

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.07.2015		Stratégie			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	4'076'059	1.0%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	100'761'561	23.6%	15.0%	22.0%	29.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	72'854'855	17.1%	11.0%	16.0%	21.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	35'916'662	8.4%	6.0%	8.0%	10.0%		
Obligations des marchés émergents (couvertes)	15'978'835	3.7%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	229'587'972	53.8%	40.0%	50.0%	60.0%		
Actions	116'858'373	27.4%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	56'200'805	13.2%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	40'458'471	9.5%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	15'742'334	3.7%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde	49'196'596	11.5%	8.0%	10.0%	12.0%		
Marchés émergents	11'460'972	2.7%	1.0%	3.0%	5.0%		
Placements alternatifs	4'000'050	0.9%	0.0%	5.0%	7.0%	15.0%	55 let. d)
CRIP	4'000'050	0.9%					
Immobilier	76'200'529	17.9%	13.0%	20.0%	27.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	56'634'252	13.3%	9.0%	15.0%	21.0%		
Etranger (couvert)	19'566'277	4.6%	4.0%	5.0%	6.0%		
Valeurs réelles	197'058'952	46.2%		50.0%			
Total	426'646'924	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	60'657'568	14.2%	10.0%	15.0%	19.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	204'974'197	48.0%					
Couverture	144'316'629	33.8%					

* La limite maximale d'avance sur un objet immobilier est fixée à 30% de sa valeur vénale.

Performances du portefeuille

2015

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/15	T2/15	juil. 15	YTD 2015*
Portefeuille total	426.6	2.02%	-1.83%	1.94%	2.10%
Benchmark composite		2.00%	-1.90%	1.86%	1.92%
Différence		0.02%	0.07%	0.08%	0.18%

* jusqu'au 31.07.2015

© PPCmetrics SA

Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2010	2011	2012	2013	2014	YTD 2015*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	426.6	2.20%	-0.26%	8.01%	6.13%	8.37%	2.10%	28.77%	3.39%	01.01.08
Benchmark composite		3.07%	0.92%	8.16%	6.72%	9.08%	1.92%	33.21%	3.85%	
Différence		-0.87%	-1.19%	-0.15%	-0.59%	-0.71%	0.18%	-4.44%	-0.46%	

* jusqu'au 31.07.2015

© PPCmetrics SA

Comparaison rendement / risque

