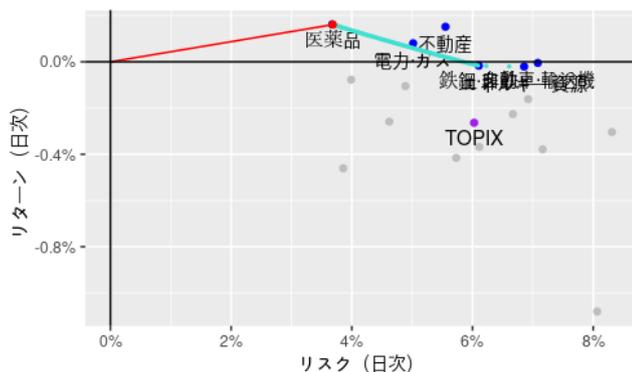


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

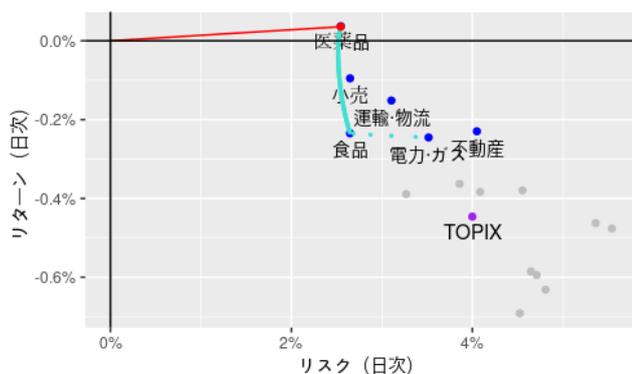
2024年8月17日

【半月】



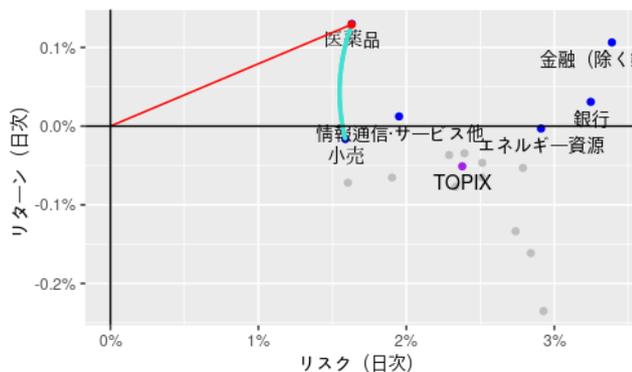
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.161%	3.685%	0.044	—
医薬品	0.162%	3.674%	0.044	99.5%
不動産	0.152%	5.552%	0.027	0.0%
電力・ガス	0.080%	5.016%	0.016	0.0%
自動車・輸送機	-0.005%	7.082%	-0.001	0.0%
鉄鋼・非鉄	-0.017%	6.105%	-0.003	0.5%
エネルギー資源	-0.021%	6.856%	-0.003	0.0%

【一ヶ月】



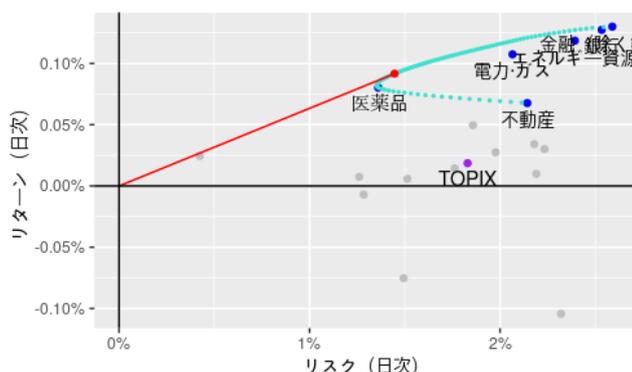
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.036%	2.544%	0.014	—
医薬品	0.037%	2.546%	0.015	98.9%
小売	-0.095%	2.648%	-0.036	1.1%
運輸・物流	-0.152%	3.105%	-0.049	0.0%
不動産	-0.230%	4.050%	-0.057	0.0%
食品	-0.235%	2.648%	-0.089	0.0%
電力・ガス	-0.245%	3.516%	-0.070	0.0%

【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	0.129%	1.630%	0.079	—
医薬品	0.130%	1.631%	0.080	99.5%
金融(除く銀行)	0.106%	3.389%	0.031	0.0%
銀行	0.031%	3.246%	0.009	0.0%
情報通信・サービス他	0.012%	1.951%	0.006	0.0%
エネルギー資源	-0.003%	2.910%	-0.001	0.0%
小売	-0.016%	1.588%	-0.010	0.5%

【半年】

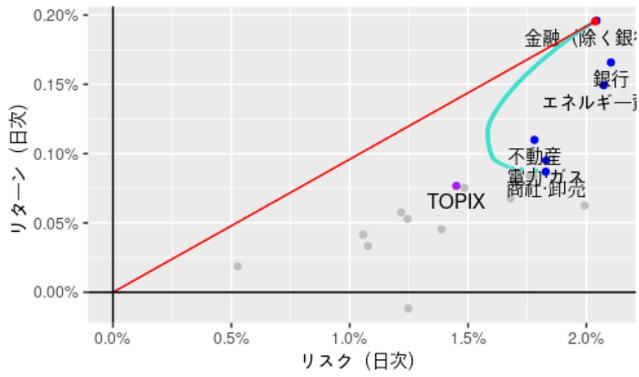


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.092%	1.446%	0.063	—
金融(除く銀行)	0.130%	2.590%	0.050	0.0%
銀行	0.127%	2.534%	0.050	6.7%
エネルギー資源	0.119%	2.393%	0.050	4.5%
電力・ガス	0.107%	2.066%	0.052	24.1%
医薬品	0.080%	1.361%	0.059	64.6%
不動産	0.068%	2.143%	0.032	0.0%

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。

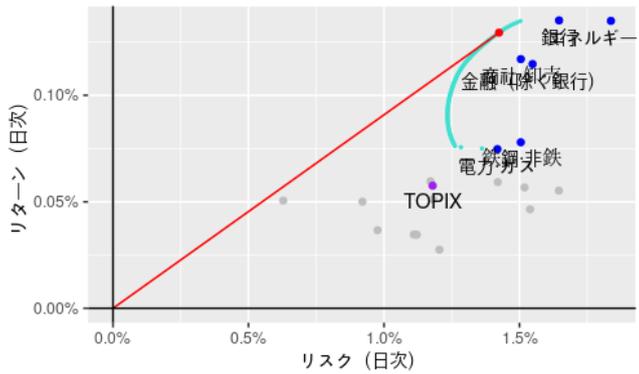
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.195%	2.037%	0.096	—
金融（除く銀行）	0.196%	2.043%	0.096	98.2%
銀行	0.166%	2.103%	0.079	1.8%
エネルギー資源	0.149%	2.073%	0.072	0.0%
不動産	0.110%	1.780%	0.062	0.0%
電力・ガス	0.095%	1.830%	0.052	0.0%
商社・卸売	0.087%	1.828%	0.048	0.0%

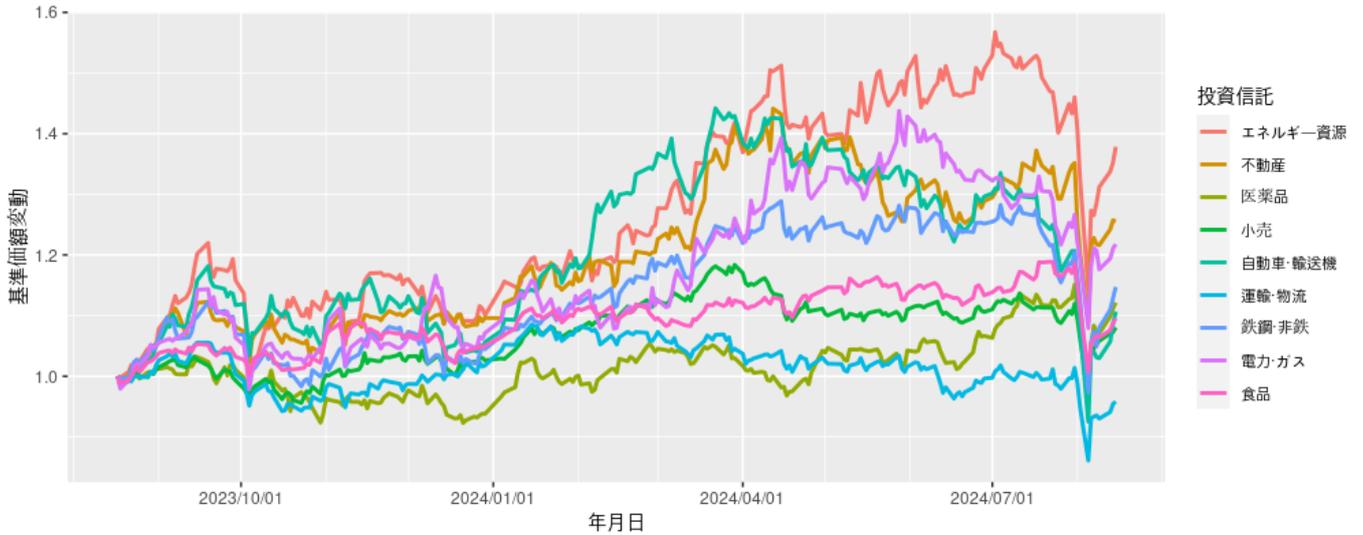
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.129%	1.425%	0.091	—
銀行	0.135%	1.646%	0.082	48.0%
エネルギー資源	0.135%	1.837%	0.073	26.3%
商社・卸売	0.117%	1.505%	0.078	23.4%
金融（除く銀行）	0.115%	1.548%	0.074	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.078%	1.505%	0.052	0.0%
電力・ガス	0.075%	1.419%	0.053	2.4%

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。