

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 28.02.2022		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	28 955 850	1.2%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	372 021 887	15.1%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	225 372 395	9.1%	6.0%	9.0%	12.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	144 933 361	5.9%	4.0%	6.0%	8.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	94 346 884	3.8%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	865 630 377	35.1%	25.0%	34.0%	46.0%		
<i>Actions</i>	691 006 451	28.0%	17.0%	28.0%	39.0%	50.0%	55 let. b)
<i>Suisse</i>	243 267 922	9.9%	6.0%	10.0%	14.0%		
Large Cap	194 639 116	7.9%	6.0%	8.0%	10.0%		
Small & Mid Cap	48 628 806	2.0%	0.0%	2.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	375 420 015	15.2%	10.0%	15.0%	20.0%		
Large & Mid Cap	208 252 424	8.4%	6.0%	8.0%	10.0%		
Large & Mid Cap (hedged)	117 385 026	4.8%	3.0%	5.0%	7.0%		
Small Cap	49 782 565	2.0%	1.0%	2.0%	3.0%		
Marchés émergents	72 318 514	2.9%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	79 173 740	3.2%	1.0%	3.0%	5.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	5 146 471	2.5%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	55 368 812					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	771 478 757	31.3%	22.0%	32.0%	42.0%		
<i>Suisse</i>	633 047 385	25.7%	19.0%	27.0%	35.0%		
Direct	262 116 262	10.6%	10.0%	12.0%	14.0%		
Indirect non coté	113 294 675	4.6%	2.0%	4.0%	6.0%		
Indirect coté	257 636 448	10.4%	7.0%	11.0%	15.0%		
Etranger (couvert)	138 431 372	5.6%	3.0%	5.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 602 174 231	64.9%		66.0%			
Total	2 467 804 608	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	390 868 786	15.8%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 190 511 564	48.2%					
Couverture	799 642 778	32.4%					

Performances du portefeuille

2022

Rendements année sous revue	CHF mio.	janv. 22	févr. 22	YTD 2022*
Portefeuille total	2'467.8	-2.07%	-2.08%	-4.11%

* jusqu'au 28.02.2022

© PPCmetrics SA

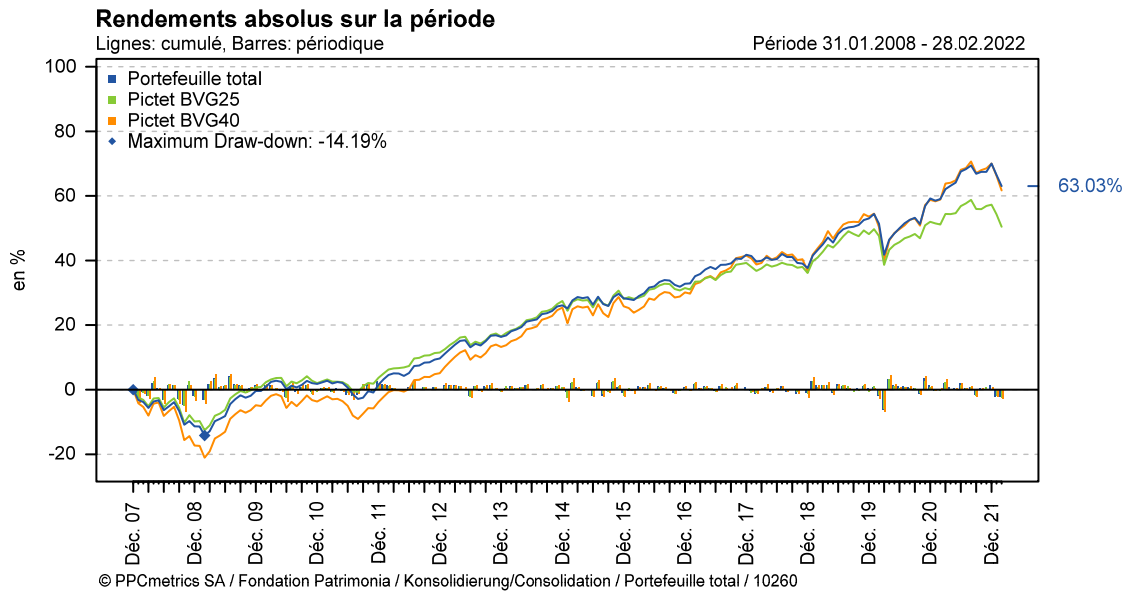
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2017	2018	2019	2020	2021	YTD 2022*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'467.8	6.74%	-2.88%	11.15%	4.04%	6.78%	-4.11%	63.03%	3.51%	01.01.08

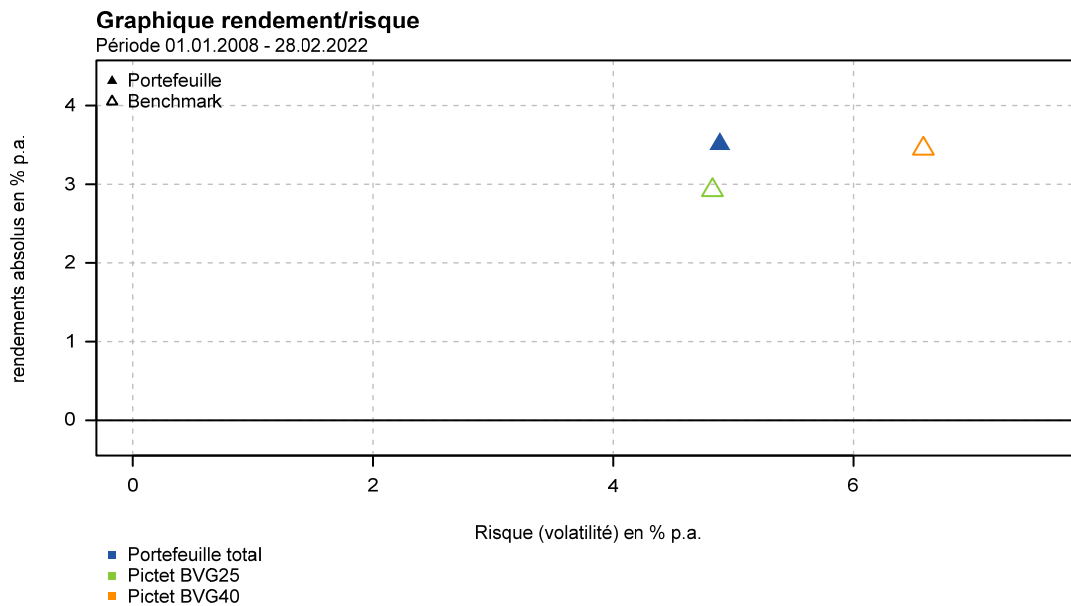
* jusqu'au 28.02.2022

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille



Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2021 au 31.12.2021)

Peer Group public - Investisseurs institutionnels

Peer Group: données publiques (54)

