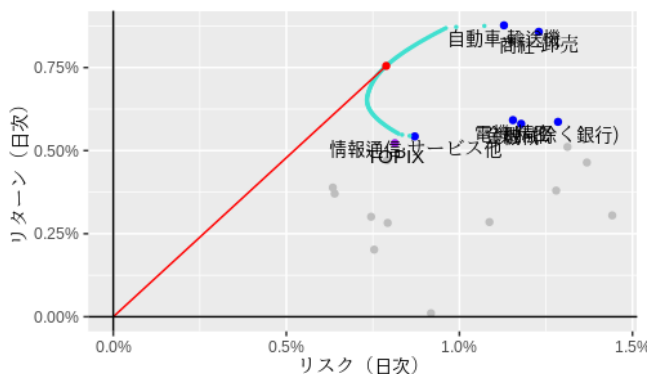


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

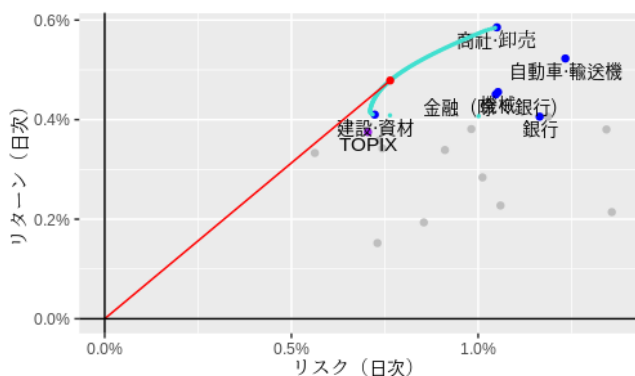
2024年1月20日

【半月】



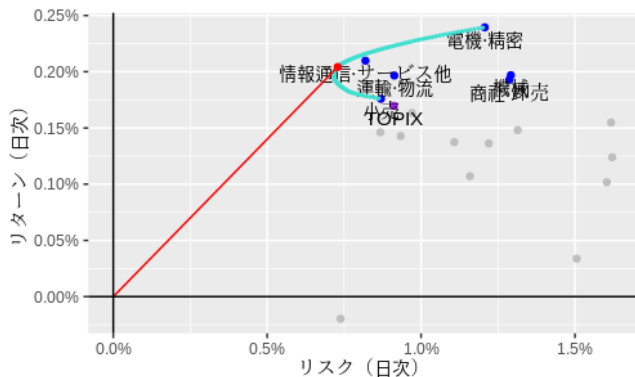
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.755%	0.789%	0.957	—
自動車・輸送機	0.877%	1.129%	0.777	45.6%
商社・卸売	0.857%	1.229%	0.697	19.0%
電機・精密	0.592%	1.155%	0.512	0.0%
金融(除く銀行)	0.587%	1.285%	0.456	0.0%
機械	0.581%	1.178%	0.493	0.0%
情報通信・サービス他	0.543%	0.871%	0.623	35.4%

【一ヶ月】



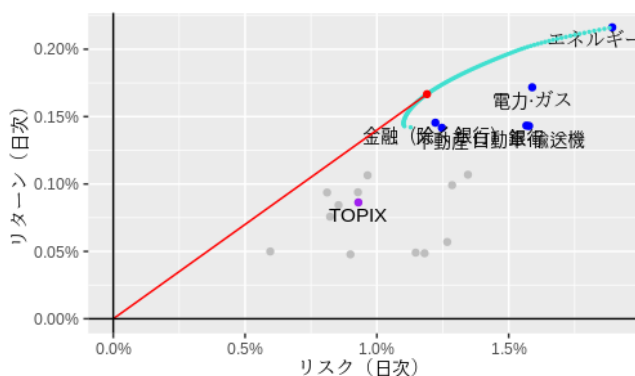
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.479%	0.764%	0.626	—
商社・卸売	0.585%	1.050%	0.557	33.2%
自動車・輸送機	0.523%	1.233%	0.424	8.0%
機械	0.455%	1.053%	0.432	3.1%
金融(除く銀行)	0.451%	1.047%	0.430	0.0%
建設・資材	0.410%	0.723%	0.567	55.7%
銀行	0.406%	1.165%	0.349	0.0%

【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	0.204%	0.729%	0.280	—
電機・精密	0.239%	1.207%	0.198	0.0%
情報通信・サービス他	0.210%	0.819%	0.256	61.6%
機械	0.197%	1.292%	0.152	0.0%
運輸・物流	0.197%	0.913%	0.215	35.8%
商社・卸売	0.193%	1.287%	0.150	0.0%
小売	0.176%	0.870%	0.202	2.6%

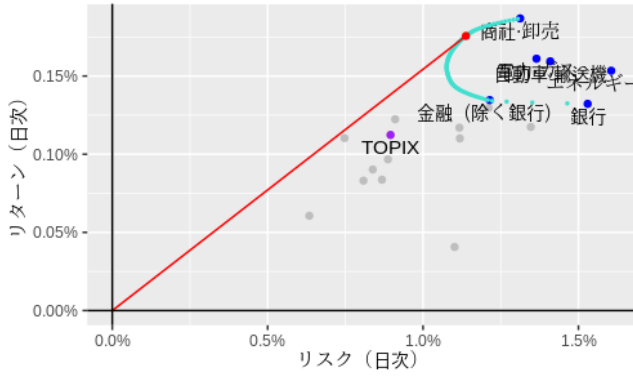
【半年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.167%	1.190%	0.140	—
エネルギー資源	0.216%	1.893%	0.114	23.9%
電力・ガス	0.172%	1.589%	0.108	21.2%
金融(除く銀行)	0.145%	1.222%	0.119	17.5%
銀行	0.143%	1.567%	0.091	8.3%
自動車・輸送機	0.143%	1.577%	0.091	0.0%
不動産	0.142%	1.247%	0.114	29.1%

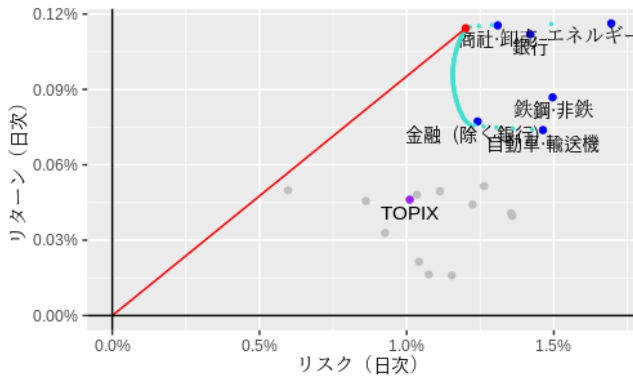
備考 グラフ中の赤点(・)は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【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	0.176%	1.138%	0.154	—
商社・卸売	0.187%	1.312%	0.142	60.7%
電力・ガス	0.161%	1.365%	0.118	35.2%
自動車・輸送機	0.159%	1.409%	0.113	0.0%
エネルギー資源	0.153%	1.606%	0.096	0.6%
金融 (除く銀行)	0.135%	1.215%	0.111	0.0%
銀行	0.132%	1.530%	0.086	3.6%

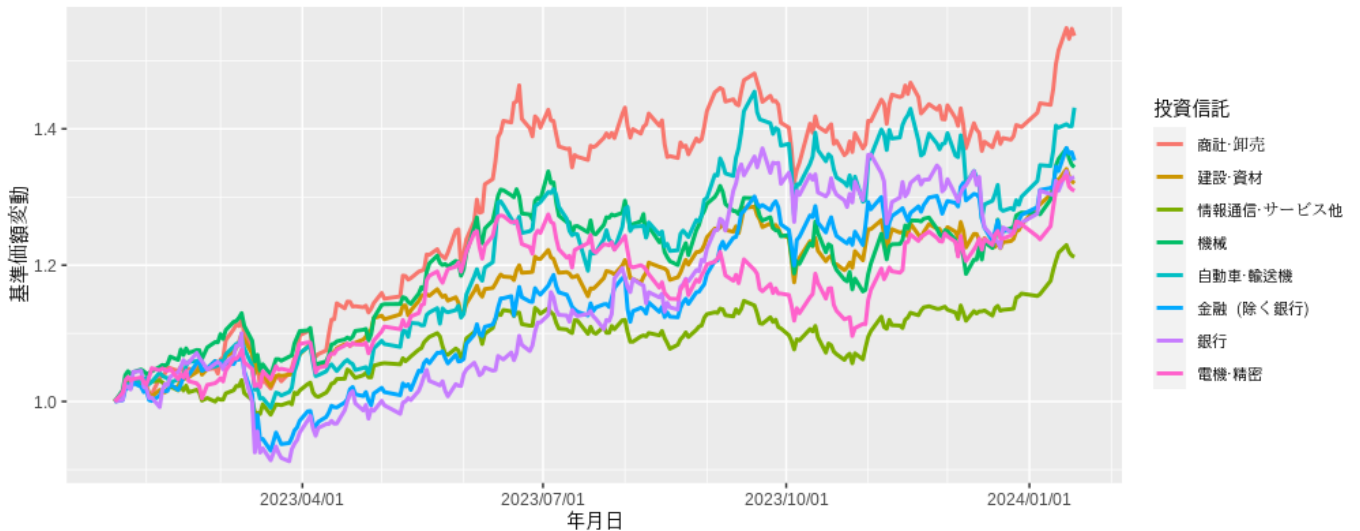
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.114%	1.201%	0.095	—
エネルギー資源	0.116%	1.695%	0.069	10.2%
商社・卸売	0.115%	1.309%	0.088	55.9%
銀行	0.112%	1.419%	0.079	33.9%
鉄鋼・非鉄	0.087%	1.496%	0.058	0.0%
金融 (除く銀行)	0.077%	1.241%	0.062	0.0%
自動車・輸送機	0.074%	1.463%	0.050	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。