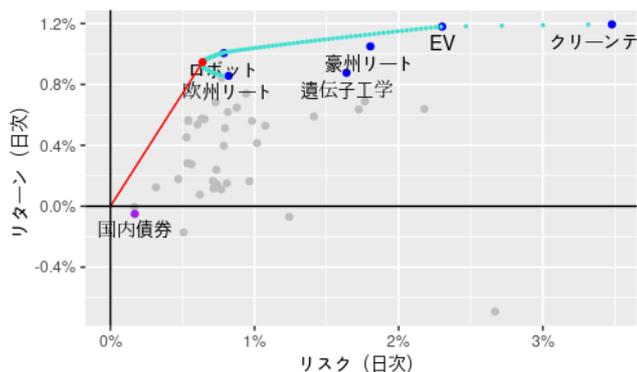


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

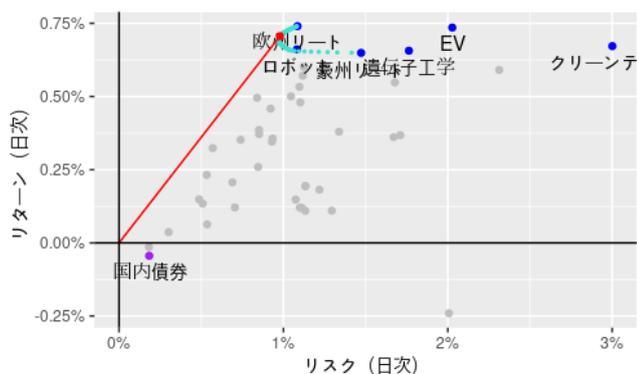
2024年5月18日

【半月】



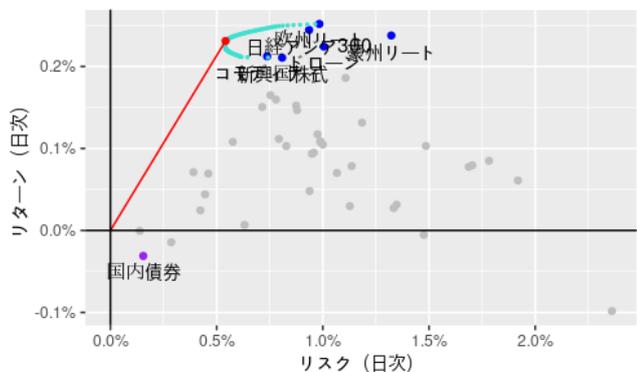
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.946%	0.639%	1.481	—
クリーンテック	1.194%	3.479%	0.343	0.0%
EV	1.180%	2.302%	0.513	0.0%
豪州リート	1.050%	1.804%	0.582	0.0%
ロボット	1.005%	0.787%	1.278	60.0%
遺伝子工学	0.876%	1.638%	0.535	0.0%
欧州リート	0.856%	0.820%	1.044	40.0%

【一ヶ月】



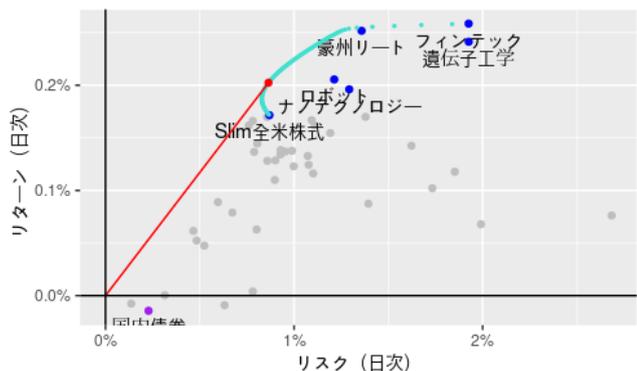
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.706%	0.979%	0.721	—
欧州リート	0.740%	1.085%	0.682	58.3%
EV	0.735%	2.027%	0.363	0.0%
クリーンテック	0.672%	3.001%	0.224	0.0%
ロボット	0.661%	1.082%	0.611	32.5%
遺伝子工学	0.656%	1.763%	0.372	0.4%
豪州リート	0.649%	1.472%	0.441	8.8%

【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	0.231%	0.542%	0.426	—
欧州リート	0.252%	0.984%	0.256	32.7%
日経アジア 300	0.245%	0.935%	0.261	17.9%
豪州リート	0.238%	1.322%	0.180	0.0%
ドローン	0.224%	1.005%	0.223	0.0%
コモディティ	0.212%	0.738%	0.288	49.3%
新興国株式	0.211%	0.808%	0.261	0.0%

【半年】

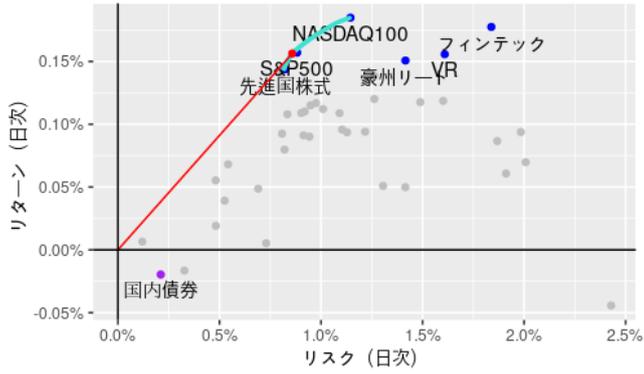


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.202%	0.864%	0.234	—
フィンテック	0.259%	1.926%	0.134	0.0%
豪州リート	0.252%	1.358%	0.185	35.6%
遺伝子工学	0.241%	1.926%	0.125	3.2%
ロボット	0.205%	1.213%	0.169	0.0%
ナノテクノロジー	0.196%	1.292%	0.152	0.5%
Slim 全米株式	0.172%	0.869%	0.197	60.7%

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。

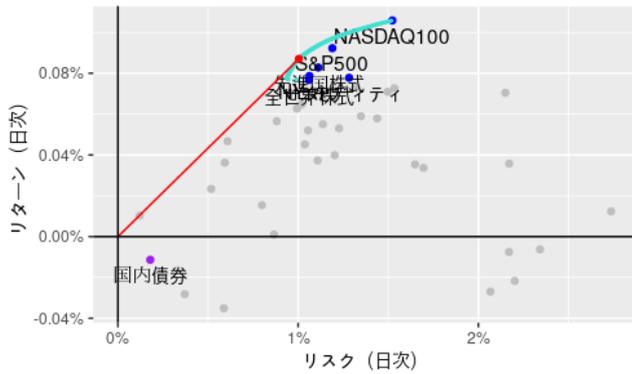
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.156%	0.858%	0.182	—
NASDAQ100	0.185%	1.145%	0.161	0.5%
フィンテック	0.177%	1.839%	0.097	0.0%
S&P500	0.157%	0.882%	0.178	85.5%
VR	0.156%	1.609%	0.097	0.0%
豪州リート	0.151%	1.416%	0.106	13.9%
先進国株式	0.144%	0.823%	0.175	0.0%

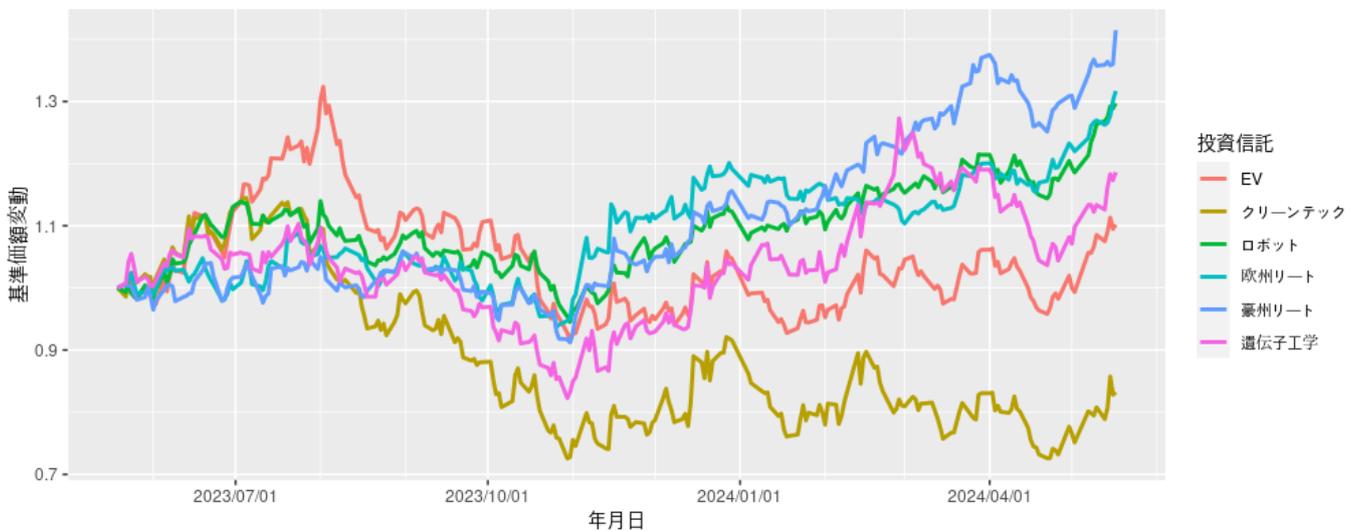
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.087%	1.004%	0.087	—
NASDAQ100	0.106%	1.523%	0.070	0.9%
S&P500	0.092%	1.190%	0.078	62.3%
先進国株式	0.083%	1.112%	0.075	0.0%
NYダウ	0.079%	1.063%	0.074	0.0%
コモディティ	0.078%	1.283%	0.061	36.8%
全世界株式	0.077%	1.060%	0.072	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。