

Factsheet 09/2021

30.09.2021

Actions Suisse Smart Beta Dynamique 100.

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

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			
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 30.09.2021 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
Derniers mois	-5.70	-5.66	-0.04
Derniers 3 mois	-1.97	-1.97	0.00
Année en cours	10.46	12.88	-2.42
Derniers 12 mois	18.90	18.23	0.67
Derniers 3 ans ¹	9.71	11.66	-1.95
Derniers 5 ans ¹	11.92	11.11	0.81
Derniers 10 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement ¹	10.61	8.01	2.60

¹ annualisé

Chiffres-clés

		30.09.2021	31.12.2020
Fortune nette	(en millions CHF)	141.53	129.67
Nombre de quotes-parts		76 384	77 306
Valeur en capital ²	(en CHF)	1 820.37	1 642.44
Revenu couru ²	(en CHF)	32.53	34.93
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 852.90	1 677.37
TER (TVA incl.)	(en %)		0.58

² par quote-part

Indicateurs de risque au 30.09.2021 (en %)

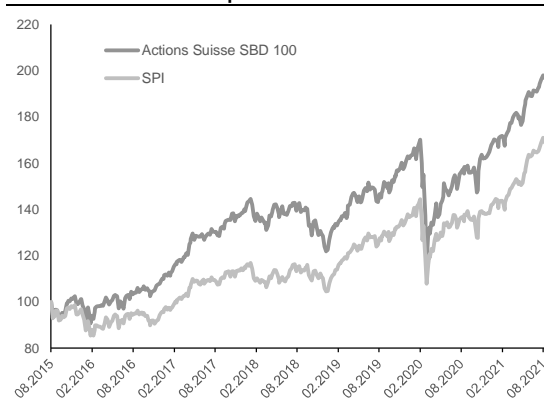
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité ³	(en %)	14.36	15.31	12.78
Marge d'erreur	(en %)	3.63	5.67	5.16
Beta		0.86	1.07	1.01
Sharpe Ratio		1.22	0.55	0.83
Information Ratio		0.18	-0.34	0.16
Jensen-Alpha		0.03	-0.03	0.01
Max. Drawdown		-5.70	-18.50	-18.50
Recovery Period	(en jours)	N.a.	244	244

³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

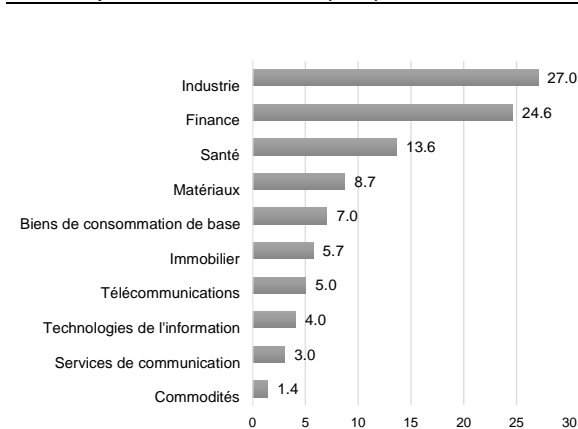
Les 10 principales positions au 30.09.2021 (en %)

Partners Group Holding N	3.99
VAT Group N	3.71
Baloise Holding N	3.41
ABB N	3.20
Helvetia Holding N	3.14
Swiss Prime Site N	3.09
Roche Holding G	3.04
Kuehne + Nagel N	2.97
Swiss Life Holding N	2.96
Swisscom N	2.96

Évolution des valeurs depuis le lancement



Structure par secteur au 30.09.2021 (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 09/2021

30.09.2021

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	Indexé
Allocation d'actifs stratégique	- 40% Obligations Suisse - 10% Obligations Global - 15% Actions Suisse - 15% Actions Global Responsables - 20% Immobilier Suisse

Performance au 30.09.2021 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
1 mois	-1.86	-1.76	-0.10
3 mois	-0.07	-0.11	0.03
Année en cours	4.99	5.10	-0.11
Derniers 12 mois	7.62	7.74	-0.12
Derniers 3 ans ¹	4.88	5.62	-0.75
Derniers 5 ans ¹	3.57	4.26	-0.69
Derniers 10 ans ¹	4.49	5.13	-0.64
Derniers 15 ans ¹	3.14	3.67	-0.53
Depuis le lancement ¹	4.53	4.91	-0.38

¹ annualisé

Chiffres-clés

		30.09.2021	31.12.2020
Fortune nette	(en millions CHF)	20.85	19.69
Nombre de quotes-parts		17 525	17 376
Valeur en capital ²	(en CHF)	1 180.78	1 122.99
Revenu couru ²	(en CHF)	9.17	10.43
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 189.95	1 133.42
TER 2020 (TVA incl.)	(en %)		0.35

² par quote-part

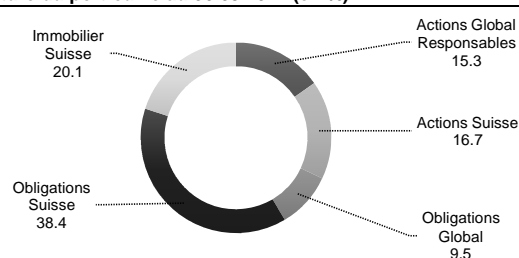
Indicateurs de risque au 30.09.2021 (en %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité ³	(en %)	5.06	6.30	5.23
Marge d'erreur	(en %)	0.36	0.72	0.59
Beta		0.93	0.99	1.00
Sharpe Ratio		2.10	1.25	1.26
Information Ratio		-0.35	-1.03	-1.18
Jensen-Alpha		0.01	-0.01	-0.01
Max. Drawdown		-1.86	-8.46	-8.46
Recovery Period	(en jours)	N.a.	244	244
Modified Duration ⁴	(en %)	7.41		

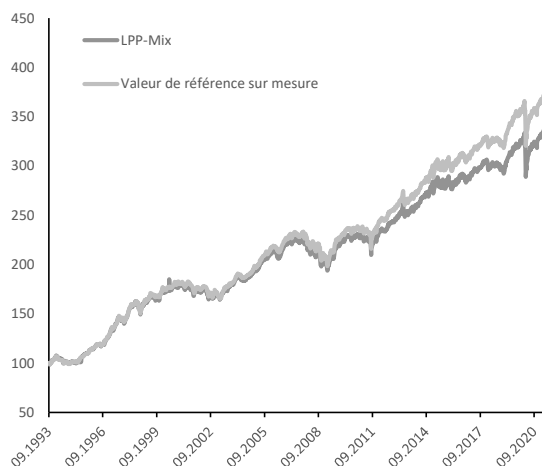
³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

⁴ Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 30.09.2021

Structure du portefeuille au 30.09.2021 (en %)



Évolution des valeurs depuis lancement



Notation de durabilité⁵

Obligations Suisse	1	2	3	4	5	6	7
Obligations Global	1	2	3	4	5	6	7
Actions Suisse	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

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 09/2021

30.09.2021

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	- 24% Obligations Suisse - 5% Obligations Global - 20% Actions Suisse - 15% Actions Global Responsables - 26% Immobilier Suisse - 10% Hypothèques Suisse

Performance au 30.09.2021 (in %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
1 mois	-1.91	-1.98	0.07
3 mois	0.03	-0.14	0.17
Année en cours	5.58	5.99	-0.41
Derniers 12 mois	8.91	8.66	0.25
Derniers 3 ans ¹	5.20	6.47	-1.26
Derniers 5 ans ¹	4.62	5.66	-1.04
Derniers 10 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.
Derniers 15 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement ¹	4.50	5.36	-0.86

¹annualisé

Chiffres-clés

		30.09.2021	31.12.2020
Fortune nette	(en millions CHF)	518.42	400.94
Nombre de quotes-parts		380 133	310 398
Valeur en capital ²	(en CHF)	1 361.18	1 290.77
Revenu couru ²	(en CHF)	2.60	0.93
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 363.78	1 291.70
TER 2020 (TVA incl.)	(en %)		0.64

² par quote-part

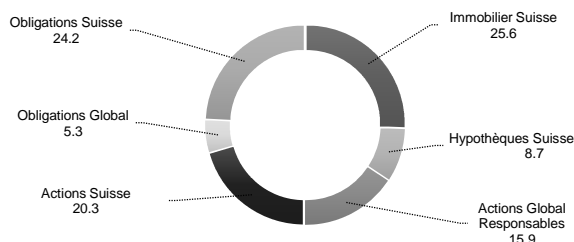
Indicateurs de risque au 30.09.2021 (in %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité ³	(en %)	4.88	6.47	5.54
Marge d'erreur	(en %)	1.19	1.99	1.93
Beta		0.80	1.10	1.10
Sharpe Ratio		1.98	0.92	0.97
Information Ratio		0.21	-0.63	-0.54
Jensen-Alpha		0.02	-0.02	-0.02
Max. Drawdown		-1.91	-8.77	-8.77
Recovery Period	(en jours)	N.a.	244	244
Modified Duration ⁴	(en %)	7.42		

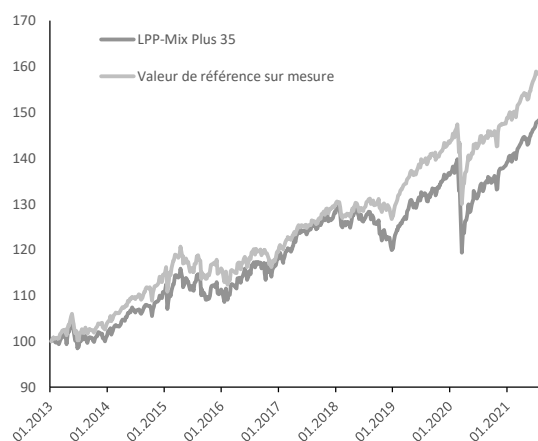
³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

⁴ Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 30.09.2021

Structure du portefeuille au 30.09.2021 (en %)



Évolution des valeurs depuis lancement



Notation de durabilité⁵

Obligations Suisse	1	2	3	4	5	6	7
Obligations Global	1	2	3	4	5	6	7
Actions Suisse	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

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 09/2021

30.09.2021

Hypothèques Suisse.

Rendement à faible volatilité.

Caractéristiques

Année de fondation	2018
N° de valeur	40868027 (ISIN: CH0408680277)
Bloomberg	HYPSCWH 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 30.09.2021 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence	
1 mois		-0.01	-0.99	0.98
3 mois		0.03	-0.41	0.44
Année en cours		0.28	-0.77	1.05
Derniers 12 mois		0.40	-0.12	0.52
Derniers 3 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Derniers 5 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Derniers 10 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Derniers 15 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement		5.28	2.47	2.81

¹ annualisé

Chiffres-clés

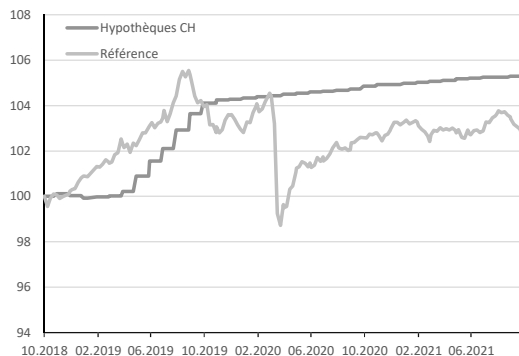
		30.09.2021	31.12.2020
Fortune nette	(en millions CHF)	73.94	52.78
Nombre de quotes-parts		70 233	50 273
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 052.80	1049.81
² par quote-part			
TER 2020 (TVA incl.)	(en %)		0.24
Ø-durée restante	(en ans)	8.50	8.82
Modified Duration	(en ans)	8.18	8.46
Nombre d'hypothèques		116	101
Investiture moyenne	(en %)	60.7	61.2
Intérêt moyen	(in % p.a.)	0.87	0.89
Rendement à échéance	(in % p.a.)	0.77	0.75

Indicateurs de risque au 30.09.2021 (en %)

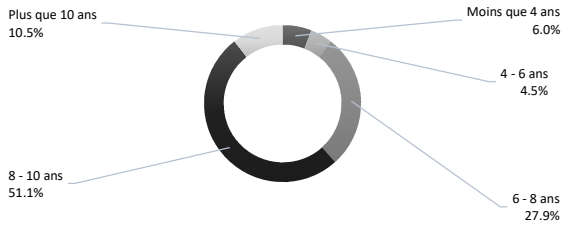
		1 an (par mois)	3 ans	5 ans
Volatilité de groupe de placement ³	(en %)	0.02%	N.a.	N.a.
Volatilité de Valeur de référence ³	(en %)	0.49%	N.a.	N.a.

³ mesuré en écart type (fluctuations des rendements)

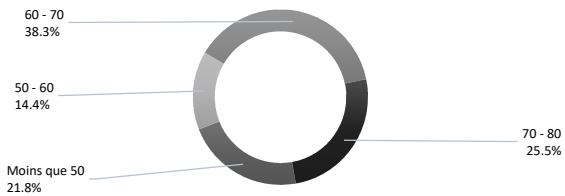
Évolution des valeurs depuis le lancement



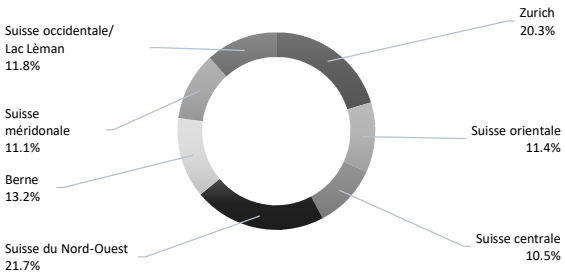
Diversification par durée restante au 30.09.2021



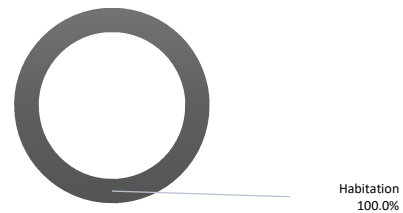
Diversification par investiture au 30.09.2021 (en %)



Diversification par régions au 30.09.2021



Diversification par mode d'utilisation au 30.09.2021



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 09/2021

30.09.2021

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 30.09.2021 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. au valeur de référence	Risque ¹
3 mois	0.65	1.68	-1.03	
Année en cours	2.39	3.91	-1.51	
Derniers 12 mois	4.02	4.90	-0.88	1.87
Derniers 3 ans ²	3.65	4.78	-1.13	1.65
Derniers 5 ans ²	3.70	4.86	-1.16	1.70
Derniers 10 ans ²	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Derniers 15 ans ²	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement ²	3.63	5.01	-1.38	1.66

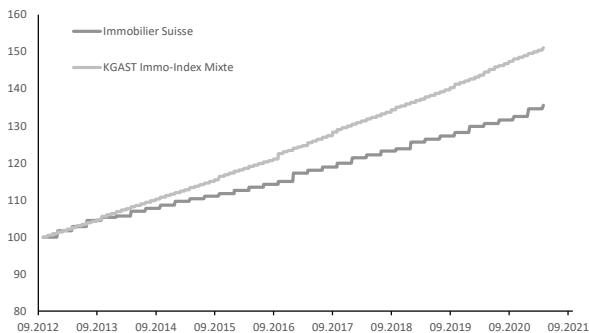
¹ mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

² annualisé

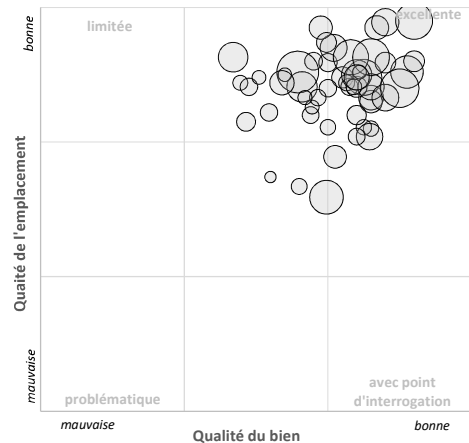
Chiffres-clés

		30.09.2021	31.12.2020
Fortune nette	(en millions CHF)	883.30	862.61
Nombre de quotes-parts		640 705	640 676
Valeur en capital ³	(en CHF)	1 346.40	1 309.58
Revenu couru ³	(en CHF)	32.23	36.83
Valeur d'inventaire ³	(en CHF)	1 378.63	1 346.41
³ par quote-part			
Taux de perte sur loyer	(en %)	7.86	10.00
Quotes-parts financement par fonds de tiers	(en %)	0.00	0.00
Marge de résultat opérationnel	(en %)	69.41	71.18
TER _{SA} 2020 (NAV) (TVA incl.)	(en %)		0.52
ROE	(en %)	2.39	3.76
ROIC	(en %)	2.33	3.62

Évolution des valeurs depuis le lancement

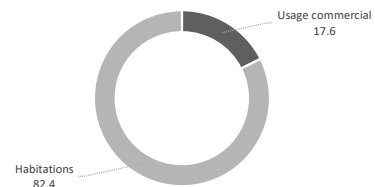


Profil de qualité au 30.09.2021⁴



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 30.09.2021⁵ (in%)



⁵ le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

Diversification par canton au 30.09.2021⁵ (in%)

Argovie	23.3	Lucerne	4.4
Zurich	14.3	Thurgovie	4.3
Bâle-Campagne	8.8	Soleure	3.0
Berne	7.6	Saint-Gall	2.8
Vaud	7.3	Jura	2.5
Bâle-Ville	6.4	Schaffhouse	2.3
Schwyz	5.8	Neuchâtel	0.9
Genève	5.4	Zoug	0.8

⁵ 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 09/2021

30.09.2021

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 30.09.2021 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. au valeur de	Risque ¹
3 mois	0.73	1.68	-0.95	
Année en cours	3.81	3.91	-0.09	
Derniers 12 mois	4.65	4.90	-0.25	2.37
Derniers 3 ans ²	3.94	4.78	-0.85	1.83
Derniers 5 ans ²	5.19	4.86	0.33	3.26
Derniers 10 ans ²	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Derniers 15 ans ²	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement ²	5.26	4.98	0.28	3.18

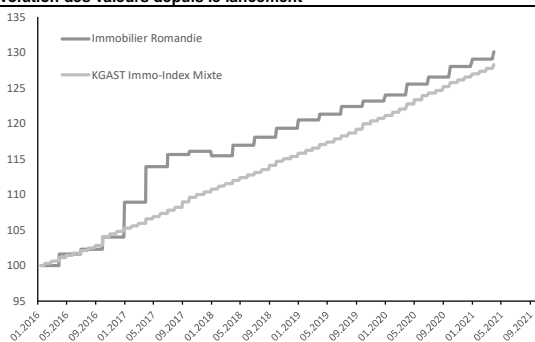
¹ mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

² annualisé

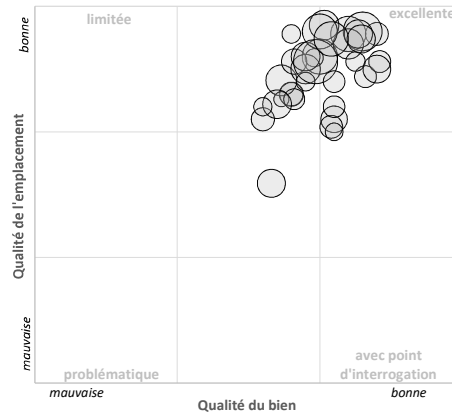
Chiffres-clés

		30.09.2021	31.12.2020
Fortune nette	(en millions CHF)	373.89	313.82
Nombre de quotes-parts		279 051	243 152
Valeur en capital ³	(en CHF)	1 308.26	1 247.47
Revenu couru ³	(en CHF)	31.60	43.17
Valeur d'inventaire ³	(en CHF)	1 339.86	1 290.64
³ par quote-part			
Taux de perte sur loyer	(en %)	4.94	3.42
Quotes-parts financement par fonds de tiers	(en %)	13.13	18.94
Marge de résultat opérationnel	(en %)	63.93	65.21
TER _{SA} 2020 (NAV) (TVA incl.)	(en %)	0.91	
ROE	(en %)	3.96	4.37
ROIC	(en %)	2.96	3.27

Évolution des valeurs depuis le lancement

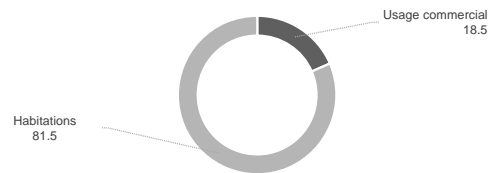


Profil de qualité au 30.09.2021⁴



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 30.09.2021⁵ (en %)



⁵ le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

Diversification par canton au 30.09.2021⁶ (en %)

Vaud	45.1
Genève	42.5
Vallais	6.7
Neuchâtel	5.8

⁶ 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%