

## Factsheet 09/2022

30.09.2022

### Actions Suisse Smart Beta Dynamique 100 ESG.

Des indices innovant, un placement intelligent

#### Caractéristiques

Année de fondation	2015
N° de valeur	27589595 (ISIN: CH0275895958)
Bloomberg	AKSB100 SW
Valeur de référence	Swiss Performance Index (SPI)
Évaluation	Hebdomadaire
Politique de distribution	Accumulative

#### Style de placement

##### Actions Suisse Smart Beta Dynamique 100 ESG

Signal	Offensif (100% ≥ GLOCAP ≥ 80%)	Neutre (80% > GLOCAP ≥ 60%)	Défensif (60% > GLOCAP ≥ 0%)
Proportion: basé risque / basé rendement	30% / 70%	50% / 50%	70% / 30%

Allocation



	Offensif	Neutre	Défensif
Minimum Volatility Index	15.0%	25.0%	35.0%
Risk Parity Index	15.0%	25.0%	35.0%
Value Index	23.3%	16.6%	10.0%
Momentum Index	23.3%	16.6%	10.0%
Quality Index	23.3%	16.6%	10.0%

#### Performance au 30.09.2022 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
Derniers mois	-7.45	-5.98	-1.47
Derniers 3 mois	-5.64	-4.83	-0.81
Année en cours	-23.54	-19.93	-3.61
Derniers 12 mois	-18.10	-12.48	-5.62
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	0.08	2.48	-2.40
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	2.56	4.74	-2.18
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement <sup>1</sup>	6.04	4.86	1.18

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		30.09.2022	31.12.2021
Fortune nette	(en millions CHF)	83.58	151.79
Nombre de quotes-parts		55 076	76 470
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 477.96	1 955.62
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	39.61	29.29
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 517.57	1 984.91
TER (TVA incl.)	(en %)		0.58

<sup>2</sup> par quote-part

#### Indicateurs de risque au 30.09.2022 (en %)

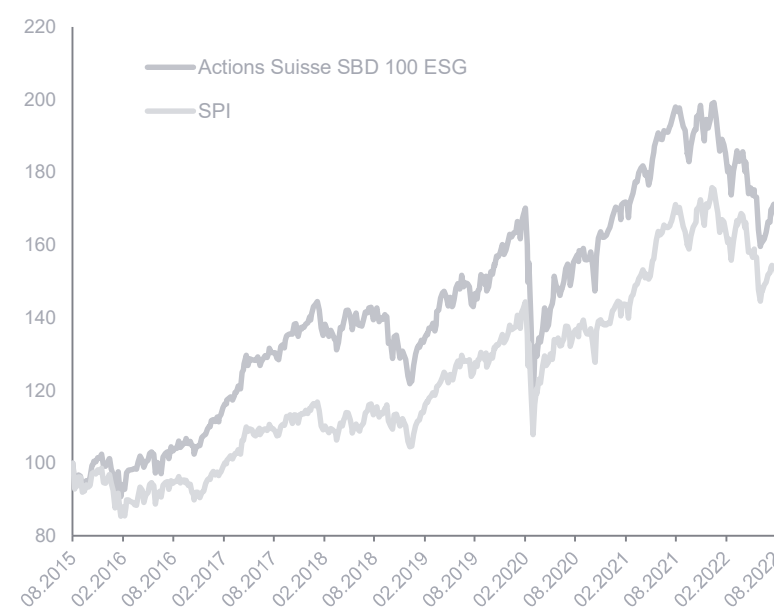
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	16.15	16.21	14.50
Marge d'erreur	(en %)	2.43	5.16	4.97
Beta		0.95	1.05	1.04
Sharpe Ratio		-1.28	-0.15	0.00
Information Ratio		-2.31	-0.46	-0.44
Jensen-Alpha		-0.06	-0.02	-0.02
Max. Drawdown		-23.54	-23.54	-23.54
Recovery Period	(en jours)	N.a.	N.a.	N.a.

<sup>3</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

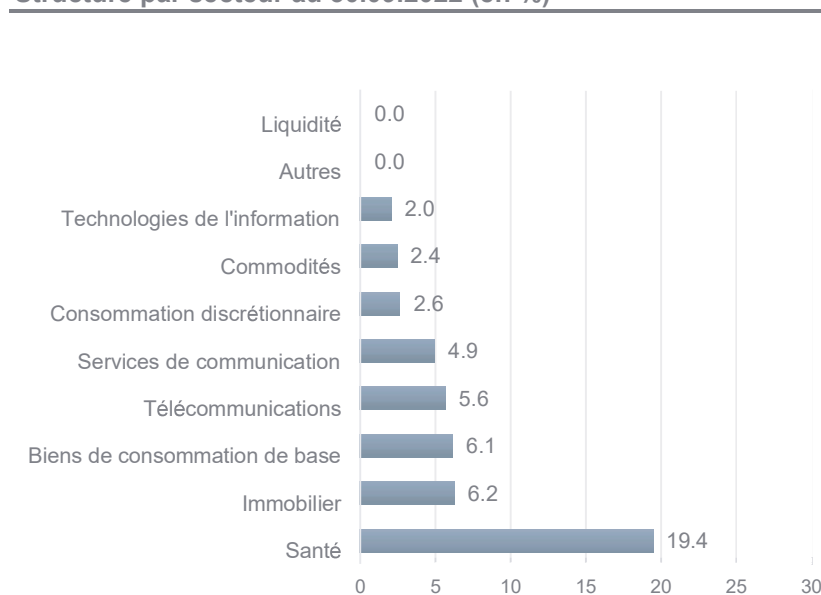
#### Les 10 principales positions au 30.09.2022 (en %)

Banque Cantonale Vaudoise N	5.02
Swisscom AG N	4.92
Novartis AG N	4.91
Galenica AG N	3.64
Baloise-Holding N	3.58
DKSH Holding AG N	3.41
PSP Swiss Property N	3.34
Roche Holding AG G	2.92
Helvetia Holding AG N	2.86
Swiss Prime Site AG N	2.75

#### Évolution des valeurs depuis le lancement



#### Structure par secteur au 30.09.2022 (en %)



#### Souscription et reprise

Les souscriptions et les reprises qui parviennent à l'Helvetia Fondation de placement avant mardi 11.00 h sont décomptées au cours de clôture du mercredi suivant.

#### Frais

Acquisition	0.00%
Reprise	0.00%

## Factsheet 09/2022

30.09.2022

### LPP-Mix.

Bien diversifié.

#### Caractéristiques

Année de fondation	1993
N° de valeur	1176860 (ISIN: CH0011768600)
Bloomberg	PATBVGM SW
Valeur de référence	Sur mesure
Évaluation	Hebdomadaire
Politique de distribution	Accumulative
Style de placement	Core-satellite
Allocation d'actifs stratégique*	- 40% Obligations Suisse - 10% Obligations Global hedged CHF - 15% Actions Suisse Responsables - 15% Actions Global Responsables - 20% Immobilier Suisse

#### Performance au 30.09.2022 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
1 mois	-3.35	-3.26	-0.09
3 mois	-2.01	-1.83	-0.18
Année en cours	-11.76	-11.39	-0.37
Derniers 12 mois	-10.02	-9.40	-0.62
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	-1.01	-0.53	-0.48
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	0.84	1.58	-0.74
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	2.55	3.19	-0.64
Derniers 15 ans <sup>1</sup>	2.22	2.78	-0.56
Depuis le lancement <sup>1</sup>	3.99	4.38	-0.39

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		30.09.2022	31.12.2021
Fortune nette	(en millions CHF)	18.43	20.76
Nombre de quotes-parts		17 212	17 105
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 062.16	1 205.09
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	8.53	8.36
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 070.69	1 213.45
TER 2021 (TVA incl.)	(en %)		0.44

<sup>2</sup> par quote-part

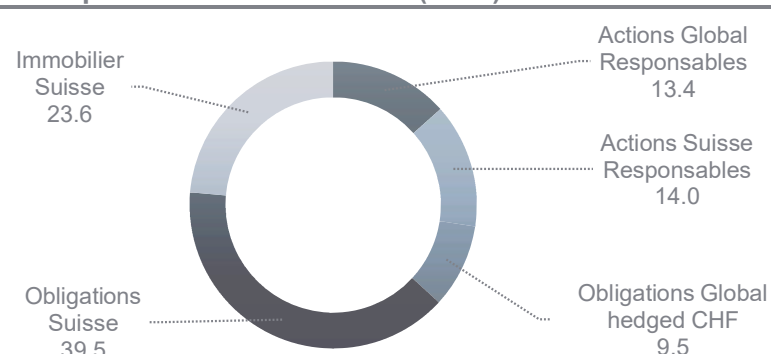
#### Indicateurs de risque au 30.09.2022 (en %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	6.97	7.23	6.10
Marge d'erreur	(en %)	0.44	0.55	0.61
Beta		0.94	1.00	1.00
Sharpe Ratio		-1.36	-0.06	0.23
Information Ratio		-1.41	-0.89	-1.20
Jensen-Alpha		-0.01	0.00	-0.01
Max. Drawdown		-11.76	-11.76	-11.76
Recovery Period	(en jours)	N.a.	N.a.	N.a.
Modified Duration <sup>4</sup>	(en %)	6.70		

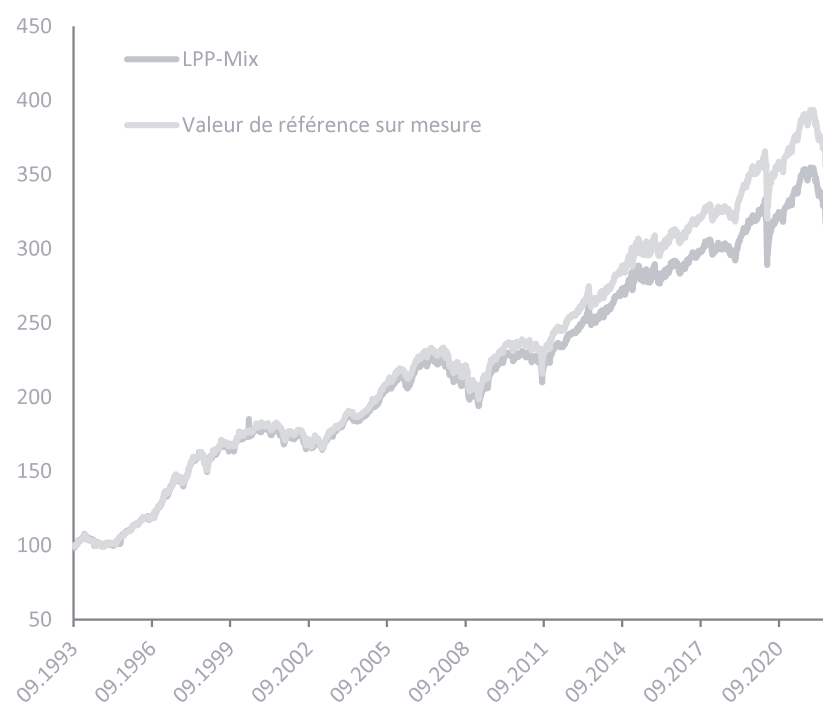
<sup>3</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

<sup>4</sup> Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 30.09.2022

#### Structure du portefeuille au 30.09.2022 (en %)



#### Évolution des valeurs depuis lancement



#### Notation de durabilité<sup>5</sup>

Obligations Suisse	1	2	3	4	5	6	7
Obligations Global hedged CHF	1	2	3	4	5	6	7
Actions Suisse Responsables	1	2	3	4	5	6	7
Actions Global Responsables	1	2	3	4	5	6	7

<sup>5</sup>Échelle: 1 pour faible et 7 pour élevée

#### Souscription et reprise

Les souscriptions et les reprises qui parviennent à l'Helvetia Fondation de placement avant mardi 11.00 h sont décomptées au cours de clôture du mercredi suivant.

#### Frais

Acquisition	0.00%
Reprise	0.25%

## Factsheet 09/2022

30.09.2022

### LPP-Mix Plus 35.

Orienté rendement.

#### Caractéristiques

Année de fondation	2013
N° de valeur	3539998 (ISIN: CH0035399986)
Bloomberg	BVGMP30 SW
Valeur de référence	Sur mesure
Évaluation	Hebdomadaire
Politique de distribution	Accumulative
Style de placement	Core-Satellite
Allocaion d'actifs stratégique*	- 22% Obligations Suisse - 7% Obligations Global hedged CHF - 20% Actions Suisse Responsables de ça 10% Smart Beta Dynamique 100 ESG 10% Responsables - 15% Actions Global Responsables - 26% Immobilier Suisse - 10% Hypothèques Suisse

#### Performance au 30.09.2022 (in %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
1 mois	-3.46	-3.19	-0.27
3 mois	-2.21	-1.81	-0.40
Année en cours	-11.29	-10.63	-0.66
Derniers 12 mois	-9.43	-8.03	-1.40
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	-0.07	0.96	-1.03
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	1.12	2.70	-1.58
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Derniers 15 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement <sup>1</sup>	2.98	3.92	-0.94

<sup>1</sup>annualisé

#### Chiffres-clés

		30.09.2022	31.12.2021
Fortune nette	(en millions CHF)	602.12	555.43
Nombre de quotes-parts		487 469	398 885
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 230.04	1 390.75
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	5.15	1.70
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 235.19	1 392.45
TER 2021 (TVA incl.)	(en %)		0.55

<sup>2</sup> par quote-part

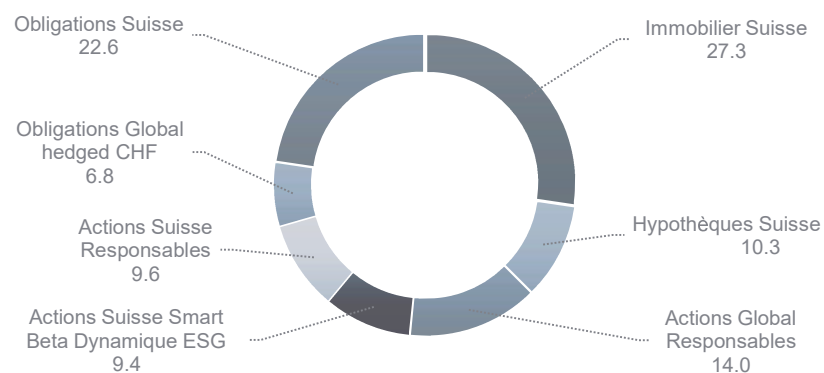
#### Indicateurs de risque au 30.09.2022 (in %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	6.87	7.03	6.25
Marge d'erreur	(en %)	0.60	1.57	1.72
Beta		0.92	1.04	1.07
Sharpe Ratio		-1.29	0.07	0.27
Information Ratio		-2.31	-0.66	-0.92
Jensen-Alpha		-0.02	-0.01	-0.02
Max. Drawdown		-11.29	-11.29	-11.29
Recovery Period	(en jours)	N.a.	N.a.	N.a.
Modified Duration <sup>4</sup>	(en %)	6.67		

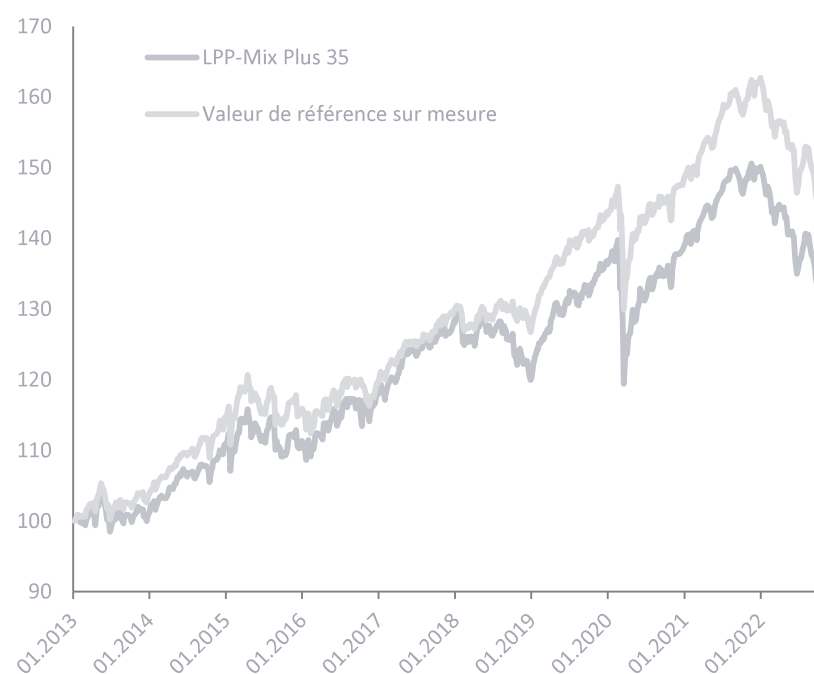
<sup>3</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

<sup>4</sup> Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 30.09.2022

#### Structure du portefeuille au 30.09.2022 (en %)



#### Évolution des valeurs depuis lancement



#### Notation de durabilité<sup>5</sup>

Obligations Suisse	1	2	3	4	5	6	7
Obligations Global hedged CHF	1	2	3	4	5	6	7
Actions Suisse Responsables	1	2	3	4	5	6	7
Actions Global Responsables	1	2	3	4	5	6	7

<sup>5</sup>Échelle: 1 pour faible et 7 pour élevée

#### Souscription et reprise

Les souscriptions et les reprises qui parviennent à l'Helvetia Fondation de placement avant mardi 11.00 h sont décomptées au cours de clôture du mercredi suivant.

#### Frais

Acquisition	0.00%
Reprise	0.50%

## Factsheet 09/2022

30.09.2022

### Hypothèques Suisse.

Rendement à faible volatilité.

#### Caractéristiques

Année de fondation	2018
N° de valeur	40868027 (ISIN: CH0408680277)
Bloomberg	HYPSCSW SW
Valeur de référence	Swiss Bond Index (SBI) Total AAA-BBB 5-7Y, TR
Évaluation	Mensuel
Politique de distribution	Accumulative
Style de placement	Actif

#### Performance au 30.09.2022 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence
1 mois	-1.48	-2.16	0.68
3 mois	-2.95	-2.56	-0.39
Année en cours	-6.18	-10.66	4.48
Derniers 12 mois	-6.19	-11.10	4.91
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	-1.74	-4.33	2.59
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Derniers 15 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement	-1.24	-8.90	7.66

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

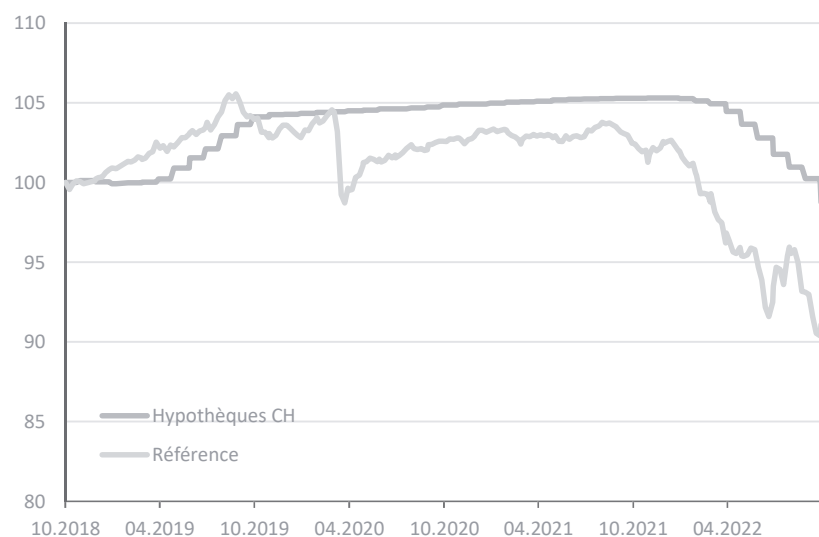
		30.09.2022	31.12.2021
Fortune nette	(en millions CHF)	92.60	77.13
Nombre de quotes-parts		93 764	73 268
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	987.63	1052.71
<sup>2</sup> par quote-part			
TER 2021 (TVA incl.)	(en %)		0.20
Ø-durée restante	(en ans)	8.03	8.52
Modified Duration	(en ans)	7.75	8.21
Nombre d'hypothèques		179	145
Investiture moyenne	(en %)	57.9	59.3
Intérêt moyen	(in % p.a.)	0.81	0.83
Rendement à échéance	(in % p.a.)	1.47	0.76

#### Indicateurs de risque au 30.09.2022 (en %)

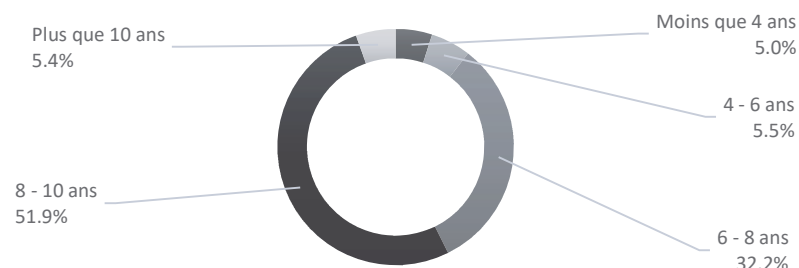
		1 an	3 ans	5 ans
		(par mois)		
Volatilité de groupe de placement <sup>3</sup>	(en %)	0.48%	0.38%	N.a.
Volatilité de Valeur de référence <sup>3</sup>	(en %)	1.54%	1.35%	N.a.

<sup>3</sup> mesuré en écart type (fluctuations des rendements)

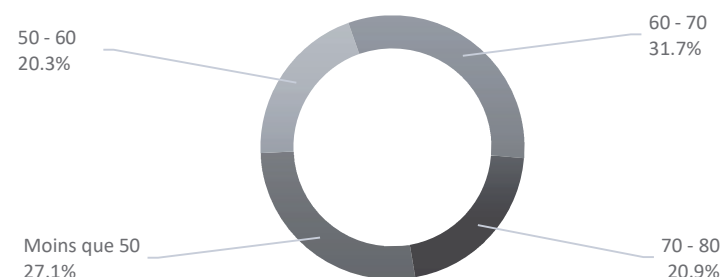
#### Évolution des valeurs depuis le lancement



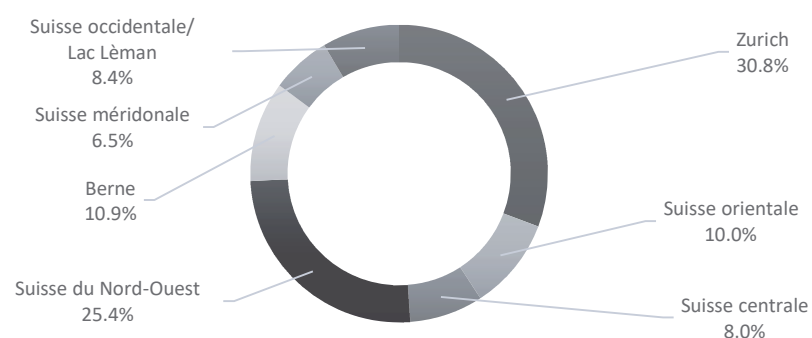
#### Diversification par durée restante au 30.09.2022



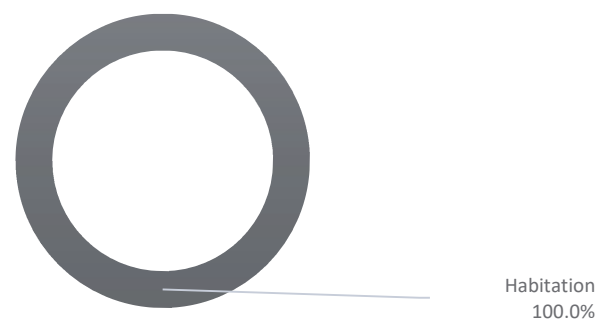
#### Diversification par investiture au 30.09.2022 (en %)



#### Diversification par régions au 30.09.2022



#### Diversification par mode d'utilisation au 30.09.2022



#### Souscription et reprise

Les souscriptions sont acceptées en tout temps. La reprise de quotes-parts se fait en principe en fin de trimestre, avec un préavis de six mois.

#### Frais

Acquisition	max. 0.25%
Reprise	max. 0.50%

## Factsheet 09/2022

30.09.2022

### Immobilier Suisse.

Des rendements stables et durables, une volatilité faible.

#### Caractéristiques

Année de fondation	2012
N° de valeur	18823078 (ISIN: CH0188230780)
Bloomberg	IMMSCHW SW
Valeur de référence	KGAST Immo-Index Mixte
Évaluation	Trimestrielle
Politique de distribution	Accumulative
Style de placement	Actif
Région	Suisse
Répartition stratégique	- min. ¾ habitations - max. ¼ usage commercial

#### Performance au 30.09.2022 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. au valeur de référence	Risque <sup>1</sup>
3 mois	0.58	1.28	-0.70	
Année en cours	3.17	3.70	-0.53	
Derniers 12 mois	4.23	4.84	-0.60	2.04
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	3.89	4.86	-0.97	1.78
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	3.68	4.77	-1.08	1.68
Derniers 10 ans <sup>2</sup>	3.69	5.00	-1.30	1.69
Derniers 15 ans <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement <sup>2</sup>	3.69	5.00	-1.30	1.69

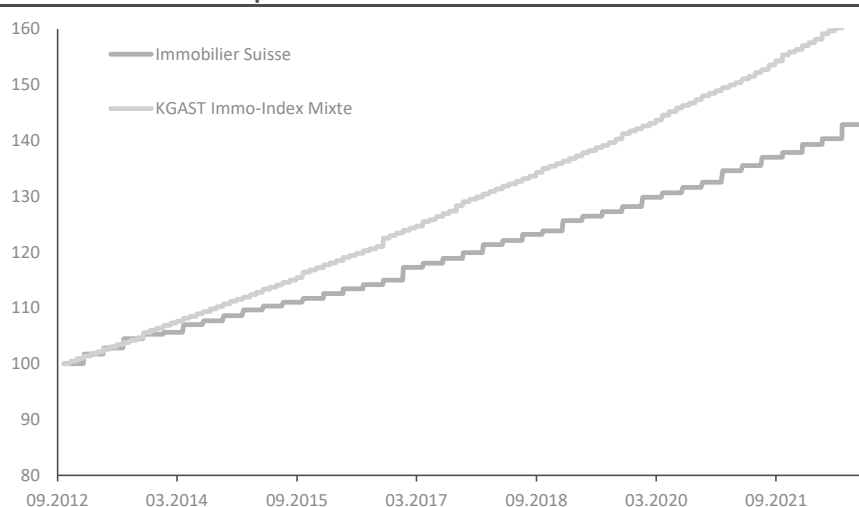
<sup>1</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

<sup>2</sup> annualisé

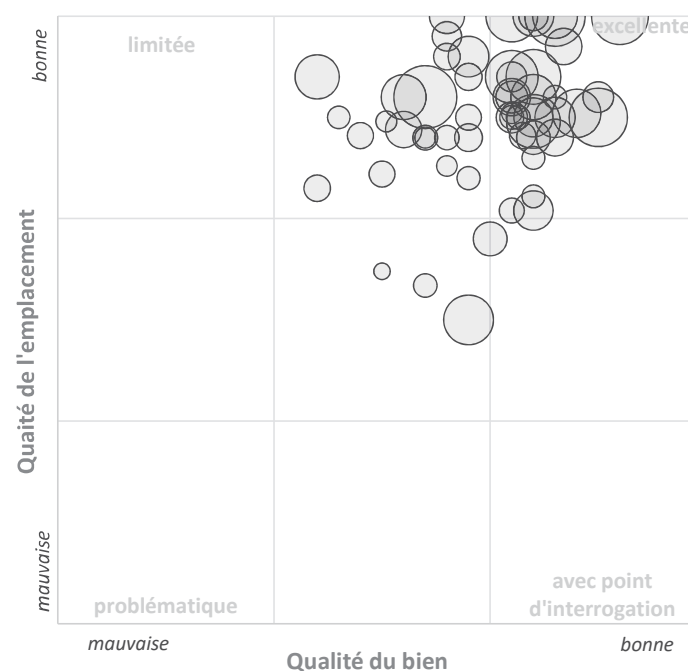
#### Chiffres-clés

		30.09.2022	31.12.2021
Fortune nette	(en millions CHF)	920.69	892.38
Nombre de quotes-parts		640 708	640 705
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 407.98	1 357.72
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	29.01	35.08
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 436.99	1 392.80
<sup>3</sup> par quote-part			
Taux de perte sur loyer	(en %)	5.32	7.24
Quotes-parts financement par fonds de tiers	(en %)	6.67	0.00
Marge de résultat opérationnel	(en %)	71.05	69.43
TER <sub>ISA</sub> 2021 (NAV) (TVA incl.)	(en %)		0.56
ROE	(en %)	3.17	3.45
ROIC	(en %)	3.01	3.33

#### Évolution des valeurs depuis le lancement

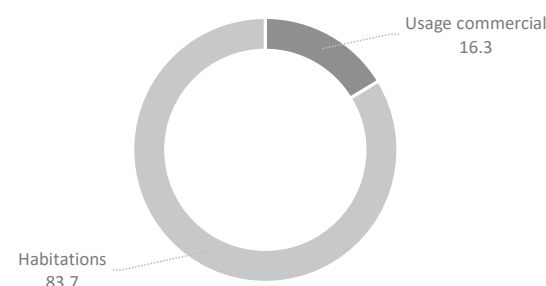


#### Profil de qualité au 30.09.2022<sup>4</sup>



<sup>4</sup> Sur la base des évaluations de l'expert immobilier KPMG SA. La taille de la bulle reflète la valeur marchande du bien en question.

#### Diversification par utilisation au 30.09.2022<sup>5</sup> (in%)



<sup>5</sup> le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

#### Diversification par canton au 30.09.2022<sup>6</sup> (in%)

Argovie	21.0	Lucerne	4.4
Genève	15.6	Thurgovie	3.7
Zürich	12.9	Soleure	2.6
Bâle-Campagne	7.8	Saint-Gall	2.5
Berne	6.8	Schaffhouse	2.1
Vaud	6.5	Jura	2.1
Bâle-Ville	5.8	Neuchâtel	0.8
Schwyz	5.1	Zoug	0.8

<sup>6</sup> le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

#### Souscription et reprise

Groupe de placement fermé (souscriptions possibles lors d'accroissements de capital). Les reprises peuvent être annoncées auprès de l'Helvetia Fondation de placement à tout moment. Lors d'une cession (cf. Art. 22 du règlement), le décompte s'effectuera à la valeur nette d'inventaire de la fin du trimestre suivant.

Frais	
Acquisition	0.00%
Reprise	Max. 2.50%

## Factsheet 09/2022

30.09.2022

### Immobilier Romandie.

Des rendements stables et durables, une volatilité faible.

#### Caractéristiques

Année de fondation	2016
N° de valeur	30120010 (ISIN: CH0301200108)
Bloomberg	IMMROMD SW
Valeur de référence	KGAST Immo-Index Mixte
Évaluation	Trimestrielle
Politique de distribution	Accumulative
Style de placement	Actif
Région	Romandie, régions MS des Wüest Partner régions de monitoring 7 (Lac Léman) et 8 (Romandie) et dans les régions MS 98 (Sierre), 99 (Sion), 100 (Martigny) et 101 (Monthey/St-Maurice)
Répartition stratégique	- mind. ¼ habitations - max. ¼ usage commercial

#### Performance au 30.09.2022 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. au valeur de	Risque <sup>1</sup>
3 mois	0.69	1.28	-0.59	
Année en cours	2.77	3.70	-0.94	
Derniers 12 mois	3.54	4.84	-1.30	1.52
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	4.04	4.86	-0.81	1.86
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	3.63	4.77	-1.13	1.77
Derniers 10 ans <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Derniers 15 ans <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement <sup>2</sup>	5.00	4.95	0.05	2.98

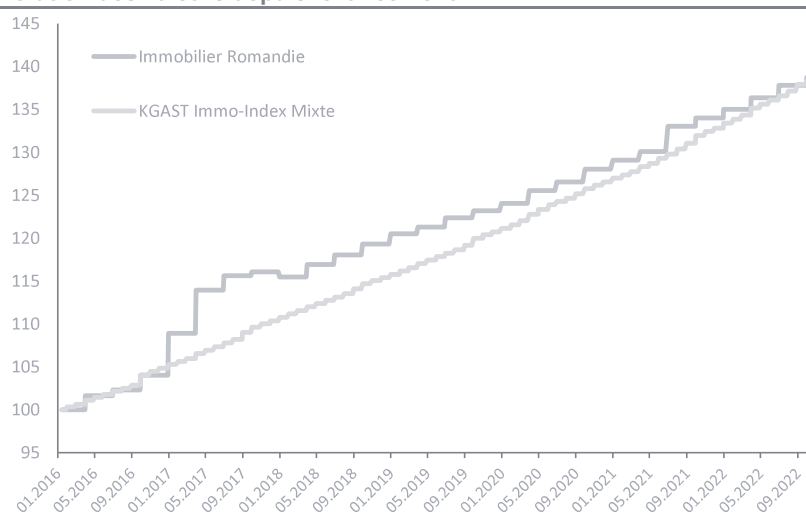
<sup>1</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

<sup>2</sup> annualisé

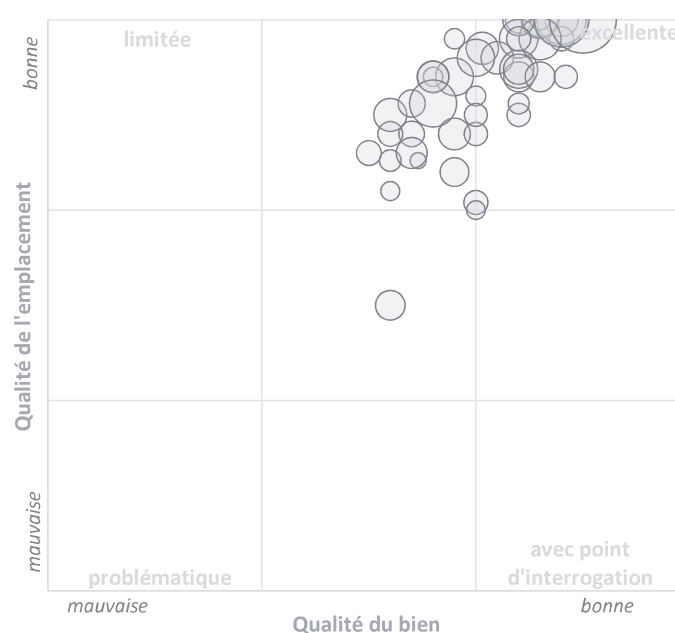
#### Chiffres-clés

		30.09.2022	31.12.2021
Fortune nette	(en millions CHF)	590.34	478.54
Nombre de quotes-parts		425 532	354 484
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 358.79	1 315.62
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	28.50	34.33
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 387.29	1 349.95
	<sup>3</sup> par quote-part		
Taux de perte sur loyer	(en %)	3.60	5.17
Quotes-parts financement par fonds de tiers	(en %)	23.55	11.96
Marge de résultat opérationnel	(en %)	61.76	59.78
TER <sub>ISA</sub> 2021 (NAV) (TVA incl.)	(en %)	0.77	
ROE	(en %)	3.09	4.40
ROIC	(en %)	2.35	3.59

#### Évolution des valeurs depuis le lancement

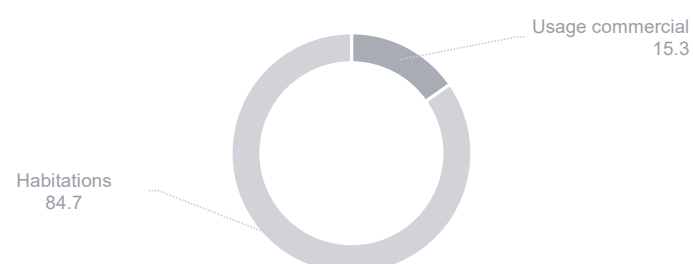


#### Profil de qualité au 30.09.2022<sup>4</sup>



<sup>4</sup> Sur la base des évaluations de l'expert immobilier KPMG SA. La taille de la bulle reflète la valeur marchande du bien en question.

#### Diversification par utilisation au 30.09.2022<sup>5</sup> (en %)



<sup>5</sup> le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

#### Diversification par canton au 30.09.2022<sup>6</sup> (en %)

Genève	64.0
Vaud	28.7
Valais	4.0
Neuchâtel	3.3

<sup>6</sup> le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

#### Souscription et reprise

Le groupe de placement est ouvert aux nouvelles souscriptions jusqu'à nouvel ordre. Les reprises peuvent être annoncées auprès de l'Helvetia Fondation de placement à tout moment. Lors d'une cession (cf. Art. 22 du règlement), le décompte s'effectuera à la valeur nette d'inventaire de la fin du trimestre suivant.

#### Frais

Acquisition	0.00%
Reprise	Max. 2.50%