

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 30.11.2022		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	19 373 870	0.8%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	358 063 642	14.8%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	209 957 255	8.7%	6.0%	9.0%	12.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	146 071 854	6.1%	4.0%	6.0%	8.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	93 874 669	3.9%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	827 341 290	34.3%	25.0%	34.0%	46.0%		
<i>Actions</i>	668 933 885	27.7%	17.0%	28.0%	39.0%	50.0%	55 let. b)
<i>Suisse</i>	231 240 077	9.6%	6.0%	10.0%	14.0%		
Large Cap	189 504 671	7.9%	6.0%	8.0%	10.0%		
Small & Mid Cap	41 735 406	1.7%	0.0%	2.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	362 478 983	15.0%	10.0%	15.0%	20.0%		
Large & Mid Cap	190 186 680	7.9%	6.0%	8.0%	10.0%		
Large & Mid Cap (hedged)	125 204 628	5.2%	3.0%	5.0%	7.0%		
Small Cap	47 087 675	2.0%	1.0%	2.0%	3.0%		
Marchés émergents	75 214 825	3.1%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	74 375 917	3.1%	1.0%	3.0%	5.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	7 416 371	3.3%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	71 274 168					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	762 464 006	31.6%	22.0%	32.0%	42.0%		
<i>Suisse</i>	635 752 268	26.4%	19.0%	27.0%	35.0%		
Direct	269 086 264	11.2%	10.0%	12.0%	14.0%		
Indirect non coté	130 671 700	5.4%	2.0%	4.0%	6.0%		
Indirect coté	235 994 304	9.8%	7.0%	11.0%	15.0%		
Etranger (couvert)	126 711 738	5.3%	3.0%	5.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 584 464 347	65.7%		66.0%			
Total	2 411 805 637	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	391 179 719	16.2%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 167 375 780	48.4%					
Couverture	776 196 061	32.2%					

Performances du portefeuille

2022

Rendements année sous revue	CHF mio.	T1/22	T2/22	T3/22	oct. 22	nov. 22	YTD 2022*
Portefeuille total	2'411.8	-4.09%	-7.12%	-2.68%	1.57%	2.05%	-10.14%

* jusqu'au 30.11.2022

© PPCmetrics SA

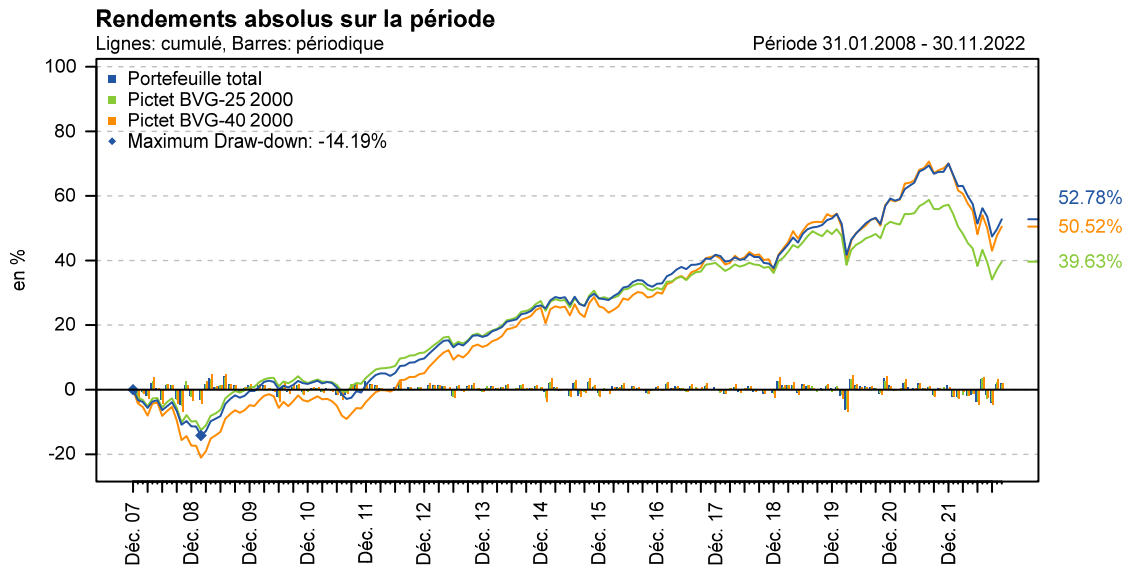
Depuis le début de la mesure de performance

	CHF mio.	2017	2018	2019	2020	2021	YTD 2022*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'411.8	6.74%	-2.88%	11.15%	4.04%	6.78%	-10.14%	52.78%	2.88%	01.01.08

* jusqu'au 30.11.2022

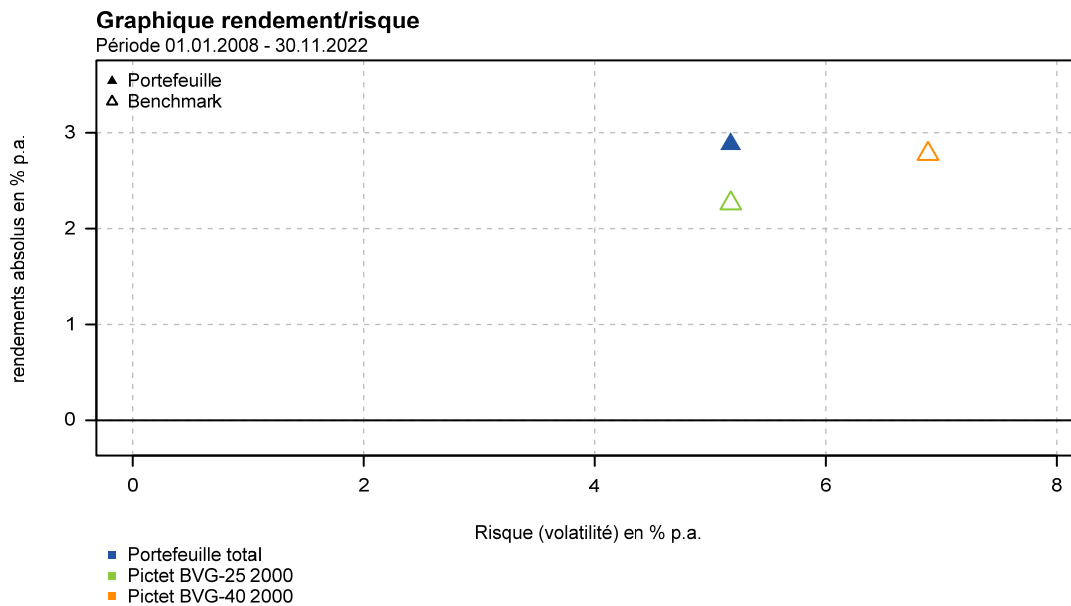
© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



© PPCmetrics SA

Profil rendement / risque du portefeuille

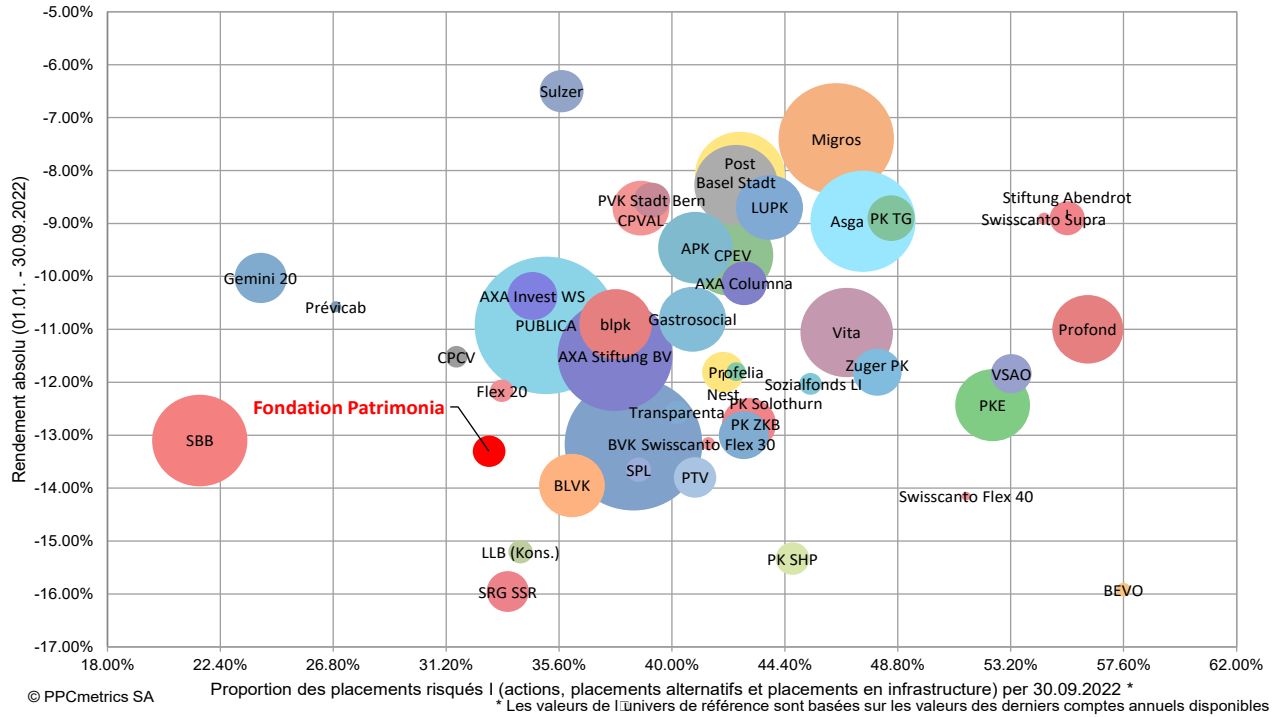


© PPCmetrics SA / Fondation Patrimonia / Konsolidierung/Consolidation / Portefeuille total / 10260

Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2022 au 30.09.2022)

Peer Group public - Investisseurs institutionnels

Peer Group: données publiques (46)
Période: 01.01.2022 - 30.09.2022



© PPCmetrics SA

Proportion des placements risqués I (actions, placements alternatifs et placements en infrastructure) per 30.09.2022 *

* Les valeurs de l'univers de référence sont basées sur les valeurs des derniers comptes annuels disponibles