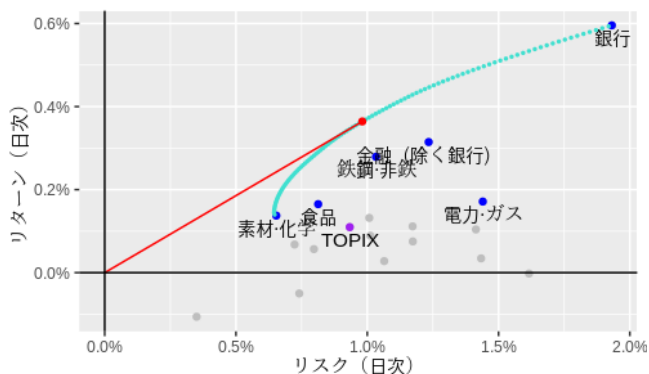


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

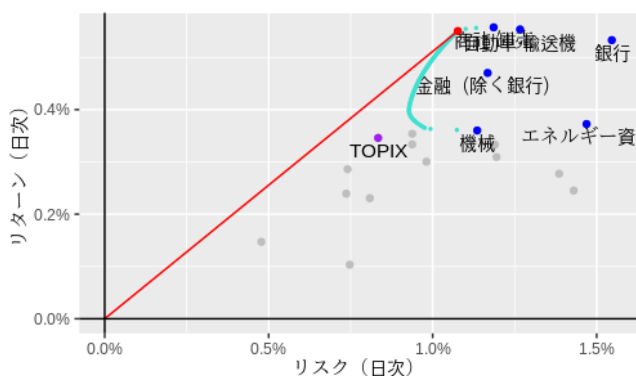
2024年2月3日

【半月】



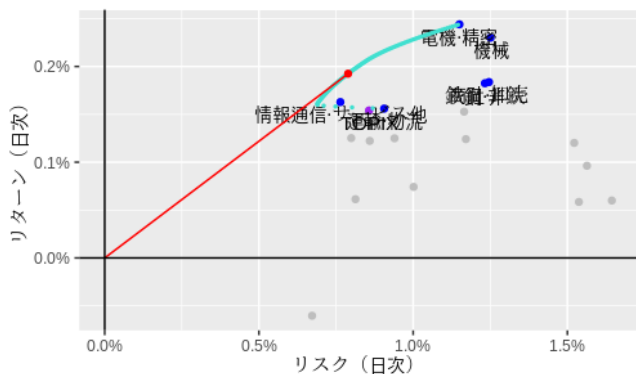
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.364%	0.981%	0.371	—
銀行	0.596%	1.931%	0.308	37.6%
金融(除く銀行)	0.315%	1.234%	0.255	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.279%	1.033%	0.270	32.7%
電力・ガス	0.171%	1.440%	0.119	0.0%
食品	0.165%	0.813%	0.203	29.7%
素材・化学	0.137%	0.654%	0.210	0.0%

【一ヶ月】



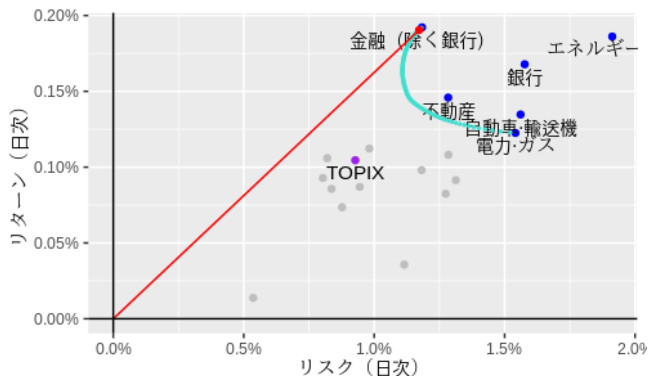
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.550%	1.077%	0.511	—
商社・卸売	0.557%	1.186%	0.470	50.3%
自動車・輸送機	0.553%	1.266%	0.437	28.9%
銀行	0.533%	1.546%	0.345	20.5%
金融(除く銀行)	0.470%	1.168%	0.403	0.0%
エネルギー資源	0.372%	1.469%	0.253	0.0%
機械	0.360%	1.136%	0.317	0.4%

【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	0.193%	0.789%	0.244	—
電機・精密	0.244%	1.150%	0.212	40.0%
機械	0.230%	1.251%	0.184	0.0%
商社・卸売	0.184%	1.246%	0.147	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.182%	1.233%	0.148	0.0%
情報通信・サービス他	0.163%	0.764%	0.213	18.7%
運輸・物流	0.156%	0.906%	0.172	41.3%

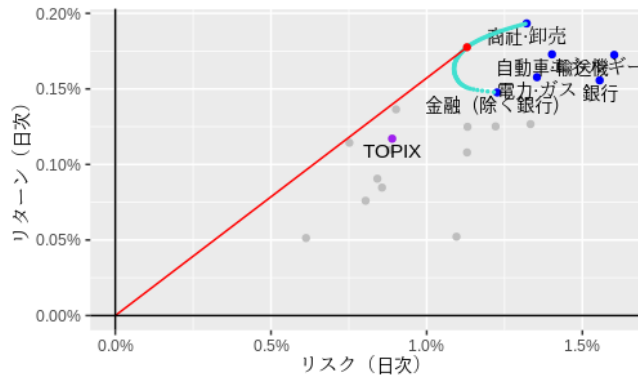
【半年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.190%	1.172%	0.162	—
金融(除く銀行)	0.192%	1.183%	0.162	96.1%
エネルギー資源	0.186%	1.913%	0.097	0.2%
銀行	0.168%	1.577%	0.106	0.0%
不動産	0.146%	1.284%	0.114	3.7%
自動車・輸送機	0.135%	1.561%	0.086	0.0%
電力・ガス	0.123%	1.541%	0.080	0.0%

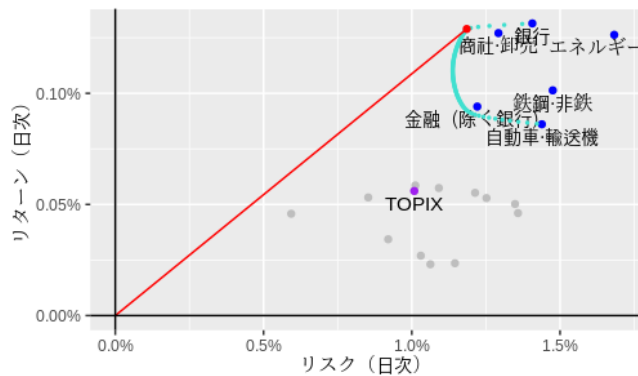
備考 グラフ中の赤点(・)は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【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	0.178%	1.130%	0.157	—
商社・卸売	0.193%	1.321%	0.146	52.3%
自動車・輸送機	0.173%	1.402%	0.123	2.5%
エネルギー資源	0.172%	1.602%	0.108	7.2%
電力・ガス	0.158%	1.354%	0.116	27.9%
銀行	0.156%	1.555%	0.100	10.2%
金融 (除く銀行)	0.148%	1.226%	0.120	0.0%

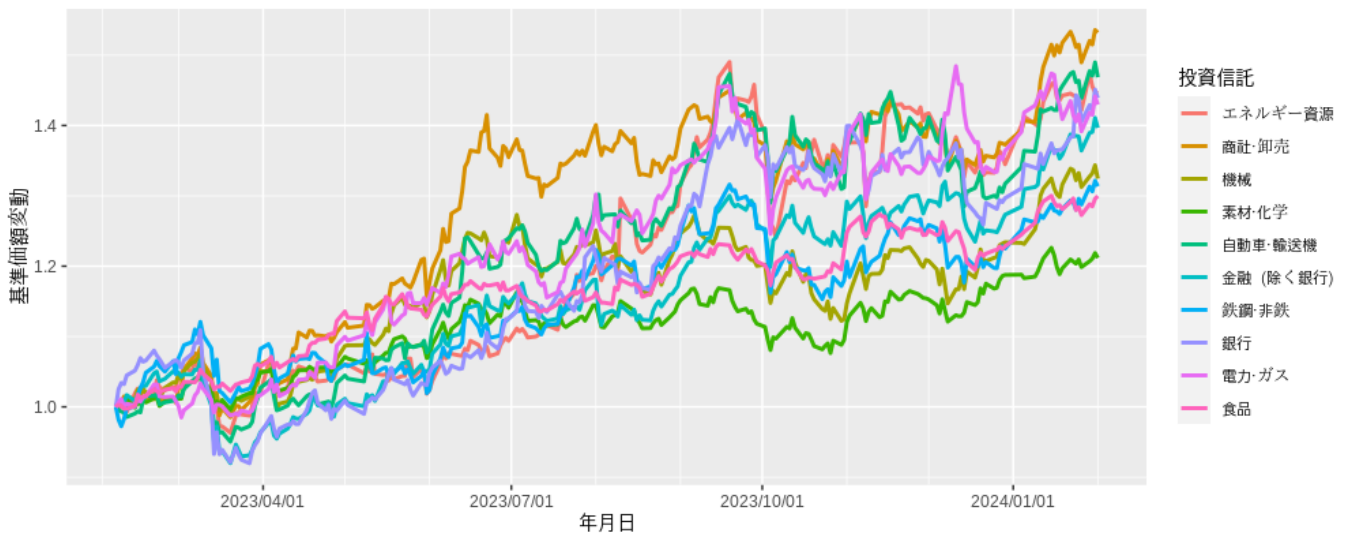
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.129%	1.185%	0.109	—
銀行	0.131%	1.406%	0.093	43.9%
商社・卸売	0.127%	1.292%	0.098	49.8%
エネルギー資源	0.126%	1.683%	0.075	6.3%
鉄鋼・非鉄	0.101%	1.475%	0.069	0.0%
金融 (除く銀行)	0.094%	1.221%	0.077	0.0%
自動車・輸送機	0.086%	1.439%	0.060	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。