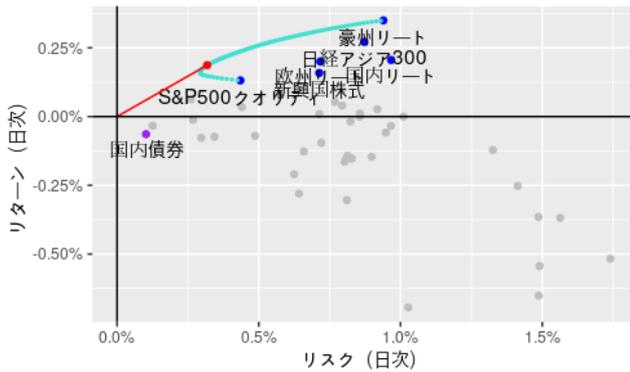


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

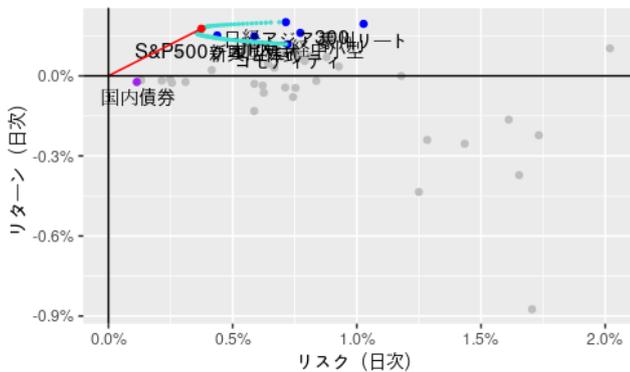
2024年3月16日

【半月】



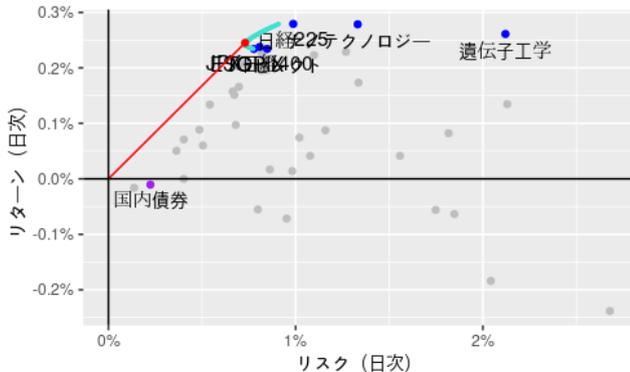
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.187%	0.318%	0.588	—
豪州リート	0.350%	0.939%	0.372	0.0%
日経アジア 300	0.271%	0.872%	0.311	17.2%
国内リート	0.206%	0.967%	0.213	15.1%
欧州リート	0.200%	0.717%	0.279	29.5%
新興国株式	0.158%	0.713%	0.222	0.0%
S&P500 クオリティ	0.131%	0.435%	0.302	38.2%

【一ヶ月】



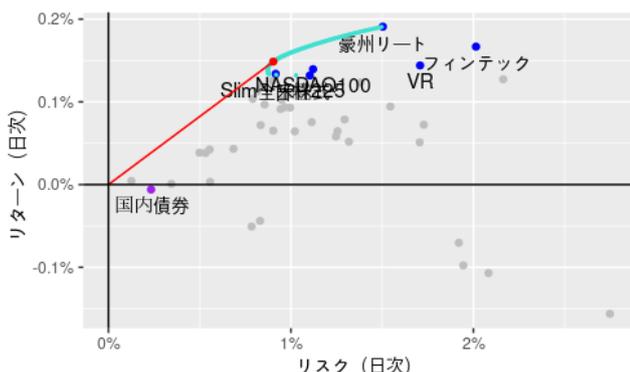
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.177%	0.374%	0.472	—
日経アジア 300	0.201%	0.714%	0.282	31.4%
豪州リート	0.195%	1.027%	0.190	15.2%
JPX 日経中小型	0.161%	0.773%	0.208	32.7%
S&P500 クオリティ	0.152%	0.438%	0.346	20.7%
新興国株式	0.148%	0.588%	0.253	0.0%
コモディティ	0.119%	0.722%	0.164	0.0%

【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	0.245%	0.730%	0.336	—
日経 225	0.279%	0.987%	0.283	0.0%
ナノテクノロジー	0.279%	1.331%	0.209	24.9%
遺伝子工学	0.261%	2.121%	0.123	0.0%
JPX 日経 400	0.238%	0.808%	0.294	0.0%
ESG セレクト	0.234%	0.848%	0.276	0.0%
TOPIX	0.234%	0.777%	0.301	75.1%

【半年】

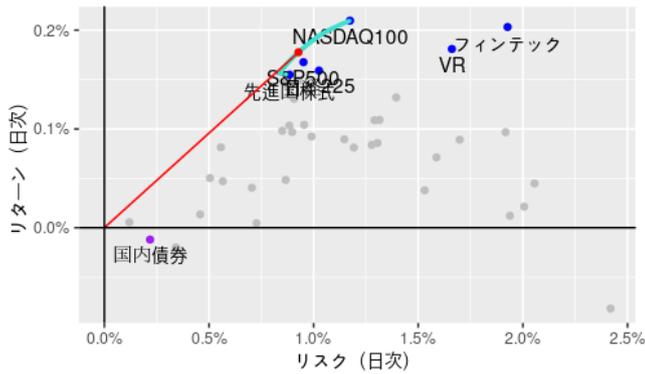


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.149%	0.903%	0.165	—
豪州リート	0.191%	1.504%	0.127	26.7%
フィンテック	0.167%	2.014%	0.083	0.0%
VR	0.144%	1.708%	0.084	0.0%
NASDAQ100	0.140%	1.121%	0.124	0.0%
Slim 全米株式	0.134%	0.917%	0.146	51.7%
日経 225	0.132%	1.104%	0.119	21.6%

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。

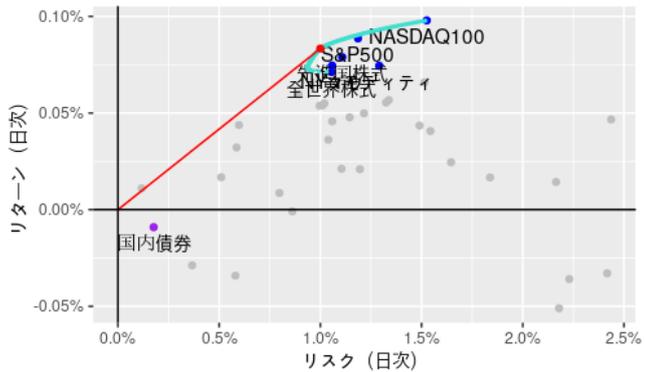
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.178%	0.928%	0.192	—
NASDAQ100	0.210%	1.174%	0.179	35.0%
フィンテック	0.203%	1.927%	0.105	0.0%
VR	0.181%	1.661%	0.109	0.0%
S&P500	0.168%	0.951%	0.176	16.6%
日経 225	0.159%	1.026%	0.155	35.4%
先進国株式	0.155%	0.885%	0.175	13.0%

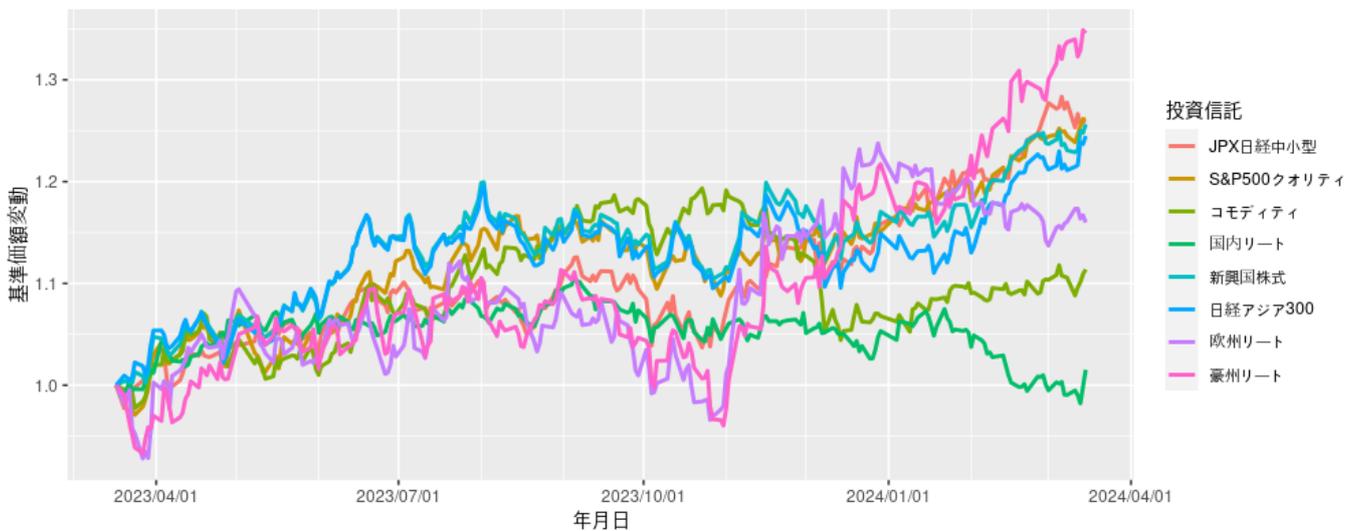
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.083%	1.000%	0.083	—
NASDAQ100	0.098%	1.526%	0.064	0.0%
S&P500	0.089%	1.186%	0.075	63.0%
先進国株式	0.079%	1.108%	0.071	0.0%
NY ダウ	0.075%	1.058%	0.070	0.0%
コモディティ	0.074%	1.291%	0.058	37.0%
全世界株式	0.071%	1.055%	0.067	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。