

Aktien Schweiz Smart Beta Dynamisch 100.

Innovativ indexiert, intelligent investiert.

30.09.2019

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 30.09.2019 (in %)

| | Anlagegruppe | Benchmark | Diff. zum Benchmark | KGAST Ranking |
|------------------------------|--------------|-----------|---------------------|---------------|
| 1 Monat | 2.68 | 1.43 | 1.25 | |
| 3 Monate | 1.38 | 2.14 | -0.76 | |
| YTD | 23.55 | 24.45 | -0.90 | |
| Letzte 12 Monate | 7.89 | 13.19 | -5.30 | |
| 3 Jahre ¹ | 12.79 | 11.26 | 1.53 | |
| 5 Jahre ¹ | N.a. | N.a. | N.a. | |
| 10 Jahre ¹ | N.a. | N.a. | N.a. | |
| Seit Lancierung ¹ | 10.60 | 6.64 | 3.96 | |

¹annualisiert

Kennzahlen

| | | 30.09.2019 | 31.12.2018 |
|-------------------------------|---------------|------------|------------|
| Nettvermögen | (in Mio. CHF) | 102.04 | 49.39 |
| Anzahl Ansprüche | | 67 407 | 40 314 |
| Kapitalwert ² | (in CHF) | 1 479.30 | 1 151.91 |
| Laufender Ertrag ² | (in CHF) | 34.47 | 73.30 |
| Inventarwert ² | (in CHF) | 1 513.77 | 1 225.21 |
| TER (inkl. MWST) | (in %) | 0.58 | |

² pro Anspruch

Risikokennzahlen per 30.09.2019 (in %)

| | | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre |
|--------------------------|------------|--------|---------|---------|
| Volatilität ³ | (in %) | 14.96 | 10.56 | N.a. |
| Tracking Error | (in %) | 3.33 | 4.57 | N.a. |
| Beta | | 0.84 | 0.93 | N.a. |
| Sharpe Ratio | | 0.23 | 0.78 | N.a. |
| Information Ratio | | -1.59 | 0.34 | N.a. |
| Jensen-Alpha | | -0.04 | 0.02 | N.a. |
| Max. Drawdown | | -12.67 | -14.17 | N.a. |
| Recovery Period | (in Tagen) | 120 | 120 | N.a. |

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

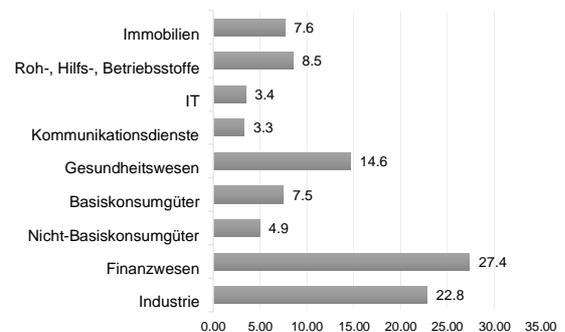
10 grösste Positionen per 30.09.2019 (in %)

| | |
|-----------------------------|------|
| PSP Swiss Property AG N | 4.83 |
| Swiss Life Holding AG N | 3.97 |
| Sonova Holding AG N | 3.49 |
| UBS Group AG N | 3.38 |
| Novartis AG N | 3.33 |
| Roche Holding AG G | 3.20 |
| Partners Group Holding AG N | 3.18 |
| Geberit AG N | 3.15 |
| Helvetia Holding AG N | 3.07 |
| Nestle AG N | 2.99 |

Wertenwicklung seit Lancierung



Branchenstruktur per 30.09.2019 (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 | 0.00% |
| Rücknahme | 0.00% |

BVG-Mix.

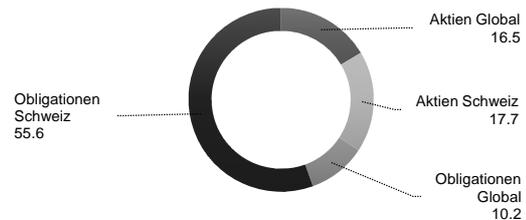
Gut diversifiziert.

30.09.2019

Charakteristika

| | |
|-------------------------------|--|
| Gründungsjahr | 1993 |
| Valoren-Nr. | 1176860 (ISIN: CH0011768600) |
| Bloomberg | PATBVMG 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 30.09.2019 (in %)



Performance per 30.09.2019 (in %)

| | Anlage- gruppe | Benchmark | Diff. zum Benchmark | KGAST Ranking |
|------------------------------|-------------------|-----------|------------------------|------------------|
| 1 Monat | -0.27 | -0.51 | 0.24 | |
| 3 Monate | 2.03 | 2.24 | -0.21 | |
| YTD | 9.85 | 10.87 | -1.03 | |
| Letzte 12 Monate | 7.00 | 8.60 | -1.60 | |
| 3 Jahre ¹ | 3.39 | 4.32 | -0.92 | |
| 5 Jahre ¹ | 3.30 | 4.15 | -0.86 | |
| 10 Jahre ¹ | 3.87 | 4.56 | -0.69 | |
| 15 Jahre ¹ | 3.71 | 4.27 | -0.56 | |
| Seit Lancierung ¹ | 4.58 | 4.96 | -0.38 | |

¹ annualisiert

Kennzahlen

| | | 30.09.2019 | 31.12.2018 |
|-------------------------------|---------------|------------|------------|
| Nettovermögen | (in Mio. CHF) | 17.34 | 14.85 |
| Anzahl Ansprüche | | 15 709 | 14 779 |
| Kapitalwert ² | (in CHF) | 1 095.63 | 953.71 |
| Laufender Ertrag ² | (in CHF) | 8.16 | 51.15 |
| Inventarwert ² | (in CHF) | 1 103.79 | 1 004.86 |
| TER 2018 (inkl. MWST) | (in %) | 0.53 | |

² pro Anspruch

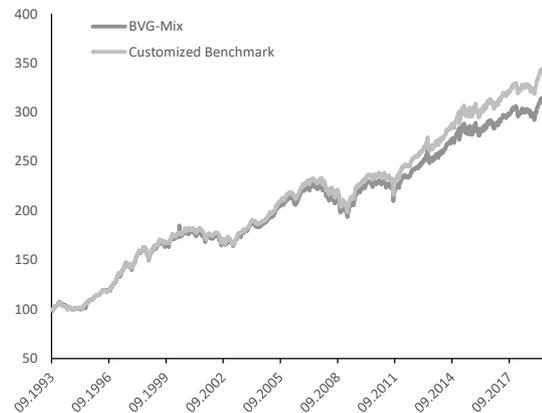
Risikokennzahlen per 30.09.2019 (in %)

| | | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre |
|--------------------------------|------------|--------|---------|---------|
| Volatilität ³ | (in %) | 4.52 | 3.61 | 4.06 |
| Tracking Error | (in %) | 0.93 | 0.59 | 0.50 |
| Beta | | 0.90 | 0.96 | 0.99 |
| Sharpe Ratio | | 2.22 | 1.78 | 1.55 |
| Information Ratio | | -1.72 | -1.58 | -1.73 |
| Jensen-Alpha | | 0.00 | -0.01 | -0.01 |
| Max. Drawdown | | -2.59 | -3.80 | -12.50 |
| Recovery Period | (in Tagen) | 59 | 59 | N.a. |
| Modified Duration ⁴ | (in %) | 7.55 | | |

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

⁴ Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 30.06.2019

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 | 0.25% |

BVG-Mix Plus 30.

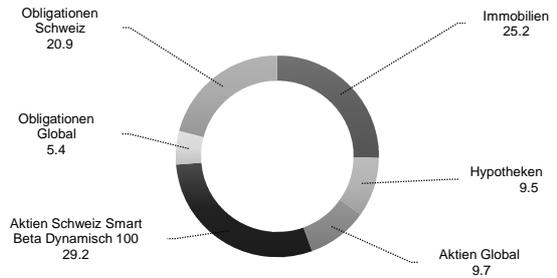
Renditeorientiert.

30.09.2019

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 30.09.2019 (in %)



Performance per 30.09.2019 (in %)

| | Anlage-gruppe | Benchmark | Diff. zum Benchmark | KGAST Ranking |
|------------------------------|---------------|-----------|---------------------|---------------|
| 1 Monat | 0.74 | 0.20 | 0.54 | |
| 3 Monate | 1.49 | 1.88 | -0.39 | |
| YTD | 10.85 | 10.95 | -0.11 | |
| Letzte 12 Monate | 5.69 | 8.04 | -2.35 | |
| 3 Jahre ¹ | 4.40 | 5.65 | -1.25 | |
| 5 Jahre ¹ | 4.37 | 4.83 | -0.47 | |
| 10 Jahre ¹ | N.a. | N.a. | N.a. | |
| 15 Jahre ¹ | N.a. | N.a. | N.a. | |
| Seit Lancierung ¹ | 4.37 | 5.26 | -0.90 | |

¹ annualisiert

Kennzahlen

| | | 30.09.2019 | 31.12.2018 |
|-------------------------------|---------------|------------|------------|
| Nettovermögen | (in Mio. CHF) | 205.66 | 68.07 |
| Anzahl Ansprüche | | 166 129 | 60 953 |
| Kapitalwert ² | (in CHF) | 1 233.09 | 1 103.25 |
| Laufender Ertrag ² | (in CHF) | 4.86 | 13.57 |
| Inventarwert ² | (in CHF) | 1 237.95 | 1 116.82 |
| TER 2018 (inkl. MWST) | (in %) | 0.86 | |

² pro Anspruch

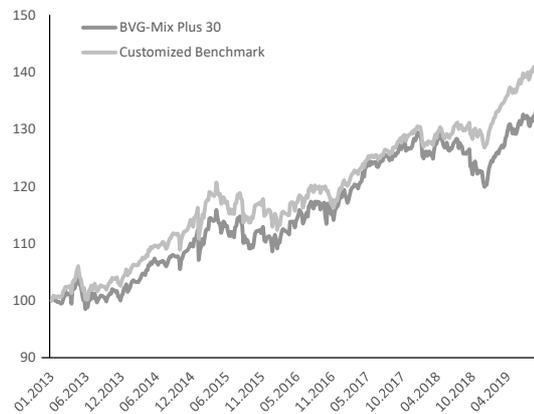
Risikokennzahlen per 30.09.2019 (in %)

| | | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre |
|--------------------------------|------------|--------|---------|---------|
| Volatilität ³ | (in %) | 6.02 | 4.62 | 4.69 |
| Tracking Error | (in %) | 2.25 | 1.98 | 1.83 |
| Beta | | 1.12 | 1.12 | 0.98 |
| Sharpe Ratio | | 0.89 | 0.88 | 0.85 |
| Information Ratio | | -1.04 | -0.63 | -0.26 |
| Jensen-Alpha | | -0.03 | -0.02 | 0.00 |
| Max. Drawdown | | -4.65 | -6.26 | -6.26 |
| Recovery Period | (in Tagen) | 90 | 120 | 120 |
| Modified Duration ⁴ | (in %) | 7.50 | | |

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

⁴ Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 30.06.2019

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

| | |
|-----------|-------|
| Erwerb | 0.00% |
| Rücknahme | 0.50% |

Immobilien Schweiz.

Nachhaltig stabile Renditen, geringe Volatilität.

30.09.2019

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. ¾ Wohnimmobilien - max. ¼ Geschäftsimmobilien |

Performance per 30.09.2019 (in %)

| | Anlage- gruppe | Bench- mark | Diff. zum Benchmar | Risiko ¹ | KGAST Ranking |
|------------------------------|-------------------|----------------|-----------------------|---------------------|------------------|
| 3 Monate | 0.73 | 1.47 | -0.75 | | |
| YTD | 1.99 | 3.61 | -1.62 | | |
| Letzte 12 Monate | 3.53 | 4.61 | -1.08 | 1.68 | |
| 3 Jahre ² | 3.69 | 4.86 | -1.17 | 1.74 | |
| 5 Jahre ² | 3.37 | 4.98 | -1.62 | 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 | 3.61 | 5.05 | -1.45 | 1.67 | |

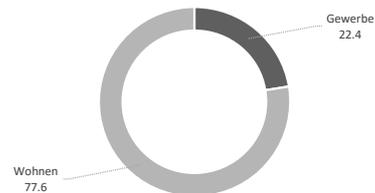
¹ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

² annualisiert

Kennzahlen

| | | 30.09.2019 | 31.12.2018 |
|---|---------------|------------|------------|
| Nettovermögen | (in Mio. CHF) | 615.74 | 602.56 |
| Anzahl Ansprüche | | 480 408 | 479 465 |
| Kapitalwert ³ | (in CHF) | 1 256.25 | 1 015.79 |
| Laufender Ertrag ³ | (in CHF) | 25.45 | 240.94 |
| Inventarwert ³ | (in CHF) | 1 281.70 | 1 256.73 |
| ³ pro Anspruch | | | |
| Mietzinsausfallquote | (in %) | 12.44 | 10.61 |
| Fremdfinanzierungsquote | (in %) | 0.81 | - |
| EBIT-Marge | (in %) | 70.23 | 67.79 |
| TER _{SA} 2018 (NAV) (inkl. MWST) | (in %) | 0.61 | - |
| ROE | (in %) | 2.03 | 7.15 |
| ROIC | (in %) | 1.94 | 3.51 |

Diversifikation nach Nutzung per 30.09.2019⁴ (in %)



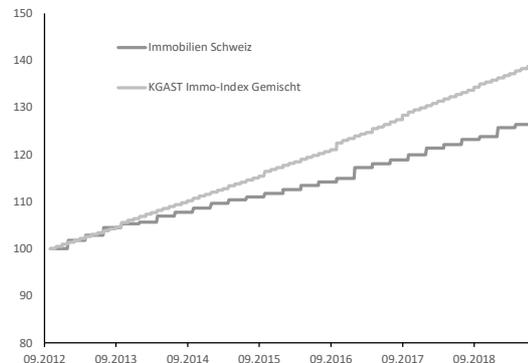
⁴ Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Diversifikation nach Kanton per 30.09.2019⁵ (in %)

| | | | |
|-------------|------|------------------|-----|
| Aargau | 22.5 | St. Gallen | 3.8 |
| Zürich | 15.3 | Jura | 3.6 |
| Waadt | 10.0 | Schaffhausen | 1.2 |
| Bern | 9.7 | Solothurn | 1.2 |
| Schwyz | 7.8 | Neuenburg | 1.2 |
| Genf | 7.0 | Zug | 1.1 |
| Basel-Stadt | 6.4 | Basel-Landschaft | 0.9 |
| Thurgau | 6.1 | | |

⁵ 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 Anlagengestiftung 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.

30.09.2019

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 30.09.2019 (in %)

| | Anlagegruppe | Benchmark | Diff. zum Benchmark | Risiko ¹ | KGAST Ranking |
|------------------------------|--------------|-----------|---------------------|---------------------|---------------|
| 3 Monate | 0.65 | 1.47 | -0.82 | | |
| YTD | 2.23 | 3.61 | -1.38 | | |
| Letzte 12 Monate | 3.22 | 4.61 | -1.39 | 1.39 | |
| 3 Jahre ² | 5.79 | 4.86 | 0.93 | 3.89 | |
| 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 | 5.78 | 5.03 | 0.75 | 3.66 | |

¹ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

² annualisiert

Kennzahlen

| | | 30.09.2019 | 31.12.2018 |
|--|---------------|------------|------------|
| Nettvermögen | (in Mio. CHF) | 236.17 | 187.57 |
| Anzahl Ansprüche | | 191 734 | 155 667 |
| Kapitalwert ³ | (in CHF) | 1 188.49 | 1 046.01 |
| Laufender Ertrag ³ | (in CHF) | 43.25 | 158.91 |
| Inventarwert ³ | (in CHF) | 1 231.74 | 1 204.92 |
| ³ pro Anspruch | | | |
| Mietzinsausfallquote | (in %) | 3.45 | 5.03 |
| Fremdfinanzierungsquote | (in %) | 17.74 | 16.07 |
| EBIT-Marge | (in %) | 68.29 | 60.13 |
| TER _{ISA} 2018 (NAV) (inkl. MWST) | (in %) | 0.93 | |
| ROE | (in %) | 3.35 | 6.74 |
| ROIC | (in %) | 1.88 | 3.65 |

Diversifikation nach Nutzung per 30.09.2019* (in %)



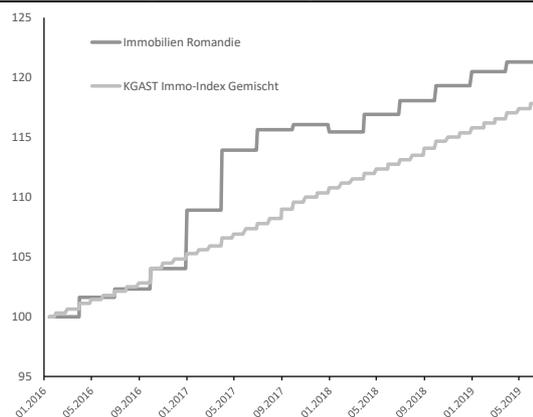
* Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Diversifikation nach Kanton per 30.09.2019* (in %)

| | |
|-----------|------|
| Waadt | 47.5 |
| Genf | 31.6 |
| Neuenburg | 10.5 |
| Wallis | 10.4 |

* 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.

30.09.2019

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 30.09.2019 (in %)

| | Anlagegruppe | Benchmark | Differenz |
|-----------------------|--------------|-----------|-----------|
| 1 Monat | 0.45 | -1.28 | 1.73 |
| 3 Monate | 1.96 | 0.57 | 1.39 |
| YTD | 4.19 | 3.11 | 1.08 |
| 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 | 4.11 | 4.03 | 0.08 |

¹annualisiert

Kennzahlen

| | | 30.09.2019 |
|-------------------------------|---------------|------------|
| Nettovermögen | (in Mio. CHF) | 25.59 |
| Anzahl Ansprüche | | 24 584 |
| Kapitalwert ² | (in CHF) | 1036.64 |
| Laufender Ertrag ² | (in CHF) | 4.44 |
| Inventarwert ² | (in CHF) | 1 041.08 |

² pro Anspruch

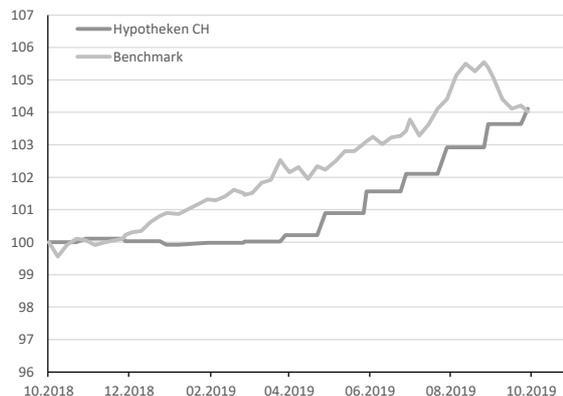
| | | |
|-----------------------------|-------------|------|
| TER (inkl. MWST) ex ante | (in % p.a.) | 0.30 |
| Ø-Restlaufzeit | (in Jahren) | 8.62 |
| Modified Duration | (in %) | 8.56 |
| Anzahl Hypotheken | | 47 |
| Durchschnittliche Belehnung | (in %) | 62.6 |
| Durchschnittlicher Zinssatz | (in % p.a.) | 0.97 |

Risikokennzahlen per 30.09.2019

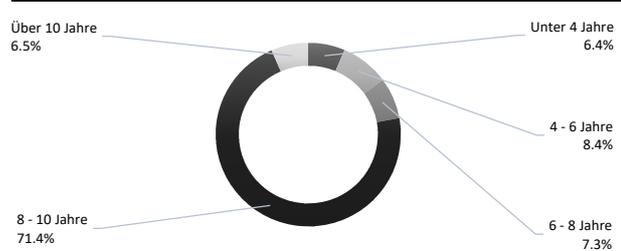
| | | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre |
|---------------------------------------|--------|--------|---------|---------|
| Volatilität ³ Anlagegruppe | (in %) | N.a. | N.a. | N.a. |
| Volatilität ³ Benchmark | (in %) | N.a. | N.a. | N.a. |

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Rendite)

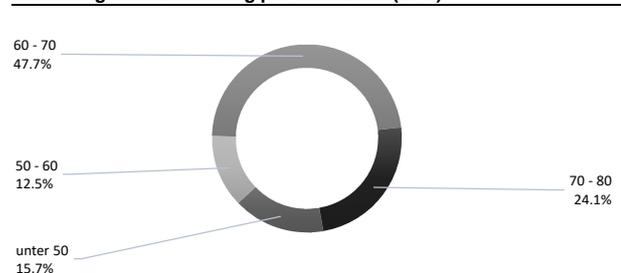
Wertentwicklung seit Lancierung



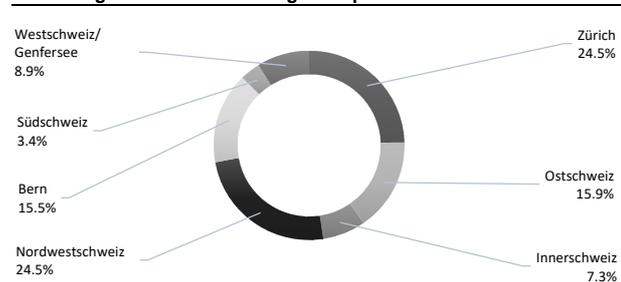
Aufteilung nach Restlaufzeiten per 30.09.2019



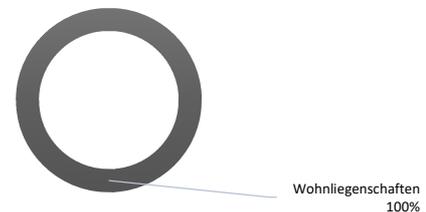
Aufteilung nach Belehnung per 30.09.2019 (in %)



Aufteilung Immobilien nach Regionen per 30.09.2019



Aufteilung nach Nutzungsarten per 30.09.2019



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% |