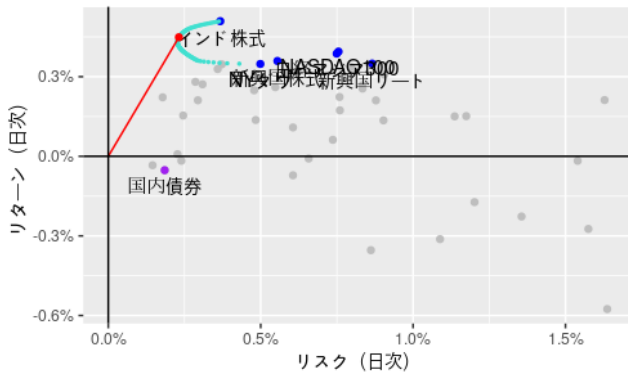


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

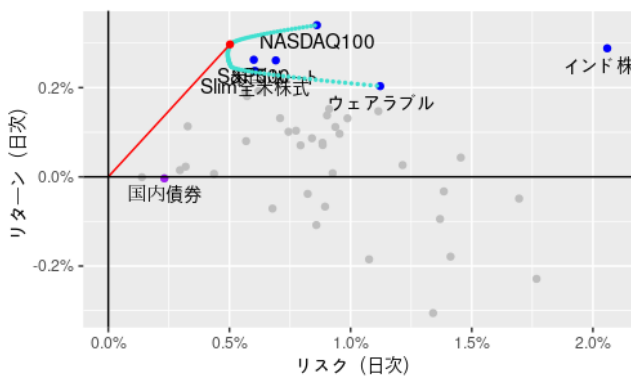
2024年6月29日

【半月】



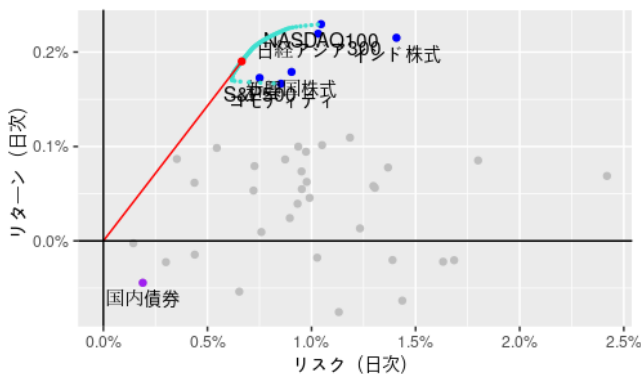
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.449%	0.232%	1.936	—
インド株式	0.509%	0.367%	1.386	60.6%
NASDAQ100	0.395%	0.755%	0.522	3.7%
日経アジア 300	0.387%	0.749%	0.516	0.0%
新興国株式	0.359%	0.555%	0.647	10.4%
新興国リート	0.349%	0.866%	0.403	14.2%
NY ダウ	0.348%	0.499%	0.697	11.1%

【一ヶ月】



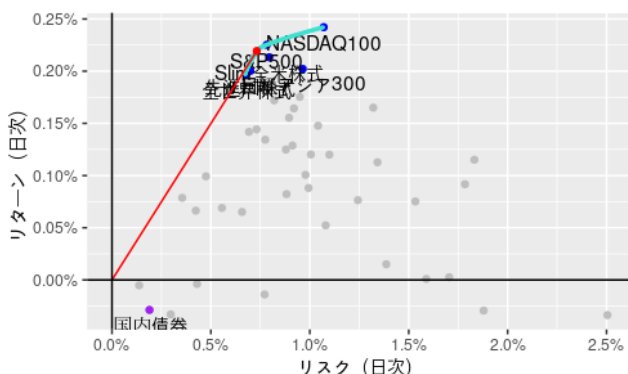
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.297%	0.502%	0.591	—
NASDAQ100	0.340%	0.861%	0.395	45.2%
インド株式	0.288%	2.059%	0.140	0.9%
S&P500	0.262%	0.601%	0.437	0.0%
米国リート	0.261%	0.691%	0.378	53.9%
Slim 全米株式	0.238%	0.605%	0.393	0.0%
ウェアラブル	0.203%	1.122%	0.181	0.0%

【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	0.190%	0.665%	0.286	—
NASDAQ100	0.230%	1.046%	0.219	18.8%
日経アジア 300	0.219%	1.032%	0.213	13.7%
インド株式	0.215%	1.408%	0.153	6.2%
新興国株式	0.179%	0.904%	0.198	0.0%
S&P500	0.173%	0.750%	0.230	25.3%
コモディティ	0.167%	0.853%	0.195	36.0%

【半年】

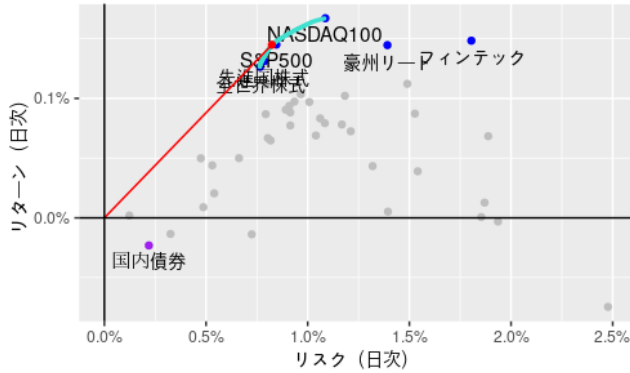


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.219%	0.732%	0.300	—
NASDAQ100	0.242%	1.070%	0.226	0.0%
S&P500	0.225%	0.783%	0.288	74.6%
Slim 全米株式	0.213%	0.795%	0.268	0.0%
日経アジア 300	0.202%	0.964%	0.210	24.1%
先進国株式	0.200%	0.699%	0.286	1.3%
全世界株式	0.197%	0.678%	0.291	0.0%

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。

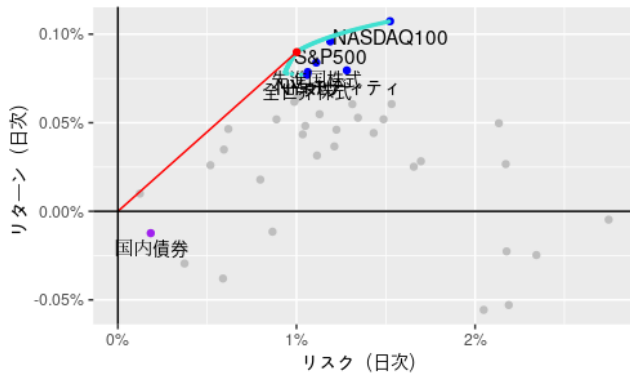
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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%	0.824%	0.176	—
NASDAQ100	0.167%	1.087%	0.154	0.0%
フィンテック	0.148%	1.805%	0.082	0.0%
S&P500	0.145%	0.846%	0.171	85.0%
豪州リート	0.145%	1.392%	0.104	14.4%
先進国株式	0.131%	0.786%	0.167	0.0%
全世界株式	0.126%	0.766%	0.165	0.6%

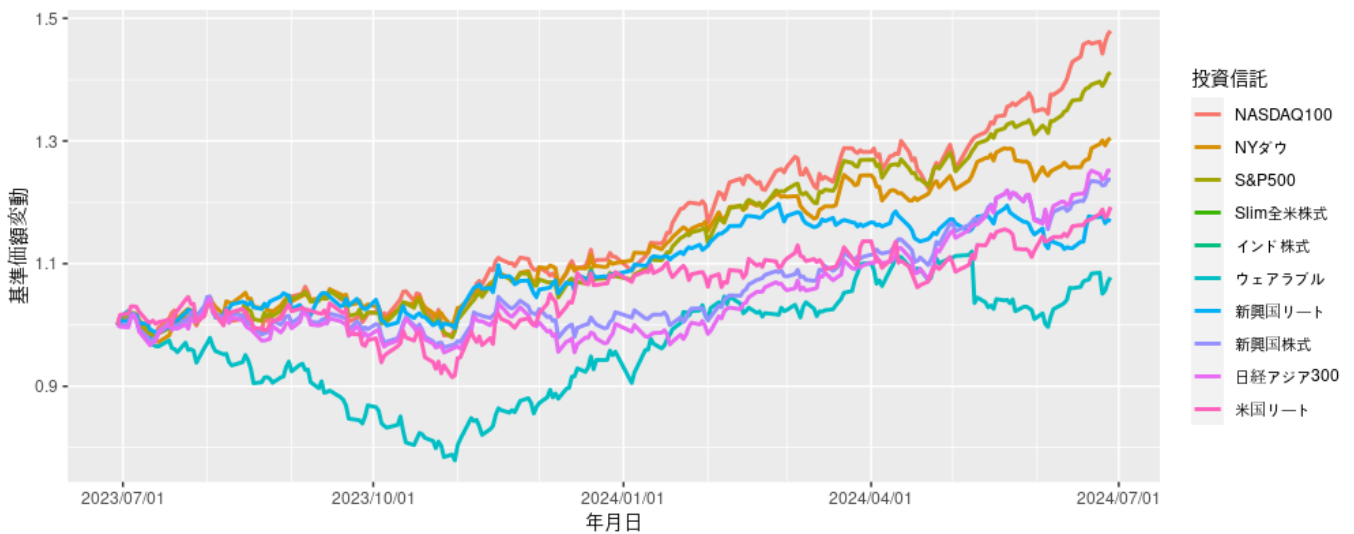
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.090%	1.001%	0.090	—
NASDAQ100	0.107%	1.524%	0.070	0.0%
S&P500	0.096%	1.189%	0.081	63.1%
先進国株式	0.084%	1.111%	0.076	0.0%
コモディティ	0.080%	1.282%	0.062	36.9%
NYダウ	0.079%	1.063%	0.074	0.0%
全世界株式	0.077%	1.060%	0.073	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。