

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.08.2021		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	13 846 555	0.6%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	342 298 415	15.2%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	227 359 205	10.1%	7.0%	10.0%	13.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	182 911 075	8.1%	6.0%	8.0%	10.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	91 139 535	4.1%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	857 554 785	38.1%	28.0%	37.0%	49.0%		
<i>Actions</i>	<i>577 419 843</i>	<i>25.7%</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>286 348 970</i>	<i>12.7%</i>	<i>9.0%</i>	<i>12.0%</i>	<i>15.0%</i>		
Large Cap	215 993 179	9.6%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	70 355 791	3.1%	2.0%	3.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	<i>230 640 613</i>	<i>10.3%</i>	<i>8.0%</i>	<i>10.0%</i>	<i>12.0%</i>		
Large & Mid Cap	206 465 825	9.2%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	24 174 788	1.1%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	60 430 260	2.7%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	88 447 290	3.9%	2.0%	4.0%	6.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	2 462 470	1.8%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	38 025 578					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	<i>684 164 257</i>	<i>30.4%</i>	<i>26.0%</i>	<i>31.0%</i>	<i>36.0%</i>		
Suisse	536 605 142	23.9%	21.0%	25.0%	29.0%		
<i>Direct</i>	<i>240 439 030</i>	<i>10.7%</i>					
<i>Indirect</i>	<i>296 166 112</i>	<i>13.2%</i>					
Etranger (couvert)	147 559 115	6.6%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 390 519 438	61.9%		63.0%			
Total	2 248 074 223	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	331 558 921	14.7%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 068 975 141	47.6%					
Couverture	737 416 220	32.8%					

Performances du portefeuille

2021

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/21	T2/21	juil. 21	août 21	YTD 2021*
Portefeuille total	2'248.1	1.78%	3.36%	0.46%	0.67%	6.40%

* jusqu'au 31.08.2021

© PPCmetrics SA

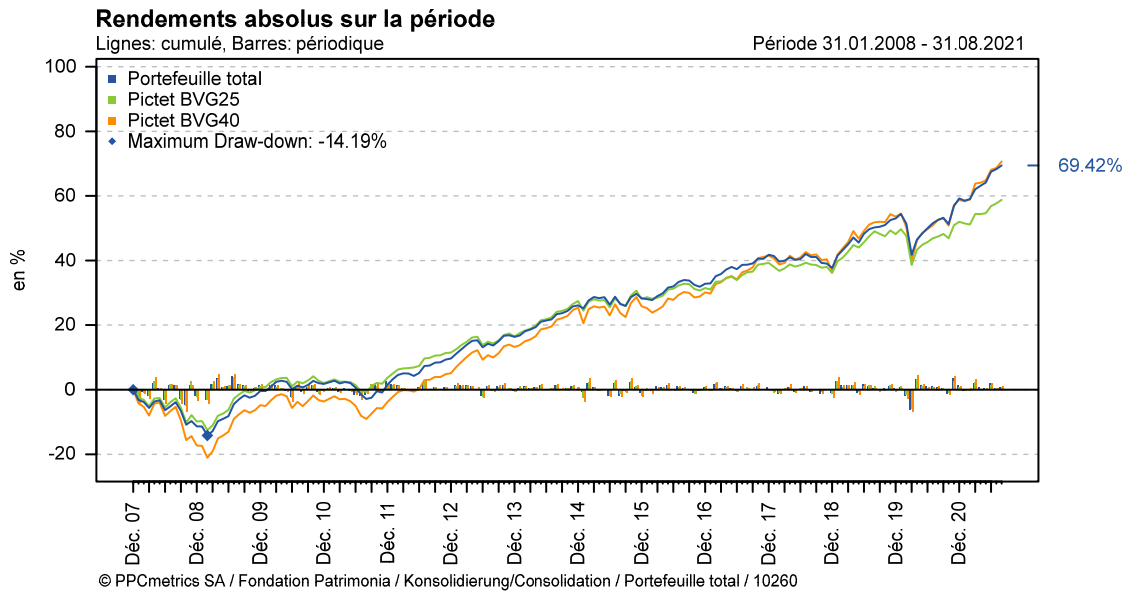
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2016	2017	2018	2019	2020	YTD 2021*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'248.1	3.54%	6.74%	-2.88%	11.15%	4.04%	6.40%	69.42%	3.93%	01.01.08

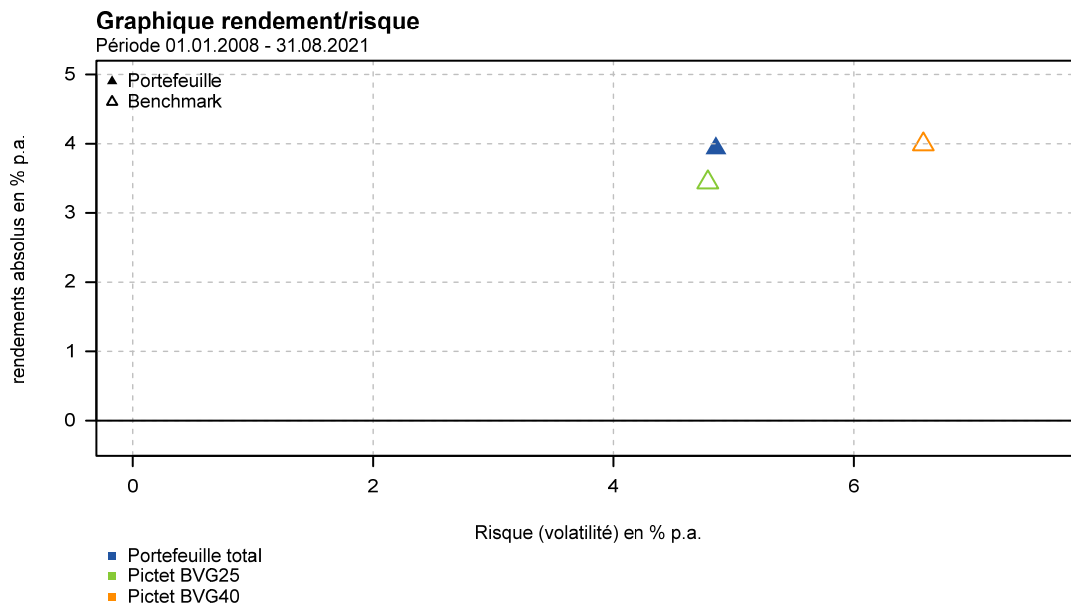
* jusqu'au 31.08.2021

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille



Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2021 au 30.06.2021)

Peer Group public - Investisseurs institutionnels

Peer Group: données publiques (50)

