

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 30.11.2023		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	23 396 786	0.8%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	418 263 133	15.2%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	240 216 538	8.7%	6.0%	9.0%	12.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	154 643 071	5.6%	4.0%	6.0%	8.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	111 108 529	4.0%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	947 628 057	34.4%	25.0%	34.0%	46.0%		
<i>Actions</i>	761 944 199	27.7%	17.0%	28.0%	39.0%	50.0%	55 let. b)
<i>Suisse</i>	263 677 384	9.6%	6.0%	10.0%	14.0%		
Large Cap	212 152 698	7.7%	6.0%	8.0%	10.0%		
Small & Mid Cap	51 524 686	1.9%	0.0%	2.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	418 822 494	15.2%	10.0%	15.0%	20.0%		
Large & Mid Cap	231 155 370	8.4%	6.0%	8.0%	10.0%		
Large & Mid Cap (hedged)	135 930 441	4.9%	3.0%	5.0%	7.0%		
Small Cap	51 736 683	1.9%	1.0%	2.0%	3.0%		
Marchés émergents	79 444 321	2.9%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	89 959 326	3.3%	1.0%	3.0%	5.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	10 161 402	4.0%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	98 918 117					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	846 076 945	30.7%	22.0%	32.0%	42.0%		
<i>Suisse</i>	719 937 014	26.1%	19.0%	27.0%	35.0%		
Direct	387 172 651	14.1%	10.0%	12.0%	14.0%		
Indirect non coté	129 451 589	4.7%	2.0%	4.0%	6.0%		
Indirect coté	203 312 774	7.4%	7.0%	11.0%	15.0%		
Etranger (couvert)	126 139 931	4.6%	3.0%	5.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 807 059 989	65.6%		66.0%			
Total	2 754 688 046	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	471 415 893	17.1%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 329 413 729	48.3%					
Couverture	857 997 836	31.1%					

Performances du portefeuille

2023

Rendements année sous revue	CHF mio.	T1/23	T2/23	T3/23	oct. 23	nov. 23	YTD 2023*
Portefeuille total	2'754.7	2.12%	1.22%	-1.18%	-1.76%	2.83%	3.19%

* jusqu'au 30.11.2023

© PPCmetrics SA

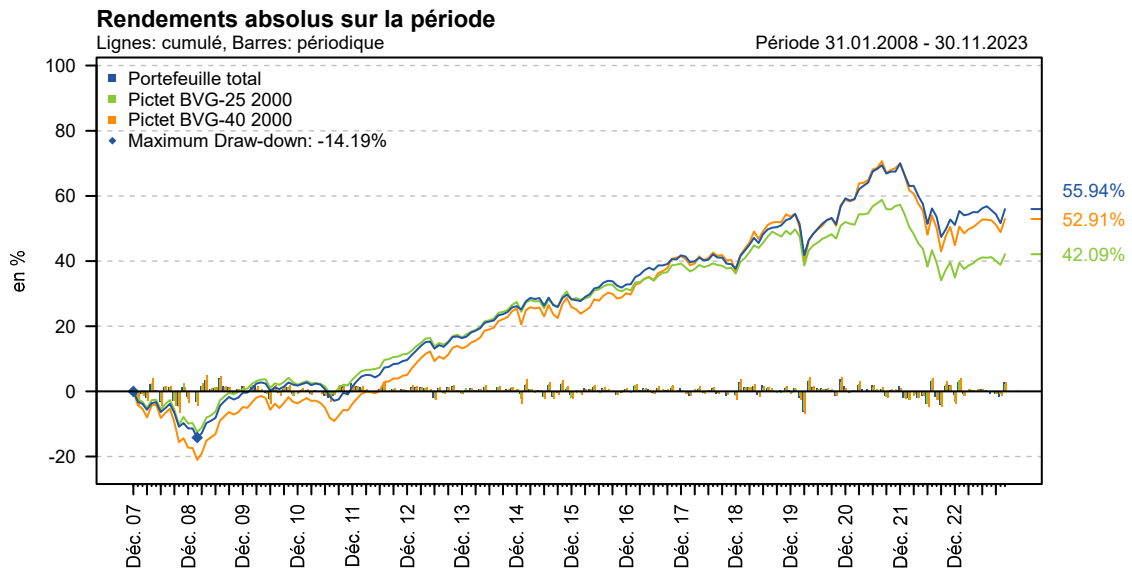
Depuis le début de la mesure de performance

	CHF mio.	2018	2019	2020	2021	2022	YTD 2023*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'754.7	-2.88%	11.15%	4.04%	6.78%	-11.12%	3.19%	55.94%	2.83%	01.01.08

* jusqu'au 30.11.2023

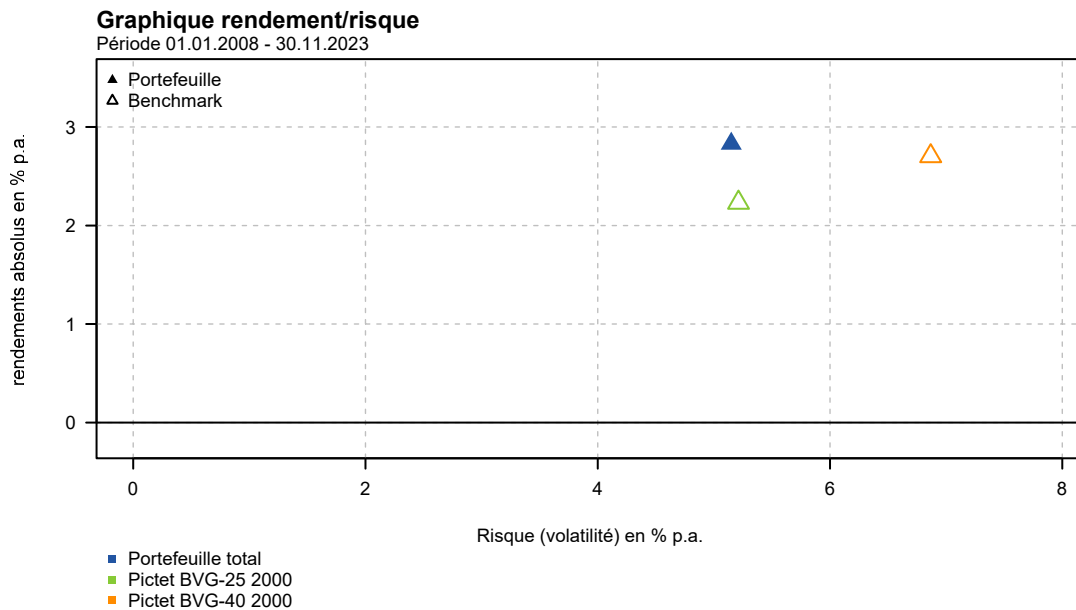
© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



© PPCmetrics SA

Profil rendement / risque du portefeuille

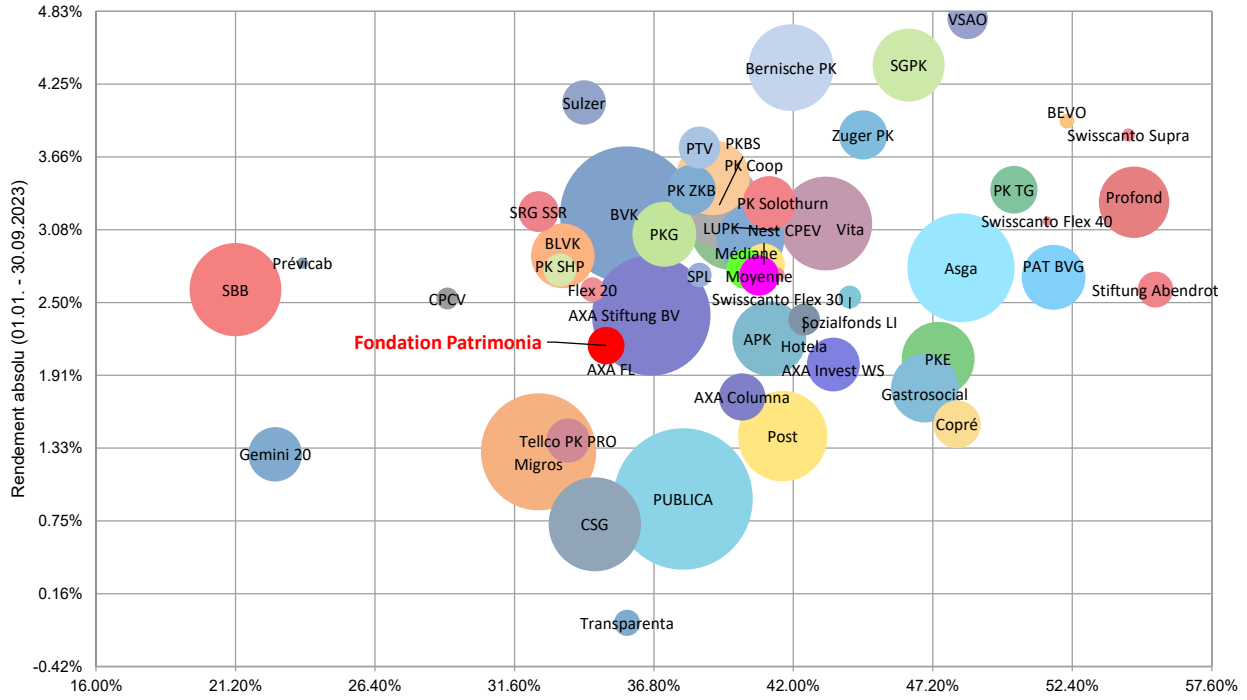


© PPCmetrics SA / Fondation Patrimonia / Konsolidierung/Consolidation / Portefeuille total / 10260

Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2023 au 30.09.2023)

Peer Group public - Investisseurs institutionnels

Peer Group: données publiques (52)
Période: 01.01.2023 - 30.09.2023



© PPCmetrics SA

Proportion des placements risqués I (actions, placements alternatifs et placements en infrastructure) au 30.09.2023 *

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