

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 28.02.2023		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	33 301 538	1.3%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	381 665 590	14.8%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	227 598 576	8.8%	6.0%	9.0%	12.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	153 510 119	5.9%	4.0%	6.0%	8.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	94 764 332	3.7%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	890 840 155	34.5%	25.0%	34.0%	46.0%		
<i>Actions</i>	704 048 842	27.3%	17.0%	28.0%	39.0%	50.0%	55 let. b)
<i>Suisse</i>	252 052 992	9.8%	6.0%	10.0%	14.0%		
Large Cap	197 917 533	7.7%	6.0%	8.0%	10.0%		
Small & Mid Cap	54 135 459	2.1%	0.0%	2.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	379 139 950	14.7%	10.0%	15.0%	20.0%		
Large & Mid Cap	207 589 298	8.0%	6.0%	8.0%	10.0%		
Large & Mid Cap (hedged)	123 647 846	4.8%	3.0%	5.0%	7.0%		
Small Cap	47 902 806	1.9%	1.0%	2.0%	3.0%		
Marchés émergents	72 855 900	2.8%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	81 805 879	3.2%	1.0%	3.0%	5.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	8 838 848	3.5%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	81 189 457					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	814 198 930	31.5%	22.0%	32.0%	42.0%		
<i>Suisse</i>	690 223 259	26.7%	19.0%	27.0%	35.0%		
Direct	345 393 286	13.4%	10.0%	12.0%	14.0%		
Indirect non coté	131 770 310	5.1%	2.0%	4.0%	6.0%		
Indirect coté	213 059 663	8.3%	7.0%	11.0%	15.0%		
Etranger (couvert)	123 975 671	4.8%	3.0%	5.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 690 081 956	65.5%		66.0%			
Total	2 580 922 111	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	418 376 309	16.2%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 223 678 732	47.4%					
Couverture	805 302 423	31.2%					

Performances du portefeuille

2023

Rendements année sous revue	CHF mio.	janv. 23	févr. 23	YTD 2023*
Portefeuille total	2'580.9	2.80%	-0.83%	1.95%

* jusqu'au 28.02.2023

© PPCmetrics SA

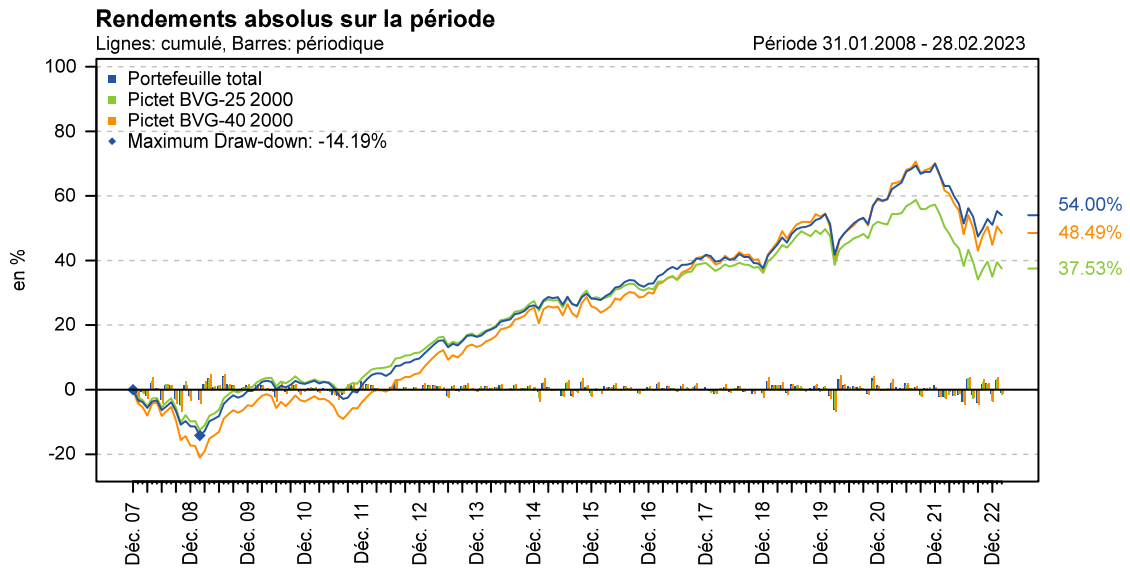
Depuis le début de la mesure de performance

	CHF mio.	2018	2019	2020	2021	2022	YTD 2023*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'580.9	-2.88%	11.15%	4.04%	6.78%	-11.16%	1.95%	54.00%	2.89%	01.01.08

* jusqu'au 28.02.2023

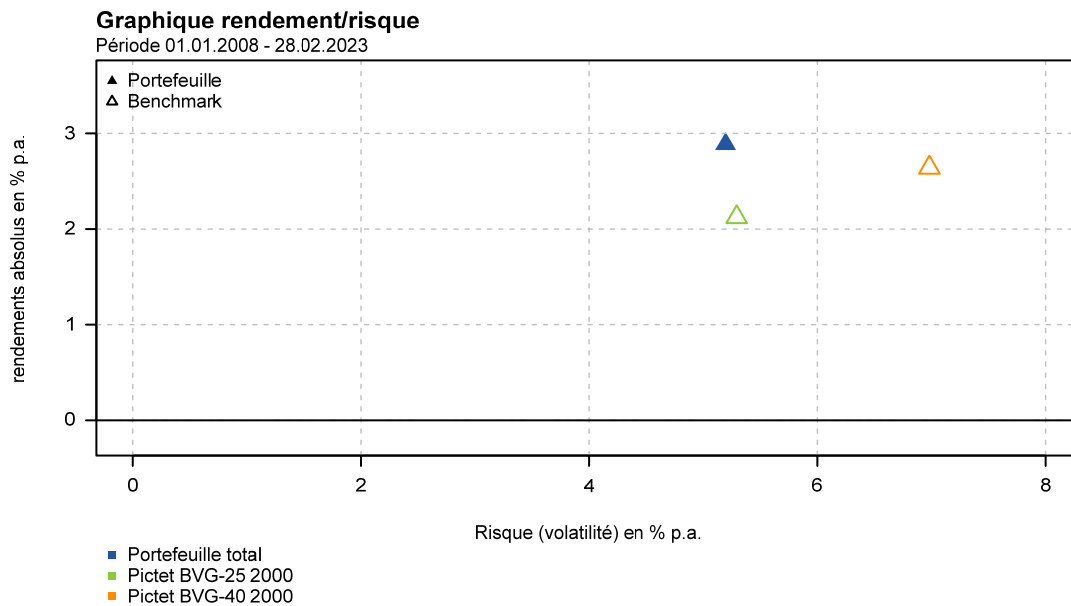
© PPCmetrics SA

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 31.12.2022)

Peer Group public - Investisseurs institutionnels

Peer Group: données publiques (50)
Période: 01.01.2022 - 31.12.2022

