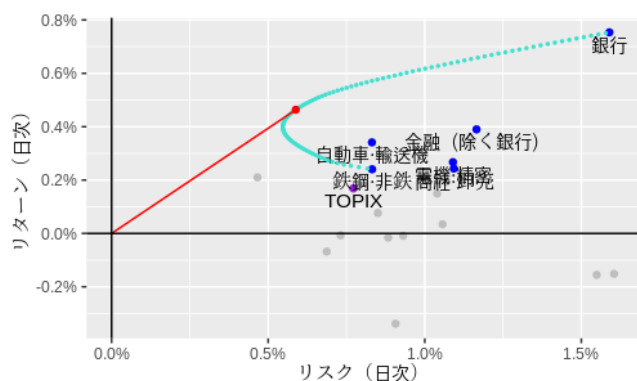


## TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

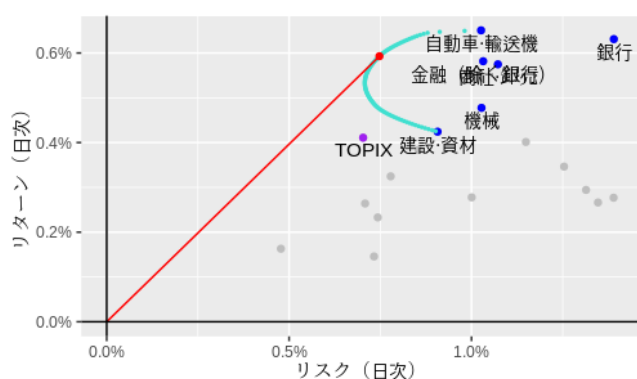
2024年1月27日

【半月】



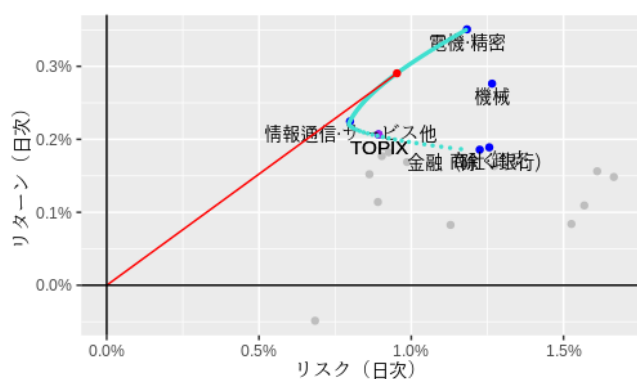
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.464%	0.588%	0.788	—
銀行	0.754%	1.590%	0.474	32.6%
金融 (除く銀行)	0.390%	1.165%	0.335	0.0%
自動車・輸送機	0.341%	0.831%	0.410	55.7%
電機・精密	0.267%	1.090%	0.245	0.0%
商社・卸売	0.243%	1.093%	0.222	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.240%	0.832%	0.289	11.7%

【一ヶ月】



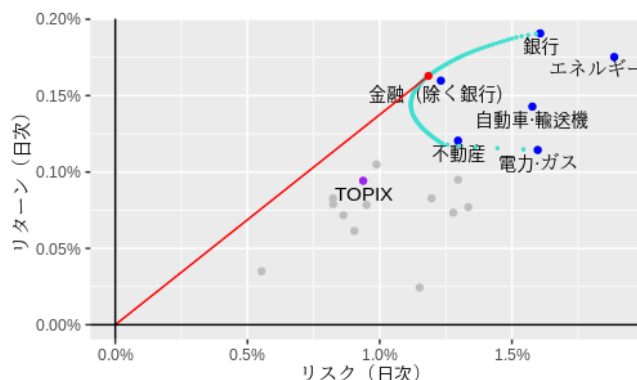
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.593%	0.748%	0.793	—
自動車・輸送機	0.651%	1.026%	0.634	39.5%
銀行	0.631%	1.390%	0.454	28.4%
金融 (除く銀行)	0.582%	1.032%	0.563	0.0%
商社・卸売	0.575%	1.072%	0.536	3.9%
機械	0.477%	1.027%	0.465	27.4%
建設・資材	0.424%	0.907%	0.468	0.8%

【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	0.291%	0.953%	0.305	—
電機・精密	0.351%	1.183%	0.296	52.9%
機械	0.276%	1.265%	0.218	0.0%
情報通信・サービス他	0.225%	0.799%	0.281	45.1%
TOPIX	0.207%	0.893%	0.232	0.0%
商社・卸売	0.189%	1.256%	0.150	0.0%
金融 (除く銀行)	0.186%	1.225%	0.152	2.0%

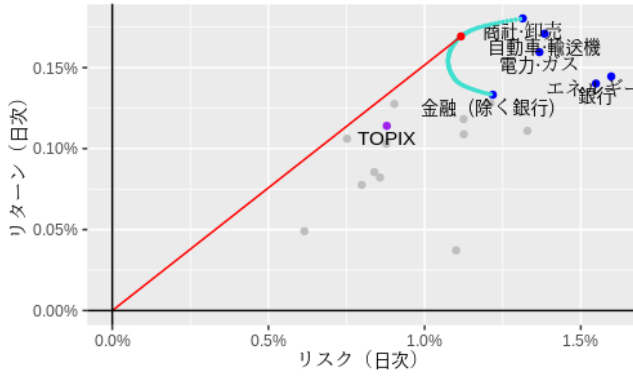
【半年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.163%	1.184%	0.138	—
銀行	0.191%	1.607%	0.119	35.2%
エネルギー資源	0.175%	1.887%	0.093	6.7%
金融 (除く銀行)	0.160%	1.231%	0.130	35.6%
自動車・輸送機	0.143%	1.577%	0.091	0.0%
不動産	0.121%	1.296%	0.093	22.5%
電力・ガス	0.114%	1.598%	0.072	0.0%

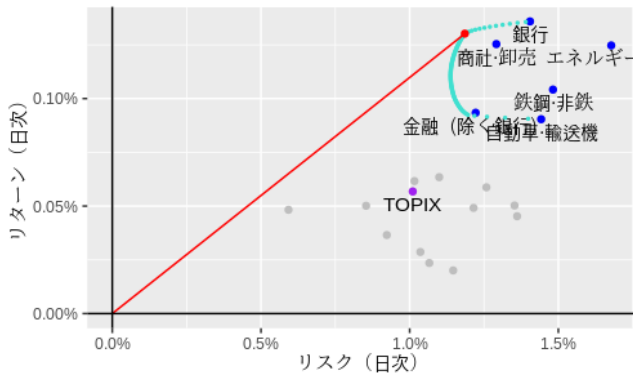
備考 グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【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	0.169%	1.116%	0.152	—
商社・卸売	0.180%	1.314%	0.137	46.6%
自動車・輸送機	0.171%	1.384%	0.124	13.3%
電力・ガス	0.160%	1.368%	0.117	32.6%
エネルギー資源	0.145%	1.597%	0.090	0.0%
銀行	0.140%	1.548%	0.091	7.6%
金融 (除く銀行)	0.133%	1.218%	0.109	0.0%

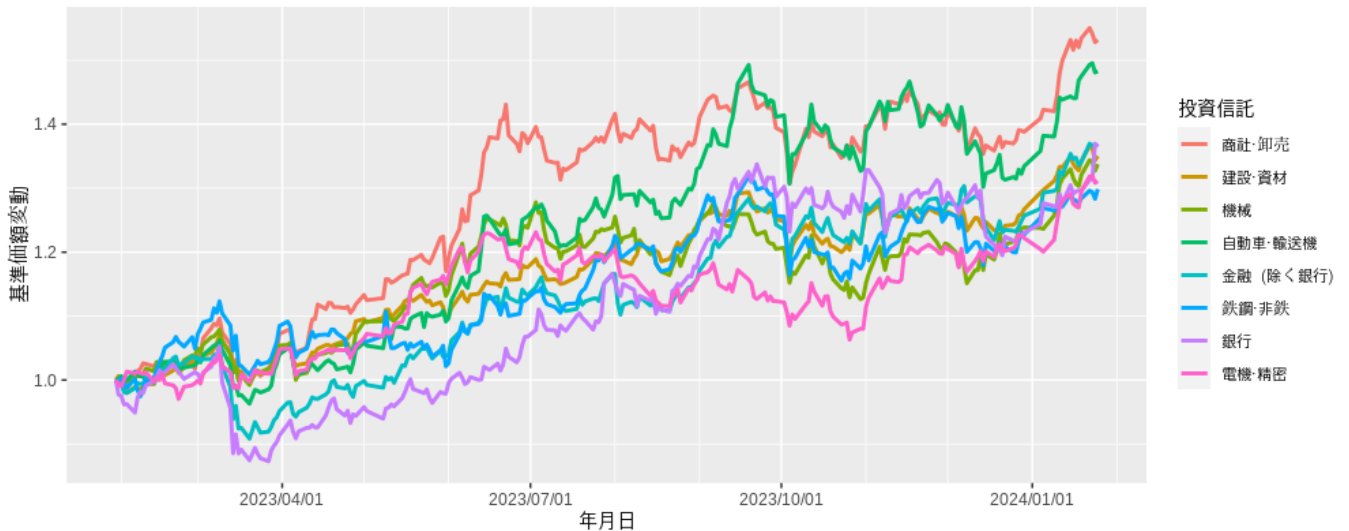
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.130%	1.186%	0.110	—
銀行	0.136%	1.405%	0.097	46.5%
商社・卸売	0.125%	1.292%	0.097	47.2%
エネルギー資源	0.125%	1.678%	0.074	6.3%
鉄鋼・非鉄	0.104%	1.482%	0.070	0.0%
金融 (除く銀行)	0.093%	1.222%	0.076	0.0%
自動車・輸送機	0.090%	1.442%	0.063	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。