

現在保有している投資信託のポートフォリオ

2024年5月18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	0.740%	0.943%	0.785	0.076%	0.620%	0.123	0.117%	0.716%	0.163
一ヶ月	0.379%	1.338%	0.284	0.148%	1.075%	0.138	0.194%	1.133%	0.171
四半期	0.131%	1.185%	0.111	0.095%	0.958%	0.099	0.109%	0.989%	0.110
半年	0.167%	1.093%	0.153	0.129%	0.901%	0.143	0.138%	0.929%	0.149
一年	0.185%	1.145%	0.161	0.110%	0.920%	0.120	0.115%	0.949%	0.121
三年	0.106%	1.523%	0.070	0.063%	0.993%	0.063	0.064%	1.008%	0.064

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	0.184%	1.136%	0.162	0.467%	1.200%	0.389	-0.495%	0.908%	-0.545
一ヶ月	0.218%	1.725%	0.126	0.296%	1.654%	0.179	-0.231%	1.515%	-0.152
四半期	0.077%	1.302%	0.059	0.213%	1.354%	0.157	0.035%	1.428%	0.025
半年	0.138%	1.201%	0.115	0.209%	1.275%	0.164	0.119%	1.505%	0.079
一年	0.095%	1.195%	0.079	0.136%	1.282%	0.106	0.182%	1.495%	0.122
三年	0.060%	1.342%	0.045	0.070%	1.336%	0.053	0.087%	1.446%	0.060

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	0.200%	0.984%	0.203	-0.002%	1.331%	-0.002	-0.154%	1.147%	-0.134
一ヶ月	0.217%	1.080%	0.201	0.179%	1.379%	0.130	0.305%	1.340%	0.228
四半期	0.230%	1.451%	0.159	0.155%	1.308%	0.119	0.234%	1.304%	0.180
半年	0.189%	1.441%	0.131	0.238%	1.323%	0.180	0.208%	1.294%	0.161
一年	0.200%	1.470%	0.136	0.197%	1.258%	0.157	0.187%	1.348%	0.139
三年	0.126%	1.390%	0.091	0.104%	1.238%	0.084	0.136%	1.301%	0.105

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	-0.092%	0.652%	-0.141	0.166%	0.711%	0.233	0.277%	0.817%	0.339
一ヶ月	0.045%	0.931%	0.048	0.121%	0.704%	0.171	0.054%	0.937%	0.058
四半期	0.068%	0.855%	0.079	0.212%	0.738%	0.288	0.337%	0.890%	0.378
半年	0.096%	0.835%	0.114	0.063%	0.801%	0.079	0.178%	0.834%	0.213
一年	0.100%	0.858%	0.116	0.080%	0.820%	0.097	0.123%	0.769%	0.159
三年	0.064%	0.914%	0.070	0.078%	1.283%	0.061	0.081%	0.819%	0.099

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。