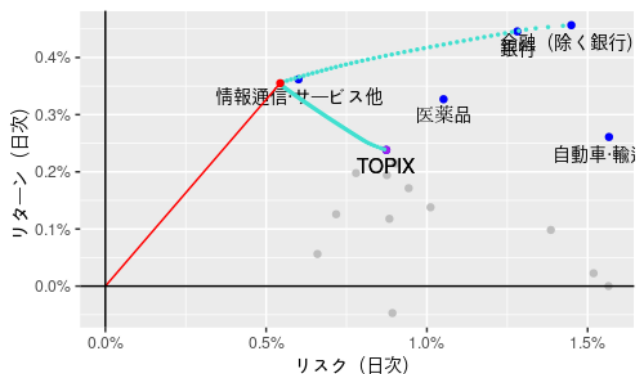


TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

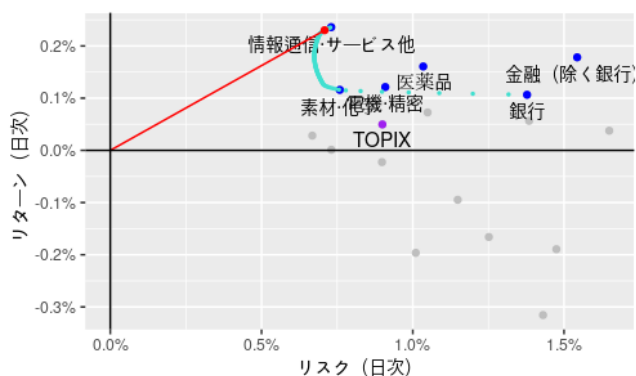
2024年6月29日

【半月】



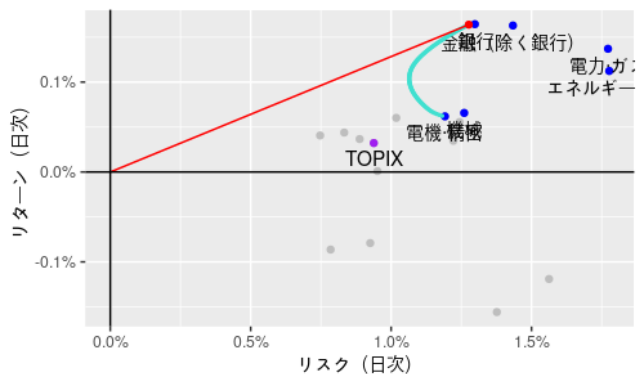
| TOPIX-17 | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.355% | 0.544% | 0.653 | — |
| 金融 (除く銀行) | 0.457% | 1.449% | 0.315 | 0.0% |
| 銀行 | 0.446% | 1.281% | 0.348 | 0.0% |
| 情報通信・サービス他 | 0.362% | 0.601% | 0.602 | 80.6% |
| 医薬品 | 0.327% | 1.052% | 0.311 | 19.4% |
| 自動車・輸送機 | 0.261% | 1.566% | 0.167 | 0.0% |
| TOPIX | 0.238% | 0.874% | 0.273 | 0.0% |

【一ヶ月】



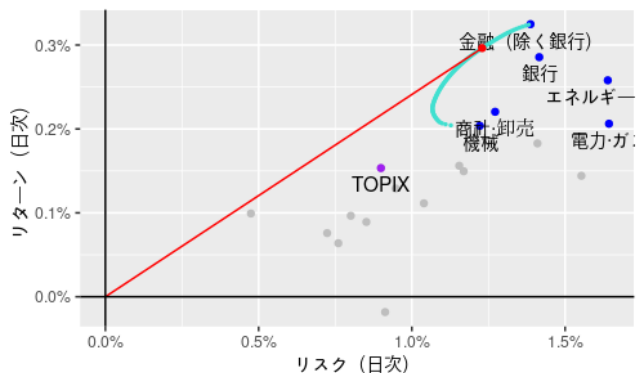
| TOPIX-17 | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.230% | 0.709% | 0.325 | — |
| 情報通信・サービス他 | 0.236% | 0.730% | 0.323 | 92.3% |
| 金融 (除く銀行) | 0.178% | 1.543% | 0.115 | 0.0% |
| 医薬品 | 0.161% | 1.034% | 0.155 | 7.7% |
| 電機・精密 | 0.121% | 0.909% | 0.133 | 0.0% |
| 素材・化学 | 0.116% | 0.759% | 0.153 | 0.0% |
| 銀行 | 0.106% | 1.378% | 0.077 | 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 | 0.164% | 1.277% | 0.128 | — |
| 銀行 | 0.164% | 1.298% | 0.127 | 75.3% |
| 金融 (除く銀行) | 0.163% | 1.434% | 0.114 | 24.1% |
| 電力・ガス | 0.137% | 1.772% | 0.077 | 0.6% |
| エネルギー資源 | 0.112% | 1.777% | 0.063 | 0.0% |
| 機械 | 0.066% | 1.260% | 0.052 | 0.0% |
| 電機・精密 | 0.062% | 1.192% | 0.052 | 0.0% |

【半年】

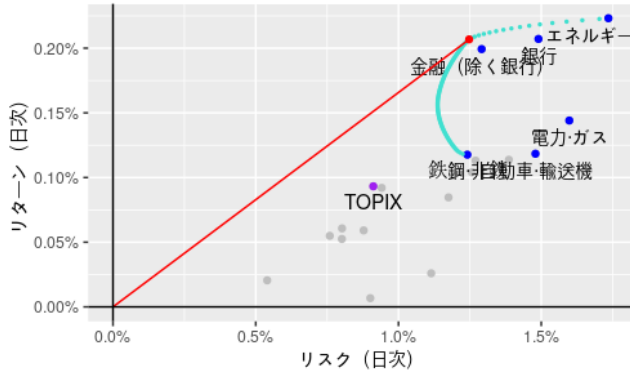


| TOPIX-17 | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.296% | 1.229% | 0.241 | — |
| 金融 (除く銀行) | 0.325% | 1.387% | 0.234 | 57.6% |
| 銀行 | 0.286% | 1.416% | 0.202 | 22.8% |
| エネルギー資源 | 0.258% | 1.639% | 0.157 | 7.9% |
| 商社・卸売 | 0.220% | 1.272% | 0.173 | 0.0% |
| 電力・ガス | 0.206% | 1.643% | 0.126 | 0.0% |
| 機械 | 0.204% | 1.222% | 0.167 | 11.8% |

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。

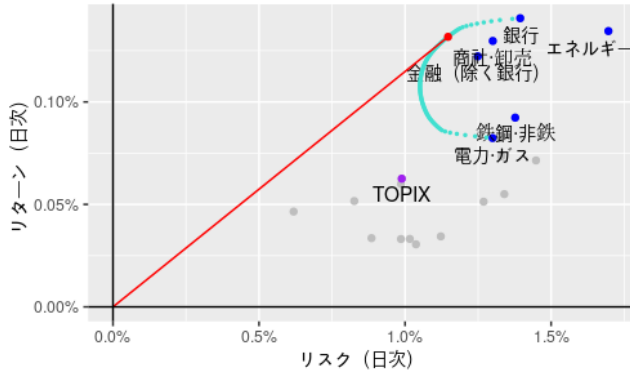
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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 | 0.207% | 1.247% | 0.166 | — |
| エネルギー資源 | 0.223% | 1.735% | 0.129 | 23.5% |
| 銀行 | 0.207% | 1.490% | 0.139 | 24.1% |
| 金融（除く銀行） | 0.199% | 1.291% | 0.154 | 52.4% |
| 電力・ガス | 0.144% | 1.598% | 0.090 | 0.0% |
| 自動車・輸送機 | 0.118% | 1.480% | 0.080 | 0.0% |
| 鉄鋼・非鉄 | 0.118% | 1.241% | 0.095 | 0.0% |

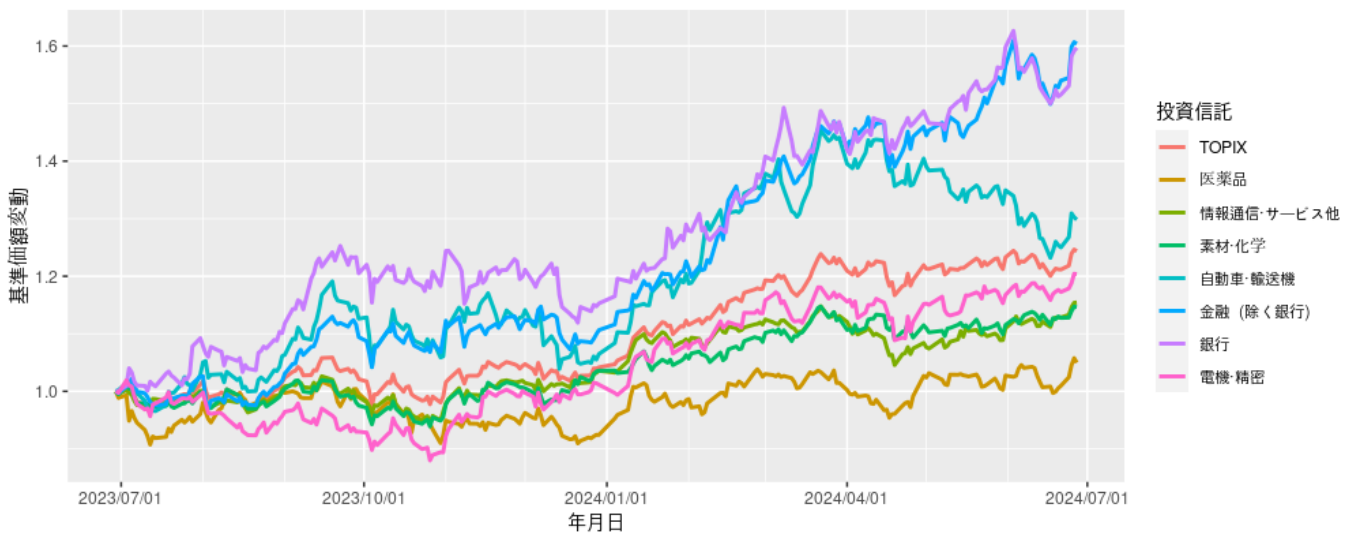
【三年】



| TOPIX-17 | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.132% | 1.147% | 0.115 | — |
| 銀行 | 0.141% | 1.394% | 0.101 | 40.6% |
| エネルギー資源 | 0.135% | 1.696% | 0.079 | 9.2% |
| 商社・卸売 | 0.130% | 1.300% | 0.100 | 37.6% |
| 金融（除く銀行） | 0.122% | 1.249% | 0.098 | 7.6% |
| 鉄鋼・非鉄 | 0.092% | 1.377% | 0.067 | 0.0% |
| 電力・ガス | 0.082% | 1.300% | 0.063 | 5.0% |

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。