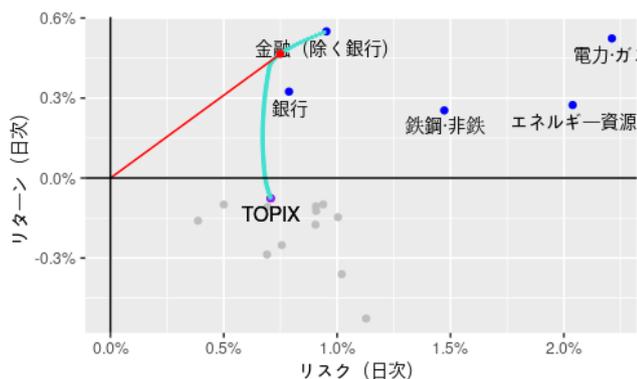


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

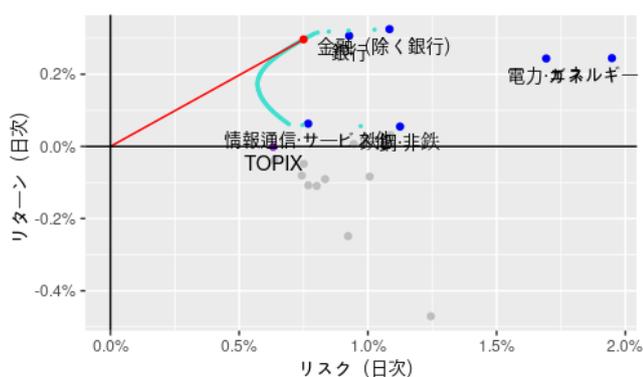
2024年6月1日

【半月】



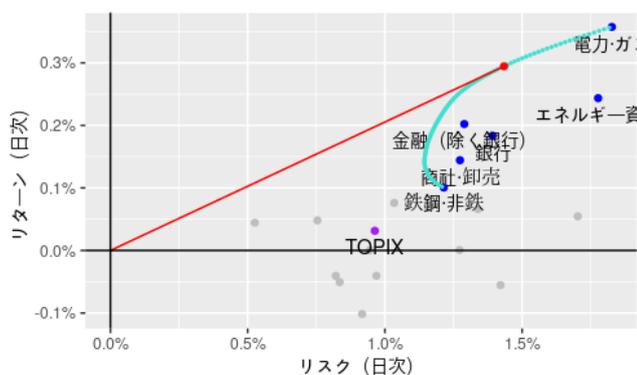
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.465%	0.749%	0.621	—
金融 (除く銀行)	0.550%	0.953%	0.577	62.6%
電力・ガス	0.524%	2.212%	0.237	0.0%
銀行	0.324%	0.788%	0.411	37.4%
エネルギー資源	0.274%	2.039%	0.134	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.254%	1.473%	0.172	0.0%
TOPIX	-0.076%	0.707%	-0.108	0.0%

【一ヶ月】



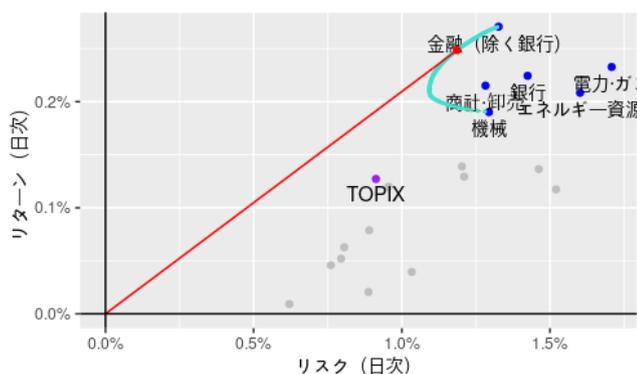
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.297%	0.750%	0.395	—
金融 (除く銀行)	0.325%	1.084%	0.300	37.5%
銀行	0.307%	0.927%	0.331	55.6%
エネルギー資源	0.245%	1.948%	0.126	0.0%
電力・ガス	0.244%	1.693%	0.144	0.0%
情報通信・サービス他	0.063%	0.768%	0.082	6.9%
鉄鋼・非鉄	0.055%	1.125%	0.049	0.0%

【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%	1.434%	0.205	—
電力・ガス	0.357%	1.827%	0.196	59.2%
エネルギー資源	0.244%	1.777%	0.137	1.2%
金融 (除く銀行)	0.202%	1.289%	0.157	39.6%
銀行	0.184%	1.392%	0.132	0.0%
商社・卸売	0.144%	1.274%	0.113	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.101%	1.215%	0.083	0.0%

【半年】

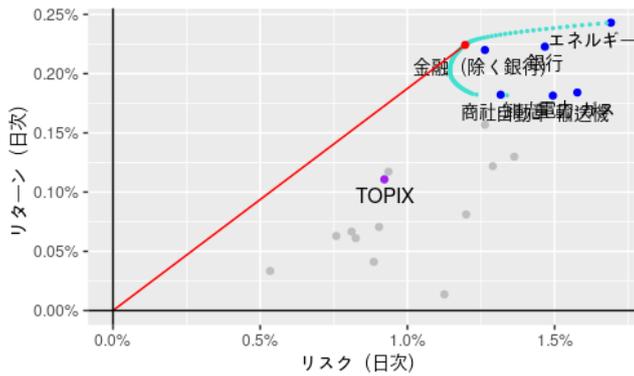


TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.249%	1.186%	0.210	—
金融 (除く銀行)	0.271%	1.327%	0.204	61.5%
電力・ガス	0.233%	1.708%	0.136	8.3%
銀行	0.224%	1.425%	0.158	11.3%
商社・卸売	0.215%	1.282%	0.168	2.4%
エネルギー資源	0.208%	1.601%	0.130	5.0%
機械	0.190%	1.294%	0.147	11.6%

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。

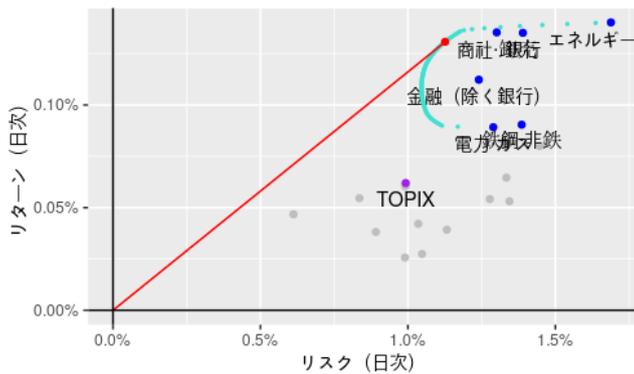
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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	0.224%	1.196%	0.187	—
エネルギー資源	0.243%	1.691%	0.144	22.7%
銀行	0.223%	1.467%	0.152	20.1%
金融(除く銀行)	0.220%	1.263%	0.174	52.9%
電力・ガス	0.184%	1.577%	0.117	4.2%
商社・卸売	0.182%	1.317%	0.138	0.0%
自動車・輸送機	0.181%	1.494%	0.121	0.0%

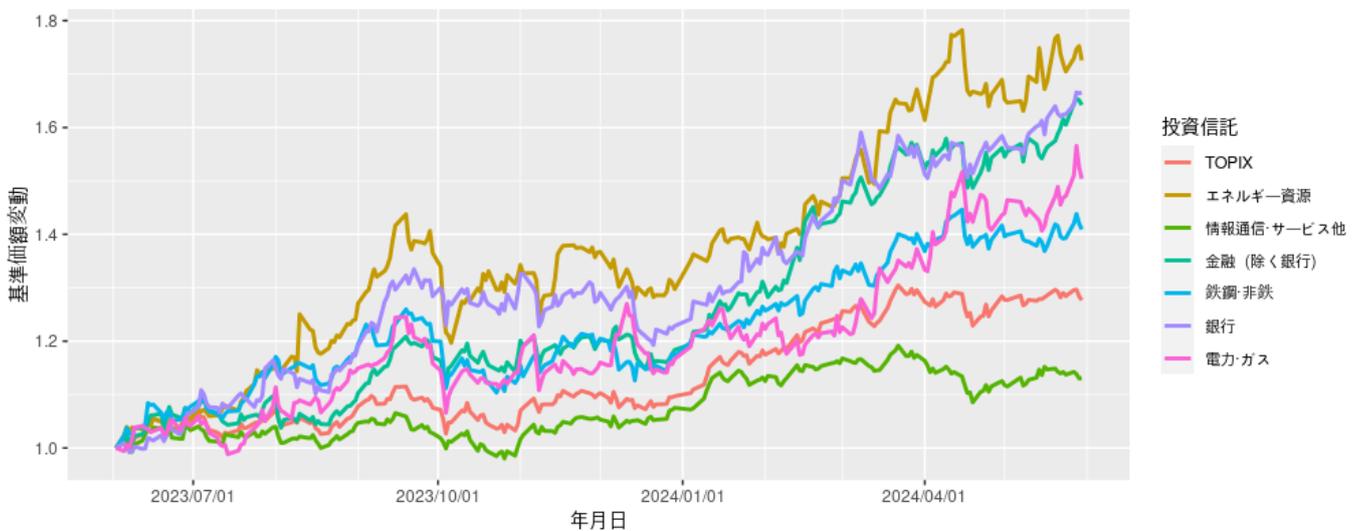
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.131%	1.126%	0.116	—
エネルギー資源	0.140%	1.688%	0.083	10.6%
商社・卸売	0.135%	1.301%	0.104	43.1%
銀行	0.135%	1.390%	0.097	35.4%
金融(除く銀行)	0.112%	1.240%	0.091	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.090%	1.386%	0.065	0.0%
電力・ガス	0.089%	1.290%	0.069	10.9%

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。

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。