

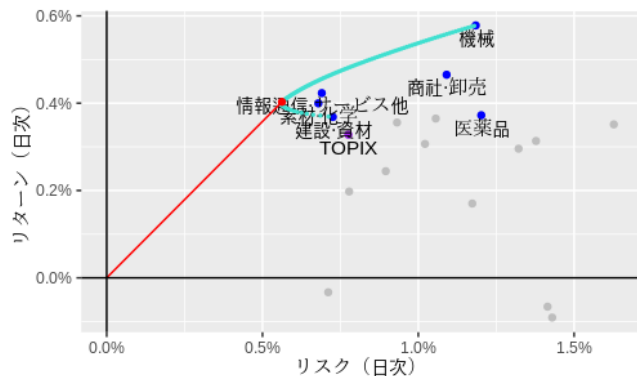
TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

2024年1月13日

【半月】

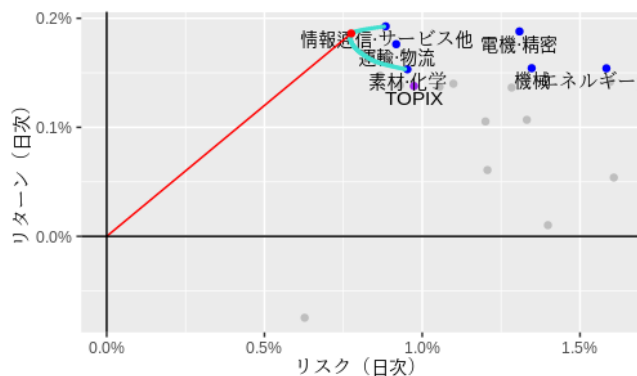
データ不足のため削除

【一ヶ月】



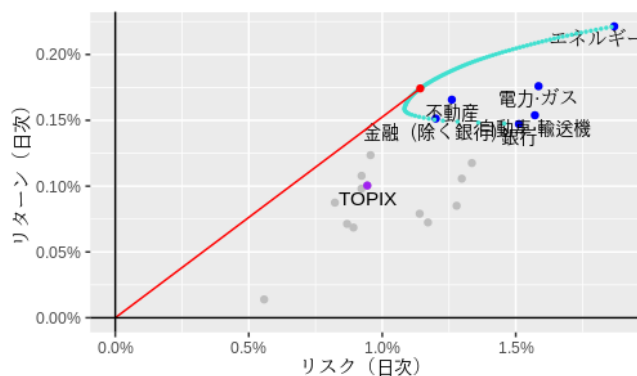
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.403%	0.562%	0.716	—
機械	0.578%	1.184%	0.488	0.0%
商社・卸売	0.465%	1.091%	0.426	0.0%
情報通信・サービス他	0.423%	0.690%	0.613	40.4%
素材・化学	0.400%	0.679%	0.588	39.9%
医薬品	0.372%	1.202%	0.310	0.0%
建設・資材	0.368%	0.726%	0.508	19.7%

【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	0.186%	0.775%	0.240	—
情報通信・サービス他	0.193%	0.884%	0.218	60.3%
電機・精密	0.188%	1.308%	0.144	0.0%
運輸・物流	0.176%	0.918%	0.192	39.7%
機械	0.154%	1.347%	0.115	0.0%
エネルギー資源	0.154%	1.584%	0.097	0.0%
素材・化学	0.153%	0.953%	0.161	0.0%

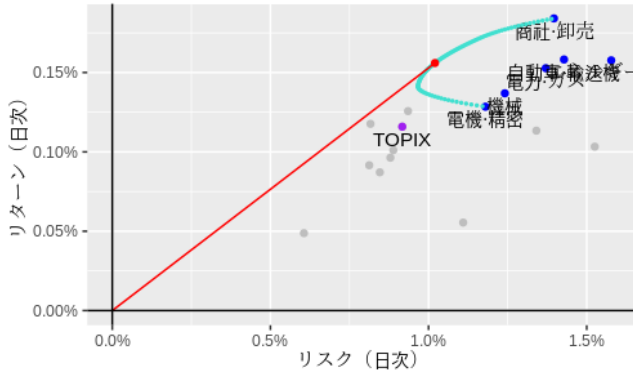
【半年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.174%	1.142%	0.153	—
エネルギー資源	0.221%	1.869%	0.118	19.4%
電力・ガス	0.176%	1.585%	0.111	16.0%
不動産	0.166%	1.261%	0.131	40.7%
自動車・輸送機	0.154%	1.572%	0.098	0.0%
金融 (除く銀行)	0.151%	1.201%	0.126	13.1%
銀行	0.147%	1.512%	0.097	10.8%

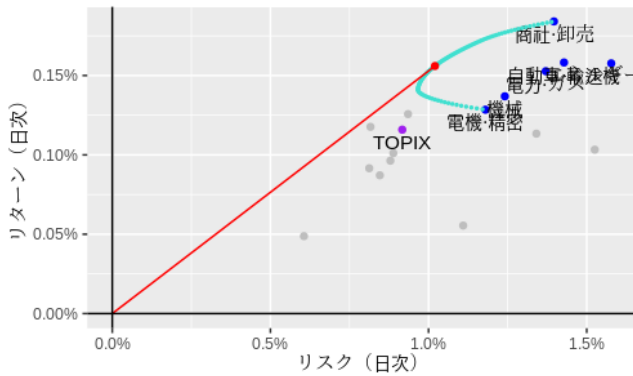
備考 グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【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	0.156%	1.020%	0.153	—
商社・卸売	0.184%	1.396%	0.132	28.5%
自動車・輸送機	0.158%	1.428%	0.111	0.0%
エネルギー資源	0.158%	1.578%	0.100	14.3%
電力・ガス	0.153%	1.371%	0.111	31.0%
機械	0.137%	1.241%	0.110	0.0%
電機・精密	0.128%	1.180%	0.109	26.2%

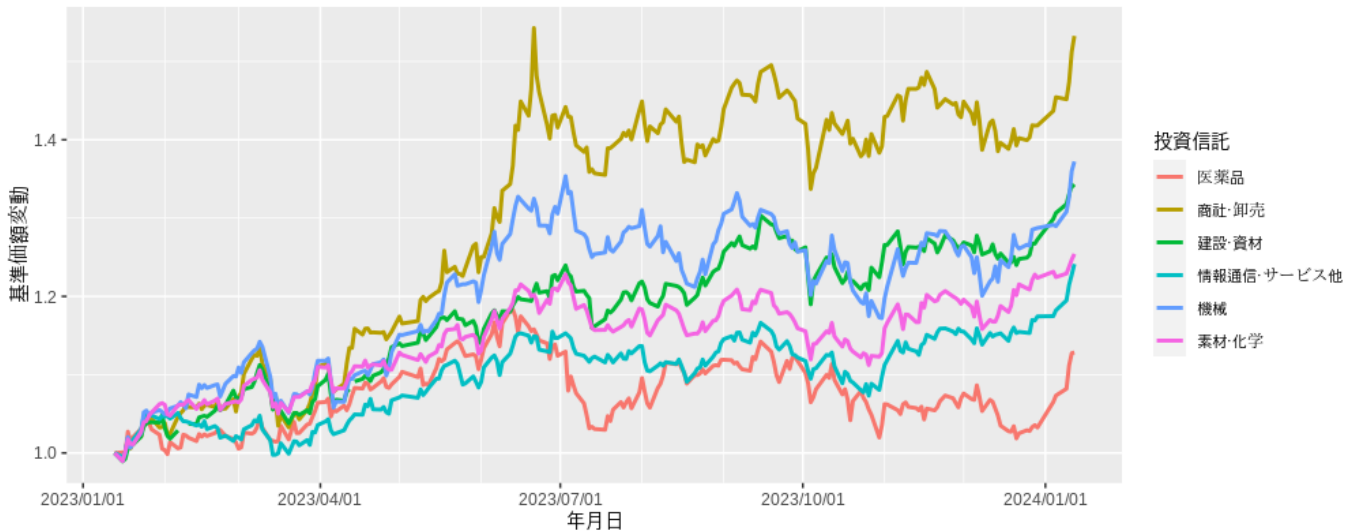
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.156%	1.020%	0.153	—
商社・卸売	0.184%	1.396%	0.132	28.5%
自動車・輸送機	0.158%	1.428%	0.111	0.0%
エネルギー資源	0.158%	1.578%	0.100	14.3%
電力・ガス	0.153%	1.371%	0.111	31.0%
機械	0.137%	1.241%	0.110	0.0%
電機・精密	0.128%	1.180%	0.109	26.2%

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。