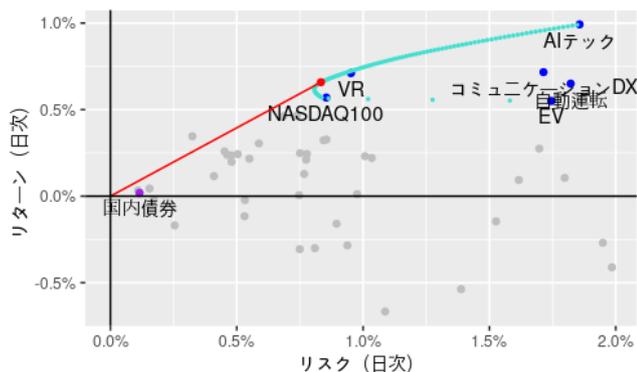


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

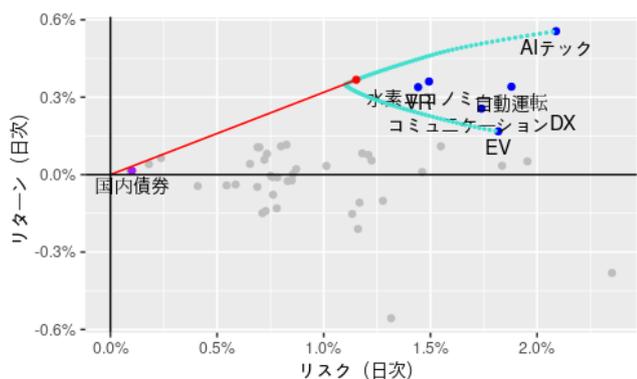
2024年12月14日

【半月】



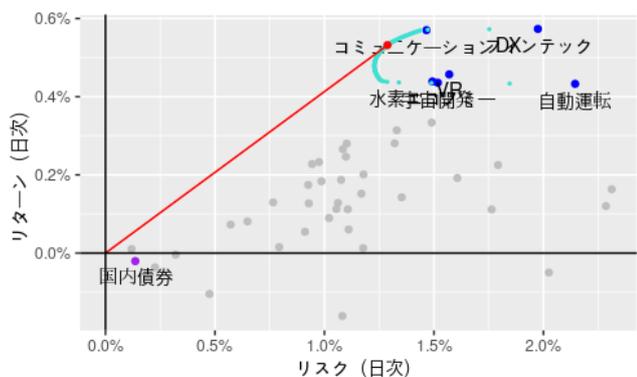
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.658%	0.833%	0.790	—
AI テック	0.992%	1.857%	0.534	0.0%
コミュニケーション DX	0.716%	1.714%	0.418	0.0%
VR	0.711%	0.952%	0.747	58.7%
自動運転	0.650%	1.822%	0.357	7.0%
NASDAQ100	0.570%	0.855%	0.667	34.2%
EV	0.550%	1.745%	0.315	0.0%

【一ヶ月】



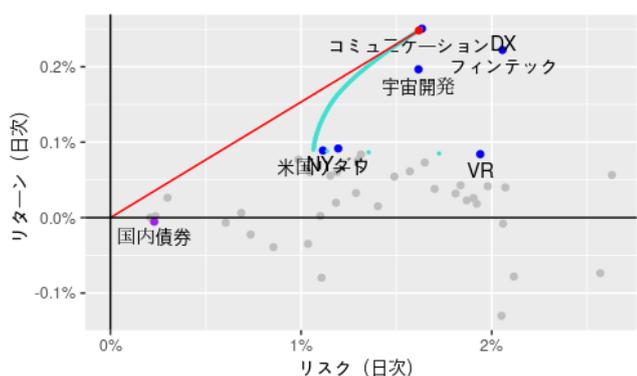
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.368%	1.152%	0.319	—
AI テック	0.556%	2.089%	0.266	8.2%
水素エコノミー	0.361%	1.493%	0.242	49.3%
自動運転	0.341%	1.880%	0.181	0.0%
VR	0.339%	1.442%	0.235	42.5%
コミュニケーション DX	0.256%	1.739%	0.147	0.0%
EV	0.168%	1.818%	0.092	0.0%

【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	0.532%	1.288%	0.413	—
フィンテック	0.573%	1.975%	0.290	6.2%
コミュニケーション DX	0.570%	1.466%	0.389	64.5%
VR	0.457%	1.570%	0.291	0.0%
水素エコノミー	0.439%	1.493%	0.294	29.3%
宇宙開発	0.436%	1.518%	0.287	0.0%
自動運転	0.433%	2.145%	0.202	0.0%

【半年】

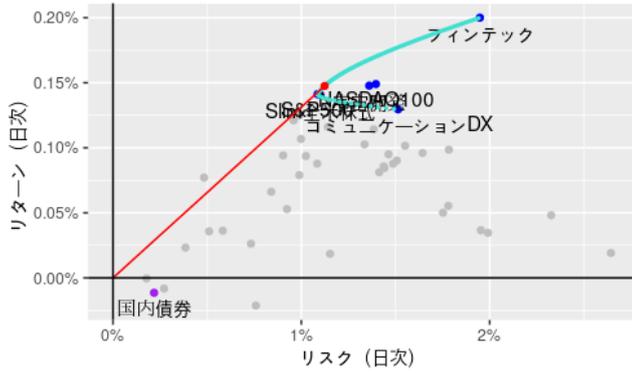


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.248%	1.617%	0.153	—
コミュニケーション DX	0.251%	1.634%	0.153	95.4%
フィンテック	0.222%	2.056%	0.108	0.0%
宇宙開発	0.197%	1.616%	0.122	4.6%
NY ダウ	0.092%	1.195%	0.077	0.0%
米国リート	0.089%	1.114%	0.080	0.0%
VR	0.084%	1.939%	0.043	0.0%

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。

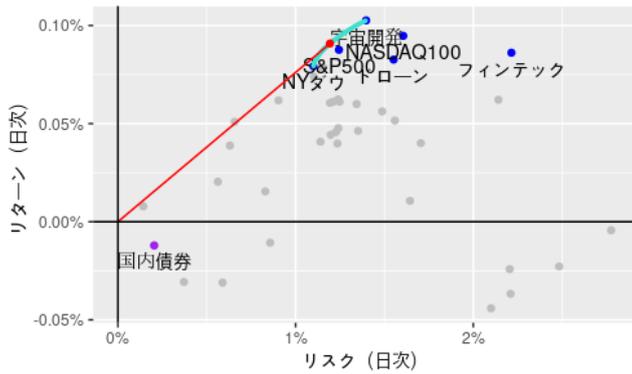
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.148%	1.124%	0.131	—
フィンテック	0.200%	1.948%	0.103	10.7%
NASDAQ100	0.149%	1.396%	0.107	0.0%
宇宙開発	0.148%	1.361%	0.109	0.0%
S&P500	0.141%	1.087%	0.130	89.3%
Slim 全米株式	0.141%	1.101%	0.128	0.0%
コミュニケーション DX	0.130%	1.514%	0.086	0.0%

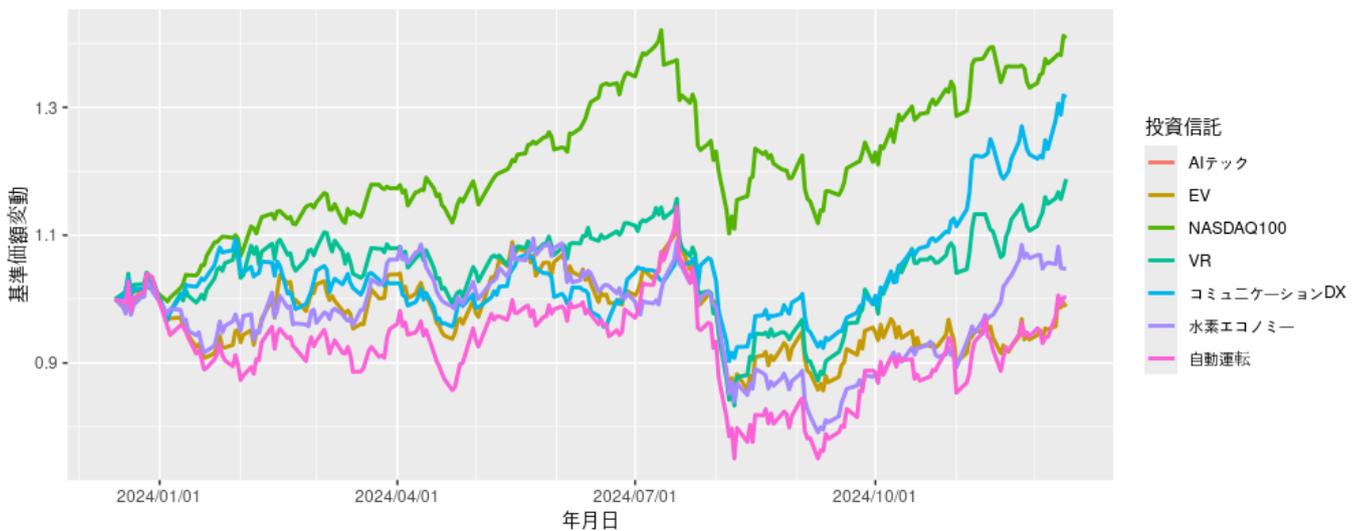
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.091%	1.193%	0.076	—
宇宙開発	0.103%	1.397%	0.073	49.2%
NASDAQ100	0.095%	1.606%	0.059	0.0%
S&P500	0.088%	1.244%	0.070	1.0%
フィンテック	0.086%	2.215%	0.039	0.0%
ドローン	0.083%	1.552%	0.053	0.0%
NY ダウ	0.079%	1.100%	0.072	49.9%

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。