

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 30.04.2021		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	40 048 793	1.9%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	316 036 946	14.8%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	209 033 858	9.8%	7.0%	10.0%	13.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	170 187 819	8.0%	6.0%	8.0%	10.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	88 933 525	4.2%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	824 240 941	38.6%	28.0%	37.0%	49.0%		
<i>Actions</i>	<i>527 672 753</i>	<i>24.7%</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>252 006 424</i>	<i>11.8%</i>	<i>9.0%</i>	<i>12.0%</i>	<i>15.0%</i>		
Large Cap	188 045 074	8.8%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	63 961 350	3.0%	2.0%	3.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	<i>211 949 699</i>	<i>9.9%</i>	<i>8.0%</i>	<i>10.0%</i>	<i>12.0%</i>		
Large & Mid Cap	188 509 749	8.8%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	23 439 950	1.1%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	63 716 630	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	82 294 148	3.9%	2.0%	4.0%	6.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	1 624 071	1.4%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	28 651 053					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	<i>671 657 119</i>	<i>31.4%</i>	<i>26.0%</i>	<i>31.0%</i>	<i>36.0%</i>		
Suisse	532 285 580	24.9%	21.0%	25.0%	29.0%		
<i>Direct</i>	<i>238 100 041</i>	<i>11.1%</i>					
<i>Indirect</i>	<i>294 185 539</i>	<i>13.8%</i>					
Etranger (couvert)	139 371 539	6.5%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 311 899 144	61.4%		63.0%			
Total	2 136 140 085	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	275 666 329	12.9%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	965 487 218	45.2%					
Couverture	689 820 889	32.3%					

Performances du portefeuille

2021

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/21	avr. 21	YTD 2021*
Portefeuille total	2'136.1	1.78%	0.63%	2.43%

* jusqu'au 30.04.2021

© PPCmetrics SA

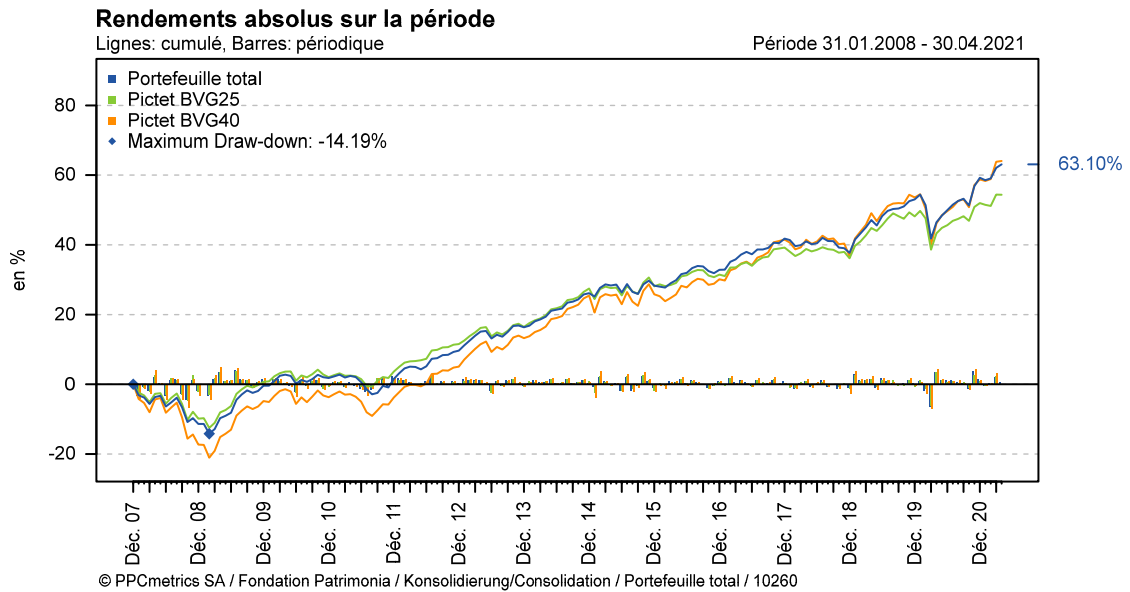
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2016	2017	2018	2019	2020	YTD 2021*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'136.1	3.54%	6.74%	-2.88%	11.15%	4.04%	2.43%	63.10%	3.74%	01.01.08

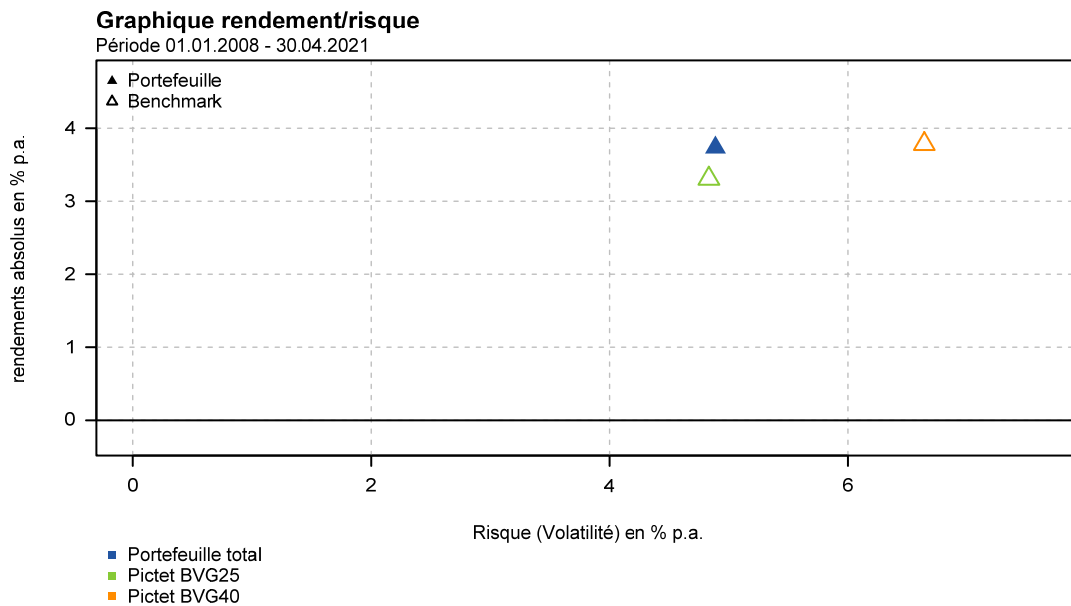
* jusqu'au 30.04.2021

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille



Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2020 au 31.12.2020)

