

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.10.2016		Stratégie			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	3'963'488	0.6%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	116'111'691	17.7%	9.0%	16.0%	24.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	99'008'586	15.1%	9.0%	14.0%	19.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	51'691'823	7.9%	5.0%	7.0%	9.0%		
Obligations des marchés émergents (couvertes)	29'136'161	4.4%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	299'911'749	45.7%	40.0%	41.0%	60.0%		
Actions	183'584'044	28.0%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	87'583'255	13.4%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	63'736'705	9.7%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	23'846'550	3.6%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde	72'765'857	11.1%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large et Mid Cap	66'199'624	10.1%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	6'566'233	1.0%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	23'234'932	3.5%	1.0%	3.0%	5.0%		
Placements alternatifs (couverts)	172'458'151	4.1%	2.0%	6.0%	10.0%	15.0%	55 let. d)
SSL + CRIP	19'797'618	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
Matières premières	7'338'172	1.1%	1.0%	3.0%	5.0%		
Immobilier	145'322'361	22.2%	21.0%	28.0%	35.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	113'012'202	17.2%	9.0%	22.0%	28.0%		
Etranger (couvert)	32'310'159	4.9%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	356'042'195	54.3%		59.0%			
Total	655'953'944	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	96'000'789	14.6%	10.0%	15.0%	19.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	335'283'308	51.1%					
Couverture	239'282'519	36.5%					

Performances du portefeuille

2016

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/16	T2/16	T3/16	oct. 16	YTD 2016*
Portefeuille total	656	0.54%	2.31%	1.39%	-0.98%	3.27%

* jusqu'au 31.10.2016

© PPCmetrics SA

Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2011	2012	2013	2014	2015	YTD 2016*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	656	-0.26%	8.01%	6.13%	8.37%	1.71%	3.27%	32.48%	3.24%	01.01.08

* jusqu'au 31.10.2016

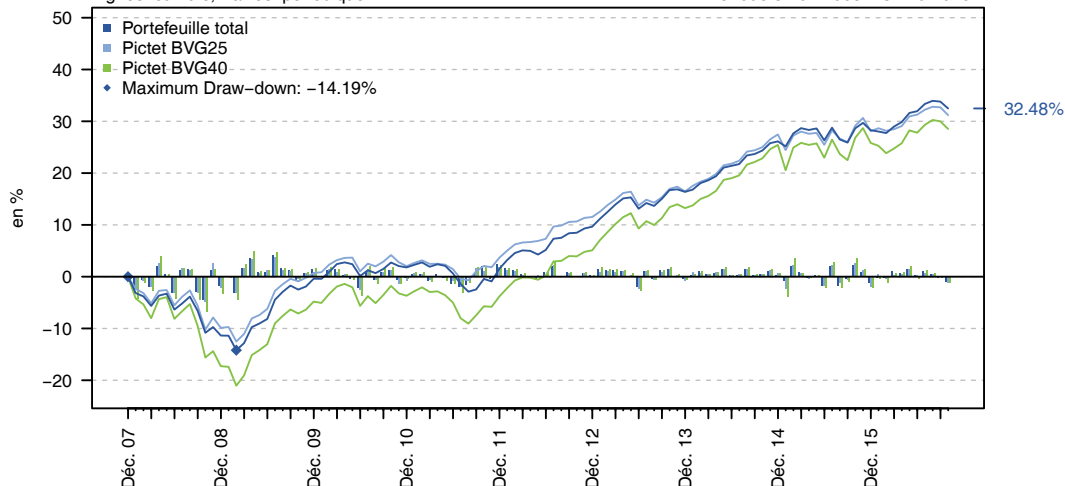
© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés

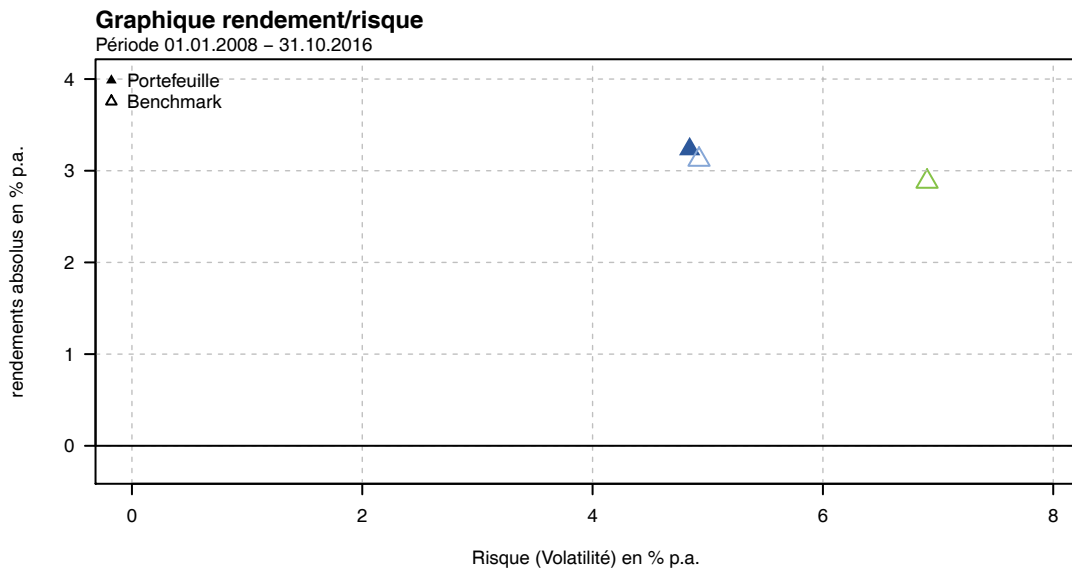
Rendements absolus sur la période

Lignes: cumulé, Barres: périodique

Période 31.01.2008 – 31.10.2016



Profil rendement / risque du portefeuille



- Portefeuille total
 - Pictet BVG25
 - Pictet BVG40
- © PPCmetrics SA / Fondation Patrimonia / Konsolidierung/Consolidation / Portefeuille total / 10260

Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2016 au 30.09.2016)

