

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 28.02.2017		Stratégie			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	15'909'545	2.0%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	139'774'272	18.0%	9.0%	16.0%	24.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	119'364'760	15.4%	9.0%	14.0%	19.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	62'384'355	8.0%	5.0%	7.0%	9.0%		
Obligations des marchés émergents (couvertes)	28'756'095	3.7%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	366'189'027	47.2%	40.0%	41.0%	60.0%		
Actions	217'770'770	28.1%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	106'809'150	13.8%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	80'820'828	10.4%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	25'988'322	3.3%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde	87'676'237	11.3%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large et Mid Cap	80'314'305	10.3%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	7'361'932	0.9%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	23'285'383	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
Placements alternatifs (couverts)	192'223'731	5.1%	2.0%	6.0%	10.0%	15.0%	55 let. d)
SSL + CRIP	20'162'375	2.6%	1.0%	3.0%	5.0%		
Matières premières	19'676'497	2.5%	1.0%	3.0%	5.0%		
Immobilier	152'384'859	19.6%	21.0%	28.0%	35.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	119'601'590	15.4%	9.0%	22.0%	28.0%		
Etranger (couvert)	32'783'269	4.2%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	409'994'501	52.8%		59.0%			
Total	776'183'528	100.0%		100.0%			

Total Monnaies étrangères - après couverture	110'961'620	14.3%	10.0%	15.0%	19.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	394'088'971	50.8%					
Couverture	283'127'351	36.5%					

Performances du portefeuille

2017

Rendements année sous revue	mio de CHF	janv. 17	févr. 17	YTD 2017*
Portefeuille total	776.2	0.05%	1.69%	1.74%

* jusqu'au 28.02.2017

© PPCmetrics SA

Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2012	2013	2014	2015	2016	YTD 2017*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	776.2	8.01%	6.13%	8.37%	1.71%	3.53%	1.74%	35.12%	3.34%	01.01.08

* jusqu'au 28.02.2017

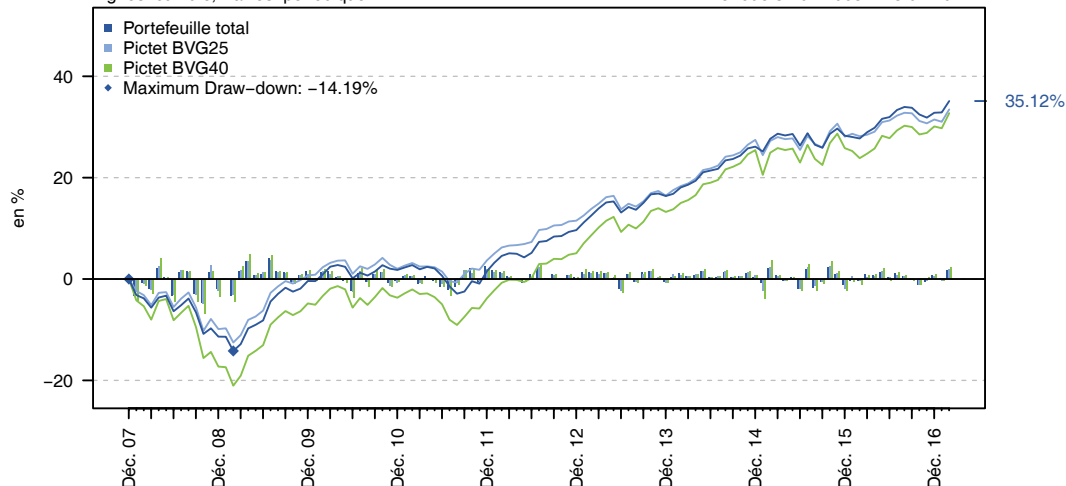
© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés

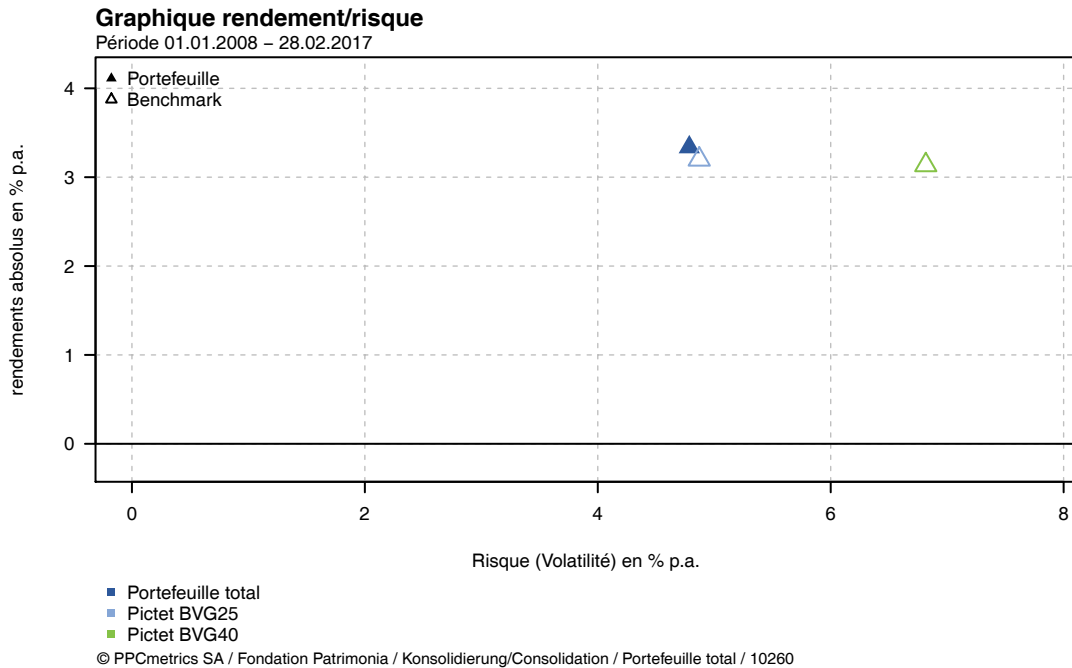
Rendements absolus sur la période

Lignes: cumulé, Barres: périodique

Période 31.01.2008 – 28.02.2017



Profil rendement / risque du portefeuille



Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2016 au 31.12.2016)

