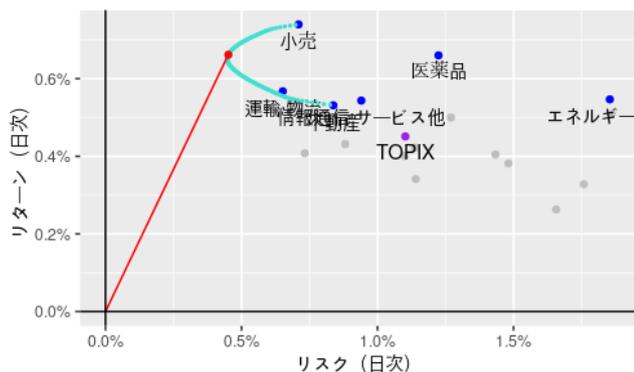


## TOPIX17 シリーズ（+米ドル）を使った効率的ポートフォリオ

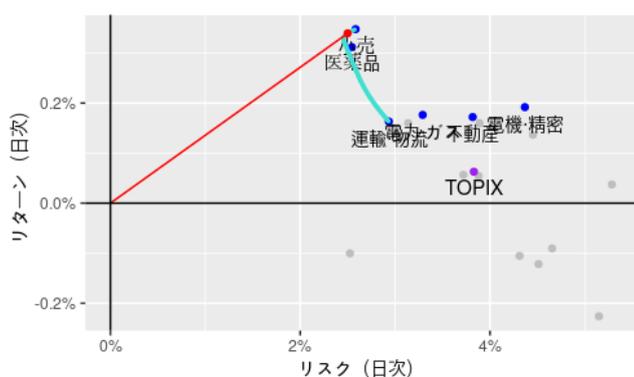
2024年8月31日

### 【半月】



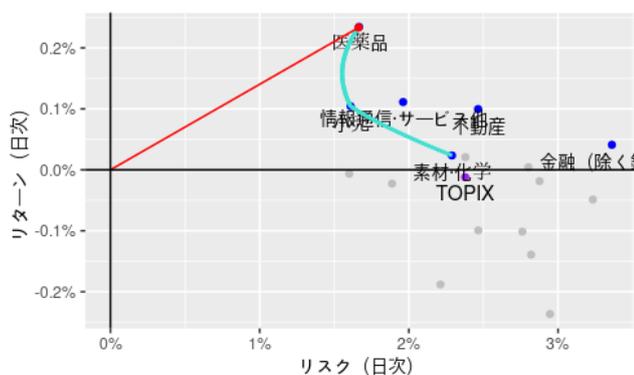
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.662%	0.451%	1.465	—
小売	0.740%	0.710%	1.042	50.9%
医薬品	0.660%	1.224%	0.539	6.9%
運輸・物流	0.567%	0.652%	0.871	42.2%
エネルギー資源	0.547%	1.854%	0.295	0.0%
情報通信・サービス他	0.543%	0.940%	0.578	0.0%
不動産	0.531%	0.838%	0.634	0.0%

### 【一ヶ月】



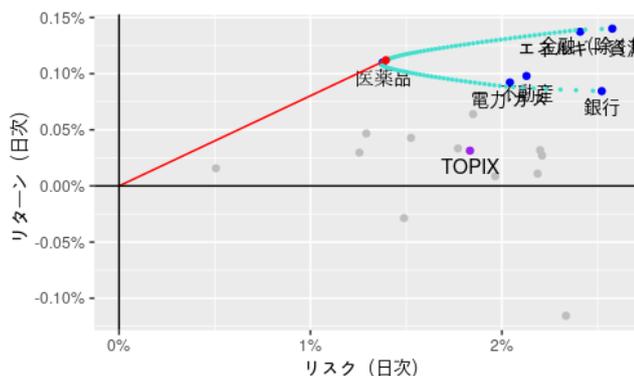
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.339%	2.500%	0.136	—
小売	0.348%	2.584%	0.135	76.8%
医薬品	0.312%	2.544%	0.123	23.2%
電機・精密	0.192%	4.368%	0.044	0.0%
電力・ガス	0.176%	3.291%	0.054	0.0%
不動産	0.172%	3.817%	0.045	0.0%
運輸・物流	0.163%	2.934%	0.056	0.0%

### 【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	0.233%	1.663%	0.140	—
医薬品	0.234%	1.666%	0.141	99.2%
情報通信・サービス他	0.111%	1.961%	0.057	0.0%
小売	0.104%	1.610%	0.065	0.8%
不動産	0.100%	2.464%	0.040	0.0%
金融（除く銀行）	0.041%	3.361%	0.012	0.0%
素材・化学	0.024%	2.289%	0.010	0.0%

### 【半年】

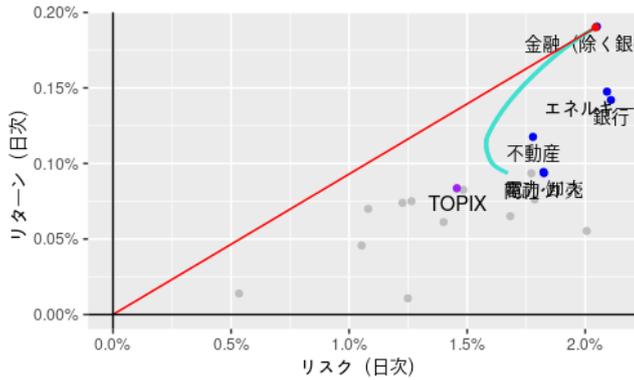


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.112%	1.394%	0.080	—
金融（除く銀行）	0.140%	2.577%	0.054	0.0%
エネルギー資源	0.137%	2.409%	0.057	7.8%
医薬品	0.110%	1.377%	0.080	92.2%
不動産	0.098%	2.129%	0.046	0.0%
電力・ガス	0.092%	2.042%	0.045	0.0%
銀行	0.084%	2.522%	0.033	0.0%

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。

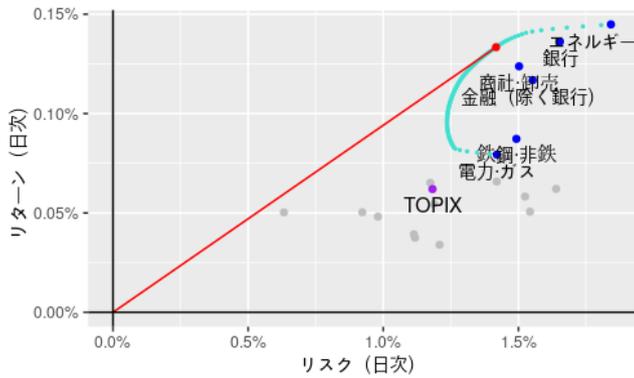
（2）リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.190%	2.044%	0.093	—
金融 (除く銀行)	0.191%	2.049%	0.093	98.9%
エネルギー資源	0.148%	2.092%	0.071	1.1%
銀行	0.142%	2.109%	0.067	0.0%
不動産	0.118%	1.779%	0.066	0.0%
電力・ガス	0.094%	1.823%	0.052	0.0%
商社・卸売	0.094%	1.825%	0.051	0.0%

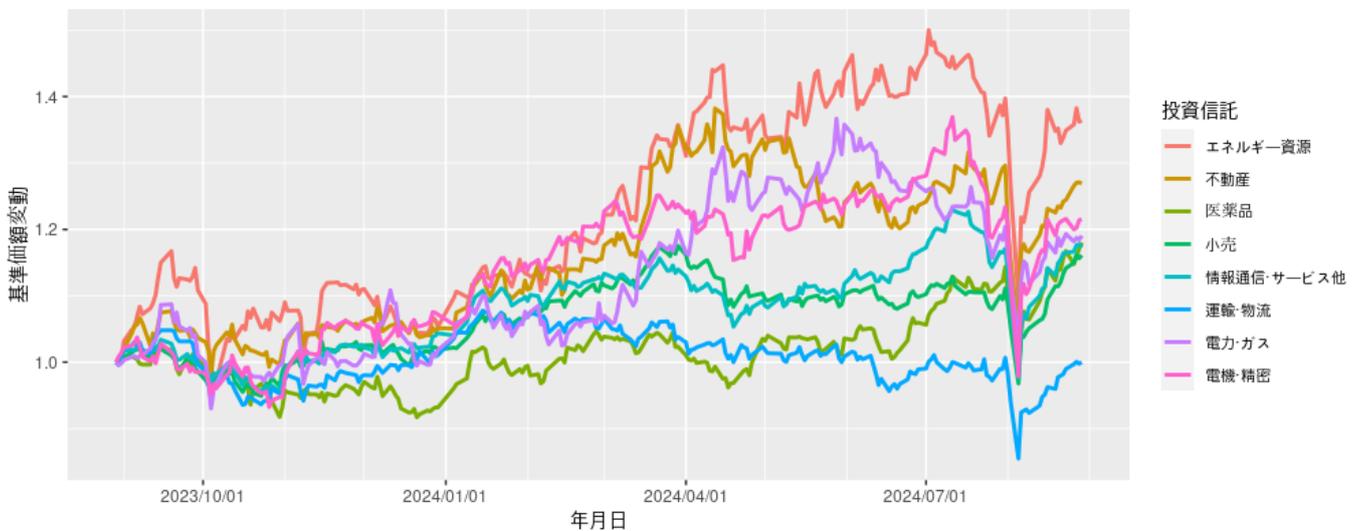
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.133%	1.417%	0.094	—
エネルギー資源	0.145%	1.842%	0.079	28.8%
銀行	0.136%	1.654%	0.082	40.6%
商社・卸売	0.124%	1.502%	0.082	27.3%
金融 (除く銀行)	0.117%	1.553%	0.075	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.087%	1.493%	0.058	0.0%
電力・ガス	0.079%	1.420%	0.056	3.3%

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。