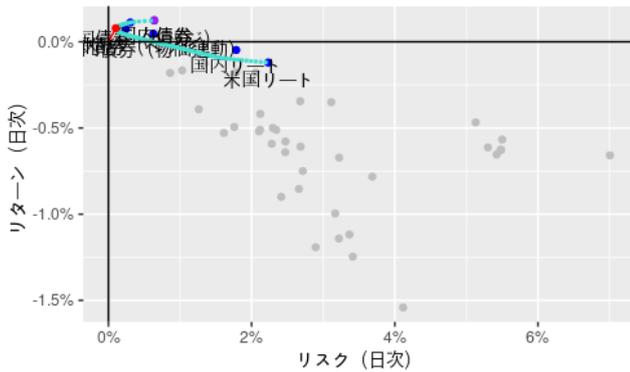


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

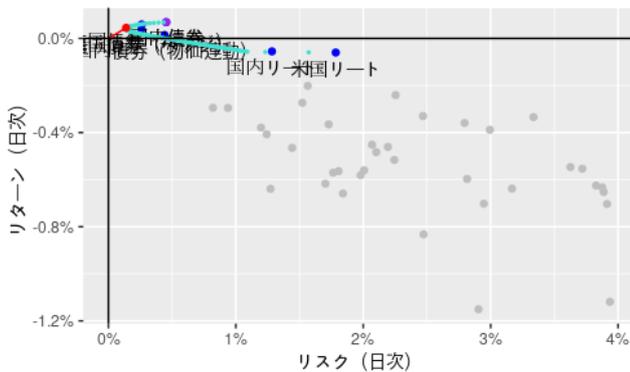
2024年8月10日

【半月】



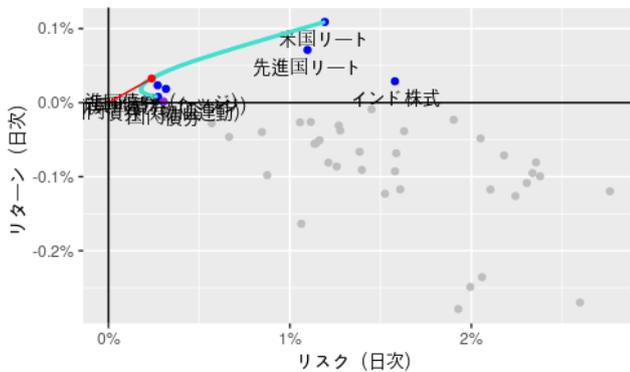
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.079%	0.103%	0.769	—
国内債券	0.124%	0.640%	0.194	25.2%
先進国債券（ヘッジ）	0.112%	0.306%	0.365	38.2%
新興国債券（ヘッジ）	0.073%	0.241%	0.303	15.9%
国内債券（物価連動）	0.047%	0.629%	0.074	6.0%
国内リート	-0.048%	1.785%	-0.027	11.5%
米国リート	-0.120%	2.233%	-0.054	3.2%

【一ヶ月】



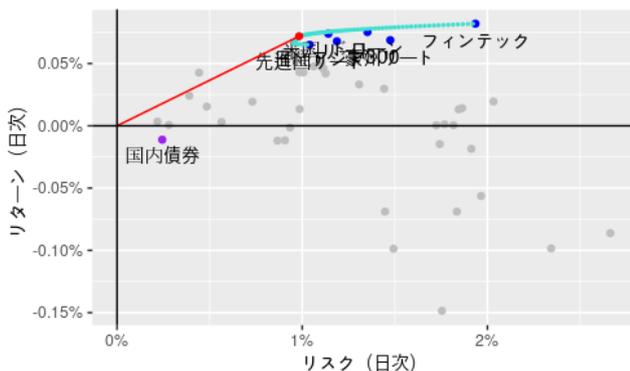
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.045%	0.139%	0.325	—
国内債券	0.069%	0.453%	0.152	34.1%
先進国債券（ヘッジ）	0.059%	0.261%	0.227	29.0%
新興国債券（ヘッジ）	0.040%	0.259%	0.153	0.0%
国内債券（物価連動）	0.014%	0.441%	0.032	35.8%
国内リート	-0.055%	1.284%	-0.043	0.0%
米国リート	-0.060%	1.784%	-0.034	1.1%

【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	0.033%	0.239%	0.137	—
米国リート	0.109%	1.193%	0.091	13.8%
先進国リート	0.071%	1.097%	0.065	0.0%
インド株式	0.029%	1.579%	0.018	2.6%
先進国債券（ヘッジ）	0.023%	0.272%	0.086	66.3%
新興国債券（ヘッジ）	0.019%	0.317%	0.059	0.0%
国内債券（物価連動）	0.008%	0.274%	0.029	17.4%

【半年】

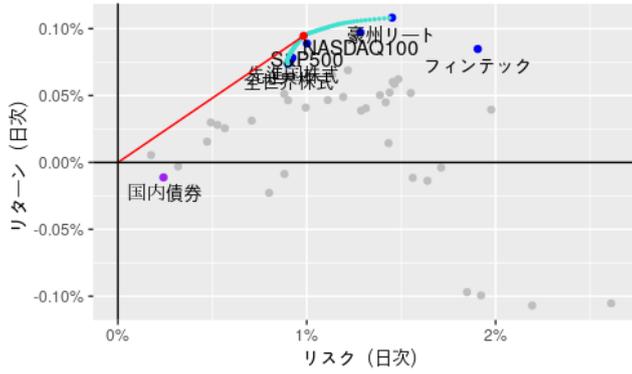


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.072%	0.983%	0.073	—
フィンテック	0.082%	1.935%	0.042	0.0%
ドローン	0.075%	1.352%	0.056	14.4%
米国リート	0.074%	1.141%	0.065	49.1%
豪州リート	0.069%	1.475%	0.047	0.5%
日経アジア 300	0.068%	1.187%	0.057	36.0%
先進国リート	0.065%	1.039%	0.063	0.0%

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。

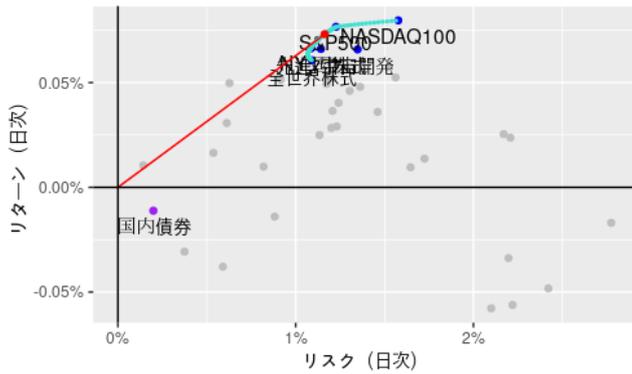
（２）リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.095%	0.983%	0.096	—
豪州リート	0.108%	1.452%	0.075	29.7%
NASDAQ100	0.097%	1.284%	0.076	0.0%
S&P500	0.089%	1.001%	0.089	70.3%
フィンテック	0.085%	1.905%	0.045	0.0%
先進国株式	0.078%	0.924%	0.085	0.0%
全世界株式	0.074%	0.900%	0.082	0.0%

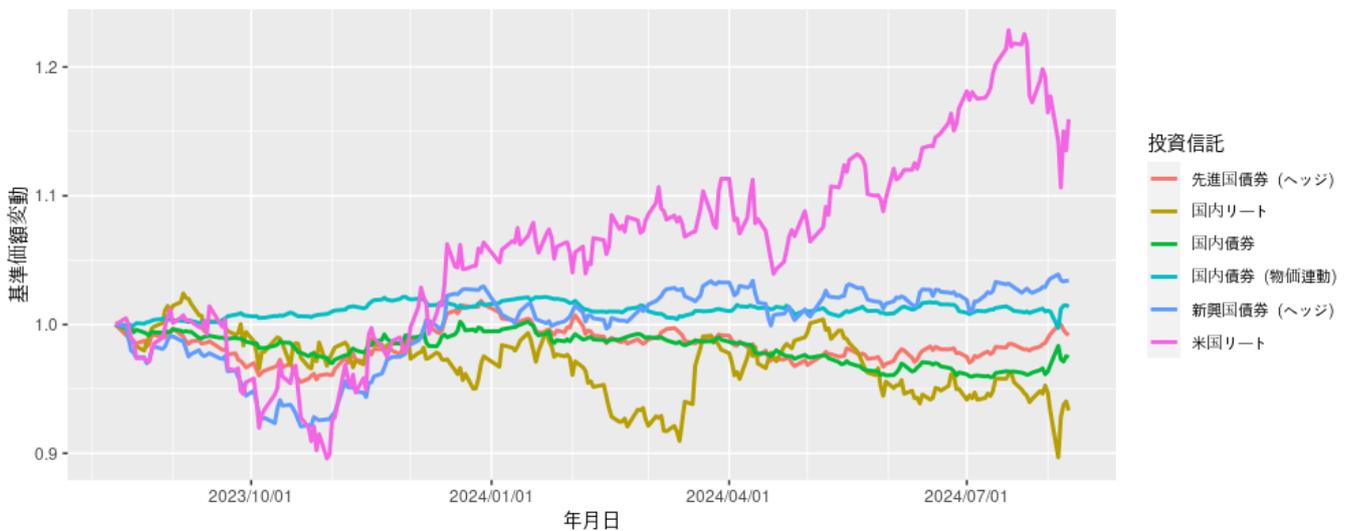
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.073%	1.163%	0.063	—
NASDAQ100	0.080%	1.577%	0.051	0.0%
S&P500	0.077%	1.227%	0.062	65.6%
NYダウ	0.066%	1.088%	0.061	34.4%
先進国株式	0.066%	1.142%	0.058	0.0%
宇宙開発	0.066%	1.348%	0.049	0.0%
全世界株式	0.061%	1.092%	0.056	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。