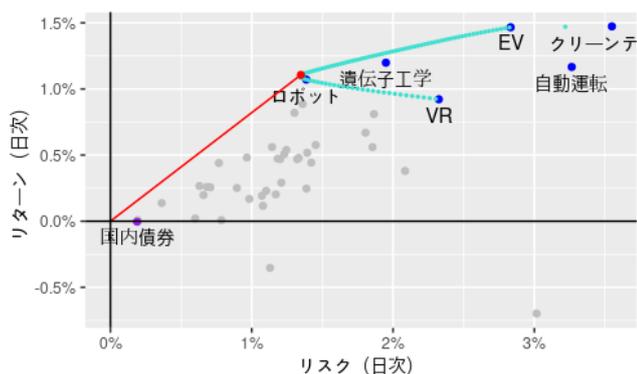


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

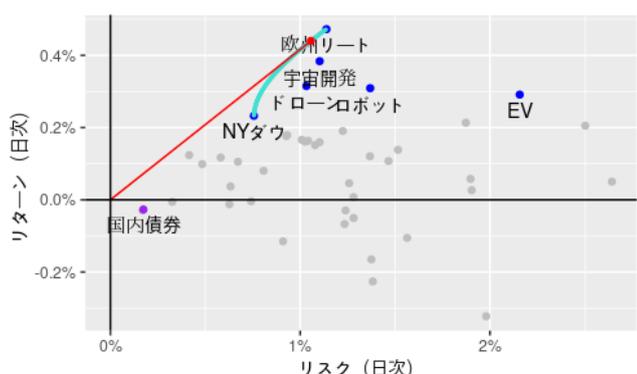
2024年5月11日

【半月】



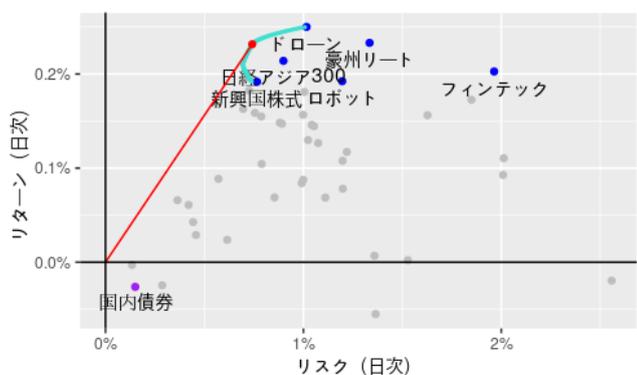
eMAIXS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	1.107%	1.348%	0.821	—
クリーンテック	1.473%	3.549%	0.415	0.0%
EV	1.466%	2.832%	0.518	0.0%
遺伝子工学	1.199%	1.950%	0.615	28.0%
自動運転	1.167%	3.265%	0.357	0.0%
ロボット	1.071%	1.386%	0.773	72.0%
VR	0.922%	2.324%	0.397	0.0%

【一ヶ月】



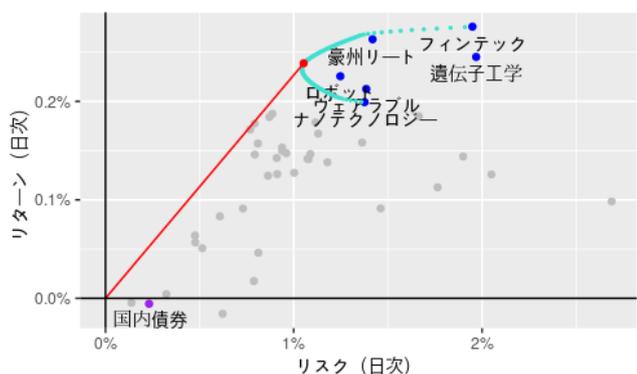
eMAIXS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.440%	1.057%	0.417	—
欧州リート	0.472%	1.138%	0.415	83.1%
宇宙開発	0.384%	1.103%	0.348	5.3%
ドローン	0.315%	1.033%	0.305	0.0%
ロボット	0.309%	1.369%	0.226	0.0%
EV	0.291%	2.157%	0.135	0.0%
NYダウ	0.233%	0.756%	0.308	11.5%

【四半期】



eMAIXS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.232%	0.741%	0.312	—
ドローン	0.250%	1.016%	0.246	46.1%
豪州リート	0.233%	1.335%	0.175	5.6%
日経アジア 300	0.214%	0.899%	0.238	48.3%
フィンテック	0.203%	1.964%	0.103	0.0%
ロボット	0.192%	1.196%	0.161	0.0%
新興国株式	0.192%	0.765%	0.251	0.0%

【半年】

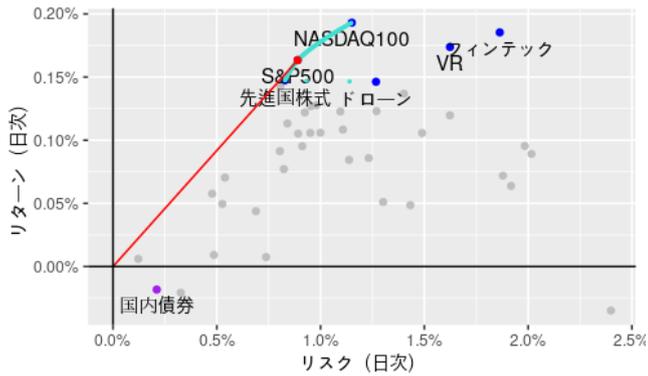


eMAIXS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.239%	1.053%	0.227	—
フィンテック	0.276%	1.949%	0.142	0.0%
豪州リート	0.263%	1.419%	0.185	43.6%
遺伝子工学	0.245%	1.969%	0.125	0.0%
ロボット	0.226%	1.247%	0.181	31.9%
ウェアラブル	0.213%	1.385%	0.153	24.5%
ナノテクノロジー	0.199%	1.376%	0.145	0.0%

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。

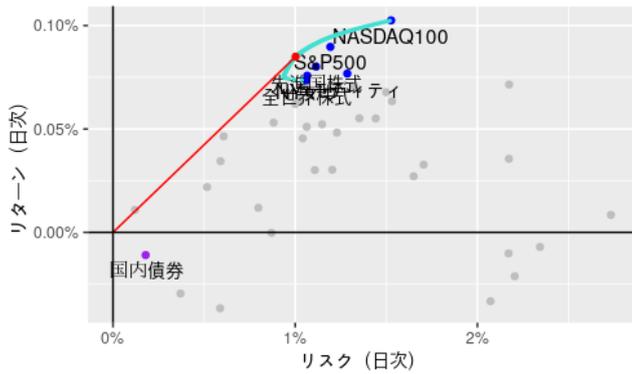
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAIXS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.163%	0.890%	0.184	—
NASDAQ100	0.193%	1.151%	0.168	0.0%
フィンテック	0.185%	1.863%	0.099	0.0%
VR	0.174%	1.624%	0.107	0.0%
S&P500	0.163%	0.890%	0.184	99.7%
先進国株式	0.147%	0.828%	0.178	0.3%
ドローン	0.146%	1.267%	0.115	0.0%

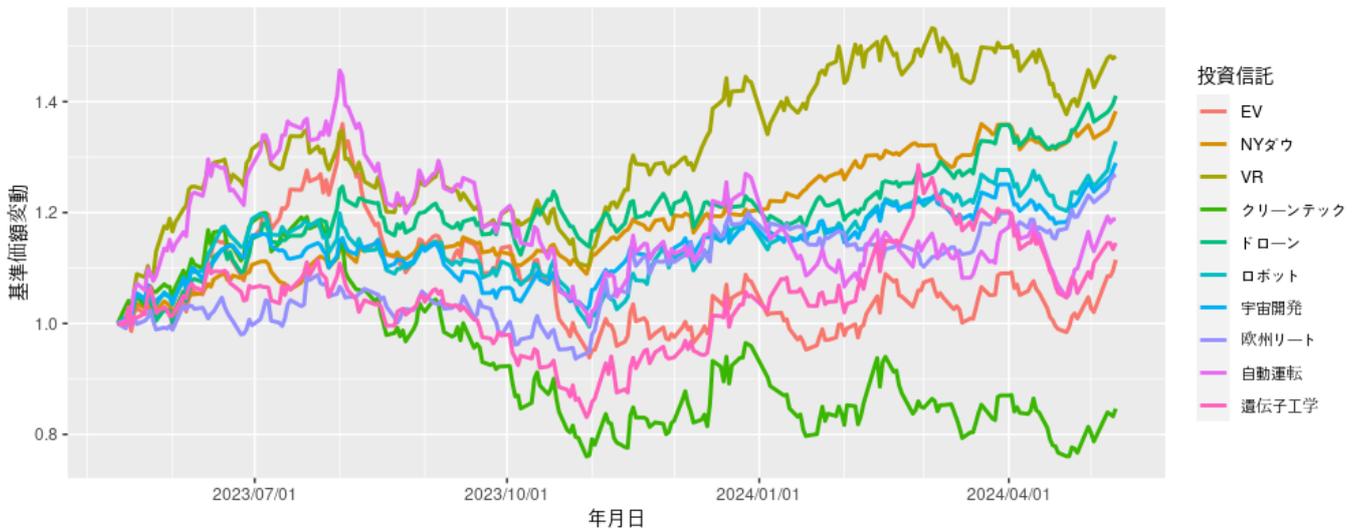
【三年】



eMAIXS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.085%	1.002%	0.085	—
NASDAQ100	0.103%	1.526%	0.067	0.8%
S&P500	0.090%	1.193%	0.075	61.8%
先進国株式	0.080%	1.114%	0.072	0.0%
コモディティ	0.077%	1.286%	0.060	37.5%
NYダウ	0.076%	1.066%	0.071	0.0%
全世界株式	0.074%	1.061%	0.069	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。