

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 30.09.2015		Stratégie			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	28'207'764	6.3%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	100'341'745	22.5%	15.0%	22.0%	29.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	72'565'942	16.3%	11.0%	16.0%	21.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	35'563'853	8.0%	6.0%	8.0%	10.0%		
Obligations des marchés émergents (couvertes)	15'916'130	3.6%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	252'595'434	56.6%	40.0%	50.0%	60.0%		
Actions	113'593'223	25.4%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	57'088'351	12.8%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	42'394'683	9.5%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	14'693'668	3.3%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde	42'406'619	9.5%	8.0%	10.0%	12.0%		
Marchés émergents	14'098'253	3.2%	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	76'165'504	17.1%	13.0%	20.0%	27.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	56'634'252	12.7%	9.0%	15.0%	21.0%		
Etranger (couvert)	19'531'252	4.4%	4.0%	5.0%	6.0%		
Valeurs réelles	193'758'777	43.4%		50.0%			
Total	446'354'211	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	56'504'872	12.7%	10.0%	15.0%	19.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	200'082'049	44.8%					
Couverture	143'577'177	32.2%					

* 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	août 15	sept. 15	T3/15	YTD 2015*
Portefeuille total	446.4	2.02%	-1.83%	1.94%	-1.77%	-0.52%	-0.39%	-0.23%
Benchmark composite		2.00%	-1.90%	1.85%	-1.98%	-0.59%	-0.76%	-0.69%
Différence		0.02%	0.07%	0.09%	0.21%	0.07%	0.37%	0.46%

* jusqu'au 30.09.2015

© 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	446.4	2.20%	-0.26%	8.01%	6.13%	8.37%	-0.23%	25.83%	3.01%	01.01.08
Benchmark composite		3.07%	0.92%	8.16%	6.72%	9.08%	-0.69%	29.80%	3.42%	
Différence		-0.87%	-1.19%	-0.15%	-0.59%	-0.71%	0.46%	-3.96%	-0.41%	

* jusqu'au 30.09.2015

© PPCmetrics SA

Comparaison rendement / risque

