

25.08.2009 - 11:00 Uhr

Comparaison de performances ASIP : Performance annuelle moyenne de 3.4% des institutions de prévoyance participant à la comparaison de performances ASIP

Zurich (ots) -

Indication: La performance des caisses de pensions suisses peut être téléchargée en format pdf sous:
<http://presseportal.ch/de/pm/100005511> -

La comparaison de performances réalisée par le consultant Watson Wyatt sur mandat de l'Association Suisse des Institutions de Prévoyance (ASIP) donne pour le premier semestre 2009 une performance médiane de 3.4% sur le portefeuille total (1) des institutions de prévoyance participantes. Malgré cette légère reprise, les rendements nécessaires moyens sur les derniers cinq ans n'ont pas été atteints.

L'éventail des résultats pour le premier semestre 2009 se situe entre 1.4% et 8.5% pour 90% des caisses. La performance doit être interprétée en tenant compte de la capacité de risque et de la volatilité de la stratégie de placement choisie par la caisse de pension.

La forte reprise des actions étrangères, les rendements légèrement positifs des actions et des obligations suisses ainsi que les placements immobiliers indirects suisses ont considérablement contribué au rendement positif. Les obligations en monnaies étrangères ont obtenues de bons résultats par une grande diversification, tandis que les immobiliers étrangers présentaient des résultats légèrement négatifs. Les matières premières finalement, se sont, après une forte baisse au cours du second semestre 2008, bien redressés au premier semestre 2009.

La performance médiane sur 5 ans (1.7.2004-30.06.2009) s'élevait à 1.9% par année. L'éventail pour cette période était entre 0.0% et 4.0% par année pour 90% des caisses. La performance médiane sur 1, 2 et 3 ans s'établissait à -6.4% et -6.7%, respectivement -1.6% et demeure encore négative. En dépit d'un bon premier semestre la plupart des institutions de prévoyance n'a pour cette raison pas réussi à réaliser le rendement nécessaire.

(1) Le portefeuille total comprend entre autres les placements en actions et obligations, les placements immobiliers directs et indirects, et ceux dans les hedge funds. Les débiteurs et les régularisations ne sont pas compris. Performance médiane (rendement) signifie que la moitié des participants a dégagé une performance supérieure et l'autre moitié une performance inférieure. La performance d'institutions de prévoyance isolées peut s'écarter de cette valeur médiane, puisque celle-ci dépend dans une large mesure de l'allocation individuelle des classes d'actifs).

Après une année boursière difficile, la performance positive du premier semestre a stoppée pour l'instant la baisse des taux de couverture et soutient les mesures d'assainissements éventuellement prises. Néanmoins, une fin d'alerte de la situation financière des institutions de prévoyance, pour la plupart encore tendue, serait trop tôt. Les futurs gains seront utilisés à augmenter d'urgence les réserves de fluctuations.

La comparaison de performance est, avec une fortune totale de CHF 150 milliards, 70 caisses de pensions et plus de 650 mandats, la plus grande comparaison indépendante de Suisse. Elle est effectuée semestriellement. Les institutions de prévoyance participantes reçoivent un rapport personnalisé avec des comparaisons des leurs portefeuilles en rapport à Peergroup.

L'Association Suisse des Institutions de Prévoyance (ASIP), dont le siège est à Zurich, est l'association faitière de plus de 1000 institutions de prévoyance. Représentant plus de 2,5 millions d'assurés et gérant une fortune globale d'environ 400 milliards de francs, l'ASIP s'engage pour le maintien et le développement de la prévoyance professionnelle reposant sur un régime décentralisé et libéral et basée sur le système des trois piliers.

ANNEXE: Quelques chiffres

A) Résultats de principales classes d'actifs et du portefeuille total pour le premier semestre 2009

Classe d'actifs	Plus pas (5% des participants ont atteint au maximum ...%)	Média	Plus haut (5% des participants ont atteint au minimum. ...%)
Actions suisses	-0.3%	1.9%	4.2%
Actions étrangères	7.7%	11.2%	16.3%
Obligations suisses	0.3%	1.5%	2.8%
Obligations monnaies étrangères	-1.6%	3.4%	12.8%
Totalité du portefeuille	1.4%	3.4%	8.5%

B) Performance des caisses de pensions suisses: voir PDF sur www.presseportal.ch/fr

C) Allocation des actifs

Classe d'actifs	Moyenne des participants au 30.06.2009	Moyenne des participants au 31.12.08
Obligations CHF	24.8%	25.7%
Obligations monnaies étrangères	21.5%	20.2%
Actions suisses	6.5%	6.2%
Actions étrangères	19.0%	17.5%
Immobilier	10.8%	14.8%
Matières premières	1.1%	0.8%
Hedge Funds	3.0%	3.4%
Liquidités	7.6%	7.2%
Autres	5.7%	4.2%

Contact:

ASIP - Association suisse des Institutions de prévoyance
Christoph Ryter, Président

Hanspeter Konrad, Directeur
Kreuzstrasse 26
8008 Zurich
Tél. : +41/ 43/243'74'15 ou 16
E-Mail: info@asip.ch
Internet: www.asip.ch

Watson Wyatt AG (exécution technique)
Adrian Marti
Seefeldstrasse 214
Boîte postale
8034 Zurich
Tél. : +41/43/488'44'00

Diese Meldung kann unter <https://www.presseportal.ch/fr/pm/100005511/100588635> abgerufen werden.