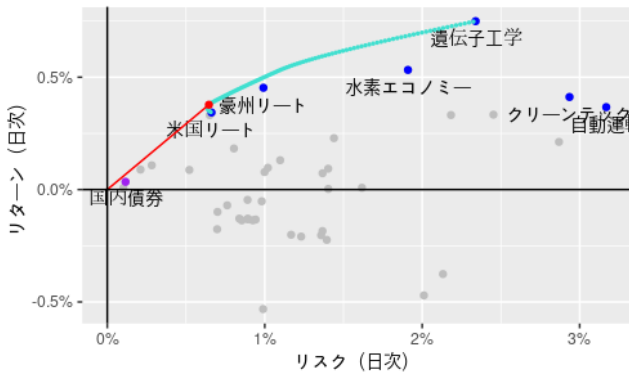


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

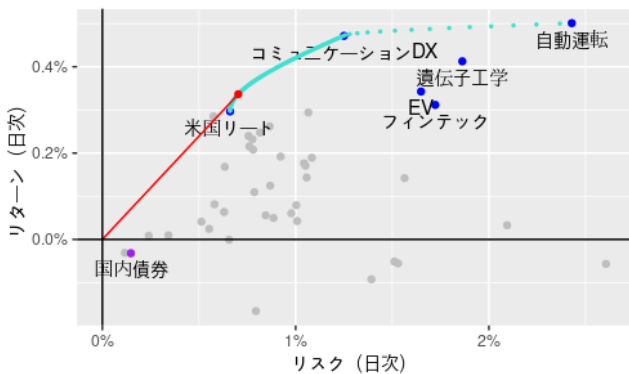
2024年7月20日

【半月】



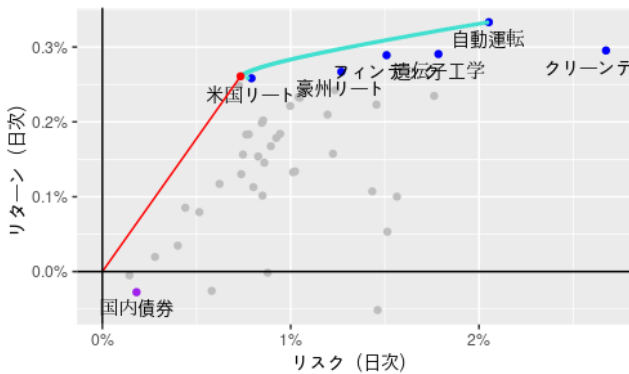
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.378%	0.645%	0.585	—
遺伝子工学	0.749%	2.339%	0.320	0.0%
水素エコノミー	0.532%	1.910%	0.279	0.0%
豪州リート	0.453%	0.992%	0.457	31.4%
クリーンテック	0.412%	2.935%	0.140	0.0%
自動運転	0.367%	3.169%	0.116	0.0%
米国リート	0.343%	0.662%	0.518	68.6%

【一ヶ月】



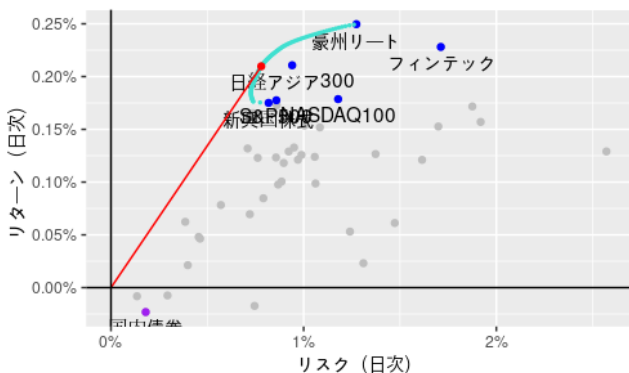
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.336%	0.703%	0.478	—
自動運転	0.501%	2.429%	0.206	0.0%
コミュニケーション DX	0.472%	1.250%	0.377	22.8%
遺伝子工学	0.413%	1.862%	0.222	0.0%
EV	0.343%	1.649%	0.208	0.0%
フィンテック	0.312%	1.722%	0.181	0.0%
米国リート	0.297%	0.661%	0.449	77.2%

【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	0.261%	0.734%	0.355	—
自動運転	0.333%	2.052%	0.162	0.0%
クリーンテック	0.295%	2.674%	0.110	0.0%
遺伝子工学	0.291%	1.784%	0.163	0.0%
フィンテック	0.289%	1.509%	0.192	2.0%
豪州リート	0.267%	1.269%	0.210	23.2%
米国リート	0.258%	0.792%	0.326	74.8%

【半年】

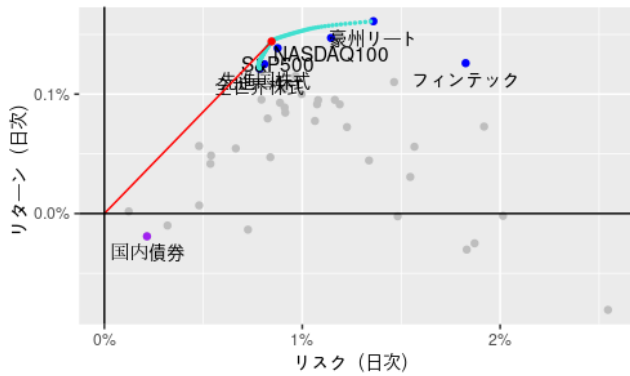


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.210%	0.780%	0.269	—
豪州リート	0.250%	1.274%	0.196	24.6%
フィンテック	0.228%	1.712%	0.133	3.7%
日経アジア 300	0.211%	0.940%	0.224	38.0%
NASDAQ100	0.179%	1.179%	0.152	0.0%
S&P500	0.178%	0.858%	0.207	33.7%
新興国株式	0.175%	0.818%	0.214	0.0%

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。

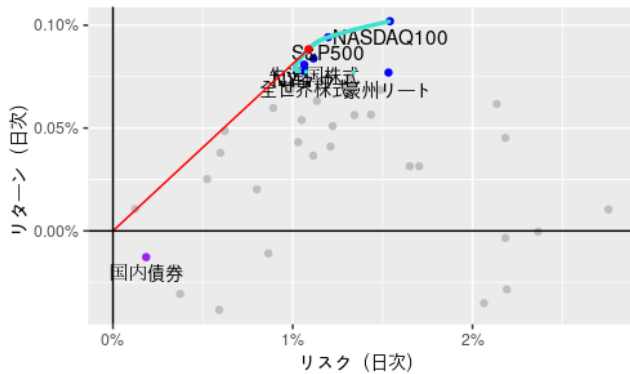
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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%	0.845%	0.171	—
豪州リート	0.161%	1.359%	0.118	24.9%
NASDAQ100	0.147%	1.145%	0.128	0.0%
S&P500	0.139%	0.876%	0.158	75.1%
フィンテック	0.126%	1.826%	0.069	0.0%
先進国株式	0.125%	0.808%	0.155	0.0%
全世界株式	0.121%	0.785%	0.154	0.0%

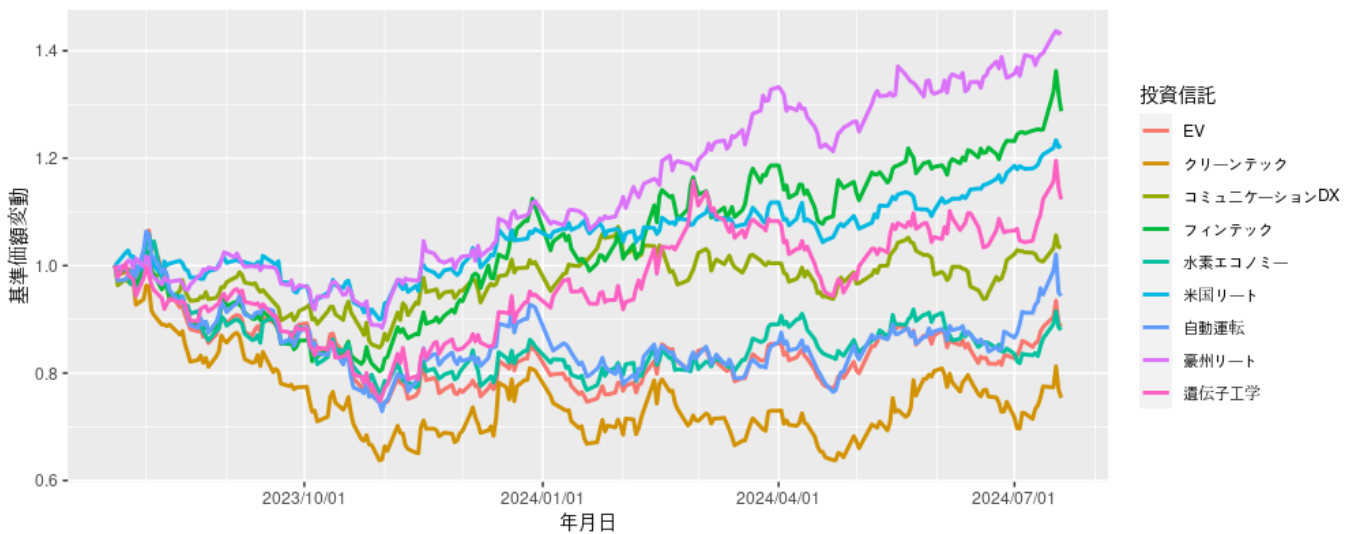
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.088%	1.088%	0.081	—
NASDAQ100	0.102%	1.541%	0.066	0.0%
S&P500	0.094%	1.197%	0.079	61.7%
先進国株式	0.084%	1.116%	0.075	0.0%
NYダウ	0.081%	1.064%	0.076	19.9%
全世界株式	0.078%	1.064%	0.073	0.0%
豪州リート	0.077%	1.533%	0.050	18.4%

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。