| 銘柄 | NASDAQ100 (8%) | | | S&P500 (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 | 0.465% | 1.347% | 0.345 | 0.294% | 0.908% | 0.323 | % | % | |
| 一ヶ月 | 0.250% | 1.178% | 0.212 | 0.163% | 0.878% | 0.186 | % | % | |
| 四半期 | 0.233% | 0.878% | 0.265 | 0.190% | 0.684% | 0.279 | % | % | |
| 半年 | 0.273% | 1.096% | 0.250 | 0.221% | 0.933% | 0.237 | % | % | |
| 一年 | 0.101% | 1.756% | 0.058 | 0.068% | 1.457% | 0.047 | % | % | |
| 三年 | 0.136% | 1.511% | 0.090 | 0.098% | 1.229% | 0.080 | % | % | |
| | | | | | | | | | |
| 銘柄 | 宇宙開発(6%) | | | ドローン (5%) | | | フィンテック(8%) | | |
| 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 | 0.335% | 2.033% | 0.165 | -0.061% | 1.709% | -0.036 | 0.816% | 3.153% | 0.259 |
| 一ヶ月 | 0.055% | 1.810% | 0.031 | -0.440% | 1.704% | -0.258 | 0.283% | 2.888% | 0.098 |
| 四半期 | 0.323% | 1.446% | 0.223 | 0.238% | 1.531% | 0.155 | 0.577% | 2.081% | 0.277 |
| 半年 | 0.400% | 1.445% | 0.277 | 0.309% | 1.574% | 0.196 | 0.457% | 1.925% | 0.237 |
| 一年 | 0.189% | 1.940% | 0.098 | 0.105% | 1.939% | 0.054 | 0.176% | 2.257% | 0.078 |
| 三年 | 0.126% | 1.536% | 0.082 | 0.096% | 1.615% | 0.059 | 0.156% | 2.078% | 0.075 |
| | | | | | | - | | | |
| | | | | | | | | | |
| 銘柄 | AI テ | ック(17% | %) | クリーン | /テック | (3%) | 日経半導 | | 0%) |
| 銘柄 期間 | AI テ リターン | ック(17% リスク | る) t値 | クリーン リターン | /テック リスク | (3%) t値 | 日経半辺 | 算体株(1 リスク | 0%) t値 |
| | 1 | | | | | | | | |
| 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 |
| 期間 ——— 半月 | リターン 0.708% | リスク 2.844% | t値 0.249 | リターン 1.667% | リスク 4.002% | t値 0.417 | リターン 1.202% | リスク 3.205% | t値 0.375 |
| 期間 半月 一ヶ月 四半期 半年 | リターン 0.708% 0.141% | リスク 2.844% 2.260% | t値 0.249 0.063 | リターン 1.667% 0.924% | リスク 4.002% 3.384% | t値 0.417 0.273 | リターン 1.202% 0.365% | リスク 3.205% 2.722% | t値 0.375 0.134 |
| 期間 半月 一ヶ月 四半期 半年 一年 | リターン 0.708% 0.141% 0.514% | リスク 2.844% 2.260% 1.698% | t値 0.249 0.063 0.302 | リターン 1.667% 0.924% 0.906% | リスク 4.002% 3.384% 2.411% | t値 0.417 0.273 0.376 | リターン 1.202% 0.365% 0.637% | リスク 3.205% 2.722% 2.276% | t値 0.375 0.134 0.280 |
| 期間 半月 一ヶ月 四半期 半年 | リターン 0.708% 0.141% 0.514% 0.467% | リスク 2.844% 2.260% 1.698% 1.800% | t値 0.249 0.063 0.302 0.260 | リターン 1.667% 0.924% 0.906% 0.721% | リスク 4.002% 3.384% 2.411% 2.391% | t値 0.417 0.273 0.376 0.302 | リターン 1.202% 0.365% 0.637% 0.452% | リスク 3.205% 2.722% 2.276% 1.995% | t値 0.375 0.134 0.280 0.227 |
| 期間 半月 一ヶ月 四半期 半年 一年 | リターン 0.708% 0.141% 0.514% 0.467% 0.220% | リスク 2.844% 2.260% 1.698% 1.800% 2.427% | t値 0.249 0.063 0.302 0.260 | リターン 1.667% 0.924% 0.906% 0.721% 0.281% | リスク 4.002% 3.384% 2.411% 2.391% 2.636% | t値 0.417 0.273 0.376 0.302 0.106 | リターン 1.202% 0.365% 0.637% 0.452% | リスク 3.205% 2.722% 2.276% 1.995% | t値 0.375 0.134 0.280 0.227 |
| 期間 半月 一ヶ月 四半年 一三年 一銘柄 | リターン 0.708% 0.141% 0.514% 0.467% 0.220% | リスク 2.844% 2.260% 1.698% 1.800% 2.427% — | t値 0.249 0.063 0.302 0.260 | リターン 1.667% 0.924% 0.906% 0.721% 0.281% 0.072% | リスク 4.002% 3.384% 2.411% 2.391% 2.636% 2.557% | t値 0.417 0.273 0.376 0.302 0.106 | リターン 1.202% 0.365% 0.637% 0.452% 0.164% — | リスク 3.205% 2.722% 2.276% 1.995% 2.375% 一 | t値 0.375 0.134 0.280 0.227 0.069 |
| 期間 半月 一ヶ月 四半年 一年 三年 | リターン 0.708% 0.141% 0.514% 0.467% 0.220% | リスク 2.844% 2.260% 1.698% 1.800% 2.427% | t値 0.249 0.063 0.302 0.260 | リターン 1.667% 0.924% 0.906% 0.721% 0.281% 0.072% | リスク 4.002% 3.384% 2.411% 2.391% 2.636% 2.557% | t値 0.417 0.273 0.376 0.302 0.106 | リターン 1.202% 0.365% 0.637% 0.452% 0.164% — | リスク 3.205% 2.722% 2.276% 1.995% 2.375% — | t値 0.375 0.134 0.280 0.227 0.069 |
| 期間 半月 一ヶ月 四半年 一三年 一銘柄 | リターン 0.708% 0.141% 0.514% 0.467% 0.220% — | リスク 2.844% 2.260% 1.698% 1.800% 2.427% — | t値 0.249 0.063 0.302 0.260 0.091 | リターン 1.667% 0.924% 0.906% 0.721% 0.281% 0.072% | リスク 4.002% 3.384% 2.411% 2.391% 2.636% 2.557% | t値 0.417 0.273 0.376 0.302 0.106 0.028 | リターン 1.202% 0.365% 0.637% 0.452% 0.164% — | リスク 3.205% 2.722% 2.276% 1.995% 2.375% 一 | t値 0.375 0.134 0.280 0.227 0.069 |
| 期 半 _一 四 半 一 三 銘期 半 _一 | リターン 0.708% 0.141% 0.514% 0.467% 0.220% 銀行 リターン | リスク 2.844% 2.260% 1.698% 1.800% 2.427% — | t値 0.249 0.063 0.302 0.260 0.091 — | リターン 1.667% 0.924% 0.906% 0.721% 0.281% 0.072% | リスク 4.002% 3.384% 2.411% 2.391% 2.636% 2.557% 或 (10%) リスク | t値 0.417 0.273 0.376 0.302 0.106 0.028 | リターン 1.202% 0.365% 0.637% 0.452% 0.164% — 鉄鋼・ | リスク 3.205% 2.722% 2.276% 1.995% 2.375% - 非鉄(49 リスク | t値 0.375 0.134 0.280 0.227 0.069 — |
| 期半 一 四 半 一 三銘期半 一 四月 月 期年 年 年柄間月 月 期 | リターン 0.708% 0.141% 0.514% 0.467% 0.220% 銀行 リターン 0.439% 0.206% 0.204% | リスク 2.844% 2.260% 1.698% 1.800% 2.427% 「プ (12%) リスク 1.264% | t値 0.249 0.063 0.302 0.260 0.091 — t値 0.347 | リターン 1.667% 0.924% 0.906% 0.721% 0.281% 0.072% 機材 リターン 0.155% | リスク 4.002% 3.384% 2.411% 2.391% 2.636% 2.557% 域 (10%) リスク 1.702% 1.720% 1.515% | t値 0.417 0.273 0.376 0.302 0.106 0.028 t値 0.091 | リターン 1.202% 0.365% 0.637% 0.452% 0.164% 鉄鋼・ リターン 1.308% | リスク 3.205% 2.722% 2.276% 1.995% 2.375% 一 非鉄(45 リスク 2.308% | t値 0.375 0.134 0.280 0.227 0.069 — *********************************** |
| 期 半 - 四 半 - 三 銘期 半 - 四 半 - 三 銘期 半 - 四 半 析間 月 月 期 年 | リターン 0.708% 0.141% 0.514% 0.467% 0.220% 銀行 リターン 0.439% 0.206% | リスク 2.844% 2.260% 1.698% 1.800% 2.427% — 「ブ (12%) リスク 1.264% 1.858% | t値 0.249 0.063 0.302 0.260 0.091 — t値 0.347 0.111 | リターン 1.667% 0.924% 0.906% 0.721% 0.281% 0.072% 機材 リターン 0.155% 0.259% | リスク 4.002% 3.384% 2.411% 2.391% 2.636% 2.557% 域 (10%) リスク 1.702% 1.720% | t値 0.417 0.273 0.376 0.302 0.106 0.028 t値 0.091 0.151 0.151 0.225 | リターン 1.202% 0.365% 0.637% 0.452% 0.164% 鉄鋼・ リターン 1.308% 0.691% 0.538% 0.461% | リスク 3.205% 2.722% 2.276% 1.995% 2.375% 一 非鉄(49 リスク 2.308% 2.055% | t値 0.375 0.134 0.280 0.227 0.069 — %) t値 0.567 0.336 |
| 期 半 一四半一三 銘期 半 一四半一間 月月期年年年 柄間 月月期年年 | リターン 0.708% 0.141% 0.514% 0.467% 0.220% 銀行 リターン 0.439% 0.206% 0.204% | リスク 2.844% 2.260% 1.698% 1.800% 2.427% — 一 デ (12%) リスク 1.264% 1.858% 1.653% | t値 0.249 0.063 0.302 0.260 0.091 — t値 0.347 0.111 0.123 | リターン 1.667% 0.924% 0.906% 0.721% 0.281% 0.072% 機材 リターン 0.155% 0.259% 0.228% | リスク 4.002% 3.384% 2.411% 2.391% 2.636% 2.557% 域 (10%) リスク 1.702% 1.720% 1.515% | t値 0.417 0.273 0.376 0.302 0.106 0.028 t値 0.091 0.151 0.151 | リターン 1.202% 0.365% 0.637% 0.452% 0.164% 鉄鋼・ リターン 1.308% 0.691% 0.538% | リスク 3.205% 2.722% 2.276% 1.995% 2.375% - - 非鉄(49 リスク 2.308% 2.055% 1.572% | t値 0.375 0.134 0.280 0.227 0.069 — %) t値 0.567 0.336 0.342 |
| 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 0.708% 0.141% 0.514% 0.467% 0.220% 銀行 リターン 0.439% 0.206% 0.204% 0.254% | リスク 2.844% 2.260% 1.698% 1.800% 2.427% ブ (12%) リスク 1.264% 1.858% 1.653% 1.477% | t値 0.249 0.063 0.302 0.260 0.091 — t値 0.347 0.111 0.123 0.172 | リターン 1.667% 0.924% 0.906% 0.721% 0.281% 0.072% 機材 リターン 0.155% 0.259% 0.228% 0.284% | リスク 4.002% 3.384% 2.411% 2.391% 2.636% 2.557% 或 (10%) リスク 1.702% 1.720% 1.515% 1.260% | t値 0.417 0.273 0.376 0.302 0.106 0.028 t値 0.091 0.151 0.151 0.225 | リターン 1.202% 0.365% 0.637% 0.452% 0.164% 鉄鋼・ リターン 1.308% 0.691% 0.538% 0.461% | リスク 3.205% 2.722% 2.276% 1.995% 2.375% 非鉄(4 リスク 2.308% 2.055% 1.572% 1.354% | t値 0.375 0.134 0.280 0.227 0.069 — %) t値 0.567 0.336 0.342 0.340 |

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。