

Indicateurs	Fortune au 30.09.2023		Valeur au 30.09.2023	
	en mio CHF	en %		
Exercice des droits de vote et engagement				
Pourcentage des entreprises où l'on vote, par rapport au capital investi				
Actions Suisse	425	10%		97%
Actions Europe hors Suisse (hedged)	193	4%		84%
Actions États-Unis (hedged)	495	11%		91%
Actions Japon (hedged)	76	2%		74%
Actions Pacifique hors Japon (hedged)	46	1%		98%
Actions marchés émergents	123	3%		100%
Actions monde Small Caps hors Suisse (hedged)	120	3%		1%
Immobiliers Suisse indirects	133	3%		100%
Pourcentage d'approbation des propositions de la Direction				
Actions Suisse	425	10%		69%
Actions Europe hors Suisse (hedged)	193	4%		-
Actions États-Unis (hedged)	495	11%		81%
Actions Japon (hedged)	76	2%		95%
Actions Pacifique hors Japon (hedged)	46	1%		70%
Actions marchés émergents	123	3%		84%
Actions monde Small Caps hors Suisse (hedged)	120	3%		89%
Biens immobiliers Suisse indirects	133	3%		74%
Initiatives d'engagement direct de la Caisse de retraite			Ethos Engagement Pool Suisse et International	
Émissions de gaz à effet de serre			PF	QT
Intensité emprunts d'état (tonnes CO₂ e / mio CHF PIB)				
Fonds marché monétaires CHF (portion Emprunts d'État: 31,8%)	30	1%	9,7	-
Fonds marché monétaires CHF (portion Emprunts d'État: 9,0%)	30	1%	632,9	-
Obligations CHF (portion Emprunts d'État: 14,6%)	533	12%	60,0	36%
Obligations USD (hedged) (portion Emprunts d'État: 3,2%)	112	3%	367,0	-
Obligations EUR (hedged) (portion Emprunts d'État: 4,8%)	87	2%	-	-
Intensité actions, obligations d'entreprises et obligations convertibles (tonnes CO₂ e / mio CHF résultat, scopes 1 et 2)				
Fonds marché monétaires CHF (portion obligations d'entreprises: 62,1%)	30	1%	9,7	-
Fonds marché monétaires CHF (portion obligations d'entreprises: 91,0%)	30	1%	14,2	-
Obligations CHF (portion obligations d'entreprises: 85,4%)	533	12%	42,0	87%
Obligations USD (hedged) (portion obligations d'entreprises: 95,5%)	112	3%	305,0	-
Obligations EUR (hedged) (portion obligations d'entreprises: 92,0%)	87	2%	125,0	92%
Actions Suisse	425	10%	77,5	98%
Actions Europe hors Suisse (hedged)	193	4%	95,8	99%
Actions États-Unis (hedged)	495	11%	124,2	99%
Actions Japon (hedged)	76	2%	84,5	100%
Actions Pacifique hors Japon (hedged)	46	1%	174,9	96%
Actions marchés émergents	123	3%	327,2	-
Actions monde Small Caps hors Suisse (hedged)	120	3%	171,9	95%
Empreinte carbone actions, obligations d'entreprises et obligations convertibles (tonnes CO₂ e / mio CHF de capital investi, scopes 1 et 2)				
Fonds marché monétaires CHF (portion obligations d'entreprises: 62,1%)	30	1%	3,6	-
Fonds marché monétaires CHF (portion obligations d'entreprises: 91,0%)	30	1%	3,2	62%
Obligations CHF (portion obligations d'entreprises: 85,4%)	533	12%	38,0	47%
Obligations USD (hedged) (portion obligations d'entreprises: 95,5%)	112	3%	97,0	-
Obligations EUR (hedged) (portion obligations d'entreprises: 92,0%)	87	2%	29,7	92%
Actions Suisse	425	10%	43,3	98%
Actions Europe hors Suisse (hedged)	193	4%	72,2	99%
Actions États-Unis (hedged)	495	11%	33,3	99%
Actions Japon (hedged)	76	2%	64,0	100%
Actions Pacifique hors Japon (hedged)	46	1%	77,4	96%
Actions marchés émergents	123	3%	147,2	-
Actions monde Small Caps hors Suisse (hedged)	120	3%	87,2	95%

Indicateurs	Fortune au 30.09.2023		Valeur au 30.09.2023	
	en mio CHF	en %	PF	QT
Exposition aux combustibles fossiles				
Part d'investissements dans des entreprises ayant des activités dans le charbon (>5% de leurs recettes)				
Fonds marché monétaires CHF (portion obligations d'entreprises: 62,1%)	30	1%	0,0%	-
Fonds marché monétaires CHF (portion obligations d'entreprises: 91,0%)	30	1%	0,1%	-
Obligations CHF (portion obligations d'entreprises: 85,4%)	533	12%	0,0%	100%
Obligations USD (hedged) (portion obligations d'entreprises: 95,5%)	112	3%	6,5%	-
Obligations EUR (hedged) (portion obligations d'entreprises: 92,0%)	87	2%	0,2%	92%
Actions Suisse	425	10%	0,2%	0%
Actions Europe hors Suisse (hedged)	193	4%	1,0%	3%
Actions États-Unis (hedged)	495	11%	1,1%	99%
Actions Japon (hedged)	76	2%	0,7%	100%
Actions Pacifique hors Japon (hedged)	46	1%	11,6%	13%
Actions marchés émergents	123	3%	2,0%	-
Actions monde Small Caps hors Suisse (hedged)	120	3%	1,3%	95%
Part d'investissements dans des entreprises ayant des activités dans d'autres combustibles fossiles (>5% de leurs recettes)				
Fonds marché monétaires CHF (portion obligations d'entreprises: 62,1%)	30	1%	0,0%	-
Fonds marché monétaires CHF (portion obligations d'entreprises: 91,0%)	30	1%	1,7%	-
Obligations CHF (portion obligations d'entreprises: 85,4%)	533	12%	0,6%	100%
Obligations USD (hedged) (portion obligations d'entreprises: 95,5%)	112	3%	18,0%	-
Obligations EUR (hedged) (portion obligations d'entreprises: 92,0%)	87	2%	14,2%	92%
Actions Suisse	425	10%	0,2%	0%
Actions Europe hors Suisse (hedged)	193	4%	12,3%	14%
Actions États-Unis (hedged)	495	11%	8,4%	99%
Actions Japon (hedged)	76	2%	7,1%	100%
Actions Pacifique hors Japon (hedged)	46	1%	16,8%	19%
Actions marchés émergents	123	3%	6,2%	-
Actions monde Small Caps hors Suisse (hedged)	120	3%	8,2%	95%
Indicateurs biens immobiliers Suisse			PF	QT
Intensité énergétique kWh par m² de surface de référence énergétique				
Biens immobiliers Suisse directs	1082	24%	91,8	100%
Biens immobiliers Suisse indirects	133	3%	109,4	97%
Intensité carbone kg CO₂ par m² de surface de référence énergétique (scopes 1 et 2)				
Biens immobiliers Suisse directs	1082	24%	7,9	100%
Biens immobiliers Suisse indirects	133	3%	17,0	99%
Mix de sources énergétiques (part des sources d'énergie fossiles)				
Biens immobiliers Suisse directs	1082	24%	30,0%	100%
Biens immobiliers Suisse indirects	133	3%	56,6%	97%

Légende:

- non spécifié
- PF portefeuille
- QT taux de transparence

Source des données:

Autodéclaration des représentants élus sur demande Contrôleur des investissements PPCmetrics; chiffres énergétiques immobilier direct par l'intermédiaire de partenaires énergétiques externes.

Glossaire – Description des chiffres clés relatives au climat

Actions et obligations d'entreprise

Intensité de CO ₂ (scope 1 et 2 [*])	Intensité carbone moyenne pondérée des entreprises du portefeuille, exprimée en tonnes de CO ₂ e (équivalents CO ₂) par mio CHF de chiffre d'affaires.
Empreinte de CO ₂ (scope 1 et 2)	Emissions de carbone des entreprises du portefeuille, exprimées en tonnes de CO ₂ e (équivalents CO ₂) par mio CHF de capital investi.
Exposition au charbon	Part des investissements dans les entreprises qui génèrent plus de 5% de leur chiffre d'affaires en exerçant des activités dans un secteur utilisant du charbon. Les activités couvrent l'ensemble de la chaîne de création de valeur.
Exposition à d'autres combustibles fossiles	Part des investissements dans des entreprises qui génèrent plus de 5% de leur chiffre d'affaires en exerçant des activités dans un secteur utilisant d'autres combustibles fossiles. Les activités couvrent l'ensemble de la chaîne de création de valeur.

Emprunts d'état

Intensité du CO ₂	Intensité carbone moyenne pondérée des pays du portefeuille, exprimée en tonnes de CO ₂ e (équivalents CO ₂) par mio CHF de PIB.
------------------------------	---

Comme les données sur lesquelles reposent les chiffres clés ne sont souvent pas disponibles pour l'ensemble du patrimoine (partiel), un taux de transparence est indiqué. Le taux de transparence mesure à chaque fois la part du patrimoine applicable pour laquelle les données déterminantes sont disponibles.

Biens immobiliers

Intensité de CO ₂ (scope 1)	Quantité de CO ₂ émise exprimée en kilogrammes par mètre carré de surface de référence énergétique ou par mètre carré de surface pouvant faire l'objet d'une location et par an (kg/m ²).
Intensité de CO ₂ (scope 1 et 2 [†])	Quantité de CO ₂ émise exprimée en kilogrammes par mètre carré de surface de référence énergétique ou par mètre carré de surface pouvant faire l'objet d'une location et par an (kg/m ²).
Intensité de l'énergie consommée	Consommation d'énergie du portefeuille exprimée en kilowattheures par mètre carré de surface de référence énergétique ou par mètre carré de surface pouvant faire l'objet d'une location et par an (kWh/m ²).
Mix énergétique	Part de la surface de référence énergétique des bâtiments utilisant des sources d'énergie fossile (obligatoirement du pétrole et du gaz) par rapport à la surface de référence énergétique totale.

Un taux de transparence est également indiqué pour les chiffres clés relatives au climat des biens immobiliers.

* Scope 1: émissions directes provenant de sources appartenant à l'entreprise. Scope 2: émissions provenant de la production de l'électricité, du chauffage urbain et de la vapeur achetés à l'extérieur et consommés par l'entreprise (émissions indirectes). Scope 3: toutes les émissions restantes dues à l'activité commerciale de l'entreprise. La base de données repose souvent sur des estimations, c'est pourquoi les émissions du scope 3 ne sont pas encore prises en compte à ce stade. Toutes les mesures requises pour prendre en compte, dès que possible, les émissions du scope 3 ont été prises.

† Les émissions du scope 1 sont celles générées directement pendant l'exploitation d'un bâtiment. Font partie intégrante du scope 1, par exemple, les émissions dues à la combustion de pétrole dans le bâtiment pour la production de l'eau chaude et du chauffage. Les émissions du scope 2 sont celles générées lors de la production de l'électricité, si celle-ci est nécessaire au fonctionnement du support énergétique utilisé dans un bâtiment (par exemple, production de l'électricité requise au fonctionnement de systèmes de chauffage renouvelables comme les pompes à chaleur ou les chauffages électriques).