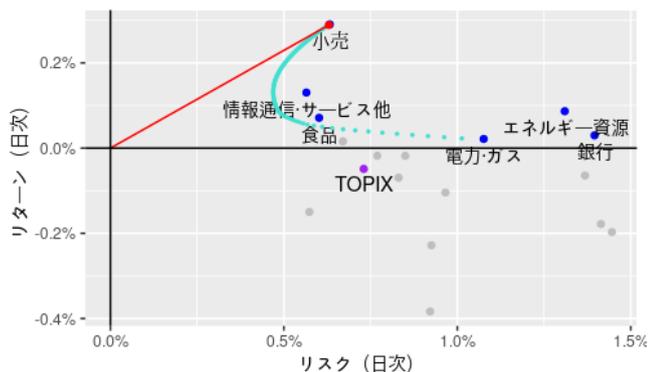


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

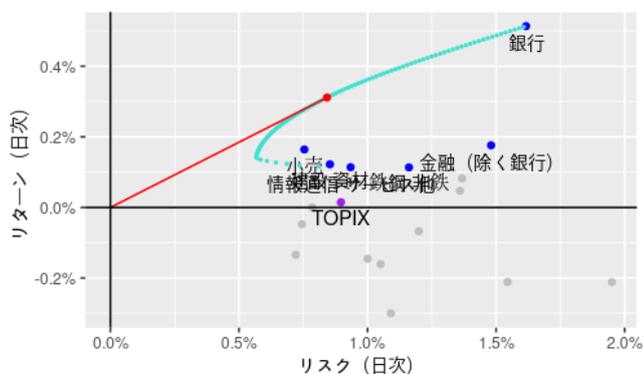
2024年11月29日

【半月】



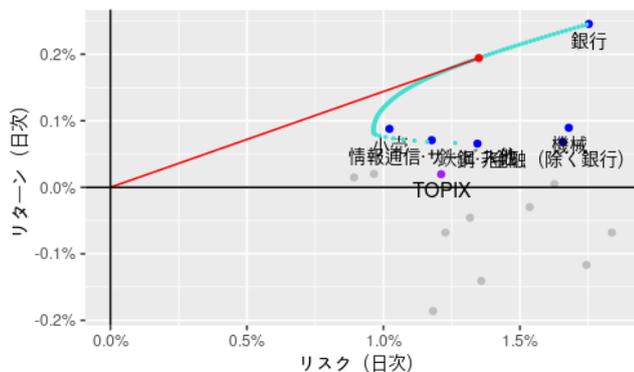
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.289%	0.630%	0.459	—
小売	0.290%	0.632%	0.459	99.2%
情報通信・サービス他	0.130%	0.565%	0.231	0.8%
エネルギー資源	0.087%	1.310%	0.066	0.0%
食品	0.071%	0.602%	0.118	0.0%
銀行	0.030%	1.396%	0.021	0.0%
電力・ガス	0.021%	1.076%	0.020	0.0%

【一ヶ月】



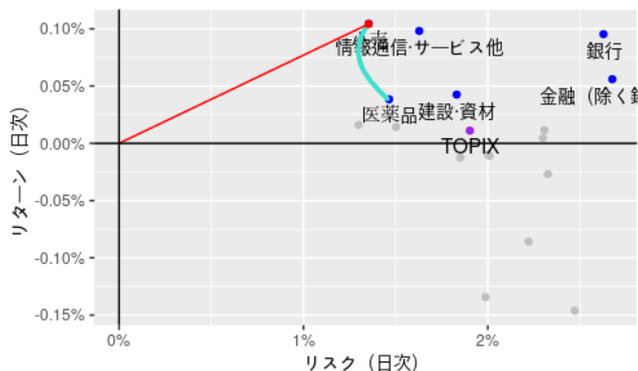
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.311%	0.843%	0.370	—
銀行	0.513%	1.616%	0.318	42.2%
金融(除く銀行)	0.176%	1.481%	0.119	0.0%
小売	0.164%	0.754%	0.218	57.2%
建設・資材	0.122%	0.854%	0.143	0.6%
情報通信・サービス他	0.114%	0.934%	0.122	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.113%	1.161%	0.098	0.0%

【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	0.194%	1.350%	0.144	—
銀行	0.246%	1.753%	0.140	67.5%
機械	0.089%	1.679%	0.053	0.0%
小売	0.088%	1.022%	0.086	32.5%
情報通信・サービス他	0.071%	1.177%	0.060	0.0%
金融(除く銀行)	0.068%	1.657%	0.041	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.066%	1.344%	0.049	0.0%

【半年】

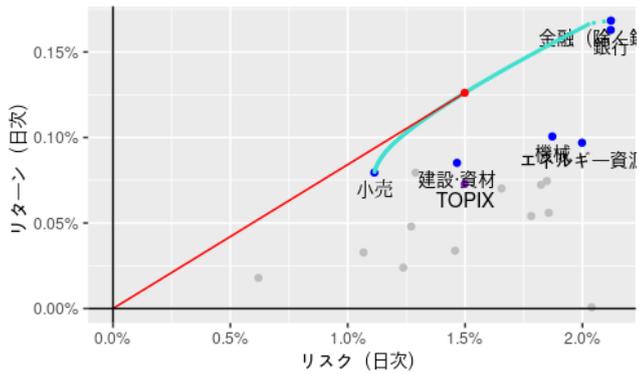


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.104%	1.353%	0.077	—
小売	0.104%	1.354%	0.077	99.5%
情報通信・サービス他	0.098%	1.628%	0.060	0.0%
銀行	0.095%	2.627%	0.036	0.0%
金融(除く銀行)	0.056%	2.675%	0.021	0.0%
建設・資材	0.043%	1.831%	0.023	0.0%
医薬品	0.038%	1.465%	0.026	0.5%

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。

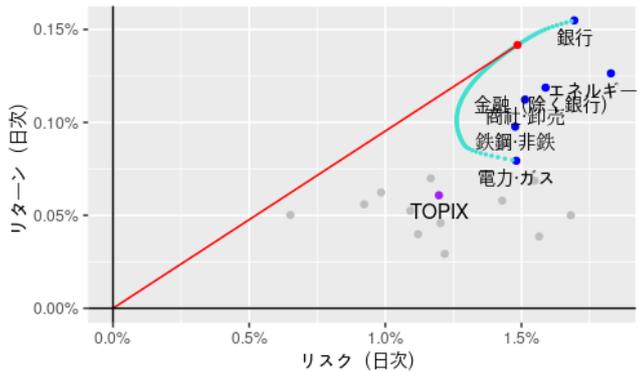
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.126%	1.498%	0.084	—
金融 (除く銀行)	0.168%	2.121%	0.079	23.1%
銀行	0.163%	2.121%	0.077	31.4%
機械	0.101%	1.872%	0.054	0.0%
エネルギー資源	0.097%	1.998%	0.049	0.0%
建設・資材	0.085%	1.466%	0.058	0.0%
小売	0.080%	1.114%	0.071	45.6%

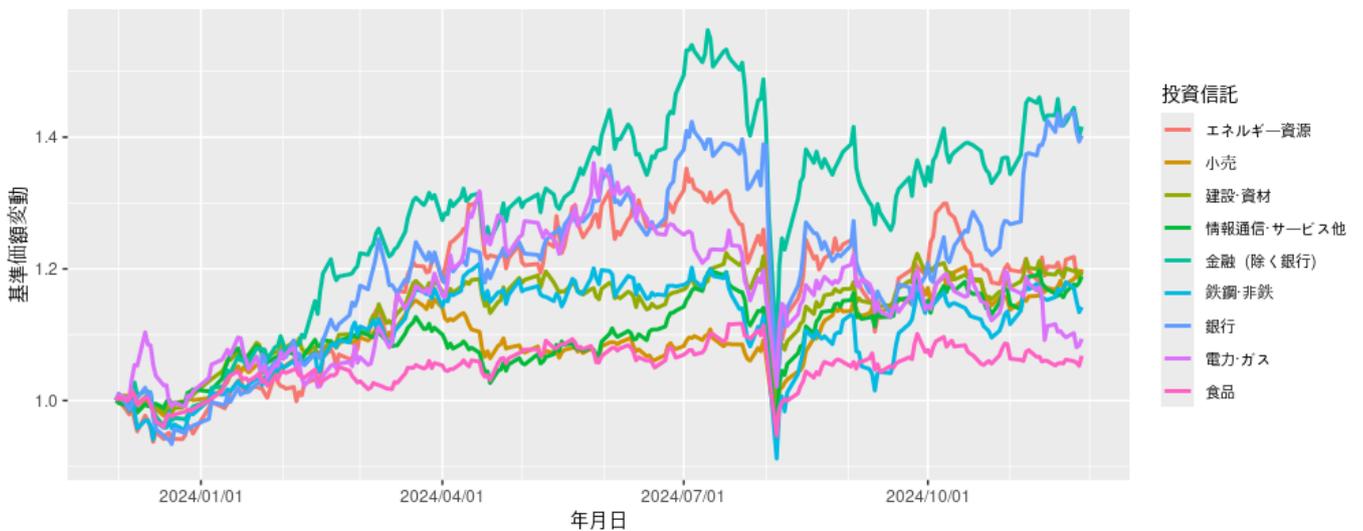
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.142%	1.486%	0.095	—
銀行	0.155%	1.694%	0.091	65.6%
エネルギー資源	0.126%	1.829%	0.069	20.9%
金融 (除く銀行)	0.119%	1.589%	0.075	0.0%
商社・卸売	0.112%	1.513%	0.074	8.9%
鉄鋼・非鉄	0.098%	1.477%	0.066	0.0%
電力・ガス	0.079%	1.481%	0.054	4.6%

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。