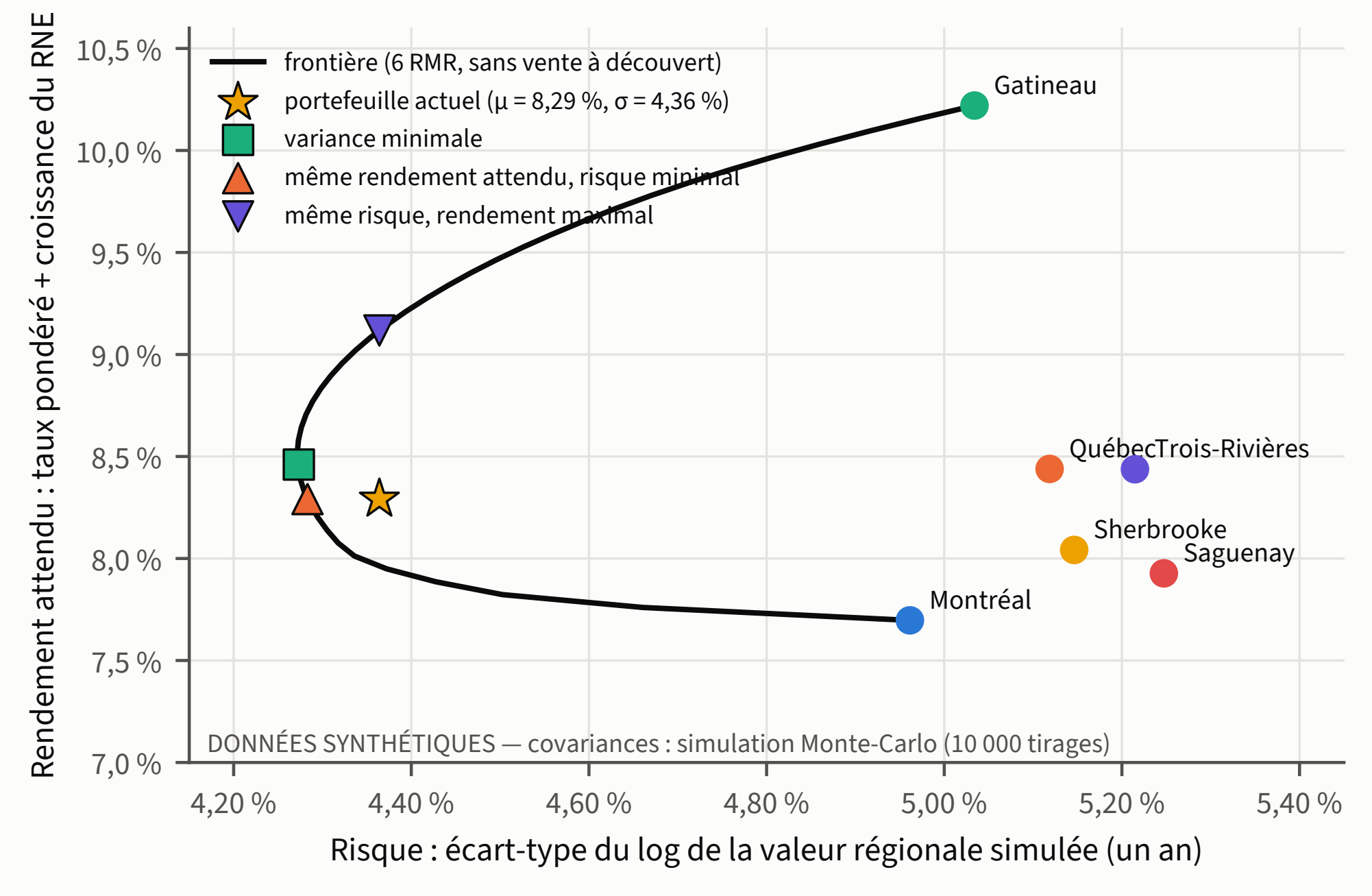

frontière (6 RMR, sans vente à découvert)
portefeuille actuel (μ = 8,29 %, σ = 4,36 %)
variance minimale
même rendement attendu, risque minimal
même risque, rendement maximal
Gatineau
QuébecTrois-Rivières
Sherbrooke
Saguenay
Montréal
DONNÉES SYNTHÉTIQUES — covariances : simulation Monte-Carlo (10 000 tirages)
Rendement attendu : taux pondéré + croissance du RNE
10,5 %
10,0 %
9,5 %
9,0 %
8,5 %
8,0 %
7,5 %
7,0 %
4,20 %
4,40 %
4,60 %
4,80 %
5,00 %
5,20 %
5,40 %
Risque : écart-type du log de la valeur régionale simulée (un an)