

Table d'allocation d'actifs – MSCI World et obligations

| Année | 100% FTSE Gov Bond | 90/10 | 80/20 | 70/30 | 60/40 | 50/50 | 40/60 | 30/70 | 20/80 | 10/90 | 100% MSCI World |
|------------------------------------|-----------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------------------|
| 1985 | -0,8% | 1,0% | 2,7% | 4,5% | 6,2% | 8,0% | 9,8% | 11,5% | 13,3% | 15,0% | 16,8% |
| 1986 | 1,8% | 3,6% | 5,3% | 7,1% | 8,8% | 10,6% | 12,4% | 14,1% | 15,9% | 17,6% | 19,4% |
| 1987 | -2,5% | -2,6% | -2,7% | -2,8% | -2,9% | -3,1% | -3,2% | -3,3% | -3,4% | -3,5% | -3,6% |
| 1988 | 16,7% | 18,3% | 19,8% | 21,4% | 23,0% | 24,6% | 26,1% | 27,7% | 29,3% | 30,8% | 32,4% |
| 1989 | 2,4% | 4,1% | 5,7% | 7,4% | 9,0% | 10,7% | 12,3% | 14,0% | 15,6% | 17,3% | 18,9% |
| 1990 | -2,6% | -5,2% | -7,9% | -10,5% | -13,1% | -15,8% | -18,4% | -21,0% | -23,6% | -26,3% | -28,9% |
| 1991 | 19,2% | 19,8% | 20,4% | 21,0% | 21,6% | 22,3% | 22,9% | 23,5% | 24,1% | 24,7% | 25,3% |
| 1992 | 17,0% | 15,3% | 13,6% | 12,0% | 10,3% | 8,6% | 6,9% | 5,2% | 3,6% | 1,9% | 0,2% |
| 1993 | 22,3% | 23,6% | 24,8% | 26,1% | 27,4% | 28,7% | 29,9% | 31,2% | 32,5% | 33,7% | 35,0% |
| 1994 | -7,0% | -6,5% | -5,9% | -5,4% | -4,9% | -4,4% | -3,8% | -3,3% | -2,8% | -2,2% | -1,7% |
| 1995 | 14,0% | 14,1% | 14,3% | 14,4% | 14,5% | 14,7% | 14,8% | 14,9% | 15,0% | 15,2% | 15,3% |
| 1996 | 6,1% | 7,2% | 8,3% | 9,4% | 10,5% | 11,6% | 12,6% | 13,7% | 14,8% | 15,9% | 17,0% |
| 1997 | 13,9% | 15,5% | 17,1% | 18,7% | 20,3% | 21,9% | 23,5% | 25,1% | 26,7% | 28,3% | 29,9% |
| 1998 | 8,1% | 9,1% | 10,1% | 11,1% | 12,1% | 13,1% | 14,0% | 15,0% | 16,0% | 17,0% | 18,0% |
| 1999 | 12,2% | 15,7% | 19,1% | 22,6% | 26,0% | 29,5% | 32,9% | 36,4% | 39,8% | 43,3% | 46,7% |
| 2000 | 8,5% | 7,1% | 5,6% | 4,2% | 2,7% | 1,3% | -0,2% | -1,7% | -3,1% | -4,6% | -6,0% |
| 2001 | 4,4% | 2,8% | 1,1% | -0,5% | -2,1% | -3,8% | -5,4% | -7,0% | -8,6% | -10,3% | -11,9% |
| 2002 | 1,4% | -2,0% | -5,4% | -8,7% | -12,1% | -15,5% | -18,9% | -22,3% | -25,6% | -29,0% | -32,4% |
| 2003 | -4,4% | -2,9% | -1,3% | 0,3% | 1,8% | 3,4% | 4,9% | 6,5% | 8,0% | 9,6% | 11,1% |
| 2004 | 2,3% | 2,8% | 3,2% | 3,7% | 4,1% | 4,6% | 5,1% | 5,5% | 6,0% | 6,4% | 6,9% |
| 2005 | 7,3% | 9,3% | 11,2% | 13,2% | 15,2% | 17,2% | 19,1% | 21,1% | 23,1% | 25,0% | 27,0% |
| 2006 | -5,1% | -3,8% | -2,5% | -1,1% | 0,2% | 1,5% | 2,8% | 4,1% | 5,5% | 6,8% | 8,1% |
| 2007 | 0,0% | -0,2% | -0,4% | -0,6% | -0,8% | -1,0% | -1,2% | -1,4% | -1,6% | -1,8% | -2,0% |
| 2008 | 16,8% | 11,4% | 6,1% | 0,7% | -4,7% | -10,1% | -15,4% | -20,8% | -26,2% | -31,5% | -36,9% |
| 2009 | -0,7% | 2,0% | 4,7% | 7,4% | 10,1% | 12,9% | 15,6% | 18,3% | 21,0% | 23,7% | 26,4% |
| 2010 | 12,4% | 13,3% | 14,1% | 15,0% | 15,9% | 16,8% | 17,6% | 18,5% | 19,4% | 20,2% | 21,1% |
| 2011 | 10,1% | 8,9% | 7,7% | 6,5% | 5,3% | 4,1% | 2,9% | 1,7% | 0,5% | -0,7% | -1,9% |
| 2012 | -0,2% | 1,3% | 2,7% | 4,2% | 5,6% | 7,1% | 8,5% | 10,0% | 11,4% | 12,9% | 14,3% |
| 2013 | -8,2% | -5,2% | -2,2% | 0,8% | 3,8% | 6,9% | 9,9% | 12,9% | 15,9% | 18,9% | 21,9% |
| 2014 | 13,4% | 14,0% | 14,7% | 15,3% | 16,0% | 16,6% | 17,2% | 17,9% | 18,5% | 19,2% | 19,8% |
| 2015 | 7,7% | 8,1% | 8,4% | 8,8% | 9,1% | 9,5% | 9,8% | 10,2% | 10,5% | 10,9% | 11,2% |
| 2016 | 4,7% | 5,4% | 6,1% | 6,8% | 7,5% | 8,2% | 8,9% | 9,6% | 10,3% | 11,0% | 11,7% |
| 2017 | -5,8% | -4,4% | -3,0% | -1,6% | -0,2% | 1,2% | 2,6% | 4,0% | 5,4% | 6,8% | 8,2% |
| 2018 | 4,2% | 3,4% | 2,6% | 1,8% | 1,0% | 0,2% | -0,7% | -1,5% | -2,3% | -3,1% | -3,9% |
| 2019 | 7,7% | 10,0% | 12,3% | 14,7% | 17,0% | 19,3% | 21,6% | 23,9% | 26,3% | 28,6% | 30,9% |
| 2020 | 1,2% | 1,8% | 2,3% | 2,9% | 3,4% | 4,0% | 4,5% | 5,1% | 5,6% | 6,2% | 6,7% |
| 2021* | -0,9% | 1,8% | 4,5% | 7,3% | 10,0% | 12,7% | 15,4% | 18,1% | 20,9% | 23,6% | 26,3% |
| Rendement Moyen | 5,1% | 5,6% | 6,1% | 6,6% | 7,0% | 7,4% | 7,8% | 8,1% | 8,4% | 8,7% | 8,9% |
| Volatilité (écart-type) | 6,9% | 6,6% | 6,7% | 7,1% | 7,7% | 8,7% | 9,7% | 10,9% | 12,2% | 13,6% | 15,0% |
| Plus forte baisse | -14,1% | -14,2% | -16,1% | -18,3% | -23,9% | -29,3% | -34,4% | -39,4% | -44,4% | -49,1% | -53,9% |
| Plus mauvaise année | -8,2% | -6,5% | -7,9% | -10,5% | -13,1% | -15,8% | -18,9% | -22,3% | -26,2% | -31,5% | -36,9% |
| Ratio de Sharpe | 0,62 | 0,72 | 0,78 | 0,8 | 0,79 | 0,76 | 0,72 | 0,68 | 0,64 | 0,61 | 0,58 |

* année en cours