銘柄	NASDAQ100(7%)			S&P500(6%)					
期間	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	0.370%	0.766%	0.483	0.211%	0.620%	0.340	%	%	
一ヶ月	0.228%	0.675%	0.338	0.177%	0.539%	0.329	%	%	
四半期	0.226%	0.886%	0.256	0.202%	0.736%	0.275	%	%	
半年	0.195%	2.062%	0.095	0.143%	1.777%	0.081	%	%	
一年	0.119%	1.806%	0.066	0.091%	1.509%	0.060	%	%	
三年	0.115%	1.565%	0.074	0.089%	1.272%	0.070	%	%	
<u></u>	宇宙開発 (5%)			ドローン (5%)			フィンテック (7%)		
期間	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	0.673%	1.301%	0.517	0.672%	1.173%	0.573	1.544%	1.001%	1.542
一ヶ月	0.469%	1.197%	0.392	0.418%	1.007%	0.415	0.840%	1.263%	0.665
四半期	0.374%	1.289%	0.290	0.359%	1.552%	0.231	0.561%	1.531%	0.367
半年	0.301%	2.057%	0.146	0.235%	2.061%	0.114	0.326%	2.311%	0.141
一年	0.219%	1.948%	0.112	0.157%	1.937%	0.081	0.213%	2.205%	0.097
三年	0.118%	1.553%	0.076	0.095%	1.622%	0.058	0.130%	2.089%	0.062
	-						-		
 銘柄	 商社・卸売 (8%)		銀行 (12%)			스패 (I	公人组织	F07)	
シロロコ	间红	* エロヤクピ(0フ	(o)	亚文	[] (1 <i>27</i> 0)		並際 ()	除く銀行、	5%)
期間	リターン	・即元 (8) リスク	o) t値	リターン	リスク	t 値	サターン	味く戯打、 リスク	5%) t値
	リターン	`	′	リターン	. ,	t値 0.038	リターン		
期間		リスク	t 值		リスク			リスク	t 値
期間 ———— 半月	リターン 0.210%	リスク 0.853%	t値 0.246	リターン 0.043%	リスク	0.038	リターン -0.027%	リスク 0.920%	t値 -0.029
期間 半月 一ヶ月	リターン 0.210% 0.303%	リスク 0.853% 0.936%	t値 0.246 0.324	リターン 0.043% 0.032%	リスク 1.127% 1.269%	0.038 0.025	$ \begin{array}{ c c c c c } \hline $	リスク 0.920% 1.114%	t値 -0.029 -0.044
期間 半月 一ヶ月 四半期	リターン 0.210% 0.303% 0.284%	リスク 0.853% 0.936% 0.982%	t値 0.246 0.324 0.290	リターン 0.043% 0.032% 0.258%	リスク 1.127% 1.269% 1.526%	0.038 0.025 0.169	$ \begin{array}{ c c c } \hline y \not S - \not \\ \hline -0.027\% \\ -0.049\% \\ \hline 0.191\% \\ \end{array} $	リスク 0.920% 1.114% 1.091%	t値 -0.029 -0.044 0.175
期間 半月 一ヶ月 四半期 半年	リターン 0.210% 0.303% 0.284% 0.179%	リスク 0.853% 0.936% 0.982% 1.565%	t値 0.246 0.324 0.290 0.114	リターン 0.043% 0.032% 0.258% 0.112%	リスク 1.127% 1.269% 1.526% 2.416%	0.038 0.025 0.169 0.046	リターン -0.027% -0.049% 0.191% 0.102%	リスク 0.920% 1.114% 1.091% 2.064%	t値 -0.029 -0.044 0.175 0.050
期間 半月 一ヶ月 四半期 半年 一年	リターン 0.210% 0.303% 0.284% 0.179% 0.108%	リスク 0.853% 0.936% 0.982% 1.565% 1.398%	t値 0.246 0.324 0.290 0.114 0.077	リターン 0.043% 0.032% 0.258% 0.112% 0.198%	リスク 1.127% 1.269% 1.526% 2.416% 1.993%	0.038 0.025 0.169 0.046 0.099	リターン -0.027% -0.049% 0.191% 0.102% 0.117%	リスク 0.920% 1.114% 1.091% 2.064% 1.721%	t値 -0.029 -0.044 0.175 0.050 0.068
期間 半月 一ヶ月 四半期 半年 一年	リターン 0.210% 0.303% 0.284% 0.179% 0.108% 0.124%	リスク 0.853% 0.936% 0.982% 1.565% 1.398%	t値 0.246 0.324 0.290 0.114 0.077	リターン 0.043% 0.032% 0.258% 0.112% 0.198%	リスク 1.127% 1.269% 1.526% 2.416% 1.993%	0.038 0.025 0.169 0.046 0.099	リターン -0.027% -0.049% 0.191% 0.102% 0.117%	リスク 0.920% 1.114% 1.091% 2.064% 1.721%	t値 -0.029 -0.044 0.175 0.050 0.068
期間 半月 一ヶ月 四半年 一年 三年	リターン 0.210% 0.303% 0.284% 0.179% 0.108% 0.124%	リスク 0.853% 0.936% 0.982% 1.565% 1.398% 1.534%	t値 0.246 0.324 0.290 0.114 0.077	リターン 0.043% 0.032% 0.258% 0.112% 0.198% 0.165%	リスク 1.127% 1.269% 1.526% 2.416% 1.993%	0.038 0.025 0.169 0.046 0.099	リターン -0.027% -0.049% 0.191% 0.102% 0.117%	リスク 0.920% 1.114% 1.091% 2.064% 1.721%	t値 -0.029 -0.044 0.175 0.050 0.068
期間 半月 一 ア 平 年 一 三 一 銘柄	リターン 0.210% 0.303% 0.284% 0.179% 0.108% 0.124%	リスク 0.853% 0.936% 0.982% 1.565% 1.398% 1.534%	t値 0.246 0.324 0.290 0.114 0.077 0.081	リターン 0.043% 0.032% 0.258% 0.112% 0.198% 0.165%	リスク 1.127% 1.269% 1.526% 2.416% 1.993% 1.887%	0.038 0.025 0.169 0.046 0.099 0.088	リターン -0.027% -0.049% 0.191% 0.102% 0.117% 0.125%	リスク 0.920% 1.114% 1.091% 2.064% 1.721% 1.701%	t値 -0.029 -0.044 0.175 0.050 0.068 0.074
期 半 _ケ 半 ケ 一 三 銘期 が	リターン 0.210% 0.303% 0.284% 0.179% 0.108% 0.124%	リスク 0.853% 0.936% 0.982% 1.565% 1.398% 1.534% 後 械(9%) リスク	t値 0.246 0.324 0.290 0.114 0.077 0.081	リターン 0.043% 0.032% 0.258% 0.112% 0.198% 0.165%	リスク 1.127% 1.269% 1.526% 2.416% 1.993% 1.887%	0.038 0.025 0.169 0.046 0.099 0.088	リターン -0.027% -0.049% 0.191% 0.102% 0.117% 0.125%	リスク 0.920% 1.114% 1.091% 2.064% 1.721% 1.701%	t値 -0.029 -0.044 0.175 0.050 0.068 0.074
期 半 ₋ 四 半 一 三 銘 期 半 4	リターン 0.210% 0.303% 0.284% 0.179% 0.108% 0.124%	リスク 0.853% 0.936% 0.982% 1.565% 1.398% 1.534% 後械(9%) リスク 0.899%	t値 0.246 0.324 0.290 0.114 0.077 0.081 t値	リターン 0.043% 0.032% 0.258% 0.112% 0.198% 0.165%	リスク 1.127% 1.269% 1.526% 2.416% 1.993% 1.887%	0.038 0.025 0.169 0.046 0.099 0.088	リターン -0.027% -0.049% 0.191% 0.102% 0.117% 0.125% リターン	リスク 0.920% 1.114% 1.091% 2.064% 1.721% 1.701% リスク %	t値 -0.029 -0.044 0.175 0.050 0.068 0.074
期半 一 四 半 一 三銘期半 テ月 月 期 年 年 年柄 間月 月	リターン 0.210% 0.303% 0.284% 0.179% 0.108% 0.124%	リスク 0.853% 0.936% 0.982% 1.565% 1.398% 1.534% 後械 (9%) リスク 0.899% 1.045%	t値 0.246 0.324 0.290 0.114 0.077 0.081 t値 0.463 -0.055	リターン 0.043% 0.032% 0.258% 0.112% 0.198% 0.165%	リスク 1.127% 1.269% 1.526% 2.416% 1.993% 1.887% リスク %	0.038 0.025 0.169 0.046 0.099 0.088	リターン -0.027% -0.049% 0.191% 0.102% 0.117% 0.125%	リスク 0.920% 1.114% 1.091% 2.064% 1.721% 1.701%	t値 -0.029 -0.044 0.175 0.050 0.068 0.074
期 半 一 四 半 一 三 銘 期 半 っ 平 年 年 柄 間 月 月 期	リターン 0.210% 0.303% 0.284% 0.179% 0.108% 0.124% りターン 0.417% -0.058% 0.182%	リスク 0.853% 0.936% 0.982% 1.565% 1.398% 1.534% 沙 スク 0.899% 1.045% 1.129%	t値 0.246 0.324 0.290 0.114 0.077 0.081 t値 0.463 -0.055 0.162	リターン 0.043% 0.032% 0.258% 0.112% 0.198% 0.165% リターン % % %	リスク 1.127% 1.269% 1.526% 2.416% 1.993% 1.887% リスク % %	0.038 0.025 0.169 0.046 0.099 0.088	リターン -0.027% -0.049% 0.191% 0.102% 0.117% 0.125% リターン % %	リスク 0.920% 1.114% 1.091% 2.064% 1.721% 1.701% リスク % %	t値 -0.029 -0.044 0.175 0.050 0.068 0.074
期 半 一 四 半 一 三 銘期 半 一 四 半 日 三 銘期 半 ヶ 半 年 年 柄間 月 月 期 年	リターン 0.210% 0.303% 0.284% 0.179% 0.108% 0.124% りターン 0.417% -0.058% 0.182% 0.139%	リスク 0.853% 0.936% 0.982% 1.565% 1.398% 1.534% 後械(9%) リスク 0.899% 1.045% 1.129% 1.864%	t値 0.246 0.324 0.290 0.114 0.077 0.081 t値 0.463 -0.055 0.162 0.075	リターン 0.043% 0.032% 0.258% 0.112% 0.198% 0.165% リターン % % % %	リスク 1.127% 1.269% 1.526% 2.416% 1.993% 1.887% リスク % %	0.038 0.025 0.169 0.046 0.099 0.088	リターン -0.027% -0.049% 0.191% 0.102% 0.117% 0.125% リターン % % %	リスク 0.920% 1.114% 1.091% 2.064% 1.721% 1.701% リスク % % % %	t値 -0.029 -0.044 0.175 0.050 0.068 0.074

備考 (1) 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。

(2) 銘柄欄の%は運用資産中の割合をしめす。





備考 一年前を 1.00 として直近一年間の価額変動を示す。