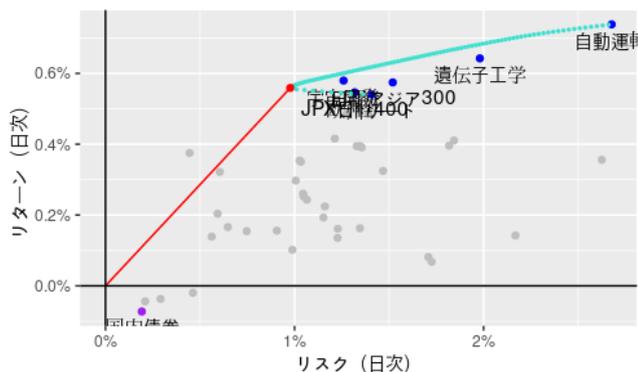


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

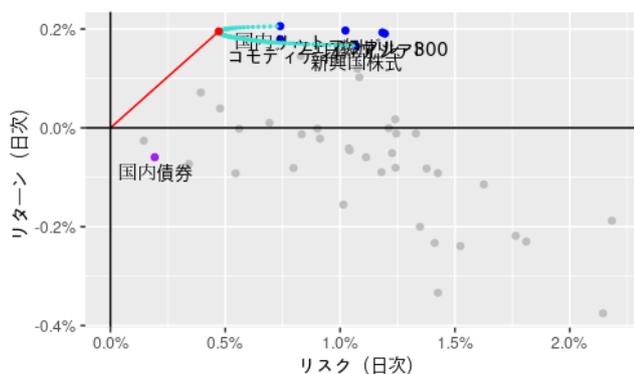
2024年5月4日

【半月】



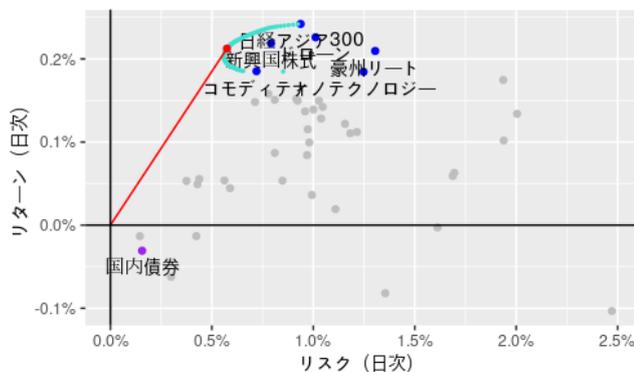
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.559%	0.977%	0.572	—
自動運転	0.738%	2.678%	0.276	0.0%
遺伝子工学	0.642%	1.980%	0.324	0.1%
宇宙開発	0.580%	1.260%	0.460	0.0%
日経アジア 300	0.575%	1.520%	0.378	44.2%
JPX 日経 400	0.546%	1.318%	0.414	55.7%
欧州リート	0.540%	1.409%	0.383	0.0%

【一ヶ月】



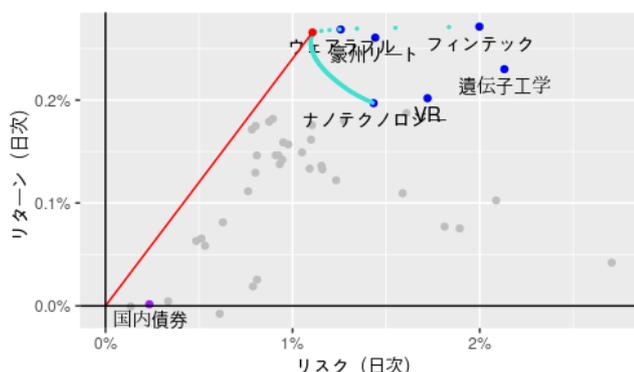
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.195%	0.472%	0.414	—
国内リート	0.206%	0.739%	0.279	42.3%
ウェアラブル	0.197%	1.023%	0.192	7.3%
欧州リート	0.193%	1.184%	0.163	19.7%
日経アジア 300	0.191%	1.195%	0.160	6.7%
コモディティ	0.179%	0.740%	0.243	24.1%
新興国株式	0.166%	1.070%	0.155	0.0%

【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	0.212%	0.574%	0.370	—
日経アジア 300	0.242%	0.937%	0.258	32.4%
ドローン	0.226%	1.011%	0.223	19.5%
新興国株式	0.219%	0.791%	0.276	0.0%
豪州リート	0.210%	1.305%	0.161	3.3%
コモディティ	0.185%	0.720%	0.257	44.8%
ナノテクノロジー	0.185%	1.248%	0.148	0.0%

【半年】

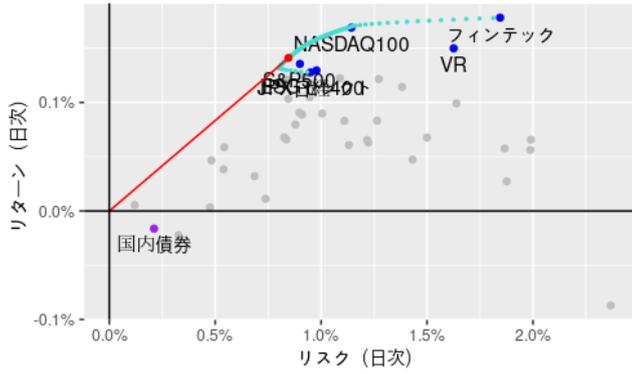


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.266%	1.106%	0.240	—
フィンテック	0.271%	1.998%	0.136	0.0%
ウェアラブル	0.269%	1.257%	0.214	64.2%
豪州リート	0.261%	1.442%	0.181	35.8%
遺伝子工学	0.230%	2.132%	0.108	0.0%
VR	0.202%	1.721%	0.117	0.0%
ナノテクノロジー	0.197%	1.433%	0.137	0.0%

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。

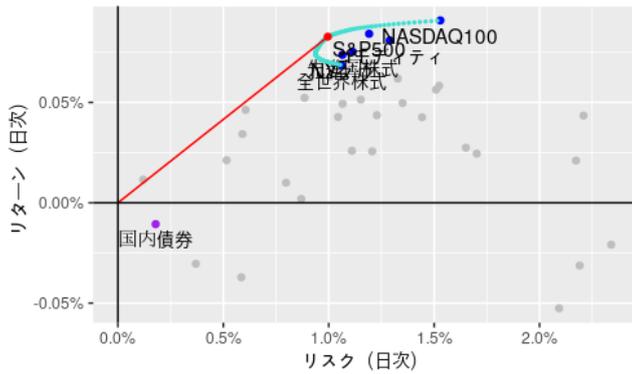
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.141%	0.846%	0.167	—
フィンテック	0.178%	1.845%	0.097	1.6%
NASDAQ100	0.169%	1.143%	0.148	24.3%
VR	0.150%	1.626%	0.092	0.0%
S&P500	0.136%	0.900%	0.151	32.4%
ESG セレクト	0.129%	0.978%	0.132	0.0%
JPX 日経 400	0.128%	0.950%	0.134	41.8%

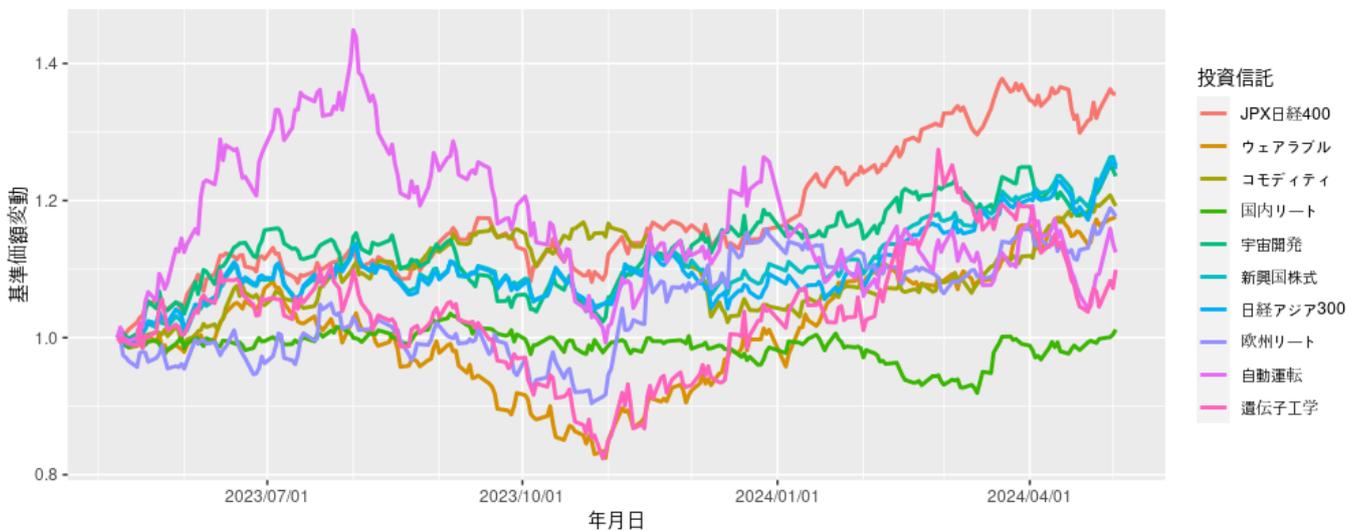
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.083%	0.996%	0.083	—
NASDAQ100	0.091%	1.529%	0.059	0.0%
S&P500	0.084%	1.192%	0.071	56.9%
コモディティ	0.081%	1.289%	0.063	42.6%
先進国株式	0.075%	1.113%	0.068	0.0%
NY ダウ	0.074%	1.065%	0.069	0.5%
全世界株式	0.069%	1.061%	0.065	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。