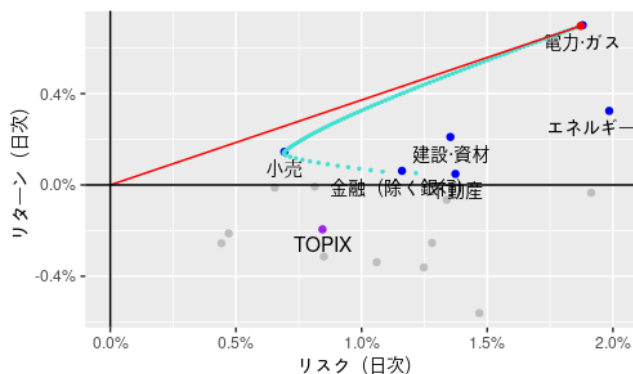


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

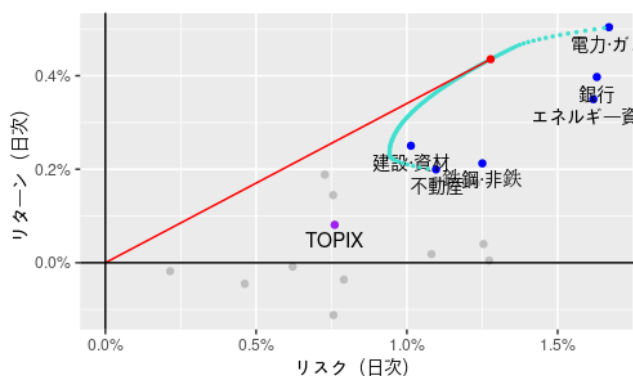
2024年3月16日

【半月】



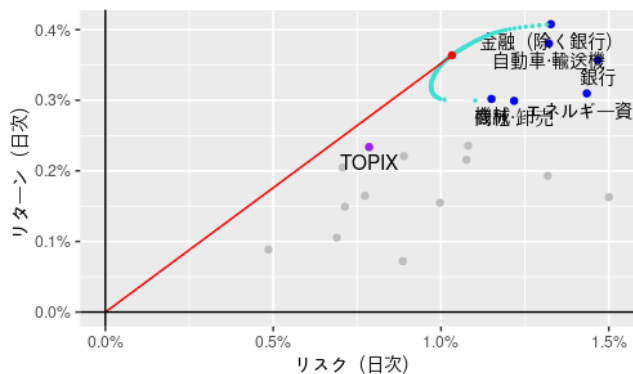
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.697%	1.872%	0.372	—
電力・ガス	0.700%	1.880%	0.372	99.4%
エネルギー資源	0.324%	1.985%	0.163	0.0%
建設・資材	0.210%	1.353%	0.155	0.0%
小売	0.145%	0.693%	0.210	0.6%
金融(除く銀行)	0.062%	1.161%	0.053	0.0%
不動産	0.048%	1.373%	0.035	0.0%

【一ヶ月】



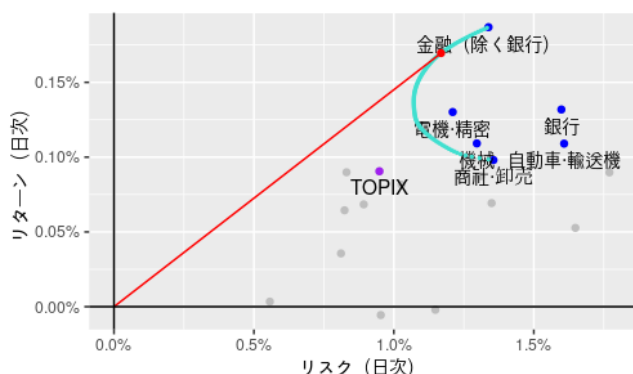
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.435%	1.278%	0.341	—
電力・ガス	0.504%	1.670%	0.302	53.7%
銀行	0.397%	1.630%	0.244	33.4%
エネルギー資源	0.350%	1.618%	0.216	0.0%
建設・資材	0.250%	1.013%	0.247	13.0%
鉄鋼・非鉄	0.212%	1.250%	0.170	0.0%
不動産	0.200%	1.097%	0.182	0.0%

【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	0.364%	1.033%	0.352	—
金融(除く銀行)	0.408%	1.327%	0.307	25.8%
自動車・輸送機	0.380%	1.321%	0.288	31.1%
銀行	0.357%	1.468%	0.243	17.5%
エネルギー資源	0.310%	1.434%	0.216	6.4%
機械	0.302%	1.150%	0.262	19.2%
商社・卸売	0.299%	1.218%	0.246	0.0%

【半年】

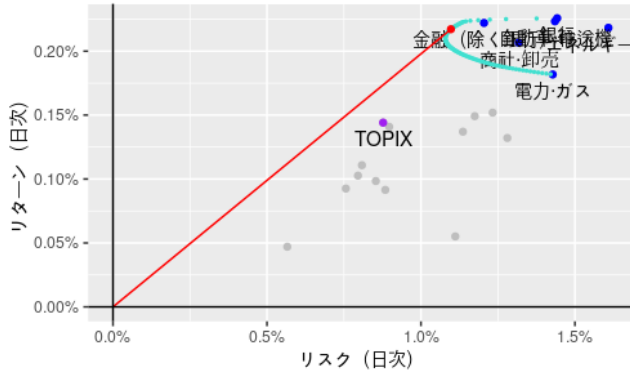


TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.170%	1.169%	0.145	—
金融(除く銀行)	0.187%	1.338%	0.140	69.5%
銀行	0.132%	1.599%	0.082	0.0%
電機・精密	0.130%	1.210%	0.108	30.5%
機械	0.109%	1.297%	0.084	0.0%
自動車・輸送機	0.109%	1.608%	0.068	0.0%
商社・卸売	0.098%	1.356%	0.072	0.0%

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。

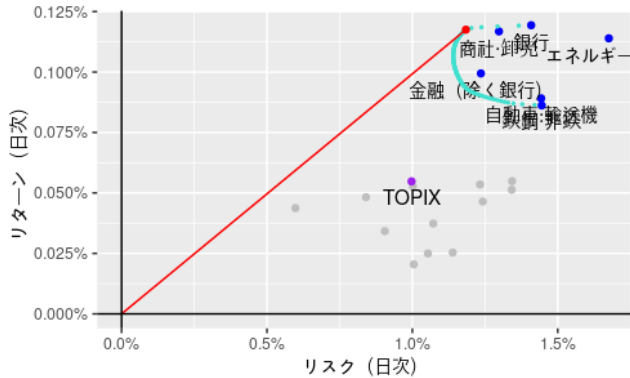
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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	0.217%	1.097%	0.198	—
銀行	0.226%	1.442%	0.157	18.2%
自動車・輸送機	0.223%	1.435%	0.156	15.8%
金融(除く銀行)	0.222%	1.205%	0.184	39.6%
エネルギー資源	0.218%	1.609%	0.136	7.1%
商社・卸売	0.207%	1.317%	0.157	9.3%
電力・ガス	0.182%	1.428%	0.127	10.1%

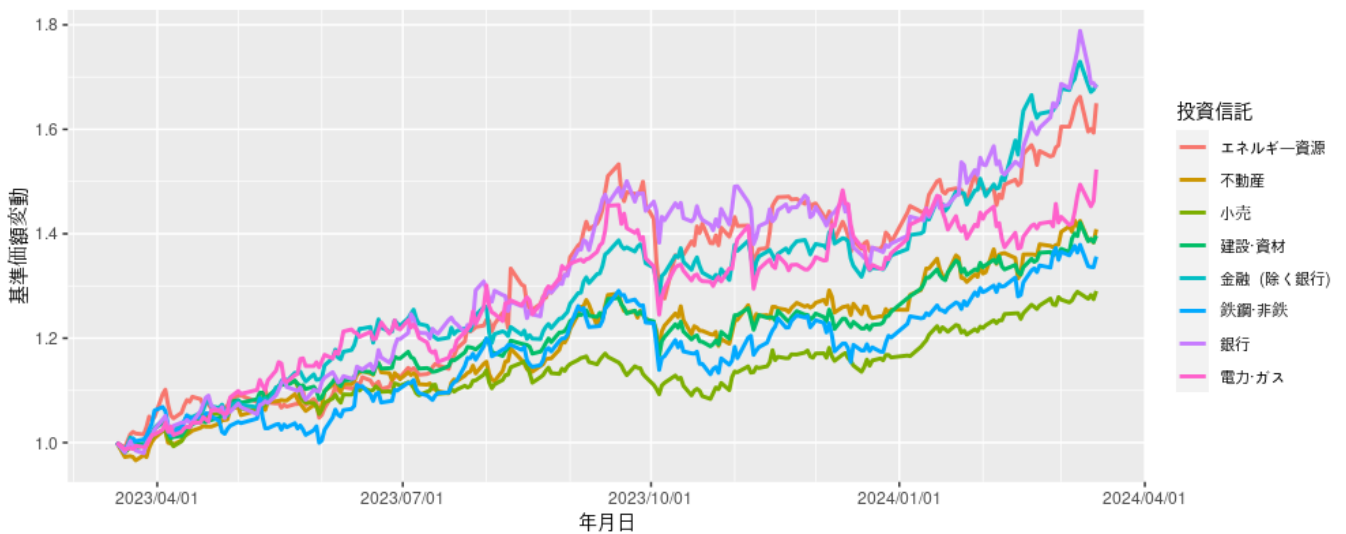
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.118%	1.184%	0.099	—
銀行	0.119%	1.409%	0.085	40.5%
商社・卸売	0.117%	1.298%	0.090	52.2%
エネルギー資源	0.114%	1.676%	0.068	6.6%
金融(除く銀行)	0.099%	1.236%	0.080	0.7%
自動車・輸送機	0.089%	1.443%	0.062	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.086%	1.445%	0.060	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。