

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 30.06.2023		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	19 876 760	0.7%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	409 529 796	15.0%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	239 519 519	8.7%	6.0%	9.0%	12.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	154 203 520	5.6%	4.0%	6.0%	8.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	110 809 369	4.0%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	933 938 964	34.1%	25.0%	34.0%	46.0%		
<i>Actions</i>	778 287 553	28.4%	17.0%	28.0%	39.0%	50.0%	55 let. b)
<i>Suisse</i>	271 848 516	9.9%	6.0%	10.0%	14.0%		
Large Cap	216 822 020	7.9%	6.0%	8.0%	10.0%		
Small & Mid Cap	55 026 496	2.0%	0.0%	2.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	424 972 606	15.5%	10.0%	15.0%	20.0%		
Large & Mid Cap	236 303 297	8.6%	6.0%	8.0%	10.0%		
Large & Mid Cap (hedged)	134 511 272	4.9%	3.0%	5.0%	7.0%		
Small Cap	54 158 037	2.0%	1.0%	2.0%	3.0%		
Marchés émergents	81 466 431	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	87 626 971	3.2%	1.0%	3.0%	5.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	9 547 467	3.4%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	84 303 188					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	844 517 934	30.8%	22.0%	32.0%	42.0%		
<i>Suisse</i>	715 658 169	26.1%	19.0%	27.0%	35.0%		
Direct	374 192 476	13.7%	10.0%	12.0%	14.0%		
Indirect non coté	132 353 755	4.8%	2.0%	4.0%	6.0%		
Indirect coté	209 111 938	7.6%	7.0%	11.0%	15.0%		
Etranger (couvert)	128 859 765	4.7%	3.0%	5.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 804 283 113	65.9%		66.0%			
Total	2 738 222 077	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	465 778 420	17.0%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 321 308 836	48.3%					
Couverture	855 530 416	31.2%					

Performances du portefeuille

2023

Rendements année sous revue	CHF mio.	T1/23	avr. 23	mai 23	juin 23	T2/23	YTD 2023*
Portefeuille total	2'738.2	2.22%	0.45%	-0.04%	0.77%	1.18%	3.43%

* jusqu'au 30.06.2023

© PPCmetrics SA

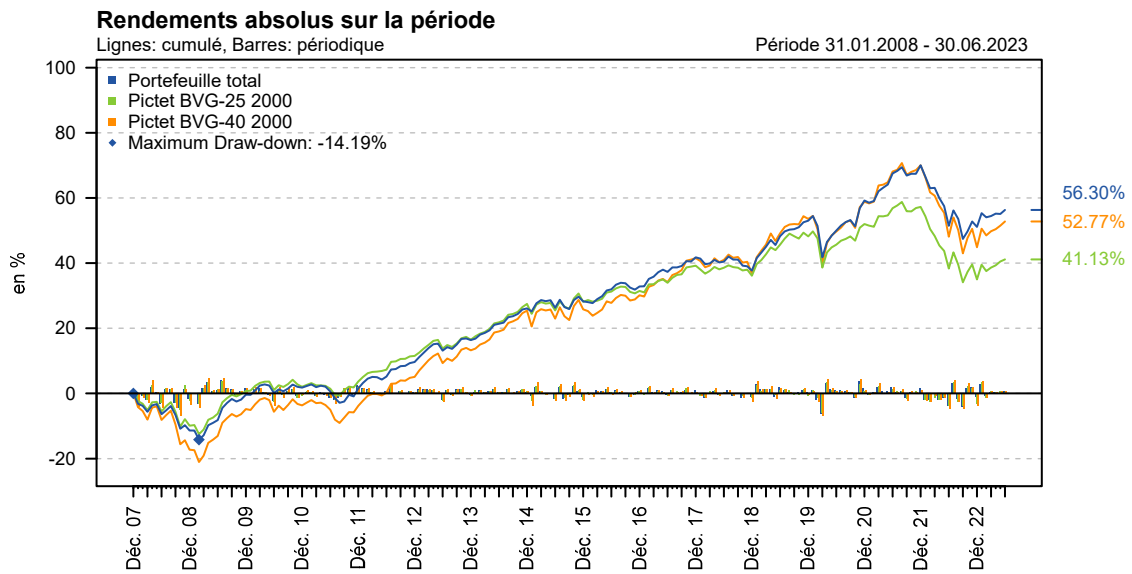
Depuis le début de la mesure de performance

	CHF mio.							Depuis le lancement		
		2018	2019	2020	2021	2022	YTD 2023*	cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'738.2	-2.88%	11.15%	4.04%	6.78%	-11.12%	3.43%	56.30%	2.92%	01.01.08

* jusqu'au 30.06.2023

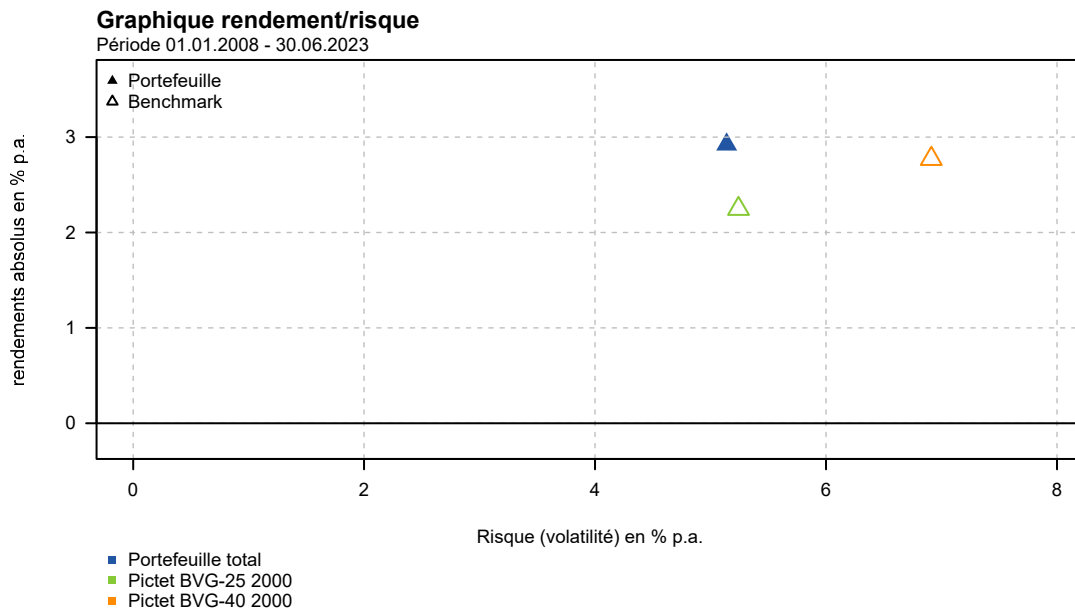
© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



© PPCmetrics SA

Profil rendement / risque du portefeuille

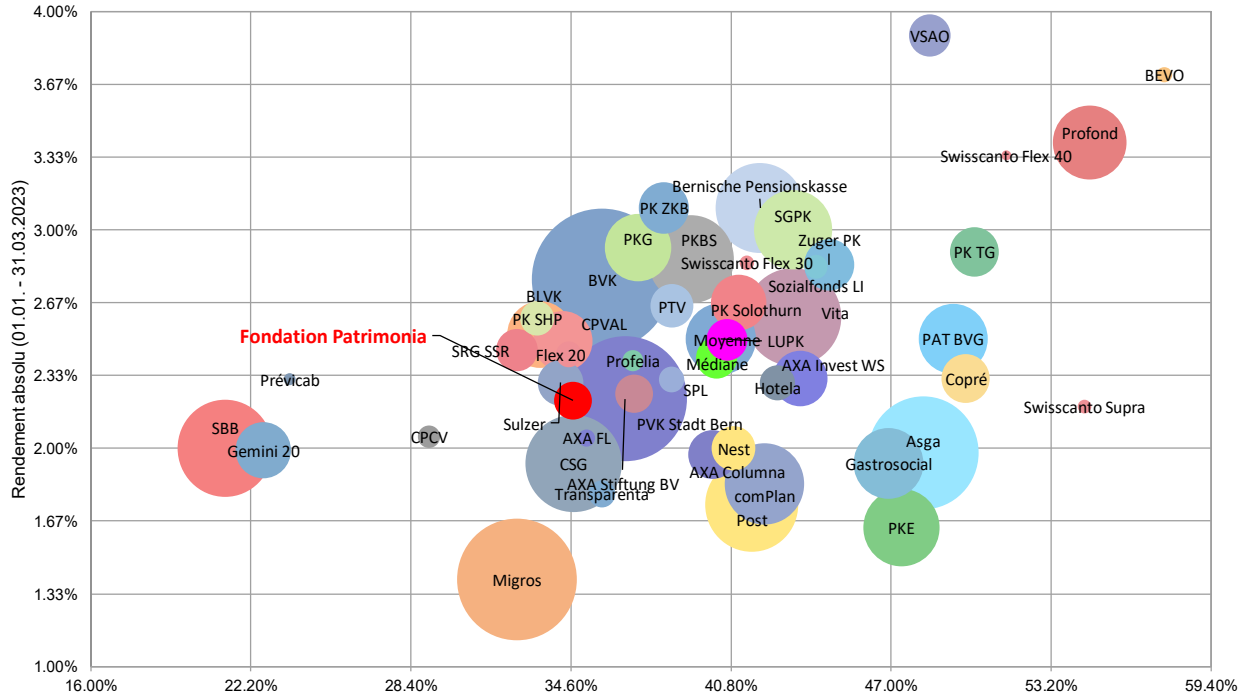


© PPCmetrics SA / Fondation Patrimonia / Konsolidierung/Consolidation / Portefeuille total / 10260

Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2023 au 31.03.2023)

Peer Group public - Investisseurs institutionnels

Peer Group: données publiques (50)
Période: 01.01.2023 - 31.03.2023



© PPCmetrics SA

Proportion des placements risqués I (actions, placements alternatifs et placements en infrastructure) au 31.03.2023 *

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