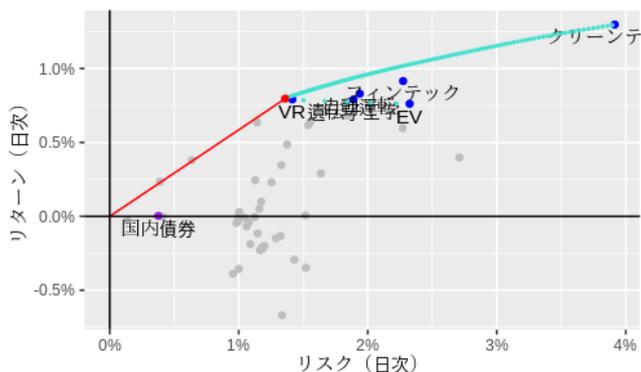


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

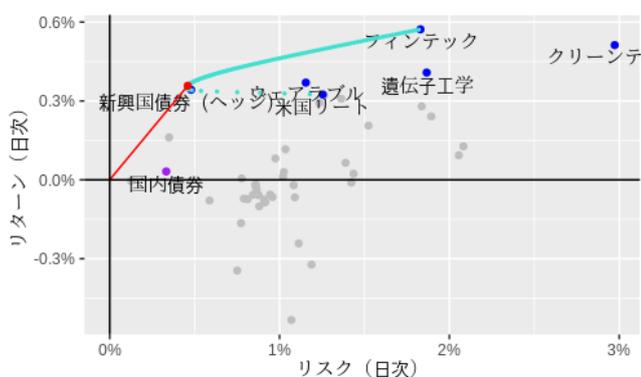
2023年12月16日

【半月】



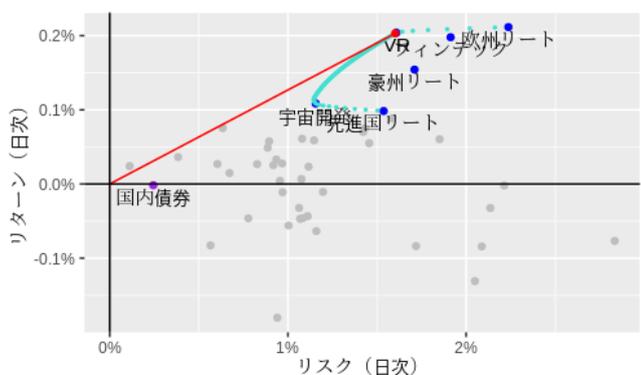
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.797%	1.360%	0.586	—
クリーンテック	1.298%	3.914%	0.332	0.0%
フィンテック	0.916%	2.274%	0.403	4.3%
自動運転	0.830%	1.938%	0.429	0.0%
VR	0.791%	1.415%	0.559	72.4%
遺伝子工学	0.790%	1.890%	0.418	23.3%
EV	0.762%	2.324%	0.328	0.0%

【一ヶ月】



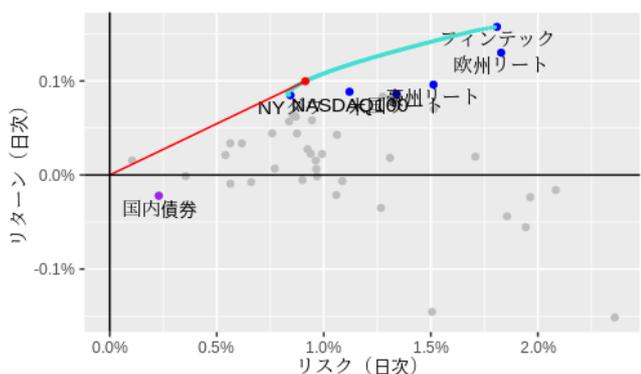
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.358%	0.459%	0.779	—
フィンテック	0.572%	1.830%	0.313	5.4%
クリーンテック	0.513%	2.973%	0.172	0.0%
遺伝子工学	0.408%	1.866%	0.219	0.0%
ウェアラブル	0.370%	1.155%	0.320	10.3%
新興国債券 (ヘッジ)	0.343%	0.479%	0.715	84.2%
米国リート	0.324%	1.255%	0.259	0.0%

【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	0.203%	1.602%	0.127	—
欧州リート	0.211%	2.237%	0.095	0.0%
VR	0.204%	1.608%	0.127	98.2%
フィンテック	0.198%	1.913%	0.103	0.0%
豪州リート	0.154%	1.710%	0.090	1.8%
宇宙開発	0.108%	1.156%	0.094	0.0%
先進国リート	0.098%	1.537%	0.064	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	0.100%	0.914%	0.109	—
フィンテック	0.158%	1.809%	0.087	12.7%
欧州リート	0.130%	1.829%	0.071	11.4%
豪州リート	0.096%	1.512%	0.064	4.3%
NASDAQ100	0.089%	1.120%	0.079	0.0%
米国リート	0.086%	1.340%	0.064	0.0%
NY ダウ	0.085%	0.844%	0.100	71.5%

備考 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。