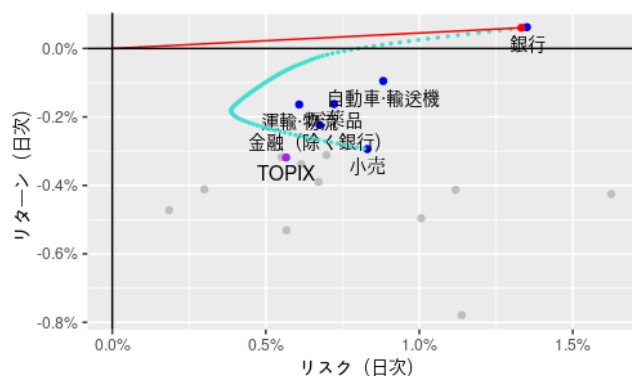


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

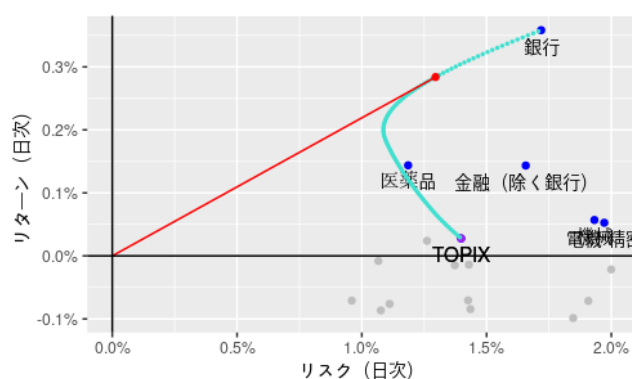
2024年10月26日

【半月】



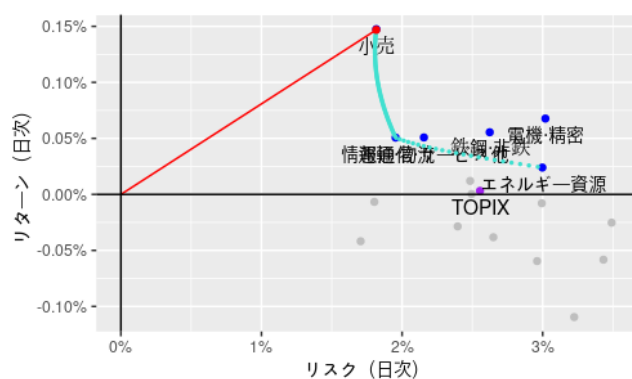
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.060%	1.333%	0.045	—
銀行	0.062%	1.350%	0.046	98.9%
自動車・輸送機	-0.095%	0.882%	-0.108	1.1%
医薬品	-0.162%	0.722%	-0.225	0.0%
運輸・物流	-0.164%	0.609%	-0.269	0.0%
金融(除く銀行)	-0.223%	0.675%	-0.331	0.0%
小売	-0.294%	0.831%	-0.354	0.0%

【一ヶ月】



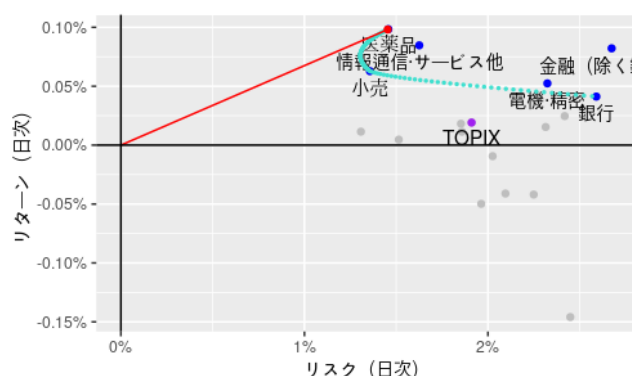
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.284%	1.295%	0.219	—
銀行	0.358%	1.719%	0.208	65.3%
医薬品	0.144%	1.186%	0.121	34.7%
金融(除く銀行)	0.143%	1.657%	0.087	0.0%
機械	0.057%	1.932%	0.029	0.0%
電機・精密	0.053%	1.972%	0.027	0.0%
TOPIX	0.028%	1.398%	0.020	0.0%

【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	0.147%	1.816%	0.081	—
小売	0.147%	1.817%	0.081	99.4%
電機・精密	0.068%	3.020%	0.022	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.055%	2.623%	0.021	0.0%
情報通信・サービス他	0.051%	2.155%	0.024	0.0%
運輸・物流	0.051%	1.954%	0.026	0.6%
エネルギー資源	0.024%	2.998%	0.008	0.0%

【半年】

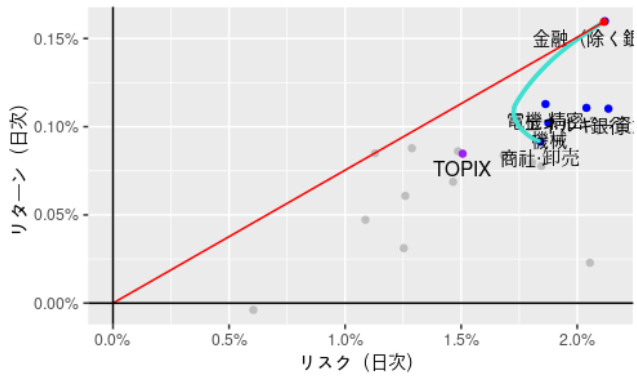


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.098%	1.454%	0.067	—
医薬品	0.098%	1.457%	0.068	99.2%
情報通信・サービス他	0.085%	1.626%	0.052	0.0%
金融(除く銀行)	0.082%	2.674%	0.031	0.0%
小売	0.063%	1.357%	0.046	0.8%
電機・精密	0.052%	2.324%	0.023	0.0%
銀行	0.041%	2.590%	0.016	0.0%

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。

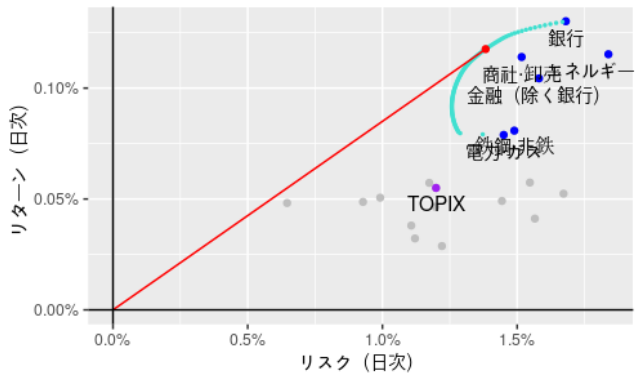
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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%	2.115%	0.075	—
金融（除く銀行）	0.160%	2.119%	0.075	99.3%
電機・精密	0.113%	1.863%	0.061	0.7%
エネルギー資源	0.111%	2.040%	0.054	0.0%
銀行	0.110%	2.134%	0.052	0.0%
機械	0.102%	1.876%	0.054	0.0%
商社・卸売	0.092%	1.842%	0.050	0.0%

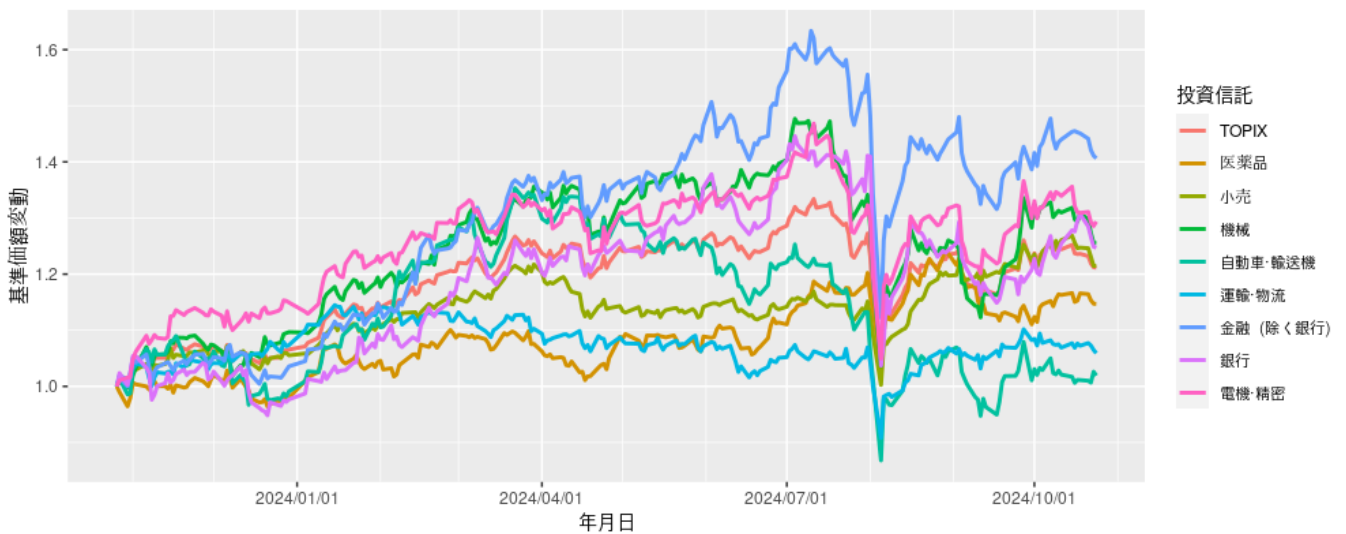
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.118%	1.383%	0.085	—
銀行	0.130%	1.681%	0.077	44.6%
エネルギー資源	0.115%	1.839%	0.063	11.4%
商社・卸売	0.114%	1.517%	0.075	33.3%
金融（除く銀行）	0.104%	1.581%	0.066	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.081%	1.489%	0.054	0.0%
電力・ガス	0.079%	1.450%	0.054	10.7%

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。