

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.10.2018		Stratégie			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	11'921'274	1.3%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	148'670'575	15.9%	13.0%	16.0%	19.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	128'950'036	13.8%	11.0%	14.0%	17.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	63'897'817	6.8%	5.0%	7.0%	9.0%		
Obligations des marchés émergents (couvertes)	36'083'440	3.9%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	389'523'142	41.7%	40.0%	41.0%	60.0%		
Actions	237'648'682	25.5%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	118'568'000	12.7%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	86'086'634	9.2%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	32'481'366	3.5%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde	93'730'242	10.0%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large et Mid Cap	84'758'718	9.1%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	8'971'524	1.0%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	25'350'440	2.7%	1.0%	3.0%	5.0%		
Placements alternatifs (couverts)	54'897'286	5.9%	2.0%	6.0%	10.0%	15.0%	55 let. d)
SSL	23'699'669	2.5%	1.0%	3.0%	5.0%		
CRIP	4'000'050	0.4%					
Matières premières	27'197'567	2.9%	1.0%	3.0%	5.0%		
Immobilier	251'293'294	26.9%	23.0%	28.0%	33.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	204'355'024	21.9%	18.0%	22.0%	26.0%		
Direct	82'920'900	8.9%					
Indirect	121'434'124	13.0%					
Etranger (couvert)	46'938'270	5.0%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	543'839'262	58.3%		59.0%			
Total	933'362'404	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	119'080'682	12.8%	10.0%	15.0%	19.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	445'847'481	47.8%					
Couverture	326'766'799	35.0%					

Performances du portefeuille

2018

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/18	T2/18	T3/18	oct. 18	YTD 2018*
Portefeuille total	933.4	-1.30%	0.37%	0.44%	-1.29%	-1.78%

* jusqu'au 31.10.2018

© PPCmetrics SA

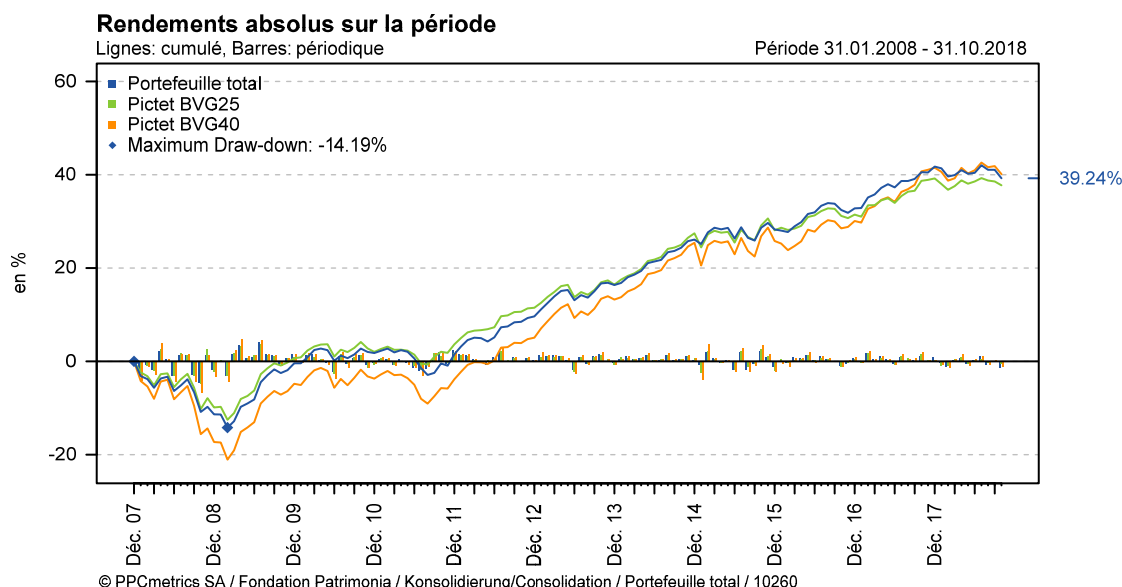
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2013	2014	2015	2016	2017	YTD 2018*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	933.4	6.13%	8.37%	1.71%	3.54%	6.74%	-1.78%	39.24%	3.10%	01.01.08

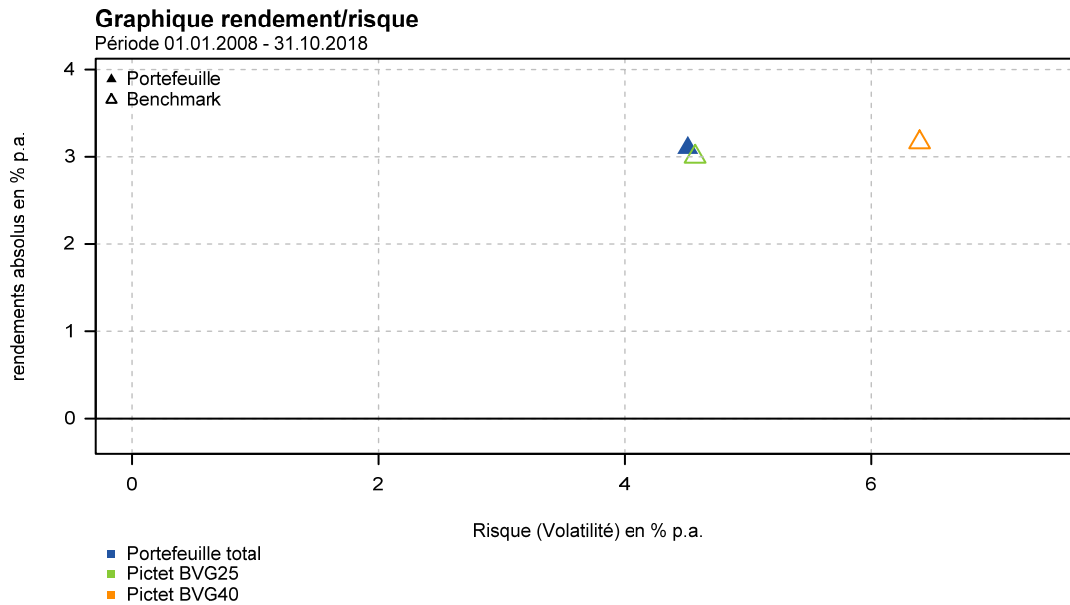
* jusqu'au 31.10.2018

© 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)

