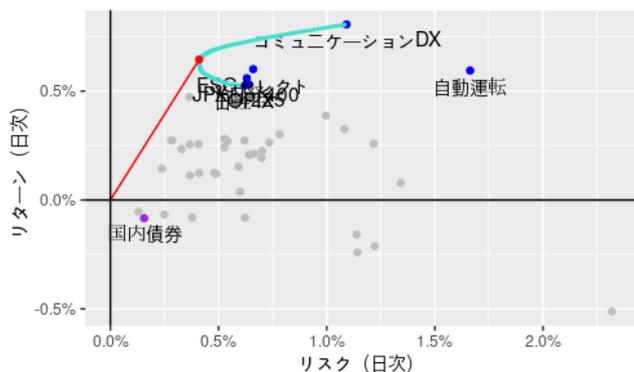


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

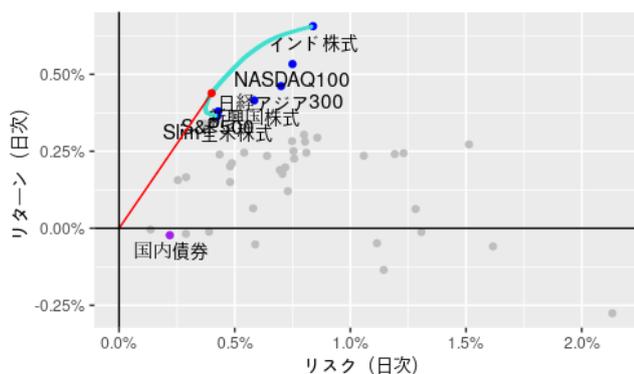
2024年7月6日

【半月】



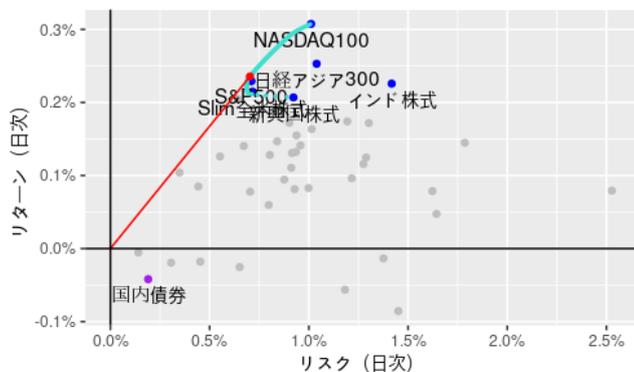
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.645%	0.410%	1.573	—
コミュニケーション DX	0.806%	1.092%	0.738	30.0%
ESG セレクト	0.601%	0.660%	0.910	38.1%
自動運転	0.595%	1.663%	0.357	7.4%
JPX 日経 400	0.559%	0.630%	0.887	0.0%
日経 225	0.531%	0.640%	0.829	24.4%
TOPIX	0.526%	0.622%	0.845	0.0%

【一ヶ月】



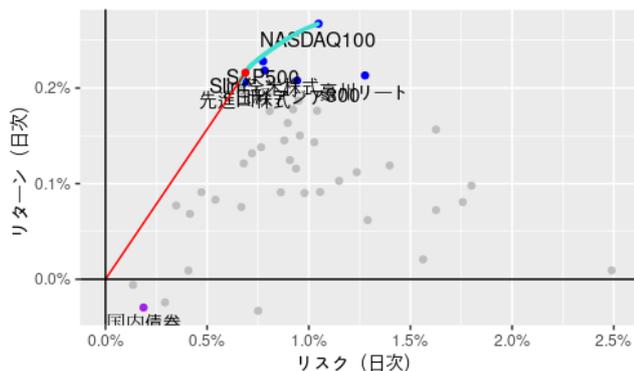
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.439%	0.400%	1.097	—
インド株式	0.656%	0.839%	0.783	18.4%
NASDAQ100	0.533%	0.750%	0.711	0.0%
日経アジア 300	0.462%	0.700%	0.660	0.0%
新興国株式	0.415%	0.584%	0.711	26.6%
S&P500	0.380%	0.429%	0.886	45.9%
Slim 全米株式	0.364%	0.425%	0.857	9.1%

【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	0.236%	0.703%	0.335	—
NASDAQ100	0.307%	1.011%	0.304	4.6%
日経アジア 300	0.253%	1.039%	0.243	13.1%
S&P500	0.229%	0.711%	0.322	74.7%
インド株式	0.226%	1.418%	0.159	7.6%
Slim 全米株式	0.215%	0.717%	0.299	0.0%
新興国株式	0.207%	0.923%	0.224	0.0%

【半年】

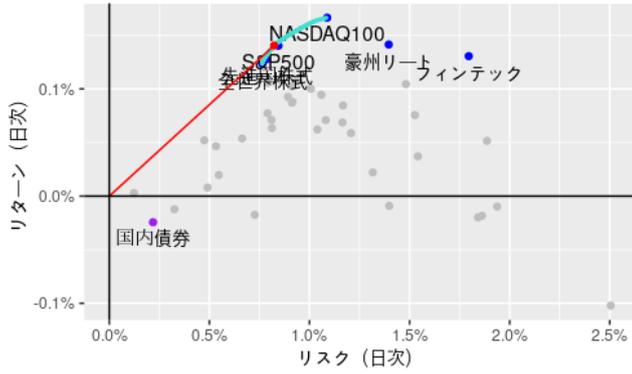


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.216%	0.688%	0.314	—
NASDAQ100	0.267%	1.048%	0.255	0.0%
S&P500	0.228%	0.775%	0.294	41.6%
Slim 全米株式	0.218%	0.783%	0.279	0.0%
豪州リート	0.213%	1.277%	0.167	8.9%
日経アジア 300	0.208%	0.942%	0.220	18.6%
先進国株式	0.206%	0.686%	0.300	30.9%

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。

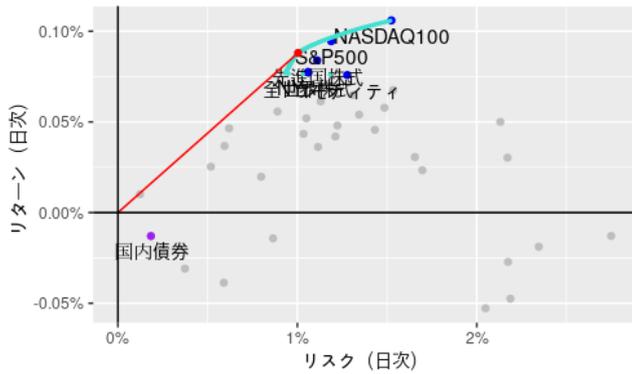
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.140%	0.823%	0.171	—
NASDAQ100	0.166%	1.088%	0.153	0.1%
豪州リート	0.141%	1.396%	0.101	14.8%
S&P500	0.140%	0.845%	0.166	85.1%
フィンテック	0.131%	1.796%	0.073	0.0%
先進国株式	0.128%	0.785%	0.163	0.0%
全世界株式	0.123%	0.765%	0.161	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	0.088%	1.004%	0.088	—
NASDAQ100	0.106%	1.524%	0.070	0.0%
S&P500	0.095%	1.189%	0.079	65.3%
先進国株式	0.084%	1.111%	0.076	0.0%
全世界株式	0.078%	1.060%	0.073	0.0%
NYダウ	0.077%	1.062%	0.073	0.0%
コモディティ	0.076%	1.278%	0.059	34.7%

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。