

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 29.02.2020		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	28 611 304	1.9%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	222 902 590	15.1%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	189 631 460	12.9%	7.0%	10.0%	13.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	118 387 956	8.0%	6.0%	8.0%	10.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	58 026 408	3.9%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	617 559 718	41.9%	28.0%	37.0%	49.0%		
<i>Actions</i>	361 002 567	24.5%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
<i>Suisse</i>	177 367 041	12.0%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	135 617 403	9.2%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	41 749 638	2.8%	2.0%	3.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	143 875 900	9.8%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large & Mid Cap	130 456 061	8.8%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	13 419 839	0.9%	0.0%	1.0%	2.0%		
<i>Marchés émergents</i>	39 759 626	2.7%	1.0%	3.0%	5.0%		
<i>Placements alternatifs (couverts)</i>	60 580 599	4.1%	3.0%	7.0%	11.0%	15.0%	55 let. d)
SSL (couverts)	57 880 448	3.9%	2.0%	4.0%	6.0%		
Infrastructure	0	0.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
Matières premières (couvertes)	2 700 151	0.2%	0.0%	0.0%	0.0%		
<i>Immobilier</i>	435 839 545	29.5%	26.0%	31.0%	36.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	363 991 582	24.7%	21.0%	25.0%	29.0%		
Direct	157 916 982	10.7%					
Indirect	206 074 600	14.0%					
Etranger (couvert)	71 847 963	4.9%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	857 422 711	58.1%		63.0%			
Total	1 474 982 429	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	183 635 526	12.5%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	682 109 912	46.2%					
Couverture	498 474 386	33.8%					

Performances du portefeuille

2020

Rendements année sous revue	mio de CHF	janv. 20	févr. 20	YTD 2020*
Portefeuille total	1'475	0.91%	-1.77%	-0.87%

* jusqu'au 29.02.2020

© PPCmetrics SA

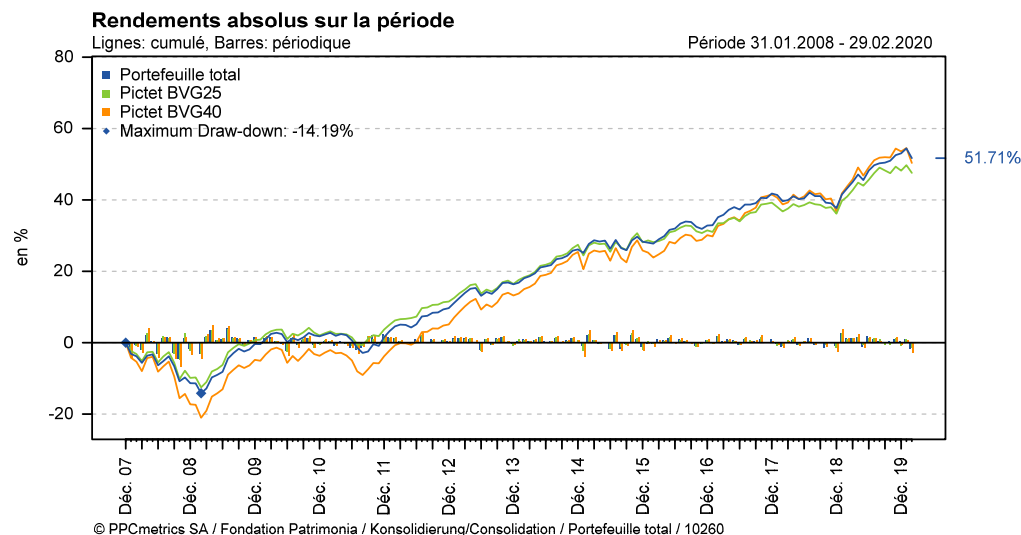
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2015	2016	2017	2018	2019	YTD 2020*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	1'475	1.71%	3.54%	6.74%	-2.88%	11.15%	-0.87%	51.71%	3.48%	01.01.08

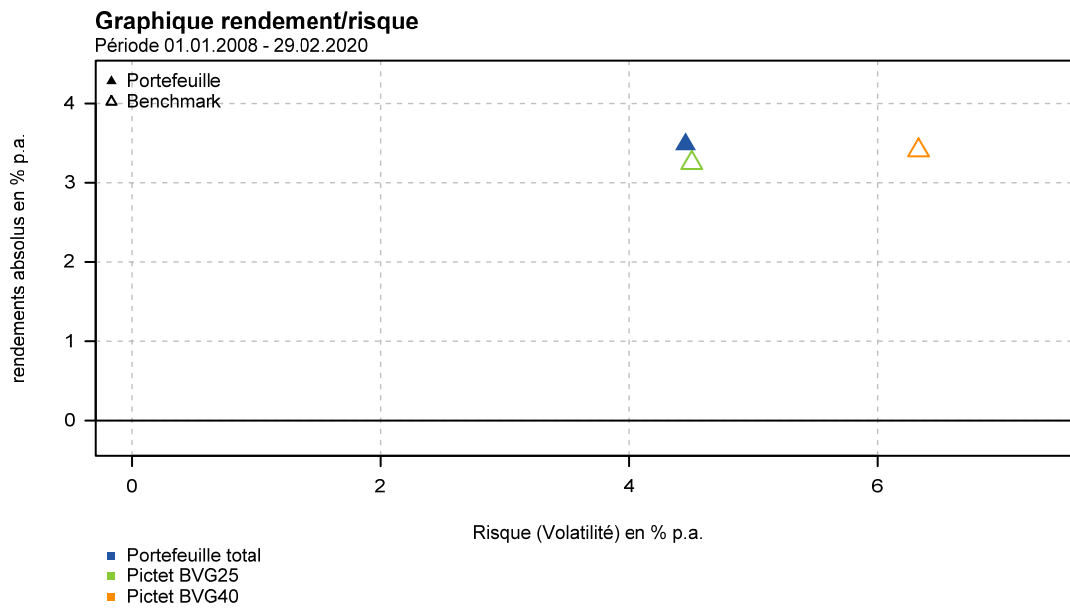
* jusqu'au 29.02.2020

© 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 31.12.2019)

