

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 30.06.2020		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	9 408 563	0.6%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	216 018 231	14.4%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	160 452 885	10.7%	7.0%	10.0%	13.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	118 360 658	7.9%	6.0%	8.0%	10.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	63 191 090	4.2%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	567 431 427	37.9%	28.0%	37.0%	49.0%		
<i>Actions</i>	<i>408 569 105</i>	<i>27.3%</i>	<i>18.0%</i>	<i>25.0%</i>	<i>32.0%</i>	<i>50.0%</i>	<i>55 let. b)</i>
<i>Suisse</i>	<i>202 447 688</i>	<i>13.5%</i>	<i>9.0%</i>	<i>12.0%</i>	<i>15.0%</i>		
Large Cap	152 899 290	10.2%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	49 548 398	3.3%	2.0%	3.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	<i>159 708 950</i>	<i>10.7%</i>	<i>8.0%</i>	<i>10.0%</i>	<i>12.0%</i>		
Large & Mid Cap	143 637 041	9.6%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	16 071 909	1.1%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	46 412 467	3.1%	1.0%	3.0%	5.0%		
<i>Placements alternatifs (couverts)</i>	<i>59 852 888</i>	<i>4.0%</i>	<i>3.0%</i>	<i>7.0%</i>	<i>11.0%</i>	<i>15.0%</i>	<i>55 let. d)</i>
SSL (couverts)	59 852 888	4.0%	2.0%	4.0%	6.0%		
Infrastructure	0	0.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
<i>Immobilier</i>	<i>459 982 353</i>	<i>30.8%</i>	<i>26.0%</i>	<i>31.0%</i>	<i>36.0%</i>	<i>30.0%</i>	<i>55 let. c)</i>
Suisse	374 659 335	25.0%	21.0%	25.0%	29.0%		
<i>Direct</i>	<i>190 852 982</i>	<i>12.8%</i>					
<i>Indirect</i>	<i>181 982 244</i>	<i>12.2%</i>					
Etranger (couvert)	85 323 018	5.7%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	928 404 346	62.1%		63.0%			
Total	1 495 835 773	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	206 121 417	13.8%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	693 301 956	46.3%					
Couverture	487 180 539	32.6%					

Performances du portefeuille

2020

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/20	avr. 20	mai 20	juin 20	T2/20	YTD 2020*
<i>Portefeuille total</i>	1'495.8	-7.35%	3.30%	1.31%	1.12%	5.82%	-1.96%

* jusqu'au 30.06.2020

© PPCmetrics SA

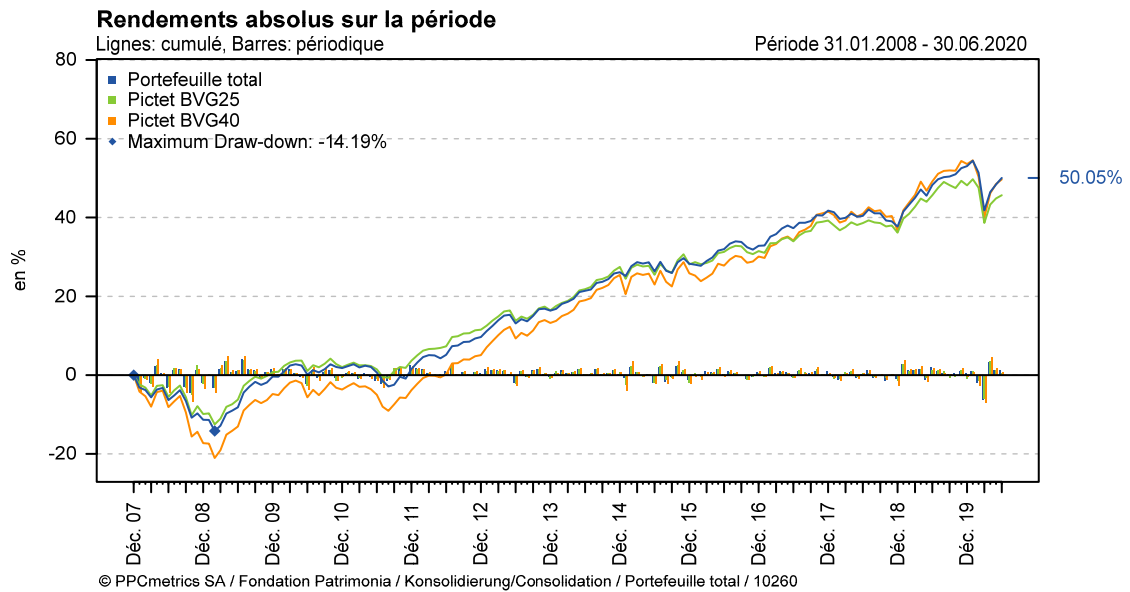
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2015	2016	2017	2018	2019	YTD 2020*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
<i>Portefeuille total</i>	1'495.8	1.71%	3.54%	6.74%	-2.88%	11.15%	-1.96%	50.05%	3.30%	01.01.08

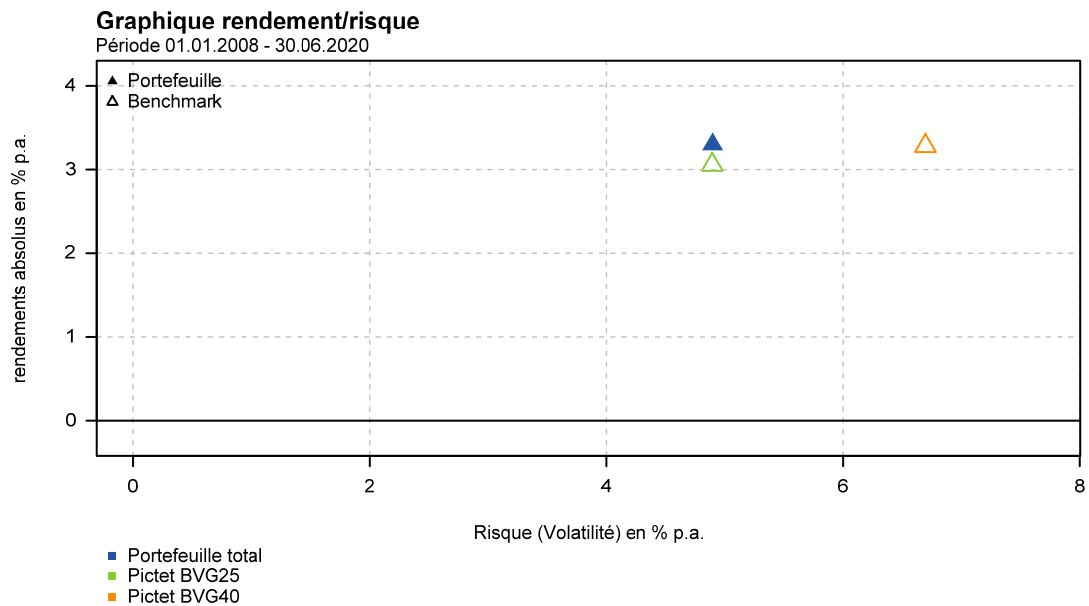
* jusqu'au 30.06.2020

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille



Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2020 au 31.03.2020)

