

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.10.2022		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	17 835 714	0.8%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	353 225 782	15.0%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	202 863 589	8.6%	6.0%	9.0%	12.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	136 065 524	5.8%	4.0%	6.0%	8.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	87 155 882	3.7%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	797 146 491	33.8%	25.0%	34.0%	46.0%		
<i>Actions</i>	640 330 930	27.2%	17.0%	28.0%	39.0%	50.0%	55 let. b)
<i>Suisse</i>	226 368 888	9.6%	6.0%	10.0%	14.0%		
Large Cap	186 781 593	7.9%	6.0%	8.0%	10.0%		
Small & Mid Cap	39 587 295	1.7%	0.0%	2.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	352 608 416	15.0%	10.0%	15.0%	20.0%		
Large & Mid Cap	187 069 454	7.9%	6.0%	8.0%	10.0%		
Large & Mid Cap (hedged)	118 872 043	5.0%	3.0%	5.0%	7.0%		
Small Cap	46 666 919	2.0%	1.0%	2.0%	3.0%		
Marchés émergents	61 363 626	2.6%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	73 680 394	3.1%	1.0%	3.0%	5.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	7 576 017	3.4%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	73 455 746					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	765 886 022	32.5%	22.0%	32.0%	42.0%		
<i>Suisse</i>	630 639 724	26.7%	19.0%	27.0%	35.0%		
Direct	269 086 264	11.4%	10.0%	12.0%	14.0%		
Indirect non coté	129 189 534	5.5%	2.0%	4.0%	6.0%		
Indirect coté	232 363 926	9.9%	7.0%	11.0%	15.0%		
Etranger (couvert)	135 246 298	5.7%	3.0%	5.0%	7.0%		
Valeurs réelles	1 560 929 109	66.2%		66.0%			
Total	2 358 075 600	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	376 121 762	16.0%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 130 005 492	47.9%					
Couverture	753 883 730	32.0%					

Performances du portefeuille

2022

Rendements année sous revue	CHF mio.	T1/22	T2/22	T3/22	oct. 22	YTD 2022*
Portefeuille total	2'348.0	-4.09%	-7.12%	-2.65%	1.57%	-11.92%

* jusqu'au 31.10.2022

© PPCmetrics SA

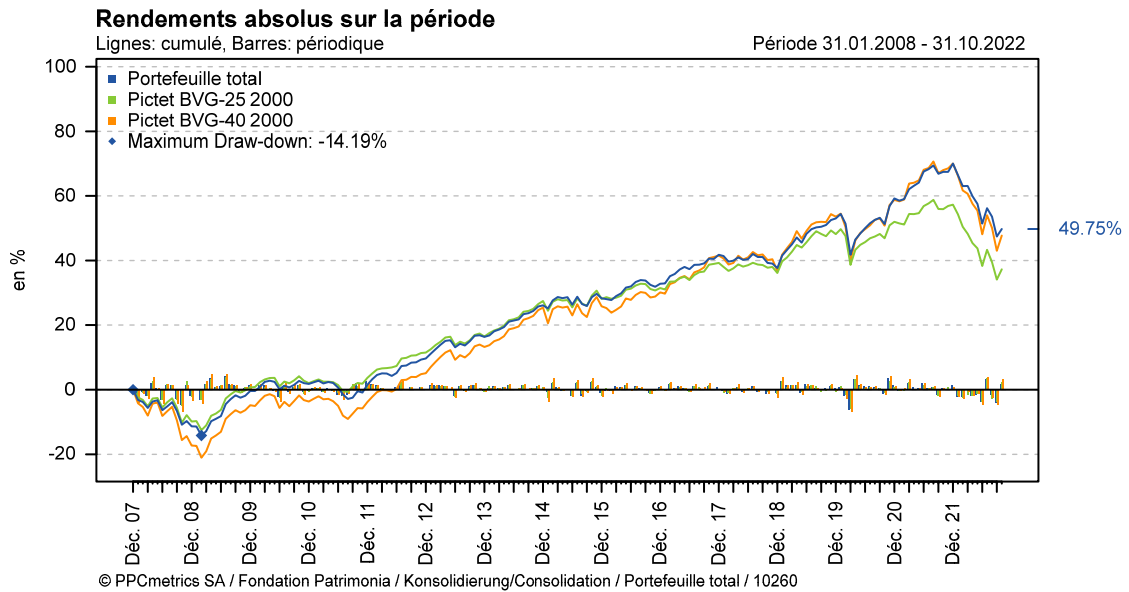
Depuis le début de la mesure de performance

	CHF mio.	2017	2018	2019	2020	2021	YTD 2022*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	2'348.0	6.74%	-2.88%	11.15%	4.04%	6.78%	-11.92%	49.75%	2.76%	01.01.08

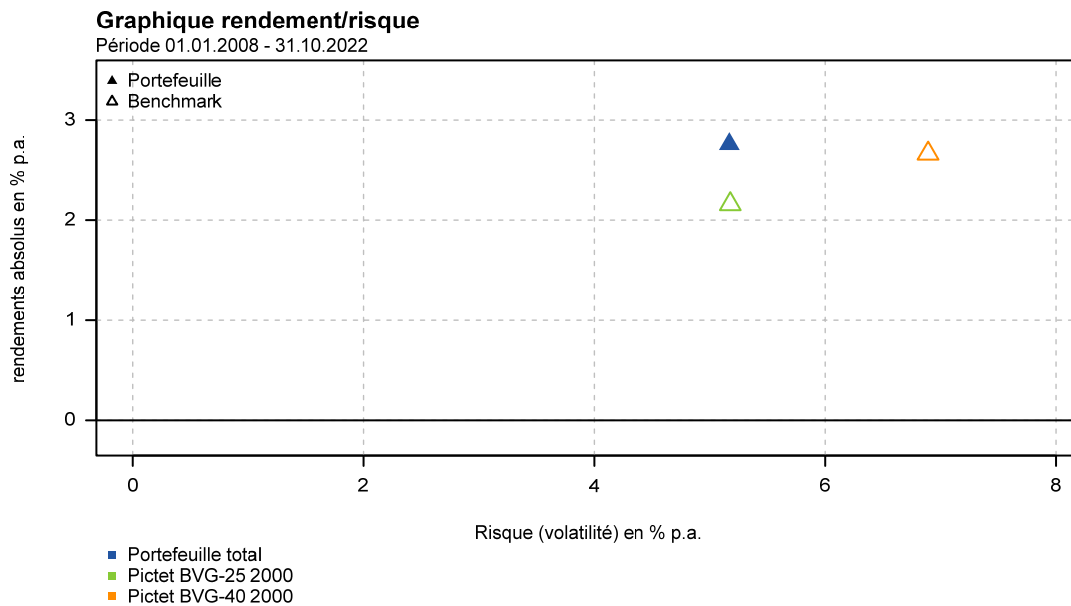
* jusqu'au 31.10.2022

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille



Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2022 au 30.09.2022)

Peer Group public - Investisseurs institutionnels

Peer Group: données publiques (42)
Période: 01.01.2022 - 30.09.2022

