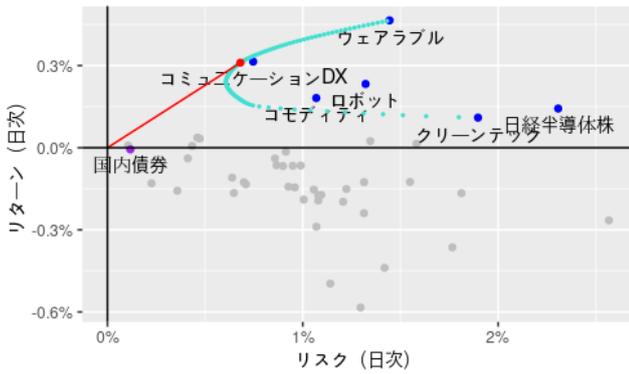


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

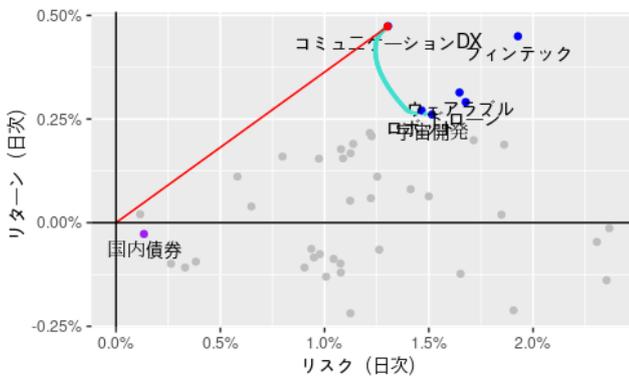
2024年11月1日

【半月】



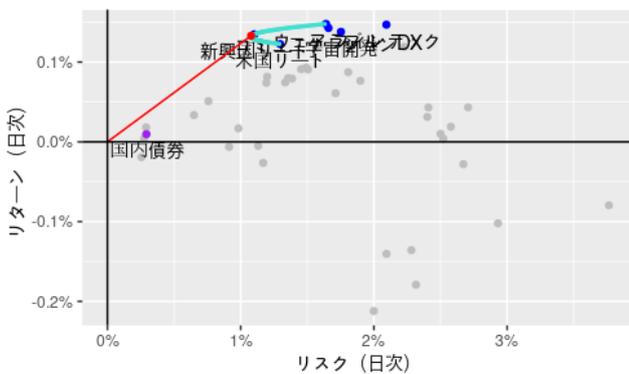
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.311%	0.680%	0.456	—
ウェアラブル	0.465%	1.444%	0.322	12.5%
コミュニケーション DX	0.314%	0.746%	0.421	76.4%
ロボット	0.233%	1.321%	0.176	0.0%
コモディティ	0.182%	1.069%	0.170	0.0%
日経半導体株	0.143%	2.307%	0.062	0.0%
クリーンテック	0.110%	1.897%	0.058	11.1%

【一ヶ月】



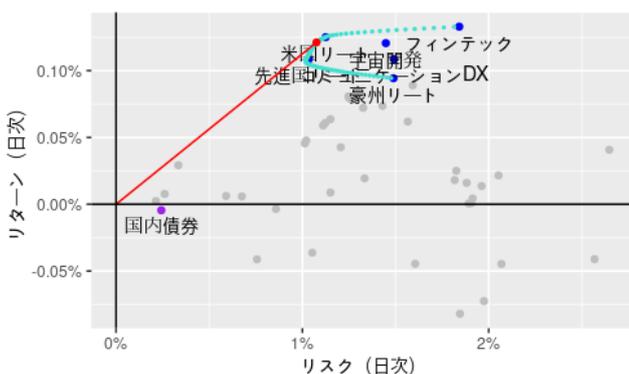
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.473%	1.302%	0.363	—
コミュニケーション DX	0.474%	1.304%	0.364	99.4%
フィンテック	0.450%	1.927%	0.233	0.0%
ウェアラブル	0.314%	1.647%	0.191	0.0%
ドローン	0.291%	1.677%	0.173	0.6%
ロボット	0.271%	1.465%	0.185	0.0%
宇宙開発	0.261%	1.515%	0.172	0.0%

【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	0.133%	1.078%	0.123	—
ウェアラブル	0.148%	1.641%	0.090	0.0%
フィンテック	0.147%	2.094%	0.070	0.0%
コミュニケーション DX	0.143%	1.659%	0.086	0.0%
宇宙開発	0.138%	1.753%	0.079	0.0%
新興国リート	0.135%	1.102%	0.122	85.7%
米国リート	0.123%	1.296%	0.095	14.3%

【半年】

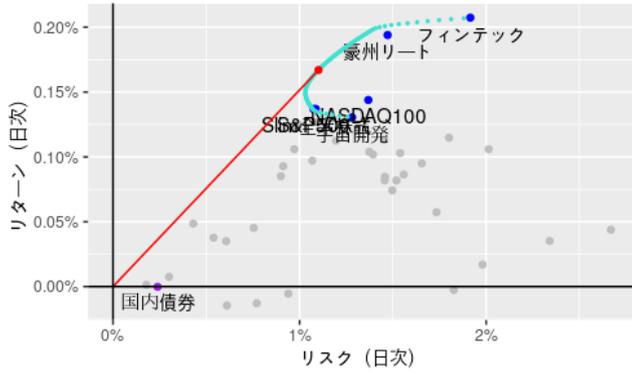


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.121%	1.076%	0.113	—
フィンテック	0.133%	1.842%	0.072	0.0%
米国リート	0.125%	1.125%	0.111	83.4%
宇宙開発	0.121%	1.448%	0.083	0.0%
先進国リート	0.109%	1.034%	0.105	0.0%
コミュニケーション DX	0.109%	1.491%	0.073	8.4%
豪州リート	0.094%	1.489%	0.063	8.2%

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。

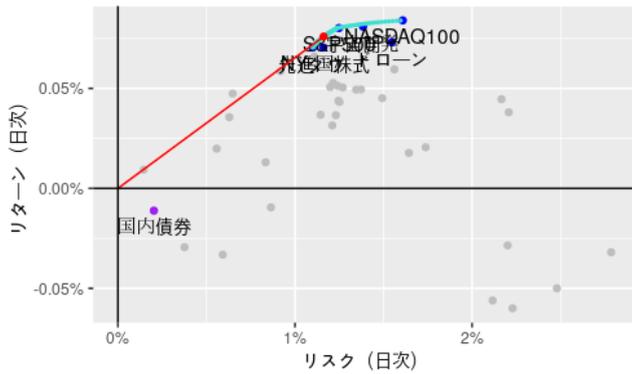
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.167%	1.102%	0.152	—
フィンテック	0.207%	1.915%	0.108	7.0%
豪州リート	0.194%	1.472%	0.132	44.1%
NASDAQ100	0.144%	1.368%	0.105	0.0%
Slim 全米株式	0.137%	1.087%	0.126	0.0%
S&P500	0.137%	1.075%	0.127	48.9%
宇宙開発	0.130%	1.282%	0.102	0.0%

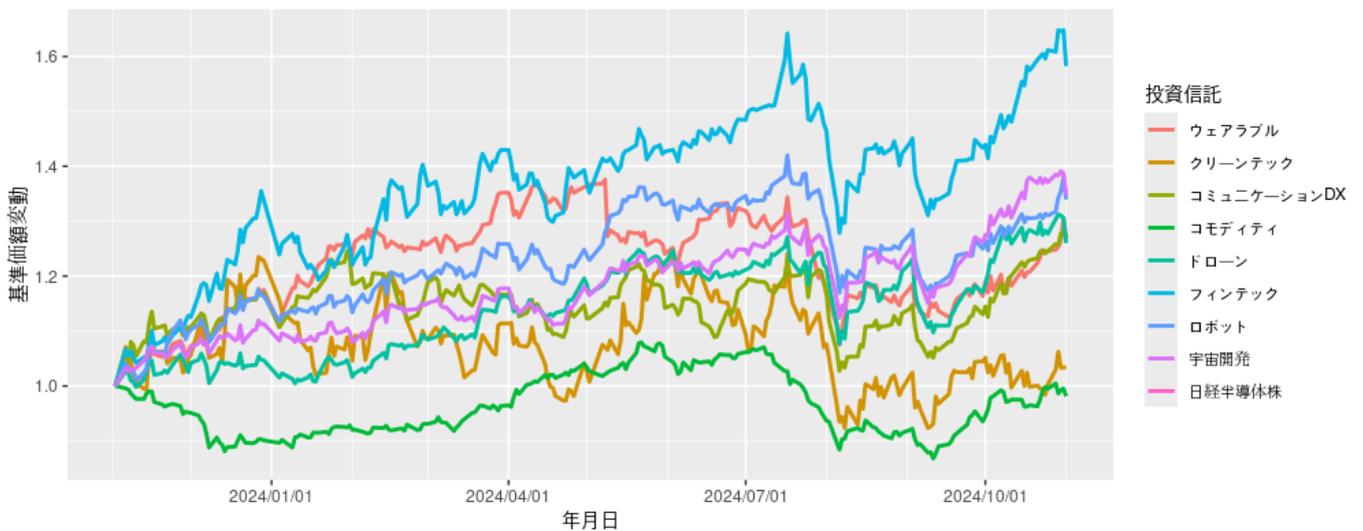
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.076%	1.162%	0.065	—
NASDAQ100	0.084%	1.609%	0.052	0.0%
宇宙開発	0.081%	1.384%	0.058	13.2%
S&P500	0.080%	1.248%	0.064	41.9%
ドローン	0.073%	1.547%	0.047	0.0%
NY ダウ	0.070%	1.101%	0.064	45.0%
先進国株式	0.070%	1.160%	0.061	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。