

Factsheet 03/2024

31.03.2024

Actions Suisse Smart Beta Dynamique 100 ESG.

Investissement innovant et 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	Neutre	Défensif
	(100% ≥ GLOCAP ≥ 80%)	(80% > GLOCAP ≥ 60%)	(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%

ESG-Overlay:

Les entreprises ayant des émissions de CO₂ élevées, des activités commerciales critiques en matière d'ESG ou une faible notation ESG, ainsi que les entreprises impliquées dans de graves controverses, sont exclues. Elles sont remplacées par le Vontobel Climate Target Index.

Performance au 31.03.2024 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
Derniers mois	3.20	3.94	-0.74
Derniers 3 mois	5.25	5.98	-0.73
Année en cours	5.25	5.98	-0.73
Derniers 12 mois	8.03	6.16	1.87
Derniers 3 ans ¹	1.90	3.29	-1.39
Derniers 5 ans ¹	6.37	6.56	-0.19
Derniers 10 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement ¹	7.58	5.94	1.64

¹ annualisé

Chiffres-clés

		31.03.2024	31.12.2023
Fortune nette	(en millions CHF)	110.71	94.69
Nombre de quotes-parts		58 981	53 094
Valeur en capital ²	(en CHF)	1 870.57	1 739.59
Revenu couru ²	(en CHF)	6.48	43.78
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 877.05	1 783.37
TER (TVA incl.)	(en %)		0.58

² par quote-part

Indicateurs de risque au 31.03.2024 (en %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité ³	(en %)	10.23	13.18	14.32
Marge d'erreur	(en %)	4.13	3.81	4.84
Beta		0.86	0.96	1.05
Sharpe Ratio		0.63	0.02	0.33
Information Ratio		0.45	-0.36	-0.04
Jensen-Alpha		0.03	-0.01	0.00
Max. Drawdown		-8.40	-23.54	-23.54
Recovery Period	(en jours)	90	N.a.	N.a.

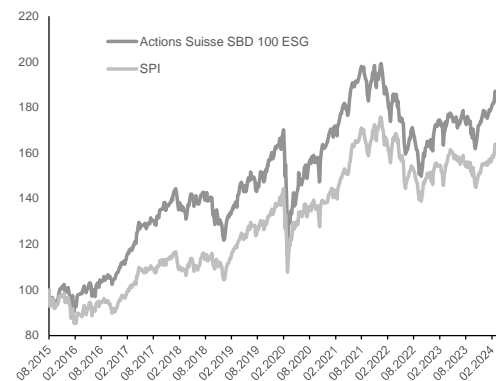
³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

Avertissement: Les informations et descriptions contenues dans le présent document ne constituent ni une offre, ni une invitation à acheter ou à vendre des instruments financiers spécifiques, ni un conseil en placement. Elles sont exclusivement destinées à des fins d'information. Toute action ou omission fondée sur les informations contenues dans le présent document relève de la seule responsabilité de leur destinataire. Le respect des prescriptions légales relève également de la responsabilité individuelle de chaque destinataire. Le/la destinataire a conscience que les données peuvent changer à l'avenir. Dans ce contexte, Helvetia Fondation de placement ne fournit aucune garantie quant à l'exactitude, l'exhaustivité et la véracité du contenu du présent document. Par ailleurs, il convient de relever que toute performance d'un placement enregistré dans le passé ne préjuge pas de son rendement futur. Le présent document a été établi indépendamment d'objectifs d'investissement définis, d'une situation financière particulière ou de besoins spécifiques d'un(e) destinataire déterminé(e). L'utilisation du contenu du présent document est autorisée à condition d'en mentionner la source.

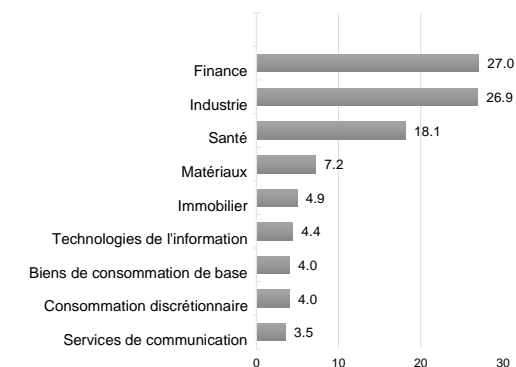
Les 10 principales positions au 31.03.2024 (en %)

UBS Group AG N	5.00
Partners Group Holding AG N	4.97
Adecco Group AG N	3.75
Vat Group AG N	3.59
Swisscom AG N	3.45
Helvetia Holding AG N	3.06
PSP Swiss Property AG N	2.90
Novartis AG N	2.84
Logitech International SA N	2.80
Geberit AG N	2.75

Évolution des valeurs depuis le lancement



Structure par secteur au 31.03.2024 (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 03/2024

31.03.2024

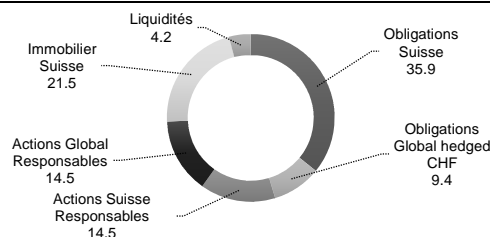
LPP-Mix.

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

Structure du portefeuille au 31.03.2024 (en %)



Performance au 31.03.2024 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
1 mois	1.84	1.89	-0.05
3 mois	3.58	3.51	0.07
Année en cours	3.58	3.51	0.07
Derniers 12 mois	7.49	7.44	0.05
Derniers 3 ans ¹	1.02	1.16	-0.14
Derniers 5 ans ¹	2.46	2.78	-0.32
Derniers 10 ans ¹	2.91	3.47	-0.56
Derniers 15 ans ¹	3.81	4.35	-0.54
Depuis le lancement ¹	4.17	4.53	-0.36

¹ annualisé

Chiffres-clés

		31.03.2024	31.12.2023
Fortune nette	(en millions CHF)	25.29	20.84
Nombre de quotes-parts		21 156	18 055
Valeur en capital ²	(en CHF)	1 196.15	1 145.55
Revenu couru ²	(en CHF)	-0.72	8.56
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 195.43	1 154.11
TER 2023 (TVA incl.)	(en %)		0.41

² par quote-part

Indicateurs de risque au 31.03.2024 (en %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité ³	(en %)	3.57	5.97	6.38
Marge d'erreur	(en %)	0.39	0.41	0.55
Beta		0.87	0.98	1.00
Sharpe Ratio		0.18	-0.98	-0.69
Information Ratio		0.14	-0.35	-0.57
Jensen-Alpha		0.00	0.00	0.00
Max. Drawdown		-2.16	-11.76	-11.76
Recovery Period	(en jours)	30	N.a.	N.a.
Modified Duration ⁴	(en %)	6.81		

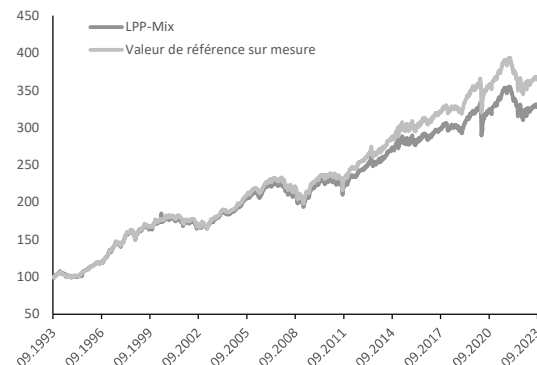
³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

⁴ Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 31.03.2024

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.

Évolution des valeurs depuis le lancement



Notation de durabilité⁵

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

⁵Échelle: 1 pour faible et 7 pour élevée

GRESB Rating

L'organisation indépendante Global Real Estate Sustainability Benchmark (GRESB) établit annuellement un classement dans le domaine des placements immobiliers destiné à mettre à la disposition des investisseurs des résultats de benchmarking indépendants et transparents sur la performance ESG des entreprises et des véhicules de placement immobilier.

G R E S B
★ ★ ★ ☆ ☆ 2023

Frais

Acquisition	0.00%
Reprise	0.25%

Factsheet 03/2024

31.03.2024

LPP-Mix Plus 35.

Orienté rendement.

Caractéristiques

Année de fondation ¹	2013
N° de valeur	127924353 (ISIN: CH1279243534)
Bloomberg	LOBMIXC SW
Valeur de référence	Sur mesure
Évaluation	Hebdomadaire
Politique de distribution	Accumulative
Style de placement	Core-Satellite
Allocaion d'actifs stratégique	- 17% Obligations Suisse - 7% Obligations Global hedged CHF - 20% Actions Suisse Responsables de ça 7% Smart Beta Dynamique 100 ESG 13% Responsables - 15% Actions Global Responsables - 26% Immobilier Suisse - 10% Hypothèques Suisse - 5% Placements alternatifs

¹ de 2013 à fin juin 2023 comme LPP-Mix Plus 30 ou LPP-Mix Plus 35 (N° de valeur 3539998)

Performance au 31.03.2024 (in %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
1 mois	1.80	1.91	-0.11
3 mois	3.81	3.82	-0.01
Année en cours	3.81	3.82	-0.01
Derniers 12 mois	6.84	7.17	-0.33
Derniers 3 ans ²	1.02	1.97	-0.95
Derniers 5 ans ²	3.05	3.76	-0.71
Derniers 10 ans ²	3.58	4.26	-0.68
Derniers 15 ans ²	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement ²	3.54	4.40	-0.86

² annualisé

Chiffres-clés

		31.03.2024	31.12.2023
Fortune nette	(en millions CHF)	1 136.98	943.32
Nombre de quotes-parts		828 809	713 865
Valeur en capital ³	(en CHF)	1 373.04	1 323.03
Revenu couru ³	(en CHF)	- 1.21	- 1.61
Valeur d'inventaire ³	(en CHF)	1 371.83	1 321.42
TER 2023 (TVA incl.)	(en %)		0.52

³ par quote-part

Indicateurs de risque au 31.03.2024 (in %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité ⁴	(en %)	3.67	5.75	6.25
Marge d'erreur	(en %)	0.49	0.76	1.46
Beta		0.87	0.95	1.04
Sharpe Ratio		0.00	-1.01	-0.61
Information Ratio		-0.68	-1.26	-0.49
Jensen-Alpha		0.00	-0.01	-0.01
Max. Drawdown		-2.51	-11.29	-11.29
Recovery Period	(en jours)	61	N.a.	N.a.
Modified Duration ⁵	(en %)	6.72		

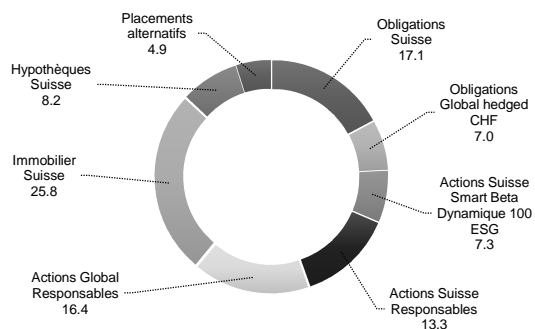
⁴ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

⁵ Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 31.03.2024

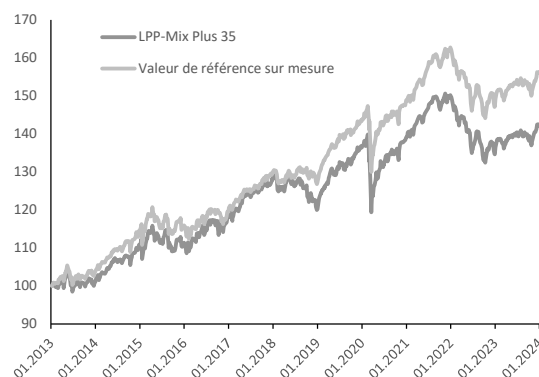
Souscription et reprise

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.

Structure du portefeuille au 31.03.2024 (en %)



Évolution des valeurs depuis le lancement



Notation de durabilité⁶

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

⁶ Échelle: 1 pour faible et 7 pour élevée

GRESB Rating



☆☆☆☆ 2023

L'organisation indépendante Global Real Estate Sustainability Benchmark (GRESB) établit annuellement un classement dans le domaine des placements immobiliers destiné à mettre à la disposition des investisseurs des résultats de benchmarking indépendants et transparents sur la performance ESG des entreprises et des véhicules de placement immobilier.

Frais

Acquisition	0.00%
Reprise	0.50%

Factsheet 03/2024

31.03.2024

Hypothèques Suisse.

Rendement à faible volatilité.

Caractéristiques

Année de fondation	2018
N° de valeur	40868027 (ISIN: CH0408680277)
Bloomberg	HYPSCHEW 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 31.03.2024 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence
1 mois	1.20	0.61	0.59
3 mois	1.52	0.71	0.81
Année en cours	1.52	0.71	0.81
Derniers 12 mois	2.76	6.10	-3.34
Derniers 3 ans ¹	-2.71	-1.71	-1.00
Derniers 5 ans ¹	-0.70	-0.91	0.21
Derniers 10 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.
Derniers 15 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement ¹	-0.59	-0.42	-0.17

¹ annualisé

Chiffres-clés

		31.03.2024	31.12.2023
Fortune nette	(en millions CHF)	124.55	108.69
Nombre de quotes-parts		128 699	114 019
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	967.76	953.29

² par quote-part

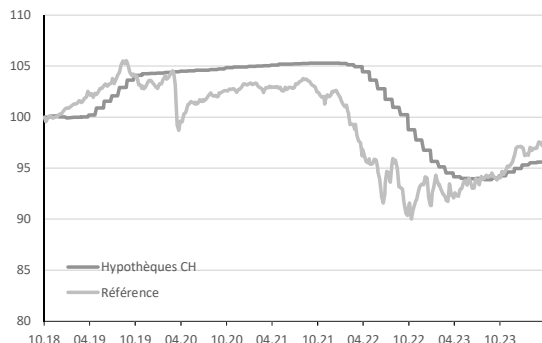
TER 2023 (TVA incl.)	(en %)	0.25
Ø-durée restante	(en ans)	6.63
Modified Duration	(en ans)	6.32
Nombre d'hypothèques		230
Investiture moyenne	(en %)	59.4
Intérêt moyen	(in % p.a.)	1.14
Rendement à échéance	(in % p.a.)	2.20

Indicateurs de risque au 31.03.2024 (en %)

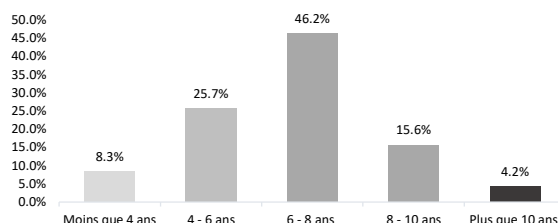
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité de groupe de placement ³	(en %)	1.26	1.88	1.72
Volatilité de Valeur de référence ³	(en %)	1.91	4.50	4.37

³ mesuré en écart type (fluctuations des rendements), annualisé

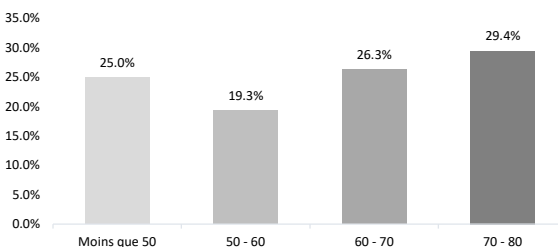
Évolution des valeurs depuis le lancement



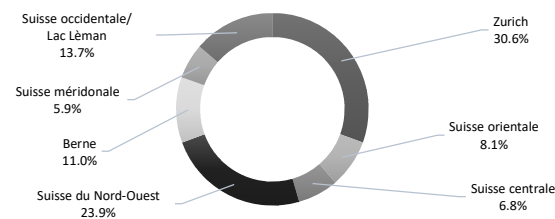
Diversification par durée résiduelle au 31.03.2024



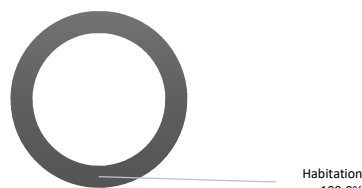
Diversification par nantissement au 31.03.2024 (en %)



Diversification par régions au 31.03.2024



Diversification par type d'utilisation au 31.03.2024



Souscription et reprise

Les souscriptions sont acceptées en tout temps. La reprise de quotes-parts a lieu le 30.06. et 31.12., avec un préavis de six mois.

Frais	
Acquisition	0.25%
Reprise	0.50%

Factsheet 03/2024

31.03.2024

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 31.03.2024 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. au valeur de référence	Risque ¹
3 mois	1.60	0.68	0.92	
Année en cours	1.60	0.68	0.92	
Derniers 12 mois	2.60	2.05	0.56	1.73
Derniers 3 ans ²	3.65	3.83	-0.18	1.82
Derniers 5 ans ²	3.61	4.18	-0.57	1.73
Derniers 10 ans ²	3.50	4.57	-1.07	1.64
Derniers 15 ans ²	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement ²	3.64	4.67	-1.03	1.71

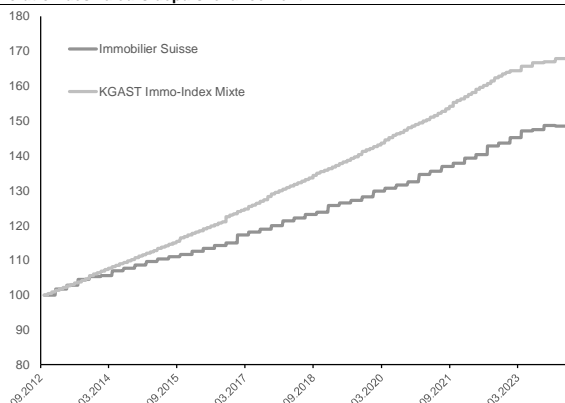
¹ mesuré en écart-type (fluctuation des rendements)

² annualisé

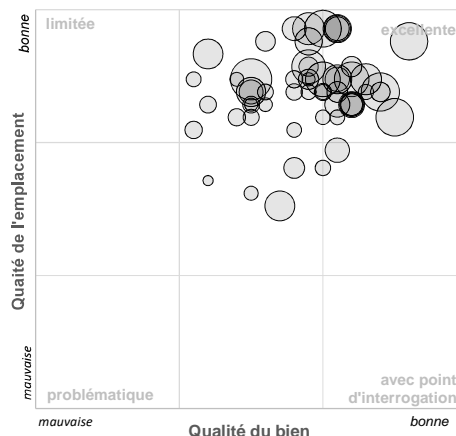
Chiffres-clés

		31.03.2024	31.12.2023
Fortune total	(en millions CHF)	953.04	1 016.27
Fortune nette	(en millions CHF)	770.63	830.73
Nombre de quotes-parts		510 562	559 165
Valeur en capital ³	(en CHF)	1 497.89	1 437.44
Revenu couru ³	(en CHF)	11.48	48.21
Valeur d'inventaire ³	(en CHF)	1 509.37	1 485.65
³ par quote-part			
Taux de perte sur loyer	(en %)	5.55	5.68
Quotes-parts financement par fonds de tiers	(en %)	16.18	16.05
Marge de résultat opérationnel	(en %)	71.38	72.63
TER _{12M} 2023 (NAV) (TVA incl.)	(en %)		0.66
ROE	(en %)	1.28	2.00
ROIC	(en %)	1.31	2.17

Évolution des valeurs depuis le lancement

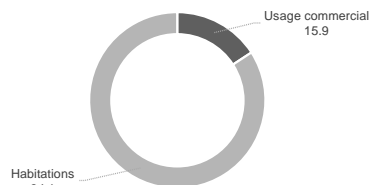


Profil de qualité au 31.03.2024⁴



⁴ 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 31.03.2024 (in%)



Diversification par canton au 31.03.2024 (in%)

Argovie	19.2	Thurgovie	3.7
Genève	16.1	Schwyz	3.4
Zürich	14.2	Soleure	2.9
Bâle-Campagne	9.0	Schaffhouse	2.2
Vaud	7.0	Jura	2.1
Berne	6.5	Saint-Gall	1.8
Bâle-Ville	6.3	Neuchâtel	0.8
Lucerne	3.9	Zoug	0.8

GRESB 2023



L'organisation indépendante Global Real Estate Sustainability Benchmark (GRESB) établit annuellement un classement dans le domaine des placements immobiliers destiné à mettre à la disposition des investisseurs des résultats de benchmarking indépendants et transparents sur la performance ESG des entreprises et des véhicules de placement immobilier.

Souscription et reprise

Groupe de placement fermé (souscriptions possibles lors d'augmentations de capital). Les reprises peuvent être annoncées auprès de l'Helvetia Fondation de placement à tout moment. Les reprises ont lieu le 30.06. et le 31.12., avec un préavis de six mois. Lors d'une cession (cf. Art. 20 du règlement), le décompte s'effectuera à la valeur nette d'inventaire de la fin du trimestre suivant.

Frais	
Acquisition	0.00%
Reprise	2.50%

Factsheet 03/2024

31.03.2024

Immobilier Romandie.

Des rendements stables et durables, une volatilité faible.

Caractéristiques

Année de fondation	2016
N° de valeur	30120010 (ISIN: CH0301200108)
Bloomberg	IMROMD SW
Valeur de référence	KGAST Immo-Index Mixte
Évaluation	Trimestrielle
Politique de distribution	Accumulative
Style de placement	Actif
Région	Romandie, Wüest Partner régions de monitoring 7 (Lac Léman) et 8 (Romandie) et les régions MS 98 (Sierre), 99 (Sion), 100 (Martigny) et 101 (Monthey/St-Maurice)
Répartition stratégique	- mind. ¾ habitations - max. ¼ usage commercial

Performance au 31.03.2024 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. au valeur de	Risque ¹
3 mois	0.51	0.68	-0.16	
Année en cours	0.51	0.68	-0.16	
Demiers 12 mois	3.03	2.05	0.98	1.70
Demiers 3 ans ²	3.68	3.83	-0.15	1.84
Demiers 5 ans ²	3.63	4.18	-0.55	1.71
Demiers 10 ans ²	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Demiers 15 ans ²	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement ²	4.63	4.51	0.12	2.78

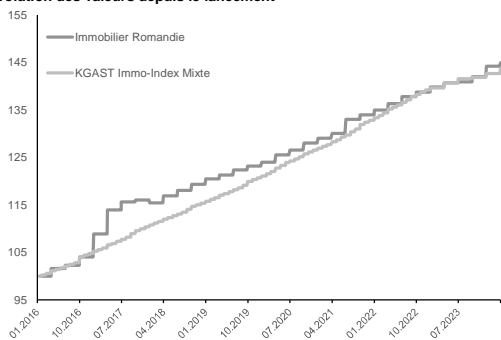
¹ mesuré en écart-type (fluctuation des rendements)

² annualisé

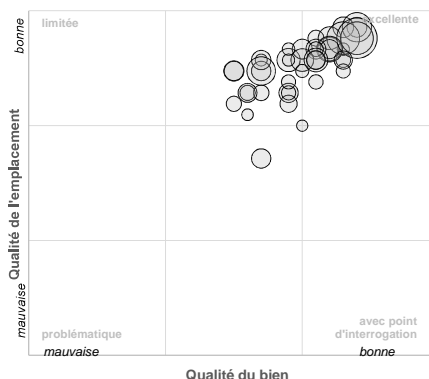
Chiffres-clés

	31.03.2024	31.12.2023
Fortune totale	(en millions CHF) 813.22	809.44
Fortune nette	(en millions CHF) 634.13	630.82
Nombre de quotes-parts	437 407	437 362
Valeur en capital ¹	(en CHF) 1 442.32	1 403.61
Revenu courant ¹	(en CHF) 7.42	38.71
Valeur d'inventaire ¹	(en CHF) 1 449.74	1 442.32
¹ par quote-part		
Taux de perte sur loyer	(en %) 0.97	2.79
Quotes-parts financement par fonds de tiers	(en %) 21.50	21.50
Marge de résultat opérationnel	(en %) 57.75	68.47
TER _{NAV} 2023 (NAV) (TVA incl.)	(en %) 0.66	
ROE	(en %) 0.51	3.18
ROIC	(en %) 0.47	2.66

Évolution des valeurs depuis le lancement

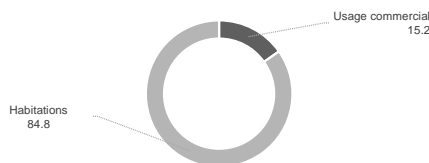


Profil de qualité au 31.03.2024*



* 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 31.03.2024 (en %)



Diversification par canton au 31.03.2024 (en %)

Genève	64.1
Vaud	29.7
Valais	4.1
Neuchâtel	2.1

GRESB 2023



L'organisation indépendante Global Real Estate Sustainability Benchmark (GRESB) établit annuellement un classement dans le domaine des placements immobiliers destiné à mettre à la disposition des investisseurs des résultats de benchmarking indépendants et transparents sur la performance ESG des entreprises et des véhicules de placement immobilier.

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. Les reprises ont lieu le 30.06. et le 31.12., avec un préavis de six mois. Lors d'une cession (cf. Art. 20 du règlement), le décompte s'effectuera à la valeur nette d'inventaire de la fin du trimestre suivant.

Frais	
Acquisition	0.00%
Reprise	2.50%