

# Actions Suisse Smart Beta Dynamique 100.

Des indices innovant, un placement intelligent.




30.06.2019

## 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 30.06.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	KGAST Ranking
Derniers mois	4.21	3.75	0.46	
Derniers 3 mois	8.32	6.55	1.77	
Année en cours	21.87	21.84	0.03	
Derniers 12 mois	7.94	15.98	-8.04	
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	14.53	11.42	3.11	<b>1. Grade</b>
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>	10.93	6.50	4.43	

<sup>1</sup> annualisé

## Chiffres-clés

		30.06.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	102.16	49.39
Nombre de quotes-parts		68 417	40 314
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 458.41	1 151.91
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	34.78	73.30
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 493.19	1 225.21
TER (TVA incl.)	(en %)	0.58	

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

## Indicateurs de risque au 30.06.2019 (en %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	15.10	10.49	N.a.
Marge d'erreur	(en %)	3.36	4.56	N.a.
Beta		0.97	0.92	N.a.
Sharpe Ratio		0.09	0.75	N.a.
Information Ratio		-2.39	0.68	N.a.
Jensen-Alpha		-0.08	0.04	N.a.
Max. Drawdown		-14.17	-14.17	N.a.
Recovery Period	(en jours)	120	120	N.a.

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

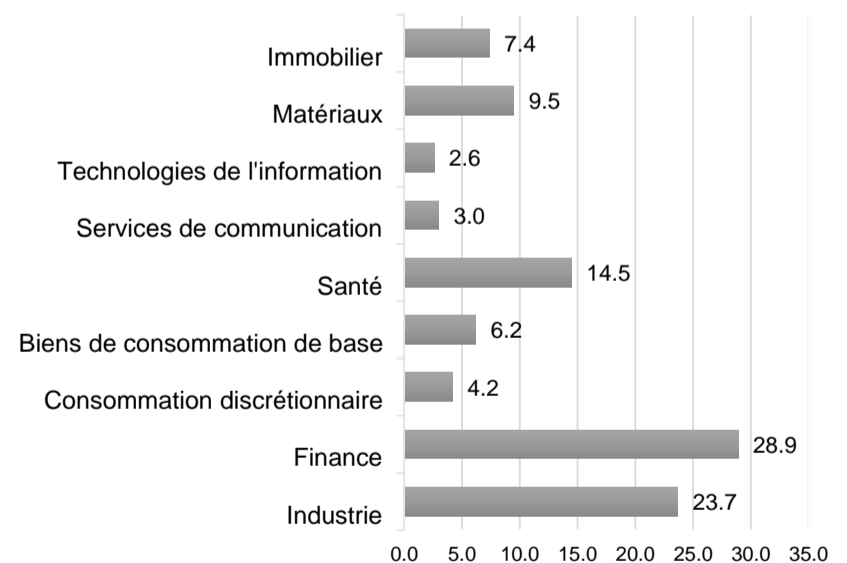
## Les 10 principales positions au 30.06.2019 (en %)

PSP Swiss Property AG N	4.35
Swiss Life Holding AG N	4.22
Helvetia Holding AG N	3.96
Roche Holding AG G	3.89
Zurich Insurance Group AG N	3.86
Novartis AG N	3.43
Partners Group Holding AG N	3.19
Nestle AG N	3.10
Swiss Prime Site AG N	3.02
Straumann Holding AG N	2.99

## Évolution des valeurs depuis le lancement



## Structure par secteur au 30.06.2019 (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	-
Reprise	-

# LPP-Mix.

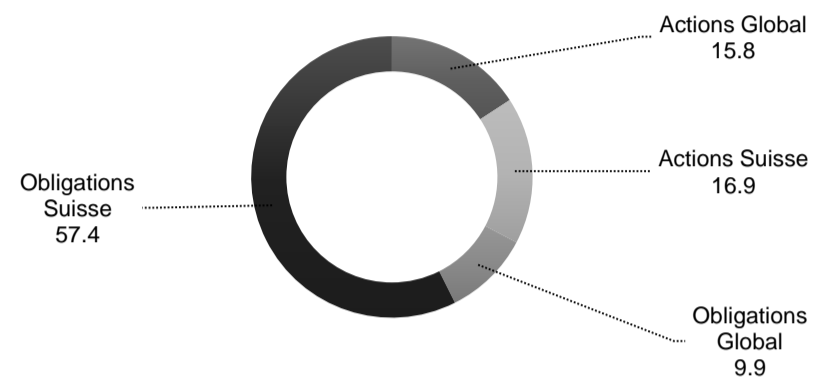
Bien diversifié.

## 30.06.2019

### 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 30.06.2019 (en %)



### Performance au 30.06.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	KGAST Ranking
1 mois	1.28	1.34	-0.06	
3 mois	2.20	2.44	-0.24	
Année en cours	7.66	8.44	-0.79	<b>2. Grade</b>
Derniers 12 mois	4.89	6.21	-1.32	<b>2. Grade</b>
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	3.12	3.94	-0.82	
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	3.31	4.15	-0.84	
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	4.28	4.94	-0.66	
Derniers 15 ans <sup>1</sup>	3.65	4.19	-0.54	
Depuis le lancement <sup>1</sup>	4.55	4.92	-0.38	

<sup>1</sup> annualisé

### Chiffres-clés

		30.06.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	17.48	14.85
Nombre de quotes-parts		16 154	14 779
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 072.78	953.71
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	9.02	51.15
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 081.80	1 004.86
TER 2018 (TVA incl.)	(en %)	0.53	

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

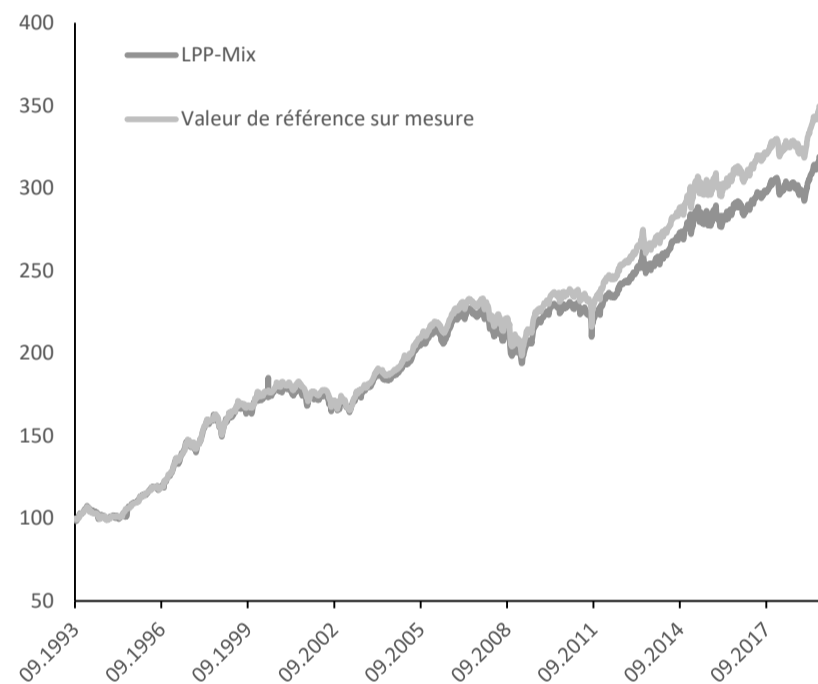
### Indicateurs de risque au 30.06.2019 (en %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	4.55	3.53	4.05
Marge d'erreur	(en %)	0.86	0.53	0.45
Beta		0.93	0.97	0.99
Sharpe Ratio		1.71	1.70	1.52
Information Ratio		-1.53	-1.54	-1.86
Jensen-Alpha		-0.01	-0.01	-0.01
Max. Drawdown		-3.34	-3.80	-12.50
Recovery Period	(en jours)	59	59	N.a.
Modified Duration <sup>4</sup>	(en %)	7.25		

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

<sup>4</sup> Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 31.03.2019

### 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%

# LPP-Mix Plus 30.

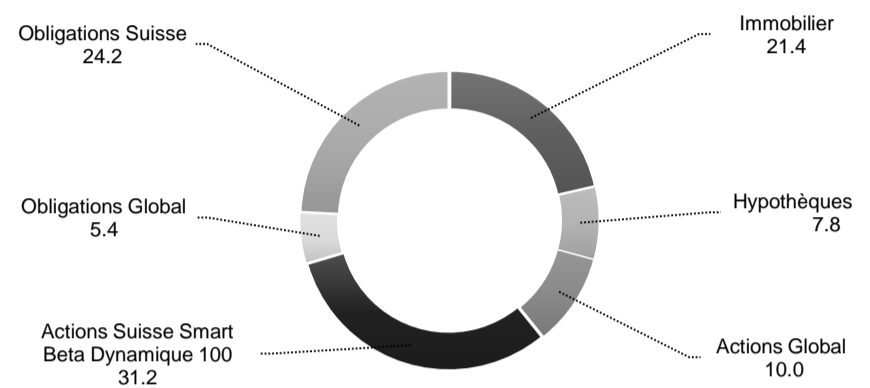
Orienté rendement.

30.06.2019

## 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

## Structure du portefeuille au 30.06.2019 (en %)



## Performance au 30.06.2019 (in %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	KGAST Ranking
1 mois	1.69	1.41	0.28	
3 mois	3.31	2.65	0.66	
Année en cours	9.22	8.81	0.41	<b>4. Grade</b>
Derniers 12 mois	3.69	7.29	-3.60	
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	4.41	5.37	-0.96	
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	4.33	4.85	-0.52	<b>3. Grade</b>
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>	4.30	5.16	-0.85	

<sup>1</sup> annualisé

## Chiffres-clés

		30.06.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	196.47	68.07
Nombre de quotes-parts		161 072	60 953
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 214.22	1 103.25
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	5.56	13.57
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 219.78	1 116.82
TER 2018 (TVA incl.)	(en %)	0.86	

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

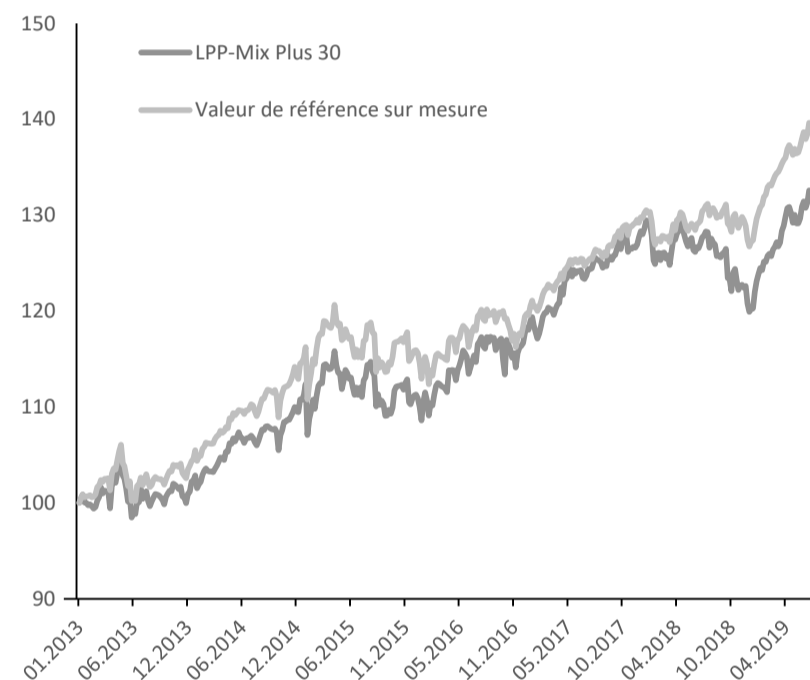
## Indicateurs de risque au 30.06.2019 (in %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	6.35	4.62	4.70
Marge d'erreur	(en %)	2.23	1.93	1.81
Beta		1.15	1.13	0.99
Sharpe Ratio		0.37	0.67	0.64
Information Ratio		-1.61	-0.49	-0.29
Jensen-Alpha		-0.05	-0.01	0.00
Max. Drawdown		-6.26	-6.26	-6.26
Recovery Period	(en jours)	120	120	120
Modified Duration <sup>4</sup>	(en %)	7.25		

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

<sup>4</sup> Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 31.03.2019

## 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%

## Immobilier Suisse.

Des rendements stables et durables, une volatilité faible.

30.06.2019

### 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. 2/3 habitations - max. 1/3 usage commercial

### Performance au 30.06.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. Au valeur de	Risque <sup>1</sup>	Ranking KGAST
3 mois	0.66	1.01	-0.35		
Année en cours	1.25	2.10	-0.85		
Derniers 12 mois	3.32	4.50	-1.19	1.63	
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	3.67	5.00	-1.32	1.74	
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	3.39	4.94	-1.55	1.55	
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	5.02	-1.38	1.68	

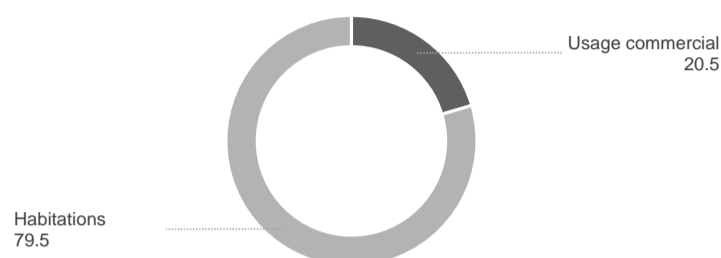
<sup>1</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

<sup>2</sup> annualisé

### Chiffres-clés

		30.06.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	611.28	602.56
Nombre de quotes-parts		480 408	479 465
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 256.26	1 015.79
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	16.17	240.94
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 272.43	1 256.73
<sup>3</sup> par quote-part			
Taux de perte sur loyer	(en %)	12.39	10.61
Quote-part financement par de fonds de tiers	(en %)	-	-
Marge de résultat opérationnel	(en %)	67.22	67.79
TER <sub>ISA</sub> 2018 (NAV) (TVA incl.)	(en %)	0.61	-
ROE	(en %)	1.29	7.15
ROIC	(en %)	1.23	3.51

### Diversification par utilisation au 30.06.2019<sup>4</sup> (in%)



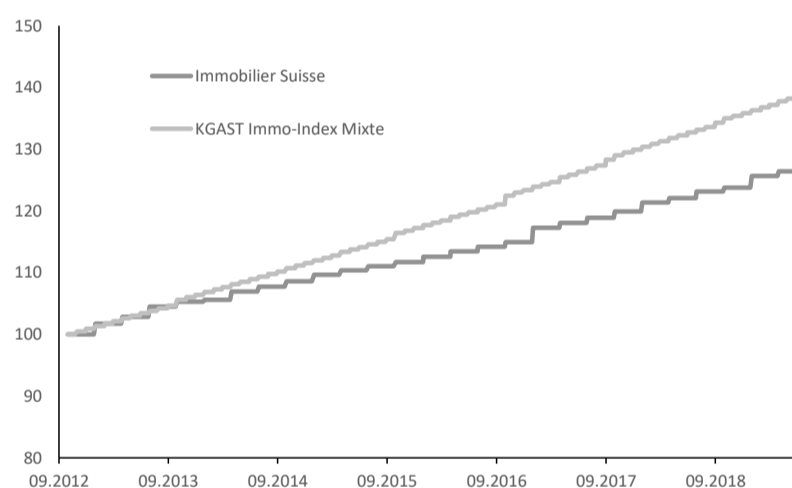
<sup>4</sup> le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

### Diversification par canton au 30.06.2019<sup>5</sup> (in%)

Canton	Pourcentage (in%)	Ranking
Argovie	22.6	Jura 3.7
Zurich	15.9	Thurgovie 3.4
Vaud	10.6	Schaffhouse 3.0
Berne	10.1	Soleure 1.3
Schwyz	8.1	Neuchâtel 1.2
Genève	7.3	Zoug 1.1
Bâle-Ville	6.7	Bâle-Campagne 1.0
Saint-Gall	4.0	

<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

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%

## Immobilier Romandie.

Des rendements stables et durables, une volatilité faible.

30.06.2019

### Caractéristiques

Année de fondation	2016
N° de valeur	30120010 (ISIN: CH301200108)
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 30.06.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. Au valeur de	Risque <sup>1</sup>	KGAST Ranking
3 mois	0.89	1.01	-0.12		
Année en cours	1.56	2.10	-0.54		
Derniers 12 mois	3.66	4.50	-0.85	1.57	
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	6.15	5.00	1.15	3.95	<b>1. Grade</b>
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>	6.01	4.96	1.05	3.78	

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

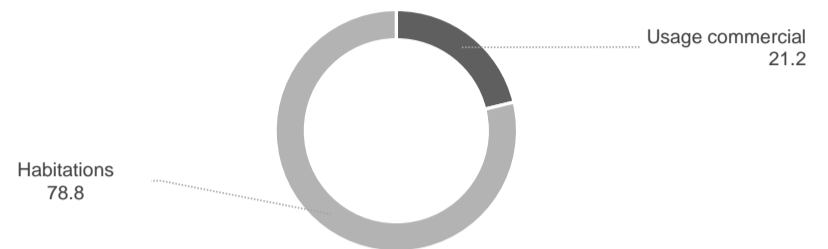
<sup>2</sup> annualisé

### Chifres-clés

		30.06.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	217.57	187.57
Nombre de quotes-parts		177 791	155 667
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 190.90	1 046.01
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	32.84	158.91
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 223.74	1 204.92
Taux de perte sur loyer	(en %)	3.40	5.03
Quote-part financement par de fonds de tiers	(en %)	19.19	16.07
Marge de résultat opérationnel	(en %)	65.99	60.13
TER <sub>ISA</sub> 2018 (NAV) (TVA incl.)	(en %)	0.93	
ROE	(en %)	2.68	6.74
ROIC	(en %)	1.32	3.65

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

### Diversification par utilisation au 30.06.2019<sup>4</sup> (en %)



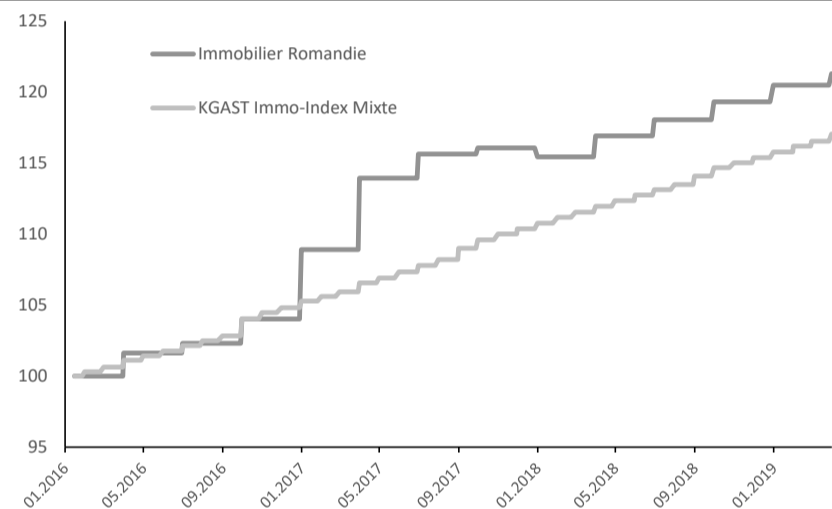
<sup>4</sup> le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

### Diversification par canton au 30.06.2019<sup>5</sup> (en %)

Vaud	45.7
Genève	31.8
Neuchâtel	11.3
Valais	11.2

<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%

# Hypothèques Suisse.

Rendement à faible volatilité.

30.06.2019

## 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 30.06.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence	KGAST Ranking
1 mois		0.54	0.32	0.22
3 mois		1.88	1.10	0.78
Année en cours		2.18	2.52	-0.34
Derniers 12 mois		N.a.	N.a.	n.a.
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		2.11	3.44	-1.33

<sup>1</sup> annualisé

## Chifres-clés

		30.06.2019
Fortune nette	(en millions CHF)	20.02
Nombre de quotes-parts		19 602
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1018.50
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	2.58
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 021.08

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

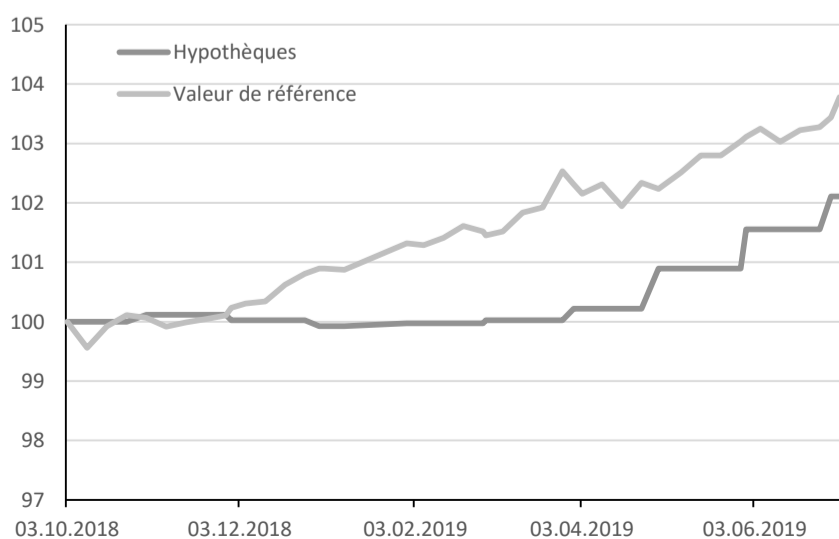
TER 2018 (TVA incl.) ex ante	(en %)	0.30
Ø-durée restante	(en ans)	8.59
Modified Duration	(en ans)	8.39
Nombre d'hypothèques		40
investiture moyenne	(en %)	65.6
Rendement brut	(in % p.a.)	0.99

## Indicateurs de risque au 30.06.2019 (en %)

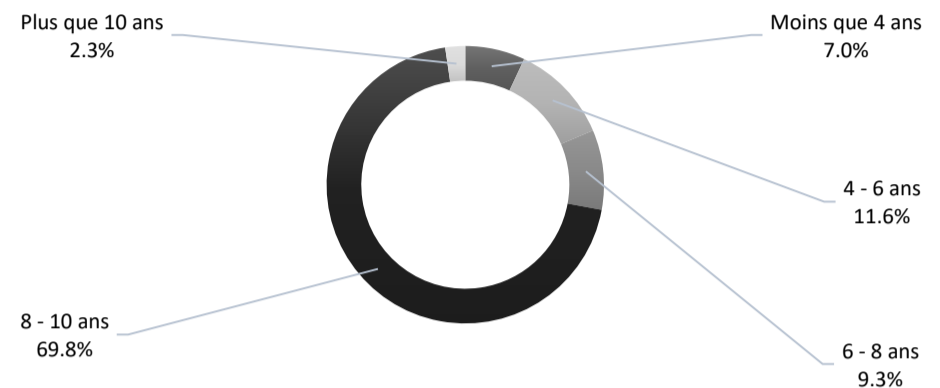
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité de groupe de placement <sup>3</sup>	(en %)	N.a.	N.a.	N.a.
Volatilité de Valeur de référence <sup>3</sup>	(en %)	N.a.	N.a.	N.a.

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

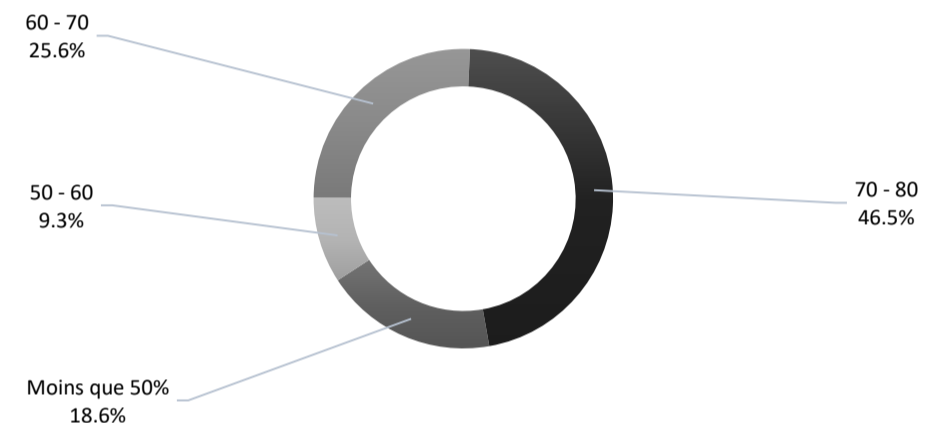
## Évolution des valeurs depuis le lancement



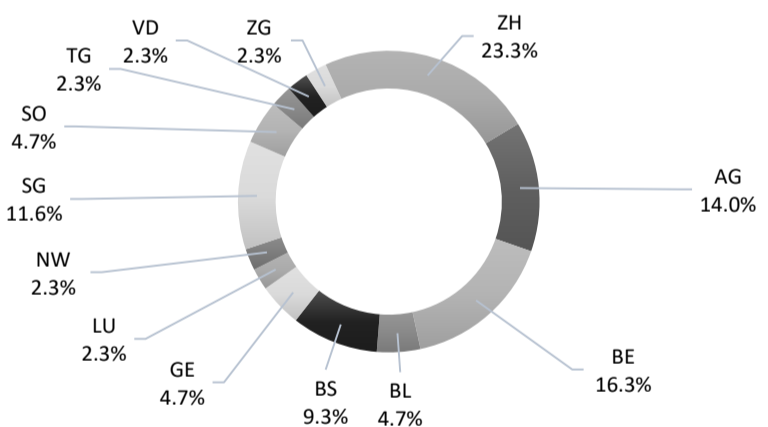
## Diversification par durée restante au 30.06.2019



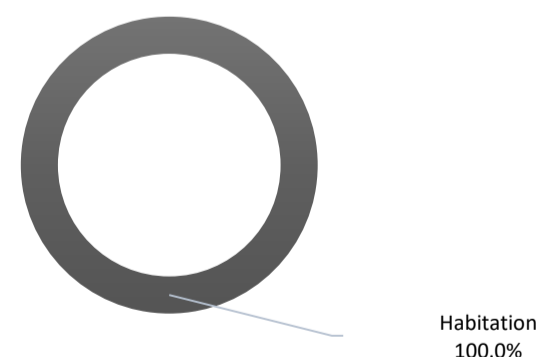
## Diversification par investiture au 30.06.2019 (en %)



## Diversification des biens immobilières par cantons au 30.06.2019



## Diversification par mode d'utilisation au 30.06.2019



## 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%