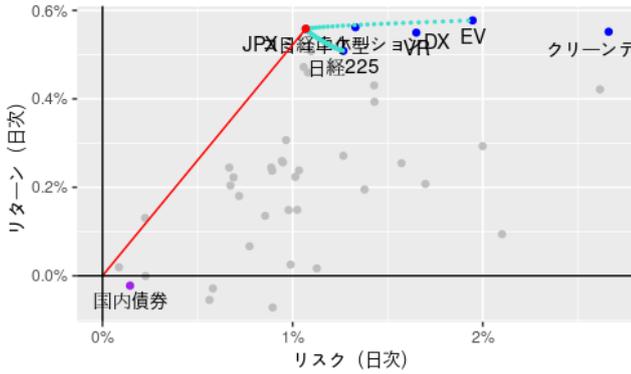


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

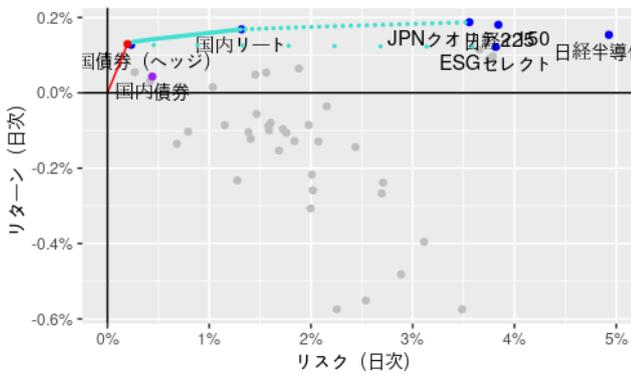
2024年8月31日

【半月】



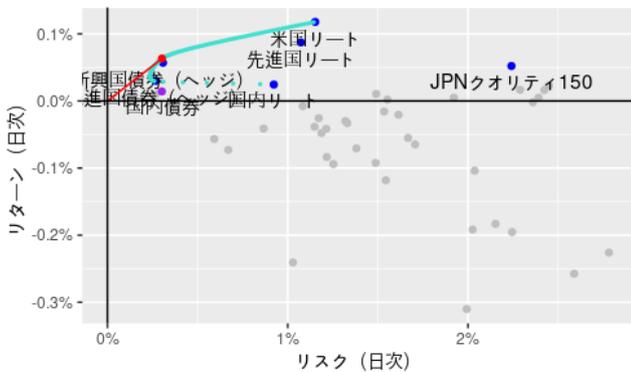
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.558%	1.069%	0.522	—
EV	0.577%	1.947%	0.297	0.0%
コミュニケーション DX	0.562%	1.331%	0.422	13.0%
JPN 日経中小型	0.558%	1.070%	0.522	87.0%
クリーンテック	0.552%	2.662%	0.207	0.0%
VR	0.550%	1.650%	0.333	0.0%
日経 225	0.509%	1.267%	0.401	0.0%

【一ヶ月】



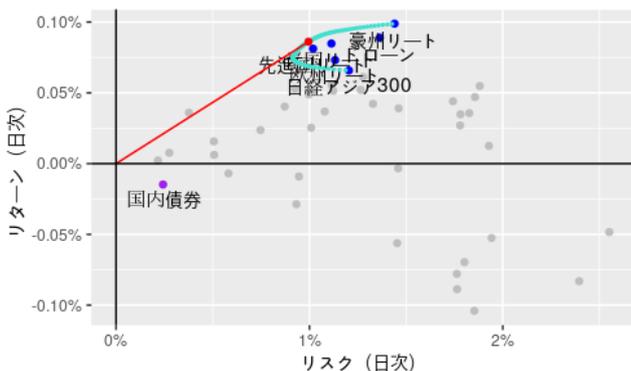
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.129%	0.197%	0.657	—
JPN クオリティ 150	0.188%	3.557%	0.053	3.1%
日経 225	0.181%	3.842%	0.047	0.0%
国内リート	0.169%	1.318%	0.128	0.0%
日経半導体株	0.154%	4.928%	0.031	0.0%
新興国債券 (ヘッジ)	0.128%	0.233%	0.547	96.6%
ESG セレクト	0.122%	3.815%	0.032	0.3%

【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	0.063%	0.302%	0.209	—
米国リート	0.118%	1.153%	0.102	10.5%
先進国リート	0.087%	1.073%	0.081	0.0%
新興国債券 (ヘッジ)	0.057%	0.308%	0.185	87.0%
JPN クオリティ 150	0.052%	2.241%	0.023	2.5%
先進国債券 (ヘッジ)	0.030%	0.269%	0.112	0.0%
国内リート	0.024%	0.923%	0.027	0.0%

【半年】

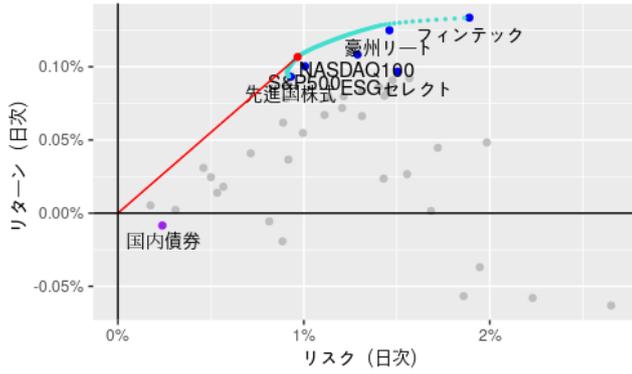


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.086%	0.995%	0.087	—
豪州リート	0.099%	1.440%	0.069	25.0%
ドローン	0.089%	1.364%	0.065	9.8%
米国リート	0.085%	1.114%	0.076	44.7%
先進国リート	0.081%	1.019%	0.080	0.0%
欧州リート	0.073%	1.133%	0.065	17.9%
日経アジア 300	0.066%	1.204%	0.055	2.6%

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。

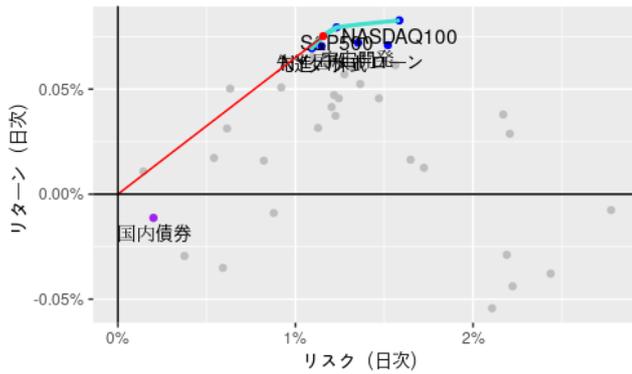
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.107%	0.967%	0.110	—
フィンテック	0.134%	1.890%	0.071	0.0%
豪州リート	0.125%	1.461%	0.086	28.1%
NASDAQ100	0.108%	1.289%	0.084	0.0%
S&P500	0.100%	1.006%	0.100	57.8%
ESG セレクト	0.097%	1.505%	0.064	14.1%
先進国株式	0.093%	0.930%	0.100	0.0%

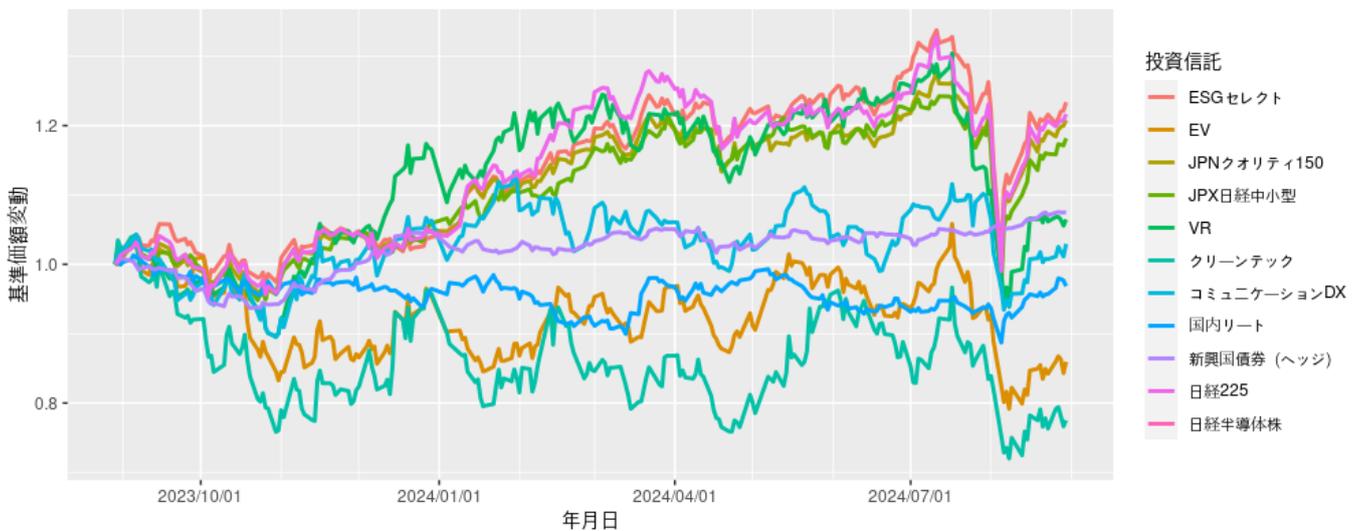
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.075%	1.156%	0.065	—
NASDAQ100	0.083%	1.585%	0.052	0.0%
S&P500	0.079%	1.232%	0.064	57.9%
宇宙開発	0.072%	1.353%	0.053	0.0%
ドローン	0.071%	1.521%	0.047	0.0%
先進国株式	0.070%	1.147%	0.061	0.0%
NY ダウ	0.069%	1.093%	0.064	42.1%

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。