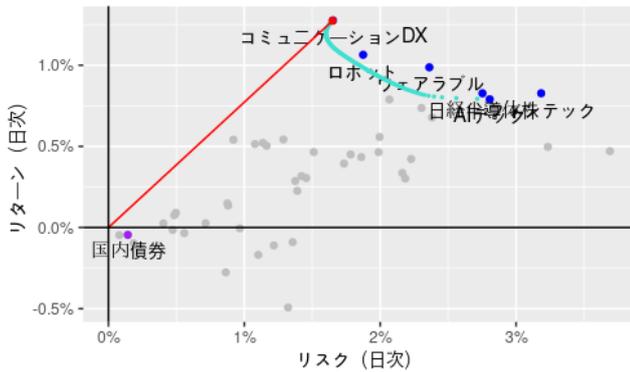


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

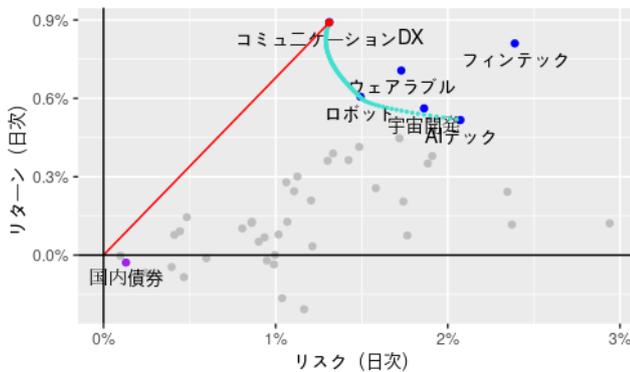
2024年11月9日

【半月】



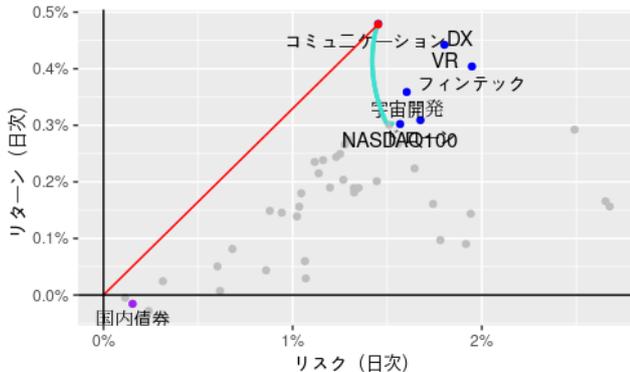
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	1.274%	1.649%	0.772	—
コミュニケーション DX	1.276%	1.652%	0.772	99.5%
ロボット	1.064%	1.874%	0.568	0.0%
ウェアラブル	0.987%	2.362%	0.418	0.0%
フィンテック	0.827%	3.185%	0.260	0.0%
日経半導体株	0.827%	2.753%	0.300	0.5%
AI テック	0.790%	2.806%	0.282	0.0%

【一ヶ月】



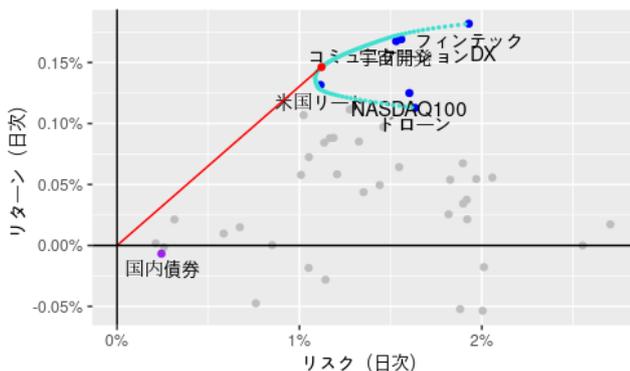
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.890%	1.311%	0.679	—
コミュニケーション DX	0.892%	1.312%	0.680	99.3%
フィンテック	0.810%	2.389%	0.339	0.0%
ウェアラブル	0.707%	1.730%	0.408	0.0%
ロボット	0.606%	1.493%	0.406	0.7%
宇宙開発	0.562%	1.862%	0.302	0.0%
AI テック	0.517%	2.073%	0.249	0.0%

【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	0.478%	1.451%	0.330	—
コミュニケーション DX	0.479%	1.452%	0.330	99.5%
VR	0.442%	1.802%	0.245	0.0%
フィンテック	0.404%	1.948%	0.207	0.0%
宇宙開発	0.359%	1.603%	0.224	0.0%
ドローン	0.309%	1.675%	0.184	0.5%
NASDAQ100	0.302%	1.568%	0.193	0.0%

【半年】

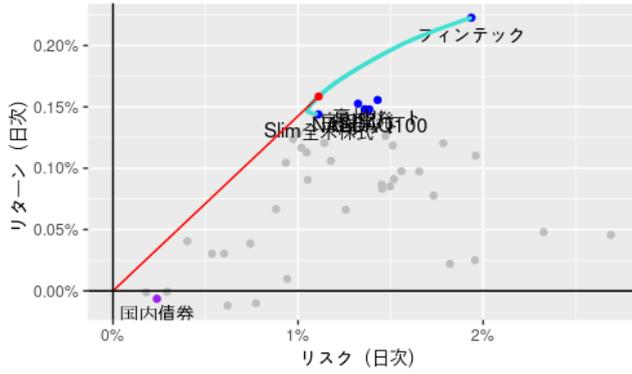


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.146%	1.121%	0.130	—
フィンテック	0.182%	1.929%	0.094	0.0%
コミュニケーション DX	0.169%	1.558%	0.108	31.3%
宇宙開発	0.168%	1.530%	0.109	8.3%
米国リート	0.132%	1.116%	0.118	60.4%
NASDAQ100	0.125%	1.603%	0.078	0.0%
ドローン	0.113%	1.634%	0.069	0.0%

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。

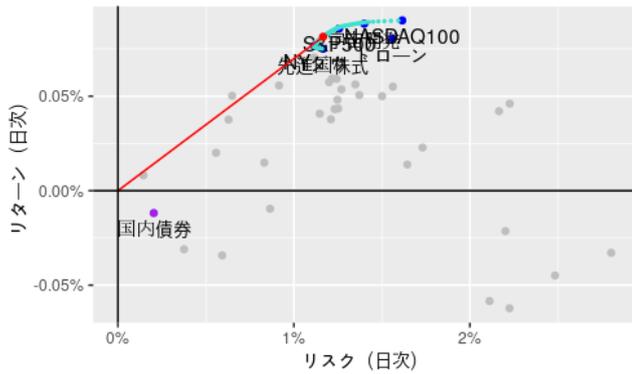
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.158%	1.111%	0.143	—
フィンテック	0.223%	1.936%	0.115	13.8%
豪州リート	0.156%	1.430%	0.109	31.8%
宇宙開発	0.153%	1.324%	0.115	0.0%
ロボット	0.148%	1.361%	0.109	0.0%
NASDAQ100	0.148%	1.385%	0.107	0.0%
Slim 全米株式	0.144%	1.110%	0.130	54.4%

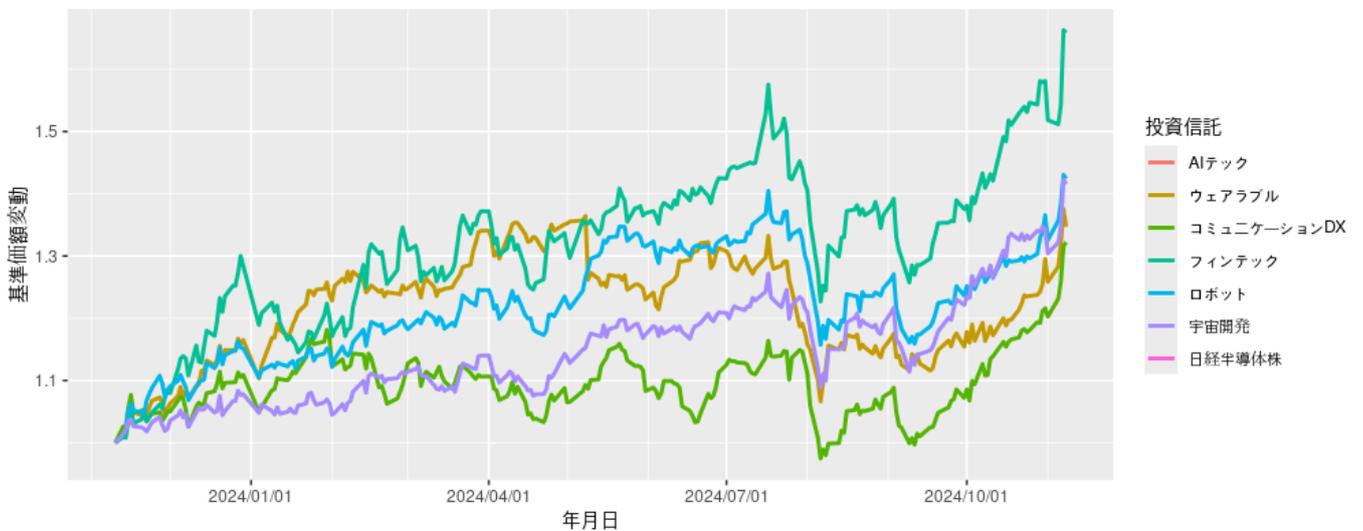
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.081%	1.166%	0.070	—
NASDAQ100	0.090%	1.616%	0.056	0.0%
宇宙開発	0.088%	1.400%	0.063	15.6%
S&P500	0.086%	1.257%	0.068	32.7%
ドローン	0.080%	1.560%	0.052	0.0%
NY ダウ	0.077%	1.116%	0.069	51.7%
先進国株式	0.075%	1.166%	0.064	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。