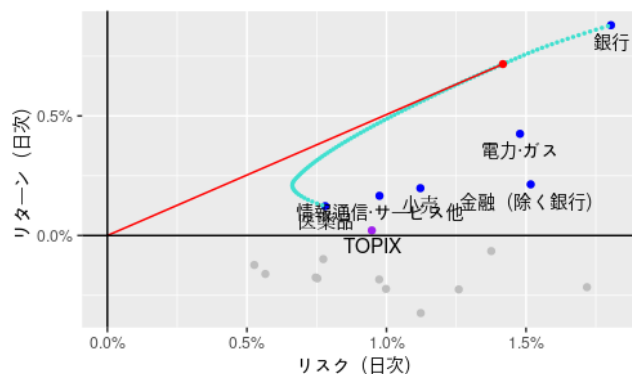


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

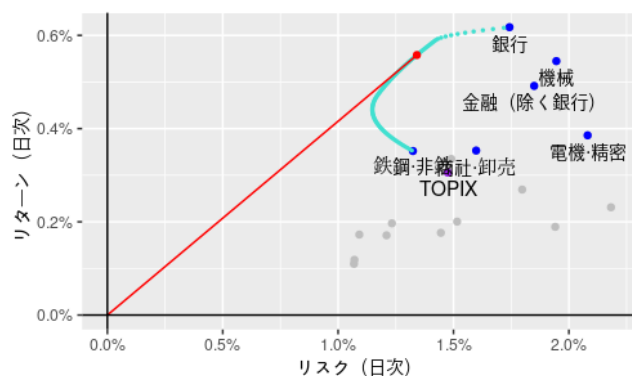
2024年10月19日

【半月】



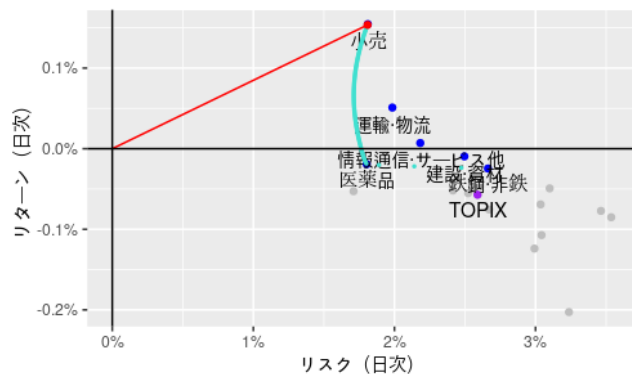
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.717%	1.417%	0.506	—
銀行	0.880%	1.804%	0.487	66.6%
電力・ガス	0.425%	1.478%	0.288	28.6%
金融(除く銀行)	0.214%	1.517%	0.141	0.0%
小売	0.198%	1.121%	0.177	4.8%
情報通信・サービス他	0.166%	0.975%	0.170	0.0%
医薬品	0.123%	0.781%	0.157	0.0%

【一ヶ月】



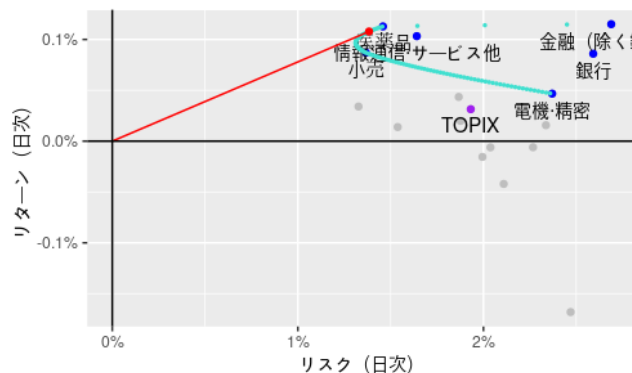
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.558%	1.341%	0.416	—
銀行	0.618%	1.743%	0.354	57.4%
機械	0.545%	1.946%	0.280	27.7%
金融(除く銀行)	0.492%	1.850%	0.266	0.0%
電機・精密	0.386%	2.081%	0.185	0.0%
商社・卸売	0.353%	1.598%	0.221	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.352%	1.324%	0.266	14.9%

【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	0.154%	1.809%	0.085	—
小売	0.154%	1.811%	0.085	99.5%
運輸・物流	0.051%	1.985%	0.026	0.0%
情報通信・サービス他	0.007%	2.183%	0.003	0.0%
建設・資材	-0.010%	2.496%	-0.004	0.0%
医薬品	-0.019%	1.803%	-0.011	0.5%
鉄鋼・非鉄	-0.025%	2.663%	-0.009	0.0%

【半年】

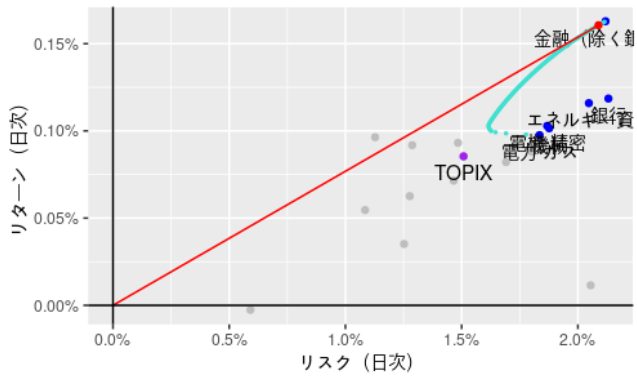


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.108%	1.384%	0.078	—
金融(除く銀行)	0.115%	2.689%	0.043	0.0%
医薬品	0.113%	1.459%	0.077	80.8%
情報通信・サービス他	0.103%	1.641%	0.063	0.0%
小売	0.087%	1.367%	0.064	19.2%
銀行	0.086%	2.592%	0.033	0.0%
電機・精密	0.047%	2.370%	0.020	0.0%

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。

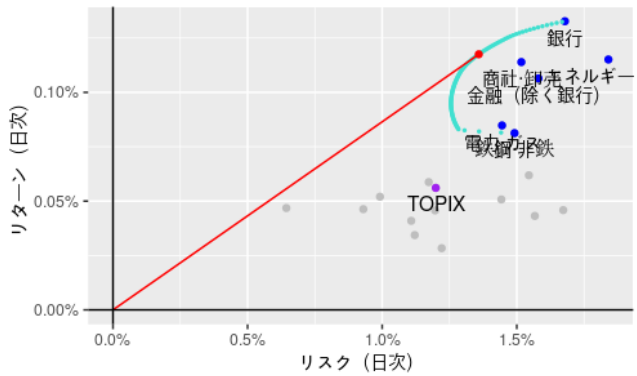
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.161%	2.089%	0.077	—
金融（除く銀行）	0.163%	2.119%	0.077	96.5%
銀行	0.119%	2.131%	0.056	0.0%
エネルギー資源	0.116%	2.047%	0.057	0.0%
電機・精密	0.103%	1.868%	0.055	0.0%
機械	0.101%	1.876%	0.054	0.0%
電力・ガス	0.098%	1.835%	0.053	3.5%

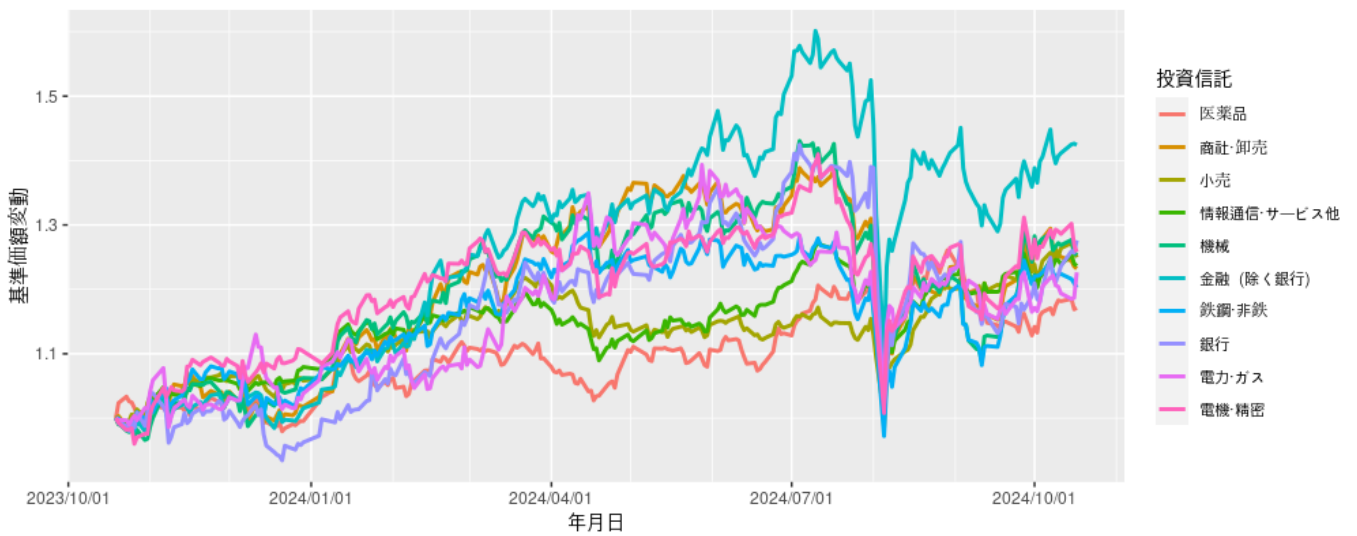
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.118%	1.359%	0.086	—
銀行	0.133%	1.679%	0.079	44.8%
エネルギー資源	0.115%	1.840%	0.063	9.6%
商社・卸売	0.114%	1.517%	0.075	28.6%
金融（除く銀行）	0.106%	1.581%	0.067	0.0%
電力・ガス	0.085%	1.445%	0.059	17.0%
鉄鋼・非鉄	0.081%	1.492%	0.054	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。