

Aktien Schweiz Smart Beta Dynamisch 100.

Innovativ indexiert, intelligent investiert.




30.09.2019

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 30.09.2019 (in %)

	Anlagegruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	KGAST Ranking
1 Monat	2.68	1.43	1.25	
3 Monate	1.38	2.14	-0.76	
YTD	23.55	24.45	-0.90	
Letzte 12 Monate	7.89	13.19	-5.30	
3 Jahre ¹	12.79	11.26	1.53	
5 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
10 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
Seit Lancierung ¹	10.60	6.64	3.96	

¹annualisiert

Kennzahlen

		30.09.2019	31.12.2018
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	102.04	49.39
Anzahl Ansprüche		67 407	40 314
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 479.30	1 151.91
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	34.47	73.30
Inventarwert ²	(in CHF)	1 513.77	1 225.21
TER (inkl. MWST)	(in %)	0.58	

²pro Anspruch

Risikokennzahlen per 30.09.2019 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	14.96	10.56	N.a.
Tracking Error	(in %)	3.33	4.57	N.a.
Beta		0.84	0.93	N.a.
Sharpe Ratio		0.23	0.78	N.a.
Information Ratio		-1.59	0.34	N.a.
Jensen-Alpha		-0.04	0.02	N.a.
Max. Drawdown		-12.67	-14.17	N.a.
Recovery Period	(in Tagen)	120	120	N.a.

³gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

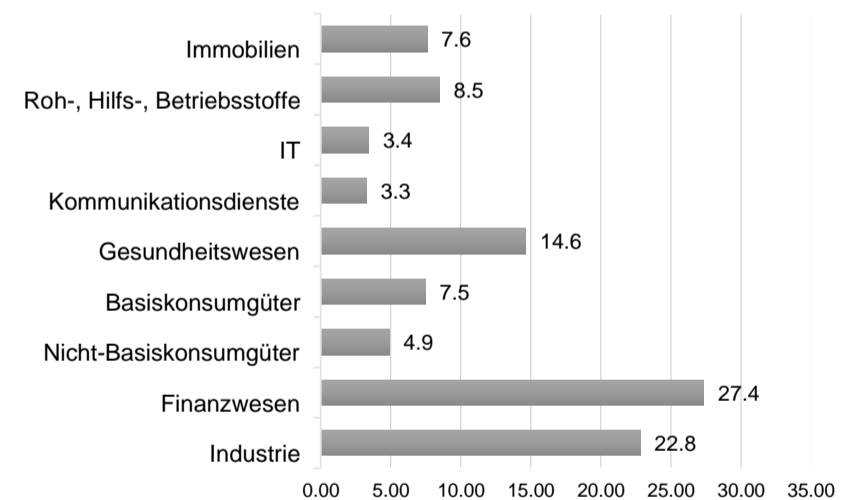
10 grösste Positionen per 30.09.2019 (in %)

PSP Swiss Property AG N	4.83
Swiss Life Holding AG N	3.97
Sonova Holding AG N	3.49
UBS Group AG N	3.38
Novartis AG N	3.33
Roche Holding AG G	3.20
Partners Group Holding AG N	3.18
Geberit AG N	3.15
Helvetia Holding AG N	3.07
Nestle AG N	2.99

Wertenwicklung seit Lancierung



Branchenstruktur per 30.09.2019 (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%