

## Factsheet 03/2021

31.03.2021

### 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



	15.0%	25.0%	35.0%
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 31.03.2021 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
Derniers mois	5.90	6.70	-0.80
Derniers 3 mois	5.75	5.16	0.59
Année en cours	5.75	5.16	0.59
Derniers 12 mois	34.18	23.81	10.37
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	9.70	11.21	-1.51
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	12.49	11.00	1.49
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement <sup>1</sup>	10.74	7.39	3.35

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		31.03.2021	31.12.2020
Fortune nette	(en millions CHF)	132.94	129.67
Nombre de quotes-parts		74 948	77 306
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 767.17	1 642.44
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	6.61	34.93
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 773.78	1 677.37
TER (TVA incl.)	(en %)		0.58

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

#### Indicateurs de risque au 31.03.2021 (en %)

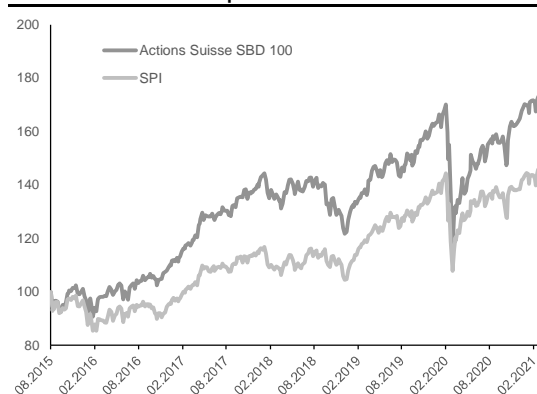
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	13.00	14.98	12.61
Marge d'erreur	(en %)	2.91	5.76	5.17
Beta		0.89	1.06	1.03
Sharpe Ratio		2.43	0.48	0.79
Information Ratio		3.57	-0.26	0.29
Jensen-Alpha		0.13	-0.02	0.01
Max. Drawdown		-4.86	-18.50	-18.50
Recovery Period	(en jours)	30	244	244

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

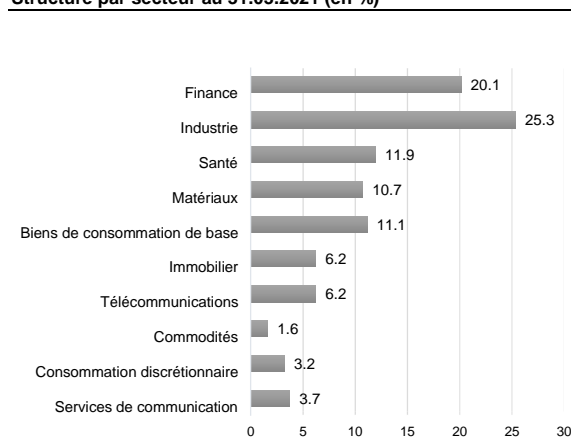
#### Les 10 principales positions au 31.03.2021 (en %)

Kuehne + Nagel N	3.96
Logitech N	3.75
Swisscom N	3.70
Nestle N	3.67
Emmi N	3.26
Swiss Prime Site N	3.15
PSP Swiss Property N	3.05
Partners Group Holding N	2.79
ABB N	2.68
Barry Callebaut N	2.63

#### Évolution des valeurs depuis le lancement



#### Structure par secteur au 31.03.2021 (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 03/2021

31.03.2021

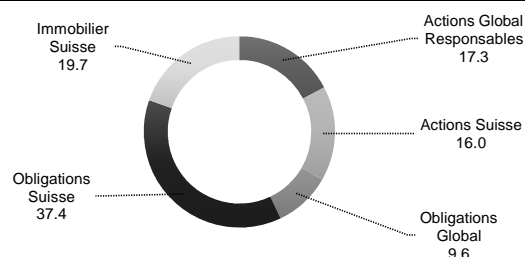
### LPP-Mix.

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	- 40% Obligations Suisse - 10% Obligations Global - 15% Actions Suisse - 15% Actions Global Responsables - 20% Immobilier Suisse

#### Structure du portefeuille au 31.03.2021 (en %)



#### Performance au 31.03.2021 (en %)

Période	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
1 mois	2.61	2.43	0.18
3 mois	2.32	2.36	-0.04
Année en cours	2.32	2.36	-0.04
Derniers 12 mois	12.95	12.93	0.03
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	4.20	5.00	-0.80
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	3.73	4.42	-0.68
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	4.09	4.79	-0.69
Derniers 15 ans <sup>1</sup>	3.10	3.64	-0.54
Depuis le lancement <sup>1</sup>	4.51	4.90	-0.38

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

	31.03.2021	31.12.2020
Fortune nette (en millions CHF)	20.52	19.69
Nombre de quotes-parts	17 695	17 376
Valeur en capital <sup>2</sup> (en CHF)	1 156.17	1 122.99
Revenu couru <sup>2</sup> (en CHF)	3.51	10.43
Valeur d'inventaire <sup>2</sup> (en CHF)	1 159.68	1 133.42
TER 2020 (TVA incl.) (en %)		0.35

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

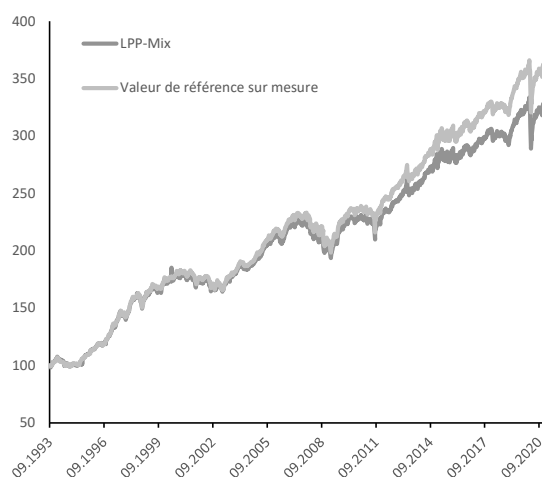
#### Indicateurs de risque au 31.03.2021 (en %)

	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup> (en %)	5.34	6.18	5.11
Marge d'erreur (en %)	0.48	0.73	0.58
Beta	0.94	0.99	1.00
Sharpe Ratio	2.98	1.16	1.31
Information Ratio	0.05	-1.09	-1.18
Jensen-Alpha	0.01	-0.01	-0.01
Max. Drawdown	-1.33	-8.46	-8.88
Recovery Period (en jours)	30	244	1 095
Modified Duration <sup>4</sup> (en %)	7.34		

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

<sup>4</sup> Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 31.03.2021

#### Évolution des valeurs depuis lancement



#### Notation de durabilité<sup>5</sup>

Obligations Suisse	1	2	3	4	5	6	7
Obligations Global	1	2	3	4	5	6	7
Actions Suisse	1	2	3	4	5	6	7
Actions Global Responsables	1	2	3	4	5	6	7

<sup>5</sup>Echelle: 1 pour faible et 7 pour élevée

#### 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 03/2021

31.03.2021

### LPP-Mix Plus 35.

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 - 20% Actions Suisse - 15% Actions Global Responsables - 26% Immobilier Suisse - 10% Hypothèques Suisse

#### Performance au 31.03.2021 (in %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
1 mois	2.54	2.65	-0.12
3 mois	3.03	2.73	0.29
Année en cours	3.03	2.73	0.29
Derniers 12 mois	14.84	12.91	1.93
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	4.44	6.16	-1.72
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	5.07	5.86	-0.79
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>	4.47	5.29	-0.82

<sup>1</sup>annualisé

#### Chiffres-clés

		31.03.2021	31.12.2020
Fortune nette	(en millions CHF)	464.62	400.94
Nombre de quotes-parts		349 130	310 398
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 331.72	1 290.77
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	- 0.94	0.93
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 330.78	1 291.70
TER 2020 (TVA incl.)	(en %)		0.64

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

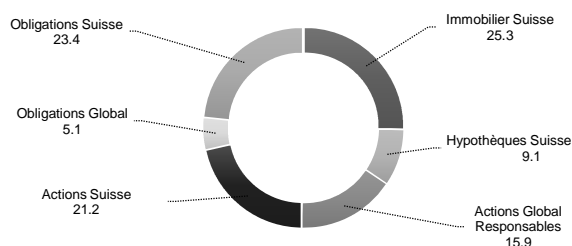
#### Indicateurs de risque au 31.03.2021 (in %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	4.74	6.51	5.50
Marge d'erreur	(en %)	1.00	2.05	1.92
Beta		0.83	1.14	1.14
Sharpe Ratio		2.94	0.54	0.75
Information Ratio		1.94	-0.84	-0.41
Jensen-Alpha		0.04	-0.02	-0.01
Max. Drawdown		-1.14	-8.77	-8.77
Recovery Period	(en jours)	30	244	244
Modified Duration <sup>4</sup>	(en %)	7.35		

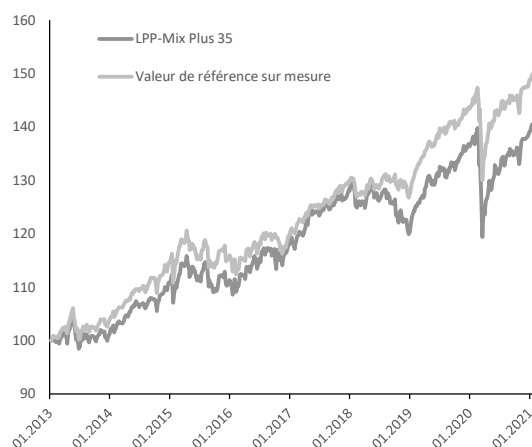
<sup>3</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

<sup>4</sup> Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 31.03.2021

#### Structure du portefeuille au 31.03.2021 (en %)



#### Évolution des valeurs depuis lancement



#### Notation de durabilité<sup>5</sup>

Obligations Suisse	1	2	3	4	5	6	7
Obligations Global	1	2	3	4	5	6	7
Actions Suisse	1	2	3	4	5	6	7
Actions Global Responsables	1	2	3	4	5	6	7

<sup>5</sup>Échelle: 1 pour faible et 7 pour élevée

#### 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 03/2021

31.03.2021

### 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. ¼ habitations - max. ¼ usage commercial

#### Performance au 31.03.2021 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. au valeur de référence	Risque <sup>1</sup>
3 mois	0.67	1.05	-0.38	
Année en cours	0.67	1.05	-0.38	
Derniers 12 mois	3.76	4.51	-0.75	1.77
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	3.54	4.65	-1.10	1.62
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	3.62	4.88	-1.26	1.68
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>	3.64	4.97	-1.33	1.67

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

<sup>2</sup> annualisé

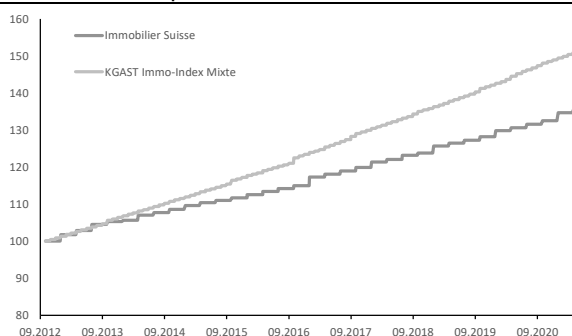
#### Chiffres-clés

		31.03.2021	31.12.2020
Fortune nette	(en millions CHF)	868.40	862.61
Nombre de quotes-parts		640 676	640 676
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 346.40	1 309.58
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	9.04	36.83
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 355.44	1 346.41

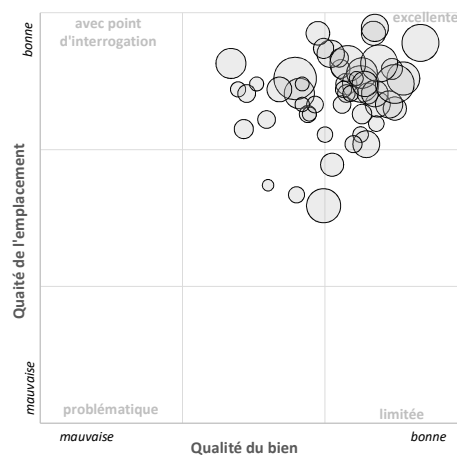
<sup>3</sup> par quote-part

Taux de perte sur loyer	(en %)	8.21	10.00
Quotes-parts financement par fonds de tiers	(en %)	0.00	0.00
Marge de résultat opérationnel	(en %)	68.80	71.18
TER <sub>SA</sub> 2020 (NAV) (TVA incl.)	(en %)	0.52	
ROE	(en %)	0.67	3.76
ROIC	(en %)	0.66	3.62

#### Évolution des valeurs depuis le lancement

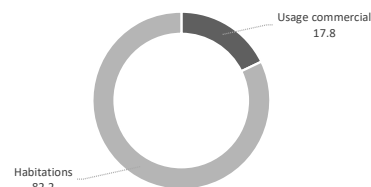


#### Profil de qualité au 31.03.2021<sup>4</sup>



<sup>4</sup> Sur la base des évaluations de l'expert immobilier KPMG SA. La taille de la bulle reflète la valeur marchande du bien en question.

#### Diversification par utilisation au 31.03.2021<sup>5</sup> (in%)



<sup>5</sup> le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

#### Diversification par canton au 31.03.2021<sup>6</sup> (in%)

Argovie	22.1	Thurgovie	4.4
Zurich	14.4	Lucerne	4.4
Bâle-Campagne	9.0	Soleure	3.0
Berne	7.8	Saint-Gall	2.8
Vaud	7.5	Jura	2.5
Bâle-Ville	6.6	Schaffhouse	2.4
Schwyz	5.8	Neuchâtel	0.9
Genève	5.6	Zoug	0.8

<sup>6</sup> le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

#### 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 03/2021

31.03.2021

### 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	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. ¼ habitations - max. ¼ usage commercial

#### Performance au 31.03.2021 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. au valeur de	Risque <sup>1</sup>
3 mois	0.79	1.05	-0.27	
Année en cours	0.79	1.05	-0.27	
Derniers 12 mois	3.62	4.51	-0.89	1.56
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	3.62	4.65	-1.03	1.53
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	5.06	4.88	0.18	3.20
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>	5.18	4.90	0.28	3.20

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

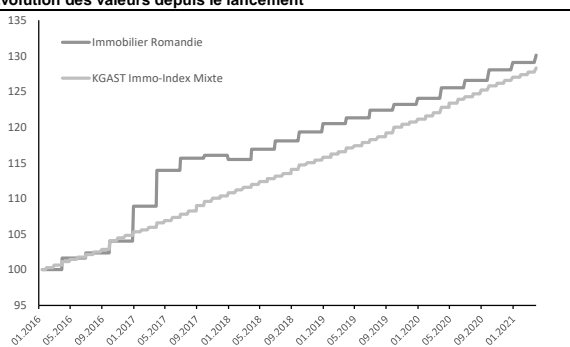
<sup>2</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

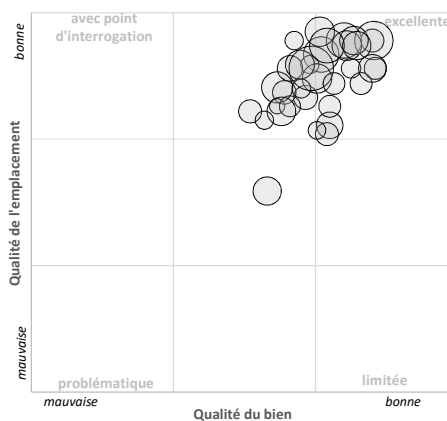
	31.03.2021	31.12.2020
Fortune nette (en millions CHF)	334.51	313.82
Nombre de quotes-parts	257 159	243 152
Valeur en capital <sup>3</sup> (en CHF)	1 288.30	1 247.47
Revenu couru <sup>2</sup> (en CHF)	12.48	43.17
Valeur d'inventaire <sup>3</sup> (en CHF)	1 300.78	1 290.64
Taux de perte sur loyer (en %)	5.48	3.42
Quotes-parts financement par fonds de tiers (en %)	17.58	18.94
Marge de résultat opérationnel (en %)	62.04	65.21
TER <sub>SA</sub> 2020 (NAV) (TVA incl.) (en %)		0.91
ROE (en %)	0.97	4.37
ROIC (en %)	0.60	3.27

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

#### Évolution des valeurs depuis le lancement

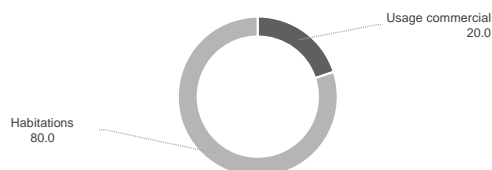


#### Profil de qualité au 31.03.2021<sup>4</sup>



<sup>4</sup> Sur la base des évaluations de l'expert immobilier KPMG SA. La taille de la bulle reflète la valeur marchande du bien en question.

#### Diversification par utilisation au 31.03.2021<sup>5</sup> (en %)



<sup>5</sup> le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

#### Diversification par canton au 31.03.2021<sup>6</sup> (en %)

Genève	44.4
Vaud	42.5
Valais	7.0
Neuchâtel	6.1

<sup>6</sup> le calcul pour les projets a été effectué avec les frais d'investissement attendus

#### 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 03/2021

31.03.2021

### 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 31.03.2021 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence
1 mois	0.04	0.50	-0.46
3 mois	0.12	-0.33	0.45
Année en cours	0.12	-0.33	0.45
Derniers 12 mois	0.57	3.29	-2.72
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	5.10	2.92	2.18

<sup>1</sup>annualisé

#### Chiffres-clés

		31.03.2021	31.12.2020
Fortune nette	(en millions CHF)	58.34	52.78
Nombre de quotes-parts		55 505	50 273
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 051.04	1049.81

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

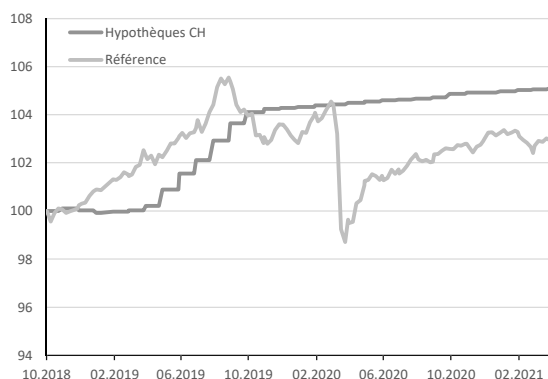
TER 2020 (TVA incl.)	(en %)	0.24
Ø-durée restante	(en ans)	8.68
Modified Duration	(en ans)	8.32
Nombre d'hypothèques		105
Investiture moyenne	(en %)	60.7
Intérêt moyen	(in % p.a.)	0.88
Rendement à échéance	(in % p.a.)	0.75

#### Indicateurs de risque au 31.03.2021 (en %)

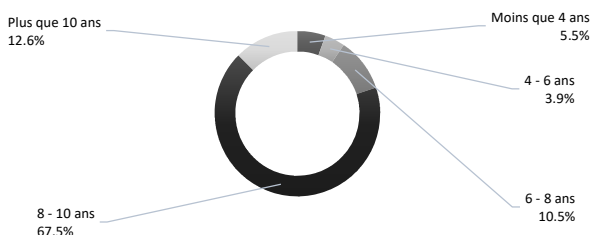
		1 an (par mois)	3 ans	5 ans
Volatilité de groupe de placement <sup>3</sup>	(en %)	0.03%	N.a.	N.a.
Volatilité de Valeur de référence <sup>3</sup>	(en %)	0.58%	N.a.	N.a.

<sup>3</sup> mesuré en écart type (fluctuations des rendements)

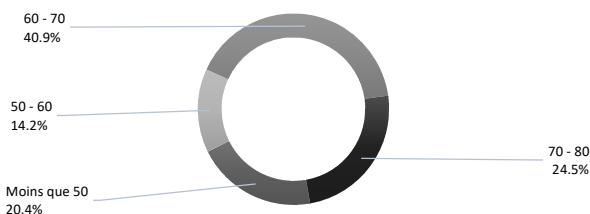
#### Évolution des valeurs depuis le lancement



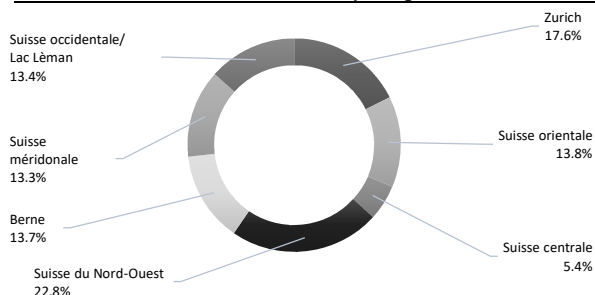
#### Diversification par durée restante au 31.03.2021



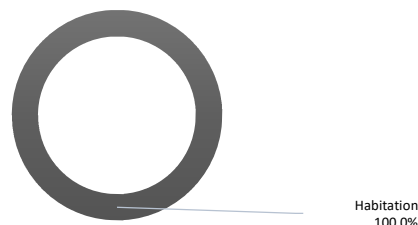
#### Diversification par investiture au 31.03.2021 (en %)



#### Diversification des biens immobilières par régions au 31.03.2021



#### Diversification par mode d'utilisation au 31.03.2021



#### 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%