

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 30.09.2019		Stratégie			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	8'650'304	0.7%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	211'274'598	15.9%	13.0%	16.0%	19.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	185'539'719	14.0%	11.0%	14.0%	17.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	92'753'200	7.0%	5.0%	7.0%	9.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	53'126'796	4.0%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	551'344'617	41.5%	40.0%	41.0%	60.0%		
Actions	355'593'696	26.8%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	182'791'220	13.8%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	140'593'227	10.6%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	42'197'993	3.2%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde DM	132'742'093	10.0%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large & Mid Cap	118'395'004	8.9%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	14'347'089	1.1%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	40'060'383	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
Placements alternatifs (couverts)	61'592'992	4.6%	2.0%	6.0%	10.0%	15.0%	55 let. d)
SSL (couverts)	38'418'384	2.9%	1.0%	3.0%	5.0%		
Matières premières (absolute return) (couvertes)	23'174'608	1.7%	1.0%	3.0%	5.0%		
Immobilier	359'731'366	27.1%	23.0%	28.0%	33.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	300'284'258	22.6%	18.0%	22.0%	26.0%		
Direct	154'580'141	11.6%					
Indirect	145'704'117	11.0%					
Etranger DM (couvert)	59'447'108	4.5%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	776'918'054	58.5%		59.0%			
Total	1'328'262'671	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	172'802'476	13.0%	9.0%	13.0%	17.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	625'262'291	47.1%					
Couverture	452'459'815	34.1%					

Performances du portefeuille

2019

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/19	T2/19	juil. 19	août 19	sept. 19	T3/19	YTD 2019*
Portefeuille total	1'328.3	5.31%	2.24%	0.98%	0.38%	0.10%	1.47%	9.26%

* jusqu'au 30.09.2019

© PPCmetrics SA

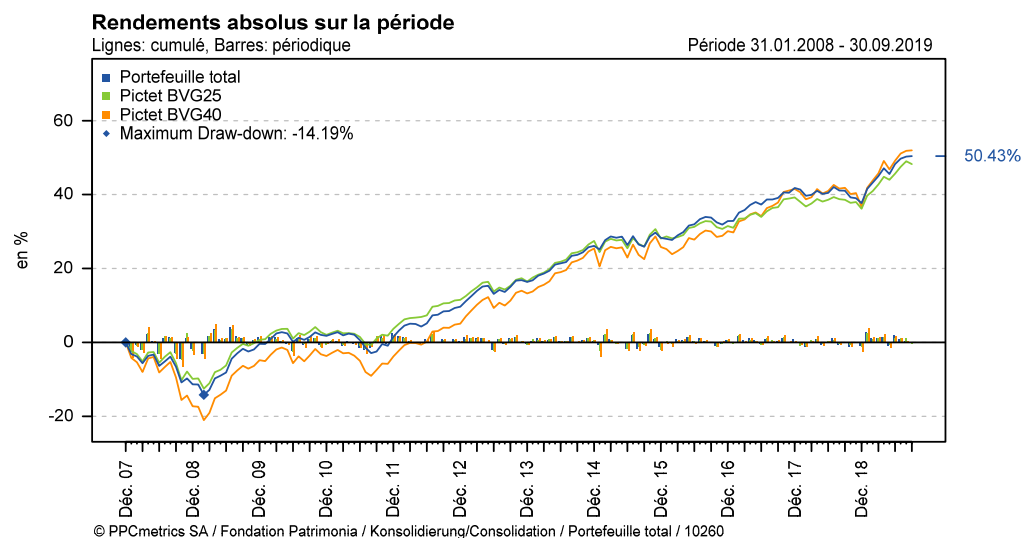
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2014	2015	2016	2017	2018	YTD 2019*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	1'328.3	8.37%	1.71%	3.54%	6.74%	-2.88%	9.26%	50.43%	3.54%	01.01.08

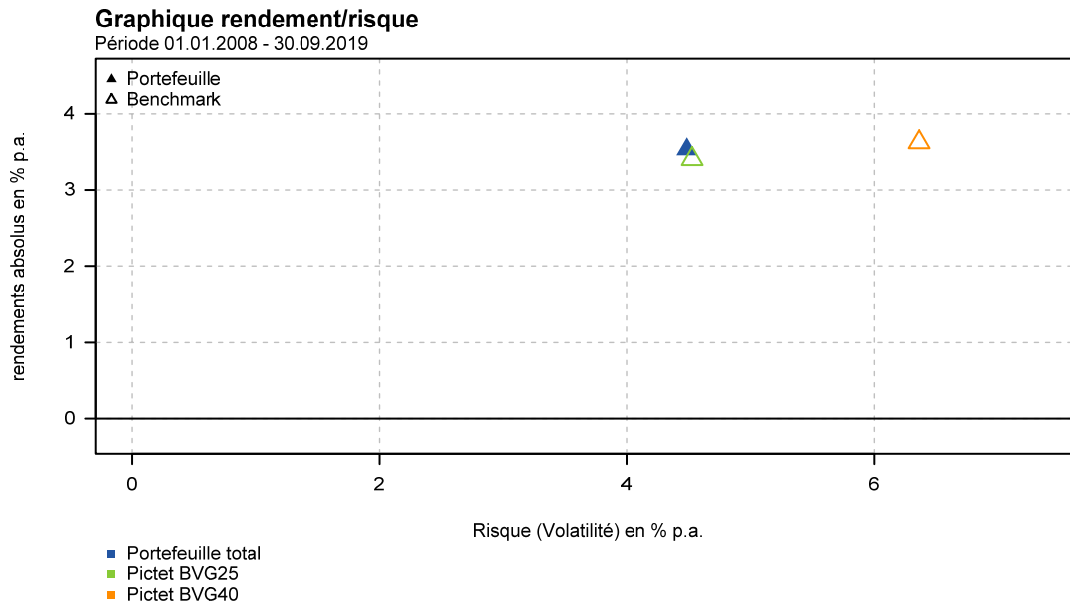
* jusqu'au 30.09.2019

© 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)

