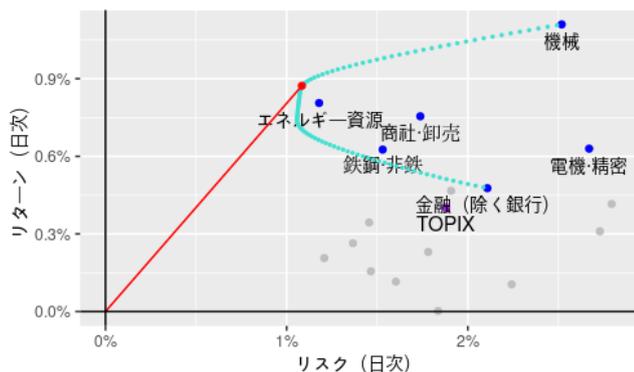


## TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

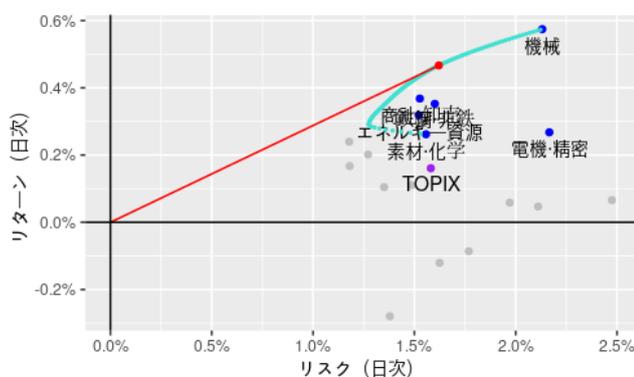
2024年10月5日

### 【半月】



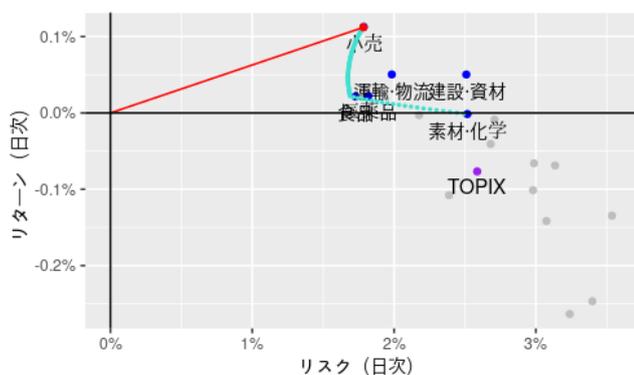
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.872%	1.084%	0.805	—
機械	1.110%	2.518%	0.441	21.9%
エネルギー資源	0.806%	1.179%	0.684	78.1%
商社・卸売	0.755%	1.738%	0.434	0.0%
電機・精密	0.630%	2.670%	0.236	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.626%	1.530%	0.409	0.0%
金融(除く銀行)	0.477%	2.108%	0.226	0.0%

### 【一ヶ月】



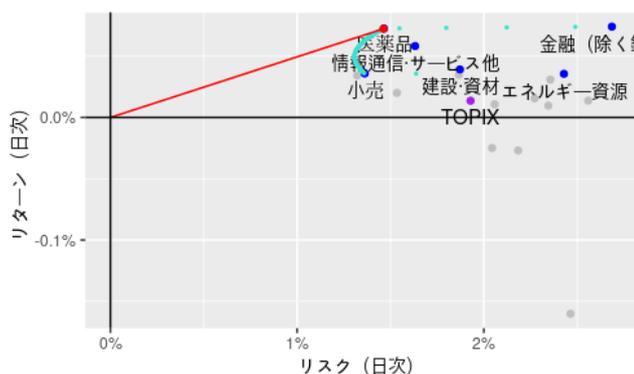
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.467%	1.621%	0.288	—
機械	0.574%	2.131%	0.270	57.8%
商社・卸売	0.368%	1.527%	0.241	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.352%	1.601%	0.220	0.0%
エネルギー資源	0.319%	1.522%	0.209	42.2%
電機・精密	0.268%	2.166%	0.124	0.0%
素材・化学	0.262%	1.557%	0.168	0.0%

### 【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	0.112%	1.784%	0.063	—
小売	0.113%	1.786%	0.063	99.4%
運輸・物流	0.050%	1.984%	0.025	0.0%
建設・資材	0.050%	2.509%	0.020	0.0%
医薬品	0.022%	1.819%	0.012	0.6%
食品	0.021%	1.728%	0.012	0.0%
素材・化学	-0.001%	2.517%	-0.001	0.0%

### 【半年】

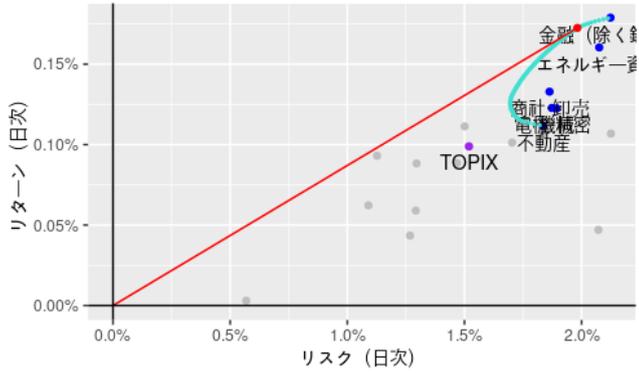


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.072%	1.462%	0.049	—
金融(除く銀行)	0.074%	2.686%	0.028	0.0%
医薬品	0.072%	1.465%	0.049	99.5%
情報通信・サービス他	0.058%	1.632%	0.036	0.0%
建設・資材	0.039%	1.872%	0.021	0.0%
小売	0.036%	1.362%	0.026	0.5%
エネルギー資源	0.036%	2.429%	0.015	0.0%

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。

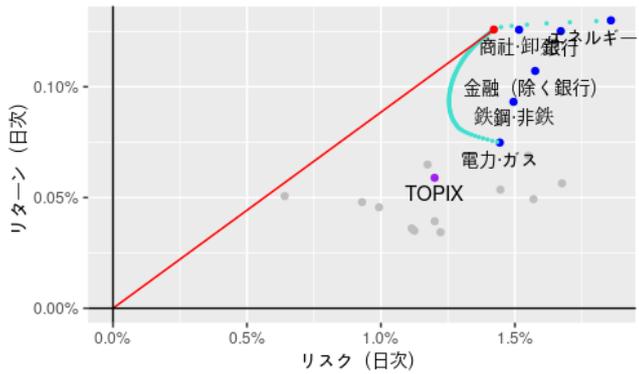
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.173%	1.982%	0.087	—
金融 (除く銀行)	0.179%	2.123%	0.084	65.5%
エネルギー資源	0.160%	2.075%	0.077	34.5%
商社・卸売	0.133%	1.863%	0.071	0.0%
電機・精密	0.123%	1.873%	0.066	0.0%
機械	0.122%	1.894%	0.065	0.0%
不動産	0.112%	1.834%	0.061	0.0%

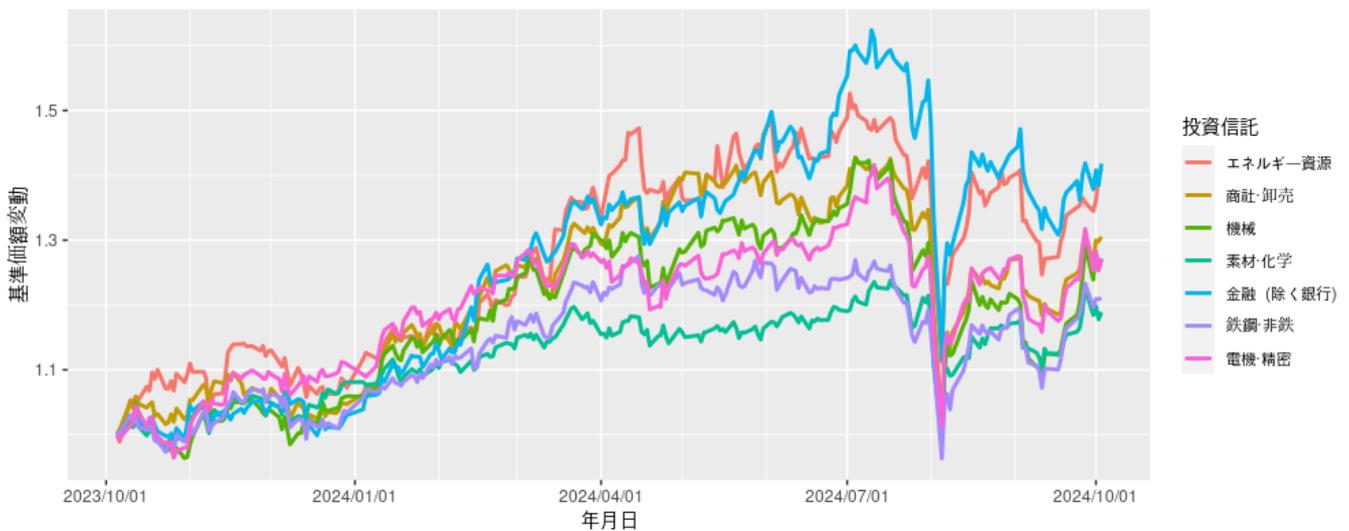
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.126%	1.421%	0.089	—
エネルギー資源	0.130%	1.858%	0.070	16.8%
商社・卸売	0.126%	1.516%	0.083	50.1%
銀行	0.125%	1.671%	0.075	32.2%
金融 (除く銀行)	0.107%	1.576%	0.068	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.093%	1.495%	0.062	0.0%
電力・ガス	0.075%	1.444%	0.052	0.8%

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。