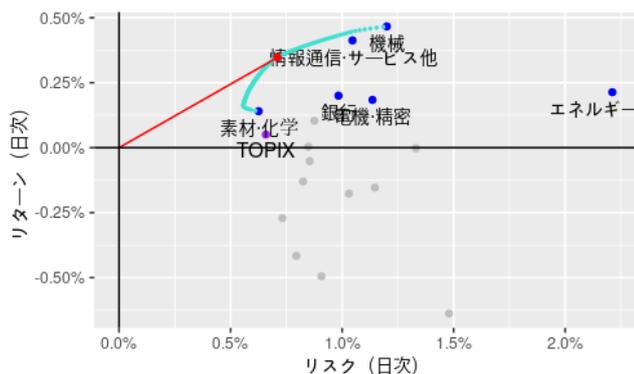


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

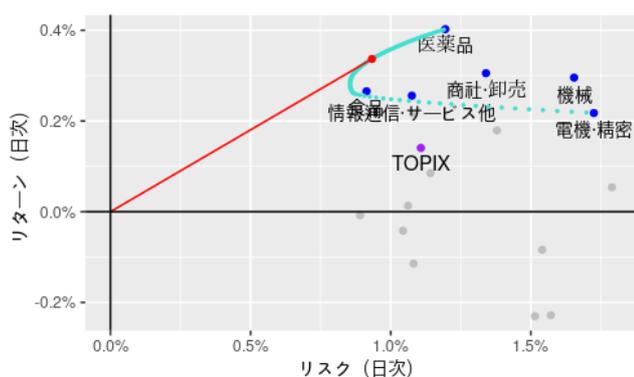
2024年5月18日

【半月】



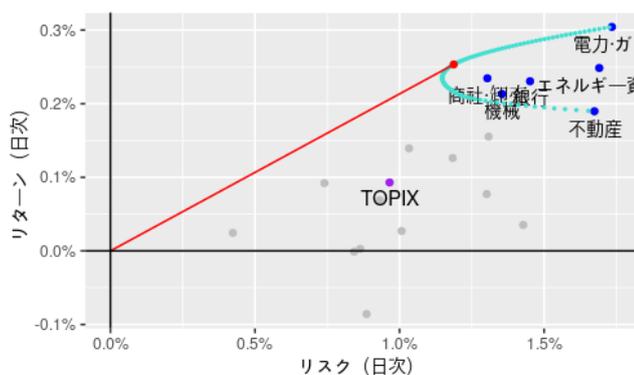
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.348%	0.711%	0.489	—
機械	0.467%	1.200%	0.389	17.9%
情報通信・サービス他	0.413%	1.047%	0.394	47.0%
エネルギー資源	0.213%	2.211%	0.097	0.0%
銀行	0.200%	0.984%	0.203	35.2%
電機・精密	0.184%	1.136%	0.162	0.0%
素材・化学	0.140%	0.626%	0.224	0.0%

【一ヶ月】



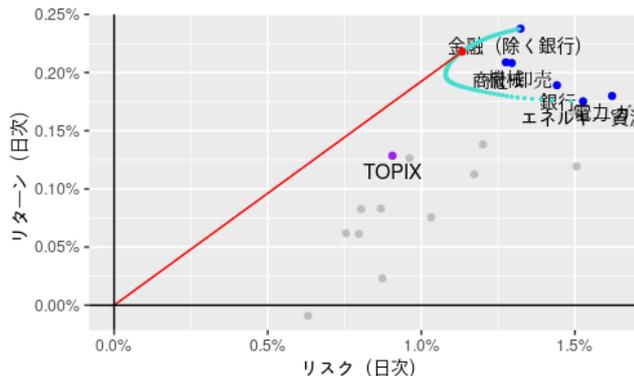
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.337%	0.933%	0.361	—
医薬品	0.403%	1.195%	0.337	53.7%
商社・卸売	0.305%	1.340%	0.228	0.0%
機械	0.296%	1.654%	0.179	0.0%
食品	0.265%	0.914%	0.291	23.2%
情報通信・サービス他	0.256%	1.075%	0.238	23.1%
電機・精密	0.218%	1.725%	0.126	0.0%

【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	0.253%	1.187%	0.213	—
電力・ガス	0.304%	1.734%	0.175	36.5%
エネルギー資源	0.248%	1.691%	0.147	0.4%
商社・卸売	0.234%	1.304%	0.180	20.1%
銀行	0.230%	1.451%	0.159	14.2%
機械	0.213%	1.354%	0.157	28.8%
不動産	0.190%	1.674%	0.113	0.0%

【半年】

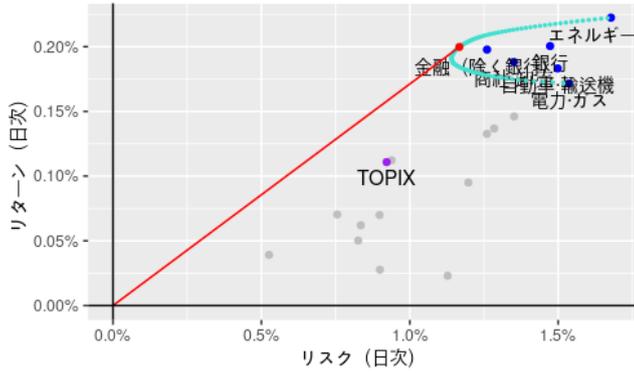


TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.218%	1.133%	0.192	—
金融 (除く銀行)	0.238%	1.323%	0.180	41.6%
機械	0.209%	1.275%	0.164	34.5%
商社・卸売	0.208%	1.294%	0.161	12.8%
銀行	0.189%	1.441%	0.131	5.4%
電力・ガス	0.180%	1.621%	0.111	5.7%
エネルギー資源	0.175%	1.527%	0.115	0.0%

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。

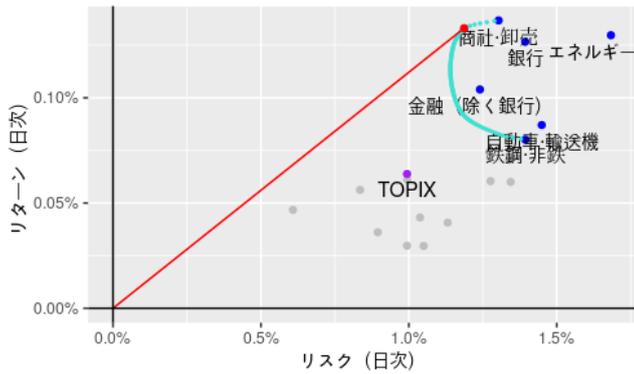
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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	0.200%	1.167%	0.171	—
エネルギー資源	0.222%	1.678%	0.133	19.5%
銀行	0.200%	1.473%	0.136	18.5%
金融（除く銀行）	0.198%	1.260%	0.157	40.0%
商社・卸売	0.188%	1.350%	0.139	15.2%
自動車・輸送機	0.183%	1.498%	0.122	0.0%
電力・ガス	0.172%	1.536%	0.112	6.9%

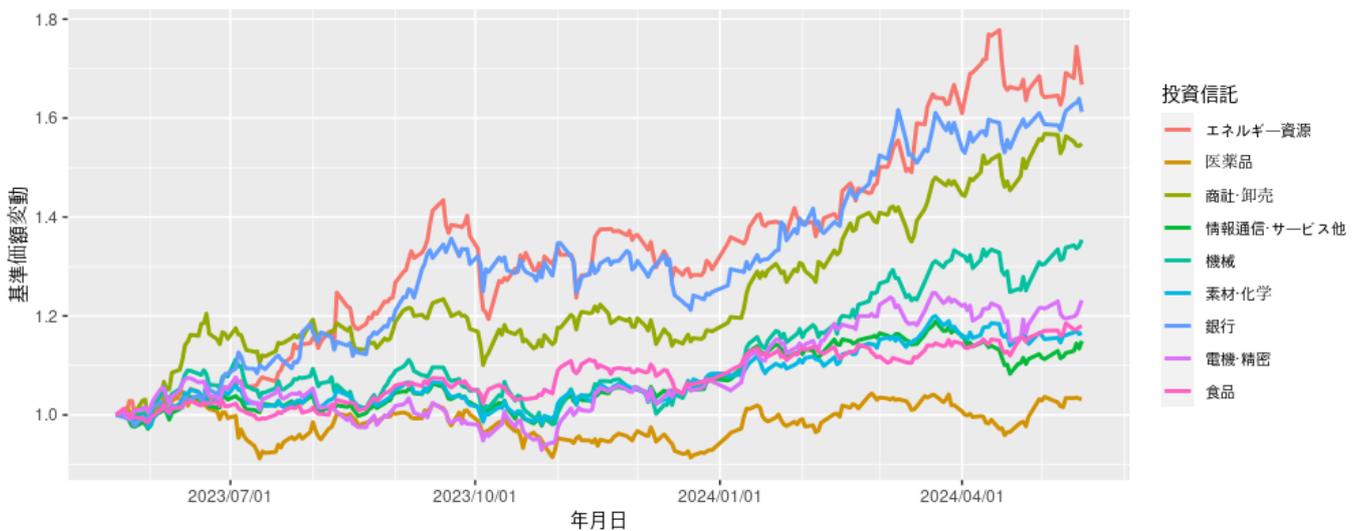
【三年】



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%	1.187%	0.112	—
商社・卸売	0.137%	1.303%	0.105	61.9%
エネルギー資源	0.130%	1.683%	0.077	6.2%
銀行	0.127%	1.393%	0.091	31.9%
金融（除く銀行）	0.104%	1.240%	0.084	0.0%
自動車・輸送機	0.087%	1.449%	0.060	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.080%	1.394%	0.057	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。