

Table d'allocation d'actifs

1985-2023	100 % Obligations	90 / 10	80 / 20	70 / 30	60 / 40	50 / 50	40 / 60	30 / 70	20 / 80	10 / 90	100 % Actions
1985	-0,7 %	1,0 %	2,6 %	4,3 %	5,9 %	7,6 %	9,2 %	10,8 %	12,5 %	14,1 %	15,8 %
1986	1,8 %	3,5 %	5,2 %	6,8 %	8,5 %	10,2 %	11,9 %	13,6 %	15,2 %	16,9 %	18,6 %
1987	-2,5 %	-2,7 %	-2,8 %	-3,0 %	-3,1 %	-3,3 %	-3,5 %	-3,6 %	-3,8 %	-3,9 %	-4,1 %
1988	16,7 %	18,2 %	19,7 %	21,2 %	22,7 %	24,2 %	25,7 %	27,2 %	28,7 %	30,2 %	31,7 %
1989	2,4 %	4,0 %	5,6 %	7,2 %	8,8 %	10,4 %	12,0 %	13,6 %	15,2 %	16,8 %	18,4 %
1990	-2,6 %	-5,3 %	-7,9 %	-10,6 %	-13,3 %	-16,0 %	-18,6 %	-21,3 %	-24,0 %	-26,6 %	-29,3 %
1991	19,2 %	19,7 %	20,3 %	20,8 %	21,4 %	21,9 %	22,4 %	23,0 %	23,5 %	24,1 %	24,6 %
1992	17,0 %	15,3 %	13,5 %	11,8 %	10,0 %	8,3 %	6,6 %	4,8 %	3,1 %	1,3 %	-0,4 %
1993	22,3 %	23,5 %	24,7 %	25,9 %	27,1 %	28,3 %	29,5 %	30,7 %	31,9 %	33,1 %	34,3 %
1994	-7,0 %	-6,5 %	-6,0 %	-5,6 %	-5,1 %	-4,6 %	-4,1 %	-3,6 %	-3,2 %	-2,7 %	-2,2 %
1995	14,0 %	14,1 %	14,2 %	14,2 %	14,3 %	14,4 %	14,5 %	14,6 %	14,6 %	14,7 %	14,8 %
1996	6,1 %	7,1 %	8,2 %	9,2 %	10,3 %	11,3 %	12,3 %	13,4 %	14,4 %	15,5 %	16,5 %
1997	13,9 %	15,5 %	17,0 %	18,6 %	20,1 %	21,7 %	23,2 %	24,8 %	26,3 %	27,9 %	29,4 %
1998	8,1 %	9,1 %	10,0 %	11,0 %	11,9 %	12,9 %	13,8 %	14,8 %	15,7 %	16,7 %	17,6 %
1999	12,2 %	15,6 %	19,0 %	22,4 %	25,8 %	29,2 %	32,6 %	36,0 %	39,4 %	42,8 %	46,2 %
2000	8,5 %	7,0 %	5,5 %	4,1 %	2,6 %	1,1 %	-0,4 %	-1,9 %	-3,3 %	-4,8 %	-6,3 %
2001	4,4 %	2,7 %	1,1 %	-0,6 %	-2,2 %	-3,9 %	-5,6 %	-7,2 %	-8,9 %	-10,5 %	-12,2 %
2002	1,4 %	-2,0 %	-5,4 %	-8,8 %	-12,2 %	-15,7 %	-19,1 %	-22,5 %	-25,9 %	-29,3 %	-32,7 %
2003	-4,4 %	-2,9 %	-1,4 %	0,1 %	1,6 %	3,1 %	4,5 %	6,0 %	7,5 %	9,0 %	10,5 %
2004	2,3 %	2,7 %	3,1 %	3,5 %	3,9 %	4,4 %	4,8 %	5,2 %	5,6 %	6,0 %	6,4 %
2005	7,3 %	9,2 %	11,1 %	13,0 %	14,9 %	16,9 %	18,8 %	20,7 %	22,6 %	24,5 %	26,4 %
2006	-5,2 %	-3,9 %	-2,6 %	-1,4 %	-0,1 %	1,2 %	2,5 %	3,8 %	5,0 %	6,3 %	7,6 %
2007	0,0 %	-0,3 %	-0,5 %	-0,8 %	-1,0 %	-1,3 %	-1,5 %	-1,7 %	-2,0 %	-2,3 %	-2,5 %
2008	16,8 %	11,4 %	6,0 %	0,6 %	-4,8 %	-10,3 %	-15,7 %	-21,1 %	-26,5 %	-31,9 %	-37,3 %
2009	-0,7 %	1,9 %	4,6 %	7,2 %	9,8 %	12,5 %	15,1 %	17,7 %	20,3 %	23,0 %	25,6 %
2010	12,4 %	13,2 %	14,0 %	14,8 %	15,6 %	16,5 %	17,3 %	18,1 %	18,9 %	19,7 %	20,5 %
2011	10,1 %	8,8 %	7,6 %	6,3 %	5,1 %	3,8 %	2,5 %	1,3 %	0,0 %	-1,2 %	-2,5 %
2012	-0,2 %	1,2 %	2,6 %	3,9 %	5,3 %	6,7 %	8,1 %	9,5 %	10,8 %	12,2 %	13,6 %
2013	-8,2 %	-5,3 %	-2,3 %	0,6 %	3,6 %	6,5 %	9,4 %	12,4 %	15,3 %	18,3 %	21,2 %
2014	13,4 %	14,0 %	14,6 %	15,1 %	15,7 %	16,3 %	16,9 %	17,5 %	18,0 %	18,6 %	19,2 %
2015	7,7 %	8,0 %	8,3 %	8,6 %	8,9 %	9,2 %	9,4 %	9,7 %	10,0 %	10,3 %	10,6 %
2016	4,7 %	5,3 %	6,0 %	6,6 %	7,2 %	7,9 %	8,5 %	9,1 %	9,7 %	10,4 %	11,0 %
2017	-5,8 %	-4,5 %	-3,1 %	-1,8 %	-0,4 %	0,9 %	2,2 %	3,6 %	4,9 %	6,3 %	7,6 %
2018	4,2 %	3,3 %	2,5 %	1,6 %	0,8 %	-0,1 %	-1,0 %	-1,8 %	-2,7 %	-3,5 %	-4,4 %
2019	7,7 %	9,9 %	12,2 %	14,4 %	16,7 %	18,9 %	21,1 %	23,4 %	25,6 %	27,9 %	30,1 %
2020	1,2 %	1,7 %	2,2 %	2,7 %	3,2 %	3,7 %	4,1 %	4,6 %	5,1 %	5,6 %	6,1 %
2021	0,1 %	3,3 %	6,5 %	9,7 %	12,9 %	16,1 %	19,2 %	22,4 %	25,6 %	28,8 %	32,0 %
2022	-13,3 %	-13,3 %	-13,3 %	-13,2 %	-13,2 %	-13,2 %	-13,2 %	-13,2 %	-13,1 %	-13,1 %	-13,1 %
2023	1,6 %	3,4 %	5,2 %	7,0 %	8,8 %	10,6 %	12,3 %	14,1 %	15,9 %	17,7 %	19,5 %
Rendement Moyen	4,5 %	4,9 %	5,2 %	5,6 %	6,0 %	6,4 %	6,7 %	7,1 %	7,5 %	7,9 %	8,3 %
Volatilité (écart-type)	6,9 %	6,7 %	6,7 %	7,1 %	7,8 %	8,7 %	9,8 %	10,9 %	12,2 %	13,5 %	14,9 %
Plus forte baisse	-20,0 %	-16,0 %	-16,2 %	-18,4 %	-24,1 %	-29,6 %	-34,8 %	-39,8 %	-44,8 %	-49,6 %	-55,7 %
Plus mauvaise année	-13,3 %	-13,3 %	-13,3 %	-13,2 %	-13,3 %	-16,0 %	-19,1 %	-22,5 %	-26,5 %	-31,9 %	-37,3 %
Ratio de Sharpe	0,52	0,61	0,67	0,70	0,70	0,67	0,65	0,62	0,59	0,56	0,54