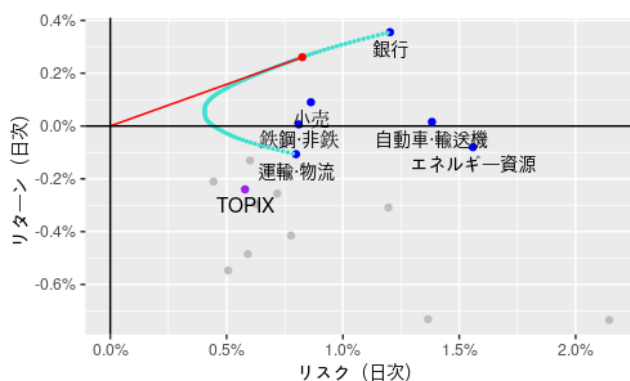


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

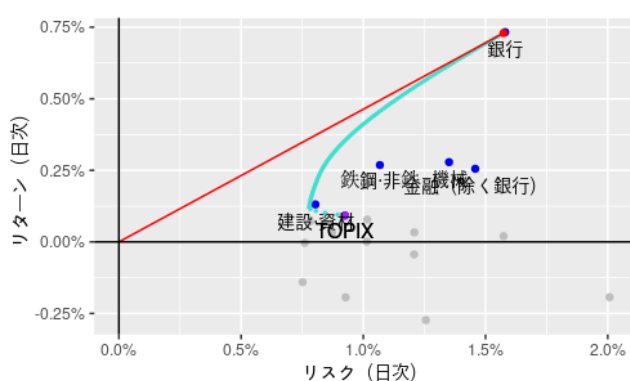
2024年11月23日

【半月】



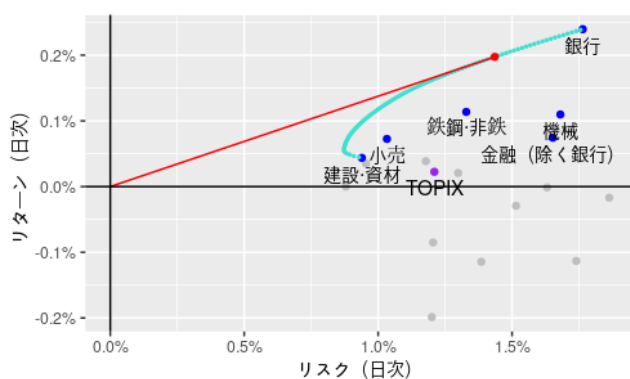
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.261%	0.825%	0.316	—
銀行	0.355%	1.202%	0.296	64.6%
小売	0.090%	0.862%	0.104	34.3%
自動車・輸送機	0.015%	1.383%	0.011	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.006%	0.810%	0.008	1.1%
エネルギー資源	-0.080%	1.559%	-0.051	0.0%
運輸・物流	-0.107%	0.798%	-0.134	0.0%

【一ヶ月】



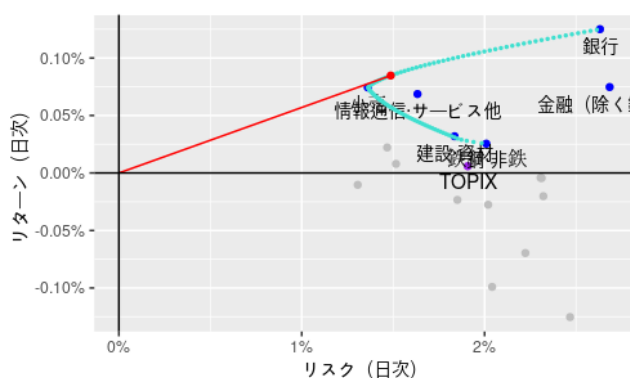
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.729%	1.574%	0.464	—
銀行	0.733%	1.580%	0.464	99.5%
機械	0.279%	1.351%	0.206	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.268%	1.068%	0.251	0.0%
金融(除く銀行)	0.255%	1.458%	0.175	0.0%
建設・資材	0.131%	0.804%	0.163	0.5%
TOPIX	0.092%	0.925%	0.099	0.0%

【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	0.197%	1.435%	0.138	—
銀行	0.240%	1.764%	0.136	72.7%
鉄鋼・非鉄	0.114%	1.329%	0.086	8.3%
機械	0.110%	1.680%	0.065	0.0%
金融(除く銀行)	0.074%	1.652%	0.045	0.0%
小売	0.073%	1.033%	0.070	18.9%
建設・資材	0.044%	0.939%	0.047	0.0%

【半年】

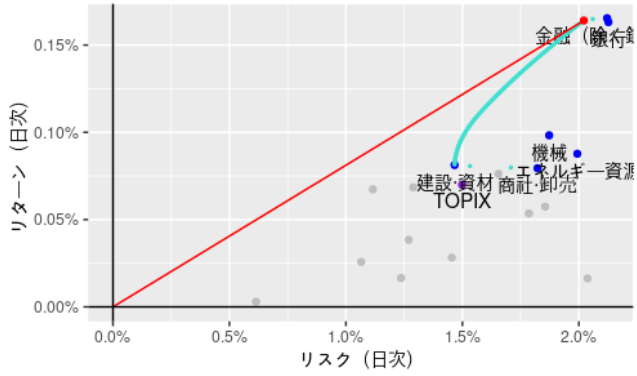


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.085%	1.487%	0.057	—
銀行	0.125%	2.631%	0.048	20.4%
金融(除く銀行)	0.075%	2.684%	0.028	0.0%
小売	0.074%	1.361%	0.055	79.6%
情報通信・サービス他	0.069%	1.633%	0.042	0.0%
建設・資材	0.032%	1.836%	0.017	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.025%	2.009%	0.013	0.0%

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。

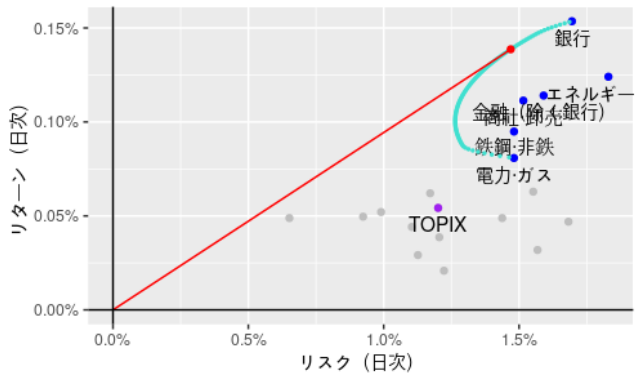
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.164%	2.021%	0.081	—
金融 (除く銀行)	0.165%	2.121%	0.078	53.1%
銀行	0.163%	2.127%	0.077	46.6%
機械	0.098%	1.872%	0.052	0.0%
エネルギー資源	0.088%	1.993%	0.044	0.0%
建設・資材	0.081%	1.467%	0.055	0.3%
商社・卸売	0.079%	1.822%	0.044	0.0%

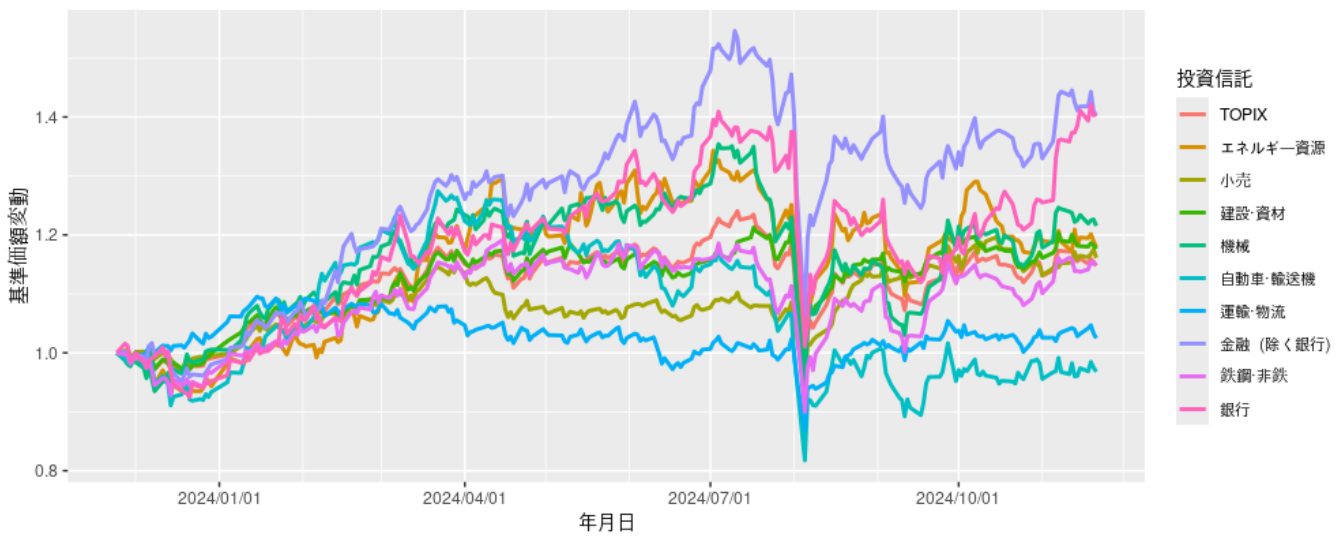
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.139%	1.469%	0.094	—
銀行	0.154%	1.695%	0.091	64.4%
エネルギー資源	0.124%	1.830%	0.068	19.1%
金融 (除く銀行)	0.114%	1.591%	0.072	0.0%
商社・卸売	0.111%	1.516%	0.073	9.1%
鉄鋼・非鉄	0.095%	1.481%	0.064	0.0%
電力・ガス	0.081%	1.481%	0.055	7.5%

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。