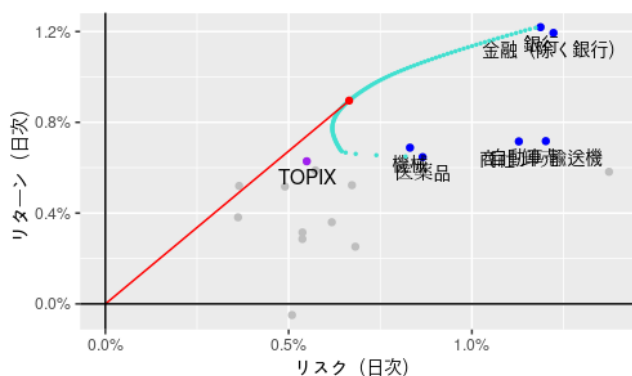


## TOPIX-17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

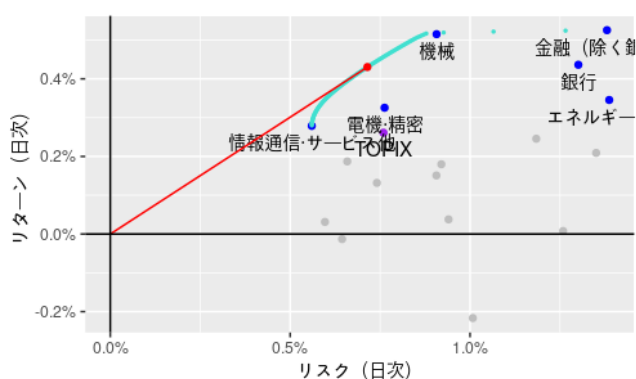
2024年7月6日

### 【半月】



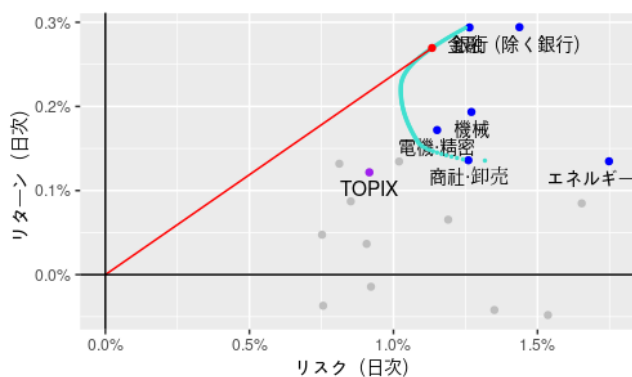
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.896%	0.665%	1.347	—
銀行	1.219%	1.187%	1.027	40.0%
金融 (除く銀行)	1.194%	1.223%	0.977	0.0%
自動車・輸送機	0.717%	1.202%	0.597	0.0%
商社・卸売	0.716%	1.128%	0.635	0.0%
機械	0.688%	0.831%	0.828	48.7%
医薬品	0.647%	0.866%	0.747	11.4%

### 【一ヶ月】



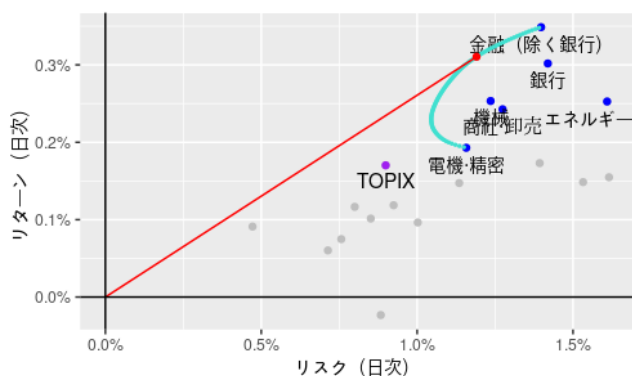
TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.430%	0.715%	0.602	—
金融 (除く銀行)	0.525%	1.381%	0.381	0.0%
機械	0.515%	0.907%	0.568	57.8%
銀行	0.436%	1.301%	0.335	9.6%
エネルギー資源	0.346%	1.387%	0.249	0.0%
電機・精密	0.326%	0.762%	0.427	0.0%
情報通信・サービス他	0.279%	0.560%	0.498	32.6%

### 【四半期】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.269%	1.134%	0.238	—
金融 (除く銀行)	0.294%	1.437%	0.205	5.7%
銀行	0.294%	1.264%	0.233	74.3%
機械	0.193%	1.271%	0.152	0.0%
電機・精密	0.172%	1.152%	0.149	20.0%
商社・卸売	0.136%	1.260%	0.108	0.0%
エネルギー資源	0.135%	1.748%	0.077	0.0%

### 【半年】

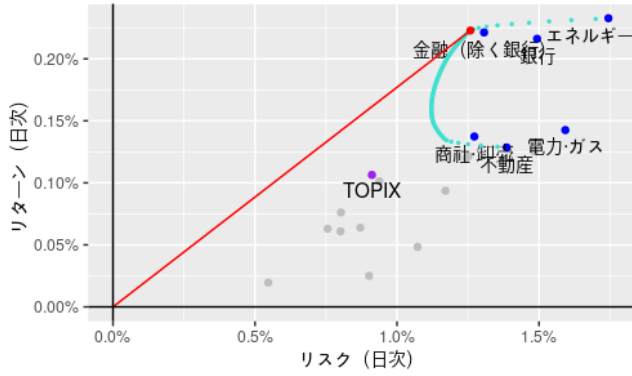


TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.311%	1.191%	0.261	—
金融 (除く銀行)	0.349%	1.398%	0.249	48.8%
銀行	0.302%	1.419%	0.213	22.0%
機械	0.253%	1.236%	0.205	28.5%
エネルギー資源	0.253%	1.609%	0.157	0.7%
商社・卸売	0.243%	1.274%	0.190	0.0%
電機・精密	0.193%	1.158%	0.167	0.0%

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。

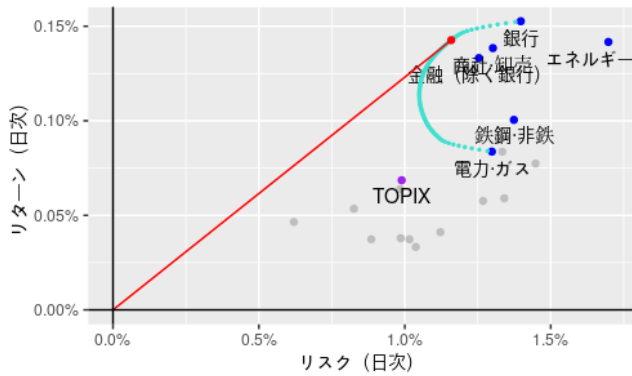
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.223%	1.258%	0.177	—
エネルギー資源	0.233%	1.744%	0.133	20.9%
金融（除く銀行）	0.221%	1.307%	0.169	62.8%
銀行	0.216%	1.493%	0.145	16.3%
電力・ガス	0.143%	1.593%	0.089	0.0%
商社・卸売	0.137%	1.272%	0.108	0.0%
不動産	0.129%	1.386%	0.093	0.0%

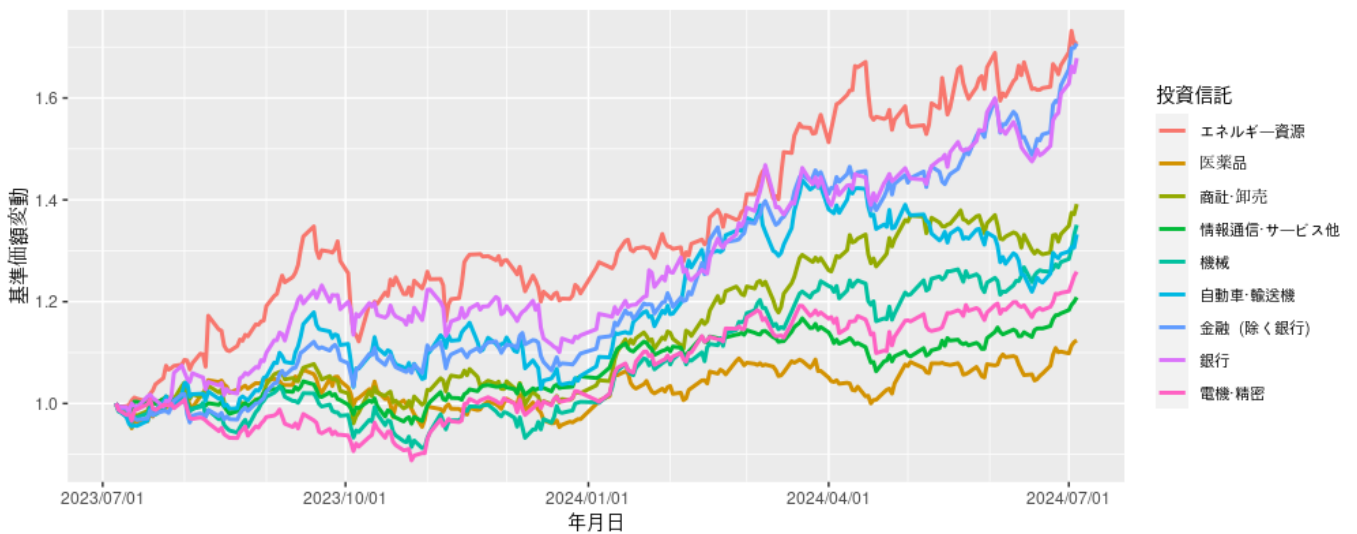
【三年】



TOPIX-17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.143%	1.159%	0.123	—
銀行	0.153%	1.398%	0.109	41.3%
エネルギー資源	0.142%	1.698%	0.083	8.3%
商社・卸売	0.138%	1.302%	0.106	37.0%
金融（除く銀行）	0.133%	1.254%	0.106	11.0%
鉄鋼・非鉄	0.100%	1.374%	0.073	0.0%
電力・ガス	0.084%	1.298%	0.064	2.5%

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。

TOPIX-17 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 とした直近一年間の価額変動を示します。