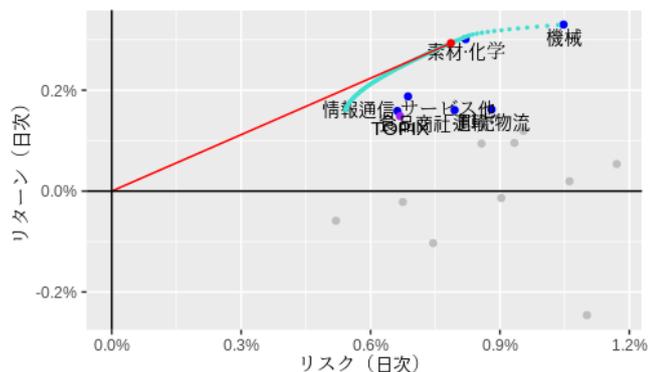


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

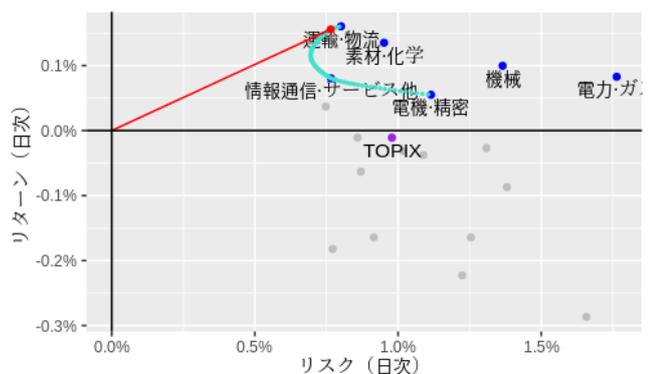
2023年12月30日

【半月】



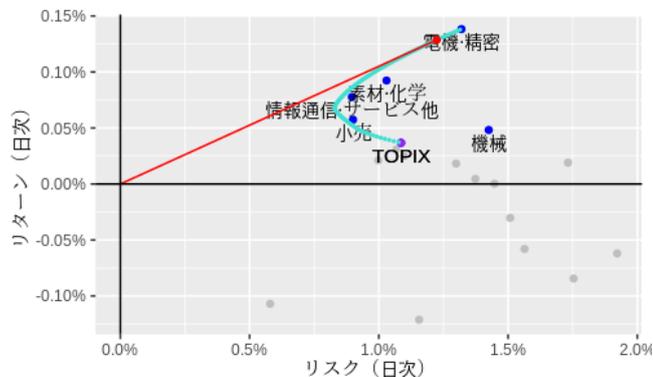
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.293%	0.786%	0.373	—
機械	0.330%	1.048%	0.315	16.9%
素材・化学	0.301%	0.820%	0.367	74.1%
情報通信・サービス他	0.188%	0.687%	0.273	0.0%
運輸・物流	0.162%	0.881%	0.184	2.2%
商社・卸売	0.161%	0.795%	0.202	0.0%
食品	0.159%	0.662%	0.240	6.8%

【一ヶ月】



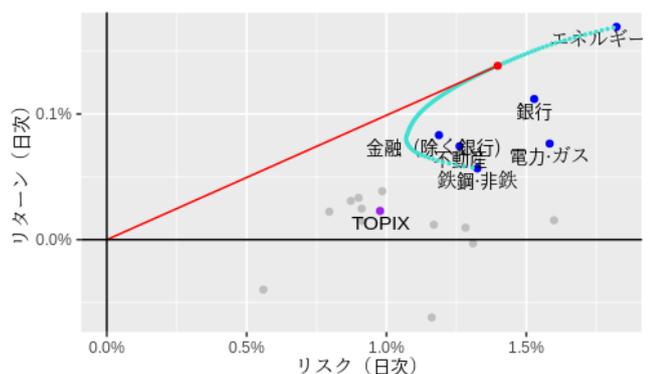
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.156%	0.765%	0.204	—
運輸・物流	0.160%	0.801%	0.200	81.2%
素材・化学	0.135%	0.951%	0.142	18.8%
機械	0.100%	1.365%	0.073	0.0%
電力・ガス	0.083%	1.764%	0.047	0.0%
情報通信・サービス他	0.080%	0.766%	0.105	0.0%
電機・精密	0.055%	1.115%	0.049	0.0%

【四半期】



効率的ポートフォリオ	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.129%	1.224%	0.105	—
電機・精密	0.138%	1.320%	0.105	81.9%
素材・化学	0.092%	1.030%	0.090	9.2%
情報通信・サービス他	0.078%	0.896%	0.087	9.0%
小売	0.057%	0.900%	0.064	0.0%
機械	0.048%	1.425%	0.034	0.0%
TOPIX	0.037%	1.086%	0.034	0.0%

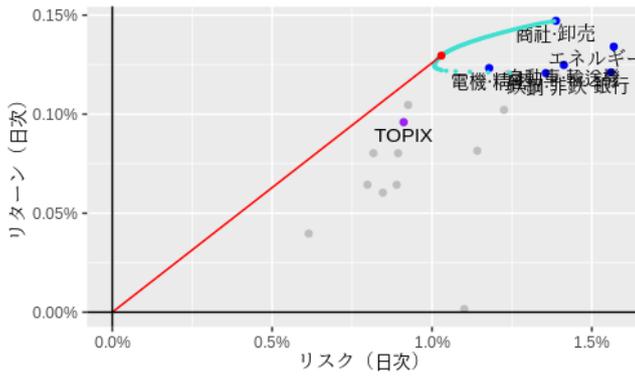
【半年】



効率的ポートフォリオ	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.138%	1.398%	0.099	—
エネルギー資源	0.169%	1.822%	0.093	54.1%
銀行	0.112%	1.528%	0.073	33.7%
金融 (除く銀行)	0.083%	1.188%	0.070	0.0%
電力・ガス	0.076%	1.583%	0.048	0.0%
不動産	0.074%	1.261%	0.059	12.3%
鉄鋼・非鉄	0.057%	1.325%	0.043	0.0%

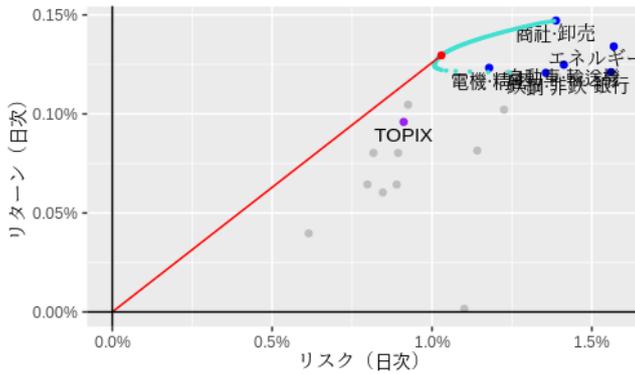
備考 グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【一年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.130%	1.029%	0.126	—
商社・卸売	0.147%	1.388%	0.106	19.8%
エネルギー資源	0.134%	1.569%	0.085	18.0%
自動車・輸送機	0.125%	1.413%	0.088	0.0%
電機・精密	0.123%	1.179%	0.105	45.0%
銀行	0.121%	1.559%	0.078	17.2%
鉄鋼・非鉄	0.121%	1.356%	0.089	0.0%

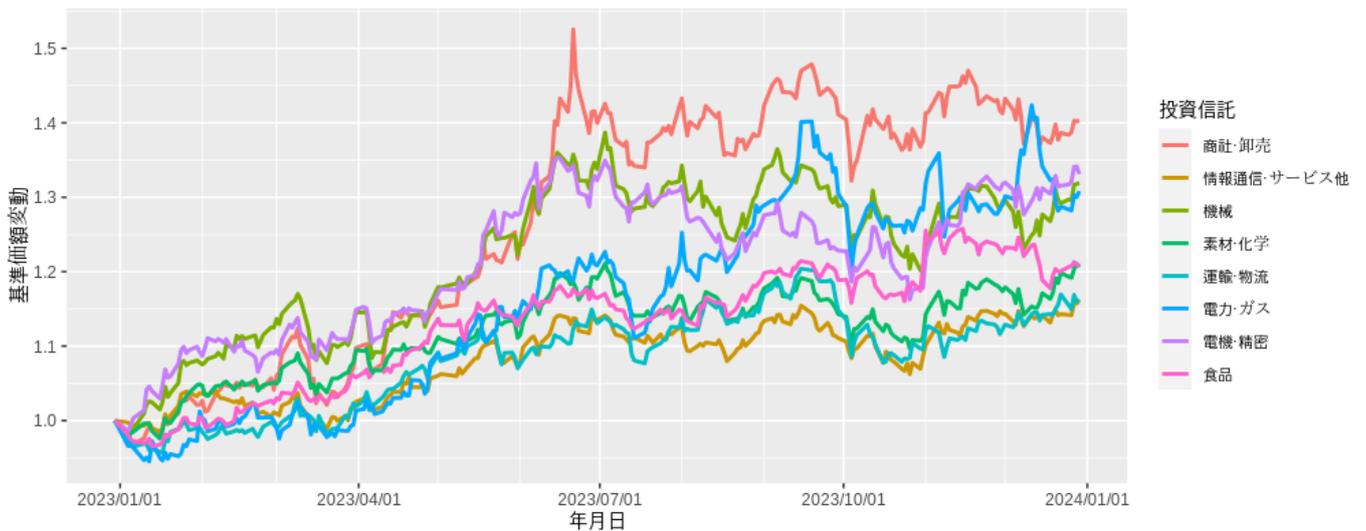
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.130%	1.029%	0.126	—
商社・卸売	0.147%	1.388%	0.106	19.8%
エネルギー資源	0.134%	1.569%	0.085	18.0%
自動車・輸送機	0.125%	1.413%	0.088	0.0%
電機・精密	0.123%	1.179%	0.105	45.0%
銀行	0.121%	1.559%	0.078	17.2%
鉄鋼・非鉄	0.121%	1.356%	0.089	0.0%

備考 グラフ中の赤点（・）は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

TOPIX-17 シリーズでリターンが高かった銘柄の基準価額の変動



備考 直近半月と一ヶ月でリターン上位にランクされた銘柄について一年前を 1.00 とした直近一年間の価額変動を示す。