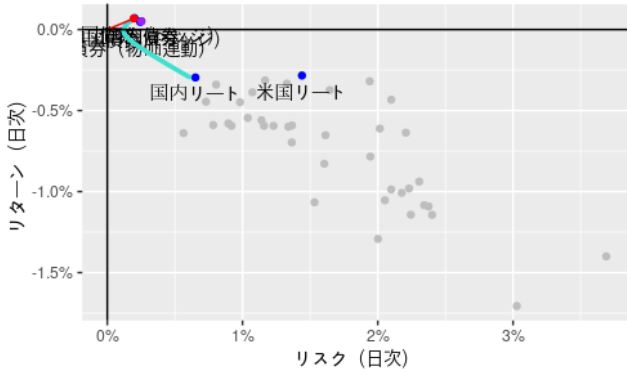


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

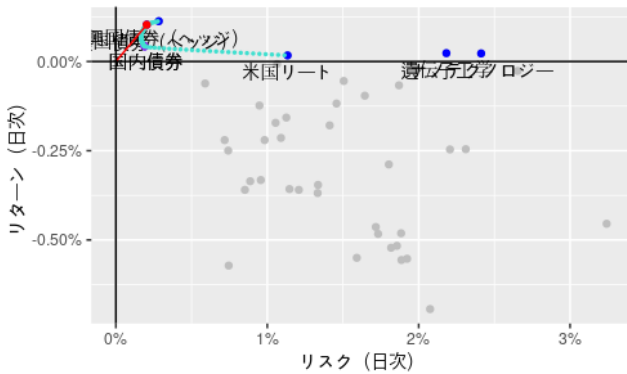
2024年8月3日

【半月】



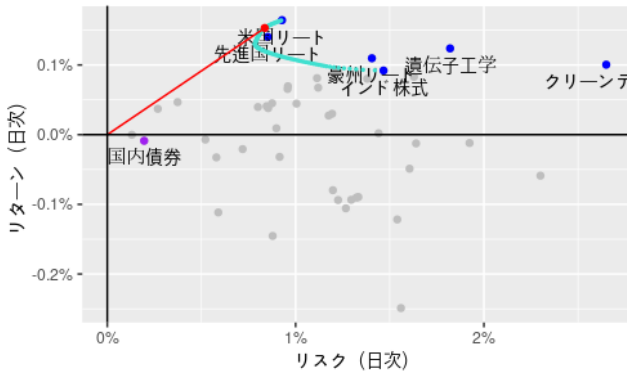
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.068%	0.196%	0.349	—
先進国債券 (ヘッジ)	0.070%	0.201%	0.349	90.3%
国内債券	0.051%	0.252%	0.204	9.7%
新興国債券 (ヘッジ)	0.047%	0.243%	0.196	0.0%
国内債券 (物価連動)	-0.017%	0.124%	-0.140	0.0%
米国リート	-0.284%	1.439%	-0.197	0.0%
国内リート	-0.296%	0.652%	-0.454	0.0%

【一ヶ月】



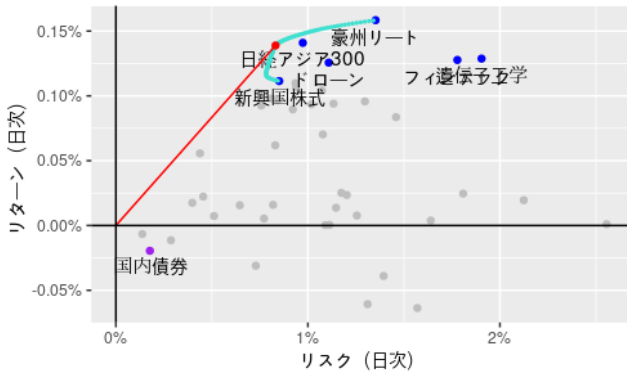
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.103%	0.204%	0.505	—
新興国債券 (ヘッジ)	0.113%	0.283%	0.398	0.0%
先進国債券 (ヘッジ)	0.103%	0.204%	0.505	99.6%
国内債券	0.043%	0.190%	0.223	0.4%
遺伝子工学	0.023%	2.183%	0.011	0.0%
ナノテクノロジー	0.022%	2.413%	0.009	0.0%
米国リート	0.017%	1.134%	0.015	0.0%

【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	0.153%	0.836%	0.183	—
米国リート	0.164%	0.928%	0.177	84.2%
先進国リート	0.140%	0.853%	0.165	0.0%
遺伝子工学	0.124%	1.820%	0.068	0.0%
豪州リート	0.110%	1.405%	0.078	1.2%
クリーンテック	0.100%	2.650%	0.038	0.0%
インド株式	0.092%	1.467%	0.063	14.6%

【半年】

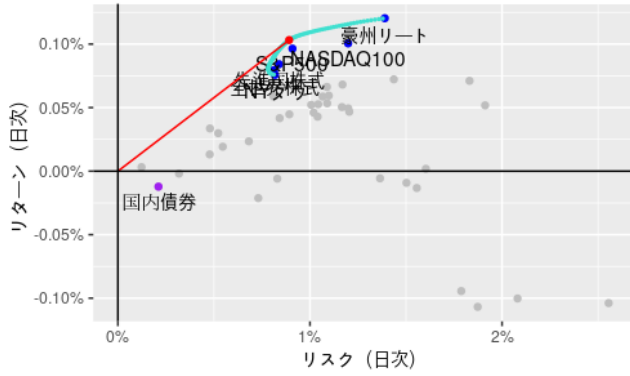


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.139%	0.832%	0.167	—
豪州リート	0.158%	1.353%	0.117	16.1%
日経アジア 300	0.141%	0.974%	0.145	52.3%
遺伝子工学	0.129%	1.904%	0.068	0.0%
フィンテック	0.128%	1.778%	0.072	0.0%
ドローン	0.126%	1.108%	0.113	31.6%
新興国株式	0.111%	0.851%	0.131	0.0%

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。

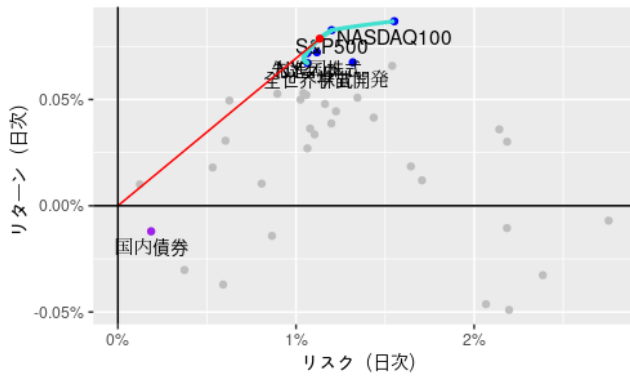
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.103%	0.892%	0.116	—
豪州リート	0.120%	1.390%	0.087	28.3%
NASDAQ100	0.101%	1.199%	0.084	0.0%
S&P500	0.096%	0.909%	0.106	71.7%
先進国株式	0.084%	0.839%	0.100	0.0%
全世界株式	0.079%	0.813%	0.098	0.0%
NY ダウ	0.076%	0.818%	0.093	0.0%

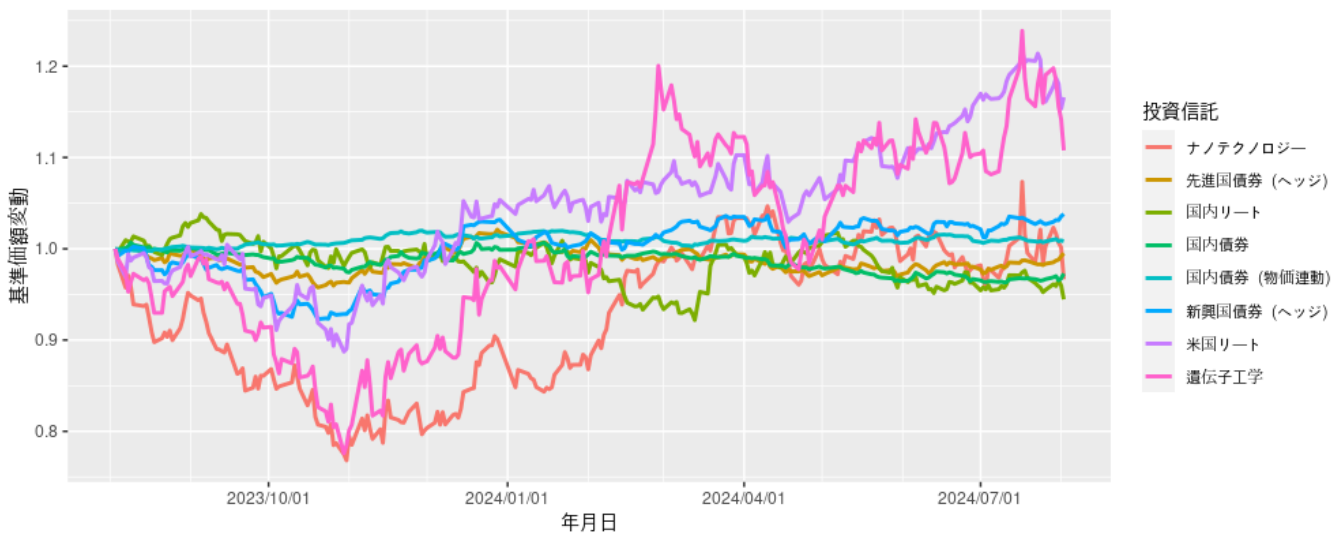
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.079%	1.133%	0.069	—
NASDAQ100	0.087%	1.552%	0.056	0.0%
S&P500	0.083%	1.200%	0.069	63.1%
先進国株式	0.072%	1.117%	0.065	0.0%
NY ダウ	0.072%	1.064%	0.067	36.9%
宇宙開発	0.067%	1.319%	0.051	0.0%
全世界株式	0.067%	1.066%	0.063	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。