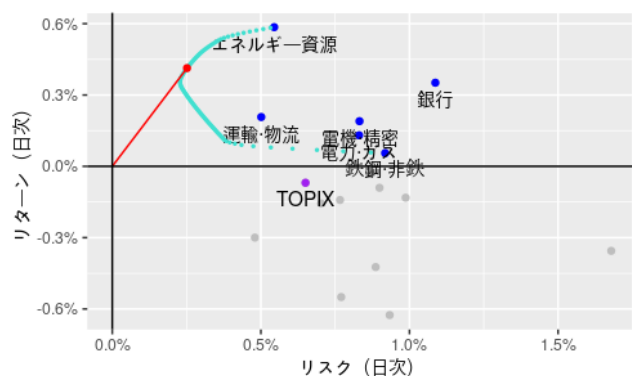


TOPIX17 シリーズ（+米ドル）を使った効率的ポートフォリオ

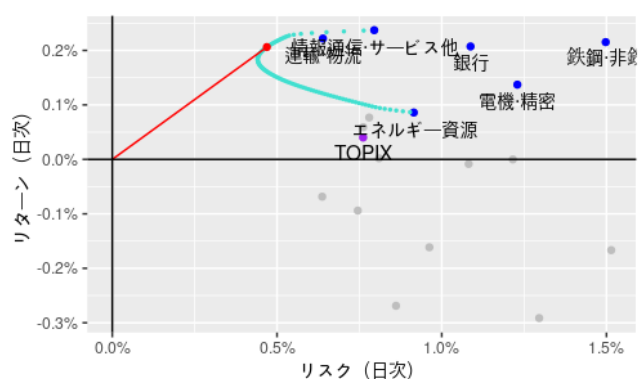
2025年2月21日

【半月】



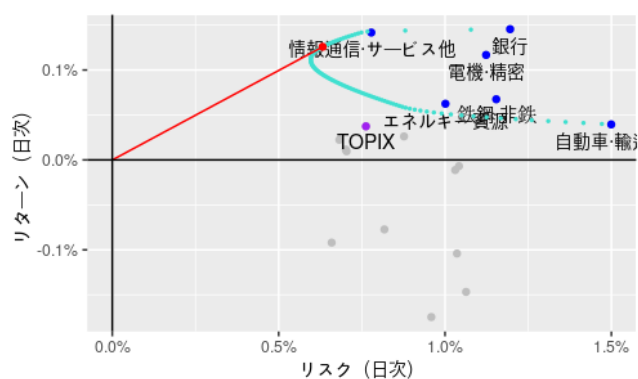
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.413%	0.251%	1.643	—
エネルギー資源	0.585%	0.545%	1.074	53.0%
銀行	0.352%	1.087%	0.324	7.0%
運輸・物流	0.207%	0.501%	0.414	25.9%
電機・精密	0.190%	0.832%	0.228	10.2%
電力・ガス	0.131%	0.831%	0.157	3.8%
鉄鋼・非鉄	0.056%	0.918%	0.060	0.0%

【一ヶ月】



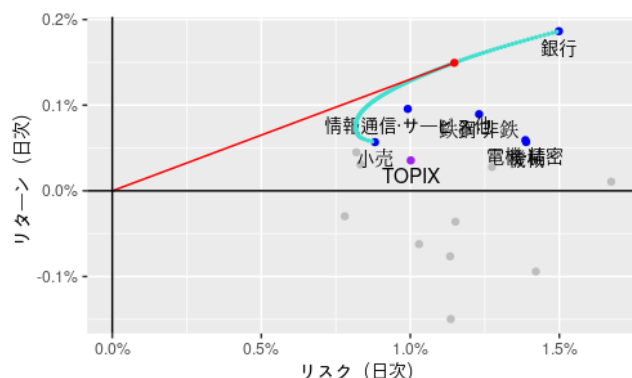
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.206%	0.469%	0.439	—
情報通信・サービス他	0.237%	0.795%	0.298	37.4%
運輸・物流	0.222%	0.639%	0.347	44.0%
鉄鋼・非鉄	0.215%	1.498%	0.144	3.1%
銀行	0.207%	1.087%	0.191	0.0%
電機・精密	0.137%	1.230%	0.112	0.0%
エネルギー資源	0.086%	0.915%	0.094	15.6%

【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	0.126%	0.632%	0.199	—
銀行	0.145%	1.196%	0.122	10.5%
情報通信・サービス他	0.142%	0.778%	0.182	69.0%
電機・精密	0.117%	1.123%	0.104	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.067%	1.154%	0.058	0.0%
エネルギー資源	0.062%	1.001%	0.062	20.5%
自動車・輸送機	0.040%	1.500%	0.026	0.0%

【半年】

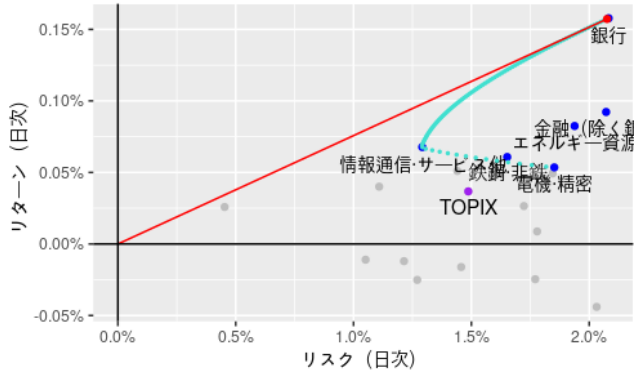


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.149%	1.148%	0.130	—
銀行	0.186%	1.499%	0.124	59.4%
情報通信・サービス他	0.096%	0.991%	0.096	38.9%
鉄鋼・非鉄	0.089%	1.231%	0.073	1.7%
電機・精密	0.059%	1.386%	0.043	0.0%
機械	0.057%	1.389%	0.041	0.0%
小売	0.057%	0.881%	0.064	0.0%

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。

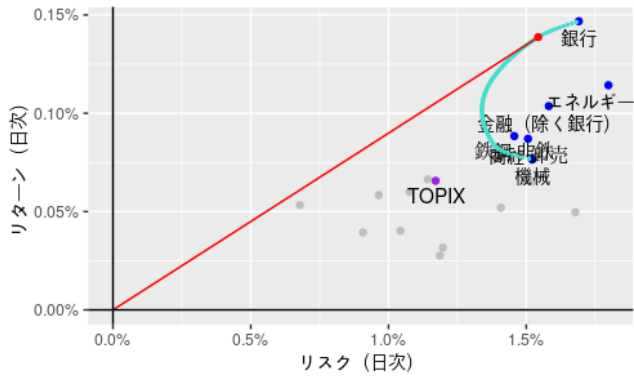
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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%	2.076%	0.076	—
銀行	0.158%	2.083%	0.076	99.4%
金融（除く銀行）	0.092%	2.072%	0.045	0.0%
エネルギー資源	0.082%	1.938%	0.043	0.0%
情報通信・サービス他	0.068%	1.292%	0.052	0.6%
鉄鋼・非鉄	0.061%	1.652%	0.037	0.0%
電機・精密	0.054%	1.852%	0.029	0.0%

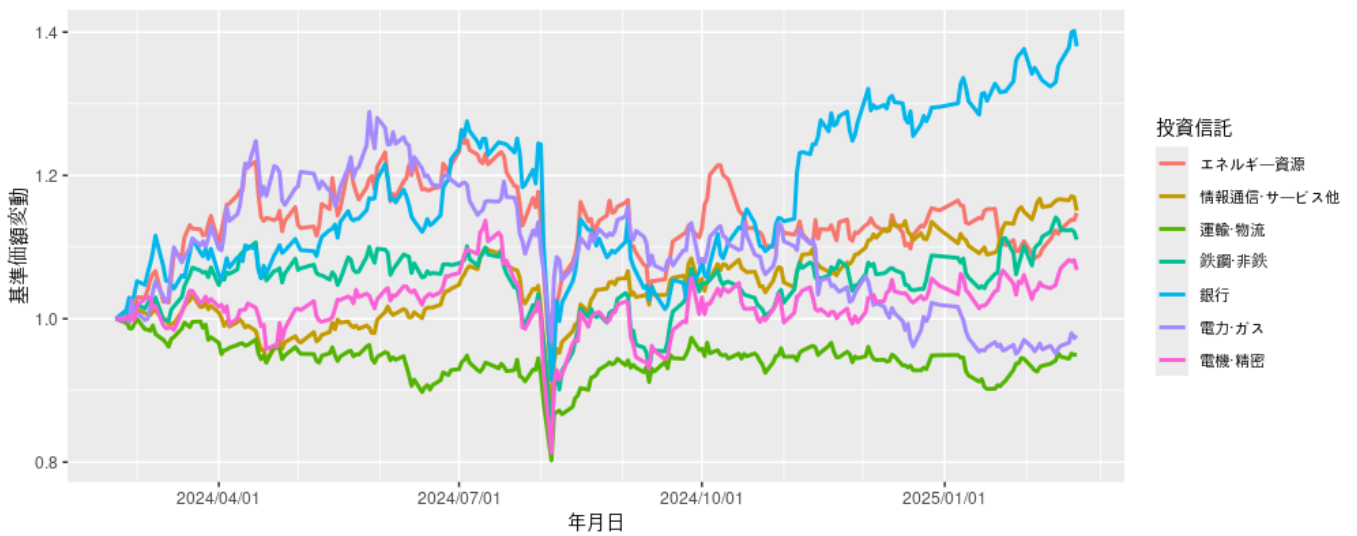
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.139%	1.543%	0.090	—
銀行	0.147%	1.691%	0.087	75.2%
エネルギー資源	0.114%	1.798%	0.064	24.8%
金融（除く銀行）	0.104%	1.582%	0.066	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.088%	1.457%	0.061	0.0%
商社・卸売	0.087%	1.506%	0.058	0.0%
機械	0.076%	1.522%	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。