

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.10.2019		Stratégie			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	10'274'674	0.8%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	213'357'367	15.8%	13.0%	16.0%	19.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	187'267'344	13.8%	11.0%	14.0%	17.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	93'902'120	6.9%	5.0%	7.0%	9.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	53'320'976	3.9%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	558'122'481	41.3%	40.0%	41.0%	60.0%		
Actions	360'903'679	26.7%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	184'909'311	13.7%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	141'943'016	10.5%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	42'966'295	3.2%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde DM	135'814'170	10.0%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large & Mid Cap	121'223'482	9.0%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	14'590'688	1.1%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	40'180'198	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
Placements alternatifs (couverts)	61'267'110	4.5%	2.0%	6.0%	10.0%	15.0%	55 let. d)
SSL (couverts)	38'016'264	2.8%	1.0%	3.0%	5.0%		
Matières premières (absolute return) (couvertes)	23'250'846	1.7%	1.0%	3.0%	5.0%		
Immobilier	371'996'888	27.5%	23.0%	28.0%	33.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	305'835'332	22.6%	18.0%	22.0%	26.0%		
Direct	154'580'141	11.4%					
Indirect	151'255'191	11.2%					
Etranger DM (couvert)	66'161'556	4.9%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	794'167'677	58.7%		59.0%			
Total	1'352'290'158	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	175'994'368	13.0%	9.0%	13.0%	17.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	637'913'474	47.2%					
Couverture	461'919'106	34.2%					

Performances du portefeuille

2019

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/19	T2/19	T3/19	oct. 19	YTD 2019*
Portefeuille total	1'352.3	5.31%	2.24%	1.46%	0.38%	9.66%

* jusqu'au 31.10.2019

© PPCmetrics SA

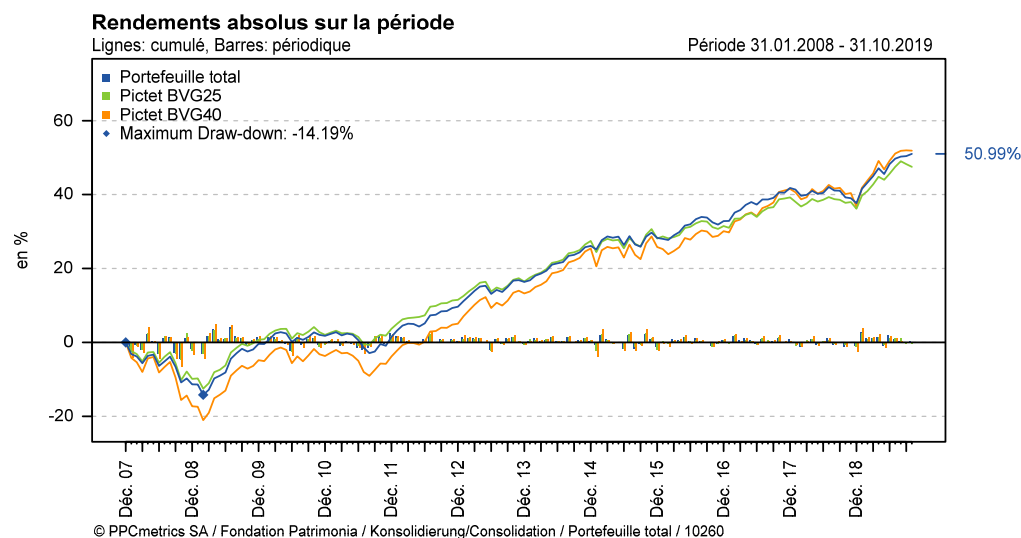
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2014	2015	2016	2017	2018	YTD 2019*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	1'352.3	8.37%	1.71%	3.54%	6.74%	-2.88%	9.66%	50.99%	3.54%	01.01.08

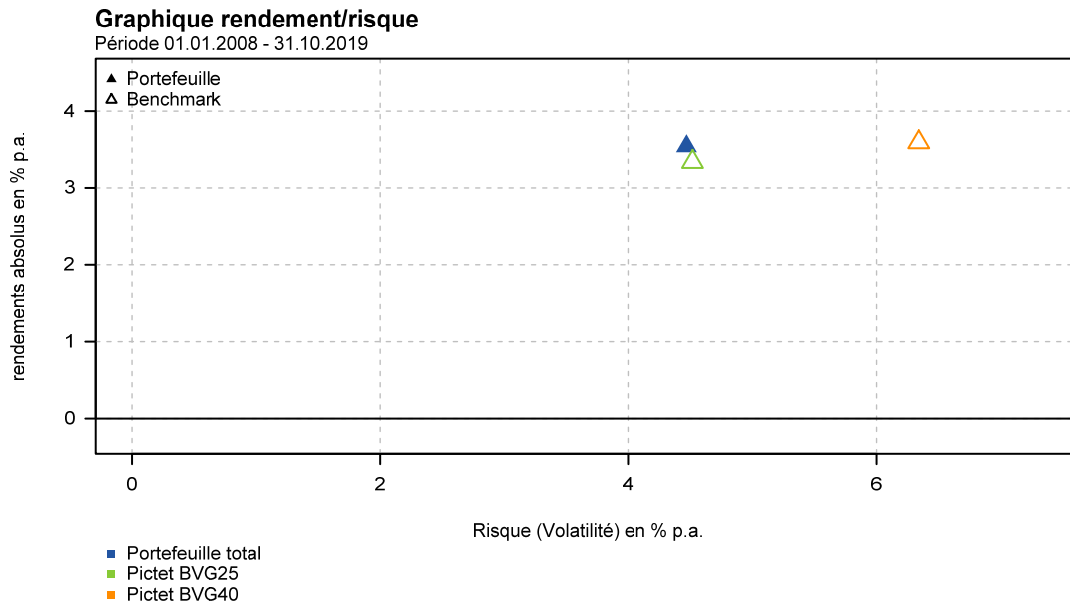
* jusqu'au 31.10.2019

© 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 30.09.2019)

