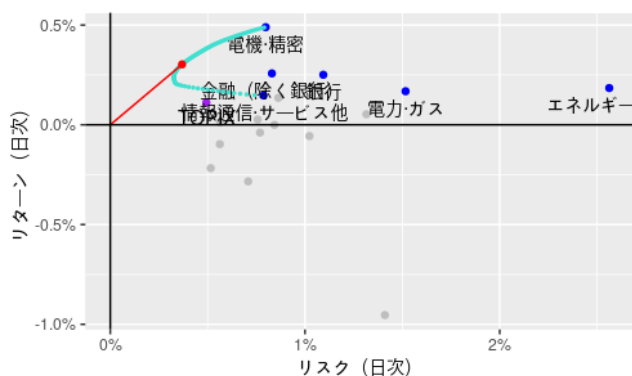


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

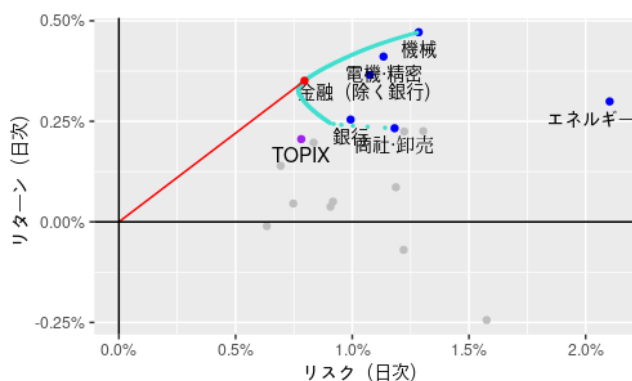
2024年5月25日

【半月】



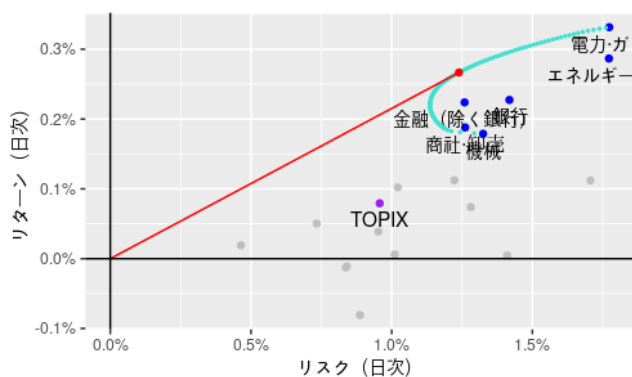
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.303%	0.369%	0.821	—
電機・精密	0.489%	0.798%	0.613	30.6%
金融(除く銀行)	0.258%	0.830%	0.310	26.1%
銀行	0.251%	1.094%	0.229	21.4%
エネルギー資源	0.184%	2.563%	0.072	0.0%
電力・ガス	0.168%	1.517%	0.111	0.0%
情報通信・サービス他	0.147%	0.787%	0.187	21.9%

【一ヶ月】



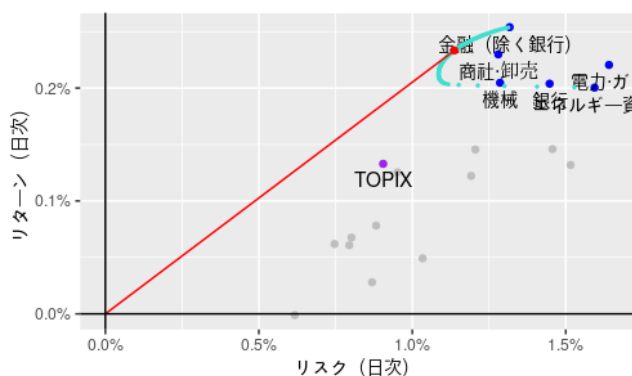
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.351%	0.795%	0.441	—
機械	0.472%	1.285%	0.367	0.0%
電機・精密	0.411%	1.134%	0.362	40.3%
金融(除く銀行)	0.365%	1.076%	0.339	30.4%
エネルギー資源	0.299%	2.103%	0.142	0.0%
銀行	0.254%	0.993%	0.256	29.3%
商社・卸売	0.233%	1.181%	0.197	0.0%

【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	0.267%	1.239%	0.215	—
電力・ガス	0.332%	1.773%	0.187	37.2%
エネルギー資源	0.287%	1.772%	0.162	10.5%
銀行	0.227%	1.418%	0.160	15.4%
金融(除く銀行)	0.224%	1.259%	0.178	26.9%
商社・卸売	0.188%	1.261%	0.149	0.0%
機械	0.179%	1.325%	0.135	9.9%

【半年】

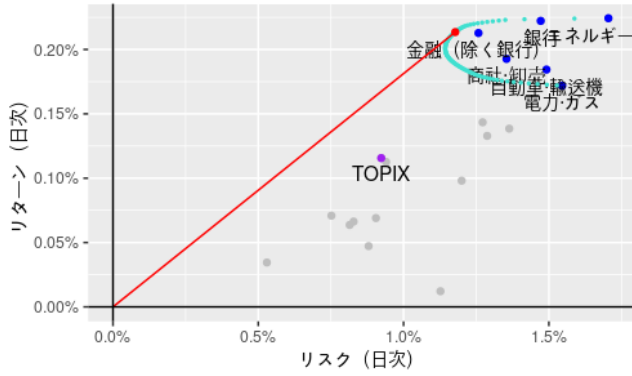


TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.233%	1.137%	0.205	—
金融(除く銀行)	0.254%	1.317%	0.193	42.5%
商社・卸売	0.230%	1.280%	0.180	23.1%
電力・ガス	0.220%	1.641%	0.134	12.0%
機械	0.205%	1.286%	0.159	20.3%
銀行	0.204%	1.447%	0.141	2.0%
エネルギー資源	0.200%	1.594%	0.126	0.0%

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。

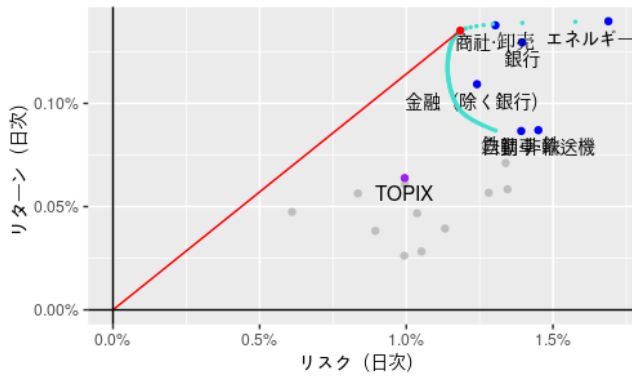
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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	0.214%	1.178%	0.181	—
エネルギー資源	0.224%	1.705%	0.132	15.2%
銀行	0.222%	1.472%	0.151	24.2%
金融（除く銀行）	0.213%	1.258%	0.169	47.0%
商社・卸売	0.193%	1.354%	0.142	11.1%
自動車・輸送機	0.184%	1.492%	0.124	0.0%
電力・ガス	0.172%	1.546%	0.111	2.6%

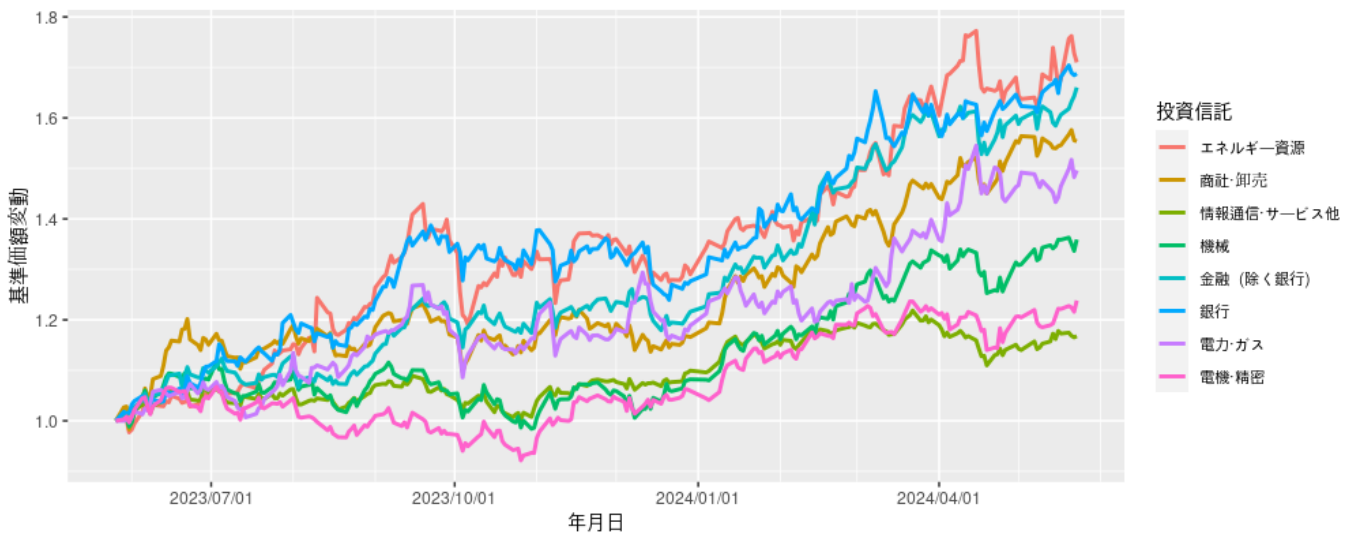
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.135%	1.184%	0.114	—
エネルギー資源	0.140%	1.689%	0.083	12.2%
商社・卸売	0.138%	1.304%	0.106	54.1%
銀行	0.130%	1.395%	0.093	33.7%
金融（除く銀行）	0.109%	1.241%	0.088	0.0%
自動車・輸送機	0.087%	1.450%	0.060	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.087%	1.392%	0.062	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。