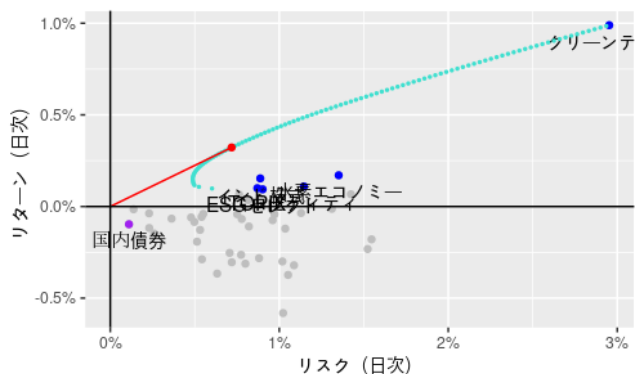


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

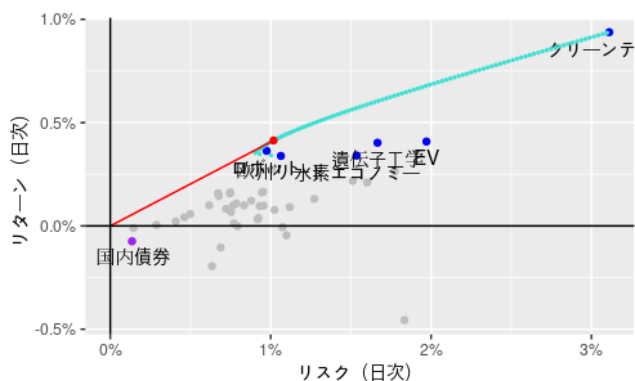
2024年6月1日

【半月】



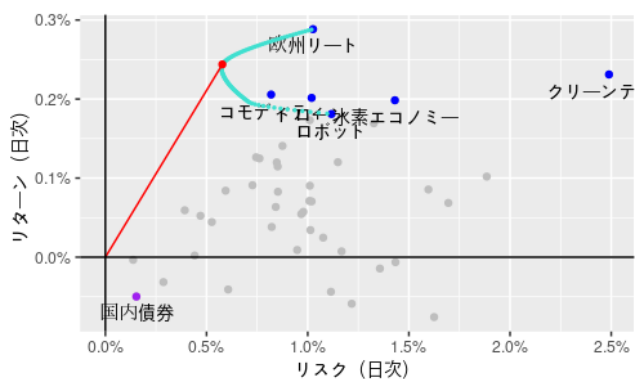
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.322%	0.718%	0.449	—
クリーンテック	0.989%	2.953%	0.335	22.9%
水素エコノミー	0.170%	1.352%	0.126	0.0%
インド株式	0.153%	0.888%	0.173	29.4%
コモディティ	0.109%	1.146%	0.095	29.7%
TOPIX	0.100%	0.870%	0.115	18.0%
ESG セレクト	0.094%	0.902%	0.104	0.0%

【一ヶ月】



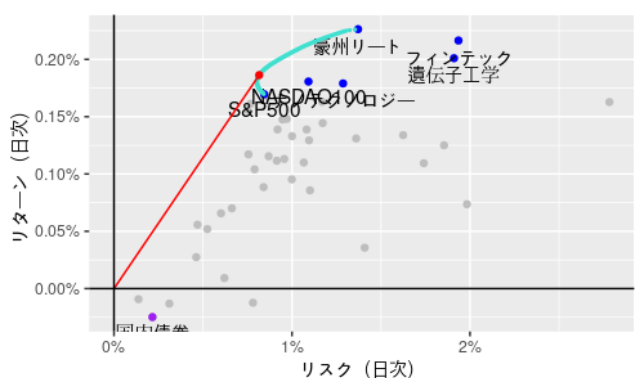
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.414%	1.018%	0.406	—
クリーンテック	0.938%	3.111%	0.301	10.1%
EV	0.408%	1.971%	0.207	0.0%
遺伝子工学	0.403%	1.666%	0.242	0.0%
ロボット	0.363%	0.975%	0.373	58.5%
水素エコノミー	0.340%	1.536%	0.222	0.0%
欧州リート	0.339%	1.064%	0.318	31.4%

【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	0.244%	0.578%	0.422	—
欧州リート	0.288%	1.026%	0.281	46.2%
クリーンテック	0.231%	2.489%	0.093	0.0%
コモディティ	0.206%	0.819%	0.251	53.8%
ドローン	0.201%	1.019%	0.198	0.0%
水素エコノミー	0.198%	1.431%	0.139	0.0%
ロボット	0.181%	1.118%	0.162	0.0%

【半年】

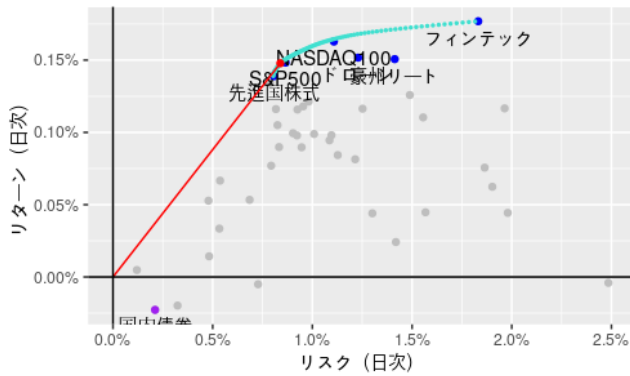


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.186%	0.816%	0.228	—
豪州リート	0.226%	1.371%	0.165	29.5%
フィンテック	0.216%	1.935%	0.112	0.0%
遺伝子工学	0.201%	1.910%	0.105	0.0%
NASDAQ100	0.181%	1.093%	0.165	0.0%
ナノテクノロジー	0.179%	1.287%	0.139	0.0%
S&P500	0.170%	0.844%	0.201	70.5%

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。

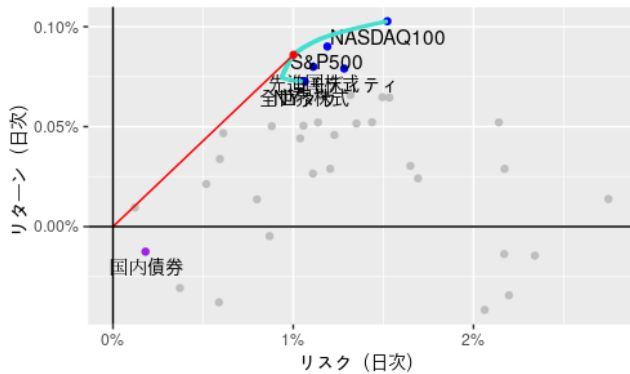
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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%	0.839%	0.176	—
フィンテック	0.177%	1.832%	0.097	0.0%
NASDAQ100	0.163%	1.108%	0.147	0.0%
ドローン	0.152%	1.230%	0.123	0.8%
豪州リート	0.151%	1.413%	0.107	14.6%
S&P500	0.148%	0.866%	0.171	75.9%
先進国株式	0.139%	0.807%	0.172	8.7%

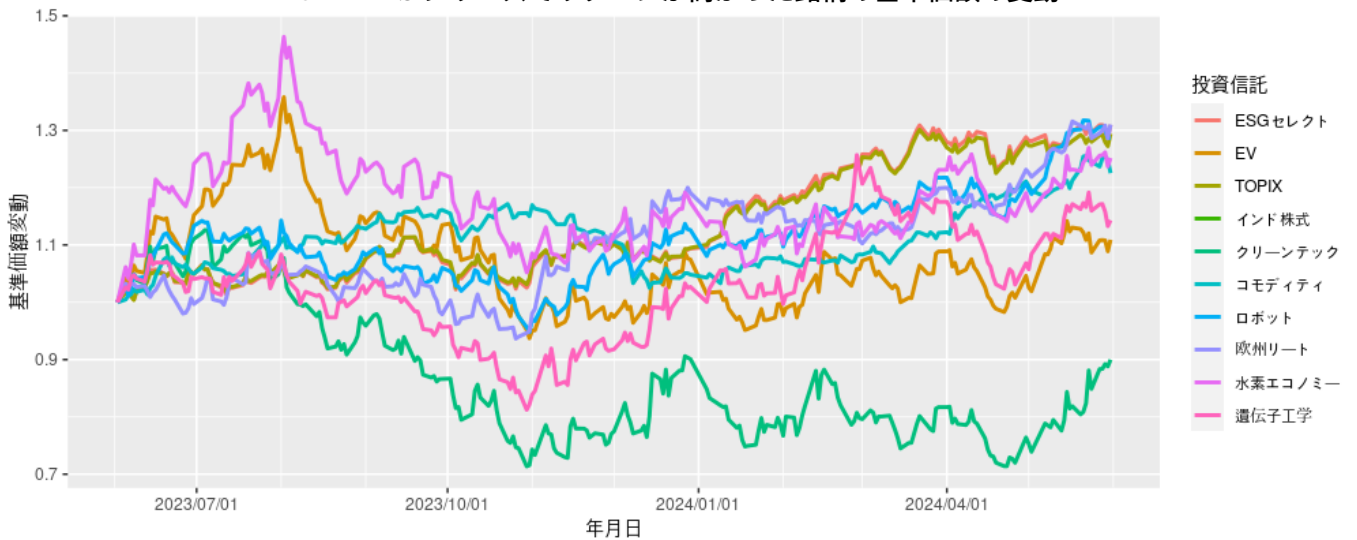
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.086%	1.002%	0.086	—
NASDAQ100	0.103%	1.522%	0.067	0.6%
S&P500	0.090%	1.190%	0.076	61.1%
先進国株式	0.080%	1.111%	0.072	0.0%
コモディティ	0.079%	1.283%	0.062	38.3%
全世界株式	0.073%	1.060%	0.069	0.0%
NY ダウ	0.072%	1.064%	0.068	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。