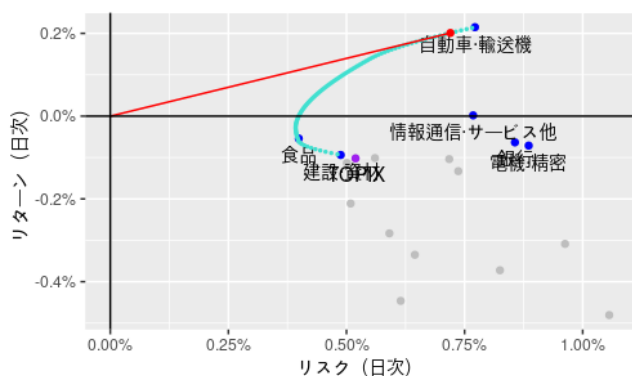


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

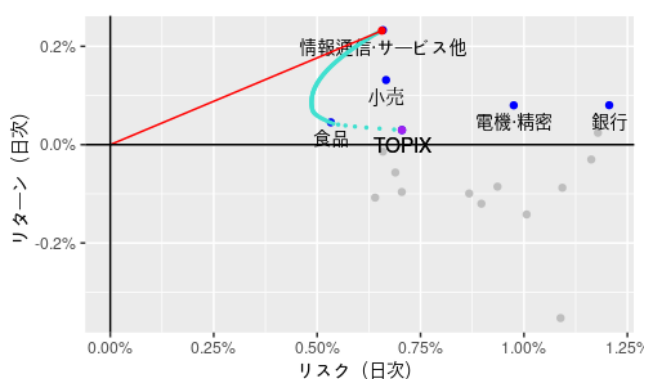
2024年12月20日

【半月】



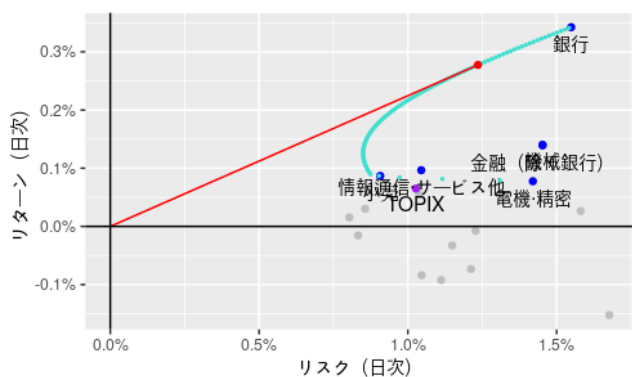
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.201%	0.720%	0.279	—
自動車・輸送機	0.215%	0.772%	0.278	93.5%
情報通信・サービス他	0.002%	0.768%	0.002	6.5%
食品	-0.054%	0.399%	-0.136	0.0%
銀行	-0.063%	0.857%	-0.074	0.0%
電機・精密	-0.071%	0.886%	-0.080	0.0%
建設・資材	-0.094%	0.488%	-0.192	0.0%

【一ヶ月】



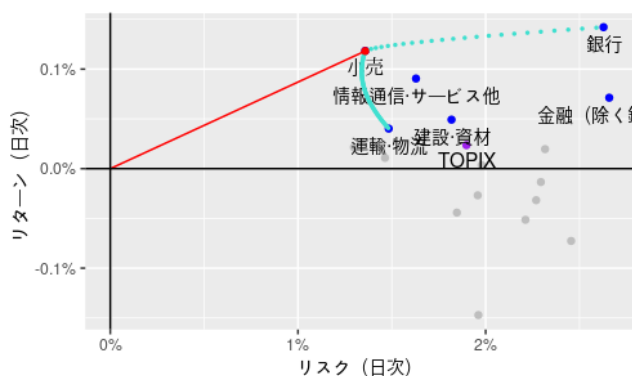
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.232%	0.656%	0.353	—
情報通信・サービス他	0.233%	0.659%	0.353	99.0%
小売	0.131%	0.667%	0.197	1.0%
銀行	0.080%	1.206%	0.067	0.0%
電機・精密	0.080%	0.975%	0.082	0.0%
食品	0.045%	0.533%	0.085	0.0%
TOPIX	0.030%	0.705%	0.042	0.0%

【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	0.277%	1.236%	0.225	—
銀行	0.342%	1.549%	0.221	74.6%
機械	0.140%	1.452%	0.097	0.0%
金融 (除く銀行)	0.139%	1.453%	0.096	0.0%
情報通信・サービス他	0.097%	1.045%	0.092	0.0%
小売	0.087%	0.907%	0.096	25.4%
電機・精密	0.078%	1.420%	0.055	0.0%

【半年】

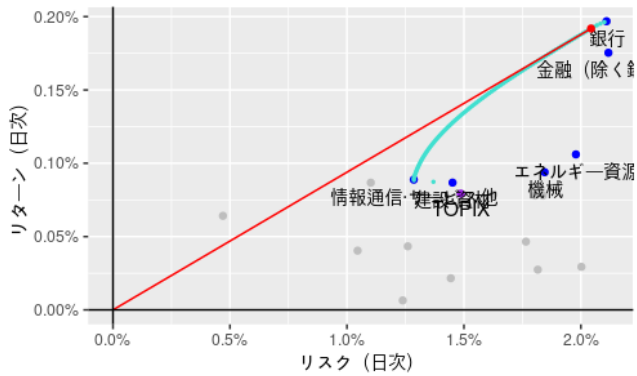


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.118%	1.358%	0.087	—
銀行	0.142%	2.628%	0.054	0.0%
小売	0.118%	1.359%	0.087	99.7%
情報通信・サービス他	0.091%	1.629%	0.056	0.0%
金融 (除く銀行)	0.071%	2.658%	0.027	0.0%
建設・資材	0.049%	1.818%	0.027	0.0%
運輸・物流	0.040%	1.484%	0.027	0.3%

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。

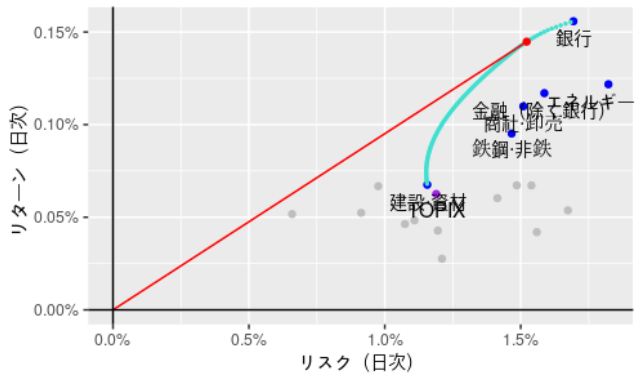
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.192%	2.043%	0.094	—
銀行	0.197%	2.110%	0.093	80.4%
金融（除く銀行）	0.175%	2.118%	0.083	18.7%
エネルギー資源	0.106%	1.979%	0.054	0.0%
機械	0.094%	1.845%	0.051	0.0%
情報通信・サービス他	0.089%	1.286%	0.069	0.9%
建設・資材	0.087%	1.451%	0.060	0.0%

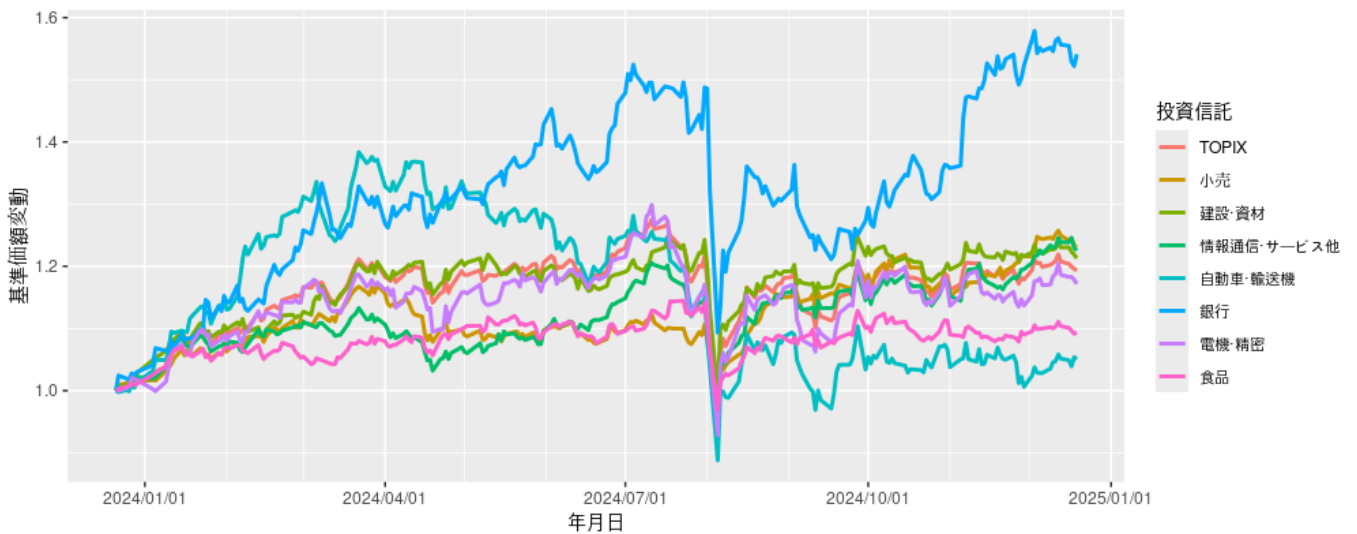
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.145%	1.522%	0.095	—
銀行	0.156%	1.694%	0.092	70.8%
エネルギー資源	0.122%	1.823%	0.067	20.0%
金融（除く銀行）	0.117%	1.587%	0.074	0.0%
商社・卸売	0.110%	1.510%	0.073	9.2%
鉄鋼・非鉄	0.095%	1.467%	0.065	0.0%
建設・資材	0.068%	1.156%	0.058	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。