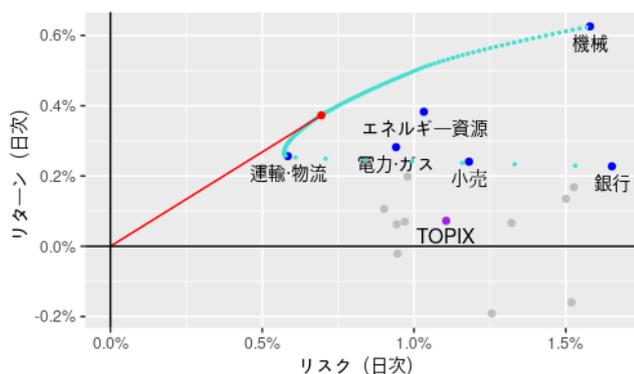


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

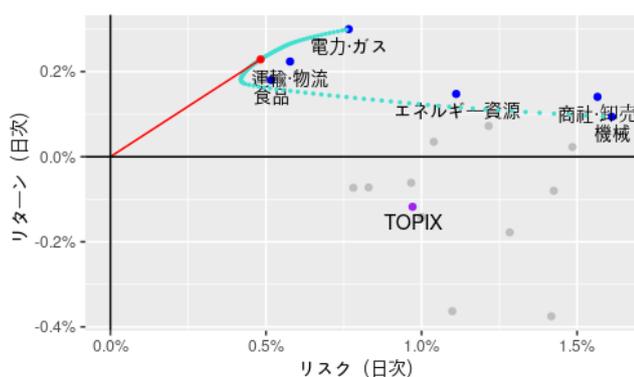
2025年3月15日

【半月】



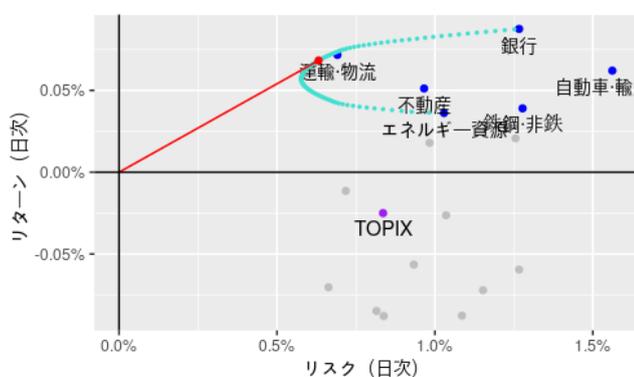
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.373%	0.695%	0.536	—
機械	0.626%	1.580%	0.396	23.7%
エネルギー資源	0.383%	1.032%	0.371	22.8%
電力・ガス	0.282%	0.941%	0.300	0.0%
運輸・物流	0.256%	0.584%	0.439	53.5%
小売	0.241%	1.181%	0.204	0.0%
銀行	0.227%	1.652%	0.138	0.0%

【一ヶ月】



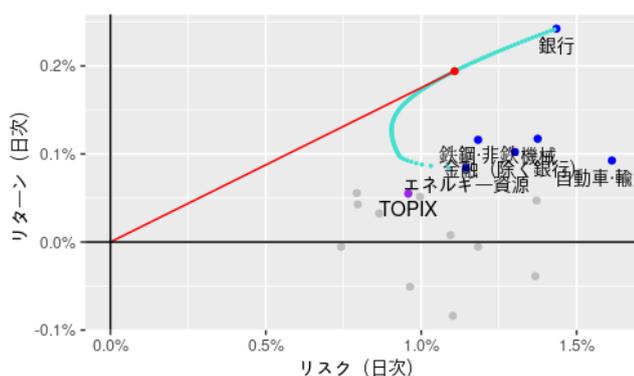
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.229%	0.483%	0.474	—
電力・ガス	0.300%	0.766%	0.391	28.2%
運輸・物流	0.224%	0.577%	0.387	39.9%
食品	0.180%	0.517%	0.349	23.9%
エネルギー資源	0.148%	1.111%	0.133	8.0%
商社・卸売	0.141%	1.566%	0.090	0.0%
機械	0.094%	1.612%	0.058	0.0%

【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	0.068%	0.632%	0.108	—
銀行	0.088%	1.267%	0.069	10.5%
運輸・物流	0.072%	0.691%	0.104	71.4%
自動車・輸送機	0.062%	1.562%	0.040	0.0%
不動産	0.051%	0.966%	0.053	8.9%
鉄鋼・非鉄	0.039%	1.278%	0.031	0.0%
エネルギー資源	0.036%	1.029%	0.035	9.1%

【半年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.194%	1.107%	0.175	—
銀行	0.242%	1.435%	0.169	66.5%
機械	0.117%	1.375%	0.085	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.116%	1.183%	0.098	14.9%
金融(除く銀行)	0.102%	1.301%	0.079	0.0%
自動車・輸送機	0.093%	1.614%	0.057	0.0%
エネルギー資源	0.084%	1.144%	0.073	18.6%

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。

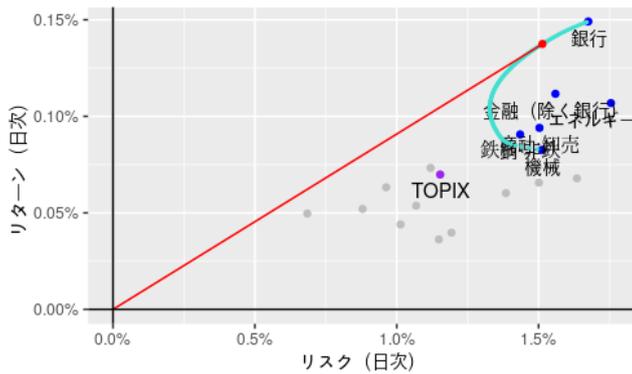
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】

計算できませんでした。

TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	%	%		—
	%	%		%
	%	%		%
	%	%		%
	%	%		%
	%	%		%

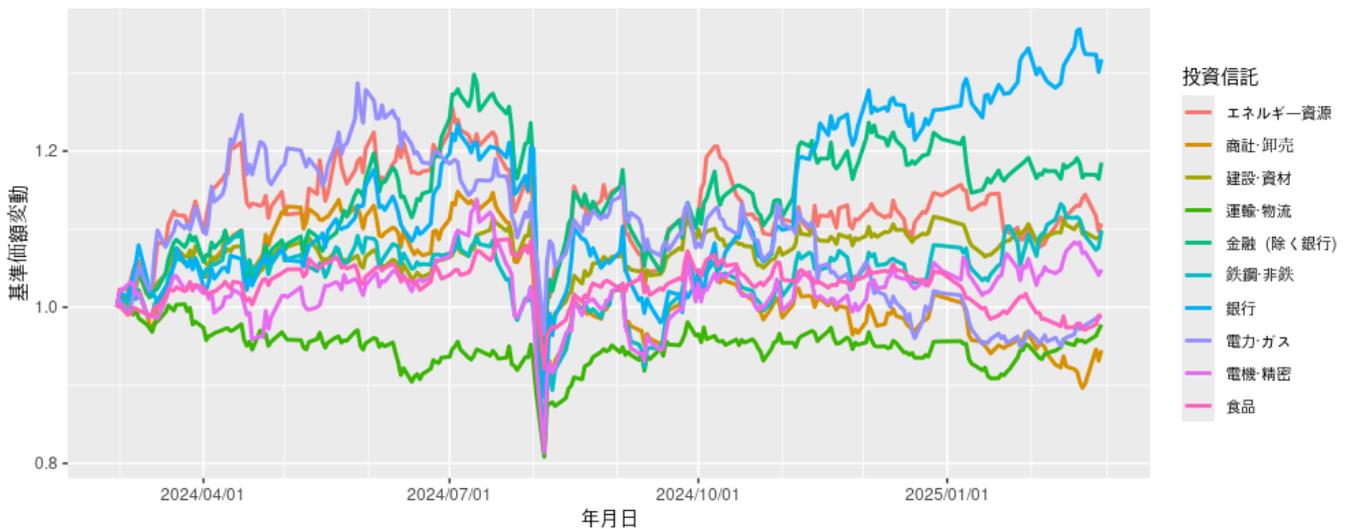
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.137%	1.514%	0.091	—
銀行	0.149%	1.675%	0.089	75.7%
金融（除く銀行）	0.112%	1.559%	0.072	0.0%
エネルギー資源	0.107%	1.755%	0.061	15.7%
商社・卸売	0.094%	1.503%	0.063	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.091%	1.435%	0.063	8.6%
機械	0.083%	1.512%	0.055	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。