900          | 4.58         |
| BNPP IP EurCLO 30 Var   | 1'000'000                    | 500'000            | 0                     | 1'500'000                | 90.25  | 1'353'750          | 4.55         |
| Logiclane I CLO 35 Var  | 0                            | 1'500'000          | 0                     | 1'500'000                | 90.07  | 1'351'050          | 4.54         |
| Nthwoods Cap 19 33 Var  | 2'000'000                    | 0                  | 500'000               | 1'500'000                | 89.61  | 1'344'150          | 4.52         |
| Northwoods 24 35 Var  | 1'500'000                    | 0                  | 0                     | 1'500'000                | 83.00  | 1'245'000          | 4.18         |
| Armada Euro CLO 31 Var  | 1'310'000                    | 0                  | 0                     | 1'310'000                | 91.50  | 1'198'650          | 4.03         |
| Aurium CLO IV 31 Var  | 1'250'000                    | 0                  | 0                     | 1'250'000                | 90.00  | 1'125'000          | 3.78         |
| North West VI 32 Var  | 1'000'000                    | 0                  | 0                     | 1'000'000                | 94.75  | 947'500            | 3.18         |
| North West VI 32 Var  | 1'000'000                    | 0                  | 0                     | 1'000'000                | 94.75  | 947'500            | 3.18         |
| Con CLO III 30 Var  | 0                            | 1'000'000          | 0                     | 1'000'000                | 91.55  | 915'510            | 3.08         |
| Aqu Eu CLO 19-3 34 Var  | 1'000'000                    | 0                  | 0                     | 1'000'000                | 91.15  | 911'500            | 3.06         |
| Sculp Eur I 34 Var  | 1'000'000                    | 0                  | 0                     | 1'000'000                | 91.02  | 910'200            | 3.06         |
| Snd Pt VII 35 Var   | 1'000'000                    | 0                  | 0                     | 1'000'000                | 90.83  | 908'300            | 3.05         |
| Contego CLO IV 30 Var   | 1'000'000                    | 0                  | 0                     | 1'000'000                | 90.65  | 906'520            | 3.05         |
| Blackrock V 31 Var  | 1'000'000                    | 0                  | 0                     | 1'000'000                | 90.50  | 905'000            | 3.04         |
| Sculptor Eur V 32 Var   | 1'000'000                    | 0                  | 0                     | 1'000'000                | 90.50  | 905'000            | 3.04         |
| Cordatus XXVI 37 Var  | 900'000                      | 0                  | 0                     | 900'000                  | 100.00 | 900'000            | 3.02         |
| Cairn CLO XII 34 Var  | 1'000'000                    | 0                  | 0                     | 1'000'000                | 87.61  | 876'100            | 2.94         |
| Nthwoods Cap 23 34 Var  | 550'000                      | 0                  | 0                     | 550'000                  | 87.54  | 481'470            | 1.62         |
| Aqu Eu CLO 17-2 30 Var  | 1'000'000                    | 0                  | 1'000'000             | 0                        | 0.00   | 0                  | 0.00         |
| Arbour CLO II 34 Var  | 1'000'000                    | 0                  | 1'000'000             | 0                        | 0.00   | 0                  | 0.00         |
| Bluemt Fuji II 30 Var   | 1'000'000                    | 0                  | 1'000'000             | 0                        | 0.00   | 0                  | 0.00         |
| BNPP 2019 32 Var  | 0                            | 1'000'000          | 1'000'000             | 0                        | 0.00   | 0                  | 0.00         |
| Dryd 51EuCLO17 31 Var   | 1'500'000                    | 0                  | 1'500'000             | 0                        | 0.00   | 0                  | 0.00         |
| <b>Total Floater Obligationen in EUR</b>                      |                              |                    |                       |                          |        | <b>27'175'155</b>  | <b>91.32</b> |
| <b>Floater Obligationen in USD</b>                            |                              |                    |                       |                          |        |                    |              |
| Venture 31 31 Var   | 1'000'000                    | 0                  | 1'000'000             | 0                        | 0.00   | 0                  | 0.00         |
| Venture XXVII 30 Var  | 1'500'000                    | 0                  | 1'500'000             | 0                        | 0.00   | 0                  | 0.00         |
| <b>Total Floater Obligationen in USD</b>                      |                              |                    |                       |                          |        | <b>0</b>           | <b>0.00</b>  |
| <b>Total Floater Obligationen</b>                             |                              |                    |                       |                          |        | <b>27'175'155</b>  | <b>91.32</b> |
| <b>Total Wertpapiere, die an einer Börse gehandelt werden</b> |                              |                    |                       |                          |        | <b>27'175'155</b>  | <b>91.32</b> |
| <b>Total Wertpapiere</b>                                      |                              |                    |                       |                          |        | <b>27'175'155</b>  | <b>91.32</b> |

|                              | Anfangsbestand<br>01.01.2023 | Käufe <sup>1</sup> | Verkäufe <sup>1</sup> | Endbestand<br>30.06.2023 | Kurs | Kurswert<br>in EUR | % des<br>NAV |
|------------------------------|------------------------------|--------------------|-----------------------|--------------------------|------|--------------------|--------------|
| Bankguthaben                 |                              |                    |                       |                          |      | 2'315'375          | 7.78         |
| Derivative Finanzinstrumente |                              |                    |                       |                          |      | -26'114            | -0.09        |
| Sonstige Vermögenswerte      |                              |                    |                       |                          |      | 341'285            | 1.15         |
| Gesamtvermögen               |                              |                    |                       |                          |      | 29'805'702         | 100.16       |
| Verbindlichkeiten            |                              |                    |                       |                          |      | -48'934            | -0.16        |
| Bankverbindlichkeiten        |                              |                    |                       |                          |      | -1                 | 0.00         |
| Nettovermögen                |                              |                    |                       |                          |      | 29'756'768         | 100.00       |

<sup>1</sup> inklusive Split, Umtausch, Gratisaktien und Zuteilung aus Anrechten

## Derivative Finanzinstrumente

### Am Ende der Berichtsperiode offene Devisentermingeschäfte

| Klasse   | Betrag        | Gegenwert           | Fälligkeit | Gegenpartei | Verkehrswert<br>in EUR | % des NAV |
|----------|---------------|---------------------|------------|-------------|------------------------|-----------|
| CHF Kauf | CHF 5'695'000 | gegen EUR 5'882'657 | 15.09.2023 | VP Bank AG  | -26'114                | -0.09     |

### Volumen über offene Kontrakte in derivativen Finanzinstrumenten

|  |     |         |
|--|-----|---------|
| Devisentermin short  | EUR | -26'114 |
| Total aus Derivategeschäften gebundene Mittel / Basiswerte in EUR: |     | -26'114 |

### Während der Berichtsperiode getätigte Devisentermingeschäfte

| Devisentermingeschäft                  | Termin     |
|--|------------|
| Kauf EUR 1'183'421 gegen USD 1'282'000 | 15.02.2023 |
| Kauf EUR 1'233'530 gegen USD 1'320'000 | 14.03.2023 |
| Kauf CHF 245'000 gegen EUR 248'428     | 17.03.2023 |
| Kauf EUR 1'187'593 gegen USD 1'275'000 | 18.04.2023 |
| Kauf EUR 1'156'358 gegen USD 1'275'000 | 15.05.2023 |
| Kauf EUR 1'125'034 gegen USD 1'230'000 | 15.06.2023 |
| Kauf EUR 5'781'893 gegen CHF 5'620'000 | 16.06.2023 |
| Kauf EUR 5'796'506 gegen CHF 5'640'000 | 16.06.2023 |
| Kauf CHF 5'640'000 gegen EUR 5'834'282 | 16.06.2023 |

## Ergänzende Angaben

### Jahresabschluss

Letzter Kalendertag des Monats Dezember.

### Rechnungseinheit

Berichtswährung des OGAW: EUR

Währung der Portfolios und deren Anteilklassen:

Alegra High Grade ABS Portfolio: EUR

- Anteilklasse CHF: CHF

- Anteilklasse EUR: EUR

### Bewertungsgrundsätze

Die Bewertung des Vermögens erfolgt nach den in den konstituierenden Dokumenten genannten Grundsätzen.

### Risikomanagement Methode

Das Derivaterisiko wird gemäss Commitment Ansatz berechnet.

### Verwendete Devisenkurse per Ende der Berichtsperiode:

EUR 1.— entspricht CHF 0.976100

EUR 1.— entspricht USD 1.090980

### Performance Fee

Während der Berichtsperiode wurde keine Performance Fee erhoben.

### Transaktionskosten

- Anteilklasse CHF: EUR 835.25

- Anteilklasse EUR: EUR 3'556.90

### Hinterlegungsstelle

Die Wertpapiere waren per Ende der Berichtsperiode bei folgender Hinterlegungsstelle deponiert:

Alegra High Grade ABS Portfolio:

- Euroclear Bank SA, 1210 Brussels, BELGIEN (BE)

### Vertriebsländer

Der Fonds wird zum Berichtsstichtag in folgenden Ländern vertrieben:

- Deutschland

- Liechtenstein

- Schweiz

### Steuerliche Transparenz

Der Fonds ist zum Berichtsstichtag in folgenden Ländern steuerlich transparent:

- Deutschland

- Liechtenstein

- Schweiz

### **Anlegerinformationen**

Die konstituierenden Dokumente, die Prospekte, die Basisinformationsblätter für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte (PRIIP), die letzten verfügbaren Jahres- und Halbjahresberichte, die aktuellen Anteilspreise sowie weitere Informationen sind kostenlos in deutscher Sprache auf folgenden Webseiten erhältlich: [www.vpfundsolutions.li](http://www.vpfundsolutions.li), [www.lafv.li](http://www.lafv.li). In der Schweiz können diese bei PVB Pernet von Ballmoos AG, Zollikerstrasse 226, 8008 Zürich, Schweiz und Helvetische Bank AG, Seefeldstrasse 215, 8008 Zürich, Schweiz kostenlos bezogen werden.