

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 30.11.2018		Stratégie			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	8'407'593	0.9%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	148'729'615	16.0%	13.0%	16.0%	19.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	128'890'663	13.9%	11.0%	14.0%	17.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	63'553'443	6.8%	5.0%	7.0%	9.0%		
Obligations des marchés émergents (couvertes)	35'840'111	3.9%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	385'421'425	41.5%	40.0%	41.0%	60.0%		
Actions	228'316'570	24.6%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	116'516'485	12.5%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	85'779'602	9.2%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	30'736'883	3.3%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde	85'223'318	9.2%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large et Mid Cap	85'223'318	9.2%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	-	0.0%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	26'576'767	2.9%	1.0%	3.0%	5.0%		
Placements alternatifs (couverts)	54'006'534	5.8%	2.0%	6.0%	10.0%	15.0%	55 let. d)
SSL	23'380'488	2.5%	1.0%	3.0%	5.0%		
CRIP	4'000'050	0.4%					
Matières premières	26'625'996	2.9%	1.0%	3.0%	5.0%		
Immobilier	261'523'488	28.1%	23.0%	28.0%	33.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	214'540'903	23.1%	18.0%	22.0%	26.0%		
Direct	114'038'602	12.3%					
Indirect	100'502'301	10.8%					
Etranger (couvert)	46'982'585	5.1%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	543'846'592	58.5%		59.0%			
Total	929'268'017	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	111'800'085	12.0%	10.0%	15.0%	19.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	437'073'371	47.0%					
Couverture	325'273'286	35.0%					

Performances du portefeuille

2018

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/18	T2/18	T3/18	oct. 18	nov. 18	YTD 2018*
Portefeuille total	929.3	-1.30%	0.37%	0.44%	-1.29%	-0.13%	-1.91%

* jusqu'au 30.11.2018

© PPCmetrics SA

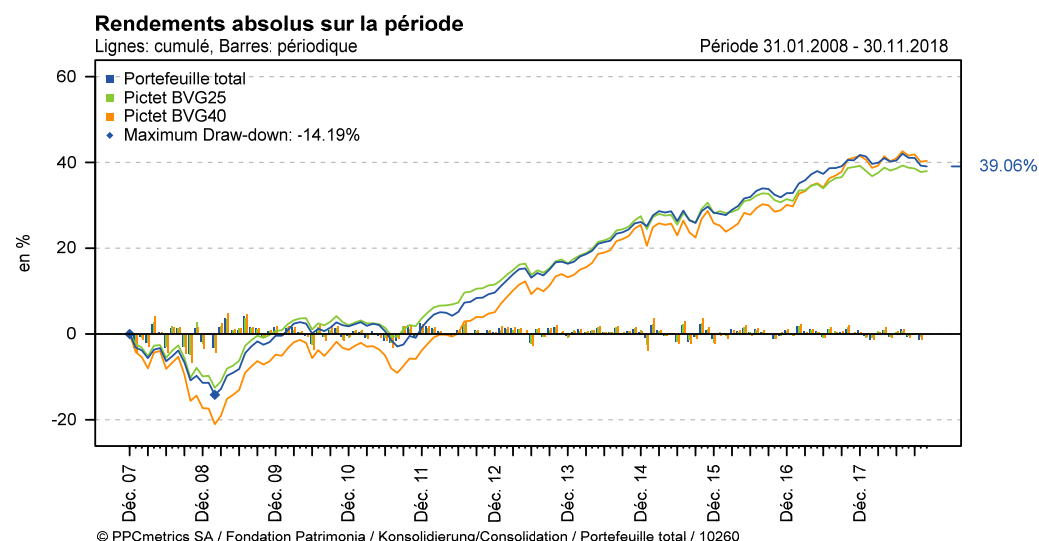
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2013	2014	2015	2016	2017	YTD 2018*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	929.3	6.13%	8.37%	1.71%	3.54%	6.74%	-1.91%	39.06%	3.07%	01.01.08

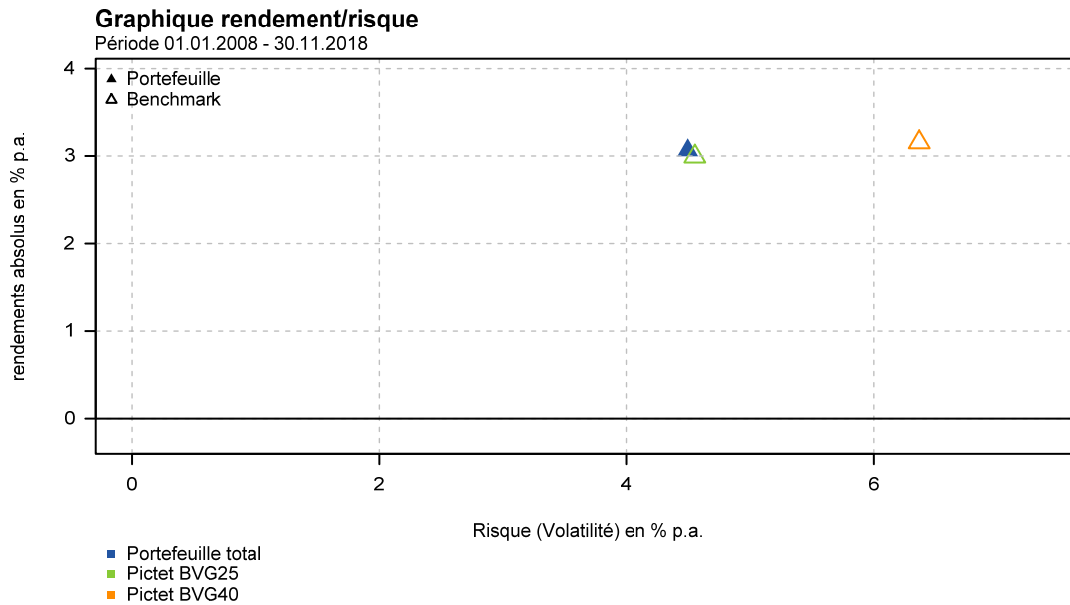
* jusqu'au 30.11.2018

© 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)

