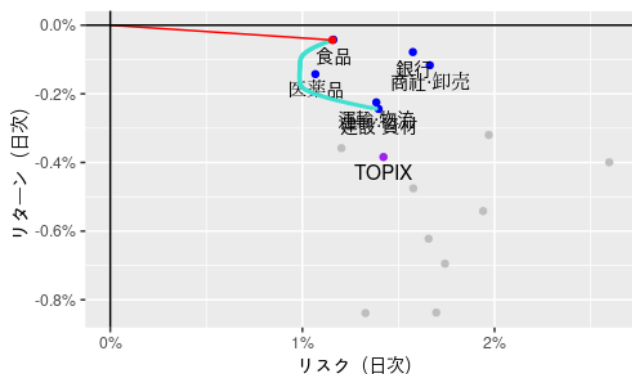


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

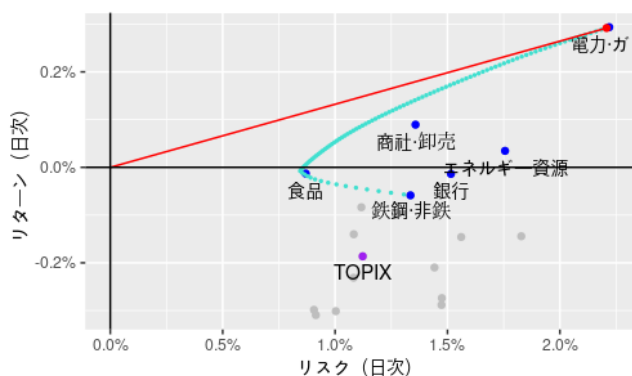
2024年4月27日

【半月】



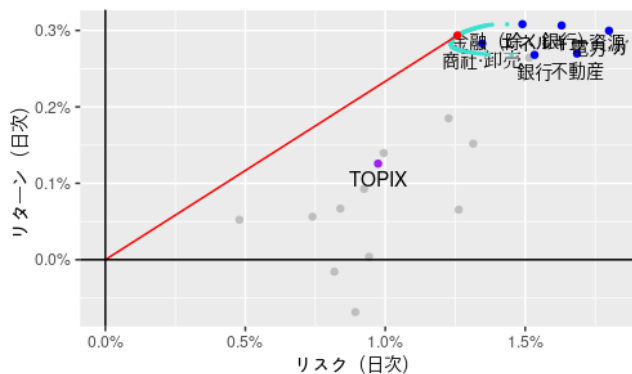
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	-0.043%	1.156%	-0.037	—
食品	-0.042%	1.161%	-0.036	99.0%
銀行	-0.078%	1.575%	-0.050	0.0%
商社・卸売	-0.117%	1.663%	-0.070	0.0%
医薬品	-0.143%	1.067%	-0.134	1.0%
運輸・物流	-0.225%	1.384%	-0.163	0.0%
建設・資材	-0.244%	1.397%	-0.175	0.0%

【一ヶ月】



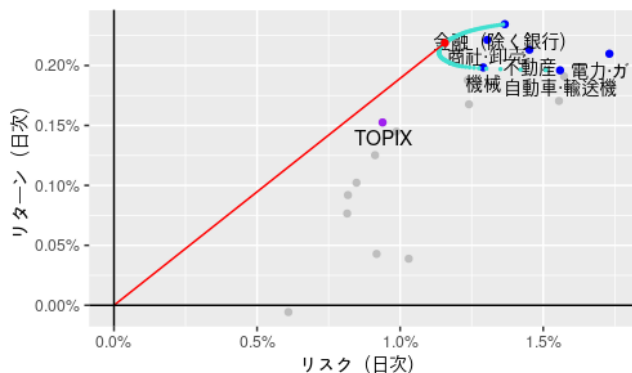
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.292%	2.208%	0.132	—
電力・ガス	0.294%	2.220%	0.132	99.1%
商社・卸売	0.089%	1.358%	0.066	0.9%
エネルギー資源	0.035%	1.756%	0.020	0.0%
食品	-0.013%	0.870%	-0.015	0.0%
銀行	-0.014%	1.515%	-0.009	0.0%
鉄鋼・非鉄	-0.059%	1.335%	-0.044	0.0%

【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	0.294%	1.258%	0.233	—
金融 (除く銀行)	0.308%	1.490%	0.207	26.4%
エネルギー資源	0.307%	1.630%	0.188	14.2%
電力・ガス	0.300%	1.799%	0.167	13.0%
商社・卸売	0.283%	1.346%	0.210	34.5%
不動産	0.270%	1.685%	0.160	11.9%
銀行	0.268%	1.533%	0.175	0.0%

【半年】

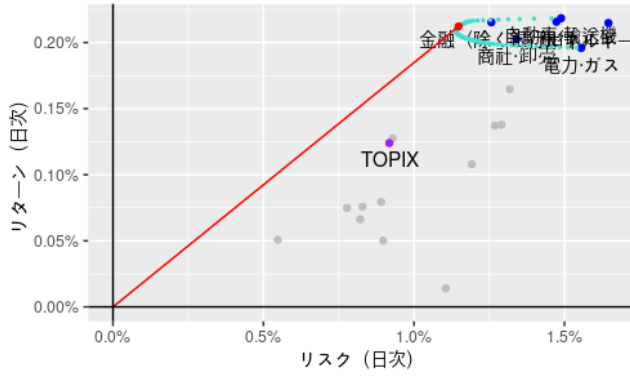


TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.219%	1.156%	0.189	—
金融 (除く銀行)	0.234%	1.366%	0.172	29.8%
商社・卸売	0.221%	1.305%	0.170	29.0%
不動産	0.213%	1.452%	0.147	14.8%
電力・ガス	0.210%	1.731%	0.121	8.1%
機械	0.198%	1.290%	0.154	18.4%
自動車・輸送機	0.196%	1.559%	0.126	0.0%

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。

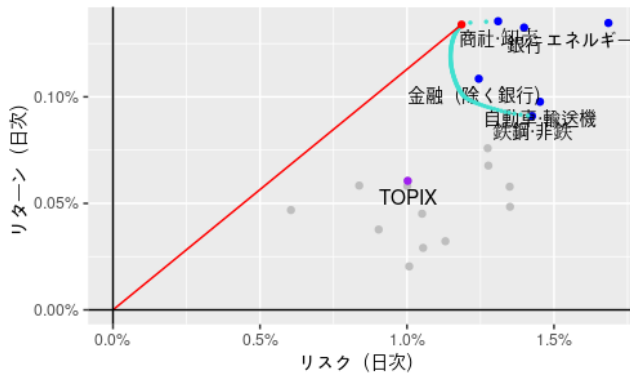
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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	0.212%	1.148%	0.185	—
自動車・輸送機	0.218%	1.489%	0.147	14.1%
銀行	0.216%	1.473%	0.146	18.0%
金融（除く銀行）	0.215%	1.257%	0.171	36.6%
エネルギー資源	0.215%	1.646%	0.130	9.1%
商社・卸売	0.203%	1.340%	0.151	10.8%
電力・ガス	0.196%	1.556%	0.126	11.3%

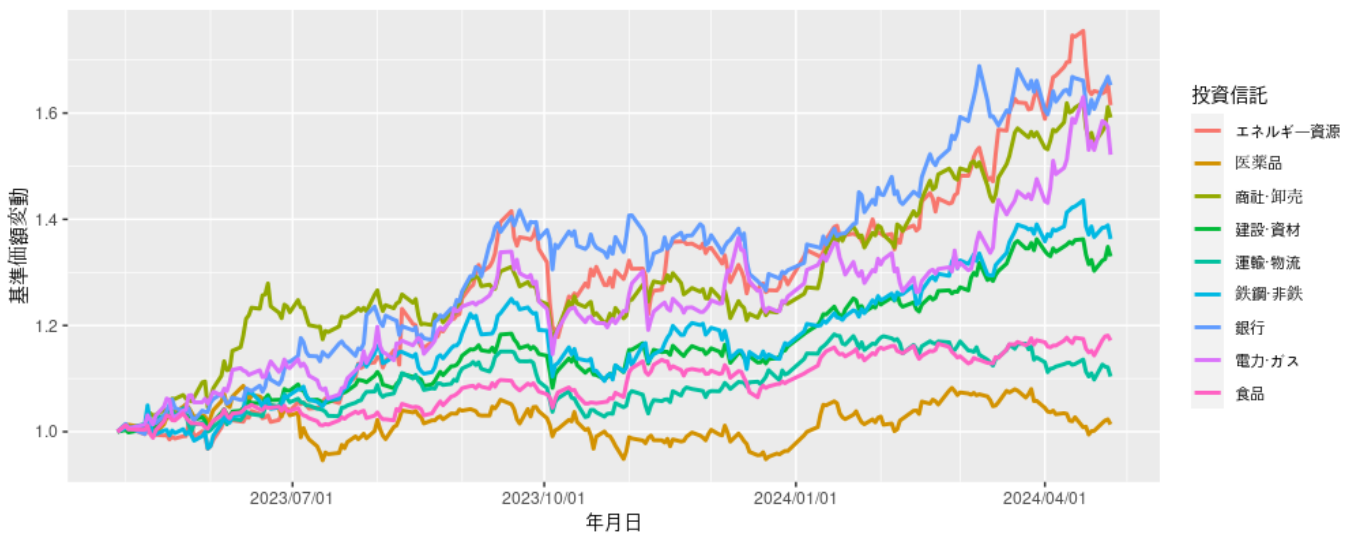
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.134%	1.186%	0.113	—
商社・卸売	0.135%	1.310%	0.103	51.0%
エネルギー資源	0.135%	1.685%	0.080	9.6%
銀行	0.133%	1.398%	0.095	38.2%
金融（除く銀行）	0.108%	1.244%	0.087	1.3%
自動車・輸送機	0.098%	1.452%	0.067	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.091%	1.425%	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。