

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.12.2018		Stratégie			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	58 270 502	5.9%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	150 059 868	15.3%	13.0%	16.0%	19.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	130 520 646	13.3%	11.0%	14.0%	17.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	64 044 924	6.5%	5.0%	7.0%	9.0%		
Obligations des marchés émergents (couvertes)	36 266 152	3.7%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	439 162 092	44.7%	40.0%	41.0%	60.0%		
Actions	211 951 577	21.6%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	108 478 775	11.0%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	79 988 186	8.1%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	28 490 589	2.9%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde	77 645 987	7.9%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large et Mid Cap	77 645 987	7.9%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	-	0.0%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	25 826 815	2.6%	1.0%	3.0%	5.0%		
Placements alternatifs (couverts)	49 234 535	5.0%	2.0%	6.0%	10.0%	15.0%	55 let. d)
SSL	22 824 369	2.3%	1.0%	3.0%	5.0%		
Matières premières	26 410 166	2.7%	1.0%	3.0%	5.0%		
Immobilier	282 726 265	28.8%	23.0%	28.0%	33.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	235 150 083	23.9%	18.0%	22.0%	26.0%		
Direct	133 918 997	13.6%					
Indirect	101 231 086	10.3%					
Etranger (couvert)	47 576 182	4.8%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	543 912 377	55.3%		59.0%			
Total	983 074 469	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	103 472 802	10.5%	9.0%	13.0%	17.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	431 115 241	43.9%					
Couverture	327 642 439	33.3%					

Performances du portefeuille

2018

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/18	T2/18	T3/18	oct. 18	nov. 18	déc. 18	T4/18	2018
Portefeuille total	983.1	-1.30%	0.37%	0.44%	-1.30%	-0.14%	-0.97%	-2.39%	-2.88%

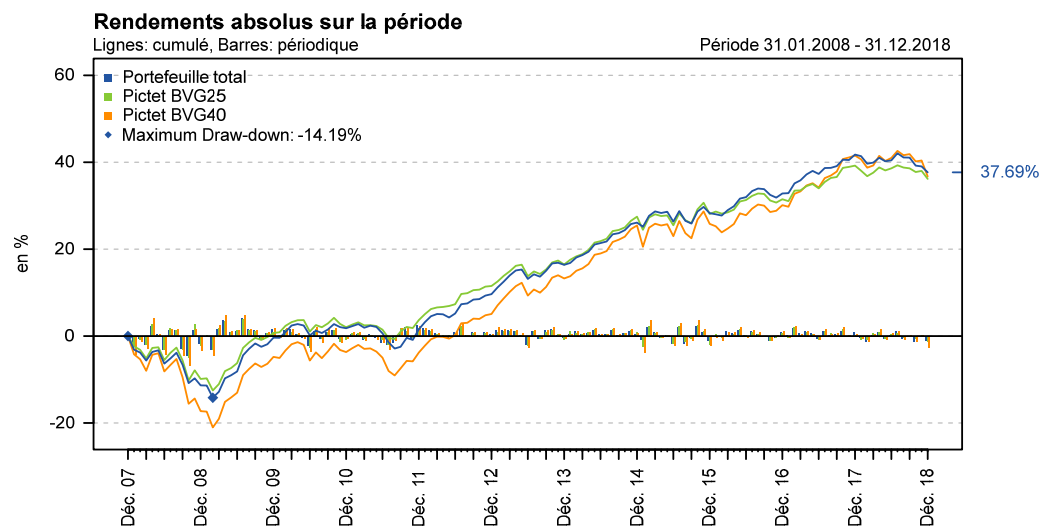
© PPCmetrics SA

Depuis le début de la mesure de performance

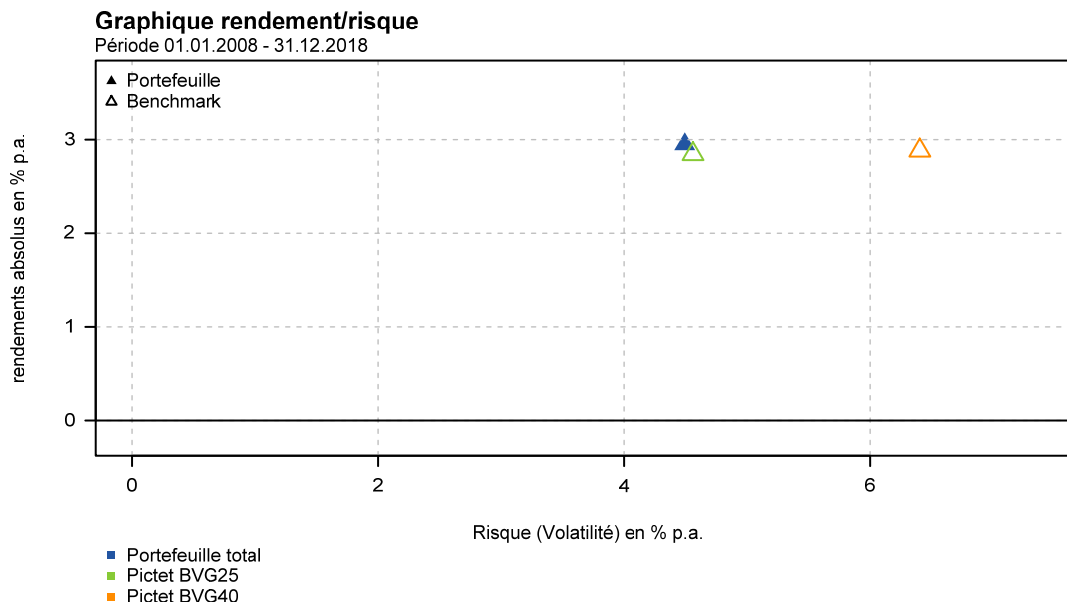
	mio de CHF	2013	2014	2015	2016	2017	2018	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	983.1	6.13%	8.37%	1.71%	3.54%	6.74%	-2.88%	37.69%	2.95%	01.01.08

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille



© PPCmetrics SA / Fondation Patrimonia / Konsolidierung/Consolidation / Portefeuille total / 10260

Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2018 au 30.09.2018)

