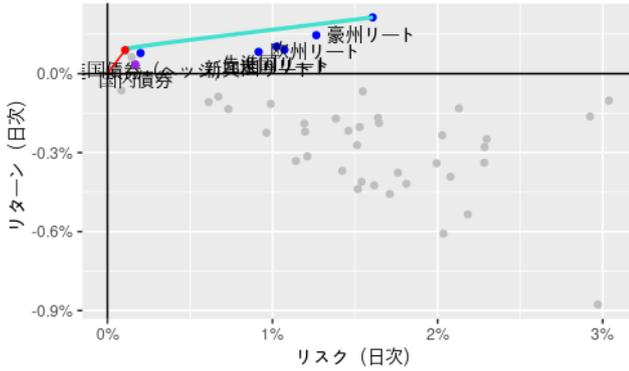


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

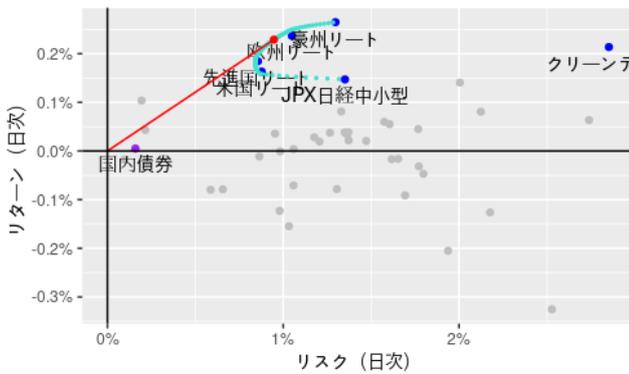
2024年9月13日

【半月】



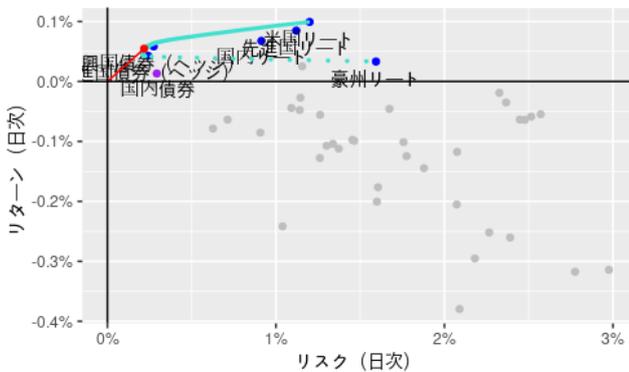
| eMAXIS     | リターン   | リスク    | t 値   | 割合    |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.090% | 0.107% | 0.834 | —     |
| 豪州リート      | 0.214% | 1.606% | 0.133 | 8.2%  |
| 欧州リート      | 0.146% | 1.265% | 0.115 | 0.0%  |
| 先進国リート     | 0.103% | 1.024% | 0.100 | 0.0%  |
| 米国リート      | 0.091% | 1.072% | 0.085 | 2.9%  |
| 新興国リート     | 0.083% | 0.915% | 0.090 | 1.0%  |
| 先進国債券(ヘッジ) | 0.078% | 0.201% | 0.389 | 87.9% |

【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 | 0.229% | 0.947% | 0.242 | —     |
| 豪州リート      | 0.265% | 1.297% | 0.204 | 24.6% |
| 欧州リート      | 0.236% | 1.050% | 0.225 | 47.7% |
| クリーンテック    | 0.214% | 2.853% | 0.075 | 0.0%  |
| 先進国リート     | 0.184% | 0.856% | 0.216 | 27.3% |
| 米国リート      | 0.163% | 0.877% | 0.186 | 0.0%  |
| JPX 日経中小型  | 0.147% | 1.351% | 0.109 | 0.4%  |

【四半期】



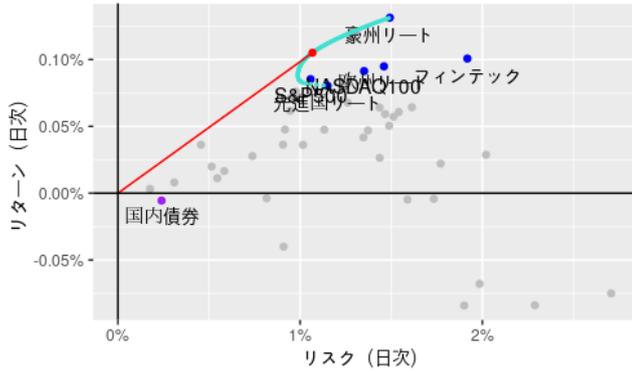
| eMAXIS     | リターン   | リスク    | t 値   | 割合    |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.055% | 0.218% | 0.251 | —     |
| 米国リート      | 0.099% | 1.200% | 0.083 | 8.2%  |
| 先進国リート     | 0.085% | 1.121% | 0.076 | 0.0%  |
| 国内リート      | 0.068% | 0.914% | 0.074 | 6.2%  |
| 新興国債券(ヘッジ) | 0.058% | 0.275% | 0.213 | 36.4% |
| 先進国債券(ヘッジ) | 0.043% | 0.241% | 0.177 | 49.1% |
| 豪州リート      | 0.033% | 1.594% | 0.021 | 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 | %    | %   | —   | —  |
|            | %    | %   | —   | —  |
|            | %    | %   | —   | —  |
|            | %    | %   | —   | —  |
|            | %    | %   | —   | —  |
|            | %    | %   | —   | —  |
|            | %    | %   | —   | —  |

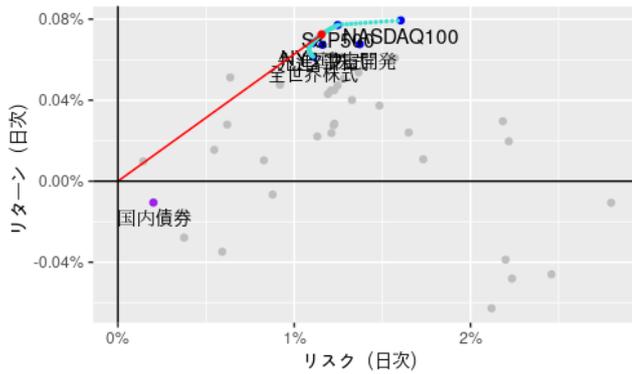
備考 (1) グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。  
 (2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



| eMAXIS     | リターン   | リスク    | t 値   | 割合    |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.105% | 1.068% | 0.098 | —     |
| 豪州リート      | 0.131% | 1.492% | 0.088 | 40.6% |
| フィンテック     | 0.101% | 1.918% | 0.053 | 0.0%  |
| 欧州リート      | 0.095% | 1.460% | 0.065 | 11.9% |
| NASDAQ100  | 0.091% | 1.351% | 0.068 | 0.0%  |
| S&P500     | 0.085% | 1.057% | 0.081 | 47.5% |
| 先進国リート     | 0.080% | 1.151% | 0.070 | 0.0%  |

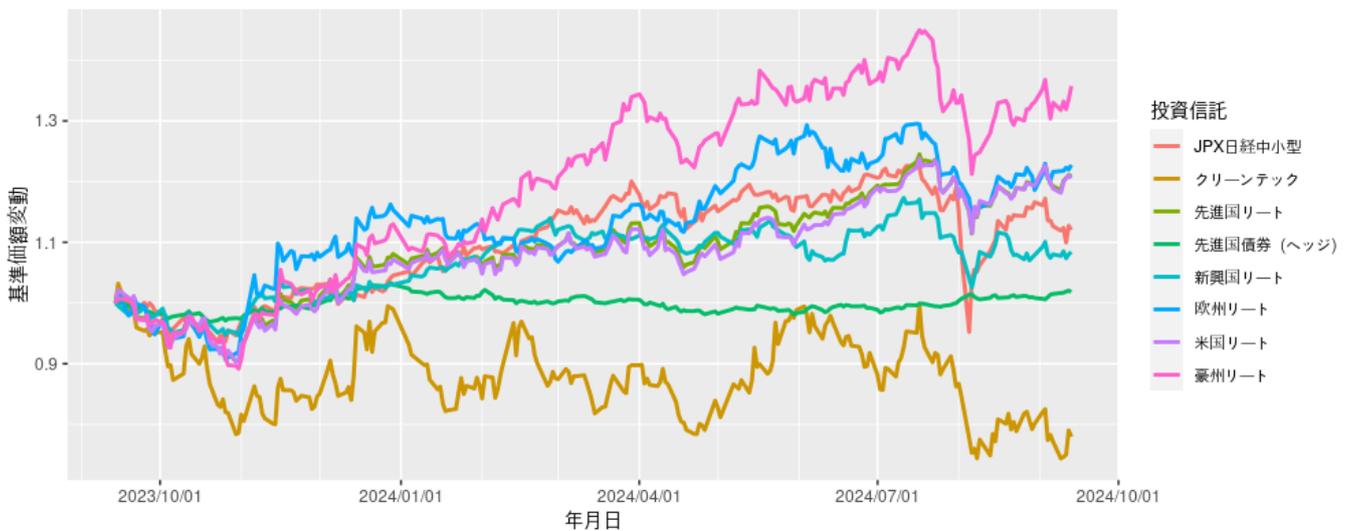
【三年】



| eMAXIS     | リターン   | リスク    | t 値   | 割合    |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.072% | 1.155% | 0.063 | —     |
| NASDAQ100  | 0.079% | 1.604% | 0.049 | 0.0%  |
| S&P500     | 0.077% | 1.247% | 0.062 | 48.3% |
| NYダウ       | 0.068% | 1.104% | 0.062 | 51.7% |
| 宇宙開発       | 0.068% | 1.372% | 0.049 | 0.0%  |
| 先進国株式      | 0.067% | 1.160% | 0.058 | 0.0%  |
| 全世界株式      | 0.061% | 1.109% | 0.055 | 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。