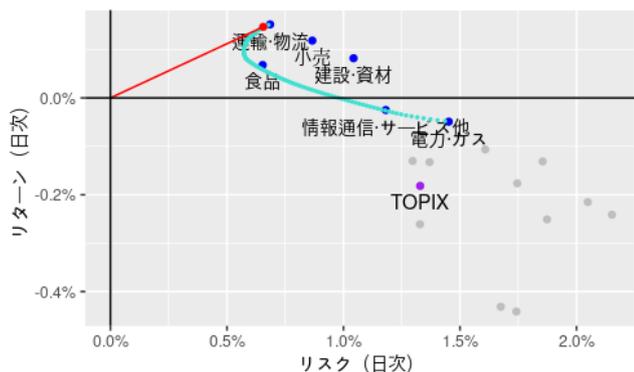


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

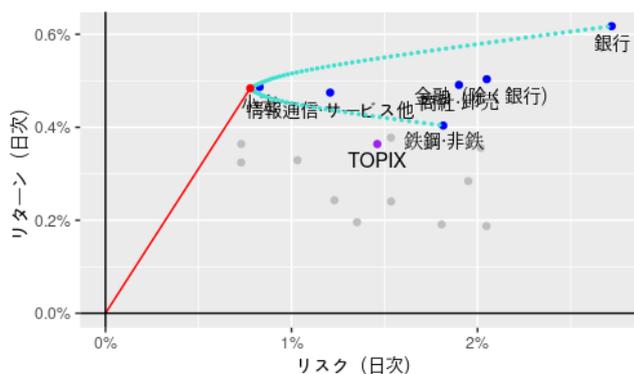
2024年9月7日

【半月】



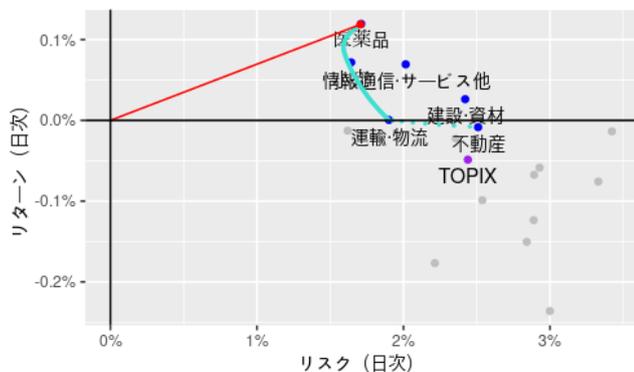
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.147%	0.656%	0.224	—
運輸・物流	0.152%	0.685%	0.221	85.0%
小売	0.118%	0.866%	0.137	15.0%
建設・資材	0.082%	1.043%	0.078	0.0%
食品	0.068%	0.653%	0.104	0.0%
情報通信・サービス他	-0.025%	1.182%	-0.021	0.0%
電力・ガス	-0.049%	1.452%	-0.034	0.0%

【一ヶ月】



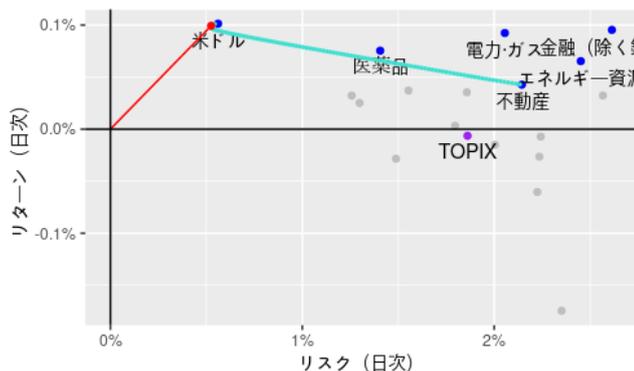
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.484%	0.778%	0.622	—
銀行	0.618%	2.721%	0.227	0.0%
金融 (除く銀行)	0.503%	2.049%	0.246	0.0%
商社・卸売	0.491%	1.900%	0.259	0.0%
小売	0.487%	0.829%	0.587	77.4%
情報通信・サービス他	0.475%	1.208%	0.393	22.6%
鉄鋼・非鉄	0.404%	1.815%	0.222	0.0%

【四半期】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.119%	1.706%	0.070	—
医薬品	0.119%	1.711%	0.070	98.7%
小売	0.072%	1.643%	0.044	1.3%
情報通信・サービス他	0.069%	2.015%	0.034	0.0%
建設・資材	0.026%	2.421%	0.011	0.0%
運輸・物流	0.000%	1.901%	0.000	0.0%
不動産	-0.008%	2.509%	-0.003	0.0%

【半年】

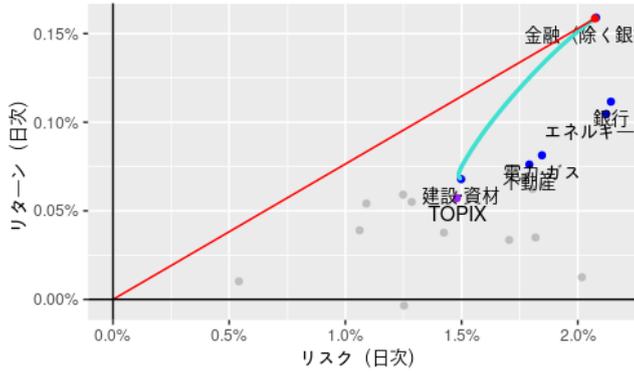


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.099%	0.525%	0.189	—
米ドル	0.101%	0.561%	0.181	89.2%
金融 (除く銀行)	0.095%	2.613%	0.036	0.0%
電力・ガス	0.092%	2.055%	0.045	4.4%
医薬品	0.075%	1.406%	0.054	6.4%
エネルギー資源	0.065%	2.451%	0.027	0.0%
不動産	0.043%	2.144%	0.020	0.0%

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。

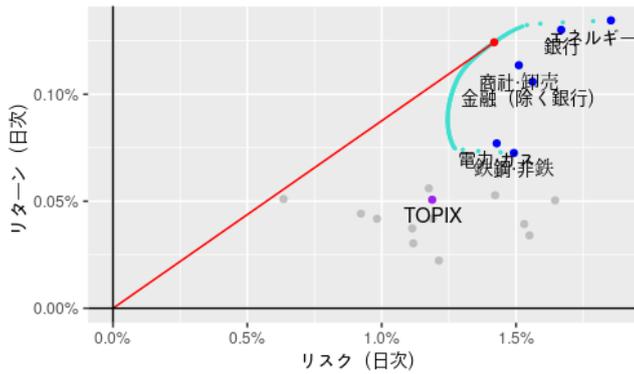
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.159%	2.074%	0.076	—
金融（除く銀行）	0.159%	2.079%	0.076	99.4%
銀行	0.112%	2.143%	0.052	0.0%
エネルギー資源	0.105%	2.122%	0.049	0.0%
電力・ガス	0.081%	1.846%	0.044	0.6%
不動産	0.076%	1.792%	0.042	0.0%
建設・資材	0.068%	1.498%	0.045	0.0%

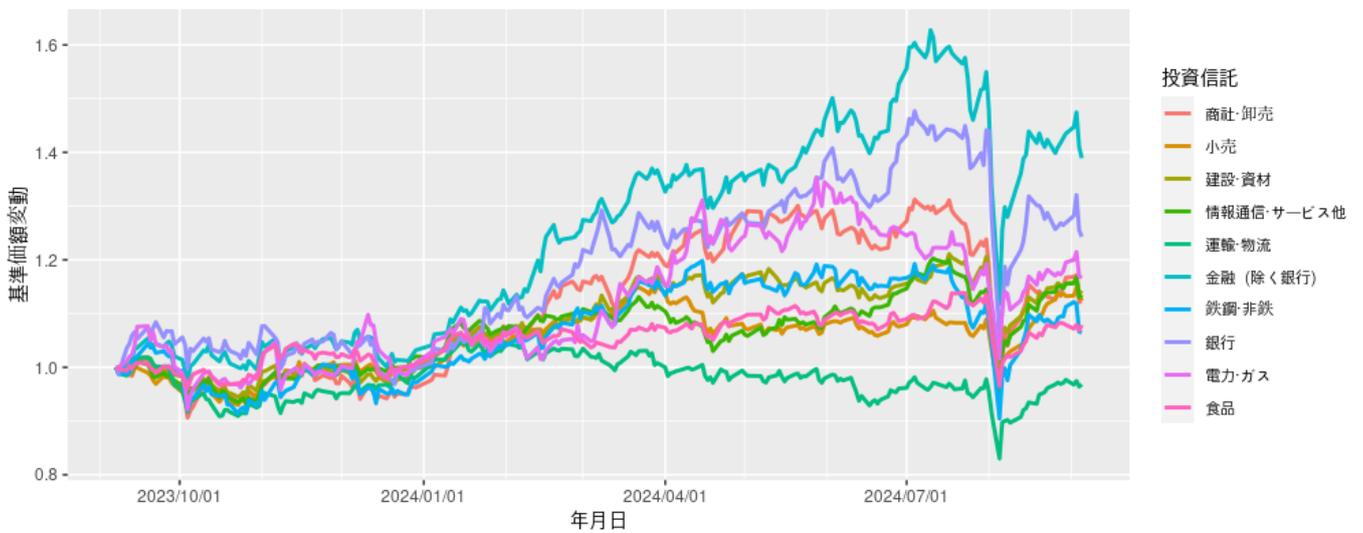
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.124%	1.419%	0.088	—
エネルギー資源	0.135%	1.853%	0.073	28.2%
銀行	0.130%	1.668%	0.078	43.7%
商社・卸売	0.114%	1.510%	0.075	21.5%
金融（除く銀行）	0.106%	1.562%	0.068	0.0%
電力・ガス	0.077%	1.428%	0.054	6.6%
鉄鋼・非鉄	0.073%	1.492%	0.049	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。

TOPIX17 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として直近一年間の価額変動を示す。