

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 30.06.2021		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	45 405 328	2.1%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	322 442 270	14.6%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	216 155 129	9.8%	7.0%	10.0%	13.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	172 498 731	7.8%	6.0%	8.0%	10.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	89 813 176	4.1%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	846 314 634	38.2%	28.0%	37.0%	49.0%		
<i>Actions</i>	<i>565 380 561</i>	<i>25.5%</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>276 608 658</i>	<i>12.5%</i>	<i>9.0%</i>	<i>12.0%</i>	<i>15.0%</i>		
Large Cap	208 257 111	9.4%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	68 351 547	3.1%	2.0%	3.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	<i>223 551 882</i>	<i>10.1%</i>	<i>8.0%</i>	<i>10.0%</i>	<i>12.0%</i>		
Large & Mid Cap	199 528 564	9.0%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	24 023 318	1.1%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	65 220 021	2.9%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	83 230 707	3.8%	2.0%	4.0%	6.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	2 453 425	1.5%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	29 770 771					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	<i>686 327 962</i>	<i>31.0%</i>	<i>26.0%</i>	<i>31.0%</i>	<i>36.0%</i>		
Suisse	544 208 887	24.6%	21.0%	25.0%	29.0%		
<i>Direct</i>	<i>238 100 041</i>	<i>10.8%</i>					
<i>Indirect</i>	<i>306 108 846</i>	<i>13.8%</i>					
Etranger (couvert)	142 119 075	6.4%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 367 163 426	61.8%		63.0%			
Total	2 213 478 060	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	288 771 903	13.0%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	992 588 721	44.8%					
Couverture	703 816 818	31.8%					

Performances du portefeuille

2021

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/21	avr. 21	mai 21	juin 21	T2/21	YTD 2021*
Portefeuille total	2'213.5	1.83%	0.65%	0.61%	1.97%	3.26%	5.15%

* jusqu'au 30.06.2021

© PPCmetrics SA

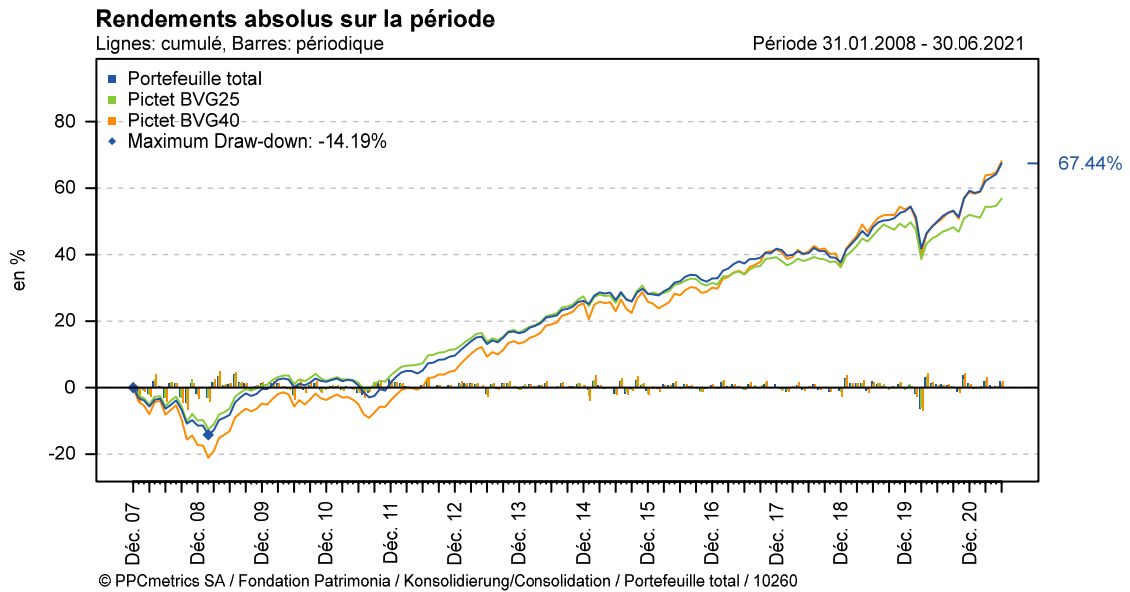
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2016	2017	2018	2019	2020	YTD 2021*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'213.5	3.54%	6.74%	-2.88%	11.15%	4.04%	5.15%	67.44%	3.89%	01.01.08

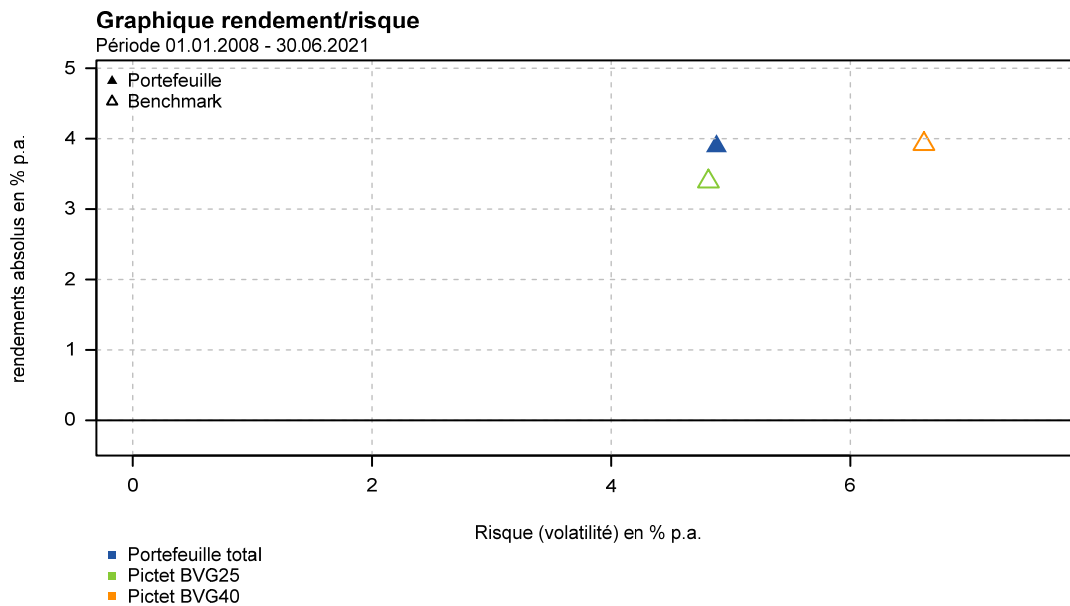
* jusqu'au 30.06.2021

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille



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

