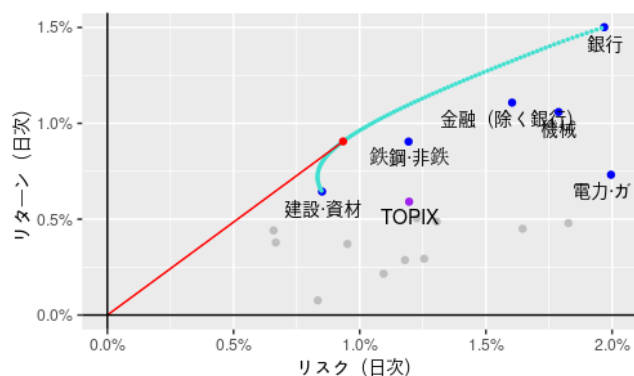


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

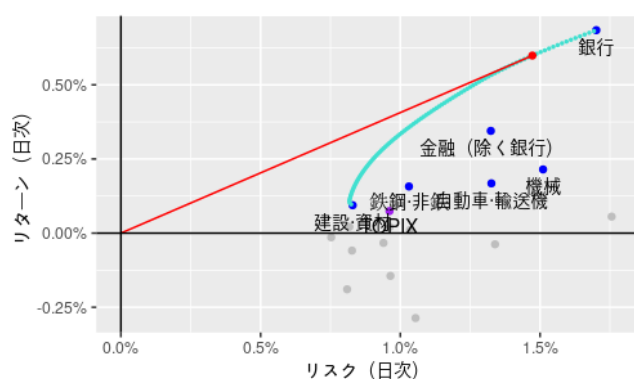
2024年11月9日

【半月】



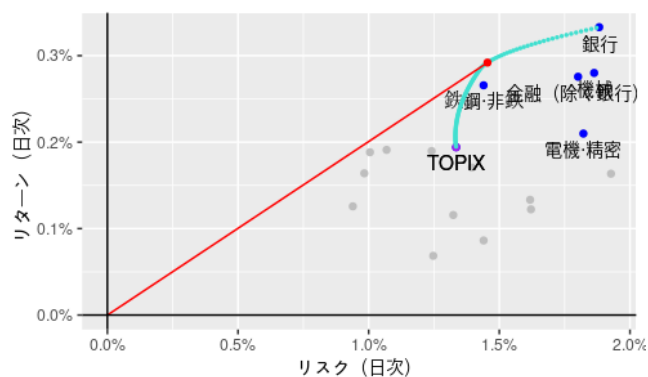
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.906%	0.934%	0.969	—
銀行	1.501%	1.969%	0.763	30.5%
金融 (除く銀行)	1.108%	1.604%	0.691	0.0%
機械	1.059%	1.788%	0.592	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.905%	1.194%	0.758	0.0%
電力・ガス	0.732%	1.996%	0.367	0.0%
建設・資材	0.644%	0.851%	0.757	69.5%

【一ヶ月】



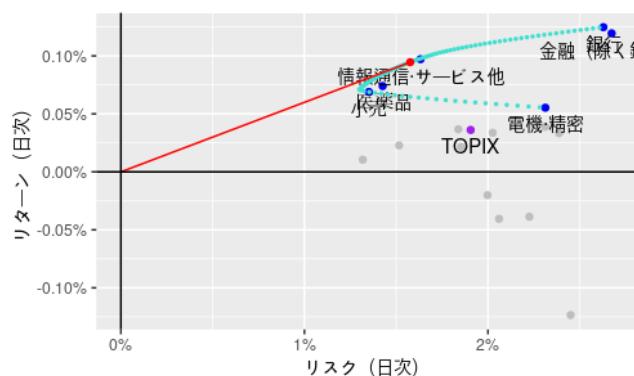
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.599%	1.473%	0.407	—
銀行	0.684%	1.701%	0.402	83.4%
金融 (除く銀行)	0.345%	1.324%	0.260	0.0%
機械	0.215%	1.511%	0.142	0.0%
自動車・輸送機	0.168%	1.326%	0.127	16.6%
鉄鋼・非鉄	0.157%	1.031%	0.153	0.0%
建設・資材	0.094%	0.829%	0.113	0.0%

【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	0.292%	1.455%	0.201	—
銀行	0.333%	1.882%	0.177	39.1%
機械	0.280%	1.863%	0.150	0.0%
金融 (除く銀行)	0.276%	1.801%	0.153	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.266%	1.440%	0.185	60.9%
電機・精密	0.210%	1.822%	0.115	0.0%
TOPIX	0.194%	1.335%	0.145	0.0%

【半年】

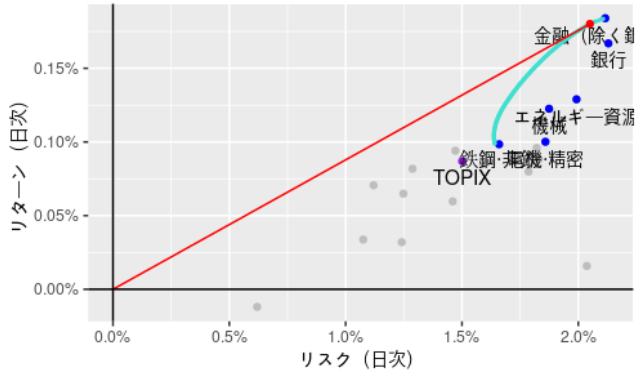


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.095%	1.576%	0.060	—
銀行	0.125%	2.629%	0.047	5.8%
金融 (除く銀行)	0.119%	2.674%	0.045	0.0%
情報通信・サービス他	0.097%	1.633%	0.060	76.2%
医薬品	0.074%	1.426%	0.052	18.1%
小売	0.069%	1.351%	0.051	0.0%
電機・精密	0.055%	2.313%	0.024	0.0%

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。

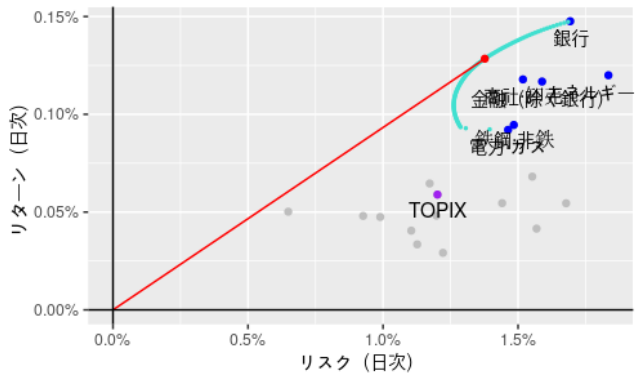
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.180%	2.050%	0.088	—
金融（除く銀行）	0.184%	2.116%	0.087	77.4%
銀行	0.167%	2.129%	0.078	22.6%
エネルギー資源	0.129%	1.992%	0.065	0.0%
機械	0.123%	1.874%	0.065	0.0%
電機・精密	0.100%	1.859%	0.054	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.098%	1.660%	0.059	0.0%

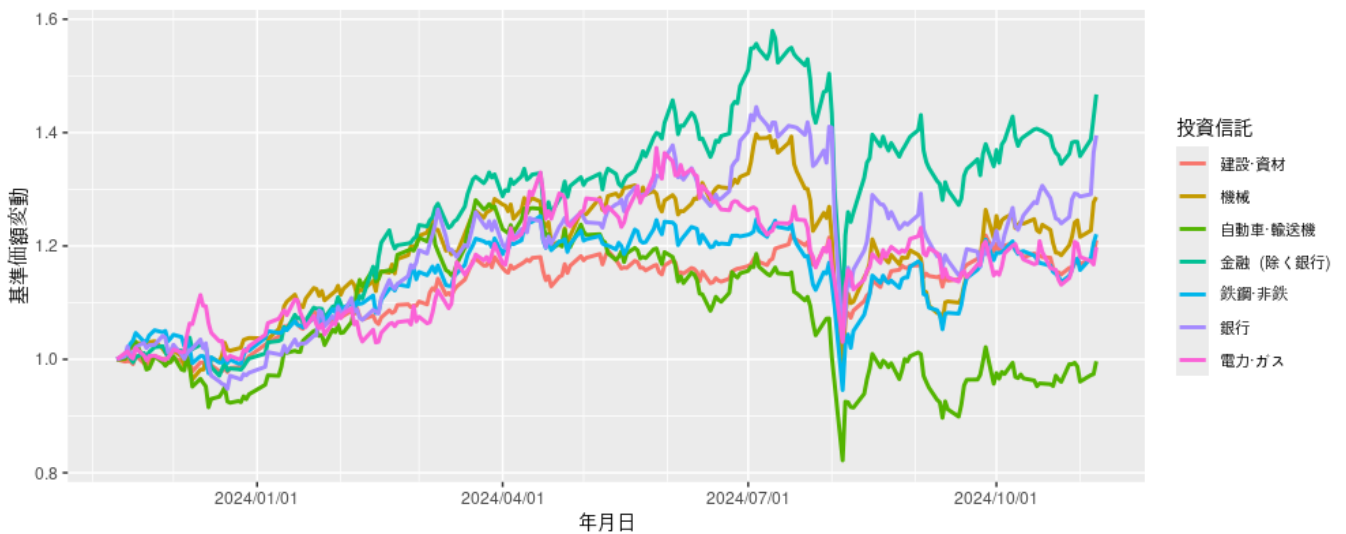
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.128%	1.377%	0.093	—
銀行	0.148%	1.693%	0.087	51.1%
エネルギー資源	0.120%	1.835%	0.065	9.3%
商社・卸売	0.118%	1.518%	0.078	21.0%
金融（除く銀行）	0.117%	1.589%	0.073	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.095%	1.484%	0.064	0.0%
電力・ガス	0.092%	1.463%	0.063	18.6%

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。