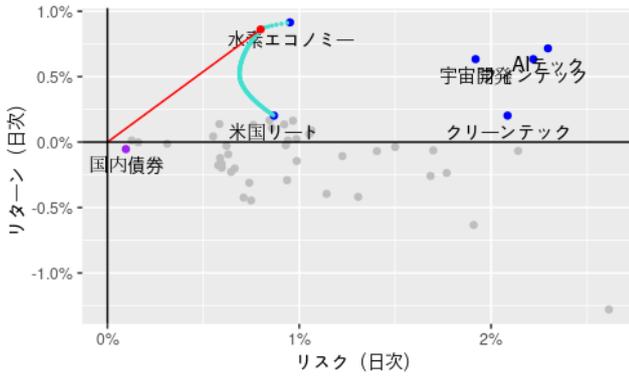


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

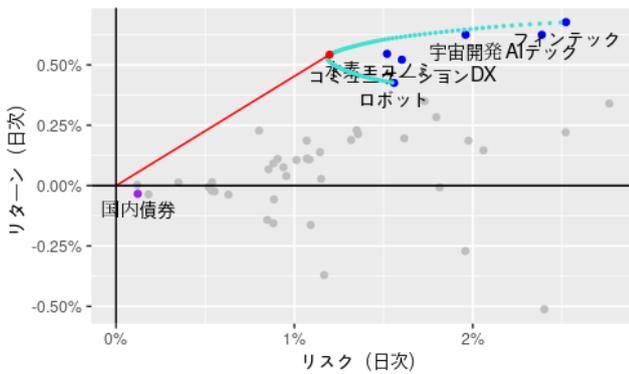
2024年11月23日

【半月】



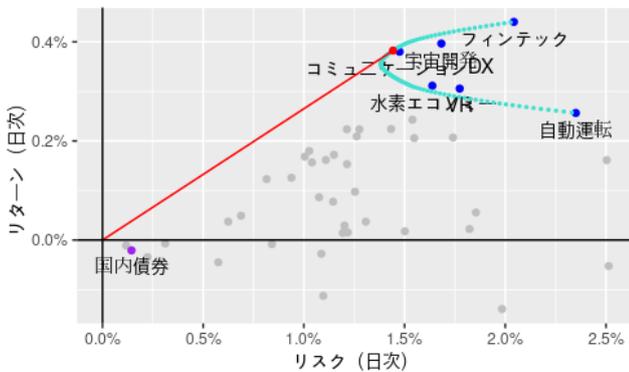
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.861%	0.798%	1.079	—
水素エコノミー	0.915%	0.952%	0.961	80.4%
AI テック	0.716%	2.297%	0.312	1.8%
宇宙開発	0.634%	1.919%	0.330	17.8%
フィンテック	0.634%	2.220%	0.285	0.0%
クリーンテック	0.203%	2.086%	0.097	0.0%
米国リート	0.202%	0.868%	0.233	0.0%

【一ヶ月】



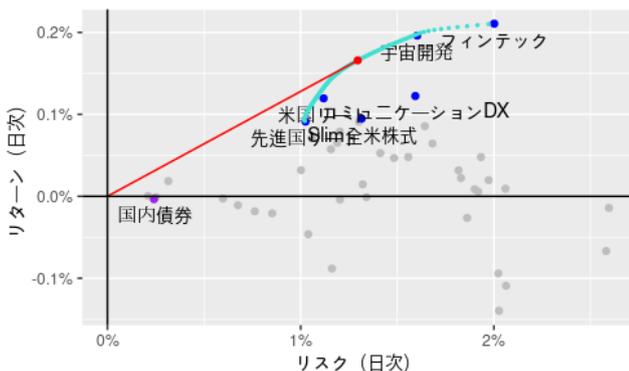
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.542%	1.197%	0.453	—
フィンテック	0.677%	2.523%	0.268	5.2%
宇宙開発	0.625%	1.960%	0.319	0.0%
AI テック	0.625%	2.387%	0.262	0.0%
水素エコノミー	0.546%	1.519%	0.359	52.8%
コミュニケーション DX	0.521%	1.602%	0.325	42.0%
ロボット	0.425%	1.559%	0.273	0.0%

【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	0.382%	1.442%	0.265	—
フィンテック	0.440%	2.043%	0.216	12.0%
宇宙開発	0.397%	1.683%	0.236	13.1%
コミュニケーション DX	0.380%	1.475%	0.258	64.7%
水素エコノミー	0.311%	1.638%	0.190	10.2%
VR	0.306%	1.774%	0.172	0.0%
自動運転	0.256%	2.350%	0.109	0.0%

【半年】

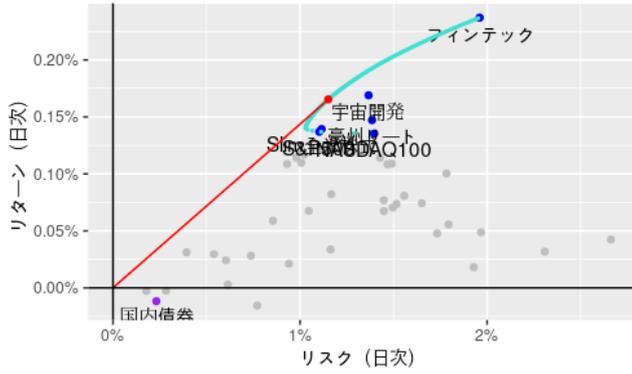


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.166%	1.295%	0.128	—
フィンテック	0.211%	2.001%	0.105	8.6%
宇宙開発	0.196%	1.603%	0.122	50.2%
コミュニケーション DX	0.122%	1.593%	0.077	0.0%
米国リート	0.120%	1.119%	0.107	41.1%
Slim 全米株式	0.095%	1.315%	0.072	0.0%
先進国リート	0.091%	1.025%	0.089	0.0%

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。

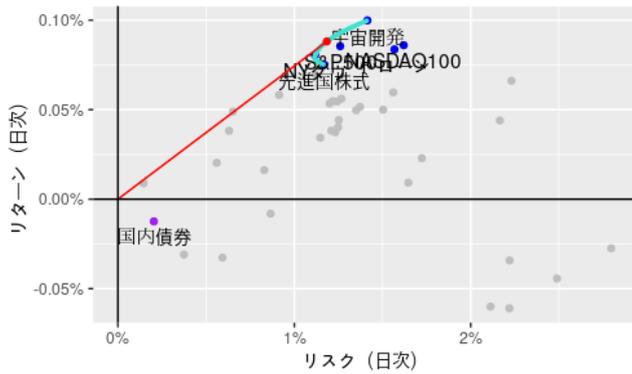
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.165%	1.151%	0.144	—
フィンテック	0.237%	1.960%	0.121	18.3%
宇宙開発	0.169%	1.367%	0.124	21.4%
豪州リート	0.147%	1.385%	0.106	31.8%
Slim 全米株式	0.139%	1.115%	0.125	0.0%
S&P500	0.137%	1.103%	0.124	28.5%
NASDAQ100	0.135%	1.396%	0.097	0.0%

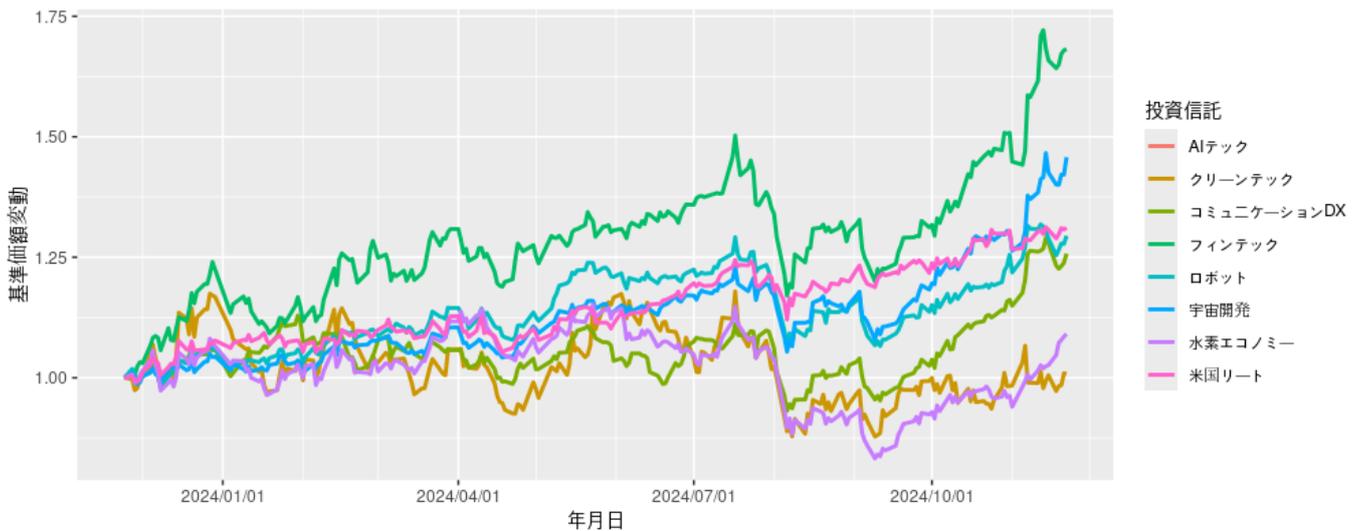
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.088%	1.184%	0.074	—
宇宙開発	0.100%	1.414%	0.071	39.7%
NASDAQ100	0.086%	1.620%	0.053	0.0%
S&P500	0.085%	1.260%	0.068	0.0%
ドローン	0.084%	1.568%	0.053	0.0%
NY ダウ	0.080%	1.118%	0.072	60.3%
先進国株式	0.075%	1.169%	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。