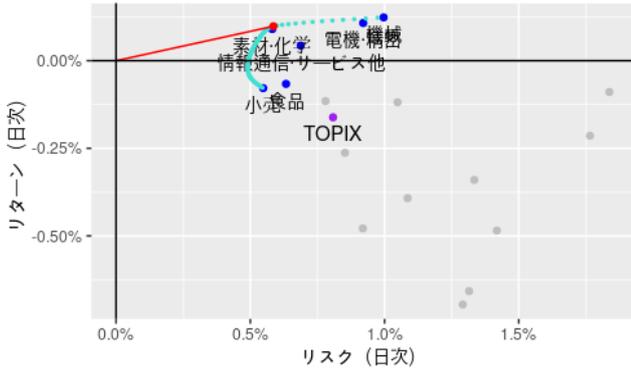


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

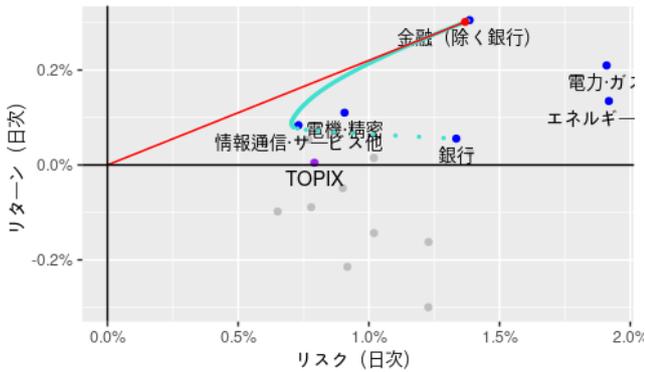
2024年6月15日

【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 | 0.098% | 0.586% | 0.168 | — |
| 機械 | 0.124% | 0.997% | 0.124 | 24.5% |
| 電機・精密 | 0.108% | 0.921% | 0.117 | 0.0% |
| 素材・化学 | 0.090% | 0.582% | 0.155 | 75.5% |
| 情報通信・サービス他 | 0.043% | 0.688% | 0.062 | 0.0% |
| 食品 | -0.066% | 0.633% | -0.104 | 0.0% |
| 小売 | -0.078% | 0.548% | -0.143 | 0.0% |

【一ヶ月】



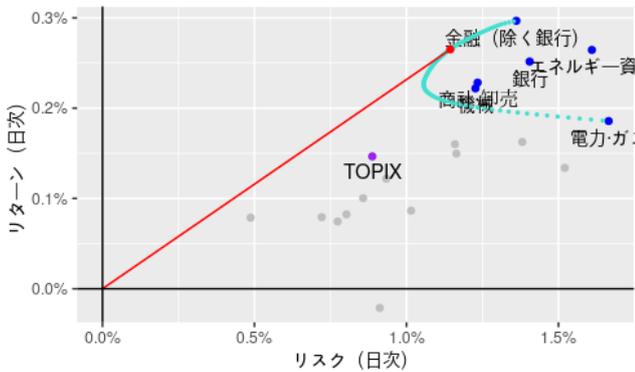
| TOPIX-17 | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.301% | 1.368% | 0.220 | — |
| 金融(除く銀行) | 0.305% | 1.385% | 0.220 | 98.3% |
| 電力・ガス | 0.210% | 1.910% | 0.110 | 0.0% |
| エネルギー資源 | 0.135% | 1.918% | 0.070 | 0.0% |
| 電機・精密 | 0.110% | 0.907% | 0.121 | 0.0% |
| 情報通信・サービス他 | 0.084% | 0.731% | 0.115 | 1.7% |
| 銀行 | 0.056% | 1.334% | 0.042 | 0.0% |

【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 | % | % | | — |
| — | % | % | | % |
| — | % | % | | % |
| — | % | % | | % |
| — | % | % | | % |
| — | % | % | | % |

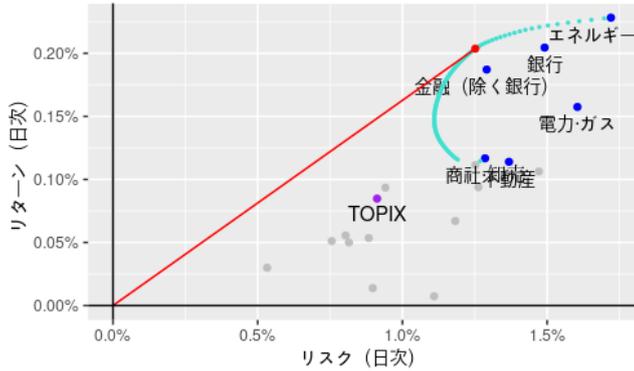
【半年】



| TOPIX-17 | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.265% | 1.144% | 0.232 | — |
| 金融(除く銀行) | 0.297% | 1.361% | 0.218 | 42.7% |
| エネルギー資源 | 0.264% | 1.610% | 0.164 | 16.5% |
| 銀行 | 0.252% | 1.405% | 0.179 | 14.2% |
| 商社・卸売 | 0.228% | 1.234% | 0.185 | 0.0% |
| 機械 | 0.222% | 1.227% | 0.181 | 26.6% |
| 電力・ガス | 0.186% | 1.665% | 0.112 | 0.0% |

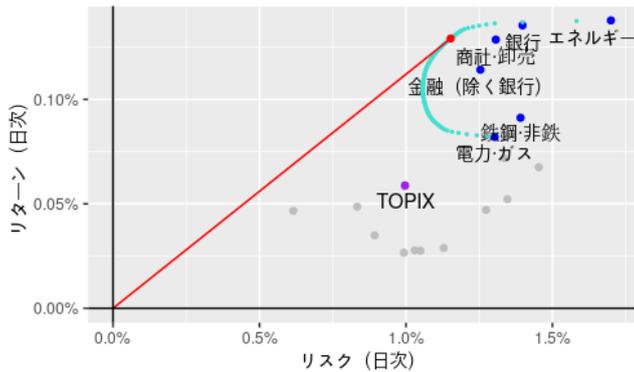
備考 (1) グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。
 (2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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 | 0.204% | 1.252% | 0.163 | — |
| エネルギー資源 | 0.228% | 1.720% | 0.133 | 29.6% |
| 銀行 | 0.205% | 1.491% | 0.137 | 27.7% |
| 金融（除く銀行） | 0.187% | 1.291% | 0.145 | 41.3% |
| 電力・ガス | 0.157% | 1.605% | 0.098 | 1.5% |
| 商社・卸売 | 0.117% | 1.286% | 0.091 | 0.0% |
| 不動産 | 0.114% | 1.368% | 0.083 | 0.0% |

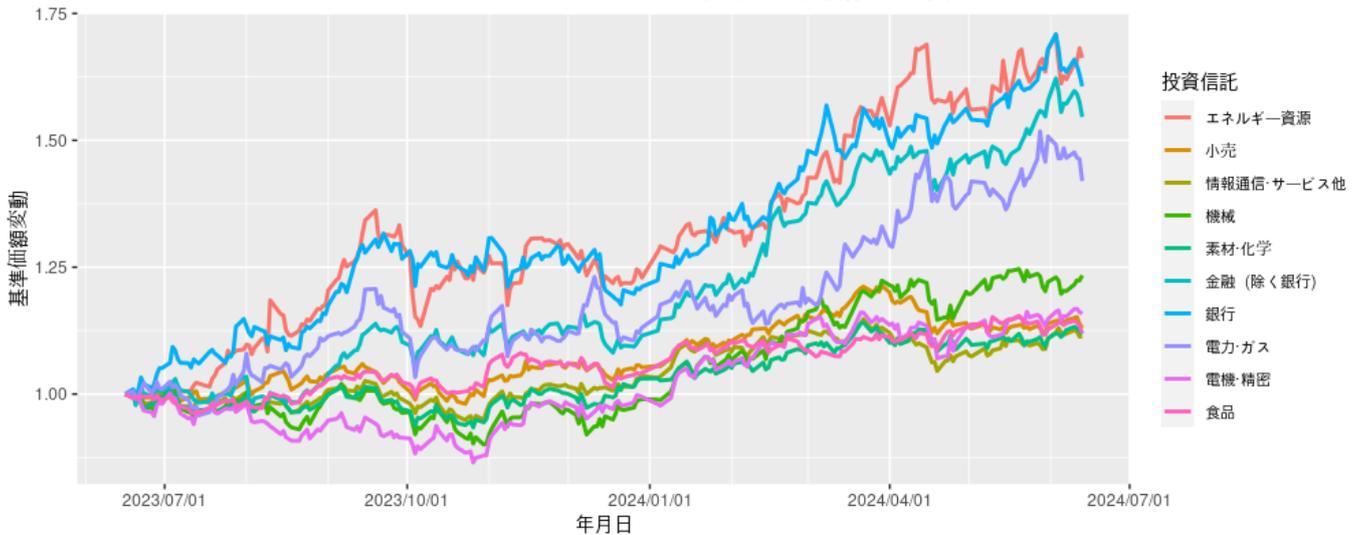
【三年】



| TOPIX-17 | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.129% | 1.153% | 0.112 | — |
| エネルギー資源 | 0.138% | 1.700% | 0.081 | 12.4% |
| 銀行 | 0.135% | 1.398% | 0.097 | 40.6% |
| 商社・卸売 | 0.129% | 1.307% | 0.098 | 39.8% |
| 金融（除く銀行） | 0.114% | 1.254% | 0.091 | 0.0% |
| 鉄鋼・非鉄 | 0.091% | 1.391% | 0.066 | 0.0% |
| 電力・ガス | 0.082% | 1.303% | 0.063 | 7.2% |

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。