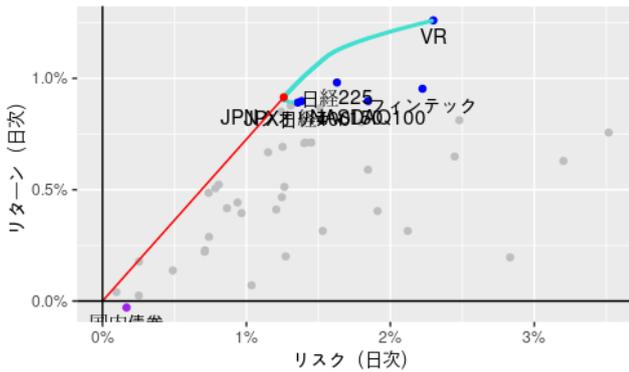


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

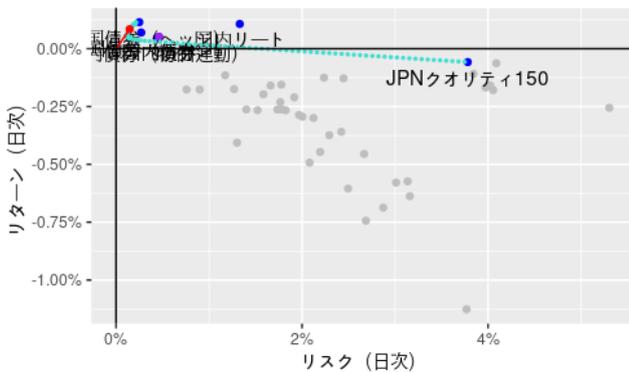
2024年8月24日

【半月】



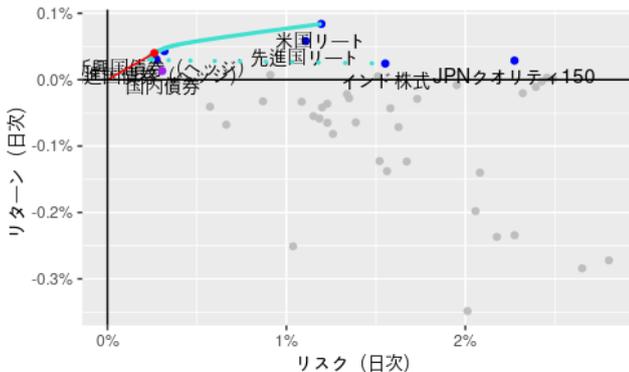
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.915%	1.259%	0.726	—
VR	1.260%	2.298%	0.548	2.1%
日経 225	0.981%	1.629%	0.602	0.0%
フィンテック	0.953%	2.223%	0.429	22.7%
NASDAQ100	0.898%	1.846%	0.487	0.0%
JPN クオリティ 150	0.898%	1.384%	0.649	27.9%
JPX 日経 400	0.891%	1.357%	0.657	47.2%

【一ヶ月】



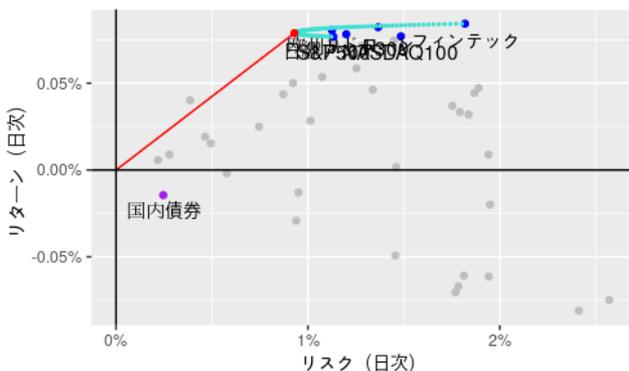
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.084%	0.146%	0.578	—
新興国債券 (ヘッジ)	0.115%	0.250%	0.459	53.4%
国内リート	0.107%	1.330%	0.080	2.0%
先進国債券 (ヘッジ)	0.070%	0.271%	0.258	0.0%
国内債券	0.051%	0.462%	0.110	17.1%
国内債券 (物価連動)	0.045%	0.439%	0.102	27.4%
JPN クオリティ 150	-0.058%	3.782%	-0.015	0.0%

【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	0.040%	0.262%	0.153	—
米国リート	0.084%	1.196%	0.070	8.2%
先進国リート	0.058%	1.108%	0.053	0.0%
新興国債券 (ヘッジ)	0.043%	0.319%	0.135	42.3%
先進国債券 (ヘッジ)	0.031%	0.273%	0.113	45.3%
JPN クオリティ 150	0.029%	2.275%	0.013	2.2%
インド株式	0.024%	1.553%	0.016	2.1%

【半年】

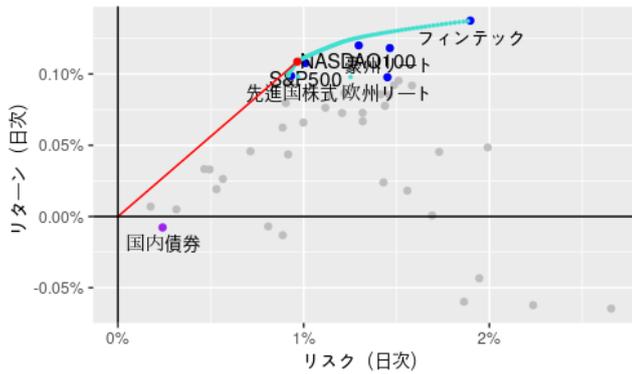


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.079%	0.929%	0.085	—
フィンテック	0.084%	1.819%	0.046	0.0%
ドローン	0.082%	1.366%	0.060	0.0%
欧州リート	0.081%	1.125%	0.072	45.2%
日経アジア 300	0.078%	1.200%	0.065	25.4%
NASDAQ100	0.077%	1.485%	0.052	0.0%
S&P500	0.077%	1.133%	0.068	29.4%

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。

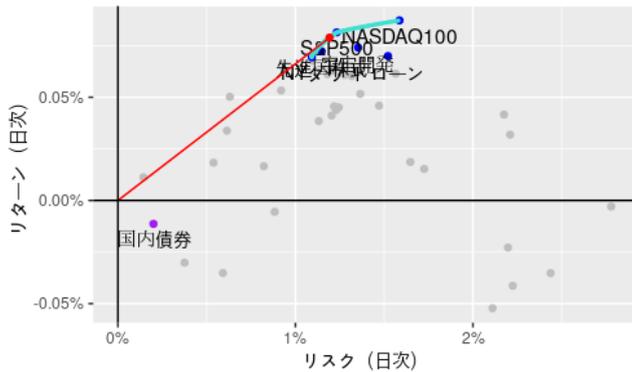
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.109%	0.966%	0.112	—
フィンテック	0.137%	1.897%	0.072	0.0%
NASDAQ100	0.120%	1.297%	0.093	0.0%
豪州リート	0.118%	1.464%	0.081	18.2%
S&P500	0.108%	1.010%	0.107	72.3%
先進国株式	0.099%	0.933%	0.106	0.0%
欧州リート	0.098%	1.451%	0.067	9.5%

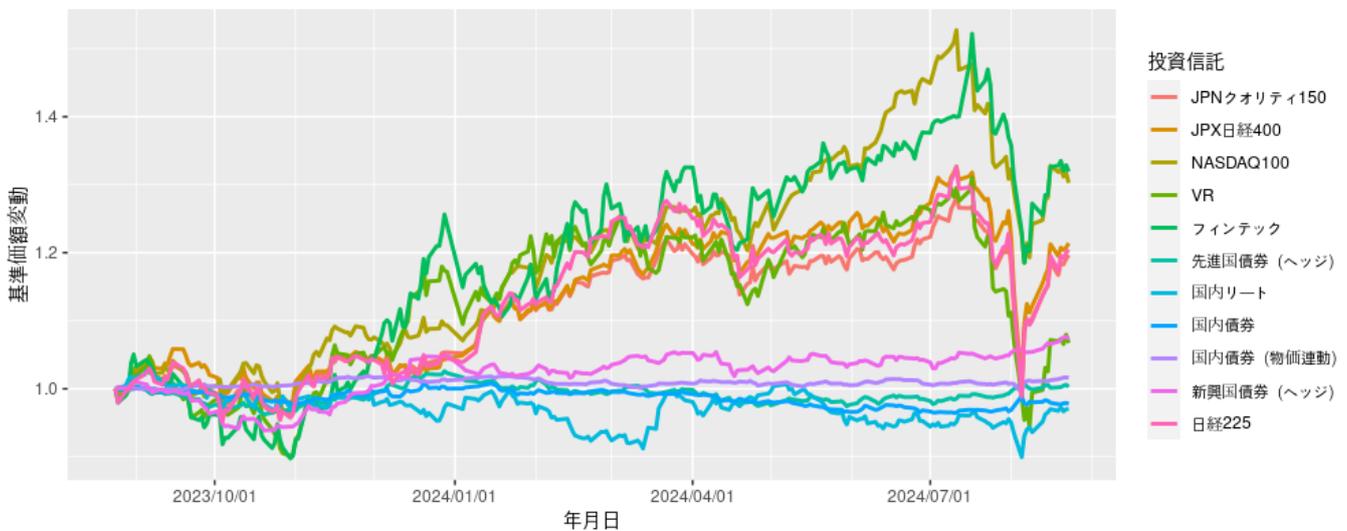
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.079%	1.192%	0.066	—
NASDAQ100	0.087%	1.586%	0.055	0.0%
S&P500	0.081%	1.233%	0.066	79.2%
宇宙開発	0.074%	1.353%	0.055	0.0%
先進国株式	0.072%	1.148%	0.063	0.0%
ドローン	0.070%	1.522%	0.046	0.0%
NYダウ	0.069%	1.092%	0.063	20.8%

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。