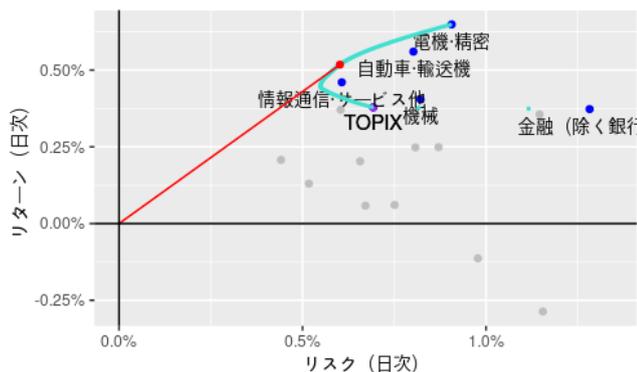


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

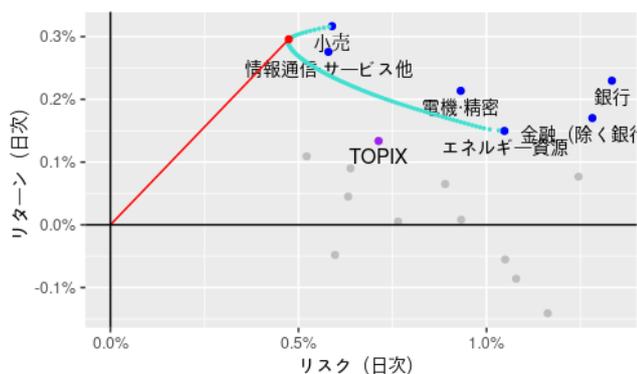
2024年12月14日

【半月】



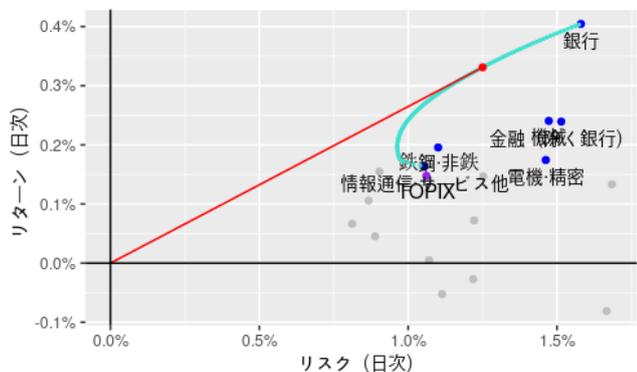
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.518%	0.602%	0.860	—
電機・精密	0.649%	0.906%	0.716	17.5%
自動車・輸送機	0.560%	0.802%	0.699	24.6%
情報通信・サービス他	0.460%	0.607%	0.758	57.9%
機械	0.404%	0.821%	0.492	0.0%
TOPIX	0.379%	0.693%	0.546	0.0%
金融(除く銀行)	0.373%	1.282%	0.291	0.0%

【一ヶ月】



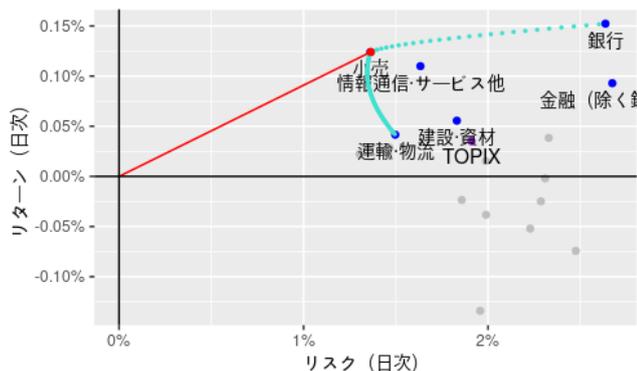
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.296%	0.474%	0.624	—
小売	0.317%	0.589%	0.537	57.2%
情報通信・サービス他	0.276%	0.580%	0.476	35.5%
銀行	0.230%	1.333%	0.172	7.3%
電機・精密	0.214%	0.931%	0.229	0.0%
金融(除く銀行)	0.170%	1.281%	0.133	0.0%
エネルギー資源	0.150%	1.048%	0.143	0.0%

【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	0.331%	1.250%	0.265	—
銀行	0.405%	1.580%	0.256	65.5%
機械	0.241%	1.472%	0.163	0.0%
金融(除く銀行)	0.239%	1.514%	0.158	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.196%	1.101%	0.178	30.5%
電機・精密	0.174%	1.462%	0.119	0.0%
情報通信・サービス他	0.164%	1.054%	0.155	4.0%

【半年】

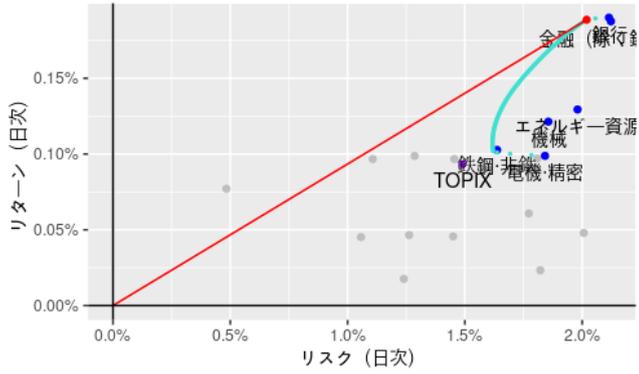


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.124%	1.364%	0.091	—
銀行	0.152%	2.636%	0.058	0.6%
小売	0.124%	1.362%	0.091	99.4%
情報通信・サービス他	0.110%	1.633%	0.067	0.0%
金融(除く銀行)	0.093%	2.674%	0.035	0.0%
建設・資材	0.056%	1.831%	0.030	0.0%
運輸・物流	0.042%	1.497%	0.028	0.0%

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。

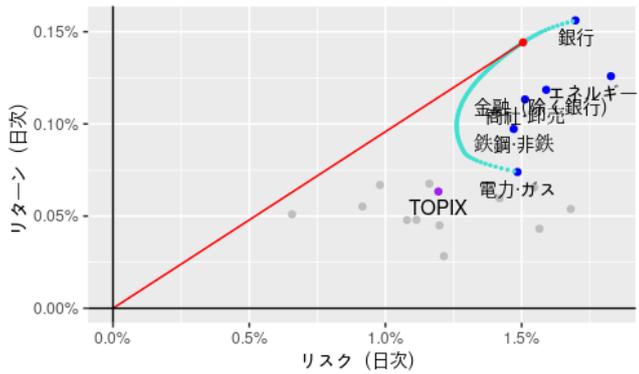
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.189%	2.019%	0.093	—
銀行	0.190%	2.114%	0.090	54.1%
金融 (除く銀行)	0.188%	2.123%	0.088	45.5%
エネルギー資源	0.129%	1.980%	0.065	0.5%
機械	0.121%	1.856%	0.065	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.103%	1.637%	0.063	0.0%
電機・精密	0.099%	1.841%	0.054	0.0%

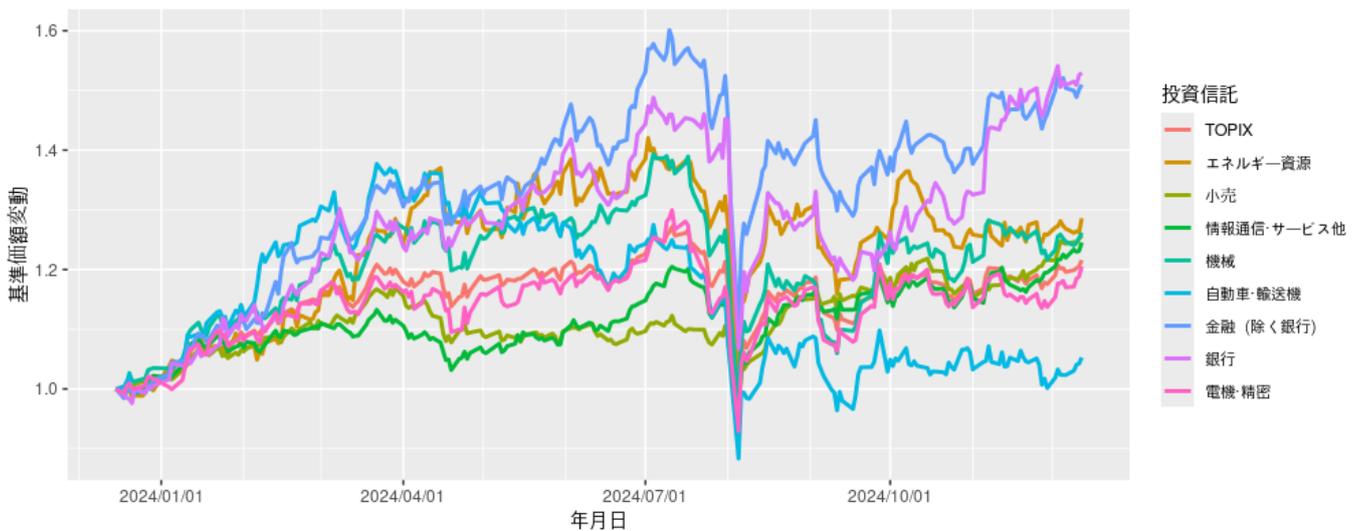
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.144%	1.505%	0.096	—
銀行	0.156%	1.697%	0.092	66.1%
エネルギー資源	0.126%	1.828%	0.069	20.6%
金融 (除く銀行)	0.118%	1.590%	0.075	0.0%
商社・卸売	0.113%	1.513%	0.075	13.2%
鉄鋼・非鉄	0.097%	1.471%	0.066	0.0%
電力・ガス	0.074%	1.485%	0.050	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。

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。