

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 30.11.2019		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	13'616'566	1.0%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	214'340'270	15.7%	13.0%	16.0%	19.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	185'024'932	13.5%	11.0%	14.0%	17.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	93'841'726	6.9%	5.0%	7.0%	9.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	52'949'736	3.9%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	559'773'230	41.0%	40.0%	41.0%	60.0%		
<i>Actions</i>	371'829'553	27.2%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
<i>Suisse</i>	189'518'332	13.9%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	144'462'175	10.6%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	45'056'157	3.3%	2.0%	3.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	141'582'691	10.4%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large & Mid Cap	126'313'599	9.2%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	15'269'092	1.1%	0.0%	1.0%	2.0%		
<i>Marchés émergents</i>	40'728'530	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
<i>Placements alternatifs (couverts)</i>	61'373'121	4.5%	2.0%	6.0%	10.0%	15.0%	55 let. d)
SSL (couverts)	38'236'473	2.8%	1.0%	3.0%	5.0%		
Matières premières (couvertes)	23'136'648	1.7%	1.0%	3.0%	5.0%		
<i>Immobilier</i>	373'562'162	27.3%	23.0%	28.0%	33.0%	30.0%	55 let. c)
<i>Suisse</i>	307'474'256	22.5%	18.0%	22.0%	26.0%		
Direct	154'580'141	11.3%					
Indirect	152'894'115	11.2%					
<i>Etranger (couvert)</i>	66'087'906	4.8%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	806'764'836	59.0%		59.0%			
Total	1'366'538'066	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	182'311'221	13.3%	9.0%	13.0%	17.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	641'588'642	46.9%					
Couverture	459'277'421	33.6%					

Performances du portefeuille

2019

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/19	T2/19	T3/19	oct. 19	nov. 19	YTD 2019*
Portefeuille total	1'366.5	5.31%	2.24%	1.46%	0.38%	1.02%	10.79%

* jusqu'au 30.11.2019

© PPCmetrics SA

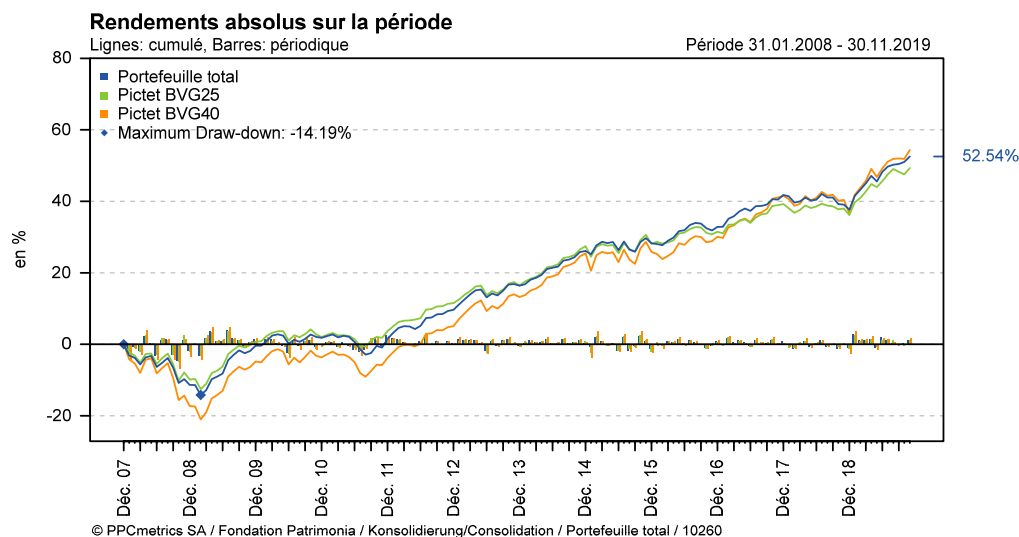
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2014	2015	2016	2017	2018	YTD 2019*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	1'366.5	8.37%	1.71%	3.54%	6.74%	-2.88%	10.79%	52.54%	3.61%	01.01.08

* jusqu'au 30.11.2019

© PPCmetrics SA

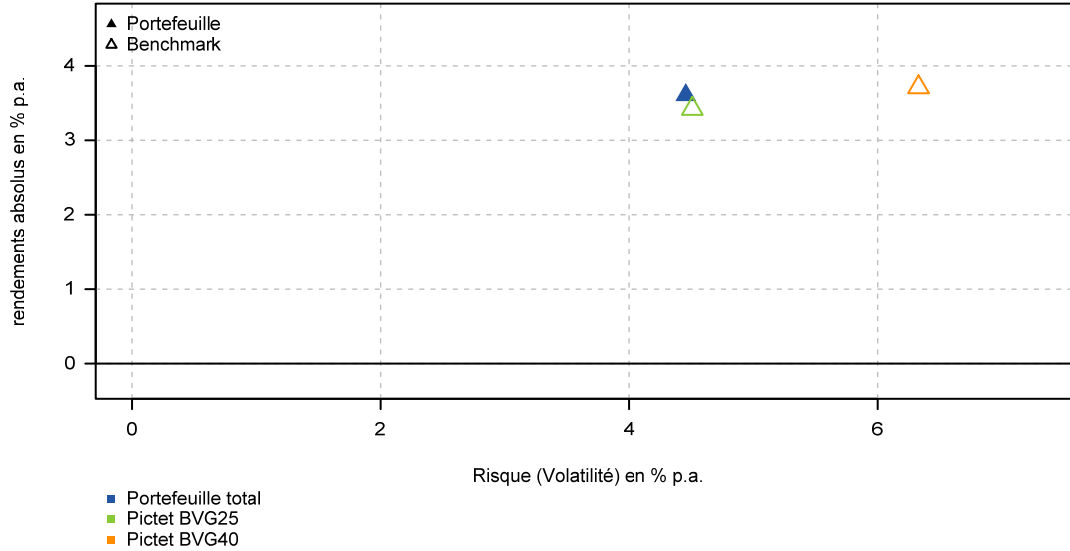
Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille

Graphique rendement/risque

Période 01.01.2008 - 30.11.2019



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

Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2019 au 30.09.2019)

