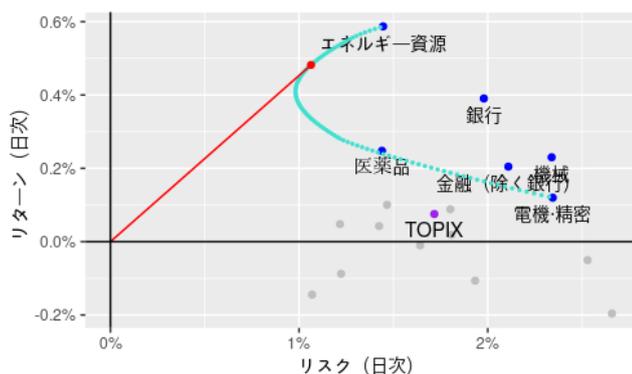


## TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

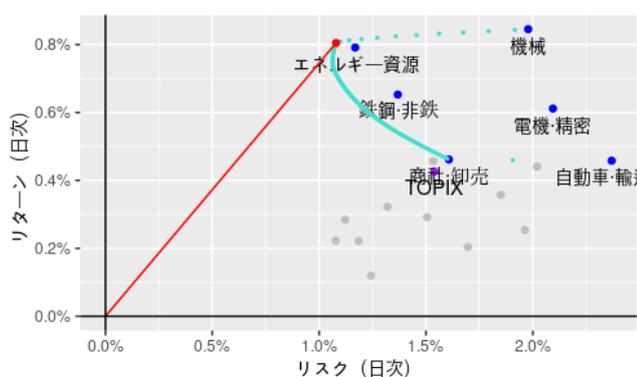
2024年10月12日

### 【半月】



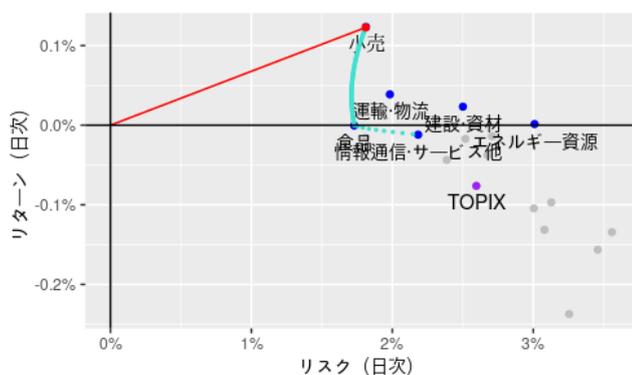
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.482%	1.063%	0.453	—
エネルギー資源	0.587%	1.445%	0.406	61.0%
銀行	0.391%	1.979%	0.197	19.0%
医薬品	0.248%	1.439%	0.172	20.0%
機械	0.230%	2.339%	0.098	0.0%
金融 (除く銀行)	0.205%	2.109%	0.097	0.0%
電機・精密	0.120%	2.345%	0.051	0.0%

### 【一ヶ月】



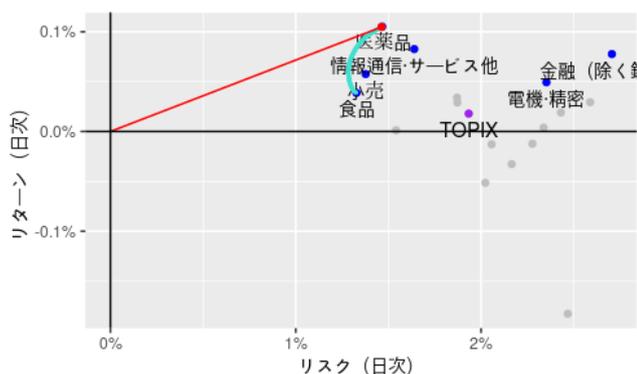
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.805%	1.079%	0.746	—
機械	0.845%	1.978%	0.427	24.9%
エネルギー資源	0.791%	1.169%	0.677	75.1%
鉄鋼・非鉄	0.653%	1.368%	0.477	0.0%
電機・精密	0.612%	2.094%	0.292	0.0%
商社・卸売	0.462%	1.607%	0.287	0.0%
自動車・輸送機	0.458%	2.369%	0.193	0.0%

### 【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	0.123%	1.811%	0.068	—
小売	0.123%	1.813%	0.068	99.5%
運輸・物流	0.039%	1.982%	0.020	0.0%
建設・資材	0.023%	2.500%	0.009	0.0%
エネルギー資源	0.001%	3.009%	0.000	0.0%
食品	-0.000%	1.729%	0.000	0.5%
情報通信・サービス他	-0.012%	2.183%	-0.005	0.0%

### 【半年】

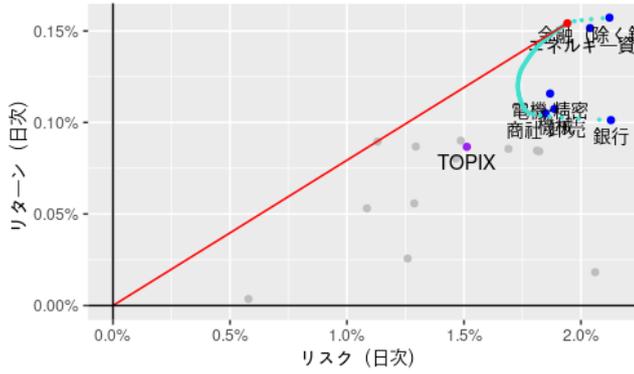


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.105%	1.463%	0.072	—
医薬品	0.105%	1.466%	0.072	99.3%
情報通信・サービス他	0.083%	1.639%	0.050	0.0%
金融 (除く銀行)	0.078%	2.706%	0.029	0.0%
小売	0.058%	1.377%	0.042	0.7%
電機・精密	0.049%	2.353%	0.021	0.0%
食品	0.039%	1.328%	0.029	0.0%

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。

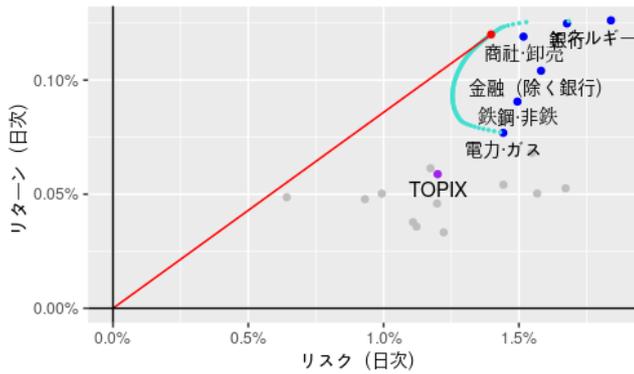
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.154%	1.942%	0.079	—
金融（除く銀行）	0.157%	2.122%	0.074	48.1%
エネルギー資源	0.152%	2.039%	0.074	51.6%
電機・精密	0.116%	1.868%	0.062	0.3%
機械	0.107%	1.887%	0.057	0.0%
商社・卸売	0.105%	1.849%	0.057	0.0%
銀行	0.101%	2.128%	0.048	0.0%

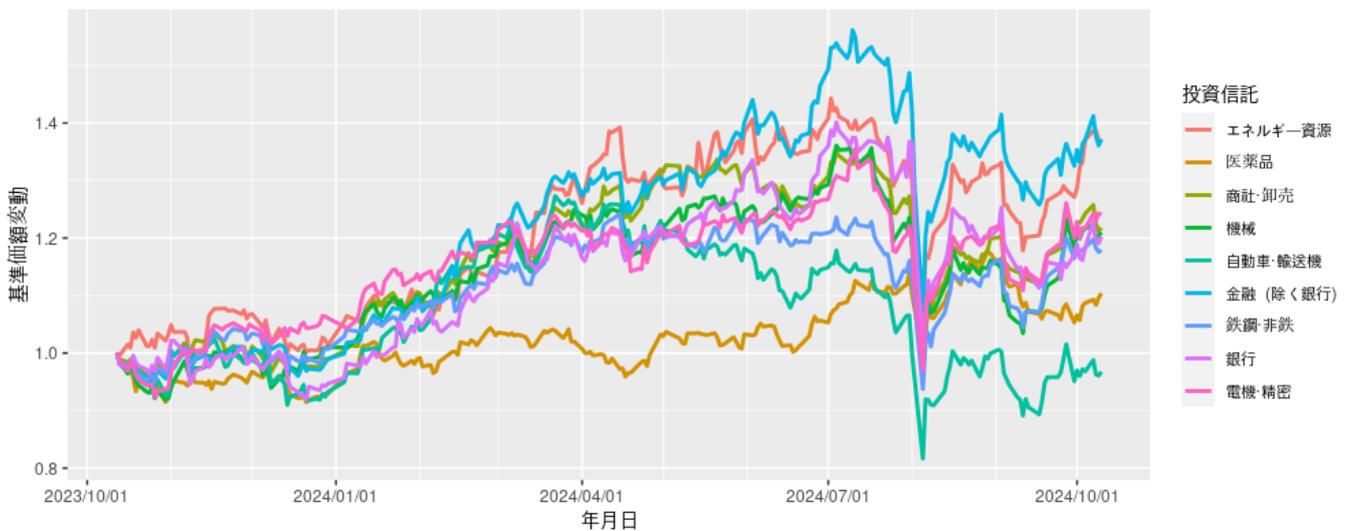
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.120%	1.397%	0.086	—
エネルギー資源	0.126%	1.840%	0.069	19.1%
銀行	0.125%	1.678%	0.074	35.7%
商社・卸売	0.119%	1.517%	0.078	39.4%
金融（除く銀行）	0.104%	1.582%	0.066	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.091%	1.495%	0.061	0.0%
電力・ガス	0.077%	1.442%	0.053	5.8%

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。