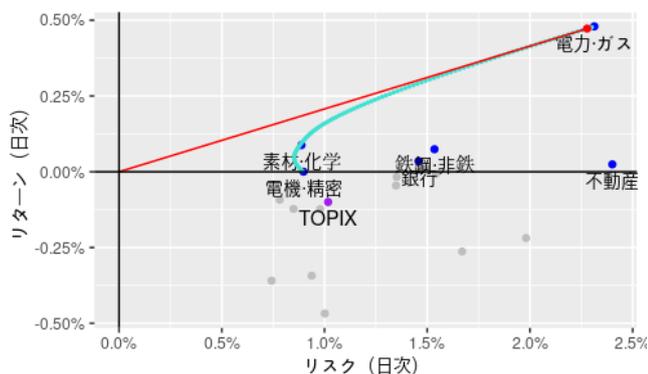


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

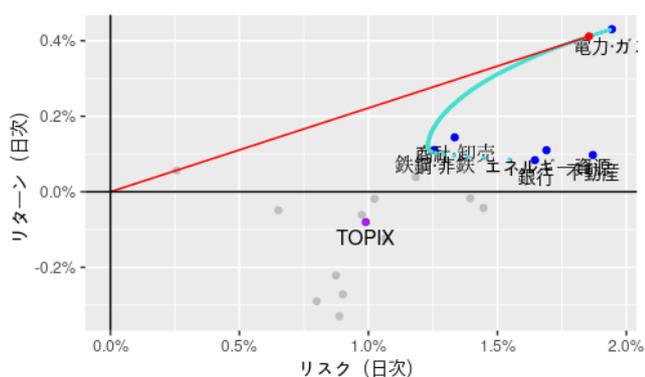
2024年4月20日

【半月】



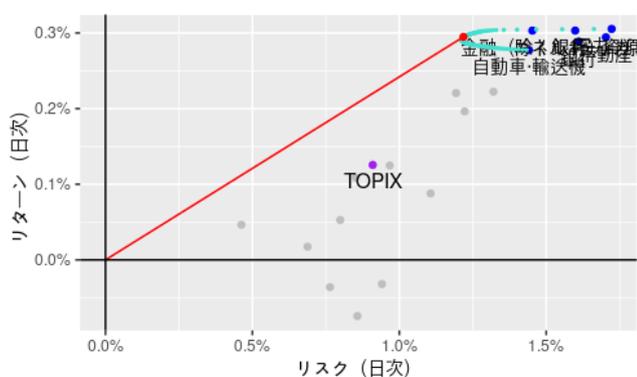
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.472%	2.278%	0.207	—
電力・ガス	0.480%	2.313%	0.207	98.4%
素材・化学	0.088%	0.888%	0.099	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.074%	1.535%	0.048	0.0%
銀行	0.035%	1.458%	0.024	0.0%
不動産	0.024%	2.401%	0.010	1.6%
電機・精密	0.000%	0.898%	0.000	0.0%

【一ヶ月】



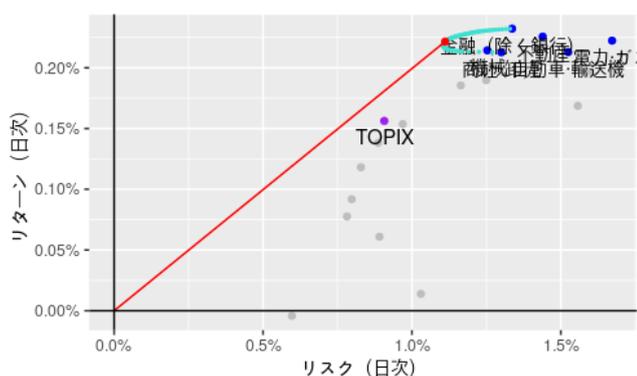
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.412%	1.855%	0.222	—
電力・ガス	0.431%	1.944%	0.222	94.3%
商社・卸売	0.144%	1.334%	0.108	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.111%	1.255%	0.088	0.0%
エネルギー資源	0.110%	1.690%	0.065	0.0%
不動産	0.097%	1.870%	0.052	5.7%
銀行	0.084%	1.645%	0.051	0.0%

【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	0.295%	1.218%	0.242	—
電力・ガス	0.305%	1.722%	0.177	19.5%
エネルギー資源	0.303%	1.598%	0.190	10.6%
金融(除く銀行)	0.303%	1.453%	0.209	19.8%
不動産	0.294%	1.703%	0.173	15.9%
銀行	0.289%	1.611%	0.179	13.5%
自動車・輸送機	0.277%	1.441%	0.192	20.8%

【半年】

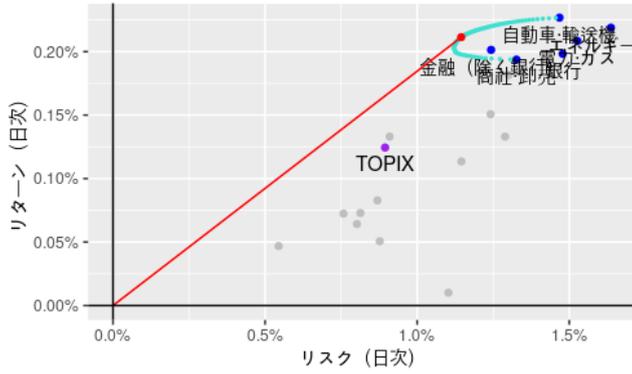


TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.222%	1.112%	0.199	—
金融(除く銀行)	0.232%	1.336%	0.174	23.8%
不動産	0.226%	1.439%	0.157	15.8%
電力・ガス	0.222%	1.672%	0.133	17.0%
機械	0.214%	1.253%	0.171	34.5%
自動車・輸送機	0.213%	1.525%	0.140	0.0%
商社・卸売	0.213%	1.300%	0.164	8.9%

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。

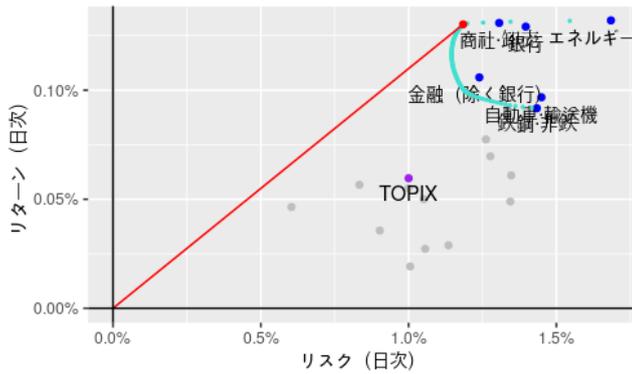
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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	0.211%	1.145%	0.185	—
自動車・輸送機	0.227%	1.468%	0.155	27.4%
エネルギー資源	0.219%	1.637%	0.134	11.4%
電力・ガス	0.208%	1.527%	0.136	21.3%
金融（除く銀行）	0.201%	1.243%	0.162	27.2%
銀行	0.198%	1.478%	0.134	12.0%
商社・卸売	0.194%	1.327%	0.146	0.7%

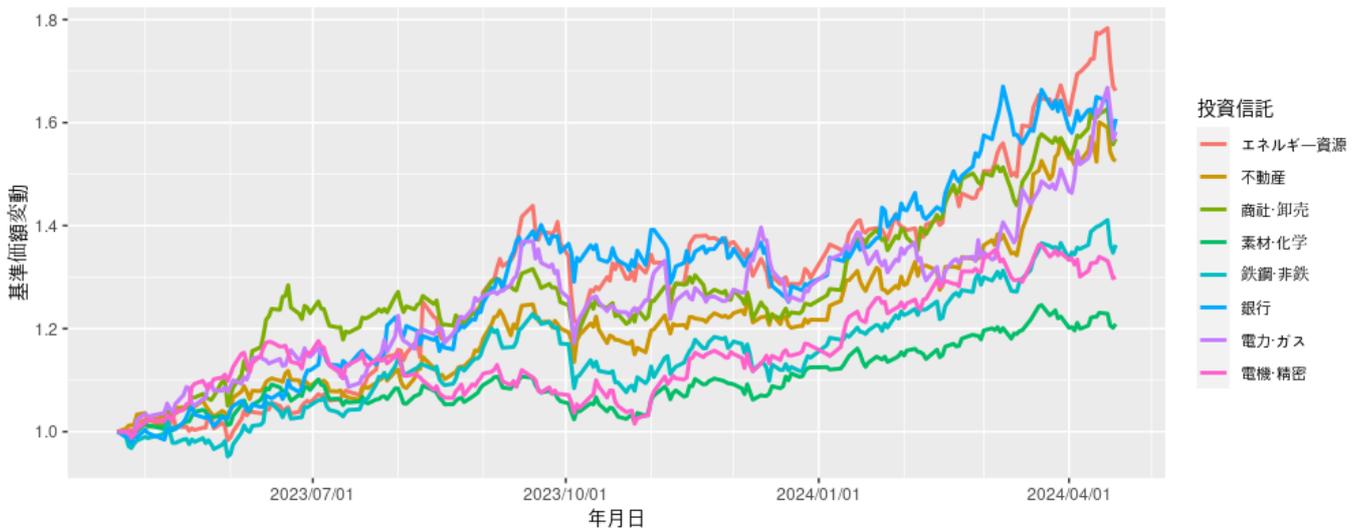
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.130%	1.184%	0.110	—
エネルギー資源	0.132%	1.684%	0.078	10.0%
商社・卸売	0.131%	1.306%	0.100	50.6%
銀行	0.129%	1.396%	0.092	39.0%
金融（除く銀行）	0.106%	1.239%	0.085	0.4%
自動車・輸送機	0.097%	1.449%	0.067	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.092%	1.434%	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。