

Factsheet 09/2021

30.09.2021

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

Anlagestil

Aktien Schweiz Smart Beta Dynamisch 100

Aktiesignal	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 30.09.2021 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	-5.70	-5.66	-0.04
3 Monate	-1.97	-1.97	0.00
YTD	10.46	12.88	-2.42
Letzte 12 Monate	18.90	18.23	0.67
3 Jahre ¹	9.71	11.66	-1.95
5 Jahre ¹	11.92	11.11	0.81
10 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung ¹	10.61	8.01	2.60

¹ annualisiert

Kennzahlen

		30.09.2021	31.12.2020
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	141.53	129.67
Anzahl Ansprüche		76 384	77 306
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 820.37	1 642.44
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	32.53	34.93
Inventarwert ²	(in CHF)	1 852.90	1 677.37
TER (inkl. MWST)	(in %)		0.58

² pro Anspruch

Risikokennzahlen per 30.09.2021 (in %)

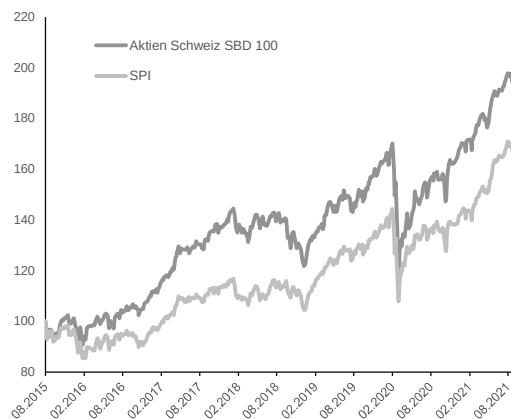
		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	14.36	15.31	12.78
Tracking Error	(in %)	3.63	5.67	5.16
Beta		0.86	1.07	1.01
Sharpe Ratio		1.22	0.55	0.83
Information Ratio		0.18	-0.34	0.16
Jensen-Alpha		0.03	-0.03	0.01
Max. Drawdown		-5.70	-18.50	-18.50
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	244	244

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

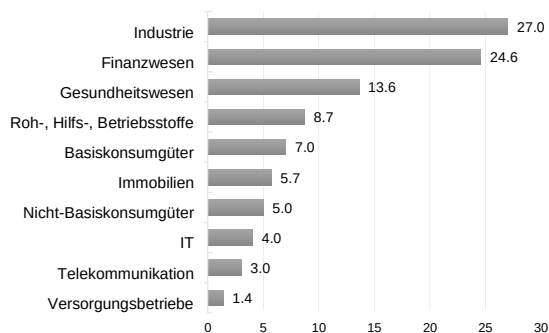
10 grösste Positionen per 30.09.2021 (in %)

Partners Group Holding N	3.99
VAT Group N	3.71
Baloise Holding N	3.41
ABB N	3.20
Helvetia Holding N	3.14
Swiss Prime Site N	3.09
Roche Holding G	3.04
Kuehne + Nagel N	2.97
Swiss Life Holding N	2.96
Swisscom N	2.96

Wertenwicklung seit Lancierung



Branchenstruktur per 30.09.2021 (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 09/2021

30.09.2021

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

Performance per 30.09.2021 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	-1.86	-1.76	-0.10
3 Monate	-0.07	-0.11	0.03
YTD	4.99	5.10	-0.11
Letzte 12 Monate	7.62	7.74	-0.12
3 Jahre ¹	4.88	5.62	-0.75
5 Jahre ¹	3.57	4.26	-0.69
10 Jahre ¹	4.49	5.13	-0.64
15 Jahre ¹	3.14	3.67	-0.53
Seit Lancierung ¹	4.53	4.91	-0.38

¹ annualisiert

Kennzahlen

		30.09.2021	31.12.2020
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	20.85	19.69
Anzahl Ansprüche		17 525	17 376
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 180.78	1 122.99
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	9.17	10.43
Inventarwert ²	(in CHF)	1 189.95	1 133.42
TER 2020 (inkl. MWST)	(in %)		0.35

² pro Anspruch

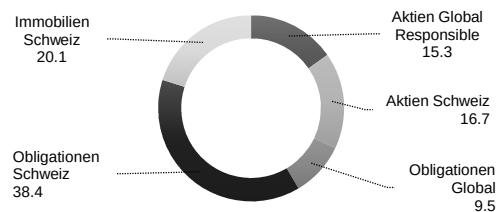
Risikokennzahlen per 30.09.2021 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	5.06	6.30	5.23
Tracking Error	(in %)	0.36	0.72	0.59
Beta		0.93	0.99	1.00
Sharpe Ratio		2.10	1.25	1.26
Information Ratio		-0.35	-1.03	-1.18
Jensen-Alpha		0.01	-0.01	-0.01
Max. Drawdown		-1.86	-8.46	-8.46
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	244	244
Modified Duration ⁴	(in %)	7.41		

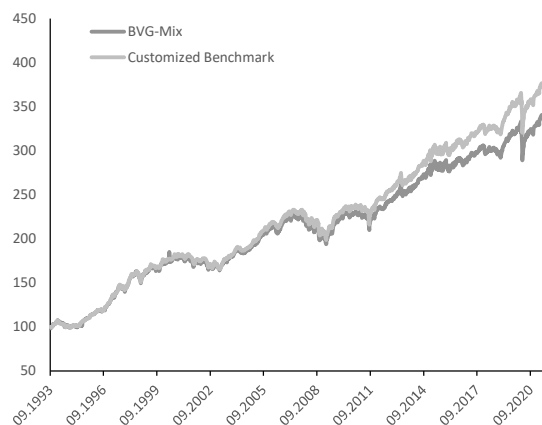
³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

⁴ Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 30.09.2021

Anlageklassenstruktur per 30.09.2021 (in %)



Wertentwicklung seit Lancierung



Nachhaltigkeitsrating⁵

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

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 09/2021

30.09.2021

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

Performance per 30.09.2021 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	-1.91	-1.98	0.07
3 Monate	0.03	-0.14	0.17
YTD	5.58	5.99	-0.41
Letzte 12 Monate	8.91	8.66	0.25
3 Jahre ¹	5.20	6.47	-1.26
5 Jahre ¹	4.62	5.66	-1.04
10 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.
15 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung ¹	4.50	5.36	-0.86

¹ annualisiert

Kennzahlen

		30.09.2021	31.12.2020
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	518.42	400.94
Anzahl Ansprüche		380 133	310 398
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 361.18	1 290.77
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	2.60	0.93
Inventarwert ²	(in CHF)	1 363.78	1 291.70
TER 2020 (inkl. MWST)	(in %)		0.64

² pro Anspruch

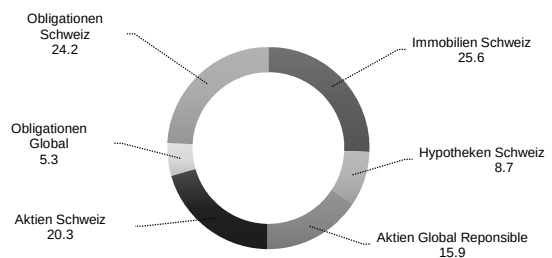
Risikokennzahlen per 30.09.2021 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	4.88	6.47	5.54
Tracking Error	(in %)	1.19	1.99	1.93
Beta		0.80	1.10	1.10
Sharpe Ratio		1.98	0.92	0.97
Information Ratio		0.21	-0.63	-0.54
Jensen-Alpha		0.02	-0.02	-0.02
Max. Drawdown		-1.91	-8.77	-8.77
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	244	244
Modified Duration ⁴	(in %)	7.42		

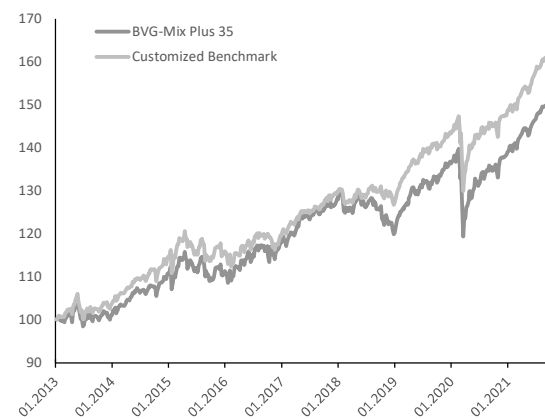
³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

⁴ Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 30.09.2021

Anlageklassenstruktur per 30.09.2021 (in %)



Wertentwicklung seit Lancierung



Nachhaltigkeitsrating⁵

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

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 09/2021

30.09.2021

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 30.09.2021 (in %)

Anlagegruppe	Benchmark	Differenz
1 Monat	-0.01	0.98
3 Monate	0.03	0.44
YTD	0.28	1.05
Letzte 12 Monate	0.40	0.52
3 Jahre ¹	N.a.	N.a.
5 Jahre ¹	N.a.	N.a.
10 Jahre ¹	N.a.	N.a.
15 Jahre ¹	N.a.	N.a.
Seit Lancierung	5.28	2.81

¹ annualisiert

Kennzahlen

	30.09.2021	31.12.2020
Nettovermögen	(in Mio. CHF) 73.94	52.78
Anzahl Ansprüche	70 233	50 273
Inventarwert ²	(in CHF) 1 052.80	1 049.81

² pro Anspruch

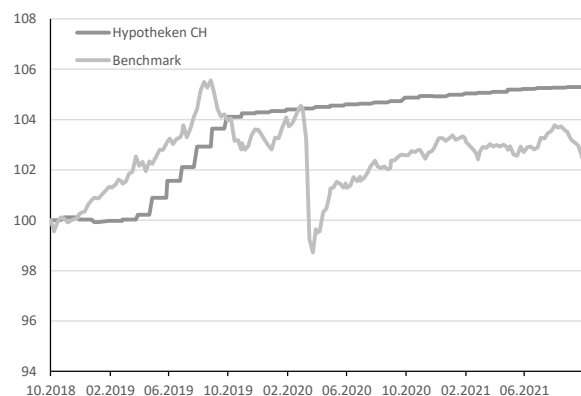
TER 2020 (inkl. MWST)	(in % p.a.)	0.24
Durchschnittliche Restlaufzeit	(in Jahren)	8.50
Modified Duration	(in %)	8.18
Anzahl Hypotheken		116
Durchschnittliche Belehnung	(in %)	60.7
Durchschnittlicher Zinssatz	(in % p.a.)	0.87
Rendite auf Verfall	(in % p.a.)	0.77

Risikokennzahlen per 30.09.2021

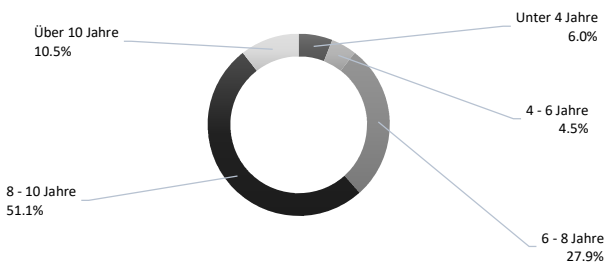
	1 Jahr (pro Monat)	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³ Anlagegruppe	(in %) 0.02%	N.a.	N.a.
Volatilität ³ Benchmark	(in %) 0.49%	N.a.	N.a.

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Rendite)

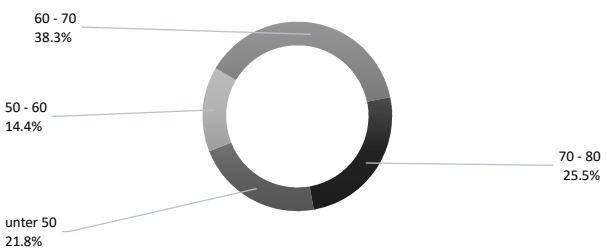
Wertentwicklung seit Lancierung



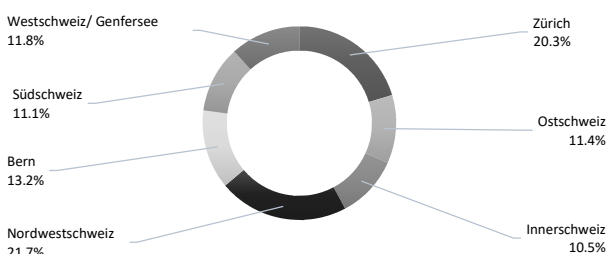
Aufteilung nach Restlaufzeiten per 30.09.2021



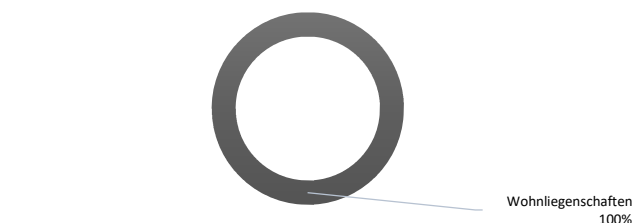
Aufteilung nach Belehnung per 30.09.2021 (in %)



Aufteilung nach Regionen per 30.09.2021



Aufteilung nach Nutzungsarten per 30.09.2021



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 09/2021

30.09.2021

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 Geschäftsimmobilen

Performance per 30.09.2021 (in %)

	Anlage- gruppe	Bench- mark	Diff. zum Benchmark	Risiko ¹
3 Monate	0.65	1.68	-1.03	
YTD	2.39	3.91	-1.51	
Letzte 12 Monate	4.02	4.90	-0.88	1.87
3 Jahre ²	3.65	4.78	-1.13	1.65
5 Jahre ²	3.70	4.86	-1.16	1.70
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	1.66

¹ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

² annualisiert

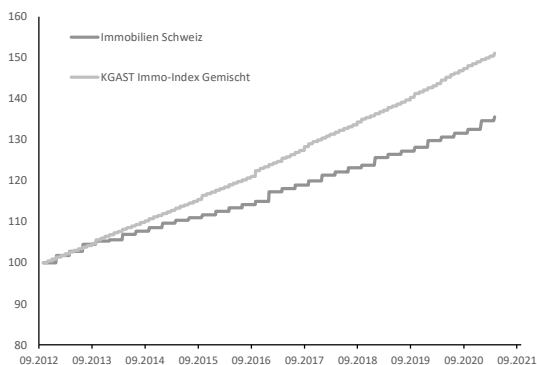
Kennzahlen

	30.09.2021	31.12.2020
Nettovermögen	(in Mio. CHF) 883.30	862.61
Anzahl Ansprüche	640 705	640 676
Kapitalwert ³	(in CHF) 1 346.40	1 309.58
Laufender Ertrag ³	(in CHF) 32.23	36.83
Inventarwert ³	(in CHF) 1 378.63	1 346.41

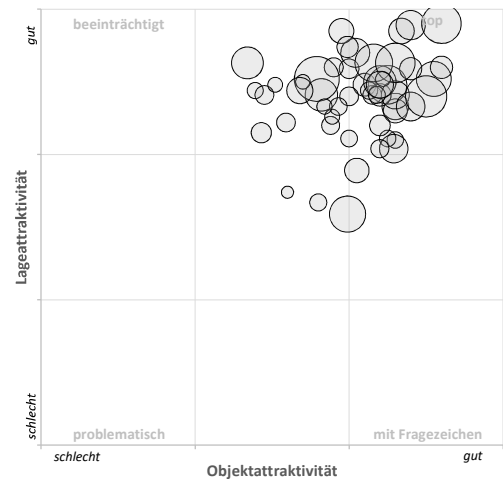
³ pro Anspruch

Mietzinsausfallquote	(in %)	7.86	10.00
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	0.00	0.00
EBIT-Marge	(in %)	69.41	71.18
TER _{ISA} 2020 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)		0.52
ROE	(in %)	2.39	3.76
ROIC	(in %)	2.33	3.62

Wertentwicklung seit Lancierung

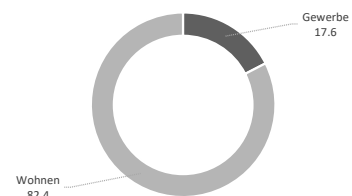


Qualitätsprofil per 30.09.2021⁴



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

Diversifikation nach Nutzung per 30.09.2021⁵ (in %)



⁵ Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Diversifikation nach Kanton per 30.09.2021⁶ (in %)

Aargau	23.3	Luzern	4.4
Zürich	14.3	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	2.3
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 Nettoinventarwert des jeweiligen folgenden Quartalsendes.

Gebühren

Erwerb	0.00%
Rücknahme	Max. 2.50%

Factsheet 09/2021

30.09.2021

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 30.09.2021 (in %)

	Anlage- gruppe	Bench- mark	Diff. zum Benchmark	Risiko ¹
3 Monate	0.73	1.68	-0.95	
YTD	3.81	3.91	-0.09	
Letzte 12 Monate	4.65	4.90	-0.25	2.37
3 Jahre ²	3.94	4.78	-0.85	1.83
5 Jahre ²	5.19	4.86	0.33	3.26
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	5.26	4.98	0.28	3.18

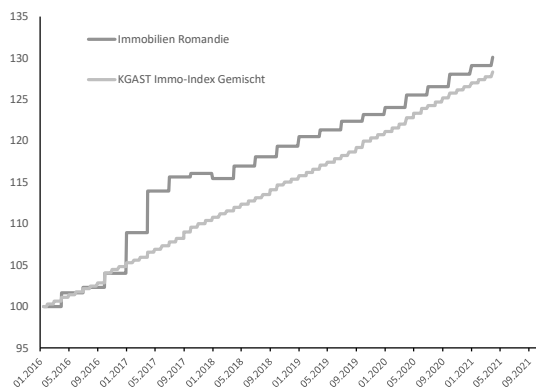
¹ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

² annualisiert

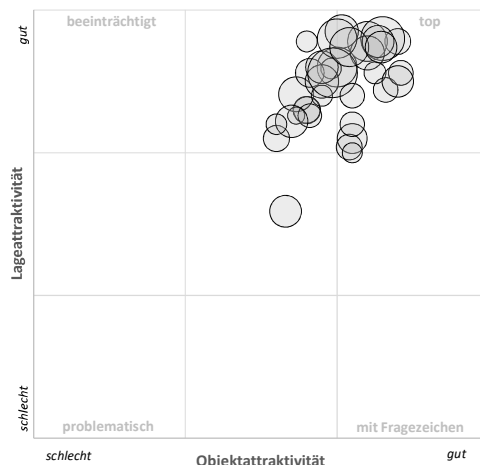
Kennzahlen

		30.09.2021	31.12.2020
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	373.89	313.82
Anzahl Ansprüche		279 051	243 152
Kapitalwert ³	(in CHF)	1 308.26	1 247.47
Laufender Ertrag ³	(in CHF)	31.60	43.17
Inventarwert ³	(in CHF)	1 339.86	1 290.64
³ pro Anspruch			
Mietzinsausfallquote	(in %)	4.94	3.42
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	13.13	18.94
EBIT-Marge	(in %)	63.93	65.21
TER _{ISA} 2020 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)	0.91	
ROE	(in %)	3.96	4.37
ROIC	(in %)	2.96	3.27

Wertentwicklung seit Lancierung

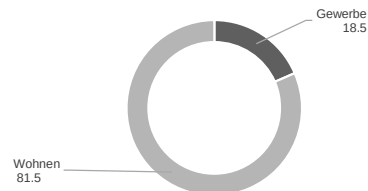


Qualitätsprofil per 30.09.2021⁴



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

Diversifikation nach Nutzung per 30.09.2021⁵ (in %)



⁵ Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Diversifikation nach Kanton per 30.09.2021⁶ (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%