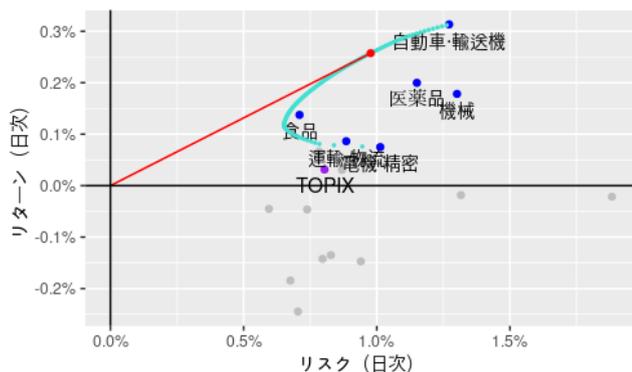


## TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

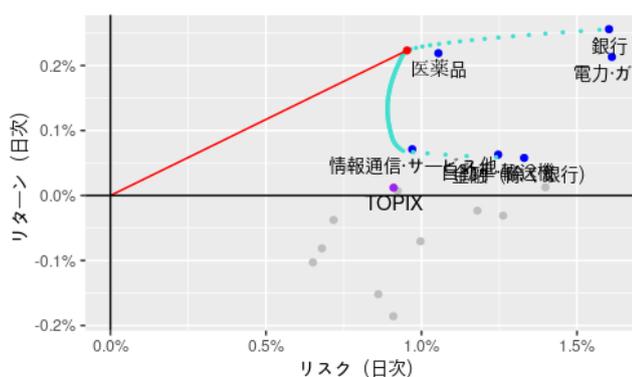
2024 年 11 月 1 日

### 【半月】



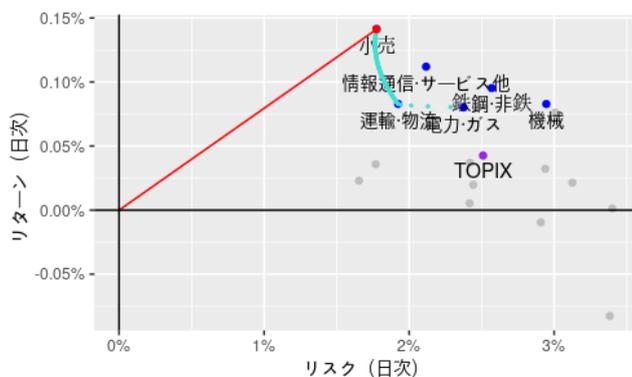
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.257%	0.977%	0.263	—
自動車・輸送機	0.313%	1.272%	0.246	62.9%
医薬品	0.200%	1.150%	0.174	0.0%
機械	0.178%	1.301%	0.137	22.6%
食品	0.137%	0.710%	0.194	14.5%
運輸・物流	0.086%	0.885%	0.097	0.0%
電機・精密	0.075%	1.013%	0.074	0.0%

### 【一ヶ月】



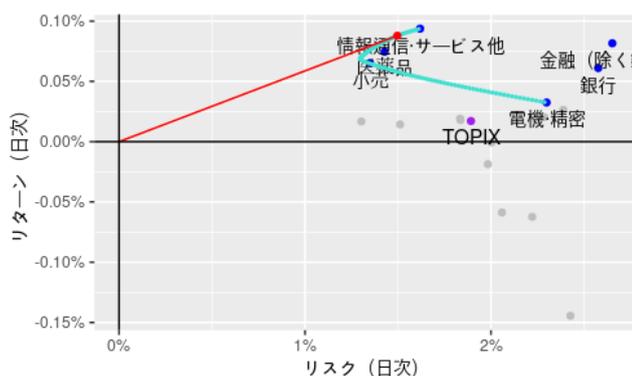
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.223%	0.954%	0.234	—
銀行	0.256%	1.603%	0.160	14.8%
医薬品	0.219%	1.054%	0.208	65.2%
電力・ガス	0.213%	1.612%	0.132	20.0%
情報通信・サービス他	0.071%	0.970%	0.073	0.0%
自動車・輸送機	0.063%	1.247%	0.050	0.0%
金融 (除く銀行)	0.058%	1.330%	0.043	0.0%

### 【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	0.141%	1.775%	0.080	—
小売	0.141%	1.776%	0.080	99.5%
情報通信・サービス他	0.112%	2.117%	0.053	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.095%	2.569%	0.037	0.0%
運輸・物流	0.083%	1.924%	0.043	0.5%
機械	0.083%	2.946%	0.028	0.0%
電力・ガス	0.080%	2.375%	0.034	0.0%

### 【半年】

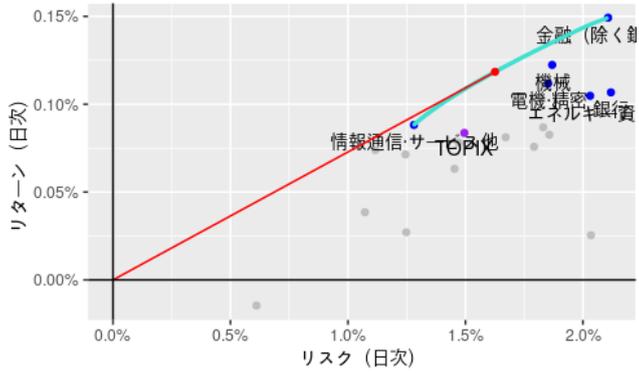


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.088%	1.497%	0.059	—
情報通信・サービス他	0.094%	1.619%	0.058	69.6%
金融 (除く銀行)	0.082%	2.653%	0.031	0.0%
医薬品	0.075%	1.428%	0.052	30.4%
小売	0.065%	1.349%	0.048	0.0%
銀行	0.061%	2.577%	0.024	0.0%
電機・精密	0.032%	2.299%	0.014	0.0%

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。

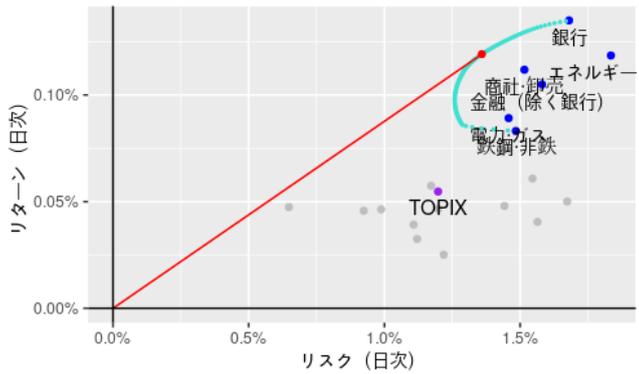
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.118%	1.626%	0.073	—
金融（除く銀行）	0.149%	2.107%	0.071	44.1%
機械	0.122%	1.869%	0.065	9.6%
電機・精密	0.112%	1.852%	0.060	0.0%
銀行	0.107%	2.119%	0.050	0.0%
エネルギー資源	0.105%	2.031%	0.052	0.0%
情報通信・サービス他	0.088%	1.281%	0.069	46.3%

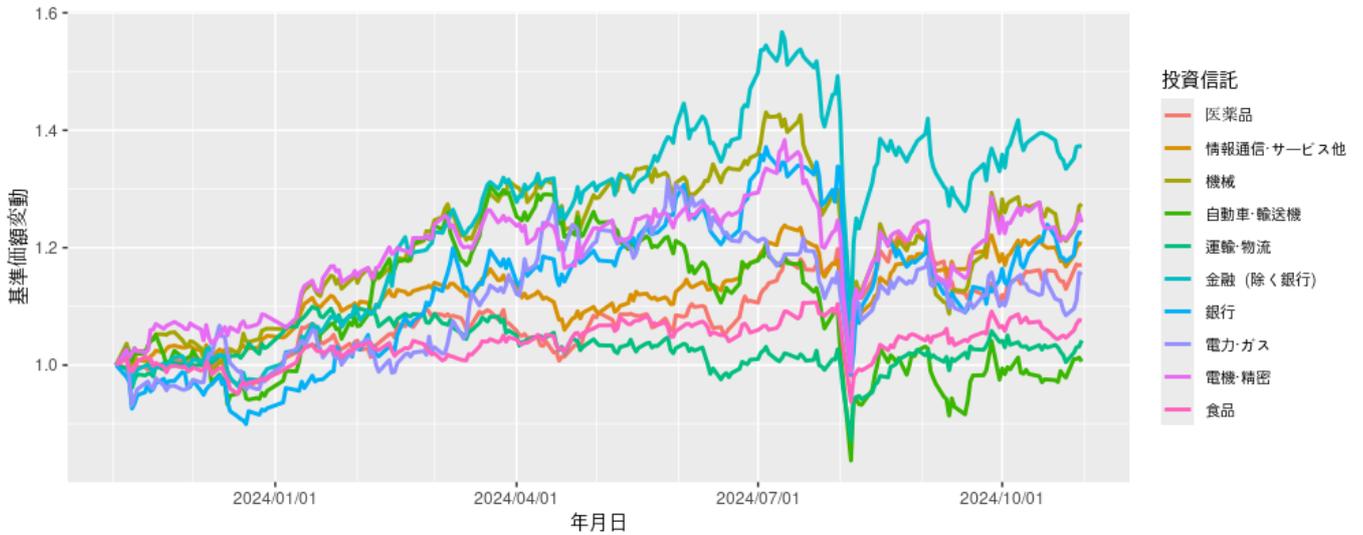
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.119%	1.359%	0.088	—
銀行	0.135%	1.680%	0.080	47.0%
エネルギー資源	0.118%	1.835%	0.065	13.6%
商社・卸売	0.112%	1.516%	0.074	19.7%
金融（除く銀行）	0.105%	1.581%	0.066	0.0%
電力・ガス	0.089%	1.458%	0.061	19.7%
鉄鋼・非鉄	0.083%	1.484%	0.056	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。

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。