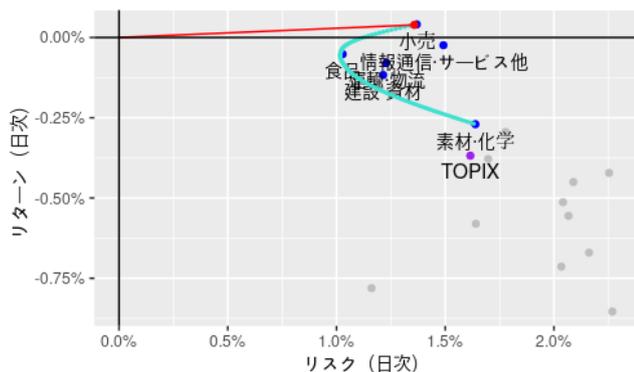


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

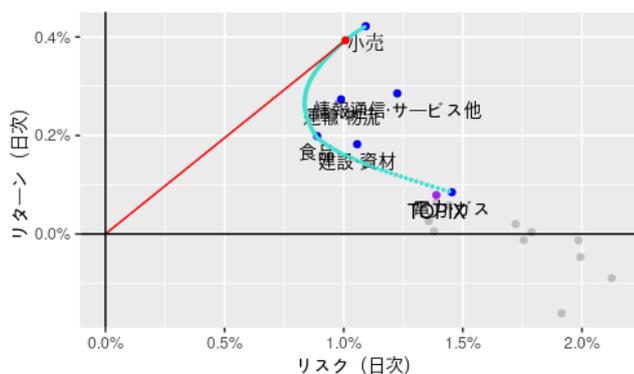
2024年9月13日

【半月】



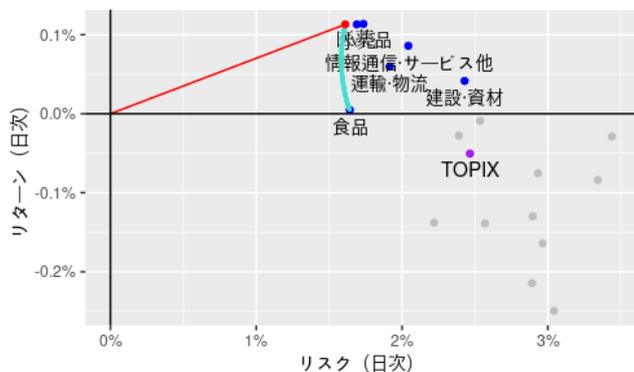
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.039%	1.358%	0.029	—
小売	0.041%	1.369%	0.030	98.3%
情報通信・サービス他	-0.024%	1.491%	-0.016	0.0%
食品	-0.052%	1.028%	-0.051	1.7%
運輸・物流	-0.080%	1.228%	-0.065	0.0%
建設・資材	-0.117%	1.214%	-0.096	0.0%
素材・化学	-0.270%	1.639%	-0.165	0.0%

【一ヶ月】



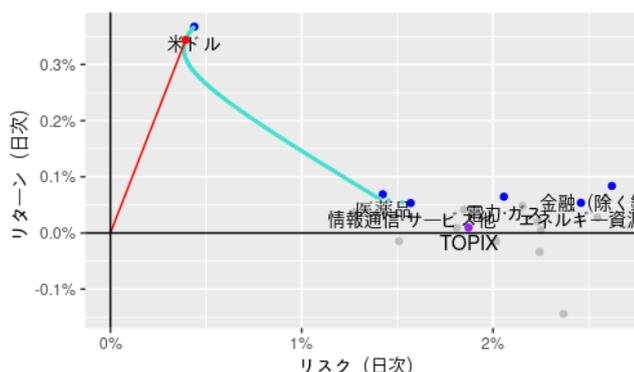
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.393%	1.008%	0.390	—
小売	0.422%	1.093%	0.386	80.7%
情報通信・サービス他	0.285%	1.225%	0.233	0.0%
運輸・物流	0.273%	0.989%	0.276	19.3%
食品	0.199%	0.888%	0.224	0.0%
建設・資材	0.182%	1.057%	0.172	0.0%
電力・ガス	0.085%	1.454%	0.058	0.0%

【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	0.113%	1.611%	0.070	—
医薬品	0.114%	1.735%	0.066	44.3%
小売	0.113%	1.690%	0.067	55.5%
情報通信・サービス他	0.086%	2.043%	0.042	0.0%
運輸・物流	0.060%	1.915%	0.031	0.0%
建設・資材	0.041%	2.429%	0.017	0.0%
食品	0.005%	1.642%	0.003	0.2%

【半年】

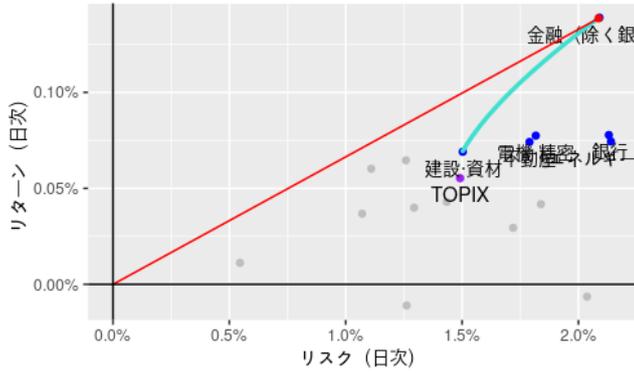


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.344%	0.394%	0.874	—
米ドル	0.367%	0.438%	0.838	92.1%
金融(除く銀行)	0.084%	2.621%	0.032	0.0%
医薬品	0.069%	1.424%	0.048	7.9%
電力・ガス	0.065%	2.057%	0.031	0.0%
エネルギー資源	0.054%	2.459%	0.022	0.0%
情報通信・サービス他	0.053%	1.569%	0.034	0.0%

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。

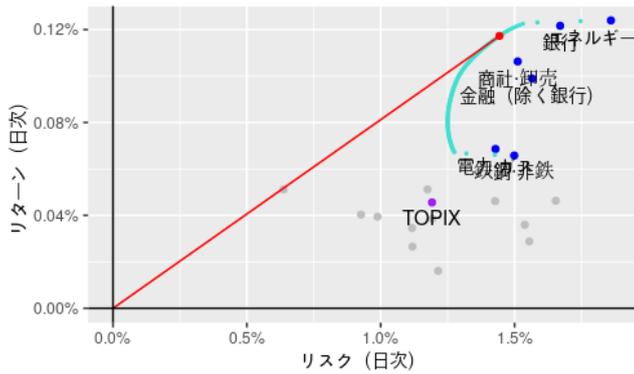
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.139%	2.086%	0.066	—
金融（除く銀行）	0.139%	2.090%	0.066	99.5%
銀行	0.078%	2.131%	0.037	0.0%
電機・精密	0.077%	1.817%	0.043	0.0%
エネルギー資源	0.074%	2.140%	0.035	0.0%
不動産	0.074%	1.790%	0.041	0.5%
建設・資材	0.069%	1.503%	0.046	0.0%

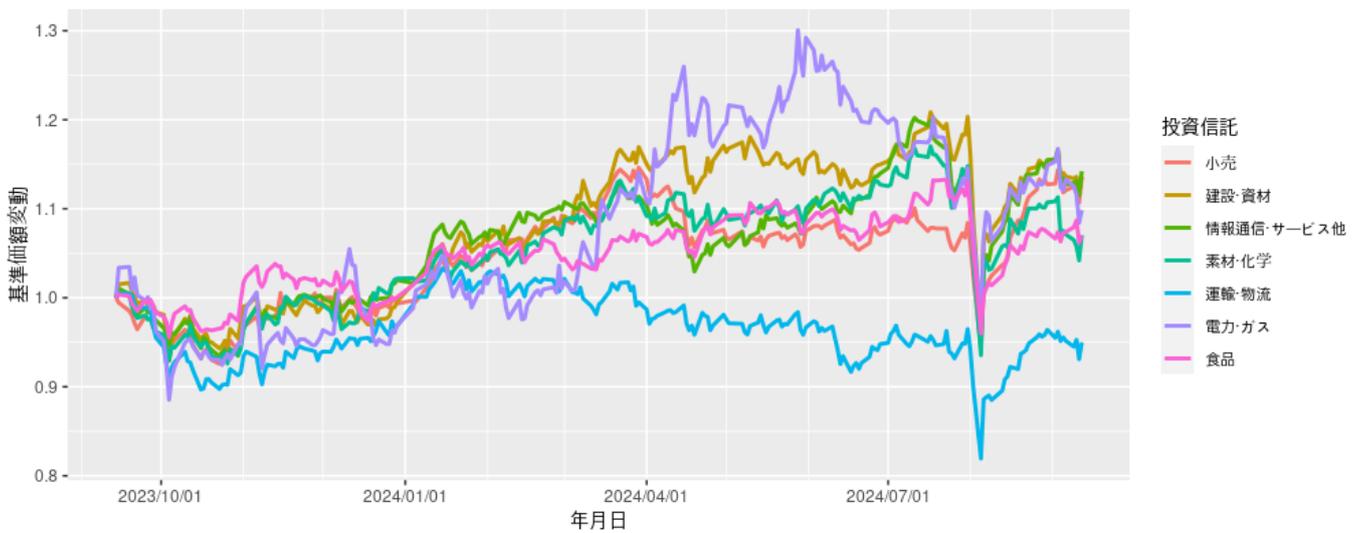
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.117%	1.444%	0.081	—
エネルギー資源	0.124%	1.860%	0.067	26.9%
銀行	0.122%	1.670%	0.073	45.5%
商社・卸売	0.106%	1.512%	0.070	25.5%
金融（除く銀行）	0.099%	1.566%	0.063	0.0%
電力・ガス	0.069%	1.429%	0.048	2.0%
鉄鋼・非鉄	0.066%	1.499%	0.044	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。