



**Rapport  
trimestriel  
3/2014**

**Helvetia Fondation de placement.**

**Votre fondation de placement suisse.**

**helvetia** 

# Sommaire.

- 3 Actions Suisse indexées**
- 4 Actions Global indexées**
- 5 Obligations Suisse indexées**
- 6 Obligations Global indexées**
- 7 LPP-Mix**
- 8 LPP-Mix Plus 25**
- 9 LPP-Mix Plus 30**
- 10 Immobilier Suisse**

# Actions Suisse indexées.

## Le succès à la manière suisse.

### Caractéristiques

Année de fondation	1993
N° de valeur	1176850 (ISIN: CH0011768501)
Bloomberg	PATAKCH SW
Valeur de référence	Swiss Performance Index (SPI)
Évaluation	Hebdomadaire
Style de placement	Indexé

### Performance au 30.09.2014 (en % p.a.)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Risque <sup>1</sup>	KGAST Ranking
Année en cours	10.5	10.9		
Derniers 12 mois	13.5	14.2		
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	19.6	20.2	8.2	
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	9.3	9.7	9.8	
Derniers 10 ans <sup>2</sup>	7.5	7.9	13.1	<b>3<sup>e</sup> rang</b>
Depuis le lancement <sup>2</sup>	8.2	8.5		

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

<sup>2</sup> annualisé

### Chiffres-clés

		30.09.2014	31.12.2013
Fortune nette	(en millions CHF)	80.3	88.7
Nombre de quotes-parts		65 374	77 250
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 196.44	1 120.08
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	32.62	28.18
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 229.06	1 148.26
<sup>3</sup> par quote-part			
Marge d'erreur	(en %)	0.14	
TER 2013 (TVA incl.)	(en %)	0.43	

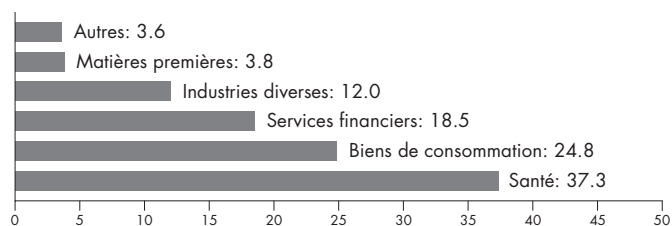
### Les 10 principales positions au 30.09.2014 (en %)

Novartis AG	18.5	Zurich Insurance Group AG	3.4
Nestlé SA	18.1	CIE Financière Richemont SA	3.3
Roche Holding AG	15.9	Credit Suisse Group AG	3.2
UBS AG	4.8	Syngenta AG	2.3
ABB LTD	4.0	Swiss Re AG	2.1

### Évolution des valeurs depuis le lancement



### Structure par secteur au 30.09.2014 (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	> CHF 100 mille	> CHF 2 millions	> CHF 10 millions
Acquisition	0.55%	0.50%	0.45%
Reprise	0.35%	0.35%	0.35%

# Actions Global indexées.

## La solution internationale.

### Caractéristiques

Année de fondation	1993
N° de valeur	1176852 (ISIN: CH0011768527)
Bloomberg	PATAKGL SW
Valeur de référence:	- 35.0% USA - 10.0% J
indices nationaux	- 25.0% EMU - 3.0% Pacifique
MSCI (sur mesure)	- 15.0% UK - 12.0% EMA
Évaluation	Hebdomadaire
Style de placement	Indexé

### Performance au 30.09.2014 (en % p.a.)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Risque <sup>1</sup>	KGAST Ranking
Année en cours	9.2	9.3		
Derniers 12 mois	15.5	15.5		
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	17.2	17.5	8.1	
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	6.4	6.8	12.1	
Derniers 10 ans <sup>2</sup>	3.3	3.5	16.4	
Depuis le lancement <sup>2</sup>	4.2	4.4		

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

<sup>2</sup> annualisé

### Chiffres-clés

		30.09.2014	31.12.2013
Fortune nette	(en millions CHF)	51.4	58.0
Nombre de quotes-parts		39 693	48 972
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 148.54	1 060.99
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	145.48	124.19
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 294.02	1 185.18

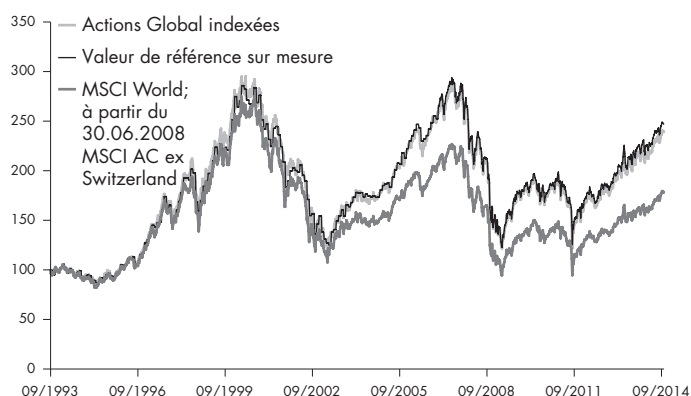
<sup>3</sup> par quote-part

Marge d'erreur	(en %)	0.89
TER 2013 (TVA incl.)	(en %)	0.56

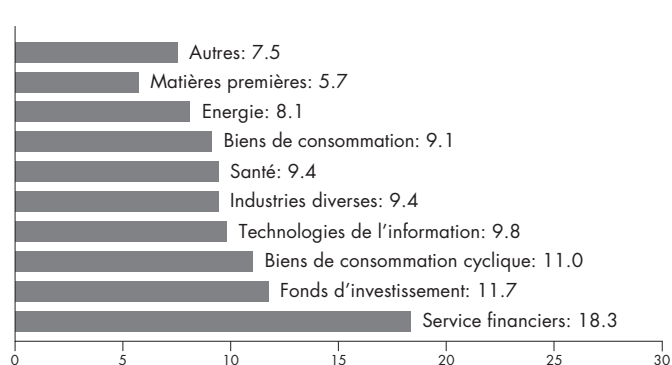
### Les 10 principales positions au 30.09.2014 (en %)

ISHARES MSCI EMA	11.7	Royal Dutch Shell PLC-A SHS	0.8
Apple Inc	1.3	Banco Santander SA	0.8
HSBC Holdings PLC	1.1	EXXON Mobil Corp	0.8
Sanofi	0.9	Bayer AG REG	0.8
Total SA	0.9	BP PLC	0.8

### Évolution des valeurs depuis le lancement



### Structure par secteur au 30.09.2014 (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	> CHF 100 mille	> CHF 2 millions	> CHF 10 millions
Acquisition	0.65%	0.60%	0.55%
Reprise	0.45%	0.45%	0.45%

# Obligations Suisse indexées.

## La réussite à coup sûr.

### Caractéristiques

Année de fondation	2001
N° de valeur	1176855 (ISIN: CH0011768550)
Bloomberg	PATOBCH SW
Valeur de référence	Swiss Bond Index (SBI) Domestic AAA-BBB
Évaluation	Hebdomadaire
Style de placement	Indexé

### Performance au 30.09.2014 (en % p.a.)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Risque <sup>1</sup>	KGAST Ranking
Année en cours	5.1	5.5		<b>5<sup>e</sup> rang</b>
Derniers 12 mois	4.5	4.9		
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	2.0	2.2	2.5	<b>5<sup>e</sup> rang</b>
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	3.1	3.4	2.7	<b>4<sup>e</sup> rang</b>
Derniers 10 ans <sup>2</sup>	3.0	3.4	2.9	<b>5<sup>e</sup> rang</b>
Depuis le lancement <sup>2</sup>	3.4	3.8		

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

<sup>2</sup> annualisé

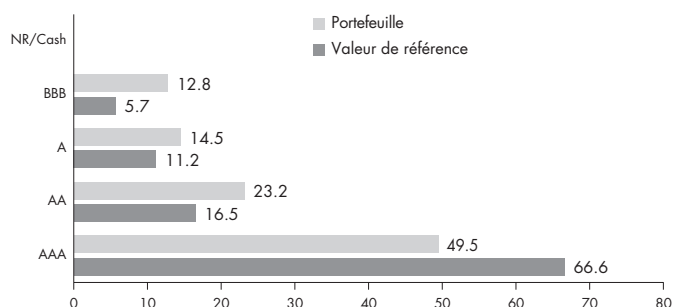
### Chiffres-clés

		30.09.2014	31.12.2013
Fortune nette	(en millions CHF)	52.8	56.5
Nombre de quotes-parts		48 903	53 711
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 061.44	1 026.77
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	18.32	25.21
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 079.76	1 051.98

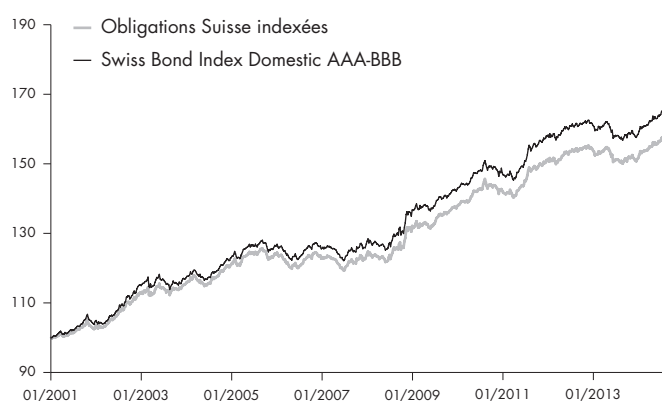
<sup>3</sup> par quote-part

Marge d'erreur	(en %)	0.13	
TER 2013 (TVA incl.)	(en %)	0.32	
Rendement direct	(en %)	2.96	3.04
Rendement à échéance	(en %)	0.72	1.16
Durée moyenne	(en ans)	8.84	7.96
Modified duration	(en ans)	7.51	6.74

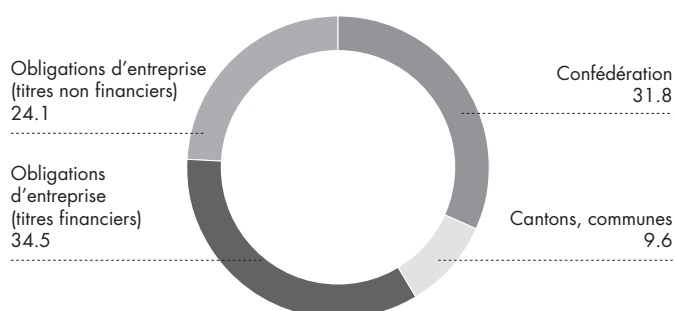
### Répart. par agence de notation 30.09.2014 (en %)



### Évolution des valeurs depuis le lancement



### Structure d'émetteurs au 30.09.2014 (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	> CHF 100 mille	> CHF 2 millions	> CHF 10 millions
Acquisition	0.25%	0.22%	0.20%
Reprise	0.20%	0.20%	0.20%

# Obligations Global indexées.

## La diversification internationale.

### Caractéristiques

Année de fondation	2001
N° de valeur	1176857 (ISIN: CH0011768576)
Bloomberg	PATOBGL SW
Valeur de référence:	- 52.4% EMU - 2.5% AUS
indices nationaux	- 25.0% USA - 2.5% CDN
JP Morgan Government	- 9.0% UK - 1.8% DK
Bond (sur mesure)	- 5.0% J - 1.8% S
Évaluation	Hebdomadaire
Style de placement	Indexé

### Performance au 30.09.2014 (en % p.a.)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Risque <sup>1</sup>	KGAST Ranking
Année en cours	9.1	9.5		<b>4<sup>e</sup> rang</b>
Derniers 12 mois	8.0	8.8		<b>3<sup>e</sup> rang</b>
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	4.4	5.1	5.2	<b>4<sup>e</sup> rang</b>
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	1.1	1.3	8.1	<b>2<sup>e</sup> rang</b>
Derniers 10 ans <sup>2</sup>	1.7	2.0	7.7	<b>2<sup>e</sup> rang</b>
Depuis le lancement <sup>2</sup>	1.5	1.8		

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

<sup>2</sup> annualisé

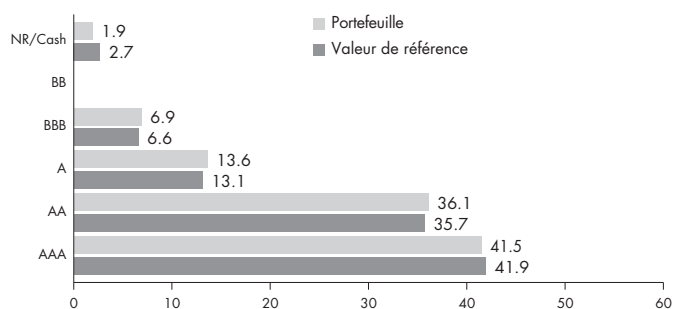
### Chiffres-clés

		30.09.2014	31.12.2013
Fortune nette	(en millions CHF)	25.2	27.7
Nombre de quotes-parts		28 104	33 689
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	696.12	643.09
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	200.92	179.11
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	897.04	822.20

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

Marge d'erreur	(en %)	0.25	
TER 2013 (TVA incl.)	(en %)	0.35	
Rendement direct	(en %)	4.75	4.68
Rendement à échéance	(en %)	1.58	1.95
Durée moyenne	(en ans)	9.46	7.92
Modified duration	(en ans)	7.52	6.29

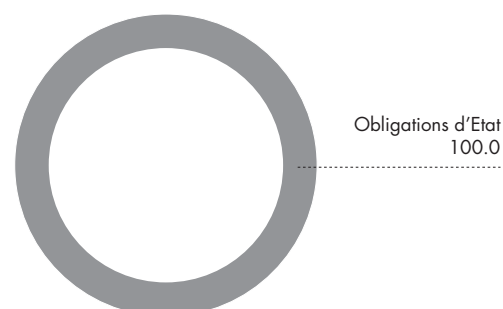
### Répart. par agence de notation 30.09.2014 (en %)



### Évolution des valeurs depuis le lancement



### Structure d'émetteurs au 30.09.2014 (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	> CHF 100 mille	> CHF 2 millions	> CHF 10 millions
Acquisition	0.25%	0.22%	0.20%
Reprise	0.20%	0.20%	0.20%

# 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
Style de placement	Indexé
Allocation d'actifs stratégique	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 60% Obligations Suisse indexées</li> <li>- 10% Obligations Global indexées</li> <li>- 15% Actions Suisse indexées</li> <li>- 15% Actions Global indexées</li> </ul>

### Performance au 30.09.2014 (en % p.a.)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Risque <sup>1</sup>	KGAST Ranking
Année en cours	6.8	7.3		<b>2<sup>e</sup> rang</b>
Derniers 12 mois	7.8	8.4		<b>3<sup>e</sup> rang</b>
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	7.0	7.4	2.9	
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	4.5	5.0	3.1	
Derniers 10 ans <sup>2</sup>	3.9	4.3	4.5	<b>2<sup>e</sup> rang</b>
Depuis le lancement <sup>2</sup>	4.9	5.2		

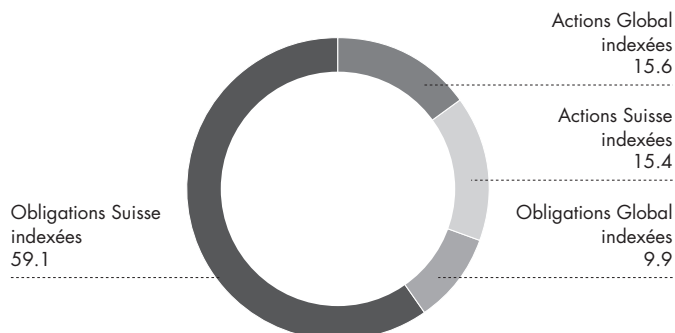
<sup>1</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

<sup>2</sup> annualisé

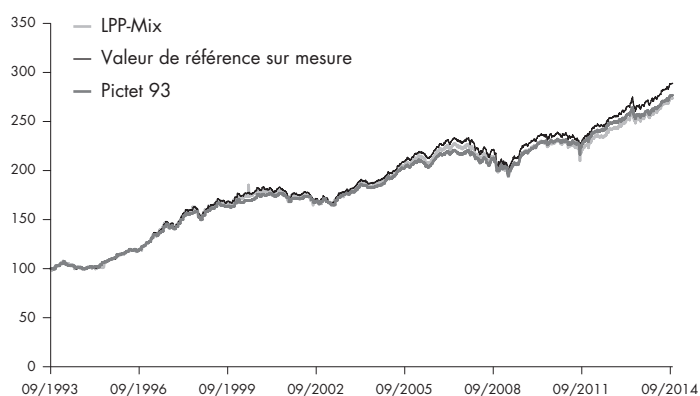
### Chiffres-clés

		30.09.2014	31.12.2013
Fortune nette	(en millions CHF)	24.3	21.4
Nombre de quotes-parts		22 742	20 741
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 047.56	1 005.66
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	18.86	25.43
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 066.42	1 031.09
<sup>3</sup> par quote-part			
Marge d'erreur	(en %)	0.55	
TER 2013 (TVA incl.)	(en %)	0.53	

### Structure du portefeuille au 30.09.2014 (en %)



### Évolution des valeurs depuis le 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	> CHF 100 mille	> CHF 2 millions	> CHF 10 millions
Acquisition	0.35%	0.32%	0.30%
Reprise	0.25%	0.25%	0.25%

# LPP-Mix Plus 25.

## Orienté rendement.

### Caractéristiques

Année de fondation	2008
N° de valeur	3539996 (ISIN: CH0035399960)
Bloomberg	BVGMP25 SW
Valeur de référence	Sur mesure
Évaluation	Hebdomadaire
Style de placement	Core-satellite
Allocation d'actifs stratégique	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 25% Obligations Suisse indexées</li> <li>- 20% Obligations Global indexées</li> <li>- 20% Actions Suisse indexées</li> <li>- 5% Actions Global indexées</li> <li>- 10% hedge funds</li> <li>- 20% immobilier</li> </ul>

### Performance au 30.09.2014 (en % p.a.)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Risque <sup>1</sup>	KGAST Ranking
Année en cours	7.2	7.7		<b>1<sup>er</sup> rang</b>
Derniers 12 mois	7.6	9.0		<b>4<sup>e</sup> rang</b>
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	7.1	7.7	3.3	
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	4.6	5.3	3.4	
Derniers 10 ans <sup>2</sup>	N.a.	N.a.		
Depuis le lancement <sup>2</sup>	3.3	3.8		

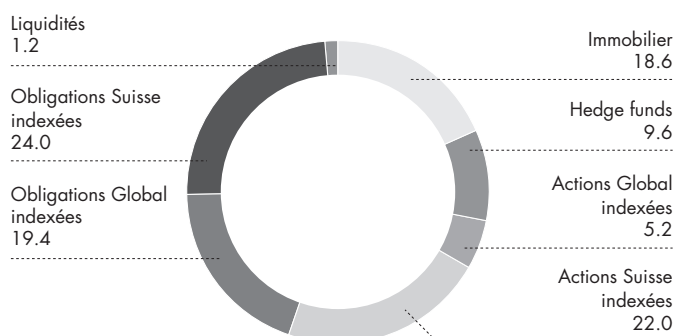
<sup>1</sup> mesuré en fluctuation standard (fluctuation des rendements)

<sup>2</sup> annualisé

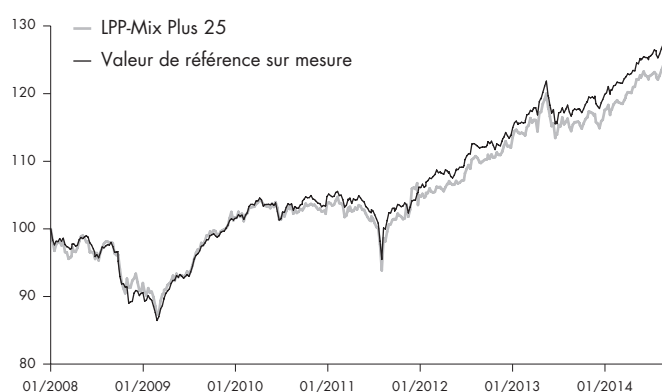
### Chiffres-clés

		30.09.2014	31.12.2013
Fortune nette	(en millions CHF)	1.0	0.9
Nombre de quotes-parts		829	829
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 051.29	992.29
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	96.35	78.52
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 147.64	1 070.81
<sup>3</sup> par quote-part			
Marge d'erreur	(en %)	0.90	
TER 2013 (TVA incl.)	(en %)	0.86	

### Structure du portefeuille au 30.09.2014 (en %)



### Évolution des valeurs depuis le 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	> CHF 100 mille	> CHF 2 millions	> CHF 10 millions
Acquisition	0.46%	0.43%	0.41%
Reprise	0.26%	0.26%	0.26%

# LPP-Mix Plus 30.

## Caractéristiques

Année de fondation	2013
N° de valeur	3539998 (ISIN: CH0035399986)
Bloomberg	BVGMP30 SW
Valeur de référence	Sur mesure
Évaluation	Hebdomadaire
Style de placement	Core-satellite
Allocation d'actifs stratégique	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 29% Obligations Suisse indexées</li> <li>- 5% Obligations Global indexées</li> <li>- 21% Actions Suisse indexées</li> <li>- 9% Actions Global indexées</li> <li>- 8% hedge funds</li> <li>- 24% immobilier</li> <li>- 4% matières premières</li> </ul>

## Performance au 30.09.2014 (en % p.a.)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Risque <sup>1</sup>	KGAST Ranking
Année en cours	6.4	7.4		
Derniers 12 mois	7.1	8.8		
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	N.a.	N.a.		
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	N.a.	N.a.		
Derniers 10 ans <sup>2</sup>	N.a.	N.a.		
Depuis le lancement <sup>2</sup>	4.4	6.5		

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

<sup>2</sup> annualisé

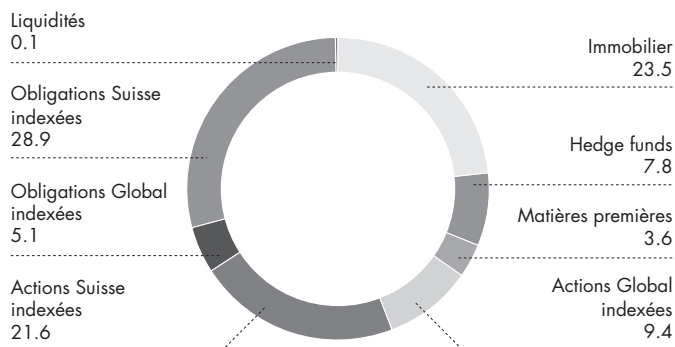
## Chiffres-clés

		30.09.2014	31.12.2013
Fortune nette	(en millions CHF)	6.7	3.5
Nombre de quotes-parts		6 301	3 431
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	1 035.76	990.46
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	26.51	21.15
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 062.27	1 011.61

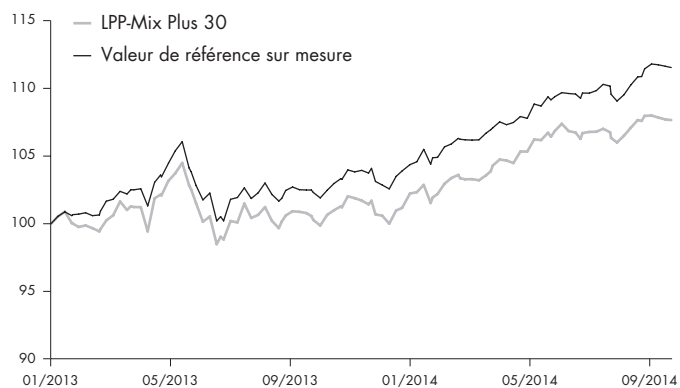
<sup>3</sup> par quote-part

Marge d'erreur	(en %)	0.88
TER 2013 (TVA incl.)	(en %)	0.93

## Structure du portefeuille au 30.09.2014 (en %)



## Évolution des valeurs depuis le 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	> CHF 100 mille	> CHF 2 millions	> CHF 10 millions
Acquisition	0.61%	0.40%	0.30%
Reprise	0.50%	0.50%	0.50%

# 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
Évaluation	Trimestrielle
Style de placement	Actif
Région	Suisse
Répartition stratégique	- 2/3 habitations - 1/3 usage commercial

## Performance au 30.09.2014 (en % p.a.)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Risque <sup>1</sup>	KGAST Ranking
Année en cours	2.8	3.6		
Derniers 12 mois	3.1	5.4		
Derniers 3 ans <sup>2</sup>	N.a.	N.a.		
Derniers 5 ans <sup>2</sup>	N.a.	N.a.		
Derniers 10 ans <sup>2</sup>	N.a.	N.a.		
Depuis le lancement <sup>2</sup>	4.2	5.7		

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

<sup>2</sup> annualisé

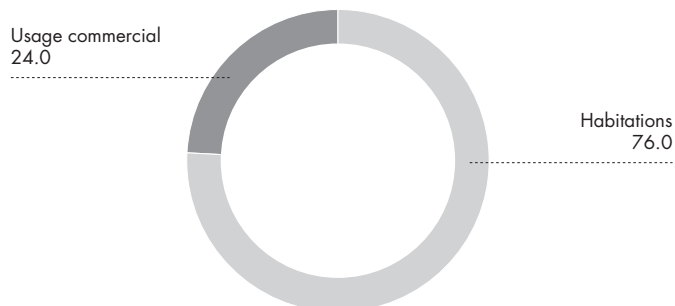
## Chiffres-clés

		30.09.2014	31.12.2013
Fortune nette	(en millions CHF)	267.7	209.2
Nombre de quotes-parts		246 443	198 097
Valeur en capital <sup>3</sup>	(en CHF)	983.29	984.31
Revenu couru <sup>3</sup>	(en CHF)	102.80	71.93
Valeur d'inventaire <sup>3</sup>	(en CHF)	1 086.09	1 056.24

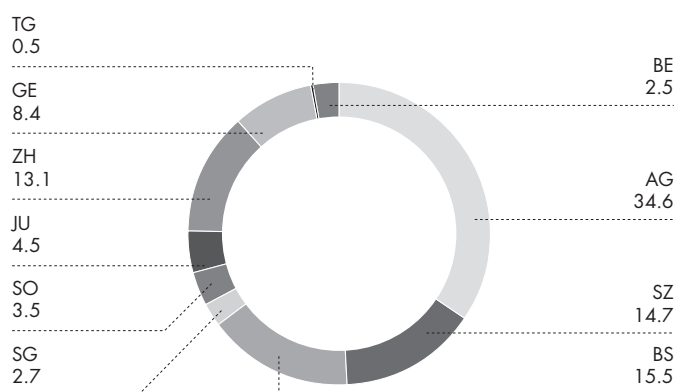
<sup>3</sup> par quote-part

Taux de perte sur loyer	(en %)	3.98	3.58
Quote-part de financement par de fonds de tiers	(en %)	-	-
Marge de résultat opérationnel	(en %)	80.11	78.10
TER <sub>ISA</sub> 2013 (TVA incl.)	(en %)	0.64	
ROE	(en %)	4.05	4.61
Rendement du dividende	(en %)	-	-

## Répart. par type d'affectation au 30.09.2014 (en %)



## Répart. par canton au 30.09.2014 (en %)



## Souscription et reprise

Les reprises peuvent être annoncées auprès de l'Helvetia Fondation de placement à tout moment. 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	> CHF 100 mille	> CHF 2 millions	> CHF 10 millions
Acquisition	2.50%	2.50%	2.50%
Reprise	Max. 2.50%	Max. 2.50%	Max. 2.50%

**Helvetia Fondation de placement**

St. Alban-Anlage 26, 4002 Bâle  
T 058 280 1000 (24 h), F 058 280 2940  
[www.helvetia-anlagestiftung.ch/fr](http://www.helvetia-anlagestiftung.ch/fr)

Membre de la CAFP

**Votre fondation de placement suisse.**

