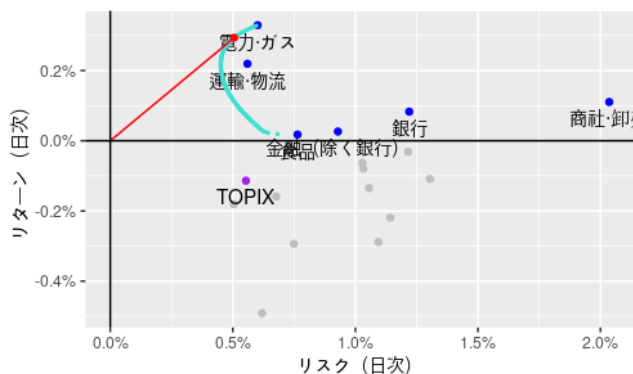


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

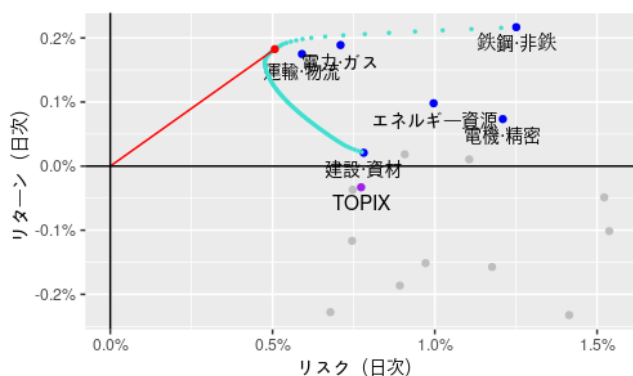
2025年2月28日

【半月】



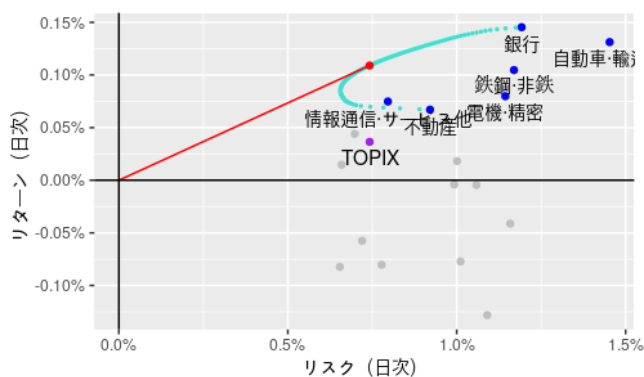
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.293%	0.505%	0.581	—
電力・ガス	0.329%	0.601%	0.548	67.4%
運輸・物流	0.219%	0.560%	0.392	32.6%
商社・卸売	0.111%	2.036%	0.054	0.0%
銀行	0.083%	1.220%	0.068	0.0%
金融 (除く銀行)	0.026%	0.929%	0.028	0.0%
食品	0.018%	0.764%	0.023	0.0%

【一ヶ月】



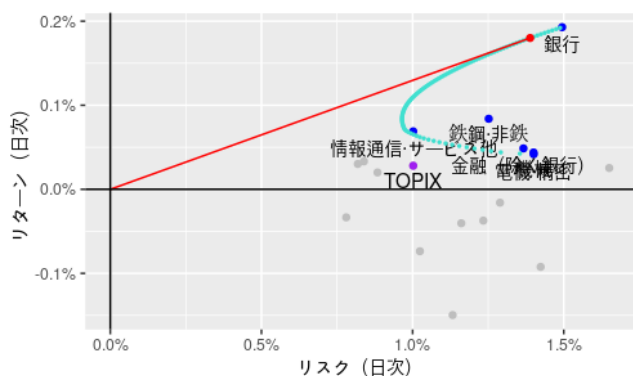
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.182%	0.507%	0.360	—
鉄鋼・非鉄	0.217%	1.251%	0.173	14.9%
電力・ガス	0.189%	0.710%	0.266	41.0%
運輸・物流	0.175%	0.591%	0.296	38.3%
エネルギー資源	0.098%	0.996%	0.098	5.7%
電機・精密	0.073%	1.209%	0.061	0.0%
建設・資材	0.021%	0.781%	0.027	0.0%

【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	0.109%	0.742%	0.147	—
銀行	0.145%	1.192%	0.122	40.2%
自動車・輸送機	0.131%	1.453%	0.090	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.105%	1.170%	0.089	26.7%
電機・精密	0.080%	1.144%	0.070	0.0%
情報通信・サービス他	0.075%	0.796%	0.094	5.1%
不動産	0.067%	0.921%	0.073	28.0%

【半年】

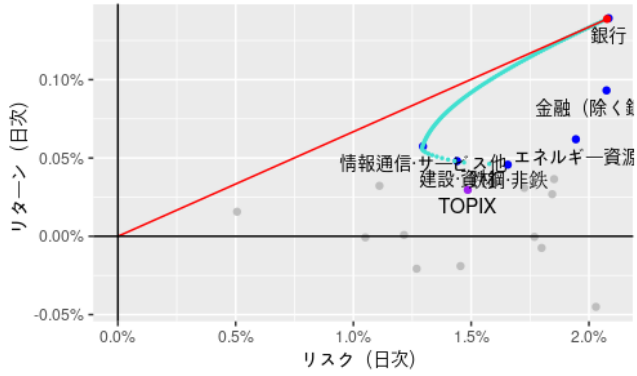


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.180%	1.389%	0.130	—
銀行	0.193%	1.495%	0.129	88.2%
鉄鋼・非鉄	0.084%	1.252%	0.067	11.8%
情報通信・サービス他	0.069%	1.002%	0.069	0.0%
金融 (除く銀行)	0.049%	1.367%	0.036	0.0%
機械	0.044%	1.400%	0.031	0.0%
電機・精密	0.042%	1.401%	0.030	0.0%

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。

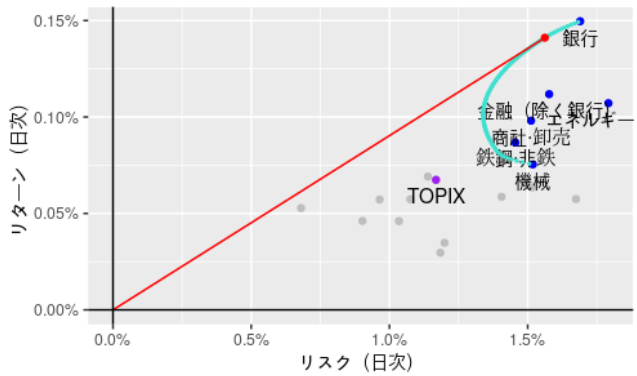
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.139%	2.077%	0.067	—
銀行	0.139%	2.084%	0.067	99.4%
金融(除く銀行)	0.093%	2.075%	0.045	0.0%
エネルギー資源	0.062%	1.945%	0.032	0.0%
情報通信・サービス他	0.057%	1.295%	0.044	0.6%
建設・資材	0.048%	1.440%	0.033	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.046%	1.655%	0.028	0.0%

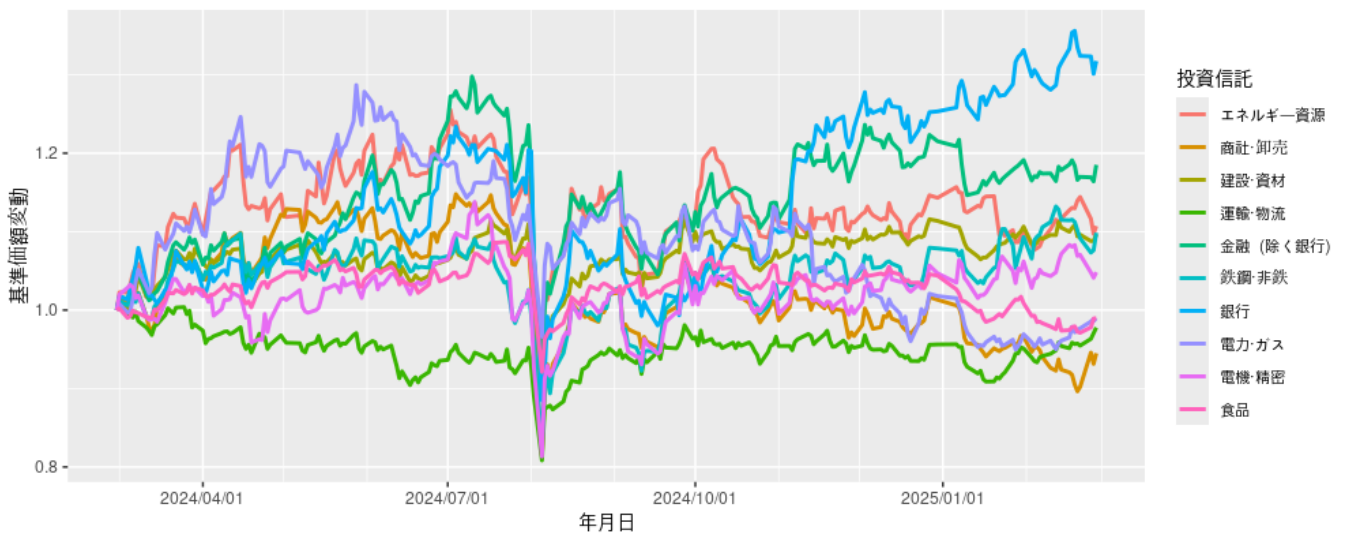
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.141%	1.562%	0.090	—
銀行	0.150%	1.690%	0.089	80.0%
金融(除く銀行)	0.112%	1.578%	0.071	0.0%
エネルギー資源	0.107%	1.792%	0.060	19.4%
商社・卸売	0.098%	1.512%	0.065	0.6%
鉄鋼・非鉄	0.087%	1.456%	0.060	0.0%
機械	0.075%	1.519%	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。