

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 30.04.2018		Stratégie			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	8'707'822	0.9%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	147'337'037	15.8%	13.0%	16.0%	19.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	128'796'682	13.8%	11.0%	14.0%	17.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	64'247'582	6.9%	5.0%	7.0%	9.0%		
Obligations des marchés émergents (couvertes)	36'384'875	3.9%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	385'473'998	41.4%	40.0%	41.0%	60.0%		
Actions	242'281'559	26.0%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	118'578'811	12.7%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	84'104'032	9.0%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	34'474'779	3.7%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde	94'914'099	10.2%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large et Mid Cap	85'357'888	9.2%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	9'556'211	1.0%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	28'788'649	3.1%	1.0%	3.0%	5.0%		
Placements alternatifs (couverts)	55'233'261	5.9%	2.0%	6.0%	10.0%	15.0%	55 let. d)
SSL	23'676'171	2.5%	1.0%	3.0%	5.0%		
CRIP	4'000'050	0.4%					
Matières premières	27'557'040	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
Immobilier	248'304'305	26.7%	23.0%	28.0%	33.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	203'893'294	21.9%	18.0%	22.0%	26.0%		
Direct	82'920'900	8.9%					
Indirect	120'972'394	13.0%					
Etranger (couvert)	44'411'011	4.8%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	545'819'125	58.6%		59.0%			
Total	931'293'123	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	123'702'748	13.3%	10.0%	15.0%	19.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	448'776'109	48.2%					
Couverture	325'073'361	34.9%					

Performances du portefeuille

2018

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/18	avr. 18	YTD 2018*
Portefeuille total	931.3	-1.30%	0.77%	-0.54%

* jusqu'au 30.04.2018

© PPCmetrics SA

Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2013	2014	2015	2016	2017	YTD 2018*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	931.3	6.13%	8.37%	1.71%	3.54%	6.74%	-0.54%	41.01%	3.38%	01.01.08

* jusqu'au 30.04.2018

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



