

Factsheet 06/2020

30.06.2020

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) |
| Evaluation | 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 30.06.2020 (en %)

| | Groupe de placement | Valeur de référence | Différence au valeur de référence | KGAST Ranking |
|----------------------------------|---------------------|---------------------|-----------------------------------|---------------|
| Derniers mois | 1.66 | 1.55 | 0.11 | |
| Derniers 3 mois | 11.92 | 9.86 | 2.06 | |
| Année en cours | -8.79 | -3.13 | -5.66 | |
| Derniers 12 mois | -0.92 | 3.83 | -4.75 | |
| Derniers 3 ans ¹ | 5.25 | 7.08 | -1.83 | |
| Derniers 5 ans ¹ | N.a. | N.a. | N.a. | |
| Derniers 10 ans ¹ | N.a. | N.a. | N.a. | |
| Depuis le lancement ¹ | 8.39 | 5.94 | 2.45 | |

¹ annualisé

Chiffres-clés

| | | 30.06.2020 | 31.12.2019 |
|----------------------------------|-------------------|------------|------------|
| Fortune nette | (en millions CHF) | 130.82 | 106.75 |
| Nombre de quotes-parts | | 88 425 | 65 808 |
| Valeur en capital ² | (en CHF) | 1 445.71 | 1 590.48 |
| Revenu couru ² | (en CHF) | 33.79 | 31.59 |
| Valeur d'inventaire ² | (en CHF) | 1 479.50 | 1 622.07 |
| TER (TVA incl.) | (en %) | 0.58 | |

² par quote-part

Indicateurs de risque au 30.06.2020 (en %)

| | | 1 an | 3 ans | 5 ans |
|-------------------------|------------|--------|--------|-------|
| Volatilité ³ | (en %) | 17.15 | 13.64 | N.a. |
| Marge d'erreur | (en %) | 4.70 | 5.75 | N.a. |
| Beta | | 0.83 | 1.07 | N.a. |
| Sharpe Ratio | | -0.25 | 0.14 | N.a. |
| Information Ratio | | -1.01 | -0.32 | N.a. |
| Jensen-Alpha | | -0.05 | -0.02 | N.a. |
| Max. Drawdown | | -18.50 | -18.50 | N.a. |
| Recovery Period | (en jours) | N.a. | N.a. | N.a. |

³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

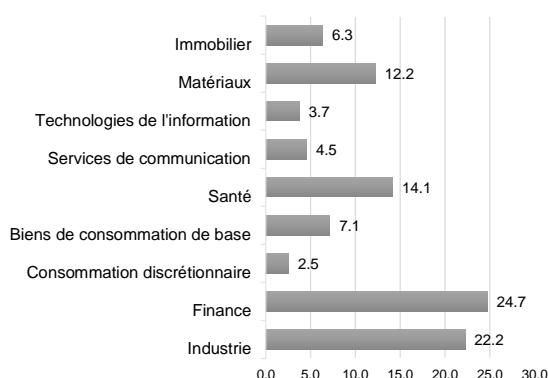
Les 10 principales positions au 30.06.2020 (en %)

| | |
|-----------------------------|------|
| Roche Holding AG G | 4.39 |
| Banque Cantonale Vadoise N | 3.93 |
| Swiss Prime Site AG N | 3.35 |
| EMS-Chemie Holding AG N | 3.29 |
| Partners Group Holding AG N | 3.23 |
| VAT Group AG N | 3.14 |
| BELIMO Holding AG N | 3.09 |
| Helvetia Holding AG N | 3.07 |
| PSP Swiss Property AG N | 2.96 |
| Swiss Re AG N | 2.95 |

Évolution des valeurs depuis le lancement



Structure par secteur au 30.06.2020 (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 06/2020

30.06.2020

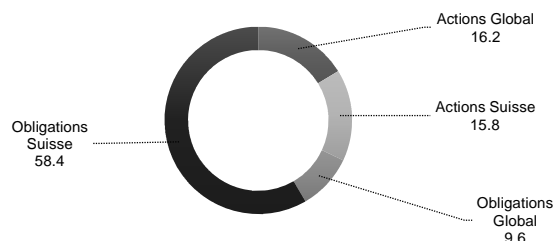
LPP-Mix.

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 30.06.2020 (en %)



Performance au 30.06.2020 (en %)

| | Groupe de placement | Valeur de référence | Différence au valeur de référence | KGAST Ranking |
|----------------------------------|---------------------|---------------------|-----------------------------------|---------------|
| 1 mois | 0.59 | 0.48 | 0.11 | |
| 3 mois | 6.06 | 5.78 | 0.28 | |
| Année en cours | -1.90 | -1.17 | -0.73 | |
| Derniers 12 mois | 0.66 | 1.20 | -0.54 | |
| Derniers 3 ans ¹ | 2.61 | 3.47 | -0.86 | |
| Derniers 5 ans ¹ | 2.69 | 3.44 | -0.75 | |
| Derniers 10 ans ¹ | 3.55 | 4.25 | -0.70 | |
| Derniers 15 ans ¹ | 3.06 | 3.59 | -0.54 | |
| Depuis le lancement ¹ | 4.40 | 4.78 | -0.38 | |

¹ annualisé

Chiffres-clés

| | | 30.06.2020 | 31.12.2019 |
|----------------------------------|-------------------|------------|------------|
| Fortune nette | (en millions CHF) | 18.47 | 18.41 |
| Nombre de quotes-parts | | 16 961 | 16 587 |
| Valeur en capital ² | (en CHF) | 1 076.44 | 1 102.82 |
| Revenu couru ² | (en CHF) | 12.48 | 7.19 |
| Valeur d'inventaire ² | (en CHF) | 1 088.92 | 1 110.01 |
| TER 2019 (TVA incl.) | (en %) | 0.35 | |

² par quote-part

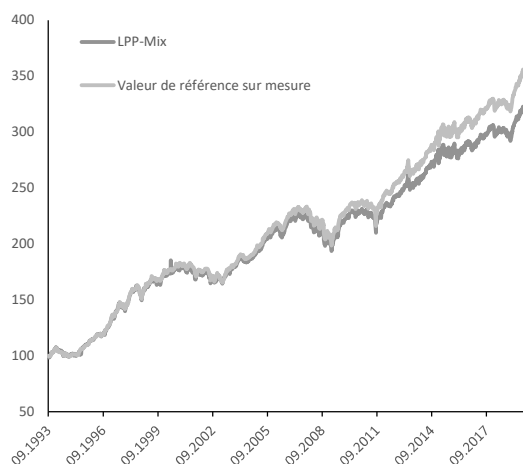
Indicateurs de risque au 30.06.2020 (en %)

| | | 1 an | 3 ans | 5 ans |
|--------------------------------|------------|-------|-------|--------|
| Volatilité ³ | (en %) | 8.93 | 5.86 | 5.27 |
| Marge d'erreur | (en %) | 0.83 | 0.70 | 0.56 |
| Beta | | 0.94 | 0.99 | 1.00 |
| Sharpe Ratio | | 0.07 | 0.44 | 0.51 |
| Information Ratio | | -0.65 | -1.24 | -1.33 |
| Jensen-Alpha | | 0.00 | -0.01 | -0.01 |
| Max. Drawdown | | -8.46 | -8.46 | -11.23 |
| Recovery Period | (en jours) | N.a. | N.a. | 1 187 |
| Modified Duration ⁴ | (en %) | 7.52 | | |

³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

⁴ Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 30.04.2020

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 06/2020

30.06.2020

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 30.06.2020 (in %)

| | Groupe de placement | Valeur de référence | Différence au valeur de référence | KGAST Ranking |
|----------------------------------|---------------------|---------------------|-----------------------------------|---------------|
| 1 mois | 0.64 | 0.57 | 0.06 | |
| 3 mois | 5.70 | 5.28 | 0.42 | |
| Année en cours | -3.29 | -0.57 | -2.73 | |
| Derniers 12 mois | 0.41 | 2.84 | -2.43 | |
| Derniers 3 ans ¹ | 2.25 | 4.55 | -2.29 | |
| Derniers 5 ans ¹ | 3.45 | 4.35 | -0.89 | |
| Derniers 10 ans ¹ | N.a. | N.a. | N.a. | |
| Derniers 15 ans ¹ | N.a. | N.a. | N.a. | |
| Depuis le lancement ¹ | 3.77 | 4.85 | -1.08 | |

¹annualisé

Chiffres-clés

| | | 30.06.2020 | 31.12.2019 |
|----------------------------------|-------------------|------------|------------|
| Fortune nette | (en millions CHF) | 357.66 | 224.66 |
| Nombre de quotes-parts | | 292 013 | 177 384 |
| Valeur en capital ² | (en CHF) | 1 222.48 | 1 262.22 |
| Revenu couru ² | (en CHF) | 2.31 | 4.29 |
| Valeur d'inventaire ² | (en CHF) | 1 224.79 | 1 266.51 |
| TER 2019 (TVA incl.) | (en %) | 0.77 | |

² par quote-part

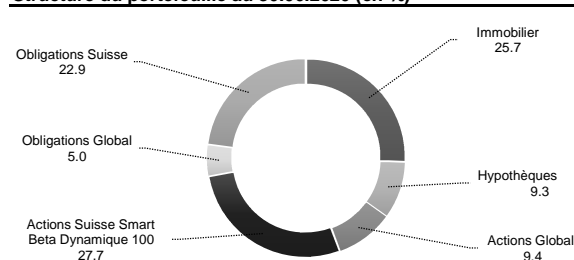
Indicateurs de risque au 30.06.2020 (in %)

| | | 1 an | 3 ans | 5 ans |
|--------------------------------|------------|-------|-------|-------|
| Volatilité ³ | (en %) | 8.31 | 6.21 | 5.67 |
| Marge d'erreur | (en %) | 8.01 | 4.75 | 3.84 |
| Beta | | 1.14 | 1.18 | 1.06 |
| Sharpe Ratio | | -0.12 | 0.13 | 0.36 |
| Information Ratio | | -0.30 | -0.48 | -0.23 |
| Jensen-Alpha | | -0.03 | -0.03 | -0.01 |
| Max. Drawdown | | -8.77 | -8.77 | -8.77 |
| Recovery Period | (en jours) | N.a. | N.a. | N.a. |
| Modified Duration ⁴ | (en %) | 7.30 | | |

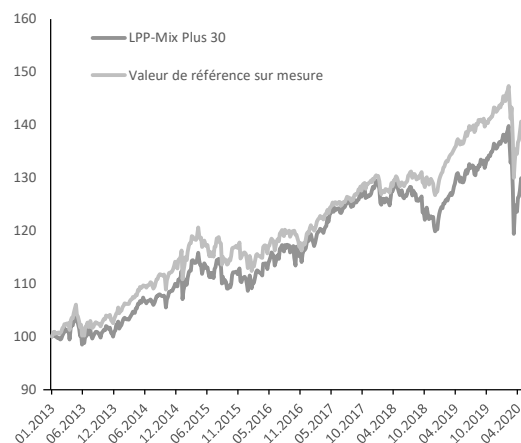
³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

⁴ Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 30.04.2020

Structure du portefeuille au 30.06.2020 (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 06/2020

30.06.2020

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. ½ habitations - max. ½ usage commercial |

Performance au 30.06.2020 (en %)

| | Groupe de placement | Valeur de référence | Diff. Au valeur de référence | Risque ¹ | Ranking KGAST |
|----------------------------------|---------------------|---------------------|------------------------------|---------------------|---------------|
| 3 mois | 0.72 | 1.20 | -0.49 | | |
| Année en cours | 1.35 | 2.58 | -1.23 | | |
| Derniers 12 mois | 3.40 | 5.10 | -1.70 | 1.53 | |
| Derniers 3 ans ² | 3.43 | 4.85 | -1.41 | 1.53 | |
| Derniers 5 ans ² | 3.45 | 5.01 | -1.55 | 1.58 | |
| 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 | 3.60 | 5.03 | -1.43 | 1.67 | |

¹ mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

² annualisé

Chiffres-clés

| | | 30.06.2020 | 31.12.2019 |
|--|-------------------|------------|------------|
| Fortune nette | (en millions CHF) | 842.94 | 798.88 |
| Nombre de quotes-parts | | 640 676 | 615 371 |
| Valeur en capital ³ | (en CHF) | 1 297.67 | 1 264.68 |
| Revenu couru ³ | (en CHF) | 18.04 | 33.52 |
| Valeur d'inventaire ³ | (en CHF) | 1 315.71 | 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 _{NAV} 2019 (NAV) (TVA incl.) | (en %) | 0.57 | |
| ROE | (en %) | 0.67 | 3.34 |
| ROIC | (en %) | 0.62 | 3.30 |

³ par quote-part

Diversification par utilisation au 30.06.2020* (in%)



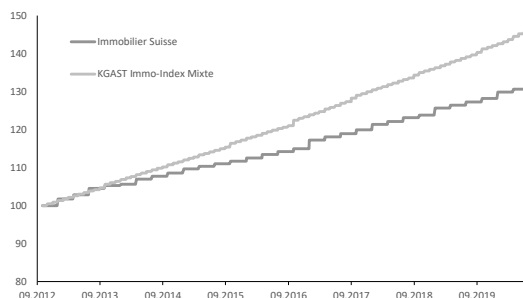
* le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

Diversification par canton au 30.06.2020* (in%)

| Canton | Pourcentage (in%) |
|---------------|-------------------|
| Argovie | 23.2 |
| Zurich | 14.7 |
| Berne | 8.3 |
| Vaud | 7.7 |
| Bâle-Ville | 6.8 |
| Schwyz | 6.0 |
| Genève | 5.7 |
| Bâle-Campagne | 5.0 |
| Thurgovie | 4.7 |
| Lucerne | 4.6 |
| Soleure | 3.3 |
| Saint-Gall | 3.0 |
| Jura | 2.7 |
| Schaffhouse | 2.5 |
| Neuchâtel | 0.9 |
| 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 06/2020

30.06.2020

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 30.06.2020 (en %)

| | Groupe de placement | Valeur de référence | Diff. Au valeur de référence | Risque ¹ | KGAST Ranking |
|----------------------------------|---------------------|---------------------|------------------------------|---------------------|---------------|
| 3 mois | 0.80 | 1.20 | -0.40 | | |
| Année en cours | 2.03 | 2.58 | -0.55 | | |
| Derniers 12 mois | 3.40 | 5.10 | -1.70 | 1.51 | |
| Derniers 3 ans ² | 3.05 | 4.85 | -1.80 | 1.56 | |
| Derniers 5 ans ² | N.a. | N.a. | N.a. | N.a. | |
| 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 | 5.42 | 4.99 | 0.43 | 3.50 | |

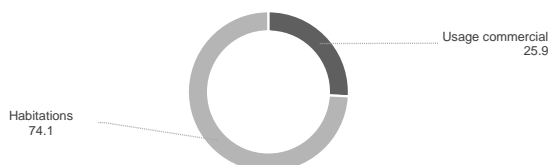
¹ mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

² annualisé

Chiffres-clés

| | 30.06.2020 | 31.12.2019 |
|--|--------------------------|------------|
| Fortune nette | (en millions CHF) 279.25 | 250.50 |
| Nombre de quotes-parts | 220 686 | 201 980 |
| Valeur en capital ³ | (en CHF) 1 240.81 | 1 190.20 |
| Revenu couru ³ | (en CHF) 24.54 | 50.03 |
| Valeur d'inventaire ³ | (en CHF) 1 265.35 | 1 240.23 |
| ³ par quote-part | | |
| Taux de perte sur loyer | (en %) | 3.28 |
| Quote-part financement par de fonds de tiers | (en %) | 13.76 |
| Marge de résultat opérationnel | (en %) | 63.74 |
| TER _{SA} 2019 (NAV) (TVA incl.) | (en %) | 0.88 |
| ROE | (en %) | 1.56 |
| ROIC | (en %) | 1.07 |

Diversification par utilisation au 30.06.2020* (en %)



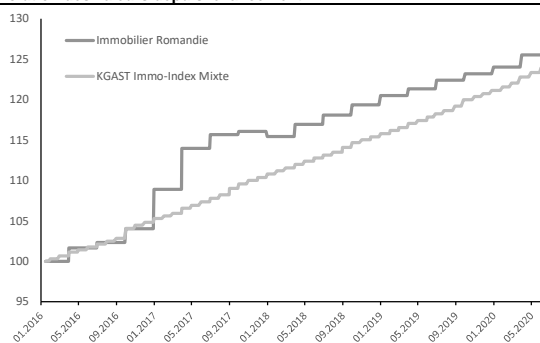
* le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

Diversification par canton au 30.06.2020* (en %)

| | |
|-----------|------|
| Vaud | 41.4 |
| Genève | 41.2 |
| Valais | 8.9 |
| Neuchâtel | 8.5 |

* 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 06/2020

30.06.2020

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 30.06.2020 (en %)

| | Groupe de placement | Valeur de référence | Différence |
|------------------------------|---------------------|---------------------|------------|
| 1 mois | 0.02 | 0.26 | -0.24 |
| 3 mois | 0.12 | 2.10 | -1.98 |
| Année en cours | 0.28 | -1.06 | 1.34 |
| Derniers 12 mois | 2.47 | -1.65 | 4.12 |
| Derniers 3 ans ¹ | N.a. | N.a. | n.a. |
| Derniers 5 ans ¹ | N.a. | N.a. | n.a. |
| Derniers 10 ans ¹ | N.a. | N.a. | n.a. |
| Derniers 15 ans ¹ | N.a. | N.a. | n.a. |
| Depuis le lancement | 4.63 | 1.73 | 2.90 |

¹ annualisé

Chiffres-clés

| | | 30.06.2020 | 31.12.2019 |
|----------------------------------|-------------------|------------|------------|
| Fortune nette | (en millions CHF) | 39.47 | 28.15 |
| Nombre de quotes-parts | | 37 735 | 26977.00 |
| Valeur d'inventaire ² | (en CHF) | 1 046.01 | 1043.32 |

² par quote-part

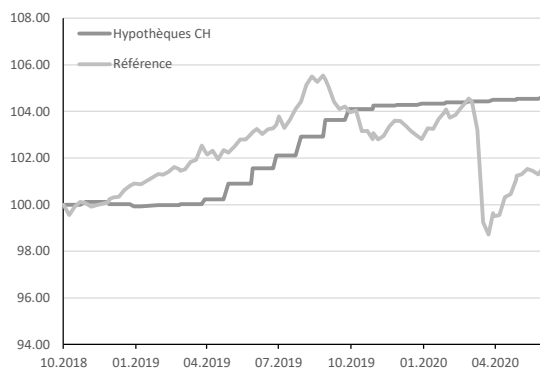
| | | 30.06.2020 | 31.12.2019 |
|----------------------|-------------|------------|------------|
| TER 2019 (TVA incl.) | (en %) | 0.39 | |
| Ø-durée restante | (en ans) | 8.82 | 8.49 |
| Modified Duration | (en ans) | 8.45 | 8.01 |
| Nombre d'hypothèques | | 72 | 51.00 |
| investiture moyenne | (en %) | 60.7 | 0.96 |
| Rendement brut | (in % p.a.) | 0.92 | 0.70 |

Indicateurs de risque au 30.06.2020 (en %)

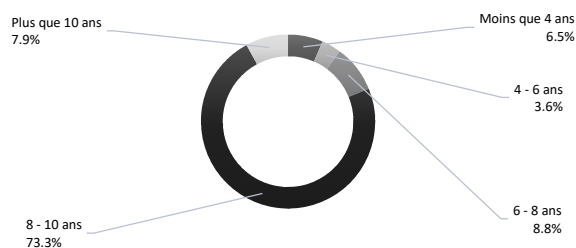
| | | 1 an (par mois) | 3 ans | 5 ans |
|--|--------|--------------------|-------|-------|
| Volatilité de groupe de placement ³ | (en %) | 0.28% | N.a. | N.a. |
| Volatilité de Valeur de référence ³ | (en %) | 1.69% | N.a. | N.a. |

³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

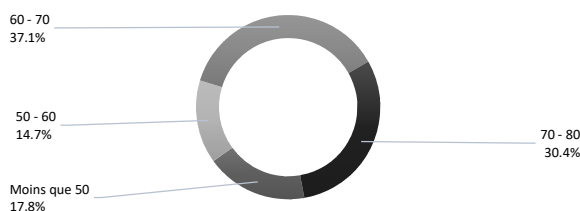
Évolution des valeurs depuis le lancement



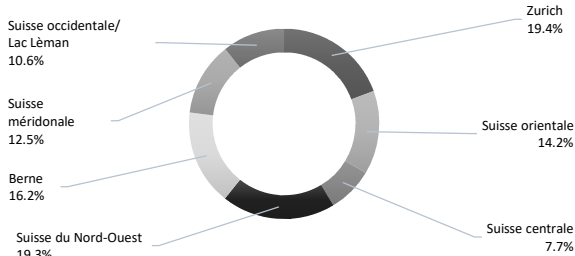
Diversification par durée restante au 30.06.2020



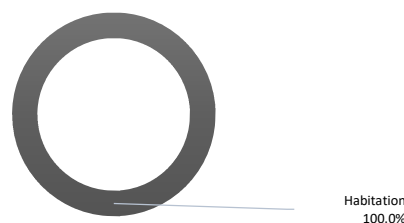
Diversification par investiture au 30.06.2020 (en %)



Diversification des biens immobilières par régions au 30.06.2020



Diversification par mode d'utilisation au 30.06.2020



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.

| | |
|-------------|------------|
| Frais | |
| Acquisition | max. 0.25% |
| Reprise | max. 0.50% |