Helvetia Anlagestiftung
Steinengraben 41, 4002 Basel, T 058 280 1000 (24h)
www.helvetia-anlagestiftung.ch
Mitglieder der KGAST

Factsheet 06/2021

30.06.2021

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 30.06.2021 (in %)

Logitech N	4.28
Partners Group Holding N	3.95
Kuehne + Nagel N	3.69
Swiss Prime Site N	3.07
Roche Holding G	2.95
Helvetia Holding N	2.88
Baloise-Holding N	2.72
ABB N	2.72
Swiss Life Holding N	2.68
PSP Swiss Property N	2.68

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%

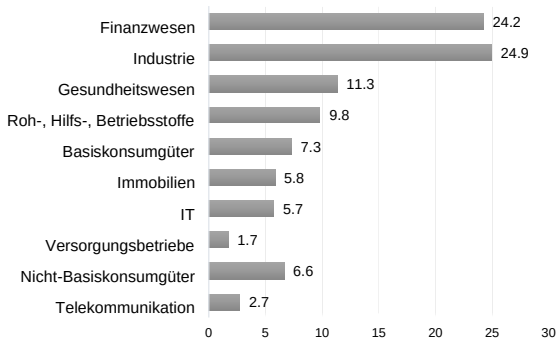
Wertenwicklung seit Lancierung

Performance per 30.06.2021 (in %)

	Anlage-gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	1.91	4.62	-2.71
3 Monate	6.56	9.50	-2.94
YTD	12.68	15.15	-2.47
Letzte 12 Monate	27.75	23.41	4.34
3 Jahre[1]	10.96	14.12	-3.16
5 Jahre[1]	13.72	12.12	1.60
10 Jahre[1]	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung[1]	11.47	8.74	2.73

[1] annualisiert

Branchenstruktur per 30.06.2021 (in %)



Kennzahlen

		30.06.2021	31.12.2020
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	144.37	129.67
Anzahl Ansprüche		76 382	77 306
Kapitalwert[2]	(in CHF)	1 856.68	1 642.44
Laufender Ertrag[2]	(in CHF)	33.41	34.93
Inventarwert[2]	(in CHF)	1 890.09	1 677.37
TER (inkl. MWST)	(in %)		0.58

[2] pro Anspruch

Risikokennzahlen per 30.06.2021 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität[3]	(in %)	12.51	14.91	12.43
Tracking Error	(in %)	4.35	5.85	5.23
Beta		0.83	1.06	1.01
Sharpe Ratio		2.03	0.57	0.91
Information Ratio		1.00	-0.54	0.31
Jensen-Alpha		0.08	-0.04	0.01
Max. Drawdown		-4.86	-18.50	-18.50
Recovery Period	(in Tagen)	30	244	244

[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
Steinengraben 41, 4002 Basel, T 058 280 1000 (24h)
www.helvetia-anlagestiftung.ch
Mitglieder der KGAST

Factsheet 06/2021

30.06.2021

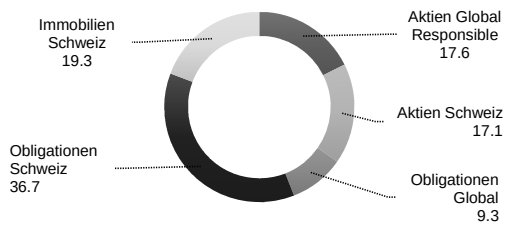
BVG-Mix.

Gut diversifiziert.

Charakteristika

Gründungsjahr	1993
Valoren-Nr.	1176860 (ISIN: CH0011768600)
Bloomberg	PATBVGM SW
Benchmark	Customised
Bewertung	Wöchentlich
Ausschüttungspolitik	Thesaurierend
Anlagestil	Indexiert
Strategische Asset Allocation	- 40% Obligationen Schweiz - 10% Obligationen Global - 15% Aktien Schweiz - 15% Aktien Global Responsible - 20% Immobilien Schweiz

Anlageklassenstruktur per 30.06.2021 (in %)

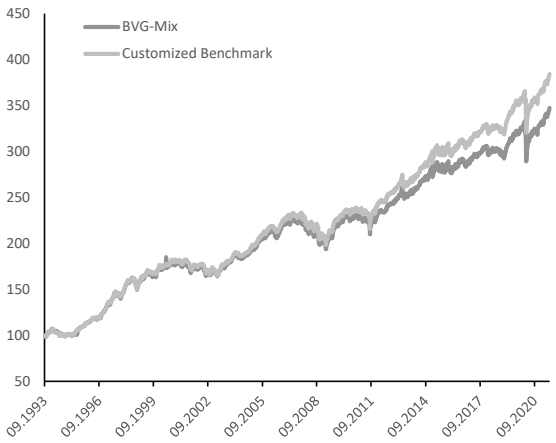


Performance per 30.06.2021 (in %)

	Anlage-gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	1.88	1.92	-0.03
3 Monate	2.69	2.62	0.06
YTD	5.07	5.14	-0.07
Letzte 12 Monate	9.36	9.66	-0.30
3 Jahre[1]	4.91	5.63	-0.72
5 Jahre[1]	3.84	4.50	-0.66
10 Jahre[1]	4.46	5.15	-0.69
15 Jahre[1]	3.46	4.00	-0.53
Seit Lancierung[1]	4.57	4.95	-0.38

[1] annualisiert

Wertentwicklung seit Lancierung



Kennzahlen

		30.06.2021	31.12.2020
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	21.12	19.69
Anzahl Ansprüche		17 737	17 376
Kapitalwert[2]	(in CHF)	1 180.88	1 122.99
Laufender Ertrag[2]	(in CHF)	9.96	10.43
Inventarwert[2]	(in CHF)	1 190.84	1 133.42
TER 2020 (inkl. MWST)	(in %)		0.35

[2] pro Anspruch

Nachhaltigkeitsrating[5]

Obligationen Schweiz	1 2 3 4 5 6 **7**
Obligationen Global	1 2 3 4 **5** 6 7
Aktien Schweiz	1 2 3 4 5 **6** 7
Aktien Global Responsible	1 2 3 4 5 **6** 7

[5]Skala: 1 für niedrig und 7 für hoch

Risikokennzahlen per 30.06.2021 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität[3]	(in %)	4.30	6.19	5.13
Tracking Error	(in %)	0.42	0.72	0.58
Beta		0.92	0.99	1.00
Sharpe Ratio		2.18	0.79	0.75
Information Ratio		-0.70	-1.00	-1.15
Jensen-Alpha		0.00	-0.01	-0.01
Max. Drawdown		-1.33	-8.46	-8.46
Recovery Period	(in Tagen)	30	244	244
Modified Duration[4]	(in %)	7.40		

[3] gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

[4] Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 30.06.2021

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
Steinengraben 41, 4002 Basel, T 058 280 1000 (24h)
www.helvetia-anlagestiftung.ch
Mitglieder der KGAST

Factsheet 06/2021

30.06.2021

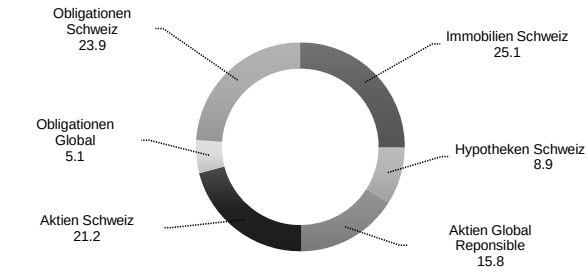
BVG-Mix Plus 35.

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 - 20% Aktien Schweiz - 15% Aktien Global Responsible - 26% Immobilien Schweiz - 10% Hypotheken Schweiz

Anlageklassenstruktur per 30.06.2021 (in %)

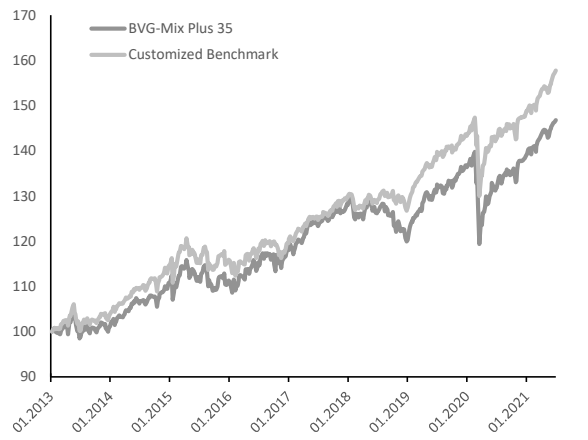


Performance per 30.06.2021 (in %)

	Anlage-gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	1.29	1.96	-0.67
3 Monate	2.45	3.11	-0.66
YTD	5.55	6.04	-0.50
Letzte 12 Monate	11.31	10.62	0.70
3 Jahre[1]	5.04	6.93	-1.89
5 Jahre[1]	4.93	5.92	-0.98
10 Jahre[1]	N.a.	N.a.	N.a.
15 Jahre[1]	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung[1]	4.63	5.53	-0.89

[1] annualisiert

Wertentwicklung seit Lancierung



Kennzahlen

		30.06.2021	31.12.2020
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	505.27	400.94
Anzahl Ansprüche		370 607	310 398
Kapitalwert[2]	(in CHF)	1 360.08	1 290.77
Laufender Ertrag[2]	(in CHF)	3.29	0.93
Inventarwert[2]	(in CHF)	1 363.37	1 291.70
TER 2020 (inkl. MWST)	(in %)		0.64

[2] pro Anspruch

Nachhaltigkeitsrating[5]

Obligationen Schweiz	1 2 3 4 5 6 **7**
Obligationen Global	1 2 3 4 **5** 6 7
Aktien Schweiz	1 2 3 4 5 **6** 7
Aktien Global Responsible	1 2 3 4 5 **6** 7

[5]Skala: 1 für niedrig und 7 für hoch

Risikokennzahlen per 30.06.2021 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität[3]	(in %)	4.07	6.41	5.43
Tracking Error	(in %)	1.30	2.03	1.91
Beta		0.77	1.12	1.12
Sharpe Ratio		2.40	0.54	0.62
Information Ratio		0.54	-0.93	-0.51
Jensen-Alpha		0.03	-0.03	-0.01
Max. Drawdown		-1.14	-8.77	-8.77
Recovery Period	(in Tagen)	30	244	244
Modified Duration[4]	(in %)	7.40		

[3] gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

[4] Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 30.06.2021

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
Steinengraben 41, 4002 Basel, T 058 280 1000 (24h)
www.helvetia-anlagestiftung.ch
Mitglieder der KGAST

Factsheet 06/2021

30.06.2021

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.¾ Wohnimmobilien - max. ¼ Geschäftsimmobilien

Performance per 30.06.2021 (in %)

	Anlage-gruppe	Bench-mark	Diff. zum Benchmark	Risiko[1]
3 Monate	1.05	1.12	-0.07	
YTD	1.73	2.19	-0.46	
Letzte 12 Monate	4.10	4.43	-0.32	2.00
3 Jahre[2]	3.61	4.68	-1.07	1.67
5 Jahre[2]	3.71	4.90	-1.20	1.72
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]	3.66	4.96	-1.30	1.69

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

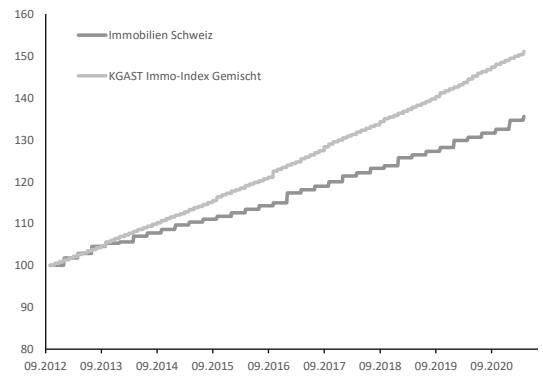
Kennzahlen

		30.06.2021	31.12.2020
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	877.54	862.61
Anzahl Ansprüche		640 676	640 676
Kapitalwert[3]	(in CHF)	1 346.41	1 309.58
Laufender Ertrag[3]	(in CHF)	23.30	36.83
Inventarwert[3]	(in CHF)	1 369.71	1 346.41

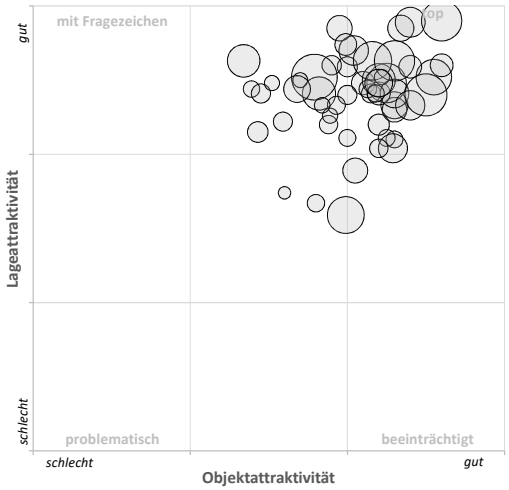
[3] pro Anspruch

Mietzinsausfallquote	(in %)	8.10	10.00
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	0.00	0.00
EBIT-Marge	(in %)	69.63	71.18
TER_{ISA} 2020 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)		0.52
ROE	(in %)	1.73	3.76
ROIC	(in %)	1.69	3.62

Wertentwicklung seit Lancierung

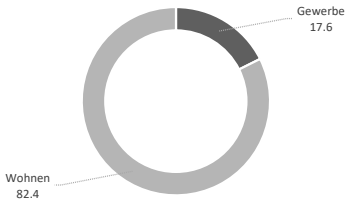


Qualitätsprofil per 30.06.2021[4]



[4] Basierend auf Beurteilungen des Immobilienschätzers KPMG AG. Die Blasengrösse widerspiegelt den Marktwert der jeweiligen Liegenschaft.

Diversifikation nach Nutzung per 30.06.2021[5] (in %)



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

Diversifikation nach Kanton per 30.06.2021[6] (in %)

Aargau	23.3	Luzern	4.4
Zürich	14.4	Thurgau	4.3
Basel-Landschaft	8.8	Solothurn	3.0
Bern	7.6	St. Gallen	2.8
Waadt	7.3	Jura	2.5
Basel-Stadt	6.4	Schaffhausen	2.4
Schwyz	5.8	Neuenburg	0.9
Genf	5.4	Zug	0.8

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

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
Steinengraben 41, 4002 Basel, T 058 280 1000 (24h)
www.helvetia-anlagestiftung.ch
Mitglieder der KGAST

Factsheet 06/2021

30.06.2021

Immobilien Romandie.

Nachhaltig stabile Renditen, geringe Volatilität.

Charakteristika

Gründungsjahr	2016
Valoren-Nr.	30120010 (ISIN: CH0301200108)
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 30.06.2021 (in %)

	Anlage-gruppe	Bench-mark	Diff. zum Benchmark	Risiko[1]
3 Monate	2.26	1.12	1.14	
YTD	3.07	2.19	0.88	
Letzte 12 Monate	5.13	4.43	0.70	2.49
3 Jahre[2]	4.06	4.68	-0.62	1.86
5 Jahre[2]	5.39	4.90	0.49	3.31
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]	5.37	4.89	0.48	3.24

[1] gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

[2] annualisiert

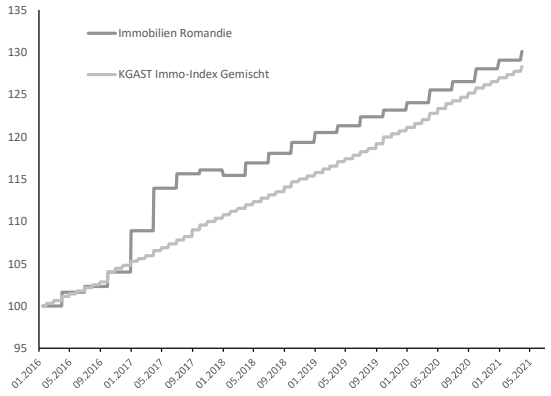
Kennzahlen

		30.06.2021	31.12.2020
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	360.39	313.82
Anzahl Ansprüche		270 931	243 152
Kapitalwert[3]	(in CHF)	1 308.26	1 247.47
Laufender Ertrag[3]	(in CHF)	21.94	43.17
Inventarwert[3]	(in CHF)	1 330.20	1 290.64

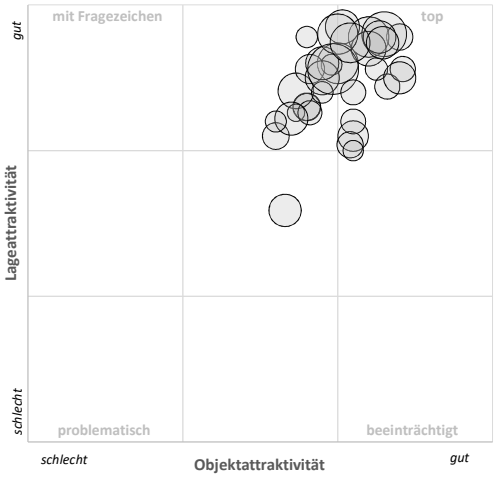
[3] pro Anspruch

Mietzinsausfallquote	(in %)	5.04	3.42
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	13.27	18.94
EBIT-Marge	(in %)	62.65	65.21
TER_{ISA} 2020 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)		0.91
ROE	(in %)	3.25	4.37
ROIC	(in %)	2.38	3.27

Wertentwicklung seit Lancierung

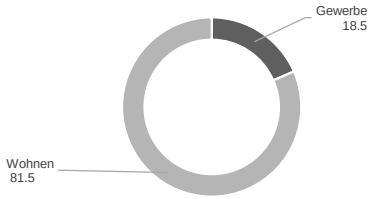


Qualitätsprofil per 30.06.2021[4]



[4] Basierend auf Beurteilungen des Immobilienschätzers KPMG AG. Die Blasengrösse widerspiegelt den Marktwert der jeweiligen Liegenschaft.

Diversifikation nach Nutzung per 30.06.2021[5] (in %)



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

Diversifikation nach Kanton per 30.06.2021[6] (in %)

Waadt	45.1
Genf	42.5
Wallis	6.7
Neuenburg	5.8

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

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
Steinengraben 41, 4002 Basel, T 058 280 1000 (24h)
www.helvetia-anlagestiftung.ch
Mitglied der KGAST

Factsheet 06/2021

30.06.2021

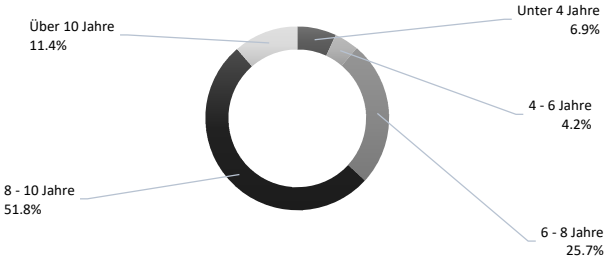
Hypotheken Schweiz.

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

Aufteilung nach Restlaufzeiten per 30.06.2021

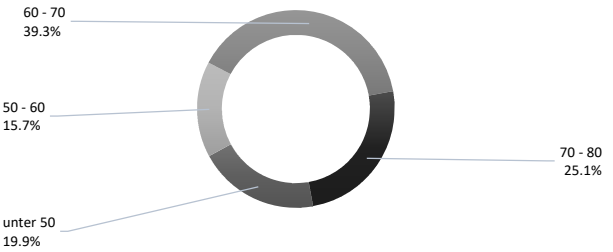


Performance per 30.06.2021 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Differenz
1 Monat	0.03	0.14	-0.11
3 Monate	0.13	-0.03	0.16
YTD	0.25	-0.36	0.61
Letzte 12 Monate	0.59	1.14	-0.55
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	5.25	2.89	2.36

[1] annualisiert

Aufteilung nach Belehnung per 30.06.2021 (in %)



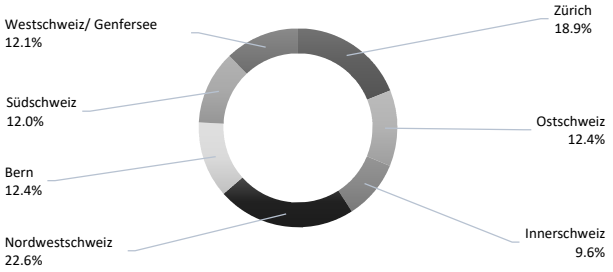
Kennzahlen

		30.06.2021	31.12.2020
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	67.52	52.78
Anzahl Ansprüche		64 153	50 273
Inventarwert[2]	(in CHF)	1 052.45	1 049.81

[2] pro Anspruch

TER 2020 (inkl. MWST)	(in % p.a.)		0.24
Durchschnittliche Restlaufzeit	(in Jahren)	8.56	8.82
Modified Duration	(in %)	8.22	8.46
Anzahl Hypotheken		114	101
Durchschnittliche Belehnung	(in %)	60.9	61.2
Durchschnittlicher Zinssatz	(in % p.a.)	0.88	0.89
Rendite auf Verfall	(in % p.a.)	0.77	0.75

Aufteilung Immobilien nach Regionen per 30.06.2021

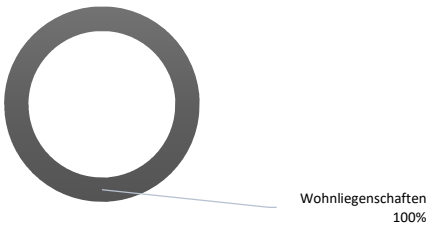


Risikokennzahlen per 30.06.2021

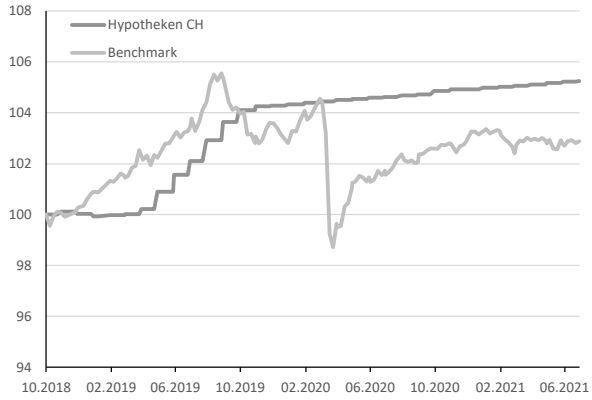
		1 Jahr (pro Monat)	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität[3] Anlagegruppe	(in %)	0.03%	N.a.	N.a.
Volatilität[3] Benchmark	(in %)	0.41%	N.a.	N.a.

[3] gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Rendite)

Aufteilung nach Nutzungsarten per 30.06.2021



Wertentwicklung seit Lancierung



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%