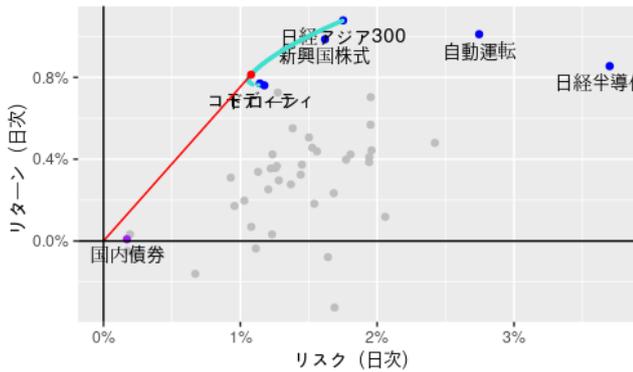


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

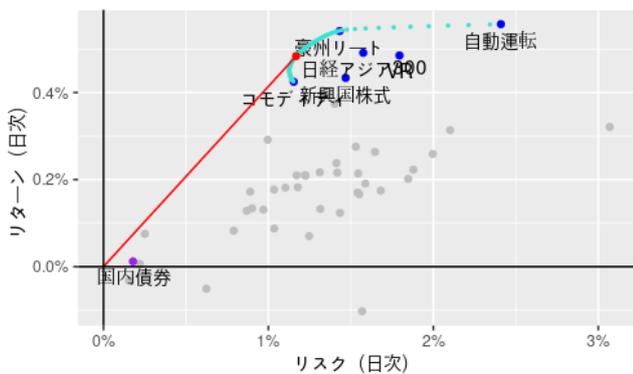
2024年10月5日

【半月】



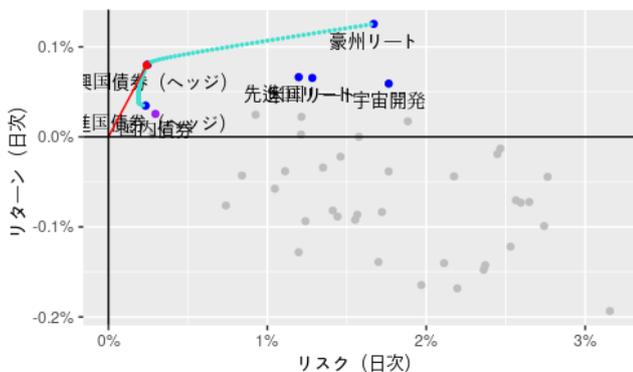
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.813%	1.079%	0.754	—
日経アジア 300	1.079%	1.752%	0.616	5.6%
自動運転	1.011%	2.745%	0.368	12.5%
新興国株式	0.986%	1.619%	0.609	0.0%
日経半導体株	0.855%	3.699%	0.231	0.0%
コモディティ	0.770%	1.143%	0.674	34.8%
ドローン	0.761%	1.175%	0.647	47.1%

【一ヶ月】



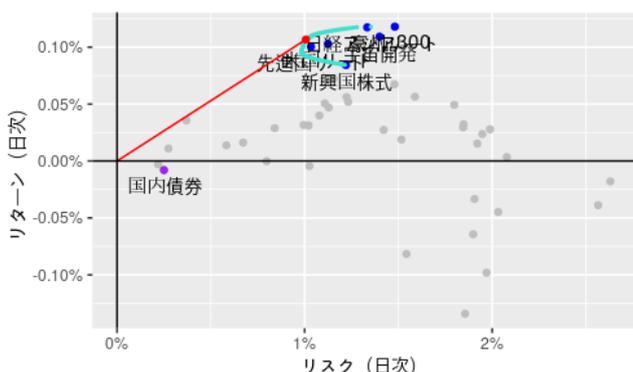
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.484%	1.168%	0.414	—
自動運転	0.557%	2.410%	0.231	0.0%
豪州リート	0.541%	1.432%	0.378	45.8%
日経アジア 300	0.491%	1.575%	0.312	8.2%
VR	0.485%	1.795%	0.270	0.0%
新興国株式	0.434%	1.468%	0.295	0.0%
コモディティ	0.425%	1.154%	0.368	45.9%

【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	0.080%	0.240%	0.331	—
豪州リート	0.125%	1.669%	0.075	0.0%
新興国債券（ヘッジ）	0.080%	0.247%	0.326	96.1%
先進国リート	0.066%	1.197%	0.055	0.0%
米国リート	0.065%	1.283%	0.051	3.5%
宇宙開発	0.059%	1.764%	0.034	0.0%
先進国債券（ヘッジ）	0.035%	0.234%	0.148	0.4%

【半年】

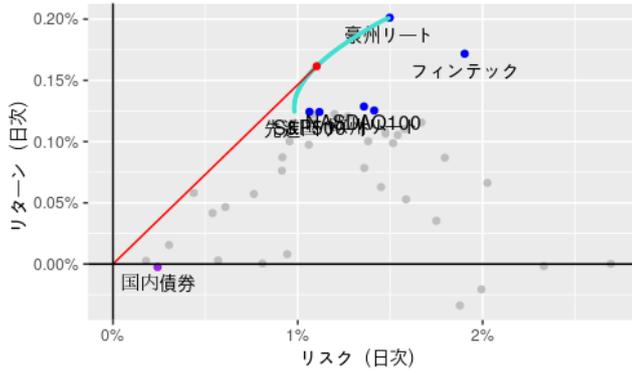


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.107%	1.007%	0.106	—
豪州リート	0.118%	1.481%	0.080	3.4%
日経アジア 300	0.117%	1.334%	0.088	32.8%
宇宙開発	0.109%	1.400%	0.078	1.1%
米国リート	0.103%	1.125%	0.092	0.0%
先進国リート	0.100%	1.034%	0.097	62.7%
新興国株式	0.084%	1.220%	0.069	0.0%

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。

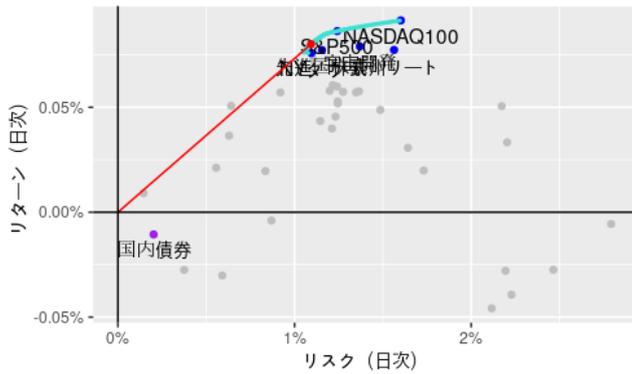
（２）リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.162%	1.102%	0.147	—
豪州リート	0.201%	1.498%	0.134	48.4%
フィンテック	0.172%	1.903%	0.090	0.0%
NASDAQ100	0.129%	1.358%	0.095	0.0%
欧州リート	0.125%	1.413%	0.089	1.6%
S&P500	0.124%	1.063%	0.117	43.4%
先進国リート	0.124%	1.117%	0.111	6.6%

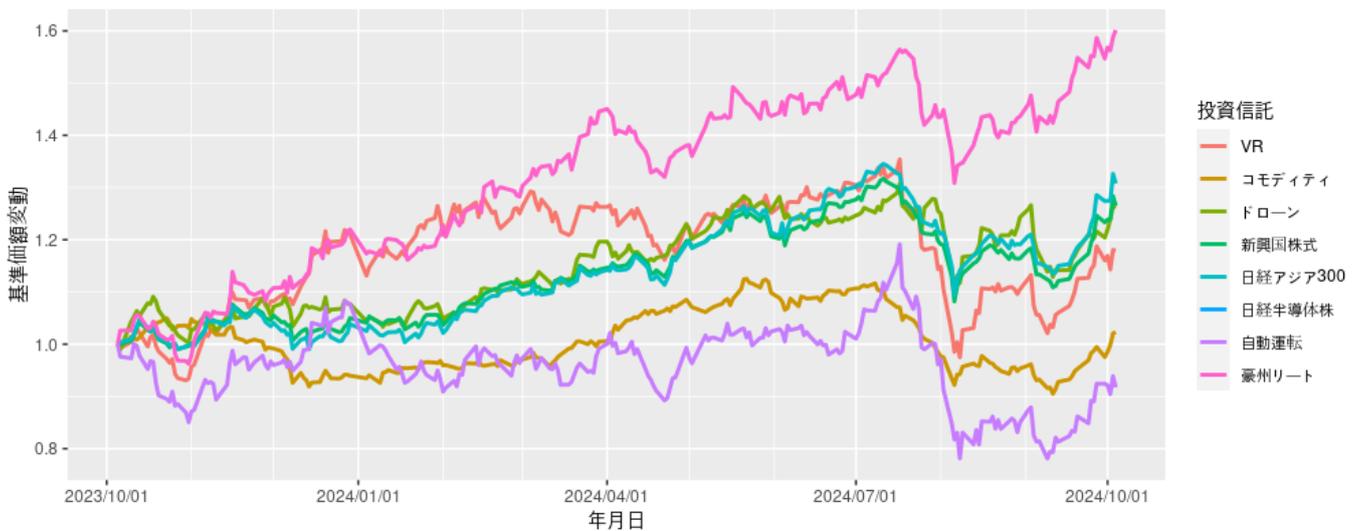
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.080%	1.093%	0.073	—
NASDAQ100	0.091%	1.602%	0.057	0.0%
S&P500	0.086%	1.241%	0.070	37.8%
宇宙開発	0.079%	1.370%	0.058	0.0%
豪州リート	0.077%	1.563%	0.049	21.4%
先進国株式	0.077%	1.155%	0.067	0.0%
NY ダウ	0.076%	1.095%	0.069	40.8%

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。