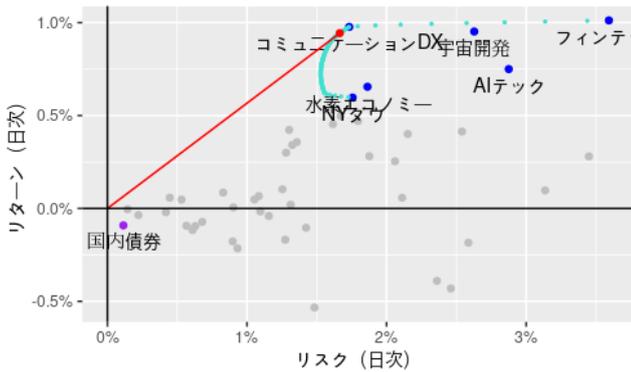


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

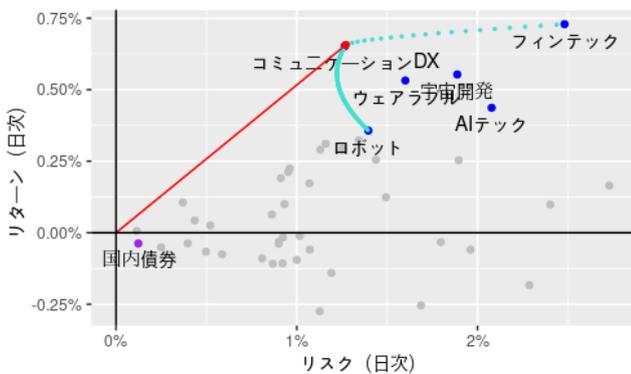
2024年11月15日

【半月】



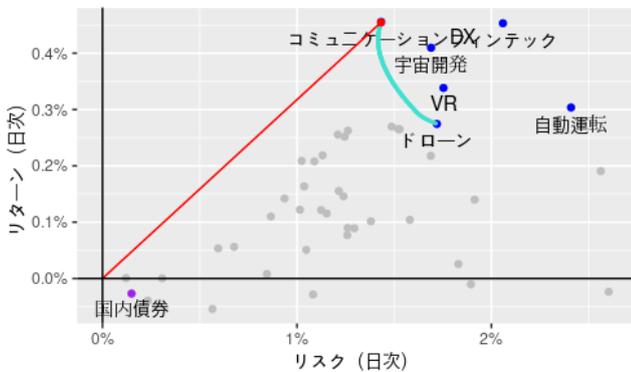
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.943%	1.665%	0.567	—
フィンテック	1.012%	3.593%	0.282	0.0%
コミュニケーション DX	0.977%	1.732%	0.564	89.6%
宇宙開発	0.952%	2.628%	0.362	0.0%
AI テック	0.750%	2.875%	0.261	0.0%
水素エコノミー	0.655%	1.863%	0.351	10.4%
NY ダウ	0.596%	1.757%	0.340	0.0%

【一ヶ月】



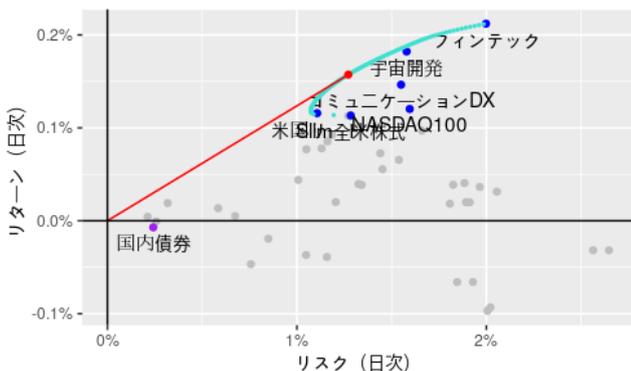
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.656%	1.271%	0.517	—
フィンテック	0.729%	2.482%	0.294	6.3%
コミュニケーション DX	0.652%	1.265%	0.515	93.7%
宇宙開発	0.553%	1.888%	0.293	0.0%
ウェアラブル	0.532%	1.601%	0.332	0.0%
AI テック	0.437%	2.078%	0.210	0.0%
ロボット	0.357%	1.396%	0.256	0.0%

【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	0.455%	1.432%	0.317	—
コミュニケーション DX	0.456%	1.433%	0.318	99.5%
フィンテック	0.453%	2.059%	0.220	0.0%
宇宙開発	0.410%	1.690%	0.242	0.0%
VR	0.338%	1.753%	0.193	0.0%
自動運転	0.304%	2.409%	0.126	0.0%
ドローン	0.274%	1.720%	0.160	0.5%

【半年】

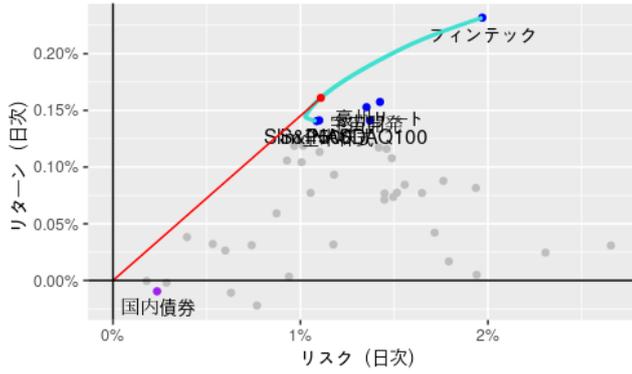


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.157%	1.271%	0.124	—
フィンテック	0.212%	1.998%	0.106	17.5%
宇宙開発	0.182%	1.579%	0.115	36.7%
コミュニケーション DX	0.146%	1.550%	0.094	0.9%
NASDAQ100	0.120%	1.595%	0.075	0.0%
米国リート	0.116%	1.107%	0.105	44.9%
Slim 全米株式	0.113%	1.284%	0.088	0.0%

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。

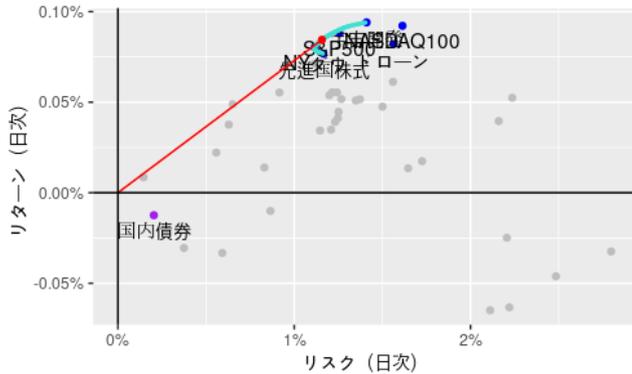
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.161%	1.109%	0.145	—
フィンテック	0.232%	1.970%	0.118	16.6%
豪州リート	0.157%	1.425%	0.111	31.8%
宇宙開発	0.153%	1.353%	0.113	0.0%
Slim 全米株式	0.141%	1.100%	0.128	0.0%
NASDAQ100	0.141%	1.372%	0.103	0.0%
S&P500	0.140%	1.087%	0.129	51.6%

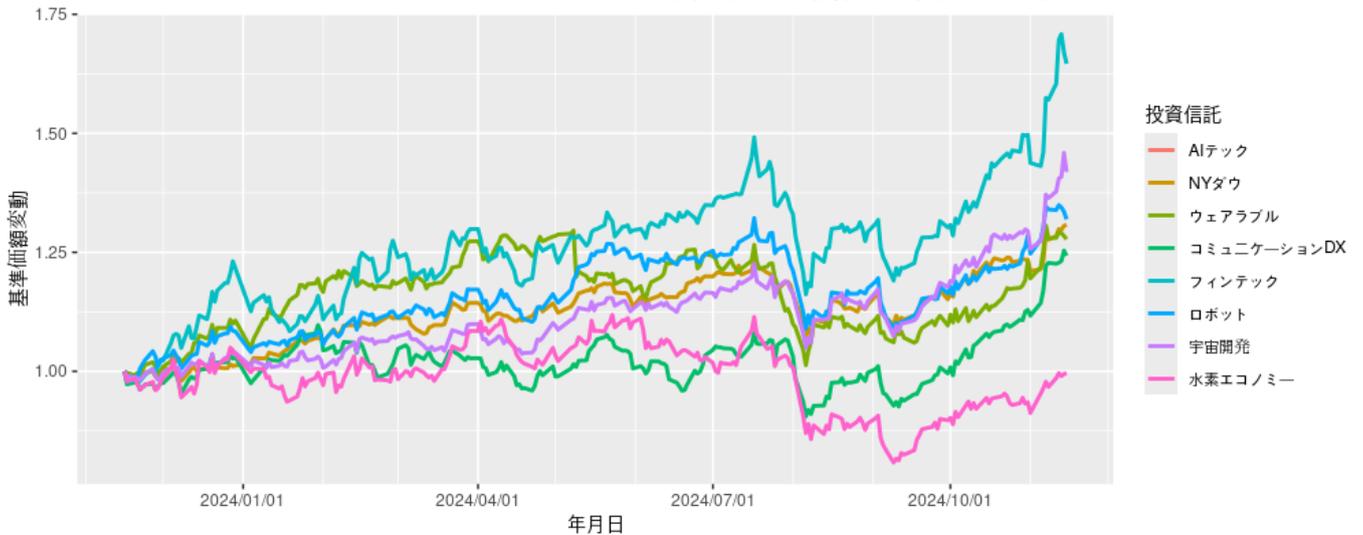
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.084%	1.157%	0.073	—
宇宙開発	0.094%	1.410%	0.067	22.0%
NASDAQ100	0.092%	1.614%	0.057	0.0%
S&P500	0.088%	1.256%	0.070	15.3%
ドローン	0.082%	1.564%	0.052	0.0%
NY ダウ	0.080%	1.116%	0.072	62.7%
先進国株式	0.077%	1.165%	0.066	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。