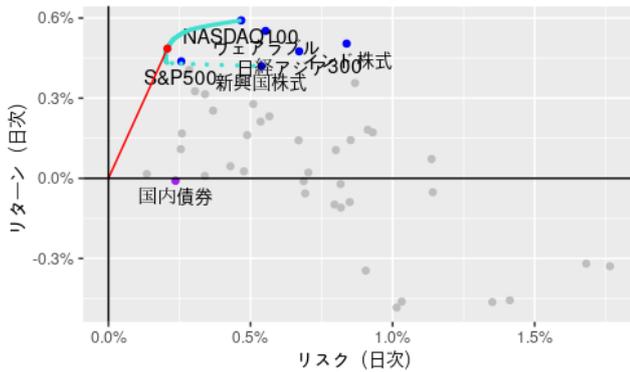


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

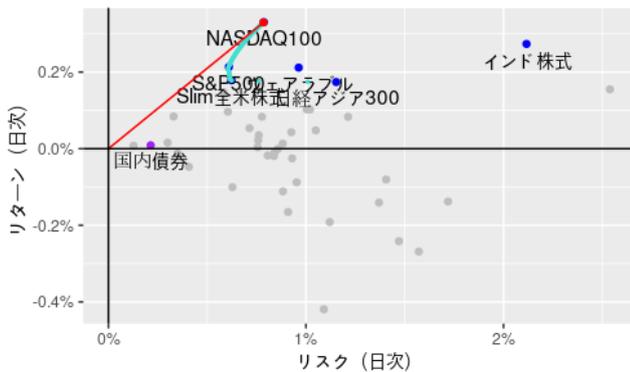
2024年6月22日

【半月】



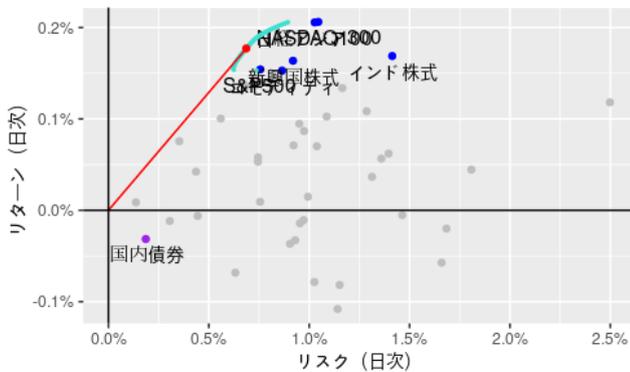
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.486%	0.208%	2.338	—
NASDAQ100	0.591%	0.467%	1.265	24.0%
ウェアラブル	0.552%	0.553%	0.997	13.4%
インド株式	0.504%	0.838%	0.601	2.4%
日経アジア 300	0.475%	0.671%	0.708	0.0%
S&P500	0.438%	0.256%	1.706	29.0%
新興国株式	0.420%	0.539%	0.779	31.3%

【一ヶ月】



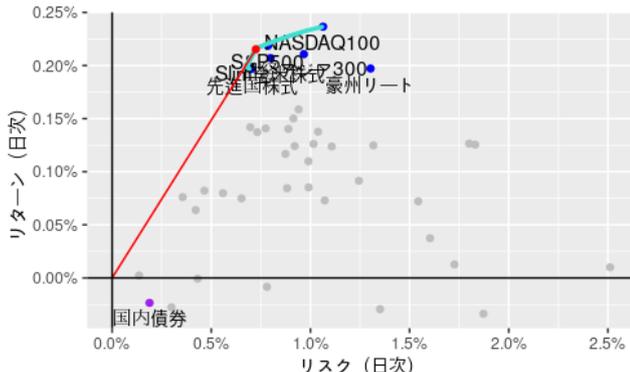
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.330%	0.785%	0.420	—
NASDAQ100	0.330%	0.786%	0.420	99.3%
インド株式	0.273%	2.117%	0.129	0.0%
S&P500	0.213%	0.610%	0.350	0.7%
ウェアラブル	0.212%	0.963%	0.220	0.0%
Slim 全米株式	0.179%	0.623%	0.287	0.0%
日経アジア 300	0.174%	1.153%	0.151	0.0%

【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	0.177%	0.687%	0.258	—
日経アジア 300	0.206%	1.045%	0.197	20.9%
NASDAQ100	0.206%	1.028%	0.200	24.3%
インド株式	0.169%	1.414%	0.119	0.3%
新興国株式	0.164%	0.919%	0.178	0.0%
S&P500	0.154%	0.757%	0.204	17.3%
コモディティ	0.153%	0.865%	0.177	37.2%

【半年】

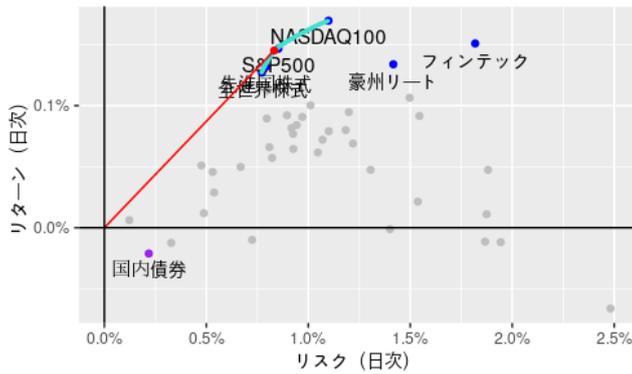


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.215%	0.725%	0.297	—
NASDAQ100	0.237%	1.064%	0.222	0.0%
S&P500	0.219%	0.786%	0.278	69.2%
日経アジア 300	0.211%	0.967%	0.218	24.8%
Slim 全米株式	0.207%	0.799%	0.259	0.0%
豪州リート	0.197%	1.303%	0.151	6.1%
先進国株式	0.197%	0.704%	0.280	0.0%

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。

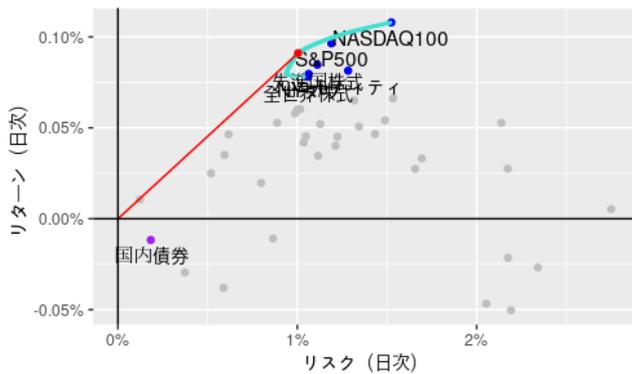
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.145%	0.833%	0.174	—
NASDAQ100	0.170%	1.099%	0.154	0.0%
フィンテック	0.151%	1.818%	0.083	0.0%
S&P500	0.147%	0.853%	0.172	88.5%
豪州リート	0.134%	1.417%	0.094	11.5%
先進国株式	0.132%	0.793%	0.166	0.0%
全世界株式	0.127%	0.772%	0.164	0.0%

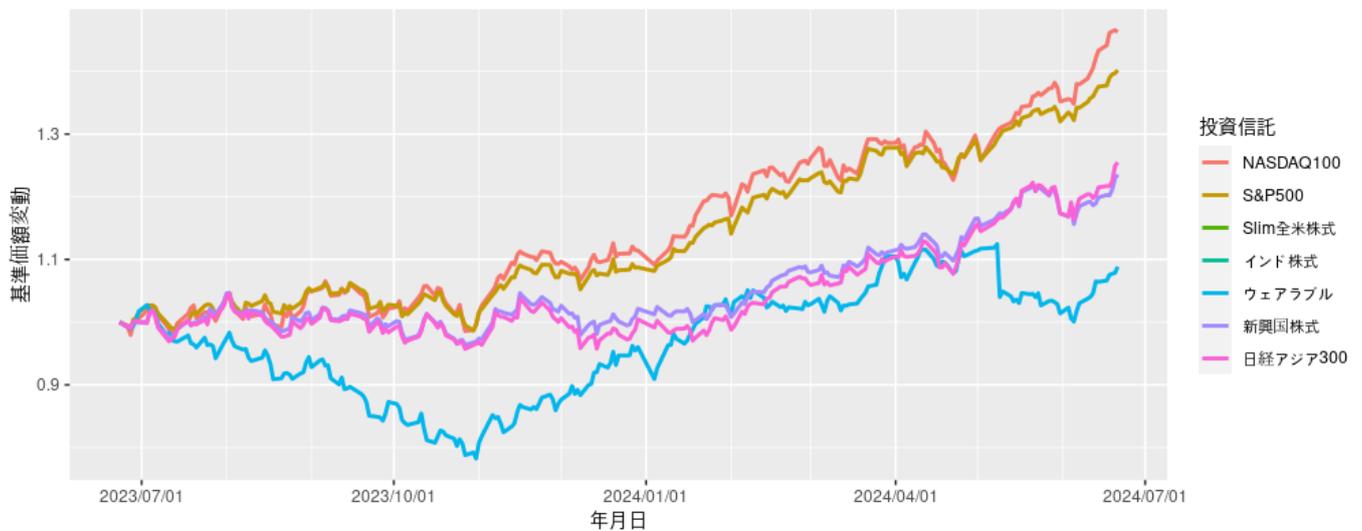
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.091%	1.004%	0.091	—
NASDAQ100	0.108%	1.524%	0.071	0.0%
S&P500	0.096%	1.190%	0.081	64.2%
先進国株式	0.085%	1.112%	0.076	0.0%
コモディティ	0.081%	1.283%	0.063	35.8%
NYダウ	0.080%	1.064%	0.075	0.0%
全世界株式	0.078%	1.061%	0.074	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。