

## Factsheet 03/2025

31.03.2025

### Actions Suisse Smart Beta Dynamique 100 ESG.

Investissement innovant et 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

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%

#### ESG-Overlay

Les entreprises ayant des émissions de CO2 élevées, des activités commerciales critiques en matière d'ESG ou une faible notation ESG, ainsi que les entreprises impliquées dans de graves controverses, sont exclues. Elles sont remplacées par le Vontobel Climate Target Index.

#### Performance au 31.03.2025 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
Derniers mois	-1.64	-2.04	0.40
Derniers 3 mois	4.69	8.58	-3.89
Année en cours	4.69	8.58	-3.89
Derniers 12 mois	5.60	8.79	-3.19
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	2.51	2.64	-0.13
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	8.44	8.22	0.22
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement <sup>1</sup>	7.37	6.23	1.14

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		31.03.2025	31.12.2024
Fortune nette	(en millions CHF)	143.19	117.13
Nombre de quotes-parts		72 236	61 861
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 968.62	1 850.95
Revenue couru <sup>2</sup>	(en CHF)	13.62	42.53
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 982.24	1 893.48
TER 2024 (TVA incl.)	(en %)		0.58

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

#### Indicateurs de risque au 31.03.2025

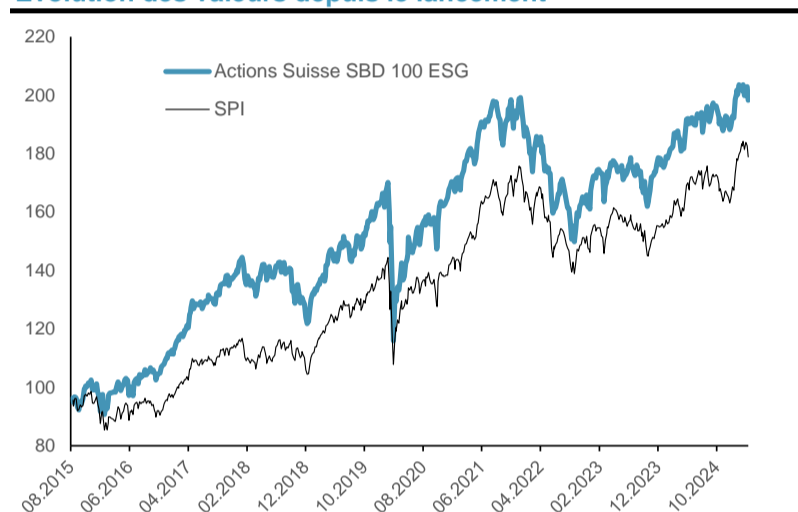
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	10.82	12.75	12.90
Marge d'erreur	(en %)	4.21	4.08	3.86
Beta		0.76	0.94	0.96
Sharpe Ratio		1.31	0.87	1.32
Information Ratio		-0.76	-0.03	0.06
Jensen-Alpha		0.01	0.00	0.01
Max. Drawdown		-4.05	-17.52	-23.54
Recovery Period	(en jours)	31	548	854

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

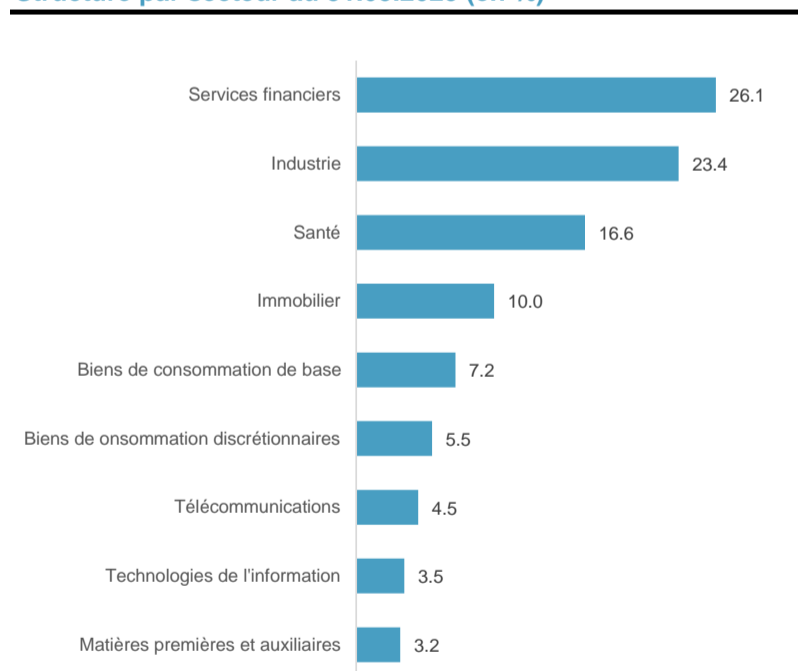
#### Les 10 principales positions au 31.03.2025 (en %)

PSP Swiss Property AG N	5.11
Swiss Prime Site AG N	4.79
Swisscom AG N	4.47
Swissquote Group Holding SA N	3.82
Novartis AG N	3.42
Swiss Re AG N	3.40
Baloise-Holding AG N	3.07
Zurich Insurance Group AG N	2.87
Helvetia Holding AG N	2.80
Sandoz Group AG N	2.66

#### Évolution des valeurs depuis le lancement



#### Structure par secteur au 31.03.2025 (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 03/2025

31.03.2025

### LPP-Mix.

Bien diversifié.

#### 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	Core-satellite
Allocation d'actifs stratégique	- 40% Obligations Suisse - 10% Obligations Global hedged CHF - 15% Actions Suisse Responsables - 15% Actions Global Responsables - 20% Immobilier Suisse

#### Performance au 31.03.2025 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
1 mois	-1.61	-1.63	0.02
3 mois	0.11	0.14	-0.03
Année en cours	0.11	0.14	-0.03
Derniers 12 mois	4.24	4.31	-0.07
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	2.39	2.52	-0.13
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	3.95	4.09	-0.14
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	2.48	2.96	-0.48
Derniers 15 ans <sup>1</sup>	3.14	3.68	-0.54
Depuis le lancement <sup>1</sup>	4.17	4.53	-0.36

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		31.03.2025	31.12.2024
Fortune nette	(en millions CHF)	23.35	23.99
Nombre de quotes-parts		18 740	19 271
Valeur en capital <sup>2</sup>	(en CHF)	1 246.75	1 234.82
Revenu couru <sup>2</sup>	(en CHF)	- 0.64	9.91
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 246.11	1 244.73
TER 2024 (TVA incl.)	(en %)		0.40

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

#### Indicateurs de risque au 31.03.2025

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>3</sup>	(en %)	3.51	5.77	5.51
Marge d'erreur	(en %)	0.75	0.54	0.50
Beta		0.86	0.97	0.99
Sharpe Ratio		0.74	0.13	0.42
Information Ratio		-0.09	-0.23	-0.29
Jensen-Alpha		0.00	0.00	0.00
Max. Drawdown		-1.61	-7.76	-11.76
Recovery Period	(en jours)	N.a.	517	670
Modified Duration <sup>4</sup>		6.79		

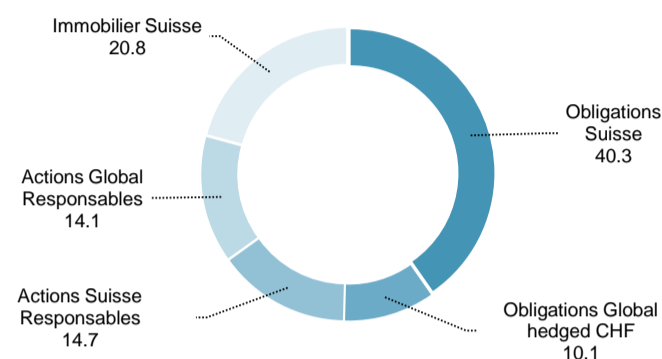
<sup>3</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

<sup>4</sup> durée calculée sur les placements à revenu fixe au 31.03.2025

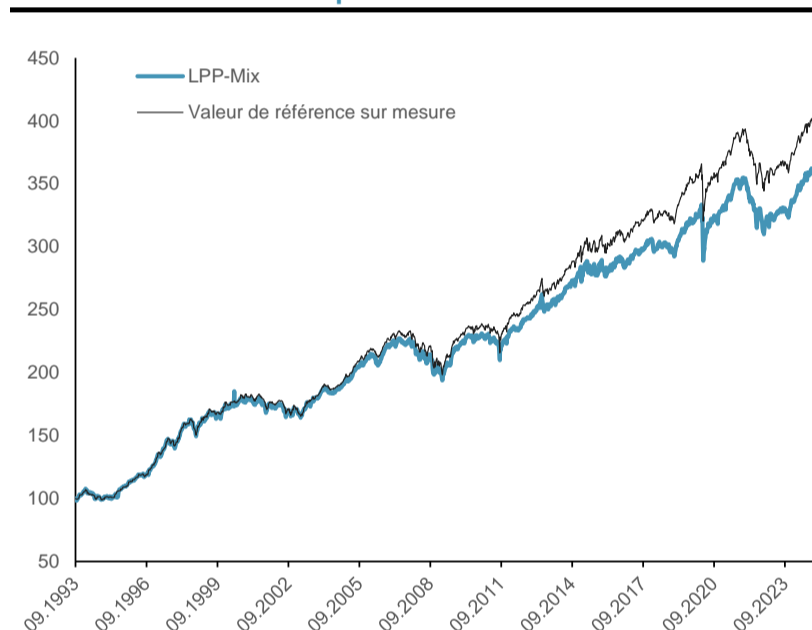
#### Souscription et reprise

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.

#### Structure du portefeuille au 31.03.2025 (en %)



#### Évolution des valeurs depuis le lancement



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

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

#### GRESB Rating



L'organisation indépendante Global Real Estate Sustainability Benchmark (GRESB) établit annuellement un classement dans le domaine des placements immobiliers destiné à mettre à la disposition des investisseurs des résultats de benchmarking indépendants et transparents sur la performance ESG des entreprises et des véhicules de placement immobilier.

#### Frais

Acquisition	0.00%
Reprise	0.25%

## Factsheet 03/2025

31.03.2025

### LPP-Mix Plus 35.

Orienté rendement.

#### Caractéristiques

Année de fondation <sup>1</sup>	2013
N° de valeur	127924353 (ISIN: CH1279243534)
Bloomberg	LOBMIXC SW
Valeur de référence	Sur mesure
Évaluation	Hebdomadaire
Politique de distribution	Accumulative
Style de placement	Core-Satellite
Allocaion d'actifs stratégique	- 17% Obligationen Schweiz - 7% Obligationen Global hedged CHF - 20% Actions Suisse Responsables dont 7% Smart Beta Dynamique 100 ESG 13% Responsables - 15% Actions Global Responsables - 26% Immobilier Suisse - 10% Hypothèques Suisse - 5% Placements alternatifs

<sup>1</sup> de 2013 à fin juin 2023 comme LPP-Mix Plus 30 ou LPP-Mix Plus 35 (N° de valeur 3539998)

#### Performance au 31.03.2025 (in %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
1 mois	-1.70	-1.61	-0.09
3 mois	0.45	0.77	-0.32
Année en cours	0.45	0.77	-0.32
Derniers 12 mois	4.87	4.61	0.26
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	2.38	2.83	-0.45
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	4.42	4.67	-0.25
Derniers 10 ans <sup>1</sup>	3.12	3.69	-0.57
Derniers 15 ans <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement <sup>1</sup>	3.64	4.44	-0.80

<sup>2</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

		31.03.2025	31.12.2024
Fortune nette	(en millions CHF)	1 543.82	1 273.15
Nombre de quotes-parts		1 073 066	888 949
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 440.06	1 426.16
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	- 1.36	6.04
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 438.70	1 432.20
TER 2024 (inkl. MWST)	(en %)		0.55

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

#### Indicateurs de risque au 31.03.2025

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité <sup>4</sup>	(en %)	3.84	5.65	5.35
Marge d'erreur	(en %)	1.04	0.78	0.92
Beta		0.88	0.96	0.96
Sharpe Ratio		0.84	0.13	0.52
Information Ratio		0.25	-0.58	-0.27
Jensen-Alpha		0.01	0.00	0.00
Max. Drawdown		-1.70	-7.87	-11.29
Recovery Period	(en jours)	N.a.	517	639
Modified Duration <sup>5</sup>		6.69		

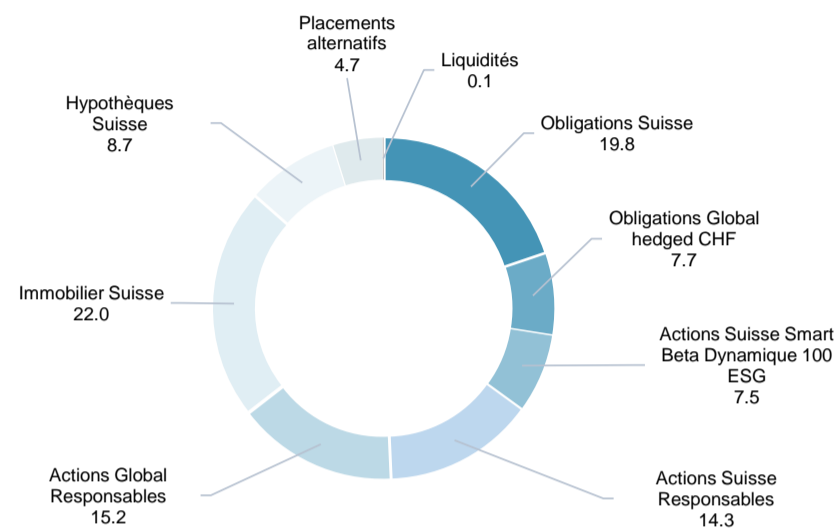
<sup>4</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

<sup>5</sup> duration calculée sur les placements à revenu fixe au 31.03.2025

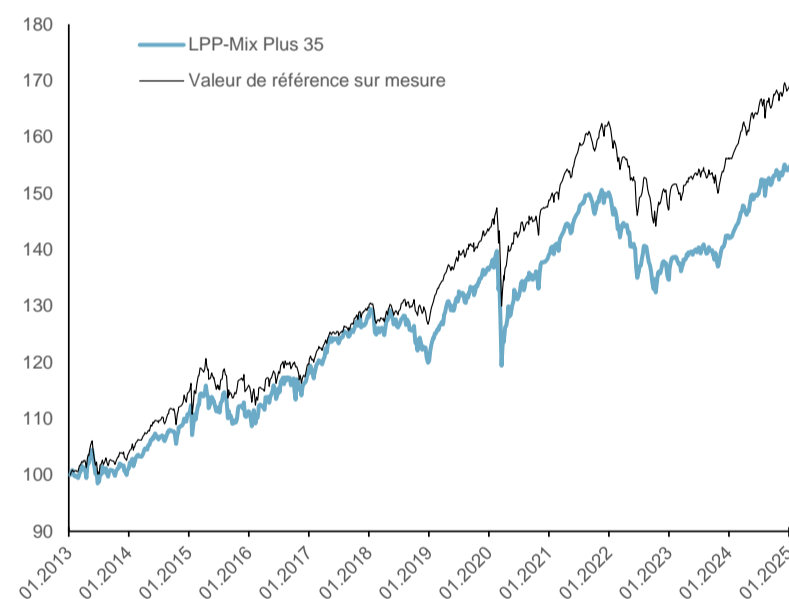
#### Souscription et reprise

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.

#### Structure du portefeuille au 31.03.2025 (en %)



#### Évolution des valeurs depuis le lancement



#### Notation de durabilité<sup>6</sup>

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

<sup>6</sup> échelle: 1 pour faible et 7 pour élevée

#### GRESB Rating



L'organisation indépendante Global Real Estate Sustainability Benchmark (GRESB) établit annuellement un classement dans le domaine des placements immobiliers destiné à mettre à la disposition des investisseurs des résultats de benchmarking indépendants et transparents sur la performance ESG des entreprises et des véhicules de placement immobilier.

#### Frais

Acquisition	0.00%
Reprise	0.50%

## Factsheet 03/2025

31.03.2025

### Hypothèques Suisse.

Rendement à faible volatilité.

#### Caractéristiques

	2018
N° de valeur	40868027 (ISIN: CH0408680277)
Bloomberg	HYPCHW 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 31.03.2025 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence
1 mois	-0.41	-0.22	-0.19
3 mois	-0.86	-0.71	-0.15
Année en cours	-0.86	-0.71	-0.15
Derniers 12 mois	7.57	4.12	3.45
Derniers 3 ans <sup>1</sup>	-0.11	1.66	-1.77
Derniers 5 ans <sup>1</sup>	-0.08	0.42	-0.50
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>	0.62	0.27	0.35

<sup>1</sup> annualisé

#### Chiffres-clés

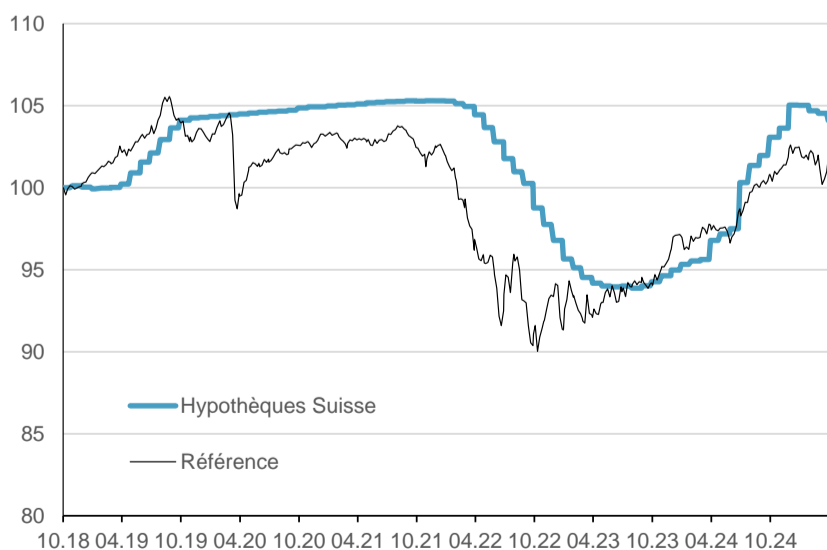
		31.03.2025	31.12.2024
Fortune nette	(en millions CHF)	168.28	165.52
Nombre de quotes-parts		161 647	157 628
Valeur d'inventaire <sup>2</sup>	(en CHF)	1 041.04	1050.10
		<sup>2</sup> par quote-part	
TER 2024 (TVA incl.)	(en %)		0.33
Ø-durée restante	(en ans)	5.75	5.97
Modified Duration		5.50	5.71
Nombre d'hypothèques		300	296
Investiture moyenne	(en %)	60.4	60.5
Intérêt moyen	(in % p.a.)	1.32	1.32
Rendement à échéance	(in % p.a.)	1.11	0.94

#### Indicateurs de risque au 31.03.2025 (en %)

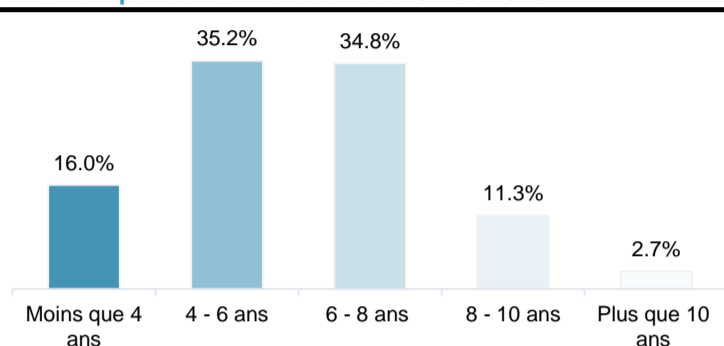
		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité de groupe de placement <sup>3</sup>	(en %)	3.16	2.96	2.29
Volatilité de Valeur de référence <sup>3</sup>	(en %)	2.93	4.32	3.87

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

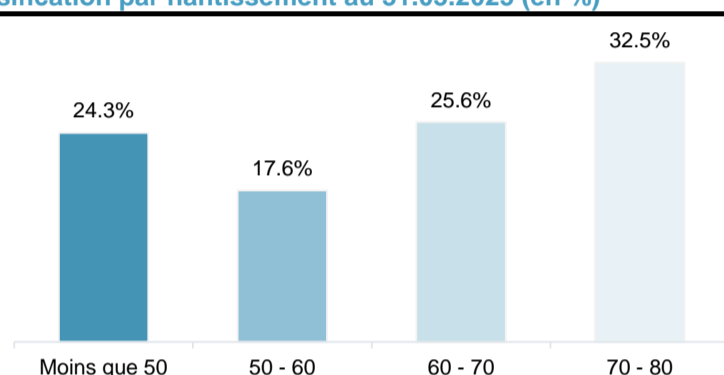
#### Évolution des valeurs depuis le lancement



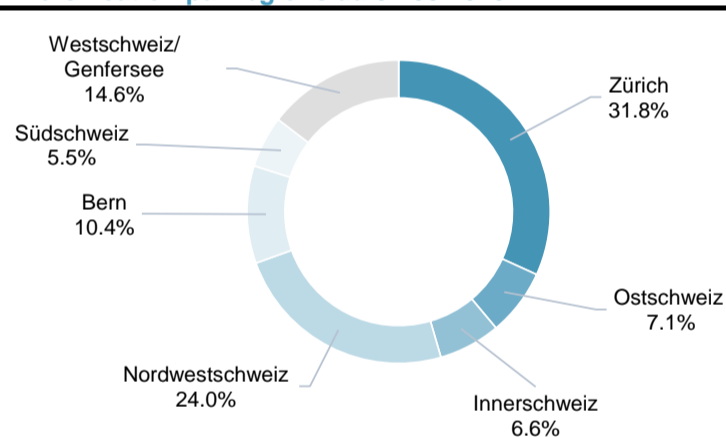
#### Diversification par durée résiduelle au 31.03.2025



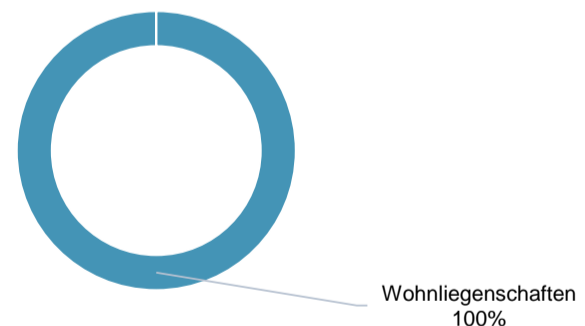
#### Diversification par nantissement au 31.03.2025 (en %)



#### Diversification par régions au 31.03.2025



#### Diversification par type d'utilisation au 31.03.2025



#### 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. Les reprises ont lieu le 30.06. et le 31.12., avec un préavis de six mois. Lors d'une cession (cf. Art. 20 du règlement), le décompte s'effectuera à la valeur nette d'inventaire de la fin du trimestre suivant.

#### Frais

Acquisition	0.25%
Reprise	0.50%

## Factsheet 03/2025

31.03.2025

### 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. ¾ habitations - max. ¼ usage commercial

#### Performance per 31.03.2025 (in %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. au valeur de référence	Risque <sup>1</sup>
3 mois	0.75	1.09	-0.34	
Année en cours	0.75	1.09	-0.34	
Derniers 12 mois	3.91	4.03	-0.12	2.48
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	3.78	3.40	0.38	2.13
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	3.72	4.01	-0.28	1.93
Derniers 10 ans <sup>2</sup>	3.58	4.49	-0.91	1.75
Derniers 15 ans <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Depuis le lancement <sup>2</sup>	3.67	4.62	-0.96	1.77

<sup>1</sup> mesuré en écart-type (fluctuation des rendements)

<sup>2</sup> annualisé

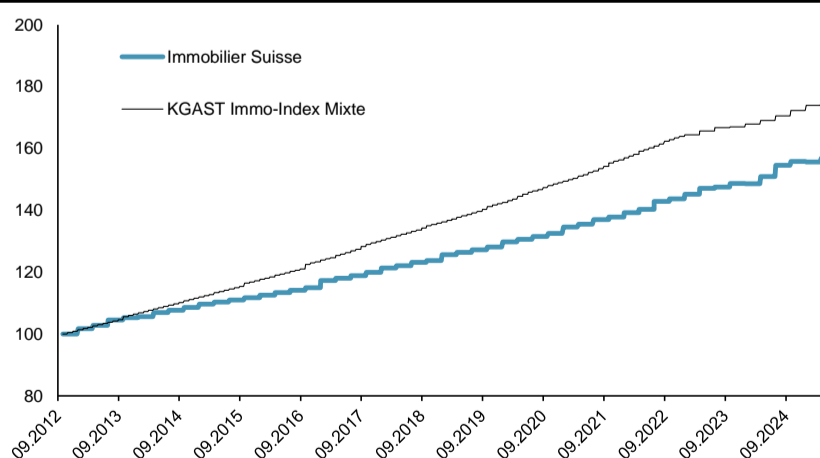
#### Chiffres-clés

		31.03.2025	31.12.2024
Fortune total	(en millions CHF)	988.07	967.14
Fortune nette	(en millions CHF)	823.02	811.17
Nombre de quotes-parts		524 777	521 121
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 556.30	1 512.18
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	12.02	44.41
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 568.32	1 556.59

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

	(en %)	31.03.2025	31.12.2024
Taux de perte sur loyer		6.42	5.68
Quotes-parts financement par fonds de tiers		12.30	16.05
Marge de résultat opérationnel		72.72	72.63
TER <sub>ISA</sub> 2024 (NAV) (TVA incl.)			0.69
ROE		0.77	2.00
ROIC		0.68	2.17

#### Évolution des valeurs depuis le lancement

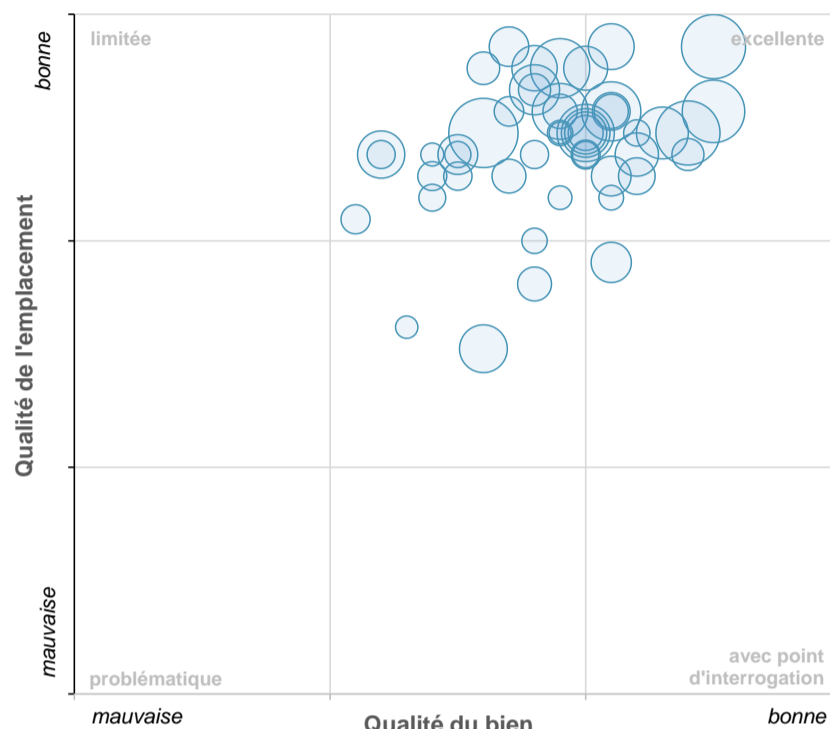


#### Souscription et reprise

Groupe de placement fermé (souscriptions possibles lors d'augmentations de capital). Les reprises peuvent être annoncées auprès de l'Helvetia Fondation de placement à tout moment. Les reprises ont lieu le 30.06. et le 31.12., avec un préavis de six mois. Lors d'une cession (cf. Art. 20 du règlement), le décompte s'effectuera à la valeur nette d'inventaire de la fin du trimestre suivant.

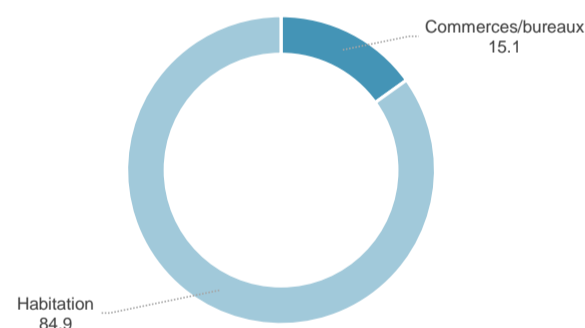
**Avertissement:** Les informations et descriptions contenues dans le présent document ne constituent ni une offre, ni une invitation à acheter ou à vendre des instruments financiers spécifiques, ni un conseil en placement. Elles sont exclusivement destinées à des fins d'information. Toute action ou omission fondée sur les informations contenues dans le présent document relève de la seule responsabilité de leur destinataires. Le respect des prescriptions légales relève également de la responsabilité individuelle de chaque destinataire. Le/la destinataire a conscience que les données peuvent changer à l'avenir. Dans ce contexte, Helvetia Fondation de placement ne fournit aucune garantie quant à l'exactitude, l'exhaustivité et la véracité du contenu du présent document. Par ailleurs, il convient de relever que toute performance d'un placement enregistré dans le passé ne préjuge pas de son rendement futur. Le présent document a été établi indépendamment d'objectifs d'investissement définis, d'une situation financière

#### Profil de qualité au 31.03.2025<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 31.03.2025 (en %)



#### Diversification par canton au 31.03.2025 (en %)

Argovie	19.5	Lucerne	4.2
Genève	15.2	Thurgovie	3.7
Zurich	14.9	Schwyz	3.6
Bâle-Campagne	9.0	Schaffhouse	2.3
Berne	6.4	Saint-Gall	1.9
Bâle-Ville	5.8	Jura	1.7
Vaud	5.7	Zoug	0.9
Soleure	4.4	Neuchâtel	0.8

#### GRESB 2024



L'organisation indépendante Global Real Estate Sustainability Benchmark (GRESB) établit annuellement un classement dans le domaine des placements immobiliers destiné à mettre à la disposition des investisseurs des résultats de benchmarking indépendants et transparents sur la performance ESG des entreprises et des véhicules de placement immobilier.

#### Frais

Acquisition	0.00%
Reprise	2.50%

## Factsheet 03/2025

31.03.2025

### 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, Wüest Partner régions de monitoring 7 (Lac Léman) et 8 (Romandie) ainsi que 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 31.03.2025 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Diff. au valeur de référence	Risque <sup>1</sup>
3 mois	0.62	1.09	-0.47	
Année en cours	0.62	1.09	-0.47	
Derniers 12 mois	3.58	4.03	-0.44	1.67
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	3.27	3.40	-0.13	1.55
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	3.65	4.01	-0.36	1.73
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>	4.51	4.46	0.06	2.68

<sup>1</sup> mesuré en écart-type (fluctuation des rendements)

<sup>2</sup> annualisé

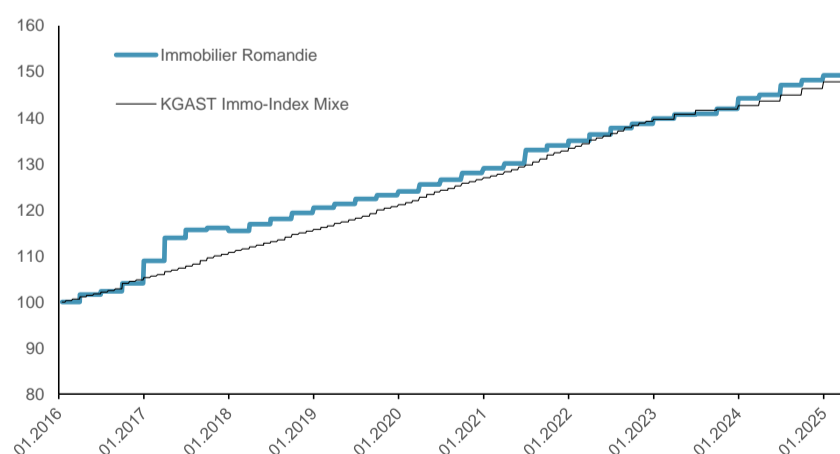
#### Chiffres-clés

		31.03.2025	31.12.2024
Fortune total	(en millions CHF)	804.39	800.75
Fortune nette	(en millions CHF)	671.34	666.13
Nombre de quotes-parts		447 047	446 335
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 492.41	1 459.16
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	9.30	33.28
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 501.71	1 492.44

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

Taux de perte sur loyer	(en %)	0.96	2.79
Quotes-parts financement par fonds de tiers	(en %)	14.69	21.50
Marge de résultat opérationnel	(en %)	65.34	68.47
TER <sub>ISA</sub> 2024 (NAV) (inkl. MWST)	(en %)		0.66
ROE	(en %)	0.62	3.18
ROIC	(en %)	0.56	2.66

#### Évolution des valeurs depuis le lancement

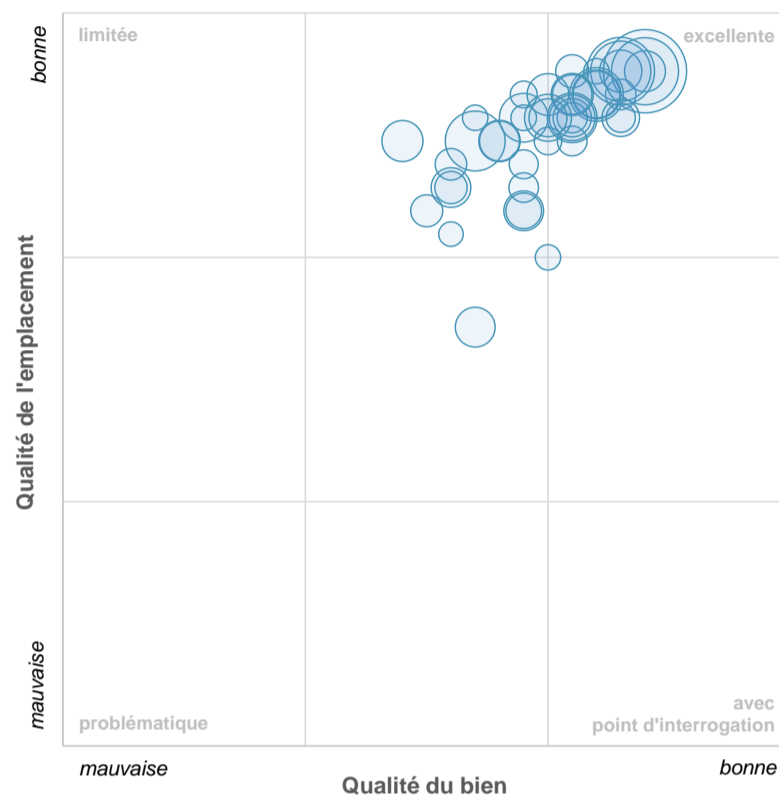


#### Souscription et reprise

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. Les reprises ont lieu le 30.06. et le 31.12., avec un préavis de six mois. Lors d'une cession (cf. Art. 20 du règlement), le décompte s'effectuera à la valeur nette d'inventaire de la fin du trimestre suivant.

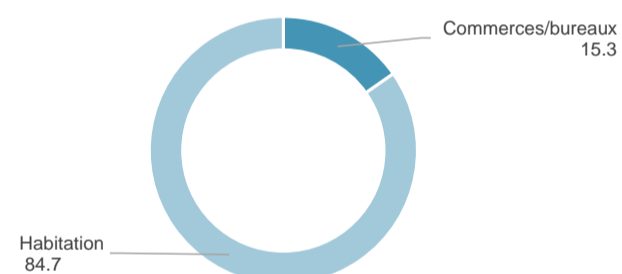
**Avertissement:** Les informations et descriptions contenues dans le présent document ne constituent ni une offre, ni une invitation à acheter ou à vendre des instruments financiers spécifiques, ni un conseil en placement. Elles sont exclusivement destinées à des fins d'information. Toute action ou omission fondée sur les informations contenues dans le présent document relève de la seule responsabilité de leur destinataire. Le respect des prescriptions légales relève également de la responsabilité individuelle de chaque destinataire. Le/la destinataire a conscience que les données peuvent changer à l'avenir. Dans ce contexte, Helvetia Fondation de placement ne fournit aucune garantie quant à l'exactitude, l'exhaustivité et la véracité du contenu du présent document. Par ailleurs, il convient de relever que toute performance d'un placement enregistré dans le passé ne préjuge pas de son rendement futur. Le présent document a été établi indépendamment d'objectifs d'investissement définis, d'une situation financière particulière ou de besoins spécifiques d'un(e) destinataire déterminé(e). L'utilisation du contenu du présent document est autorisée à condition d'en mentionner la source.

#### Profil de qualité au 31.03.2025<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 31.03.2025 (en %)



#### Diversification par canton au 31.03.2025 (en %)

Genève	64.2
Vaud	29.6
Valais	4.2
Neuchâtel	2.0

#### GRESB 2024



L'organisation indépendante Global Real Estate Sustainability Benchmark (GRESB) établit annuellement un classement dans le domaine des placements immobiliers destiné à mettre à la disposition des investisseurs des résultats de benchmarking indépendants et transparents sur la performance ESG des entreprises et des véhicules de placement immobilier.

#### Frais

Acquisition	0.00%
Reprise	2.50%