

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.12.2021		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	31 127 713	1.3%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	366 754 894	14.9%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	218 982 770	8.9%	6.0%	9.0%	12.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	149 641 564	6.1%	4.0%	6.0%	8.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	101 299 753	4.1%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	867 806 694	35.3%	25.0%	34.0%	46.0%		
<i>Actions</i>	711 165 044	28.9%	17.0%	28.0%	39.0%	50.0%	55 let. b)
<i>Suisse</i>	249 366 054	10.1%	6.0%	10.0%	14.0%		
Large Cap	198 096 673	8.1%	6.0%	8.0%	10.0%		
Small & Mid Cap	51 269 381	2.1%	0.0%	2.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	387 405 483	15.8%	10.0%	15.0%	20.0%		
Large & Mid Cap	216 303 093	8.8%	6.0%	8.0%	10.0%		
Large & Mid Cap (hedged)	120 730 311	4.9%	3.0%	5.0%	7.0%		
Small Cap	50 372 079	2.0%	1.0%	2.0%	3.0%		
Marchés émergents	74 393 507	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	79 643 862	3.2%	1.0%	3.0%	5.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	5 159 841	2.4%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	54 364 196					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	740 676 976	30.1%	22.0%	32.0%	42.0%		
<i>Suisse</i>	600 183 689	24.4%	19.0%	27.0%	35.0%		
Direct	262 116 262	10.7%	10.0%	12.0%	14.0%		
Indirect non coté	113 162 318	4.6%	2.0%	4.0%	6.0%		
Indirect coté	224 905 109	9.1%	7.0%	11.0%	15.0%		
Etranger (couvert)	140 493 287	5.7%	3.0%	5.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 591 009 919	64.7%		66.0%			
Total	2 458 816 613	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	400 592 716	16.3%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 211 384 263	49.3%					
Couverture	810 791 547	33.0%					

Performances du portefeuille

2022

Rendements année sous revue	CHF mio.	janv. 22	YTD 2022*
Portefeuille total	2'458.8	-2.07%	-2.07%

* jusqu'au 31.01.2022

© PPCmetrics SA

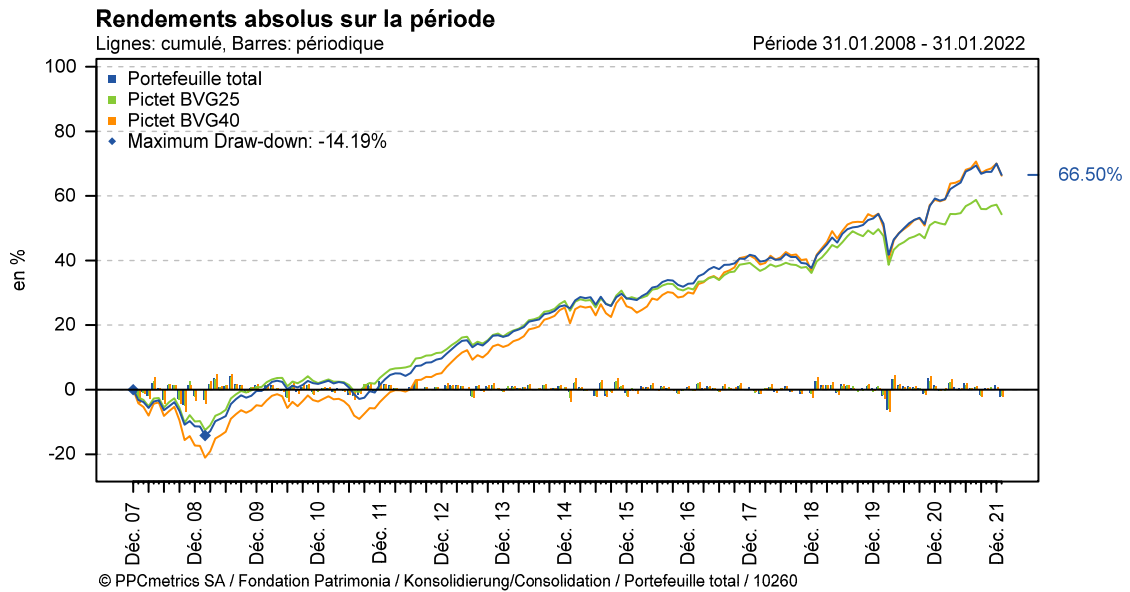
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF	2017	2018	2019	2020	2021	YTD 2022*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'458.8	6.74%	-2.88%	11.15%	4.04%	6.78%	-2.07%	66.50%	3.69%	01.01.08

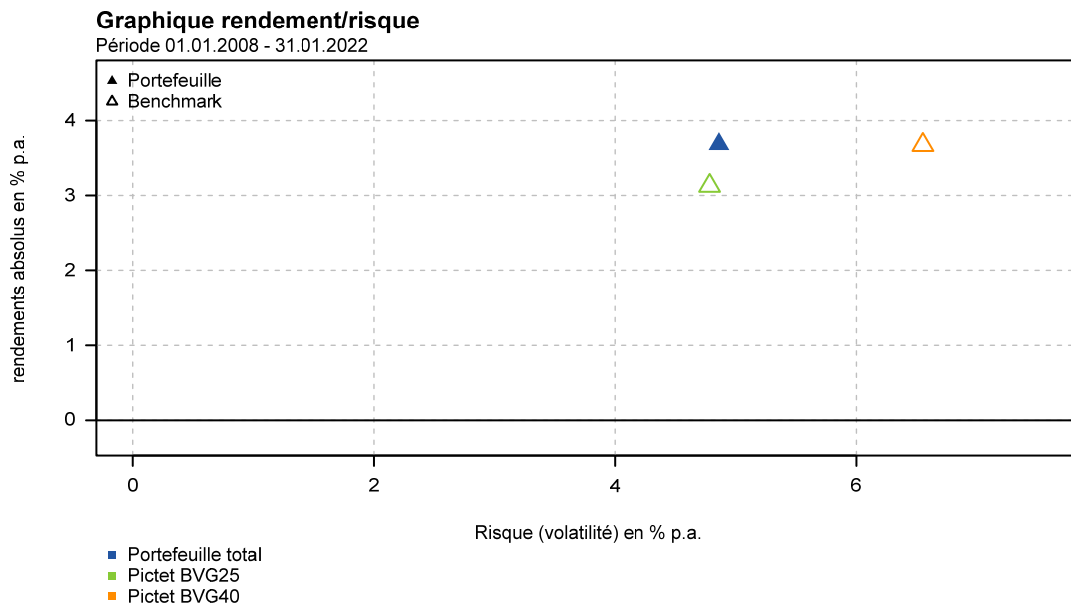
* jusqu'au 31.01.2022

© 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)

