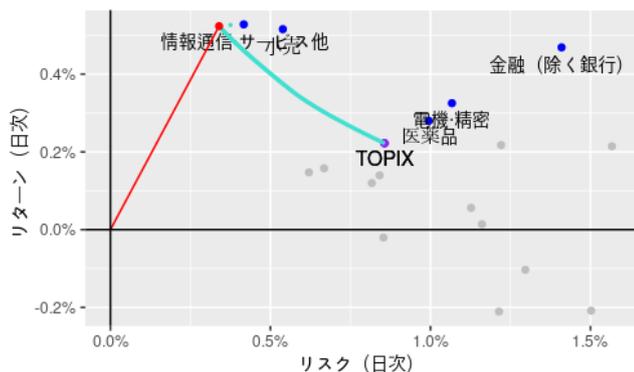


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

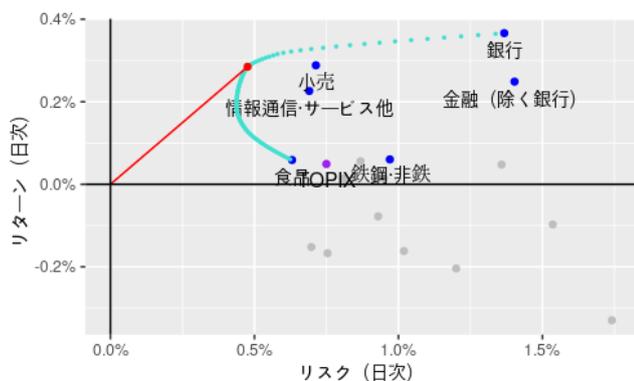
2024年12月6日

【半月】



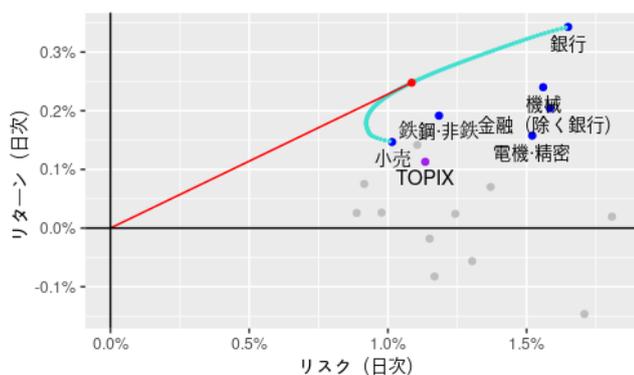
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.523%	0.340%	1.541	—
情報通信・サービス他	0.528%	0.417%	1.267	62.8%
小売	0.516%	0.539%	0.957	37.2%
金融(除く銀行)	0.469%	1.410%	0.332	0.0%
電機・精密	0.325%	1.067%	0.305	0.0%
医薬品	0.280%	0.995%	0.281	0.0%
TOPIX	0.222%	0.856%	0.260	0.0%

【一ヶ月】



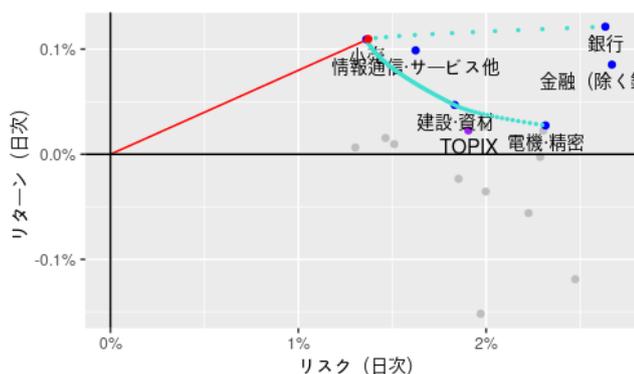
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.285%	0.476%	0.598	—
銀行	0.366%	1.367%	0.268	18.2%
小売	0.288%	0.713%	0.404	53.3%
金融(除く銀行)	0.249%	1.403%	0.177	0.0%
情報通信・サービス他	0.226%	0.690%	0.328	28.5%
鉄鋼・非鉄	0.060%	0.970%	0.062	0.0%
食品	0.059%	0.631%	0.093	0.0%

【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	0.248%	1.086%	0.228	—
銀行	0.343%	1.649%	0.208	47.4%
機械	0.240%	1.560%	0.154	0.0%
金融(除く銀行)	0.204%	1.584%	0.129	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.192%	1.184%	0.162	18.0%
電機・精密	0.158%	1.520%	0.104	0.0%
小売	0.147%	1.015%	0.145	34.6%

【半年】

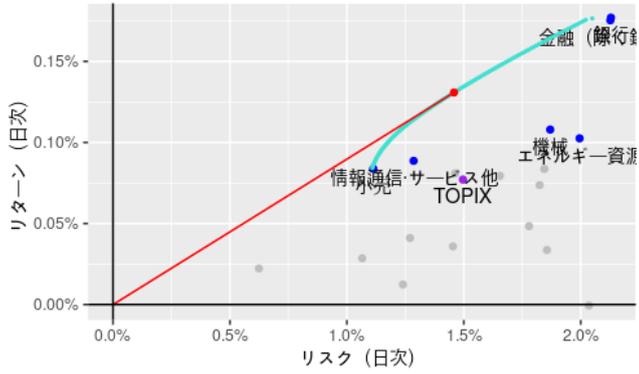


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.110%	1.373%	0.080	—
銀行	0.121%	2.635%	0.046	3.0%
小売	0.109%	1.363%	0.080	97.0%
情報通信・サービス他	0.099%	1.625%	0.061	0.0%
金融(除く銀行)	0.085%	2.670%	0.032	0.0%
建設・資材	0.047%	1.833%	0.026	0.0%
電機・精密	0.027%	2.316%	0.012	0.0%

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。

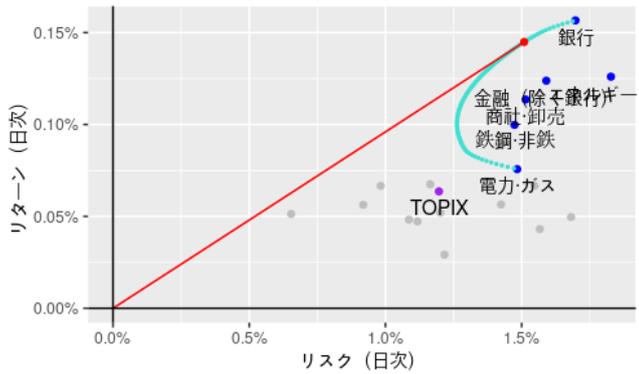
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.131%	1.458%	0.090	—
銀行	0.177%	2.129%	0.083	37.9%
金融(除く銀行)	0.175%	2.126%	0.082	12.9%
機械	0.108%	1.869%	0.058	0.0%
エネルギー資源	0.103%	1.995%	0.051	0.0%
情報通信・サービス他	0.089%	1.285%	0.069	0.0%
小売	0.084%	1.113%	0.075	49.3%

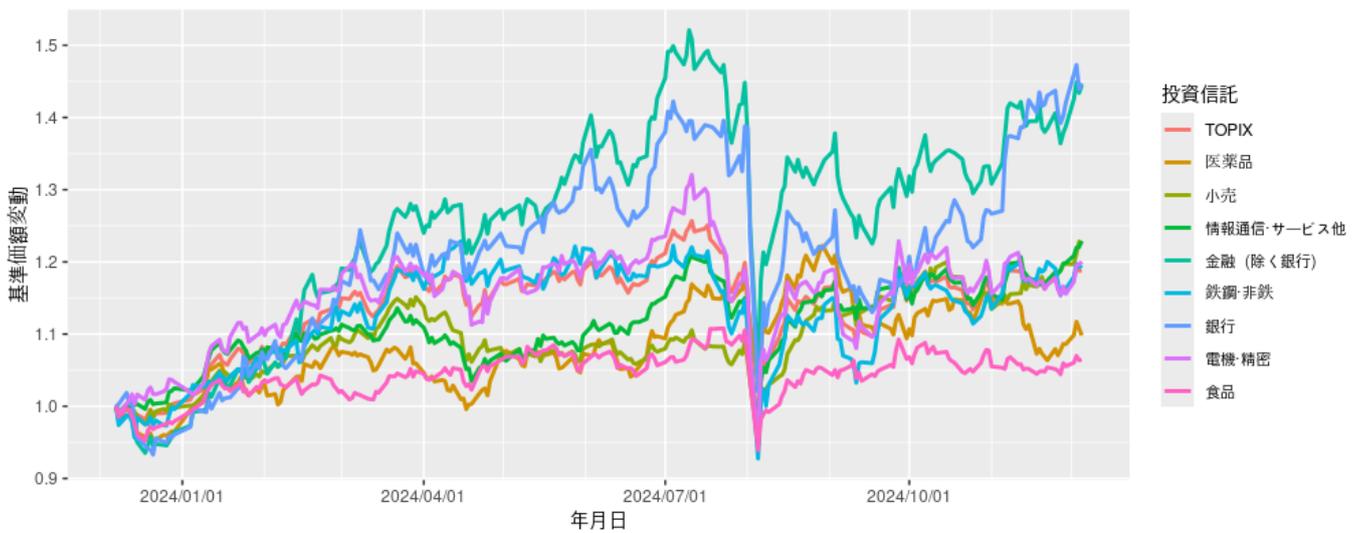
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.145%	1.509%	0.096	—
銀行	0.157%	1.697%	0.092	67.0%
エネルギー資源	0.126%	1.827%	0.069	20.6%
金融(除く銀行)	0.124%	1.590%	0.078	0.0%
商社・卸売	0.114%	1.515%	0.075	12.2%
鉄鋼・非鉄	0.100%	1.473%	0.068	0.0%
電力・ガス	0.076%	1.483%	0.051	0.2%

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。