Quartals-bericht 2/2015

Helvetia Anlagestiftung.

Ihre Schweizer Anlagestiftung.

helvetia

Inhalt.

3 Aktien Schweiz indexiert

4 Aktien Global indexiert

5 Obligationen Schweiz indexiert

6 Obligationen Global indexiert

7 BVG-Mix

8 BVG-Mix Plus 25

9 BVG-Mix Plus 30

10 Immobilien Schweiz

Aktien Schweiz indexiert.
Erfolg auf schweizerisch.

Charakteristika

Gründungsjahr	1993
Valoren-Nr.	1176850 (ISIN: CH0011768501)
Bloomberg	PATAKCH SW
Benchmark	Swiss Performance Index (SPI)
Bewertung	Wöchentlich
Anlagestil	Indexiert

Performance per 30.06.2015 (in % p.a.)

	Anlage-gruppe	Bench-mark	Risiko[1]	KGAST Ranking
Im laufenden Jahr	0.6	0.7		
Letzte 12 Monate	4.9	5.5	13.4	
Letzte 3 Jahre [2]	15.9	16.6	10.2	
Letzte 5 Jahre [2]	10.0	10.5	10.4	
Letzte 10 Jahre [2]	6.1	6.5	13.5	**Rang 4**
Seit Lancierung [2]	8.0	8.3		

[1] gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Renditen), weitere Risikokennzahlen können der Website https://www.helvetia.com/ch/investment-foundation/de/informationen/risk-ratio.html entnommen werden

[2] annualisiert

Kennzahlen

		30.06.2015	31.12.2014
Nettofondsvermögen	(in Mio. CHF)	68.2	81.1
Anzahl Ansprüche		60 656	65 001
Kapitalwert [3]	(in CHF)	1 093.70	1 216.95
Aufgelaufener Ertrag [3]	(in CHF)	31.16	31.41
Inventarwert [3]	(in CHF)	1 124.86	1 248.36

[3] pro Anspruch

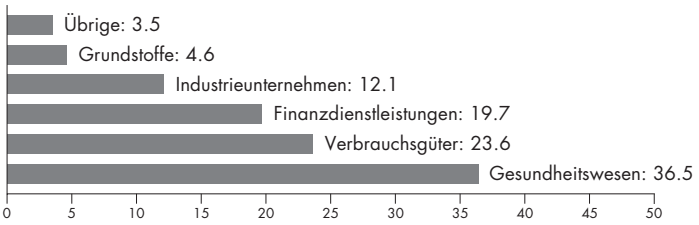
Tracking Error	(in %)	0.26
TER 2014 (inkl. MWSt)	(in %)	0.42

10 grösste Positionen per 30.06.2015 (in %)

Novartis AG	18.7	Zurich Insurance Group AG	3.4
Nestlé SA	17.4	Credit Suisse Group AG	3.2
Roche Holding AG	14.7	CIE Financière Richemont SA	3.2
UBS AG	5.5	Syngenta AG	2.8
ABB LTD	3.6	Swiss Re AG	2.3

Wertentwicklung seit Lancierung

Branchenstruktur per 30.06.2015 (in %)



Zeichnung und Rücknahme

Zeichnungen und Rücknahmen, die bis Dienstag um 11.00 Uhr bei der Helvetia Anlagestiftung eintreffen, werden mit den Schlusskursen vom folgenden Mittwoch abgerechnet.

Gebühren	> CHF 100 Tsd.	> CHF 2 Mio.	> CHF 10 Mio.
Erwerb	0.55%	0.50%	0.45%
Rücknahme	0.35%	0.35%	0.35%

Aktien Global indexiert.
International ausgerichtet.

Charakteristika

Gründungsjahr	1993
Valoren-Nr.	1176852 (ISIN: CH0011768527)
Bloomberg	PATAKGL SW
Benchmark: MSCI Länderindices (customised)	– 35.0% USA – 10.0% J – 25.0% EMU – 3.0% Pazifik – 15.0% UK – 12.0% EMA
Bewertung	Wöchentlich
Anlagestil	Indexiert

Performance per 30.06.2015 (in % p.a.)

	Anlage-gruppe	Bench-mark	Risiko[1]	KGAST Ranking
Im laufenden Jahr	–3.3	–2.8		**Rang 3**
Letzte 12 Monate	3.4	3.9	13.7	
Letzte 3 Jahre [2]	11.6	12.2	10.0	
Letzte 5 Jahre [2]	7.4	7.9	12.4	
Letzte 10 Jahre [2]	1.9	2.1	16.7	
Seit Lancierung [2]	4.0	4.2		

[1] gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Renditen), weitere Risikokennzahlen können der Website https://www.helvetia.com/ch/investment-foundation/de/informationen/risk-ratio.html entnommen werden

[2] annualisiert

Kennzahlen

		30.06.2015	31.12.2014
Nettofondsvermögen	(in Mio. CHF)	39.4	51.8
Anzahl Ansprüche		30 653	38 955
Kapitalwert [3]	(in CHF)	1 119.22	1 179.21
Aufgelaufener Ertrag [3]	(in CHF)	166.19	150.49
Inventarwert [3]	(in CHF)	1 285.41	1 329.70

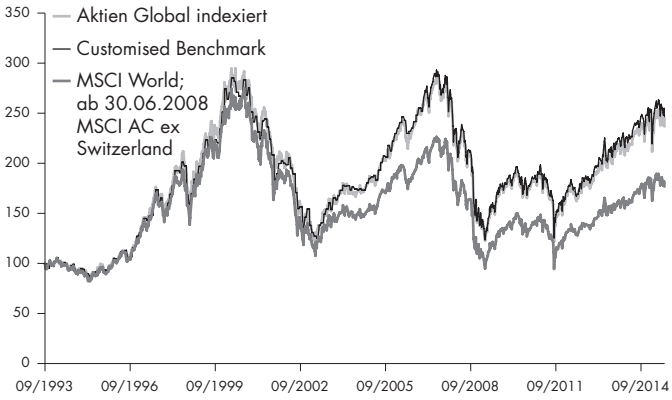
[3] pro Anspruch

Tracking Error	(in %)	0.86
TER 2014 (inkl. MWSt)	(in %)	0.56

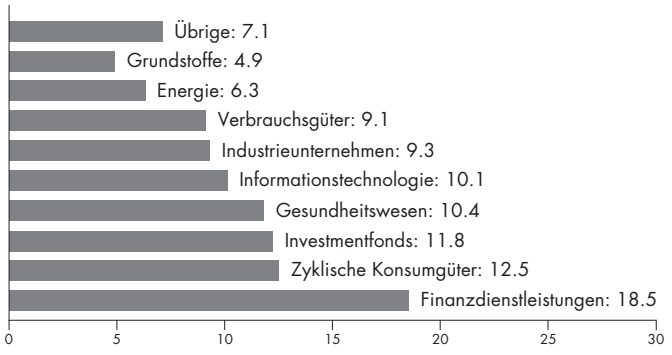
10 grösste Positionen per 30.06.2015 (in %)

ISHARES MSCI EMA	11.8	Total SA	0.7
Apple Inc	1.4	BP PLC	0.7
HSBC Holdings PLC	1.0	Toyota Motor Corp	0.7
Bayer AG	0.8	Microsoft Corp	0.7
Sanofi	0.8	Banco Santander SA	0.7

Wertentwicklung seit Lancierung



Branchenstruktur per 30.06.2015 (in %)



Zeichnung und Rücknahme

Zeichnungen und Rücknahmen, die bis Dienstag um 11.00 Uhr bei der Helvetia Anlagestiftung eintreffen, werden mit den Schlusskursen vom folgenden Mittwoch abgerechnet.

Gebühren	> CHF 100 Tsd.	> CHF 2 Mio.	> CHF 10 Mio.
Erwerb	0.65%	0.60%	0.55%
Rücknahme	0.45%	0.45%	0.45%

Obligationen Schweiz indexiert.
Erfolg auf sicher.

Charakteristika

Gründungsjahr	2001
Valoren-Nr.	1176855 (ISIN: CH0011768550)
Bloomberg	PATOBCH SW
Benchmark	Swiss Bond Index (SBI) Domestic AAA-BBB
Bewertung	Wöchentlich
Anlagestil	Indexiert

Performance per 30.06.2015 (in % p.a.)

	Anlage-gruppe	Bench-mark	Risiko[1]	KGAST Ranking
Im laufenden Jahr	1.2	1.2		**Rang 2**
Letzte 12 Monate	5.0	5.2	3.5	**Rang 3**
Letzte 3 Jahre [2]	2.5	2.6	3.0	**Rang 2**
Letzte 5 Jahre [2]	2.9	3.2	2.9	**Rang 4**
Letzte 10 Jahre [2]	2.8	3.2	3.0	**Rang 3**
Seit Lancierung [2]	3.5	3.9		

[1] gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Renditen), weitere Risikokennzahlen können der Website https://www.helvetia.com/ch/investment-foundation/de/informationen/risk-ratio.html entnommen werden

[2] annualisiert

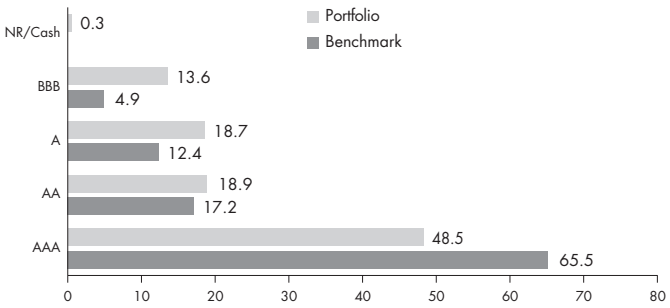
Kennzahlen

		30.06.2015	31.12.2014
Nettofondsvermögen	(in Mio. CHF)	54.3	53.0
Anzahl Ansprüche		49 672	47 925
Kapitalwert [3]	(in CHF)	1 082.54	1 082.74
Aufgelaufener Ertrag [3]	(in CHF)	11.54	24.12
Inventarwert [3]	(in CHF)	1 094.08	1 106.86

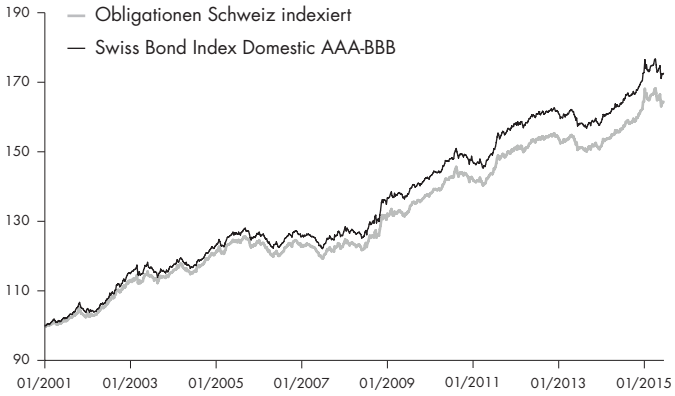
[3] pro Anspruch

Tracking Error	(in %)	0.27	
TER 2014 (inkl. MWSt)	(in %)	0.32	
Direkte Rendite	(in %)	2.91	2.95
Rendite auf Verfall	(in %)	0.23	0.49
Ø-Laufzeit	(in Jahren)	9.09	9.06
Modified Duration	(in Jahren)	7.76	7.70

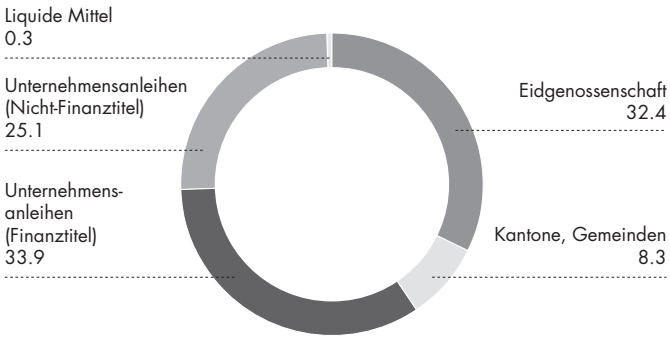
Kreditratingstruktur per 30.06.2015 (in %)



Wertentwicklung seit Lancierung



Emittentenstruktur per 30.06.2015 (in %)



Zeichnung und Rücknahme

Zeichnungen und Rücknahmen, die bis Dienstag um 11.00 Uhr bei der Helvetia Anlagestiftung eintreffen, werden mit den Schlusskursen vom folgenden Mittwoch abgerechnet.

Gebühren	> CHF 100 Tsd.	> CHF 2 Mio.	> CHF 10 Mio.
Erwerb	0.25%	0.22%	0.20%
Rücknahme	0.20%	0.20%	0.20%

Obligationen Global indexiert.
Internationale Diversifikation.

Charakteristika

Gründungsjahr	2001	
Valoren-Nr.	1176857 (ISIN: CH0011768576)	
Bloomberg	PATOBGL SW	
Benchmark:	– 52.4% EMU	– 2.5% AUS
JP Morgan Government	– 25.0% USA	– 2.5% CDN
Bond Länderindices	– 9.0% UK	– 1.8% DK
(customised)	– 5.0% J	– 1.8% S
Bewertung	Wöchentlich	
Anlagestil	Indexiert	

Performance per 30.06.2015 (in % p.a.)

	Anlage-gruppe	Bench-mark	Risiko[1]	KGAST Ranking
Im laufenden Jahr	–11.5	–11.2		
Letzte 12 Monate	–4.6	–4.4	10.7	**Rang 3**
Letzte 3 Jahre [2]	–0.2	0.6	7.1	**Rang 4**
Letzte 5 Jahre [2]	–0.2	0.2	8.6	**Rang 3**
Letzte 10 Jahre [2]	0.2	0.4	8.1	**Rang 2**
Seit Lancierung [2]	0.9	1.1		

[1] gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Renditen), weitere Risikokennzahlen können der Website https://www.helvetia.com/ch/investment-foundation/de/informationen/risk-ratio.html entnommen werden

[2] annualisiert

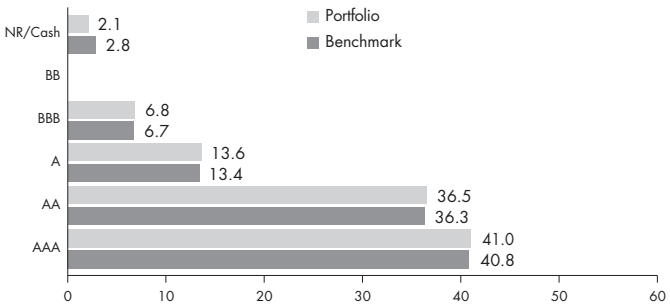
Kennzahlen

		30.06.2015	31.12.2014
Nettofondsvermögen	(in Mio. CHF)	22.5	25.1
Anzahl Ansprüche		27 337	26 952
Kapitalwert [3]	(in CHF)	603.27	721.67
Aufgelaufener Ertrag [3]	(in CHF)	220.01	208.22
Inventarwert [3]	(in CHF)	823.28	929.89

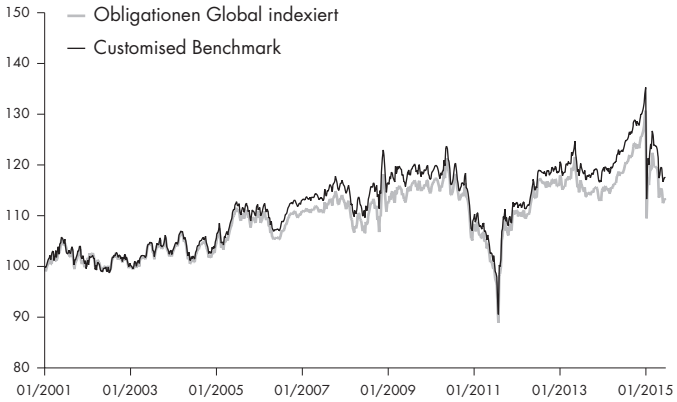
[3] pro Anspruch

Tracking Error	(in %)	0.35	
TER 2014 (inkl. MWSt)	(in %)	0.34	
Direkte Rendite	(in %)	4.85	4.80
Rendite auf Verfall	(in %)	1.38	1.16
Ø-Laufzeit	(in Jahren)	8.88	9.22
Modified Duration	(in Jahren)	7.24	7.06

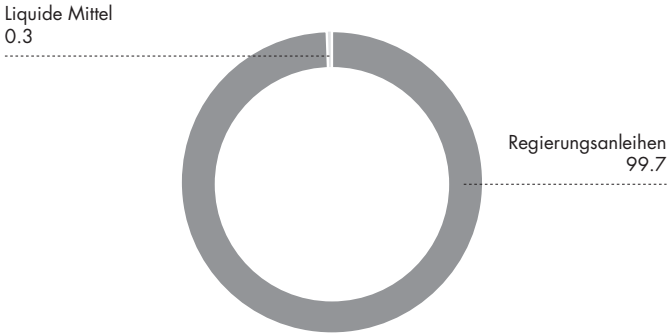
Kreditratingstruktur per 30.06.2015 (in %)



Wertentwicklung seit Lancierung



Emittentenstruktur per 30.06.2015 (in %)



Zeichnung und Rücknahme

Zeichnungen und Rücknahmen, die bis Dienstag um 11.00 Uhr bei der Helvetia Anlagestiftung eintreffen, werden mit den Schlusskursen vom folgenden Mittwoch abgerechnet.

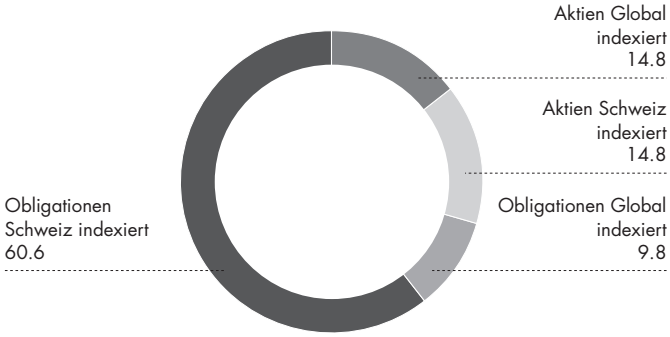
Gebühren	> CHF 100 Tsd.	> CHF 2 Mio.	> CHF 10 Mio.
Erwerb	0.25%	0.22%	0.20%
Rücknahme	0.20%	0.20%	0.20%

BVG-Mix.
Gut diversifiziert.

Charakteristika

Gründungsjahr	1993
Valoren-Nr.	1176860 (ISIN: CH0011768600)
Bloomberg	PATBVGM SW
Benchmark	Customised
Bewertung	Wöchentlich
Anlagestil	Indexiert
Strategische Asset Allocation	– 60% Obligationen Schweiz indexiert – 10% Obligationen Global indexiert – 15% Aktien Schweiz indexiert – 15% Aktien Global indexiert

Anlageklassenstruktur per 30.06.2015 (in %)



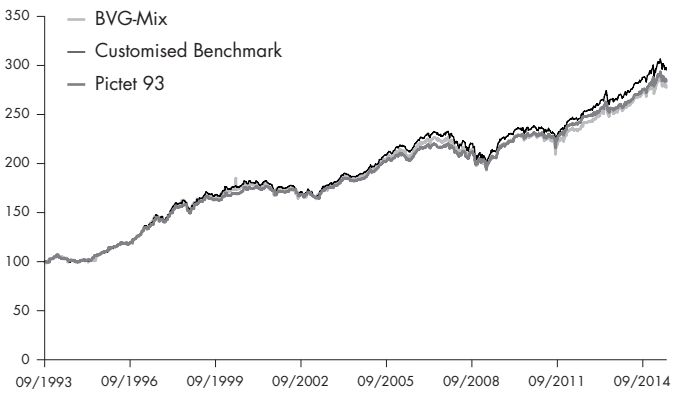
Performance per 30.06.2015 (in % p.a.)

	Anlage-gruppe	Bench-mark	Risiko[1]	KGAST Ranking
Im laufenden Jahr	–0.9	–0.3		
Letzte 12 Monate	3.7	4.7	4.4	
Letzte 3 Jahre [2]	5.5	6.1	3.7	
Letzte 5 Jahre [2]	4.4	5.1	3.4	
Letzte 10 Jahre [2]	3.2	3.7	4.6	**Rang 3**
Seit Lancierung [2]	4.8	5.1		

[1] gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Renditen), weitere Risikokennzahlen können der Website https://www.helvetia.com/ch/investment-foundation/de/informationen/risk-ratio.html entnommen werden

[2] annualisiert

Wertentwicklung seit Lancierung



Kennzahlen

		30.06.2015	31.12.2014
Nettofondsvermögen	(in Mio. CHF)	23.0	22.0
Anzahl Ansprüche		21 880	20 135
Kapitalwert [3]	(in CHF)	1 018.60	1 074.36
Aufgelaufener Ertrag [3]	(in CHF)	32.52	18.54
Inventarwert [3]	(in CHF)	1 051.12	1 092.90

[3] pro Anspruch

Tracking Error	(in %)	1.04	
TER 2014 (inkl. MWSt)	(in %)	0.52	

Zeichnung und Rücknahme

Zeichnungen und Rücknahmen, die bis Dienstag um 11.00 Uhr bei der Helvetia Anlagestiftung eintreffen, werden mit den Schlusskursen vom folgenden Mittwoch abgerechnet.

Gebühren	> CHF 100 Tsd.	> CHF 2 Mio.	> CHF 10 Mio.
Erwerb	0.35%	0.32%	0.30%
Rücknahme	0.25%	0.25%	0.25%

BVG-Mix Plus 25.
Renditeorientiert.

Charakteristika

Gründungsjahr	2008
Valoren-Nr.	3539996 (ISIN: CH0035399960)
Bloomberg	BVGMP25 SW
Benchmark	Customised
Bewertung	Wöchentlich
Anlagestil	Core-Satellite
Strategische Asset Allocation	– 25% Obligationen Schweiz indexiert – 20% Obligationen Global indexiert – 20% Aktien Schweiz indexiert – 5% Aktien Global indexiert – 10% Hedge Funds – 20% Immobilien

Performance per 30.06.2015 (in % p.a.)

	Anlage-gruppe	Bench-mark	Risiko[1]	KGAST Ranking
Im laufenden Jahr	–0.8	–0.8		
Letzte 12 Monate	4.3	4.9	4.4	**Rang 5**
Letzte 3 Jahre [2]	5.9	6.3	4.1	**Rang 4**
Letzte 5 Jahre [2]	4.7	5.3	3.7	**Rang 5**
Letzte 10 Jahre [2]	N.a.	N.a.		
Seit Lancierung [2]	3.3	3.7		

[1] gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Renditen), weitere Risikokennzahlen können der Website https://www.helvetia.com/ch/investment-foundation/de/informationen/risk-ratio.html entnommen werden

[2] annualisiert

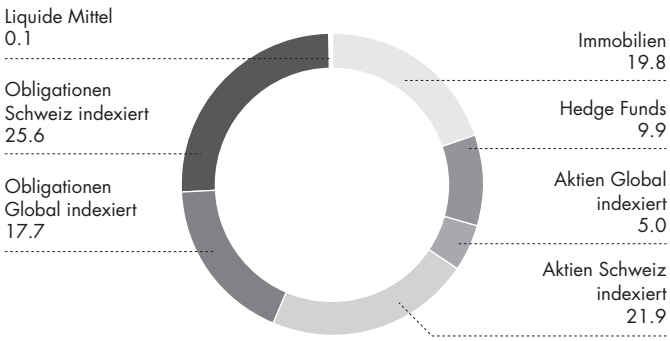
Kennzahlen

		30.06.2015	31.12.2014
Nettofondsvermögen	(in Mio. CHF)	1.0	1.0
Anzahl Ansprüche		829	829
Kapitalwert [3]	(in CHF)	1 040.35	1 088.41
Aufgelaufener Ertrag [3]	(in CHF)	134.42	95.50
Inventarwert [3]	(in CHF)	1 174.77	1 183.91

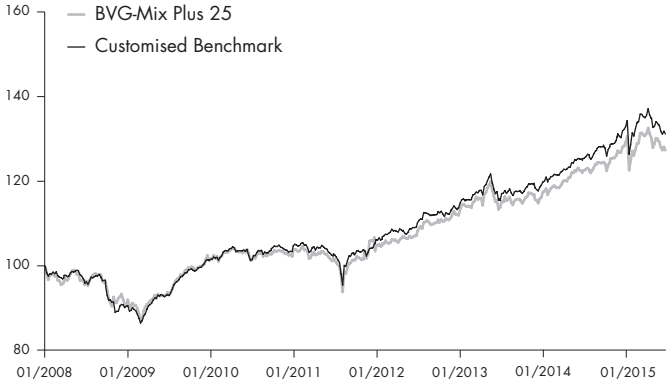
[3] pro Anspruch

Tracking Error	(in %)	1.45	
TER 2014 (inkl. MWSt)	(in %)	1.27	

Anlageklassenstruktur per 30.06.2015 (in %)



Wertentwicklung seit Lancierung



Zeichnung und Rücknahme

Zeichnungen und Rücknahmen, die bis Dienstag um 11.00 Uhr bei der Helvetia Anlagestiftung eintreffen, werden mit den Schlusskursen vom folgenden Mittwoch abgerechnet.

Gebühren	> CHF 100 Tsd.	> CHF 2 Mio.	> CHF 10 Mio.
Erwerb	0.46%	0.43%	0.41%
Rücknahme	0.26%	0.26%	0.26%

BVG-Mix Plus 30.

Charakteristika

Gründungsjahr	2013
Valoren-Nr.	3539998 (ISIN: CH0035399986)
Bloomberg	BVGMP30 SW
Benchmark	Customised
Bewertung	Wöchentlich
Anlagestil	Core-Satellite
Strategische Asset Allocation	– 29% Obligationen Schweiz indexiert – 5% Obligationen Global indexiert – 21% Aktien Schweiz indexiert – 9% Aktien Global indexiert – 8% Hedge Funds – 24% Immobilien – 4% Rohstoffe

Performance per 30.06.2015 (in % p.a.)

	Anlage-gruppe	Bench-mark	Risiko[1]	KGAST Ranking
Im laufenden Jahr	0.5	0.7		**Rang 3**
Letzte 12 Monate	4.7	5.6	4.0	**Rang 3**
Letzte 3 Jahre [2]	N.a.	N.a.		
Letzte 5 Jahre [2]	N.a.	N.a.		
Letzte 10 Jahre [2]	N.a.	N.a.		
Seit Lancierung [2]	4.4	6.0		

[1] gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Renditen), weitere Risikokennzahlen können der Website https://www.helvetia.com/ch/investment-foundation/de/informationen/risk-ratio.html entnommen werden

[2] annualisiert

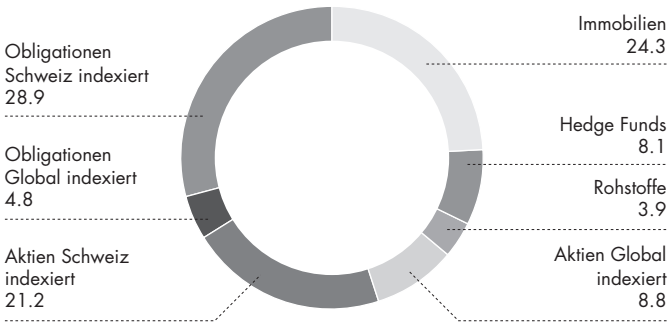
Kennzahlen

		30.06.2015	31.12.2014
Nettofondsvermögen	(in Mio. CHF)	8.5	8.4
Anzahl Ansprüche		7 904	7 656
Kapitalwert [3]	(in CHF)	1 035.28	1 067.28
Aufgelaufener Ertrag [3]	(in CHF)	41.21	25.52
Inventarwert [3]	(in CHF)	1 076.49	1 092.80

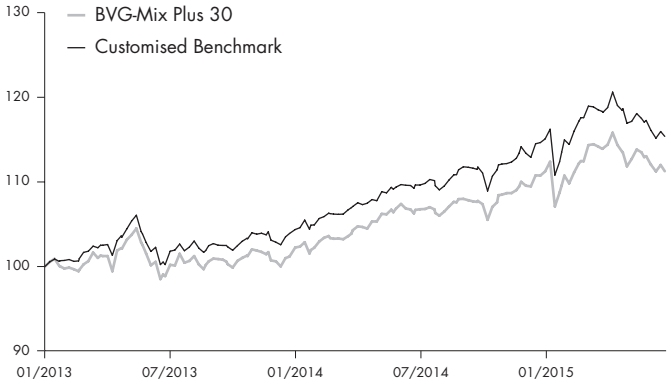
[3] pro Anspruch

Tracking Error	(in %)	1.78
TER 2014 (inkl. MWSt)	(in %)	0.97

Anlageklassenstruktur per 30.06.2015 (in %)



Wertentwicklung seit Lancierung



Zeichnung und Rücknahme

Zeichnungen und Rücknahmen, die bis Dienstag um 11.00 Uhr bei der Helvetia Anlagestiftung eintreffen, werden mit den Schlusskursen vom folgenden Mittwoch abgerechnet.

Gebühren	> CHF 100 Tsd.	> CHF 2 Mio.	> CHF 10 Mio.
Erwerb	0.61%	0.40%	0.30%
Rücknahme	0.50%	0.50%	0.50%

Immobilien Schweiz.
Nachhaltig stabile Renditen, geringe Volatilität.

Charakteristika

Gründungsjahr	2012
Valoren-Nr.	18823078 (ISIN: CH0188230780)
Bloomberg	IMMSCHW SW
Benchmark	KGAST Immo-Index
Bewertung	Quartalsweise
Anlagestil	Aktiv
Region	Schweiz
Strategische Diversifikation	– $^2/_3$ Wohnimmobilien – $^1/_3$ Geschäftsimmobilien

Performance per 30.06.2015 (in % p.a.)

	Anlage-gruppe	Bench-mark	Risiko[1]	KGAST Ranking
Im laufenden Jahr	1.2	2.3		
Letzte 12 Monate	3.1	5.1	1.3	
Letzte 3 Jahre [2]	N.a.	N.a.		
Letzte 5 Jahre [2]	N.a.	N.a.		
Letzte 10 Jahre [2]	N.a.	N.a.		
Seit Lancierung [2]	3.9	5.5		

[1] gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Renditen), weitere Risikokennzahlen können der Website https://www.helvetia.com/ch/investment-foundation/de/informationen/risk-ratio.html entnommen werden

[2] annualisiert

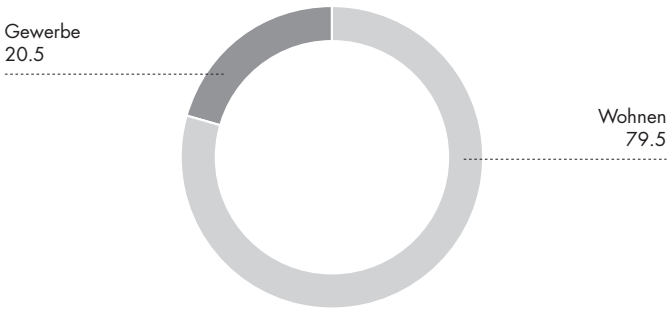
Kennzahlen

		30.06.2015	31.12.2014
Nettofondsvermögen	(in Mio. CHF)	374.2	369.6
Anzahl Ansprüche		337 070	337 070
Kapitalwert [3]	(in CHF)	979.49	979.50
Aufgelaufener Ertrag [3]	(in CHF)	130.80	117.14
Inventarwert [3]	(in CHF)	1 110.29	1 096.64

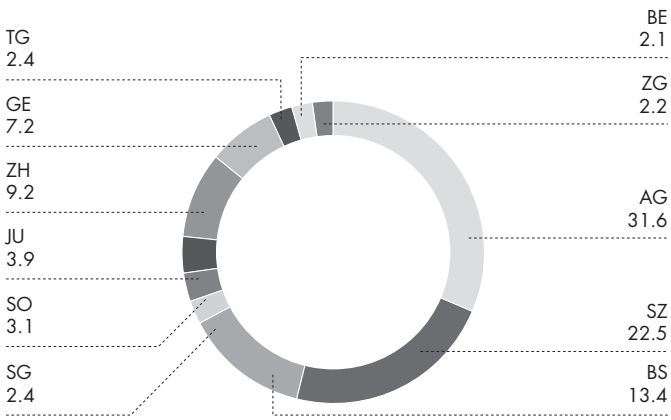
[3] pro Anspruch

Mietzinsausfallquote	(in %)	3.37	4.19
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	–	–
EBIT-Marge	(in %)	78.86	76.35
TER_{ISA} (NAV) 2014 (inkl. MWST)	(in %)	0.61	
ROE	(in %)	1.23	6.42
Ausschüttungsrendite	(in %)	–	–

Diversifikation nach Nutzungsart per 30.06.2015 (in %)



Diversifikation nach Kanton per 30.06.2015 (in %)



Zeichnung und Rücknahme

Rücknahmen können jederzeit bei der Helvetia Anlagestiftung angemeldet werden. Bei Zessionsmöglichkeit (vgl. Art. 20, Reglement) erfolgt die Abrechnung mit dem Nettoinventarwert des jeweiligen folgenden Quartalsendes.

Gebühren	> CHF 100 Tsd.	> CHF 2 Mio.	> CHF 10 Mio.
Erwerb	2.50%	2.50%	2.50%
Rücknahme	Max. 2.50%	Max. 2.50%	Max. 2.50%

12-5151 08.15

Helvetia Anlagestiftung
St. Alban-Anlage 26, 4002 Basel
T 058 280 1000 (24 h), F 058 280 2940
www.helvetia-anlagestiftung.ch

Mitglied der KGAST

Ihre Schweizer Anlagestiftung.