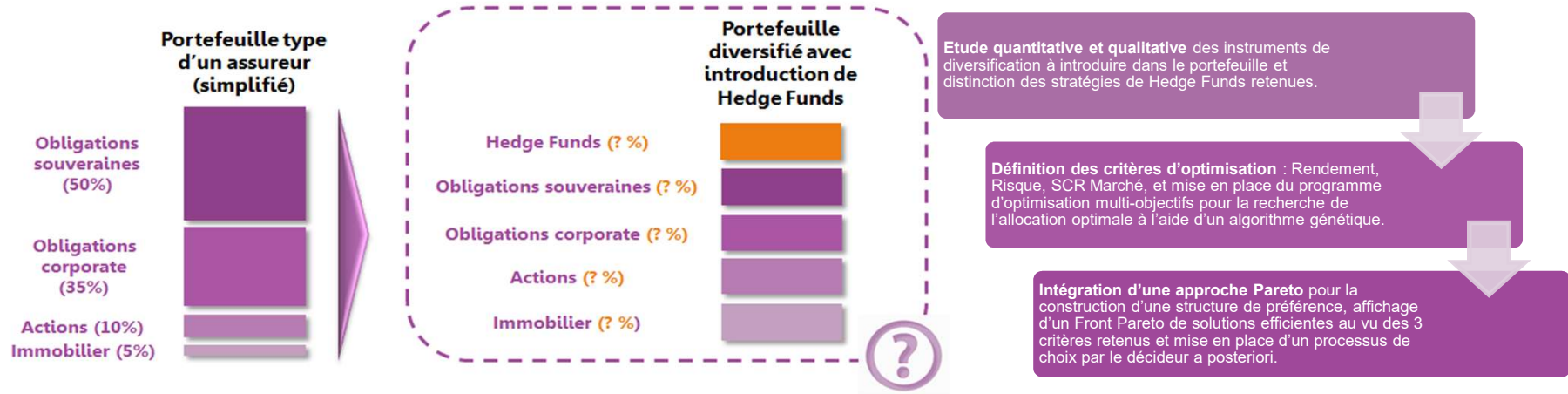


Allocation d'actifs sous Solvabilité 2

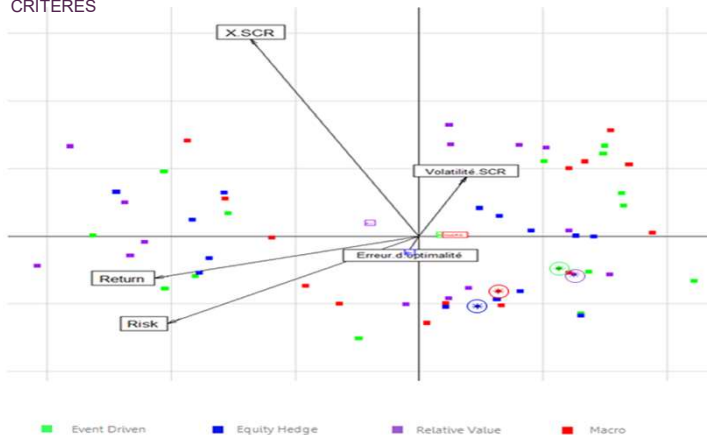
La modélisation d'une allocation stratégique sous le triptyque SCR/Rendement/Risque : un exemple de démarche méthodologique et d'analyse de résultats.

DÉMARCHE MÉTHODOLOGIQUE



ANALYSE DES RÉSULTATS

ÉTUDE DES ALLOCATIONS OPTIMALES PAR TYPE DE STRATÉGIE, SELON LES 3 CRITÈRES



CONSTITUTION D'UN INDICE SYNTHÉTIQUE DES STRATÉGIES ÉTUDIÉES ET OPTIMISATION DE L'ALLOCATION DU PORTEFEUILLE DIVERSIFIÉ AVEC DES HEDGE FUNDS.

