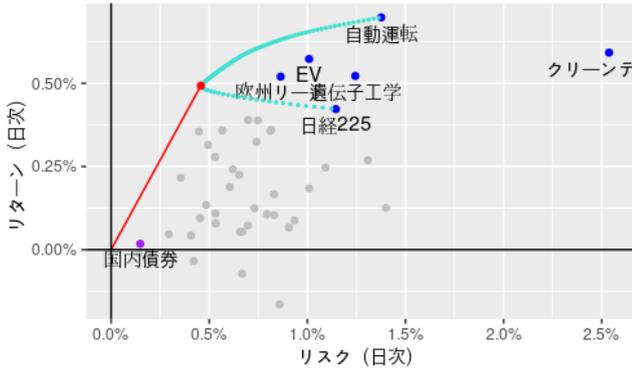


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

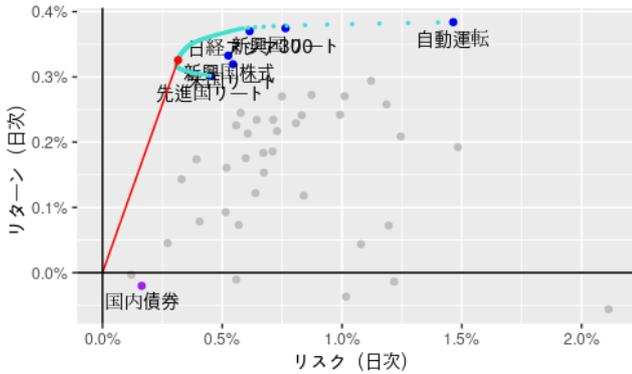
2024年7月13日

【半月】



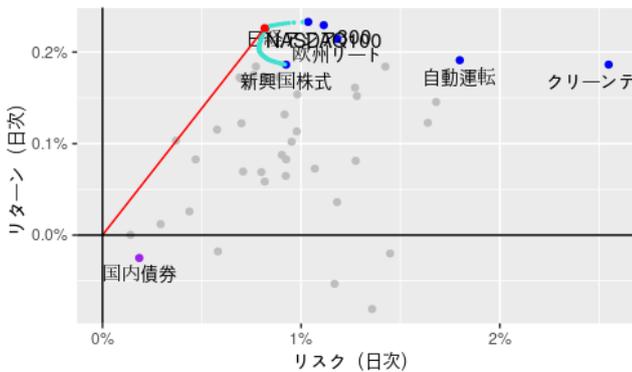
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.493%	0.457%	1.078	—
自動運転	0.698%	1.376%	0.507	0.0%
クリーンテック	0.592%	2.537%	0.233	0.0%
EV	0.573%	1.009%	0.568	0.0%
遺伝子工学	0.522%	1.244%	0.420	30.9%
欧州リート	0.520%	0.864%	0.602	40.5%
日経 225	0.422%	1.145%	0.369	28.6%

【一ヶ月】



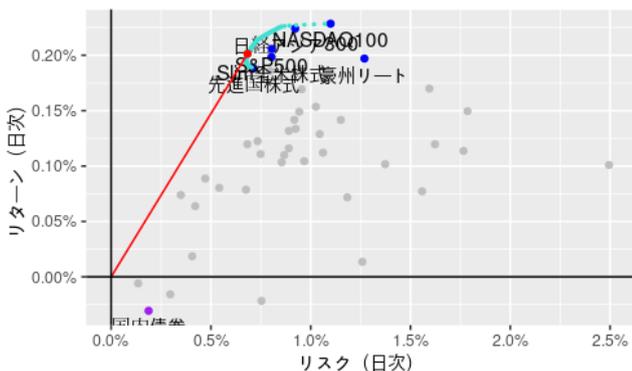
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.326%	0.316%	1.032	—
自動運転	0.384%	1.464%	0.262	5.4%
新興国リート	0.375%	0.764%	0.490	0.0%
日経アジア 300	0.370%	0.614%	0.602	20.2%
新興国株式	0.333%	0.525%	0.633	19.0%
米国リート	0.319%	0.545%	0.586	0.0%
先進国リート	0.301%	0.455%	0.662	55.3%

【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	0.226%	0.816%	0.277	—
日経アジア 300	0.233%	1.036%	0.225	40.3%
NASDAQ100	0.229%	1.114%	0.206	28.8%
欧州リート	0.214%	1.182%	0.181	30.9%
自動運転	0.191%	1.799%	0.106	0.0%
クリーンテック	0.186%	2.548%	0.073	0.0%
新興国株式	0.186%	0.924%	0.202	0.0%

【半年】

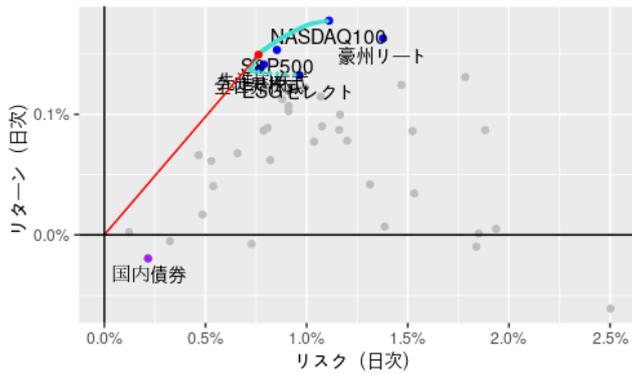


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.201%	0.684%	0.295	—
NASDAQ100	0.229%	1.100%	0.208	0.0%
日経アジア 300	0.224%	0.922%	0.243	33.6%
S&P500	0.206%	0.805%	0.255	1.3%
Slim 全米株式	0.198%	0.804%	0.247	0.0%
豪州リート	0.197%	1.269%	0.155	5.6%
先進国株式	0.189%	0.710%	0.266	59.5%

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。

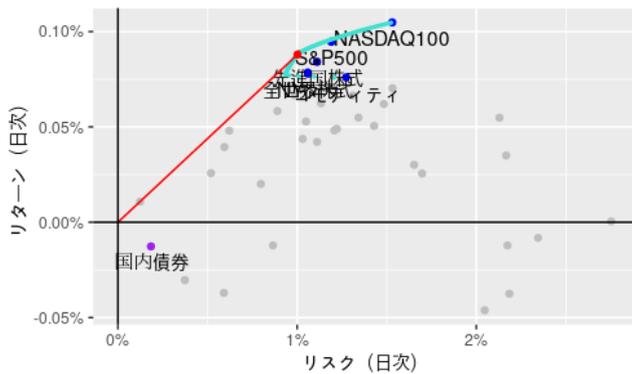
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.149%	0.762%	0.196	—
NASDAQ100	0.178%	1.111%	0.160	0.0%
豪州リート	0.163%	1.378%	0.118	15.9%
S&P500	0.153%	0.853%	0.180	57.8%
先進国株式	0.141%	0.788%	0.179	0.0%
全世界株式	0.138%	0.765%	0.180	0.0%
ESG セレクト	0.132%	0.964%	0.137	26.3%

【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.088%	1.002%	0.088	—
NASDAQ100	0.105%	1.531%	0.068	0.0%
S&P500	0.095%	1.191%	0.079	64.1%
先進国株式	0.084%	1.111%	0.076	0.0%
全世界株式	0.079%	1.059%	0.074	0.0%
NYダウ	0.078%	1.061%	0.073	0.0%
コモディティ	0.076%	1.274%	0.060	35.9%

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。