

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.05.2024		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	16 495 906	0.5%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	477 764 950	14.9%	12.0%	15.0%	18.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	284 416 930	8.9%	6.0%	9.0%	12.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	188 646 165	5.9%	4.0%	6.0%	8.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	115 813 261	3.6%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	1 083 137 212	33.8%	25.0%	34.0%	46.0%		
<i>Actions</i>	902 733 145	28.1%	17.0%	28.0%	39.0%	50.0%	55 let. b)
<i>Suisse</i>	324 749 135	10.1%	6.0%	10.0%	14.0%		
Large Cap	262 450 000	8.2%	6.0%	8.0%	10.0%		
Small & Mid Cap	62 299 135	1.9%	0.0%	2.0%	4.0%		
<i>Monde DM</i>	481 450 377	15.0%	10.0%	15.0%	20.0%		
Large & Mid Cap	256 805 958	8.0%	6.0%	8.0%	10.0%		
Large & Mid Cap (hedged)	159 119 919	5.0%	3.0%	5.0%	7.0%		
Small Cap	65 524 500	2.0%	1.0%	2.0%	3.0%		
Marchés émergents	96 533 633	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
SSL (couverts) (alternatif)	101 483 327	3.2%	1.0%	3.0%	5.0%	15.0%	55 let. d)
Infrastructure (avec effet de levier) (alternatif)	12 627 864	4.1%	1.0%	3.0%	5.0%	10.0%	55 let. f)
Infrastructure (sans effet de levier)	117 438 781					30.0%	55 let. c)
<i>Immobilier</i>	990 529 551	30.9%	20.0%	32.0%	44.0%		
<i>Suisse</i>	833 739 726	26.0%	17.0%	27.0%	37.0%		
Direct	451 558 588	14.1%	12.0%	14.0%	18.0%		
Indirect non coté	137 071 028	4.3%	2.0%	4.0%	6.0%		
Indirect coté	245 110 110	7.6%	3.0%	9.0%	13.0%		
Etranger (couvert)	156 789 825	4.9%	3.0%	5.0%	7.0%		
Valeurs réelles	2 124 812 668	66.2%		66.0%			
Total	3 207 949 880	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	548 930 736	17.1%	10.0%	16.0%	22.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	1 555 200 163	48.5%					
Couverture	1 006 269 427	31.4%					

Performances du portefeuille

2024

Rendements année sous revue	CHF mio.	T1/24	avr. 24	mai 24	YTD 2024*
Portefeuille total	3'207.9	3.66%	-1.24%	1.05%	3.44%

* jusqu'au 31.05.2024

© PPCmetrics SA

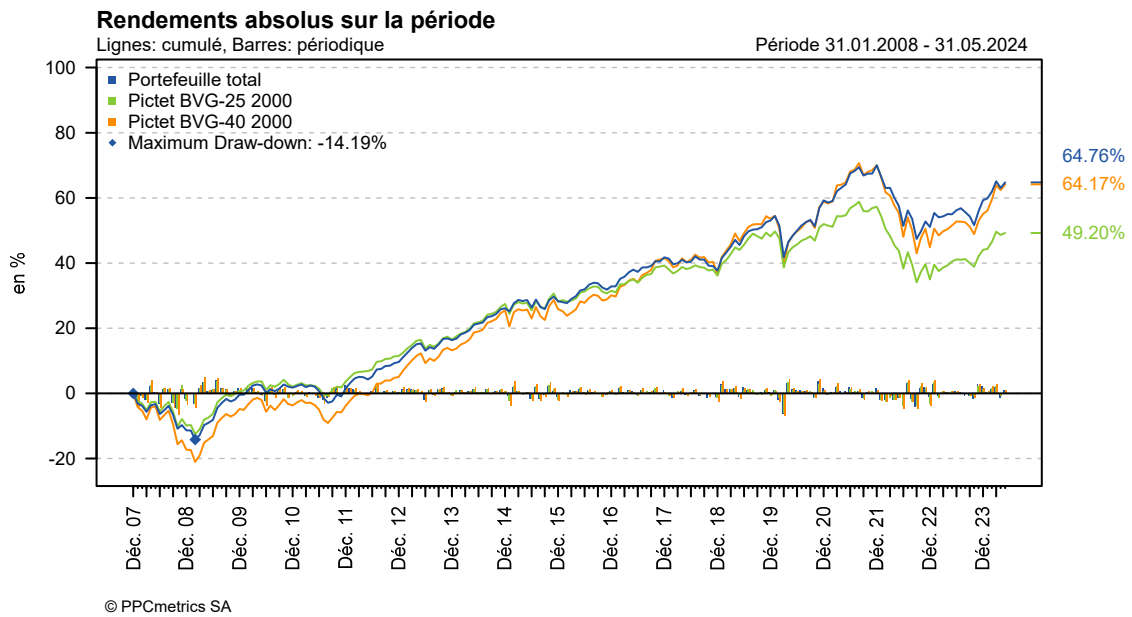
Depuis le début de la mesure de performance

	CHF mio.	2019	2020	2021	2022	2023	YTD 2024*	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	3'207.9	11.15%	4.04%	6.78%	-11.12%	5.40%	3.44%	64.76%	3.09%	01.01.08

* jusqu'au 31.05.2024

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille

