

Factsheet 04/2024

30.04.2024

LPP-Mix.

Bien diversifié.

Caractéristiques

Année de fondation	1993
N° de valeur	1176860 (ISIN: CH0011768600)
Bloomberg	PATBVGM SW
Valeur de référence	Sur mesure
Évaluation	Hebdomadaire
Politique de distribution	Accumulative
Style de placement	Core-satellite
Allocation d'actifs stratégique	- 40% Obligations Suisse - 10% Obligations Global hedged CHF - 15% Actions Suisse Responsables - 15% Actions Global Responsables - 20% Immobilier Suisse

Performance au 30.04.2024 (en %)

	Groupe de placement	Valeur de référence	Différence au valeur de référence
1 mois	-0.67	-0.98	0.31
3 mois	2.30	2.19	0.11
Année en cours	2.89	2.63	0.26
Derniers 12 mois	5.75	5.70	0.05
Derniers 3 ans ¹	0.67	0.79	-0.12
Derniers 5 ans ¹	1.96	2.28	-0.32
Derniers 10 ans ¹	2.75	3.29	-0.54
Derniers 15 ans ¹	3.57	4.09	-0.52
Depuis le lancement ¹	4.13	4.49	-0.36

¹ annualisé

Chiffres-clés

		30.04.2024	31.12.2023
Fortune nette	(en millions CHF)	23.90	20.84
Nombre de quotes-parts		20 129	18 055
Valeur en capital ²	(en CHF)	1 188.31	1 145.55
Revenu couru ²	(en CHF)	-0.83	8.56
Valeur d'inventaire ²	(en CHF)	1 187.48	1 154.11
TER 2023 (TVA incl.)	(en %)		0.41

² par quote-part

Indicateurs de risque au 30.04.2024 (en %)

		1 an	3 ans	5 ans
Volatilité ³	(en %)	3.76	5.99	6.35
Marge d'erreur	(en %)	0.50	0.46	0.56
Beta		0.84	0.98	1.00
Sharpe Ratio		-0.20	-0.97	-0.72
Information Ratio		0.12	-0.25	-0.57
Jensen-Alpha		0.00	0.00	0.00
Max. Drawdown		-2.16	-11.76	-11.76
Recovery Period	(en jours)	30	N.a.	N.a.
Modified Duration ⁴	(en %)	6.76		

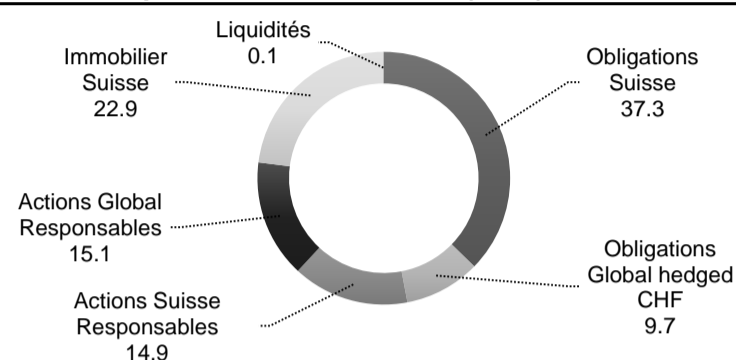
³ mesuré en fluctuation standard (fluctuations des rendements)

⁴ Duration calculée sur les placements à revenu fixe au 30.04.2024

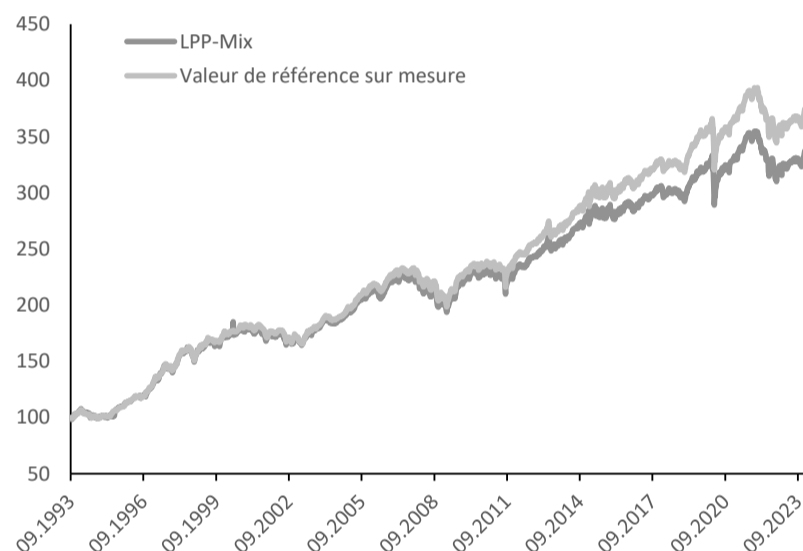
Souscription et reprise

Les souscriptions et les reprises qui parviennent à l'Helvetia Fondation de placement avant mardi 11.00 h sont décomptées au cours de clôture du mercredi suivant.

Structure du portefeuille au 30.04.2024 (en %)



Évolution des valeurs depuis le lancement

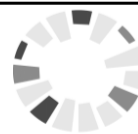


Notation de durabilité⁵

Obligations Suisse	1	2	3	4	5	6	7
Obligations Global hedged CHF	1	2	3	4	5	6	7
Actions Suisse Responsables	1	2	3	4	5	6	7
Actions Global Responsables	1	2	3	4	5	6	7

⁵Échelle: 1 pour faible et 7 pour élevée

GRESB Rating



G R E S B
☆☆☆☆☆ 2023

L'organisation indépendante Global Real Estate Sustainability Benchmark (GRESB) établit annuellement un classement dans le domaine des placements immobiliers destiné à mettre à la disposition des investisseurs des résultats de benchmarking indépendants et transparents sur la performance ESG des entreprises et des véhicules de placement immobilier.

Frais

Acquisition	0.00%
Reprise	0.25%