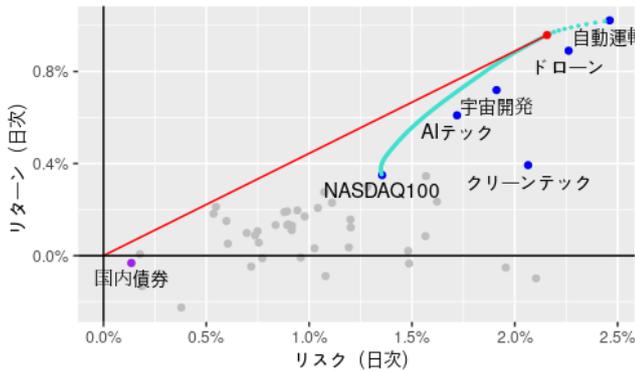


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

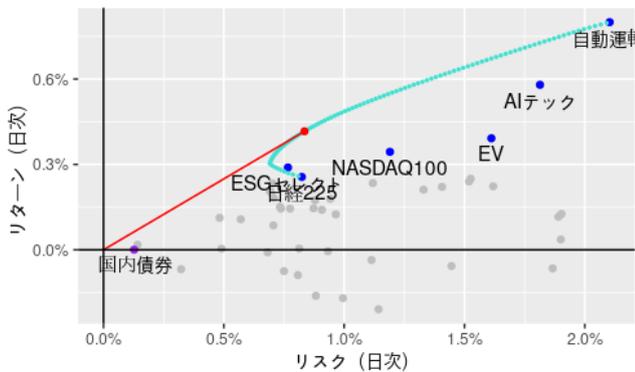
2024年12月28日

【半月】



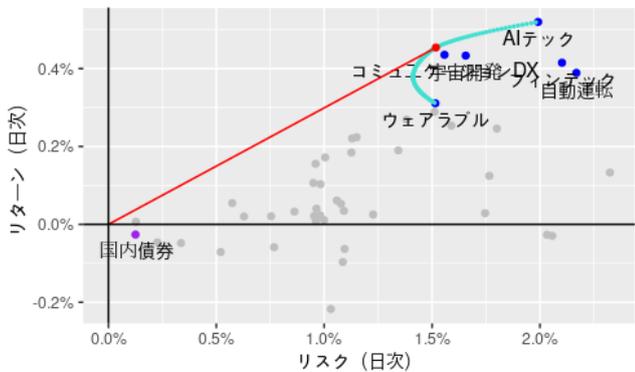
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.958%	2.157%	0.444	—
自動運転	1.022%	2.461%	0.415	53.8%
ドローン	0.890%	2.262%	0.394	45.1%
宇宙開発	0.719%	1.911%	0.376	0.0%
AI テック	0.610%	1.719%	0.355	1.1%
クリーンテック	0.393%	2.065%	0.190	0.0%
NASDAQ100	0.350%	1.355%	0.258	0.0%

【一ヶ月】



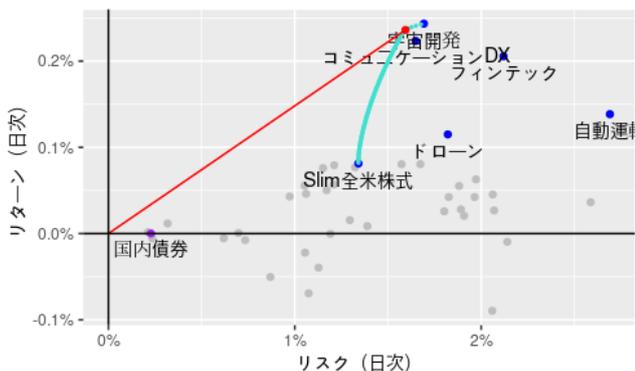
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.416%	0.835%	0.499	—
自動運転	0.800%	2.103%	0.380	18.5%
AI テック	0.580%	1.814%	0.320	10.4%
EV	0.392%	1.612%	0.243	0.0%
NASDAQ100	0.344%	1.190%	0.289	4.4%
ESG セレクト	0.289%	0.767%	0.377	66.6%
日経 225	0.256%	0.824%	0.311	0.0%

【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	0.454%	1.518%	0.299	—
AI テック	0.520%	1.992%	0.261	22.8%
コミュニケーション DX	0.435%	1.558%	0.280	47.8%
宇宙開発	0.433%	1.656%	0.262	29.5%
フィンテック	0.415%	2.102%	0.197	0.0%
自動運転	0.389%	2.169%	0.179	0.0%
ウェアラブル	0.311%	1.515%	0.205	0.0%

【半年】

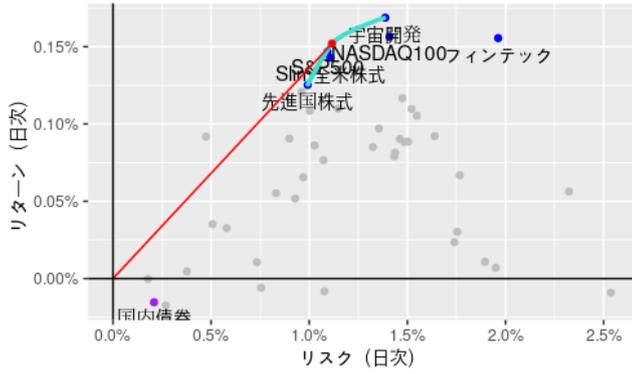


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.236%	1.594%	0.148	—
宇宙開発	0.243%	1.693%	0.144	63.5%
コミュニケーション DX	0.223%	1.649%	0.136	36.5%
フィンテック	0.206%	2.120%	0.097	0.0%
自動運転	0.138%	2.691%	0.051	0.0%
ドローン	0.115%	1.821%	0.063	0.0%
Slim 全米株式	0.081%	1.341%	0.061	0.0%

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。

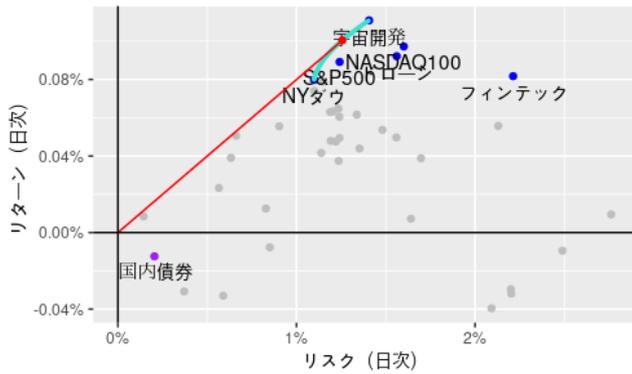
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.152%	1.116%	0.136	—
宇宙開発	0.169%	1.388%	0.122	24.2%
NASDAQ100	0.156%	1.410%	0.111	0.0%
フィンテック	0.155%	1.963%	0.079	0.0%
S&P500	0.147%	1.093%	0.134	75.8%
Slim 全米株式	0.143%	1.107%	0.129	0.0%
先進国株式	0.125%	0.992%	0.126	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	0.100%	1.257%	0.080	—
宇宙開発	0.111%	1.407%	0.079	66.5%
NASDAQ100	0.097%	1.601%	0.061	0.0%
ドローン	0.092%	1.561%	0.059	0.0%
S&P500	0.089%	1.242%	0.072	0.0%
フィンテック	0.082%	2.213%	0.037	0.0%
NY ダウ	0.080%	1.098%	0.073	33.5%

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。