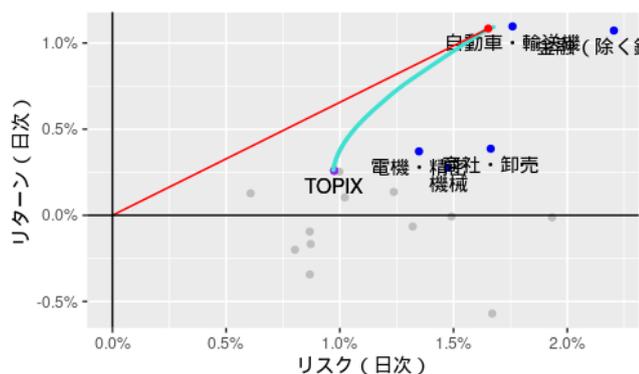


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

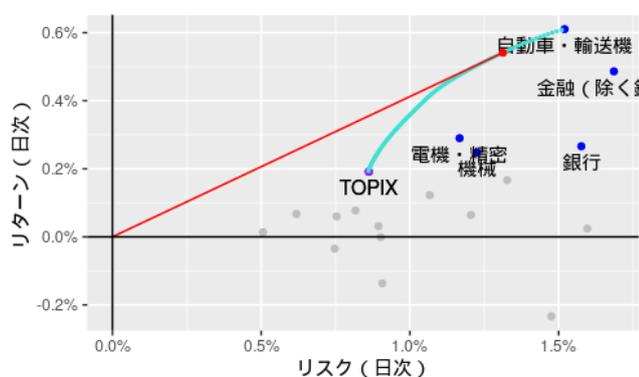
2024年2月17日

【半月】



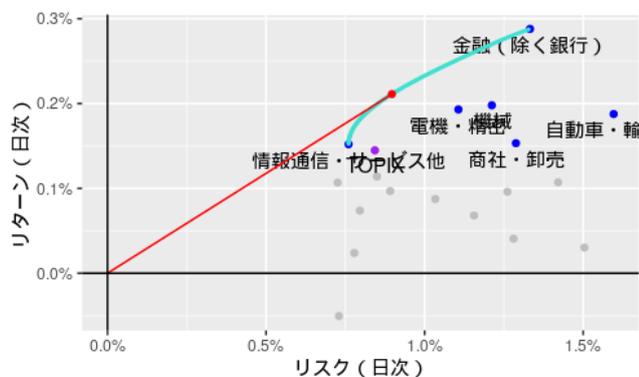
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	1.084%	1.652%	0.656	—
自動車・輸送機	1.096%	1.759%	0.623	72.3%
金融 (除く銀行)	1.072%	2.205%	0.486	26.9%
商社・卸売	0.386%	1.663%	0.232	0.0%
電機・精密	0.371%	1.348%	0.275	0.0%
機械	0.277%	1.475%	0.188	0.7%
TOPIX	0.259%	0.975%	0.266	0.0%

【一ヶ月】



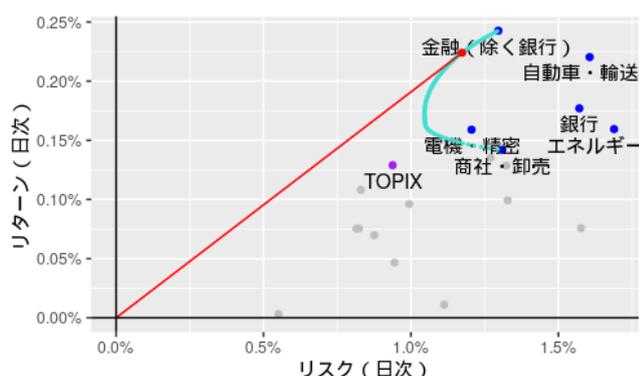
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.541%	1.313%	0.412	—
自動車・輸送機	0.610%	1.520%	0.401	74.2%
金融 (除く銀行)	0.486%	1.686%	0.288	8.5%
電機・精密	0.290%	1.167%	0.248	3.3%
銀行	0.266%	1.576%	0.169	13.9%
機械	0.248%	1.226%	0.202	0.0%
TOPIX	0.191%	0.862%	0.222	0.0%

【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	0.211%	0.897%	0.235	—
金融 (除く銀行)	0.288%	1.332%	0.216	43.5%
機械	0.198%	1.212%	0.163	0.0%
電機・精密	0.193%	1.107%	0.174	0.0%
自動車・輸送機	0.188%	1.596%	0.118	0.0%
商社・卸売	0.153%	1.288%	0.119	0.0%
情報通信・サービス他	0.152%	0.760%	0.200	56.5%

【半年】

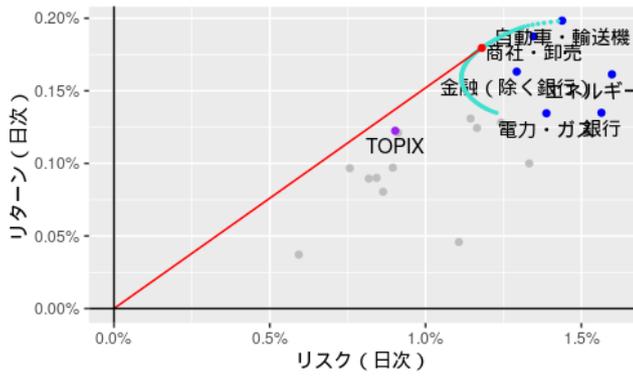


TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.224%	1.173%	0.191	—
金融 (除く銀行)	0.243%	1.296%	0.187	77.7%
自動車・輸送機	0.220%	1.606%	0.137	0.0%
銀行	0.177%	1.571%	0.113	0.0%
エネルギー資源	0.159%	1.689%	0.094	0.0%
電機・精密	0.159%	1.206%	0.132	22.3%
商社・卸売	0.142%	1.310%	0.108	0.0%

備考 (1) 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。

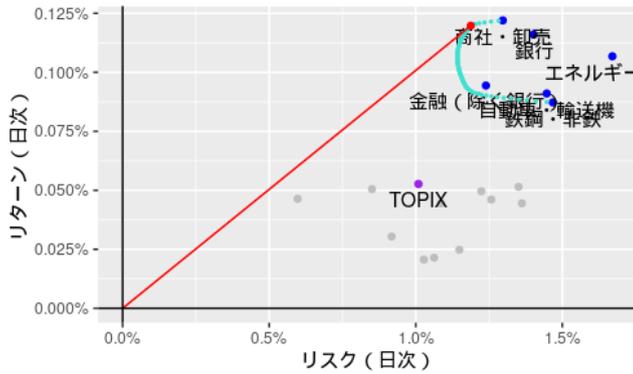
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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	0.180%	1.181%	0.152	—
自動車・輸送機	0.198%	1.438%	0.138	31.6%
商社・卸売	0.187%	1.346%	0.139	34.3%
金融(除く銀行)	0.163%	1.293%	0.126	19.5%
エネルギー資源	0.161%	1.598%	0.101	3.9%
銀行	0.135%	1.565%	0.086	0.0%
電力・ガス	0.135%	1.388%	0.097	10.7%

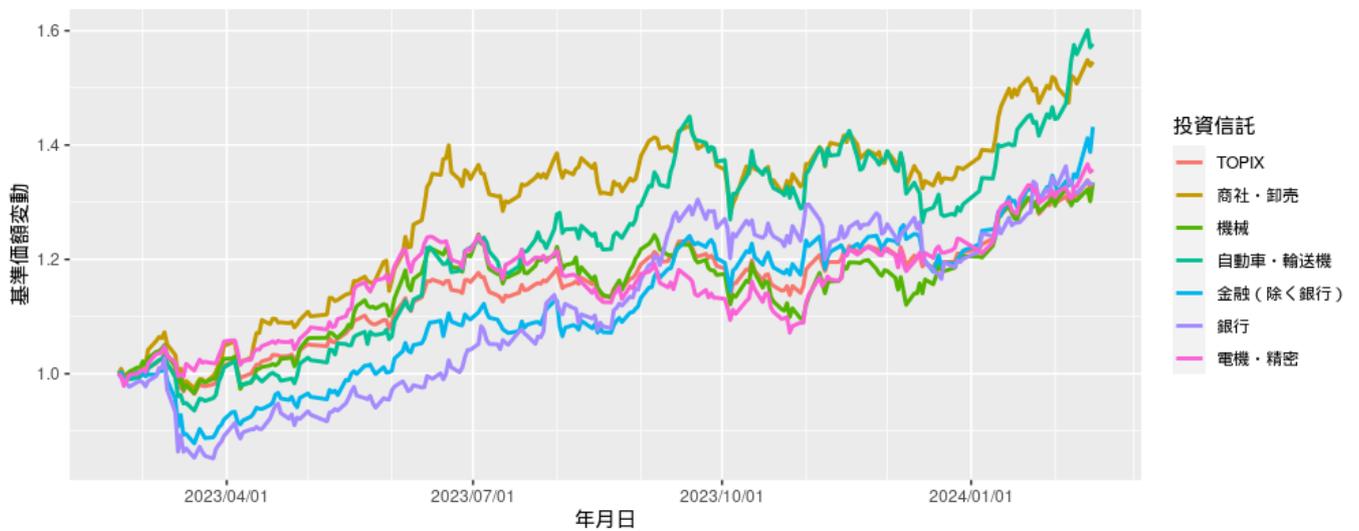
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.120%	1.188%	0.101	—
商社・卸売	0.122%	1.297%	0.094	62.7%
銀行	0.116%	1.402%	0.083	37.1%
エネルギー資源	0.107%	1.671%	0.064	0.1%
金融(除く銀行)	0.094%	1.239%	0.076	0.0%
自動車・輸送機	0.091%	1.447%	0.063	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.087%	1.468%	0.059	0.0%

備考 (1) 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。
 (2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

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の銘柄について一年前を 1 とした直近一年間の価額変動を示します。