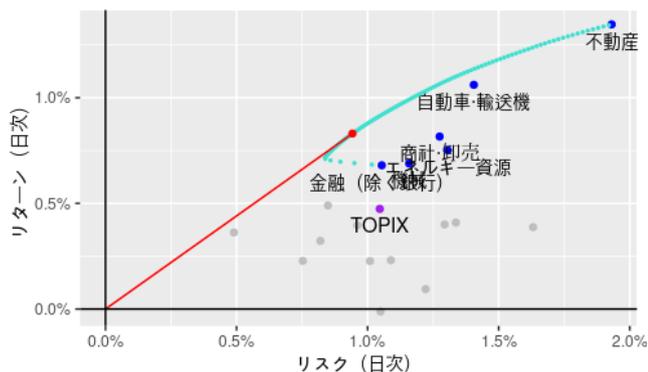


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

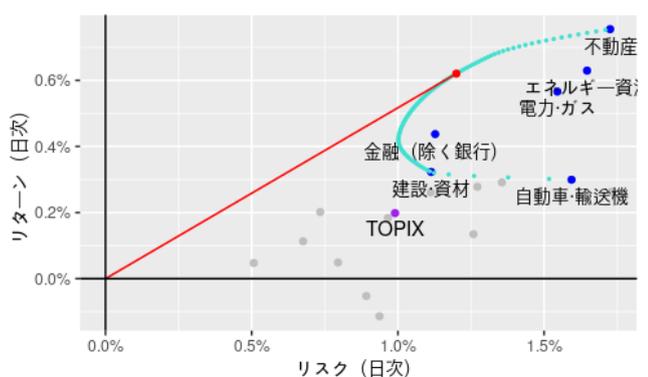
2024年3月30日

【半月】



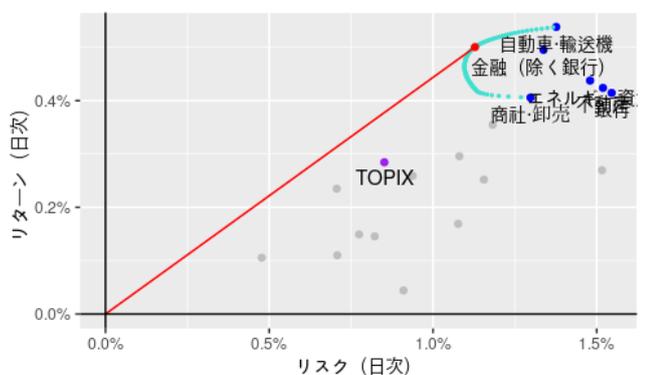
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.830%	0.942%	0.881	—
不動産	1.347%	1.931%	0.698	11.9%
自動車・輸送機	1.061%	1.405%	0.755	10.2%
商社・卸売	0.816%	1.275%	0.640	0.0%
エネルギー資源	0.752%	1.305%	0.576	39.6%
機械	0.689%	1.159%	0.595	38.2%
金融(除く銀行)	0.680%	1.054%	0.645	0.0%

【一ヶ月】



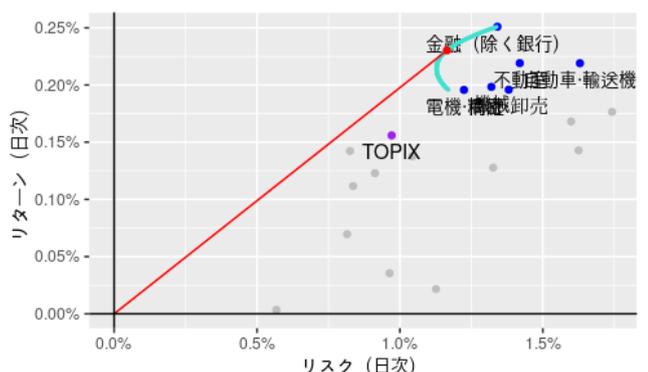
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.620%	1.200%	0.517	—
不動産	0.755%	1.726%	0.437	42.0%
エネルギー資源	0.629%	1.647%	0.382	0.0%
電力・ガス	0.566%	1.545%	0.366	38.6%
金融(除く銀行)	0.437%	1.128%	0.388	19.3%
建設・資材	0.323%	1.114%	0.290	0.0%
自動車・輸送機	0.299%	1.594%	0.188	0.0%

【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	0.501%	1.128%	0.444	—
自動車・輸送機	0.538%	1.376%	0.391	45.4%
金融(除く銀行)	0.495%	1.338%	0.370	30.9%
エネルギー資源	0.438%	1.480%	0.296	20.9%
不動産	0.424%	1.519%	0.279	0.0%
銀行	0.415%	1.546%	0.268	2.8%
商社・卸売	0.406%	1.298%	0.313	0.0%

【半年】

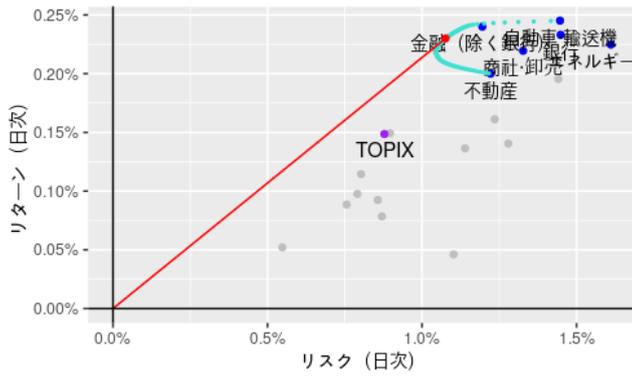


TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.230%	1.164%	0.198	—
金融(除く銀行)	0.251%	1.341%	0.187	58.8%
不動産	0.219%	1.420%	0.154	8.7%
自動車・輸送機	0.219%	1.630%	0.134	0.0%
機械	0.198%	1.320%	0.150	0.0%
商社・卸売	0.196%	1.381%	0.142	0.0%
電機・精密	0.196%	1.224%	0.160	32.5%

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。

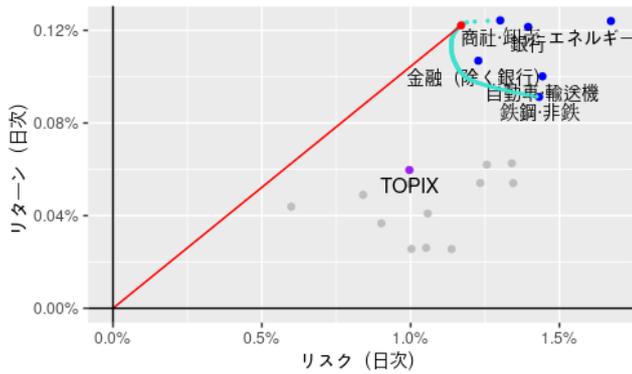
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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	0.230%	1.076%	0.214	—
自動車・輸送機	0.245%	1.447%	0.169	12.4%
金融（除く銀行）	0.240%	1.195%	0.201	42.4%
銀行	0.233%	1.448%	0.161	16.8%
エネルギー資源	0.225%	1.611%	0.139	5.4%
商社・卸売	0.220%	1.327%	0.165	2.9%
不動産	0.200%	1.222%	0.164	20.1%

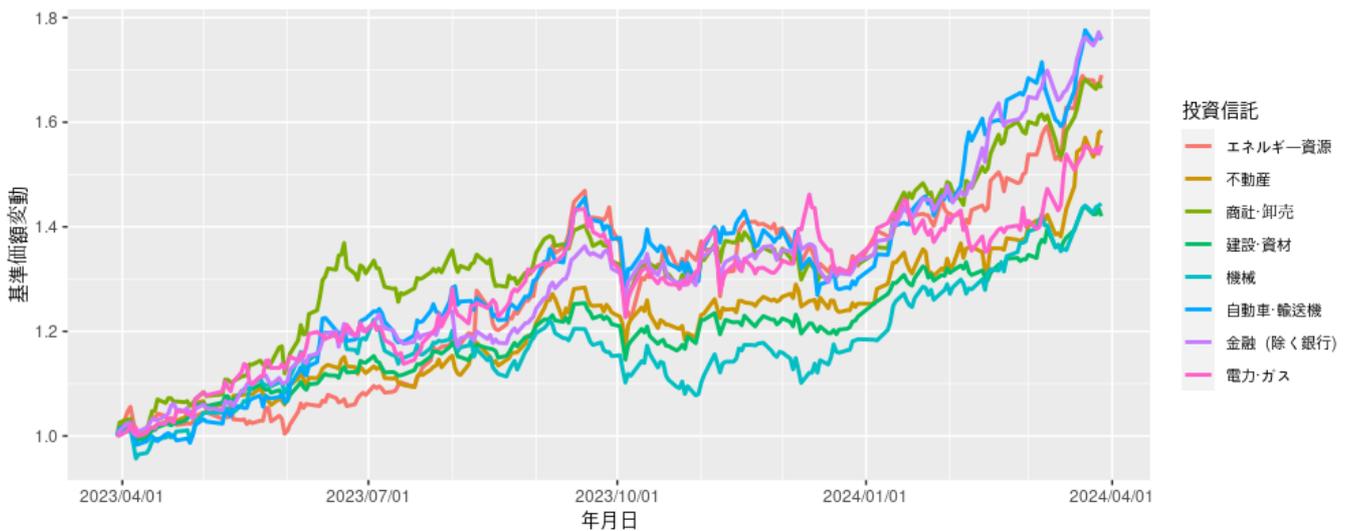
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.122%	1.169%	0.104	—
商社・卸売	0.124%	1.301%	0.096	49.3%
エネルギー資源	0.124%	1.673%	0.074	9.9%
銀行	0.121%	1.395%	0.087	34.1%
金融（除く銀行）	0.107%	1.227%	0.087	6.7%
自動車・輸送機	0.100%	1.443%	0.069	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.091%	1.431%	0.064	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。