

Factsheet 03/2022

31.03.2022

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

Anlagestil

Aktien Schweiz Smart Beta Dynamisch 100

Aktiensignal	Offensiv	Neutral	Defensiv
	(100% ≥ GLOCAP ≥ 80%)	(80% > GLOCAP ≥ 60%)	(60% > GLOCAP ≥ 0%)
Verhältnis risikobasier/renditebasiert	30% / 70%	50% / 50%	70% / 30%
Allokation			
Minimum Volatility Index	15.00%	25.00%	35.00%
Risk Parity Index	15.00%	25.00%	35.00%
Value Index	23.30%	16.60%	10.00%
Momentum Index	23.30%	16.60%	10.00%
Quality Index	23.30%	16.60%	10.00%

Performance per 31.03.2022 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	1.42	2.42	-1.00
3 Monate	-7.30	-5.51	-1.79
YTD	-7.30	-5.51	-1.79
Letzte 12 Monate	3.73	10.87	-7.14
3 Jahre ¹	10.10	11.40	-1.30
5 Jahre ¹	9.03	10.02	-0.99
10 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung ¹	9.65	7.91	1.74

¹ annualisiert

Kennzahlen

		31.03.2022	31.12.2021
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	101.94	151.79
Anzahl Ansprüche		55 400	76 470
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 834.49	1 955.62
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	5.51	29.29
Inventarwert ²	(in CHF)	1 840.00	1 984.91
TER (inkl. MWST)	(in %)		0.58

² pro Anspruch

Risikokennzahlen per 31.03.2022 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	12.38	14.74	13.30
Tracking Error	(in %)	2.86	5.35	4.98
Beta		0.85	1.07	1.03
Sharpe Ratio		0.73	1.04	1.08
Information Ratio		-2.50	-0.24	-0.20
Jensen-Alpha		-0.05	-0.02	-0.01
Max. Drawdown		-8.60	-18.50	-18.50
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	244	244

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

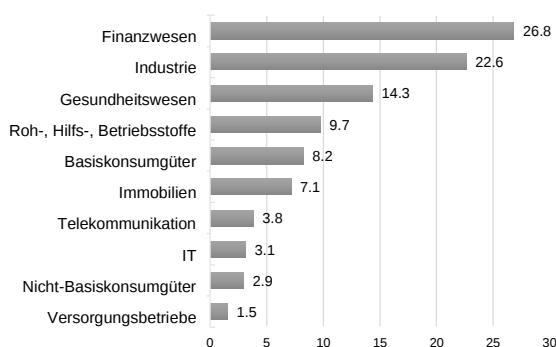
10 grösste Positionen per 31.03.2022 (in %)

Baloise Holding N	4.93
Swisscom N	3.82
Zürich Insurance Group N	3.74
Swiss Re N	3.58
Swiss Prime Site N	3.53
PSP Swiss Property N	3.48
Roche Holding G	3.20
Helvetia Holding N	3.17
Nestle N	3.11
Swiss Life Holding N	2.87

Wertenwicklung seit Lancierung



Branchenstruktur per 31.03.2022 (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%

Factsheet 03/2022

31.03.2022

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 hedged CHF - 15% Aktien Schweiz Responsible - 15% Aktien Global Responsible - 20% Immobilien Schweiz

Performance per 31.03.2022 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	-0.44	-0.50	0.05
3 Monate	-4.34	-4.38	0.04
YTD	-4.34	-4.38	0.04
Letzte 12 Monate	0.10	0.43	-0.33
3 Jahre ¹	3.12	3.62	-0.50
5 Jahre ¹	2.93	3.62	-0.69
10 Jahre ¹	3.71	4.33	-0.62
15 Jahre ¹	2.80	3.34	-0.54
Seit Lancierung ¹	4.36	4.74	-0.38

¹ annualisiert

Kennzahlen

		31.03.2022	31.12.2021
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	19.85	20.76
Anzahl Ansprüche		17 103	17 105
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 161.64	1 205.09
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	-0.84	8.36
Inventarwert ²	(in CHF)	1 160.80	1 213.45
TER 2021 (inkl. MWST)	(in %)		0.44

² pro Anspruch

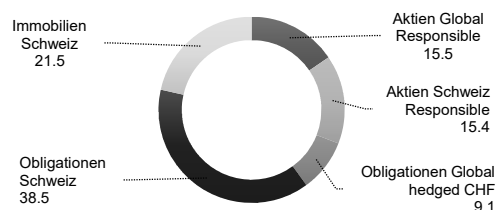
Risikokennzahlen per 31.03.2022 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	4.48	6.27	5.31
Tracking Error	(in %)	0.41	0.62	0.59
Beta		0.92	1.00	1.00
Sharpe Ratio		0.65	0.95	1.08
Information Ratio		-0.81	-0.80	-1.17
Jensen-Alpha		0.00	0.00	-0.01
Max. Drawdown		-4.34	-8.46	-8.46
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	244	244
Modified Duration ⁴	(in %)	7.01		

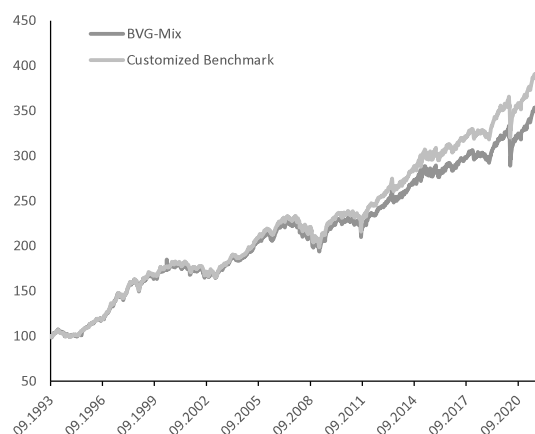
³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

⁴ Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 31.03.2022

Anlageklassenstruktur per 31.03.2022 (in %)



Wertentwicklung seit Lancierung



Nachhaltigkeitsrating⁵

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

⁵Skala: 1 für niedrig und 7 für hoch

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%

Factsheet 03/2022

31.03.2022

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 hedged CHF - 20% Aktien Schweiz - davon 10% Smart Beta Dynamisch 100 10% Responsible - 15% Aktien Global Responsible - 26% Immobilien Schweiz - 10% Hypotheken Schweiz

Performance per 31.03.2022 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	0.08	-0.04	0.12
3 Monate	-3.72	-3.82	0.10
YTD	-3.72	-3.82	0.10
Letzte 12 Monate	0.74	2.18	-1.43
3 Jahre ¹	4.33	5.05	-0.72
5 Jahre ¹	3.65	4.90	-1.25
10 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.
15 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung ¹	4.06	4.96	-0.90

¹ annualisiert

Kennzahlen

		31.03.2022	31.12.2021
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	612.31	555.43
Anzahl Ansprüche		456 714	398 885
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 341.83	1 390.75
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	- 1.14	1.70
Inventarwert ²	(in CHF)	1 340.69	1 392.45
TER 2021 (inkl. MWST)	(in %)		0.55

² pro Anspruch

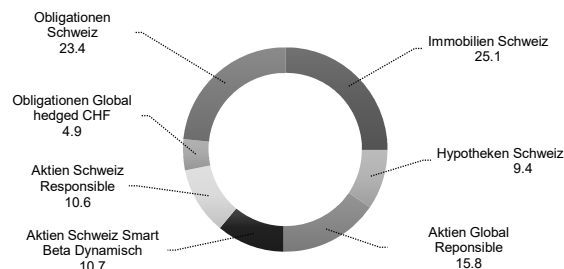
Risikokennzahlen per 31.03.2022 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	4.38	6.20	5.60
Tracking Error	(in %)	1.06	1.84	1.83
Beta		0.84	1.08	1.10
Sharpe Ratio		0.81	1.15	1.15
Information Ratio		-1.35	-0.39	-0.68
Jensen-Alpha		-0.01	-0.01	-0.02
Max. Drawdown		-3.79	-8.77	-8.77
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	244	244
Modified Duration ⁴	(in %)	7.01		

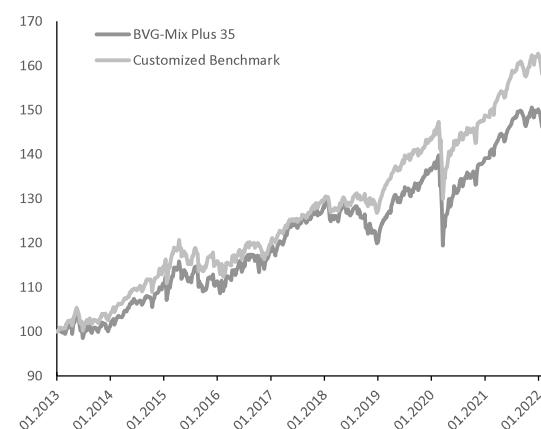
³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

⁴ Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 31.03.2022

Anlageklassenstruktur per 31.03.2022 (in %)



Wertentwicklung seit Lancierung



Nachhaltigkeitsrating⁵

Obligationen Schweiz	1	2	3	4	5	6	7
Obligationen Global hedged CHF	1	2	3	4	5	6	7
Aktien Schweiz Responsible Fonds	1	2	3	4	5	6	7
Aktien Global Responsible	1	2	3	4	5	6	7

⁵Skala: 1 für niedrig und 7 für hoch

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%

Factsheet 03/2022

31.03.2022

Hypotheken Schweiz.

Rendite bei geringer Volatilität.

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 31.03.2022 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Differenz
1 Monat	-0.47	-1.97	1.50
3 Monate	-0.78	-5.03	4.25
YTD	-0.78	-5.03	4.25
Letzte 12 Monate	-0.63	-5.91	5.28
3 Jahre ¹	1.39	-1.82	3.21
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	4.45	-3.16	7.61

¹ annualisiert

Kennzahlen

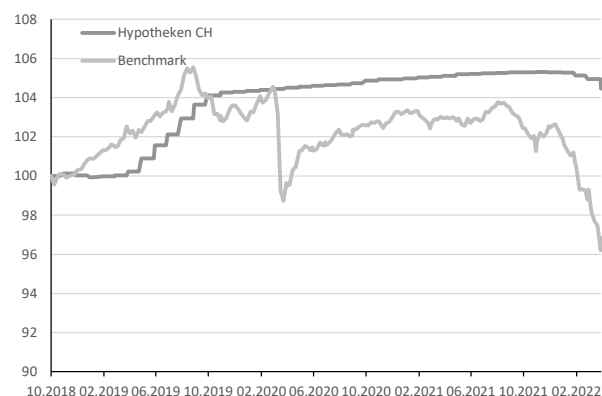
		31.03.2022	31.12.2021
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	87.22	77.13
Anzahl Ansprüche		83 511	73 268
Inventarwert ²	(in CHF)	1 044.46	1 052.71
² pro Anspruch			
TER 2021 (inkl. MWST)	(in % p.a.)		0.20
Durchschnittliche Restlaufzeit	(in Jahren)	8.41	8.52
Modified Duration	(in %)	8.10	8.21
Anzahl Hypotheken		165	145
Durchschnittliche Belehnung	(in %)	58.5	59.3
Durchschnittlicher Zinssatz	(in % p.a.)	0.81	0.83
Rendite auf Verfall	(in % p.a.)	0.86	0.76

Risikokennzahlen per 31.03.2022

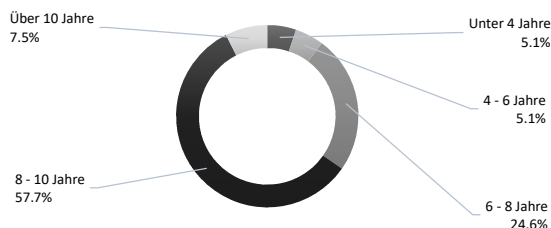
		1 Jahr (pro Monat)	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³ Anlagegruppe	(in %)	0.15%	0.26%	N.a.
Volatilität ³ Benchmark	(in %)	0.99%	1.16%	N.a.

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Rendite)

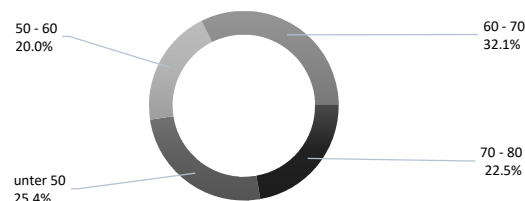
Wertentwicklung seit Lancierung



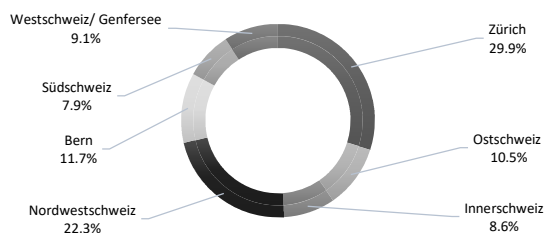
Aufteilung nach Restlaufzeiten per 31.03.2022



Aufteilung nach Belehnung per 31.03.2022 (in %)



Aufteilung nach Regionen per 31.03.2022



Aufteilung nach Nutzungsarten per 31.03.2022



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%

Factsheet 03/2022

31.03.2022

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	- mind. ¼ Wohnimmobilien
Diversifikation	- max. ¼ Geschäftsimmobilien

Performance per 31.03.2022 (in %)

	Anlage- gruppe	Bench- mark	Diff. zum Benchmark	Risiko ¹
3 Monate	0.74	1.34	-0.60	
YTD	0.74	1.34	-0.60	
Letzte 12 Monate	3.52	5.34	-1.82	1.53
3 Jahre ²	3.54	4.91	-1.37	1.56
5 Jahre ²	3.51	4.87	-1.35	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	3.63	5.01	-1.38	1.65

¹ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

² annualisiert

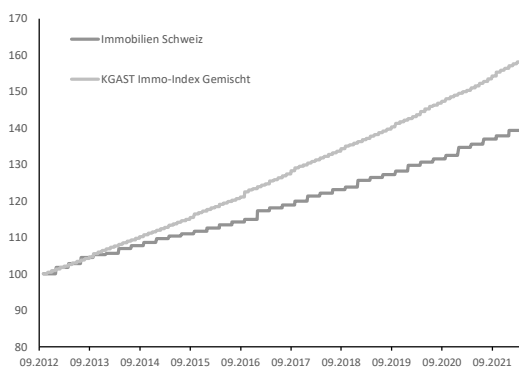
Kennzahlen

	31.03.2022	31.12.2021
Nettovermögen	(in Mio. CHF) 899.00	892.38
Anzahl Ansprüche	640 705	640 705
Kapitalwert ³	(in CHF) 1 393.43	1 357.72
Laufender Ertrag ³	(in CHF) 9.70	35.08
Inventarwert ³	(in CHF) 1 403.13	1 392.80

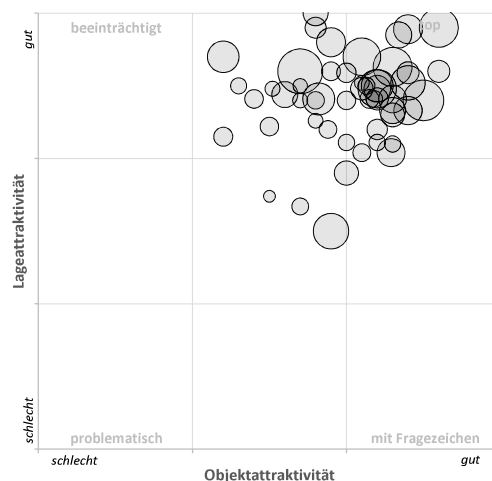
³ pro Anspruch

Mietzinsausfallquote	(in %)	5.58	7.24
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	0.00	0.00
EBIT-Marge	(in %)	70.74	69.43
TER _{ISA} 2021 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)		0.56
ROE	(in %)	0.74	3.45
ROIC	(in %)	0.72	3.33

Wertentwicklung seit Lancierung

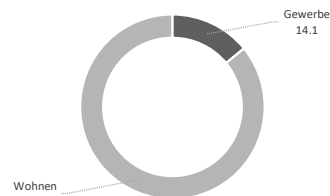


Qualitätsprofil per 31.03.2022⁴



⁴ Basierend auf Beurteilungen des Immobilienschätzers KPMG AG. Die Blasen grösser widerspiegeln den Marktwert der jeweiligen Liegenschaft.

Diversifikation nach Nutzung per 31.03.2022⁵ (in %)



⁵ Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Diversifikation nach Kanton per 31.03.2022⁶ (in %)

Aargau	23.3	Luzern	4.3
Zürich	14.2	Thurgau	4.3
Basel-Landschaft	8.9	Solothurn	3.0
Bern	7.6	St. Gallen	2.8
Waadt	7.4	Jura	2.3
Basel-Stadt	6.6	Schaffhausen	2.3
Schwyz	5.7	Neuenburg	0.9
Genf	5.6	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 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%

Factsheet 03/2022

31.03.2022

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 31.03.2022 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	Risiko ¹
3 Monate	1.00	1.34	-0.33	
YTD	1.00	1.34	-0.33	
Letzte 12 Monate	4.82	5.34	-0.52	2.41
3 Jahre ²	3.98	4.91	-0.94	1.84
5 Jahre ²	3.66	4.87	-1.21	1.81
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	5.12	4.97	0.15	3.07

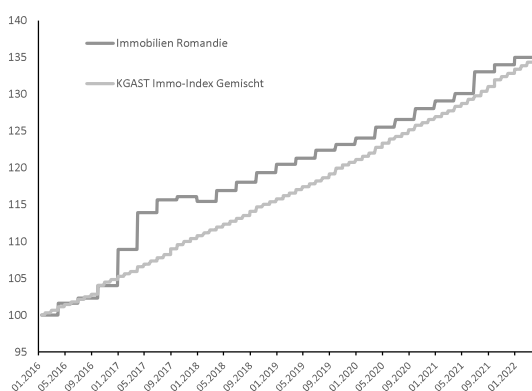
¹ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

² annualisiert

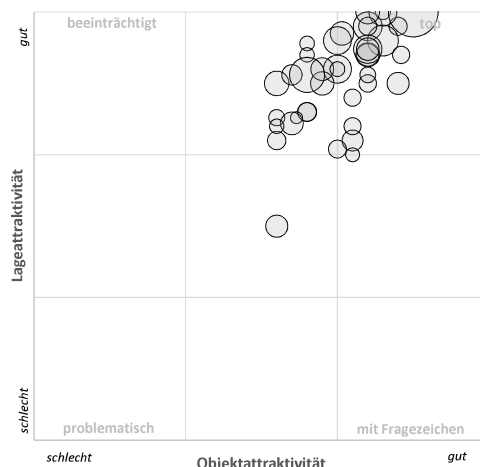
Kennzahlen

		31.03.2022	31.12.2021
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	556.16	478.54
Anzahl Ansprüche		407 897	354 484
Kapitalwert ³	(in CHF)	1 350.94	1 315.62
Laufender Ertrag ³	(in CHF)	12.55	34.33
Inventarwert ³	(in CHF)	1 363.49	1 349.95
³ pro Anspruch			
Mietzinsausfallquote	(in %)	3.23	5.17
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	6.67	11.96
EBIT-Marge	(in %)	62.16	59.78
TER _{ISA} 2021 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)		0.77
ROE	(in %)	1.34	4.40
ROIC	(in %)	0.96	3.59

Wertentwicklung seit Lancierung

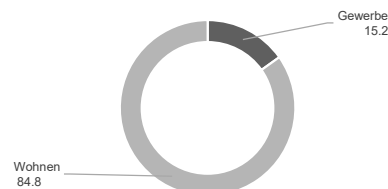


Qualitätsprofil per 31.03.2022⁴



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

Diversifikation nach Nutzung per 31.03.2022⁵ (in %)



⁵ Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Diversifikation nach Kanton per 31.03.2022⁶ (in %)

Genf	57.4
Vaud	32.9
Wallis	5.2
Neuchâtel	4.4

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 Zeichnungsmöglichkeit (vgl. Art. 22, Reglement) erfolgt die Abrechnung mit dem Nettoinventarwert des jeweiligen folgenden Quartalsendes.

Gebühren	
Erwerb	0.00%
Rücknahme	Max. 2.50%