

Factsheet 03/2023

31.03.2023

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	Neutral	Defensiv
	(100% ≥ GLOCAP ≥ 80%)	(80% > GLOCAP ≥ 60%)	(60% > GLOCAP ≥ 0%)
Verhältnis risikobasier/renditebasiert	30% / 70%	50% / 50%	70% / 30%
Allokation			
Minimum Volatility Index	15.0%	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 31.03.2023 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	0.28	1.70	-1.42
3 Monate	7.93	5.91	2.02
YTD	7.93	5.91	2.02
Letzte 12 Monate	-5.57	-6.38	0.81
3 Jahre ¹	9.54	8.72	0.82
5 Jahre ¹	5.28	7.38	-2.10
10 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung ¹	7.52	5.91	1.61

¹ annualisiert

Kennzahlen

		31.03.2023	31.12.2022
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	92.38	87.40
Anzahl Ansprüche		53 163	54 284
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 727.24	1 573.32
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	10.32	36.63
Inventarwert ²	(in CHF)	1 737.56	1 609.95
TER (inkl. MWST)	(in %)		0.58

² pro Anspruch

Risikokennzahlen per 31.03.2023 (in %)

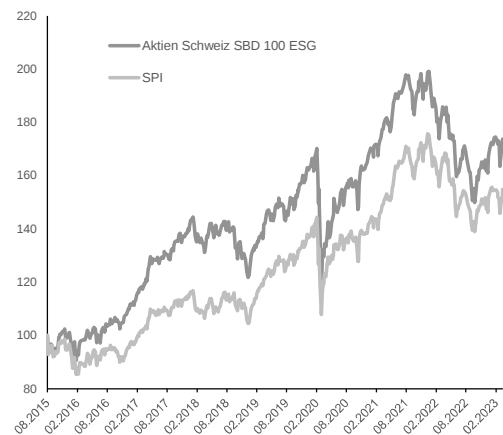
		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	16.95	14.51	14.77
Tracking Error	(in %)	4.12	3.71	5.00
Beta		1.00	0.99	1.03
Sharpe Ratio		-0.88	0.01	-0.28
Information Ratio		0.20	0.22	-0.42
Jensen-Alpha		0.01	0.01	-0.02
Max. Drawdown		-17.52	-23.54	-23.54
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	N.a.	N.a.

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

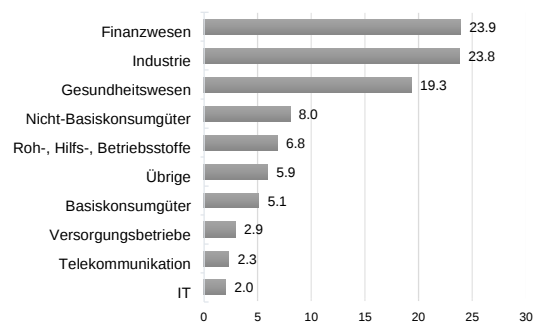
10 grösste Positionen per 31.03.2023 (in %)

Novartis AG N	3.89
Kuehne + Nagel International AG N	3.65
Roche Holding AG G	3.23
Compagnie Financiere Richemont SA N	3.17
Helvetia Holding AG N	3.11
Lonza Group AG N	3.02
Swiss Prime Site AG N	3.00
Banque Cantonale Vaudoise N	2.89
PSP Swiss Property AG N	2.87
BKW AG N	2.85

Wertenwicklung seit Lancierung



Branchenstruktur per 31.03.2023 (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 03/2023

31.03.2023

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 31.03.2023 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	0.69	0.62	0.07
3 Monate	2.74	2.71	0.03
YTD	2.74	2.71	0.03
Letzte 12 Monate	-4.19	-4.03	-0.16
3 Jahre ¹	2.70	2.94	-0.24
5 Jahre ¹	1.64	2.26	-0.62
10 Jahre ¹	2.52	3.13	-0.61
15 Jahre ¹	2.92	3.46	-0.54
Seit Lancierung ¹	4.06	4.44	-0.38

¹ annualisiert

Kennzahlen

		31.03.2023	31.12.2022
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	19.95	18.37
Anzahl Ansprüche		17 934	16 970
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 112.76	1 074.71
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	-0.64	7.76
Inventarwert ²	(in CHF)	1 112.12	1 082.47
TER 2022 (inkl. MWST)	(in %)		0.44

² pro Anspruch

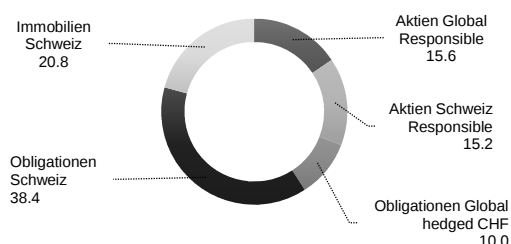
Risikokennzahlen per 31.03.2023 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	8.65	6.55	6.42
Tracking Error	(in %)	0.58	0.47	0.64
Beta		0.95	1.00	1.01
Sharpe Ratio		-0.95	-0.20	-0.37
Information Ratio		-0.29	-0.51	-0.96
Jensen-Alpha		-0.01	0.00	-0.01
Max. Drawdown		-7.76	-11.76	-11.76
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	N.a.	N.a.
Modified Duration ⁴	(in %)	6.61		

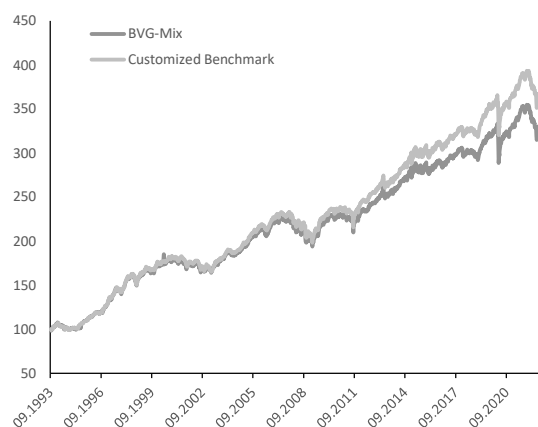
³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

⁴ Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 31.03.2023

Anlageklassenstruktur per 31.03.2023 (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 03/2023

31.03.2023

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	- 22% Obligationen Schweiz
Asset Allocation	- 7% Obligationen Global hedged CHF
	- 20% Aktien Schweiz Responsible
	davon 7% Smart Beta Dynamisch 100 ESG
	13% Responsible
	- 15% Aktien Global Responsible
	- 26% Immobilien Schweiz
	- 10% Hypotheken Schweiz

Performance per 31.03.2023 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	0.49	0.59	-0.10
3 Monate	2.68	2.75	-0.07
YTD	2.68	2.75	-0.07
Letzte 12 Monate	-4.22	-3.40	-0.82
3 Jahre ¹	3.48	3.78	-0.30
5 Jahre ¹	1.91	3.44	-1.53
10 Jahre ¹	3.16	3.97	-0.81
15 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung ¹	3.22	4.13	-0.91

¹ annualisiert

Kennzahlen

		31.03.2023	31.12.2022
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	873.09	638.33
Anzahl Ansprüche		679 947	510 458
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 285.49	1 246.22
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	- 1.44	4.28
Inventarwert ²	(in CHF)	1 284.05	1 250.50
TER 2022 (inkl. MWST)	(in %)		0.51

² pro Anspruch

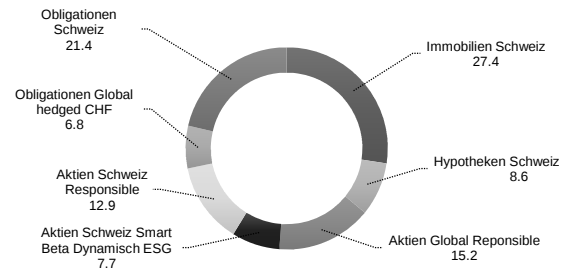
Risikokennzahlen per 31.03.2023 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	8.21	6.26	6.50
Tracking Error	(in %)	0.46	0.95	1.66
Beta		0.92	0.96	1.06
Sharpe Ratio		-1.01	-0.09	-0.33
Information Ratio		-1.80	-0.31	-0.92
Jensen-Alpha		-0.01	0.00	-0.01
Max. Drawdown		-7.87	-11.29	-11.29
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	N.a.	N.a.
Modified Duration ⁴	(in %)	6.58		

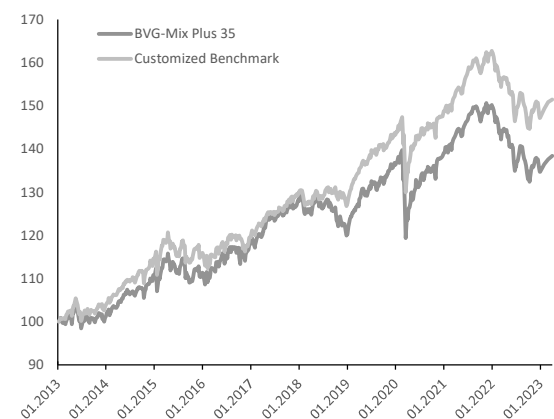
³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

⁴ Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 31.03.2023

Anlageklassenstruktur per 31.03.2023 (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 03/2023

31.03.2023

Hypotheken Schweiz.

Rendite bei geringer Volatilität.

Charakteristika

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

Performance per 31.03.2023 (in %)

Anlagegruppe	Benchmark	Differenz
1 Monat	-0.38	0.07
3 Monate	-1.55	0.84
YTD	-1.55	0.84
Letzte 12 Monate	-9.84	-4.89
3 Jahre ¹	-3.41	-2.59
5 Jahre ¹	N.a.	N.a.
10 Jahre ¹	N.a.	N.a.
15 Jahre ¹	N.a.	N.a.
Seit Lancierung	-5.83	-7.90

¹ annualisiert

Kennzahlen

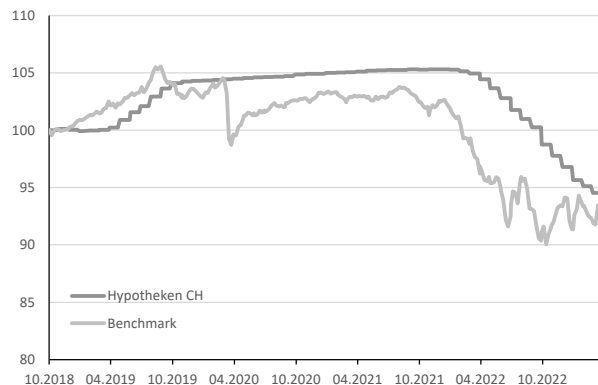
		31.03.2023	31.12.2022
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	100.45	91.56
Anzahl Ansprüche		106 663	95 719
Inventarwert ²	(in CHF)	941.73	956.60
² pro Anspruch			
TER 2022 (inkl. MWST)	(in % p.a.)		0.22
Durchschnittliche Restlaufzeit	(in Jahren)	7.63	7.87
Modified Duration	(in %)	7.35	7.58
Anzahl Hypotheken		182	181
Durchschnittliche Belehnung	(in %)	57.8	57.9
Durchschnittlicher Zinssatz	(in % p.a.)	0.81	0.81
Rendite auf Verfall	(in % p.a.)	2.04	1.83

Risikokennzahlen per 31.03.2023

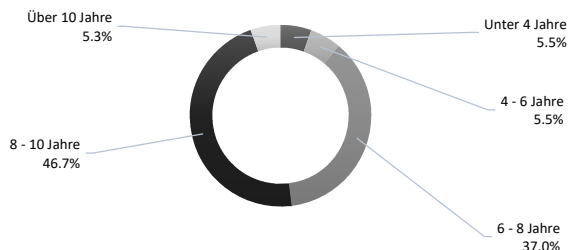
		1 Jahr (pro Monat)	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³ Anlagegruppe	(in %)	0.29%	0.45%	N.a.
Volatilität ³ Benchmark	(in %)	1.85%	1.27%	N.a.

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankung der Rendite)

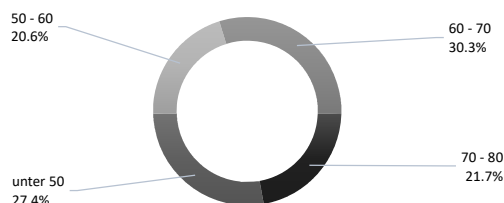
Wertentwicklung seit Lancierung



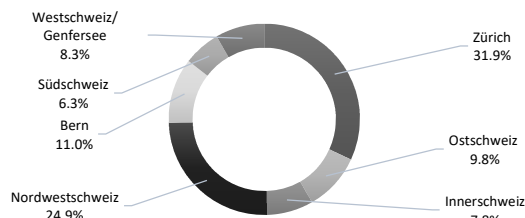
Aufteilung nach Restlaufzeiten per 31.03.2023



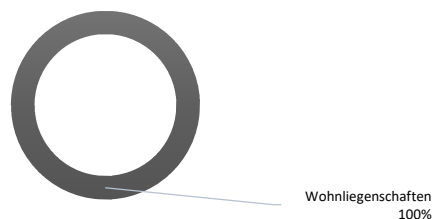
Aufteilung nach Belehnung per 31.03.2023 (in %)



Aufteilung nach Regionen per 31.03.2023



Aufteilung nach Nutzungsarten per 31.03.2023



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 03/2023

31.03.2023

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 31.03.2023 (in %)

	Anlage- gruppe	Bench- mark	Diff. zum Benchmark	Risiko ¹
3 Monate	1.33	0.77	0.56	
YTD	1.33	0.77	0.56	
Letzte 12 Monate	4.84	4.13	0.71	2.24
3 Jahre ²	4.04	4.66	-0.62	1.82
5 Jahre ²	3.80	4.68	-0.88	1.72
10 Jahre ²	3.65	4.91	-1.26	1.66
15 Jahre ²	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung ²	3.74	4.93	-1.18	1.71

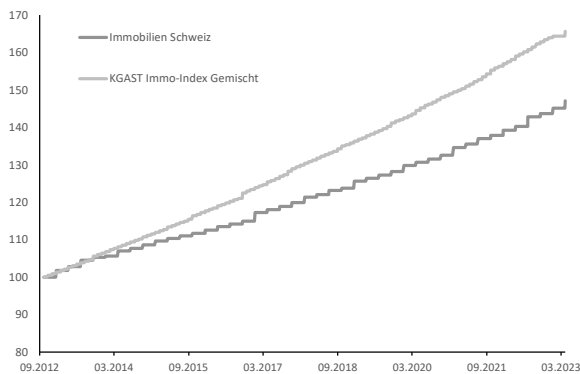
¹ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

² annualisiert

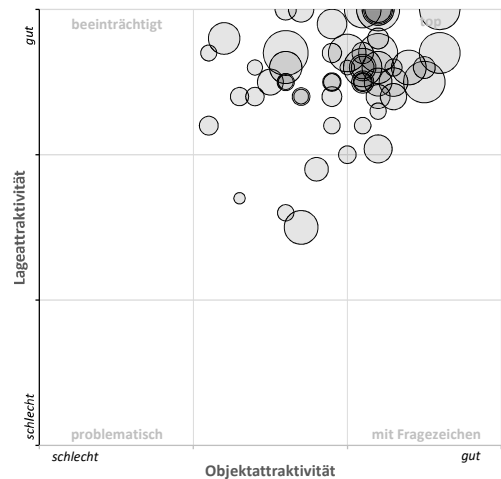
Kennzahlen

	31.03.2023	31.12.2022
Gesamtvermögen	(in Mio. CHF) 1 017.58	1 021.93
Nettovermögen	(in Mio. CHF) 834.41	930.10
Anzahl Ansprüche	567 221	640 708
Kapitalwert ³	(in CHF) 1 456.48	1 414.64
Laufender Ertrag ³	(in CHF) 14.56	37.04
Inventarwert ³	(in CHF) 1 471.04	1 451.68
³ pro Anspruch		
Mietzinsausfallquote	(in %) 5.55	6.29
Fremdfinanzierungsquote	(in %) 16.07	6.39
EBIT-Marge	(in %) 75.57	69.49
TER _{SA} 2022 (NAV) (inkl. MWST)	(in %) 0.60	
ROE	(in %) 1.00	4.23
ROIC	(in %) 1.14	3.97

Wertentwicklung seit Lancierung

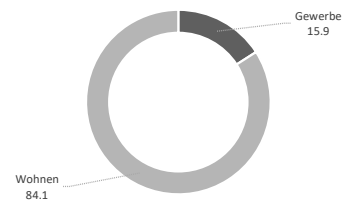


Qualitätsprofil per 31.03.2023*



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

Diversifikation nach Nutzung per 31.03.2023* (in %)



* Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Diversifikation nach Kanton per 31.03.2023* (in %)

Aargau	20.6	Luzern	3.8
Genf	15.7	Thurgau	3.7
Zürich	13.0	Solothurn	2.6
Basel-Landschaft	8.4	St. Gallen	2.5
Bern	6.7	Schaffhausen	2.1
Waadt	6.5	Jura	2.0
Basel-Stadt	5.7	Neuenburg	0.8
Schwyz	5.1	Zug	0.8

* 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. Rücknahmen sind per 30.06. und per 31.12. möglich. 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 03/2023

31.03.2023

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 31.03.2023 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	Risiko ¹
3 Monate	0.64	0.77	-0.14	
YTD	0.64	0.77	-0.14	
Letzte 12 Monate	3.20	4.13	-0.93	1.39
3 Jahre ²	3.88	4.66	-0.78	1.80
5 Jahre ²	3.77	4.68	-0.91	1.69
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	4.85	4.85	0.00	2.90

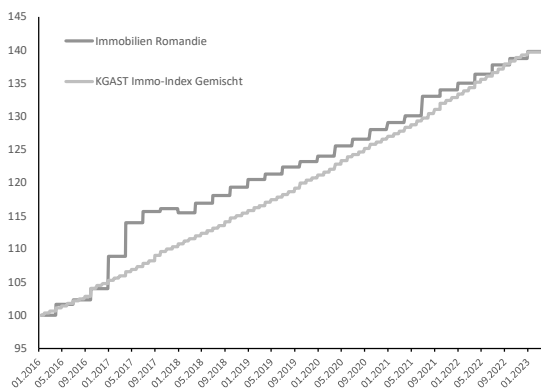
¹ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

² annualisiert

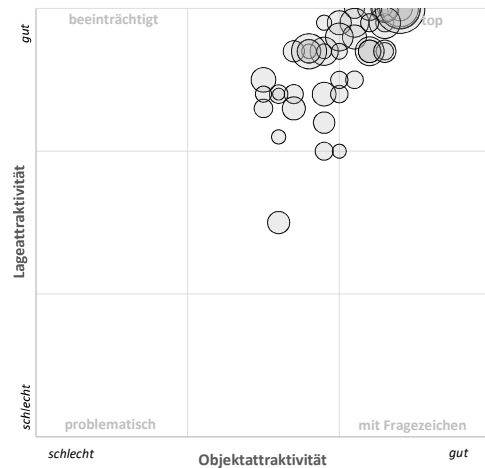
Kennzahlen

		31.03.2023	31.12.2022
Gesamtvermögen	(in Mio. CHF)	811.27	793.43
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	602.99	594.85
Anzahl Ansprüche		428 542	425 447
Kapitalwert ³	(in CHF)	1 397.94	1 365.50
Laufender Ertrag ³	(in CHF)	9.13	32.67
Inventarwert ³	(in CHF)	1 407.07	1 398.17
³ pro Anspruch			
Mietzinsausfallquote	(in %)	1.76	3.16
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	23.47	23.48
EBIT-Marge	(in %)	61.42	57.71
TER _{ISA} 2022 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)		0.72
ROE	(in %)	0.65	3.90
ROIC	(in %)	0.52	2.98

Wertentwicklung seit Lancierung

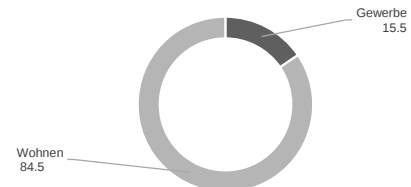


Qualitätsprofil per 31.03.2023⁴



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

Diversifikation nach Nutzung per 31.03.2023⁵ (in %)



⁵ Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Diversifikation nach Kanton per 31.03.2023⁶ (in %)

Genf	65.9
Vaud	26.8
Valais	4.0
Neuchâtel	3.3

⁶ Bei Projekten wurde mit den zu erwartenden Anlagekosten kalkuliert

Zeichnung und Rücknahme

Anlagegruppe bis auf weiteres für Zeichnungen offen. Rücknahmen können jederzeit bei der Helvetia Anlagestiftung angemeldet werden. Rücknahmen sind per 30.06. und 31.12. möglich. Bei Zeichnungsmöglichkeit (vgl. Art. 22. Reglement) erfolgt die Abrechnung mit dem Nettoinventarwert des jeweiligen folgenden Quartalsendes.

Gebühren	
Erwerb	0.00%
Rücknahme	Max. 2.50%