

## Factsheet 09/2022

30.09.2022

### Aktien Schweiz Smart Beta Dynamisch 100 ESG.

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 ESG

Aktiensignal	Offensiv (100% ≥ GLOCAP ≥ 80%)	Neutral (80% > GLOCAP ≥ 60%)	Defensiv (60% > GLOCAP ≥ 0%)
Verhältnis risikobasier/renditebasiert	30% / 70%	50% / 50%	70% / 30%

Allokation



Index	Offensiv	Neutral	Defensiv
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 30.09.2022 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	-7.45	-5.98	-1.47
3 Monate	-5.64	-4.83	-0.81
YTD	-23.54	-19.93	-3.61
Letzte 12 Monate	-18.10	-12.48	-5.62
3 Jahre <sup>1</sup>	0.08	2.48	-2.40
5 Jahre <sup>1</sup>	2.56	4.74	-2.18
10 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung <sup>1</sup>	6.04	4.86	1.18

<sup>1</sup> annualisiert

#### Kennzahlen

		30.09.2022	31.12.2021
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	83.58	151.79
Anzahl Ansprüche		55 076	76 470
Kapitalwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 477.96	1 955.62
Laufender Ertrag <sup>2</sup>	(in CHF)	39.61	29.29
Inventarwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 517.57	1 984.91
TER (inkl. MWST)	(in %)		0.58

<sup>2</sup> pro Anspruch

#### Risikokennzahlen per 30.09.2022 (in %)

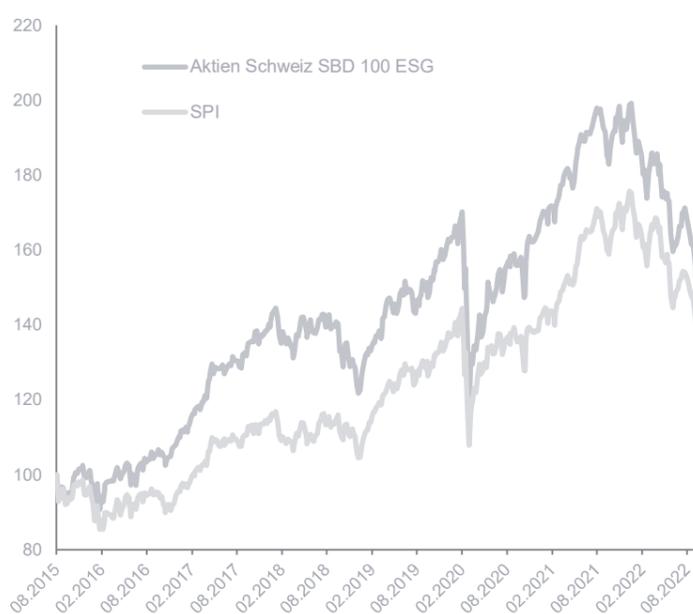
		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität <sup>3</sup>	(in %)	16.15	16.21	14.50
Tracking Error	(in %)	2.43	5.16	4.97
Beta		0.95	1.05	1.04
Sharpe Ratio		-1.28	-0.15	0.00
Information Ratio		-2.31	-0.46	-0.44
Jensen-Alpha		-0.06	-0.02	-0.02
Max. Drawdown		-23.54	-23.54	-23.54
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	N.a.	N.a.

<sup>3</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

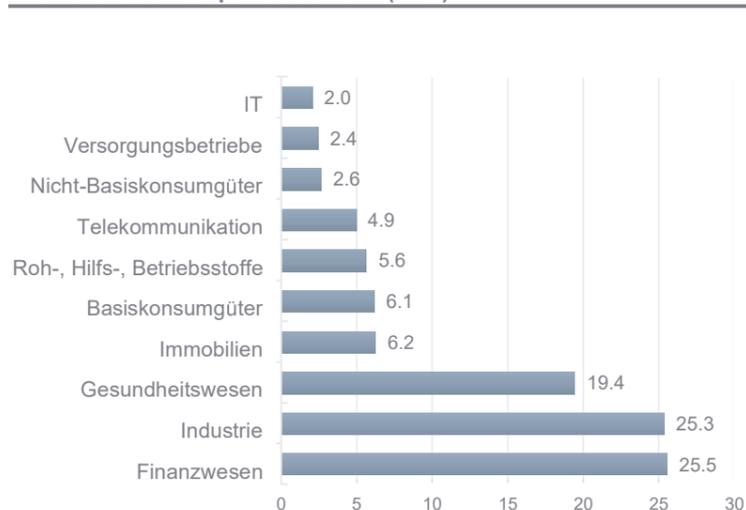
#### 10 grösste Positionen per 30.09.2022 (in %)

Banque Cantonale Vaudoise N	5.02
Swisscom AG N	4.92
Novartis AG N	4.91
Galenica AG N	3.64
Baloise-Holding N	3.58
DKSH Holding AG N	3.41
PSP Swiss Property N	3.34
Roche Holding AG G	2.92
Helvetia Holding AG N	2.86
Swiss Prime Site AG N	2.75

#### Wertenwicklung seit Lancierung



#### Branchenstruktur per 30.09.2022 (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 09/2022

30.09.2022

### BVG-Mix.

Gut diversifiziert.

#### Charakteristika

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

#### Performance per 30.09.2022 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	-3.35	-3.26	-0.09
3 Monate	-2.01	-1.83	-0.18
YTD	-11.76	-11.39	-0.37
Letzte 12 Monate	-10.02	-9.40	-0.62
3 Jahre <sup>1</sup>	-1.01	-0.53	-0.48
5 Jahre <sup>1</sup>	0.84	1.58	-0.74
10 Jahre <sup>1</sup>	2.55	3.19	-0.64
15 Jahre <sup>1</sup>	2.22	2.78	-0.56
Seit Lancierung <sup>1</sup>	3.99	4.38	-0.39

<sup>1</sup> annualisiert

#### Kennzahlen

		30.09.2022	31.12.2021
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	18.43	20.76
Anzahl Ansprüche		17 212	17 105
Kapitalwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 062.16	1 205.09
Laufender Ertrag <sup>2</sup>	(in CHF)	8.53	8.36
Inventarwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 070.69	1 213.45
TER 2021 (inkl. MWST)	(in %)		0.44

<sup>2</sup> pro Anspruch

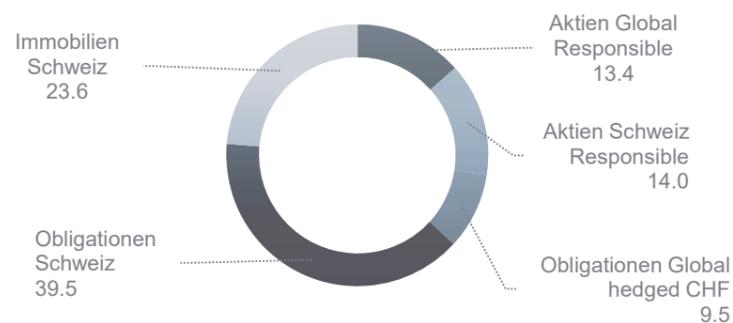
#### Risikokennzahlen per 30.09.2022 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität <sup>3</sup>	(in %)	6.97	7.23	6.10
Tracking Error	(in %)	0.44	0.55	0.61
Beta		0.94	1.00	1.00
Sharpe Ratio		-1.36	-0.06	0.23
Information Ratio		-1.41	-0.89	-1.20
Jensen-Alpha		-0.01	0.00	-0.01
Max. Drawdown		-11.76	-11.76	-11.76
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	N.a.	N.a.
Modified Duration <sup>4</sup>	(in %)	6.70		

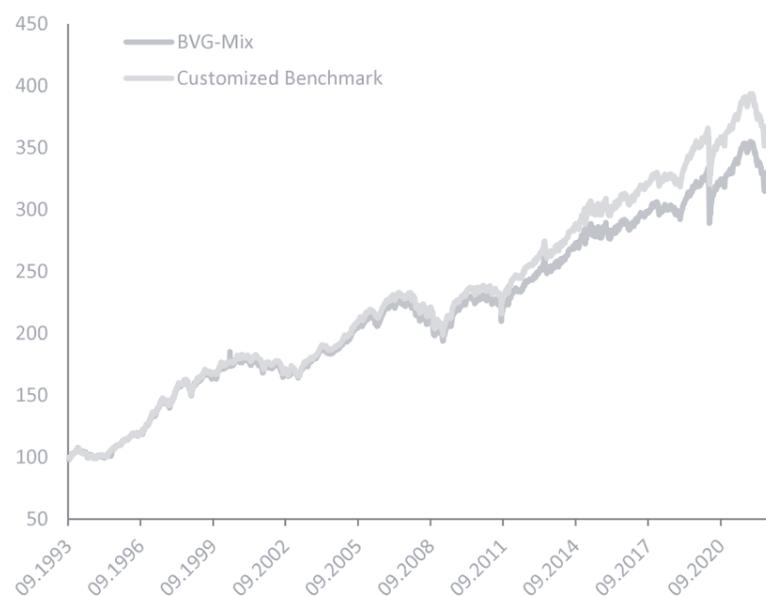
<sup>3</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

<sup>4</sup> Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 30.09.2022

#### Anlageklassenstruktur per 30.09.2022 (in %)



#### Wertentwicklung seit Lancierung



#### Nachhaltigkeitsrating<sup>5</sup>

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

<sup>5</sup>Skala: 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 09/2022

30.09.2022

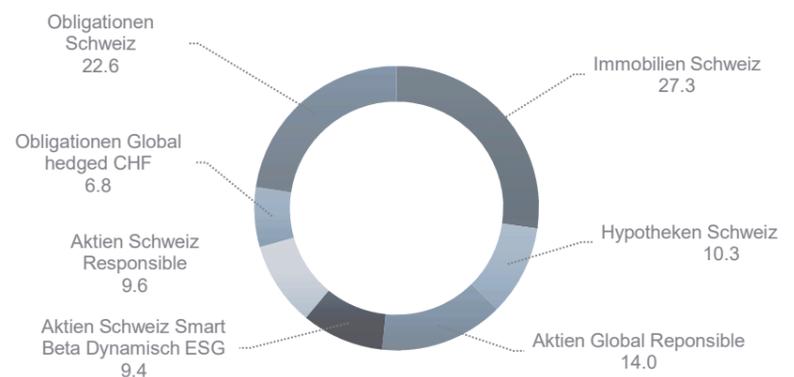
### BVG-Mix Plus 35.

Renditeorientiert.

#### Charakteristika

Gründungsjahr	2013
Valoren-Nr.	3539998 (ISIN: CH0035399986)
Bloomberg	BVGMP30 SW
Benchmark	Customised
Bewertung	Wöchentlich
Ausschüttungspolitik	Thesaurierend
Anlagestil	Core-Satellite
Strategische Asset Allocation*	- 22% Obligationen Schweiz - 7% Obligationen Global hedged CHF - 20% Aktien Schweiz Responsible davon 10% Smart Beta Dynamisch 100 ESG 10% Responsible - 15% Aktien Global Responsible - 26% Immobilien Schweiz - 10% Hypotheken Schweiz

#### Anlageklassenstruktur per 30.09.2022 (in %)



#### Performance per 30.09.2022 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	-3.46	-3.19	-0.27
3 Monate	-2.21	-1.81	-0.40
YTD	-11.29	-10.63	-0.66
Letzte 12 Monate	-9.43	-8.03	-1.40
3 Jahre <sup>1</sup>	-0.07	0.96	-1.03
5 Jahre <sup>1</sup>	1.12	2.70	-1.58
10 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
15 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung <sup>1</sup>	2.98	3.92	-0.94

<sup>1</sup> annualisiert

#### Kennzahlen

		30.09.2022	31.12.2021
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	602.12	555.43
Anzahl Ansprüche		487 469	398 885
Kapitalwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 230.04	1 390.75
Laufender Ertrag <sup>2</sup>	(in CHF)	5.15	1.70
Inventarwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 235.19	1 392.45
TER 2021 (inkl. MWST)	(in %)		0.55

<sup>2</sup> pro Anspruch

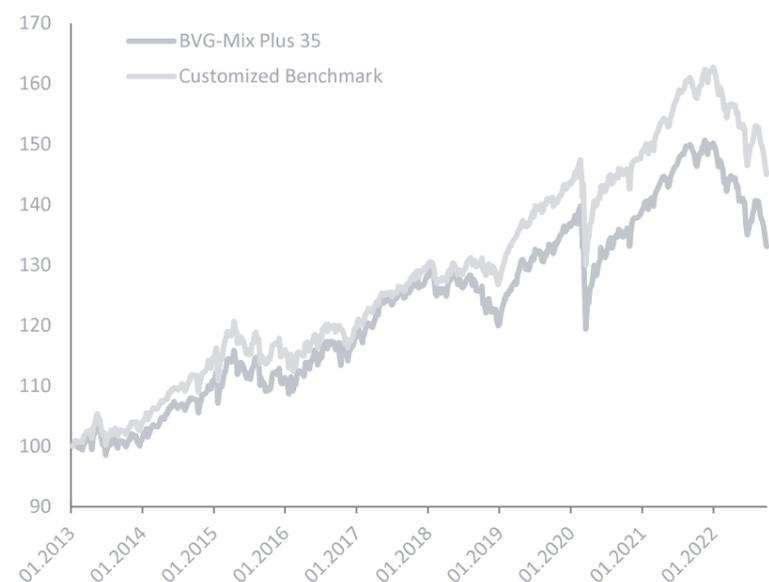
#### Risikokennzahlen per 30.09.2022 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität <sup>3</sup>	(in %)	6.87	7.03	6.25
Tracking Error	(in %)	0.60	1.57	1.72
Beta		0.92	1.04	1.07
Sharpe Ratio		-1.29	0.07	0.27
Information Ratio		-2.31	-0.66	-0.92
Jensen-Alpha		-0.02	-0.01	-0.02
Max. Drawdown		-11.29	-11.29	-11.29
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	N.a.	N.a.
Modified Duration <sup>4</sup>	(in %)	6.67		

<sup>3</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

<sup>4</sup> Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 30.09.2022

#### Wertentwicklung seit Lancierung



#### Nachhaltigkeitsrating<sup>5</sup>

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

<sup>5</sup>Skala: 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 09/2022

30.09.2022

### Hypotheken Schweiz.

Rendite bei geringer Volatilität.

#### Charakteristika

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

#### Performance per 30.09.2022 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Differenz
1 Monat	-1.48	-2.16	0.68
3 Monate	-2.95	-2.56	-0.39
YTD	-6.18	-10.66	4.48
Letzte 12 Monate	-6.19	-11.10	4.91
3 Jahre <sup>1</sup>	-1.74	-4.33	2.59
5 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
10 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
15 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung	-1.24	-8.90	7.66

<sup>1</sup>annualisiert

#### Kennzahlen

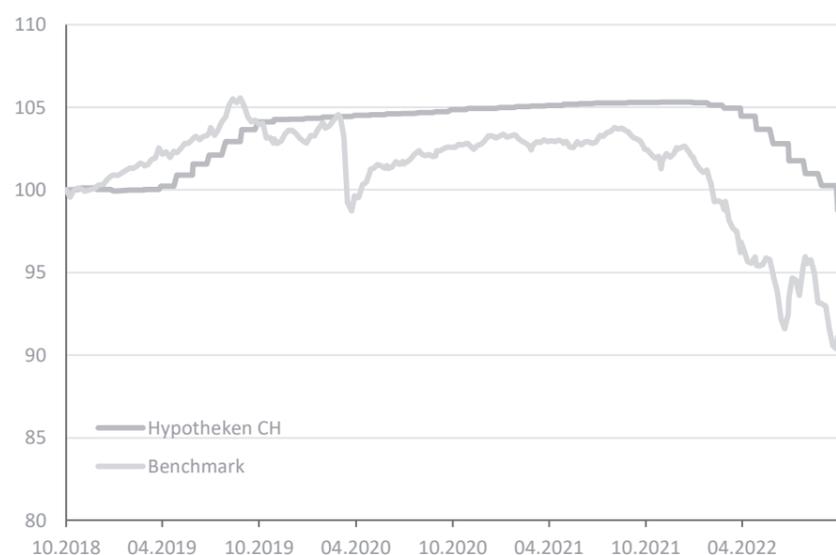
		30.09.2022	31.12.2021
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	92.60	77.13
Anzahl Ansprüche		93 764	73 268
Inventarwert <sup>2</sup>	(in CHF)	987.63	1 052.71
TER 2021 (inkl. MWST)	(in % p.a.)		0.20
Durchschnittliche Restlaufzeit	(in Jahren)	8.03	8.52
Modified Duration	(in %)	7.75	8.21
Anzahl Hypotheken		179	145
Durchschnittliche Belehnung	(in %)	57.9	59.3
Durchschnittlicher Zinssatz	(in % p.a.)	0.81	0.83
Rendite auf Verfall	(in % p.a.)	1.47	0.76

#### Risikokennzahlen per 30.09.2022

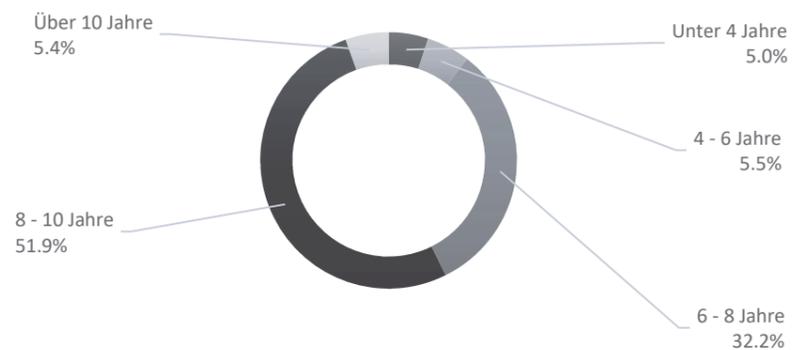
		1 Jahr (pro Monat)	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität <sup>3</sup> Anlagegruppe	(in %)	0.48%	0.38%	N.a.
Volatilität <sup>3</sup> Benchmark	(in %)	1.54%	1.35%	N.a.

<sup>3</sup>gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Rendite)

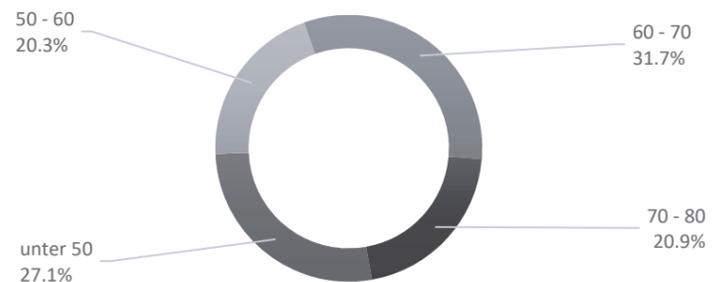
#### Wertentwicklung seit Lancierung



#### Aufteilung nach Restlaufzeiten per 30.09.2022



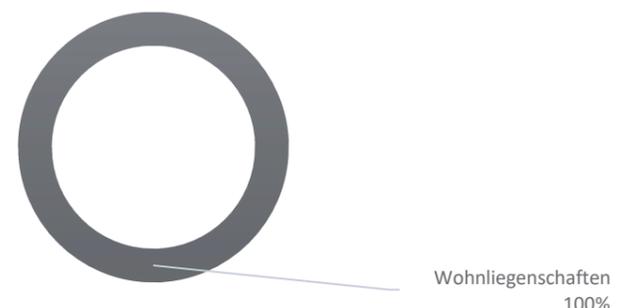
#### Aufteilung nach Belehnung per 30.09.2022 (in %)



#### Aufteilung nach Regionen per 30.09.2022



#### Aufteilung nach Nutzungsarten per 30.09.2022



#### 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 09/2022

30.09.2022

### 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 Diversifikation	- mind. ¼ Wohnimmobilien - max. ¼ Geschäftsimmobilien

#### Performance per 30.09.2022 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	Risiko <sup>1</sup>
3 Monate	0.58	1.28	-0.70	
YTD	3.17	3.70	-0.53	
Letzte 12 Monate	4.23	4.84	-0.60	2.04
3 Jahre <sup>2</sup>	3.89	4.86	-0.97	1.78
5 Jahre <sup>2</sup>	3.68	4.77	-1.08	1.68
10 Jahre <sup>2</sup>	3.69	5.00	-1.30	1.69
15 Jahre <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung <sup>2</sup>	3.69	5.00	-1.30	1.69

<sup>1</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

<sup>2</sup> annualisiert

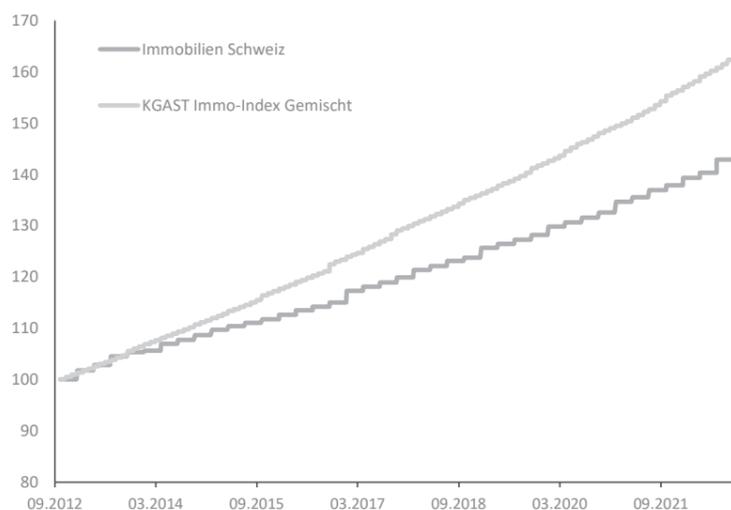
#### Kennzahlen

		30.09.2022	31.12.2021
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	920.69	892.38
Anzahl Ansprüche		640 708	640 705
Kapitalwert <sup>3</sup>	(in CHF)	1 407.98	1 357.72
Laufender Ertrag <sup>3</sup>	(in CHF)	29.01	35.08
Inventarwert <sup>3</sup>	(in CHF)	1 436.99	1 392.80

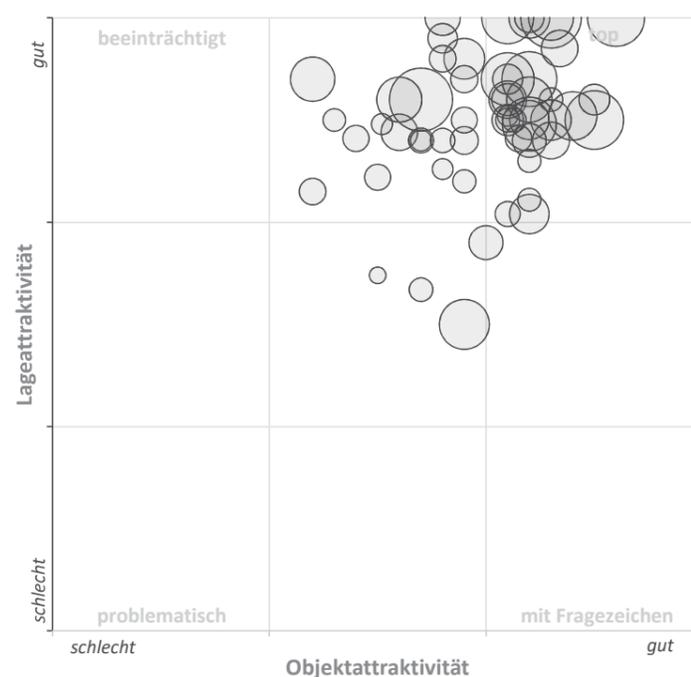
<sup>3</sup> pro Anspruch

Mietzinsausfallquote	(in %)	5.32	7.24
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	6.67	0.00
EBIT-Marge	(in %)	71.05	69.43
TER <sub>ISA</sub> 2021 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)		0.56
ROE	(in %)	3.17	3.45
ROIC	(in %)	3.01	3.33

#### Wertentwicklung seit Lancierung

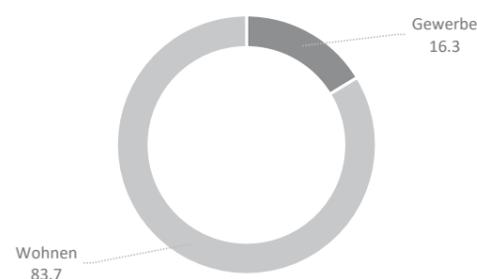


#### Qualitätsprofil per 30.09.2022<sup>4</sup>



<sup>4</sup> Basierend auf Beurteilungen des Immobilienschätzers KPMG AG. Die Blasengrösse widerspiegelt den Marktwert der jeweiligen Liegenschaft.

#### Diversifikation nach Nutzung per 30.09.2022<sup>5</sup> (in %)



<sup>5</sup> Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

#### Diversifikation nach Kanton per 30.09.2022<sup>6</sup> (in %)

Aargau	21.0	Luzern	3.9
Genf	15.6	Thurgau	3.7
Zürich	12.9	Solothurn	2.6
Basel-Landschaft	7.8	St. Gallen	2.5
Bern	6.8	Schaffhausen	2.1
Waadt	6.5	Jura	2.1
Basel-Stadt	5.8	Neuenburg	0.8
Schwyz	5.1	Zug	0.8

<sup>6</sup> 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 09/2022

30.09.2022

### 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 30.09.2022 (in %)

	Anlage- gruppe	Bench- mark	Diff. zum Benchmark	Risiko <sup>1</sup>
3 Monate	0.69	1.28	-0.59	
YTD	2.77	3.70	-0.94	
Letzte 12 Monate	3.54	4.84	-1.30	1.52
3 Jahre <sup>2</sup>	4.04	4.86	-0.81	1.86
5 Jahre <sup>2</sup>	3.63	4.77	-1.13	1.77
10 Jahre <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
15 Jahre <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung <sup>2</sup>	5.00	4.95	0.05	2.98

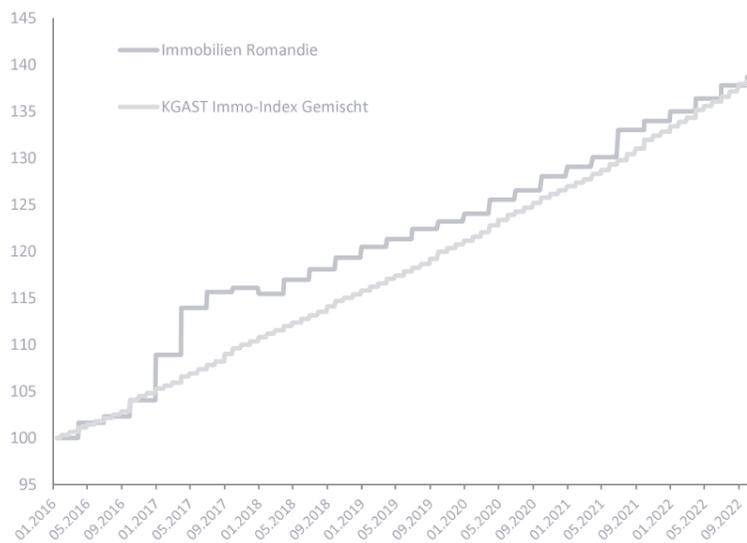
<sup>1</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

<sup>2</sup> annualisiert

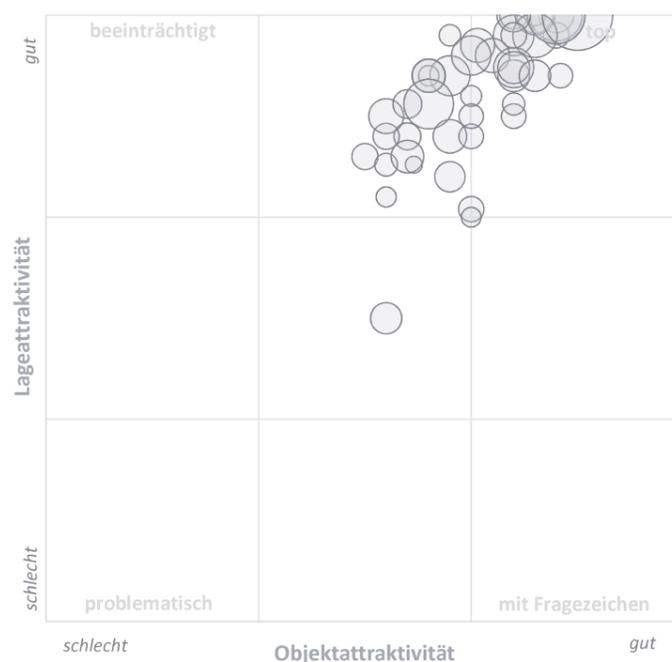
#### Kennzahlen

		30.09.2022	31.12.2021
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	590.34	478.54
Anzahl Ansprüche		425 532	354 484
Kapitalwert <sup>3</sup>	(in CHF)	1 358.79	1 315.62
Laufender Ertrag <sup>3</sup>	(in CHF)	28.50	34.33
Inventarwert <sup>3</sup>	(in CHF)	1 387.29	1 349.95
<sup>3</sup> pro Anspruch			
Mietzinsausfallquote	(in %)	3.60	5.17
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	23.55	11.96
EBIT-Marge	(in %)	61.76	59.78
TER <sub>ISA</sub> 2021 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)		0.77
ROE	(in %)	3.09	4.40
ROIC	(in %)	2.35	3.59

#### Wertentwicklung seit Lancierung



#### Qualitätsprofil per 30.09.2022<sup>4</sup>



<sup>4</sup> Basierend auf Beurteilungen des Immobilienschätzers KPMG AG. Die Blasengrösse widerspiegelt den Marktwert der jeweiligen Liegenschaft.

#### Diversifikation nach Nutzung per 30.09.2022<sup>5</sup> (in %)



<sup>5</sup> Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

#### Diversifikation nach Kanton per 30.09.2022<sup>6</sup> (in %)

Genf	64.0
Waadt	28.7
Wallis	4.0
Neuenburg	3.3

<sup>6</sup> 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%