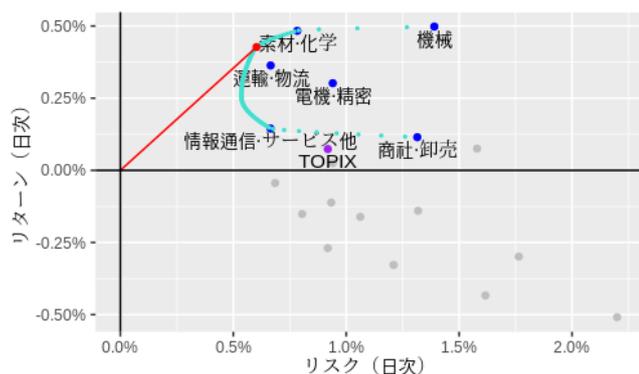


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

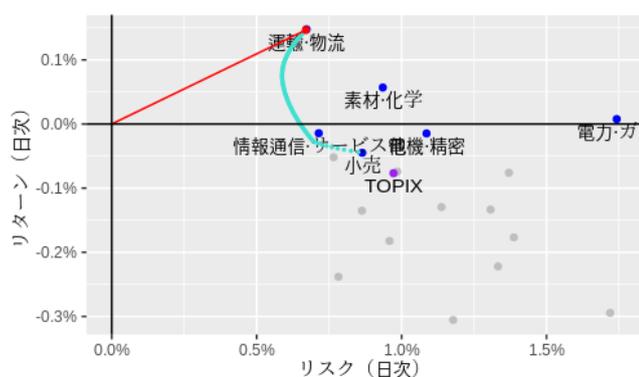
2023年12月23日

【半月】



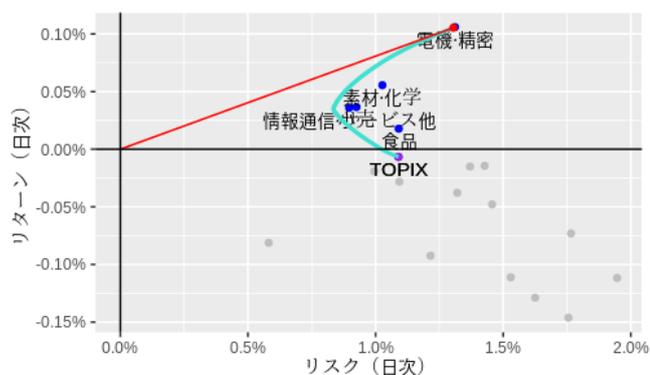
TOPIX_17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.427%	0.603%	0.708	—
機械	0.498%	1.390%	0.358	0.0%
素材・化学	0.484%	0.783%	0.617	53.1%
運輸・物流	0.363%	0.665%	0.546	46.9%
電機・精密	0.302%	0.940%	0.321	0.0%
情報通信・サービス他	0.145%	0.665%	0.218	0.0%
商社・卸売	0.115%	1.315%	0.087	0.0%

【一ヶ月】



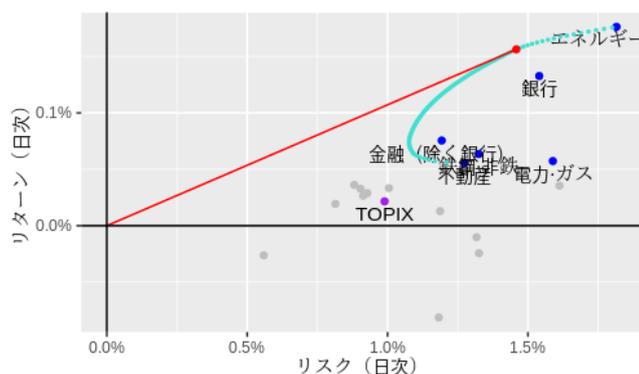
TOPIX_17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.147%	0.670%	0.219	—
運輸・物流	0.148%	0.672%	0.220	99.4%
素材・化学	0.057%	0.935%	0.061	0.0%
電力・ガス	0.008%	1.742%	0.004	0.0%
情報通信・サービス他	-0.014%	0.714%	-0.020	0.6%
電機・精密	-0.015%	1.086%	-0.014	0.0%
小売	-0.045%	0.864%	-0.052	0.0%

【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	0.105%	1.305%	0.081	—
電機・精密	0.106%	1.311%	0.081	99.2%
素材・化学	0.056%	1.027%	0.054	0.0%
小売	0.037%	0.925%	0.040	0.8%
情報通信・サービス他	0.036%	0.897%	0.040	0.0%
食品	0.018%	1.091%	0.016	0.0%
TOPIX	-0.007%	1.090%	-0.006	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	0.156%	1.458%	0.107	—
エネルギー資源	0.176%	1.815%	0.097	54.2%
銀行	0.133%	1.540%	0.086	45.8%
金融 (除く銀行)	0.075%	1.193%	0.063	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.063%	1.325%	0.048	0.0%
電力・ガス	0.057%	1.589%	0.036	0.0%
不動産	0.055%	1.273%	0.044	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。