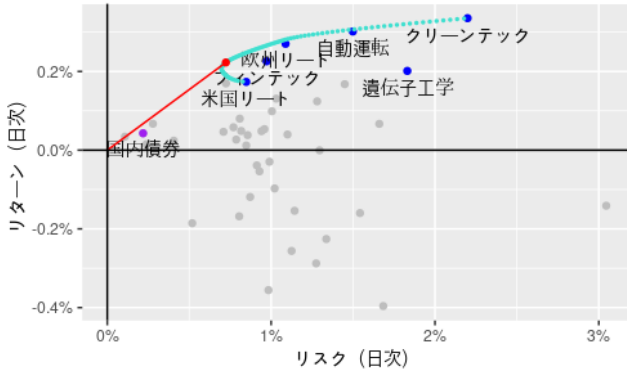


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

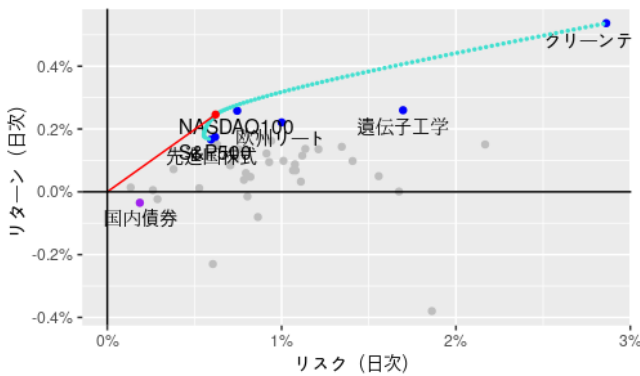
2024年6月8日

【半月】



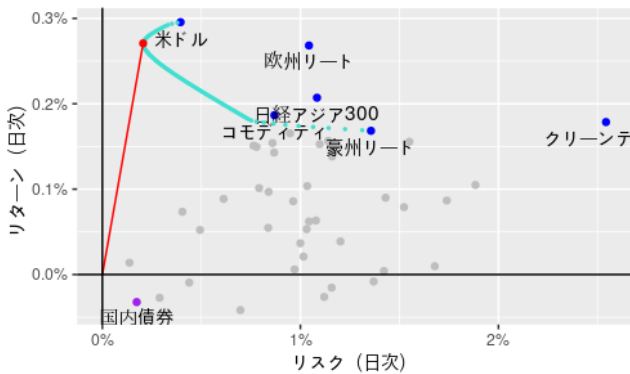
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.223%	0.724%	0.308	—
クリーンテック	0.335%	2.199%	0.153	0.0%
自動運転	0.302%	1.499%	0.201	0.0%
欧州リート	0.270%	1.088%	0.248	34.4%
フィンテック	0.226%	0.972%	0.232	30.7%
遺伝子工学	0.201%	1.831%	0.110	0.0%
米国リート	0.173%	0.848%	0.205	34.9%

【一ヶ月】



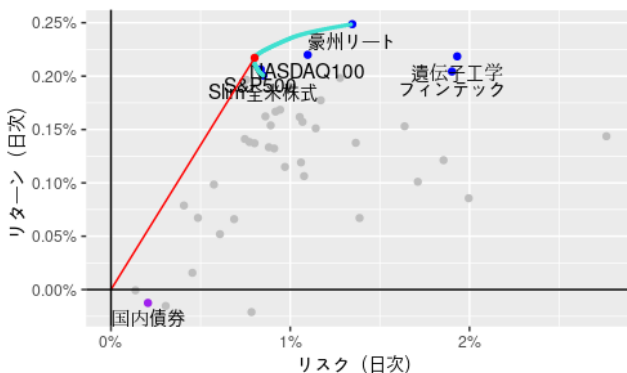
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.246%	0.621%	0.396	—
クリーンテック	0.537%	2.862%	0.188	0.0%
遺伝子工学	0.260%	1.696%	0.153	0.0%
NASDAQ100	0.258%	0.745%	0.346	68.0%
欧州リート	0.221%	1.000%	0.221	31.5%
S&P500	0.175%	0.619%	0.282	0.0%
先進国株式	0.166%	0.594%	0.280	0.5%

【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	0.271%	0.206%	1.315	—
米ドル	0.296%	0.395%	0.749	80.5%
欧州リート	0.268%	1.043%	0.257	0.0%
日経アジア 300	0.207%	1.084%	0.191	0.0%
コモディティ	0.187%	0.869%	0.215	0.0%
クリーンテック	0.179%	2.543%	0.070	0.1%
豪州リート	0.168%	1.356%	0.124	19.4%

【半年】

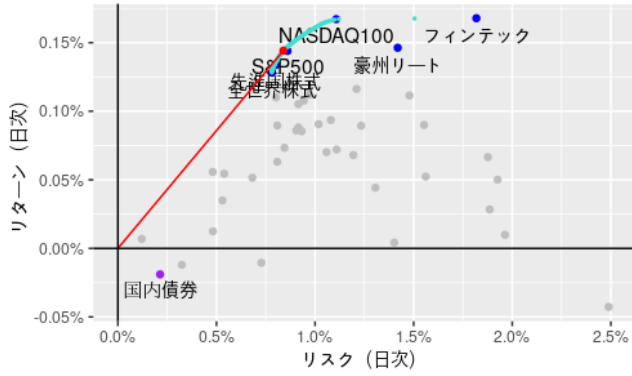


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.217%	0.801%	0.271	—
豪州リート	0.249%	1.346%	0.185	25.7%
NASDAQ100	0.220%	1.097%	0.200	0.0%
遺伝子工学	0.218%	1.931%	0.113	0.0%
S&P500	0.206%	0.836%	0.247	74.3%
フィンテック	0.204%	1.902%	0.107	0.0%
Slim 全米株式	0.201%	0.850%	0.236	0.0%

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。

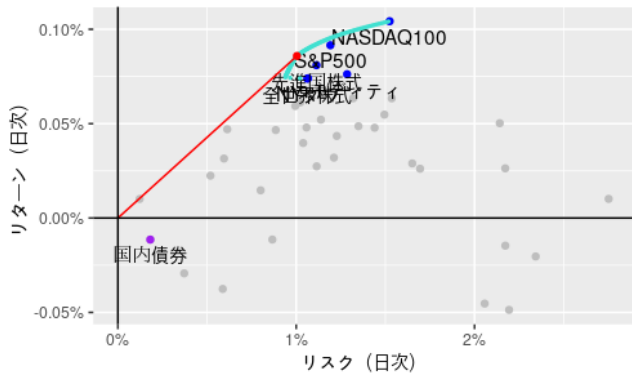
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.144%	0.839%	0.172	—
フィンテック	0.168%	1.818%	0.092	0.0%
NASDAQ100	0.167%	1.107%	0.151	0.0%
豪州リート	0.146%	1.419%	0.103	14.6%
S&P500	0.144%	0.860%	0.167	84.5%
先進国株式	0.134%	0.801%	0.167	0.9%
全世界株式	0.128%	0.782%	0.164	0.0%

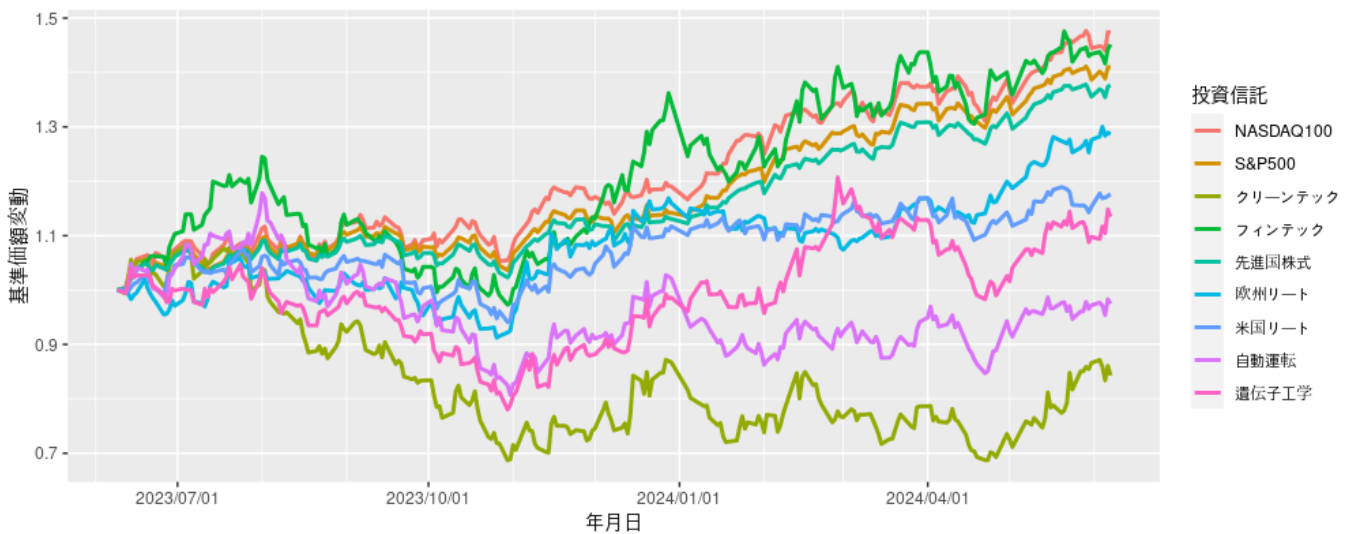
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.086%	1.004%	0.086	—
NASDAQ100	0.104%	1.524%	0.068	0.0%
S&P500	0.092%	1.192%	0.077	63.0%
先進国株式	0.081%	1.114%	0.073	0.0%
コモディティ	0.076%	1.285%	0.059	37.0%
NY ダウ	0.074%	1.067%	0.069	0.0%
全世界株式	0.074%	1.062%	0.070	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。