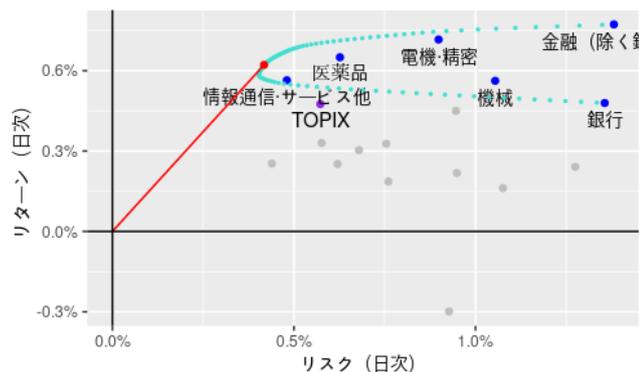


TOPIX17 シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

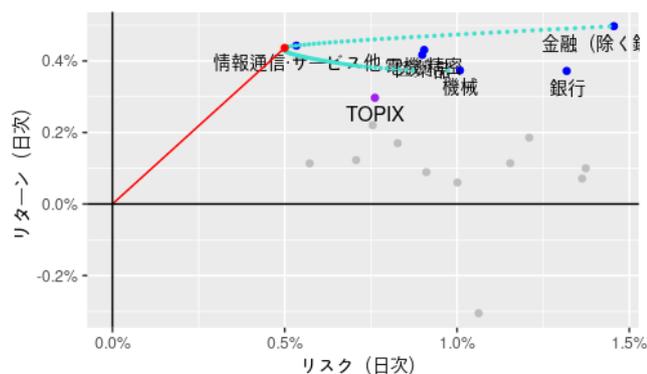
2024年7月13日

【半月】



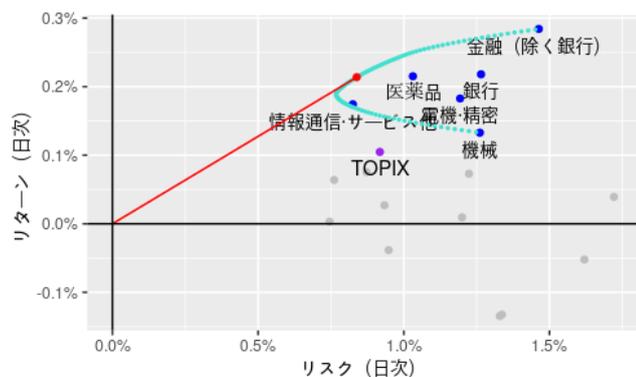
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.622%	0.418%	1.489	—
金融 (除く銀行)	0.773%	1.381%	0.560	10.6%
電機・精密	0.716%	0.898%	0.797	0.0%
医薬品	0.650%	0.627%	1.037	41.3%
情報通信・サービス他	0.564%	0.480%	1.175	37.7%
機械	0.562%	1.054%	0.533	10.3%
銀行	0.479%	1.356%	0.354	0.0%

【一ヶ月】



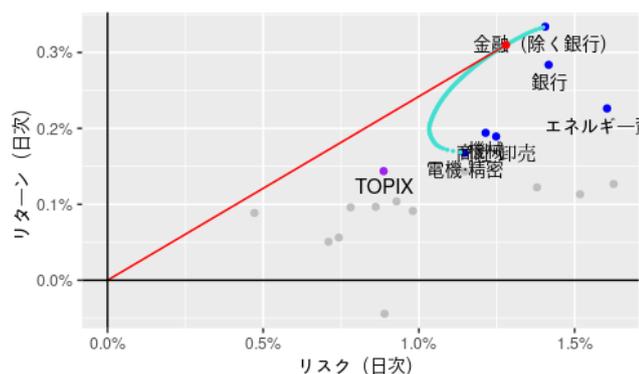
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.437%	0.500%	0.873	—
金融 (除く銀行)	0.497%	1.455%	0.342	0.0%
情報通信・サービス他	0.443%	0.534%	0.829	79.7%
電機・精密	0.431%	0.905%	0.476	0.0%
医薬品	0.417%	0.899%	0.464	18.3%
機械	0.374%	1.009%	0.370	2.0%
銀行	0.372%	1.318%	0.282	0.0%

【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	0.214%	0.838%	0.255	—
金融 (除く銀行)	0.284%	1.463%	0.194	19.2%
銀行	0.218%	1.265%	0.172	1.4%
医薬品	0.215%	1.031%	0.209	43.5%
電機・精密	0.183%	1.193%	0.153	0.0%
情報通信・サービス他	0.174%	0.825%	0.211	35.9%
機械	0.133%	1.261%	0.105	0.0%

【半年】

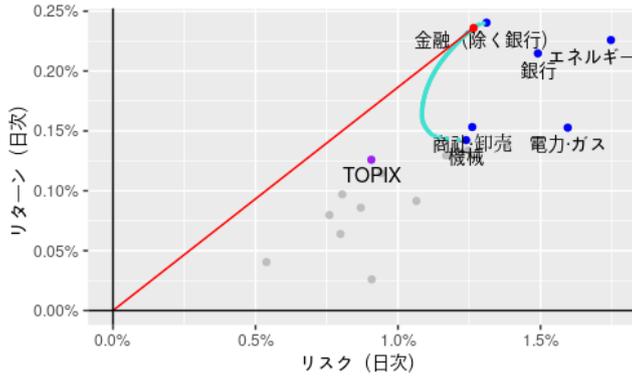


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.310%	1.280%	0.242	—
金融 (除く銀行)	0.334%	1.406%	0.238	68.2%
銀行	0.284%	1.417%	0.200	22.8%
エネルギー資源	0.226%	1.604%	0.141	0.0%
機械	0.194%	1.214%	0.160	9.1%
商社・卸売	0.189%	1.248%	0.152	0.0%
電機・精密	0.168%	1.147%	0.146	0.0%

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。

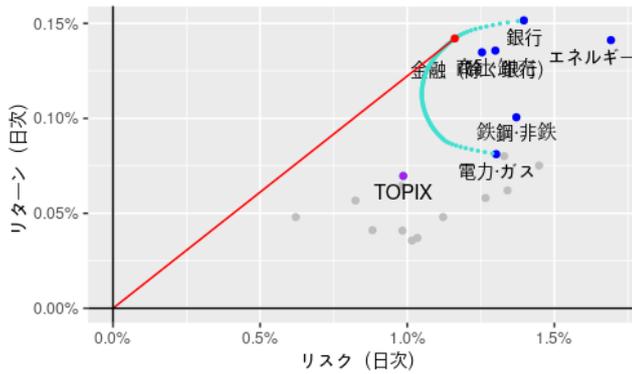
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.236%	1.265%	0.187	—
金融 (除く銀行)	0.240%	1.311%	0.183	77.3%
エネルギー資源	0.226%	1.747%	0.129	14.0%
銀行	0.215%	1.491%	0.144	8.5%
商社・卸売	0.153%	1.261%	0.122	0.0%
電力・ガス	0.153%	1.596%	0.096	0.0%
機械	0.142%	1.239%	0.115	0.2%

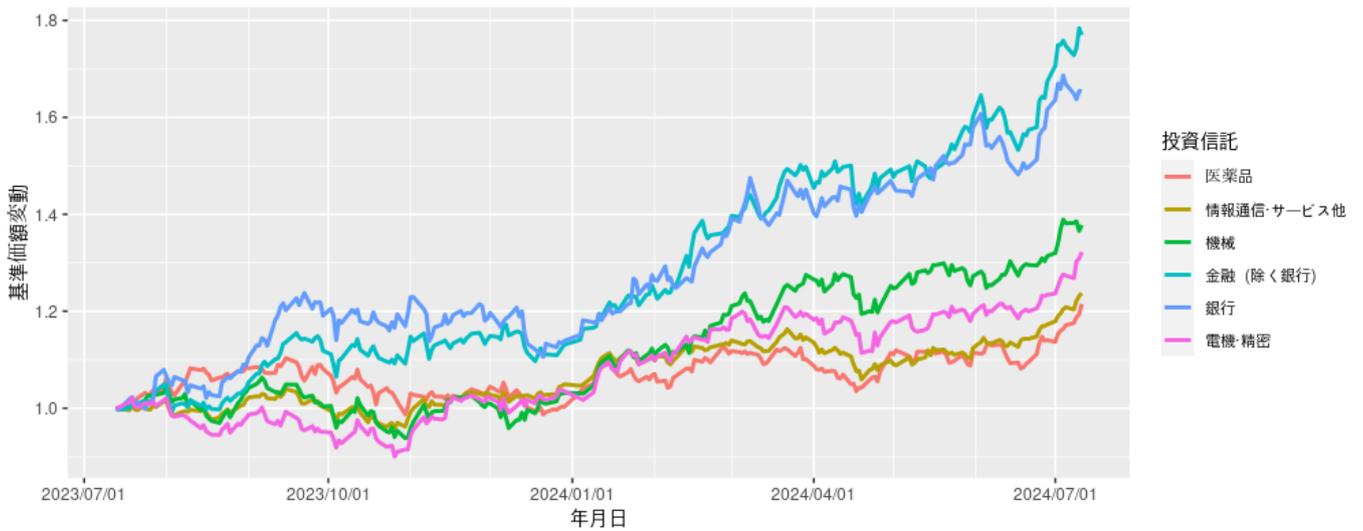
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.142%	1.161%	0.122	—
銀行	0.152%	1.396%	0.109	38.9%
エネルギー資源	0.141%	1.692%	0.083	9.8%
商社・卸売	0.136%	1.299%	0.104	33.0%
金融 (除く銀行)	0.135%	1.254%	0.107	18.1%
鉄鋼・非鉄	0.101%	1.371%	0.073	0.0%
電力・ガス	0.081%	1.302%	0.062	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。

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。