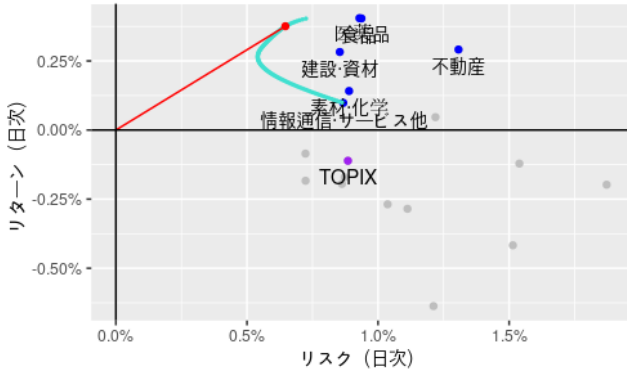


TOPIX17 シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

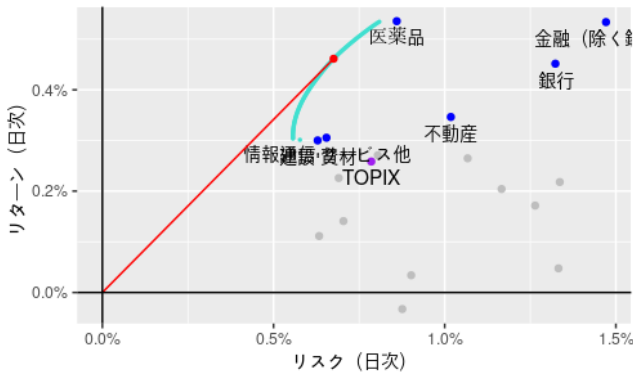
2024年7月20日

【半月】



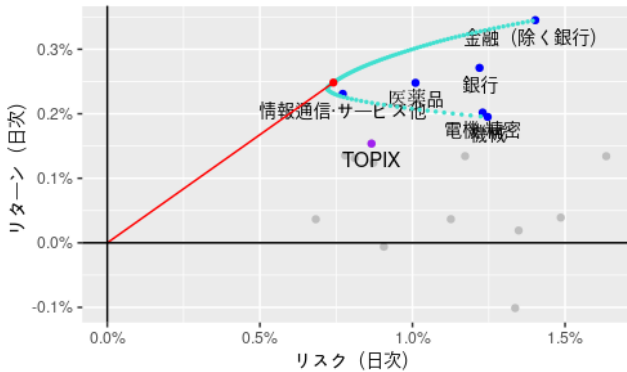
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.376%	0.647%	0.581	—
食品	0.405%	0.929%	0.436	46.9%
医薬品	0.404%	0.937%	0.431	28.7%
不動産	0.291%	1.307%	0.223	11.1%
建設・資材	0.282%	0.854%	0.331	13.3%
素材・化学	0.141%	0.889%	0.159	0.0%
情報通信・サービス他	0.098%	0.867%	0.113	0.0%

【一ヶ月】



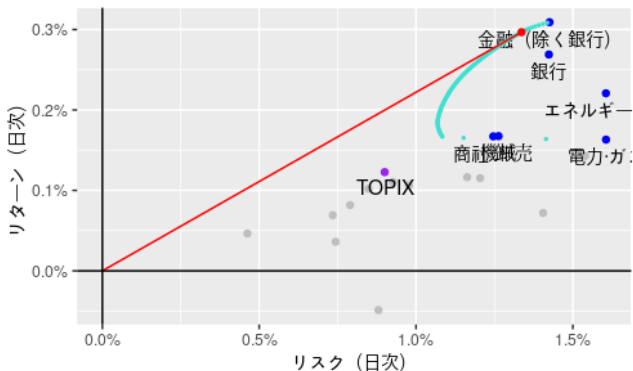
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.461%	0.676%	0.683	—
医薬品	0.535%	0.860%	0.623	55.1%
金融 (除く銀行)	0.534%	1.471%	0.363	9.8%
銀行	0.452%	1.323%	0.341	4.8%
不動産	0.346%	1.018%	0.340	3.2%
情報通信・サービス他	0.305%	0.655%	0.466	0.0%
建設・資材	0.300%	0.629%	0.477	27.2%

【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	0.248%	0.741%	0.335	—
金融 (除く銀行)	0.345%	1.402%	0.246	7.2%
銀行	0.271%	1.220%	0.222	11.9%
医薬品	0.248%	1.010%	0.245	26.5%
情報通信・サービス他	0.231%	0.772%	0.299	54.4%
電機・精密	0.202%	1.230%	0.164	0.0%
機械	0.195%	1.246%	0.157	0.0%

【半年】

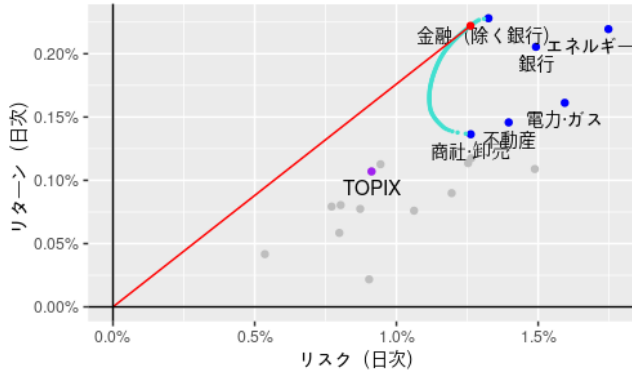


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.297%	1.336%	0.222	—
金融 (除く銀行)	0.309%	1.426%	0.217	70.5%
銀行	0.269%	1.424%	0.189	28.3%
エネルギー資源	0.221%	1.606%	0.137	1.2%
機械	0.167%	1.263%	0.133	0.0%
商社・卸売	0.167%	1.246%	0.134	0.0%
電力・ガス	0.163%	1.606%	0.102	0.0%

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。

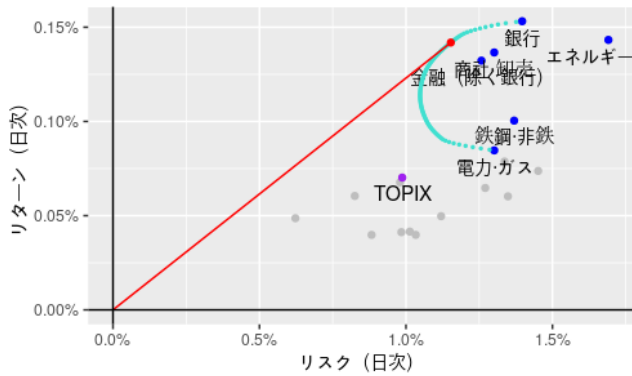
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.222%	1.261%	0.176	—
金融（除く銀行）	0.228%	1.325%	0.172	72.7%
エネルギー資源	0.219%	1.748%	0.126	15.1%
銀行	0.205%	1.492%	0.138	8.6%
電力・ガス	0.161%	1.594%	0.101	1.2%
不動産	0.146%	1.396%	0.104	2.3%
商社・卸売	0.136%	1.262%	0.108	0.0%

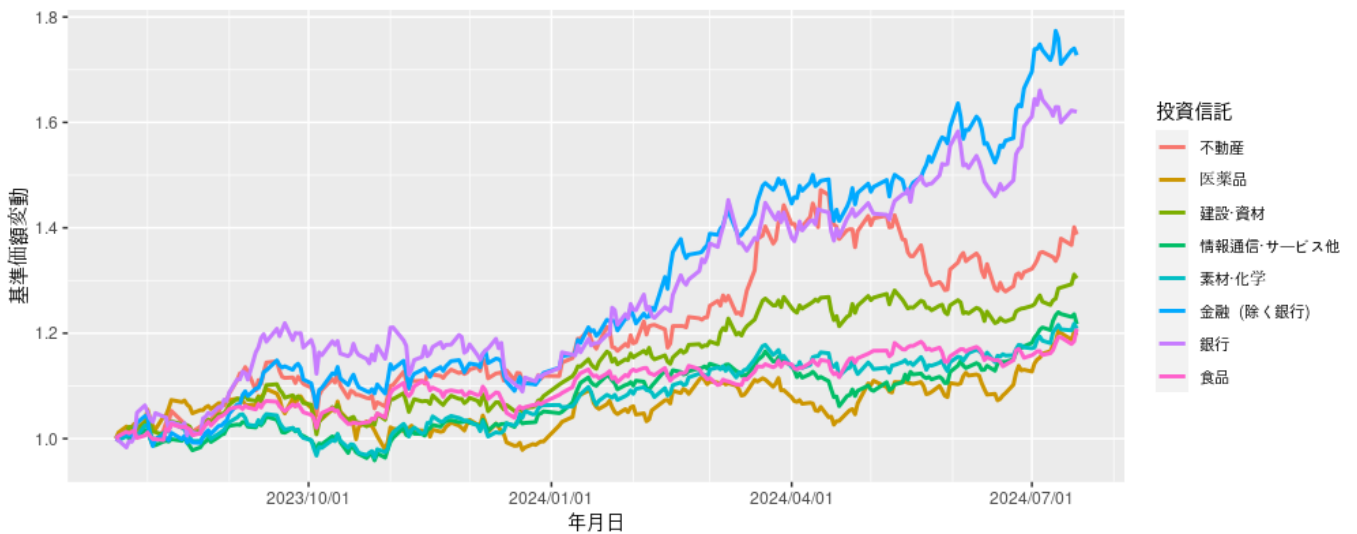
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.142%	1.153%	0.123	—
銀行	0.153%	1.397%	0.110	42.3%
エネルギー資源	0.143%	1.691%	0.085	10.0%
商社・卸売	0.137%	1.301%	0.105	34.2%
金融（除く銀行）	0.132%	1.258%	0.105	9.6%
鉄鋼・非鉄	0.100%	1.369%	0.073	0.0%
電力・ガス	0.085%	1.301%	0.065	3.9%

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。