

/// CAFP



Fondations
d'investissement:
qualité et sécurité pour
vos fonds de
prévoyance.

Comparaison de performance
30.06.2009

Table des matières

1ère partie: Comparaison des principaux groupes de placement 1

Obligations en Francs suisses	1
Obligations en monnaies étrangères	3
Obligations convertibles	6
Actions suisses	7
Actions étrangères	8
Fortunes mixtes	11
Immeubles suisses	16

2ème partie: Comparaison des subsidiaires groupes de placement 18

Marché monétaires	18
Actions Suisse Small&Mid Cap	19
Actions Japon	20
Actions Marchés émergents	21
Immeubles étrangères	22
Hedge Funds (hedged en CHF)	23

3ème partie: Comparaison des autres groupes de placement 24

Avadis	24
AWI	24
Bâloise	25
CSA	25
CSA 2	25
IST	26
Prisma	27
Renaissance	27
Sarasin	27
Swisscanto	28
Swisscanto Avant	28
UBS	29
UBS Investment Foundation 2	29
Zurich	29

4ème partie: Annexes 30

Fortune totale	30
Fournisseurs d'indice (abréviations)	31
Membres de la CAFP / contacts	32
Note explicative	33

1ère partie: Comparaison des principaux groupes de placement

30 juin 2009

Obligations domestiques en CHF

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans				
	Dénomination	Indice						Mio.	Perf	Risque	Perf
Allianz	Obligations suisses en CHF	SBI Domestic AAA-A TR	300	0.9	8.8	3.5	3.4	3.0	3.1		
Avadis	Obligations suisses en CHF	SBI Domestic AAA-BBB	954	0.1	7.8	3.2	3.3	2.6	3.0		
FWI	Obligations suisses en CHF	SBI Domestic AAA-A TR	119	2.0	11.6	4.2	3.6	3.3	3.3		
Bâloise	Obligations suisses	SBI Domestic AAA - BBB TR	546	1.5	9.0	3.4	4.0	2.8	3.5	2.9	3.2
CSF	Obligations suisses CHF	SBI Domestic	1693	0.3	7.9	3.2	3.3	2.7	3.0	3.3	3.1
IST	Obligations suisses	SBI Domestic AAA - BBB TR	377	1.1	8.4	3.3	3.3	2.6	3.0	3.1	2.8
Sarasin	Obligations suisses en CHF	SBI Domestic AAA - BBB	54	0.4	8.1	3.1	3.3	2.7	3.0	3.0	2.9
Swisscanto	Obligations suisses	SBI Domestic, AAA - BBB (TR)	3504	1.1	7.8	3.2	3.3	2.9	3.0	3.2	2.7
Swiss Life	Obligations suisses en CHF	SBI Domestic AAA - BBB	273	1.9	9.2	3.6	3.3	3.2	3.1		
UBS	Obligations suisses en CHF	SBI Domestic, AAA - BBB (TR)	476	1.3	9.7	3.8	3.3	3.2	3.0	3.1	2.9
Zurich	Obligations Suisse	SBI Domestic (TR)	2821	0.9	8.2	3.3	3.3	2.8	3.1	3.0	3.2
Moyenne arithmétique				1.0	8.8	3.4	3.4	2.9	3.1	3.1	3.0

Classes d'Investissement passives

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans				
	Dénomination	Indice						Mio.	Perf	Risque	Perf
Helvetia	Obligations Suisse indexées	SBI Domestic AAA - BBB	74	0.6	8.4	3.2	3.2	2.8	3.0		
UBS	Obligations suisses en CHF indexé	SBI Domestic, AAA-BBB (TR)	365	1.0	9.1	3.6	4.1	3.0	3.6		
Moyenne arithmétique				0.8	8.8	3.4	3.7	2.9	3.3		

Obligations étrangères en CHF

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans			
	Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque	Perf	Risque	
Allianz	Obligations étrangères CHF	SBI Foreign AAA - A TR	218	2.4	5.4	1.7	3.9	1.5	3.3		
Avadis	Obligations étrangères CHF	SBI Foreign AAA - BBB	567	1.5	2.3	0.4	3.8	0.6	3.1		
FWI	Obligations étrangères CHF	SBI Foreign AAA - A TR	86	1.7	5.5						
CSF	Obligations étrangères CHF	SBI Foreign	381	0.9	4.9	1.9	3.6	1.6	3.0	2.5	2.7
IST	Obligations étrangères CHF	SBI Foreign AAA - BBB TR	22	2.9	-1.5	-0.8	5.7	-0.1	4.6	1.6	3.6
Sarasin	Obli étrangères en CHF	SBI Foreign AAA - BBB	12	1.9	3.4	0.6	4.6	0.9	3.8		
Swisscanto	Obligations étrangères CHF	SBI Foreign AAA - BBB (TR)	345	4.8	-1.7	-1.2	7.2	-0.3	5.7	1.4	4.3
Swiss Life	Obligations étrangères en CHF	SBI Foreign AAA - BBB	108	3.9	3.8	0.8	4.9	1.1	4.0		
UBS	Obli étrangères en CHF	SBI Foreign, AAA - BBB (TR)	117	3.5	4.7	1.6	4.6	1.5	3.7	2.4	3.1
Zurich	Obli étrangères CHF	SBI Foreign (TR)	381	3.1	4.8	1.2	4.3	1.2	3.5		
Moyenne arithmétique				2.7	3.2	0.7	4.7	0.9	3.9	2.0	3.4

Obligations en monnaies étrangères

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an		3 ans		5 ans		10 ans	
	Dénomination	Indice		Mio.	Perf	Perf	Perf	Risque	Perf	Risque	Perf
Allianz	Obligations en ME	Citi WGBI ex CHF	65	1.9	9.3	2.6	7.7	2.0	6.8		
FWI	Global Obligations	Citigroup WGBI ex CHF TR	131	1.8	8.9	2.0	8.2	2.0	7.2	2.8	6.2
CSF	Obligations étrang. ME	JPM Global Traded	157	0.4	9.2	2.4	7.8	2.3	7.0	2.9	6.1
IST	Obligations étrangères	Cust. Index	259	4.4	2.8	1.4	7.4	2.2	6.5	2.6	5.7
Sarasin	Obligations internat. ex CHF	Citi WGBI ex CHF	48	2.8	6.3	1.3	8.2	1.7	7.2	2.1	6.5
Sarasin	Durable Obli internat. ex CHF	Citi WGBI ex CHF	8	2.5	8.6	2.0	7.4	1.9	6.7		
Swisscanto	Obli étrangères ME	Cust. Index	1151	6.0	5.0	2.3	8.2	3.2	7.1	3.6	5.9
Swiss Life	Obligations en ME Global	Citi WGBI ex CHF	43	3.3	7.7	1.8	8.3	1.8	7.1		
UBS	Obligations en ME Global	JPM Global Traded	202	0.9	11.4	2.6	8.3	2.3	7.3	2.4	6.3
Moyenne arithmétique				2.7	7.7	2.0	7.9	2.2	7.0	2.7	6.1

Classes d'Investissement passives

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an		3 ans		5 ans		10 ans	
	Dénomination	Indice		Mio.	Perf	Perf	Perf	Risque	Perf	Risque	Perf
Avadis	Obligations en ME	Citigroup WGBI ex CHF	10	0.4	10.4	3.1	8.1	2.7	7.2		
Helvetia	Obligations Global indexées	Cust. Index	42	4.1	8.3	3.1	8.3	2.6	7.4		
Moyenne arithmétique				2.3	9.4	3.1	8.2	2.7	7.3		

Allocation stratégique des monnaies étrangères

Gérants		USD	Euro	GBP	Yen	Autres
Allianz	Obligations en ME	22.0%	38.0%	6.0%	30.0%	4.0%
Avadis	Obligations en ME	21.8%	38.5%	6.1%	30.3%	3.3%
FWI	Global Obligations	23.0%	36.0%	7.0%	30.0%	4.0%
CSF	Obligations étrang. ME	11.0%	40.0%	10.0%	30.0%	9.0%
IST	Obligations étrangères	17.0%	61.0%	8.0%	4.0%	10.0%
Helvetia	Obligations Global indexées	25.0%	52.4%	9.0%	5.0%	8.6%
Sarasin	Obligations internat. ex CHF	22.3%	37.6%	5.9%	29.4%	4.8%
Sarasin	Durable Obli internat. ex CHF	22.3%	37.6%	5.9%	29.4%	4.8%
Swisscanto	Obli étrangères ME	20.0%	57.4%	9.0%	5.0%	8.6%
Swiss Life	Obligations en ME Global	21.7%	37.1%	6.2%	30.1%	4.9%
UBS	Obligations en ME Global	25.0%	34.0%	6.0%	32.0%	3.0%

Obligations en Euro

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an		3 ans		5 ans		10 ans	
	Dénomination	Indice		Mio.	Perf	Perf	Perf	Risque	Perf	Risque	Perf
Avadis	Obligations en EUR	Citigroup Euro Gov. Bond	143	4.3	5.6						
Bâloise	Obligations en EUR	Citigroup Euro Gov. Bond	287	3.5							
CSF	Obligations EUR	JPM EMU Bondindex	280	4.1	3.5	2.7	7.5	3.7	6.3	3.8	5.4
IST	Governo Euro Plus	JPM Europe	82	5.6	3.8	2.3	7.6	3.3	6.4		
IST	Europe Bond A-BBB	Cust. Index	13	5.9	-2.9	-0.5	8.9				
Swisscanto	Obligations Europe Top	Cust. Index	353	6.3	2.9	1.9	8.3	3.3	6.9	3.8	5.7
UBS	Obligations en EUR	JPM GBI EMU	103	3.4	5.1	3.3	7.5	4.0	6.3	3.9	5.4
Zurich	Obligations Euro	JPM GBI EMU (TR)	178	4.4	5.7	3.5	7.6	3.9	6.3	3.8	5.4
Moyenne arithmétique				4.7	3.4	2.2	7.9	3.6	6.4	3.8	5.5

Obligations en USD

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans				
	Dénomination	Indice						Mio.	Perf	Perf	Perf
CSF	Obligations USD	JPM USD Traded	40	0.6	11.8	2.0	10.8	1.9	10.6	2.6	9.6
IST	Governo USD Plus	JPM USD Traded	8	-1.2	11.4	2.2	11.1	1.8	10.8		
IST	Dollar Bond A - BBB	Cust. Index	2	7.6	5.6	0.4	11.0				
Swisscanto	Obligations Dollar Top	Cust. Index	55	1.6	8.9	2.4	11.0	2.9	10.4	2.9	9.5
UBS 1)	Obligations en USD Indexées	JPM US GBI	15	-1.0	11.6	2.0	11.5	1.9	11.0	2.0	10.1
Zurich	Obligations USD	JPM GBI USD (TR)	10	-1.9	12.8	2.5	11.7	2.1	11.1		
Moyenne arithmétique				1.0	10.4	1.9	11.2	2.1	10.8	2.5	9.7

1) jusqu'à 30.06.09 active

Obligations convertibles

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an		3 ans		5 ans		10 ans	
	Dénomination	Indice		Mio.	Perf	Perf	Perf	Risque	Perf	Risque	Perf
Prisma	Obligations Convertibles Monde	Merrill Lynch Global Convertible	70	14.9	-6.8	-4.3	14.2	0.0	12.3		
CSF	Equity-linked Bond Portfolio	UBS Global Conv. 01	53	17.7	-7.1	-1.9	15.7	0.3	13.0	-0.3	12.8
IST	Obligations Convertibles Global	UBS Global Conv. 01	111	8.4							
Swisscanto	Convertibles International	Cust. Index	384	4.7	-1.3	-0.9	10.7	2.7	9.3		
Zurich	Obligations convertibles global	JACI Global Switzerland Franc	295	18.2	-3.9	-3.2	15.2				
Moyenne arithmétique				12.8	-4.8	-2.6	14.0	1.0	11.5	-0.3	12.8

Actions suisses

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement			2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans			
	Dénomination	Indice	Mio.						Perf	Perf	Perf
Allianz	Actions suisses	SPI	68	1.6	-19.8	-8.7	16.1	1.4	14.2		
Bâloise	Actions suisses	SPI	227	1.6	-22.0	-8.8	17.0	1.4	14.9	1.1	16.3
CSF	Actions suisses	SPI	425	0.5	-21.6	-8.1	17.2	1.6	15.0	-0.5	15.6
IST	Actions suisses SPI Plus	SPI	137	2.0	-21.2						
IST 2	Actions suisses SPI Plus	SPI	42	2.0	-21.5						
Prisma	Actions suisses valeurs compl.	SPI	6	0.5	-21.5	-9.2	16.5	0.0	14.5		
Sarasin	Actions suisses	SPI	32	1.6	-23.4	-9.8	16.8	0.5	14.7	-1.8	15.6
Sarasin	Durable Actions suisses	SPI	45	0.6	-20.6	-8.3	16.2	2.0	14.3		
Swisscanto	Actions suisses	SPI	417	1.4	-21.2	-9.0	16.6	0.8	14.5	-0.5	15.0
Swiss Life	Actions Suisse	SPI	90	1.6	-21.5	-10.0	16.4	0.2	14.2		
UBS	Actions suisses	SPI (TR)	88	2.2	-18.7	-8.1	16.2	1.8	14.3	-0.4	15.2
Zurich	Actions suisses	SPI (TR)	522	-1.7	-20.7	-7.7	16.5	1.6	14.4	1.6	14.2
Moyenne arithmétique				1.2	-21.1	-8.8	16.6	1.1	14.5	-0.1	15.3

Classes d'Investissement passives

Fondation	Groupe de Placement			2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans			
	Dénomination	Indice	Mio.						Perf	Perf	Perf
FWI	Actions suisses	SMI (r)	39	0.4	-20.1	-8.9	16.1	1.2	14.1	-0.9	15.2
Avadis	Actions suisses	UBS 100	486	1.7	-20.4	-8.2	16.5	1.9	14.4		
CSF	Swiss-Index	SMI (r)	87	0.4	-20.1	-8.9	16.4	1.2	14.3		
Helvetia	Actions Suisses indexées	SPI	73	1.7	-20.4	-8.1	18.0	1.9	15.5	0.0	16.5
IST	Actions suisses SMI indexées	SMI (r)	428	0.3	-20.0	-9.1	16.0	0.7	14.0	-0.2	14.9
UBS	Actions suisses indexées	SMI (TR)	112	0.3	-20.1	-8.8	16.0	1.3	14.1		
Zurich	Actions suisses indexées	SPI	267	1.9	-20.5	-8.1	16.6				
Moyenne arithmétique				1.0	-20.2	-8.6	16.5	1.4	14.4	-0.4	15.5

Actions étrangères

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans					
	Dénomination	Indice						Mio.	Perf	Perf	Perf	Risque
Allianz	Actions étrangères	MSCI World ex CH	157	7.7	-23.6	-9.9	20.3	-1.5	17.1			
FWI	Global Actions	MSCI World AC ex CH (r)	74	6.7	-34.4	-13.5	22.3	-5.0	18.6	-5.8	18.8	
Bâloise	Actions étrangères actif	MSCI World ex CH (r)	45	8.2	-24.8	-13.0	20.6	-3.1	17.7			
Bâloise	Sustainability Actions globales	DJ Sust. Total Return Index	0	-0.2	-38.5	-17.9	22.1	-6.9	18.7			
CSF	Manager Selection Equity Global	MSCI World (r)	40	18.2	-21.3	-8.8	20.9					
IST	Actions étrangères	MSCI World ex CH (nD)	36	41.5	-46.0	-20.1	33.9	-8.6	27.1	-7.8	23.6	
Prisma	Actions worldwide	MSCI World TR net	1	13.2	-27.7	-14.0	21.4					
Sarasin	Actions intern. ex CH durable	MSCI World ex CH (nD)	43	11.9	-25.9	-12.2	21.6	-3.8	18.4			
Swisscanto Avant	Actions étrangères	MSCI World ex CH (nD)	335	9.0	-24.6	-11.0	21.0	-2.6	17.7			
Swisscanto	Actions étrangères WT	MSCI World ex CH (nD)	16	8.7	-24.6							
Swiss Life	Actions Etranger	MSCI World ex CH	89	6.9	-25.9	-13.1	21.0	-5.3	17.6			
UBS	Actions Global	MSCI World ex CH (nD)	8	18.2	-21.1	-12.2	22.0	-4.1	18.2	-5.6	18.8	
UBS 2	AST 2 Global Equities (ex CH)	MSCI World ex CH (nD)	21	17.7	-21.5	-12.4	22.7					
Zurich	Actions globales ISR	MSCI World TR net	139	13.1								
Moyenne arithmétique				12.9	-27.7	-13.2	22.5	-4.5	19.0	-6.4	20.4	

Classes d'Investissement passives

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans					
	Dénomination	Indice						Mio.	Perf	Perf	Perf	Risque
FWI	Actions globale ex CH	MSCI World ex CH	52	9.0	-24.4	-11.6	20.9	-2.8	17.5			
Avadis	Actions Monde	MSCI World ex CH	11	9.1	-24.5	-11.4	20.9	-2.7	17.5			
Avadis	Actions Monde 2	MSCI World ex CH	150	9.1								
Bâloise	Actions étrangères passif	MSCI World ex CH (r)	47	8.8	-24.2	-11.8	21.2	-3.3	17.7	-5.1	18.8	
CSF 2	World-Index	MSCI World ex CH	89	9.0	-24.7	-11.9	21.4					
Helvetia	Actions Global indexées	Cust. Index	56	10.9	-25.2	-12.0	22.8	-2.3	19.6	-4.1	19.5	
IST	Globe Index	MSCI World ex CH (nD)	504	9.0	-24.5	-11.5	20.9	-2.8	17.5	-4.4	18.4	
UBS	Actions Global	MSCI World ex CH (nD)	17	9.1	-24.7	-12.0	20.6	-3.3	17.3	-4.9	18.5	
UBS 2	AST 2 Global Equities (ex CH)	MSCI World ex CH (nD)	100	9.3	-24.6	-11.7	21.0					
Moyenne arithmétique				9.3	-24.6	-11.7	21.2	-2.9	17.9	-4.6	18.8	

Actions européennes

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an		3 ans		5 ans		10 ans	
	Dénomination	Indice		Mio.	Perf	Perf	Perf	Risque	Perf	Risque	Perf
FWI	Actions CQM Europe	Pas d'indice	14	15.2	-31.3	-12.0	25.7	-1.2	21.4	-3.6	21.0
CSF	Actions Europe	MSCI Europe ex CH (r)	255	9.3	-32.7	-12.9	22.1	-1.9	18.5	-3.2	21.8
Prisma	Actions Europe	MSCI Europe TR net	21	9.1	-34.9	-13.1	22.9	-1.2	19.6		
Swisscanto	Actions Europe	MSCI Europe ex CH	202	13.3	-28.9	-11.6	24.7	-0.5	20.3	-3.2	20.9
Swisscanto	Actions Europe Value	MSCI Europe ex Switzerland	13	13.7	-33.7	-14.9	29.4	-2.8	23.7		
Swisscanto	Actions Europe Growth	MSCI Europe ex Switzerland	2	11.9	-25.5	-9.1	21.3	1.1	17.9		
Zurich	Actions Europe	MSCI Europe ex CH (TR)	247	9.1	-32.6	-12.4	24.0	-1.8	20.1	-2.7	22.4
Moyenne arithmétique				11.7	-31.4	-12.3	24.3	-1.2	20.2	-3.2	21.5

Classes d'Investissement passives

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an		3 ans		5 ans		10 ans	
	Dénomination	Indice		Mio.	Perf	Perf	Perf	Risque	Perf	Risque	Perf
FWI	Actions Europe (ex CH) indexées	MSCI Europe ex CH	26	10.5	-30.8	-12.2	23.9	-0.8	19.7	-2.3	20.0
CSF	Euro-Index	MSCI Europe ex CH (r)	41	10.7	-30.8	-12.3	24.2	-1.0	20.0	-2.8	20.3
IST	Europe Index	MSCI Europe ex CH (nD)	164	10.6	-30.7	-12.1	23.7	-0.7	19.6	-2.4	20.0
UBS	Actions Europe indexées	MSCI Europe ex CH (nD)	60	10.5	-31.1	-12.5	23.7	-1.1	19.6	-2.9	20.1
Zürich	Actions Europe Index	MSCI Europe ex CH	145	10.4	-31.0	-12.3	23.7				
Moyenne arithmétique				10.5	-30.9	-12.3	23.8	-0.9	19.7	-2.6	20.1

Actions US / Amérique du Nord

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans				
	Dénomination	Indice						Mio.	Perf	Perf	Perf
Prisma	Actions USA	MSCI USA TR net	24	11.8	-26.1	-14.6	24.5	-6.1	20.5		
Swisscanto Avant	Actions Amérique Value	MSCI North America	3	9.5	-21.7	-13.5	23.3	-4.7	19.3		
Swisscanto Avant	Actions Amérique Growth	MSCI North America	1	12.4	-14.7	-5.2	19.3	-2.6	16.6		
Swisscanto Avant	Actions Amérique	MSCI North America	87	11.3	-17.6	-8.9	20.6	-3.1	17.4	-5.4	19.8
UBS	Actions Etats-Unis	MSCI USA (nD)	8	5.9	-22.2	-12.5	21.4	-5.5	17.9	-7.4	19.3
Zurich	Actions USA	MSCI USA (TR)	222	4.2	-21.1	-14.7	19.7	-7.9	16.9	-5.9	18.2
Moyenne arithmétique				9.2	-20.6	-11.6	21.5	-5.0	18.1	-6.2	19.1

Classes d'Investissement passives

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans				
	Dénomination	Indice						Mio.	Perf	Perf	Perf
FWI	Actions Etats-Unis, indexées	MSCI USA	14	5.4	-22.3	-12.4	20.5	-5.4	17.3	-6.1	19.2
CSF 2	USA Enhanced	MSCI USA (r)	23	5.7	-21.4	-13.7	21.0	-7.3	17.6	-8.5	19.3
CSF 2	US-Index	MSCI USA (r)	253	5.9	-21.9	-12.1	21.3	-5.3	17.8	-6.2	19.4
IST	America Index	MSCI North America (nD)	105	7.4	-22.3	-11.4	20.6	-4.4	17.4	-5.7	19.2
UBS	Actions Etats-Unis indexé	MSCI USA (nD)	3	5.3	-22.2	-12.5	20.3	-5.5	17.3		
UBS 2	AST 2 US Equ. Passive	MSCI USA (gD)	19	5.6	-21.7	-12.0	20.3				
Zurich	Actions USA Index	MSCI USA	146	5.7	-21.7	-11.9	20.2				
Moyenne arithmétique				5.9	-21.9	-12.3	20.6	-5.6	17.5	-6.6	19.3

Fortunes mixtes (10 - 19% Actions)

Fondation	Groupe de Placement		2009 Mio.	2009 Perf	1 an Perf	3 ans		5 ans		10 ans	
	Dénomination	Indice				Perf	Risque	Perf	Risque	Perf	Risque
Bâloise	LPP-Mix 15 Plus	Cust. Index	39	2.3	1.6	0.4	4.8				
IST	Mixta Optima 15	Cust. Index	17	3.7	2.5	1.1	4.0				
Helvetia	LPP-Mix Plus 15	Cust. Index	15	3.9	1.3						
Sarasin	LPP-Production	Cust. Index	13	2.2	-0.2	0.0	4.3				
Swisscanto Avant	LPP Portfolio 10	Cust. Index	106	2.4	2.9	1.7	3.7	2.7	3.2	2.9	2.7
Swisscanto	LPP Portfolio 10 WT	Cust. Index	39	2.3	3.1						
Swiss Life	LPP-Mix 15	Cust. Index	53	2.1	2.4	0.8	3.6	1.9	3.1		
UBS	LPP-12	Cust. Index	39	1.3	0.1	0.0	4.0	1.4	3.4	1.9	2.9
UBS	LPP 12-Classic	Cust. Index	55	1.3	0.1	0.0	4.0	1.4	3.4	1.9	2.9
Zurich	Profil défensif	Cust. Index	33	3.2	-0.9						
Moyenne arithmétique				2.5	1.3	0.6	4.1	1.9	3.3	2.2	2.8

Allocation stratégique

Gérants	Cash	Obli CHF	Obli ME	Actions suisses	Actions étrangères	Immeubles	Autres
Bâloise	0%	65%	10%	10%	5%	10%	0%
IST	0%	60%	10%	8%	7%	15%	0%
Helvetia	0%	35%	20%	10%	5%	20%	10%
Sarasin	0%	65%	20%	10%	5%	0%	0%
Swisscanto Avant	0%	59%	16%	8%	2%	15%	0%
Swisscanto	0%	59%	16%	8%	2%	15%	0%
Swiss Life	0%	55%	5%	8%	7%	0%	25%
UBS LPP12	0%	83%	5%	7%	5%	0%	0%
UBS LPP12 Classic	0%	83%	5%	7%	5%	0%	0%
Zurich	0%	60%	0%	8%	10%	10%	12%

Fortunes mixtes (20 - 30% Actions)

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement			2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans			
	Dénomination	Indice	Mio.						Perf	Perf	Perf Risque
Allianz	LPP-30	Cust. Index	12	2.0	-0.1	-0.2	5.6	2.0	4.8		
FWI	LPP Andante	Cust. Index (r)	56	3.3	-0.9	-0.2	5.7	2.0	4.9		
Bâloise	LPP-Mix 25 Plus	Cust. Index	50	2.7	-1.8	-0.8	6.2	1.5	5.2		
CSF 2	Mixta-LPP 25	Cust. Index	250	2.1	-2.2	-0.1	5.6	2.5	4.7	2.0	4.6
IST	Mixta Optima 25	Pictet LPP 93	486	3.8	-2.2	-0.4	5.9	2.4	5.1	2.4	4.6
Sarasin	LPP-Rendement	Pictet LPP 93	53	1.7	-1.7	-0.5	5.0	1.8	4.4		
Sarasin	LPP-durable rendement	Pictet LPP 93	6	3.0	0.1						
Swisscanto Avant	LPP Portfolio 25	Cust. Index	312	2.6	-1.8	-0.4	5.8	2.1	5.0	2.2	4.6
Swisscanto	LPP Portfolio 25 WT	Cust. Index	48	2.6	-1.9						
Swiss Life	LPP-Mix 25	Cust. Index	168	2.7	-0.3	-0.6	5.5	1.5	4.6		
UBS	LPP-25	Cust. Index	368	1.5	-4.6	-1.8	6.0	1.0	5.0	1.3	4.5
UBS	LPP-25 Classic	Cust. Index	127	1.5	-4.6	-1.8	6.0	1.0	5.0	1.3	4.5
Zurich	Profil équilibré	Cust. Index	97	3.4	-4.3						
Zurich	LPP Rendement	Cust. Index	96	2.8	-0.1	0.1	5.3	2.1	4.6	2.2	4.3
Moyenne arithmétique				2.6	-1.9	-0.6	5.7	1.8	4.8	1.9	4.5

Classes d'Investissement passives

Fondation	Groupe de Placement			2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans			
	Dénomination	Indice	Mio.						Perf	Perf	Perf Risque
Helvetia	LPP-Mix Plus 25	Cust. Index	37	3.0	-2.5						
Helvetia	LPP-Mix	Cust. Index	18	2.7	-0.6	-0.2	6.3	2.4	5.4	2.2	6.1
Moyenne arithmétique				2.9	-1.6	-0.2	6.3	2.4	5.4	2.2	6.1

Allocation stratégique

Gérants	Cash	Obli CHF	Obli ME	Actions suisses	Actions étrangères	Immeubles	Autres
Allianz	0%	58%	7%	15%	10%	10%	0%
AWI	0%	55%	10%	15%	10%	10%	0%
Bâloise	0%	55%	10%	15%	10%	10%	0%
CSF 2	9%	54%	4%	15%	10%	8%	0%
IST	0%	50%	10%	15%	10%	15%	0%
Helvetia Mix Plus 25	0%	25%	20%	20%	5%	20%	10%
Helvetia Mix	0%	60%	10%	15%	15%	0%	0%
Sarasin LPP-Rendement	0%	68%	7%	15%	10%	0%	0%
Sarasin LPP-durable rendement	0%	68%	7%	15%	10%	0%	0%
Swisscanto Avant	0%	48%	16%	21%	5%	10%	0%
Swisscanto	0%	48%	16%	21%	5%	10%	0%
Swiss Life	0%	67%	8%	13%	12%	0%	0%
UBS LPP-25	0%	68%	7%	14%	11%	0%	0%
UBS LPP-25 Classic	0%	68%	7%	14%	11%	0%	0%
Zurich Profil équilibré	1%	50%	0%	13%	15%	10%	11%
Zurich LPP Rendement	0%	68%	7%	11%	14%	0%	0%

Fortunes mixtes (31 - 40% Actions)

30 juin 2009

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans				
	Dénomination	Indice						Mio.	Perf	Perf	Perf
FWI	LPP Allegro	Cust. Index (r)	266	3.5	-4.5	-1.3	7.3	1.7	6.2	0.9	6.1
Bâloise	LPP-Mix 40 Plus	Cust. Index	81	3.0	-7.0	-2.8	8.8	1.2	7.4	1.0	7.1
CSF 2	Mixta-LPP 35	Cust. Index	814	2.5	-5.7	-1.4	7.5	2.4	6.4	1.7	6.4
IST	Mixta Optima 35	Cust. Index	74	4.1	-4.9	-1.7	7.3				
Sarasin	LPP-Croissance	Cust. Index	270	3.1	-4.6	-1.6	6.7	1.5	5.9	0.9	6.1
Sarasin	LPP-Durable	Cust. Index	95	3.8	-4.1	-2.0	7.5	1.4	6.5		
Swiss Life	LPP-Mix 35	Cust. Index	48	2.8	-3.4	-2.0	7.0	1.0	5.9		
UBS	LPP-40	Cust. Index	119	1.6	-9.5	-3.9	8.4	0.4	7.1	0.3	6.7
UBS	LPP-40 Classic	Cust. Index	72	1.6	-9.5	-3.9	8.4	0.4	7.1	0.3	6.7
Zurich	Profil progressif	Cust. Index	19	4.3	-7.1						
Zurich	LPP Rendement Plus	Cust. Index	1	2.7	-3.3	-1.1	6.7	1.8	5.8		
Moyenne arithmétique				3.0	-5.8	-2.2	7.6	1.3	6.5	0.9	6.5

Allocation stratégique

Gérants	Cash	Obli CHF	Obli ME	Actions suisses	Actions étrangères	Immeubles	Autres
AWI	0%	48%	7%	20%	15%	10%	0%
Bâloise	0%	40%	10%	25%	15%	10%	0%
CSA 2	5%	45%	9%	20%	15%	6%	0%
IST	0%	45%	10%	20%	15%	10%	0%
Sarasin BVG-Wachstum	0%	60%	5%	20%	15%	0%	0%
Sarasin BVG-Nachhaltigkeit	0%	57%	5%	17%	21%	0%	0%
Swiss Life	0%	58%	7%	18%	17%	0%	0%
UBS LPP-40	0%	52%	8%	23%	17%	0%	0%
UBS LPP-40 Classic	0%	52%	8%	23%	17%	0%	0%
Zürich Profil Progressiv	1%	41%	0%	18%	20%	10%	11%
Zürich BVG Rendite Plus	0%	59%	6%	16%	19%	0%	0%

Fortunes mixtes (41 - 50% Actions)

30 juin 2009

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans				
	Dénomination	Indice						Mio.	Perf	Perf	Perf
FWI	LPP Vivace	Cust. Index (r)	39	3.9	-8.6	-2.6	9.1	1.4	7.7		
CSF 2	Mixta-LPP 45	Cust. Index	241	3.2	-8.5	-2.7	9.2	2.0	7.9		
Sarasin	LPP-Futur	Cust. Index	35	3.4	-8.0	-3.0	8.2				
Swisscanto Avant	LPP Portfolio 45	Cust. Index	234	3.3	-8.0	-2.9	8.8	1.4	7.5	1.2	7.3
Swisscanto	LPP Portfolio 45 WT	Cust. Index	38	3.2	-8.1						
Swiss Life	LPP-Mix 45	Cust. Index	68	3.0	-6.8	-3.5	8.7	0.5	7.3		
Zurich	LPP Croissance	Cust. Index	5	3.3	-5.9	-2.2	8.3	1.6	7.2		
Moyenne arithmétique				3.3	-7.7	-2.8	8.7	1.4	7.5	1.2	7.3

Allocation stratégique

Gérants	Cash	Obli CHF	Obli ME	Actions suisses	Actions étrangères	Immeubles	Autres
AWI	0%	40%	5%	25%	20%	10%	0%
CSF 2	5%	41%	5%	25%	20%	4%	0%
Sarasin	0%	55%	0%	25%	20%	0%	0%
Swisscanto Avant	0%	30%	10%	27%	18%	15%	0%
Swisscanto	0%	30%	10%	27%	18%	15%	0%
Swiss Life	0%	49%	6%	23%	22%	0%	0%
Zürich	0%	51%	4%	21%	24%	0%	0%

Immobilier Suisse - Habitat

Basé sur la VNI

Fondation	Groupe de Placement			2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
	Dénomination	Indice	Mio. 1)					
ASSETIMMO	W (Immobilier Habitat)	KGAST Immo-Index	810 (868)	2.4	5.3	6.1	5.8	
Pensimo	Casareal	KGAST Immo-Index	644	2.4	5.3	5.4	5.3	5.1
Turidomus	Casareal	KGAST Immo-Index	1863	2.2	4.9	5.2	4.9	
Zurich	Immobilier Habitat Suisse	KGAST Immo-Index	599 (801)	3.1	6.5	6.8	6.5	
Moyenne arithmétique				2.5	5.5	5.9	5.6	5.1

1): Net fortune (totale fortune)

Immobilier Suisse - Commercial

Basé sur la VNI

Fondation	Groupe de Placement			2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
	Dénomination	Indice	Mio. 1)					
ASSETIMMO	G (Immobilier Commercial)	KGAST Immo-Index	532 (578)	2.7	5.4	5.5	5.1	
Pensimo	Proreal	KGAST Immo-Index	143	2.4	5.1	5.6	5.4	
Turidomus	Proreal	KGAST Immo-Index	517	2.2	2.8	4.4	3.5	
Zurich	Immobilier - Commercial CH	KGAST Immo-Index	164 (175)	2.2	5.0			
Moyenne arithmétique				2.4	4.6	5.2	4.7	

1): Net fortune (totale fortune)

Immobilier Suisse - mixtes

Basé sur la VNI

Fondation	Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
	Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf	Perf	Perf
Avadis	Valeurs im- mobilières suisses	KGAST Immo-Index	1729	2.4	5.3	5.5	5.4	
FWI	Immobilier Suisse	Pas d'indice	10					
CSF	Real Estate Switzerland	KGAST Immo-Index	3432 (4149)	2.3	4.5	4.6	4.6	
CSF	Real Estate CH Dynamic	KGAST Immo-Index	302 (350)	2.3	4.5	4.6		
HIG	Immobilien Schweiz	KGAST Immo-Index	492 (675)	2.6	5.7	5.3	4.7	4.4
Imoka	Immobilien Schweiz	KGAST Immo-Index	310	2.5	5.8	6.1	6.3	
IST 1)	Immo Invest Schweiz	Pas d'indice	130 (139)	1.7	4.5	5.6	5.4	
Swisscanto	Valeurs immobilières	KGAST Immo-Index	3219 (3377)	2.4	4.7	5.0	4.2	4.5
UBS	Immeubles suisses	Pas d'indice	896 (910)	2.0	4.7	4.5	4.3	3.6
Zurich	Immobiliers traditionels CH	KGAST Immo-Index	387 (387)	2.8	5.7	6.1		
Moyenne arithmétique				2.3	5.0	5.3	5.0	4.2

1): Au 31.05.2009 sur 6, 12, 36, 60 mois

Non basé sur la VNI

Fondation	Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
	Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf	Perf	Perf
CSF	Real Estate Pooled Investments A	Customized Benchmark CSA Real Estate Switzerland Pooled Investments	26	7.9	2.4			
IST	Immo Optima Schweiz	SWX Immofonds Index (TR)	248	9.5	4.3	3.2	4.4	
UBS	Immoparts Suisse	SWX Immofonds Index (TR)	139	9.9	4.2	3.2	4.2	3.1
Moyenne arithmétique				9.1	3.6	3.2	4.3	3.1

2ème partie: Comparaison des subsidiaires groupes de placement

30 juin 2009

Marché Monétaire

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an		3 ans		5 ans		10 ans	
	Dénomination	Indice		Mio.	Perf	Perf	Perf	Risque	Perf	Risque	Perf
FWI	Marché Monétaire Suisse	Citibank 3mth CHF Euro Dep. (TR)	3	0.0	0.9	1.7	0.3	1.2	0.4		
CSF	Marché monétaire CHF	Citi CHF 3mth Euro Dep.	14	1.1	-0.6	1.0	1.8	0.9	1.4	1.3	1.0
IST	Marché monétaire	Citi CHF 3mth Euro Dep.	109	1.0	2.2	1.7	0.4	1.3	0.4		
UBS	Marché monétaire CHF	JPM MM Index CHF	73	0.3	1.4	1.9	0.2	1.4	0.2	1.4	0.3
Zurich	Marché monétaire CHF	Bloomberg EFFAS Marché mon. 3	3	0.4	1.8	1.9	0.5	1.4	0.4	1.5	0.4
Moyenne arithmétique				0.6	1.1	1.6	0.6	1.2	0.6	1.4	0.6

Actions Suisse Small&Mid Caps

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement		2009	1 an		3 ans		5 ans		10 ans	
	Dénomination	Indice		Mio.	Perf	Perf	Perf	Risque	Perf	Risque	Perf
FWI	Actions Suisse SMC	SPI ex SLI Total Return	110	8.2	-32.0	-5.1	23.4	5.1	19.7		
CSF	Small & Mid Cap Switzerland	SPI Extra	100	11.3	-28.1	-4.7	26.3	5.5	22.3		
IST	Actions suisses Valeurs	SPI Extra	269	12.9	-25.9	-3.7	24.5	5.1	21.0	3.9	20.4
IST 2	Actions suisses	SPI	1	12.7	-25.9						
Swisscanto	Actions Suisse Small&Mid Caps	SPI Small & Mid Caps	37	10.0	-24.2	-3.0	22.4				
UBS	Small&Mid Caps Suisse	SPI Extra	24	12.2	-22.6	-3.2	22.8	6.1	19.4	5.3	19.2
Moyenne arithmétique				11.2	-26.5	-3.9	23.9	5.5	20.6	4.6	19.8

Actions Japon

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement			2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	
	Dénomination	Indice	Mio.						Perf
Prisma	Actions Japon	MSCI Japon TR net	37	3.1	-22.0	-18.9	18.3	-8.8	18.5
Zurich	Actions Japon	Topix (TR)	79	6.1	-28.4	-18.4	21.8	-6.1	20.6
Moyenne arithmétique				4.6	-25.2	-18.7	20.1	-7.5	19.6

Classes d'Investissement passives

Fondation	Groupe de Placement			2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans			
	Dénomination	Indice	Mio.						Perf	Perf	Perf
FWI	Actions Japon, indexé	MSCI Japan	20	5.1	-17.9	-14.0	18.4	-3.9	17.8	-4.4	20.4
CSF	Nippon-Index	MSCI Japan (r)	47	5.6	-18.1	-14.2	18.7	-4.1	18.0	-4.8	20.2
CSF	CSA Nippon Enhanced	MSCI Japan (r)	11	4.6	-21.6	-19.2	19.6	-9.3	19.1	-8.7	21.3
UBS	Actions Japon indexées	MSCI Japan (nD)	22	5.3	-18.3	-14.1	18.8	-3.8	17.8	-5.1	20.0
Zurich	Actions Japon Index	MSCI Japan	58	5.4	-18.1	-13.9	18.7				
Moyenne arithmétique				5.2	-18.8	-15.1	18.8	-5.3	18.2	-5.8	20.5

Actions Marchés Emergents

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement		2009 Mio.	1 an		3 ans		5 ans		10 ans	
	Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf	Risque	Perf	Risque	Perf	Risque
Avadis	Actions Emerging Markets	MSCI Emerging Markets	129	34.6	-27.5	-3.9	36.9	10.5	31.2		
CSF	Actions Emerging Markets	MSCI EM (r)	198	37.1	-30.7	-3.0	31.5	8.9	27.3		
IST	Actions Emerging Markets	MSCI EM (r)	20	26.7	-36.2	-7.5	30.7				
Prisma	Actions BRIC	MSCI BRIC EM TR net	40	47.7	-26.3	-1.2	32.3				
UBS	Actions Marchés émergents	MSCI EMMA (nD)	64	40.0	-25.8	-2.9	30.6	10.2	26.9	4.4	26.4
Zurich	Actions marchés émergents	MSCI Emerging Markets (TR)	192	35.8	-24.4	-2.0	29.6				
Moyenne arithmétique				37.0	-28.5	-3.4	31.9	9.9	28.5	4.4	26.4

Classes d'Investissement passives

Fondation	Groupe de Placement		2009 Mio.	1 an		3 ans		5 ans		10 ans	
	Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf	Risque	Perf	Risque	Perf	Risque
FWI	Actions Marchés Emergent	MSCI EM (r)	25	37.8	-22.1	-0.7	28.9	11.5	25.6	5.4	25.4
Moyenne arithmétique				37.8	-22.1	-0.7	28.9	11.5	25.6	5.4	25.4

Immobilier étranger

Basé sur le VNI

Fondation	Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
	Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf	Perf	Perf
AFIAA	Global Real Estate 1)	Pas d'indice	539	-9.6	-4.5	-2.4		
Testina	Testina A	Cust. Index	273	-12.4	-21.7	-5.2		
Testina	Testina B	Cust. Index	45	-9.6	-19.0			
Moyenne arithmétique				-10.5	-15.1	-3.8		

Pas basé sur le VNI

Fondation	Groupe de Placement		Mio.	2009	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre
	Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf	Perf	Perf
IST	Immo Optima Europa	GPR 250 Eur. Index (UK capped 20%)	43	9.8	-40.1	-22.6		
Swisscanto Avant	Immeubles étrangers	UBS Global Investors Index (cust)	172	-2.4	-39.2			
Testina	Testina C	Cust. Index	23	-2.3	-39.5			
UBS	Immeubles étrangers	FTSE EPRA/NAREIT Developed Index hdgd in CHF (TR)	35	1.4	-37.2	-18.9	-3.4	2.9
UBS 2	AST 2 Global Real Estate Securities	FTSE EPRA/NAREIT Developed Index hdgd in CHF (TR)	123	1.7	-36.9	-18.4		
Zürich	Immobiliers Global	UBS Global Investors Cust. Index	145	-3.0	-38.9			
Moyenne arithmétique				0.9	-38.6	-20.0	-3.4	2.9

1): Au 31.03.2009 sur 6, 12, 36 mois

Hedge Funds (hedged en CHF)

Classes d'Investissement actives

Fondation	Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
	Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque
Avadis	Hedge Fund 1)	Kein Index	146	-2.3	-10.7	-3.6 6.6	0.0 6.0	
IST	Delta Global CHF FoHF 1)	Pas d'indice	52	-2.8	-34.5			
Prisma	Alternatif - Profil Conservateur 1) 2)	Pas d'indice	82	5.2	-15.7	-3.2 7.6	-0.7 6.3	
Prisma	Alternatif - Profil Dynamique 1) 2)	Pas d'indice	52	4.8	-17.4	-2.4 8.2	1.4 8.0	
Moyenne arithmétique				1.2	-19.6	-3.1 7.5	0.2 6.8	

Classes d'Investissement passives

Fondation	Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
	Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque
CSF	Hedge Fund CHF 1) 2)	CS Tremont AllHedge Index	37	4.1	-26.6	-10.3 10.6	-4.1 8.9	
Zurich	Hedge Fund CHF 1) 2)	FTSE Hedge Index	599	0.5	-11.6	-2.4 5.6		
Moyenne arithmétique				2.3	-19.1	-6.4 8.1	-4.1 8.9	

1): Au 31.05.2009 sur 6, 12, 36, 60 mois

2): Fund of Fund

3ème Partie: Comparaison des autres groupes de placement

30 juin 2009

Avadis

Classes d'Investissement actives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque
Actions Monde hedged	MSCI World ex CH	32	4.1	-28.3			
Actions Monde hedged 2	MSCI World ex CH	820	4.3				
Immobilier Asien Pazifik	FTSE EPRA NAREIT Asia Total Return	27	29.0	-16.0			
Immobilier Europa	FTSE EPRA NAREIT Europe Net Total Return	43	7.7	-34.6	-21.7	26.3	-3.7 22.8
Immobilier Nordamerika	FTSE EPRA NAREIT Nordamerika (TR)	3	-6.2	-36.8	-20.8	35.3	-4.4 29.8
Immobilier Nordamerika 2	FTSE EPRA NAREIT Nordamerika (TR)	36	-5.7				
Private Equity Welt I	Pas d'indice	26	-24.5	-26.9	-3.3	27.2	6.0 22.5
Private Equity Welt II	Pas d'indice	39	-19.2	-18.6	-2.8	21.6	6.9 19.0
Private Equity Welt III	Pas d'indice	34	-18.3	-17.8	-1.6	19.8	5.1 18.0
Private Equity Welt IV	Pas d'indice	45	-26.2	-24.5	-10.1	18.9	
Private Equity Welt V	Pas d'indice	36	-14.9	-16.4			
Private Equity Welt VI	Pas d'indice	18	-10.5	-12.5			
Private Equity Welt VII	Pas d'indice	5	-9.1				
Private Equity Nordamerika	Pas d'indice	32	-23.7	-26.3	-7.7	20.1	0.3 18.1

Classes d'Investissement passives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque
Obligations en monnaies étrangères hedged	Citigroup WGBI ex CH, hedged in CHF	911	-1.4	6.2	3.3 3.4	2.3 3.1	

AWI

Classes d'Investissement actives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque
Active Balanced	LPP taux minimal +2% + 2%	38	-0.2	-1.3	0.9 3.1		

Bâloise

Classes d'Investissement actives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque
Eurostock Dynamic Hedge	DJ EuroStoxx 50	16	4.9	-38.6	-14.1	27.7	

CSF & CSF 2

Classes d'Investissement actives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque
Obligations Short Term CHF	SBI 1-3 TR	50	1.8	2.6	1.9	2.5	
Obligations Plus	SBI Gesamt	74	2.9	5.5	2.3	3.6	
Obligations Plus I	SBI Gesamt	56	2.9	5.6	2.4	3.6	
Obligations Mid Yield CHF	SBI Gesamt	239	2.0	4.0	1.4	3.5	1.7 2.9
Obligations Mid Yield CHF I	SBI Gesamt	76	2.1	4.2	1.5	3.5	
CSA Mezzanine	SBI AAA-BBB (TR)	64	-0.5	5.4	3.0	2.2	
Inflation-linked Bonds CHF	Customized Benchmark CSA	348	4.1	1.7	1.5	3.8	1.8 3.3
Inflation-linked Bonds EUR	Customized Benchmark CSA	63					
Obligations étrang. ME I	JPM Global Traded	221	0.5	9.3	2.5	7.8	
Obligations EUR I	JPM EMU Bondindex	122	4.2	3.6	2.8	7.5	
Obligations USD I	JPM USD Traded	15	0.7	11.9	2.1	11.2	
Obligations High Yield USD	Merrill Lynch GHY US Master II	21	29.0	-2.7	-4.7	18.9	-1.1 15.6
Obligations GBP	JPM GBP Traded	33	19.7	-9.1	-5.2	14.6	-1.1 11.8 1.5 9.8
Small & Mid Cap Switzerland I	SPI Extra	23	11.4	-28.0			
Actions Europe I	MSCI Europe ex CH (r)	38	9.3	-32.7	-12.9	22.1	
Actions Dragons d'Asie	MSCI AC FE F. ex J.	45	39.2	-17.3	-1.2	31.4	5.7 26.6 0.0 25.9
Mixta-LPP Basic I	Cust. Index	91	1.4	5.2	3.6	1.1	3.3 1.0
Mixta-LPP I	Cust. Index	131	2.8	-5.2			
Hypothèques Suisse	SBI 1-3 Jahre	1617	1.1	5.3	3.2	1.2	2.5 1.1 3.0 1.1
Hedge Funds USD 1)	HFRI FoHF Composite Index	5	-1.6	-25.0	-13.0	14.2	-5.8 12.6
Insurance Linked Strategies 1)	3 Mth Libor CHF plus 350 BP	39	1.7	1.1	4.4	40.3	3.1 31.1
Real Estate Switzerland Pooled Investments I	Customized Benchmark CSA Real Estate	87	7.9	2.5			
USA Enhanced I	MSCI USA (r)	22	5.7	-21.3	-13.6	21.0	
Private Equity	Pas d'indice	322	-19.5	-29.1	-5.3	9.6	0.7 8.1

1): Au 31.05.2009 sur 6, 12, 36, 60 mois

Classes d'Investissement passives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque	
Swiss-Index I	SMI (r)	48	0.5	-20.0	-8.8	16.4	1.3	14.3
Euro-Index I	MSCI Europe ex CH (r)	71	10.8	-30.6	-12.1	24.2	-0.7	20.0
Nippon-Index I	MSCI Japan (r)	44	5.7	-17.9	-14.0	22.0	-3.9	20.1
World-Index I	MSCI World ex CH	27	9.1	-24.5	-11.6	21.5		
US-Index I	MSCI USA (r)	118	6.0	-21.7	-11.8	21.3		

IST & IST 2

Classes d'Investissement actives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans			
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque			
Governo Bond	Cust. Index	310	3.7	6.1	2.4	7.3	2.9	6.4	3.0	5.4
Europe Small Mid	HSBC Smaller Europe (+UK)	41	22.9	-30.8	-11.3	25.7	1.5	21.5	0.6	20.5
Global Avenir	MSCI World	5	18.3	-33.6						
Asia Pacific Small Mid Caps	MSCI Asia Pacific Small Cap Index	2	15.3	-25.9						
Immo Optima Asien Pazifik	GPR General Asia Net	1	30.6	-11.7						
Mixta Protector 1)	Pas d'indice	37	-1.3	-5.5	-0.7	4.0				
IST 2 Mixta Optima Balanced	Cust. Index	24	4.4	-1.0						

1): Au 31.05.2009 sur 6, 12, 36 mois

Classes d'Investissement passives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans			
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque			
Globe Index G	MSCI World ex CH (nD)	469	9.1	-24.3	-11.2	20.9				
Europe Index G	MSCI Europe ex CH (nD)	52	10.7	-30.6	-11.9	23.7				
America Index G	MSCI North America (nD)	41	7.5	-22.1	-11.1	20.6				
Pacific Index	MSCI Pacific Free (nD)	61	11.6	-19.4	-11.0	20.1	-0.9	18.0	-3.0	18.9
Pacific Index G	MSCI Pacific Free (nD)	75	11.7	-19.2	-10.8	20.1				

Prisma

Classes d'Investissement actives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque
Actions Asie	MSCI AC Asia ex-Japon TR net	28	37.2	-10.3	-1.7 28.4	6.7 24.2	
Actions Grande Chine	MSCI Golden Dragon TR net	26	45.6	-2.4	6.4 29.1	10.8 24.1	
Actions Brésil	Brazil Bovespa Stock Index	12	57.7	-35.9			
Actions Russie	Russia RTS Index	5	19.7	-61.2			
Actions Inde	Bombay Stock Exchange	6	48.6	6.8			
Actions Chine Gao Chan	MSCI AC Zhong HUA TR net	32	51.4	8.0			

Renaissance

Groupe de Placement		Mio. 4)	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque
Renaissance Technologies 1 (1)	Pas d'indice	72	-6.9	-9.7	-2.3 4.2	-2.5 3.6	
Renaissance Technologies 2 (2)	Pas d'indice	50	-10.2	-9.6	-2.2 9.7		
Renaissance Technologies 3 (3)	Pas d'indice	67					

1): Fonds de private-equity lancé en 1998 - souscriptions closes

2): Fonds de private-equity lancé en 2004 - souscriptions closes

3): Fonds de private-equity lancé en 2007 - souscriptions closes

4): Fonds souscrits

Sarasin

Classes d'Investissement actives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf Risque
Obli CHF Couv. Dyn.	SBI Domestic Non-Government AAA-A	97	0.9	5.1	3.1 2.4	2.7 2.1	2.5 2.1
Durable Obligations en CHF	SBI Gesamt AAA-BBB	70	1.7	7.4	2.6 3.1	2.2 2.8	
Aktien Global Thematic	MSCI World Index	89	6.6				

Swisscanto

Classes d'Investissement actives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans			
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf	Risque		
Obligations Europe Plus	Cust. Index	428	9.8	3.8	2.0	8.8	3.4	7.2	3.8	6.0
Obligations Europe Max	LB Pan European HY BB	5	20.0	-2.6	0.6	12.6	2.6	10.0		
Obligations Dollar Plus	Cust. Index	78	5.4	10.8	2.6	11.1	3.0	10.4	3.1	9.6
Obligations Dollar Max	LB Pan US Aggregate HY BB	11	12.9	11.7	1.3	12.5	2.1	11.3		
Obligations Yen	JPM Yen Tr.	43	-2.9	17.1	2.7	12.7	0.4	10.8	-0.1	11.1
Actions Asie/Pacifique	MSCI AC Asia Pacific Free	93	17.6	-16.1	-8.3	22.1	1.3	19.3	-2.3	19.7
Actions Asie/Pacifique Value	MSCI AC Asia Pacific Free	21	22.7	-12.1	-6.6	22.3	2.3	19.2		
Actions Asie/Pacifique Growth	MSCI AC Asia Pacific Free	6	9.7	-22.5	-10.7	22.7	-0.2	19.9		
LPP Oeko WT	Cust. Index	6	5.2	-9.7						

Swisscanto Avant

Classes d'Investissement actives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans	5 ans	10 ans			
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf Risque	Perf Risque	Perf	Risque		
Oeko-Invest	MSCI World	81	9.5	-30.4	-10.0	23.8	1.7	20.2	-1.6	20.0
LPP Oeko	Cust. Index	33	5.3	-9.2	-0.3	10.6	4.2	9.1		

Classes d'Investissement actives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans		5 ans		10 ans	
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf	Risque	Perf	Risque	Perf	Risque
MM Obli suisses & étrangères CHF	SBI Gesamt, AAA-BBB (Total Return)	26	2.1	6.6	2.3	3.7	2.1	3.1		
Obligations en ME Europe	JPM European GBI Traded	51	4.5	5.3	2.8	7.8	3.7	6.4	3.8	5.4
Obligations en ME (hedged en CHF)	LB Global Aggr. Idx (hedged in CHF)	58	0.4	5.7	1.8	2.6				
MM Obligations en ME Global	JPM Global Traded	1	0.9	10.7	3.0	8.3	2.5	7.3		
SPI® Enhanced	SPI (TR)	7	1.6	-21.6						
MM Actions Suisse	SPI (TR)	2	-0.2	-21.7	-8.2	16.4	1.4	14.3		
Actions Euroland	MSCI EMU (nD)	58	5.9	-29.2	-12.6	24.7	-0.5	20.5	-2.7	21.7
Actions Pacifique	MSCI AC Pacific ex Japan (gD)	47	37.7	-15.7	-1.4	28.2	8.8	23.8	3.6	23.3
MM Actions Global	MSCI World ex CH (nD)	2	7.2	-25.6	-13.5	20.2	-4.8	17.2		
Actions Eco-Performance Global	MSCI World	8	15.0	-18.0	-11.1	21.8	-3.1	18.1	-4.0	19.7
Actions Marchés émergents Asie	MSCI EMMA Asia (gD)	7	38.6	-11.7	-0.9	29.3	9.0	25.6	2.6	27.0

UBS Investment Foundation for Alternative Investments

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans		5 ans		10 ans	
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf	Risque	Perf	Risque	Perf	Risque
Infrastructure ¹⁾	customized	398	n.m.							

1): fortune: groupe d'investissement PM Infrastructure et investisseurs individuels

Zurich

Classes d'Investissement actives

Groupe de Placement		Mio.	2009	1 an	3 ans		5 ans		10 ans	
Dénomination	Indice		Perf	Perf	Perf	Risque	Perf	Risque	Perf	Risque
Obligations CHF 15+	SBI 15+	665	-4.7	7.2	1.5	10.0				
Obligations Crédit 100	Merrill Lynch Cust. Index	1019	7.5	4.4	0.4	4.8	0.7	3.9		

4ème partie: Annexes

30 juin 2009

Fortune totale

Fondation	Fortune totale de la fondation de placement (Mio. CHF, sans doubles comptabilisations et dettes totales)	Evolution de la fortune totale depuis le 31 décembre 2008
Allianz	809	+ 1.1%
Avadis	6433	+ 3.3%
FWI	1123	- 5.8%
Bâloise	1202	+ 0.6%
CSF 2)	16450	+ 2.2%
IST	5089	+ 12.3%
Helvetia	259	- 0.4%
Prisma	423	+ 12.5%
Renaissance 1)	189	+ 2.7%
Sarasin	873	+ 3.1%
Swisscanto 3)	14897	+ 3.0%
Swiss Life	619	- 1.4%
UBS 4)	5423	- 1.9%
Zurich	9598	+ 8.5%
Sous-total	63373	+ 2.7%

1) Renaissance Technologies 1 + Renaissance Technologies 2 + Renaissance Technologies 3

2): CSA + CSA 2

3): Swisscanto + Swisscanto Avant

4): UBS + UBS Investment Foundation 2 + UBS Investment Foundation for Alternative Investments

Fondations de Placement

Fondation	Fortune totale de la fondation de placement (Mio. CHF, sans doubles comptabilisations et dettes totales)	Evolution de la fortune totale depuis le 31 décembre 2008
AFIAA 5)	539	- 4.1%
ASSETIMMO	1343	+ 2.2%
HIG	492	+ 4.2%
Imoka	310	+ 20.9%
Pensimo	787	- 0.3%
Turidomus	2380	- 2.5%
Testina	341	- 10.0%
Sous-total	6199	- 1.3%
Total	69572	+ 2.3%

5): Fortune au 31.03.2009 évolution par rapport au 31.12.2008

Fournisseurs d'indice (Abréviations)

Citi	Citigroup (anciennement: Salomon Brothers)
DJ	Dow Jones
JPM	JP Morgan
MSCI	Morgan Stanley Capital International
SBI	Swiss Bond Index de la SWX Swiss Exchange
SMI	Swiss Market Index de la SWX Swiss Exchange
SPI	Swiss Performance Index de la SWX Swiss Exchange
(r)	reinvested
(TR)	Total Return
(nD)	net Dividend
(gD)	gross Dividend

Membres de la CAFP

AFIAA	Anlagestiftung für Immobilienanlagen im Ausland Gartenhofstrasse 17, 8004 Zürich	www.afiaa.com Téléphone 044 245 49 44
Allianz	Allianz Suisse Fondation de Placement Bleicherweg 19, 8002 Zürich	www.allianz-suisse.ch Téléphone 058 358 71 11
Avadis	Avadis Vorsorge AG, Bruggerstrasse 61a, 5401 Bader	www.avadis.ch Telefon 058 585 19 53
FWI	Fondation Winterthur pour le placement de capitaux d'institutions de prévoyance (FWI), Affolternstrasse 42, Postfach 5143, 8050 Zürich	www.fwi-fondation.ch Téléphone 043 299 12 07
ASSETIMMO	Fondation de placements immobiliers Badenerstrasse 329, 8003 Zürich	www.assetimmo.ch Téléphone 044 404 20 42
Baloise	Fondation de placement de la Bâloise assurance Lautengartenstrasse 6, 4002 Basel	www.baloise.ch Téléphone 061 285 80 72
CSF	Credit Suisse Fondation de Placement 2, ABPA 6, Sihlcity-Kalanderstrasse 4, 8070 Zürich	www.credit-suisse.com/anlagestiftung Téléphone 044 333 48 48
CSF 2	Credit Suisse Fondation de Placement 2ième pilier, ABPA 6, Sihlcity-Kalanderstrasse 4, 8070 Zürich	www.credit-suisse.com/anlagestiftung Téléphone 044 333 48 48
HIG	HIG Immobilien Anlage Stiftung Löwenstrasse 25, 8001 Zürich	www.hig.ch Téléphone 044 213 61 62
Imoka	Imoka Fondation de Placement Obstgartenstrasse 19, Postfach 538, 8035 Zürich	www.imoka.ch Téléphone 043 255 21 00
IST	Fondation d'investissement pour la prévoyance en faveur du personnel, Steinstrasse 21, Postfach, 8036 Zürich	www.istfunds.ch Téléphone 044 455 37 00
Helvetia	Helvetia Fondation de Placement St. Alban-Anlage 26, 4002 Basel	www.helvetia-anlagestiftung.ch Téléphone 058 280 10 00
Pensimo	Pensimo Fondation de Placement Obstgartenstrasse 19, Postfach 538, 8035 Zürich	www.pensimo.ch Téléphone 043 255 21 00
Prisma	Prisma Fondation c/o KIS SA, Place St-Louis 1, CP, 1110 Morges 1	www.prisma-fondation.ch Téléphone 021 804 80 70
Renaissance	Renaissance PME private-equity, Parc scientifique EPFL, PSE-C, 1015 Lausanne	www.renaissance-pme.ch Téléphone 021 693 83 88
Sarasin	Sarasin Fondation de Placement Elisabethenstrasse 62, Postfach, 4002 Basel	www.sarasin.ch Téléphone 061 277 79 10
Swisscanto	Swisscanto Anlagestiftung Waisenhausstrasse 2, Postfach, 8021 Zürich	www.swisscanto.ch/anlagestiftung Téléphone 058 344 45 88
Swisscanto Avant	Swisscanto Anlagestiftung Avant Waisenhausstrasse 2, Postfach, 8021 Zürich	www.swisscanto.ch/anlagestiftung Téléphone 058 344 45 88
Swiss Life	Fondation de placement Swiss Life General-Guisan-Quai 40, Case postale, 8022 Zürich	www.swisslife.ch/anlagestiftung Téléphone 043 284 79 79
Testina	Testina Fondation de Placement Obstgartenstrasse 19, Postfach 538, 8035 Zürich	www.testina.ch Téléphone 043 255 21 00
Turidomus	Turidomus Fondation de Placement Obstgartenstrasse 19, Postfach 538, 8035 Zürich	www.turidomus.ch Téléphone 043 255 21 00
UBS	Fondation UBS pour l'investissement du patrimoine d'institutions de prévoyance, Postfach, 8098 Zürich	www.ubs.com/anlagestiftung Téléphone 044 234 90 80
UBS 2	UBS Investment Foundation 2 Postfach, 8098 Zürich	www.ubs.com/anlagestiftung Téléphone 044 234 90 80
UBS 3	UBS Investment Foundation for Alternative Investments, Postfach, 8098 Zürich	Telefon 044 234 90 80
Zurich	«Zurich» Fondation de Placement Case Postale, 8085 Zurich	www.zurich-fondation.ch Téléphone 044 628 78 88
CAFP	Conférence des Administrateurs de Fondations de Placement, Sihlcity- Kalanderstrasse 4, 8070 Zürich	www.cafp.ch Téléphone 044 215 47 17

Note Explicative

Comparaison de performance des fondations de placement

La comparaison de performance mesure l'évolution de la valeur d'une part avec réinvestissement des revenus au moment de leur distribution. Le prix d'émission à la date d'échéance, les revenus, ainsi que le prix d'émission à la date de la distribution sont les valeurs prises en compte pour la mesure de performance. Le prix d'émission d'une part a été employé jusqu'en décembre 2003 pour les fondations qui facturaient une commission. Le changement vers la valeur nette d'inventaire depuis janvier 2004 affecte les fonds d'Allianz Suisse, Credit Suisse, IST et Swisscanto (anciennement Prevista).

La mesure de performance est effectuée pour l'année en cours (YTD) ainsi que la performance sur 1, 3, 5 et 10 ans. Pour le rapport au 31 décembre, la performance indiquée couvre l'année en cours, l'année précédente ainsi que la performance sur 3, 5 et 10 ans. La performance indiquée correspond au taux de rendement annualisé (moyenne géométrique), sauf pour la mesure de la performance de l'année en cours où il s'agit du taux de rendement de la période (non-annualisé).

Pour chaque groupe de placement, la moyenne des performances est la moyenne arithmétique (sans pondération).

La performance est calculée uniquement dans des groupes de placement homogènes. Les fonds LPP sont répertoriés en 4 catégories de placement différentes. La répartition s'effectue en fonction du pourcentage d'actions contenu dans chaque produit. Par ailleurs, seuls les fonds qui respectent les limites de placement OPP 2 sont pris en compte.

Calcul du risque des fondations d'investissement

Le risque correspond à l'écart-type annualisé des taux de rendement mensuels. On obtient l'écart-type annualisé en multipliant l'écart-type mensuel par la racine carrée de 12. Pour le calcul des rendements mensuels, on considère la valeur nette valable à la fin du mois ou à la date d'échéance.

Fondations d'investissements immobiliers

La VNI des groupes de placements immobilières basé sur la VNI est établie sur la base d'évaluations périodiques. La VNI des fondations immobilières non basé sur la VNI est influencée par l'évolution des cours boursiers.

Pour les fondations d'investissements immobiliers qui ne publient pas de NAVs mensuels, une formule d'approximation est utilisée afin d'éviter de trop fortes variations annuelles dans la performance. De plus, le paiement du dernier exercice annuel ou le dividende budgétisée servira d'approximation aux revenus de l'année suivante et sera distribué sur une base mensuelle. Comme la valeur d'inventaire définitive utilisé pour le calcul de la performance n'est disponible qu'à la fin de chaque exercice, de possibles corrections dans la performance sont possibles. La performance hypothétique est indépendante du prix effectif, auquel les parts peuvent être acquises. Puisque des fluctuations de la valeur d'inventaires ne représente pas tous les risques liés aux investissements immobiliers, aucune donnée de risque n'est présentée pour cette classe d'actifs.

Fortune des produits

Pour chaque produit, le montant sous gestion est indiqué. Toutes les valeurs sont en millions de CHF et sont fournies par les fondations.