

Actions Suisse Smart Beta Dynamique 100.

Des indices innovant, un placement intelligent.




31.12.2019

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 31.12.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	KGAST Ranking de référence
Derniers mois	1.72	1.27	0.45	
Derniers 3 mois	7.15	4.94	2.21	
Année en cours	32.39	30.59	1.80	
Derniers 12 mois	32.39	30.59	1.80	
Derniers 3 ans ¹	13.83	12.71	1.12	
Derniers 5 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
Derniers 10 ans ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
Depuis le lancement ¹	11.71	7.42	4.29	

¹ annualisé

Chiffres-clés

		31.12.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	106.75	49.39
Nombre de quotes-parts		65 808	40 314
Valeur en capital ²	(en CHF)	1 590.48	1 151.91
Revenu couru ²	(en CHF)	31.59	73.30
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 622.07	1 225.21
TER (TVA incl.)	(en %)	0.58	

² par quote-part

Indicateurs de risque au 31.12.2019 (en %)

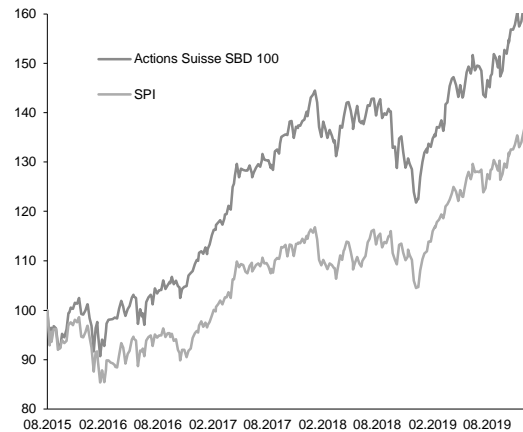
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité ³	(en %)	10.24	10.53	N.a.
Marge d'erreur	(en %)	4.63	4.21	N.a.
Beta		0.68	0.98	N.a.
Sharpe Ratio		3.29	1.43	N.a.
Information Ratio		0.39	0.27	N.a.
Jensen-Alpha		0.12	0.01	N.a.
Max. Drawdown		-2.66	-14.17	N.a.
Recovery Period	(en jours)	30	120	N.a.

³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

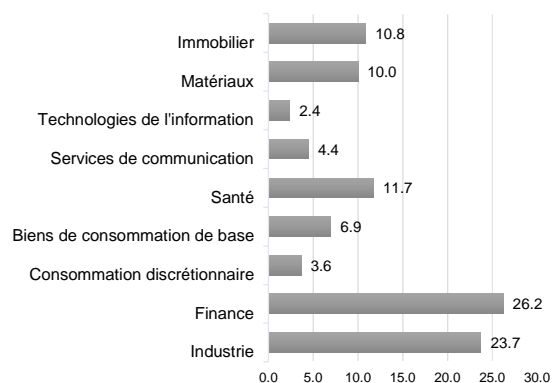
Les 10 principales positions au 31.12.2019 (en %)

PSP Swiss Property AG N	5.88
Swiss Prime Site N	4.95
Helvetia Holding AG N	4.08
Swiss Life Holding N	3.51
Zurich Insurance Group N	3.38
UBS Group AG N	3.05
BELIMO Holding N	3.02
Geberit AG N	2.98
Baloise Holding N	2.82
Roche Holding AG G	2.66

Évolution des valeurs depuis le lancement



Structure par secteur au 31.12.2019 (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.

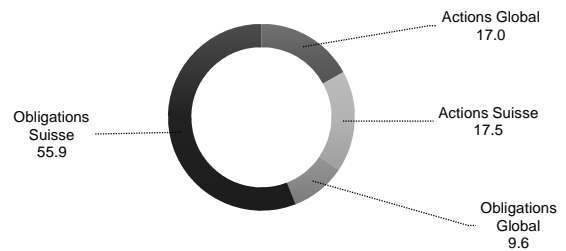
Bien diversifié.

31.12.2019

Caractéristiques

Année de fondation	1993
N° de valeur	1176860 (ISIN: CH0011768600)
Bloomberg	PATBVGW 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 31.12.2019 (en %)



Performance au 31.12.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	KGAST Ranking
1 mois	-0.64	-0.83	0.19	
3 mois	0.56	0.16	0.41	
Année en cours	10.46	11.05	-0.58	
Derniers 12 mois	10.46	11.05	-0.58	
Derniers 3 ans ¹	4.01	4.73	-0.72	
Derniers 5 ans ¹	2.91	3.63	-0.72	
Derniers 10 ans ¹	3.78	4.42	-0.64	
Derniers 15 ans ¹	3.60	4.11	-0.51	
Depuis le lancement ¹	4.56	4.92	-0.36	

¹annualisé

Chiffres-clés

		31.12.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	18.41	14.85
Nombre de quotes-parts		16 587	14 779
Valeur en capital ²	(en CHF)	1 102.82	953.71
Revenu couru ²	(en CHF)	7.19	51.15
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 110.01	1 004.86
TER 2018 (TVA incl.)	(en %)	0.35	

² par quote-part

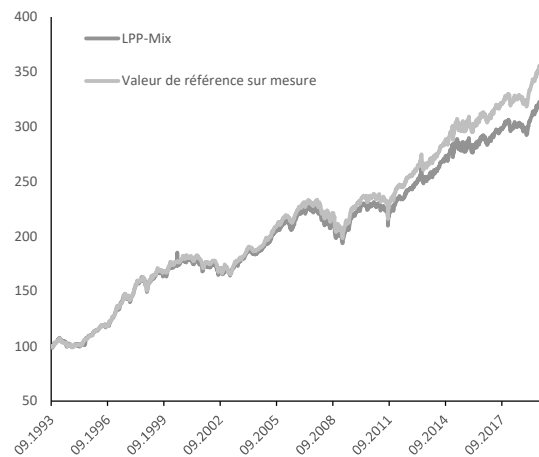
Indicateurs de risque au 31.12.2019 (en %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité ³	(en %)	3.84	3.56	4.10
Marge d'erreur	(en %)	0.97	0.63	0.52
Beta		0.82	0.95	0.98
Sharpe Ratio		3.44	1.89	1.38
Information Ratio		-0.60	-1.16	-1.38
Jensen-Alpha		0.02	0.00	-0.01
Max. Drawdown		-0.89	-3.80	-12.50
Recovery Period	(en jours)	30	59	1 309
Modified Duration ⁴	(en %)	7.40		

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.

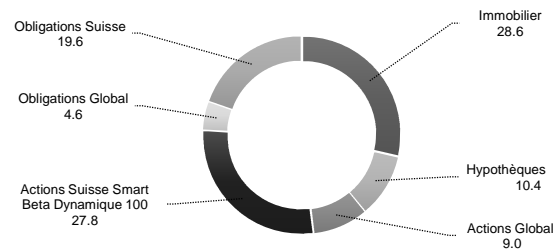
Orienté rendement.

31.12.2019

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 31.12.2019 (en %)



Performance au 31.12.2019 (in %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence	KGAST Ranking
1 mois	0.11	0.06	0.05	
3 mois	2.31	1.52	0.79	
Année en cours	13.40	12.64	0.77	
Derniers 12 mois	13.40	12.64	0.77	
Derniers 3 ans ¹	4.93	6.23	-1.30	
Derniers 5 ans ¹	4.25	4.56	-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	4.55	5.30	-0.75	

¹annualisé

Chiffres-clés

		31.12.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	224.66	68.07
Nombre de quotes-parts		177 384	60 953
Valeur en capital ²	(en CHF)	1 262.22	1 103.25
Revenu couru ²	(en CHF)	4.29	13.57
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 266.51	1 116.82
TER 2018 (TVA incl.)	(en %)	0.77	

²par quote-part

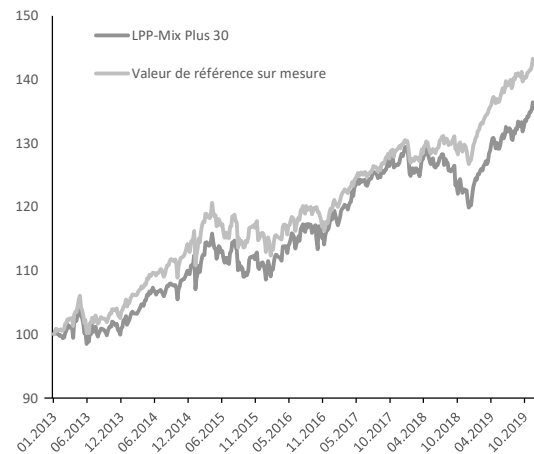
Indicateurs de risque au 31.12.2019 (in %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité ³	(en %)	4.35	4.55	4.70
Marge d'erreur	(en %)	1.92	1.97	1.85
Beta		1.06	1.17	0.98
Sharpe Ratio		3.49	1.47	1.28
Information Ratio		0.40	-0.66	-0.17
Jensen-Alpha		0.00	-0.03	0.00
Max. Drawdown		-1.31	-6.26	-6.26
Recovery Period	(en jours)	30	120	120
Modified Duration ⁴	(en %)	7.36		

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.

31.12.2019

Caractéristiques

Année de fondation	2012
N° de valeur	18823078 (ISIN: CH0188230780)
Bloomberg	IMMSCHW SW
Valeur de référence	KGAST Immo-Index Mixte
Evaluation	Trimestrielle
Politique de distribution	Accumulative
Style de placement	Actif
Région	Suisse
Répartition stratégique	- min, ½ habitations - max, ½ usage commercial

Performance au 31.12.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. Au valeur de	Risque ¹	Ranking KGAST
3 mois	1.29	0.97	0.32		
Année en cours	3.30	4.62	-1.32		
Derniers 12 mois	3.30	4.62	-1.32	1.51	
Derniers 3 ans ²	3.45	4.79	-1.34	1.54	
Derniers 5 ans ²	3.43	4.95	-1.52	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	3.67	5.02	-1.35	1.66	

¹ mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

² annualisé

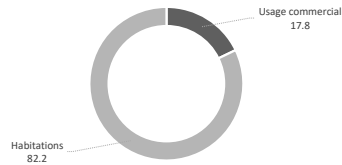
Chiffres-clés

		31.12.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	798.88	602.56
Nombre de quotes-parts		615 371	479 465
Valeur en capital ¹	(en CHF)	1 264.68	1 015.79
Revenu couru ¹	(en CHF)	33.52	240.94
Valeur d'inventaire ³	(en CHF)	1 298.20	1 256.73

¹ par quote-part

Taux de perte sur loyer	(en %)	12.12	10.61
Quote-part financement par de fonds de tiers	(en %)	1.73	-
Marge de résultat opérationnel	(en %)	69.22	67.79
TER _{NAV} 2018 (NAV) (TVA incl.)	(en %)	0.57	-
ROE	(en %)	3.34	7.15
ROIC	(en %)	3.30	3.51

Diversification par utilisation au 31.12.2019* (in%)



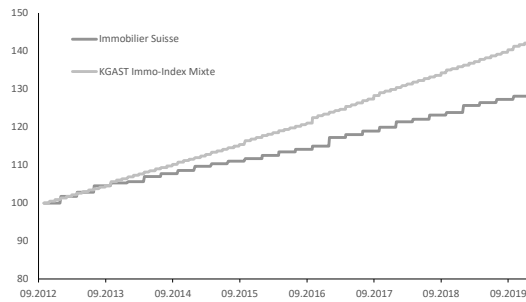
* le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

Diversification par canton au 31.12.2019* (in%)

Argovie	23.2	Thurgovie	4.7
Zürich	14.7	Lucerne	4.6
Vaud	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		

* 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.

31.12.2019

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. ¼ habitations - max. ¼ usage commercial

Performance au 31.12.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. Au valeur de	Risque ¹	KGAST Ranking
3 mois	0.69	0.97	-0.28		
Année en cours	2.93	4.62	-1.69		
Derniers 12 mois	2.93	4.62	-1.69	1.25	
Derniers 3 ans ²	4.43	4.79	-0.36	2.99	
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	5.59	4.96	0.63	3.56	

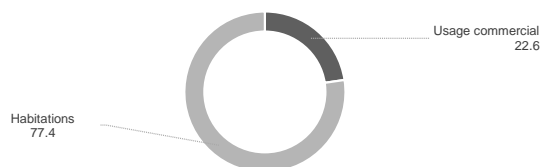
¹ mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

² annualisé

Chiffres-clés

		31.12.2019	31.12.2018
Fortune nette	(en millions CHF)	250.50	187.57
Nombre de quotes-parts		201 980	155 667
Valeur en capital ³	(en CHF)	1 190.20	1 046.01
Revenu couru ³	(en CHF)	50.03	158.91
Valeur d'inventaire ³	(en CHF)	1 240.23	1 204.92
³ par quote-part			
Taux de perte sur loyer	(en %)	3.64	5.03
Quote-part financement par de fonds de tiers	(en %)	13.03	16.07
Marge de résultat opérationnel	(en %)	64.30	60.13
TER _{SA} 2018 (NAV) (TVA incl.)	(en %)	0.88	
ROE	(en %)	4.08	6.74
ROIC	(en %)	4.85	3.65

Diversification par utilisation au 31.12.2019⁴ (en %)



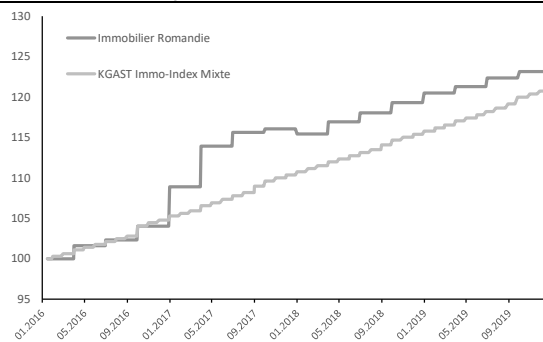
⁴ le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

Diversification par canton au 31.12.2019⁵ (en %)

Vaud	46.9
Genève	33.4
Valais	10.0
Neuchâtel	9.7

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%

Hypothèques Suisse.

Rendement à faible volatilité.

31.12.2019

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 31.12.2019 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence
1 mois	0.05	-0.75	0.80
3 mois	0.22	-1.17	1.39
Année en cours	4.41	1.90	2.51
Derniers 12 mois	4.41	1.90	2.51
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	3.47	2.26	1.21

¹annualisé

Chiffres-clés

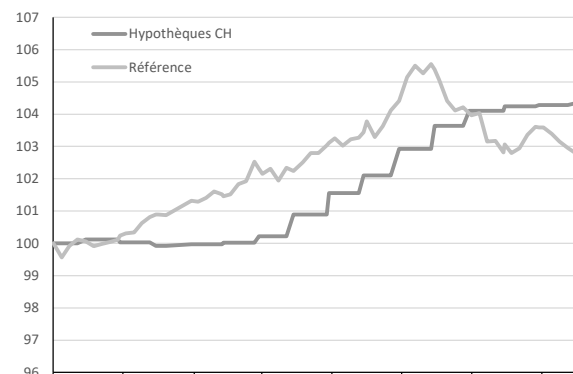
		31.12.2019
Fortune nette	(en millions CHF)	28.15
Nombre de quotes-parts		26 977
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 043.32
² par quote-part		
TER 2019 (TVA incl.)	(en %)	0.39
Ø-durée restante	(en ans)	8.49
Modified Duration	(en ans)	8.01
Nombre d'hypothèques		51
investiture moyenne	(en %)	62.7
Rendement brut	(in % p.a.)	0.96

Indicateurs de risque au 31.12.2019 (en %)

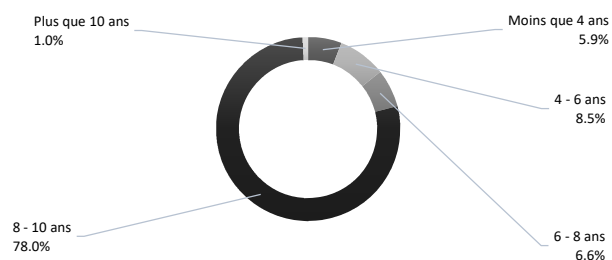
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité de groupe de placement ³	(en %)	1.05	N.a.	N.a.
Volatilité de Valeur de référence ³	(en %)	2.66	N.a.	N.a.

³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

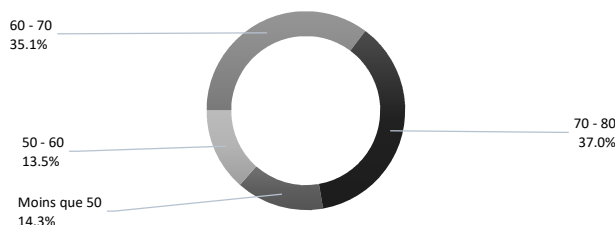
Évolution des valeurs depuis le lancement



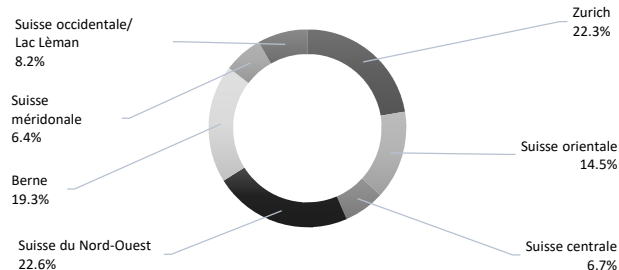
Diversification par durée restante au 31.12.2019



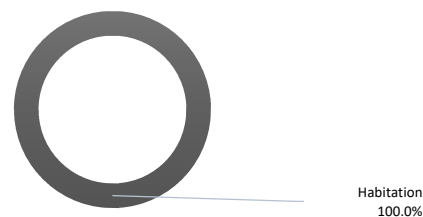
Diversification par investiture au 31.12.2019 (en %)



Diversification des biens immobilières par régions au 31.12.2019



Diversification par mode d'utilisation au 31.12.2019



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%