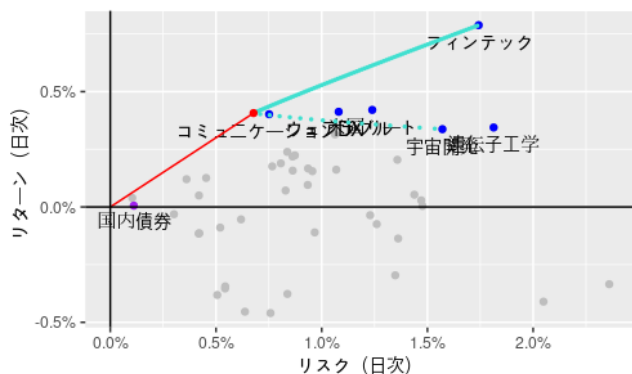


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

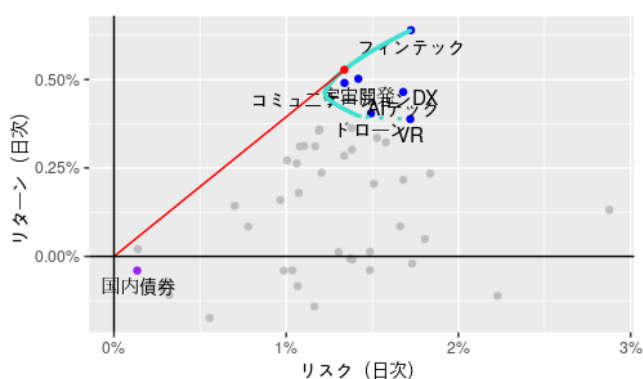
2024年10月26日

【半月】



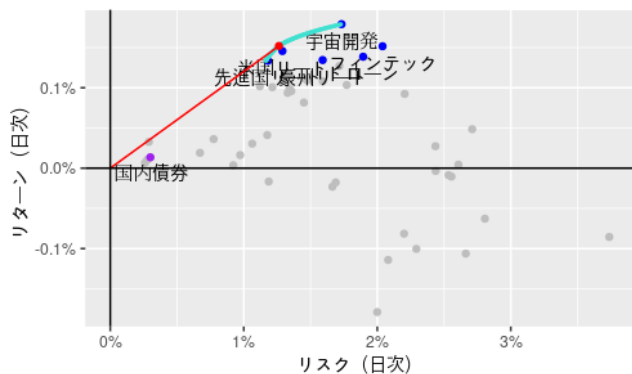
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.407%	0.678%	0.601	—
フィンテック	0.788%	1.742%	0.452	0.1%
米国リート	0.421%	1.239%	0.339	25.6%
ウェアラブル	0.413%	1.080%	0.382	0.0%
コミュニケーション DX	0.402%	0.751%	0.535	74.4%
遺伝子工学	0.345%	1.813%	0.190	0.0%
宇宙開発	0.337%	1.571%	0.215	0.0%

【一ヶ月】



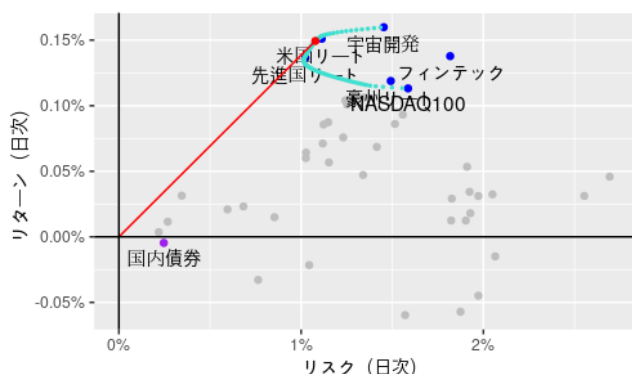
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.528%	1.338%	0.394	—
フィンテック	0.640%	1.724%	0.371	31.0%
宇宙開発	0.502%	1.419%	0.354	19.1%
コミュニケーション DX	0.490%	1.338%	0.366	37.1%
AI テック	0.465%	1.679%	0.277	0.0%
ドローン	0.404%	1.492%	0.271	12.9%
VR	0.388%	1.721%	0.226	0.0%

【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	0.152%	1.263%	0.120	—
宇宙開発	0.179%	1.732%	0.103	24.4%
フィンテック	0.152%	2.039%	0.074	0.0%
米国リート	0.146%	1.289%	0.113	58.9%
ドローン	0.139%	1.894%	0.073	0.0%
豪州リート	0.134%	1.591%	0.085	16.7%
先進国リート	0.134%	1.181%	0.113	0.0%

【半年】

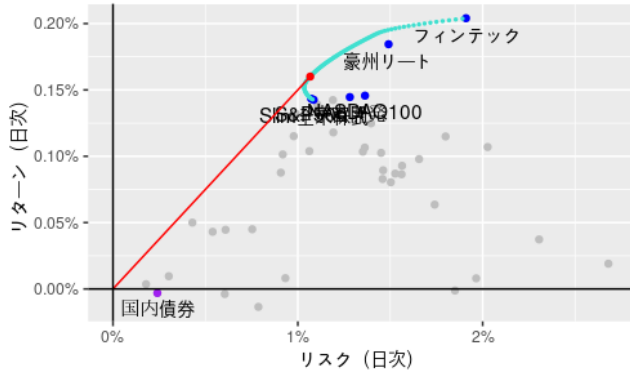


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.149%	1.078%	0.139	—
宇宙開発	0.160%	1.453%	0.110	14.3%
米国リート	0.151%	1.113%	0.136	76.6%
フィンテック	0.138%	1.818%	0.076	0.0%
先進国リート	0.136%	1.023%	0.133	0.0%
豪州リート	0.119%	1.492%	0.080	9.2%
NASDAQ100	0.113%	1.587%	0.071	0.0%

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。

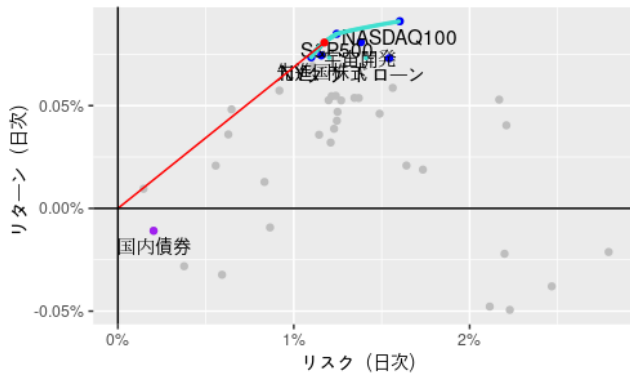
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.160%	1.067%	0.150	—
フィンテック	0.204%	1.910%	0.107	3.2%
豪州リート	0.184%	1.491%	0.124	36.0%
NASDAQ100	0.146%	1.363%	0.107	0.0%
宇宙開発	0.145%	1.281%	0.113	0.0%
S&P500	0.143%	1.072%	0.134	60.9%
Slim 全米株式	0.143%	1.086%	0.131	0.0%

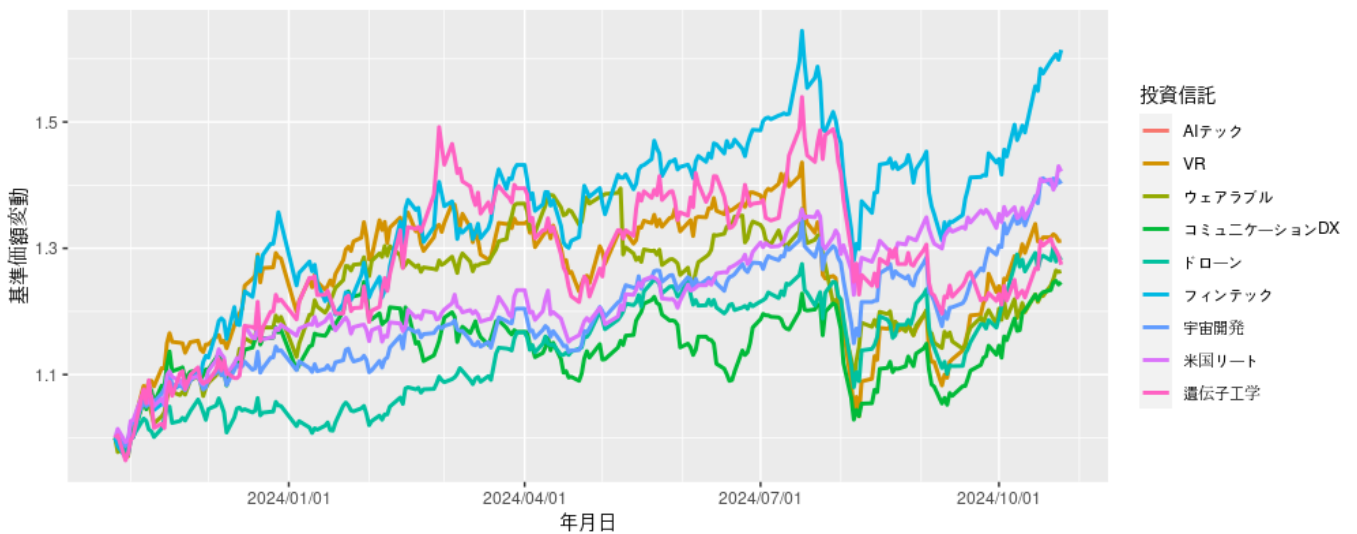
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.081%	1.174%	0.069	—
NASDAQ100	0.091%	1.603%	0.057	0.0%
S&P500	0.085%	1.244%	0.068	63.0%
宇宙開発	0.081%	1.381%	0.059	0.0%
先進国株式	0.074%	1.157%	0.064	0.0%
NYダウ	0.074%	1.099%	0.067	37.0%
ドローン	0.073%	1.543%	0.047	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。

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。