

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.07.2021		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	12 806 053	0.6%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	343 135 537	15.4%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	228 267 517	10.2%	7.0%	10.0%	13.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	183 571 413	8.2%	6.0%	8.0%	10.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	90 002 176	4.0%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	857 782 696	38.4%	28.0%	37.0%	49.0%		
<i>Actions</i>	<i>561 788 070</i>	<i>25.2%</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>280 299 276</i>	<i>12.6%</i>	<i>9.0%</i>	<i>12.0%</i>	<i>15.0%</i>		
Large Cap	211 041 378	9.4%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	69 257 898	3.1%	2.0%	3.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	<i>222 335 776</i>	<i>10.0%</i>	<i>8.0%</i>	<i>10.0%</i>	<i>12.0%</i>		
Large & Mid Cap	198 977 316	8.9%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	23 358 460	1.0%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	59 153 018	2.6%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	88 092 196	3.9%	2.0%	4.0%	6.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	2 416 885	1.8%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	38 614 186					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	<i>684 646 919</i>	<i>30.7%</i>	<i>26.0%</i>	<i>31.0%</i>	<i>36.0%</i>		
Suisse	538 348 485	24.1%	21.0%	25.0%	29.0%		
<i>Direct</i>	<i>225 206 631</i>	<i>10.1%</i>					
<i>Indirect</i>	<i>313 141 854</i>	<i>14.0%</i>					
Etranger (couvert)	146 298 434	6.6%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 375 558 256	61.6%		63.0%			
Total	2 233 340 952	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	322 519 865	14.4%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 058 751 601	47.4%					
Couverture	736 231 736	33.0%					

Performances du portefeuille

2021

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/21	T2/21	juil. 21	YTD 2021*
Portefeuille total	2'233.3	1.83%	3.35%	0.46%	5.73%

* jusqu'au 31.07.2021

© PPCmetrics SA

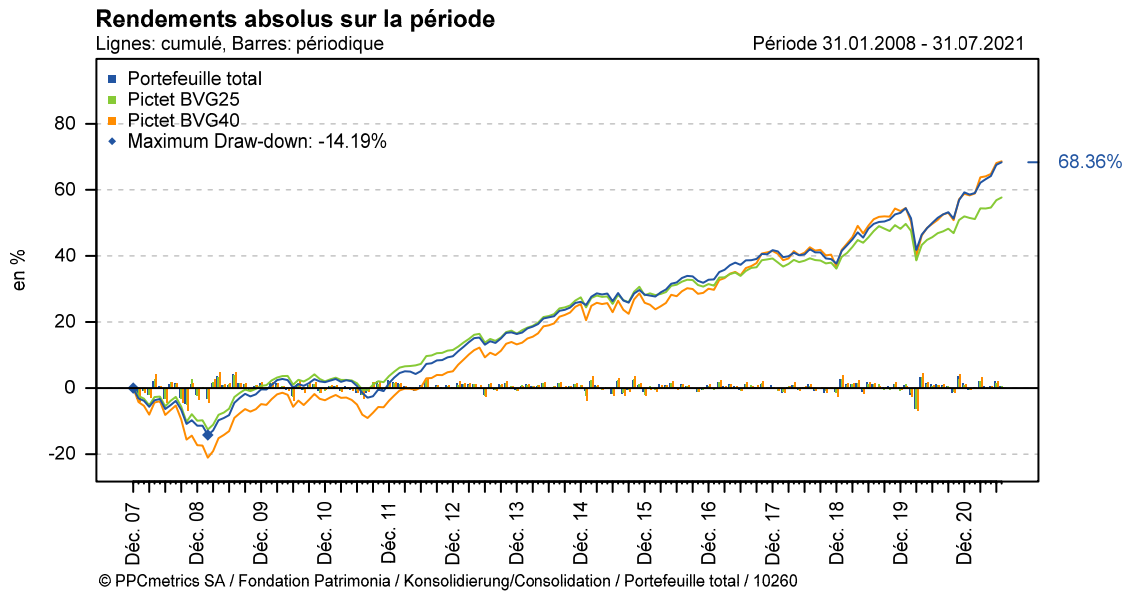
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2016	2017	2018	2019	2020	YTD 2021*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'233.3	3.54%	6.74%	-2.88%	11.15%	4.04%	5.73%	68.36%	3.91%	01.01.08

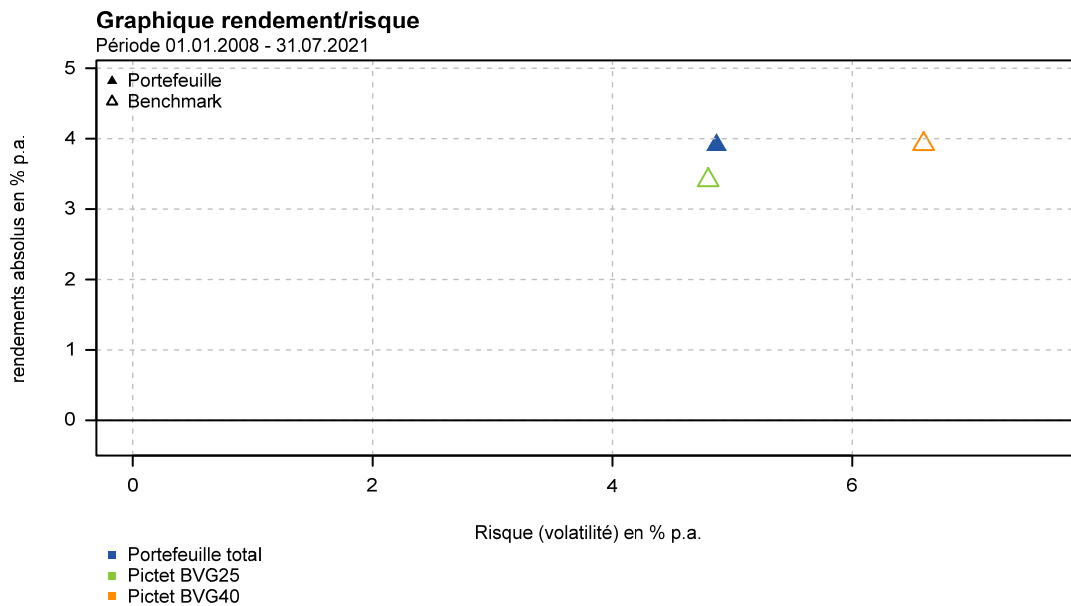
* jusqu'au 31.07.2021

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille



Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2021 au 31.03.2021)

