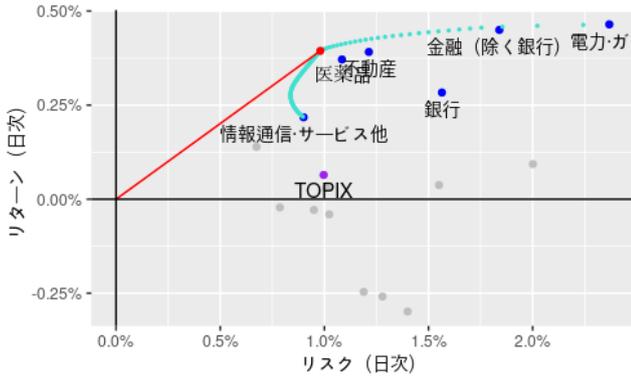


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

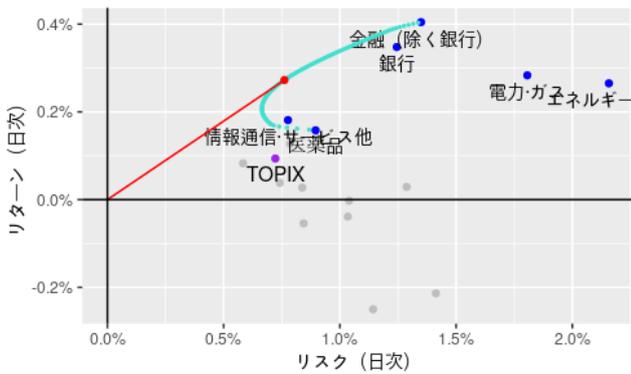
2024年6月8日

【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	0.394%	0.981%	0.402	—
電力・ガス	0.465%	2.368%	0.196	0.0%
金融(除く銀行)	0.450%	1.840%	0.244	23.4%
不動産	0.391%	1.214%	0.322	22.5%
医薬品	0.371%	1.085%	0.342	54.1%
銀行	0.283%	1.564%	0.181	0.0%
情報通信・サービス他	0.218%	0.900%	0.242	0.0%

【一ヶ月】



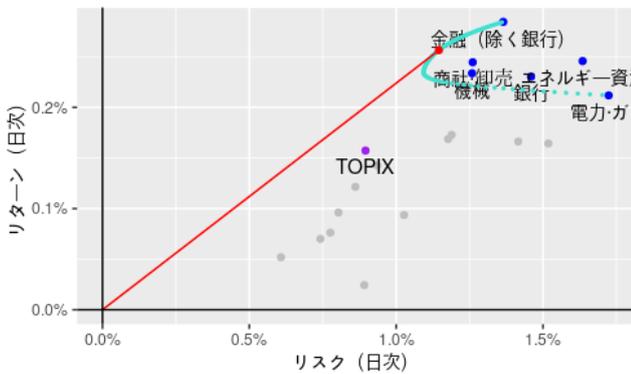
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.273%	0.761%	0.358	—
金融(除く銀行)	0.404%	1.349%	0.300	26.8%
銀行	0.348%	1.245%	0.279	21.8%
電力・ガス	0.283%	1.806%	0.157	0.0%
エネルギー資源	0.265%	2.157%	0.123	0.0%
情報通信・サービス他	0.181%	0.777%	0.233	30.1%
医薬品	0.158%	0.896%	0.176	21.2%

【四半期】

N/A

TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	%	%		—
—	%	%		%
—	%	%		%
—	%	%		%
—	%	%		%
—	%	%		%
—	%	%		%

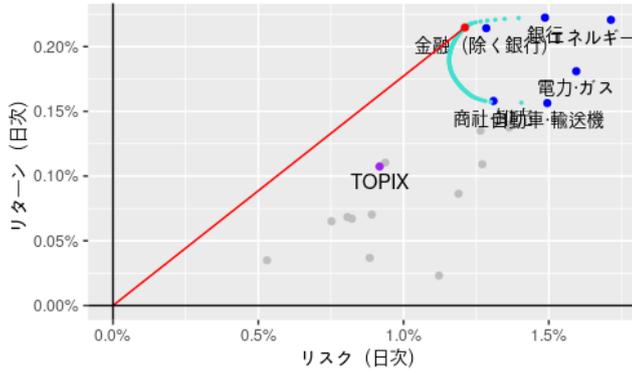
【半年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.257%	1.145%	0.224	—
金融(除く銀行)	0.285%	1.365%	0.209	39.2%
エネルギー資源	0.246%	1.635%	0.150	9.3%
商社・卸売	0.245%	1.261%	0.194	17.6%
機械	0.234%	1.258%	0.186	30.3%
銀行	0.230%	1.459%	0.158	3.6%
電力・ガス	0.212%	1.724%	0.123	0.0%

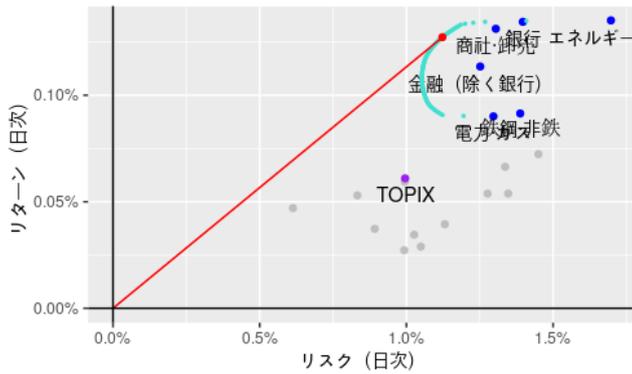
備考 (1) グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。
 (2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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	0.215%	1.211%	0.177	—
銀行	0.222%	1.487%	0.150	24.2%
エネルギー資源	0.221%	1.714%	0.129	15.9%
金融（除く銀行）	0.214%	1.285%	0.167	52.6%
電力・ガス	0.181%	1.595%	0.113	7.3%
商社・卸売	0.158%	1.310%	0.121	0.0%
自動車・輸送機	0.156%	1.495%	0.105	0.0%

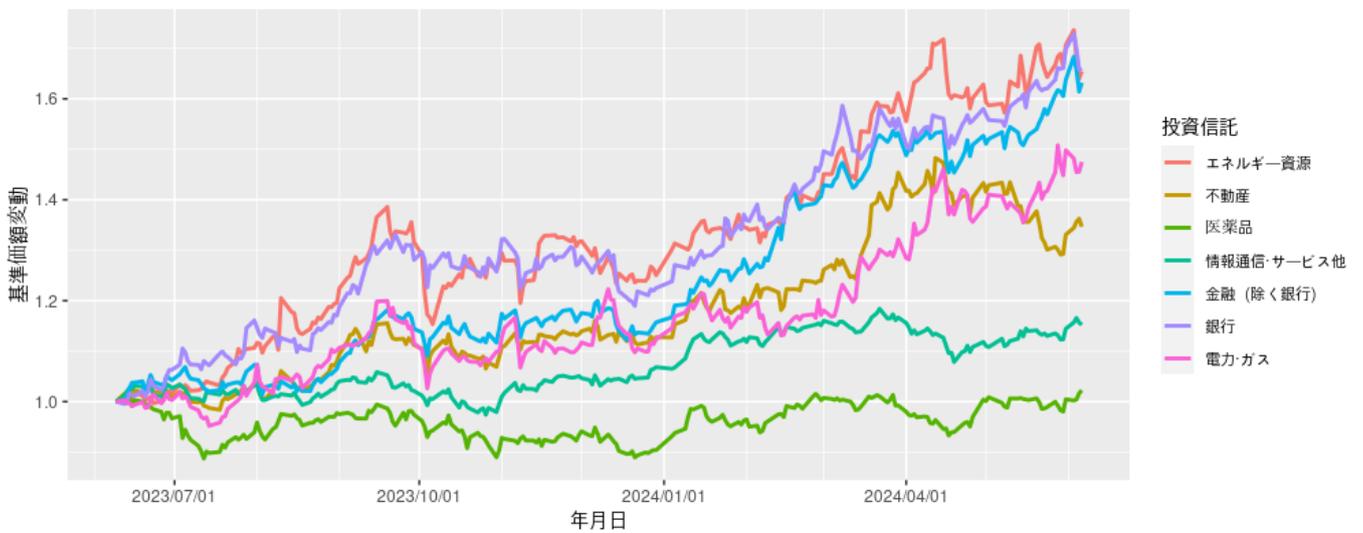
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.127%	1.123%	0.113	—
エネルギー資源	0.135%	1.697%	0.080	8.8%
銀行	0.134%	1.397%	0.096	36.6%
商社・卸売	0.131%	1.305%	0.101	41.2%
金融（除く銀行）	0.113%	1.252%	0.091	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.091%	1.388%	0.066	0.0%
電力・ガス	0.090%	1.297%	0.069	13.3%

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。