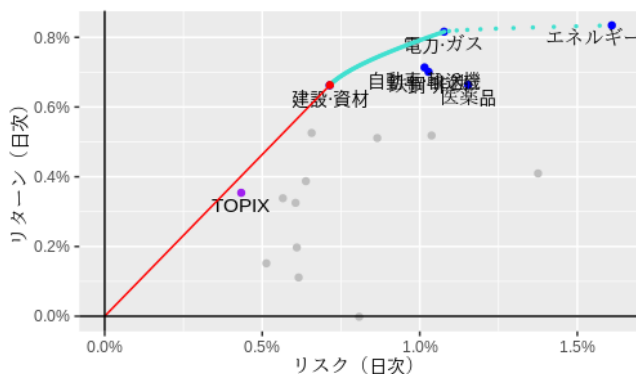


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

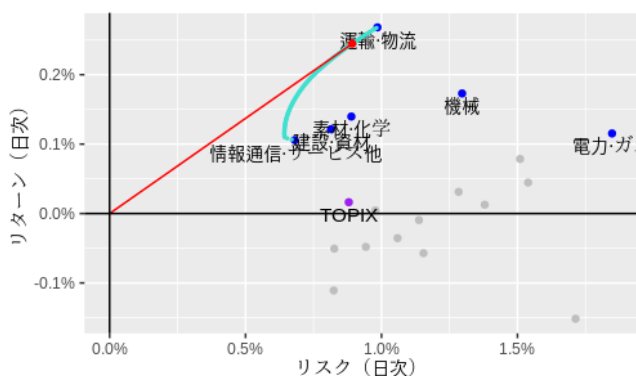
2024年1月6日

【半月】



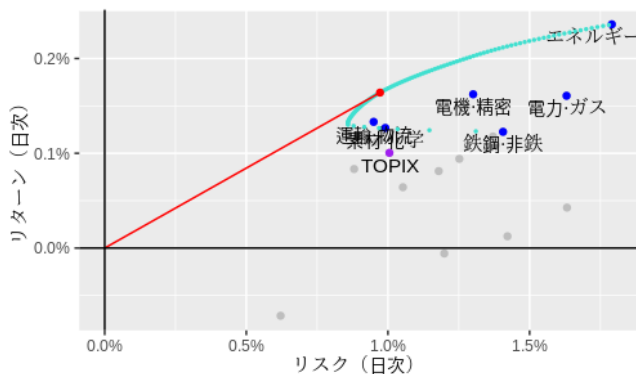
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.663%	0.715%	0.928	—
エネルギー資源	0.834%	1.610%	0.518	0.0%
電力・ガス	0.816%	1.077%	0.758	0.2%
自動車・輸送機	0.714%	1.015%	0.703	1.1%
鉄鋼・非鉄	0.701%	1.028%	0.682	0.0%
医薬品	0.664%	1.154%	0.575	0.0%
建設・資材	0.662%	0.714%	0.928	98.7%

【一ヶ月】



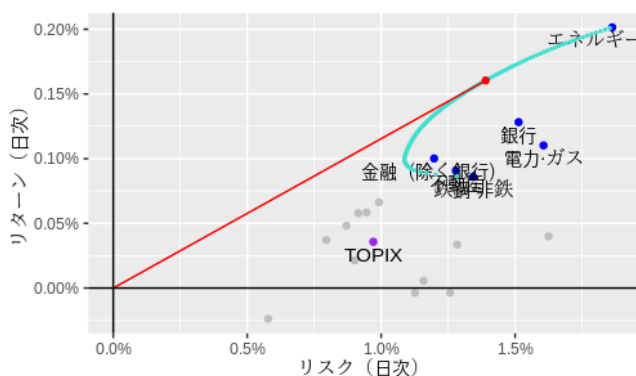
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.245%	0.892%	0.274	—
運輸・物流	0.268%	0.985%	0.272	83.3%
機械	0.173%	1.296%	0.133	0.0%
素材・化学	0.140%	0.889%	0.157	10.3%
建設・資材	0.122%	0.814%	0.149	0.0%
電力・ガス	0.115%	1.848%	0.062	0.0%
情報通信・サービス他	0.106%	0.681%	0.156	6.3%

【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	0.164%	0.972%	0.169	—
エネルギー資源	0.236%	1.790%	0.132	20.4%
電機・精密	0.162%	1.301%	0.125	31.7%
電力・ガス	0.161%	1.631%	0.099	2.5%
運輸・物流	0.133%	0.950%	0.140	45.4%
素材・化学	0.127%	0.991%	0.128	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.123%	1.406%	0.087	0.0%

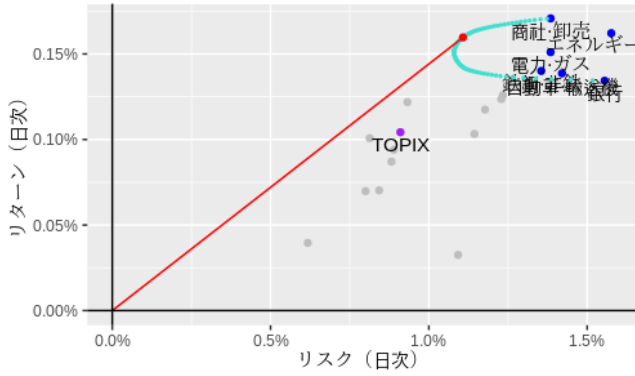
【半年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.160%	1.390%	0.115	—
エネルギー資源	0.201%	1.863%	0.108	51.3%
銀行	0.128%	1.513%	0.085	28.5%
電力・ガス	0.110%	1.606%	0.069	11.2%
金融(除く銀行)	0.100%	1.198%	0.084	0.0%
不動産	0.091%	1.279%	0.071	8.9%
鉄鋼・非鉄	0.086%	1.344%	0.064	0.0%

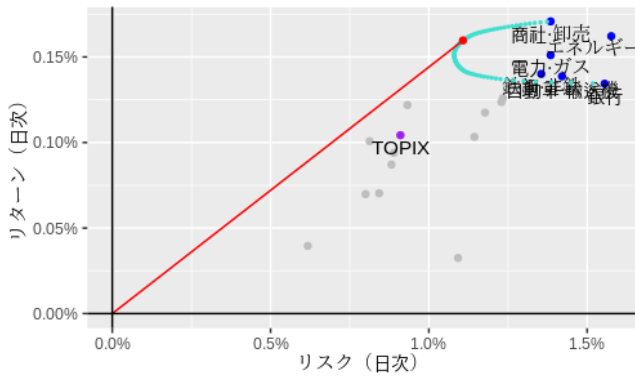
備考 グラフ中の赤点(・)は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【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	0.160%	1.108%	0.144	—
商社・卸売	0.171%	1.385%	0.123	39.8%
エネルギー資源	0.162%	1.576%	0.103	18.2%
電力・ガス	0.151%	1.385%	0.109	34.5%
鉄鋼・非鉄	0.140%	1.355%	0.103	0.0%
自動車・輸送機	0.139%	1.421%	0.098	0.0%
銀行	0.134%	1.555%	0.086	7.5%

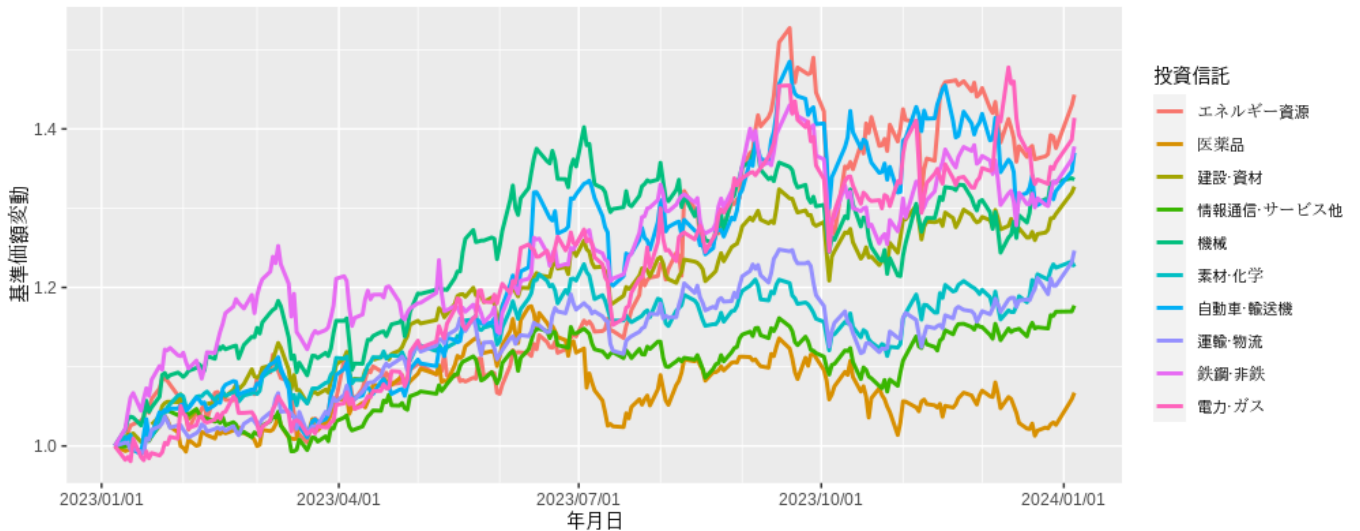
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.160%	1.108%	0.144	—
商社・卸売	0.171%	1.385%	0.123	39.8%
エネルギー資源	0.162%	1.576%	0.103	18.2%
電力・ガス	0.151%	1.385%	0.109	34.5%
鉄鋼・非鉄	0.140%	1.355%	0.103	0.0%
自動車・輸送機	0.139%	1.421%	0.098	0.0%
銀行	0.134%	1.555%	0.086	7.5%

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。