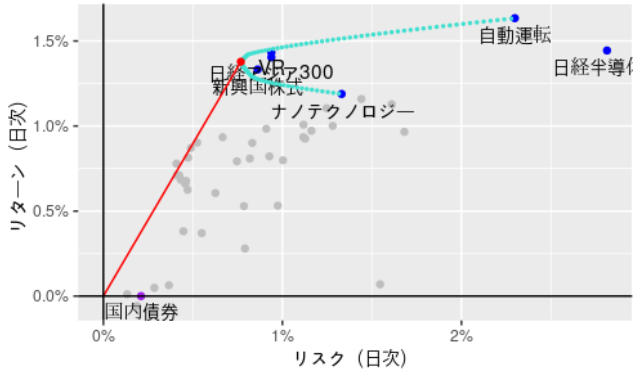


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

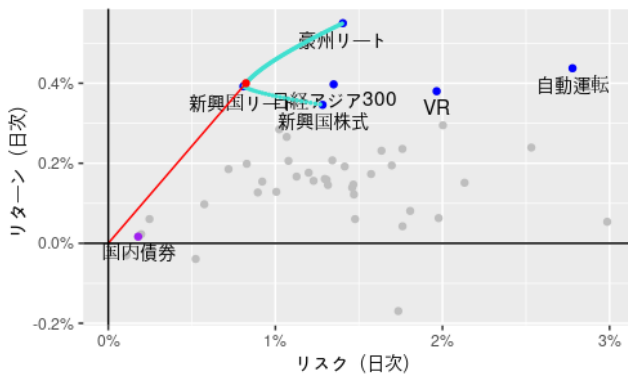
2024年9月28日

【半月】



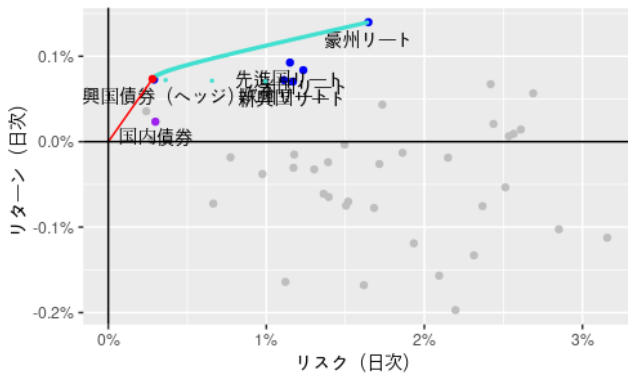
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	1.378%	0.768%	1.794	—
自動運転	1.634%	2.298%	0.711	0.0%
日経半導体株	1.444%	2.813%	0.513	0.0%
VR	1.433%	0.939%	1.527	45.0%
日経アジア 300	1.404%	0.938%	1.496	0.0%
新興国株式	1.333%	0.862%	1.546	55.0%
ナノテクノロジー	1.189%	1.331%	0.893	0.0%

【一ヶ月】



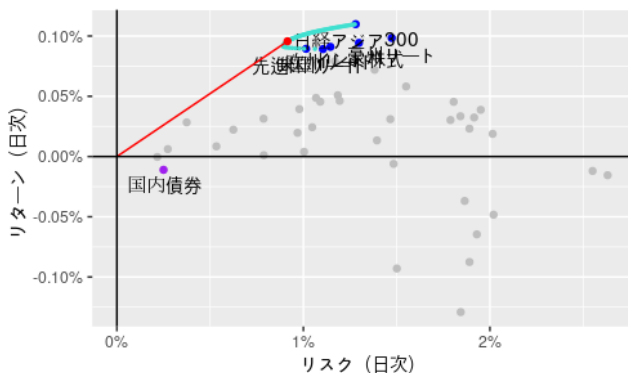
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.400%	0.824%	0.486	—
豪州リート	0.550%	1.404%	0.392	5.0%
自動運転	0.437%	2.778%	0.157	0.0%
日経アジア 300	0.397%	1.349%	0.295	0.0%
新興国リート	0.392%	0.809%	0.485	95.0%
VR	0.380%	1.965%	0.193	0.0%
新興国株式	0.346%	1.283%	0.270	0.0%

【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	0.073%	0.280%	0.263	—
豪州リート	0.140%	1.646%	0.085	0.0%
先進国リート	0.093%	1.150%	0.081	4.3%
米国リート	0.084%	1.234%	0.068	0.0%
新興国債券 (ヘッジ)	0.073%	0.290%	0.251	92.3%
欧州リート	0.072%	1.111%	0.065	0.0%
新興国リート	0.070%	1.168%	0.060	3.4%

【半年】

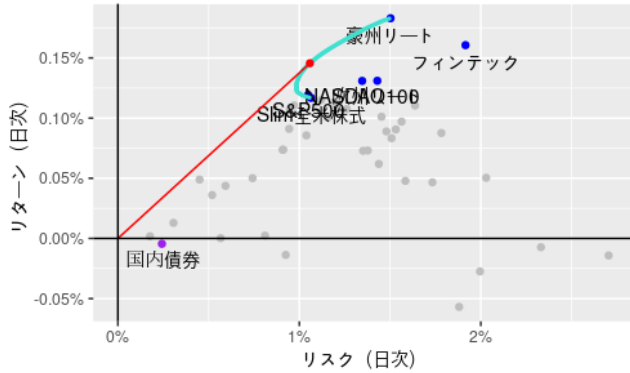


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.096%	0.915%	0.105	—
日経アジア 300	0.110%	1.281%	0.086	24.5%
豪州リート	0.098%	1.474%	0.067	0.0%
インド株式	0.094%	1.298%	0.073	18.4%
欧州リート	0.091%	1.145%	0.080	27.2%
先進国リート	0.089%	1.014%	0.088	0.0%
米国リート	0.089%	1.105%	0.081	29.9%

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。

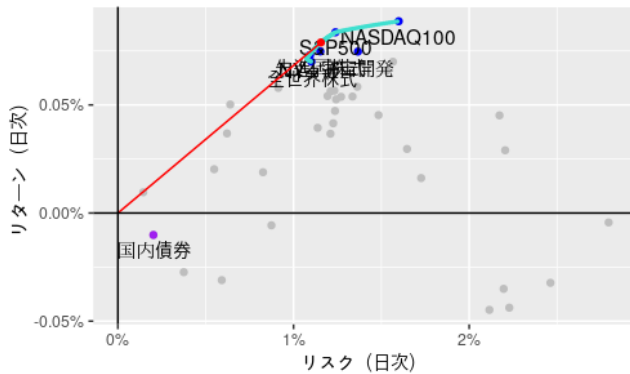
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.146%	1.058%	0.138	—
豪州リート	0.183%	1.503%	0.122	39.2%
フィンテック	0.161%	1.916%	0.084	0.0%
欧州リート	0.131%	1.430%	0.092	11.4%
NASDAQ100	0.131%	1.346%	0.097	0.0%
S&P500	0.119%	1.048%	0.114	49.4%
Slim 全米株式	0.117%	1.065%	0.110	0.0%

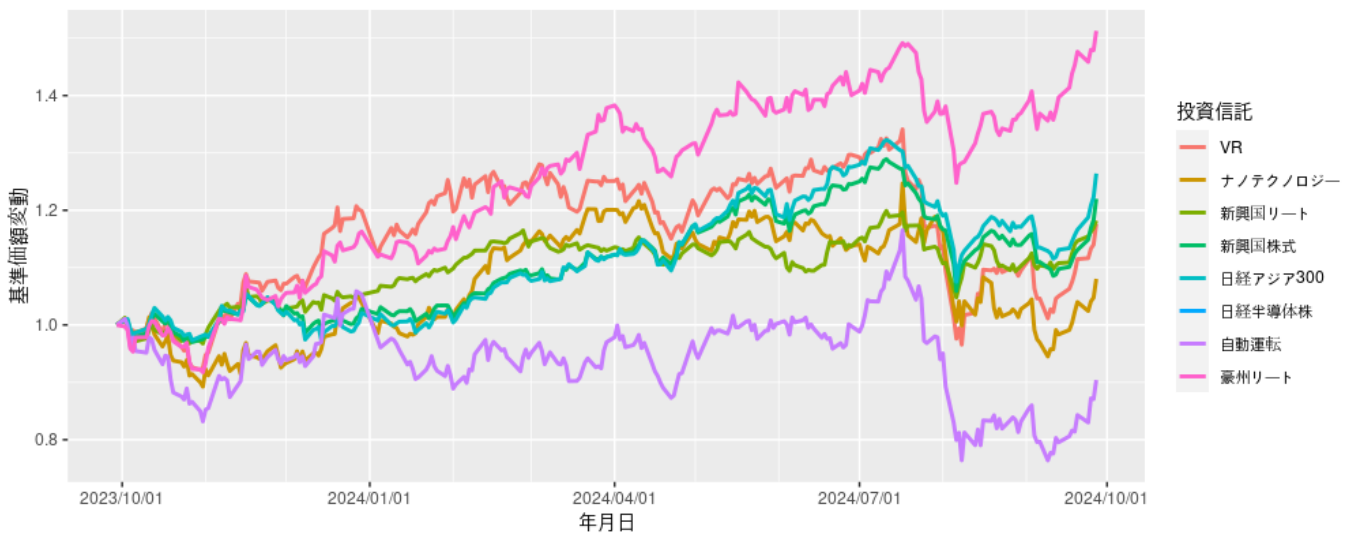
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.079%	1.156%	0.068	—
NASDAQ100	0.089%	1.599%	0.055	0.0%
S&P500	0.084%	1.239%	0.068	54.9%
先進国株式	0.075%	1.152%	0.065	0.0%
宇宙開発	0.075%	1.367%	0.055	0.0%
NYダウ	0.073%	1.094%	0.067	45.1%
全世界株式	0.070%	1.102%	0.064	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。