

## Factsheet 09/2023

30.09.2023

### 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 (100% ≥ GLOCAP ≥ 80%)	Neutral (80% > GLOCAP ≥ 60%)	Defensiv (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 30.09.2023 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	-3.26	-2.02	-1.24
3 Monate	-2.13	-3.32	1.19
YTD	5.81	4.61	1.20
Letzte 12 Monate	12.25	9.13	3.12
3 Jahre <sup>1</sup>	3.01	4.13	-1.12
5 Jahre <sup>1</sup>	3.96	5.86	-1.90
10 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung <sup>1</sup>	6.79	5.38	1.41

<sup>1</sup> annualisiert

#### Kennzahlen

		30.09.2023	31.12.2022
Nettvermögen	(in Mio. CHF)	90.39	87.40
Anzahl Ansprüche		53 064	54 284
Kapitalwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 656.87	1 573.32
Laufender Ertrag <sup>2</sup>	(in CHF)	46.60	36.63
Inventarwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 703.47	1 609.95
TER (inkl. MWST)	(in %)		0.58

<sup>2</sup> pro Anspruch

#### Risikokennzahlen per 30.09.2023 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität <sup>3</sup>	(in %)	10.35	14.24	14.81
Tracking Error	(in %)	4.46	3.69	4.96
Beta		0.85	0.97	1.05
Sharpe Ratio		0.67	-0.16	-0.09
Information Ratio		0.70	-0.30	-0.38
Jensen-Alpha		0.04	-0.01	-0.02
Max. Drawdown		-4.65	-23.54	-23.54
Recovery Period	(in Tagen)	N.a.	N.a.	N.a.

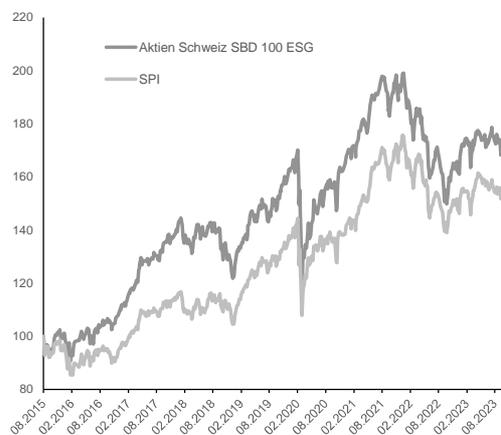
<sup>3</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

**Rechtlicher Hinweis:** Die im vorliegenden Dokument enthaltenen Angaben und Beschreibungen gelten weder als Angebot noch als Aufforderung zum Kauf bzw. Verkauf von bestimmten Finanzinstrumenten noch stellen sie eine Anlageberatung dar. Sie dienen ausschliesslich Informationszwecken. Handlungen oder Unterlassungen ausgehend von den in diesem Dokument enthaltenen Informationen erfolgen ausschliesslich auf eigene Verantwortung. Auch die Einhaltung von gesetzlichen Vorschriften liegt in der individuellen Eigenverantwortung der jeweiligen Empfängerin / des jeweiligen Empfängers. Die Empfängerin / der Empfänger ist sich zudem bewusst, dass sich Daten in Zukunft ändern können. Vor diesem Hintergrund übernimmt die Helvetia Anlagestiftung keine Gewähr betreffend Genauigkeit, Vollständigkeit und Richtigkeit des Inhalts dieses Dokuments. Im Übrigen sei grundsätzlich darauf hingewiesen, dass jede in der Vergangenheit registrierte Performance einer Anlage nicht auf deren zukünftige Rendite schliessen lässt. Das vorliegende Dokument wurde unabhängig von spezifischen Anlagezielen, von einer besonderen finanziellen Situation oder von speziellen Bedürfnissen einer bestimmten Empfängerin / eines bestimmten Empfängers erstellt. Die Verwendung des Inhalts in diesem Dokument ist unter Quellenangabe gestattet.

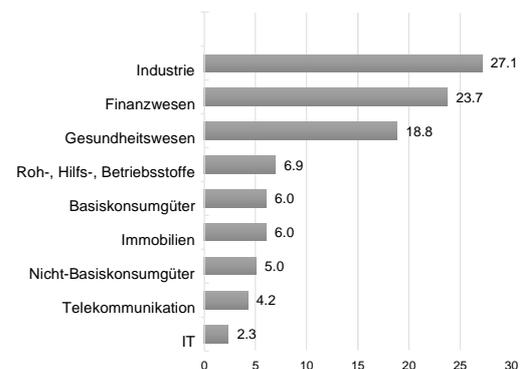
#### 10 grösste Positionen per 30.09.2023 (in %)

Swisscom AG N	4.17
Roche Holding AG G	3.73
Kuehne + Nagel International AG N	3.60
VAT Group AG N	3.59
Helvetia Holding AG N	3.05
PSP Swiss Property AG N	3.03
Nestle AG N	2.98
Swissquote Group Holding SA N	2.98
Galenica AG N	2.93
Swiss Prime Site AG N	2.89

#### Wertenwicklung seit Lancierung



#### Branchenstruktur per 30.09.2023 (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 09/2023

30.09.2023

### 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 30.09.2023 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	-0.94	-0.66	-0.28
3 Monate	-0.88	-0.75	-0.13
YTD	3.80	3.94	-0.14
<b>Letzte 12 Monate</b>			
3 Jahre <sup>1</sup>	0.54	0.85	-0.31
5 Jahre <sup>1</sup>	1.72	2.33	-0.61
10 Jahre <sup>1</sup>	2.58	3.21	-0.63
15 Jahre <sup>1</sup>	3.01	3.54	-0.53
Seit Lancierung <sup>1</sup>	4.02	4.40	-0.38

<sup>1</sup> annualisiert

#### Kennzahlen

		30.09.2023	31.12.2022
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	20.36	18.37
Anzahl Ansprüche		18 120	16 970
Kapitalwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 114.25	1 074.71
Laufender Ertrag <sup>2</sup>	(in CHF)	9.34	7.76
Inventarwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 123.59	1 082.47
TER 2022 (inkl. MWST)	(in %)		0.44

<sup>2</sup> pro Anspruch

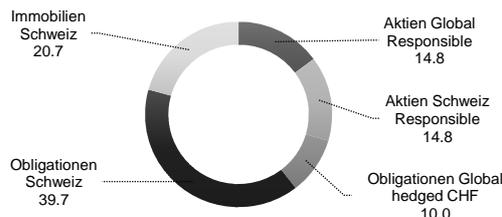
#### Risikokennzahlen per 30.09.2023 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität <sup>3</sup>	(in %)	5.35	6.13	6.41
Tracking Error	(in %)	0.62	0.50	0.66
Beta		0.94	1.00	1.01
Sharpe Ratio		-0.39	-1.06	-0.82
Information Ratio		0.11	-0.64	-0.92
Jensen-Alpha		0.00	0.00	-0.01
Max. Drawdown		-2.67	-11.76	-11.76
Recovery Period	(in Tagen)	31	N.a.	N.a.
Modified Duration <sup>4</sup>	(in %)	6.60		

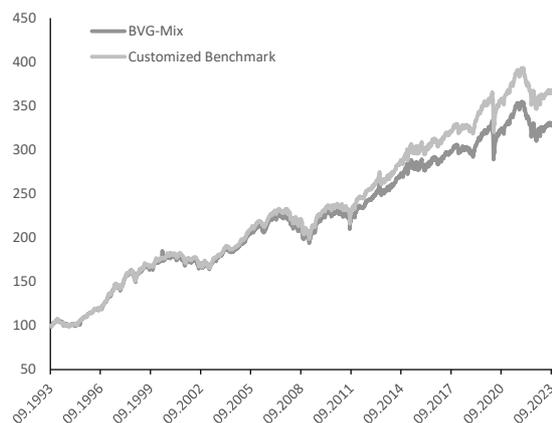
<sup>3</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

<sup>4</sup> Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 30.09.2023

#### Anlageklassenstruktur per 30.09.2023 (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 09/2023

30.09.2023

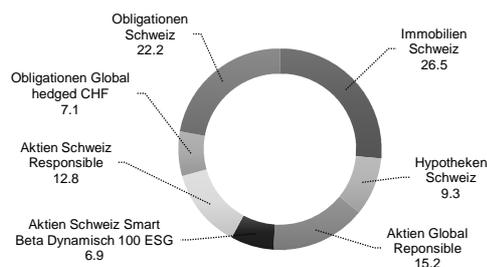
### BVG-Mix Plus 35.

Renditeorientiert.

#### Charakteristika

Gründungsjahr	2013
Valoren-Nr.	3539998 (ISIN: CH0035399986)
Bloomberg	BVGMP30 SW
Benchmark	Customised
Bewertung	Wöchentlich
Ausschüttungspolitik	Thesaurierend
Anlagestil	Core-Satellite
Strategische Asset Allocation	- 22% Obligationen Schweiz - 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

#### Anlageklassenstruktur per 30.09.2023 (in %)



#### Performance per 30.09.2023 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	-0.95	-0.65	-0.30
3 Monate	-1.02	-0.82	-0.20
YTD	3.20	3.95	-0.75
Letzte 12 Monate	4.48	5.30	-0.82
3 Jahre <sup>1</sup>	1.01	1.79	-0.78
5 Jahre <sup>1</sup>	1.96	3.21	-1.25
10 Jahre <sup>1</sup>	3.29	4.09	-0.80
15 Jahre <sup>1</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung <sup>1</sup>	3.12	4.05	-0.93

<sup>1</sup> annualisiert

#### Kennzahlen

		30.09.2023	31.12.2022
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	4.26	638.33
Anzahl Ansprüche		3 298	510 458
Kapitalwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 286.71	1 246.22
Laufender Ertrag <sup>2</sup>	(in CHF)	3.83	4.28
Inventarwert <sup>2</sup>	(in CHF)	1 290.54	1 250.50
TER 2022 (inkl. MWST)	(in %)		0.51

<sup>2</sup> pro Anspruch

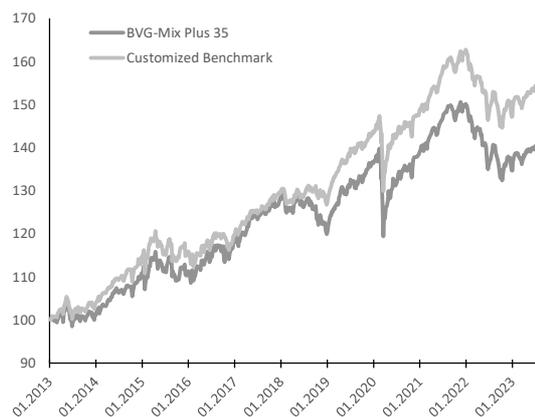
#### Risikokennzahlen per 30.09.2023 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität <sup>3</sup>	(in %)	4.96	5.94	6.41
Tracking Error	(in %)	0.61	0.85	1.58
Beta		0.88	0.95	1.05
Sharpe Ratio		-0.51	-1.01	-0.79
Information Ratio		-1.36	-0.92	-0.79
Jensen-Alpha		-0.01	-0.01	-0.01
Max. Drawdown		-2.41	-11.29	-11.29
Recovery Period	(in Tagen)	31	N.a.	N.a.
Modified Duration <sup>4</sup>	(in %)	6.56		

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

<sup>4</sup> Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 30.09.2023

#### 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 09/2023

30.09.2023

### BVG-Mix Plus 35 (EA).

Renditeorientiert.

#### Charakteristika

Gründungsjahr <sup>1</sup>	2013
Valoren-Nr.	127924353 (ISIN: CH1279243534)
Benchmark	Customised
Bewertung	Wöchentlich
Ausschüttungspolitik	Thesaurierend
Anlagestil	Core-Satellite
Strategische Asset Allocation	- 17% Obligationen Schweiz - 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 - 5% Alternative Anlagen

<sup>1</sup> von 2013 bis Ende Juni 2023 als BVG-Mix Plus 30 bzw. BVG-Mix Plus 35 aufgeführt

#### Performance per 30.09.2023 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark
1 Monat	-0.91	-0.65	-0.26
3 Monate	-0.86	-0.83	-0.03
YTD	3.36	3.95	-0.59
Letzte 12 Monate	4.64	5.30	-0.66
3 Jahre <sup>2</sup>	1.06	1.79	-0.73
5 Jahre <sup>2</sup>	1.99	3.21	-1.22
10 Jahre <sup>2</sup>	3.30	4.09	-0.79
15 Jahre <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung <sup>2</sup>	3.13	4.05	-0.92

<sup>2</sup> annualisiert

#### Kennzahlen

		30.09.2023	31.12.2022
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	896.97	638.33
Anzahl Ansprüche		693 967	510 458
Kapitalwert <sup>3</sup>	(in CHF)	1 286.20	1 246.22
Laufender Ertrag <sup>3</sup>	(in CHF)	6.33	4.28
Inventarwert <sup>4</sup>	(in CHF)	1 292.53	1 250.50
TER 2022 (inkl. MWST)	(in %)		0.51

<sup>3</sup> pro Anspruch

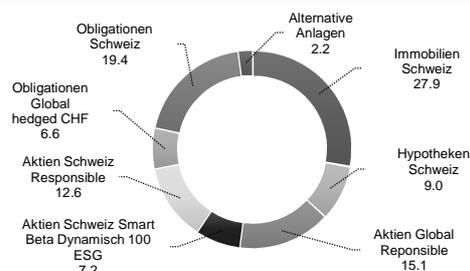
#### Risikokennzahlen per 30.09.2023 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität <sup>4</sup>	(in %)	4.95	5.94	6.41
Tracking Error	(in %)	0.65	0.86	1.58
Beta		0.88	0.95	1.05
Sharpe Ratio		-0.48	-1.00	-0.78
Information Ratio		-1.02	-0.85	-0.77
Jensen-Alpha		-0.01	-0.01	-0.01
Max. Drawdown		-2.41	-11.29	-11.29
Recovery Period	(in Tagen)	31	N.a.	N.a.
Modified Duration <sup>5</sup>	(in %)	6.54		

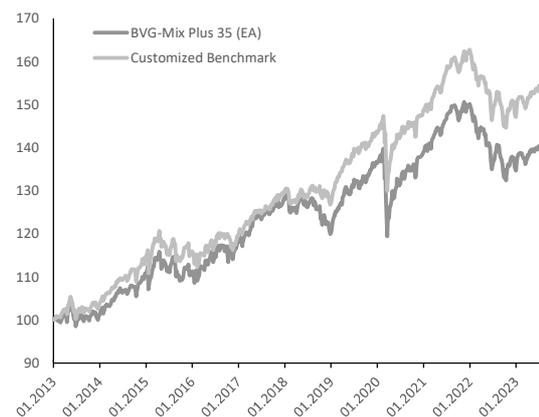
<sup>4</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

<sup>5</sup> Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 30.09.2023

#### Anlageklassenstruktur per 30.09.2023 (in %)



#### Wertentwicklung seit Lancierung



#### Nachhaltigkeitsrating<sup>6</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>6</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 09/2023

30.09.2023

### 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 30.09.2023 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Differenz
1 Monat	0.27	-0.35	0.62
3 Monate	0.28	0.58	-0.30
YTD	-1.46	3.14	-4.60
Letzte 12 Monate	-4.55	3.41	-7.96
3 Jahre <sup>1</sup>	-3.49	-2.80	-0.69
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 <sup>1</sup>	-1.18	-1.19	0.01

<sup>1</sup> annualisiert

#### Kennzahlen

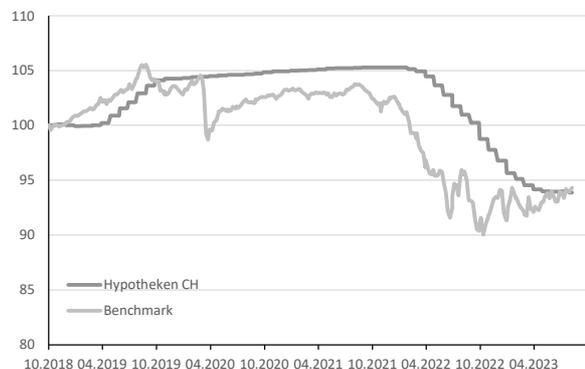
		30.09.2023	31.12.2022
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	107.48	91.56
Anzahl Ansprüche		114 019	95 719
Inventarwert <sup>2</sup>	(in CHF)	942.67	956.60
<sup>2</sup> pro Anspruch			
TER 2022 (inkl. MWST)	(in % p.a.)		0.22
Durchschnittliche Restlaufzeit	(in Jahren)	7.18	7.87
Modified Duration	(in %)	6.85	7.58
Anzahl Hypotheken		200	181
Durchschnittliche Belehnung	(in %)	58.6	57.9
Durchschnittlicher Zinssatz	(in % p.a.)	0.98	0.81
Rendite auf Verfall	(in % p.a.)	2.52	1.83

#### Risikokennzahlen per 30.09.2023

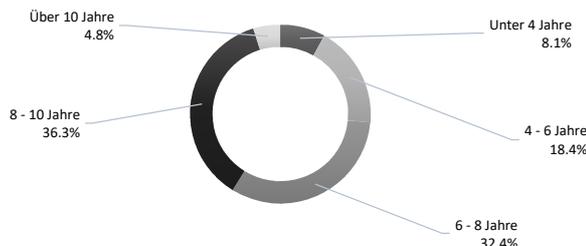
		1 Jahr (pro Monat)	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität <sup>3</sup> Anlagegruppe	(in %)	0.48%	0.45%	N.a.
Volatilität <sup>3</sup> Benchmark	(in %)	1.23%	1.26%	N.a.

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

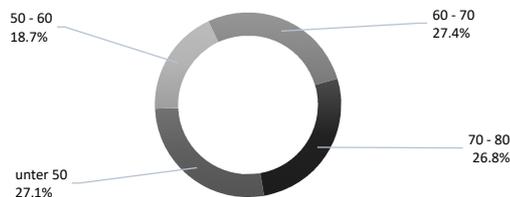
#### Wertentwicklung seit Lancierung



#### Aufteilung nach Restlaufzeiten per 30.09.2023



#### Aufteilung nach Belehnung per 30.09.2023 (in %)



#### Aufteilung nach Regionen per 30.09.2023



#### Aufteilung nach Nutzungsarten per 30.09.2023



#### Zeichnung und Rücknahme

Zeichnungen werden jederzeit entgegengenommen. Die Rücknahme von Ansprüchen erfolgt auf den 30.06. und 31.12. mit einer Ankündigungsfrist von 6 Monaten.

#### Gebühren

Erwerb	0.25%
Rücknahme	0.50%

## Factsheet 09/2023

30.09.2023

### Immobilien Schweiz.

Nachhaltig stabile Renditen, geringe Volatilität.

#### Charakteristika

Gründungsjaar	2012
Valoren-Nr.	18823078 (ISIN: CH0188230780)
Bloomberg	IMMSCHW SW
Benchmark	KGAST Immo-Index Gemischt
Bewertung	Quartalsweise
Ausschüttungspolitik	Thesaurierend
Anlagestil	Aktiv
Region	Schweiz
Strategische	- mind. ¾ Wohnimmobilien
Diversifikation	- max. ¼ Geschäftsimmobilien

#### Performance per 30.09.2023 (in %)

	Anlage- gruppe	Bench- mark	Diff. zum Benchmark	Risiko <sup>1</sup>
3 Monate	0.81	0.18	0.63	
YTD	2.45	1.59	0.86	
Letzte 12 Monate	3.49	2.58	0.91	1.67
3 Jahre <sup>2</sup>	3.92	4.10	-0.19	1.82
5 Jahre <sup>2</sup>	3.74	4.35	-0.61	1.71
10 Jahre <sup>2</sup>	3.51	4.69	-1.18	1.61
15 Jahre <sup>2</sup>	N.a.	N.a.	N.a.	N.a.
Seit Lancierung <sup>2</sup>	3.67	4.77	-1.10	1.69

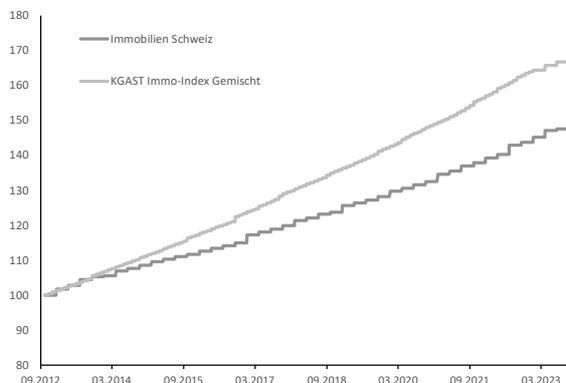
<sup>1</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

<sup>2</sup> annualisiert

#### Kennzahlen

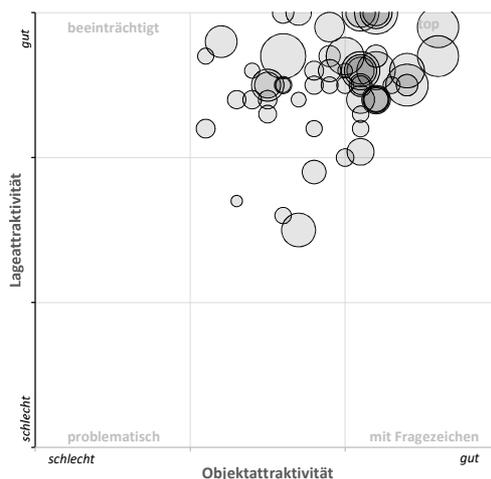
	30.09.2023	31.12.2022
Gesamtvermögen	(in Mio. CHF) 1 015.49	1 021.93
Nettovermögen	(in Mio. CHF) 831.58	930.10
Anzahl Ansprüche	559 165	640 708
Kapitalwert <sup>3</sup>	(in CHF) 1 450.39	1 414.64
Laufender Ertrag <sup>3</sup>	(in CHF) 36.80	37.04
Inventarwert <sup>3</sup>	(in CHF) 1 487.19	1 451.68
<sup>3</sup> pro Anspruch		
Mietzinsausfallquote	(in %) 5.62	6.29
Fremdfinanzierungsquote	(in %) 15.84	6.39
EBIT-Marge	(in %) 72.70	69.49
TER <sub>SA</sub> 2022 (NAV) (inkl. MWST)	(in %) 0.60	
ROE	(in %) 2.10	4.23
ROIC	(in %) 2.17	3.97

#### Wertentwicklung seit Lancierung



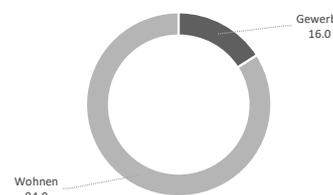
**Rechtlicher Hinweis:** Die im vorliegenden Dokument enthaltenen Angaben und Beschreibungen gelten weder als Angebot noch als Aufforderung zum Kauf bzw. Verkauf von bestimmten Finanzinstrumenten noch stellen sie eine Anlageberatung dar. Sie dienen ausschliesslich Informationszwecken. Handlungen oder Unterlassungen ausgehend von den in diesem Dokument enthaltenen Informationen erfolgen ausschliesslich auf eigene Verantwortung. Auch die Einhaltung von gesetzlichen Vorschriften liegt in der individuellen Eigenverantwortung der jeweiligen Empfängerin / des jeweiligen Empfängers. Die Empfängerin / der Empfänger ist sich zudem bewusst, dass sich Daten in Zukunft ändern können. Vor diesem Hintergrund übernimmt die Helvetia Anlagestiftung keine Gewähr betreffend Genauigkeit, Vollständigkeit und Richtigkeit des Inhalts dieses Dokuments. Im Übrigen sei grundsätzlich darauf hingewiesen, dass jede in der Vergangenheit registrierte Performance einer Anlage nicht auf deren zukünftige Rendite schliessen lässt. Das vorliegende Dokument wurde unabhängig von spezifischen Anlageerträgen, von einer besonderen finanziellen Situation oder von speziellen Bedürfnissen einer bestimmten Empfängerin / eines bestimmten Empfängers erstellt. Die Verwendung des Inhalts in diesem Dokument ist unter Quellenangabe gestattet.

#### Qualitätsprofil per 30.09.2023\*



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

#### Diversifikation nach Nutzung per 30.09.2023<sup>5</sup> (in %)



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

#### Diversifikation nach Kanton per 30.09.2023<sup>6</sup> (in %)

Aargau	20.7	Luzern	3.7
Genève	15.7	Thurgau	3.5
Zürich	13.3	Solothurn	2.6
Basel-Landschaft	8.4	St. Gallen	2.4
Bern	6.7	Schaffhausen	2.1
Waadt	6.6	Jura	2.0
Basel-Stadt	5.7	Neuenburg	0.8
Schwyz	5.2	Zug	0.7

<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. Rücknahmen erfolgen per 30.06. und per 31.12. mit einer Ankündigungsfrist von 6 Monaten. Bei Zeichnungsmöglichkeit (vgl. Art. 20, Reglement) erfolgt die Abrechnung mit dem Nettoinventarwert des jeweiligen folgenden Quartalsendes.

#### Gebühren

Erwerb	0.00%
Rücknahme	2.50%

## Factsheet 09/2023

30.09.2023

### 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 30.09.2023 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	Risiko <sup>1</sup>
3 Monate	0.77	0.18	0.59	
YTD	1.55	1.59	-0.04	
Letzte 12 Monate	2.34	2.58	-0.24	1.14
3 Jahre <sup>2</sup>	3.51	4.10	-0.59	1.73
5 Jahre <sup>2</sup>	3.54	4.35	-0.81	1.64
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>	4.65	4.64	0.01	2.82

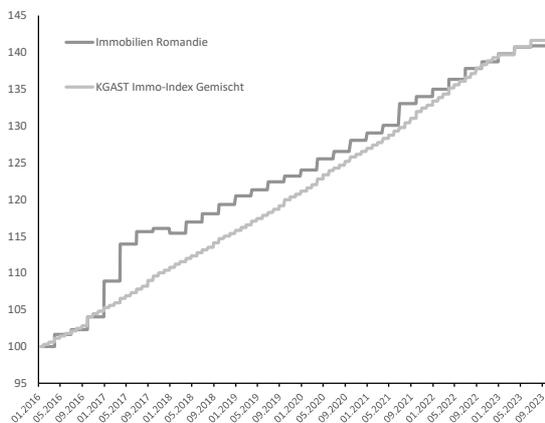
<sup>1</sup> gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

<sup>2</sup> annualisiert

#### Kennzahlen

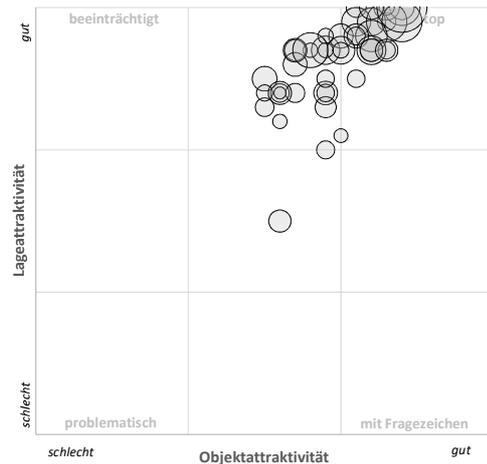
		30.09.2023	31.12.2022
Gesamtvermögen	(in Mio. CHF)	797.53	793.43
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	620.98	594.85
Anzahl Ansprüche		437 362	425 447
Kapitalwert <sup>3</sup>	(in CHF)	1 388.87	1 365.50
Laufender Ertrag <sup>3</sup>	(in CHF)	30.95	32.67
Inventarwert <sup>3</sup>	(in CHF)	1 419.82	1 398.17
<sup>3</sup> pro Anspruch			
Mietzinsausfallquote	(in %)	2.17	3.16
Fremdfinanzierungsquote	(in %)	21.06	23.48
EBIT-Marge	(in %)	72.02	57.71
TER <sub>ISA</sub> 2022 (NAV) (inkl. MWST)	(in %)		0.72
ROE	(in %)	1.57	3.90
ROIC	(in %)	1.36	2.98

#### Wertentwicklung seit Lancierung



**Rechtlicher Hinweis:** Die im vorliegenden Dokument enthaltenen Angaben und Beschreibungen gelten weder als Angebot noch als Aufforderung zum Kauf bzw. Verkauf von bestimmten Finanzinstrumenten noch stellen sie eine Anlageberatung dar. Sie dienen ausschliesslich Informationszwecken. Handlungen oder Unterlassungen ausgehend von den in diesem Dokument enthaltenen Informationen erfolgen ausschliesslich auf eigene Verantwortung. Auch die Einhaltung von gesetzlichen Vorschriften liegt in der individuellen Eigenverantwortung der jeweiligen Empfängerin / des jeweiligen Empfängers. Die Empfängerin / der Empfänger ist sich zudem bewusst, dass sich Daten in Zukunft ändern können. Vor diesem Hintergrund übernimmt die Helvetia Anlagestiftung keine Gewähr bezüglich Genauigkeit, Vollständigkeit und Richtigkeit des Inhalts dieses Dokuments. Im Übrigen ist grundsätzlich darauf hingewiesen, dass jede in der Vergangenheit registrierte Performance einer Anlage nicht auf deren zukünftige Rendite schliessen lässt. Das vorliegende Dokument wurde unabhängig von spezifischen Anlagezielen, von einer besonderen finanziellen Situation oder von speziellen Bedürfnissen einer bestimmten Empfängerin / eines bestimmten Empfängers erstellt. Die Verwendung des Inhalts in diesem Dokument ist unter Quellenangabe gestattet.

#### Qualitätsprofil per 30.09.2023<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 30.09.2023<sup>5</sup> (in %)



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

#### Diversifikation nach Kanton per 30.09.2023<sup>5</sup> (in %)

Genève	65.6
Vaud	27.1
Valais	4.0
Neuchâtel	3.3

<sup>5</sup> 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 erfolgen per 30.06. und per 31.12. mit einer Ankündigungsfrist von 6 Monaten. Bei Zessionsmöglichkeit (vgl. Art. 20, Reglement) erfolgt die Abrechnung mit dem Nettoinventarwert des jeweiligen folgenden Quartalsendes.

#### Gebühren

Erwerb	0.00%
Rücknahme	2.50%