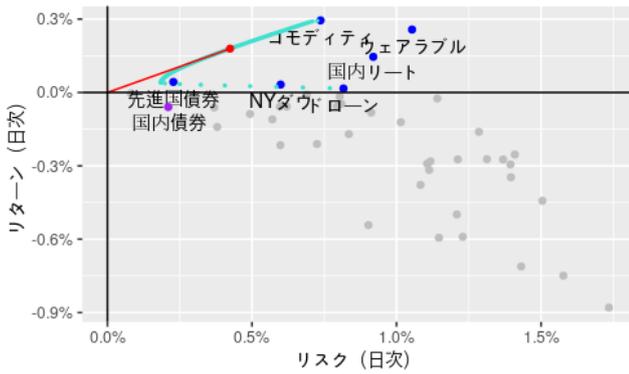


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

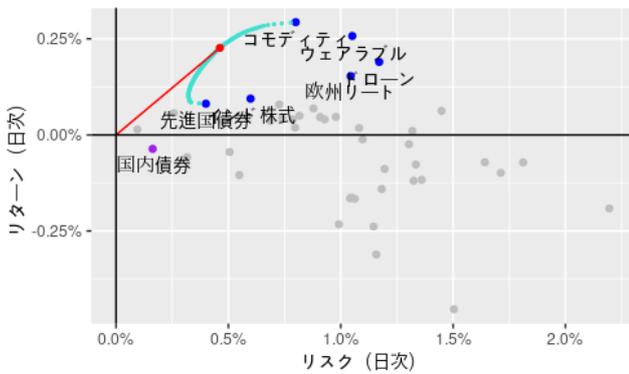
2024年4月20日

【半月】



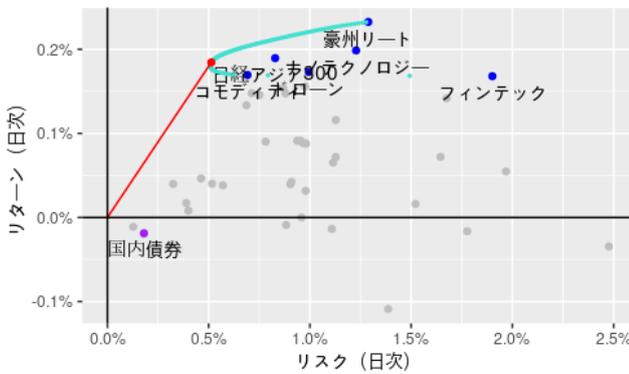
| eMAXIS     | リターン   | リスク    | t 値   | 割合    |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.179% | 0.424% | 0.422 | —     |
| コモディティ     | 0.295% | 0.737% | 0.400 | 44.5% |
| ウェアラブル     | 0.257% | 1.054% | 0.244 | 11.2% |
| 国内リート      | 0.146% | 0.920% | 0.159 | 0.0%  |
| 先進国債券      | 0.043% | 0.228% | 0.188 | 44.2% |
| NY ダウ      | 0.032% | 0.599% | 0.054 | 0.0%  |
| ドローン       | 0.016% | 0.817% | 0.020 | 0.0%  |

【一ヶ月】



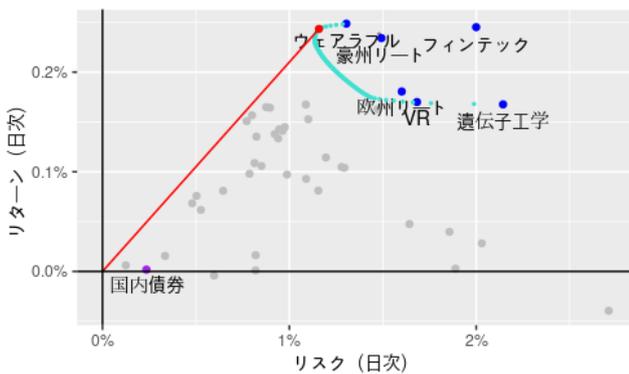
| eMAXIS     | リターン   | リスク    | t 値   | 割合    |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.227% | 0.462% | 0.490 | —     |
| コモディティ     | 0.293% | 0.800% | 0.367 | 50.1% |
| ウェアラブル     | 0.257% | 1.051% | 0.245 | 12.8% |
| ドローン       | 0.190% | 1.171% | 0.162 | 0.0%  |
| 欧州リート      | 0.153% | 1.044% | 0.146 | 19.7% |
| インド株式      | 0.094% | 0.599% | 0.158 | 17.3% |
| 先進国債券      | 0.081% | 0.400% | 0.203 | 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 | 0.184% | 0.513% | 0.360 | —     |
| 豪州リート      | 0.233% | 1.288% | 0.181 | 12.6% |
| ナノテクノロジー   | 0.199% | 1.228% | 0.162 | 4.8%  |
| 日経アジア 300  | 0.189% | 0.828% | 0.229 | 26.7% |
| ドローン       | 0.173% | 0.995% | 0.174 | 9.0%  |
| コモディティ     | 0.170% | 0.692% | 0.245 | 47.0% |
| フィンテック     | 0.168% | 1.901% | 0.088 | 0.0%  |

【半年】

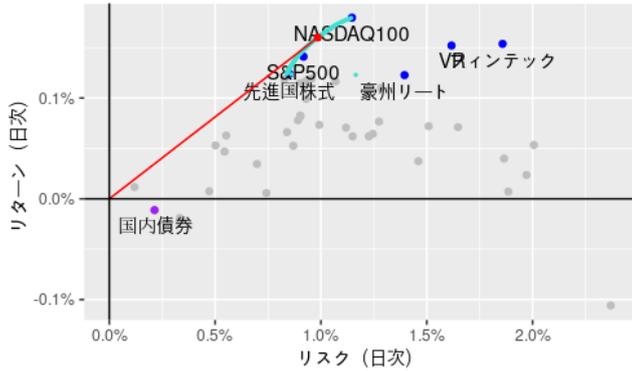


| eMAXIS     | リターン   | リスク    | t 値   | 割合    |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.243% | 1.159% | 0.210 | —     |
| ウェアラブル     | 0.249% | 1.305% | 0.191 | 64.0% |
| フィンテック     | 0.245% | 2.000% | 0.123 | 0.0%  |
| 豪州リート      | 0.234% | 1.493% | 0.157 | 35.9% |
| 欧州リート      | 0.181% | 1.601% | 0.113 | 0.1%  |
| VR         | 0.170% | 1.683% | 0.101 | 0.0%  |
| 遺伝子工学      | 0.168% | 2.144% | 0.078 | 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。

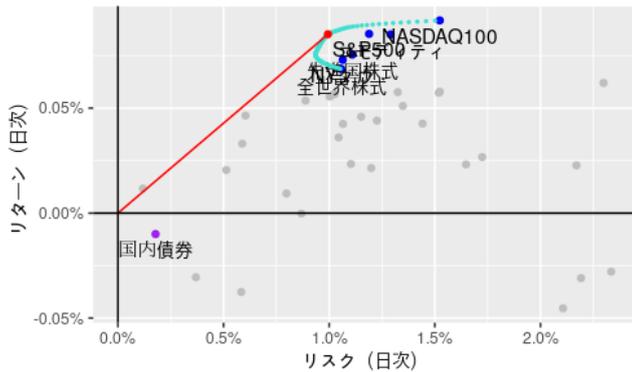
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



| eMAXIS     | リターン   | リスク    | t 値   | 割合    |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.160% | 0.985% | 0.163 | —     |
| NASDAQ100  | 0.180% | 1.147% | 0.157 | 57.3% |
| フィンテック     | 0.154% | 1.858% | 0.083 | 0.0%  |
| VR         | 0.152% | 1.617% | 0.094 | 0.0%  |
| S&P500     | 0.141% | 0.918% | 0.154 | 25.6% |
| 先進国株式      | 0.124% | 0.852% | 0.146 | 0.0%  |
| 豪州リート      | 0.123% | 1.395% | 0.088 | 17.1% |

【三年】



| eMAXIS     | リターン   | リスク    | t 値   | 割合    |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.085% | 0.994% | 0.086 | —     |
| NASDAQ100  | 0.092% | 1.523% | 0.060 | 0.0%  |
| S&P500     | 0.085% | 1.189% | 0.072 | 55.5% |
| コモディティ     | 0.085% | 1.291% | 0.066 | 44.0% |
| 先進国株式      | 0.076% | 1.110% | 0.068 | 0.0%  |
| NYダウ       | 0.073% | 1.064% | 0.069 | 0.5%  |
| 全世界株式      | 0.069% | 1.057% | 0.065 | 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。