

現在保有している投資信託のポートフォリオ

2024年5月11日

銘柄 期間	NASDAQ100			TOPIX			JPX 日経 400		
	リターン	リスク	t 値	リターン	リスク	t 値	リターン	リスク	t 値
半月	0.560%	1.855%	0.302	0.230%	1.102%	0.209	0.291%	1.210%	0.241
一ヶ月	0.138%	1.516%	0.091	-0.030%	1.239%	-0.024	0.007%	1.281%	0.006
四半期	0.108%	1.198%	0.090	0.130%	1.023%	0.127	0.145%	1.054%	0.137
半年	0.179%	1.116%	0.160	0.142%	0.910%	0.157	0.153%	0.938%	0.163
一年	0.193%	1.151%	0.168	0.122%	0.924%	0.132	0.127%	0.953%	0.133
三年	0.103%	1.526%	0.067	0.062%	1.000%	0.062	0.064%	1.015%	0.063

銘柄 期間	電機・精密			機械			自動車・輸送機		
	リターン	リスク	t 値	リターン	リスク	t 値	リターン	リスク	t 値
半月	0.204%	1.646%	0.124	0.689%	1.871%	0.369	0.122%	1.610%	0.076
一ヶ月	-0.076%	1.759%	-0.043	-0.041%	1.771%	-0.023	-0.274%	1.526%	-0.179
四半期	0.077%	1.357%	0.057	0.221%	1.413%	0.156	0.126%	1.468%	0.086
半年	0.152%	1.231%	0.123	0.209%	1.276%	0.164	0.170%	1.489%	0.114
一年	0.106%	1.209%	0.088	0.140%	1.287%	0.109	0.206%	1.490%	0.138
三年	0.055%	1.348%	0.041	0.064%	1.345%	0.048	0.096%	1.446%	0.066

銘柄 期間	銀行			金融 (除く銀行)			商社・卸売		
	リターン	リスク	t 値	リターン	リスク	t 値	リターン	リスク	t 値
半月	0.124%	1.048%	0.118	0.243%	1.497%	0.162	0.286%	1.708%	0.168
一ヶ月	0.011%	1.265%	0.008	0.028%	1.694%	0.017	0.127%	1.549%	0.082
四半期	0.280%	1.482%	0.189	0.320%	1.536%	0.209	0.305%	1.356%	0.225
半年	0.199%	1.447%	0.138	0.247%	1.317%	0.187	0.214%	1.294%	0.166
一年	0.212%	1.468%	0.145	0.214%	1.265%	0.169	0.198%	1.348%	0.147
三年	0.129%	1.390%	0.093	0.110%	1.242%	0.089	0.132%	1.307%	0.101

銘柄 期間	日本高配当株式			コモディティ			ゴールド		
	リターン	リスク	t 値	リターン	リスク	t 値	リターン	リスク	t 値
半月	0.106%	0.981%	0.108	0.008%	0.785%	0.010	0.064%	0.937%	0.068
一ヶ月	-0.012%	1.055%	-0.012	0.105%	0.672%	0.157	0.132%	1.176%	0.113
四半期	0.127%	0.909%	0.140	0.183%	0.725%	0.252	0.305%	0.892%	0.342
半年	0.121%	0.843%	0.143	0.046%	0.812%	0.057	0.173%	0.828%	0.209
一年	0.118%	0.860%	0.137	0.077%	0.823%	0.094	0.118%	0.767%	0.153
三年	0.065%	0.919%	0.070	0.077%	1.286%	0.060	0.081%	0.817%	0.100

備考 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。

現在保有する投資信託の基準価額の変動



備考 一年前を 1.00 として直近一年間の価額変動を示す。