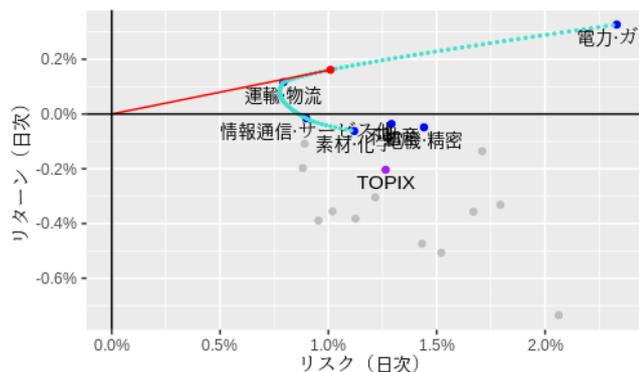


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

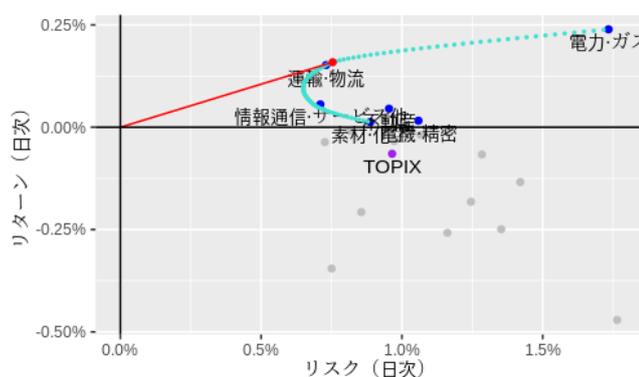
2023年12月16日

【半月】



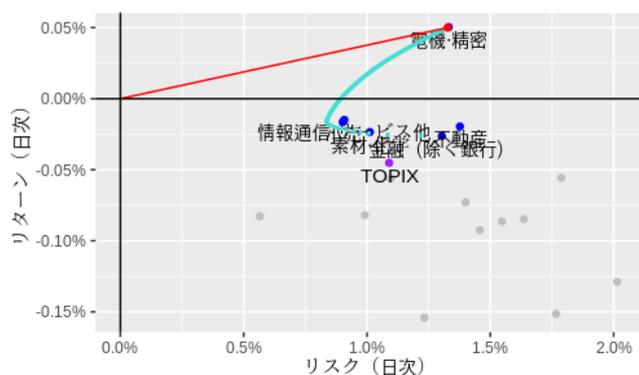
TOPIX_17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.162%	1.010%	0.160	—
電力・ガス	0.327%	2.331%	0.140	21.5%
運輸・物流	0.116%	0.792%	0.147	78.5%
情報通信・サービス他	-0.016%	0.898%	-0.018	0.0%
不動産	-0.036%	1.291%	-0.028	0.0%
電機・精密	-0.049%	1.441%	-0.034	0.0%
素材・化学	-0.062%	1.119%	-0.055	0.0%

【一ヶ月】



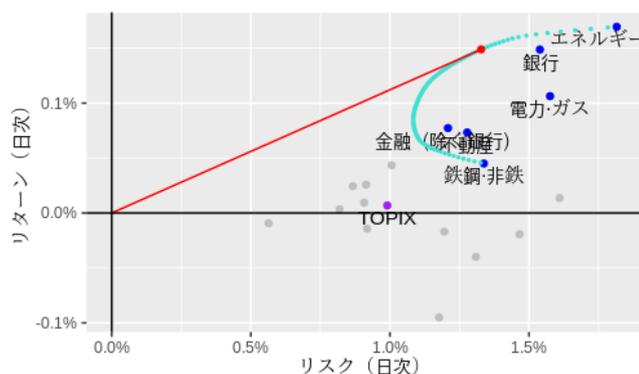
TOPIX_17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.159%	0.754%	0.211	—
電力・ガス	0.239%	1.734%	0.138	7.9%
運輸・物流	0.152%	0.731%	0.208	92.1%
情報通信・サービス他	0.056%	0.710%	0.079	0.0%
不動産	0.045%	0.954%	0.048	0.0%
電機・精密	0.016%	1.059%	0.015	0.0%
素材・化学	0.013%	0.888%	0.014	0.0%

【四半期】



TOPIX_17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.050%	1.327%	0.038	—
電機・精密	0.050%	1.331%	0.038	99.4%
情報通信・サービス他	-0.015%	0.908%	-0.016	0.0%
小売	-0.016%	0.902%	-0.018	0.6%
不動産	-0.020%	1.377%	-0.014	0.0%
素材・化学	-0.023%	1.012%	-0.023	0.0%
金融(除く銀行)	-0.026%	1.303%	-0.020	0.0%

【半年】



TOPIX_17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.149%	1.328%	0.112	—
エネルギー資源	0.169%	1.815%	0.093	35.6%
銀行	0.149%	1.539%	0.097	47.5%
電力・ガス	0.106%	1.576%	0.067	17.0%
金融(除く銀行)	0.077%	1.209%	0.064	0.0%
不動産	0.073%	1.278%	0.057	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.045%	1.338%	0.034	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。