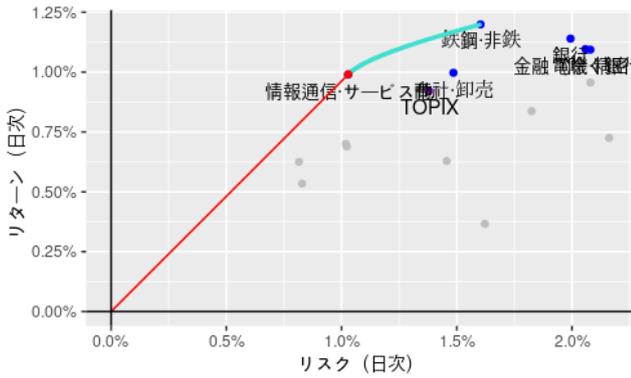


TOPIX17 シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

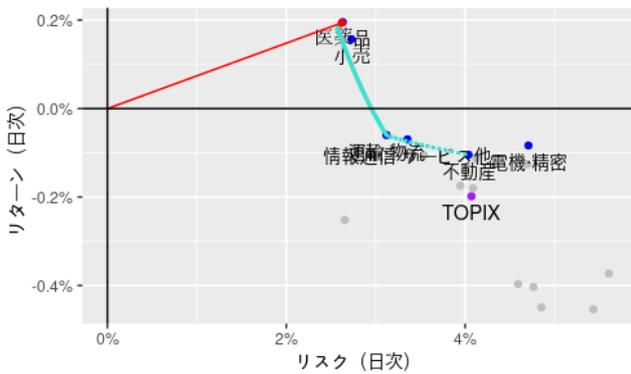
2024年8月24日

【半月】



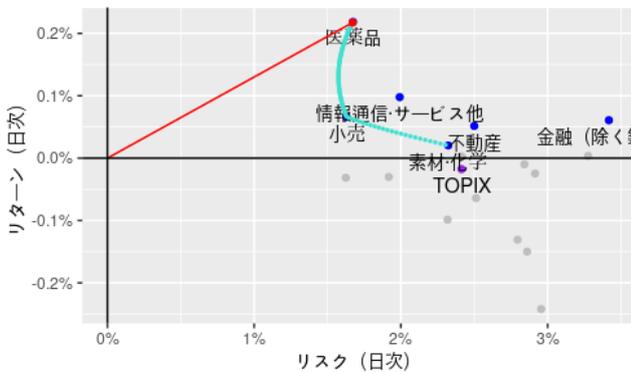
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.991%	1.029%	0.962	—
鉄鋼・非鉄	1.199%	1.603%	0.748	0.5%
銀行	1.140%	1.994%	0.572	0.0%
金融（除く銀行）	1.096%	2.058%	0.533	0.0%
電機・精密	1.094%	2.080%	0.526	0.0%
商社・卸売	0.997%	1.485%	0.671	0.0%
情報通信・サービス他	0.989%	1.028%	0.962	99.5%

【一ヶ月】



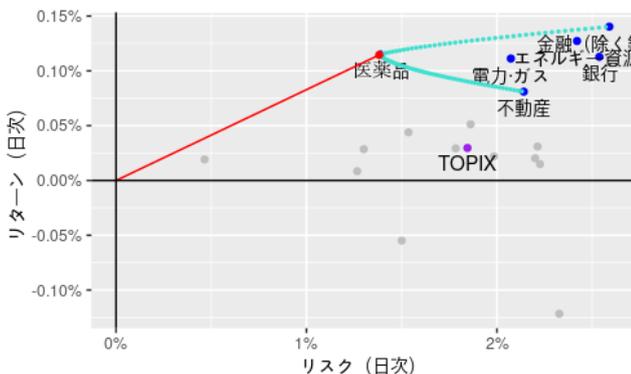
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.194%	2.621%	0.074	—
医薬品	0.195%	2.632%	0.074	96.1%
小売	0.157%	2.729%	0.057	3.9%
運輸・物流	-0.060%	3.120%	-0.019	0.0%
情報通信・サービス他	-0.070%	3.355%	-0.021	0.0%
電機・精密	-0.084%	4.708%	-0.018	0.0%
不動産	-0.104%	4.039%	-0.026	0.0%

【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	0.217%	1.671%	0.130	—
医薬品	0.218%	1.673%	0.131	99.3%
情報通信・サービス他	0.098%	1.992%	0.049	0.0%
小売	0.066%	1.629%	0.041	0.7%
金融（除く銀行）	0.061%	3.418%	0.018	0.0%
不動産	0.052%	2.500%	0.021	0.0%
素材・化学	0.020%	2.323%	0.009	0.0%

【半年】

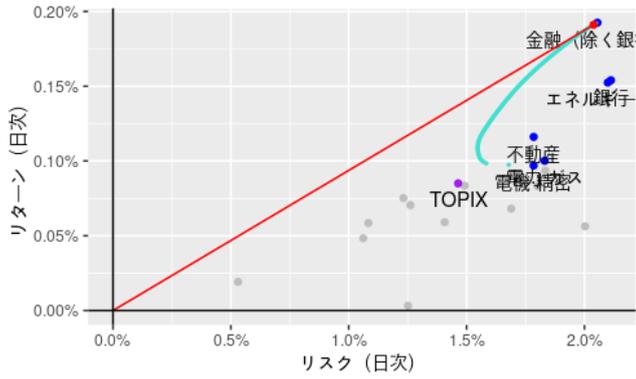


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.115%	1.382%	0.083	—
金融（除く銀行）	0.140%	2.590%	0.054	0.0%
エネルギー資源	0.127%	2.421%	0.053	0.0%
医薬品	0.115%	1.389%	0.083	91.6%
銀行	0.113%	2.538%	0.044	0.0%
電力・ガス	0.111%	2.073%	0.054	8.4%
不動産	0.081%	2.141%	0.038	0.0%

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。

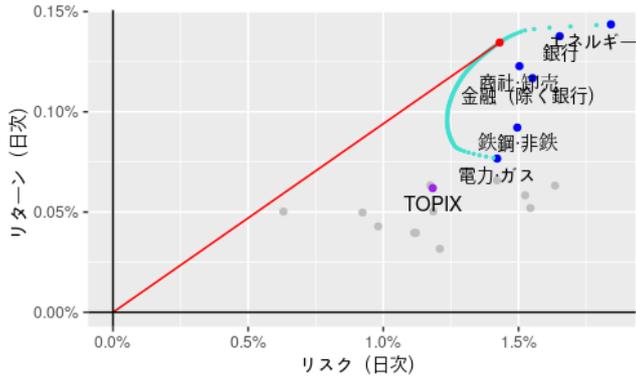
（2）リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.191%	2.039%	0.094	—
金融 (除く銀行)	0.192%	2.055%	0.094	96.4%
銀行	0.154%	2.112%	0.073	0.0%
エネルギー資源	0.152%	2.099%	0.073	3.6%
不動産	0.116%	1.785%	0.065	0.0%
電力・ガス	0.100%	1.831%	0.055	0.0%
電機・精密	0.097%	1.785%	0.054	0.0%

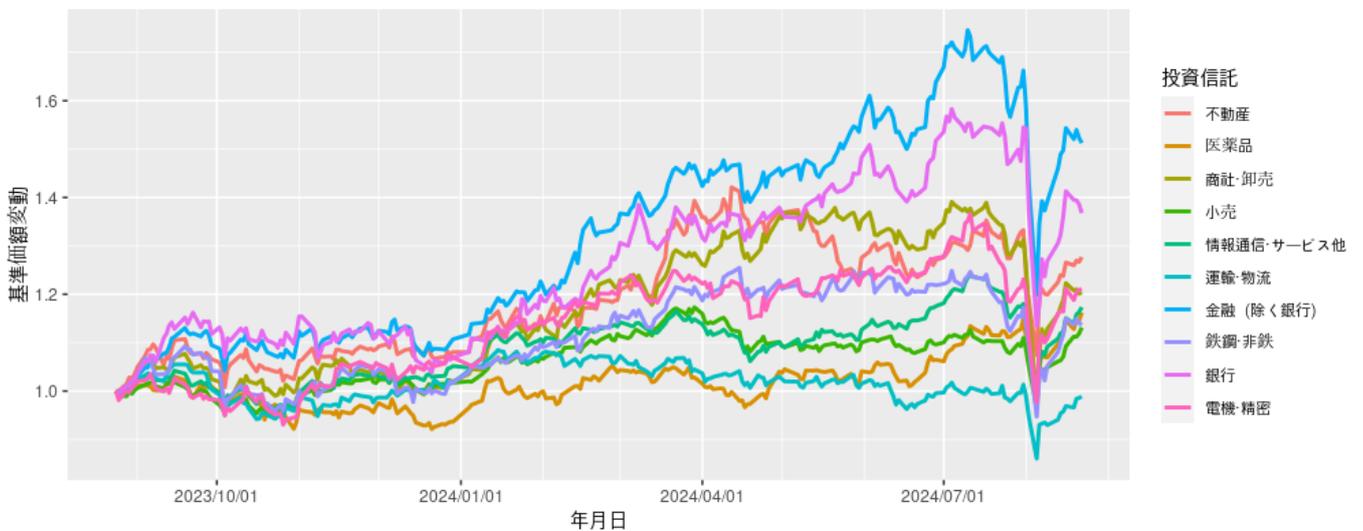
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.135%	1.430%	0.094	—
エネルギー資源	0.144%	1.842%	0.078	28.4%
銀行	0.138%	1.652%	0.083	43.6%
商社・卸売	0.123%	1.503%	0.082	26.5%
金融 (除く銀行)	0.117%	1.552%	0.075	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.092%	1.496%	0.062	0.0%
電力・ガス	0.077%	1.421%	0.054	1.4%

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。