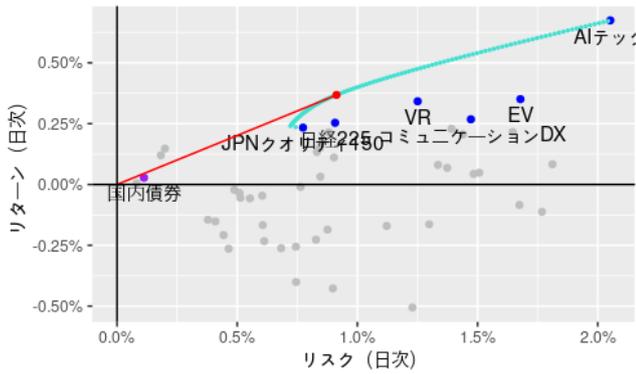


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

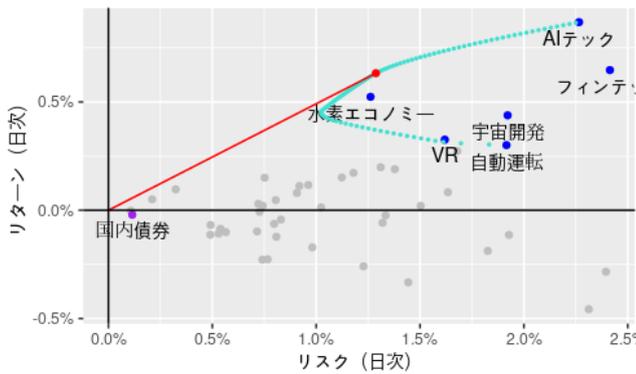
2024 年 12 月 6 日

【半月】



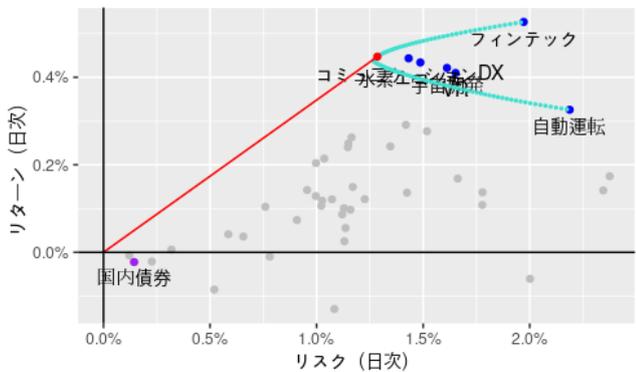
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.368%	0.913%	0.403	—
AI テック	0.674%	2.052%	0.329	30.5%
EV	0.351%	1.678%	0.209	0.0%
VR	0.342%	1.251%	0.273	0.0%
コミュニケーション DX	0.268%	1.472%	0.182	0.0%
日経 225	0.254%	0.907%	0.279	0.0%
JPN クオリティ 150	0.234%	0.774%	0.302	69.5%

【一ヶ月】



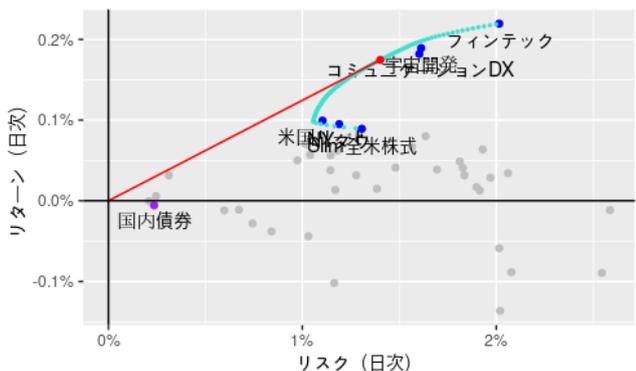
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.633%	1.288%	0.492	—
AI テック	0.869%	2.265%	0.383	31.7%
フィンテック	0.647%	2.414%	0.268	0.0%
水素エコノミー	0.524%	1.262%	0.415	68.3%
宇宙開発	0.438%	1.922%	0.228	0.0%
VR	0.326%	1.619%	0.201	0.0%
自動運転	0.301%	1.916%	0.157	0.0%

【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	0.447%	1.285%	0.348	—
フィンテック	0.527%	1.972%	0.267	9.3%
コミュニケーション DX	0.443%	1.432%	0.310	50.0%
水素エコノミー	0.434%	1.487%	0.292	40.7%
宇宙開発	0.421%	1.612%	0.261	0.0%
VR	0.410%	1.652%	0.248	0.0%
自動運転	0.326%	2.187%	0.149	0.0%

【半年】

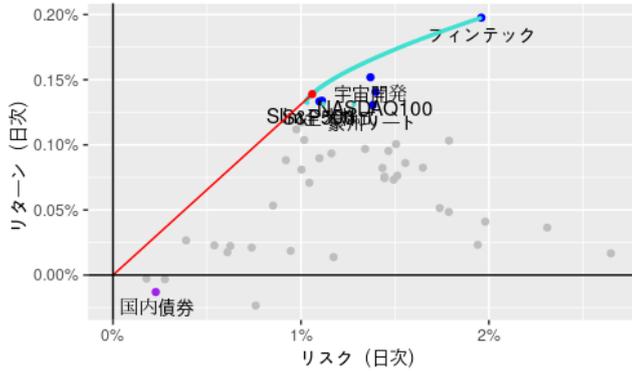


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.175%	1.402%	0.125	—
フィンテック	0.220%	2.015%	0.109	16.2%
宇宙開発	0.189%	1.613%	0.117	32.6%
コミュニケーション DX	0.182%	1.603%	0.113	32.1%
米国リート	0.099%	1.104%	0.090	19.2%
NY ダウ	0.095%	1.190%	0.080	0.0%
Slim 全米株式	0.089%	1.307%	0.068	0.0%

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。

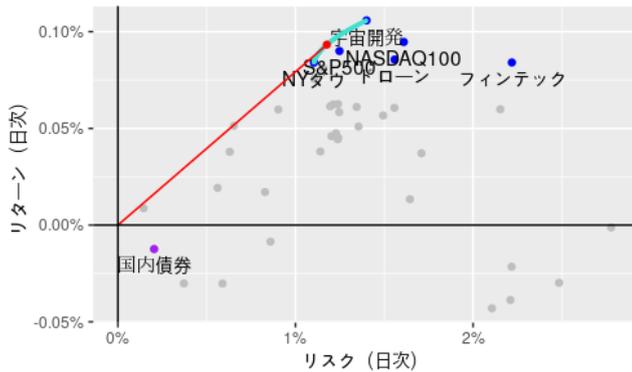
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.139%	1.060%	0.131	—
フィンテック	0.198%	1.960%	0.101	5.8%
宇宙開発	0.152%	1.370%	0.111	14.3%
NASDAQ100	0.141%	1.398%	0.101	0.0%
Slim 全米株式	0.134%	1.112%	0.120	0.0%
S&P500	0.133%	1.098%	0.121	52.4%
豪州リート	0.131%	1.382%	0.094	27.5%

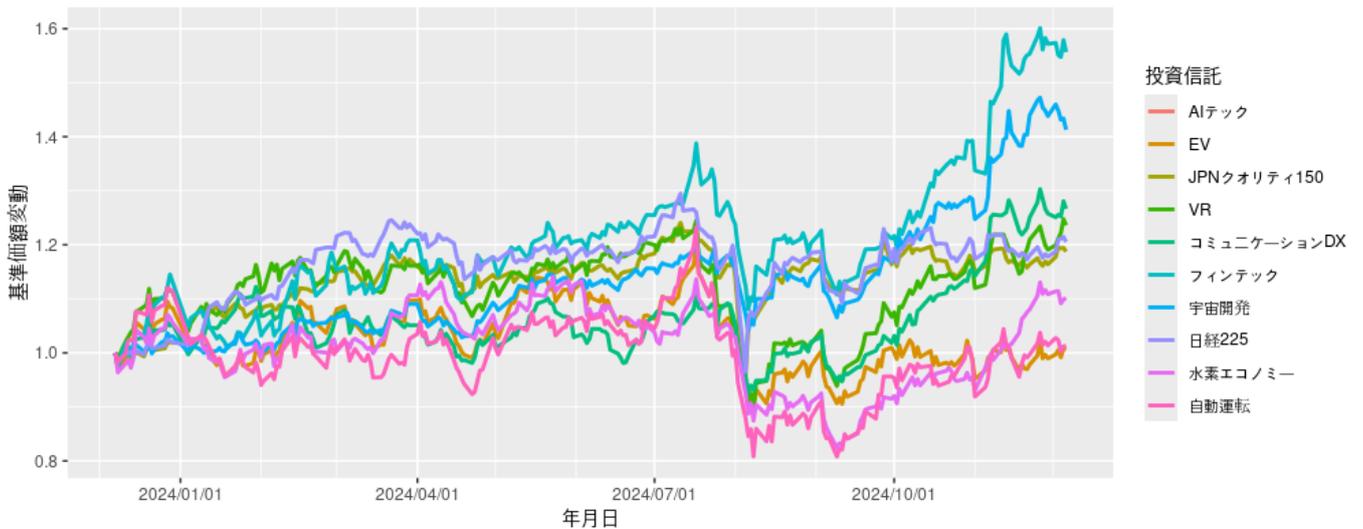
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.093%	1.176%	0.079	—
宇宙開発	0.106%	1.400%	0.076	42.5%
NASDAQ100	0.095%	1.610%	0.059	0.0%
S&P500	0.090%	1.248%	0.072	0.0%
ドローン	0.086%	1.558%	0.055	0.0%
フィンテック	0.084%	2.219%	0.038	0.0%
NY ダウ	0.084%	1.104%	0.076	57.5%

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。