

## Factsheet 03/2020

31.03.2020

### 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 31.03.2020 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	KGAST Ranking
Derniers mois	-11.67	-4.86	-6.81	
Derniers 3 mois	-18.50	-11.82	-6.68	
Année en cours	-18.50	-11.82	-6.68	
Derniers 12 mois	-4.10	0.70	-4.80	
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	3.44	5.51	-2.07	
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	
Depuis le lancement <sup>1</sup>	6.23	4.13	2.10	

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		31.03.2020	31.12.2019
Fortune nette	(en millions CHF)	120.43	106.75
Nombre de quotes-parts		91 100	65 808
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 318.18	1 590.48
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	3.76	31.59
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 321.94	1 622.07
TER (TVA incl.)	(en %)	0.58	

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

#### Indicateurs de risque au 31.03.2020 (en %)

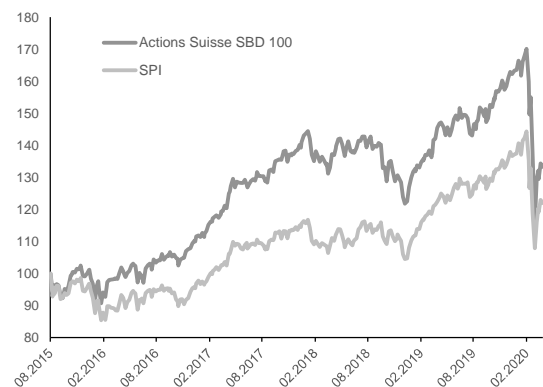
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	17.72	13.45	N.a.
Marge d'erreur	(en %)	5.27	5.76	N.a.
Beta		0.74	1.07	N.a.
Sharpe Ratio		-0.77	-0.45	N.a.
Information Ratio		-0.91	-0.36	N.a.
Jensen-Alpha		-0.07	-0.02	N.a.
Max. Drawdown		-18.50	-18.50	N.a.
Recovery Period	(en jours)	N.a.	N.a.	N.a.

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

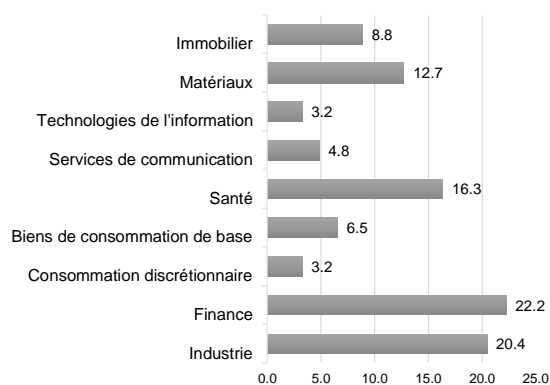
#### Les 10 principales positions au 31.03.2020 (en %)

Swiss Prime Site N	4.43
PSP Swiss Property AG N	4.37
Roche Holding AG G	3.39
SIG Combibloc Group AG N	3.30
EMS-Chemie Holding AG N	3.28
Partners Group Holding AG N	3.18
UBS Group AG N	3.07
Idorsia AG N	2.97
VAT Group AG N	2.88
BELIMO Holding N	2.77

#### Évolution des valeurs depuis le lancement



#### Structure par secteur au 31.03.2020 (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 03/2020

31.03.2020

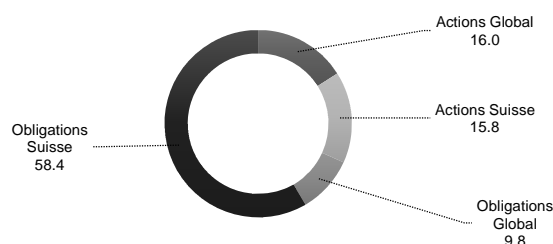
### LPP-Mix.

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	- 60% Obligations Suisse - 10% Obligations Global - 15% Actions Suisse - 15% Actions Global

#### Structure du portefeuille au 31.03.2020 (en %)



#### Performance au 31.03.2020 (en %)

Période	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	KGAST Ranking
1 mois	-6.55	-6.22	-0.34	
3 mois	-7.50	-6.57	-0.94	
Année en cours	-7.50	-6.57	-0.94	
Derniers 12 mois	-3.01	-1.99	-1.01	
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	0.72	1.72	-1.00	
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	1.03	1.85	-0.82	
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	2.74	3.47	-0.74	
Derniers 15 ans <sup>1</sup>	2.92	3.48	-0.56	
Depuis le lancement <sup>1</sup>	4.21	4.61	-0.40	

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

	31.03.2020	31.12.2019
Fortune nette (en millions CHF)	17.18	18.41
Nombre de quotes-parts	16 731	16 587
Valeur en capital <sup>2</sup> (en CHF)	1 023.27	1 102.82
Revenu couru <sup>2</sup> (en CHF)	3.44	7.19
Valeur d'inventaire <sup>2</sup> (en CHF)	1 026.71	1 110.01
TER 2019 (TVA incl.) (en %)	0.35	

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

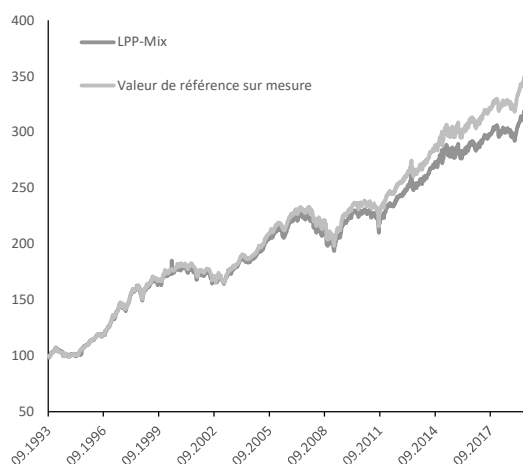
#### Indicateurs de risque au 31.03.2020 (en %)

	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup> (en %)	8.05	5.39	5.04
Marge d'erreur (en %)	0.90	0.68	0.55
Beta	0.94	0.98	1.00
Sharpe Ratio	-0.37	0.13	0.20
Information Ratio	-1.12	-1.48	-1.48
Jensen-Alpha	-0.01	-0.01	-0.01
Max. Drawdown	-8.46	-3.80	-12.50
Recovery Period (en jours)	N.a.	59	1 309
Modified Duration <sup>4</sup> (en %)	7.41		

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

<sup>4</sup> Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 31.03.2020

#### Évolution des valeurs depuis lancement



#### 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 03/2020

31.03.2020

### LPP-Mix Plus 30.

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 - 26% Actions Suisse Smart Beta Dynamique 100 - 9% Actions Global - 26% Immobilier - 10% Hypothèques

#### Performance au 31.03.2020 (in %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	KGAST Ranking
1 mois	-6.09	-4.11	-1.97	
3 mois	-8.51	-5.55	-2.96	
Année en cours	-8.51	-5.55	-2.96	
Derniers 12 mois	-1.86	0.36	-2.22	
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	1.12	3.22	-2.10	
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	1.83	2.72	-0.89	
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>	3.11	4.28	-1.17	

<sup>1</sup>annualisé

#### Chiffres-clés

		31.03.2020	31.12.2019
Fortune nette	(en millions CHF)	318.59	224.66
Nombre de quotes-parts		274 938	177 384
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 160.34	1 262.22
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	- 1.57	4.29
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 158.77	1 266.51
TER 2019 (TVA incl.)	(en %)	0.77	

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

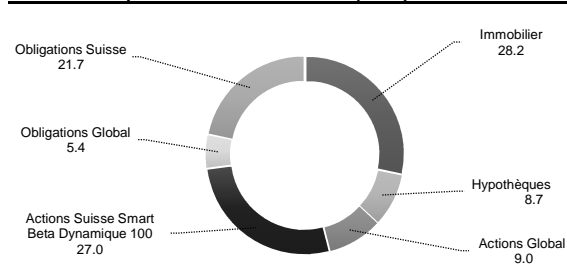
#### Indicateurs de risque au 31.03.2020 (in %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	8.23	5.99	5.53
Marge d'erreur	(en %)	6.74	4.15	3.43
Beta		1.93	1.27	1.06
Sharpe Ratio		-0.94	-0.79	-0.73
Information Ratio		-0.33	-0.51	-0.26
Jensen-Alpha		0.03	-0.01	-0.01
Max. Drawdown		-8.77	-6.26	-8.77
Recovery Period	(en jours)	N.a.	120	N.a.
Modified Duration <sup>4</sup>	(en %)	6.96		

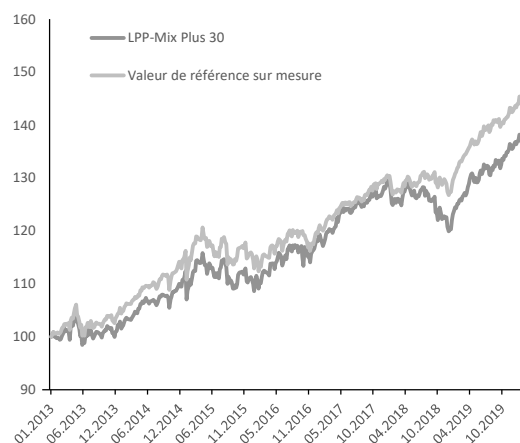
<sup>3</sup>mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

<sup>4</sup>Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 31.03.2020

#### Structure du portefeuille au 31.03.2020 (en %)



#### Évolution des valeurs depuis lancement



#### 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 03/2020

31.03.2020

### 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. ⅔ habitations - max. ⅓ usage commercial

#### Performance au 31.03.2020 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. Au valeur de référence	Risque <sup>1</sup>	Ranking KGAST
3 mois	0.63	1.36	-0.73		
Année en cours	0.63	1.36	-0.73		
Derniers 12 mois	3.34	4.90	-1.55	1.52	
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	3.43	4.83	-1.40	1.53	
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	3.43	4.98	-1.55	1.58	
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>	3.63	5.03	-1.41	1.67	

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

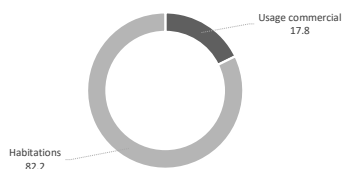
<sup>2</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		31.03.2020	31.12.2019
Fortune nette	(en millions CHF)	816.96	798.88
Nombre de quotes-parts		625 367	615 371
Valeur en capital <sup>1</sup>	(en CHF)	1 297.66	1 264.68
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	8.70	33.52
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 306.36	1 298.20
Taux de perte sur loyer	(en %)	9.87	12.12
Quote-part financement par de fonds de tiers	(en %)	0.00	1.73
Marge de résultat opérationnel	(en %)	66.88	69.22
TER <sub>30</sub> 2019 (NAV) (TVA incl.)	(en %)	0.57	
ROE	(en %)	0.67	3.34
ROIC	(en %)	0.62	3.30

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

#### Diversification par utilisation au 31.03.2020\* (in%)



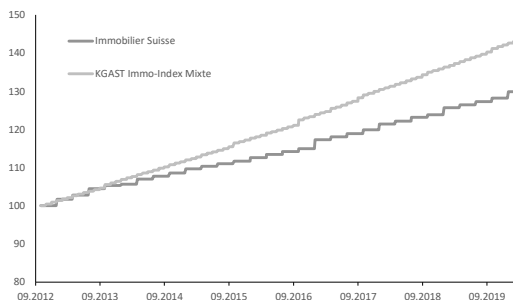
\* le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

#### Diversification par canton au 31.03.2020\* (in%)

Canton	Pourcentage (in%)	Ranking KGAST
Argovie	23.2	Thurgovie 4.7
Zürich	14.7	Lucerne 4.6
Berne	8.3	Soleure 3.3
Vaud	7.7	Saint-Gall 3.0
Bâle-Ville	6.8	Jura 2.7
Schwyz	6.0	Schaffhouse 2.5
Genève	5.7	Neuchâtel 0.9
Bâle-Campagne	5.0	Zoug 0.8

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

#### Évolution des valeurs depuis le lancement



#### 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	Taux
Acquisition	0.00%
Reprise	Max. 2.50%

## Factsheet 03/2020

31.03.2020

### 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	Roomandie, 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 31.03.2020 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. Au valeur de référence	Risque <sup>1</sup>	KGAST Ranking
3 mois	1.22	1.36	-0.14		
Année en cours	1.22	1.36	-0.14		
Derniers 12 mois	3.49	4.90	-1.41	1.54	
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	3.28	4.83	-1.55	1.69	
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.	
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>	5.55	4.99	0.55	3.50	

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

<sup>2</sup> annualisé

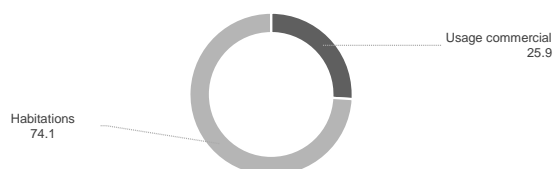
#### Chiffres-clés

		31.03.2020	31.12.2019
Fortune nette	(en millions CHF)	277.03	250.50
Nombre de quotes-parts		220 686	201 980
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 242.14	1 190.20
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	13.17	50.03
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 255.31	1 240.23

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

		31.03.2020	31.12.2019
Taux de perte sur loyer	(en %)	3.28	3.64
Quote-part financement par de fonds de tiers	(en %)	13.76	13.03
Marge de résultat opérationnel	(en %)	63.74	64.30
TER <sub>NSA</sub> 2019 (NAV) (TVA incl.)	(en %)	0.88	
ROE	(en %)	1.56	4.08
ROIC	(en %)	1.07	2.49

#### Diversification par utilisation au 31.03.2020<sup>4</sup> (en %)



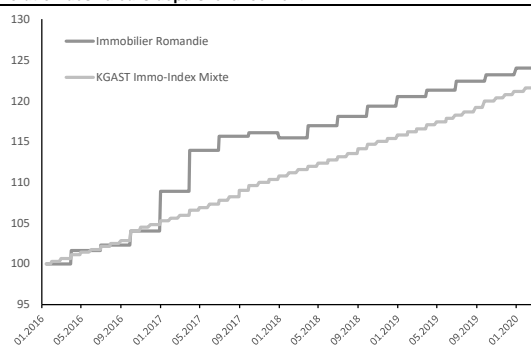
<sup>4</sup> le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

#### Diversification par canton au 31.03.2020<sup>5</sup> (en %)

Vaud	41.4
Genève	41.2
Valais	8.9
Neuchâtel	8.5

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

#### Évolution des valeurs depuis le lancement



#### 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%

## Factsheet 03/2020

31.03.2020

### 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 31.03.2020 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence
1 mois	0.06	-4.70	4.76
3 mois	0.16	-3.09	3.25
Année en cours	0.16	-3.09	3.25
Derniers 12 mois	4.27	-2.61	6.88
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	n.a.
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	4.50	-0.36	4.86

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

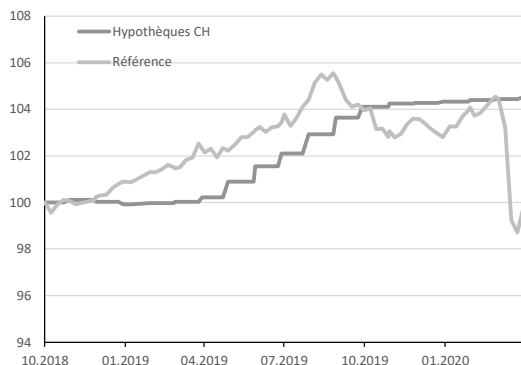
		31.03.2020	31.12.2019
Fortune nette	(en millions CHF)	33.89	28.15
Nombre de quotes-parts		32 428	26977.00
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 045.04	1043.32
<sup>2</sup> par quote-part			
TER 2019 (TVA incl.)	(en %)	0.39	
Ø-durée restante	(en ans)	8.45	8.49
Modified Duration	(en ans)	8.09	8.01
Nombre d'hypothèques		56	51.00
investiture moyenne	(en %)	61.6	0.96
Rendement brut	(in % p.a.)	0.96	0.70

#### Indicateurs de risque au 31.03.2020 (en %)

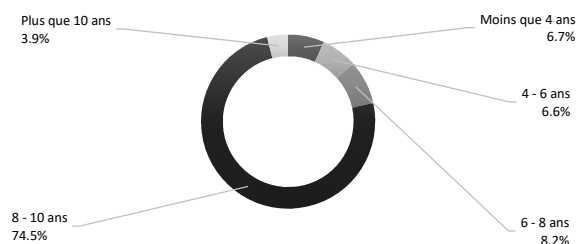
		1 an (par mois)	3 ans	5 ans
Volatilité de groupe de placement <sup>3</sup>	(en %)	0.31%	N.a.	N.a.
Volatilité de Valeur de référence <sup>3</sup>	(en %)	1.63%	N.a.	N.a.

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

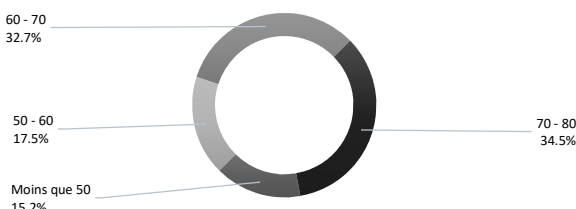
#### Évolution des valeurs depuis le lancement



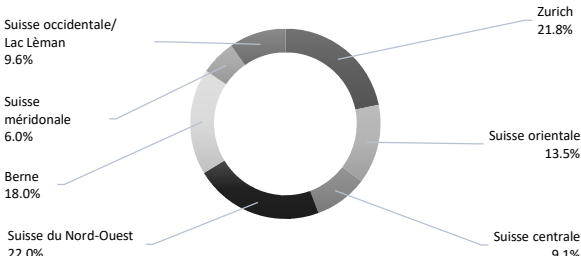
#### Diversification par durée restante au 31.03.2020



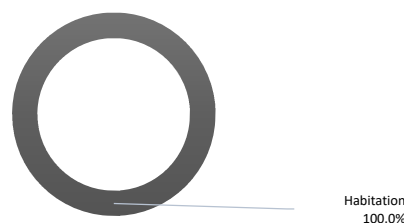
#### Diversification par investiture au 31.03.2020 (en %)



#### Diversification des biens immobilières par régions au 31.03.2020



#### Diversification par mode d'utilisation au 31.03.2020



#### 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.

<b>Frais</b>	
Acquisition	max. 0.25%
Reprise	max. 0.50%