

Aktien Schweiz Smart Beta Dynamisch 100.

Innovativ indexiert, intelligent investiert.

31.12.2019

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 31.12.2019 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	KGAST Ranking
1 Monat	1.72	1.27	0.45	
3 Monate	7.15	4.94	2.21	
YTD	32.39	30.59	1.80	
Letzte 12 Monate	32.39	30.59	1.80	
3 Jahre ¹	13.83	12.71	1.12	
5 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
10 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
Seit Lancierung ¹	11.71	7.42	4.29	

¹annualisiert

Kennzahlen

		31.12.2019	31.12.2018
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	106.75	49.39
Anzahl Ansprüche		65 808	40 314
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 590.48	1 151.91
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	31.59	73.30
Inventarwert ²	(in CHF)	1 622.07	1 225.21
TER (inkl. MWST)	(in %)	0.58	

² pro Anspruch

Risikokennzahlen per 31.12.2019 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	10.24	10.53	N.a.
Tracking Error	(in %)	4.63	4.21	N.a.
Beta		0.68	0.98	N.a.
Sharpe Ratio		3.29	1.43	N.a.
Information Ratio		0.39	0.27	N.a.
Jensen-Alpha		0.12	0.01	N.a.
Max. Drawdown		-2.66	-14.17	N.a.
Recovery Period	(in Tagen)	30	120	N.a.

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

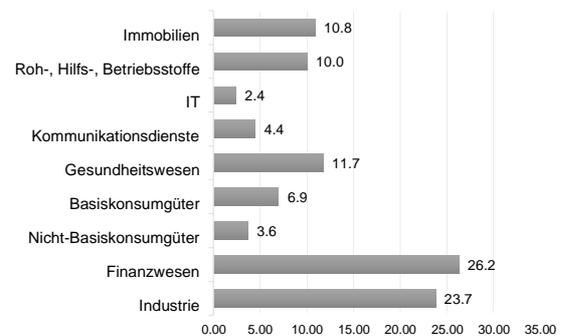
10 grösste Positionen per 31.12.2019 (in %)

PSP Swiss Property AG N	5.88
Swiss Prime Site N	4.95
Helvetia Holding AG N	4.08
Swiss Life Holding N	3.51
Zurich Insurance Group N	3.38
UBS Group AG N	3.05
BELIMO Holding N	3.02
Geberit AG N	2.98
Baloise Holding N	2.82
Roche Holding AG G	2.66

Wertenwicklung seit Lancierung



Branchenstruktur per 31.12.2019 (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.

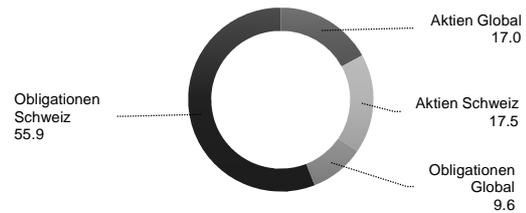
Gut diversifiziert.

31.12.2019

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 31.12.2019 (in %)



Performance per 31.12.2019 (in %)

	Anlage-gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	KGAST Ranking
1 Monat	-0.64	-0.83	0.19	
3 Monate	0.56	0.16	0.41	
YTD	10.46	11.05	-0.58	
Letzte 12 Monate	10.46	11.05	-0.58	
3 Jahre ¹	4.01	4.73	-0.72	
5 Jahre ¹	2.91	3.63	-0.72	
10 Jahre ¹	3.78	4.42	-0.64	
15 Jahre ¹	3.60	4.11	-0.51	
Seit Lancierung ¹	4.56	4.92	-0.36	

¹ annualisiert

Kennzahlen

		31.12.2019	31.12.2018
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	18.41	14.85
Anzahl Ansprüche		16 587	14 779
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 102.82	953.71
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	7.19	51.15
Inventarwert ²	(in CHF)	1 110.01	1 004.86
TER 2019 (inkl. MWST)	(in %)	0.35	

² pro Anspruch

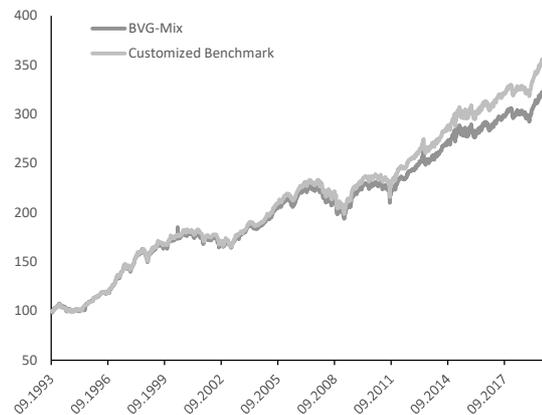
Risikokennzahlen per 31.12.2019 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	3.84	3.56	4.10
Tracking Error	(in %)	0.97	0.63	0.52
Beta		0.82	0.95	0.98
Sharpe Ratio		3.44	1.89	1.38
Information Ratio		-0.60	-1.16	-1.38
Jensen-Alpha		0.02	0.00	-0.01
Max. Drawdown		-0.89	-3.80	-12.50
Recovery Period	(in Tagen)	30	59	1 309
Modified Duration ⁴	(in %)	7.40		

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.

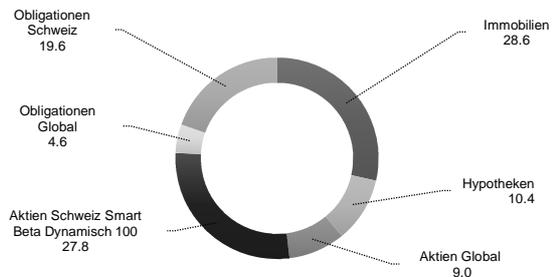
Renditeorientiert.

31.12.2019

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 31.12.2019 (in %)



Performance per 31.12.2019 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	KGAST Ranking
1 Monat	0.11	0.06	0.05	
3 Monate	2.31	1.52	0.79	
YTD	13.40	12.64	0.77	
Letzte 12 Monate	13.40	12.64	0.77	
3 Jahre ¹	4.93	6.23	-1.30	
5 Jahre ¹	4.25	4.56	-0.31	
10 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
15 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
Seit Lancierung ¹	4.55	5.30	-0.75	

¹ annualisiert

Kennzahlen

		31.12.2019	31.12.2018
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	224.66	68.07
Anzahl Ansprüche		177 384	60 953
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 262.22	1 103.25
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	4.29	13.57
Inventarwert ²	(in CHF)	1 266.51	1 116.82
TER 2019 (inkl. MWST)	(in %)	0.77	

² pro Anspruch

Risikokennzahlen per 31.12.2019 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	4.35	4.55	4.70
Tracking Error	(in %)	1.92	1.97	1.85
Beta		1.06	1.17	0.98
Sharpe Ratio		3.49	1.47	1.28
Information Ratio		0.40	-0.66	-0.17
Jensen-Alpha		0.00	-0.03	0.00
Max. Drawdown		-1.31	-6.26	-6.26
Recovery Period	(in Tagen)	30	120	120
Modified Duration ⁴	(in %)	7.36		

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	0.50%

Immobilien Schweiz.

Nachhaltig stabile Renditen, geringe Volatilität.

31.12.2019

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 31.12.2019 (in %)

	Anlage- gruppe	Bench- mark	Diff. zum Benchmar	Risiko ¹	KGAST Ranking
3 Monate	1.29	0.97	0.32		
YTD	3.30	4.62	-1.32		
Letzte 12 Monate	3.30	4.62	-1.32	1.51	
3 Jahre ²	3.45	4.79	-1.34	1.54	
5 Jahre ²	3.43	4.95	-1.52	1.58	
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	5.02	-1.35	1.66	

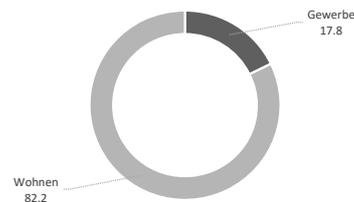
¹ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

² annualisiert

Kennzahlen

		31.12.2019	31.12.2018
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	798.88	602.56
Anzahl Ansprüche		615 371	479 465
Kapitalwert ³	(in CHF)	1 264.68	1 015.79
Laufender Ertrag ³	(in CHF)	33.52	240.94
Inventarwert ³	(in CHF)	1 298.20	1 256.73
³ pro Anspruch			
Mietzinsausfallquote	(in %)	12.12	10.61
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	1.73	-
EBIT-Marge	(in %)	69.22	67.79
TER _{ISA} 2019 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)	0.57	-
ROE	(in %)	3.34	7.15
ROIC	(in %)	3.30	3.51

Diversifikation nach Nutzung per 31.12.2019⁴ (in %)



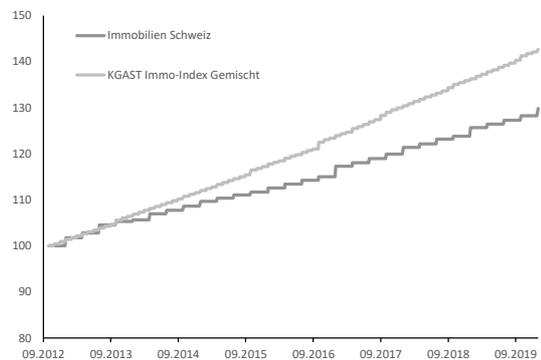
⁴ Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Diversifikation nach Kanton per 31.12.2019⁵ (in %)

Aargau	23.2	Thurgau	4.7
Zürich	14.7	Lucern	4.6
Bern	8.3	Solothurn	3.3
Waadt	7.7	St. Gallen	3.0
Basel-Stadt	6.8	Jura	2.7
Schwyz	6.0	Schaffhausen	2.5
Genf	5.7	Neuenburg	0.9
Basel-Landschaft	5.0	Zug	0.8

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 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.

31.12.2019

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. ¼ Wohnimmobilien - max. ¼ Geschäftsimmobilien

Performance per 31.12.2019 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	Risiko ¹	KGAST Ranking
3 Monate	0.69	0.97	-0.28		
YTD	2.93	4.62	-1.69		
Letzte 12 Monate	2.93	4.62	-1.69	1.25	
3 Jahre ²	4.43	4.79	-0.36	2.99	
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	5.59	4.96	0.63	3.56	

¹ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

² annualisiert

Kennzahlen

		31.12.2019	31.12.2018
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	250.50	187.57
Anzahl Ansprüche		201 980	155 667
Kapitalwert ³	(in CHF)	1 190.20	1 046.01
Laufender Ertrag ³	(in CHF)	50.03	158.91
Inventarwert ³	(in CHF)	1 240.23	1 204.92
³ pro Anspruch			
Mietzinsausfallquote	(in %)	3.64	5.03
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	13.03	16.07
EBIT-Marge	(in %)	64.30	60.13
TER _{SA} 2019 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)	0.88	-
ROE	(in %)	4.08	6.74
ROIC	(in %)	4.85	3.65

Diversifikation nach Nutzung per 31.12.2019⁴ (in %)



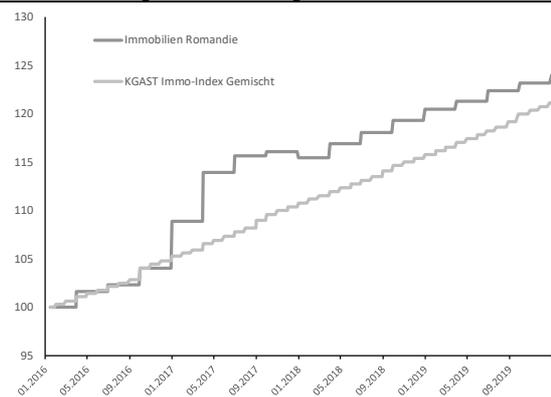
⁴ Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Diversifikation nach Kanton per 31.12.2019⁵ (in %)

Waadt	46.9
Genf	33.4
Wallis	10.0
Neuenburg	9.7

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	
Erwerb	0.00%
Rücknahme	Max. 2.50%

Hypotheken Schweiz.

Rendite bei geringer Volatilität.

31.12.2019

Charakteristika

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

Performance per 31.12.2019 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Differenz
1 Monat	0.05	-0.75	0.80
3 Monate	0.22	-1.17	1.39
YTD	4.41	1.90	2.51
Letzte 12 Monate	4.41	1.90	2.51
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	3.47	2.26	1.21

¹annualisiert

Kennzahlen

		31.12.2019
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	28.15
Anzahl Ansprüche		26 977
Inventarwert ²	(in CHF)	1 043.32

² pro Anspruch

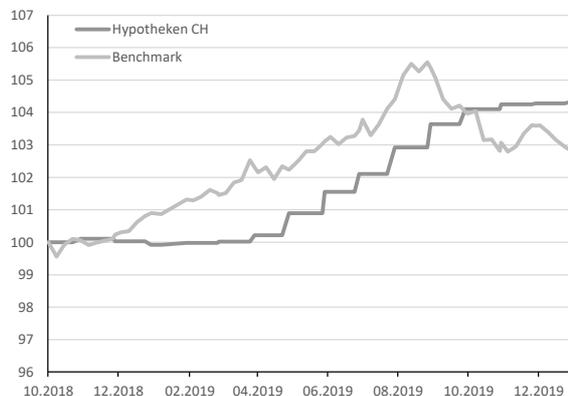
TER 2019 (inkl. MWST)	(in % p.a.)	0.39
Durchschnittliche Restlaufzeit	(in Jahren)	8.49
Modified Duration	(in %)	8.01
Anzahl Hypotheken		51
Durchschnittliche Belehnung	(in %)	62.7
Durchschnittlicher Zinssatz	(in % p.a.)	0.96
Rendite auf Verfall	(in % p.a.)	0.70

Risikokennzahlen per 31.12.2019

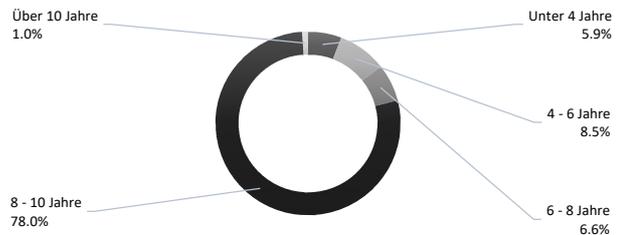
		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³ Anlagegruppe	(in %)	1.05	N.a.	N.a.
Volatilität ³ Benchmark	(in %)	2.66	N.a.	N.a.

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Rendite)

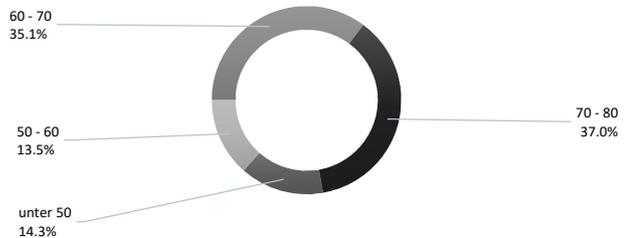
Wertentwicklung seit Lancierung



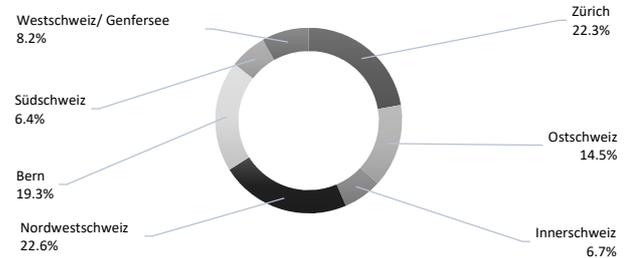
Aufteilung nach Restlaufzeiten per 31.12.2019



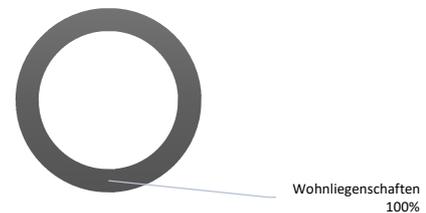
Aufteilung nach Belehnung per 31.12.2019 (in %)



Aufteilung Immobilien nach Regionen per 31.12.2019



Aufteilung nach Nutzungsarten per 31.12.2019



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%