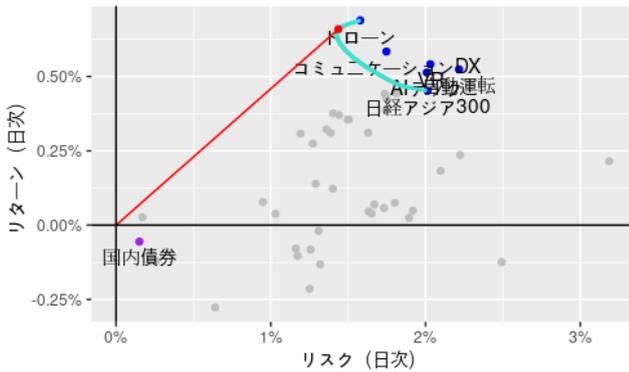


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

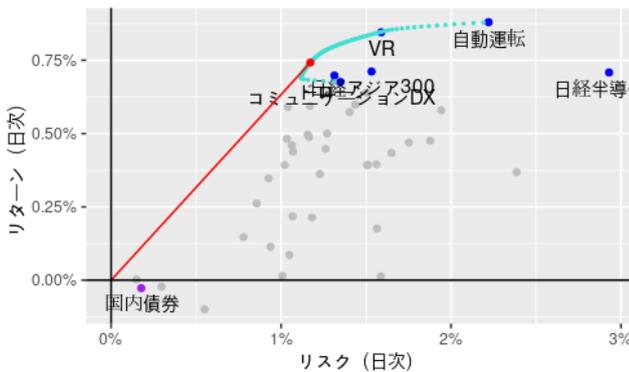
2024年10月12日

【半月】



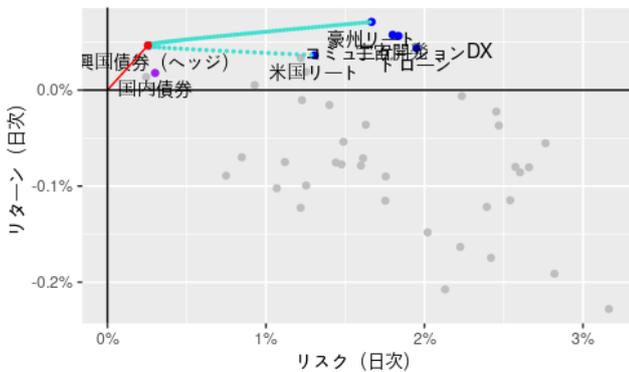
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.659%	1.436%	0.459	—
ドローン	0.689%	1.578%	0.437	71.8%
コミュニケーション DX	0.584%	1.747%	0.334	28.2%
VR	0.541%	2.031%	0.267	0.0%
自動運転	0.524%	2.216%	0.237	0.0%
AI テック	0.513%	2.008%	0.256	0.0%
日経アジア 300	0.452%	2.013%	0.225	0.0%

【一ヶ月】



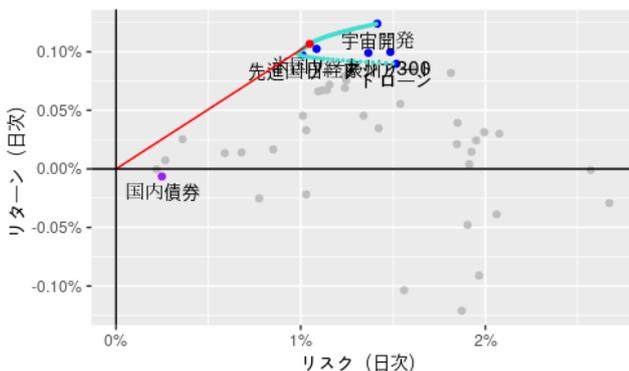
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.742%	1.172%	0.633	—
自動運転	0.880%	2.221%	0.396	0.0%
VR	0.845%	1.590%	0.532	31.1%
日経アジア 300	0.712%	1.532%	0.464	8.8%
日経半導体株	0.708%	2.930%	0.242	0.0%
ドローン	0.698%	1.314%	0.531	47.5%
コミュニケーション DX	0.676%	1.350%	0.501	12.6%

【四半期】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.047%	0.255%	0.182	—
豪州リート	0.071%	1.666%	0.043	0.0%
宇宙開発	0.058%	1.799%	0.032	0.0%
コミュニケーション DX	0.056%	1.836%	0.031	2.4%
新興国債券 (ヘッジ)	0.046%	0.262%	0.177	96.3%
ドローン	0.044%	1.950%	0.022	0.4%
米国リート	0.036%	1.307%	0.028	0.8%

【半年】

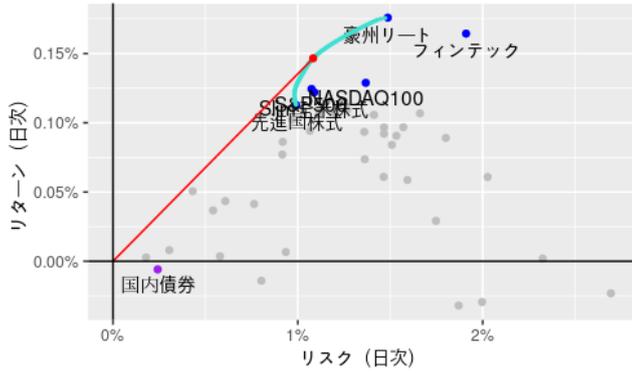


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.107%	1.049%	0.102	—
宇宙開発	0.124%	1.415%	0.088	22.8%
米国リート	0.102%	1.086%	0.094	55.3%
豪州リート	0.100%	1.486%	0.067	5.2%
日経アジア 300	0.099%	1.367%	0.072	16.7%
先進国リート	0.097%	1.009%	0.096	0.0%
ドローン	0.090%	1.518%	0.059	0.0%

備考 (1) グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

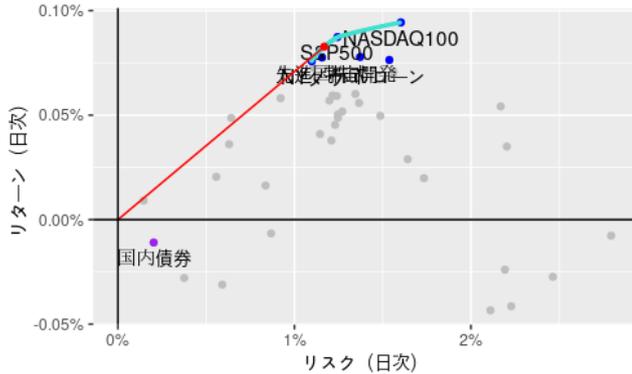
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.147%	1.083%	0.135	—
豪州リート	0.176%	1.486%	0.118	43.0%
フィンテック	0.164%	1.910%	0.086	0.0%
NASDAQ100	0.129%	1.367%	0.094	0.0%
S&P500	0.124%	1.074%	0.116	57.0%
Slim 全米株式	0.122%	1.088%	0.112	0.0%
先進国株式	0.113%	0.991%	0.114	0.0%

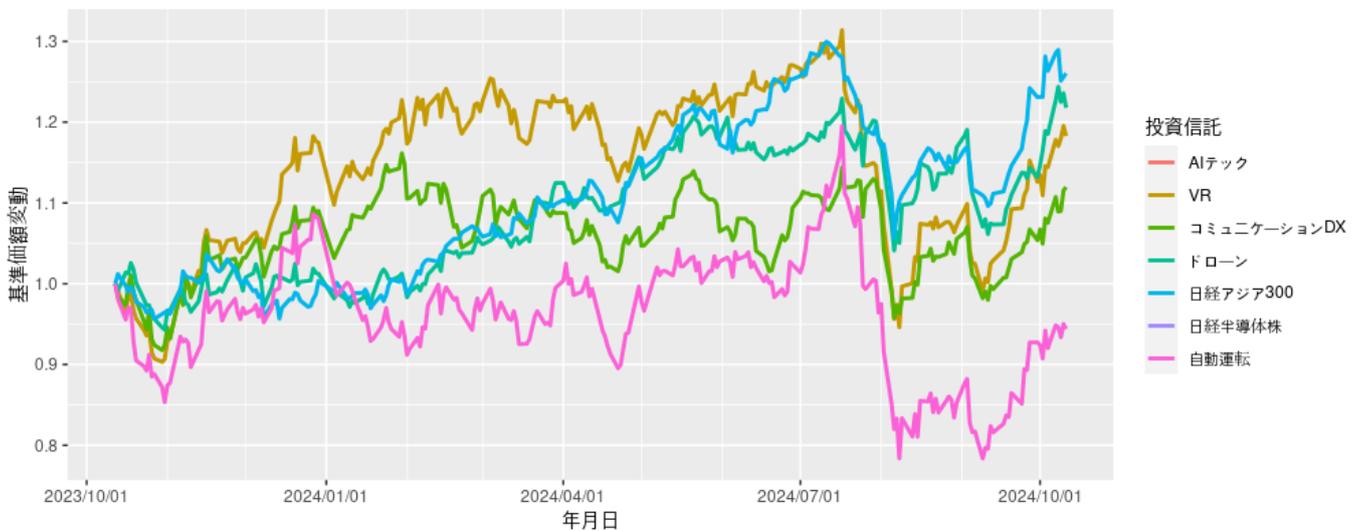
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.083%	1.169%	0.071	—
NASDAQ100	0.094%	1.603%	0.059	0.0%
S&P500	0.087%	1.244%	0.070	60.3%
宇宙開発	0.078%	1.372%	0.057	0.0%
先進国株式	0.078%	1.156%	0.067	0.0%
ドローン	0.076%	1.538%	0.050	0.0%
NY ダウ	0.076%	1.098%	0.069	39.7%

備考 (1) グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。
 (2) 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。

eMAXIS シリーズでリターンが高かった銘柄の基準価額の変動



備考 直近半月と一ヶ月でリターン上位の銘柄について一年前を1として直近一年間の価額変動を示す。