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

Factsheet 03/2020

31.03.2020

Aktien Schweiz Smart Beta Dynamisch 100.

Innovativ indexiert, intelligent investiert

Charakteristika

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

10 grösste Positionen per 31.03.2020 (in %)

Swiss Prime Site N	4.43
PSP Swiss Property AG N	4.37
Roche Holding AG G	3.39
SIG Combibloc Group AG N	3.30
EMS-Chemie Holding AG N	3.28
Partners Group Holding AG N	3.18
UBS Group AG N	3.07
Idorsia AG N	2.97
VAT Group AG N	2.88
BELIMO Holding N	2.77

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%

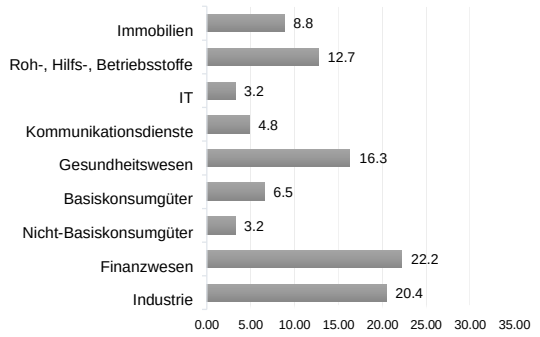
Wertenwicklung seit Lancierung

Performance per 31.03.2020 (in %)

	Anlage-gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	KGAST Ranking
1 Monat	-11.67	-4.86	-6.81	
3 Monate	-18.50	-11.82	-6.68	
YTD	-18.50	-11.82	-6.68	
Letzte 12 Monate	-4.10	0.70	-4.80	
3 Jahre[1]	3.44	5.51	-2.07	
5 Jahre[1]	N.a.	N.a.	N.a.	
10 Jahre[1]	N.a.	N.a.	N.a.	
Seit Lancierung[1]	6.23	4.13	2.10	

[1] annualisiert

Branchenstruktur per 31.03.2020 (in %)



Kennzahlen

		31.03.2020	31.12.2019
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	120.43	106.75
Anzahl Ansprüche		91 100	65 808
Kapitalwert[2]	(in CHF)	1 318.18	1 590.48
Laufender Ertrag[2]	(in CHF)	3.76	31.59
Inventarwert[2]	(in CHF)	1 321.94	1 622.07
TER (inkl. MWST)	(in %)	0.58	

[2] pro Anspruch

Risikokennzahlen per 31.03.2020 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität[3]	(in %)	17.72	13.45	N.a.
Tracking Error	(in %)	5.27	5.76	N.a.
Beta		0.74	1.07	N.a.
Sharpe Ratio		-0.77	-0.45	N.a.
Information Ratio		-0.91	-0.36	N.a.
Jensen-Alpha		-0.07	-0.02	N.a.
Max. Drawdown		-18.50	-18.50	N.a.
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	N.a.	N.a.

[3] gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

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%

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

Factsheet 03/2020

31.03.2020

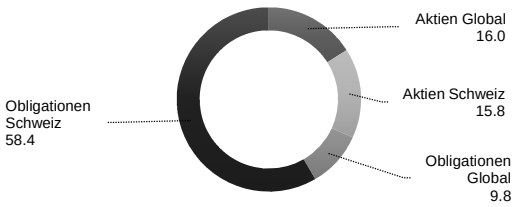
BVG-Mix.

Gut diversifiziert.

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 31.03.2020 (in %)

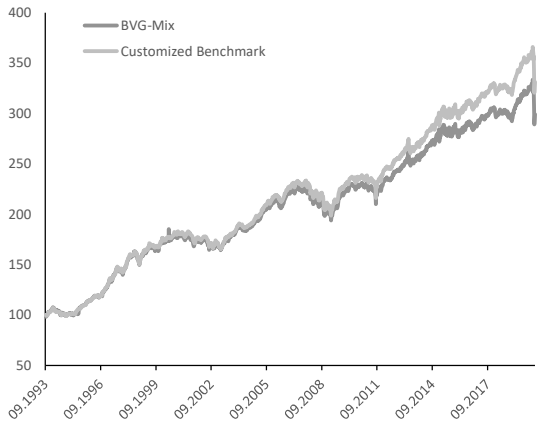


Performance per 31.03.2020 (in %)

	Anlage-gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	KGAST Ranking
1 Monat	-6.55	-6.22	-0.34	
3 Monate	-7.50	-6.57	-0.94	
YTD	-7.50	-6.57	-0.94	
Letzte 12 Monate	-3.01	-1.99	-1.01	
3 Jahre[1]	0.72	1.72	-1.00	
5 Jahre[1]	1.03	1.85	-0.82	
10 Jahre[1]	2.74	3.47	-0.74	
15 Jahre[1]	2.92	3.48	-0.56	
Seit Lancierung[1]	4.21	4.61	-0.40	

[1] annualisiert

Wertentwicklung seit Lancierung



Kennzahlen

		31.03.2020	31.12.2019
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	17.18	18.41
Anzahl Ansprüche		16 731	16 587
Kapitalwert[2]	(in CHF)	1 023.27	1 102.82
Laufender Ertrag[2]	(in CHF)	3.44	7.19
Inventarwert[2]	(in CHF)	1 026.71	1 110.01
TER 2019 (inkl. MWST)	(in %)	0.35	

[2] pro Anspruch

Risikokennzahlen per 31.03.2020 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität[3]	(in %)	8.05	5.39	5.04
Tracking Error	(in %)	0.90	0.68	0.55
Beta		0.94	0.98	1.00
Sharpe Ratio		-0.37	0.13	0.20
Information Ratio		-1.12	-1.48	-1.48
Jensen-Alpha		-0.01	-0.01	-0.01
Max. Drawdown		-8.46	-3.80	-12.50
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	59	1 309
Modified Duration[4]	(in %)	7.41		

[3] gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

[4] Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 31.03.2020

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%

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

Factsheet 03/2020

31.03.2020

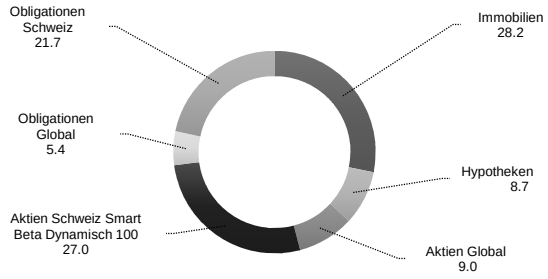
BVG-Mix Plus 30.

Renditeorientiert.

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 31.03.2020 (in %)

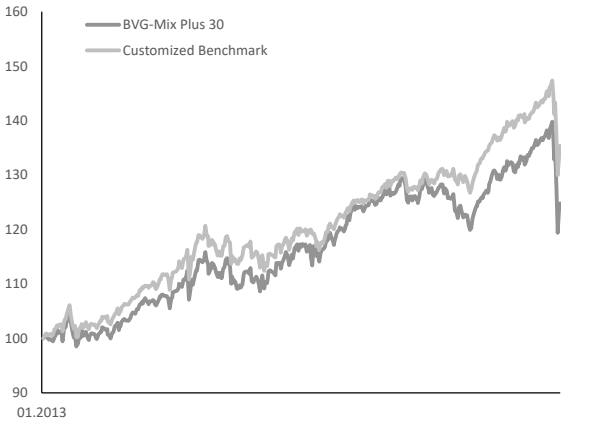


Performance per 31.03.2020 (in %)

	Anlage-gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	KGAST Ranking
1 Monat	-6.09	-4.11	-1.97	
3 Monate	-8.51	-5.55	-2.96	
YTD	-8.51	-5.55	-2.96	
Letzte 12 Monate	-1.86	0.36	-2.22	
3 Jahre[1]	1.12	3.22	-2.10	
5 Jahre[1]	1.83	2.72	-0.89	
10 Jahre[1]	N.a.	N.a.	N.a.	
15 Jahre[1]	N.a.	N.a.	N.a.	
Seit Lancierung[1]	3.11	4.28	-1.17	

[1] annualisiert

Wertentwicklung seit Lancierung



Kennzahlen

		31.03.2020	31.12.2019
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	318.59	224.66
Anzahl Ansprüche		274 938	177 384
Kapitalwert[2]	(in CHF)	1 160.34	1 262.22
Laufender Ertrag[2]	(in CHF)	-1.57	4.29
Inventarwert[2]	(in CHF)	1 158.77	1 266.51
TER 2019 (inkl. MWST)	(in %)	0.77	

[2] pro Anspruch

Risikokennzahlen per 31.03.2020 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität[3]	(in %)	8.23	5.99	5.53
Tracking Error	(in %)	6.74	4.15	3.43
Beta		1.93	1.27	1.06
Sharpe Ratio		-0.94	-0.79	-0.73
Information Ratio		-0.33	-0.51	-0.26
Jensen-Alpha		0.03	-0.01	-0.01
Max. Drawdown		-8.77	-6.26	-8.77
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	120	N.a.
Modified Duration[4]	(in %)	6.96		

[3] gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

[4] Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 31.03.2020

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%

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

Factsheet 03/2020

31.03.2020

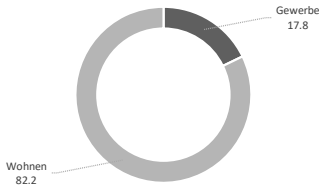
Immobilien Schweiz.

Nachhaltig stabile Renditen, geringe Volatilität.

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. ⅔ Wohnimmobilien - max. ⅓ Geschäftsimmobilien

Diversifikation nach Nutzung per 31.03.2020[4] (in %)



[4] Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Performance per 31.03.2020 (in %)

	Anlage-gruppe	Bench-mark	Diff. zum Benchmark	Risiko[1]	KGAST Ranking
3 Monate	0.63	1.36	-0.73		
YTD	0.63	1.36	-0.73		
Letzte 12 Monate	3.34	4.90	-1.55	1.52	
3 Jahre[2]	3.43	4.83	-1.40	1.53	
5 Jahre[2]	3.43	4.98	-1.55	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]	3.63	5.03	-1.41	1.67	

[1] gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)
[2] annualisiert

Diversifikation nach Kanton per 31.03.2020[5] (in %)

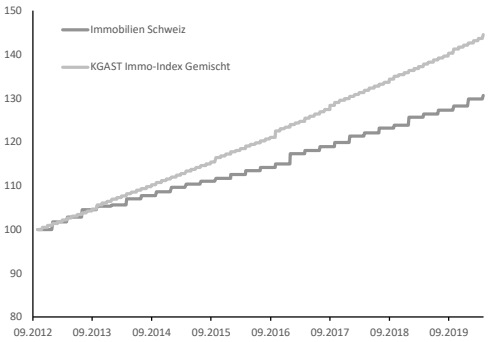
Aargau	23.2	Thurgau	4.7
Zürich	14.7	Luzern	4.6
Bern	8.3	Solothurn	3.3
Waadt	7.7	St. Gallen	3.0
Basel-Stadt	6.8	Jura	2.7
Schwyz	6.0	Schaffhausen	2.5
Genf	5.7	Neuenburg	0.9
Basel-Landschaft	5.0	Zug	0.8

[5] Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Kennzahlen

		31.03.2020	31.12.2019
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	816.96	798.88
Anzahl Ansprüche		625 367	615 371
Kapitalwert[3]	(in CHF)	1 297.66	1 264.68
Laufender Ertrag[3]	(in CHF)	8.70	33.52
Inventarwert[3]	(in CHF)	1 306.36	1 298.20
[3] pro Anspruch			
Mietzinsausfallquote	(in %)	9.87	12.12
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	0.00	1.73
EBIT-Marge	(in %)	66.88	69.22
TER_{ISA} 2019 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)	0.57	
ROE	(in %)	0.67	3.34
ROIC	(in %)	0.62	3.30

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 Nettoinvenatrwert des jeweiligen folgenden Quartalsendes.

Gebühren

Erwerb	0.00%
Rücknahme	Max. 2.50%

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

Factsheet 03/2020

31.03.2020

Immobilien Romandie.

Nachhaltig stabile Renditen, geringe Volatilität.

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-Regiojnen 98 (Sierre), 99 (Sion), 100 (Martigny) und 101 (Monthey/ST. Maurice)
Strategische Diversifikation	- mind. ¾ Wohnimmobilien - max. ¼ Geschäftsimmobilien

Performance per 31.03.2020 (in %)

	Anlage-gruppe	Bench-mark	Diff. zum Benchmark	Risiko[1]	KGAST Ranking
3 Monate	1.22	1.36	-0.14		
YTD	1.22	1.36	-0.14		
Letzte 12 Monate	3.49	4.90	-1.41	1.54	
3 Jahre[2]	3.28	4.83	-1.55	1.69	
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]	5.55	4.99	0.55	3.50	

[1] gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

[2] annualisiert

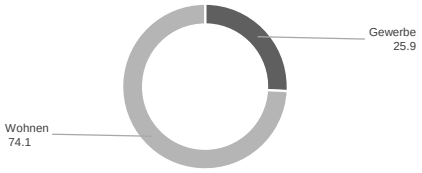
Kennzahlen

		31.03.2020	31.12.2019
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	277.03	250.50
Anzahl Ansprüche		220 686	201 980
Kapitalwert[3]	(in CHF)	1 242.14	1 190.20
Laufender Ertrag[3]	(in CHF)	13.17	50.03
Inventarwert[3]	(in CHF)	1 255.31	1 240.23

[3] pro Anspruch

Mietzinsausfallquote	(in %)	3.28	3.64
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	13.76	13.03
EBIT-Marge	(in %)	63.74	64.30
TER_{ISA} 2019 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)	0.88	0.93
ROE	(in %)	1.56	4.08
ROIC	(in %)	1.07	2.49

Diversifikation nach Nutzung per 31.03.2020[4] (in %)



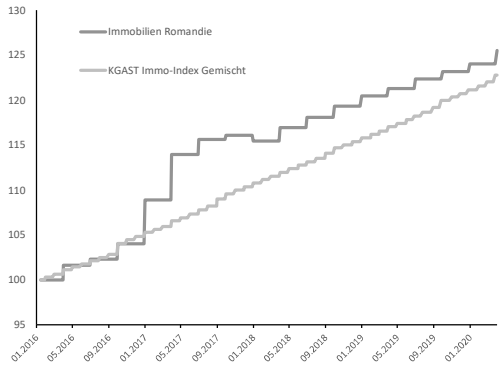
[4] Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Diversifikation nach Kanton per 31.03.2020[5] (in %)

Waadt	41.4
Genf	41.2
Wallis	8.9
Neuenburg	8.5

[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%

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

Factsheet 03/2020

31.03.2020

Hypotheken Schweiz.

Rendite bei geringer Volatilität.

Charakteristika

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

Performance per 31.03.2020 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Differenz
1 Monat	0.06	-4.70	4.76
3 Monate	0.16	-3.09	3.25
YTD	0.16	-3.09	3.25
Letzte 12 Monate	4.27	-2.61	6.88
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	4.50	-0.36	4.86

[1] annualisiert

Kennzahlen

		31.03.2020	31.12.2019
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	33.89	28.15
Anzahl Ansprüche		32 428	26 977
Inventarwert[2]	(in CHF)	1 045.04	1 043.32

[2] pro Anspruch

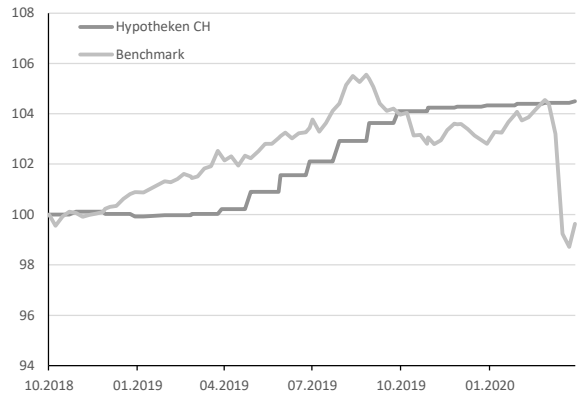
TER 2019 (inkl. MWST)	(in % p.a.)	0.39	
Durchschnittliche Restlaufzeit	(in Jahren)	8.45	8.49
Modified Duration	(in %)	8.09	8.01
Anzahl Hypotheken		56	51
Durchschnittliche Belehnung	(in %)	61.6	62.7
Durchschnittlicher Zinssatz	(in % p.a.)	0.96	0.96
Rendite auf Verfall	(in % p.a.)	0.67	0.70

Risikokennzahlen per 31.03.2020

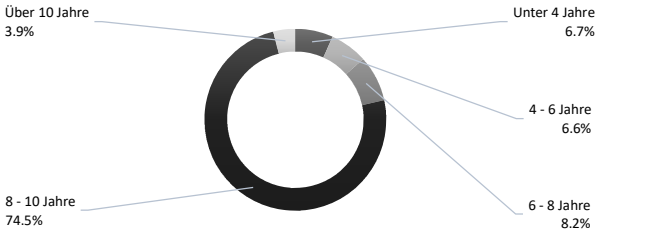
		1 Jahr (pro Monat)	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität[3] Anlagegruppe	(in %)	0.31%	N.a.	N.a.
Volatilität[3] Benchmark	(in %)	1.63%	N.a.	N.a.

[3] gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Rendite)

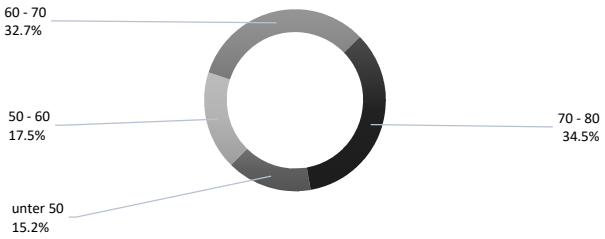
Wertentwicklung seit Lancierung



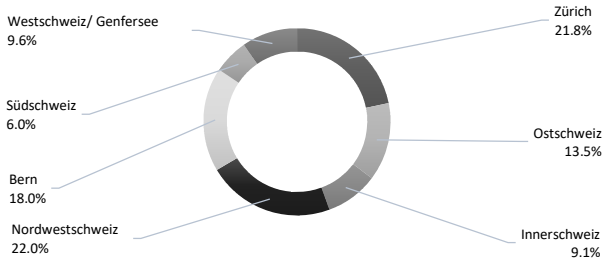
Aufteilung nach Restlaufzeiten per 31.03.2020



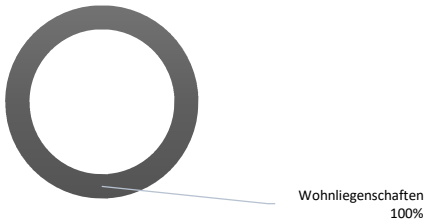
Aufteilung nach Belehnung per 31.03.2020 (in %)



Aufteilung Immobilien nach Regionen per 31.03.2020



Aufteilung nach Nutzungsarten per 31.03.2020



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%