

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.10.2023		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	24 870 882	0.9%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	412 530 532	15.4%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	229 362 303	8.6%	6.0%	9.0%	12.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	149 055 472	5.6%	4.0%	6.0%	8.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	105 506 412	3.9%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	921 325 601	34.4%	25.0%	34.0%	46.0%		
<i>Actions</i>	721 115 730	26.9%	17.0%	28.0%	39.0%	50.0%	55 let. b)
<i>Suisse</i>	248 092 532	9.3%	6.0%	10.0%	14.0%		
Large Cap	199 822 808	7.5%	6.0%	8.0%	10.0%		
Small & Mid Cap	48 269 724	1.8%	0.0%	2.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	395 761 154	14.8%	10.0%	15.0%	20.0%		
Large & Mid Cap	220 157 677	8.2%	6.0%	8.0%	10.0%		
Large & Mid Cap (hedged)	126 046 388	4.7%	3.0%	5.0%	7.0%		
Small Cap	49 557 089	1.8%	1.0%	2.0%	3.0%		
Marchés émergents	77 262 044	2.9%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	89 109 165	3.3%	1.0%	3.0%	5.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	10 357 189	4.0%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	97 963 690					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	841 348 082	31.4%	22.0%	32.0%	42.0%		
<i>Suisse</i>	721 509 191	26.9%	19.0%	27.0%	35.0%		
Direct	388 197 689	14.5%	10.0%	12.0%	14.0%		
Indirect non coté	133 373 820	5.0%	2.0%	4.0%	6.0%		
Indirect coté	199 937 682	7.5%	7.0%	11.0%	15.0%		
Etranger (couvert)	119 838 891	4.5%	3.0%	5.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 759 893 856	65.6%		66.0%			
Total	2 681 219 457	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	455 297 689	17.0%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 274 216 320	47.5%					
Couverture	818 918 631	30.5%					

Performances du portefeuille

2023

Rendements année sous revue	CHF mio.	T1/23	T2/23	T3/23	oct. 23	YTD 2023*
Portefeuille total	2'681.2	2.12%	1.22%	-1.19%	-1.76%	0.33%

* jusqu'au 31.10.2023

© PPCmetrics SA

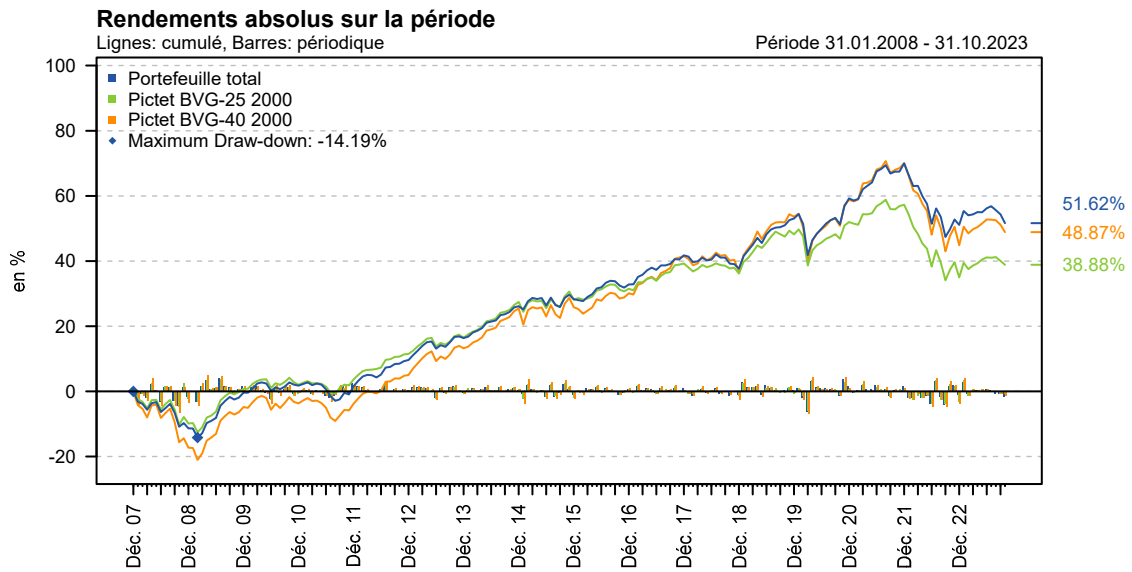
Depuis le début de la mesure de performance

	CHF mio.							YTD 2023*	Depuis le lancement		
		2018	2019	2020	2021	2022	cumulée		annualisée	Début	
Portefeuille total	2'681.2	-2.88%	11.15%	4.04%	6.78%	-11.12%	0.33%	51.62%	2.66%	01.01.08	

* jusqu'au 31.10.2023

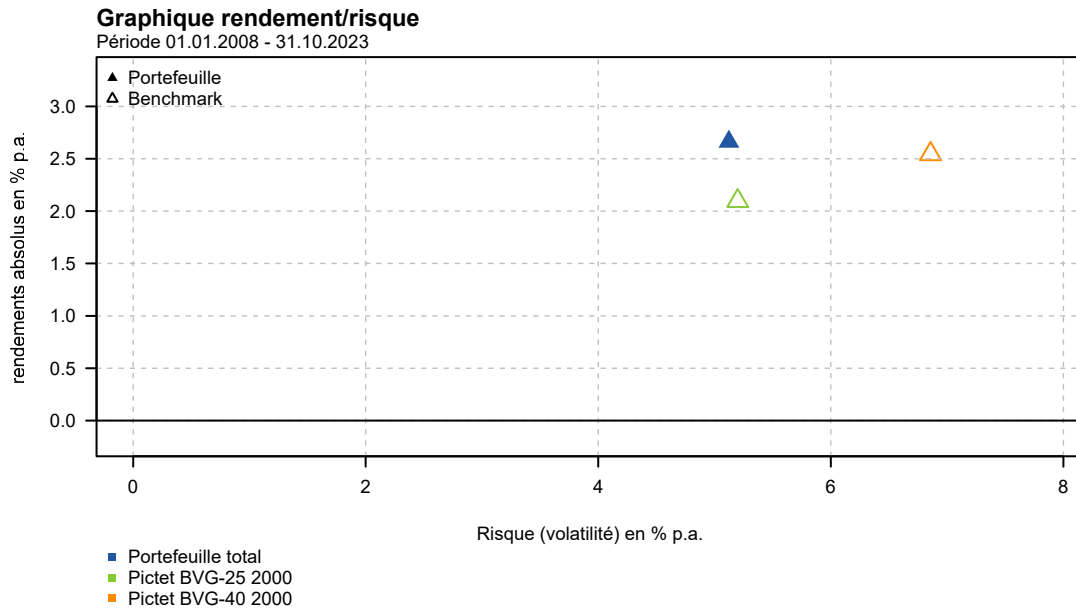
© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



© PPCmetrics SA

Profil rendement / risque du portefeuille



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

