

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.05.2021		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	9 667 125	0.5%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	321 270 317	15.0%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	215 105 044	10.1%	7.0%	10.0%	13.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	170 447 204	8.0%	6.0%	8.0%	10.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	89 182 272	4.2%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	805 671 962	37.7%	28.0%	37.0%	49.0%		
<i>Actions</i>	<i>544 428 297</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>265 132 426</i>	<i>12.4%</i>	<i>9.0%</i>	<i>12.0%</i>	<i>15.0%</i>		
Large Cap	198 175 973	9.3%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	66 956 453	3.1%	2.0%	3.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	<i>214 812 764</i>	<i>10.1%</i>	<i>8.0%</i>	<i>10.0%</i>	<i>12.0%</i>		
Large & Mid Cap	191 491 077	9.0%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	23 321 687	1.1%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	64 483 107	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	82 868 388	3.9%	2.0%	4.0%	6.0%	<i>15.0%</i>	<i>55 let. d)</i>
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	2 400 409	1.4%	1.0%	3.0%	5.0%	<i>10.0%</i>	<i>55 let. f)</i>
Infrastructure (sans effet de levier)	28 477 132					<i>30.0%</i>	<i>55 let. c)</i>
<i>Immobilier</i>	<i>670 979 380</i>	<i>31.4%</i>	<i>26.0%</i>	<i>31.0%</i>	<i>36.0%</i>		
Suisse	530 205 239	24.8%	21.0%	25.0%	29.0%		
<i>Direct</i>	<i>238 100 041</i>	<i>11.2%</i>					
<i>Indirect</i>	<i>292 105 198</i>	<i>13.7%</i>					
Etranger (couvert)	140 774 141	6.6%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 329 153 606	62.3%		63.0%			
Total	2 134 825 568	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	279 295 871	13.1%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	<i>55 let. e)</i>
Total Monnaies étrangères - avant couverture	977 672 920	45.8%					
Couverture	698 377 049	32.7%					

Performances du portefeuille

2021

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/21	avr. 21	mai 21	YTD 2021*
Portefeuille total	2'134.8	1.78%	0.66%	0.61%	3.08%

* jusqu'au 31.05.2021

© PPCmetrics SA

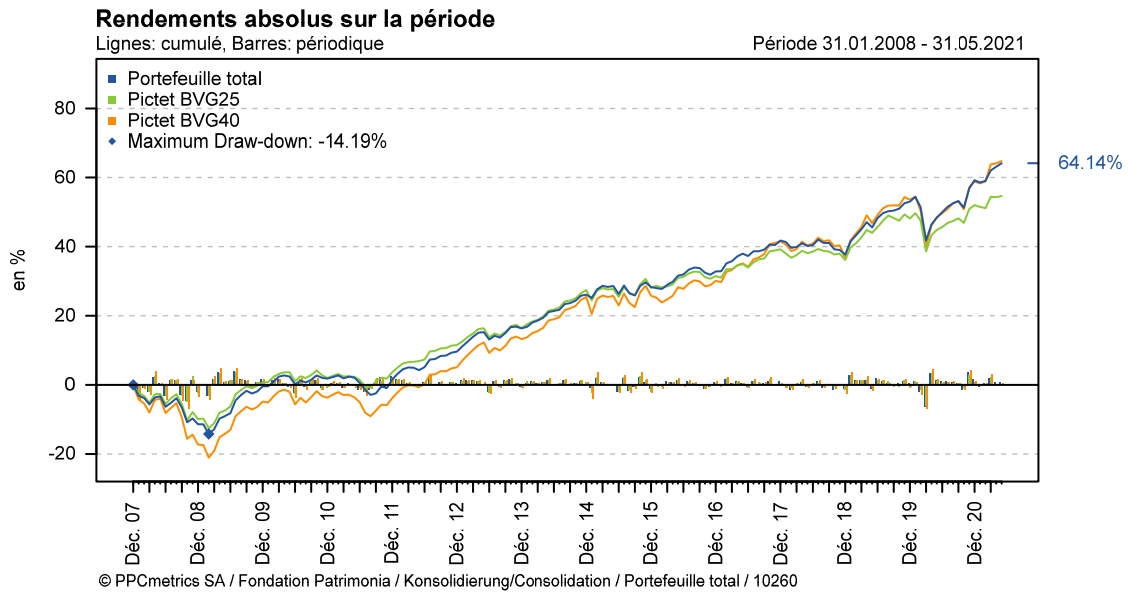
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2016	2017	2018	2019	2020	YTD 2021*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'134.8	3.54%	6.74%	-2.88%	11.15%	4.04%	3.08%	64.14%	3.76%	01.01.08

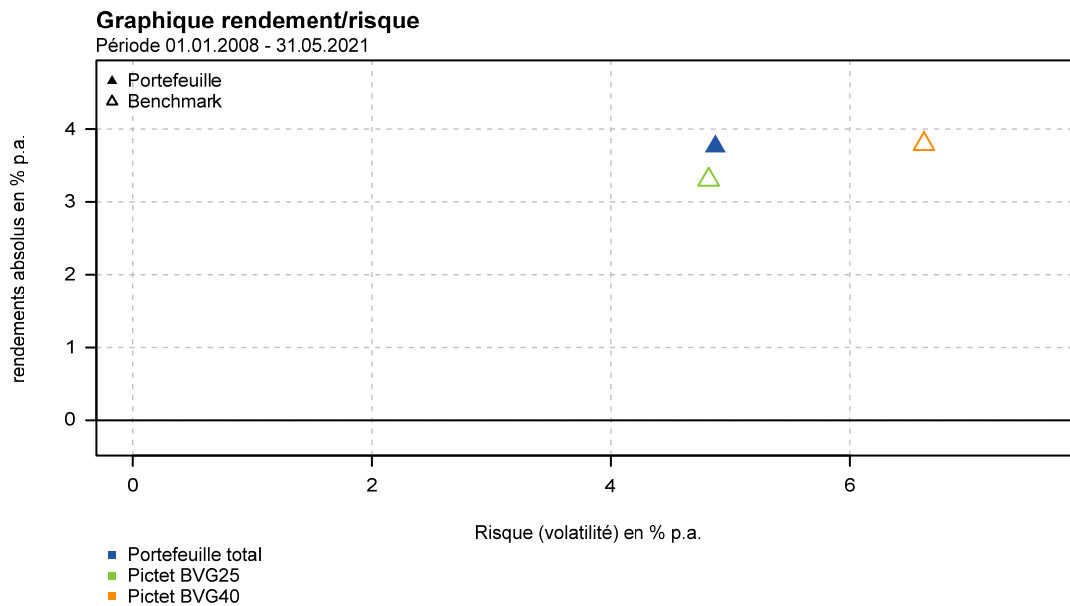
* jusqu'au 31.05.2021

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille



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

