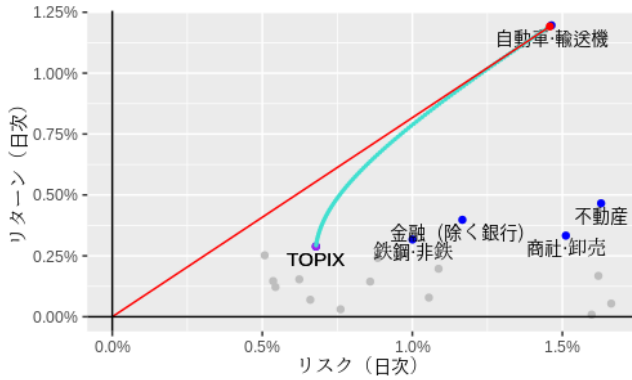


## TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

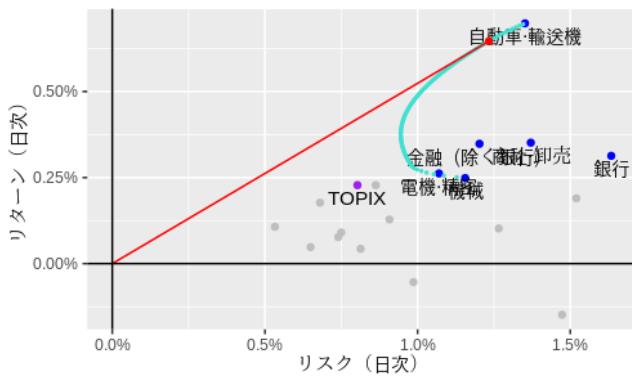
2024年2月10日

【半月】



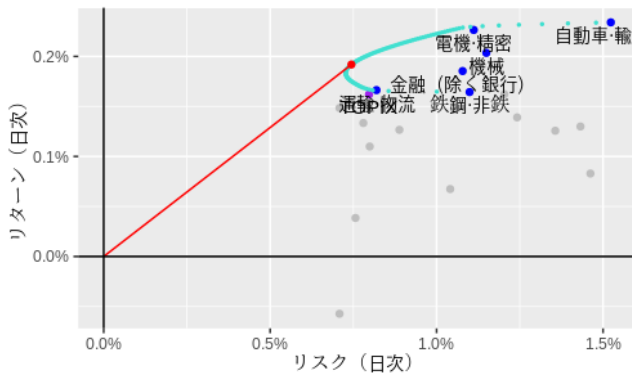
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	1.192%	1.458%	0.817	—
自動車・輸送機	1.196%	1.464%	0.817	99.5%
不動産	0.466%	1.629%	0.286	0.0%
金融(除く銀行)	0.398%	1.167%	0.341	0.0%
商社・卸売	0.333%	1.512%	0.220	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.317%	1.001%	0.317	0.0%
TOPIX	0.289%	0.679%	0.425	0.5%

【一ヶ月】



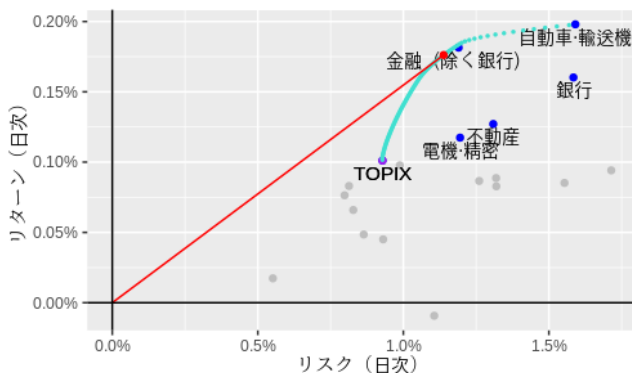
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.646%	1.234%	0.524	—
自動車・輸送機	0.698%	1.352%	0.516	86.6%
商社・卸売	0.351%	1.371%	0.256	0.0%
金融(除く銀行)	0.348%	1.203%	0.289	0.0%
銀行	0.313%	1.634%	0.192	12.9%
電機・精密	0.262%	1.070%	0.245	0.4%
機械	0.249%	1.156%	0.215	0.0%

【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	0.192%	0.744%	0.258	—
自動車・輸送機	0.234%	1.523%	0.154	3.2%
電機・精密	0.226%	1.112%	0.204	35.1%
機械	0.203%	1.149%	0.177	0.0%
金融(除く銀行)	0.185%	1.078%	0.172	12.2%
運輸・物流	0.166%	0.819%	0.203	49.5%
鉄鋼・非鉄	0.164%	1.099%	0.150	0.0%

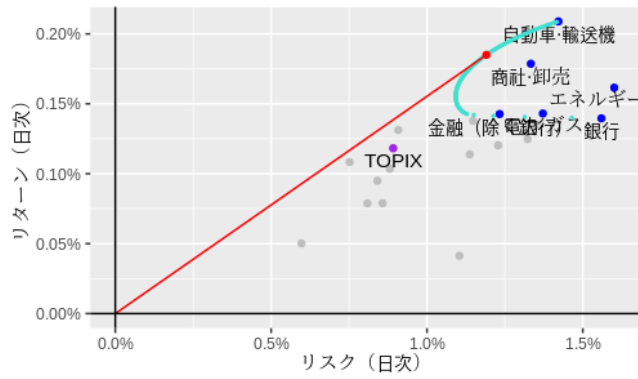
【半年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.176%	1.138%	0.155	—
自動車・輸送機	0.198%	1.591%	0.124	10.8%
金融(除く銀行)	0.181%	1.190%	0.152	78.3%
銀行	0.160%	1.584%	0.101	0.0%
不動産	0.127%	1.309%	0.097	0.0%
電機・精密	0.117%	1.195%	0.098	11.0%
TOPIX	0.101%	0.928%	0.109	0.0%

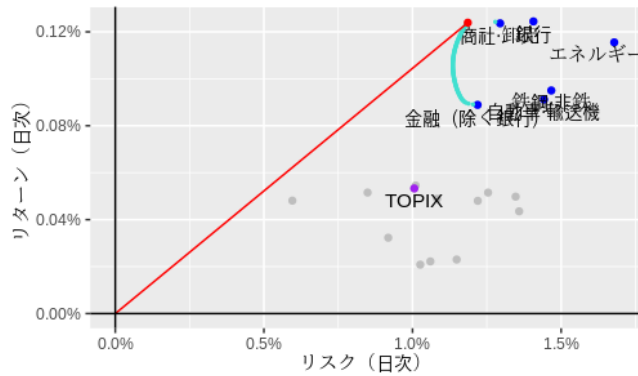
備考 グラフ中の赤点(・)は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【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	0.185%	1.191%	0.155	—
自動車・輸送機	0.209%	1.422%	0.147	50.0%
商社・卸売	0.179%	1.333%	0.134	23.3%
エネルギー資源	0.162%	1.601%	0.101	4.3%
電力・ガス	0.143%	1.372%	0.104	20.0%
金融(除く銀行)	0.143%	1.233%	0.116	0.0%
銀行	0.140%	1.560%	0.089	2.4%

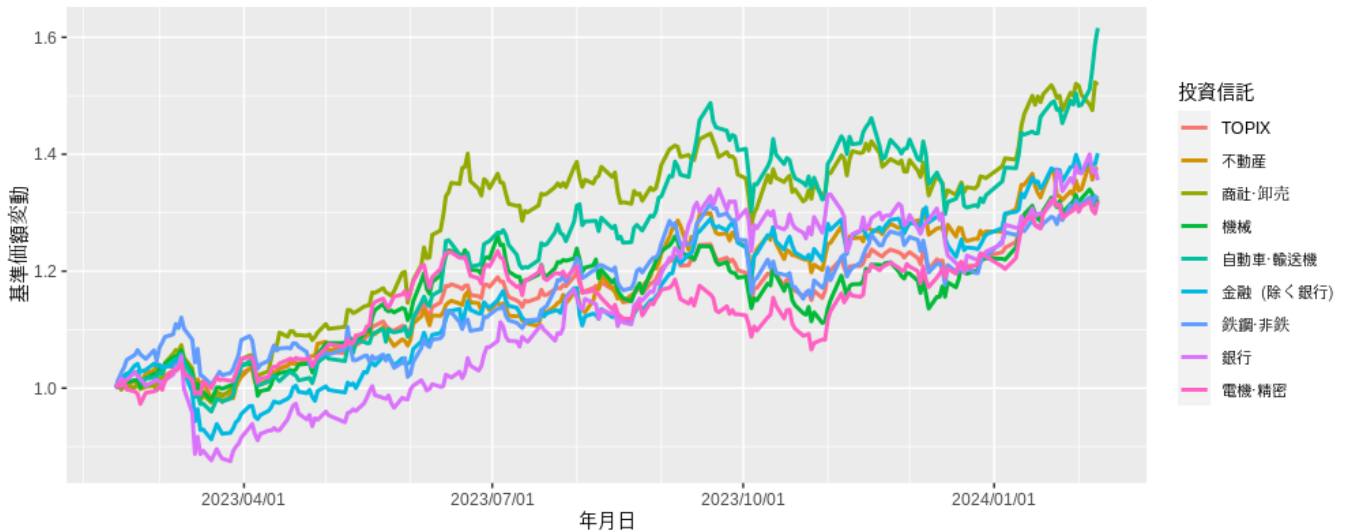
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.124%	1.186%	0.104	—
銀行	0.124%	1.407%	0.088	41.3%
商社・卸売	0.124%	1.295%	0.095	58.0%
エネルギー資源	0.115%	1.679%	0.069	0.7%
鉄鋼・非鉄	0.095%	1.467%	0.065	0.0%
自動車・輸送機	0.091%	1.442%	0.063	0.0%
金融(除く銀行)	0.089%	1.219%	0.073	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。