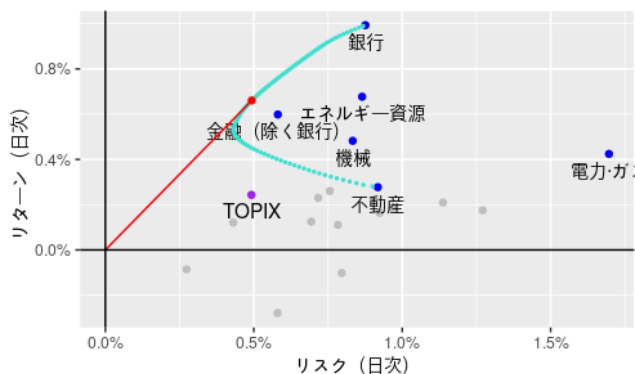


## TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

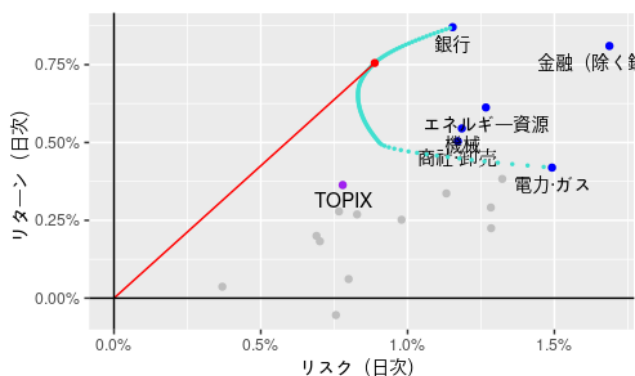
2024年3月9日

【半月】



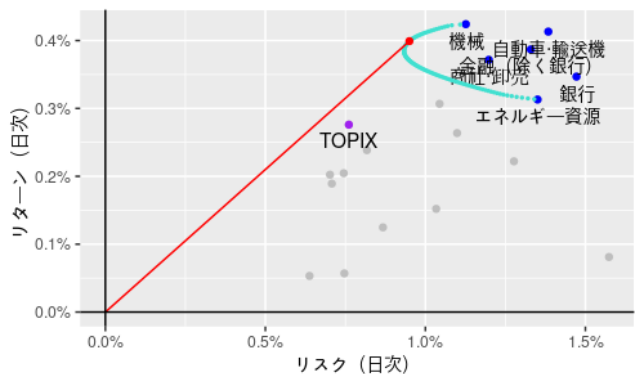
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.660%	0.493%	1.339	—
銀行	0.993%	0.876%	1.134	27.6%
エネルギー資源	0.677%	0.865%	0.783	0.0%
金融(除く銀行)	0.599%	0.581%	1.030	42.3%
機械	0.482%	0.833%	0.579	21.8%
電力・ガス	0.424%	1.697%	0.250	3.3%
不動産	0.277%	0.918%	0.302	5.0%

【一ヶ月】



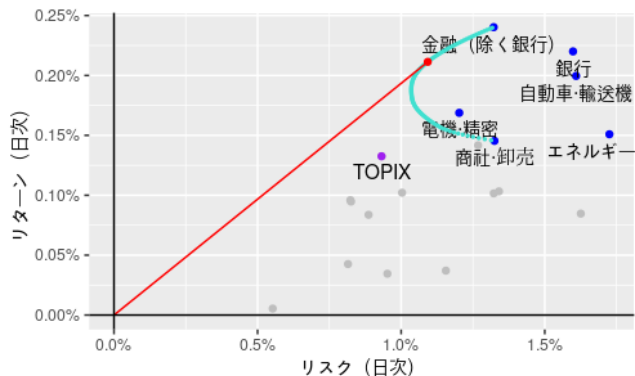
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.755%	0.888%	0.851	—
銀行	0.870%	1.153%	0.755	64.6%
金融(除く銀行)	0.810%	1.687%	0.480	0.0%
エネルギー資源	0.613%	1.267%	0.484	0.0%
機械	0.545%	1.185%	0.460	35.4%
商社・卸売	0.504%	1.171%	0.430	0.0%
電力・ガス	0.419%	1.492%	0.281	0.0%

【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	0.399%	0.950%	0.420	—
機械	0.424%	1.126%	0.377	56.8%
自動車・輸送機	0.413%	1.384%	0.298	5.7%
金融(除く銀行)	0.387%	1.329%	0.291	0.0%
商社・卸売	0.372%	1.198%	0.310	20.7%
銀行	0.347%	1.472%	0.236	15.3%
エネルギー資源	0.313%	1.351%	0.232	1.5%

【半年】

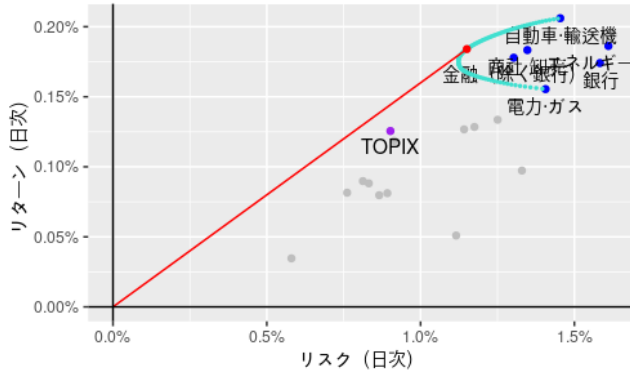


TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.211%	1.093%	0.193	—
金融(除く銀行)	0.240%	1.322%	0.182	47.8%
銀行	0.220%	1.599%	0.138	16.4%
自動車・輸送機	0.200%	1.609%	0.124	0.0%
電機・精密	0.169%	1.202%	0.140	35.9%
エネルギー資源	0.151%	1.725%	0.087	0.0%
商社・卸売	0.145%	1.325%	0.110	0.0%

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。

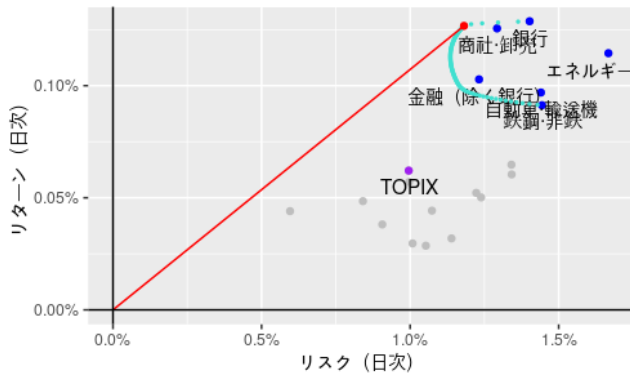
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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	0.184%	1.150%	0.160	—
自動車・輸送機	0.206%	1.454%	0.142	31.3%
エネルギー資源	0.186%	1.611%	0.116	10.9%
商社・卸売	0.183%	1.347%	0.136	13.8%
金融 (除く銀行)	0.178%	1.303%	0.137	20.2%
銀行	0.174%	1.583%	0.110	5.4%
電力・ガス	0.155%	1.406%	0.111	18.4%

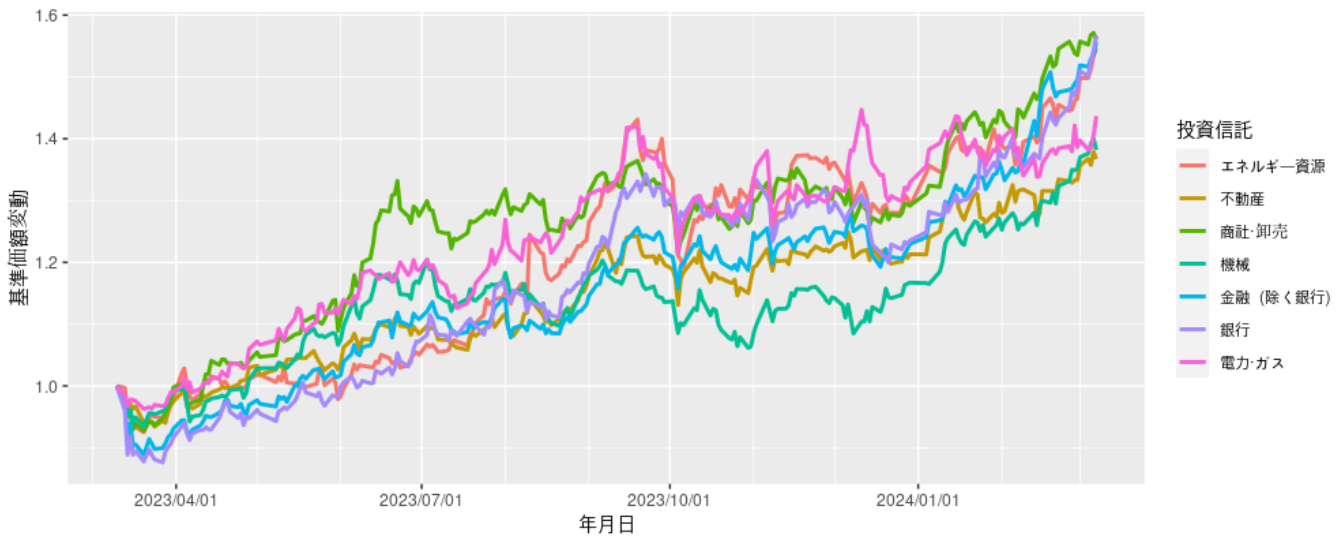
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.127%	1.181%	0.107	—
銀行	0.129%	1.402%	0.092	42.3%
商社・卸売	0.126%	1.293%	0.097	55.7%
エネルギー資源	0.114%	1.667%	0.069	2.0%
金融 (除く銀行)	0.103%	1.232%	0.083	0.0%
自動車・輸送機	0.097%	1.440%	0.067	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.091%	1.444%	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。