

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.08.2019		Stratégie			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	8'541'164	0.6%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	211'929'288	16.1%	13.0%	16.0%	19.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	187'217'057	14.2%	11.0%	14.0%	17.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	93'529'441	7.1%	5.0%	7.0%	9.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	52'358'872	4.0%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	553'575'822	42.0%	40.0%	41.0%	60.0%		
Actions	345'408'318	26.2%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	177'767'411	13.5%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	136'603'039	10.4%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	41'164'372	3.1%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde DM	128'880'559	9.8%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large & Mid Cap	114'938'183	8.7%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	13'942'376	1.1%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	38'760'348	2.9%	1.0%	3.0%	5.0%		
Placements alternatifs (couverts)	61'979'436	4.7%	2.0%	6.0%	10.0%	15.0%	55 let. d)
SSL (couverts)	38'293'918	2.9%	1.0%	3.0%	5.0%		
Matières premières (absolute return) (couvertes)	23'685'518	1.8%	1.0%	3.0%	5.0%		
Immobilier	355'865'975	27.0%	23.0%	28.0%	33.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	296'713'447	22.5%	18.0%	22.0%	26.0%		
Direct	154'580'141	11.7%					
Indirect	142'133'306	10.8%					
Etranger DM (couvert)	59'152'528	4.5%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	763'253'729	58.0%		59.0%			
Total	1'316'829'551	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	167'640'907	12.7%	9.0%	13.0%	17.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	621'878'241	47.2%					
Couverture	454'237'334	34.5%					

Performances du portefeuille

2019

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/19	T2/19	juil. 19	août 19	YTD 2019*
Portefeuille total	1'316.8	5.31%	2.24%	0.98%	0.38%	9.14%

* jusqu'au 31.08.2019

© PPCmetrics SA

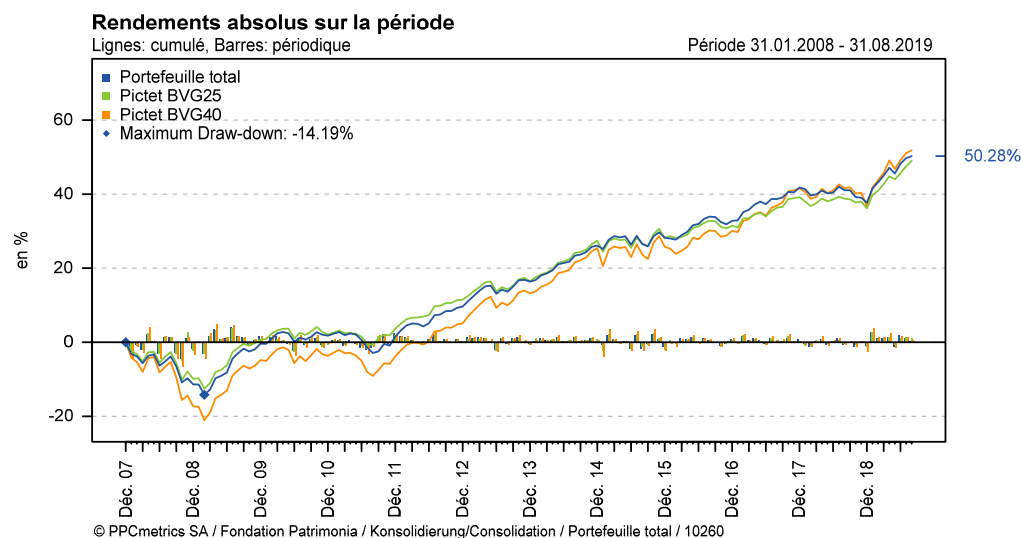
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2014	2015	2016	2017	2018	YTD 2019*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	1'316.8	8.37%	1.71%	3.54%	6.74%	-2.88%	9.14%	50.28%	3.55%	01.01.08

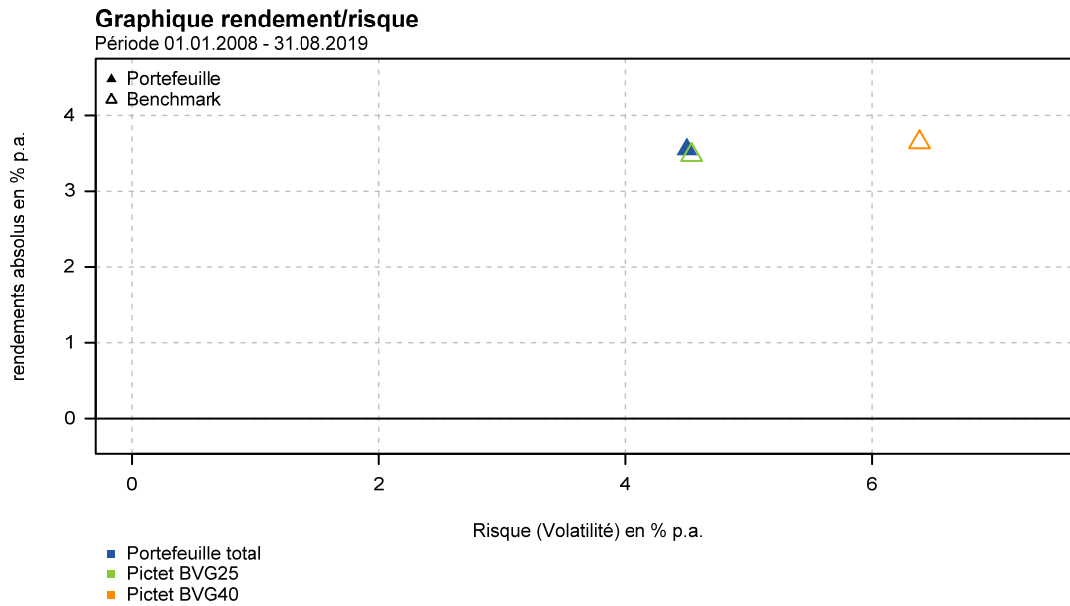
* jusqu'au 31.08.2019

© 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 01.01.2019 au 30.06.2019)

