

## Factsheet 03/2023

31.03.2023

### 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	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%

#### Performance au 31.03.2023 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
Derniers mois	0.28	1.70	-1.42
Derniers 3 mois	7.93	5.91	2.02
Année en cours	7.93	5.91	2.02
Derniers 12 mois	-5.57	-6.38	0.81
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	9.54	8.72	0.82
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	5.28	7.38	-2.10
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement <sup>1</sup>	7.52	5.91	1.61

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		31.03.2023	31.12.2022
Fortune nette	(en millions CHF)	92.38	87.40
Nombre de quotes-parts		53 163	54 284
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 727.24	1 573.32
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	10.32	36.63
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 737.56	1 609.95
TER (TVA incl.)	(en %)		0.58

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

#### Indicateurs de risque au 31.03.2023 (en %)

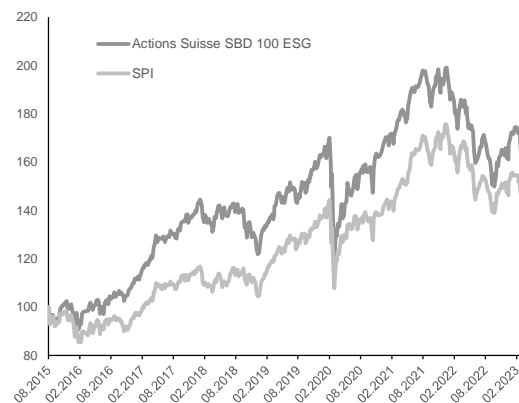
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	16.95	14.51	14.77
Marge d'erreur	(en %)	4.12	3.71	5.00
Beta		1.00	0.99	1.03
Sharpe Ratio		-0.88	0.01	-0.28
Information Ratio		0.20	0.22	-0.42
Jensen-Alpha		0.01	0.01	-0.02
Max. Drawdown		-17.52	-23.54	-23.54
Recovery Period	(en jours)	N.a.	N.a.	N.a.

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

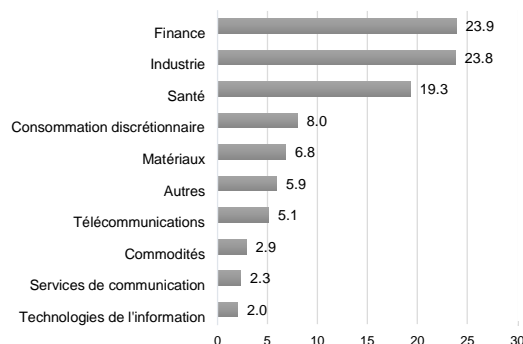
#### Les 10 principales positions au 31.03.2023 (en %)

Novartis AG N	3.89
Kuehne + Nagel International AG N	3.65
Roche Holding AG G	3.23
Compagnie Financiere Richemont SA N	3.17
Helvetia Holding AG N	3.11
Lonza Group AG N	3.02
Swiss Prime Site AG N	3.00
Banque Cantonale Vaudoise N	2.89
PSP Swiss Property AG N	2.87
BKW AG N	2.85

#### Évolution des valeurs depuis le lancement



#### Structure par secteur au 31.03.2023 (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.

<b>Frais</b>	
Acquisition	0.00%
Reprise	0.00%

## Factsheet 03/2023

31.03.2023

### 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 31.03.2023 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
1 mois	0.69	0.62	0.07
3 mois	2.74	2.71	0.03
Année en cours	2.74	2.71	0.03
Derniers 12 mois	-4.19	-4.03	-0.16
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	2.70	2.94	-0.24
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	1.64	2.26	-0.62
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	2.52	3.13	-0.61
Derniers 15 ans <sup>1</sup>	2.92	3.46	-0.54
Depuis le lancement <sup>1</sup>	4.06	4.44	-0.38

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		31.03.2023	31.12.2022
Fortune nette	(en millions CHF)	19.95	18.37
Nombre de quotes-parts		17 934	16 970
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 112.76	1 074.71
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	-0.64	7.76
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 112.12	1 082.47
TER 2022 (TVA incl.)	(en %)		0.44

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

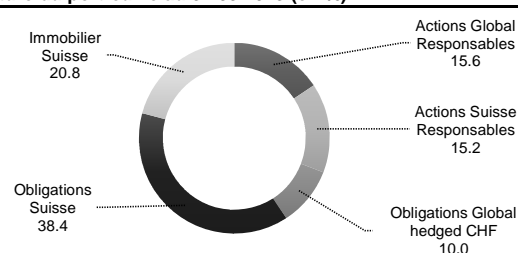
#### Indicateurs de risque au 31.03.2023 (en %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	8.65	6.55	6.42
Marge d'erreur	(en %)	0.58	0.47	0.64
Beta		0.95	1.00	1.01
Sharpe Ratio		-0.95	-0.20	-0.37
Information Ratio		-0.29	-0.51	-0.96
Jensen-Alpha		-0.01	0.00	-0.01
Max. Drawdown		-7.76	-11.76	-11.76
Recovery Period	(en jours)	N.a.	N.a.	N.a.
Modified Duration <sup>4</sup>	(en %)	6.61		

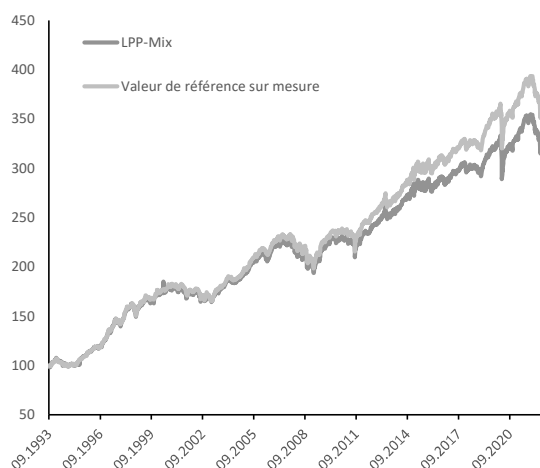
<sup>3</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

<sup>4</sup> Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 31.03.2023

#### Structure du portefeuille au 31.03.2023 (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 03/2023

31.03.2023

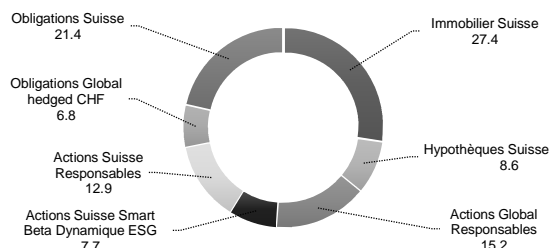
### LPP-Mix Plus 35.

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 7% Smart Beta Dynamique 100 ESG 13% Responsables - 15% Actions Global Responsables - 26% Immobilier Suisse - 10% Hypothèques Suisse

#### Structure du portefeuille au 31.03.2023 (en %)



#### Performance au 31.03.2023 (in %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
1 mois	0.49	0.59	-0.10
3 mois	2.68	2.75	-0.07
Année en cours	2.68	2.75	-0.07
Derniers 12 mois	-4.22	-3.40	-0.82
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	3.48	3.78	-0.30
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	1.91	3.44	-1.53
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	3.16	3.97	-0.81
Derniers 15 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement <sup>1</sup>	3.22	4.13	-0.91

<sup>1</sup>annualisé

#### Chiffres-clés

		31.03.2023	31.12.2022
Fortune nette	(en millions CHF)	873.09	638.33
Nombre de quotes-parts		679 947	510 458
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 285.49	1 246.22
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	- 1.44	4.28
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 284.05	1 250.50
TER 2022 (TVA incl.)	(en %)		0.51

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

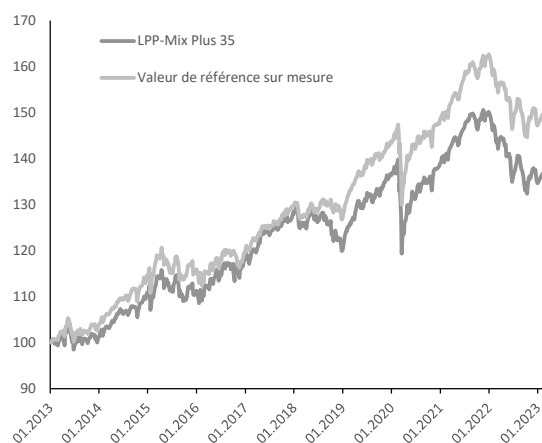
#### Indicateurs de risque au 31.03.2023 (in %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	8.21	6.26	6.50
Marge d'erreur	(en %)	0.46	0.95	1.66
Beta		0.92	0.96	1.06
Sharpe Ratio		-1.01	-0.09	-0.33
Information Ratio		-1.80	-0.31	-0.92
Jensen-Alpha		-0.01	0.00	-0.01
Max. Drawdown		-7.87	-11.29	-11.29
Recovery Period	(en jours)	N.a.	N.a.	N.a.
Modified Duration <sup>4</sup>	(en %)	6.58		

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

<sup>4</sup> Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 31.03.2023

#### 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 03/2023

31.03.2023

### 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 31.03.2023 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence	
1 mois		-0.38	0.07	-0.45
3 mois		-1.55	0.84	-2.39
Année en cours		-1.55	0.84	-2.39
Derniers 12 mois		-9.84	-4.89	-4.95
Derniers 3 ans <sup>1</sup>		-3.41	-2.59	-0.82
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		-5.83	-7.90	2.07

<sup>1</sup>annualisé

#### Chiffres-clés

		31.03.2023	31.12.2022
Fortune nette	(en millions CHF)	100.45	91.56
Nombre de quotes-parts		106 663	95 719
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	941.73	956.60

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

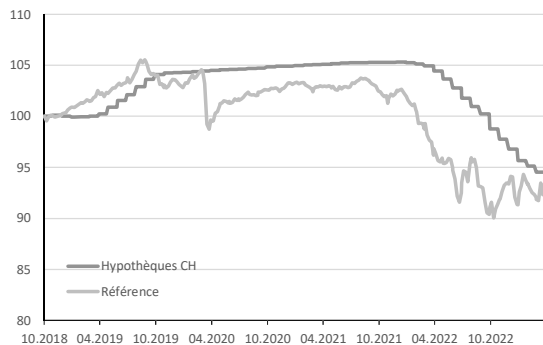
TER 2022 (TVA incl.)	(en %)		0.22
Ø-durée restante	(en ans)	7.63	7.87
Modified Duration	(en ans)	7.35	7.58
Nombre d'hypothèques		182	181
Investiture moyenne	(en %)	57.8	57.9
Intérêt moyen	(in % p.a.)	0.81	0.81
Rendement à échéance	(in % p.a.)	2.04	1.83

#### Indicateurs de risque au 31.03.2023 (en %)

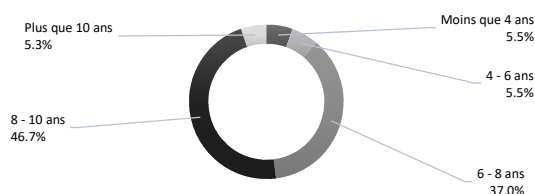
		1 an (par mois)	3 ans	5 ans
Volatilité de groupe de placement <sup>3</sup>	(en %)	0.29%	0.45%	N.a.
Volatilité de Valeur de référence <sup>3</sup>	(en %)	1.85%	1.27%	N.a.

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

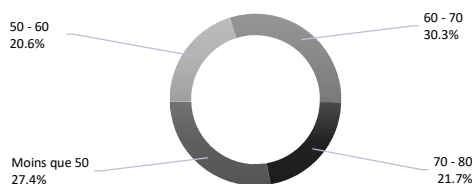
#### Évolution des valeurs depuis le lancement



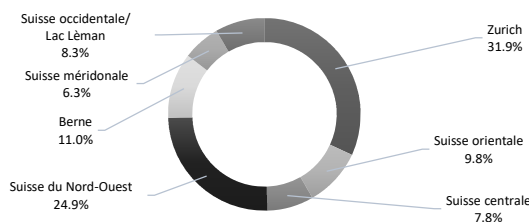
#### Diversification par durée restante au 31.03.2023



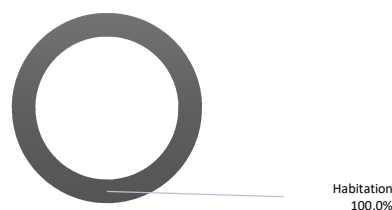
#### Diversification par investiture au 31.03.2023 (en %)



#### Diversification par régions au 31.03.2023



#### Diversification par mode d'utilisation au 31.03.2023



#### 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 03/2023

31.03.2023

### 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 31.03.2023 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. au valeur de référence	Risque <sup>1</sup>
3 mois	1.33	0.77	0.56	
Année en cours	1.33	0.77	0.56	
Derniers 12 mois	4.84	4.13	0.71	2.24
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	4.04	4.66	-0.62	1.82
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	3.80	4.68	-0.88	1.72
Derniers 10 ans <sup>2</sup>	3.65	4.91	-1.26	1.66
Derniers 15 ans <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement <sup>2</sup>	3.74	4.93	-1.18	1.71

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

<sup>2</sup> annualisé

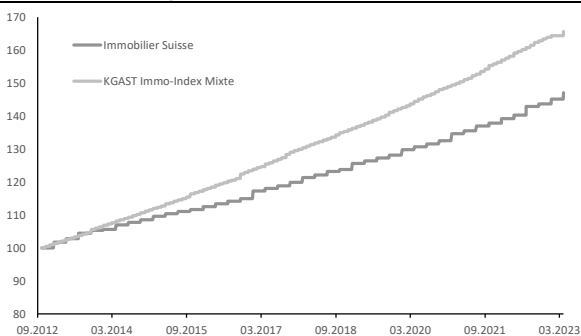
#### Chiffres-clés

		31.03.2023	31.12.2022
Fortune total	(en millions CHF)	1 017.58	1 021.93
Fortune nette	(en millions CHF)	834.41	930.10
Nombre de quotes-parts		567 221	640 708
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 456.48	1 414.64
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	14.56	37.04
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 471.04	1 451.68

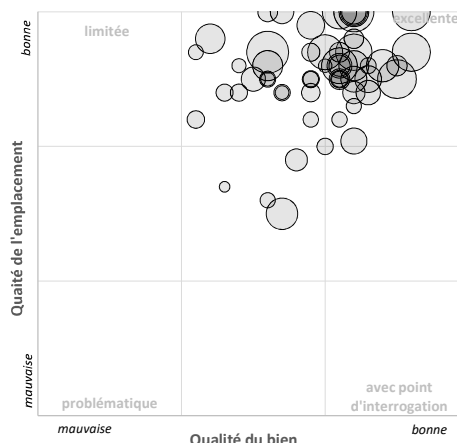
<sup>3</sup> par quote-part

Taux de perte sur loyer	(en %)	5.55	6.29
Quotes-parts financement par fonds de tiers	(en %)	16.07	6.39
Marge de résultat opérationnel	(en %)	75.57	69.49
TER <sub>SA</sub> 2022 (NAV) (TVA incl.)	(en %)		0.60
ROE	(en %)	1.00	4.23
ROIC	(en %)	1.14	3.97

#### Évolution des valeurs depuis le lancement

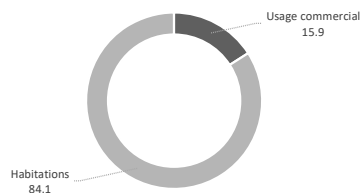


#### Profil de qualité au 31.03.2023<sup>4</sup>



<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 31.03.2023<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 31.03.2023<sup>6</sup> (in%)

Argovie	20.6	Lucerne	3.8
Genève	15.7	Thurgovie	3.7
Zurich	13.0	Soleure	2.6
Bâle-Campagne	8.4	Saint-Gall	2.5
Berne	6.7	Schaffhouse	2.1
Vaud	6.5	Jura	2.0
Bâle-Ville	5.7	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. Les reprises sont possibles au 30.06. et au 31.12. 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 03/2023

31.03.2023

### 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. ¾ habitations - max. ¼ usage commercial

#### Performance au 31.03.2023 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. au valeur de	Risque <sup>1</sup>
3 mois	0.64	0.77	-0.14	
Année en cours	0.64	0.77	-0.14	
Derniers 12 mois	3.20	4.13	-0.93	1.39
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	3.88	4.66	-0.78	1.80
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	3.77	4.68	-0.91	1.69
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>	4.85	4.85	0.00	2.90

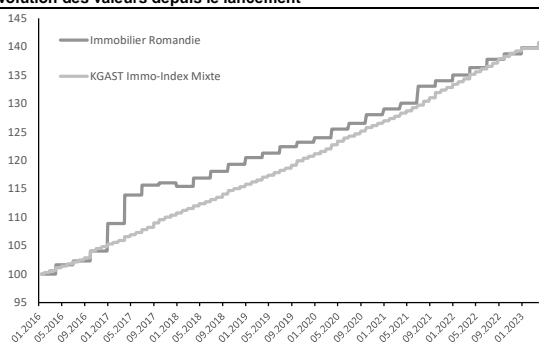
<sup>1</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

<sup>2</sup> annualisé

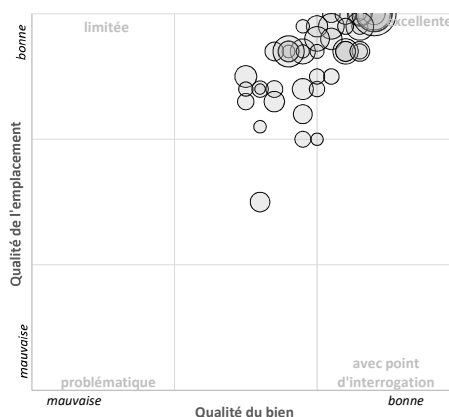
#### Chiffres-clés

		31.03.2023	31.12.2022
Fortune totale	(en millions CHF)	811.27	793.43
Fortune nette	(en millions CHF)	602.99	594.85
Nombre de quotes-parts		428 542	425 447
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 397.94	1 365.50
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	9.13	32.67
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 407.07	1 398.17
<sup>3</sup> par quote-part			
Taux de perte sur loyer	(en %)	1.76	3.16
Quotes-parts financement par fonds de tiers	(en %)	23.47	23.48
Marge de résultat opérationnel	(en %)	61.42	57.71
TER <sub>SA</sub> 2022 (NAV) (TVA incl.)	(en %)		0.72
ROE	(en %)	0.65	3.90
ROIC	(en %)	0.52	2.98

#### Évolution des valeurs depuis le lancement

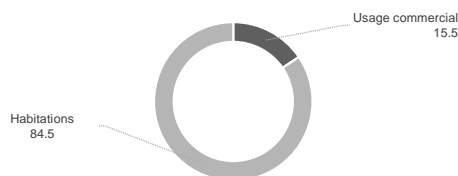


#### Profil de qualité au 31.03.2023<sup>4</sup>



<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 31.03.2023<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 31.03.2023<sup>6</sup> (en %)

Genève	65.9
Vaud	26.8
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. Les reprises sont possibles au 30.06. et au 31.12. 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.

<b>Frais</b>	
Acquisition	0.00%
Reprise	Max. 2.50%