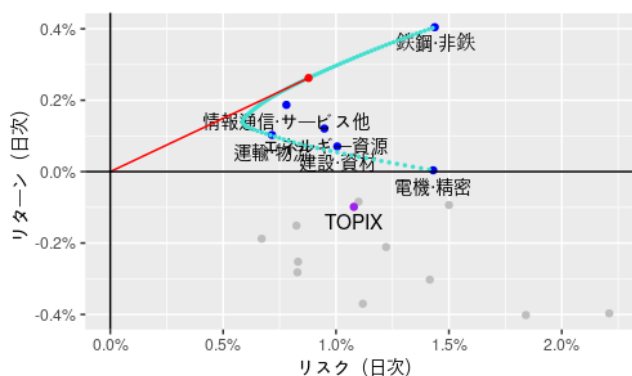


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

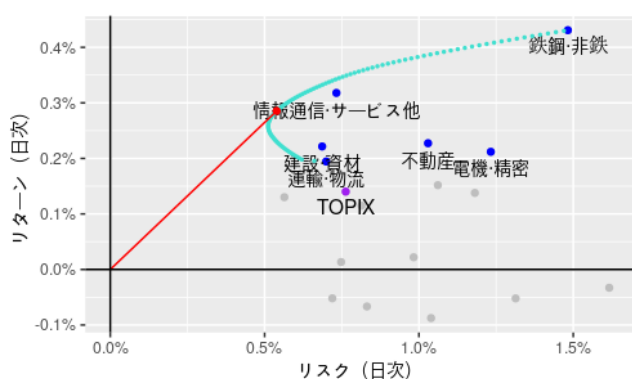
2025年2月15日

【半月】



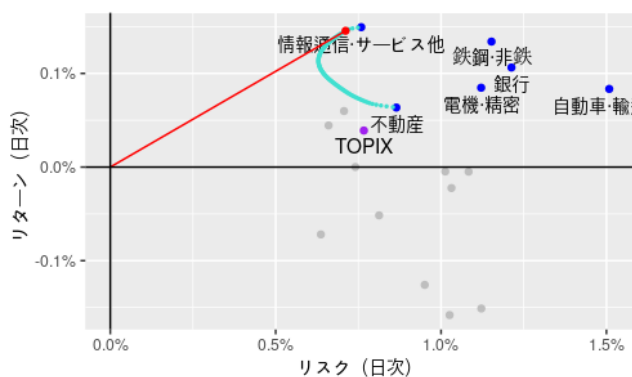
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.262%	0.878%	0.299	—
鉄鋼・非鉄	0.405%	1.437%	0.281	41.4%
情報通信・サービス他	0.187%	0.780%	0.240	41.1%
エネルギー資源	0.121%	0.948%	0.127	0.0%
運輸・物流	0.103%	0.716%	0.143	17.5%
建設・資材	0.071%	1.005%	0.070	0.0%
電機・精密	0.004%	1.430%	0.003	0.0%

【一ヶ月】



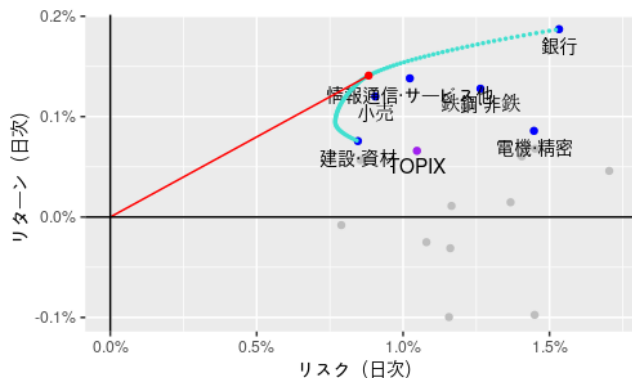
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.285%	0.539%	0.530	—
鉄鋼・非鉄	0.431%	1.483%	0.291	15.3%
情報通信・サービス他	0.318%	0.733%	0.434	41.5%
不動産	0.227%	1.029%	0.221	3.0%
建設・資材	0.222%	0.686%	0.323	9.6%
電機・精密	0.212%	1.233%	0.172	0.0%
運輸・物流	0.194%	0.699%	0.278	30.6%

【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	0.146%	0.711%	0.205	—
情報通信・サービス他	0.149%	0.759%	0.197	80.5%
鉄鋼・非鉄	0.134%	1.152%	0.116	17.5%
銀行	0.106%	1.213%	0.088	1.3%
電機・精密	0.085%	1.121%	0.076	0.0%
自動車・輸送機	0.083%	1.508%	0.055	0.0%
不動産	0.064%	0.865%	0.073	0.7%

【半年】

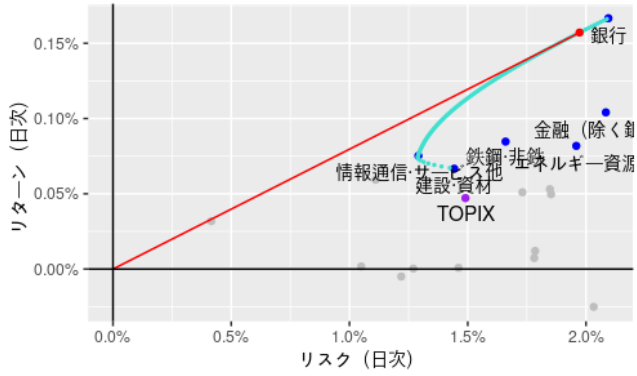


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.141%	0.882%	0.160	—
銀行	0.187%	1.533%	0.122	24.2%
情報通信・サービス他	0.138%	1.023%	0.135	22.2%
鉄鋼・非鉄	0.128%	1.264%	0.101	7.3%
小売	0.120%	0.905%	0.133	46.3%
電機・精密	0.086%	1.447%	0.059	0.0%
建設・資材	0.076%	0.846%	0.089	0.0%

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。

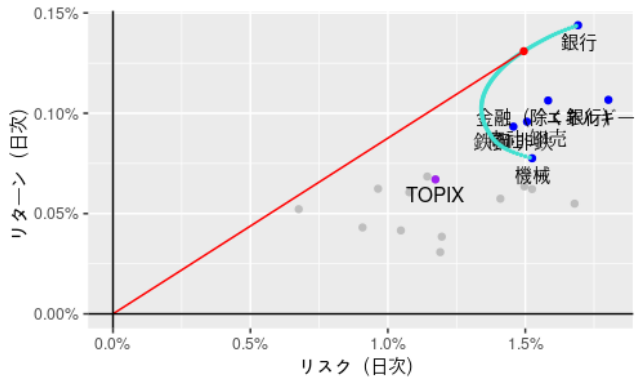
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.157%	1.973%	0.080	—
銀行	0.167%	2.095%	0.080	89.6%
金融 (除く銀行)	0.104%	2.084%	0.050	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.085%	1.660%	0.051	0.0%
エネルギー資源	0.082%	1.959%	0.042	0.0%
情報通信・サービス他	0.075%	1.291%	0.058	10.4%
建設・資材	0.067%	1.443%	0.046	0.0%

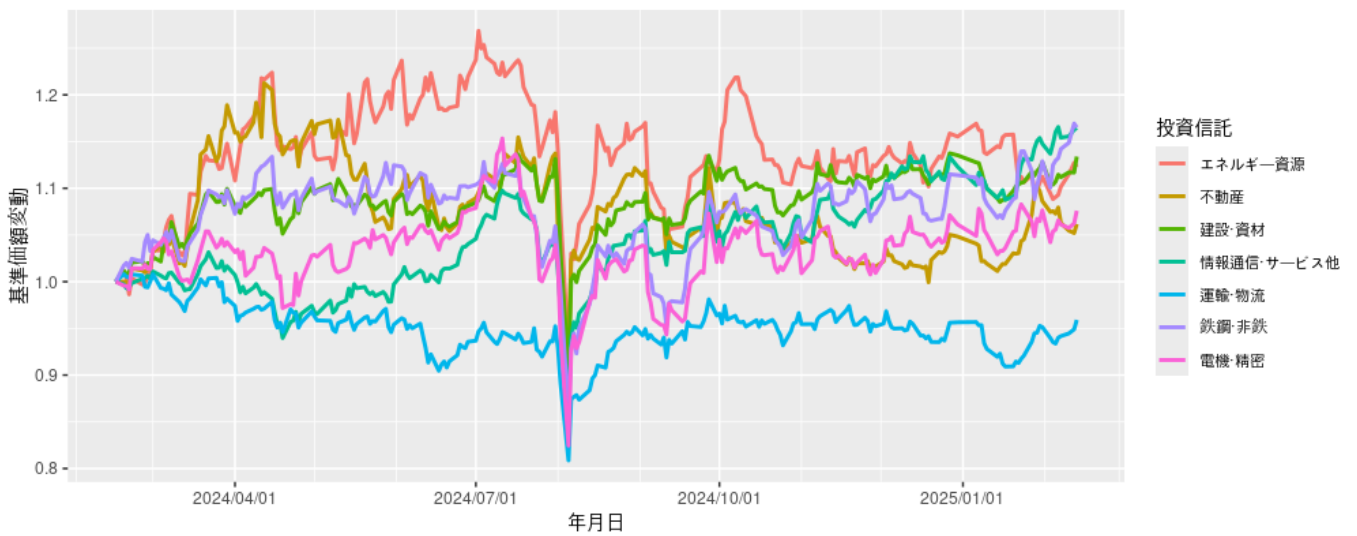
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.131%	1.495%	0.088	—
銀行	0.144%	1.692%	0.085	70.4%
エネルギー資源	0.107%	1.802%	0.059	15.1%
金融 (除く銀行)	0.106%	1.583%	0.067	0.0%
商社・卸売	0.096%	1.506%	0.064	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.093%	1.457%	0.064	14.5%
機械	0.078%	1.525%	0.051	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。