

# Rapport mensuel des portefeuilles

# Classe Production Pictet en faveur de la prévoyance individuelle (3° Pilier A)

# FPPI-LPP/Short-Term Money Market ESG-P ISIN (CH1282064158)

#### **OBJECTIFS ET POLITIQUE D'INVESTISSEMENT**

Ce portefeuille investit principalement dans des instruments du marché monétaire et des obligations à échéance courte et à notation élevée. Ces investissements sont libellés ou couverts en francs suisses, le risque de change étant ainsi inexistant ou limité.

# PERFORMANCE INDEXÉE 101.0 100.8 100.4 100.2

# ■ FPPI-LPP/Short-Term Money Market ESG-P ■ FTSE CHF 1-Month Eurodeposit (CHF) PERFORMANCE vs. FTSE CHF 1-Month Eurodeposit (CHF)

déc. 23

nov. 23

	Portefeuille	Indice	Portefeuille	Indice
	Cumulée		Annualisée	
YTD	0.37%	0.51%	-	_
1 mois	0.11%	0.12%	-	_
3 mois	0.24%	0.38%	-	_
Depuis création	0.76%	1.05%	1.15%	1.59%

janv. 24

#### **ANALYSE DU PORTEFEUILLE**

oct. 23

Duration modifiée			Rating		
48 heures - 30 jours	25.4%		A		44.6%
30 - 90 jours	43	3.1%	AAA		33.0%
90 - 120 jours	4.0%		AA	15.1%	
120 - 150 jours	10.3%		NC (incl. cash & éq.)	7.3%	
150 jours et plus (FRN incl.)	8.6%				
Liquiditás	0 E0/				

La répartition des actifs présentée ci-dessus est appelée à varier sur la durée.

STATISTIQUES	
VNI	CHF 100.76
Taille du fonds (mio.)	CHF 4.28
Rendement à 1m	0.11%
Rendement YTD	0.37%
Rend. depuis lanc.	0.76%
Gain maximal	0.75%
Perte maximale	-0.10%
Volatilité	0.21%

#### INFORMATIONS CLÉS

CTATICTICLIEC

Statut juridique	Fondation suisse
Banque dépositaire	Banque Pictet & Cie SA
Gérant	Pictet Asset
	Management SA
ISIN	CH1282064158
Monnaie de base	CHF
Dividende	Réinvesti
Date de lancement	1 septembre 2023
Clôture de l'exercice	31 décembre
Calcul de la VNI	Quotidien, "forward pricing"
Commission de gestion	0.17% p.a.

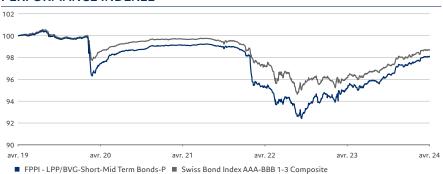


# FPPI - LPP/BVG-Short-Mid Term Bonds-P ISIN (CH0017245074)

#### **OBJECTIFS ET POLITIQUE D'INVESTISSEMENT**

Par le biais de fonds de placement ou de titres, ce portefeuille peut investir dans des obligations, titres de créances et liquidités libellés en CHF ou en monnaies étrangères; l'échéance moyenne résiduelle du portefeuille ne dépasse pas trois ans et l'échéance maximale résiduelle par investissement n'excède pas dix ans.

#### PERFORMANCE INDEXÉE



#### PERFORMANCE vs. Swiss Bond Index AAA-BBB 1-3 Composite<sup>1)</sup>

	Portefeuille	Indice	Portefeuille	Indice
	Cumulée	е	Annualis	ée
YTD	0.76%	0.66%	-	-
1 mois	0.11%	0.04%	-	-
3 mois	0.57%	0.48%	-	-
1 an	3.05%	2.65%	3.05%	2.65%
3 ans	-1.04%	-0.98%	-0.35%	-0.33%
5 ans	-1.92%	-1.31%	-0.39%	-0.26%
Depuis création	10.22%	19.31%	0.48%	0.88%

	Portefeuille	Indice	Portefeuille	Indice
	Par anné	e	avril à av	ril
2023	3.70%	2.57%	3.05%	2.65%
2022	-5.04%	-3.81%	-0.13%	-1.06%
2021	-0.20%	-0.26%	-3.85%	-2.51%
2020	-0.63%	-0.10%	1.70%	1.14%
2019	-0.27%	-0.10%	-2.54%	-1.45%

#### **ANALYSE DU PORTEFEUILLE**

Duration	modifiée		Rating			
< 1 an		29.4%	AAA			29.6%
1 - 3 ans		53.1%	AA		16.9%	
3 - 5 ans	15.9%		A		17.1%	
5 - 7 ans	0.8%		BBB			33.3%
7 - 10 ans	0.8%		BB	■0.9%		
			NC (incl. cash & éq.)	2.3%		
La répartit	ion des actifs présenté	e ci-dessus est appelée à	a varier sur la durée.			

STATISTIQUES	
VNI	CHF 110.22
Taille du fonds (mio.)	CHF 5.99
Duration moyenne	1.35 années
Rendement moyen	2.27%
Coupon moyen	1.88%
Rendement à 1m	0.11%
Rendement YTD	0.76%
Rend. depuis lanc.	10.22%
Gain maximal	6.17%
Perte maximale	-6.88%
Volatilité	2.02%
•	

#### INFORMATIONS CLÉS

Statut juridique	Fondation suisse
Banque dépositaire	Banque Pictet & Cie SA
Gérant	Pictet Asset Management SA / Ermira Marika, Olivier Hildbrand
ISIN	CH0017245074
Monnaie de base	CHF
Dividende	Réinvesti
Date de lancement	1 mars 2004
Clôture de l'exercice	31 décembre
Commission de gestion	0.30% p.a.
Calcul de la VNI	Quotidien, "forward pricing"
Bloomberg	FSMTBDP SW



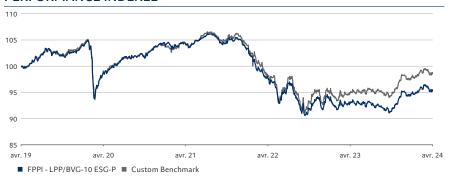
<sup>1) 1</sup> févr. 2004 à 31 déc. 2007 Swiss Bondindex Domestic 1-3 Yrs

## FPPI - LPP/BVG-10 ESG-P ISIN (CH0296545129)

#### **OBJECTIFS ET POLITIQUE D'INVESTISSEMENT**

Par le biais de fonds de placement ou de titres, ce portefeuille peut investir dans toutes les classes d'actifs autorisées par l'OPP2. La part d'actions doit être comprise entre 5% et 15% des actifs.

#### PERFORMANCE INDEXÉE



#### PERFORMANCE vs. Custom Benchmark

	Portefeuille	Indice	Portefeuille	Indice
	Cumulé	е	Annualis	ée
YTD	0.26%	0.40%	-	-
1 mois	-1.29%	-1.00%	-	-
3 mois	0.32%	0.45%	-	-
1 an	2.41%	3.82%	2.41%	3.82%
3 ans	-8.47%	-5.31%	-2.90%	-1.80%
5 ans	-4.74%	-1.43%	-0.97%	-0.29%
Depuis création	0.38%	7.08%	0.04%	0.80%

	Portefeuille	Indice	Portefeuille	Indice
	Par anne	ée	avril à av	ril
2023	3.63%	5.94%	2.41%	3.82%
2022	-12.67%	-12.23%	-4.86%	-3.46%
2021	0.83%	1.42%	-6.05%	-5.53%
2020	1.61%	1.23%	5.28%	5.07%
2019	6.21%	7.25%	-1.15%	-0.92%

#### **ANALYSE DU PORTEFEUILLE**

actifs	Exposition nette par devise

Obligations CHF	43.0%	CHF		91.7
Obligations gouvernementales monde (hdg. CHF)	<b>■</b> 17.1%	USD	<b>4.0%</b>	
Fonds couverts	7.1%	EUR	0.7%	
Obligations d'entreprises monde (hdg. CHF)	17.0%	JPY	10.3%	
Actions suisses	6.4%	GBP	10.2%	
Actions étrangères	5.1%	Autres	■3.1%	
Immobilier suisse	4.9%			
Dette émergente	4.0%			
Immobilier étranger	2.9%			
Obligations à haut rendement étrangers	11.1%			
Liquidités et équivalent	11.4%			

La répartition des actifs présentée ci-dessus est appelée à varier sur la durée.

STATISTIQUES	
VNI	CHF 100.38
Taille du fonds (mio.)	CHF 6.54
Rendement à 1m	-1.29%
Rendement YTD	0.26%
Rend. depuis lanc.	0.38%
Gain maximal	6.54%
Perte maximale	-14.71%
Volatilité	4.81%
•	

#### **INFORMATIONS CLÉS**

Statut juridique	Fondation suisse
Banque dépositaire	Banque Pictet & Cie SA
Gérant	Pictet Asset Management SA / Eric Rosset
ISIN	CH0296545129
Monnaie de base	CHF
Dividende	Réinvesti
Date de lancement	30 septembre 2015
Clôture de l'exercice	31 décembre
Commission de gestion	0.70% p.a.
Calcul de la VNI	Quotidien, "forward pricing"
Bloomberg	FPPI10P SW

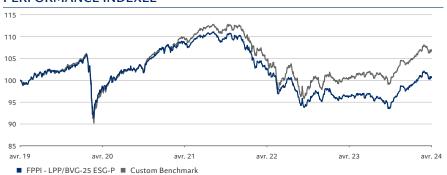


# FPPI - LPP/BVG-25 ESG-P ISIN (CH0017245355)

#### **OBJECTIFS ET POLITIQUE D'INVESTISSEMENT**

Par le biais de fonds de placement ou de titres, ce portefeuille peut investir dans toutes les classes d'actifs autorisées par l'OPP2. La part d'actions doit être comprise entre 15% et 35% des actifs.

#### PERFORMANCE INDEXÉE



#### PERFORMANCE vs. Custom Benchmark

	Portefeuille	Indice	Portefeuille	Indice
	Cumu	lée	Annua	lisée
YTD	2.29%	2.32%	-	-
1 mois	-1.42%	-1.26%	-	-
3 mois	1.97%	1.94%	-	-
1 an	4.46%	6.07%	4.46%	6.07%
3 ans	-7.12%	-2.39%	-2.43%	-0.80%
5 ans	0.64%	6.72%	0.13%	1.31%
Depuis création	51.35%	-	2.08%	-

	Portefeuille	Indice	Portefeuille	Indice
	Par anne	ée	avril à av	ril
2023	3.45%	6.55%	4.46%	6.07%
2022	-13.63%	-12.84%	-6.19%	-3.81%
2021	3.52%	5.16%	-5.23%	-4.33%
2020	3.25%	3.27%	10.05%	11.49%
2019	9.24%	10.70%	-1.54%	-1.94%

#### **ANALYSE DU PORTEFEUILLE**

ctifs	Exposition nette par devise

Obligations CHF	27.5%	CHF		79.8%
Obligations gouvernementales monde (hdg. CHF)	<b>1</b> 6.9%	USD	13.2%	
Actions étrangères	<b>■</b> 15.7%	EUR	■1.8%	
Actions suisses	<b>■</b> 11.1%	JPY	0.8%	
onds couverts	6.0%	GBP	0.4%	
Dette émergente	15.7%	Autres	4.0%	
Obligations d'entreprises monde (hdg. CHF)	4.9%			
mmobilier suisse	4.9%			
mmobilier étranger	3.4%			
Actions étrangères petite cap	2.5%			
Obligations à haut rendement étrangers	10.9%			
_iquidités et équivalent	10.5%			

STATISTIQUES	
VNI	CHF 151.35
Taille du fonds (mio.)	CHF 34.28
Rendement à 1m	-1.42%
Rendement YTD	2.29%
Rend. depuis lanc.	51.35%
Gain maximal	9.21%
Perte maximale	-15.82%
Volatilité	5.78%

#### **INFORMATIONS CLÉS**

Statut juridique	Fondation suisse
Banque dépositaire	Banque Pictet & Cie SA
Gérant	Pictet Asset
	Management SA / Eric
	Rosset
ISIN	CH0017245355
Monnaie de base	CHF
Dividende	Réinvesti
Date de lancement	1 mars 2004
Clôture de l'exercice	31 décembre
Commission de gestion	0.95% p.a.
Calcul de la VNI	Quotidien, "forward
	pricing"
Bloomberg	FPPI25P SW



# FPPI - LPP/BVG-Multi Asset Flexible-P ISIN (CH0402419755)

#### **OBJECTIFS ET POLITIQUE D'INVESTISSEMENT**

Par le biais de fonds de placement ou de titres, ce portefeuille peut investir dans toutes les classes d'actifs autorisées par l'OPP2 et a pour objectif de générer un rendement positif en francs suisses.

#### PERFORMANCE INDEXÉE



	Portefeuille	Indice	Portefeuille	Indice
	Cumulée	Cumulée		ée
YTD	2.49%	0.55%	-	-
1 mois	-1.81%	0.13%	-	-
3 mois	1.82%	0.40%	-	-
1 an	3.97%	1.68%	3.97%	1.68%
3 ans	-10.69%	1.30%	-3.70%	0.43%
5 ans	-1.66%	-0.18%	-0.33%	-0.04%
Depuis création	-0.51%	-1.04%	-0.08%	-0.17%

	Portefeuille	Indice	Portefeuille	Indice
	Par anné	е	avril à av	ril
2023	1.15%	1.48%	3.97%	1.68%
2022	-15.06%	-0.25%	-9.13%	0.34%
2021	2.03%	-0.73%	-5.47%	-0.72%
2020	6.09%	-0.70%	8.07%	-0.71%
2019	8.45%	-0.78%	1.89%	-0.75%

#### **ANALYSE DU PORTEFEUILLE**

#### Actifs **Exposition nette par devises**

Actions étrangères	24.0%	CHF		70.1%
Obligations gouvernementales monde (hdg. CHF)	<b>1</b> 4.5%	USD	20.2%	
Obligations CHF	<b>1</b> 2.2%	EUR	■2.3%	
Fonds couverts	■7.3%	JPY	0.5%	
Immobilier étranger	6.0%	GBP	0.4%	
Dette émergente	<b>1</b> 5.1%	Autres	6.5%	
Obligations d'entreprises monde (hdg. CHF)	<b>1</b> 5.0%			
Immobilier suisse	4.9%			
Actions suisses	3.5%			
Liquidités et équivalent	<b>17.5%</b>			

PERFORMANCE vs. Ice Bofa FI Saron Overnight Rate Index CHF

STATISTIQUES	
VNI	CHF 99.49
Taille du fonds (mio.)	CHF 13.15
Rendement à 1m	-1.81%
Rendement YTD	2.49%
Rend. depuis lanc.	-0.51%
Gain maximal	9.89%
Perte maximale	-19.21%
Volatilité	6.19%

#### INFORMATIONS CLÉS

Statut juridique	Fondation suisse
Banque dépositaire	Banque Pictet & Cie SA
Gérant	Pictet Asset
	Management SA / Eric
	Rosset
ISIN	CH0402419755
Monnaie de base	CHF
Dividende	Réinvesti
Date de lancement	29 mars 2018
Clôture de l'exercice	31 décembre
Commission de gestion	1.15% p.a.
Calcul de la VNI	Quotidien, "forward
	pricing"
Bloomberg	FPPIMAP SW

La répartition des actifs présentée ci-dessus est appelée à varier sur la durée.

# FPPI - LPP/BVG-40 ESG-P ISIN (CH0017245405)

#### **OBJECTIFS ET POLITIQUE D'INVESTISSEMENT**

Par le biais de fonds de placement ou de titres, ce portefeuille peut investir dans toutes les classes d'actifs autorisées par l'OPP2. La part d'actions doit être comprise entre 30% et 50% des actifs.

# PERFORMANCE INDEXÉE 125 120 115 110 105 100 85 avr. 19 avr. 20 avr. 21 avr. 22 avr. 23 avr. 24

#### PERFORMANCE vs. Custom Benchmark

	Portefeuille	Indice	Portefeuille	Indice
	Cumi	ılée	Annua	lisée
YTD	4.04%	4.21%	-	-
1 mois	-1.55%	-1.29%	-	-
3 mois	3.32%	3.45%	-	-
1 an	5.95%	8.04%	5.95%	8.04%
3 ans	-4.99%	0.69%	-1.69%	0.23%
5 ans	7.27%	14.47%	1.41%	2.74%
Depuis création	206.71%	-	3.42%	-

	Portefeuille	Indice	Portefeuille	Indice
	Par anne	Par année		ril
2023	3.49%	7.06%	5.95%	8.04%
2022	-14.40%	-13.38%	-6.80%	-4.13%
2021	7.10%	8.74%	-3.78%	-2.78%
2020	4.58%	4.33%	15.10%	16.52%
2019	12.69%	14.24%	-1.91%	-2.44%

#### **ANALYSE DU PORTEFEUILLE**

Actifs	Exposition nette par devises	

Actions étrangères	24.8%	CHF		68.4%
Obligations CHF	22.6%	USD	19.0%	
Actions suisses	<b>■</b> 14.4%	EUR	<b>2</b> .6%	
Obligations gouvernementales monde (hdg. CHF)	■8.2%	JPY	1.3%	
Fonds couverts	■5.9%	GBP	0.8%	
Dette émergente	■5.5%	Autres	7.9%	
Immobilier suisse	4.9%			
Obligations d'entreprises monde (hdg. CHF)	3.7%			
Immobilier étranger	3.6%			
Actions étrangères petite cap	2.5%			
Obligations à haut rendement étrangers	11.3%			
Liquidités et équivalent	12.6%			
La répartition des actifs présentée ci-dessus e	st appelée à	varier su	ır la durée.	

STATISTIQUES	
VNI	CHF 148.87
Taille du fonds (mio.)	CHF 139.09
Rendement à 1m	-1.55%
Rendement YTD	4.04%
Rend. depuis lanc.	206.71%
Gain maximal	11.88%
Perte maximale	-17.02%
Volatilité	7.05%

#### **INFORMATIONS CLÉS**

Statut juridique	Fondation suisse
Banque dépositaire	Banque Pictet & Cie SA
Gérant	Pictet Asset
	Management SA / Eric Rosset
ISIN	CH0017245405
Monnaie de base	CHF
Dividende	Réinvesti
Date de lancement	31 décembre 1990
Clôture de l'exercice	31 décembre
Commission de gestion	1.15% p.a.
Calcul de la VNI	Quotidien, "forward pricing"
Bloomberg	FPPI40P SW

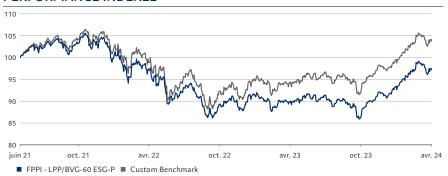


## FPPI - LPP/BVG-60 ESG-P ISIN (CH1110419004)

#### **OBJECTIFS ET POLITIQUE D'INVESTISSEMENT**

Par le biais de fonds de placement ou de titres, ce portefeuille peut investir dans toutes les classes d'actifs autorisées par l'OPP2. La part d'actions doit être comprise entre 45% et 75% des actifs et dépasse ainsi la limitation définie à l'art. 55 OPP2. Les critères environnementaux, sociaux et de gouvernance sont intégrés lors du processus d'investissement.

#### PERFORMANCE INDEXÉE



#### PERFORMANCE vs. Custom Benchmark

	Portefeuille	Indice	Portefeuille	Indice
	Cumulée		Annualis	ée
YTD	6.27%	6.28%	-	-
1 mois	-1.88%	-1.61%	-	-
3 mois	4.95%	5.09%	-	-
1 an	8.20%	10.18%	8.20%	10.18%
Depuis création	-2.92%	3.88%	-1.01%	1.31%
	Portefeuille	Indice	Portefeuille	Indice
	Par anne	ée	avril à av	/ril
2022	1 1 10/	7 90%	9 20%	10 100/

	Par ann	Par année		
2023	4.14%	7.80%	8.20%	10.18%
2022	-15.72%	-14.07%	-7.61%	-4.71%
2021	4.08%	5.51%		_

#### **ANALYSE DU PORTEFEUILLE**

Exposition nette par devises

Actions étrangères	34.1%	CHF			55.3%
Actions suisses	<b>2</b> 1.4%	USD		28.1%	
Dette émergente	6.6%	EUR	3.5%		
Obligations gouvernementales monde (hdg. CHF)	6.4%	JPY	2.0%		
Obligations CHF	6.0%	GBP	1.2%		
Fonds couverts	5.6%	Autres	9.9%		
Actions étrangères petite cap	4.9%				
Immobilier suisse	4.7%				
Immobilier étranger	3.0%				
Obligations d'entreprises monde (hdg. CHF)	2.4%				
Obligations à haut rendement étrangers	11.3%				
Liquidités et équivalent	3.6%				
1 / 1 1 1	. 1/ )		1 1 /		

La répartition des actifs présentée ci-dessus est appelée à varier sur la durée.

STATISTIQUES	
VNI	CHF 97.08
Taille du fonds (mio.)	CHF 24.91
Rendement à 1m	-1.88%
Rendement YTD	6.27%
Rend. depuis lanc.	-2.92%
Gain maximal	15.43%
Perte maximale	-18.63%

#### INFORMATIONS CLÉS

Statut juridique	Fondation suisse
Banque dépositaire	Banque Pictet & Cie SA
Gérant	Pictet Asset
	Management SA
ISIN	CH1110419004
Monnaie de base	CHF
Dividende	Réinvesti
Date de lancement	31 mai 2021
Clôture de l'exercice	31 décembre
Calcul de la VNI	Quotidien, "forward
-	pricing"
Commission de gestion	1.15% p.a.
Bloomberg	FPIFEPC SW



#### Avertissement

Le présent document est destiné exclusivement aux investisseurs éligibles et ne s'adresse pas aux ressortissants d'une juridiction ou d'un pays dans lequel la distribution, publication, mise à disposition ou utilisation de ce document seraient contraires aux lois et réglementations en vigueur, ni aux personnes physiques ou morales domiciliées, résidentes ou enregistrées dans un tel pays ou une telle juridiction.

Les informations ou données fournies dans le présent document sont communiquées à des fins d'information uniquement. Le Groupe Pictet\* n'en assume pas la responsabilité, et elles ne constituent ni une offre ni une invitation à acheter, à vendre ou à souscrire des titres ou d'autres instruments financiers.

En outre, les informations, avis et évaluations contenus dans le présent document reflètent une évaluation à la date de la publication initiale et sont susceptibles d'être modifiés sans notification préalable.

La valeur et les revenus tirés des titres ou des instruments financiers mentionnés dans le présent document sont basés sur des taux issus des sources habituelles d'information financière et peuvent varier. La valeur de marché peut varier en raison de changements économiques, financiers ou politiques, de la durée de vie résiduelle, des conditions du marché, de la volatilité et de la solvabilité de l'émetteur ou de l'émetteur de référence. En outre, les taux de change peuvent avoir un impact positif ou négatif sur la valeur, le prix ou les revenus des titres ou des investissements liés et mentionnés dans le présent document.

Les performances passées ne sont pas une indication ni une garantie des performances actuelles ou futures, et les destinataires du présent document sont entièrement responsables de leurs investissements.

Aucune garantie expresse ou implicite n'est donnée quant aux résultats futurs.

Le contenu du présent document est confidentiel et ne peut être lu et/ou utilisé que par son destinataire. Le Groupe Pictet n'est pas responsable de l'utilisation, de la transmission ou de l'exploitation du contenu du présent document. Par conséquent, toute reproduction, copie, divulgation, modification et/ou publication du contenu relève de la responsabilité exclusive de son destinataire, et le Groupe Pictet n'assume aucune responsabilité d'aucune sorte. Le destinataire du présent document s'engage à respecter les lois et réglementations en vigueur dans les juridictions où il/elle utilise les informations reproduites dans ce document.

Ce document est publié par le Groupe Pictet. Cette publication et son contenu peuvent être cités moyennant mention de la source. Tous droits réservés. copyright 2023

\* Le Groupe Pictet inclut les entités citées dans le rapport publié à l'adresse suivante : www.pictet.com/reports.

Source : FundPartner Solutions (Europe) S.A. – entité du groupe Pictet

#### Contacts

Si vous désirez suivre régulièrement l'évolution des valeurs nettes d'inventaire et la performance de nos portefeuilles, nous vous invitons à consulter les pages «Prévoyance» de notre site Internet pictet.com

Si vous souhaitez obtenir davantage de renseignements sur la Fondation Pictet en faveur de la prévoyance individuelle (3° Pilier A), n'hésitez pas à nous contacter:

PASCAL KESSLER +41 58 323 15 46

DAVID CECIL +41 58 323 12 66

pictetfoundations@pictet.com

FONDATION PICTET EN
FAVEUR DE LA PRÉVOYANCE
INDIVIDUELLE LIÉE (3<sup>E</sup> PILIER A)
Route des Acacias 60
1211 Genève 73
Suisse
+41 58 323 29 20

