

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.01.2023		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	24 005 208	0.9%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	372 009 312	14.6%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	223 954 895	8.8%	6.0%	9.0%	12.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	148 872 561	5.8%	4.0%	6.0%	8.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	97 346 566	3.8%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	866 188 542	33.9%	25.0%	34.0%	46.0%		
<i>Actions</i>	714 701 097	28.0%	17.0%	28.0%	39.0%	50.0%	55 let. b)
<i>Suisse</i>	254 903 729	10.0%	6.0%	10.0%	14.0%		
Large Cap	201 895 057	7.9%	6.0%	8.0%	10.0%		
Small & Mid Cap	53 008 672	2.1%	0.0%	2.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	382 531 167	15.0%	10.0%	15.0%	20.0%		
Large & Mid Cap	208 753 169	8.2%	6.0%	8.0%	10.0%		
Large & Mid Cap (hedged)	125 869 051	4.9%	3.0%	5.0%	7.0%		
Small Cap	47 908 947	1.9%	1.0%	2.0%	3.0%		
Marchés émergents	77 266 201	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	76 243 526	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	8 697 367	3.4%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	77 917 108					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	810 446 714	31.7%	22.0%	32.0%	42.0%		
<i>Suisse</i>	685 263 490	26.8%	19.0%	27.0%	35.0%		
Direct	345 393 286	13.5%	10.0%	12.0%	14.0%		
Indirect non coté	130 612 329	5.1%	2.0%	4.0%	6.0%		
Indirect coté	209 257 875	8.2%	7.0%	11.0%	15.0%		
Etranger (couvert)	125 183 224	4.9%	3.0%	5.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 688 005 812	66.1%		66.0%			
Total	2 554 194 354	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	420 542 792	16.5%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 218 012 615	47.7%					
Couverture	797 469 823	31.2%					

Performances du portefeuille

2023

Rendements année sous revue	CHF mio.	janv. 23	YTD 2023*
Portefeuille total	2'554.2	2.80%	2.80%

* jusqu'au 31.01.2023

© PPCmetrics SA

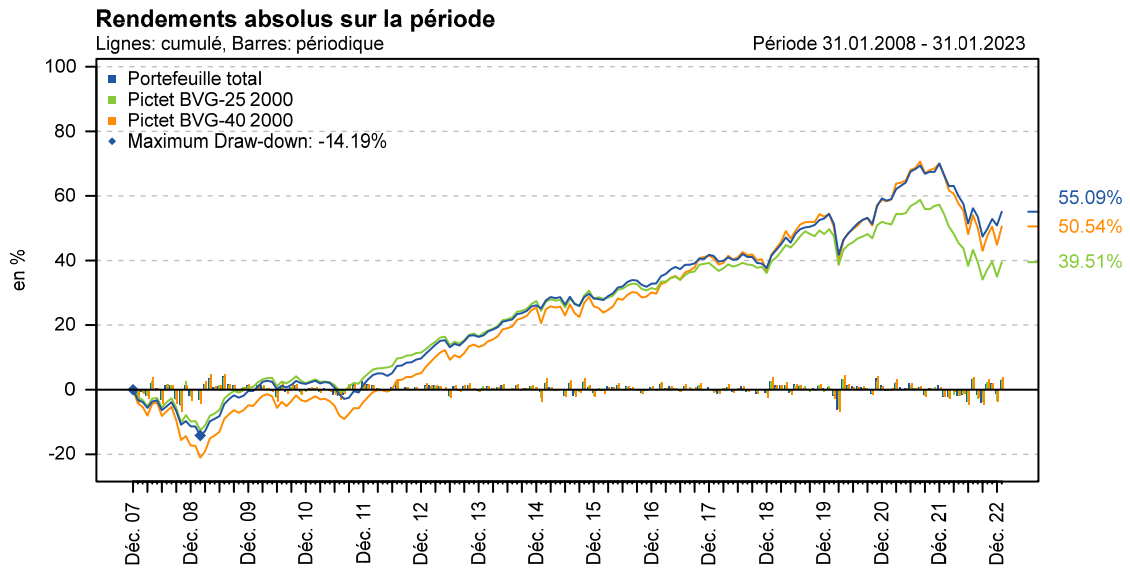
Depuis le début de la mesure de performance

	CHF mio.	2018	2019	2020	2021	2022	YTD 2023*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'554.2	-2.88%	11.15%	4.04%	6.78%	-11.27%	2.80%	55.09%	2.95%	01.01.08

* jusqu'au 31.01.2023

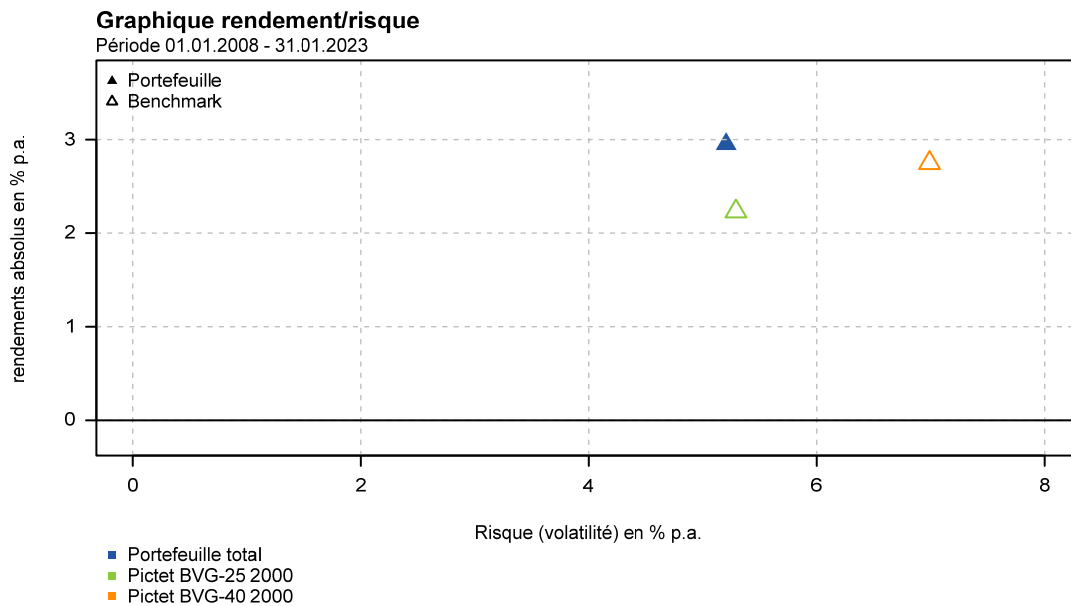
© PPCmetrics SA

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 (43)
Période: 01.01.2022 - 31.12.2022

