

Actions Suisse Smart Beta Dynamique 100.

Des indices innovant, un placement intelligent.




30.09.2019

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 30.09.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	KGAST Ranking de
Derniers mois	2.68	1.43	1.25	
Derniers 3 mois	1.38	2.14	-0.76	
Année en cours	23.55	24.45	-0.90	
Derniers 12 mois	7.89	13.19	-5.30	
Derniers 3 ans ¹	12.79	11.26	1.53	
Derniers 5 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
Derniers 10 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
Depuis le lancement ¹	10.60	6.64	3.96	

¹ annualisé

Chiffres-clés

		30.09.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	102.04	49.39
Nombre de quotes-parts		67 407	40 314
Valeur en capital ²	(en CHF)	1 479.30	1 151.91
Revenu couru ²	(en CHF)	34.47	73.30
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 513.77	1 225.21
TER (TVA incl.)	(en %)	0.58	

² par quote-part

Indicateurs de risque au 30.09.2019 (en %)

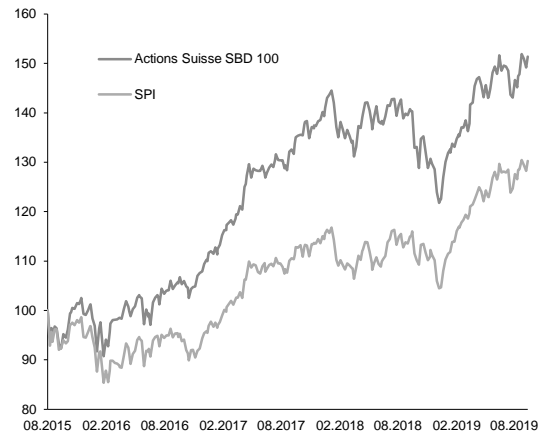
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité ³	(en %)	14.96	10.56	N.a.
Marge d'erreur	(en %)	3.33	4.57	N.a.
Beta		0.84	0.93	N.a.
Sharpe Ratio		0.23	0.78	N.a.
Information Ratio		-1.59	0.34	N.a.
Jensen-Alpha		-0.04	0.02	N.a.
Max. Drawdown		-12.67	-14.17	N.a.
Recovery Period	(en jours)	120	120	N.a.

³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

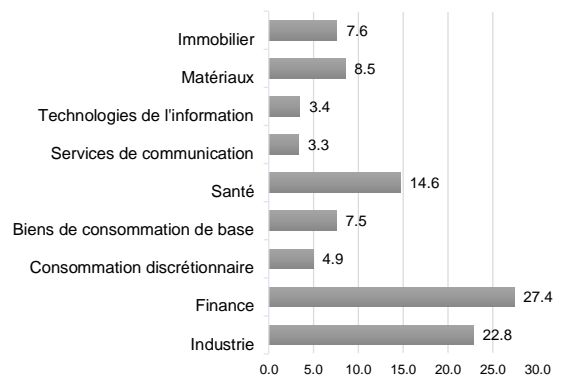
Les 10 principales positions au 30.09.2019 (en %)

PSP Swiss Property AG N	4.83
Swiss Life Holding AG N	3.97
Sonova Holding AG N	3.49
UBS Group AG N	3.38
Novartis AG N	3.33
Roche Holding AG G	3.20
Partners Group Holding AG N	3.18
Geberit AG N	3.15
Helvetia Holding AG N	3.07
Nestle AG N	2.99

Évolution des valeurs depuis le lancement



Structure par secteur au 30.09.2019 (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	0.00%
Reprise	0.00%

LPP-Mix.

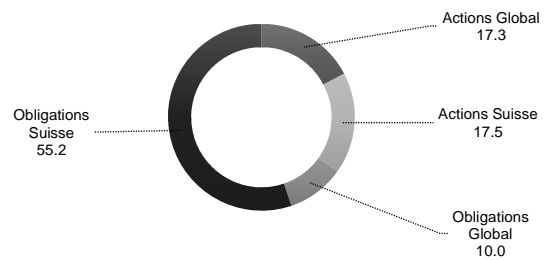
Bien diversifié.

30.11.2019

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 30.11.2019 (en %)



Performance au 30.11.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	KGAST Ranking
1 mois	1.64	0.00	1.64	
3 mois	0.94	-0.51	1.45	
Année en cours	11.18	10.87	0.30	
Derniers 12 mois	9.10	9.22	-0.11	
Derniers 3 ans ¹	4.53	5.00	-0.47	
Derniers 5 ans ¹	3.16	3.74	-0.58	
Derniers 10 ans ¹	3.93	4.49	-0.56	
Derniers 15 ans ¹	3.73	4.20	-0.47	
Depuis le lancement ¹	4.60	4.93	-0.33	

¹annualisé

Chiffres-clés

		30.11.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	18.11	14.85
Nombre de quotes-parts		16 211	14 779
Valeur en capital ²	(en CHF)	1 109.60	953.71
Revenu couru ²	(en CHF)	7.56	51.15
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 117.16	1 004.86
TER 2018 (TVA incl.)	(en %)	0.53	

² par quote-part

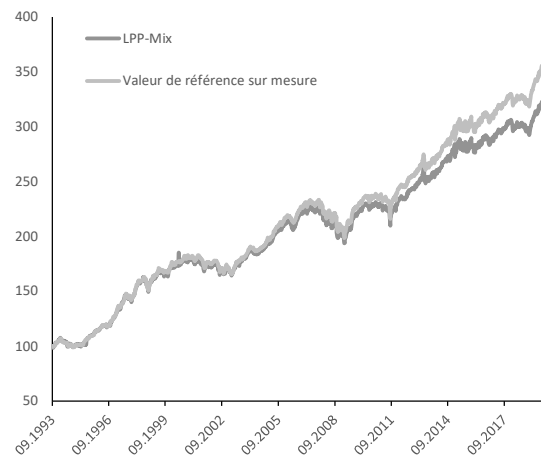
Indicateurs de risque au 30.11.2019 (en %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité ³	(en %)	4.49	3.52	4.08
Marge d'erreur	(en %)	2.04	1.17	0.93
Beta		0.85	0.94	0.98
Sharpe Ratio		2.66	2.09	1.47
Information Ratio		-0.05	-0.40	-0.63
Jensen-Alpha		0.02	0.00	0.00
Max. Drawdown		-1.86	-3.80	-12.50
Recovery Period	(en jours)	31	59	1309.00
Modified Duration ⁴	(en %)	7.53		

³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

⁴ Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 30.06.2019

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.

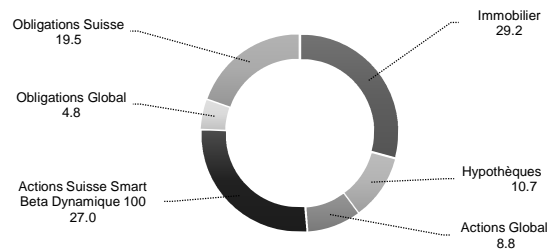
Orienté rendement.

30.11.2019

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 30.11.2019 (en %)



Performance au 30.11.2019 (in %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	KGAST Ranking
1 mois	1.57	1.48	0.08	
3 mois	2.95	1.66	1.29	
Année en cours	13.28	12.57	0.71	
Derniers 12 mois	10.98	10.35	0.63	
Derniers 3 ans ¹	5.44	6.77	-1.33	
Derniers 5 ans ¹	4.48	4.78	-0.31	
Derniers 10 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
Derniers 15 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
Depuis le lancement ¹	4.59	5.35	-0.77	

¹annualisé

Chiffres-clés

		30.11.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	218.59	68.07
Nombre de quotes-parts		172 774	60 953
Valeur en capital ²	(en CHF)	1 260.59	1 103.25
Revenu couru ²	(en CHF)	4.58	13.57
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 265.17	1 116.82
TER 2018 (TVA incl.)	(en %)	0.86	

²par quote-part

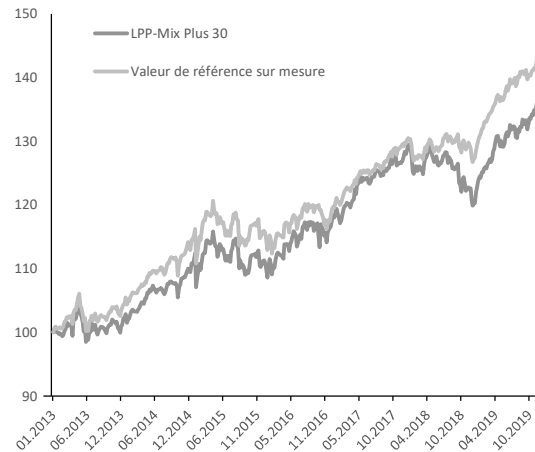
Indicateurs de risque au 30.11.2019 (in %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité ³	(en %)	5.29	4.59	4.71
Marge d'erreur	(en %)	1.92	1.97	1.85
Beta		1.02	1.17	0.98
Sharpe Ratio		2.15	1.28	1.04
Information Ratio		0.33	-0.67	-0.17
Jensen-Alpha		0.00	-0.03	0.00
Max. Drawdown		-2.04	-6.26	-6.26
Recovery Period	(en jours)	31	120	120
Modified Duration ⁴	(en %)	7.50		

³mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

⁴Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 30.06.2019

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.

30.09.2019

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. ¼ habitations - max. ¼ usage commercial

Performance au 30.09.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. Au valeur de	Risque ¹	Ranking KGAST
3 mois	0.73	1.47	-0.75		
Année en cours	1.99	3.61	-1.62		
Derniers 12 mois	3.53	4.61	-1.08	1.68	
Derniers 3 ans ²	3.69	4.86	-1.17	1.74	
Derniers 5 ans ²	3.37	4.98	-1.62	1.55	
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	3.61	5.05	-1.45	1.67	

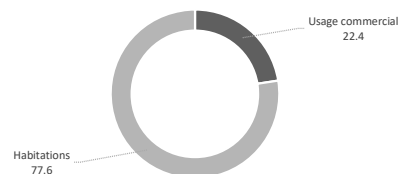
¹ mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

² annualisé

Chiffres-clés

		30.09.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	615.74	602.56
Nombre de quotes-parts		480 408	479 465
Valeur en capital ¹	(en CHF)	1 256.25	1 015.79
Revenu couru ²	(en CHF)	25.45	240.94
Valeur d'inventaire ³	(en CHF)	1 281.70	1 256.73
¹ par quote-part			
Taux de perte sur loyer	(en %)	12.44	10.61
Quote-part financement par de fonds de tiers	(en %)	0.81	-
Marge de résultat opérationnel	(en %)	70.23	67.79
TER _{ISA} 2018 (NAV) (TVA incl.)	(en %)	0.61	-
ROE	(en %)	2.03	7.15
ROIC	(en %)	1.94	3.51

Diversification par utilisation au 30.09.2019* (in%)



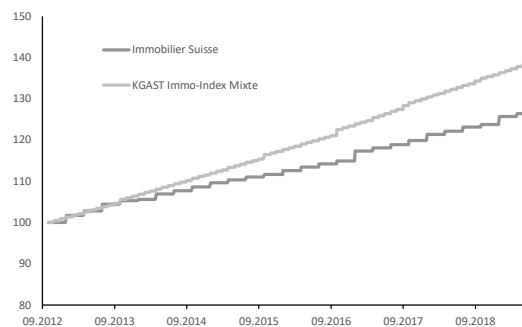
* le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

Diversification par canton au 30.09.2019* (in%)

Canton	Pourcentage (in%)
Argovie	22.5
Saint-Gall	3.8
Zurich	15.3
Jura	3.6
Vaud	10.0
Schaffhouse	1.2
Berne	9.7
Soleure	1.2
Schwyz	7.8
Neuchâtel	1.2
Genève	7.0
Zoug	1.1
Bâle-Ville	6.4
Bâle-Campagne	0.9
Thurgovie	6.1

* 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%

Immobilier Romandie.

Des rendements stables et durables, une volatilité faible.

30.09.2019

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	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 30.09.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. Au valeur de	Risque ¹	KGAST Ranking
3 mois	0.65	1.47	-0.82		
Année en cours	2.23	3.61	-1.38		
Derniers 12 mois	3.22	4.61	-1.39	1.39	
Derniers 3 ans ²	5.79	4.86	0.93	3.89	
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	5.78	5.03	0.75	3.66	

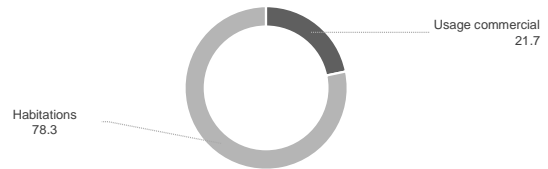
¹ mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

² annualisé

Chiffres-clés

		30.09.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	236.17	187.57
Nombre de quotes-parts		191 734	155 667
Valeur en capital ³	(en CHF)	1 188.49	1 046.01
Revenu couru ³	(en CHF)	43.25	158.91
Valeur d'inventaire ³	(en CHF)	1 231.74	1 204.92
³ par quote-part			
Taux de perte sur loyer	(en %)	3.45	5.03
Quote-part financement par de fonds de tiers	(en %)	17.74	16.07
Marge de résultat opérationnel	(en %)	68.29	60.13
TER _{NSA} 2018 (NAV) (TVA incl.)	(en %)	0.93	
ROE	(en %)	3.35	6.74
ROIC	(en %)	1.88	3.65

Diversification par utilisation au 30.09.2019* (en %)



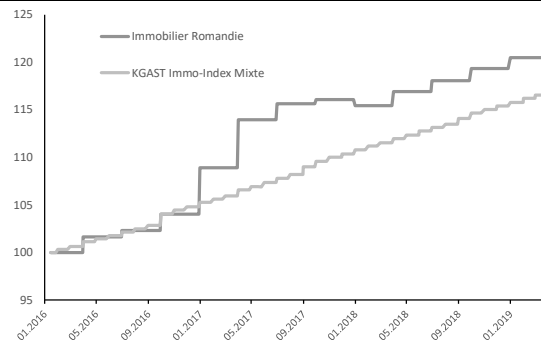
* le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

Diversification par canton au 30.09.2019* (en %)

Vaud	47.5
Genève	31.6
Neuchâtel	10.5
Valais	10.4

* 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.

30.09.2019

Caractéristiques

Année de fondation	2018
N° de valeur	40868027 (ISIN: CH0408680277)
Bloomberg	HYPSCHW 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 30.09.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence
1 mois	0.45	-1.28	1.73
3 mois	1.96	0.57	1.39
Année en cours	4.19	3.11	1.08
Derniers 12 mois	N.a.	N.a.	n.a.
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	4.11	4.03	0.08

¹annualisé

Chiffres-clés

		30.09.2019
Fortune nette	(en millions CHF)	25.59
Nombre de quotes-parts		24 584
Valeur en capital ²	(en CHF)	1036.64
Revenu couru ²	(en CHF)	4.44
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 041.08

² par quote-part

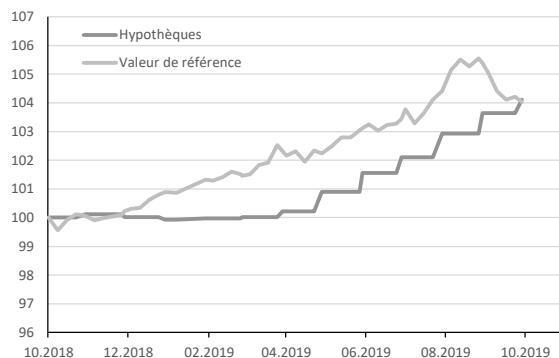
TER (TVA incl.) ex ante	(en %)	0.30
Ø-durée restante	(en ans)	8.62
Modified Duration	(en ans)	8.56
Nombre d'hypothèques		47
investissement moyenne	(en %)	62.6
Rendement brut	(in % p.a.)	0.97

Indicateurs de risque au 30.09.2019 (en %)

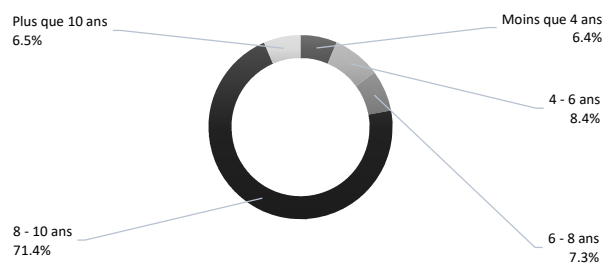
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité de groupe de placement ³	(en %)	N.a.	N.a.	N.a.
Volatilité de Valeur de référence ³	(en %)	N.a.	N.a.	N.a.

³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

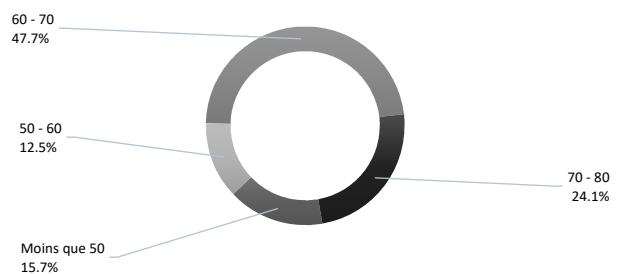
Évolution des valeurs depuis le lancement



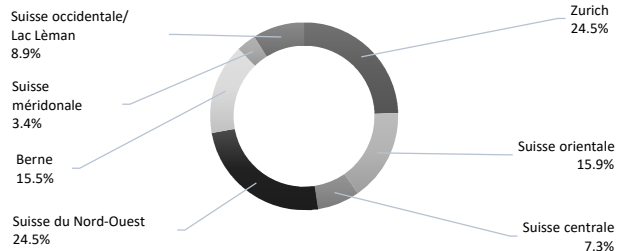
Diversification par durée restante au 30.09.2019



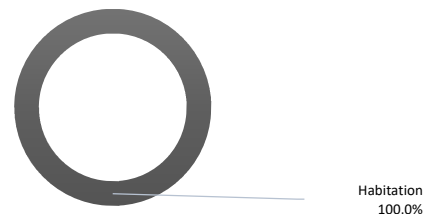
Diversification par investiture au 30.09.2019 (en %)



Diversification des biens immobilières par régions au 30.09.2019



Diversification par mode d'utilisation au 30.09.2019



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%