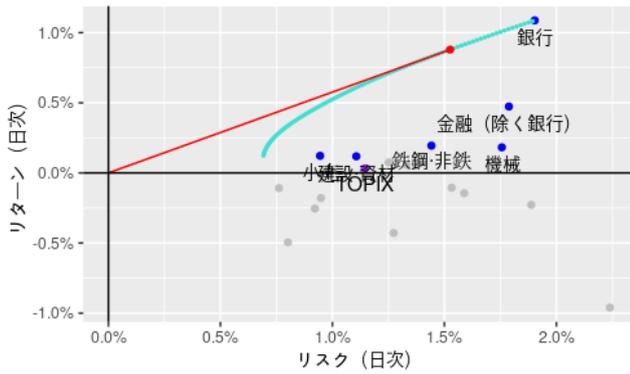


# TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

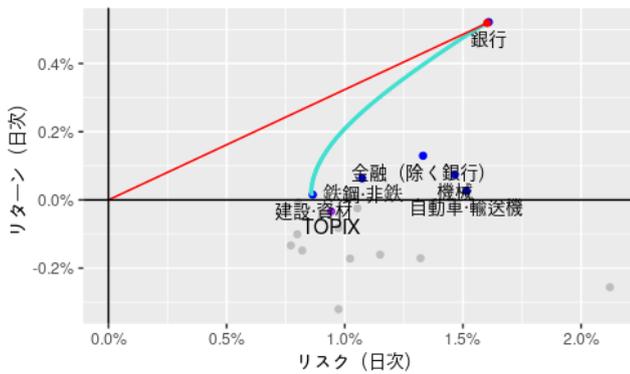
2024年11月15日

## 【半月】



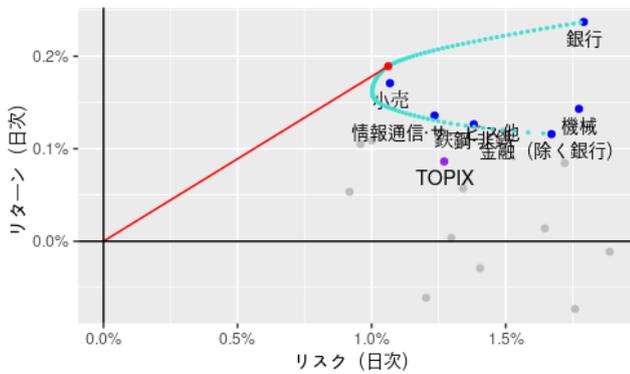
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.879%	1.525%	0.576	—
銀行	1.087%	1.903%	0.571	78.4%
金融 (除く銀行)	0.473%	1.788%	0.264	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.194%	1.442%	0.135	0.0%
機械	0.182%	1.756%	0.104	0.0%
小売	0.122%	0.945%	0.129	21.6%
建設・資材	0.118%	1.107%	0.107	0.0%

## 【一ヶ月】



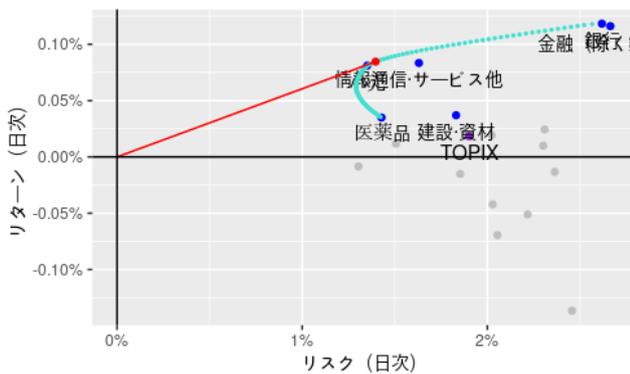
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.519%	1.603%	0.324	—
銀行	0.521%	1.609%	0.324	99.5%
金融 (除く銀行)	0.129%	1.331%	0.097	0.0%
機械	0.074%	1.466%	0.050	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.063%	1.073%	0.059	0.0%
自動車・輸送機	0.026%	1.515%	0.017	0.5%
建設・資材	0.015%	0.865%	0.018	0.0%

## 【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	0.189%	1.062%	0.178	—
銀行	0.237%	1.791%	0.132	27.7%
小売	0.171%	1.068%	0.160	72.3%
機械	0.143%	1.773%	0.081	0.0%
情報通信・サービス他	0.136%	1.235%	0.110	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.126%	1.381%	0.092	0.0%
金融 (除く銀行)	0.116%	1.671%	0.069	0.0%

## 【半年】

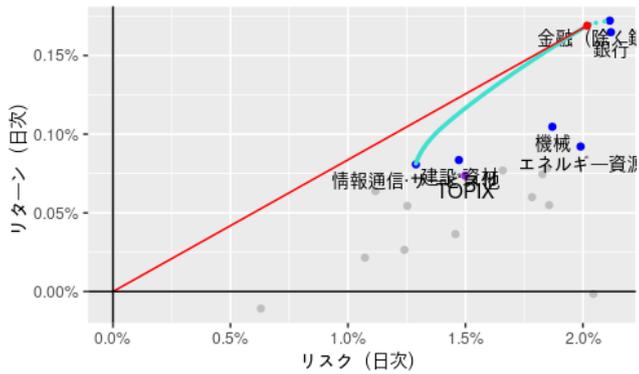


TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.085%	1.396%	0.061	—
銀行	0.118%	2.618%	0.045	9.5%
金融 (除く銀行)	0.116%	2.664%	0.044	0.0%
情報通信・サービス他	0.083%	1.630%	0.051	0.0%
小売	0.081%	1.351%	0.060	90.5%
建設・資材	0.037%	1.831%	0.020	0.0%
医薬品	0.035%	1.428%	0.024	0.0%

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。

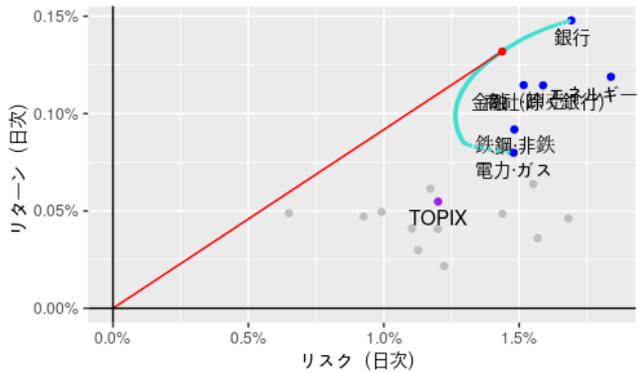
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.169%	2.018%	0.084	—
金融（除く銀行）	0.172%	2.115%	0.081	60.1%
銀行	0.165%	2.119%	0.078	39.6%
機械	0.105%	1.870%	0.056	0.0%
エネルギー資源	0.092%	1.990%	0.046	0.0%
建設・資材	0.084%	1.472%	0.057	0.0%
情報通信・サービス他	0.081%	1.289%	0.063	0.3%

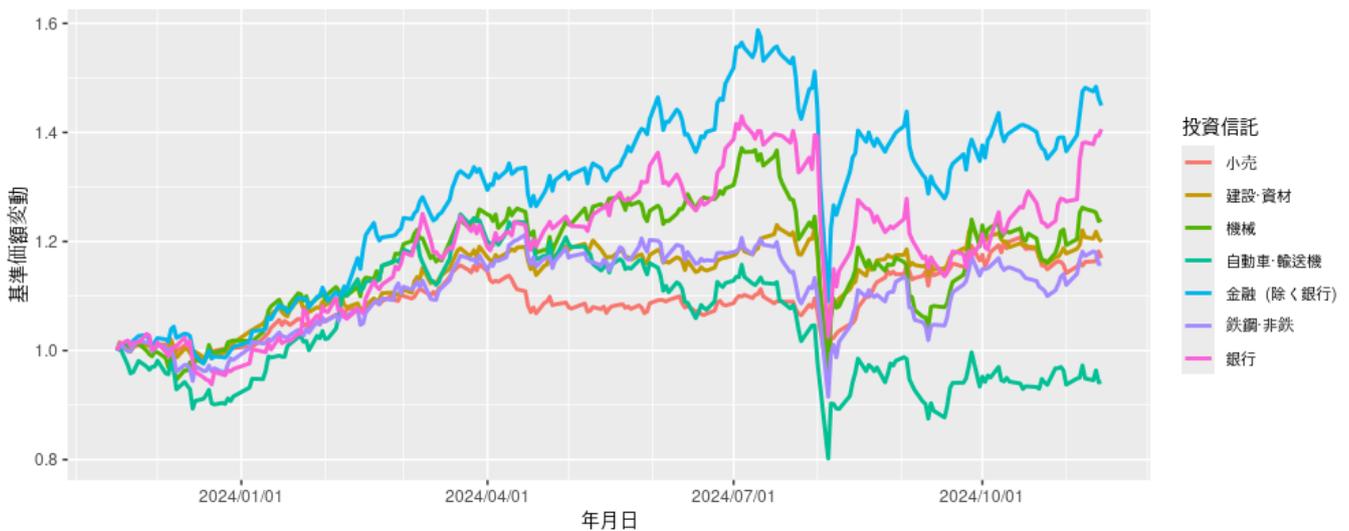
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.132%	1.437%	0.092	—
銀行	0.148%	1.692%	0.087	58.2%
エネルギー資源	0.119%	1.839%	0.065	12.6%
商社・卸売	0.115%	1.516%	0.076	21.6%
金融（除く銀行）	0.114%	1.588%	0.072	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.092%	1.482%	0.062	0.0%
電力・ガス	0.080%	1.480%	0.054	7.5%

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。