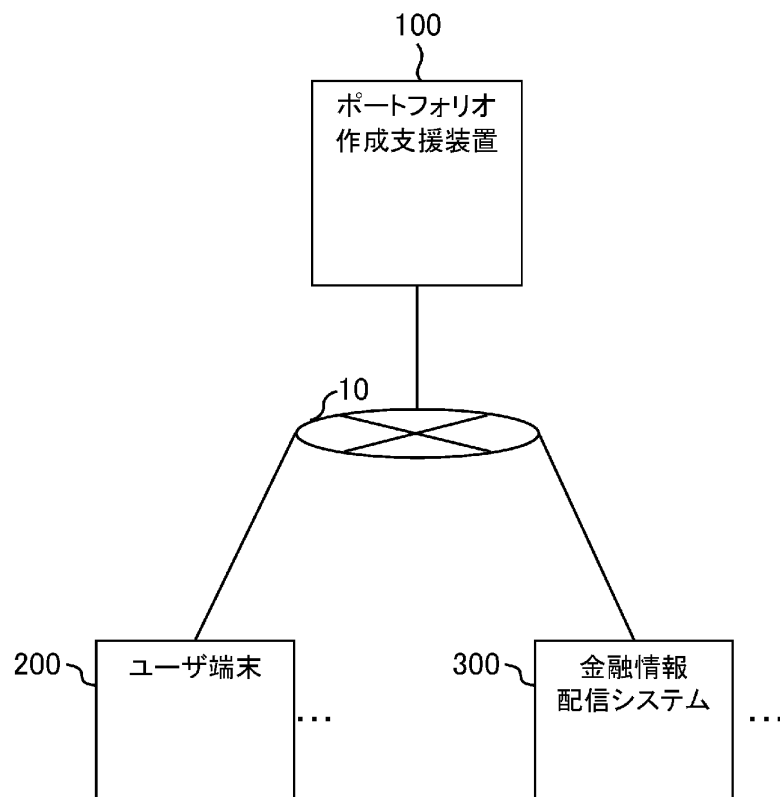
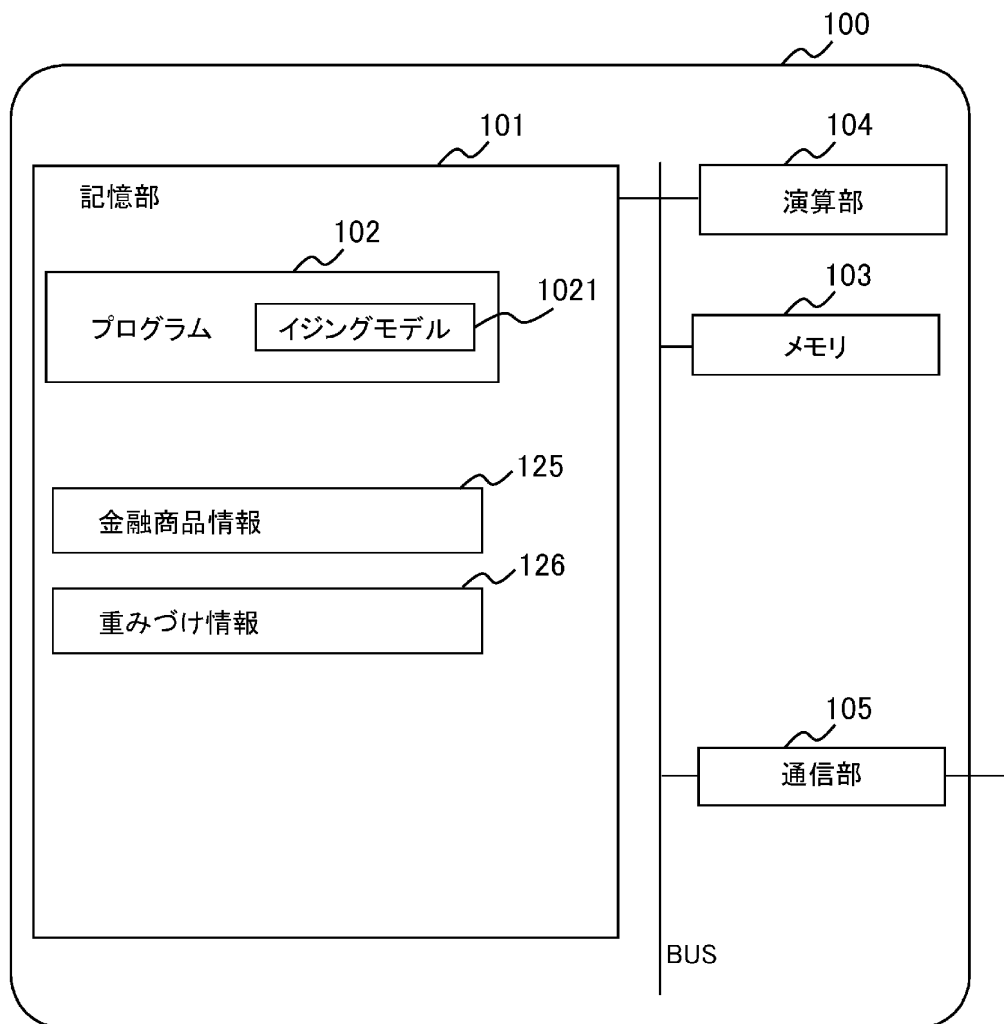


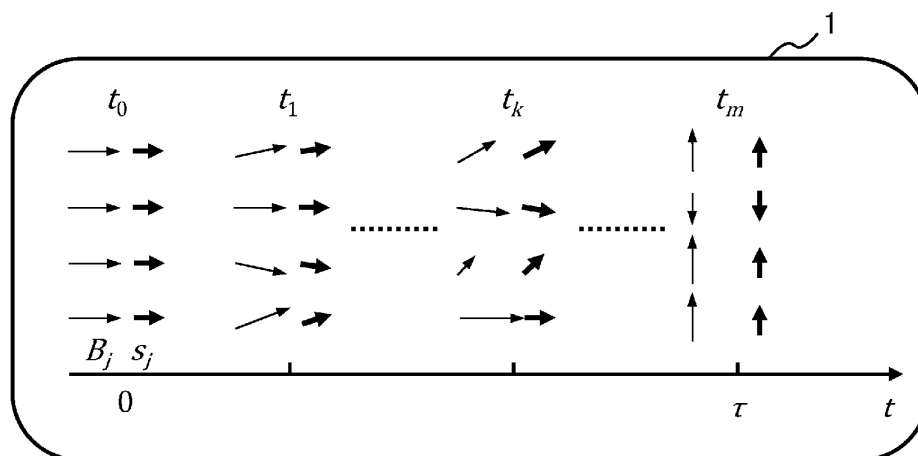
[図1]



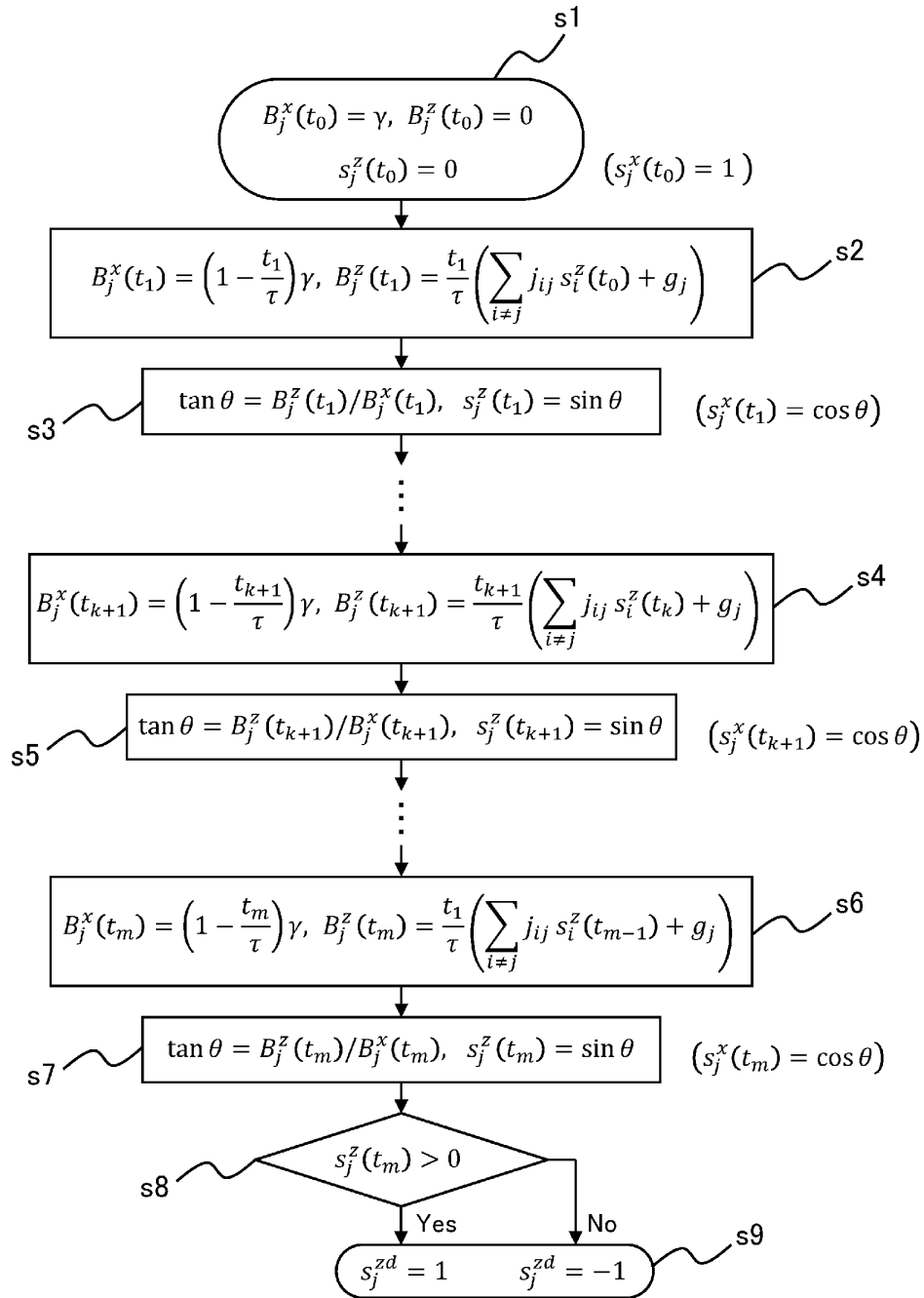
[図2]



[図3]



[図4]



[図5]

金融商品情報

125

名称	期待収益率	値下がり リスク	金利デルタ	為替デルタ	商品価格	手数料	...
A	10	2	10	15	10,000	購:*** 売:***	...
B	5	1	20	50	524,000	購:*** 売:***	...
C	20	25	50	90	98,500	購:*** 売:***	...
...	...	...	...	...	...	...	...

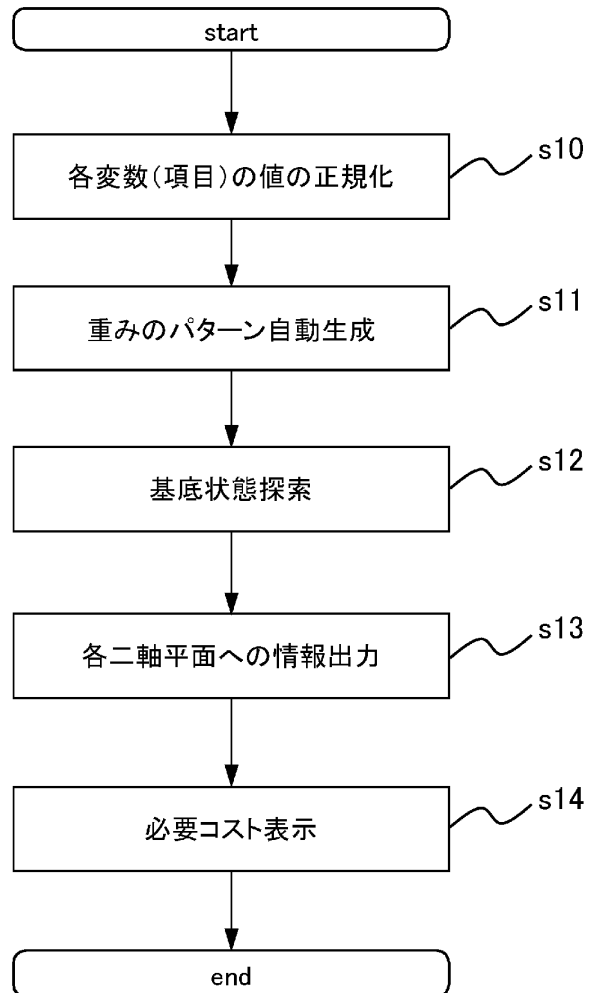
[図6]

重み付け情報

126
↙

期待収益率	値下がり リスク	金利デルタ	為替デルタ	...
0	0	100	0	...
10	0	90	0	...
20	0	80	0	...
...	...	...	...	...

[図7]



[図8]

金融商品: 銘柄A~C

銘柄	収益	リスク	金利デルタ	為替デルタ
A	10	2	10	15
B	5	1	20	50
C	20	5	50	90

[図9]

金融商品：銘柄A～Cの間の価格感応度

銘柄	A	B	C
A	1	0.9	-0.5
B	0.9	1	0.8
C	-0.5	0.8	1

[図10]

	収益	リスク	金利デルタ	為替デルタ
傾き	0.6	2.25	0.225	0.12
切片	-2	-1.25	-1.25	-0.8

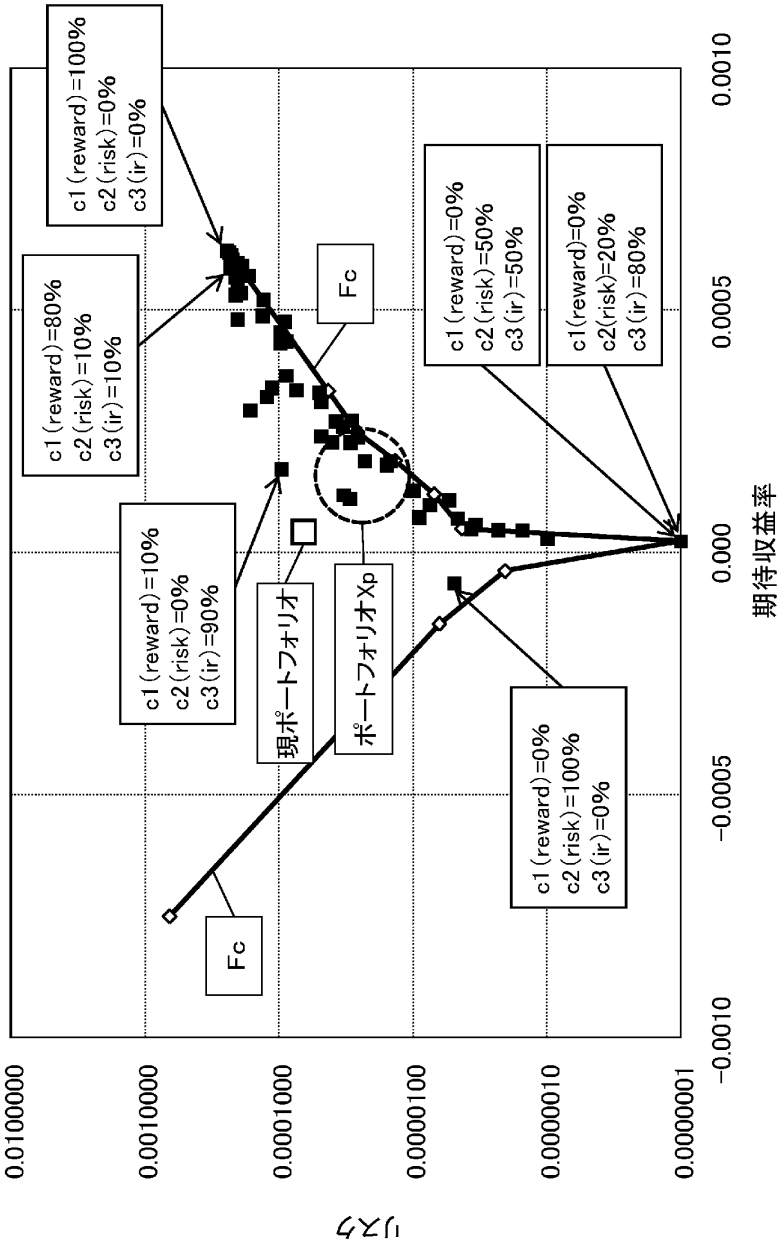
[図11]

銘柄	収益	リスク	金利デルタ	為替デルタ
A	4	3.25	1	1
B	1	1	3.25	5.2
C	10	10	10	10

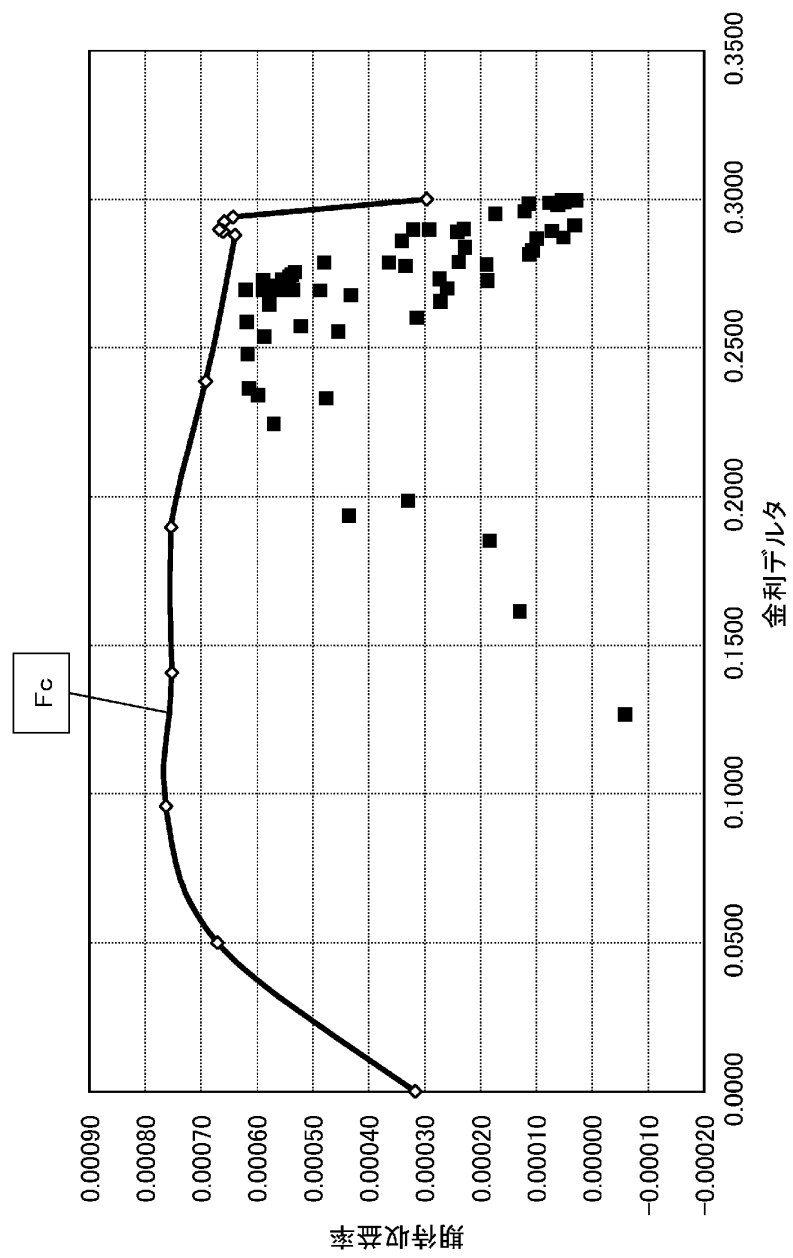
[図12]

重みづけパラメタ			評価結果				
c1 (reward)	c2 (risk)	c3 (ir)	目的関数値	収益	リスク	金利デルタ	比率の和
0%	0%	100%	-1022317	0.000113	0.000029	0.298500	100%
10%	0%	90%	-1023614	0.000173	0.000095	0.295500	100%
20%	0%	80%	-1024903	0.000294	0.000162	0.290000	100%
30%	0%	70%	-1026287	0.000590	0.000231	0.273000	100%
40%	0%	60%	-1027622	0.000482	0.000205	0.279000	100%
50%	0%	50%	-1029048	0.000535	0.000212	0.275500	100%
60%	0%	40%	-1030442	0.000558	0.000210	0.273000	100%
70%	0%	30%	-1031843	0.000569	0.000206	0.270000	100%
80%	0%	20%	-1033245	0.000580	0.000212	0.270000	100%
90%	0%	10%	-1034662	0.000623	0.000243	0.270000	100%
100%	0%	0%	-1036094	0.000623	0.000243	0.270000	100%
0%	10%	90%	-1078239	0.000053	0.000004	0.300000	100%
10%	10%	80%	-1079565	0.000120	0.000033	0.296500	100%
20%	10%	70%	-1080917	0.000322	0.000124	0.290000	100%
30%	10%	60%	-1082309	0.000340	0.000113	0.286000	100%
40%	10%	50%	-1083784	0.000539	0.000200	0.274500	100%
50%	10%	40%	-1085199	0.000536	0.000193	0.270000	100%
60%	10%	30%	-1086698	0.000574	0.000213	0.271500	100%
70%	10%	20%	-1088161	0.000580	0.000212	0.270000	100%
80%	10%	10%	-1089632	0.000616	0.000225	0.237000	100%
90%	10%	0%	-1091119	0.000616	0.000225	0.237000	100%
0%	20%	80%	-1138828	0.000026	0.000000	0.300000	100%
10%	20%	70%	-1140221	0.000075	0.000009	0.299000	100%
20%	20%	60%	-1141631	0.000231	0.000041	0.290000	100%

[図13]



[図14]



[図15]

ポートフォリオ 番号	期待収益率	値下がり リスク	金利デルタ	リスク アセット	購入 銘柄数	売却 銘柄数	必要 コスト
現状	0.00010	0.00008	0.231	100	2	1	* * *
34	0.0012	0.0007	0.220	90	3	3	* * *
37	0.00013	0.0008	0.250	110	1	1	* * *
...	...	...	...	...	...	...	...

[図16]

