

請求の範囲

- [請求項1] 各金融商品の属性情報、及びイベント発生シナリオに伴う前記各金融商品での予想損失の情報に基づき、前記各金融商品を所定の保有比率で組み合わせたポートフォリオに関して、所定のシナリオ群を採用した場合に、前記所定のシナリオ群の各々に対応する前記イベント発生に伴う予想収益及び予想損失を記述した所定式をイジングモデルとして演算する演算部を有し、
- 前記演算部は、前記演算の結果、前記予想収益と前記予想損失とで求まる収益性が大きい前記保有比率の情報を所定装置に出力するものである、
- ことを特徴とするポートフォリオ作成支援装置。
- [請求項2] 前記演算部は、
- 前記所定式として、前記予想損失が相対的に上位となるシナリオの選択、前記選択の対象とするシナリオの数、及び、前記予想収益及び前記予想損失と前記保有比率とに基づく前記収益性、の各項目を組み合わせた式をイジングモデルとして演算するものである、
- ことを特徴とする請求項1に記載のポートフォリオ作成支援装置。
- [請求項3] 前記イジングモデルに関して組合せ最適化問題を解くCMOSアニーリングマシンであることを特徴とする請求項1に記載のポートフォリオ作成支援装置。
- [請求項4] 情報処理装置が、
- 各金融商品の属性情報、及びイベント発生シナリオに伴う前記各金融商品での予想損失の情報に基づき、前記各金融商品を所定の保有比率で組み合わせたポートフォリオに関して、所定のシナリオ群を採用した場合に、前記所定のシナリオ群の各々に対応する前記イベント発生に伴う予想収益及び予想損失を記述した所定式をイジングモデルとして演算し、前記演算の結果、前記予想収益と前記予想損失とで求まる収益性が大きい前記保有比率の情報を所定装置に出力する、

ことを特徴とするポートフォリオ作成支援方法。

[請求項5]

前記情報処理装置が、

前記所定式として、前記予想損失が相対的に上位となるシナリオの選択、前記選択の対象とするシナリオの数、及び、前記予想収益及び前記予想損失と前記保有比率とに基づく前記収益性、の各項目を組み合わせた式をイジングモデルとして演算する、

ことを特徴とする請求項4に記載のポートフォリオ作成支援方法。

[請求項6]

前記情報処理装置が、前記イジングモデルに関して組合せ最適化問題を解くCMOSアニーリングマシンであることを特徴とする請求項4に記載のポートフォリオ作成支援方法。

[請求項7]

ユーザの収益性が大きくなるように、前記ユーザが保有する複数の金融商品の保有率を提示するポートフォリオ作成支援システムであって、

前記複数の金融商品の各々の属性情報、及びイベント発生シナリオに伴う前記金融商品での予想損失の情報を配信する金融情報配信システムと、

前記金融情報配信システムから受信する前記属性情報および前記予想損失の情報に基づいて、前記複数の金融商品の各々を所定の保有比率で組み合わせたポートフォリオに関して、所定のシナリオ群を採用した場合に、対応するイベント発生に伴う予想収益及び予想損失を記述した所定式をイジングモデルとして演算し、前記演算の結果前記予想収益と前記予想損失とで求まる収益性を最大化する前記保有比率の情報を算出するポートフォリオ作成支援装置と、

前記ポートフォリオ作成支援装置から受信する前記保有比率の情報を表示するユーザ端末とを含むポートフォリオ作成支援システム。

[請求項8]

ユーザの収益性が大きくなるように、前記ユーザが保有する複数の金融商品の保有率を提示するポートフォリオ作成支援方法であって、金融情報配信システムと、ポートフォリオ作成支援装置と、ユーザ

端末とがネットワークを介して通信可能に接続され、

前記金融情報配信システムは、前記複数の金融商品の各々の属性情報、及びイベント発生シナリオに伴う前記金融商品での予想損失の情報を前記ポートフォリオ作成支援装置に配信し、

前記ポートフォリオ作成支援装置は、前記金融情報配信システムから受信する前記属性情報および前記予想損失の情報に基づいて、前記複数の金融商品の各々を所定の保有比率で組み合わせたポートフォリオに関して、所定のシナリオ群を採用した場合に、対応するイベント発生に伴う予想収益及び予想損失を記述した所定式をイジングモデルとして演算し、

前記演算の結果前記予想収益と前記予想損失とで求まる収益性を最大化する前記保有比率の情報を算出し、

前記ユーザ端末は、前記ポートフォリオ作成支援装置から受信する前記保有比率の情報を表示するポートフォリオ作成支援方法。