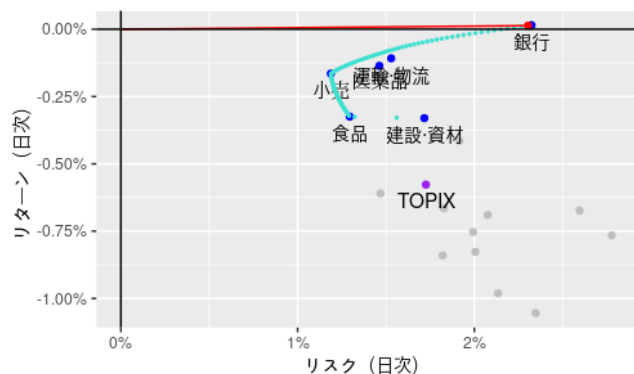


# TOPIX17 シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

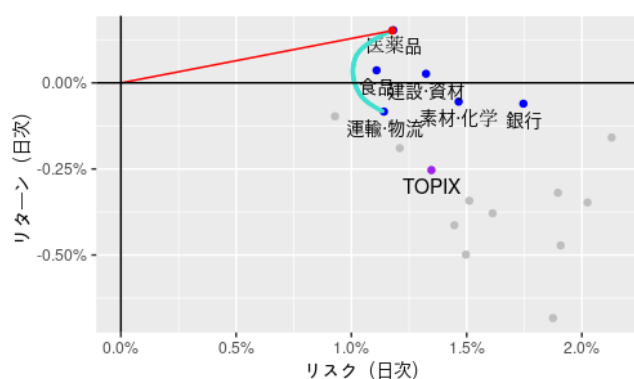
2024年8月3日

## 【半月】



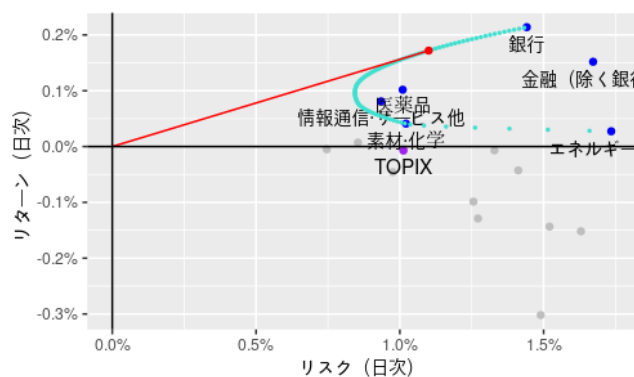
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.013%	2.304%	0.006	—
銀行	0.015%	2.324%	0.006	98.6%
運輸・物流	-0.108%	1.530%	-0.071	1.4%
医薬品	-0.136%	1.463%	-0.093	0.0%
小売	-0.165%	1.188%	-0.139	0.0%
食品	-0.325%	1.295%	-0.251	0.0%
建設・資材	-0.330%	1.717%	-0.192	0.0%

## 【一ヶ月】



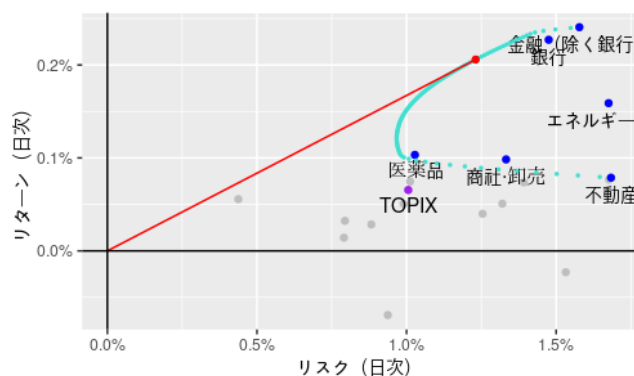
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.152%	1.177%	0.129	—
医薬品	0.153%	1.182%	0.130	99.0%
食品	0.036%	1.109%	0.033	1.0%
建設・資材	0.026%	1.324%	0.020	0.0%
素材・化学	-0.054%	1.465%	-0.037	0.0%
銀行	-0.060%	1.746%	-0.035	0.0%
運輸・物流	-0.083%	1.141%	-0.073	0.0%

## 【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	0.172%	1.100%	0.156	—
銀行	0.214%	1.441%	0.148	62.7%
金融(除く銀行)	0.152%	1.672%	0.091	0.0%
医薬品	0.102%	1.010%	0.101	36.4%
情報通信・サービス他	0.081%	0.935%	0.087	0.9%
素材・化学	0.041%	1.022%	0.040	0.0%
エネルギー資源	0.027%	1.735%	0.016	0.0%

## 【半年】

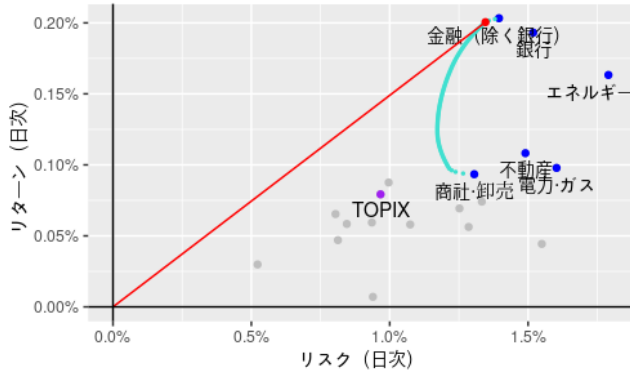


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.206%	1.231%	0.167	—
金融(除く銀行)	0.241%	1.578%	0.153	35.9%
銀行	0.227%	1.475%	0.154	43.0%
エネルギー資源	0.159%	1.675%	0.095	0.0%
医薬品	0.103%	1.028%	0.100	21.1%
商社・卸売	0.098%	1.333%	0.074	0.0%
不動産	0.079%	1.683%	0.047	0.0%

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。

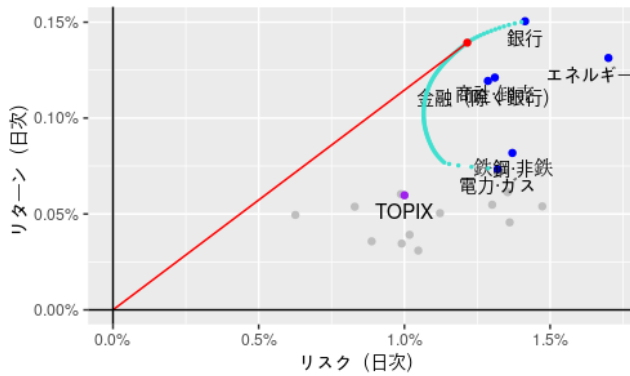
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.201%	1.346%	0.149	—
金融 (除く銀行)	0.203%	1.395%	0.146	72.8%
銀行	0.193%	1.519%	0.127	27.2%
エネルギー資源	0.163%	1.790%	0.091	0.0%
不動産	0.108%	1.490%	0.073	0.0%
電力・ガス	0.098%	1.603%	0.061	0.0%
商社・卸売	0.093%	1.305%	0.072	0.0%

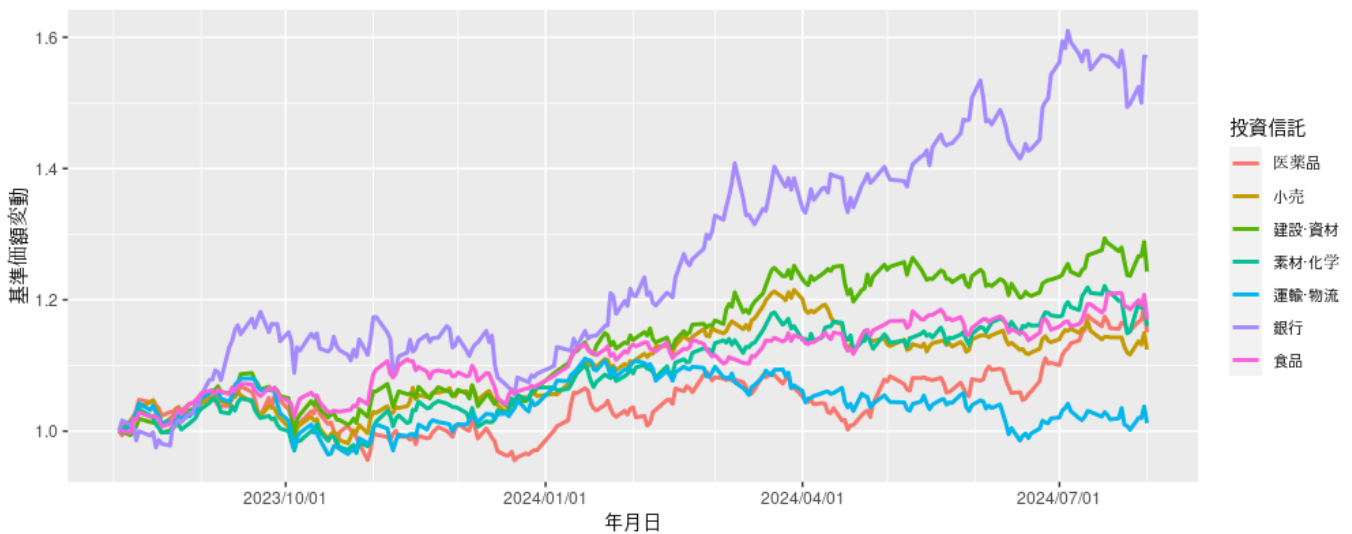
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.139%	1.216%	0.115	—
銀行	0.151%	1.414%	0.106	58.1%
エネルギー資源	0.131%	1.700%	0.077	11.1%
商社・卸売	0.121%	1.310%	0.092	30.8%
金融 (除く銀行)	0.119%	1.286%	0.093	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.082%	1.370%	0.060	0.0%
電力・ガス	0.073%	1.320%	0.056	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。

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。