

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.01.2021		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	15 901 607	0.8%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	282 137 056	15.0%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	188 577 386	10.0%	7.0%	10.0%	13.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	150 977 630	8.0%	6.0%	8.0%	10.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	76 436 911	4.1%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	714 030 590	37.9%	28.0%	37.0%	49.0%		
<i>Actions</i>	<i>473 269 102</i>	<i>25.1%</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>226 603 135</i>	<i>12.0%</i>	<i>9.0%</i>	<i>12.0%</i>	<i>15.0%</i>		
Large Cap	168 035 727	8.9%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	58 567 408	3.1%	2.0%	3.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	<i>187 883 905</i>	<i>10.0%</i>	<i>8.0%</i>	<i>10.0%</i>	<i>12.0%</i>		
Large & Mid Cap	167 302 836	8.9%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	20 581 069	1.1%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	58 782 062	3.1%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	77 523 056	4.1%	2.0%	4.0%	6.0%	<i>15.0%</i>	<i>55 let. d)</i>
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	847 750	1.5%	1.0%	3.0%	5.0%		
Infrastructure (sans effet de levier)	27 778 832						
<i>Immobilier</i>	<i>590 104 326</i>	<i>31.3%</i>	<i>26.0%</i>	<i>31.0%</i>	<i>36.0%</i>	<i>30.0%</i>	<i>55 let. c)</i>
Suisse	468 903 275	24.9%	21.0%	25.0%	29.0%		
<i>Direct</i>	<i>204 881 063</i>	<i>10.9%</i>					
<i>Indirect</i>	<i>264 022 212</i>	<i>14.0%</i>					
Etranger (couvert)	121 201 051	6.4%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 169 523 066	62.1%		63.0%			
Total	1 883 553 656	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	246 665 967	13.1%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	<i>55 let. e)</i>
Total Monnaies étrangères - avant couverture	861 382 001	45.7%					
Couverture	614 716 034	32.6%					

Performances du portefeuille

2021

Rendements année sous revue	mio de CHF	janv. 21	YTD 2021*
Portefeuille total	1'883.6	-0.43%	-0.43%

* jusqu'au 31.01.2021

© PPCmetrics SA

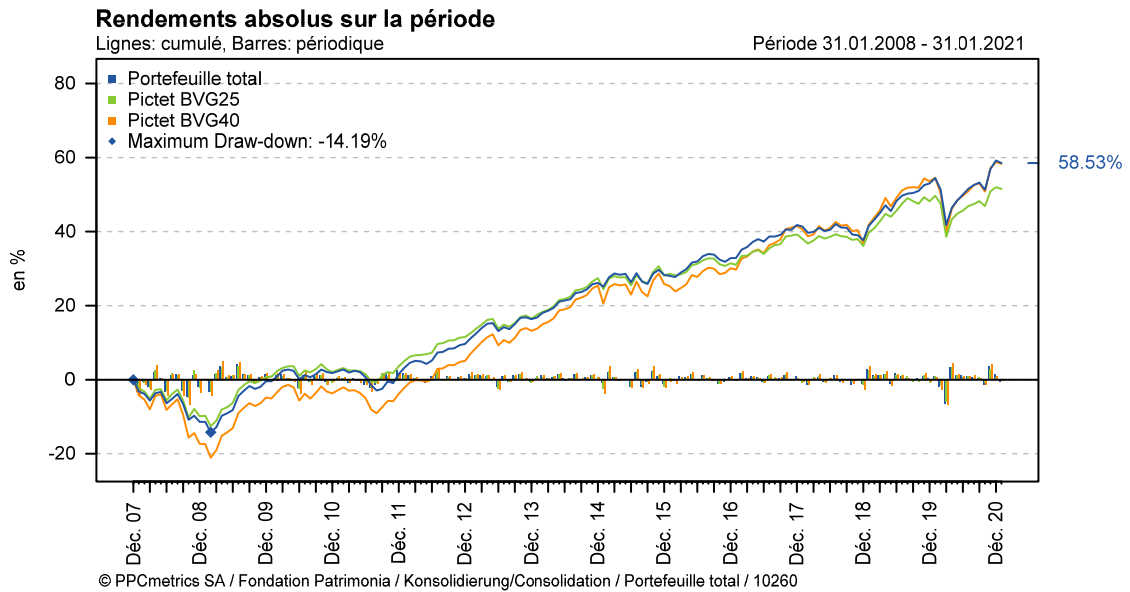
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2016	2017	2018	2019	2020	YTD 2021*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	1'883.6	3.54%	6.74%	-2.88%	11.15%	4.03%	-0.43%	58.53%	3.58%	01.01.08

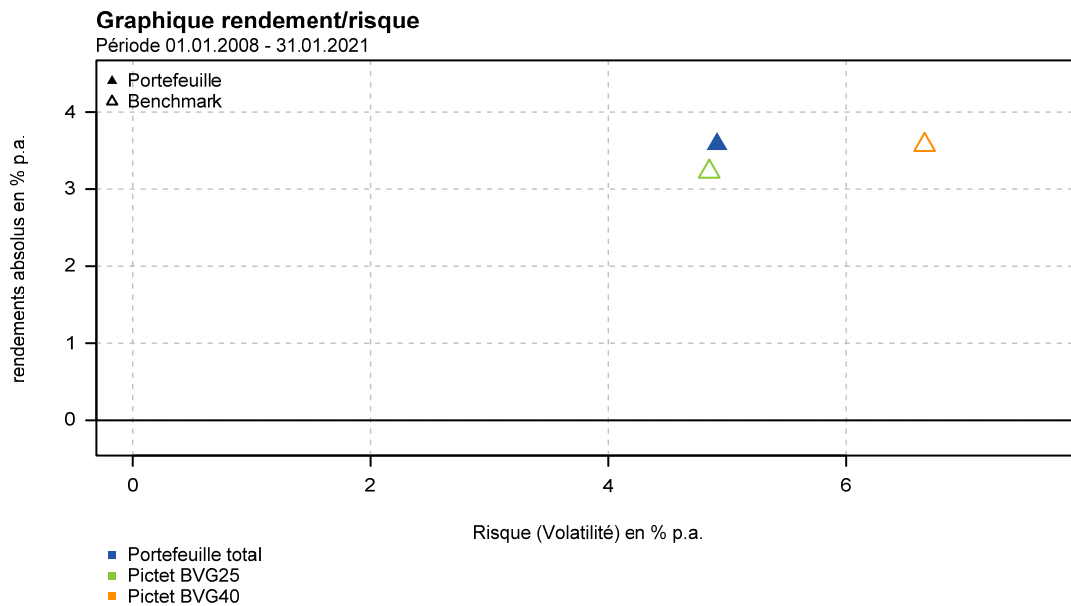
* jusqu'au 31.01.2021

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille



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

