

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 30.09.2023		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	14 428 293	0.5%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	410 171 510	15.2%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	231 527 801	8.6%	6.0%	9.0%	12.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	150 821 264	5.6%	4.0%	6.0%	8.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	107 429 615	4.0%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	914 378 483	33.8%	25.0%	34.0%	46.0%		
Actions	753 835 423	27.9%	17.0%	28.0%	39.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	261 816 675	9.7%	6.0%	10.0%	14.0%		
Large Cap	210 873 285	7.8%	6.0%	8.0%	10.0%		
Small & Mid Cap	50 943 390	1.9%	0.0%	2.0%	4.0%		
Monde DM	411 304 531	15.2%	10.0%	15.0%	20.0%		
Large & Mid Cap	228 572 944	8.5%	6.0%	8.0%	10.0%		
Large & Mid Cap (hedged)	129 691 490	4.8%	3.0%	5.0%	7.0%		
Small Cap	53 040 097	2.0%	1.0%	2.0%	3.0%		
Marchés émergents	80 714 217	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	89 524 300	3.3%	1.0%	3.0%	5.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	10 418 439	4.0%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	96 946 971					30.0%	55 let. c)
Immobilier	838 724 886	31.0%	22.0%	32.0%	42.0%		
Suisse	714 401 326	26.4%	19.0%	27.0%	35.0%		
Direct	372 345 901	13.8%	10.0%	12.0%	14.0%		
Indirect non coté	133 096 845	4.9%	2.0%	4.0%	6.0%		
Indirect coté	208 958 580	7.7%	7.0%	11.0%	15.0%		
Etranger (couvert)	124 323 560	4.6%	3.0%	5.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 789 450 019	66.2%		66.0%			
Total	2 703 828 502	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	469 692 668	17.4%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 303 010 698	48.2%					
Couverture	833 318 030	30.8%					

Performances du portefeuille

2023

Rendements année sous revue	CHF mio.	T1/23	T2/23	juil. 23	août 23	sept. 23	T3/23	YTD 2023*
Portefeuille total	2'703.8	2.12%	1.22%	0.40%	-0.77%	-0.83%	-1.20%	2.13%

* jusqu'au 30.09.2023

© PPCmetrics SA

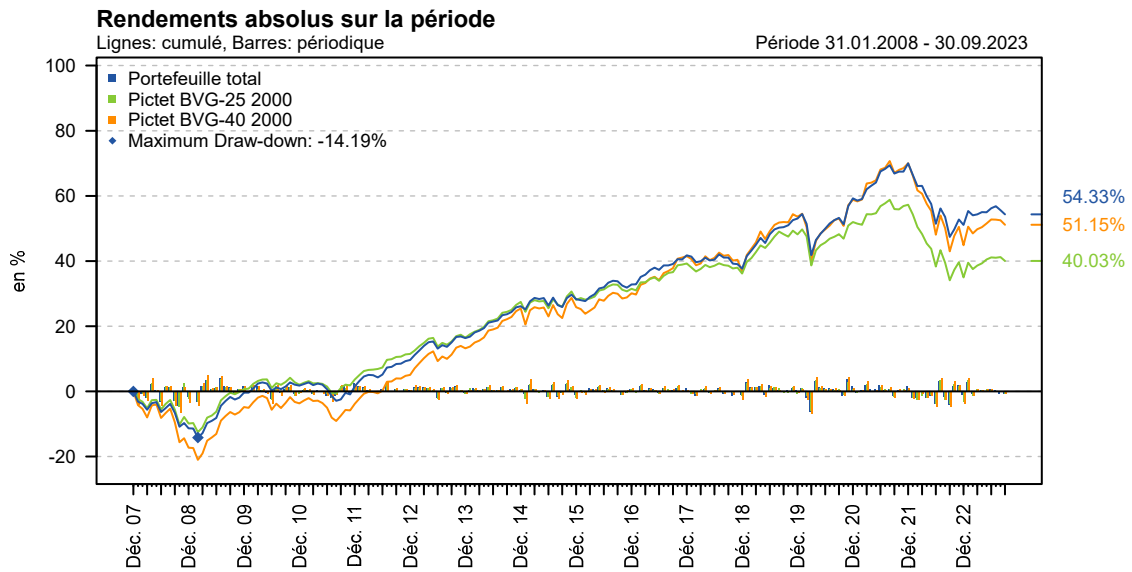
Depuis le début de la mesure de performance

	CHF mio.	2018	2019	2020	2021	2022	YTD 2023*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'703.8	-2.88%	11.15%	4.04%	6.78%	-11.12%	2.13%	54.33%	2.79%	01.01.08

* jusqu'au 30.09.2023

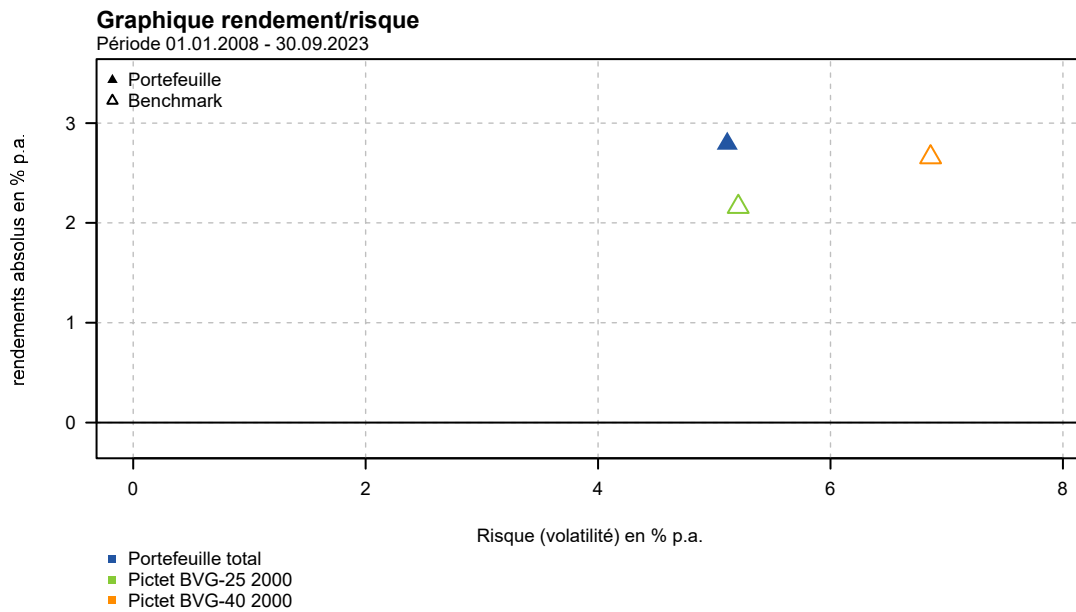
© PPCmetrics SA

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 30.06.2023)

Peer Group public - Investisseurs institutionnels

Peer Group: données publiques (51)
Période: 01.01.2023 - 30.06.2023

