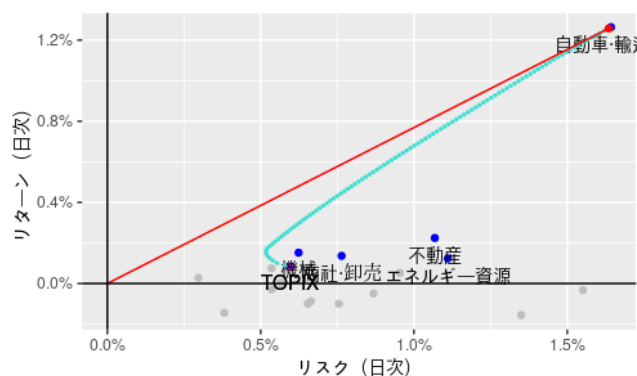


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

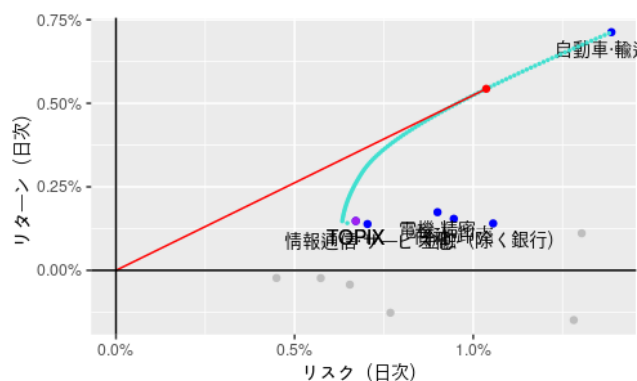
2024年12月28日

【半月】



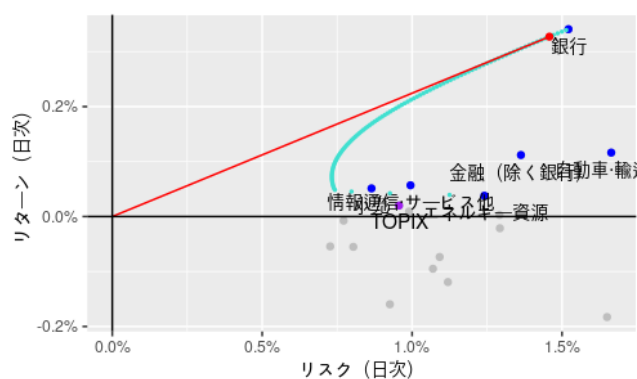
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	1.258%	1.636%	0.769	—
自動車・輸送機	1.264%	1.643%	0.769	99.4%
不動産	0.224%	1.068%	0.210	0.6%
機械	0.152%	0.624%	0.243	0.0%
商社・卸売	0.136%	0.764%	0.178	0.0%
エネルギー資源	0.123%	1.110%	0.111	0.0%
TOPIX	0.083%	0.596%	0.139	0.0%

【一ヶ月】



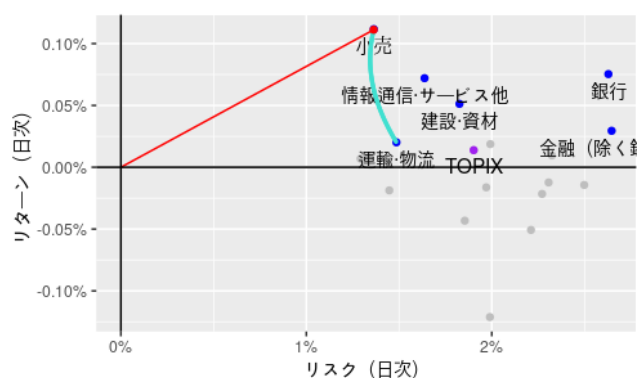
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.543%	1.036%	0.524	—
自動車・輸送機	0.713%	1.387%	0.514	70.5%
電機・精密	0.174%	0.900%	0.193	0.0%
商社・卸売	0.154%	0.946%	0.163	0.0%
TOPIX	0.148%	0.671%	0.220	0.0%
金融(除く銀行)	0.140%	1.056%	0.133	0.0%
情報通信・サービス他	0.139%	0.704%	0.197	29.5%

【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	0.327%	1.458%	0.224	—
銀行	0.341%	1.522%	0.224	94.1%
自動車・輸送機	0.116%	1.664%	0.070	5.5%
金融(除く銀行)	0.112%	1.363%	0.082	0.0%
情報通信・サービス他	0.057%	0.995%	0.057	0.0%
小売	0.051%	0.865%	0.059	0.4%
エネルギー資源	0.038%	1.241%	0.030	0.0%

【半年】

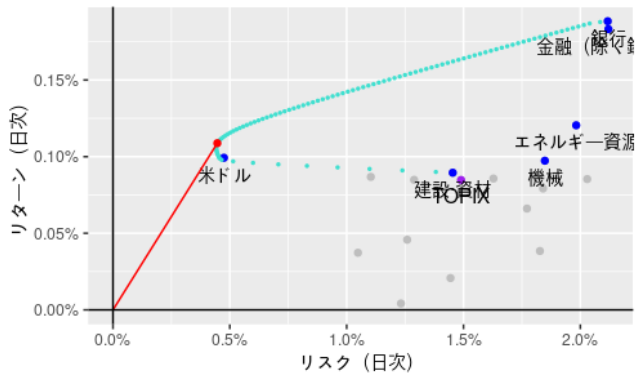


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.111%	1.363%	0.082	—
小売	0.112%	1.364%	0.082	99.5%
銀行	0.075%	2.629%	0.029	0.0%
情報通信・サービス他	0.072%	1.637%	0.044	0.0%
建設・資材	0.051%	1.826%	0.028	0.0%
金融(除く銀行)	0.029%	2.646%	0.011	0.0%
運輸・物流	0.020%	1.486%	0.014	0.5%

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。

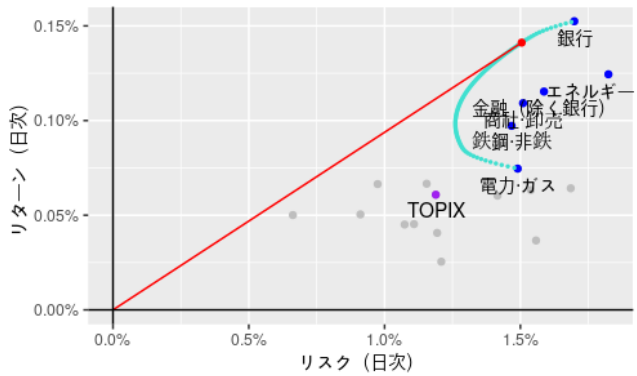
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.109%	0.447%	0.244	—
銀行	0.188%	2.117%	0.089	10.7%
金融 (除く銀行)	0.183%	2.120%	0.086	0.0%
エネルギー資源	0.120%	1.982%	0.061	0.0%
米ドル	0.099%	0.475%	0.209	89.3%
機械	0.097%	1.848%	0.053	0.0%
建設・資材	0.090%	1.454%	0.062	0.0%

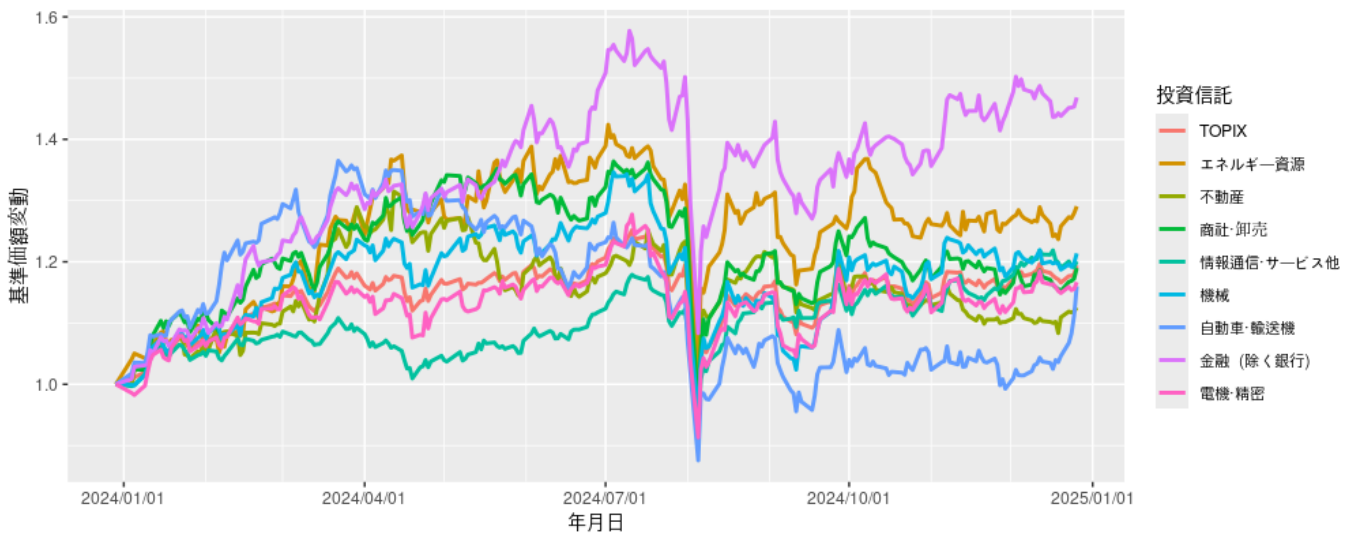
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.141%	1.505%	0.094	—
銀行	0.152%	1.698%	0.090	66.5%
エネルギー資源	0.124%	1.824%	0.068	23.4%
金融 (除く銀行)	0.115%	1.587%	0.073	0.0%
商社・卸売	0.109%	1.510%	0.072	9.0%
鉄鋼・非鉄	0.097%	1.468%	0.066	0.0%
電力・ガス	0.075%	1.490%	0.050	1.1%

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。