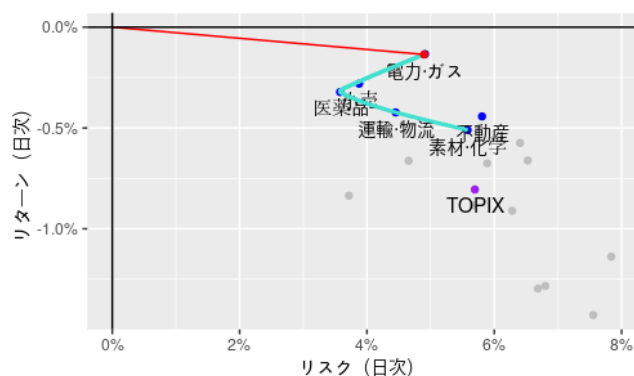


# TOPIX17 シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

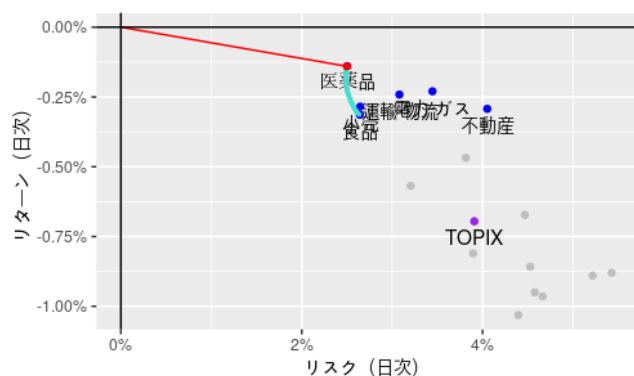
2024年8月10日

## 【半月】



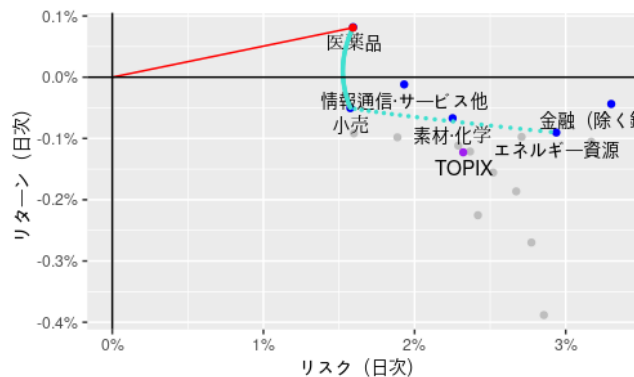
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	-0.136%	4.897%	-0.028	—
電力・ガス	-0.134%	4.912%	-0.027	99.0%
小売	-0.280%	3.877%	-0.072	0.0%
医薬品	-0.322%	3.578%	-0.090	1.0%
運輸・物流	-0.423%	4.451%	-0.095	0.0%
不動産	-0.443%	5.808%	-0.076	0.0%
素材・化学	-0.510%	5.581%	-0.091	0.0%

## 【一ヶ月】



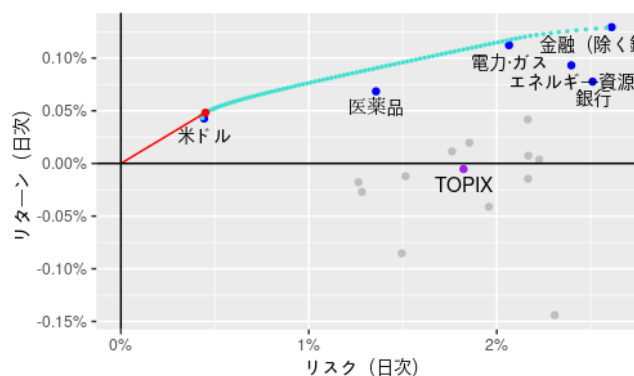
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	-0.140%	2.501%	-0.056	—
医薬品	-0.139%	2.502%	-0.056	99.4%
電力・ガス	-0.230%	3.445%	-0.067	0.0%
運輸・物流	-0.241%	3.080%	-0.078	0.0%
小売	-0.285%	2.646%	-0.108	0.6%
不動産	-0.293%	4.051%	-0.072	0.0%
食品	-0.314%	2.643%	-0.119	0.0%

## 【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	0.081%	1.592%	0.051	—
医薬品	0.082%	1.593%	0.051	99.3%
情報通信・サービス他	-0.012%	1.931%	-0.006	0.0%
金融(除く銀行)	-0.044%	3.301%	-0.013	0.0%
小売	-0.050%	1.575%	-0.032	0.7%
素材・化学	-0.067%	2.252%	-0.030	0.0%
エネルギー資源	-0.090%	2.937%	-0.031	0.0%

## 【半年】

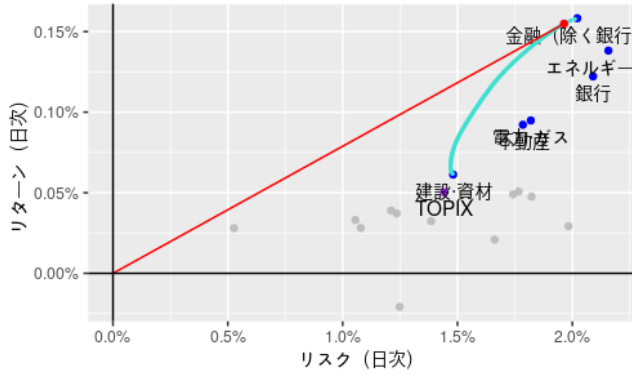


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.048%	0.450%	0.107	—
金融(除く銀行)	0.129%	2.611%	0.050	0.0%
電力・ガス	0.112%	2.065%	0.054	5.6%
エネルギー資源	0.093%	2.397%	0.039	0.0%
銀行	0.078%	2.510%	0.031	3.7%
医薬品	0.068%	1.357%	0.050	1.8%
米ドル	0.043%	0.443%	0.096	89.0%

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。

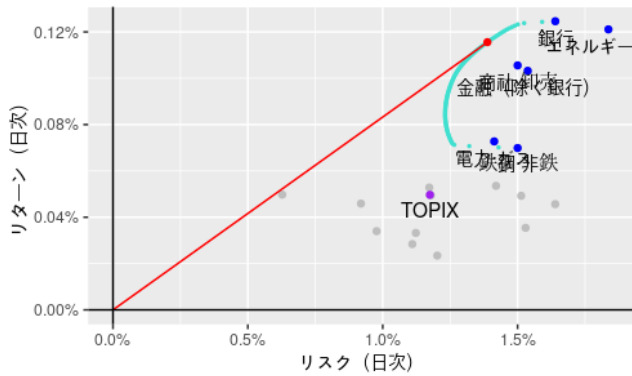
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.155%	1.964%	0.079	—
金融 (除く銀行)	0.158%	2.021%	0.078	83.1%
エネルギー資源	0.138%	2.157%	0.064	16.9%
銀行	0.122%	2.090%	0.058	0.0%
電力・ガス	0.095%	1.819%	0.052	0.0%
不動産	0.092%	1.785%	0.052	0.0%
建設・資材	0.061%	1.481%	0.041	0.0%

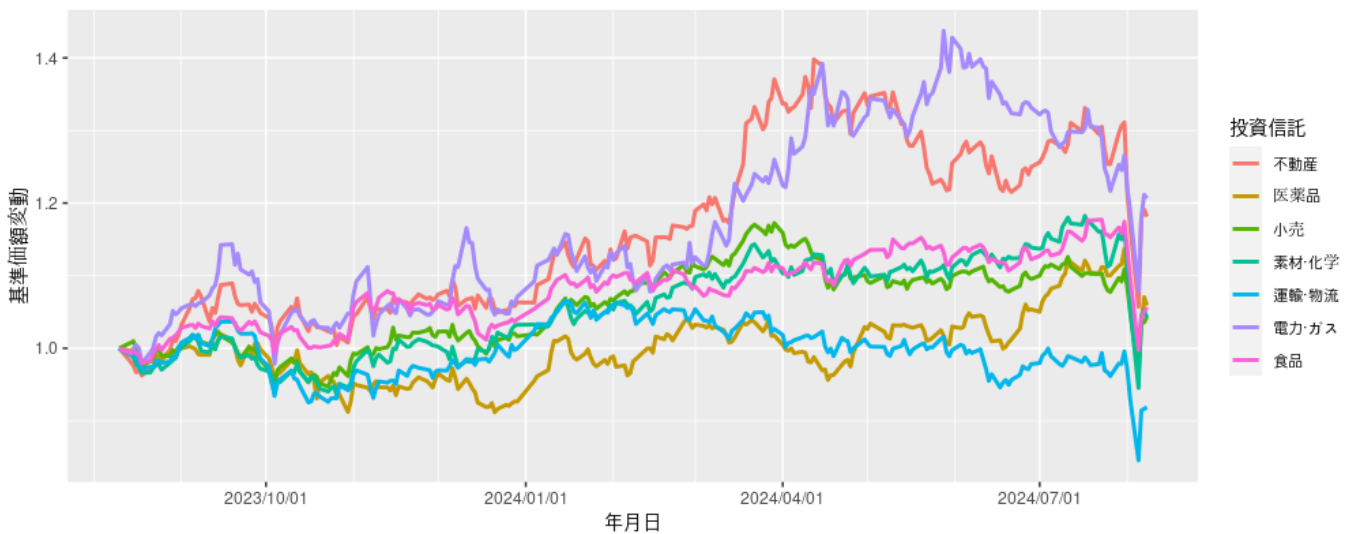
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.116%	1.388%	0.083	—
銀行	0.125%	1.640%	0.076	48.3%
エネルギー資源	0.121%	1.837%	0.066	23.1%
商社・卸売	0.106%	1.500%	0.070	20.1%
金融 (除く銀行)	0.103%	1.538%	0.067	0.0%
電力・ガス	0.073%	1.413%	0.051	8.4%
鉄鋼・非鉄	0.070%	1.500%	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。

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。