

現在保有している投資信託のポートフォリオ

2024年6月15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	0.588%	0.783%	0.751	-0.093%	0.794%	-0.117	-0.061%	0.800%	-0.076
一ヶ月	0.329%	0.777%	0.423	0.028%	0.781%	0.036	0.048%	0.793%	0.061
四半期	0.237%	1.078%	0.219	0.065%	0.975%	0.067	0.086%	1.002%	0.086
半年	0.230%	1.083%	0.212	0.148%	0.883%	0.168	0.161%	0.911%	0.176
一年	0.162%	1.102%	0.147	0.085%	0.911%	0.094	0.088%	0.937%	0.094
三年	0.106%	1.524%	0.069	0.058%	0.996%	0.058	0.060%	1.011%	0.059

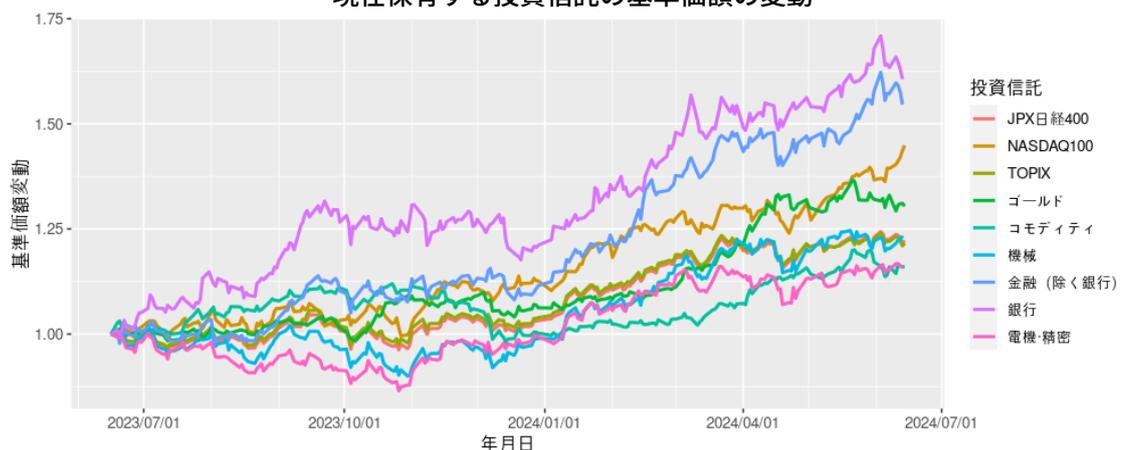
銘柄 期間	電機・精密			機械			リターン	リスク	t 値
	リターン	リスク	t 値	リターン	リスク	t 値			
半月	0.108%	0.921%	0.117	0.124%	0.997%	0.124	%	%	
一ヶ月	0.110%	0.907%	0.121	0.015%	1.019%	0.015	%	%	
四半期	0.094%	1.257%	0.075	0.152%	1.310%	0.116	%	%	
半年	0.150%	1.164%	0.129	0.222%	1.227%	0.181	%	%	
一年	0.067%	1.180%	0.057	0.093%	1.260%	0.074	%	%	
三年	0.052%	1.344%	0.039	0.072%	1.333%	0.054	%	%	

銘柄 期間	銀行			金融 (除く銀行)			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	-0.485%	1.418%	-0.342	-0.214%	1.765%	-0.121	%	%	
一ヶ月	0.056%	1.334%	0.042	0.305%	1.385%	0.220	%	%	
四半期	0.163%	1.356%	0.120	0.190%	1.407%	0.135	%	%	
半年	0.252%	1.405%	0.179	0.297%	1.361%	0.218	%	%	
一年	0.204%	1.488%	0.137	0.186%	1.289%	0.145	%	%	
三年	0.135%	1.395%	0.097	0.114%	1.251%	0.091	%	%	

銘柄 期間	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	-0.090%	1.123%	-0.080	-0.118%	1.281%	-0.092	%	%	
一ヶ月	0.011%	1.109%	0.010	-0.078%	1.137%	-0.069	%	%	
四半期	0.175%	0.882%	0.199	0.194%	1.076%	0.181	%	%	
半年	0.137%	0.787%	0.174	0.182%	0.889%	0.205	%	%	
一年	0.070%	0.851%	0.083	0.114%	0.826%	0.138	%	%	
三年	0.075%	1.287%	0.058	0.077%	0.837%	0.092	%	%	

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。