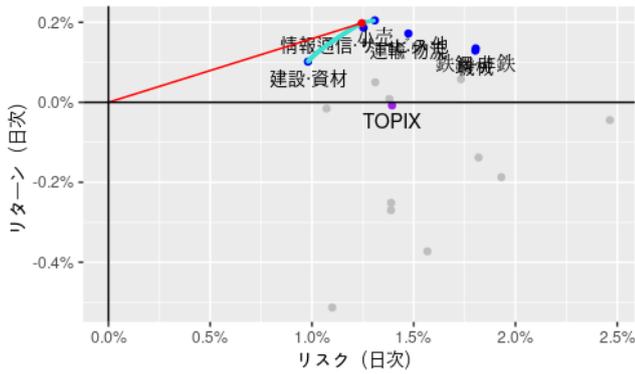


TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

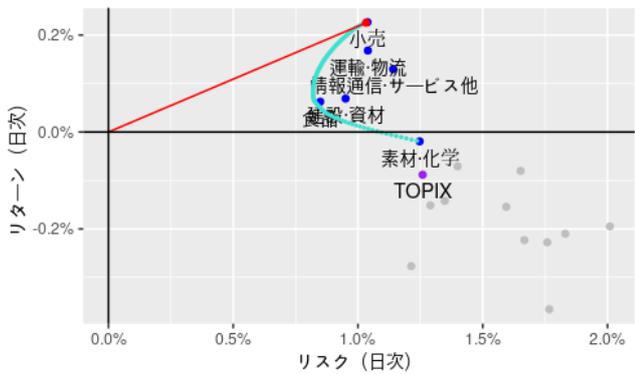
2024年9月20日

【半月】



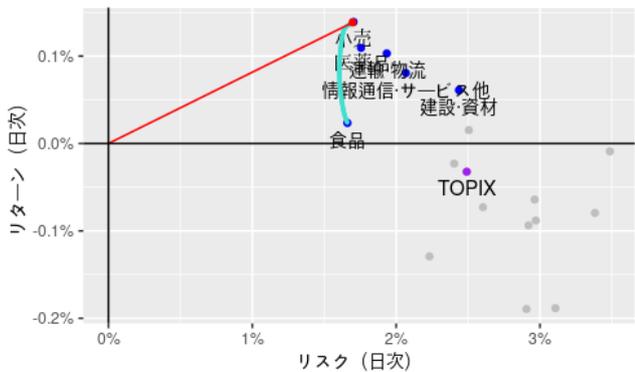
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.198%	1.245%	0.159	—
小売	0.205%	1.309%	0.156	63.8%
情報通信・サービス他	0.186%	1.253%	0.149	36.2%
運輸・物流	0.172%	1.474%	0.117	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.135%	1.805%	0.075	0.0%
機械	0.129%	1.803%	0.072	0.0%
建設・資材	0.102%	0.980%	0.104	0.0%

【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	0.225%	1.032%	0.218	—
小売	0.227%	1.038%	0.218	97.9%
運輸・物流	0.168%	1.040%	0.162	2.1%
情報通信・サービス他	0.130%	1.141%	0.114	0.0%
建設・資材	0.069%	0.950%	0.073	0.0%
食品	0.063%	0.849%	0.074	0.0%
素材・化学	-0.019%	1.247%	-0.015	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	0.139%	1.698%	0.082	—
小売	0.139%	1.704%	0.082	98.1%
医薬品	0.109%	1.756%	0.062	1.9%
運輸・物流	0.103%	1.935%	0.053	0.0%
情報通信・サービス他	0.081%	2.067%	0.039	0.0%
建設・資材	0.061%	2.437%	0.025	0.0%
食品	0.023%	1.662%	0.014	0.0%

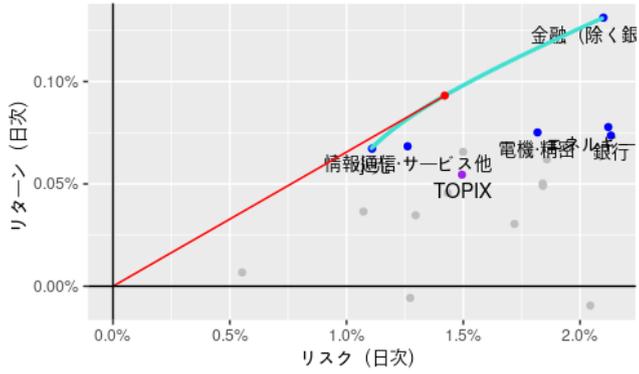
【半年】

TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	%	%	—	—
	%	%	—	—
	%	%	—	—
	%	%	—	—
	%	%	—	—
	%	%	—	—

計算できませんでした。

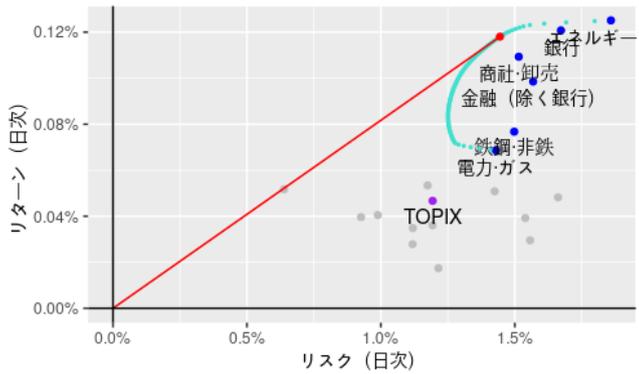
備考 (1) グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。  
 (2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.093%	1.420%	0.066	—
金融（除く銀行）	0.131%	2.100%	0.062	40.5%
エネルギー資源	0.078%	2.121%	0.037	0.0%
電機・精密	0.075%	1.818%	0.041	0.0%
銀行	0.074%	2.132%	0.035	0.0%
情報通信・サービス他	0.068%	1.261%	0.054	0.0%
小売	0.067%	1.109%	0.061	59.5%

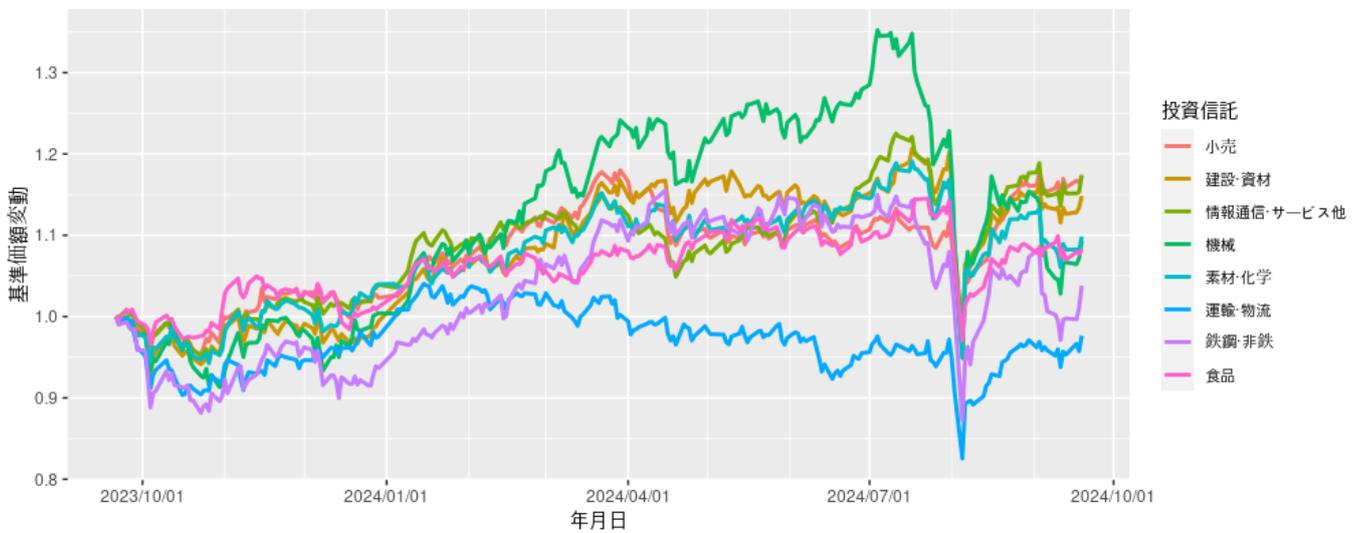
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.118%	1.445%	0.082	—
エネルギー資源	0.125%	1.859%	0.067	26.4%
銀行	0.121%	1.672%	0.072	42.1%
商社・卸売	0.109%	1.515%	0.072	30.8%
金融（除く銀行）	0.099%	1.568%	0.063	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.077%	1.498%	0.051	0.0%
電力・ガス	0.069%	1.429%	0.048	0.7%

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。