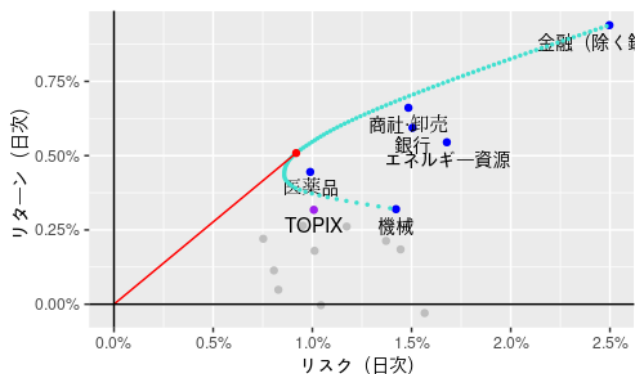


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

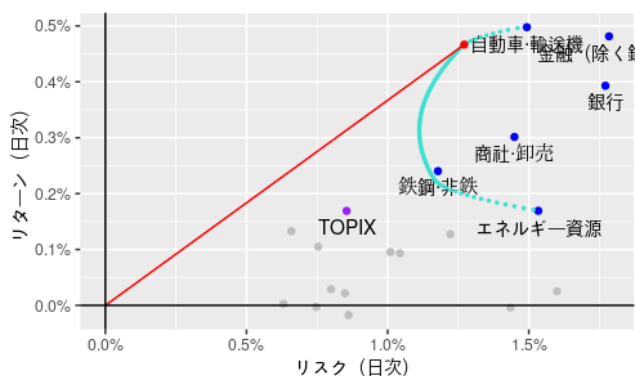
2024年2月23日

【半月】



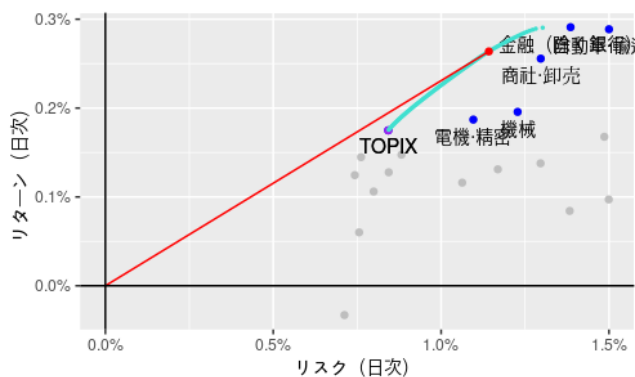
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.509%	0.918%	0.554	—
金融 (除く銀行)	0.939%	2.497%	0.376	0.0%
商社・卸売	0.661%	1.484%	0.445	35.2%
銀行	0.594%	1.505%	0.395	0.0%
エネルギー資源	0.545%	1.678%	0.325	0.0%
医薬品	0.445%	0.989%	0.450	55.0%
機械	0.320%	1.422%	0.225	9.9%

【一ヶ月】



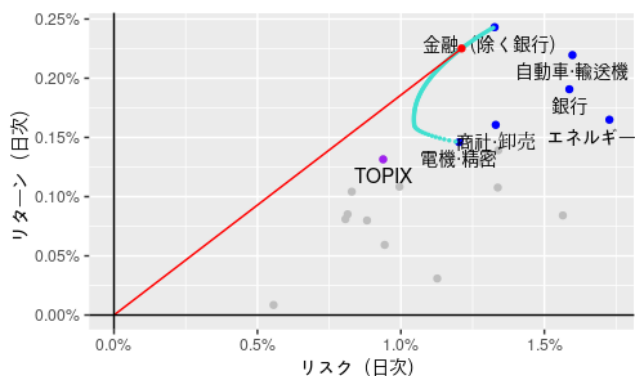
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.467%	1.271%	0.367	—
自動車・輸送機	0.498%	1.493%	0.333	67.9%
金融 (除く銀行)	0.481%	1.784%	0.270	2.7%
銀行	0.393%	1.771%	0.222	29.4%
商社・卸売	0.301%	1.449%	0.208	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.240%	1.178%	0.204	0.0%
エネルギー資源	0.169%	1.534%	0.110	0.0%

【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	0.264%	1.142%	0.231	—
金融 (除く銀行)	0.291%	1.386%	0.210	39.8%
自動車・輸送機	0.289%	1.500%	0.192	21.1%
商社・卸売	0.256%	1.297%	0.197	20.1%
機械	0.196%	1.228%	0.159	0.0%
電機・精密	0.187%	1.096%	0.171	18.9%
TOPIX	0.175%	0.842%	0.208	0.0%

【半年】

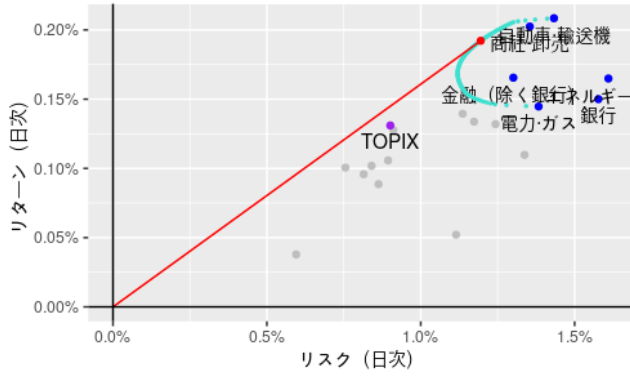


TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.225%	1.212%	0.186	—
金融 (除く銀行)	0.243%	1.327%	0.183	79.4%
自動車・輸送機	0.220%	1.598%	0.137	2.8%
銀行	0.191%	1.587%	0.120	0.0%
エネルギー資源	0.165%	1.727%	0.096	0.0%
商社・卸売	0.161%	1.331%	0.121	0.0%
電機・精密	0.146%	1.203%	0.121	17.8%

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。

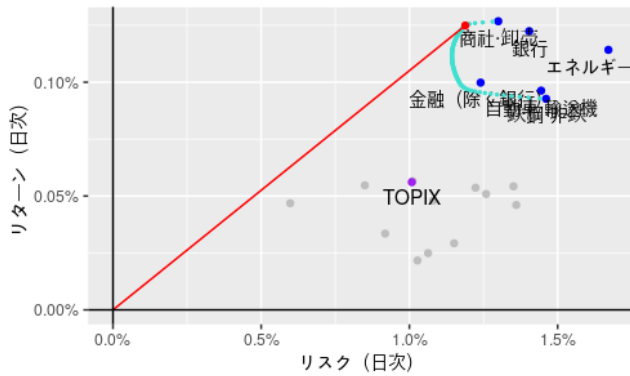
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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	0.192%	1.195%	0.161	—
自動車・輸送機	0.208%	1.433%	0.145	33.2%
商社・卸売	0.202%	1.354%	0.149	41.6%
金融（除く銀行）	0.165%	1.301%	0.127	10.5%
エネルギー資源	0.165%	1.610%	0.102	0.5%
銀行	0.150%	1.577%	0.095	0.0%
電力・ガス	0.145%	1.383%	0.105	14.2%

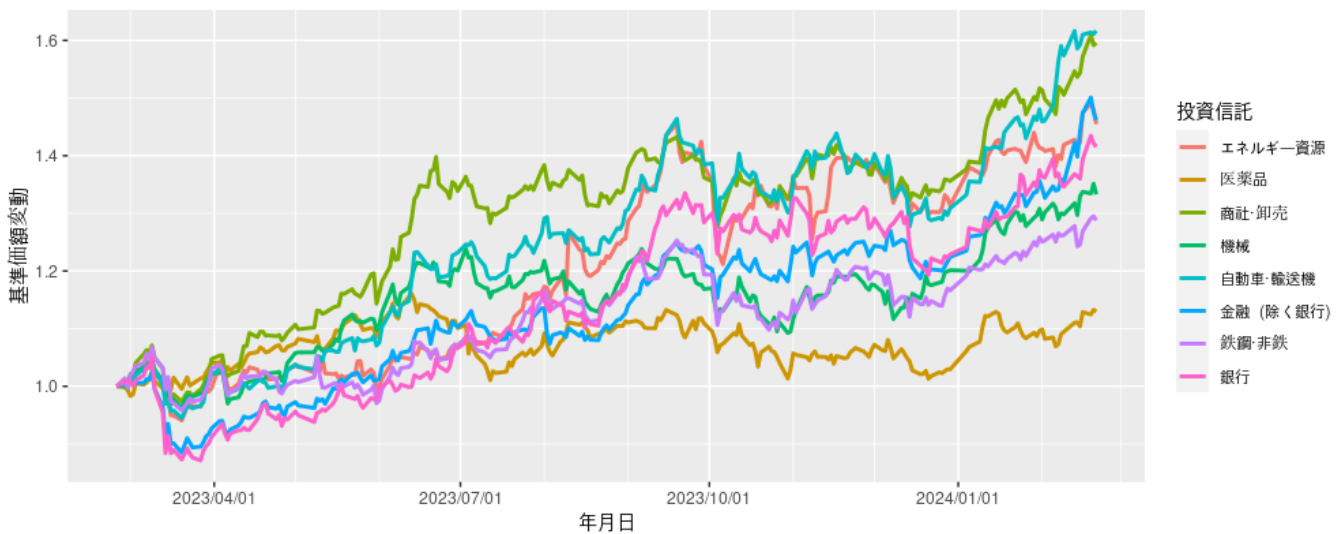
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.125%	1.188%	0.105	—
商社・卸売	0.127%	1.300%	0.098	60.4%
銀行	0.122%	1.404%	0.087	37.8%
エネルギー資源	0.114%	1.671%	0.068	1.8%
金融（除く銀行）	0.100%	1.240%	0.080	0.0%
自動車・輸送機	0.096%	1.444%	0.067	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.093%	1.461%	0.063	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。