

## Factsheet 09/2020

30.09.2020

### 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



	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 30.09.2020 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	CAFP Ranking
Derniers mois	0.21	0.52	-0.31	
Derniers 3 mois	5.33	2.32	3.01	
Année en cours	-3.93	-0.88	-3.05	
Derniers 12 mois	2.95	4.02	-1.07	
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	5.23	6.79	-1.56	
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	11.04	7.95	3.09	
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	
Depuis le lancement <sup>1</sup>	9.06	6.12	2.94	

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		30.09.2020	31.12.2019
Fortune nette	(en millions CHF)	130.67	106.75
Nombre de quotes-parts		83 851	65 808
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 521.80	1 590.48
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	36.59	31.59
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 558.39	1 622.07
TER (TVA incl.)	(en %)		0.58

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

#### Indicateurs de risque au 30.09.2020 (en %)

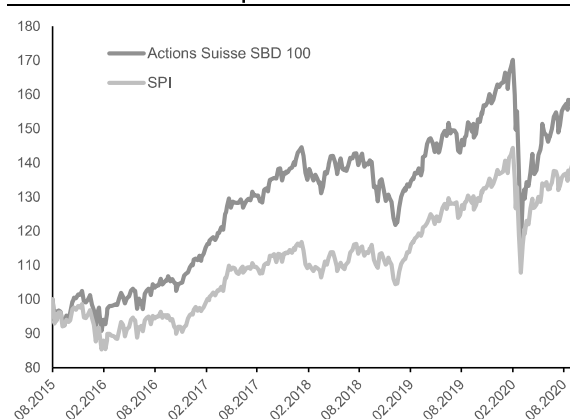
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	17.49	13.66	12.18
Marge d'erreur	(en %)	7.93	5.91	5.45
Beta		1.24	1.08	1.02
Sharpe Ratio		-0.09	0.05	0.54
Information Ratio		-0.13	-0.26	0.57
Jensen-Alpha		-0.01	-0.02	0.03
Max. Drawdown		-18.50	-18.50	-18.50
Recovery Period	(en jours)	N.a.	N.a.	N.a.

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

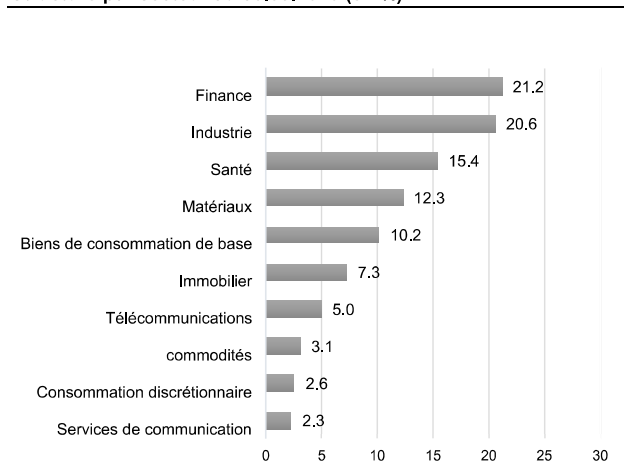
#### Les 10 principales positions au 30.09.2020 (en %)

Swiss Prime Site AG N	3.80
EMS-Chemie Holding AG N	3.66
PSP Swiss Property AG N	3.47
Logitech INTL SA	3.24
Barry Callebaut AG	3.20
Banque Cantonale Vadoise N	3.16
Nestle AG	3.10
BKW AG	3.06
Tecan Group AG	2.88
Baloise-Holding AG	2.66

#### Évolution des valeurs depuis le lancement



#### Structure par secteur au 30.09.2020 (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 09/2020

30.09.2020

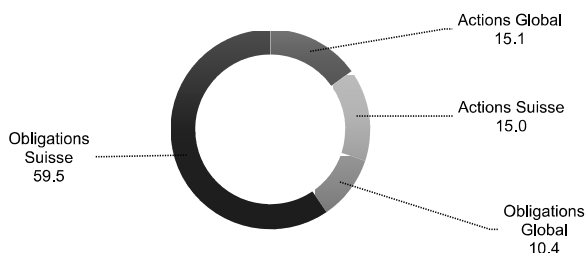
### LPP-Mix.

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 30.09.2020 (en %)



#### Performance au 30.09.2020 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	CAFP Ranking
1 mois	0.39	0.55	-0.16	
3 mois	1.54	1.74	-0.19	
Année en cours	-0.38	0.55	-0.93	
Derniers 12 mois	0.18	0.70	-0.53	
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	2.50	3.43	-0.93	
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	3.04	3.76	-0.72	
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	3.53	4.24	-0.71	
Derniers 15 ans <sup>1</sup>	2.96	3.50	-0.54	
Depuis le lancement <sup>1</sup>	4.42	4.80	-0.39	

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		30.09.2020	31.12.2019
Fortune nette	(en millions CHF)	19.14	18.41
Nombre de quotes-parts		17 308	16 587
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 094.08	1 102.82
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	11.66	7.19
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 105.74	1 110.01
TER 2019 (TVA incl.)	(en %)		0.35

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

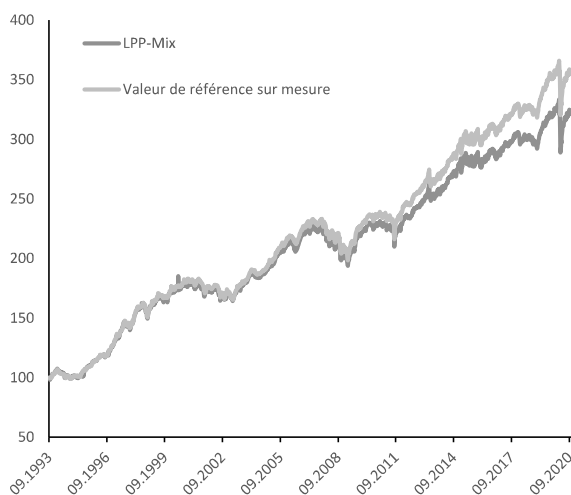
#### Indicateurs de risque au 30.09.2020 (en %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	8.81	5.85	5.08
Marge d'erreur	(en %)	0.76	0.72	0.58
Beta		0.95	0.99	1.00
Sharpe Ratio		0.37	0.95	1.21
Information Ratio		-0.70	-1.29	-1.24
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 <sup>4</sup>	(en %)	7.47		

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

<sup>4</sup> Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 30.09.2020

#### 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 09/2020

30.09.2020

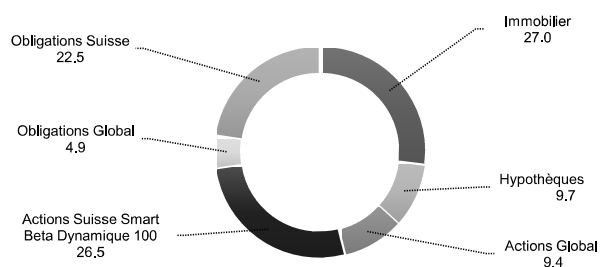
### LPP-Mix Plus 30.

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

#### Structure du portefeuille au 30.09.2020 (en %)



#### Performance au 30.09.2020 (in %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	CAFP Ranking
1 mois	0.13	0.49	-0.36	
3 mois	2.24	1.75	0.49	
Année en cours	-1.13	1.26	-2.39	
Derniers 12 mois	1.15	2.79	-1.64	
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	2.34	4.50	-2.16	
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	4.32	5.00	-0.68	
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>	3.94	4.94	-1.00	

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		30.09.2020	31.12.2019
Fortune nette	(en millions CHF)	372.01	224.66
Nombre de quotes-parts		297 092	177 384
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 250.49	1 262.22
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	1.69	4.29
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 252.18	1 266.51
TER 2019 (TVA incl.)	(en %)		0.77

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

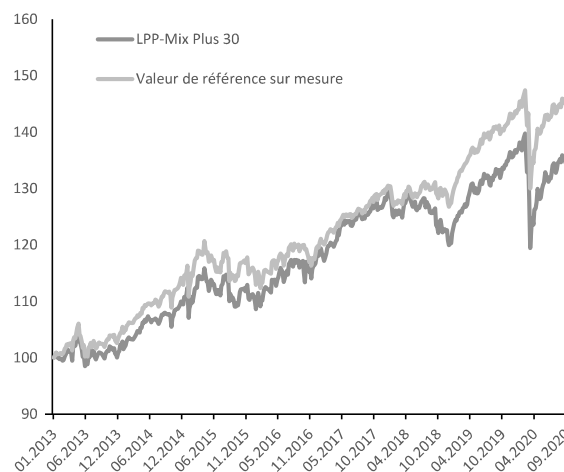
#### Indicateurs de risque au 30.09.2020 (in %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	8.40	6.21	5.35
Marge d'erreur	(en %)	8.18	4.85	3.89
Beta		1.07	1.14	1.08
Sharpe Ratio		0.06	0.28	0.69
Information Ratio		-0.20	-0.45	-0.17
Jensen-Alpha		-0.02	-0.03	-0.01
Max. Drawdown		-8.77	-8.77	-8.77
Recovery Period	(en jours)	N.a.	N.a.	N.a.
Modified Duration <sup>4</sup>	(en %)	7.46		

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

<sup>4</sup> Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 30.09.2020

#### 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	0.50%

## Factsheet 09/2020

30.09.2020

### 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 30.09.2020 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. Au valeur de référence	Risque <sup>1</sup>	CAFP Ranking
3 mois	0,73	1,22	-0,49		
Année en cours	2,09	3,83	-1,74		
Derniers 12 mois	3,40	4,84	-1,43	1,53	
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	3,39	4,70	-1,31	1,52	
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	3,48	4,92	-1,45	1,59	
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>	3,58	5,03	-1,44	1,64	

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

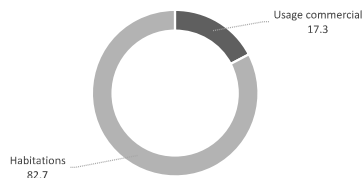
<sup>2</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

	30.09.2020	31.12.2019
Fortune nette	(en millions CHF) 849,09	798,88
Nombre de quotes-parts	640 676	615 371
Valeur en capital <sup>1</sup>	(en CHF) 1 297,67	1 264,68
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF) 27,64	33,52
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF) 1 325,31	1 298,20
Taux de perte sur loyer	(en %) 9,42	12,12
Quote-part financement par de fonds de tiers	(en %) 0,00	1,73
Marge de résultat opérationnel	(en %) 71,89	69,22
TER <sub>ISA</sub> 2019 (NAV) (TVA incl.)	(en %) 0,57	
ROE	(en %) 2,13	3,34
ROIC	(en %) 2,05	3,30

<sup>1</sup> par quote-part

#### Diversification par utilisation au 30.09.2020<sup>1</sup> (in%)



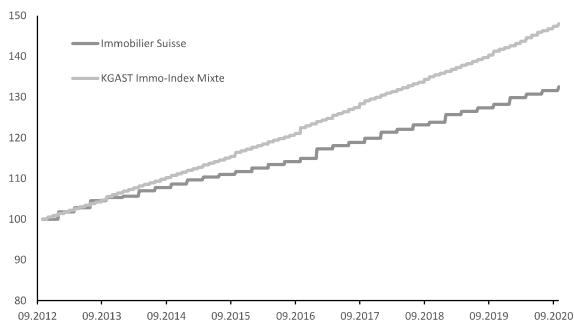
<sup>1</sup> le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

#### Diversification par canton au 30.09.2020<sup>1</sup> (in%)

Argovie	22.2	Thurgovie	4.5
Zurich	14.1	Lucerne	4.4
Bâle-Campagne	9.0	Soleure	3.1
Berne	7.9	Saint-Gall	2.8
Vaud	7.4	Jura	2.6
Bâle-Ville	6.5	Schaffhouse	2.4
Schwyz	5.8	Neuchâtel	0.9
Genève	5.4	Zoug	0.8

<sup>1</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%

## Factsheet 09/2020

30.09.2020

### 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 30.09.2020 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. Au valeur de référence	Risque <sup>1</sup>	CAFP Ranking
3 mois	1.18	1.22	-0.04		
Année en cours	3.23	3.83	-0.59		
Derniers 12 mois	3.94	4.84	-0.89	1.73	
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	3.32	4.70	-1.37	1.65	
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>	5.39	4.99	0.40	3.34	

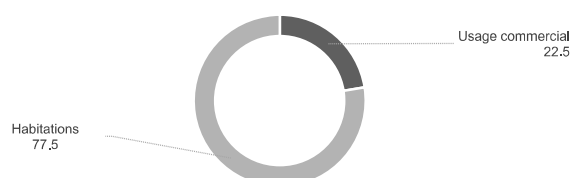
<sup>1</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

<sup>2</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		30.09.2020	31.12.2019
Fortune nette	(en millions CHF)	299.71	250.50
Nombre de quotes-parts		234 091	201 980
Valeur en capital <sup>1</sup>	(en CHF)	1 244.79	1 190.20
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	35.53	50.03
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 280.32	1 240.23
			<sup>3</sup> par quote-part
Taux de perte sur loyer	(en %)	3.16	3.64
Quote-part financement par de fonds de tiers	(en %)	15.14	13.03
Marge de résultat opérationnel	(en %)	69.66	64.30
TER <sub>SA</sub> 2019 (NAV) (TVA incl.)	(en %)		0.88
ROE	(en %)	3.56	4.08
ROIC	(en %)	2.69	2.49

#### Diversification par utilisation au 30.09.2020\* (en %)



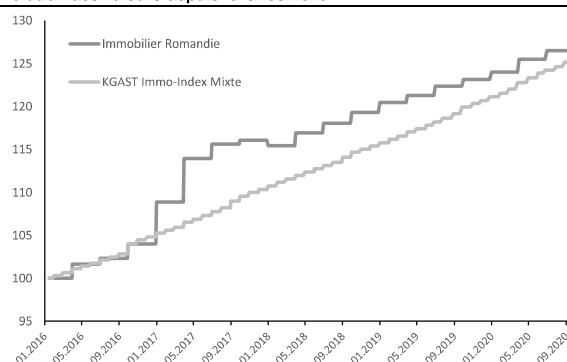
\* le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

#### Diversification par canton au 30.09.2020\* (en %)

Genève	44.6
Vaud	40.5
Valais	7.6
Neuchâtel	7.3

\* 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 09/2020

30.09.2020

### 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 30.09.2020 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence	CAFP Ranking
1 mois		0.13	0.52	-0.39
3 mois		0.22	0.84	-0.62
Année en cours		0.51	-0.22	0.73
Derniers 12 mois		0.72	-1.38	2.10
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		4.86	2.59	2.27

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

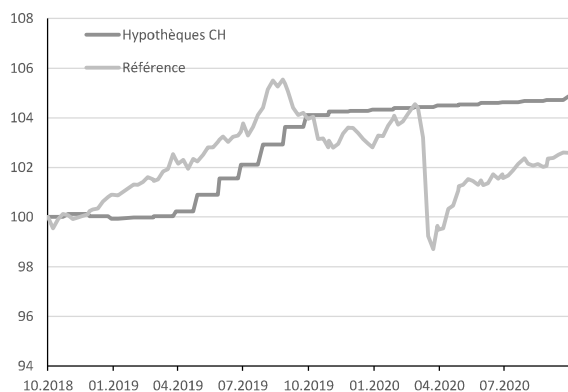
		30.09.2020	31.12.2019
Fortune nette	(en millions CHF)	45.53	28.15
Nombre de quotes-parts		43 417	26977.00
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 048.61	1043.32
		<sup>2</sup> par quote-part	
TER 2019 (TVA incl.)	(en %)		0.39
Ø-durée restante	(en ans)	8.99	8.49
Modified Duration	(en ans)	8.60	8.01
Nombre d'hypothèques		87	51.00
investiture moyenne	(en %)	60.2	0.96
Rendement brut	(in % p.a.)	0.91	0.70

#### Indicateurs de risque au 30.09.2020 (en %)

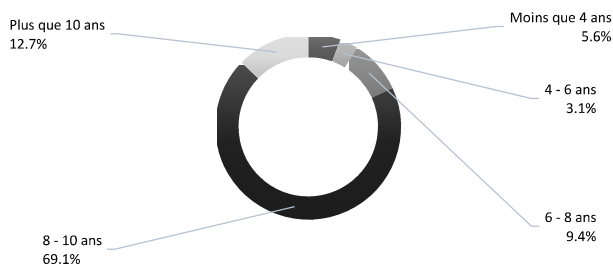
		1 an (par mois)	3 ans	5 ans
Volatilité de groupe de placement <sup>3</sup>	(en %)	0.03%	N.a.	N.a.
Volatilité de Valeur de référence <sup>3</sup>	(en %)	1.62%	N.a.	N.a.

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

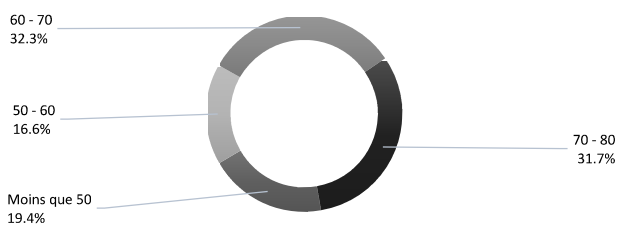
#### Évolution des valeurs depuis le lancement



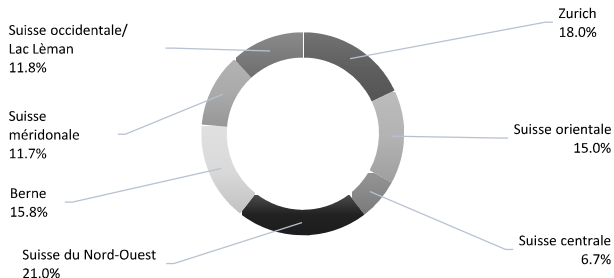
#### Diversification par durée restante au 30.09.2020



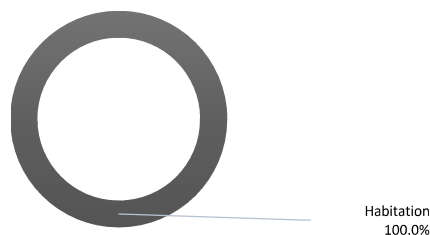
#### Diversification par investiture au 30.09.2020 (en %)



#### Diversification des biens immobilières par régions au 30.09.2020



#### Diversification par mode d'utilisation au 30.09.2020



#### 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%