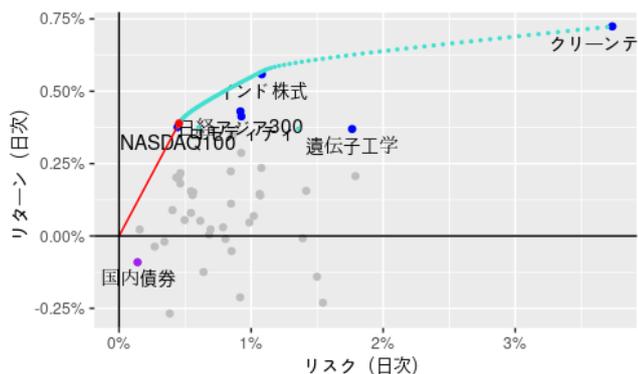


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

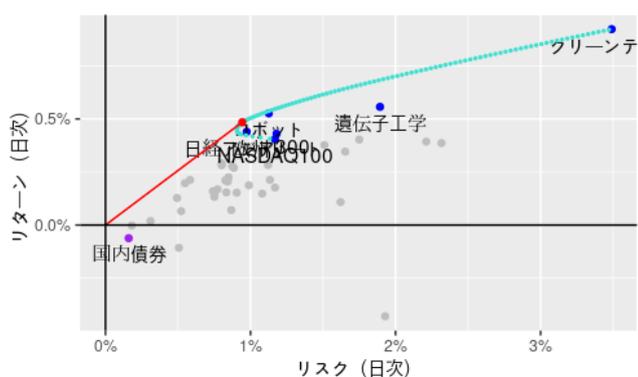
2024年5月25日

【半月】



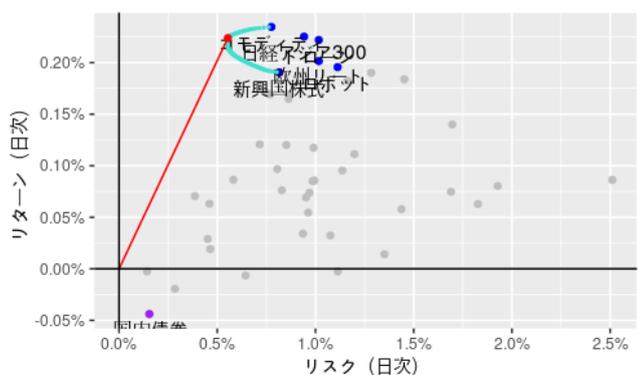
効率的ポートフォリオ	0.389%	0.454%	0.857	—
クリーンテック	0.724%	3.735%	0.194	0.0%
インド株式	0.559%	1.081%	0.517	7.2%
日経アジア 300	0.431%	0.919%	0.468	0.0%
コモディティ	0.413%	0.926%	0.446	0.0%
NASDAQ100	0.376%	0.443%	0.848	92.8%
遺伝子工学	0.369%	1.765%	0.209	0.0%

【一ヶ月】



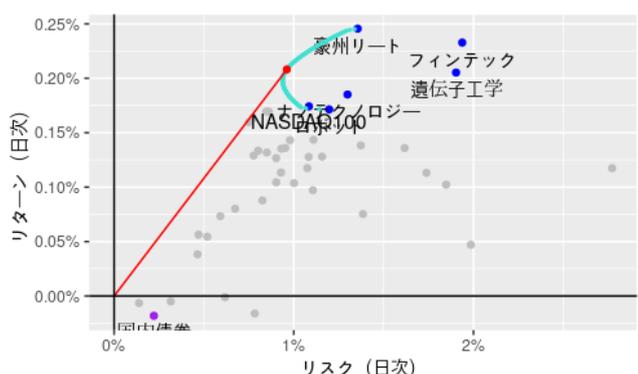
効率的ポートフォリオ	0.485%	0.943%	0.514	—
クリーンテック	0.923%	3.490%	0.264	0.0%
遺伝子工学	0.557%	1.893%	0.294	0.0%
ロボット	0.526%	1.126%	0.467	52.1%
日経アジア 300	0.440%	0.974%	0.451	47.9%
欧州リート	0.430%	1.180%	0.365	0.0%
NASDAQ100	0.404%	1.169%	0.346	0.0%

【四半期】



効率的ポートフォリオ	0.224%	0.554%	0.404	—
コモディティ	0.235%	0.775%	0.303	54.8%
日経アジア 300	0.225%	0.942%	0.239	17.7%
ドローン	0.222%	1.017%	0.218	0.0%
欧州リート	0.201%	1.017%	0.198	27.5%
ロボット	0.196%	1.113%	0.176	0.0%
新興国株式	0.191%	0.814%	0.234	0.0%

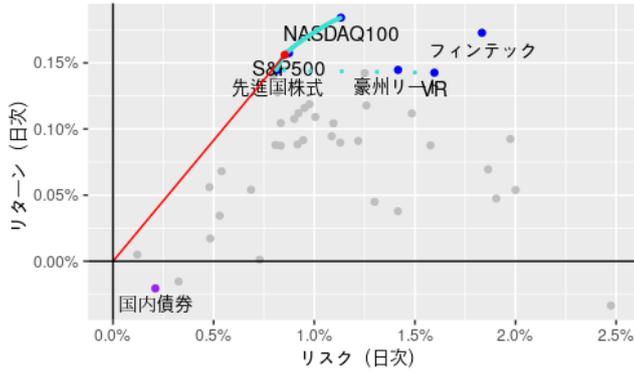
【半年】



効率的ポートフォリオ	0.208%	0.961%	0.217	—
豪州リート	0.246%	1.356%	0.181	45.6%
フィンテック	0.233%	1.937%	0.120	0.0%
遺伝子工学	0.205%	1.903%	0.108	0.0%
ナノテクノロジー	0.185%	1.299%	0.142	12.9%
NASDAQ100	0.174%	1.084%	0.161	41.6%
ロボット	0.171%	1.197%	0.143	0.0%

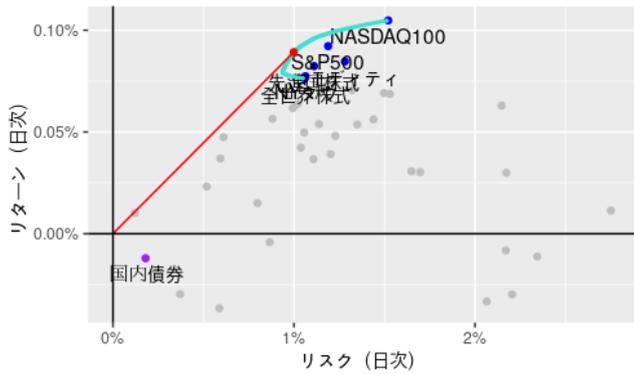
備考 (1) グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。
 (2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.156%	0.853%	0.183	—
NASDAQ100	0.184%	1.133%	0.163	0.4%
フィンテック	0.173%	1.833%	0.094	0.0%
S&P500	0.157%	0.874%	0.180	88.4%
豪州リート	0.145%	1.416%	0.102	11.1%
先進国株式	0.145%	0.817%	0.177	0.0%
VR	0.143%	1.597%	0.089	0.0%

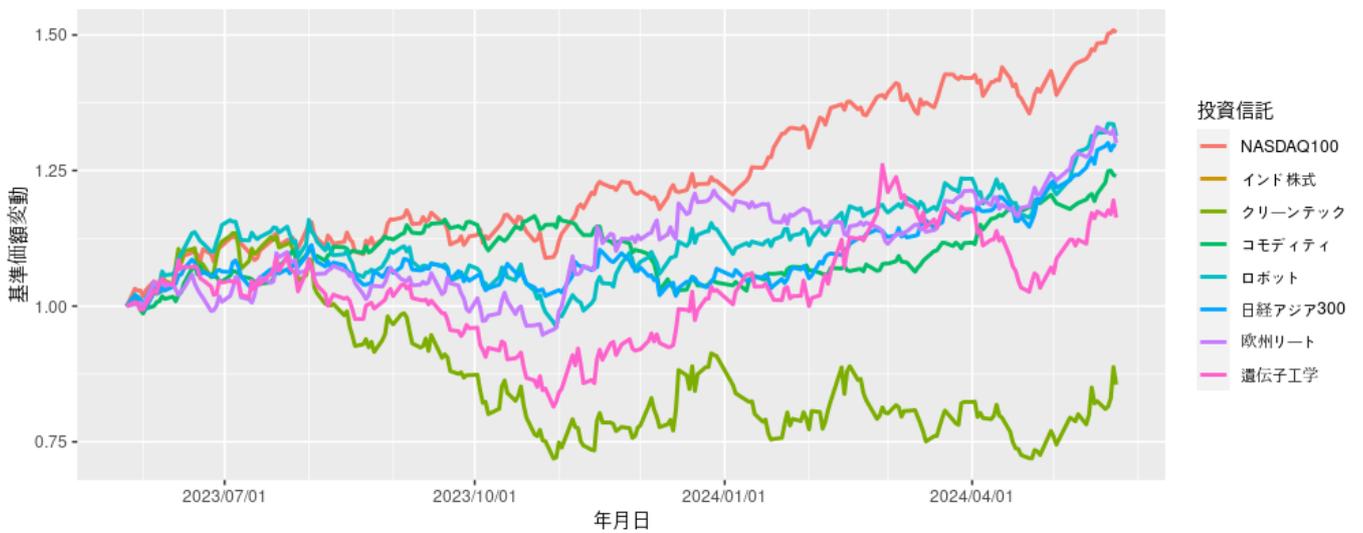
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.089%	0.998%	0.089	—
NASDAQ100	0.105%	1.521%	0.069	0.8%
S&P500	0.092%	1.189%	0.078	58.5%
コモディティ	0.085%	1.281%	0.066	40.7%
先進国株式	0.082%	1.111%	0.074	0.0%
NY ダウ	0.077%	1.063%	0.073	0.0%
全世界株式	0.076%	1.059%	0.072	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。