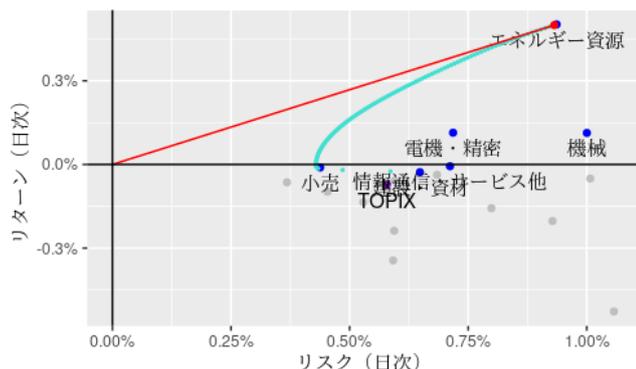


TOPIX17シリーズ(+米ドル)を使った効率的ポートフォリオ

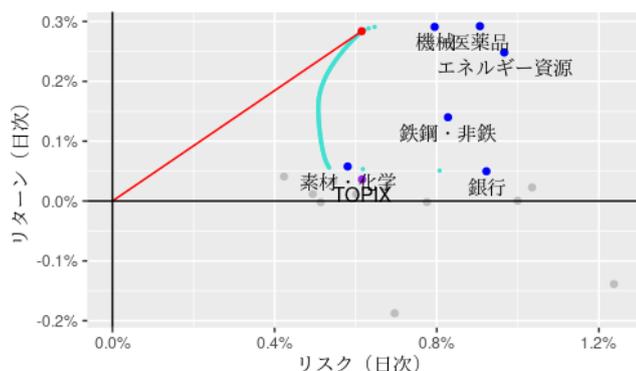
2025年6月14日

【半月】



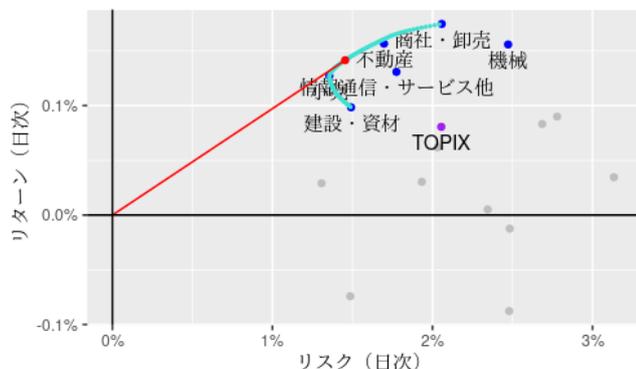
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.499%	0.932%	0.536	—
エネルギー資源	0.502%	0.936%	0.536	99.3%
電機・精密	0.114%	0.718%	0.158	0.7%
機械	0.113%	1.000%	0.113	0.0%
情報通信・サービス他	-0.006%	0.712%	-0.009	0.0%
小売	-0.011%	0.438%	-0.025	0.0%
建設・資材	-0.028%	0.648%	-0.043	0.0%

【一ヶ月】



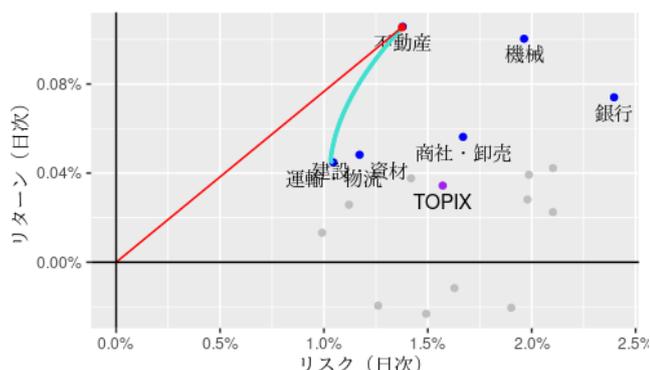
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.284%	0.615%	0.461	—
医薬品	0.292%	0.907%	0.322	39.6%
機械	0.291%	0.795%	0.366	42.2%
エネルギー資源	0.248%	0.967%	0.257	18.2%
鉄鋼・非鉄	0.140%	0.828%	0.169	0.0%
素材・化学	0.058%	0.580%	0.100	0.0%
銀行	0.050%	0.923%	0.054	0.0%

【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	0.141%	1.454%	0.097	—
商社・卸売	0.175%	2.058%	0.085	6.7%
不動産	0.157%	1.697%	0.092	37.6%
機械	0.156%	2.473%	0.063	0.0%
情報通信・サービス他	0.131%	1.775%	0.074	0.0%
小売	0.127%	1.355%	0.094	55.7%
建設・資材	0.098%	1.491%	0.066	0.0%

【半年】

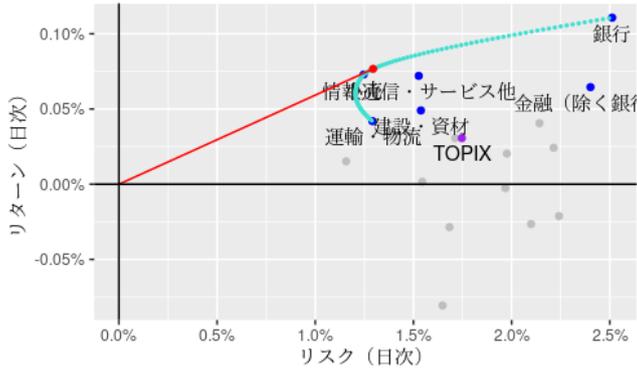


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.105%	1.376%	0.077	—
不動産	0.106%	1.379%	0.077	97.8%
機械	0.100%	1.963%	0.051	1.9%
銀行	0.074%	2.396%	0.031	0.0%
商社・卸売	0.056%	1.669%	0.034	0.0%
建設・資材	0.048%	1.172%	0.041	0.0%
運輸・物流	0.045%	1.046%	0.043	0.3%

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。

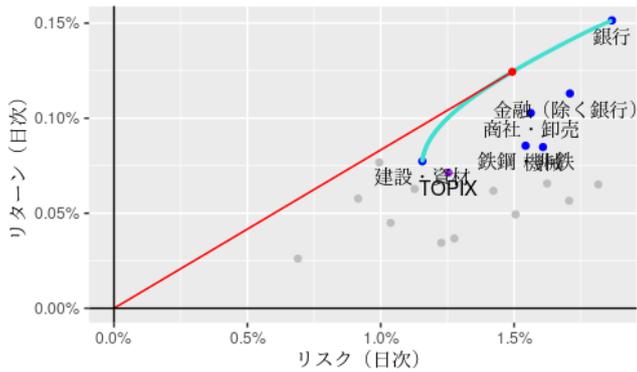
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.077%	1.295%	0.059	—
銀行	0.111%	2.512%	0.044	9.9%
小売	0.073%	1.247%	0.059	90.1%
情報通信・サービス他	0.072%	1.527%	0.047	0.0%
金融(除く銀行)	0.065%	2.402%	0.027	0.0%
建設・資材	0.049%	1.538%	0.032	0.0%
運輸・物流	0.042%	1.291%	0.033	0.0%

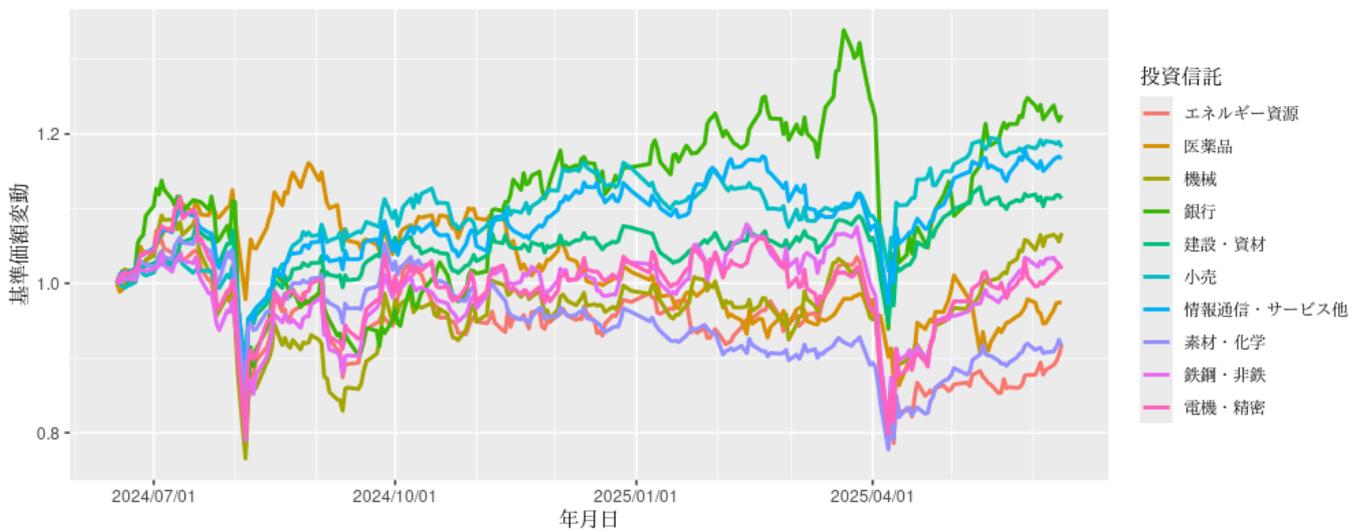
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.124%	1.493%	0.083	—
銀行	0.151%	1.867%	0.081	61.7%
金融(除く銀行)	0.113%	1.709%	0.066	0.0%
商社・卸売	0.103%	1.562%	0.066	5.2%
鉄鋼・非鉄	0.086%	1.543%	0.055	0.0%
機械	0.085%	1.608%	0.053	0.0%
建設・資材	0.077%	1.156%	0.067	33.1%

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。