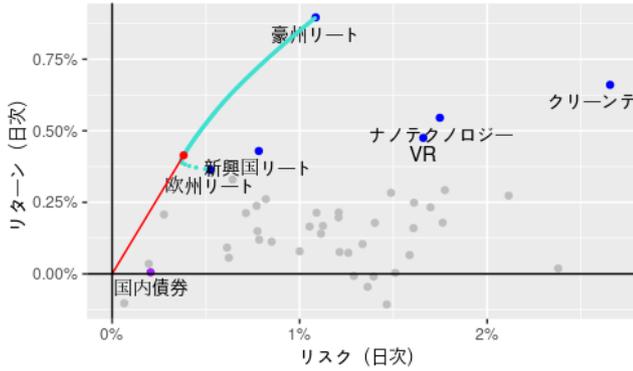


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

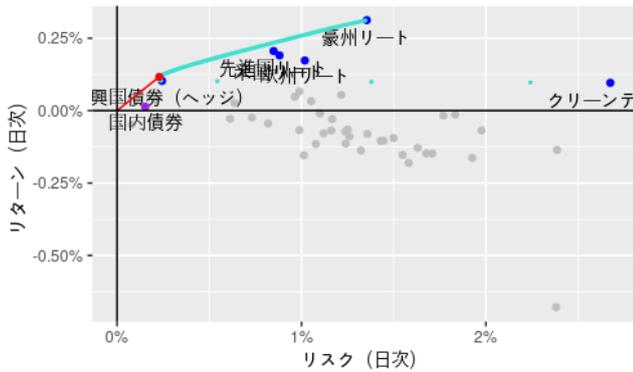
2024年9月20日

【半月】



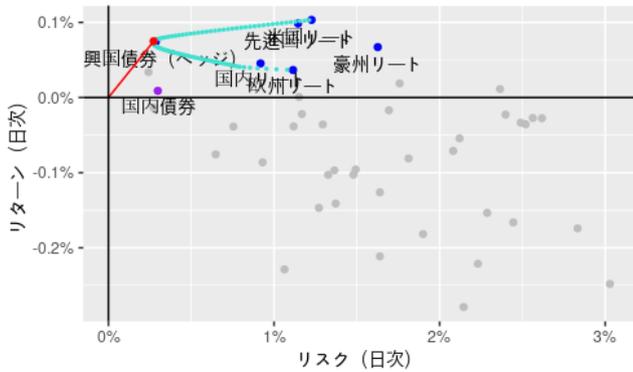
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.414%	0.381%	1.087	—
豪州リート	0.896%	1.086%	0.826	3.2%
クリーンテック	0.661%	2.655%	0.249	6.0%
ナノテクノロジー	0.545%	1.748%	0.312	0.0%
VR	0.475%	1.659%	0.286	0.0%
新興国リート	0.429%	0.782%	0.549	23.9%
欧州リート	0.364%	0.523%	0.695	66.9%

【一ヶ月】



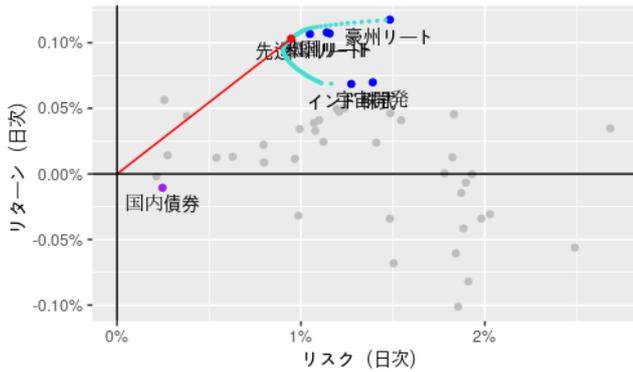
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.117%	0.228%	0.511	—
豪州リート	0.312%	1.354%	0.231	0.4%
先進国リート	0.206%	0.849%	0.243	0.0%
米国リート	0.191%	0.881%	0.217	15.1%
欧州リート	0.173%	1.018%	0.170	0.0%
新興国債券(ヘッジ)	0.103%	0.244%	0.421	84.6%
クリーンテック	0.096%	2.674%	0.036	0.0%

【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	0.075%	0.273%	0.274	—
米国リート	0.103%	1.227%	0.084	6.8%
先進国リート	0.099%	1.145%	0.086	0.0%
新興国債券(ヘッジ)	0.074%	0.286%	0.259	90.0%
豪州リート	0.067%	1.626%	0.041	0.0%
国内リート	0.045%	0.919%	0.049	3.2%
欧州リート	0.037%	1.115%	0.033	0.0%

【半年】

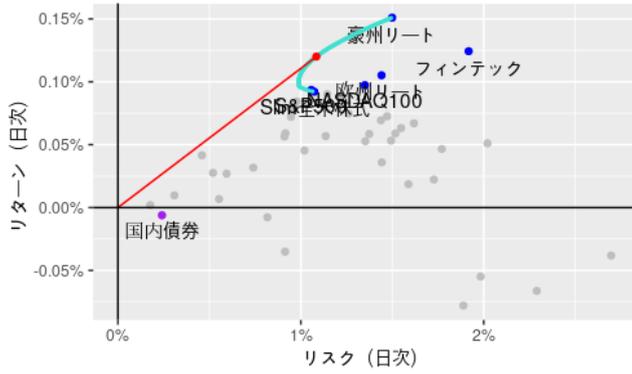


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.103%	0.946%	0.109	—
豪州リート	0.118%	1.483%	0.079	6.1%
米国リート	0.108%	1.141%	0.095	0.0%
欧州リート	0.107%	1.156%	0.093	30.6%
先進国リート	0.107%	1.049%	0.102	52.0%
宇宙開発	0.070%	1.390%	0.050	0.0%
インド株式	0.069%	1.274%	0.054	11.3%

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。

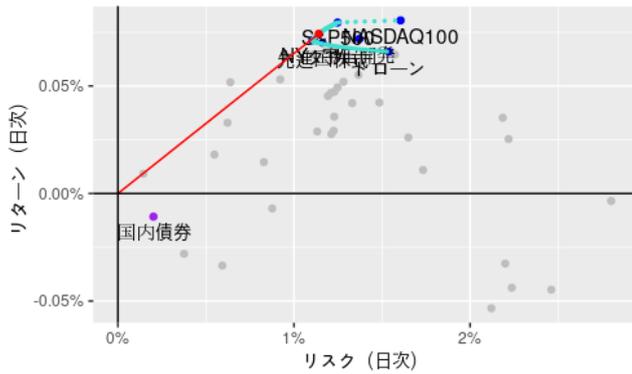
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.120%	1.085%	0.111	—
豪州リート	0.151%	1.499%	0.101	43.8%
フィンテック	0.124%	1.918%	0.065	0.0%
欧州リート	0.105%	1.441%	0.073	11.8%
NASDAQ100	0.097%	1.350%	0.072	0.0%
S&P500	0.094%	1.057%	0.088	44.4%
Slim 全米株式	0.092%	1.074%	0.086	0.0%

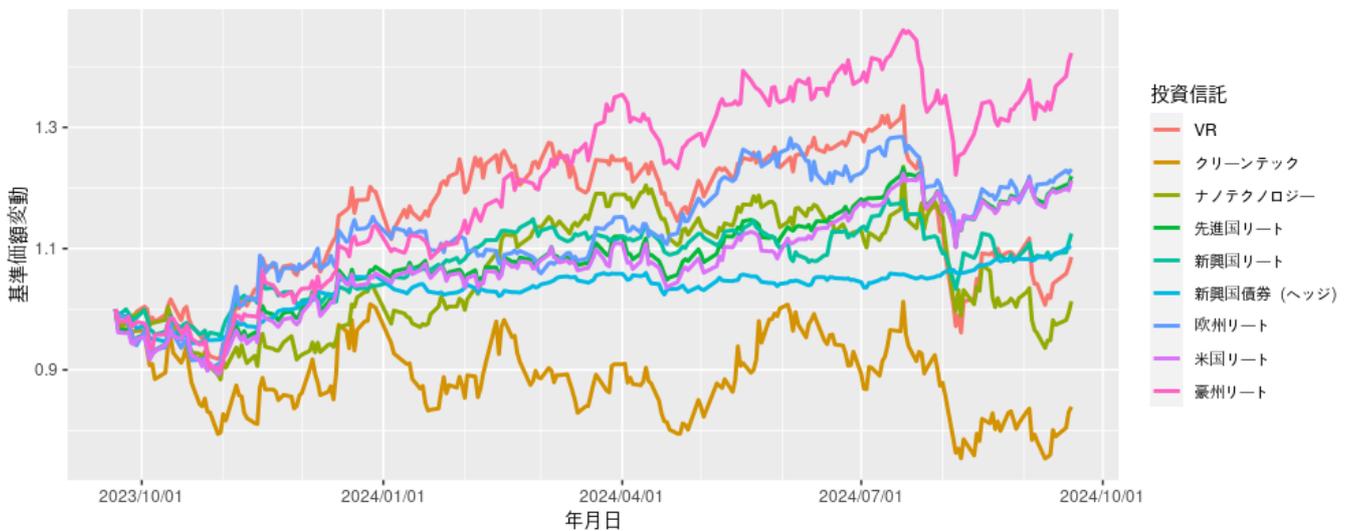
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.074%	1.140%	0.065	—
NASDAQ100	0.080%	1.605%	0.050	0.0%
S&P500	0.079%	1.248%	0.064	36.8%
宇宙開発	0.072%	1.372%	0.052	0.0%
NY ダウ	0.071%	1.105%	0.064	63.2%
先進国株式	0.070%	1.162%	0.060	0.0%
ドローン	0.066%	1.539%	0.043	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。