

Aktien Schweiz Smart Beta Dynamisch 100.

Innovativ indexiert, intelligent investiert.

31.03.2019

Charakteristika

| | |
|----------------------|-------------------------------|
| Gründungsjahr | 2015 |
| Valoren-Nr. | 27589595 (ISIN: CH0275895958) |
| Bloomberg | AKSB100 SW |
| Benchmark | Swiss Performance Index (SPI) |
| Bewertung | Wöchentlich |
| Ausschüttungspolitik | Thesaurierend |

Anlagestil

Aktien Schweiz Smart Beta Dynamisch 100

| Aktien-signal | Offensiv | Neutral | Defensiv |
|---|--|--|--|
| | (100% ≥ GLOCAP ≥ 80%) | (80% > GLOCAP ≥ 60%) | (60% > GLOCAP ≥ 0%) |
| Verhältnis risikobasiert / renditebasiert | 30% / 70% | 50% / 50% | 70% / 30% |
| Allokation | | | |
| |  |  |  |
| 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 per 31.03.2019 (in %)

| | Anlage-gruppe | Benchmark | Diff. zum Benchmark | KGAST Ranking |
|------------------------------|---------------|-----------|---------------------|---------------|
| 1 Monat | 1.93 | 2.52 | -0.59 | |
| 3 Monate | 12.51 | 14.36 | -1.84 | |
| YTD | 12.51 | 14.36 | -1.84 | |
| Letzte 12 Monate | 2.61 | 10.32 | -7.71 | |
| 3 Jahre ¹ | 11.87 | 10.57 | 1.30 | |
| 5 Jahre ¹ | N.a. | N.a. | N.a. | |
| 10 Jahre ¹ | N.a. | N.a. | N.a. | |
| Seit Lancierung ¹ | 9.28 | 5.10 | 4.19 | |

¹annualisiert

Kennzahlen

| | | 31.03.2019 | 31.12.2018 |
|-------------------------------|---------------|------------|------------|
| Nettovermögen | (in Mio. CHF) | 94.12 | 49.39 |
| Anzahl Ansprüche | | 68 279 | 40 314 |
| Kapitalwert ² | (in CHF) | 1 377.41 | 1 151.91 |
| Laufender Ertrag ² | (in CHF) | 1.10 | 73.30 |
| Inventarwert ² | (in CHF) | 1 378.51 | 1 225.21 |
| TER (inkl. MWST) | (in %) | 0.58 | |

²pro Anspruch

Risikokennzahlen per 31.03.2019 (in %)

| | | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre |
|--------------------------|------------|--------|---------|---------|
| Volatilität ³ | (in %) | 13.21 | 10.01 | N.a. |
| Tracking Error | (in %) | 2.63 | 4.51 | N.a. |
| Beta | | 1.03 | 0.87 | N.a. |
| Sharpe Ratio | | -0.21 | 0.65 | N.a. |
| Information Ratio | | -2.93 | 0.29 | N.a. |
| Jensen-Alpha | | -0.08 | 0.02 | N.a. |
| Max. Drawdown | | -14.17 | -14.17 | N.a. |
| Recovery Period | (in Tagen) | N.a. | N.a. | N.a. |

³gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Rendite)

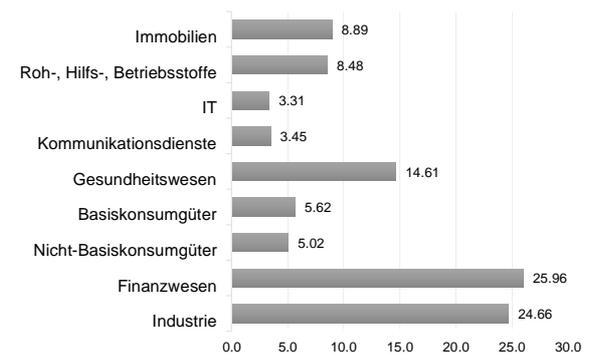
10 grösste Positionen per 31.03.2019 (in %)

| | |
|-----------------------------|------|
| PSP Swiss Property AG N | 5.51 |
| Swiss Life Holding AG N | 4.85 |
| Helvetia Holding AG N | 4.69 |
| Roche Holding AG G | 4.17 |
| Swiss Prime Site AG N | 3.35 |
| Geberit AG N | 3.21 |
| Zurich Insurance Group AG N | 3.20 |
| Partners Group Holding AG N | 3.15 |
| Novartis AG N | 3.05 |
| Adecco Group AG N | 2.72 |

Wertenwicklung seit Lancierung



Branchenstruktur per 31.03.2019 (in %)



Zeichnung und Rücknahme

Zeichnungen und

| Gebühren | > TCHF 100 | > CHF 2 Mio. | > CHF 10 Mio. |
|-----------|------------|--------------|---------------|
| Erwerb | - | - | - |
| Rücknahme | - | - | - |

BVG-Mix.

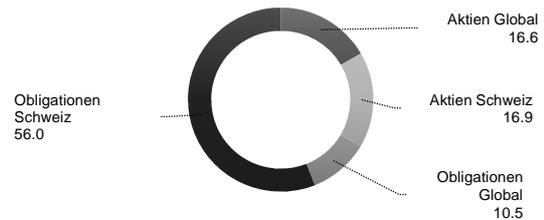
Gut diversifiziert.

31.03.2019

Charakteristika

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

Anlageklassenstruktur per 31.03.2019 (in %)



Performance per 31.03.2019 (in %)

| | Anlage- gruppe | Benchmark | Diff. zum Benchmark | KGAST Ranking |
|------------------------------|-------------------|-----------|------------------------|------------------|
| 1 Monat | 1.26 | 1.52 | -0.26 | |
| 3 Monate | 5.34 | 5.86 | -0.52 | |
| YTD | 5.34 | 5.86 | -0.52 | |
| Letzte 12 Monate | 3.26 | 4.59 | -1.33 | |
| 3 Jahre ¹ | 3.11 | 3.90 | -0.78 | |
| 5 Jahre ¹ | 3.35 | 4.17 | -0.82 | |
| 10 Jahre ¹ | 4.49 | 5.14 | -0.66 | |
| 15 Jahre ¹ | 3.39 | 3.93 | -0.54 | |
| Seit Lancierung ¹ | 4.50 | 4.87 | -0.37 | |

¹ annualisiert

Kennzahlen

| | | 31.03.2019 | 31.12.2018 |
|-------------------------------|---------------|------------|------------|
| Nettovermögen | (in Mio. CHF) | 16.44 | 14.85 |
| Anzahl Ansprüche | | 15 534 | 14 779 |
| Kapitalwert ² | (in CHF) | 1 059.16 | 953.71 |
| Laufender Ertrag ² | (in CHF) | -0.64 | 51.15 |
| Inventarwert ² | (in CHF) | 1 058.52 | 1 004.86 |
| TER 2018 (inkl. MWST) | (in %) | 0.53 | |

² pro Anspruch

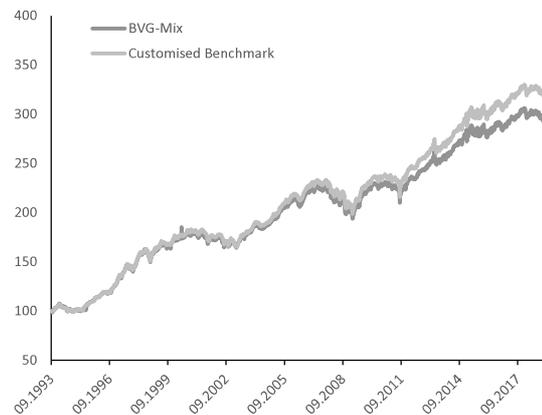
Risikokennzahlen per 31.03.2019 (in %)

| | | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre |
|--------------------------------|------------|--------|---------|---------|
| Volatilität ³ | (in %) | 4.21 | 3.38 | 3.98 |
| Tracking Error | (in %) | 0.76 | 0.47 | 0.41 |
| Beta | | 0.90 | 0.96 | 0.99 |
| Sharpe Ratio | | 1.44 | 1.76 | 1.55 |
| Information Ratio | | -1.75 | -1.67 | -2.00 |
| Jensen-Alpha | | -0.01 | 0.00 | -0.01 |
| Max. Drawdown | | -3.34 | -8.88 | -12.50 |
| Recovery Period | (in Tagen) | 59.00 | N.a. | N.a. |
| Modified Duration ⁴ | (in %) | 7.25 | | |

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Rendite)

⁴ Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 31.03.2019

Wertentwicklung seit Lancierung



Zeichnung und Rücknahme

Zeichnungen und Rücknahmen, die bis Dienstag 11:00 Uhr bei der Helvetia Anlagestiftung eintreffen, werden mit den Schlusskursen vom folgenden Mittwoch abgerechnet.

| Gebühren | > TCHF 100 | >CHF 2 Mio. | > CHF 10 Mio. |
|-----------|------------|-------------|---------------|
| Erwerb | 0.35% | 0.32% | 0.30% |
| Rücknahme | 0.25% | 0.25% | 0.25% |

BVG-Mix Plus 30.

Renditeorientiert.

31.03.2019

Charakteristika

| | |
|-------------------------------|---|
| Gründungsjahr | 2013 |
| Valoren-Nr. | 3539998 (ISIN: CH0035399986) |
| Bloomberg | BVGMP30 SW |
| Benchmark | Customised |
| Bewertung | Wöchentlich |
| Ausschüttungspolitik | Thesaurierend |
| Anlagestil | Core-Satellite |
| Strategische Asset Allocation | - 24% Obligationen Schweiz - 5% Obligationen Global - 26% Aktien Schweiz Smart Beta Dynamisch 100 - 9% Aktien Global - 26% Immobilien - 10% Hypotheken |

Performance per 31.03.2019 (in %)

| | Anlage- gruppe | Benchmark | Diff. zum Benchmark | KGAST Ranking |
|------------------------------|-------------------|-----------|------------------------|------------------|
| 1 Monat | 1.13 | 1.35 | -0.22 | |
| 3 Monate | 5.72 | 6.00 | -0.28 | |
| YTD | 5.72 | 6.00 | -0.28 | |
| Letzte 12 Monate | 1.08 | 5.58 | -4.50 | |
| 3 Jahre ¹ | 4.35 | 5.47 | -1.13 | |
| 5 Jahre ¹ | 4.12 | 4.75 | -0.63 | |
| 10 Jahre ¹ | N.a. | N.a. | N.a. | |
| 15 Jahre ¹ | N.a. | N.a. | N.a. | |
| Seit Lancierung ¹ | 3.93 | 4.92 | -0.99 | |

¹ annualisiert

Kennzahlen

| | | 31.03.2019 | 31.12.2018 |
|-------------------------------|---------------|------------|------------|
| Nettovermögen | (in Mio. CHF) | 178.93 | 68.07 |
| Anzahl Ansprüche | | 151 541 | 60 953 |
| Kapitalwert ² | (in CHF) | 1 180.22 | 1 103.25 |
| Laufender Ertrag ² | (in CHF) | 0.48 | 13.57 |
| Inventarwert ² | (in CHF) | 1 180.70 | 1 116.82 |
| TER 2018 (inkl. MWST) | (in %) | 0.86 | |

² pro Anspruch

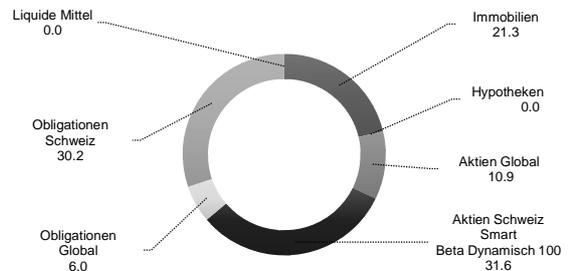
Risikokennzahlen per 31.03.2019 (in %)

| | | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre |
|--------------------------------|------------|--------|---------|---------|
| Volatilität ³ | (in %) | 5.66 | 4.36 | 4.49 |
| Tracking Error | (in %) | 1.68 | 1.78 | 1.71 |
| Beta | | 1.06 | 1.08 | 0.96 |
| Sharpe Ratio | | 0.18 | 0.99 | 0.91 |
| Information Ratio | | -2.69 | -0.63 | -0.37 |
| Jensen-Alpha | | -0.05 | -0.02 | 0.00 |
| Max. Drawdown | | -6.26 | -6.26 | -6.26 |
| Recovery Period | (in Tagen) | n.a. | n.a. | n.a. |
| Modified Duration ⁴ | (in %) | 7.25 | | |

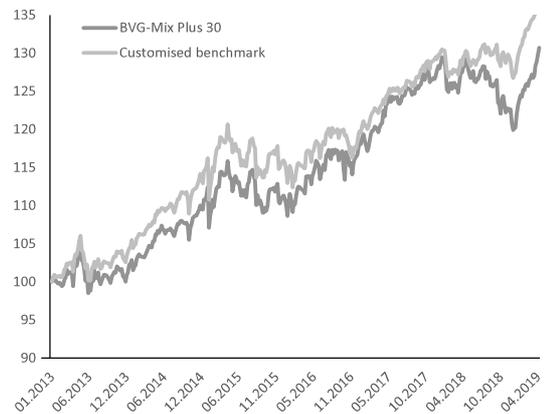
³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Rendite)

⁴ Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 31.03.2019

Anlageklassenstruktur per 31.03.2019 (in %)



Wertentwicklung seit Lancierung



Zeichnung und Rücknahme

Zeichnungen und Rücknahmen, die bis Dienstag 11:00 Uhr bei der Helvetia Anlagengestiftung eintreffen, werden mit den Schlusskursen vom folgenden Mittwoch abgerechnet.

| Gebühren | > TCHF 100 | >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.

31.03.2019

Charakteristika

| | |
|----------------------|-------------------------------|
| Gründungsjahr | 2012 |
| Valoren-Nr. | 18823078 (ISIN: CH0188230780) |
| Bloomberg | IMMSCHW SW |
| Benchmark | KGAST Immo-Index Gemischt |
| Bewertung | Quartalsweise |
| Ausschüttungspolitik | Thesaurierend |
| Anlagestil | Aktiv |
| Region | Schweiz |
| Strategische | - mind. ¼ Wohnimmobilien |
| Diversifikation | - max. ¼ Geschäftsimmobilien |

Performance per 31.03.2019 (in %)

| | Anlage- gruppe | Bench- mark | Diff. zum Benchmar | Risiko ¹ | KGAST Ranking |
|------------------------------|-------------------|----------------|-----------------------|---------------------|------------------|
| 3 Monate | 0.59 | 1.09 | -0.50 | | |
| YTD | 0.59 | 1.09 | -0.50 | | |
| Letzte 12 Monate | 3.53 | 4.54 | -1.00 | 1.70 | |
| 3 Jahre ² | 3.67 | 5.00 | -1.32 | 1.74 | |
| 5 Jahre ² | 3.40 | 4.96 | -1.57 | 1.55 | |
| 10 Jahre ² | N.a. | N.a. | N.a. | N.a. | |
| 15 Jahre ² | N.a. | N.a. | N.a. | N.a. | |
| Seit Lancierung ² | 3.67 | 5.05 | -1.38 | 1.70 | |

¹ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

² annualisiert

Kennzahlen

| | | 31.03.2019 | 31.12.2018 |
|--|---------------|------------|------------|
| Nettovermögen | (in Mio. CHF) | 607.30 | 602.56 |
| Anzahl Ansprüche | | 480 408 | 479 465 |
| Kapitalwert ³ | (in CHF) | 1 256.26 | 1 015.79 |
| Laufender Ertrag ³ | (in CHF) | 7.87 | 240.94 |
| Inventarwert ³ | (in CHF) | 1 264.13 | 1 256.73 |
| ³ pro Anspruch | | | |
| Mietzinsausfallquote | (in %) | 11.56 | 10.61 |
| Fremdfinanzierungsquote | (in %) | - | - |
| EBIT-Marge | (in %) | 64.15 | 67.79 |
| TER _{ISA} 2018 (NAV) (inkl. MWST) | (in %) | 0.61 | - |
| ROE | (in %) | 0.63 | 7.15 |
| ROIC | (in %) | 0.58 | 3.51 |

Diversifikation nach Nutzung per 31.03.2019⁴ (in %)



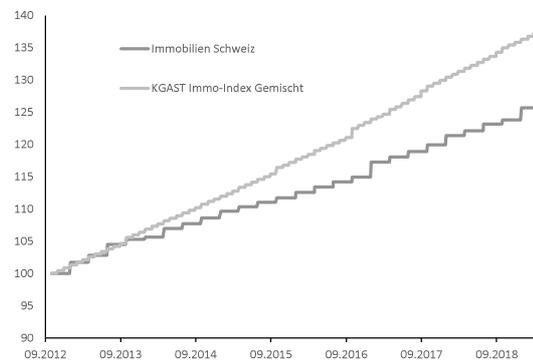
⁴ Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Diversifikation nach Kanton per 31.03.2019⁵ (in %)

| | | | |
|-------------|------|------------------|-----|
| Aargau | 22.6 | Jura | 3.7 |
| Zürich | 15.9 | Thurgau | 3.4 |
| Waadt | 10.6 | Schaffhausen | 3.0 |
| Bern | 9.9 | Solothurn | 1.5 |
| Schwyz | 8.1 | Neuenburg | 1.2 |
| Genf | 7.3 | Zug | 1.1 |
| Basel-Stadt | 6.7 | Basel-Landschaft | 1.0 |
| St. Gallen | 4.0 | | |

⁵ Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Wertentwicklung seit Lancierung



Zeichnung und Rücknahme

Anlagegruppe geschlossen (jeweils nbei kapitalerhöhungen sind Zeichnungen möglich). Rücknahmen können jederzeit bei der Helvetia Anlagestiftung angemeldet werden. Bei Zessionsmöglichkeit (vgl. Art. 22, Reglement) erfolgt die Abrechnung mit dem Nettoinventarwert des jeweiligen folgenden Quartalsendes.

| Gebühren | > TCHF 100 | > 2 Mio. | > 10 Mio. |
|-----------|------------|------------|------------|
| Erwerb | 2.50% | 2.50% | 2.50% |
| Rücknahme | Max. 2.50% | Max. 2.50% | Max. 2.50% |

Immobilien Romandie.

Nachhaltig stabile Renditen, geringe Volatilität.

31.03.2019

Charakteristika

| | |
|----------------------|---|
| Gründungsjahr | 2016 |
| Valoren-Nr. | 30120010 (Isin: CH301200108) |
| Bloomberg | IMMROMD SW |
| Benchmark | KGAST Immo-Index Gemischt |
| Bewertung | Quartalsweise |
| Ausschüttungspolitik | Thesaurierend |
| Anlagestil | Aktiv |
| Region | Romandie, MS-Regionen der Wüest & Partner-Monitoring Regionen 7 (Genfersee) und 8 (Westschweiz) sowie in den MS-Regionen 98 (Sierre), 99 (Sion), 100 (Martigny) und 101 (Monthey/ST. Maurice) |
| Strategische | - mind. ¾ Wohnimmobilien |
| Diversifikation | - max. ¼ Geschäftsimmobilien |

Performance per 31.03.2019 (in %)

| | Anlagegruppe | Benchmark | Diff. zum Benchmark | Risiko ¹ | KGAST Ranking |
|------------------------------|--------------|-----------|---------------------|---------------------|---------------|
| 3 Monate | 0.67 | 1.09 | -0.42 | | |
| YTD | 0.67 | 1.09 | -0.42 | | |
| Letzte 12 Monate | 3.74 | 4.54 | -0.79 | 1.61 | |
| 3 Jahre ² | 6.07 | 5.00 | 1.07 | 3.95 | |
| 5 Jahre ² | N.a. | N.a. | N.a. | N.a. | |
| 10 Jahre ² | N.a. | N.a. | N.a. | N.a. | |
| 15 Jahre ² | N.a. | N.a. | N.a. | N.a. | |
| Seit Lancierung ² | 6.20 | 5.02 | 1.17 | 3.90 | |

¹ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

² annualisiert

Kennzahlen

| | | 31.03.2019 | 31.12.2018 |
|--|---------------|------------|------------|
| Nettovermögen | (in Mio. CHF) | 215.66 | 187.57 |
| Anzahl Ansprüche | | 177 791 | 155 667 |
| Kapitalwert ³ | (in CHF) | 1 190.93 | 1 046.01 |
| Laufender Ertrag ³ | (in CHF) | 22.05 | 158.91 |
| Inventarwert ³ | (in CHF) | 1 212.98 | 1 204.92 |
| ³ pro Anspruch | | | |
| Mietzinsausfallquote | (in %) | 3.17 | 5.03 |
| Fremdfinanzierungsquote | (in %) | 14.59 | 16.07 |
| EBIT-Marge | (in %) | 61.84 | 60.13 |
| TER _{ISA} 2018 (NAV) (inkl. MWST) | (in %) | 0.93 | |
| ROE | (in %) | 1.77 | 6.74 |
| ROIC | (in %) | 0.59 | 3.65 |

Diversifikation nach Nutzung per 31.03.2019⁴ (in %)



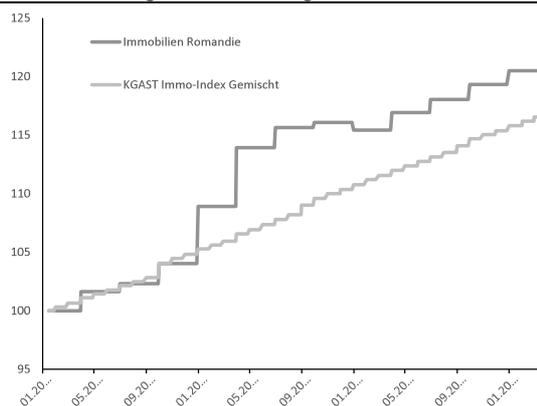
⁴ Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Diversifikation nach Kanton per 31.03.2019⁵ (in %)

| | |
|-----------|------|
| Waadt | 43.7 |
| Genf | 33.0 |
| Neuenburg | 11.7 |
| Wallis | 11.6 |

⁵ Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Wertentwicklung seit Lancierung



Zeichnung Rücknahme

Anlagegruppe bis auf weiteres für Zeichnungen offen. Rücknahmen können jederzeit bei der Helvetia Anlagestiftung angemeldet werden. Bei Zessionsmöglichkeit (vgl. Art. 22, Reglement) erfolgt die Abrechnung mit dem Nettoinventarwert des jeweiligen folgenden Quartalsendes.

| Gebühren | > TCHF 100 | > 2 Mio. | > 10 Mio. |
|-----------|------------|------------|------------|
| Erwerb | 3.75% | 3.75% | 3.75% |
| Rücknahme | Max. 2.50% | Max. 2.50% | Max. 2.50% |

Hypotheken Schweiz.

Rendite bei geringer Volatilität.

31.03.2019

Charakteristika

| | |
|----------------------|---|
| Gründungsjahr | 2018 |
| Valoren-Nr. | 40868027 (ISIN: CH0408680277) |
| Bloomberg | HYPSCSW SW |
| Benchmark | Swiss Bond Index (SBI) Total AAA-BBB 5-7Y, TR |
| Bewertung | Monatlich |
| Ausschüttungspolitik | Thesaurierend |
| Anlagestil | Aktiv |

Performance per 31.03.2019 (in %)

| | Anlagegruppe | Benchmark | Differenz |
|-----------------------|--------------|-----------|-----------|
| 1 Monat | 0.20 | 0.85 | -0.65 |
| 3 Monate | 0.30 | 1.41 | -1.11 |
| YTD | 0.30 | 1.41 | -1.11 |
| Letzte 12 Monate | N.a. | N.a. | N.a. |
| 3 Jahre ¹ | N.a. | N.a. | N.a. |
| 5 Jahre ¹ | N.a. | N.a. | N.a. |
| 10 Jahre ¹ | N.a. | N.a. | N.a. |
| 15 Jahre ¹ | N.a. | N.a. | N.a. |
| Seit Lancierung | 0.22 | 2.31 | -2.09 |

¹annualisiert

Kennzahlen

| | | 31.03.2019 |
|-------------------------------|---------------|------------|
| Nettovermögen | (in Mio. CHF) | 4.60 |
| Anzahl Ansprüche | | 4 600 |
| Kapitalwert ² | (in CHF) | 1001.17 |
| Laufender Ertrag ² | (in CHF) | -1.03 |
| Inventarwert ² | (in CHF) | 1 002.20 |

² pro Anspruch

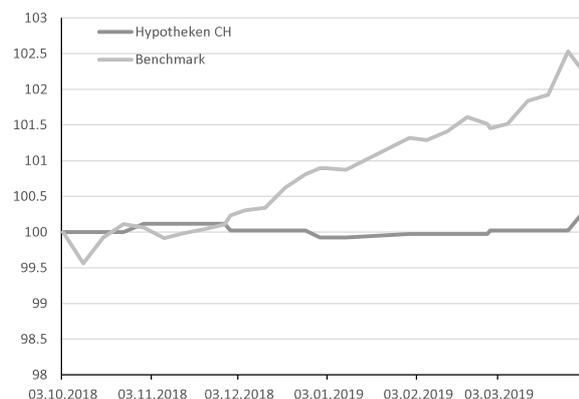
| | | |
|-----------------------------|-------------|------|
| TER (inkl. MWST) ex ante | (in % p.a.) | 0.30 |
| Ø-Restlaufzeit | (in Jahren) | 8.48 |
| Modified Duration | (in %) | 8.28 |
| Anzahl Hypotheken | | 10 |
| Durchschnittliche Belehnung | (in %) | 66.0 |
| Durchschnittlicher Zinssatz | (in % p.a.) | 1.22 |

Risikokennzahlen per 31.03.2019

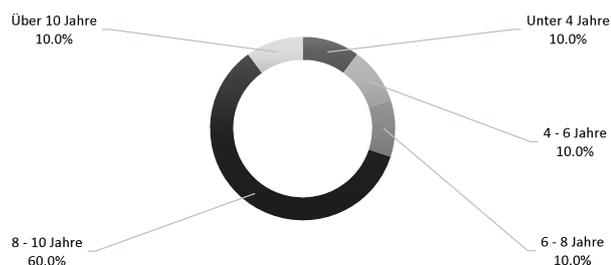
| | | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre |
|---------------------------------------|--------|--------|---------|---------|
| Volatilität ³ Anlagegruppe | (in %) | N.a. | N.a. | N.a. |
| Volatilität ³ Benchmark | (in %) | N.a. | N.a. | N.a. |

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Rendite)

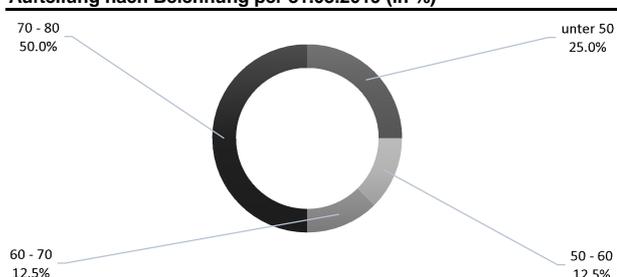
Wertentwicklung seit Lancierung



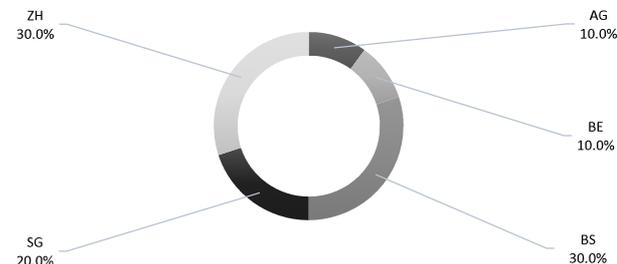
Aufteilung nach Restlaufzeiten per 31.03.2019



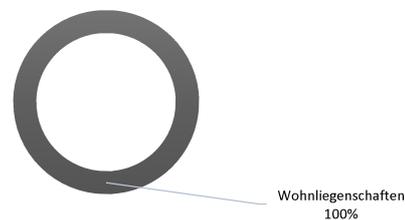
Aufteilung nach Belehnung per 31.03.2019 (in %)



Aufteilung Immobilien nach Kantonen per 31.03.2019



Aufteilung nach Nutzungsarten per 31.03.2019



Zeichnung und Rücknahme

Zeichnungen werden jederzeit entgegengenommen. Die Rücknahme von Ansprüchen erfolgt auf Quartalsende mit einer Ankündigungsfrist von 6 Monaten.

Gebühren

| | |
|-----------|------------|
| Erwerb | max. 0.25% |
| Rücknahme | max. 0.50% |