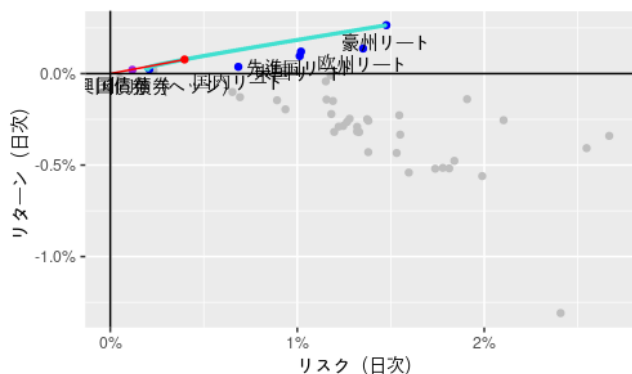


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

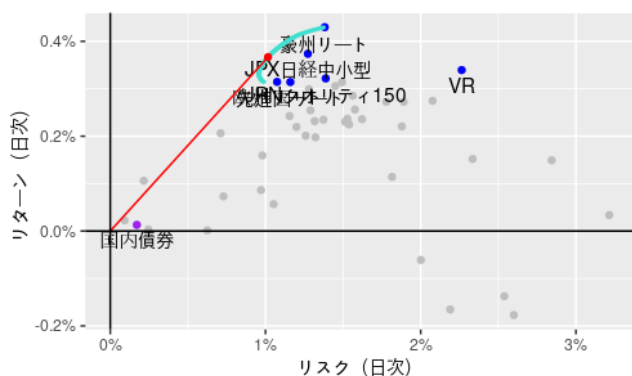
2024年9月7日

【半月】



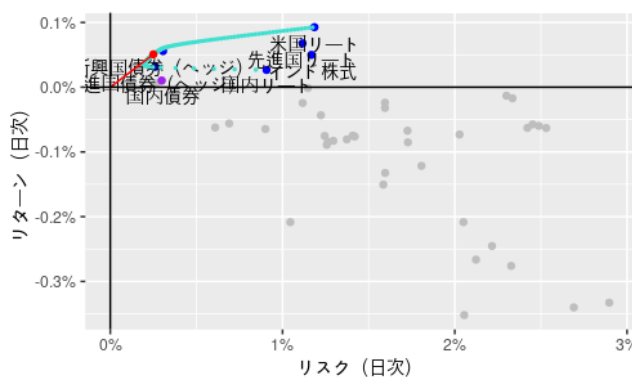
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.077%	0.397%	0.194	—
豪州リート	0.265%	1.477%	0.179	22.1%
欧州リート	0.137%	1.352%	0.101	0.0%
先進国リート	0.120%	1.020%	0.118	0.0%
米国リート	0.096%	1.013%	0.095	1.4%
国内リート	0.037%	0.685%	0.054	0.0%
新興国債券 (ヘッジ)	0.023%	0.209%	0.108	76.5%

【一ヶ月】



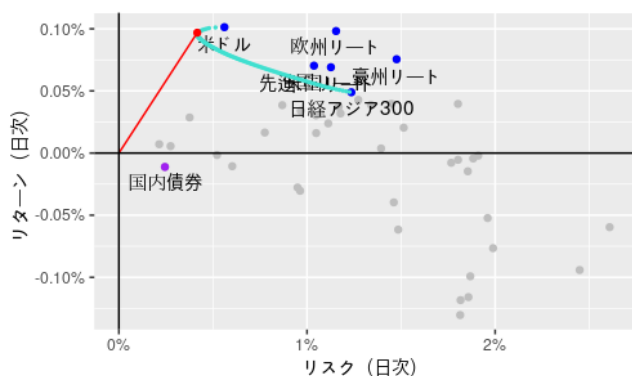
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.367%	1.016%	0.361	—
豪州リート	0.430%	1.382%	0.311	27.6%
JPX 日経中小型	0.374%	1.273%	0.294	34.7%
VR	0.339%	2.264%	0.150	0.0%
JPN クオリティ 150	0.322%	1.388%	0.232	0.0%
欧州リート	0.315%	1.075%	0.293	30.6%
先進国リート	0.314%	1.160%	0.271	7.2%

【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	0.051%	0.250%	0.203	—
米国リート	0.093%	1.185%	0.078	5.4%
先進国リート	0.068%	1.116%	0.061	0.0%
新興国債券 (ヘッジ)	0.056%	0.306%	0.182	61.1%
インド株式	0.050%	1.168%	0.043	6.5%
先進国債券 (ヘッジ)	0.032%	0.261%	0.121	24.9%
国内リート	0.027%	0.907%	0.029	2.2%

【半年】

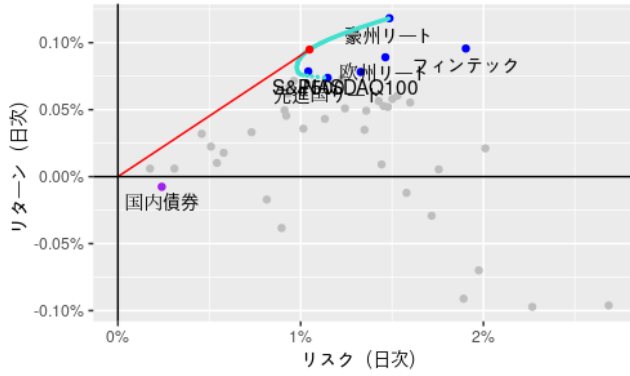


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.097%	0.417%	0.233	—
米ドル	0.101%	0.561%	0.181	78.4%
欧州リート	0.098%	1.154%	0.085	4.9%
豪州リート	0.076%	1.476%	0.051	16.7%
先進国リート	0.070%	1.037%	0.068	0.0%
米国リート	0.069%	1.127%	0.061	0.0%
日経アジア 300	0.049%	1.236%	0.040	0.0%

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。

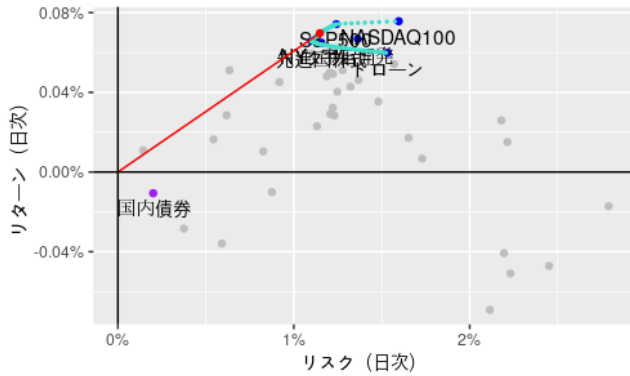
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【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%	1.048%	0.091	—
豪州リート	0.118%	1.486%	0.080	37.8%
フィンテック	0.096%	1.904%	0.050	0.0%
欧州リート	0.089%	1.463%	0.061	12.7%
S&P500	0.079%	1.042%	0.075	49.5%
NASDAQ100	0.078%	1.328%	0.059	0.0%
先進国リート	0.074%	1.148%	0.064	0.0%

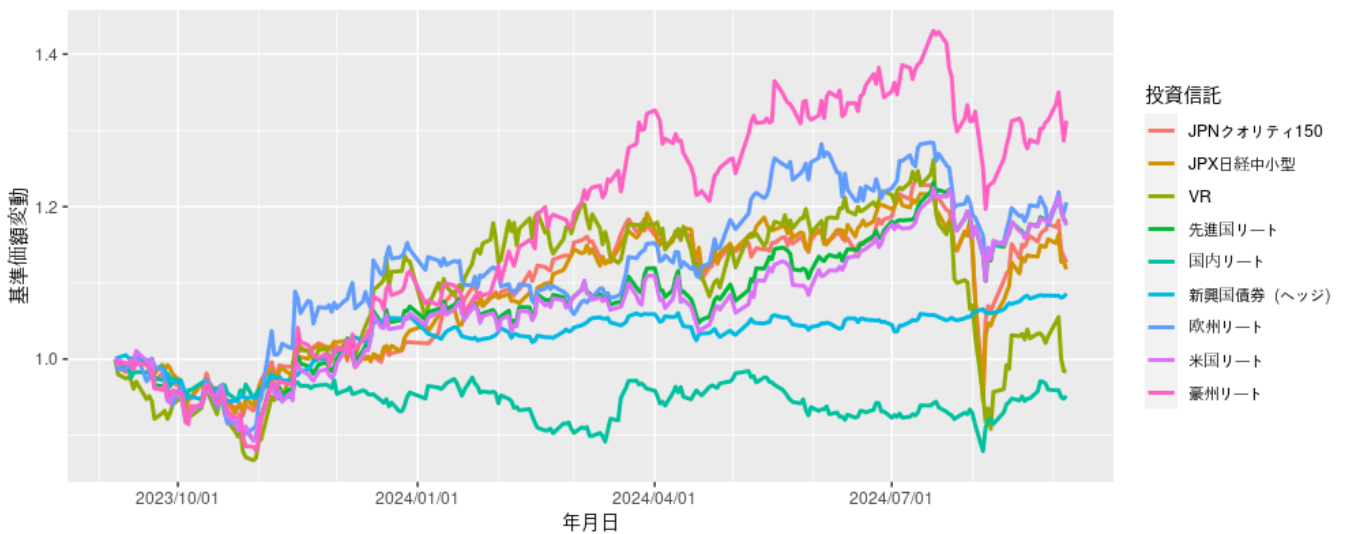
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.070%	1.148%	0.061	—
NASDAQ100	0.076%	1.597%	0.047	0.0%
S&P500	0.074%	1.242%	0.060	46.2%
宇宙開発	0.067%	1.363%	0.049	0.0%
NYダウ	0.066%	1.101%	0.060	53.8%
先進国株式	0.065%	1.156%	0.056	0.0%
ドローン	0.060%	1.534%	0.039	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。