

TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

2025 年 1 月 11 日

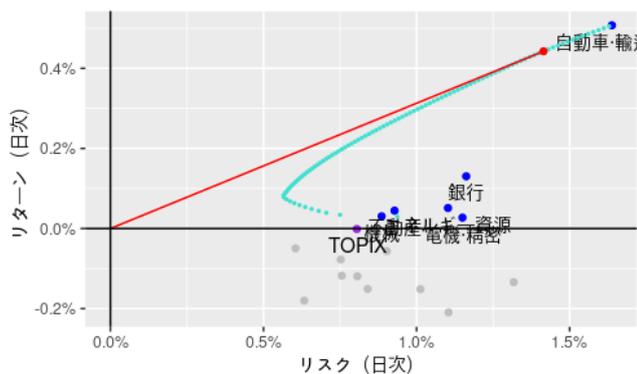
【半月】

TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.946%	1.237%	0.765	—

計算できませんでした

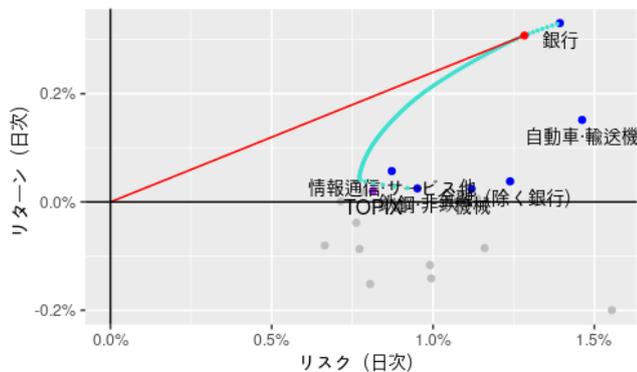
計算できませんでした

【一ヶ月】



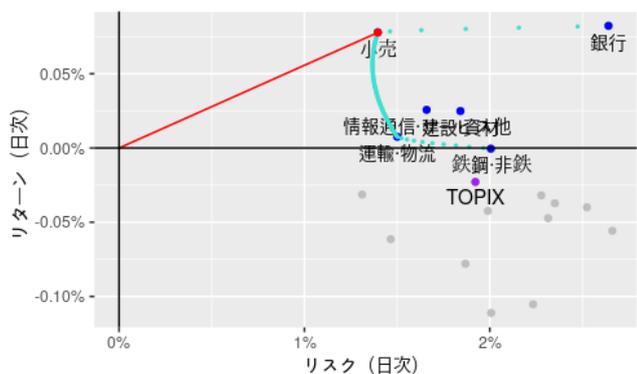
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.443%	1.415%	0.313	—
自動車・輸送機	0.507%	1.638%	0.310	82.8%
銀行	0.130%	1.162%	0.112	17.2%
エネルギー資源	0.051%	1.103%	0.046	0.0%
不動産	0.045%	0.928%	0.048	0.0%
機械	0.031%	0.886%	0.034	0.0%
電機・精密	0.027%	1.150%	0.024	0.0%

【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	0.308%	1.283%	0.240	—
銀行	0.331%	1.393%	0.237	87.2%
自動車・輸送機	0.152%	1.462%	0.104	12.8%
情報通信・サービス他	0.057%	0.872%	0.065	0.0%
金融(除く銀行)	0.038%	1.239%	0.031	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.025%	0.951%	0.026	0.0%
機械	0.024%	1.119%	0.022	0.0%

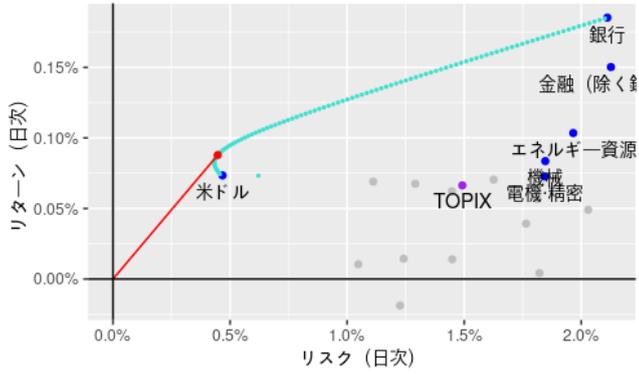
【半年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.078%	1.395%	0.056	—
銀行	0.082%	2.641%	0.031	0.0%
小売	0.078%	1.396%	0.056	99.7%
情報通信・サービス他	0.026%	1.659%	0.015	0.0%
建設・資材	0.025%	1.842%	0.014	0.0%
運輸・物流	0.008%	1.501%	0.005	0.3%
鉄鋼・非鉄	-0.000%	2.006%	0.000	0.0%

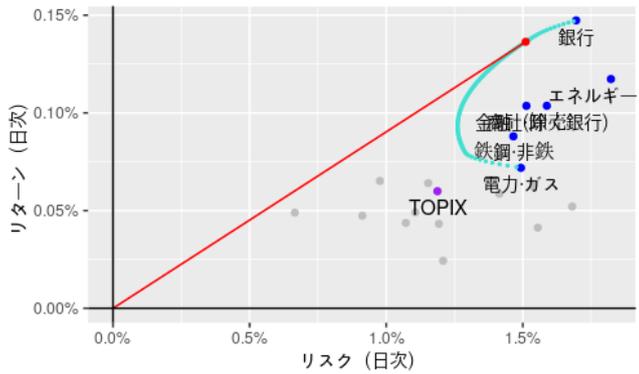
- 備考 (1) グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。
 (2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.088%	0.447%	0.196	—
銀行	0.185%	2.111%	0.088	12.9%
金融 (除く銀行)	0.150%	2.127%	0.071	0.0%
エネルギー資源	0.103%	1.966%	0.053	0.0%
機械	0.084%	1.847%	0.045	0.0%
米ドル	0.073%	0.468%	0.157	87.1%
電機・精密	0.073%	1.844%	0.039	0.0%

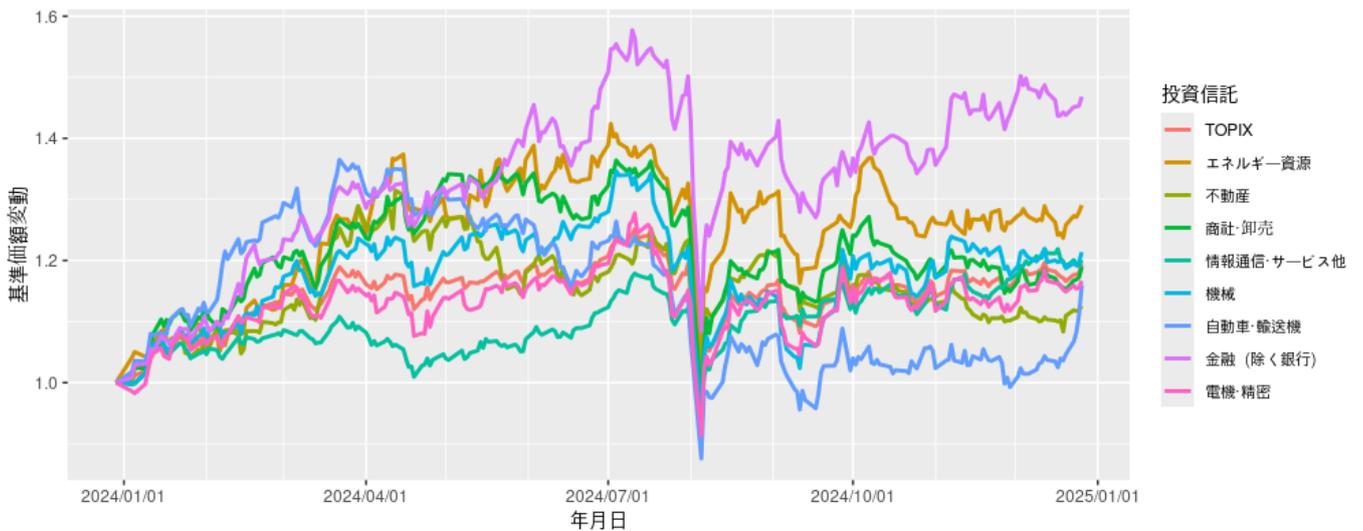
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.136%	1.511%	0.090	—
銀行	0.147%	1.695%	0.087	69.1%
エネルギー資源	0.117%	1.823%	0.064	22.5%
金融 (除く銀行)	0.104%	1.588%	0.065	0.0%
商社・卸売	0.104%	1.513%	0.068	6.8%
鉄鋼・非鉄	0.088%	1.465%	0.060	0.0%
電力・ガス	0.072%	1.493%	0.048	1.6%

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。