

# Aktien Schweiz Smart Beta Dynamisch 100.

Innovativ indexiert, intelligent investiert.

30.06.2019

## 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

Aktiensignal	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 30.06.2019 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	KGAST Ranking
1 Monat	4.21	3.75	0.46	
3 Monate	8.32	6.55	1.77	
YTD	21.87	21.84	0.03	
Letzte 12 Monate	7.94	15.98	-8.04	
3 Jahre <sup>1</sup>	14.53	11.42	3.11	<b>1. Rang</b>
5 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	
10 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	
Seit Lancierung <sup>1</sup>	10.93	6.50	4.43	

<sup>1</sup> annualisiert

## Kennzahlen

		30.06.2019	31.12.2018
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	102.16	49.39
Anzahl Ansprüche		68 417	40 314
Kapitalwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 458.41	1 151.91
Laufender Ertrag <sup>2</sup>	(in CHF)	34.78	73.30
Inventarwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 493.19	1 225.21
TER (inkl. MWST)	(in %)	0.58	

<sup>2</sup> pro Anspruch

## Risikokennzahlen per 30.06.2019 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität <sup>3</sup>	(in %)	15.10	10.49	N.a.
Tracking Error	(in %)	3.36	4.56	N.a.
Beta		0.97	0.92	N.a.
Sharpe Ratio		0.09	0.75	N.a.
Information Ratio		-2.39	0.68	N.a.
Jensen-Alpha		-0.08	0.04	N.a.
Max. Drawdown		-14.17	-14.17	N.a.
Recovery Period	(in Tagen)	120	120	N.a.

<sup>3</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

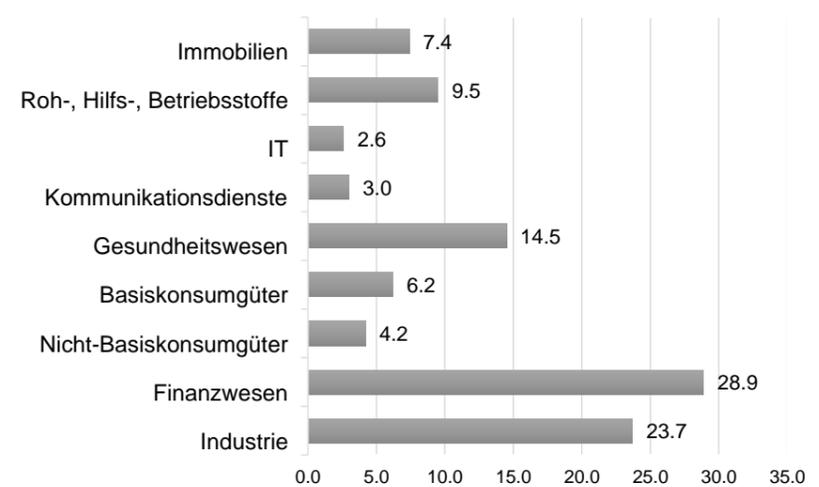
## 10 grösste Positionen per 30.06.2019 (in %)

PSP Swiss Property AG N	4.35
Swiss Life Holding AG N	4.22
Helvetia Holding AG N	3.96
Roche Holding AG G	3.89
Zurich Insurance Group AG N	3.86
Novartis AG N	3.43
Partners Group Holding AG N	3.19
Nestle AG N	3.10
Swiss Prime Site AG N	3.02
Straumann Holding AG N	2.99

## Wertenwicklung seit Lancierung



## Branchenstruktur per 30.06.2019 (in %)



## 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

Erwerb	-
Rücknahme	-

## BVG-Mix.

Gut diversifiziert.

30.06.2019

### 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

### Performance per 30.06.2019 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	KGAST Ranking
1 Monat	1.28	1.34	-0.06	
3 Monate	2.20	2.44	-0.24	
YTD	7.66	8.44	-0.79	<b>2. Rang</b>
Letzte 12 Monate	4.89	6.21	-1.32	<b>2. Rang</b>
3 Jahre <sup>1</sup>	3.12	3.94	-0.82	
5 Jahre <sup>1</sup>	3.31	4.15	-0.84	
10 Jahre <sup>1</sup>	4.28	4.94	-0.66	
15 Jahre <sup>1</sup>	3.65	4.19	-0.54	
Seit Lancierung <sup>1</sup>	4.55	4.92	-0.38	

<sup>1</sup> annualisiert

### Kennzahlen

		30.06.2019	31.12.2018
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	17.48	14.85
Anzahl Ansprüche		16 154	14 779
Kapitalwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 072.78	953.71
Laufender Ertrag <sup>2</sup>	(in CHF)	9.02	51.15
Inventarwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 081.80	1 004.86
TER 2018 (inkl. MWST)	(in %)	0.53	

<sup>2</sup> pro Anspruch

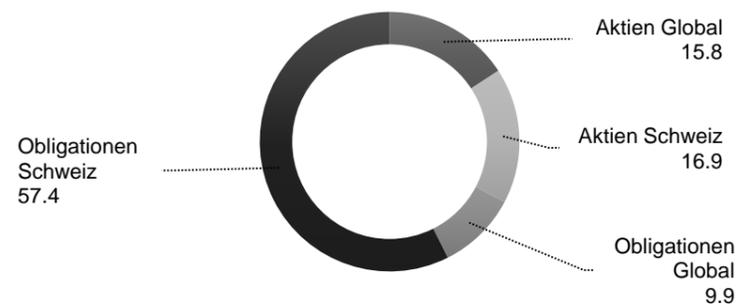
### Risikokennzahlen per 30.06.2019 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität <sup>3</sup>	(in %)	4.55	3.53	4.05
Tracking Error	(in %)	0.86	0.53	0.45
Beta		0.93	0.97	0.99
Sharpe Ratio		1.71	1.70	1.52
Information Ratio		-1.53	-1.54	-1.86
Jensen-Alpha		-0.01	-0.01	-0.01
Max. Drawdown		-3.34	-3.80	-12.50
Recovery Period	(in Tagen)	59	59	N.a.
Modified Duration <sup>4</sup>	(in %)	7.25		

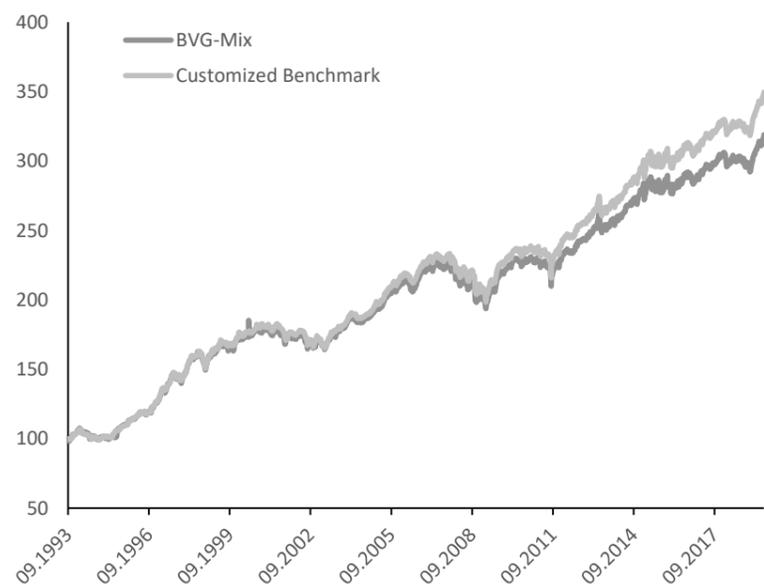
<sup>3</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

<sup>4</sup> Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 31.03.2019

### Anlageklassenstruktur per 30.06.2019 (in %)



### 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

Erwerb	0.00%
Rücknahme	0.25%

# BVG-Mix Plus 30.

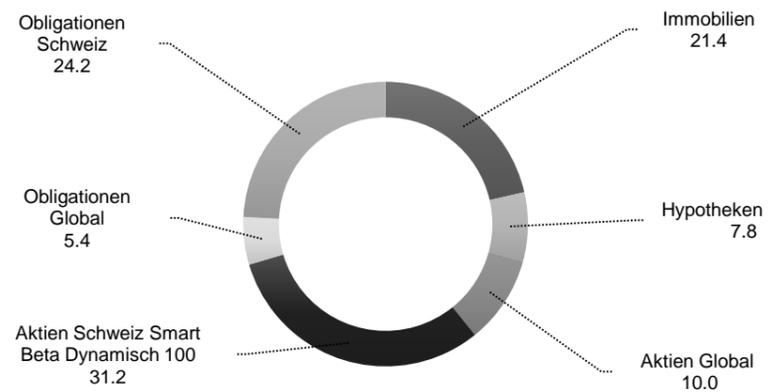
Renditeorientiert.

30.06.2019

## 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

## Anlageklassenstruktur per 30.06.2019 (in %)



## Performance per 30.06.2019 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	KGAST Ranking
1 Monat	1.69	1.41	0.28	
3 Monate	3.31	2.65	0.66	
YTD	9.22	8.81	0.41	<b>4. Rang</b>
Letzte 12 Monate	3.69	7.29	-3.60	
3 Jahre <sup>1</sup>	4.41	5.37	-0.96	
5 Jahre <sup>1</sup>	4.33	4.85	-0.52	<b>3. Rang</b>
10 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	
15 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	
Seit Lancierung <sup>1</sup>	4.30	5.16	-0.85	

<sup>1</sup> annualisiert

## Kennzahlen

		30.06.2019	31.12.2018
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	196.47	68.07
Anzahl Ansprüche		161 072	60 953
Kapitalwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 214.22	1 103.25
Laufender Ertrag <sup>2</sup>	(in CHF)	5.56	13.57
Inventarwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 219.78	1 116.82
TER 2018 (inkl. MWST)	(in %)	0.86	

<sup>2</sup> pro Anspruch

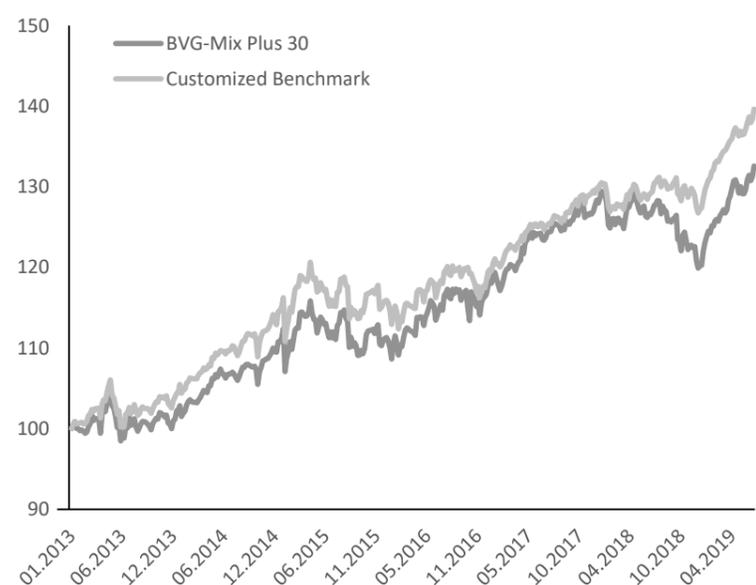
## Risikokennzahlen per 30.06.2019 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität <sup>3</sup>	(in %)	6.35	4.62	4.70
Tracking Error	(in %)	2.23	1.93	1.81
Beta		1.15	1.13	0.99
Sharpe Ratio		0.37	0.67	0.64
Information Ratio		-1.61	-0.49	-0.29
Jensen-Alpha		-0.05	-0.01	0.00
Max. Drawdown		-6.26	-6.26	-6.26
Recovery Period	(in Tagen)	120	120	120
Modified Duration <sup>4</sup>	(in %)	7.25		

<sup>3</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

<sup>4</sup> 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

Erwerb	0.00%
Rücknahme	0.50%

# Immobilien Schweiz.

Nachhaltig stabile Renditen, geringe Volatilität.

30.06.2019

## 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 Diversifikation	- mind. 2/3 Wohnimmobilien - max. 1/3 Geschäftsimmobilien

## Performance per 30.06.2019 (in %)

	Anlage- gruppe	Bench- mark	Diff. zum Benchmar	Risiko <sup>1</sup>	KGAST Ranking
3 Monate	0.66	1.01	-0.35		
YTD	1.25	2.10	-0.85		
Letzte 12 Monate	3.32	4.50	-1.19	1.63	
3 Jahre <sup>2</sup>	3.67	5.00	-1.32	1.74	
5 Jahre <sup>2</sup>	3.39	4.94	-1.55	1.55	
10 Jahre <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.	
15 Jahre <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.	
Seit Lancierung <sup>2</sup>	3.63	5.02	-1.38	1.68	

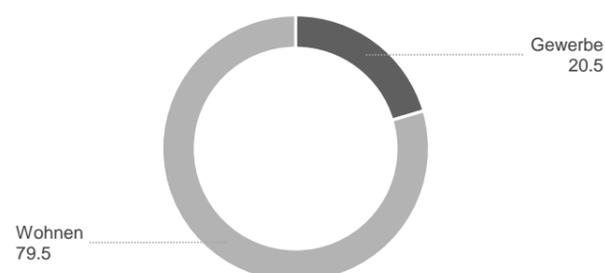
<sup>1</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

<sup>2</sup> annualisiert

## Kennzahlen

		30.06.2019	31.12.2018
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	611.28	602.56
Anzahl Ansprüche		480 408	479 465
Kapitalwert <sup>3</sup>	(in CHF)	1 256.26	1 015.79
Laufender Ertrag <sup>3</sup>	(in CHF)	16.17	240.94
Inventarwert <sup>3</sup>	(in CHF)	1 272.43	1 256.73
<sup>3</sup> pro Anspruch			
Mietzinsausfallquote	(in %)	12.39	10.61
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	-	-
EBIT-Marge	(in %)	67.22	67.79
TER <sub>ISA</sub> 2018 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)	0.61	-
ROE	(in %)	1.29	7.15
ROIC	(in %)	1.23	3.51

## Diversifikation nach Nutzung per 30.06.2019<sup>4</sup> (in %)



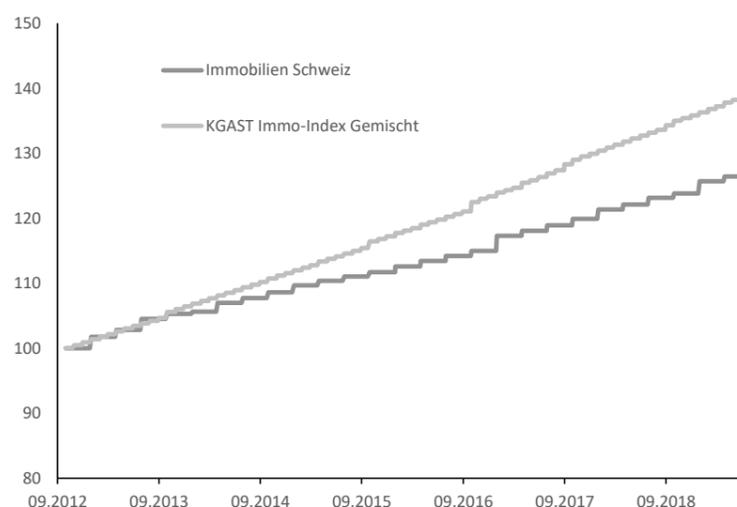
<sup>4</sup> Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

## Diversifikation nach Kanton per 30.06.2019<sup>5</sup> (in %)

Aargau	22.6	Jura	3.7
Zürich	15.9	Thurgau	3.4
Waadt	10.6	Schaffhausen	3.0
Bern	10.1	Solothurn	1.3
Schwyz	8.1	Neuenburg	1.2
Genf	7.3	Zug	1.1
Basel-Stadt	6.7	Basel-Landschaft	1.0
St. Gallen	4.0		

<sup>5</sup> Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

## Wertentwicklung seit Lancierung



## Zeichnung und Rücknahme

Anlagegruppe geschlossen (jeweils bei 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

Erwerb	0.00%
Rücknahme	Max. 2.50%

# Immobilien Romandie.

Nachhaltig stabile Renditen, geringe Volatilität.

30.06.2019

## 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 Diversifikation	- mind. ¾ Wohnimmobilien - max. ¼ Geschäftsimmobilien

## Performance per 30.06.2019 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	Risiko <sup>1</sup>	KGAST Ranking
3 Monate	0.89	1.01	-0.12		
YTD	1.56	2.10	-0.54		
Letzte 12 Monate	3.66	4.50	-0.85	1.57	
3 Jahre <sup>2</sup>	6.15	5.00	1.15	3.95	<b>1. Rang</b>
5 Jahre <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.	
10 Jahre <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.	
15 Jahre <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.	
Seit Lancierung <sup>2</sup>	6.01	4.96	1.05	3.78	

<sup>1</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

<sup>2</sup> annualisiert

## Kennzahlen

		30.06.2019	31.12.2018
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	217.57	187.57
Anzahl Ansprüche		177 791	155 667
Kapitalwert <sup>3</sup>	(in CHF)	1 190.90	1 046.01
Laufender Ertrag <sup>3</sup>	(in CHF)	32.84	158.91
Inventarwert <sup>3</sup>	(in CHF)	1 223.74	1 204.92
<sup>3</sup> pro Anspruch			
Mietzinsausfallquote	(in %)	3.40	5.03
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	19.19	16.07
EBIT-Marge	(in %)	65.99	60.13
TER <sub>ISA</sub> 2018 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)	0.93	
ROE	(in %)	2.68	6.74
ROIC	(in %)	1.32	3.65

## Diversifikation nach Nutzung per 30.06.2019<sup>4</sup> (in %)



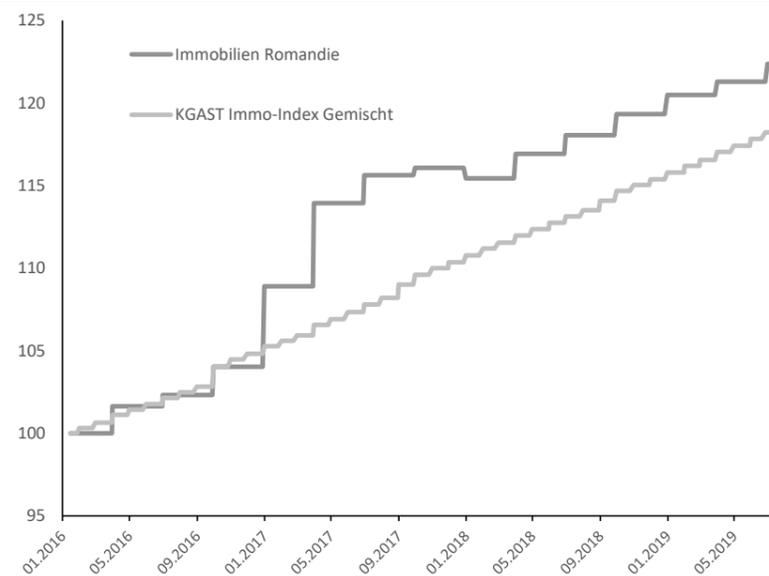
<sup>4</sup> Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

## Diversifikation nach Kanton per 30.06.2019<sup>5</sup> (in %)

Waadt	45.7
Genf	31.8
Neuenburg	11.3
Wallis	11.2

<sup>5</sup> 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

Erwerb	0.00%
Rücknahme	Max. 2.50%

# Hypotheken Schweiz.

Rendite bei geringer Volatilität.

30.06.2019

## Charakteristika

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

## Performance per 30.06.2019 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Differenz	KGAST
1 Monat	0.54	0.32	0.22	
3 Monate	1.88	1.10	0.78	
YTD	2.18	2.52	-0.34	<b>1. Rang</b>
Letzte 12 Monate	N.a.	N.a.	n.a.	
3 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	n.a.	
5 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	n.a.	
10 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	n.a.	
15 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	n.a.	
Seit Lancierung	2.11	3.44	-1.33	

<sup>1</sup> annualisiert

## Kennzahlen

		30.06.2019
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	20.02
Anzahl Ansprüche		19 602
Kapitalwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1018.50
Laufender Ertrag <sup>2</sup>	(in CHF)	2.58
Inventarwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 021.08

<sup>2</sup> pro Anspruch

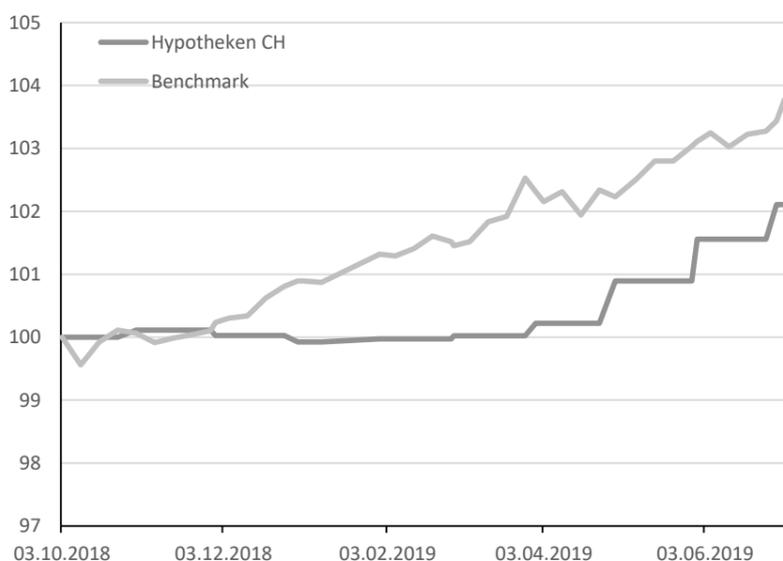
TER (inkl. MWST) ex ante	(in % p.a.)	0.30
Ø-Restlaufzeit	(in Jahren)	8.59
Modified Duration	(in %)	8.39
Anzahl Hypotheken		40
Durchschnittliche Belehnung	(in %)	65.6
Durchschnittlicher Zinssatz	(in % p.a.)	0.99

## Risikokennzahlen per 30.06.2019

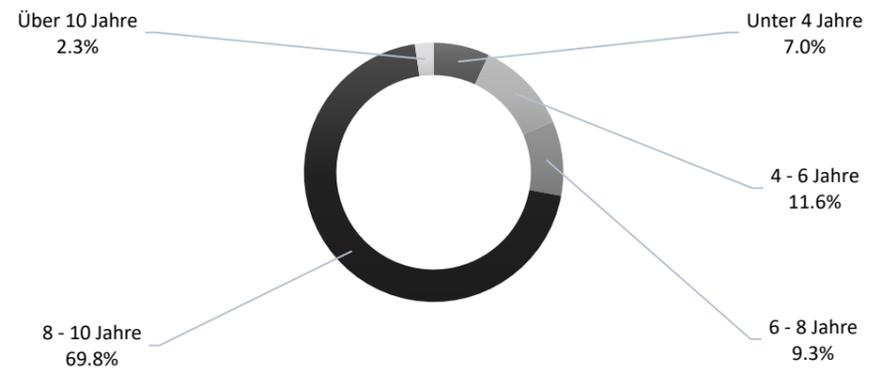
		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität <sup>3</sup> Anlagegruppe	(in %)	N.a.	N.a.	N.a.
Volatilität <sup>3</sup> Benchmark	(in %)	N.a.	N.a.	N.a.

<sup>3</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Rendite)

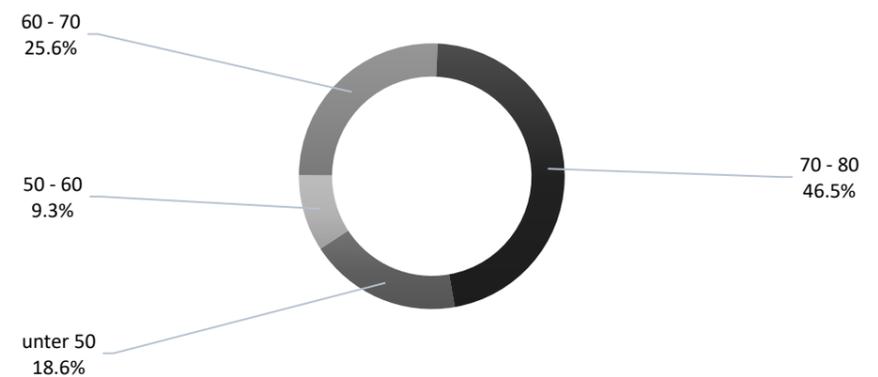
## Wertentwicklung seit Lancierung



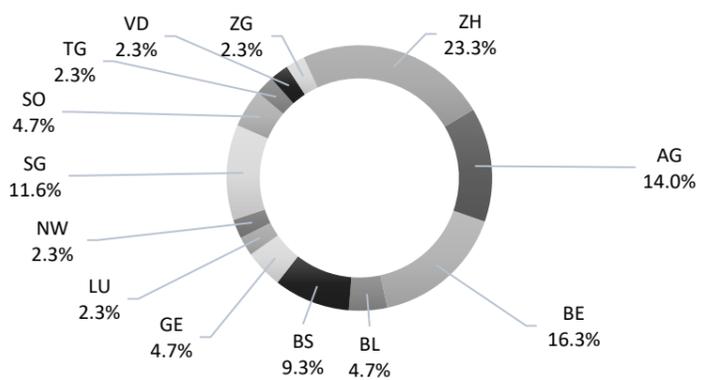
## Aufteilung nach Restlaufzeiten per 30.06.2019



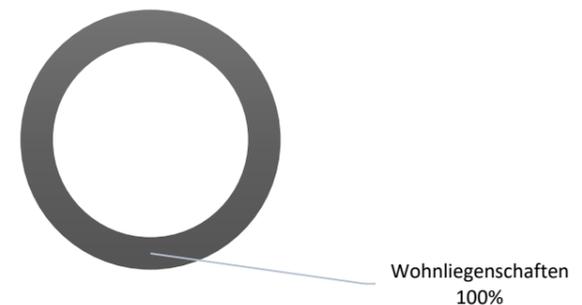
## Aufteilung nach Belehnung per 30.06.2019 (in %)



## Aufteilung Immobilien nach Kantonen per 30.06.2019



## Aufteilung nach Nutzungsarten per 30.06.2019



## 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%