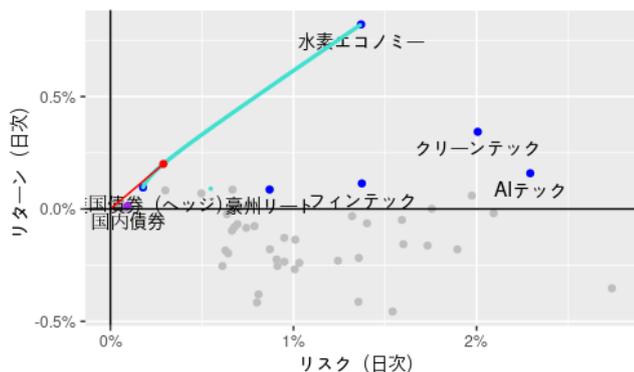


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

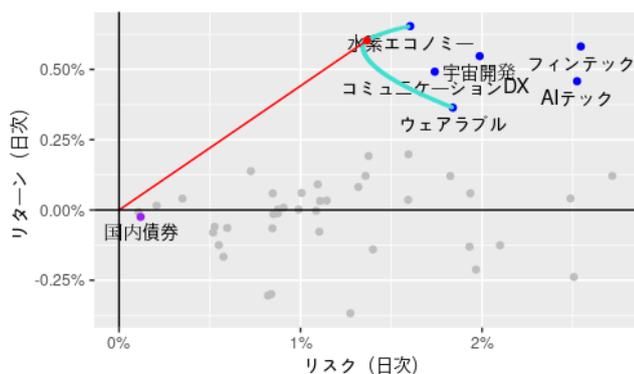
2024年11月29日

【半月】



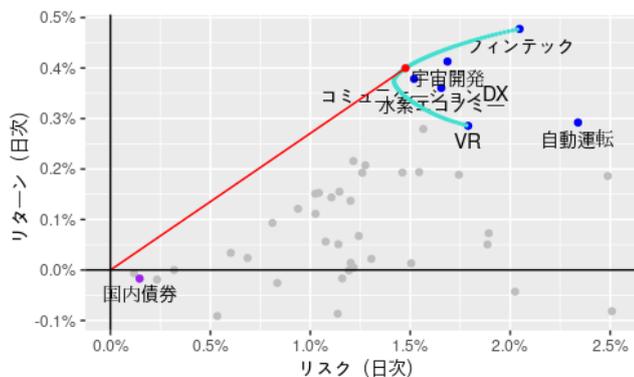
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.200%	0.289%	0.692	—
水素エコノミー	0.821%	1.369%	0.600	14.4%
クリーンテック	0.343%	2.006%	0.171	0.0%
AI テック	0.159%	2.293%	0.069	0.0%
フィンテック	0.114%	1.374%	0.083	0.0%
先進国債券（ヘッジ）	0.095%	0.178%	0.536	85.6%
豪州リート	0.086%	0.870%	0.099	0.0%

【一ヶ月】



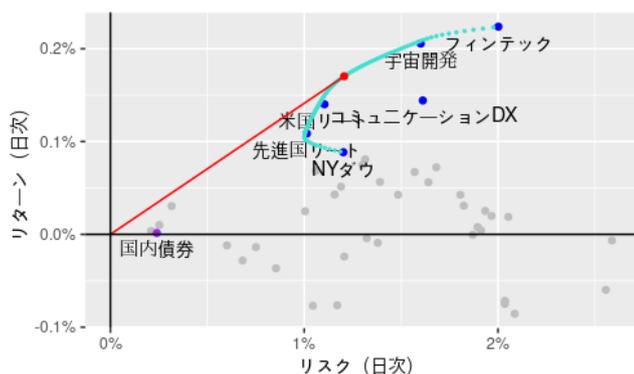
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.603%	1.366%	0.441	—
水素エコノミー	0.654%	1.604%	0.408	68.7%
フィンテック	0.582%	2.544%	0.229	0.0%
宇宙開発	0.547%	1.987%	0.275	0.0%
コミュニケーション DX	0.492%	1.740%	0.283	31.3%
AI テック	0.458%	2.524%	0.181	0.0%
ウェアラブル	0.364%	1.839%	0.198	0.0%

【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	0.400%	1.476%	0.271	—
フィンテック	0.477%	2.047%	0.233	18.9%
宇宙開発	0.413%	1.686%	0.245	18.6%
コミュニケーション DX	0.379%	1.519%	0.249	41.0%
水素エコノミー	0.360%	1.655%	0.218	21.6%
自動運転	0.292%	2.339%	0.125	0.0%
VR	0.285%	1.790%	0.160	0.0%

【半年】

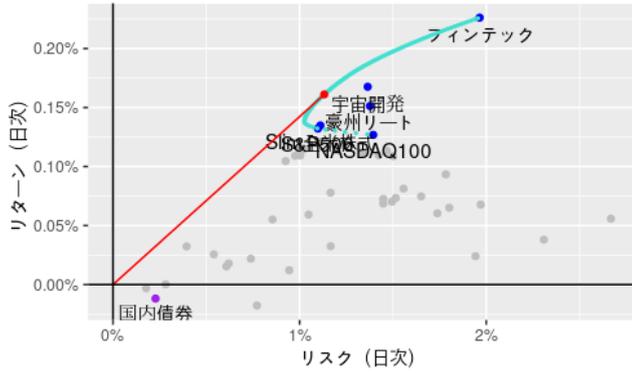


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.170%	1.206%	0.141	—
フィンテック	0.224%	2.002%	0.112	8.1%
宇宙開発	0.206%	1.601%	0.128	35.8%
コミュニケーション DX	0.144%	1.612%	0.089	0.0%
米国リート	0.140%	1.105%	0.127	56.1%
先進国リート	0.109%	1.014%	0.107	0.0%
NY ダウ	0.088%	1.202%	0.074	0.0%

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。

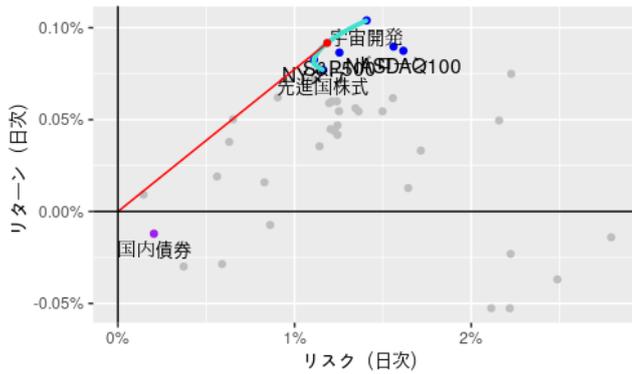
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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%	1.132%	0.142	—
フィンテック	0.226%	1.965%	0.115	12.9%
宇宙開発	0.168%	1.365%	0.123	27.8%
豪州リート	0.151%	1.377%	0.110	36.2%
Slim 全米株式	0.135%	1.111%	0.121	0.0%
S&P500	0.132%	1.098%	0.120	23.0%
NASDAQ100	0.127%	1.394%	0.091	0.0%

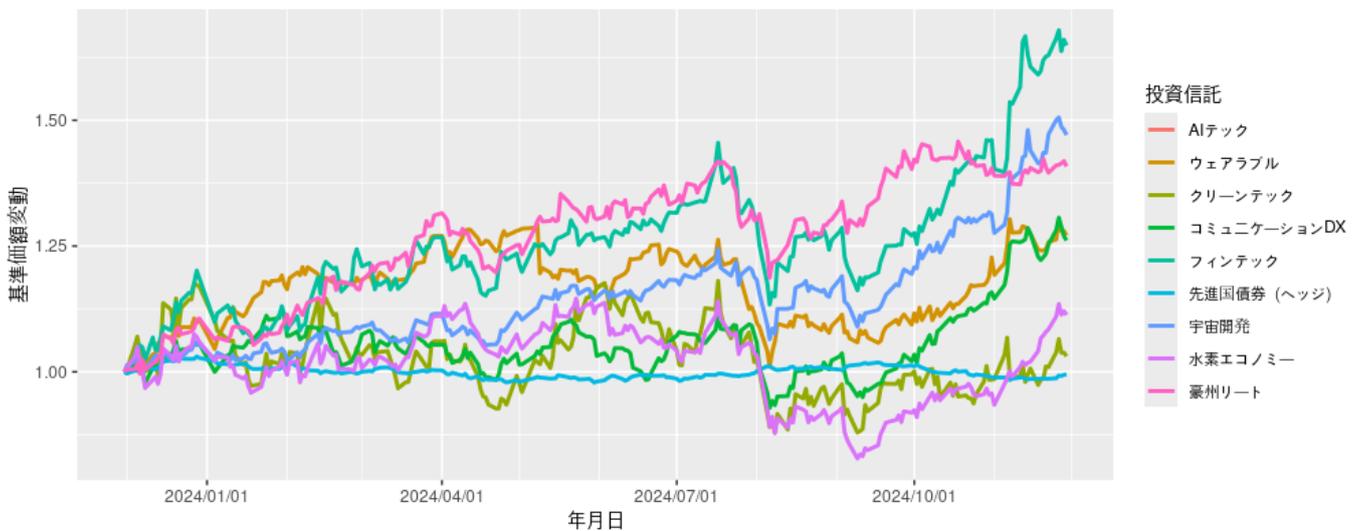
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.092%	1.185%	0.077	—
宇宙開発	0.104%	1.408%	0.074	42.8%
ドローン	0.090%	1.560%	0.058	0.0%
NASDAQ100	0.087%	1.616%	0.054	0.0%
S&P500	0.086%	1.254%	0.069	0.0%
NY ダウ	0.083%	1.110%	0.074	57.2%
先進国株式	0.077%	1.162%	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。