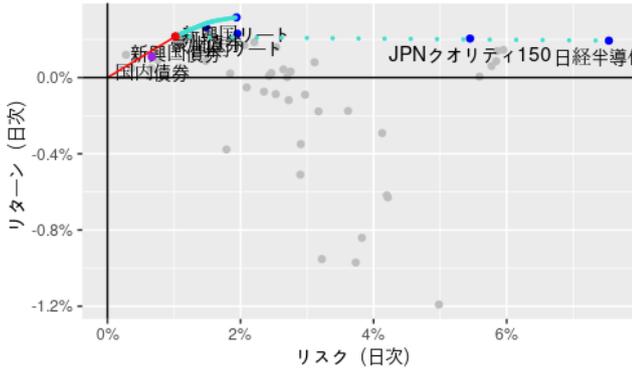


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

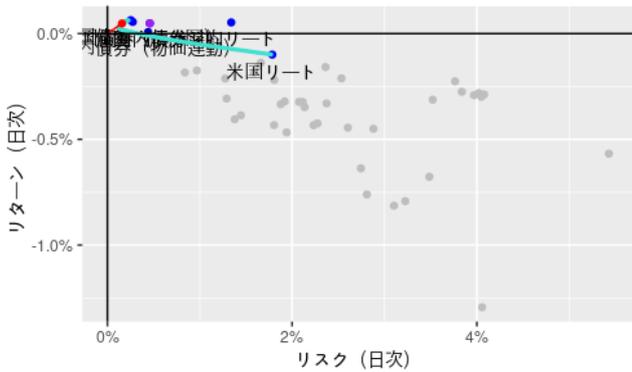
2024年8月17日

【半月】



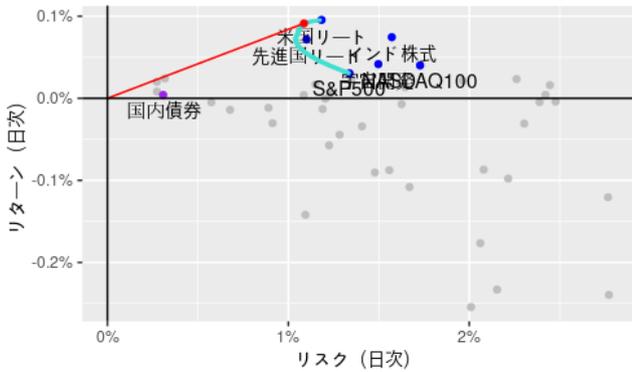
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.216%	1.024%	0.211	—
新興国リート	0.316%	1.940%	0.163	0.0%
豪州債券	0.264%	1.482%	0.178	1.4%
国内リート	0.230%	1.954%	0.118	4.5%
新興国債券	0.215%	1.020%	0.211	94.1%
JPNクオリティ150	0.205%	5.449%	0.038	0.0%
日経半導体株	0.194%	7.536%	0.026	0.0%

【一ヶ月】



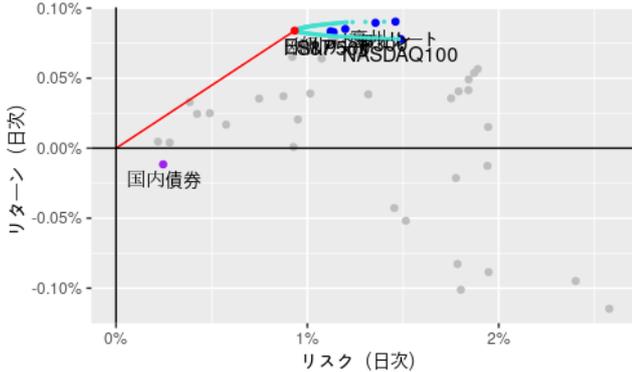
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.048%	0.158%	0.304	—
新興国債券(ヘッジ)	0.064%	0.252%	0.252	42.6%
先進国債券(ヘッジ)	0.055%	0.274%	0.202	13.2%
国内リート	0.053%	1.340%	0.039	4.4%
国内債券	0.049%	0.459%	0.106	20.4%
国内債券(物価連動)	0.007%	0.441%	0.017	19.4%
米国リート	-0.099%	1.785%	-0.056	0.0%

【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	0.091%	1.086%	0.084	—
米国リート	0.096%	1.184%	0.081	79.9%
インド株式	0.074%	1.572%	0.047	20.1%
先進国リート	0.072%	1.101%	0.065	0.0%
宇宙開発	0.042%	1.497%	0.028	0.0%
NASDAQ100	0.040%	1.728%	0.023	0.0%
S&P500	0.030%	1.338%	0.023	0.0%

【半年】

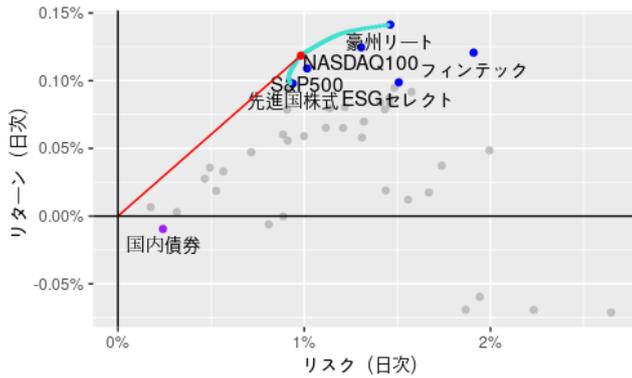


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.084%	0.933%	0.090	—
豪州リート	0.090%	1.460%	0.062	0.0%
ドローン	0.090%	1.356%	0.066	3.2%
日経アジア300	0.085%	1.198%	0.071	27.3%
欧州リート	0.083%	1.122%	0.074	42.8%
S&P500	0.083%	1.137%	0.073	26.7%
NASDAQ100	0.078%	1.489%	0.052	0.0%

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。

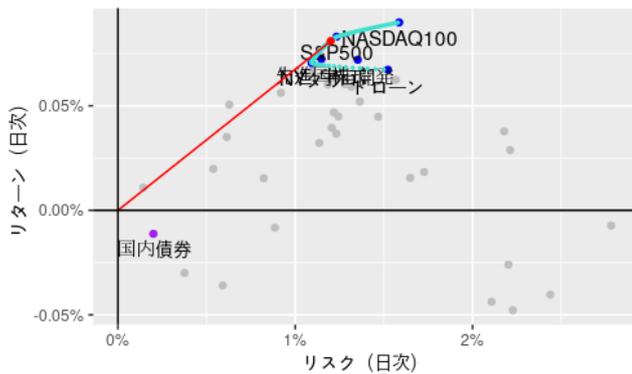
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.119%	0.982%	0.121	—
豪州リート	0.141%	1.462%	0.097	32.9%
NASDAQ100	0.125%	1.306%	0.095	0.0%
フィンテック	0.121%	1.909%	0.063	0.0%
S&P500	0.109%	1.016%	0.107	56.1%
ESG セレクト	0.099%	1.508%	0.066	11.0%
先進国株式	0.098%	0.939%	0.104	0.0%

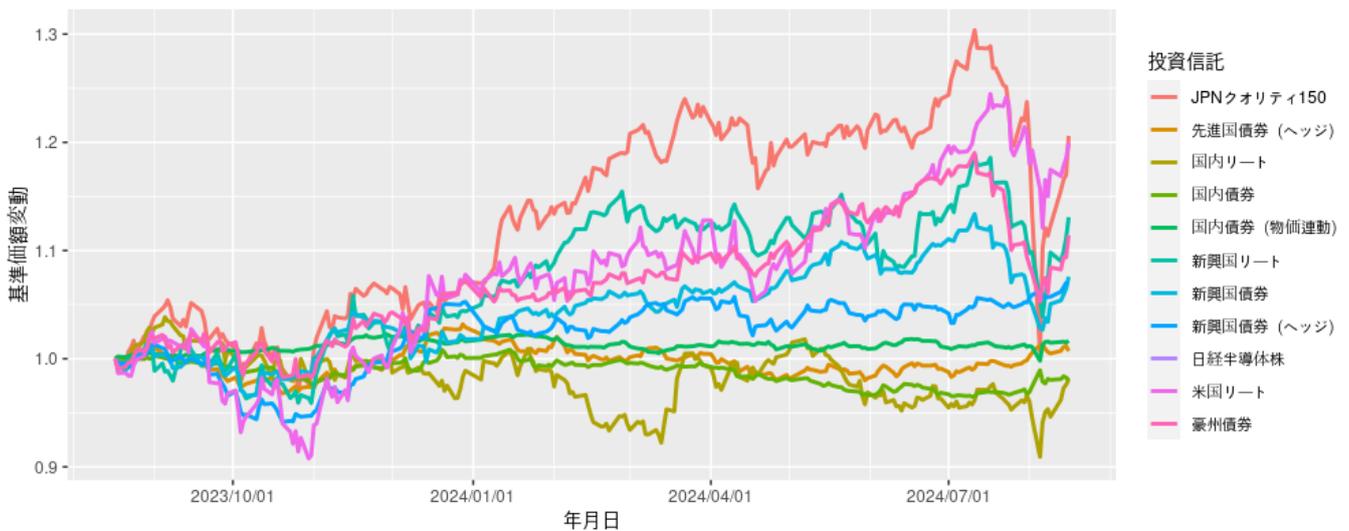
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.081%	1.200%	0.067	—
NASDAQ100	0.090%	1.586%	0.057	0.0%
S&P500	0.083%	1.233%	0.067	83.3%
先進国株式	0.072%	1.148%	0.063	0.0%
宇宙開発	0.072%	1.352%	0.053	0.0%
NY ダウ	0.070%	1.093%	0.064	16.7%
ドローン	0.067%	1.523%	0.044	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。