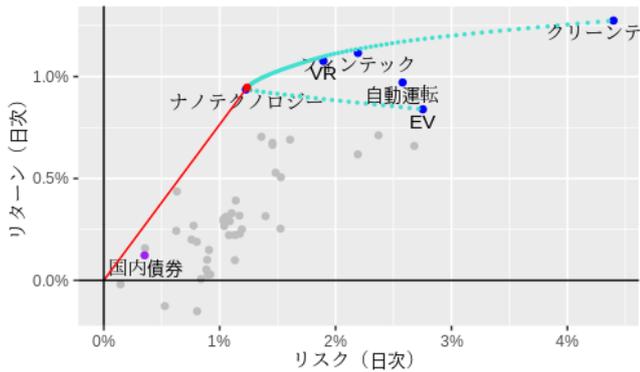


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

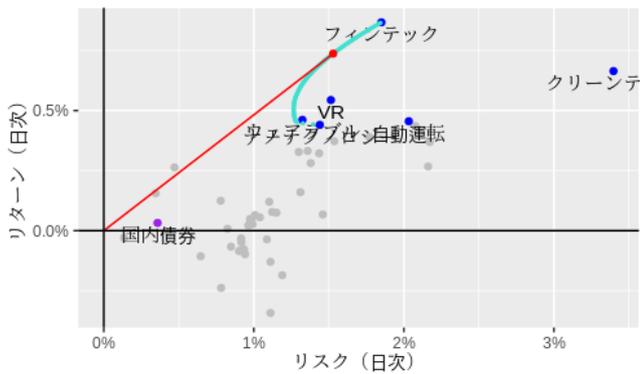
2023年12月23日

【半月】



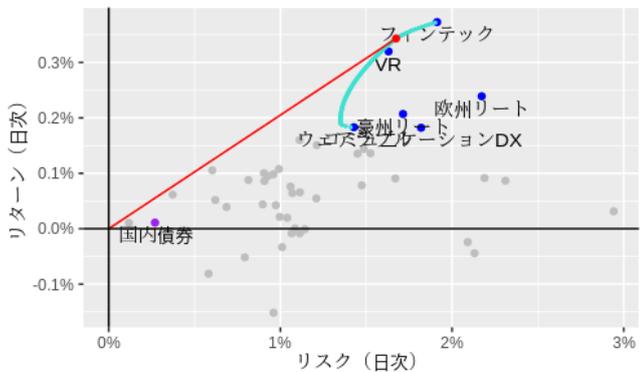
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.946%	1.237%	0.765	—
クリーンテック	1.275%	4.398%	0.290	0.0%
フィンテック	1.116%	2.193%	0.509	0.0%
VR	1.076%	1.895%	0.568	6.9%
自動運転	0.971%	2.578%	0.377	0.0%
ナノテクノロジー	0.936%	1.227%	0.763	93.1%
EV	0.839%	2.753%	0.305	0.0%

【一ヶ月】



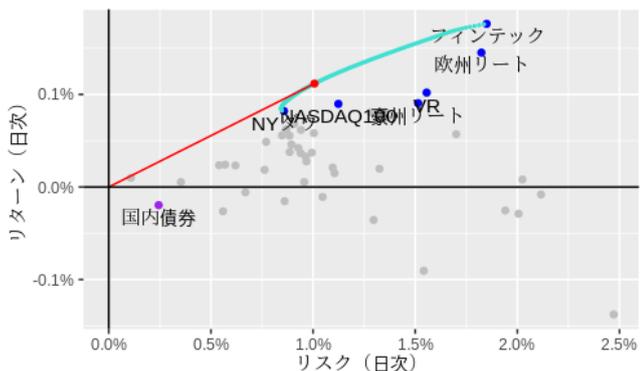
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.737%	1.529%	0.482	—
フィンテック	0.867%	1.850%	0.469	67.9%
クリーンテック	0.664%	3.397%	0.196	0.0%
VR	0.544%	1.514%	0.359	0.0%
ウェアラブル	0.461%	1.324%	0.348	32.0%
自動運転	0.456%	2.033%	0.224	0.0%
ナノテクノロジー	0.441%	1.440%	0.306	0.0%

【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	0.343%	1.674%	0.205	—
フィンテック	0.373%	1.913%	0.195	44.1%
VR	0.320%	1.630%	0.196	55.9%
欧州リート	0.239%	2.173%	0.110	0.0%
豪州リート	0.207%	1.714%	0.121	0.0%
ウェアラブル	0.183%	1.428%	0.128	0.0%
コミュニケーション DX	0.182%	1.820%	0.100	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	0.112%	1.007%	0.111	—
フィンテック	0.176%	1.850%	0.095	19.4%
欧州リート	0.145%	1.824%	0.080	18.0%
VR	0.102%	1.556%	0.066	0.0%
豪州リート	0.091%	1.514%	0.060	0.0%
NASDAQ100	0.090%	1.124%	0.080	0.0%
NYダウ	0.082%	0.858%	0.096	62.6%

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。