

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.05.2023		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	37 459 811	1.4%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	409 240 295	15.2%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	240 854 909	8.9%	6.0%	9.0%	12.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	154 548 070	5.7%	4.0%	6.0%	8.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	100 535 972	3.7%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	942 639 057	34.9%	25.0%	34.0%	46.0%		
<i>Actions</i>	757 579 641	28.1%	17.0%	28.0%	39.0%	50.0%	55 let. b)
<i>Suisse</i>	270 112 107	10.0%	6.0%	10.0%	14.0%		
Large Cap	215 751 577	8.0%	6.0%	8.0%	10.0%		
Small & Mid Cap	54 360 530	2.0%	0.0%	2.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	407 242 398	15.1%	10.0%	15.0%	20.0%		
Large & Mid Cap	227 681 987	8.4%	6.0%	8.0%	10.0%		
Large & Mid Cap (hedged)	127 501 024	4.7%	3.0%	5.0%	7.0%		
Small Cap	52 059 387	1.9%	1.0%	2.0%	3.0%		
Marchés émergents	80 225 136	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	86 443 759	3.2%	1.0%	3.0%	5.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	9 581 676	3.5%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	84 839 143					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	818 211 343	30.3%	22.0%	32.0%	42.0%		
<i>Suisse</i>	690 797 874	25.6%	19.0%	27.0%	35.0%		
Direct	346 180 885	12.8%	10.0%	12.0%	14.0%		
Indirect non coté	131 324 816	4.9%	2.0%	4.0%	6.0%		
Indirect coté	213 292 173	7.9%	7.0%	11.0%	15.0%		
Etranger (couvert)	127 413 469	4.7%	3.0%	5.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 756 655 562	65.1%		66.0%			
Total	2 699 294 619	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	454 387 329	16.8%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 291 684 532	47.9%					
Couverture	837 297 203	31.0%					

Performances du portefeuille

2023

Rendements année sous revue	CHF mio.	T1/23	avr. 23	mai 23	YTD 2023*
Portefeuille total	2'699.3	2.22%	0.45%	-0.04%	2.64%

* jusqu'au 31.05.2023

© PPCmetrics SA

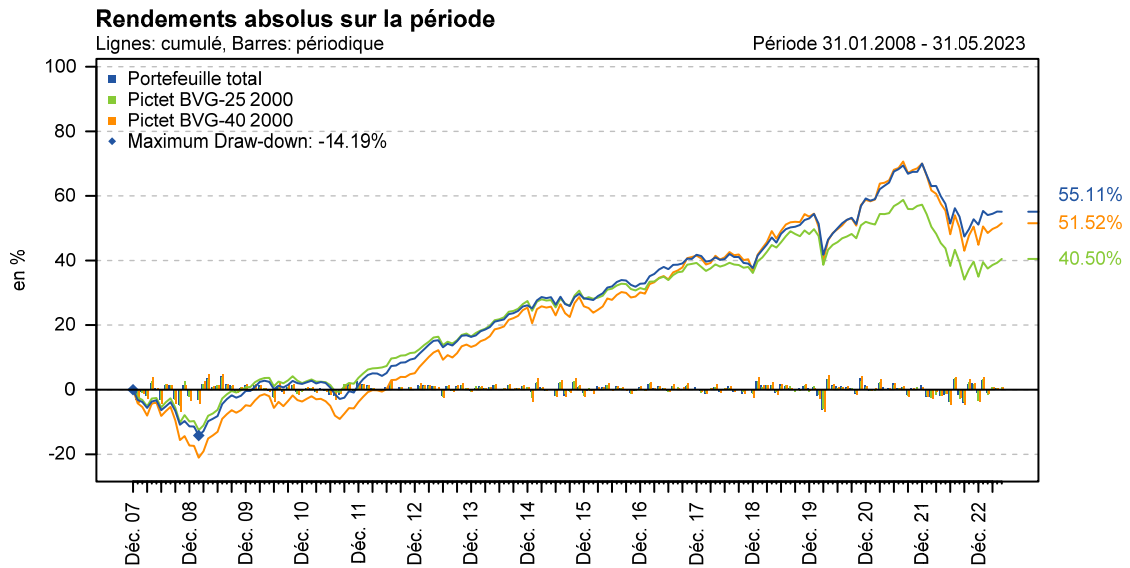
Depuis le début de la mesure de performance

	CHF mio.	2018	2019	2020	2021	2022	YTD 2023*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'699.3	-2.88%	11.15%	4.04%	6.78%	-11.12%	2.64%	55.11%	2.89%	01.01.08

* jusqu'au 31.05.2023

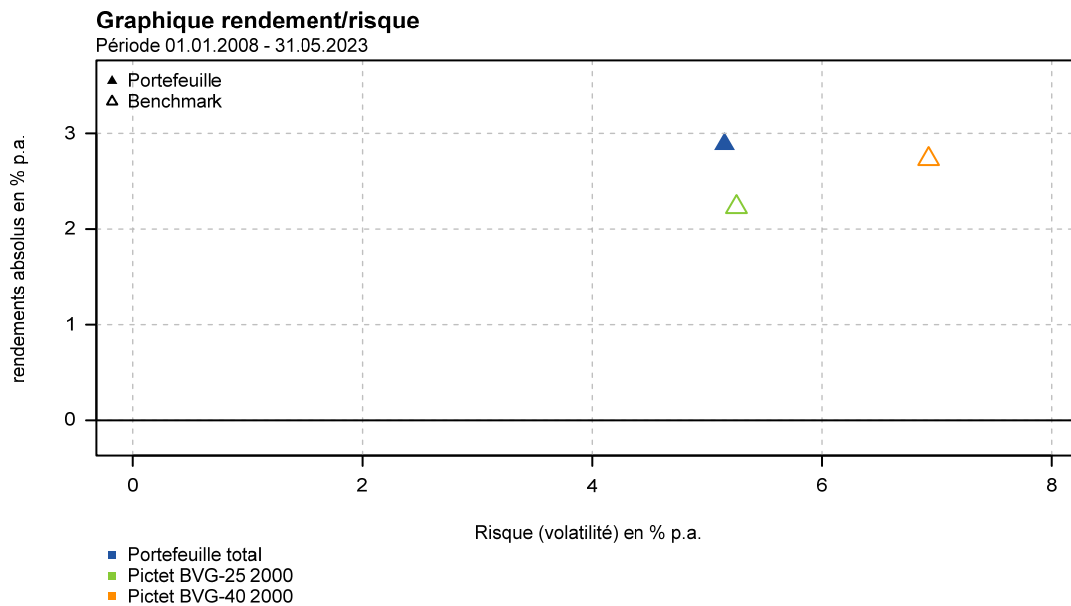
© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



© PPCmetrics SA

Profil rendement / risque du portefeuille

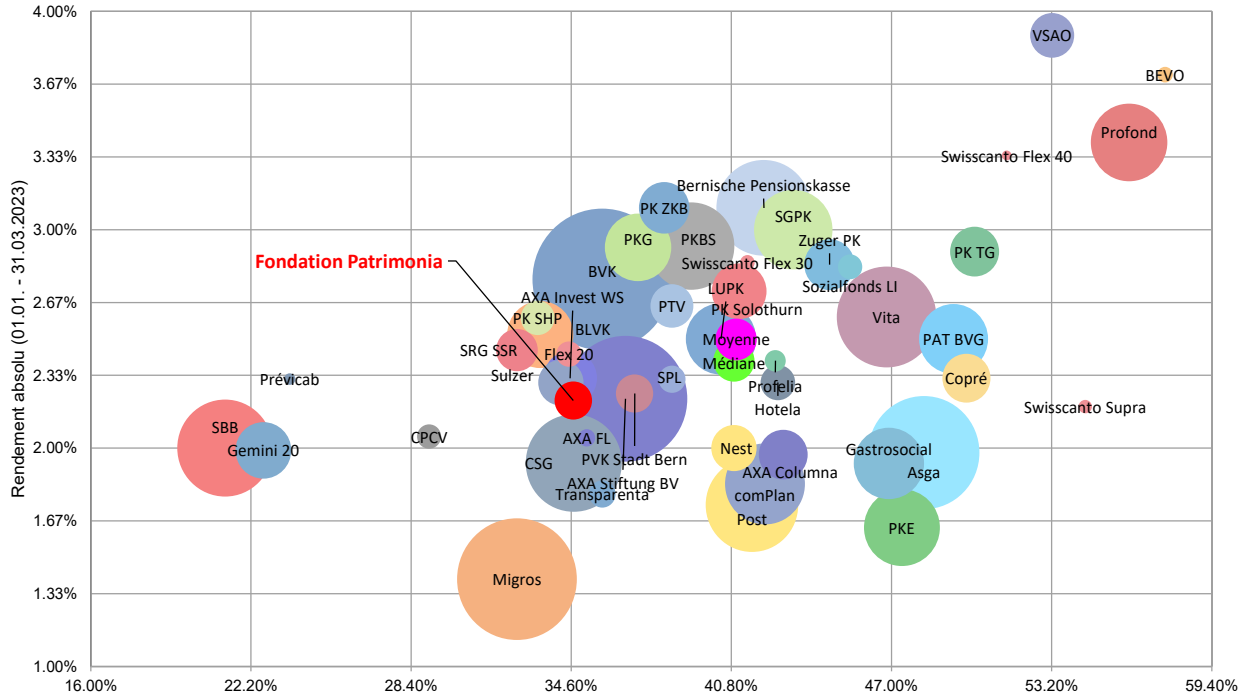


© PPCmetrics SA / Fondation Patrimonia / Konsolidierung/Consolidation / Portefeuille total / 10260

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

Peer Group public - Investisseurs institutionnels

Peer Group: données publiques (49)
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