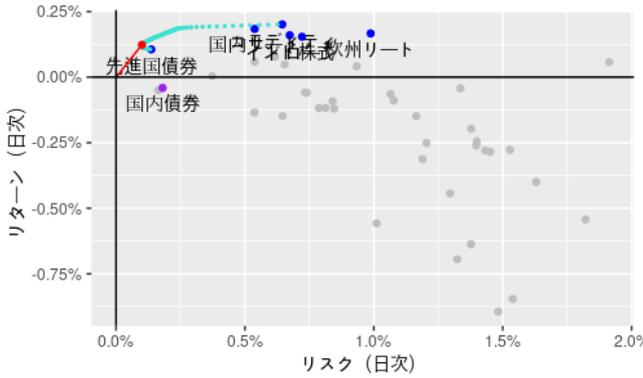


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

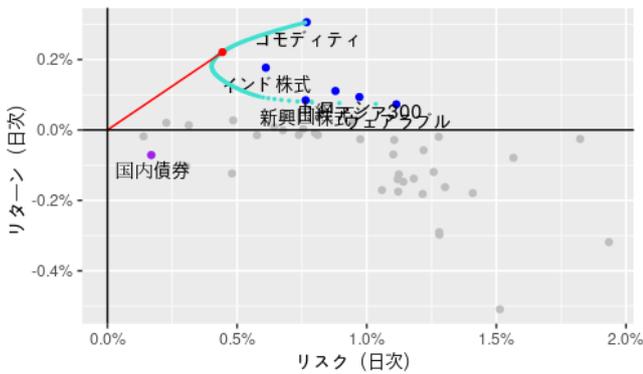
2024年4月27日

【半月】



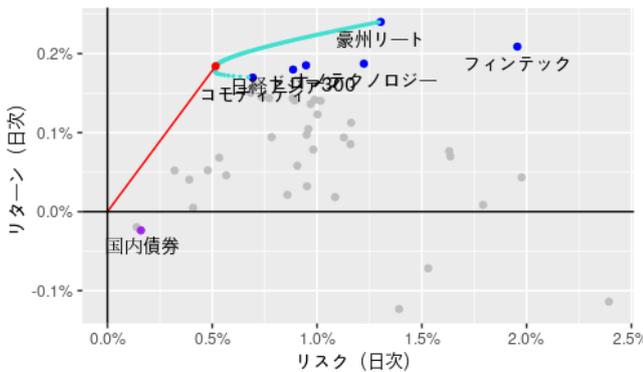
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.123%	0.100%	1.230	—
コモディティ	0.201%	0.645%	0.312	5.3%
国内リート	0.184%	0.537%	0.342	10.2%
欧州リート	0.167%	0.988%	0.169	0.0%
インド株式	0.160%	0.674%	0.237	0.0%
ドローン	0.154%	0.721%	0.213	9.5%
先進国債券	0.106%	0.136%	0.775	75.0%

【一ヶ月】



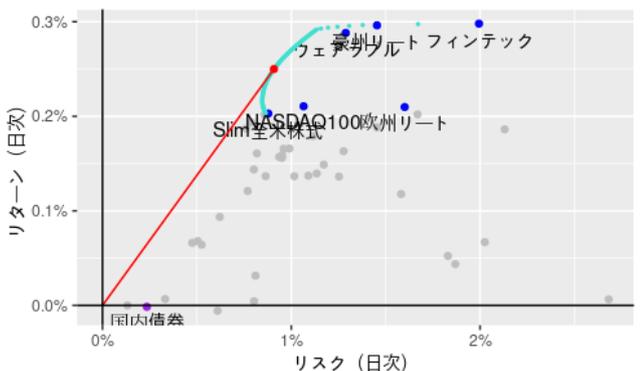
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.221%	0.443%	0.498	—
コモディティ	0.306%	0.769%	0.398	47.0%
インド株式	0.177%	0.611%	0.290	29.7%
ドローン	0.111%	0.879%	0.126	18.4%
日経アジア 300	0.094%	0.972%	0.096	0.0%
新興国株式	0.084%	0.765%	0.110	4.9%
ウェアラブル	0.073%	1.114%	0.065	0.0%

【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%	0.516%	0.357	—
豪州リート	0.240%	1.304%	0.184	13.6%
フィンテック	0.209%	1.956%	0.107	0.0%
ナノテクノロジー	0.187%	1.224%	0.153	0.0%
ドローン	0.185%	0.948%	0.195	17.8%
日経アジア 300	0.180%	0.886%	0.203	21.2%
コモディティ	0.170%	0.693%	0.245	47.5%

【半年】

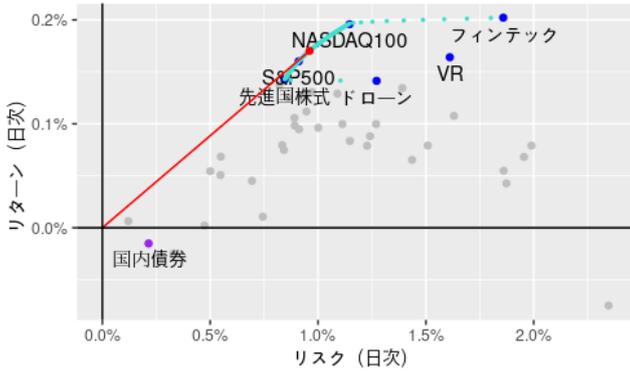


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.250%	0.908%	0.275	—
フィンテック	0.298%	1.994%	0.149	0.0%
豪州リート	0.296%	1.454%	0.204	27.7%
ウェアラブル	0.288%	1.289%	0.224	24.9%
NASDAQ100	0.211%	1.065%	0.198	0.0%
欧州リート	0.210%	1.601%	0.131	0.0%
Slim 全米株式	0.203%	0.878%	0.231	47.4%

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。

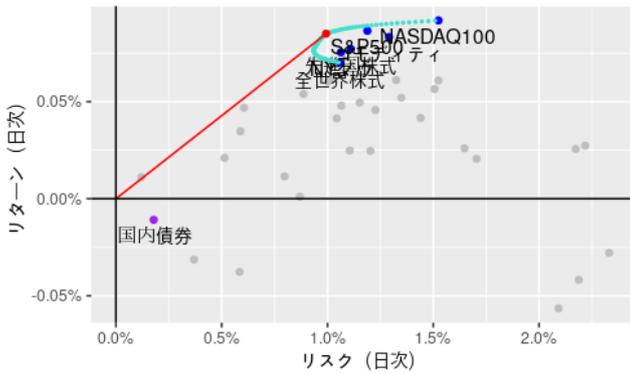
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.170%	0.961%	0.177	—
フィンテック	0.202%	1.859%	0.109	1.5%
NASDAQ100	0.196%	1.146%	0.171	26.7%
VR	0.164%	1.611%	0.102	0.0%
S&P500	0.160%	0.910%	0.176	71.8%
先進国株式	0.142%	0.845%	0.169	0.0%
ドローン	0.141%	1.272%	0.111	0.0%

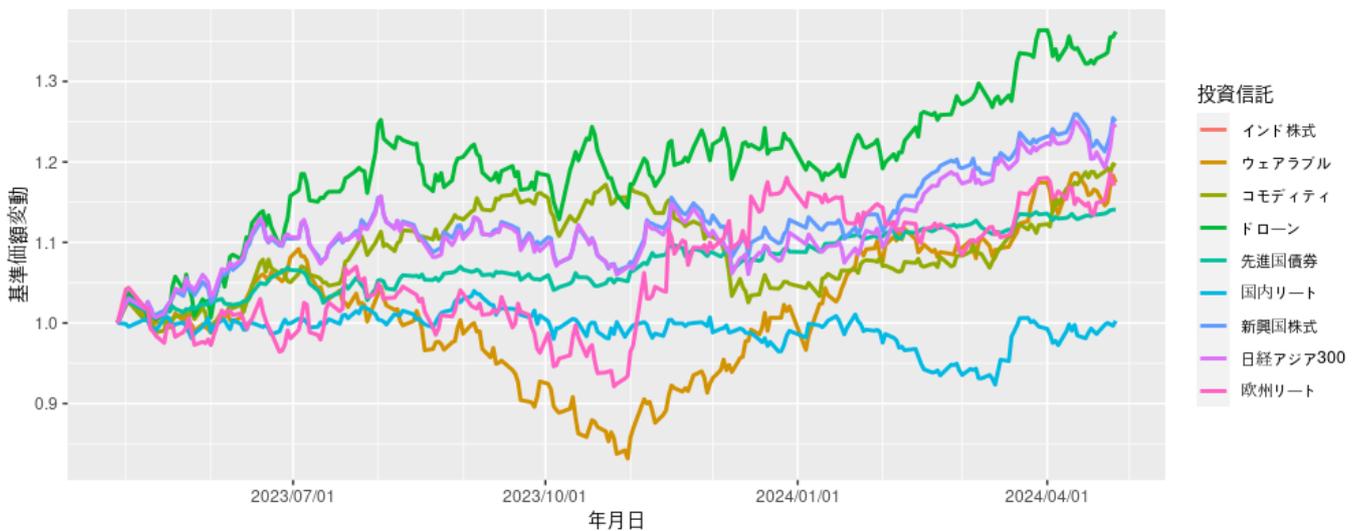
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.085%	0.993%	0.086	—
NASDAQ100	0.092%	1.525%	0.060	0.0%
S&P500	0.086%	1.189%	0.073	56.6%
コモディティ	0.083%	1.291%	0.065	42.5%
先進国株式	0.077%	1.110%	0.069	0.0%
NY ダウ	0.075%	1.063%	0.071	1.0%
全世界株式	0.070%	1.057%	0.066	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。