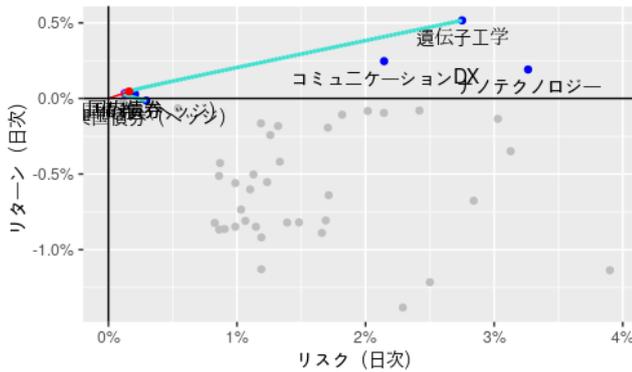


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

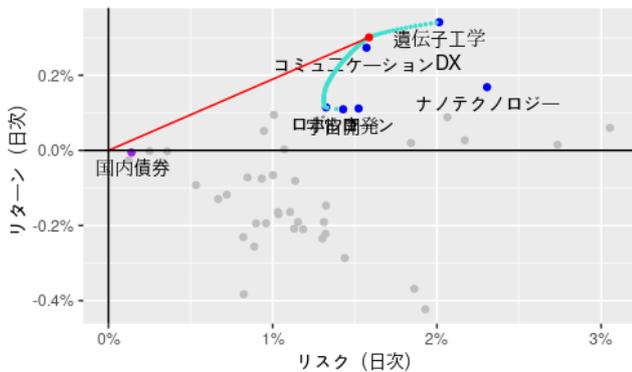
2024年7月27日

【半月】



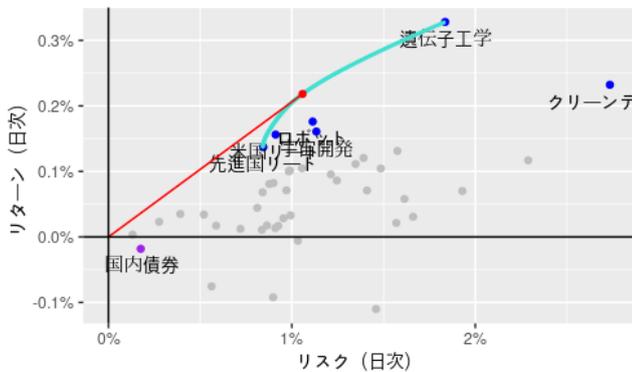
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.047%	0.161%	0.290	—
遺伝子工学	0.516%	2.751%	0.188	2.7%
コミュニケーション DX	0.246%	2.144%	0.115	0.0%
ナノテクノロジー	0.191%	3.264%	0.059	0.0%
国内債券	0.033%	0.127%	0.264	97.3%
先進国債券 (ヘッジ)	0.029%	0.207%	0.138	0.0%
新興国債券 (ヘッジ)	-0.014%	0.295%	-0.049	0.0%

【一ヶ月】



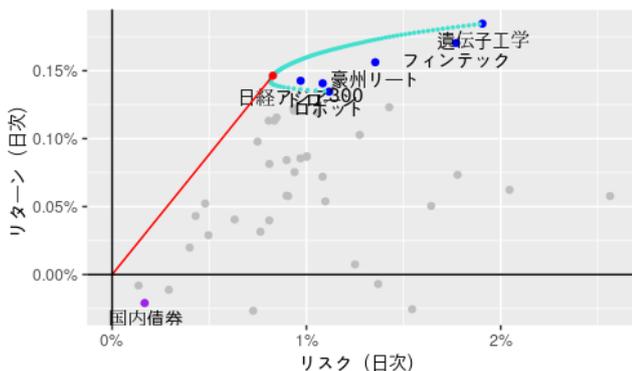
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.301%	1.587%	0.190	—
遺伝子工学	0.342%	2.014%	0.170	40.3%
コミュニケーション DX	0.274%	1.571%	0.174	59.7%
ナノテクノロジー	0.168%	2.305%	0.073	0.0%
ロボット	0.115%	1.325%	0.087	0.0%
ドローン	0.112%	1.523%	0.073	0.0%
宇宙開発	0.110%	1.429%	0.077	0.0%

【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	0.218%	1.058%	0.206	—
遺伝子工学	0.328%	1.836%	0.179	36.1%
クリーンテック	0.232%	2.734%	0.085	0.0%
ロボット	0.176%	1.114%	0.158	0.0%
宇宙開発	0.161%	1.134%	0.142	0.0%
米国リート	0.156%	0.911%	0.171	63.9%
先進国リート	0.137%	0.844%	0.162	0.0%

【半年】

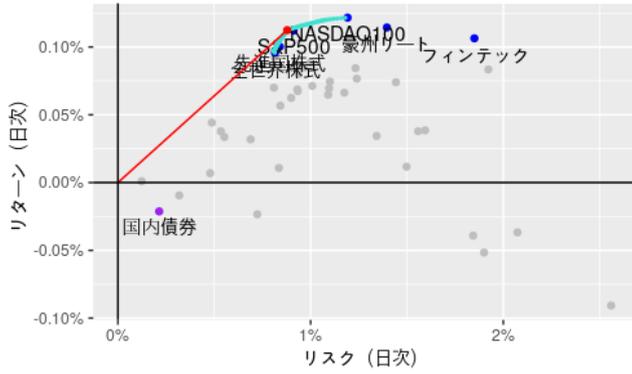


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.146%	0.827%	0.177	—
遺伝子工学	0.185%	1.906%	0.097	5.7%
フィンテック	0.170%	1.770%	0.096	0.0%
豪州リート	0.156%	1.354%	0.115	14.6%
日経アジア 300	0.143%	0.970%	0.147	47.6%
ドローン	0.141%	1.084%	0.130	32.2%
ロボット	0.135%	1.117%	0.121	0.0%

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。

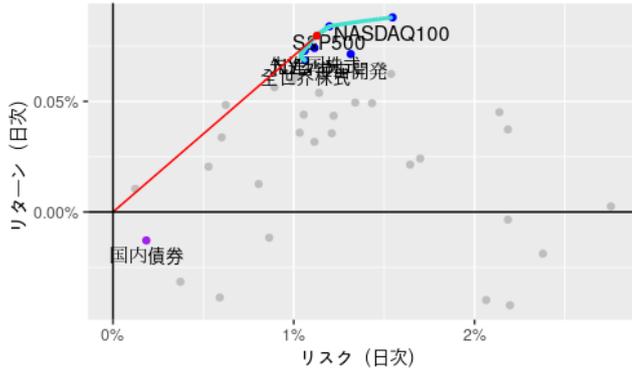
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.112%	0.878%	0.128	—
NASDAQ100	0.122%	1.192%	0.102	0.0%
豪州リート	0.114%	1.396%	0.082	18.8%
S&P500	0.112%	0.912%	0.123	80.6%
フィンテック	0.106%	1.850%	0.058	0.0%
先進国株式	0.100%	0.840%	0.119	0.0%
全世界株式	0.096%	0.815%	0.117	0.5%

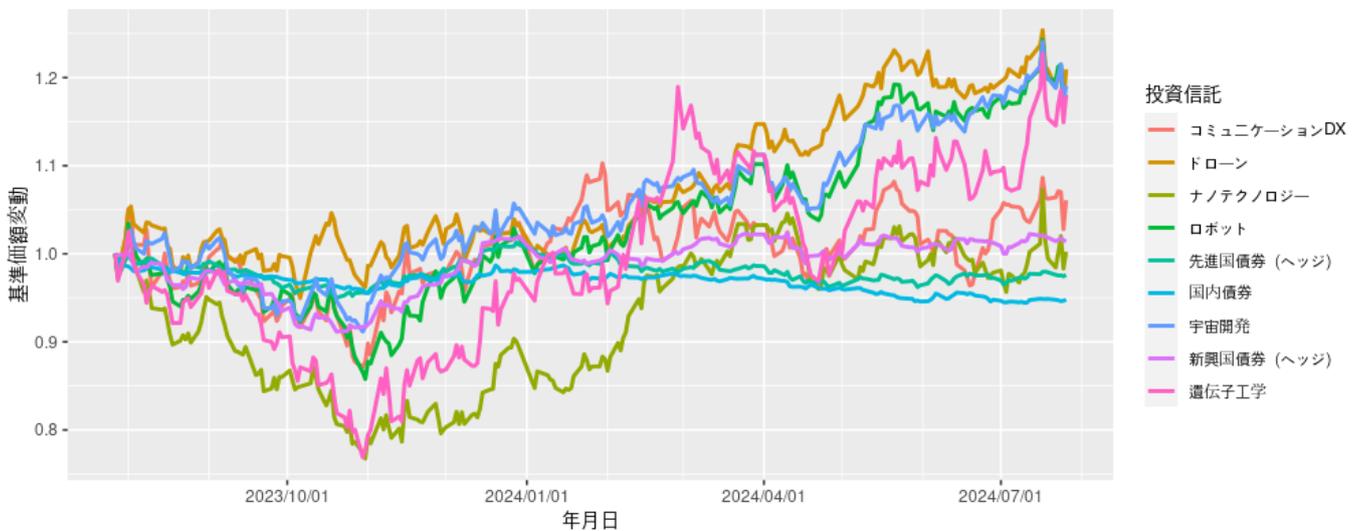
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.080%	1.128%	0.071	—
NASDAQ100	0.088%	1.547%	0.057	0.0%
S&P500	0.084%	1.197%	0.070	61.7%
先進国株式	0.074%	1.115%	0.067	0.0%
NYダウ	0.073%	1.060%	0.069	38.3%
宇宙開発	0.071%	1.315%	0.054	0.0%
全世界株式	0.069%	1.064%	0.064	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。