

Les Données au 31 décembre 2011

Gestion de la fortune

UBS Global Asset Management

Portrait

Le portefeuille est géré de manière à atteindre la rémunération requise par la LPP en s'appuyant sur le contrôle des risques. Le mandat est mis en œuvre au moyen de placements collectifs (fonds institutionnels et compartiments de fondations de placement) gérés avant tout de façon passive. La part des placements en actions représente entre 20% et 30% de la fortune nette.

| | |
|-----------------------|------------|
| Date de lancement | 23.02.2004 |
| Fortune totale en CHF | 125.1 mio. |
| All-in Fee en % p.a. | 0.30 |

Composition de l'indice de référence (Benchmark)

| | |
|----------------------------------|-----|
| Swiss Performance Index (TR) | 5% |
| MSCI World ex-Switzerland (Net) | 22% |
| SBI Domestic Rating AAA-BBB (TR) | 27% |
| SBI Foreign Rating AAA-BBB (TR) | 26% |
| Citigroup WGBI x CH Hedged CHF | 15% |
| SXI Real Estate Funds (TR) | 3% |
| FTSE EPRA/NAREIT Developed hCHF | 2% |

Statistiques

29.02.2004 – 31.12.2011

| | |
|-------------------------------|-------|
| Performance en % | 18.59 |
| Ø Performance (p.a.) en % | 2.20 |
| Volatilité (p.a.) en % | 4.59 |
| Tracking Error (ex post) en % | 0.48 |
| Information Ratio | -0.25 |

Types de placements

| | K Basic | Benchmark |
|-------------------|---------|-----------|
| Actions Suisse | 5.09% | 5.00% |
| Actions Étranger | 23.51% | 22.00% |
| Obligations CHF | 51.71% | 53.00% |
| Obligations Monde | 14.63% | 15.00% |
| Immobiliers | 4.91% | 5.00% |
| Liquidités | 0.16% | 0.00% |

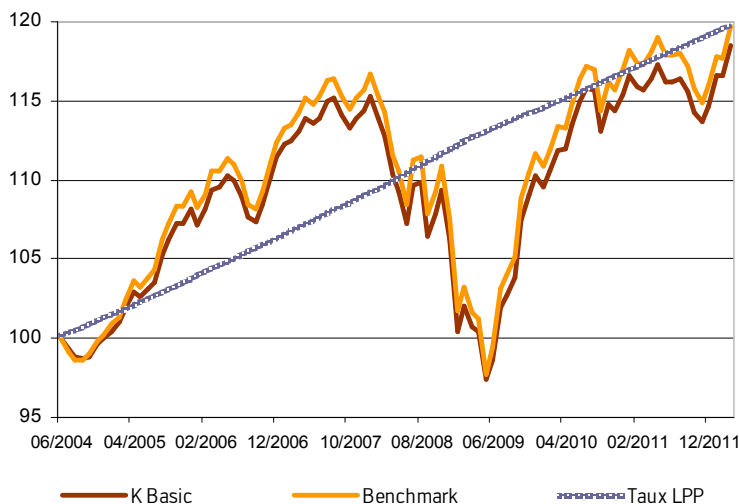
Placements en détail

| | Rendement YTD |
|---|---------------|
| UBS (CH) IF Bonds CHF Suisse Passive I-X | 7.04% |
| UBS (CH) IF Bonds CHF Étranger Passive I-X | 2.95% |
| UBS (CH) IF Global Bonds Passive hedged CHF I-X | 4.90% |
| UBS (CH) IF Equities Suisse Passive All I-X | -7.68% |
| UBS (CH) IF 2 Equities Global Passive I-X | -4.56% |
| UBS (CH) IF 2 Global Real Estate Securities I-X | -9.47% |
| UBS (CH) Swiss Real Estate Securities Selection Passive I-X | 6.88% |

Performance

| | K Basic (net) | Benchmark (sans coûts) |
|--------------|---------------|------------------------|
| Octobre 11 | 1.64% | 1.56% |
| Novembre 11 | 0.01% | -0.09% |
| Dezembre 11 | 1.60% | 1.65% |
| 2011 YTD | 2.41% | 1.99% |
| 2010 | 3.39% | 3.49% |
| 2009 | 11.08% | 11.56% |
| 2008 | -10.69% | -11.13% |
| 2007 | -0.21% | 0.07% |
| 2006 | 3.44% | 3.38% |
| 2005 | 7.31% | 7.92% |
| Ø p.a. 3 ans | 0.31% | 2.32% |

Evolution de la valeur indexé



La performance passée n'offre aucune garantie de l'évolution future. Le présent document est fourni exclusivement à titre d'information. Noventus ne peuvent fournir d'assurance ou de garantie quant à l'exactitude, à la fiabilité ou à l'exhaustivité de ces informations.