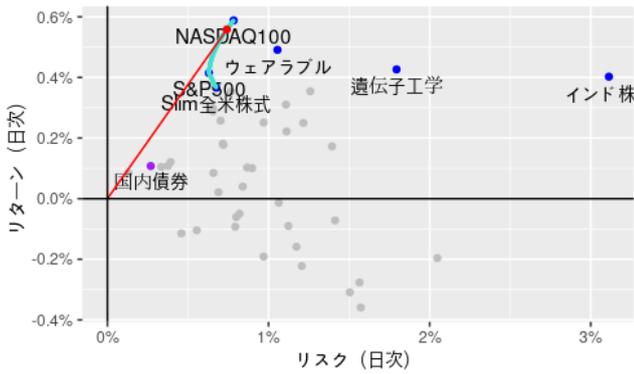


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

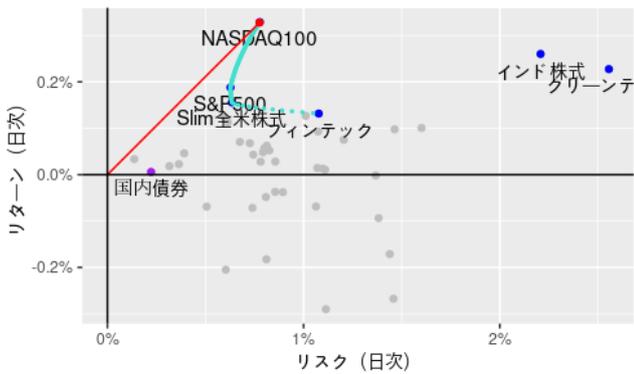
2024年6月15日

【半月】



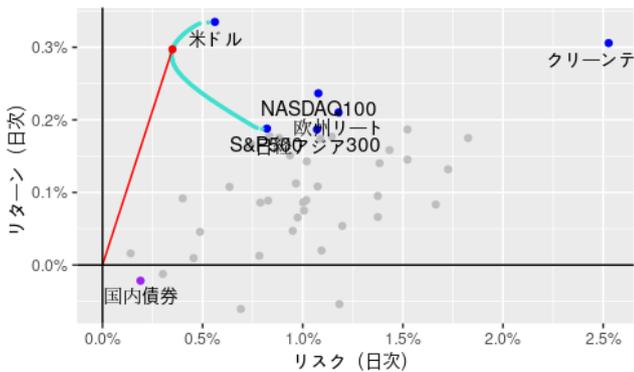
| eMAXIS | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.558% | 0.741% | 0.753 | — |
| NASDAQ100 | 0.588% | 0.783% | 0.751 | 82.7% |
| ウェアラブル | 0.491% | 1.056% | 0.465 | 0.0% |
| 遺伝子工学 | 0.426% | 1.795% | 0.238 | 0.0% |
| S&P500 | 0.415% | 0.630% | 0.658 | 17.3% |
| インド株式 | 0.402% | 3.113% | 0.129 | 0.0% |
| Slim 全米株式 | 0.366% | 0.675% | 0.543 | 0.0% |

【一ヶ月】



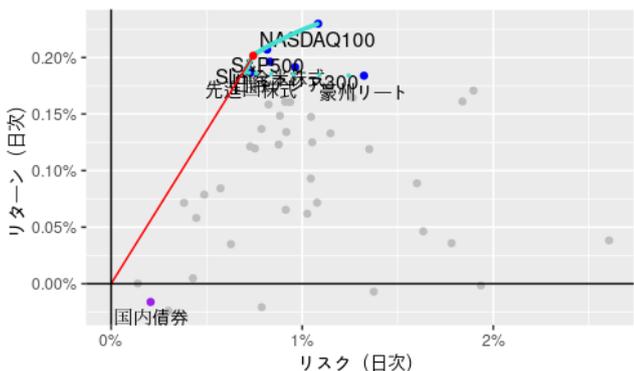
| eMAXIS | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.328% | 0.775% | 0.423 | — |
| NASDAQ100 | 0.329% | 0.777% | 0.423 | 99.3% |
| インド株式 | 0.260% | 2.208% | 0.118 | 0.0% |
| クリーンテック | 0.227% | 2.556% | 0.089 | 0.0% |
| S&P500 | 0.188% | 0.627% | 0.300 | 0.7% |
| Slim 全米株式 | 0.156% | 0.634% | 0.245 | 0.0% |
| フィンテック | 0.132% | 1.077% | 0.122 | 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 | 0.297% | 0.349% | 0.851 | — |
| 米ドル | 0.335% | 0.561% | 0.597 | 69.9% |
| クリーンテック | 0.306% | 2.527% | 0.121 | 2.3% |
| NASDAQ100 | 0.237% | 1.078% | 0.219 | 0.0% |
| 欧州リート | 0.210% | 1.179% | 0.178 | 17.2% |
| S&P500 | 0.188% | 0.821% | 0.229 | 0.0% |
| 日経アジア 300 | 0.187% | 1.072% | 0.174 | 10.5% |

【半年】

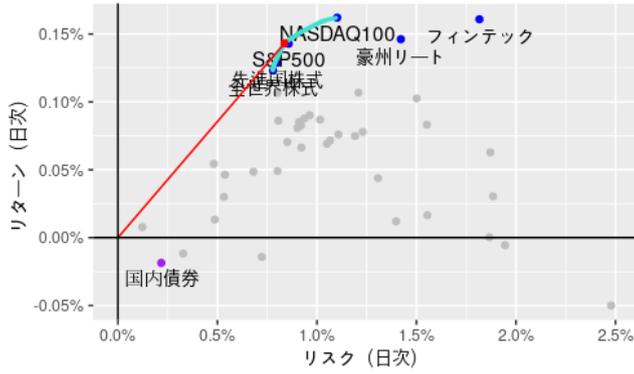


| eMAXIS | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.202% | 0.744% | 0.271 | — |
| NASDAQ100 | 0.230% | 1.083% | 0.212 | 0.0% |
| S&P500 | 0.207% | 0.817% | 0.253 | 68.2% |
| Slim 全米株式 | 0.196% | 0.832% | 0.236 | 0.0% |
| 日経アジア 300 | 0.192% | 0.963% | 0.199 | 25.5% |
| 先進国株式 | 0.187% | 0.733% | 0.255 | 0.0% |
| 豪州リート | 0.184% | 1.324% | 0.139 | 6.3% |

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。

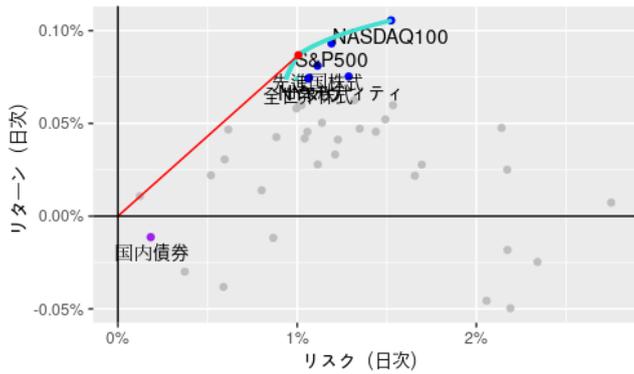
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



| eMAXIS | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.143% | 0.837% | 0.171 | — |
| NASDAQ100 | 0.162% | 1.102% | 0.147 | 0.0% |
| フィンテック | 0.161% | 1.816% | 0.089 | 0.0% |
| 豪州リート | 0.146% | 1.422% | 0.103 | 14.4% |
| S&P500 | 0.143% | 0.858% | 0.167 | 84.5% |
| 先進国株式 | 0.129% | 0.799% | 0.161 | 1.0% |
| 全世界株式 | 0.123% | 0.779% | 0.158 | 0.0% |

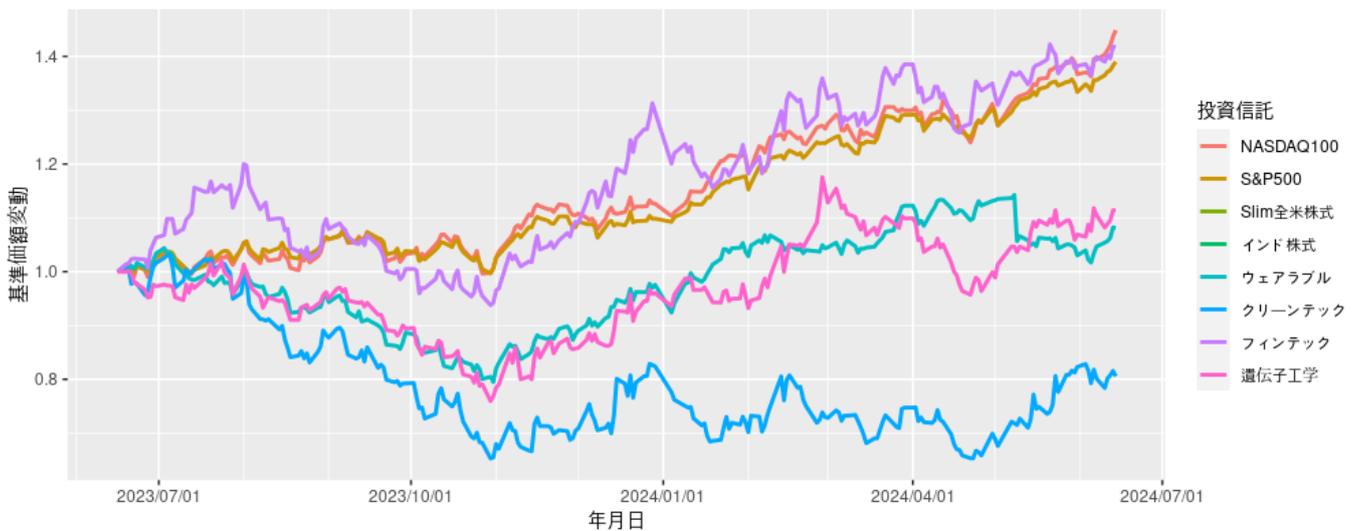
【三年】



| eMAXIS | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.087% | 1.007% | 0.086 | — |
| NASDAQ100 | 0.106% | 1.524% | 0.069 | 0.0% |
| S&P500 | 0.093% | 1.192% | 0.078 | 64.5% |
| 先進国株式 | 0.081% | 1.114% | 0.073 | 0.0% |
| コモディティ | 0.075% | 1.287% | 0.058 | 35.5% |
| NYダウ | 0.075% | 1.067% | 0.070 | 0.0% |
| 全世界株式 | 0.074% | 1.062% | 0.070 | 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。