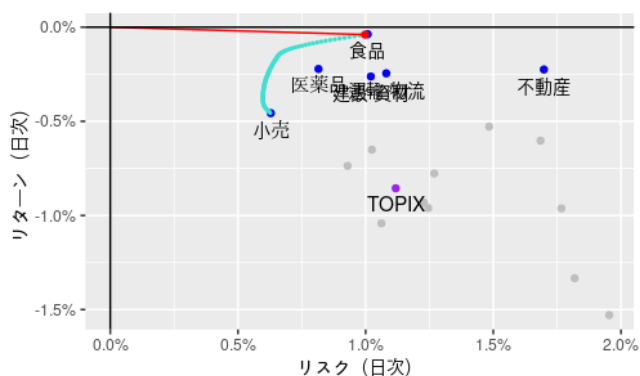


TOPIX17 シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

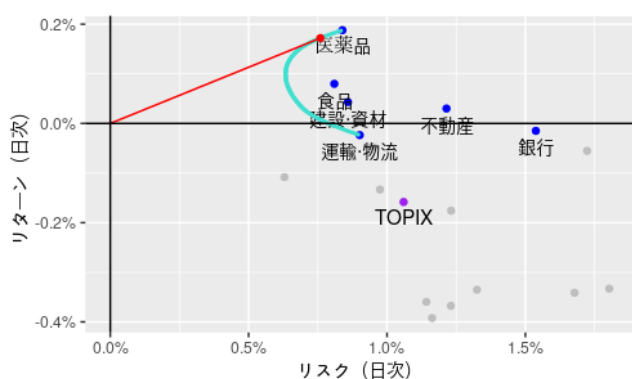
2024年7月27日

【半月】



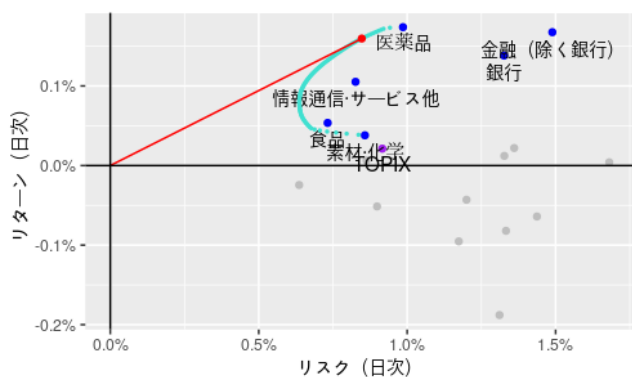
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	-0.039%	0.998%	-0.040	—
食品	-0.037%	1.008%	-0.037	98.9%
医薬品	-0.222%	0.815%	-0.272	1.1%
不動産	-0.225%	1.698%	-0.132	0.0%
運輸・物流	-0.245%	1.081%	-0.227	0.0%
建設・資材	-0.262%	1.020%	-0.257	0.0%
小売	-0.457%	0.629%	-0.726	0.0%

【一ヶ月】



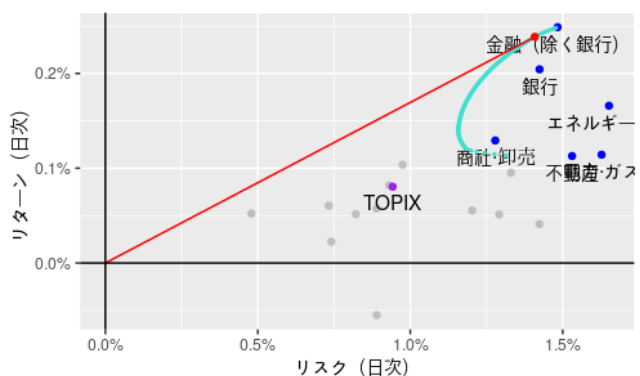
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.172%	0.759%	0.227	—
医薬品	0.188%	0.839%	0.224	85.3%
食品	0.080%	0.810%	0.099	14.7%
建設・資材	0.043%	0.859%	0.050	0.0%
不動産	0.030%	1.215%	0.025	0.0%
銀行	-0.015%	1.538%	-0.010	0.0%
運輸・物流	-0.024%	0.901%	-0.026	0.0%

【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	0.160%	0.847%	0.188	—
医薬品	0.174%	0.986%	0.176	67.0%
金融 (除く銀行)	0.168%	1.489%	0.113	13.4%
銀行	0.138%	1.326%	0.104	0.0%
情報通信・サービス他	0.105%	0.826%	0.127	19.6%
食品	0.054%	0.732%	0.073	0.0%
素材・化学	0.038%	0.858%	0.044	0.0%

【半年】

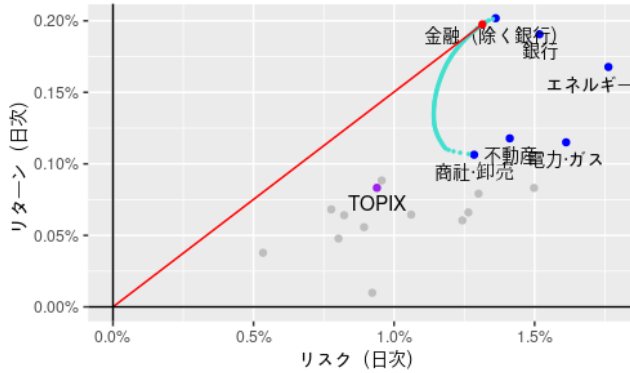


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.239%	1.408%	0.169	—
金融 (除く銀行)	0.249%	1.483%	0.168	77.1%
銀行	0.204%	1.424%	0.144	22.9%
エネルギー資源	0.166%	1.652%	0.100	0.0%
商社・卸売	0.129%	1.279%	0.101	0.0%
電力・ガス	0.114%	1.627%	0.070	0.0%
不動産	0.113%	1.531%	0.074	0.0%

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。

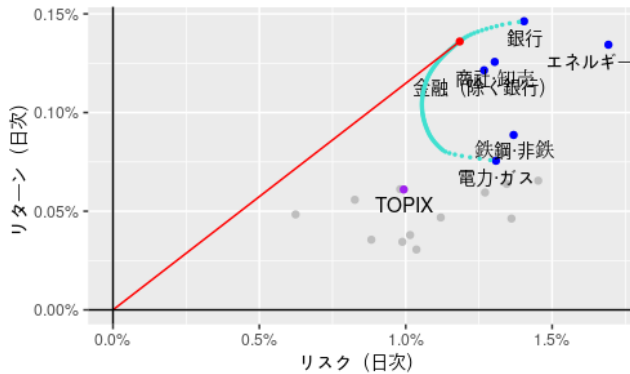
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.198%	1.314%	0.150	—
金融 (除く銀行)	0.202%	1.362%	0.148	75.6%
銀行	0.191%	1.517%	0.126	19.3%
エネルギー資源	0.168%	1.763%	0.095	4.2%
不動産	0.118%	1.412%	0.083	0.8%
電力・ガス	0.115%	1.612%	0.071	0.0%
商社・卸売	0.106%	1.285%	0.083	0.0%

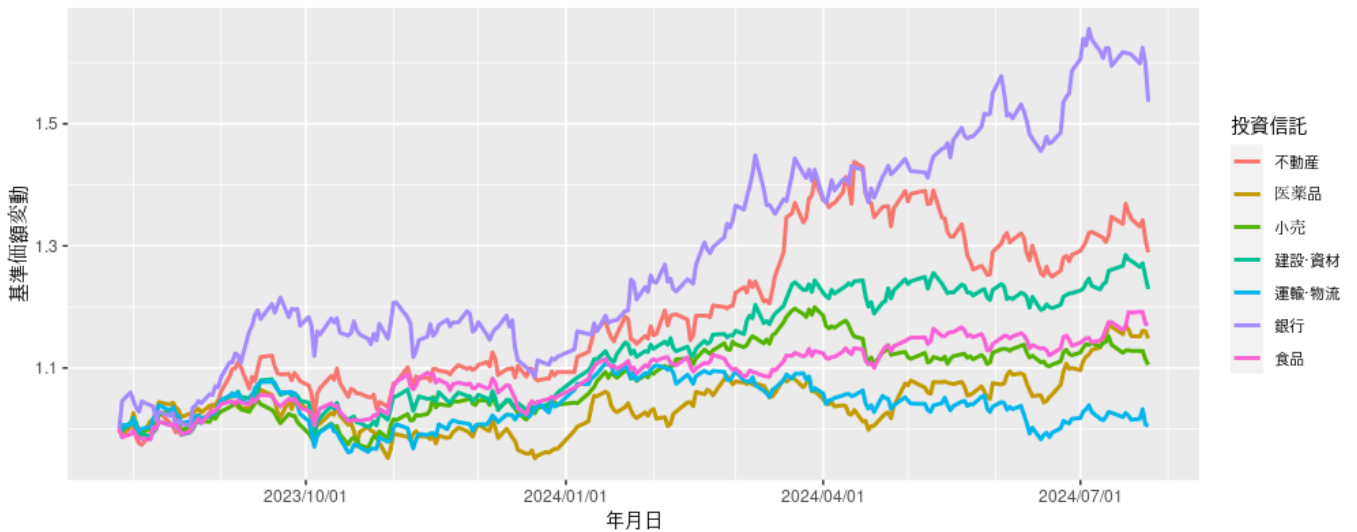
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.136%	1.184%	0.115	—
銀行	0.146%	1.404%	0.104	49.7%
エネルギー資源	0.134%	1.692%	0.079	11.4%
商社・卸売	0.126%	1.304%	0.096	34.6%
金融 (除く銀行)	0.121%	1.268%	0.096	2.9%
鉄鋼・非鉄	0.089%	1.368%	0.065	0.0%
電力・ガス	0.076%	1.308%	0.058	1.5%

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。

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。