

投資機会集合

【アセット・データ設定】

資産クラス数 **5**

資産クラス名 期待リターン リスク

資産クラス名	期待リターン	リスク
国内債券	2.80%	5.40%
国内株式	5.30%	22.15%
外国債券	3.40%	13.25%
外国株式	6.00%	19.59%
短期資産	2.10%	3.72%

相関係数

	国内債券	国内株式	外国債券	外国株式	短期資産
国内債券	1.00	0.16	-0.06	-0.05	0.46
国内株式	0.16	1.00	-0.25	0.27	0.01
外国債券	-0.06	-0.25	1.00	0.56	-0.05
外国株式	-0.05	0.27	0.56	1.00	-0.11
短期資産	0.46	0.01	-0.05	-0.11	1.00

[投資機会集合] (リスクとリターン分布)

