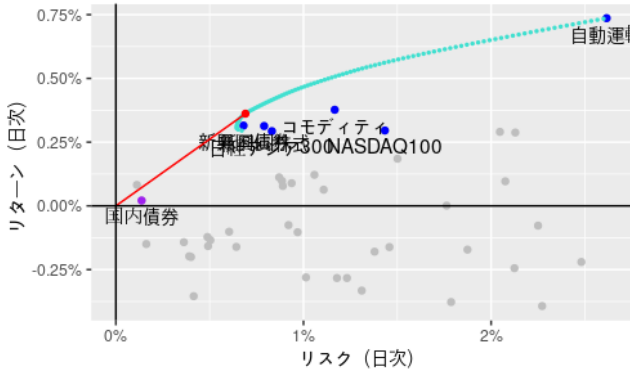


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

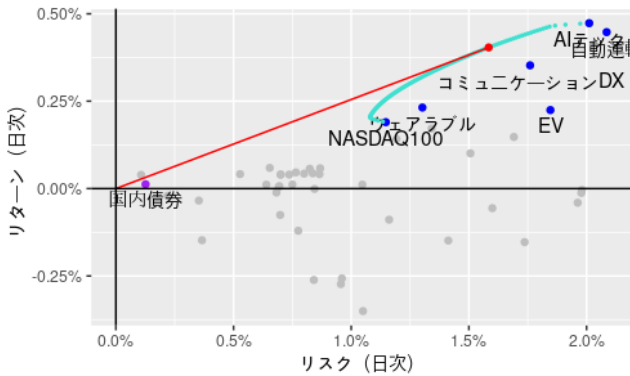
2024年12月20日

【半月】



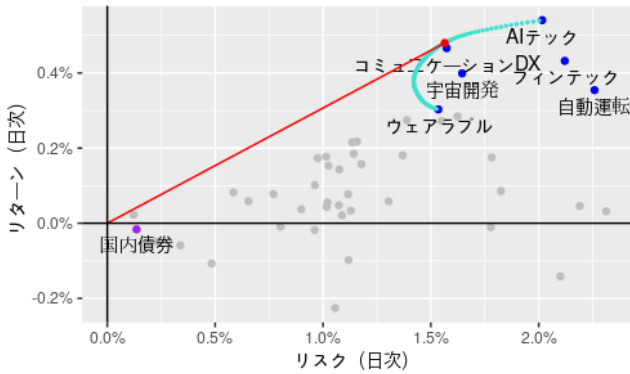
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.362%	0.691%	0.524	—
自動運転	0.736%	2.616%	0.281	12.9%
コモディティ	0.377%	1.167%	0.323	0.0%
新興国債券	0.315%	0.680%	0.463	52.1%
新興国株式	0.313%	0.790%	0.396	0.0%
NASDAQ100	0.296%	1.434%	0.206	0.0%
日経アジア 300	0.293%	0.832%	0.352	35.0%

【一ヶ月】



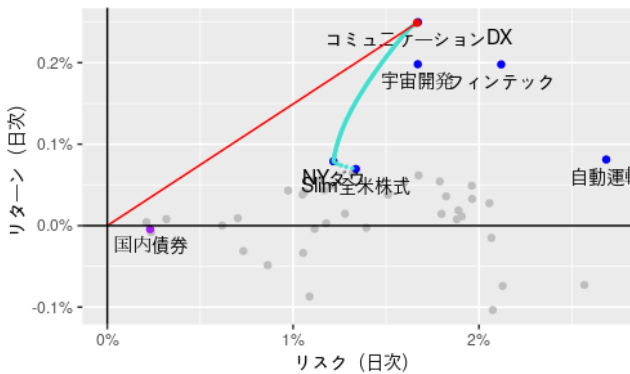
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.404%	1.584%	0.255	—
AI テック	0.473%	2.011%	0.235	49.0%
自動運転	0.447%	2.085%	0.215	24.9%
コミュニケーション DX	0.352%	1.760%	0.200	0.0%
ウェアラブル	0.232%	1.302%	0.178	26.1%
EV	0.225%	1.846%	0.122	0.0%
NASDAQ100	0.190%	1.147%	0.166	0.0%

【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	0.480%	1.564%	0.307	—
AI テック	0.541%	2.016%	0.268	26.3%
コミュニケーション DX	0.466%	1.573%	0.296	65.2%
フィンテック	0.432%	2.121%	0.204	0.0%
宇宙開発	0.399%	1.645%	0.243	8.5%
自動運転	0.354%	2.259%	0.157	0.0%
ウェアラブル	0.303%	1.534%	0.198	0.0%

【半年】

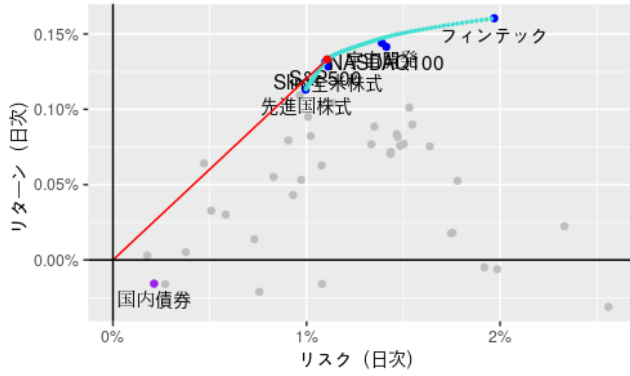


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.249%	1.666%	0.149	—
コミュニケーション DX	0.250%	1.672%	0.149	98.3%
宇宙開発	0.198%	1.671%	0.119	1.7%
フィンテック	0.198%	2.120%	0.093	0.0%
自動運転	0.081%	2.685%	0.030	0.0%
NY ダウ	0.079%	1.217%	0.065	0.0%
Slim 全米株式	0.070%	1.338%	0.052	0.0%

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。

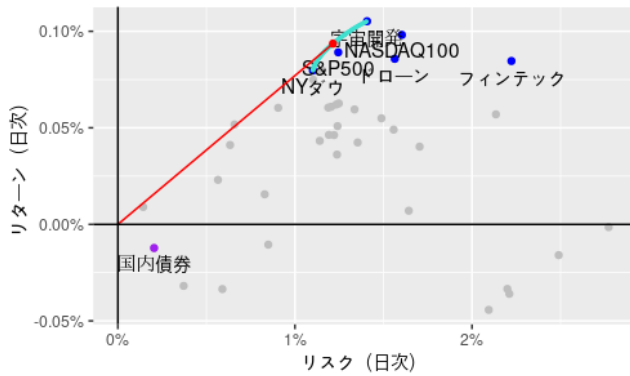
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.133%	1.106%	0.120	—
フィンテック	0.160%	1.969%	0.081	0.0%
宇宙開発	0.144%	1.389%	0.104	13.9%
NASDAQ100	0.141%	1.412%	0.100	0.0%
S&P500	0.131%	1.097%	0.120	86.1%
Slim 全米株式	0.128%	1.112%	0.116	0.0%
先進国株式	0.113%	0.995%	0.114	0.0%

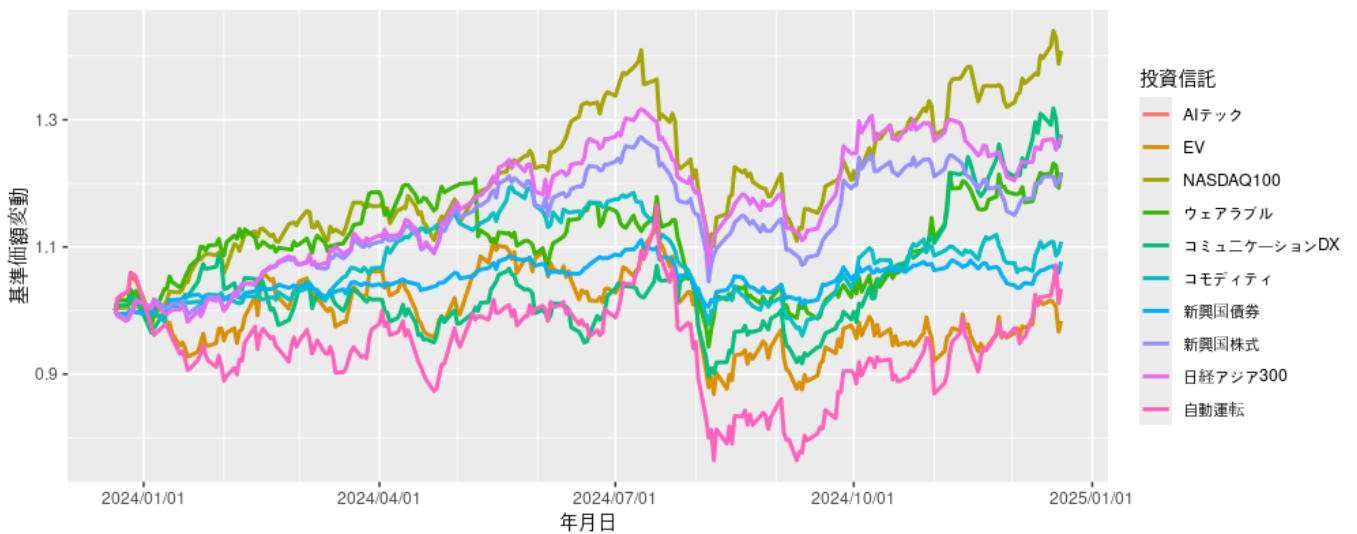
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.094%	1.215%	0.077	—
宇宙開発	0.105%	1.407%	0.075	51.4%
NASDAQ100	0.098%	1.604%	0.061	0.0%
S&P500	0.089%	1.244%	0.072	8.5%
ドローン	0.086%	1.564%	0.055	0.0%
フィンテック	0.085%	2.223%	0.038	0.0%
NY ダウ	0.080%	1.101%	0.072	40.2%

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。