

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.01.2019		Stratégie			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	14 042 475	1.3%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	172 917 249	15.8%	13.0%	16.0%	19.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	160 402 572	14.6%	11.0%	14.0%	17.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	75 706 287	6.9%	5.0%	7.0%	9.0%		
Obligations des marchés émergents (couvertes)	43 761 492	4.0%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	466 830 075	42.6%	40.0%	41.0%	60.0%		
Actions	277 419 058	25.3%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	131 673 724	12.0%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	99 579 614	9.1%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	32 094 110	2.9%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde	112 804 015	10.3%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large et Mid Cap	99 999 154	9.1%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	12 804 861	1.2%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	32 941 319	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
Placements alternatifs (couverts)	64 335 728	5.9%	2.0%	6.0%	10.0%	15.0%	55 let. d)
SSL	31 919 453	2.9%	1.0%	3.0%	5.0%		
Matières premières	32 416 275	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
Immobilier	286 996 603	26.2%	23.0%	28.0%	33.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	239 154 531	21.8%	18.0%	22.0%	26.0%		
Direct	133 918 997	12.2%					
Indirect	105 235 534	9.6%					
Etranger (couvert)	47 842 072	4.4%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	628 751 389	57.4%		59.0%			
Total	1 095 581 464	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	145 745 334	13.3%	9.0%	13.0%	17.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	537 793 485	49.1%					
Couverture	392 048 151	35.8%					

Performances du portefeuille

2019

Rendements année sous revue	mio de CHF	janv. 19	YTD 2019*	depuis le
Portefeuille total	1'096.0	2.78%	2.78%	01.01.19
Benchmark stratégique		3.86%	3.86%	
Différence		-1.08%	-1.08%	

* jusqu'au 31.01.2019

© PPCmetrics SA

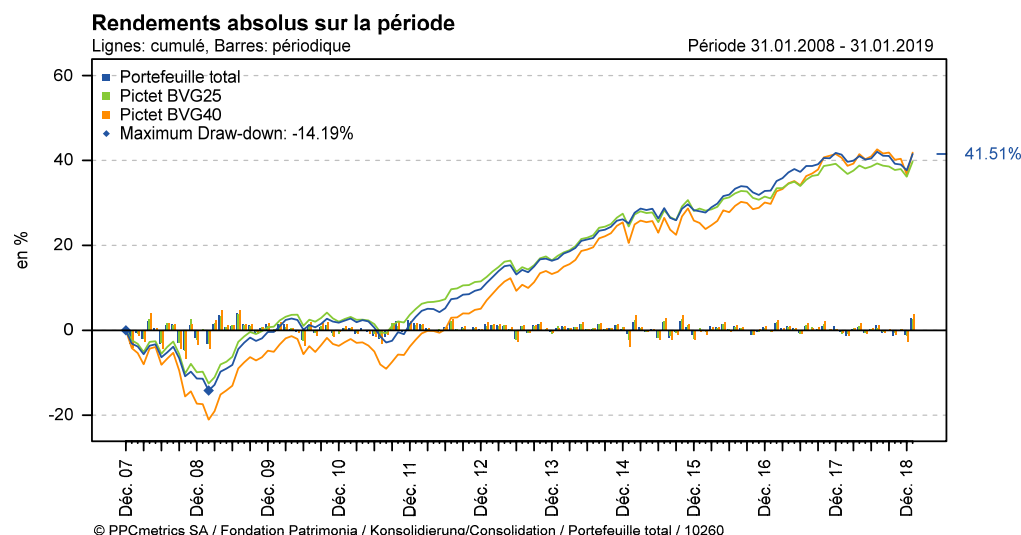
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF							Depuis le lancement		
		2014	2015	2016	2017	2018	YTD 2019*	cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	1'096	8.37%	1.71%	3.54%	6.74%	-2.88%	2.78%	41.51%	3.18%	01.01.08

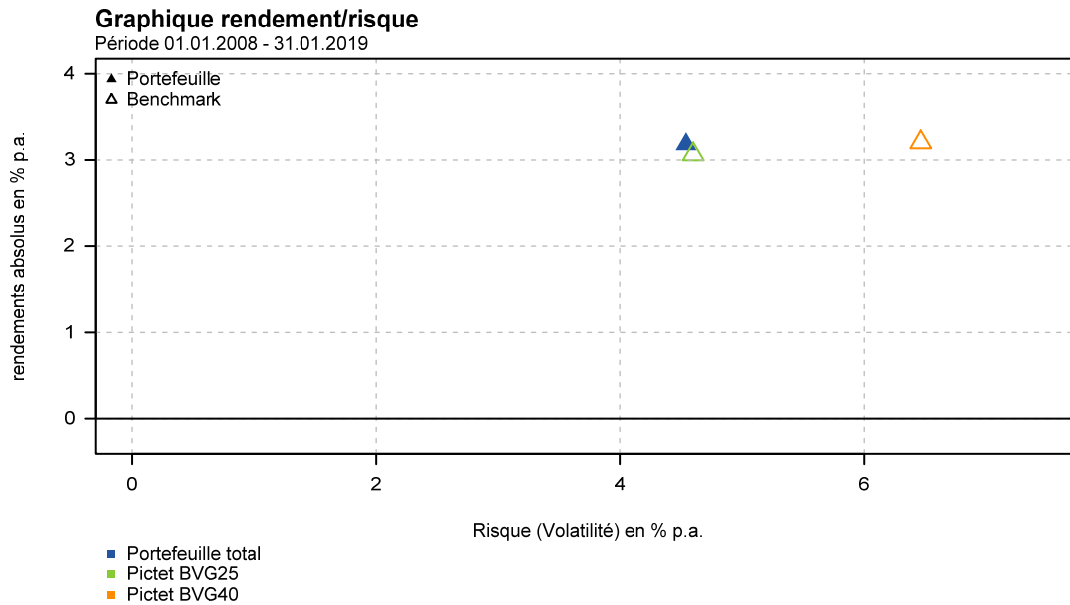
* jusqu'au 31.01.2019

© 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 31.12.2018)

