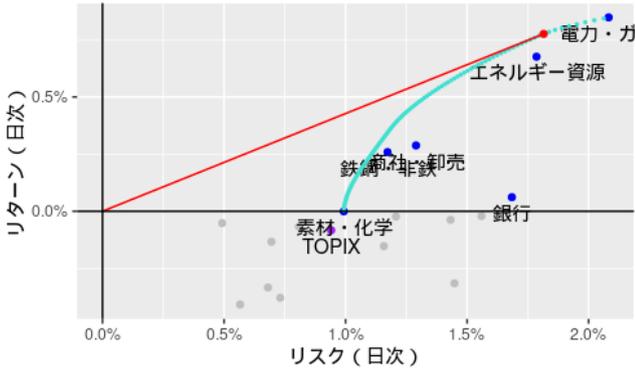


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

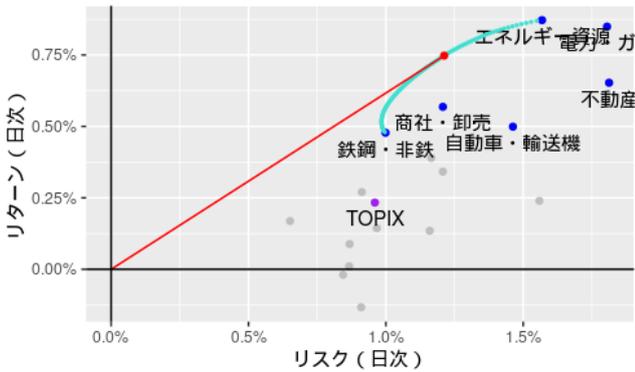
2024年4月13日

【半月】



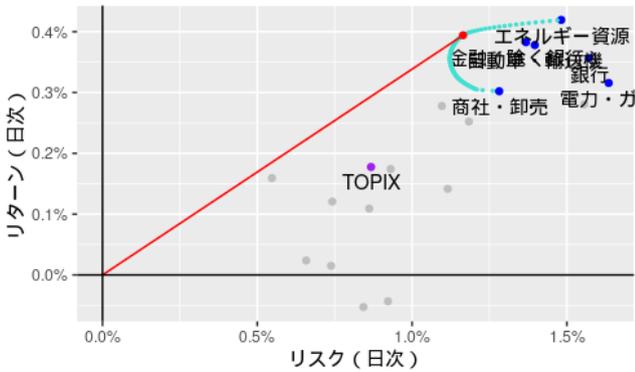
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.776%	1.815%	0.427	—
電力・ガス	0.848%	2.082%	0.407	58.1%
エネルギー資源	0.676%	1.786%	0.379	41.9%
商社・卸売	0.288%	1.290%	0.223	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.259%	1.173%	0.221	0.0%
銀行	0.062%	1.684%	0.037	0.0%
素材・化学	-0.001%	0.993%	-0.001	0.0%

【一ヶ月】



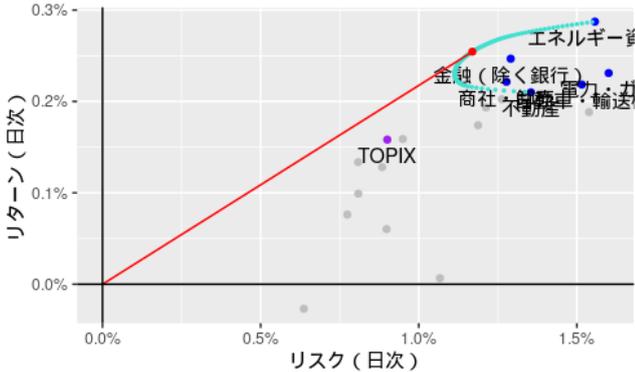
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.748%	1.212%	0.617	—
エネルギー資源	0.872%	1.569%	0.556	35.1%
電力・ガス	0.849%	1.805%	0.470	21.2%
不動産	0.653%	1.813%	0.360	16.8%
商社・卸売	0.568%	1.208%	0.471	26.0%
自動車・輸送機	0.499%	1.463%	0.341	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.478%	0.999%	0.478	0.9%

【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	0.394%	1.165%	0.339	—
エネルギー資源	0.419%	1.482%	0.283	38.7%
金融 (除く銀行)	0.383%	1.368%	0.280	24.8%
自動車・輸送機	0.378%	1.396%	0.271	31.7%
銀行	0.357%	1.571%	0.227	4.8%
電力・ガス	0.316%	1.635%	0.193	0.0%
商社・卸売	0.302%	1.281%	0.236	0.0%

【半年】

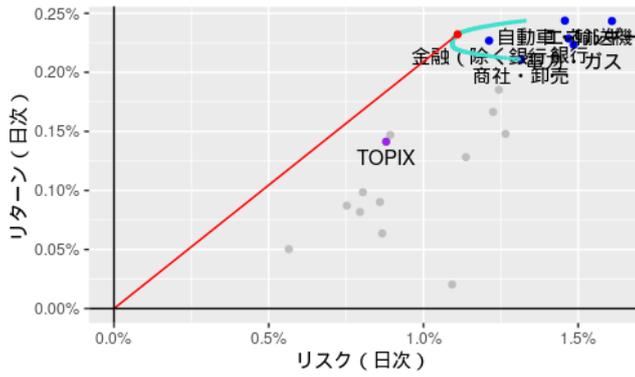


TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.254%	1.169%	0.218	—
エネルギー資源	0.287%	1.557%	0.185	34.4%
金融 (除く銀行)	0.247%	1.291%	0.191	43.7%
電力・ガス	0.231%	1.600%	0.144	7.9%
商社・卸売	0.222%	1.277%	0.173	1.2%
自動車・輸送機	0.219%	1.516%	0.144	0.0%
不動産	0.210%	1.355%	0.155	12.8%

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。

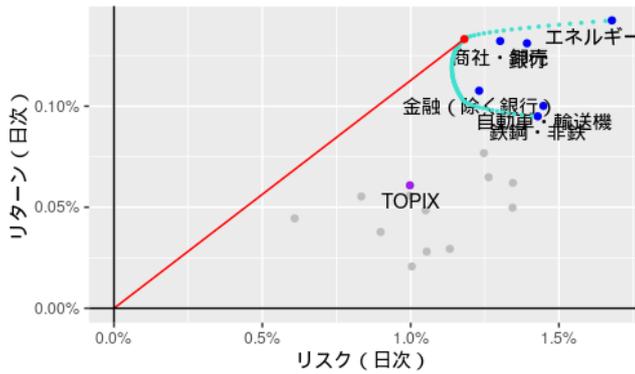
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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	0.232%	1.110%	0.209	—
自動車・輸送機	0.244%	1.457%	0.167	20.8%
エネルギー資源	0.243%	1.609%	0.151	13.5%
銀行	0.229%	1.469%	0.156	13.0%
金融(除く銀行)	0.227%	1.212%	0.187	33.6%
電力・ガス	0.223%	1.486%	0.150	19.2%
商社・卸売	0.211%	1.315%	0.160	0.0%

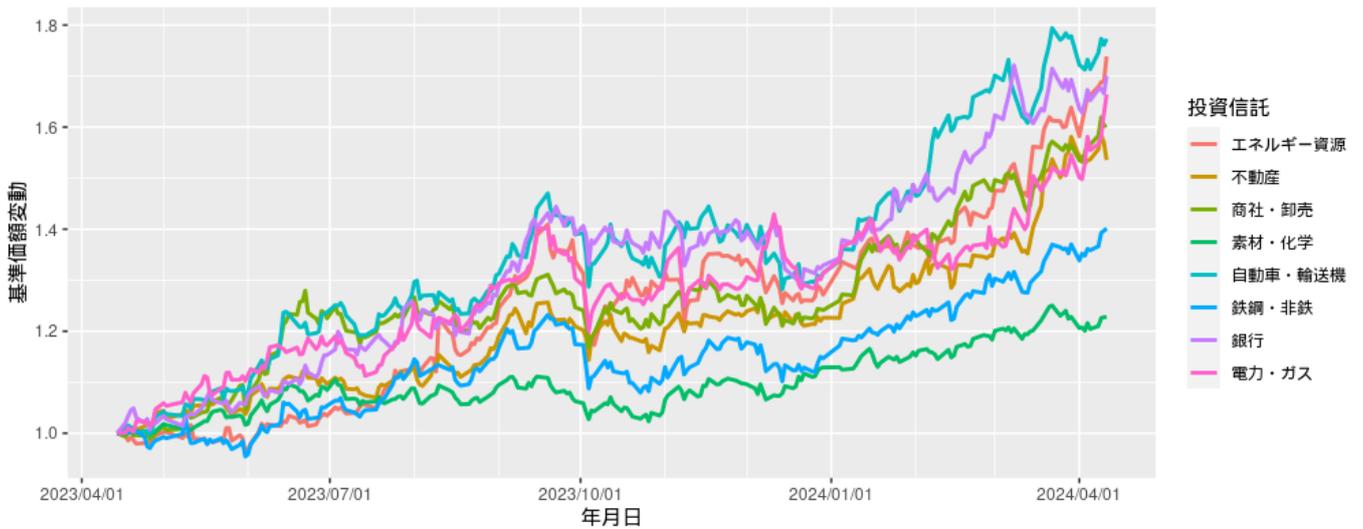
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.133%	1.181%	0.113	—
エネルギー資源	0.142%	1.679%	0.085	14.7%
商社・卸売	0.132%	1.302%	0.102	46.8%
銀行	0.131%	1.392%	0.094	38.1%
金融(除く銀行)	0.108%	1.231%	0.087	0.5%
自動車・輸送機	0.100%	1.448%	0.069	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.095%	1.428%	0.066	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。