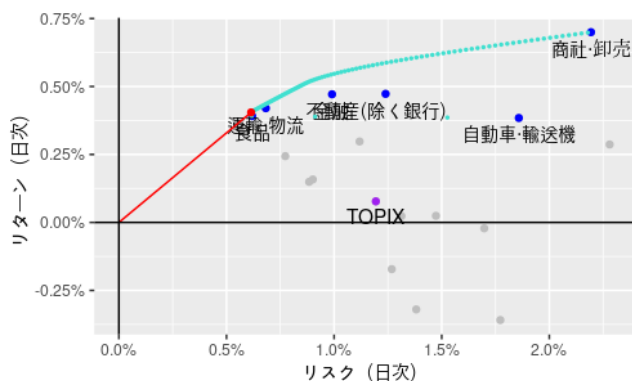


## TOPIX17 シリーズ (+米ドル) を使った効率的ポートフォリオ

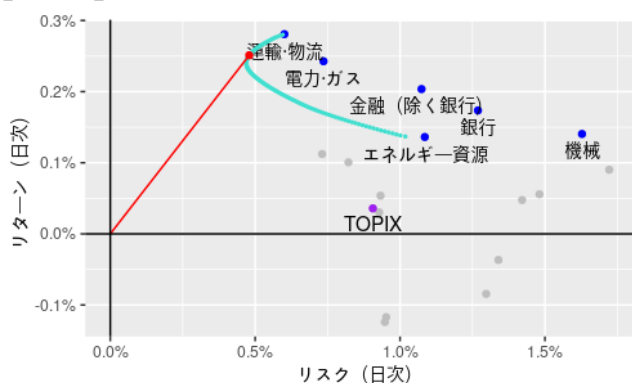
2025年3月8日

### 【半月】



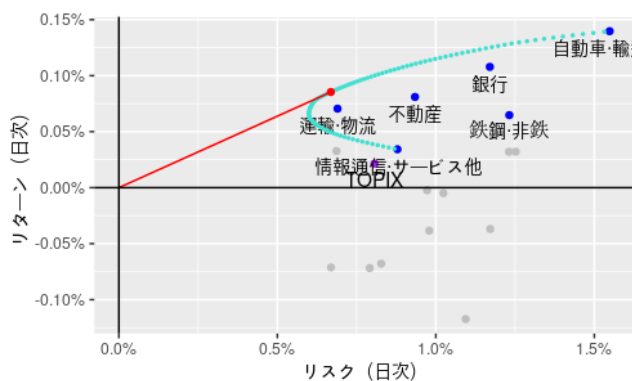
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.405%	0.614%	0.659	—
商社・卸売	0.700%	2.194%	0.319	0.0%
金融(除く銀行)	0.473%	1.239%	0.382	6.6%
不動産	0.471%	0.990%	0.476	0.0%
運輸・物流	0.420%	0.683%	0.615	28.4%
食品	0.391%	0.619%	0.632	65.0%
自動車・輸送機	0.384%	1.858%	0.207	0.0%

### 【一ヶ月】



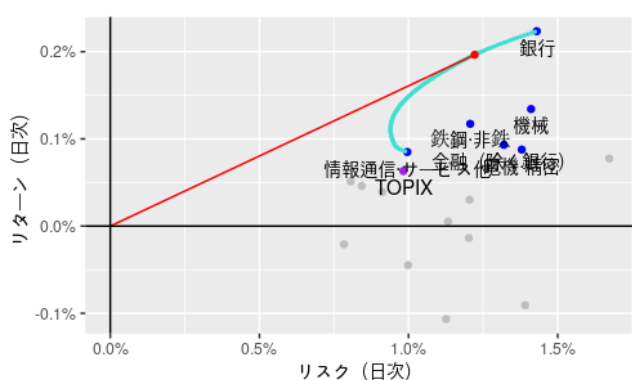
TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.251%	0.480%	0.524	—
運輸・物流	0.281%	0.601%	0.467	66.2%
電力・ガス	0.243%	0.736%	0.330	18.1%
金融(除く銀行)	0.204%	1.074%	0.190	0.0%
銀行	0.174%	1.269%	0.137	0.0%
機械	0.140%	1.628%	0.086	0.0%
エネルギー資源	0.136%	1.085%	0.125	15.7%

### 【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	0.085%	0.669%	0.128	—
自動車・輸送機	0.140%	1.548%	0.090	5.4%
銀行	0.108%	1.170%	0.092	22.4%
不動産	0.081%	0.934%	0.087	30.1%
運輸・物流	0.071%	0.690%	0.102	34.9%
鉄鋼・非鉄	0.065%	1.232%	0.053	7.2%
情報通信・サービス他	0.034%	0.879%	0.039	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	0.196%	1.222%	0.161	—
銀行	0.224%	1.430%	0.156	74.6%
機械	0.134%	1.411%	0.095	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.117%	1.207%	0.097	25.4%
金融(除く銀行)	0.093%	1.320%	0.071	0.0%
電機・精密	0.088%	1.380%	0.064	0.0%
情報通信・サービス他	0.085%	0.996%	0.085	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。

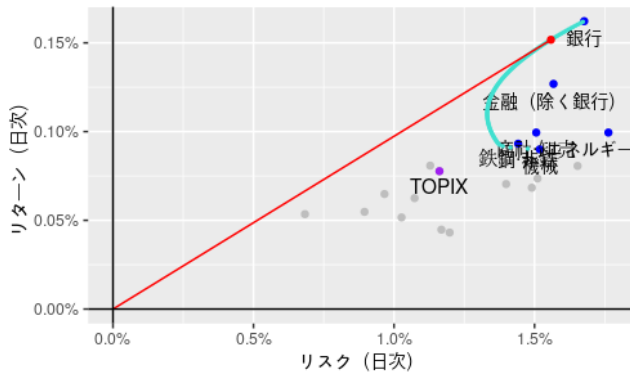
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】

計算できませんでした。

TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	-	-	-	—
-	-	-	-	—
-	-	-	-	—
-	-	-	-	—
-	-	-	-	—
-	-	-	-	—

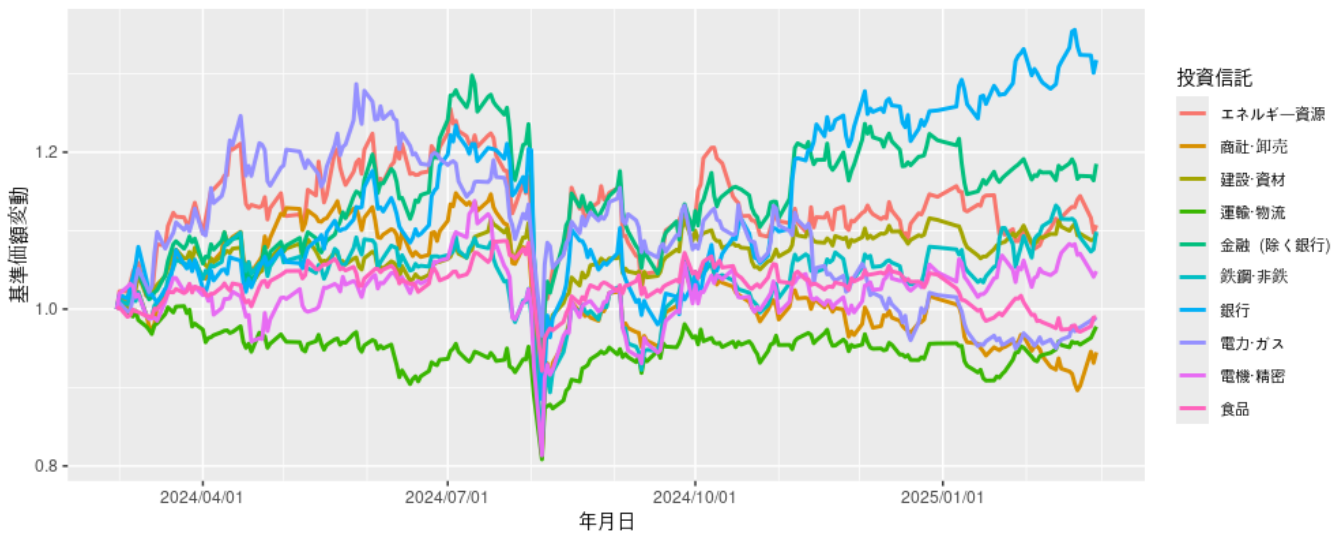
【三年】



TOPIX17	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.152%	1.558%	0.097	—
銀行	0.162%	1.677%	0.097	81.7%
金融 (除く銀行)	0.127%	1.568%	0.081	5.7%
エネルギー資源	0.099%	1.763%	0.056	3.3%
商社・卸売	0.099%	1.506%	0.066	0.0%
鉄鋼・非鉄	0.093%	1.442%	0.065	9.2%
機械	0.090%	1.519%	0.059	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。