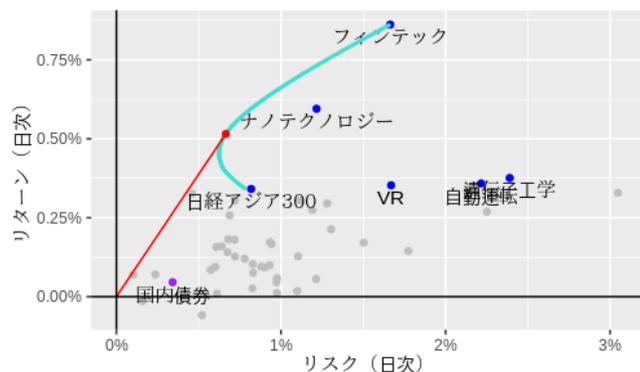


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

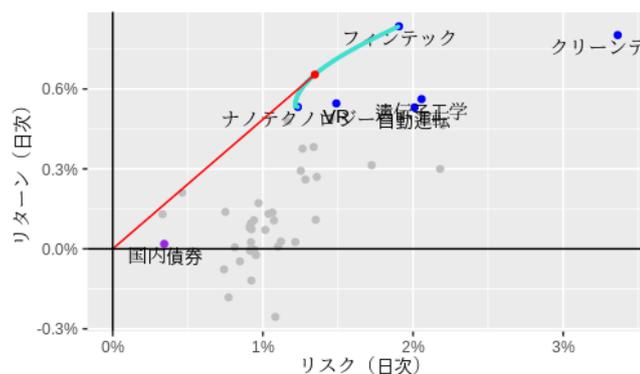
2023年12月30日

【半月】



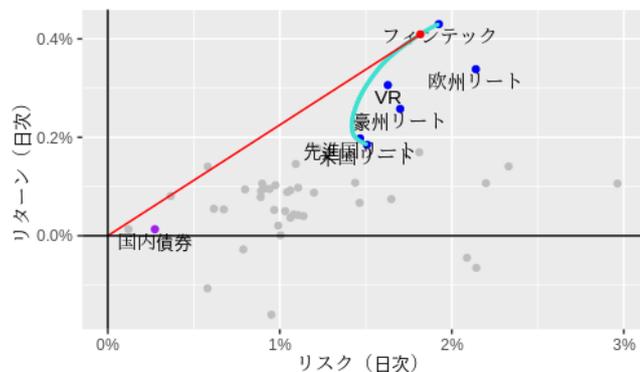
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.515%	0.665%	0.775	—
フィンテック	0.862%	1.664%	0.518	26.0%
ナノテクノロジー	0.595%	1.216%	0.489	15.3%
遺伝子工学	0.376%	2.390%	0.157	0.0%
自動運転	0.359%	2.216%	0.162	0.0%
VR	0.353%	1.669%	0.211	0.0%
日経アジア 300	0.341%	0.819%	0.417	58.7%

【一ヶ月】



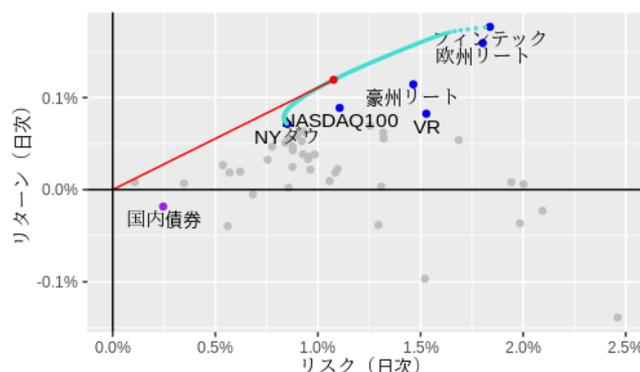
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.654%	1.346%	0.486	—
フィンテック	0.835%	1.906%	0.438	40.2%
クリーンテック	0.802%	3.363%	0.239	0.0%
遺伝子工学	0.562%	2.057%	0.273	0.0%
VR	0.546%	1.489%	0.366	1.0%
ナノテクノロジー	0.532%	1.233%	0.432	58.9%
自動運転	0.531%	2.010%	0.264	0.0%

【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	0.409%	1.817%	0.225	—
フィンテック	0.430%	1.925%	0.223	82.8%
欧州リート	0.338%	2.140%	0.158	10.4%
VR	0.306%	1.628%	0.188	0.9%
豪州リート	0.258%	1.700%	0.152	5.9%
先進国リート	0.198%	1.467%	0.135	0.0%
米国リート	0.185%	1.508%	0.123	0.0%

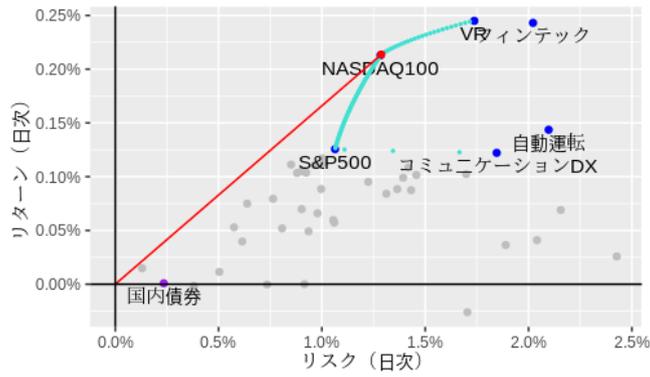
【半年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.119%	1.077%	0.111	—
フィンテック	0.177%	1.838%	0.096	19.9%
欧州リート	0.159%	1.803%	0.088	22.4%
豪州リート	0.114%	1.465%	0.078	14.2%
NASDAQ100	0.089%	1.106%	0.080	6.6%
VR	0.082%	1.528%	0.054	0.0%
NY ダウ	0.071%	0.851%	0.084	36.8%

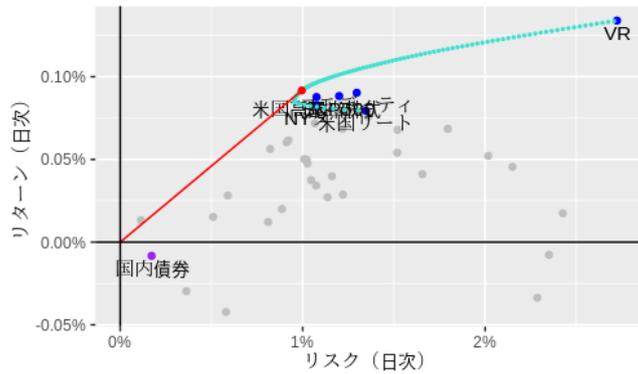
備考 グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.214%	1.287%	0.166	—
VR	0.245%	1.737%	0.141	0.0%
フィンテック	0.243%	2.022%	0.120	2.3%
NASDAQ100	0.213%	1.284%	0.166	97.7%
自動運転	0.144%	2.097%	0.068	0.0%
S&P500	0.126%	1.064%	0.118	0.0%
コミュニケーション DX	0.122%	1.846%	0.066	0.0%

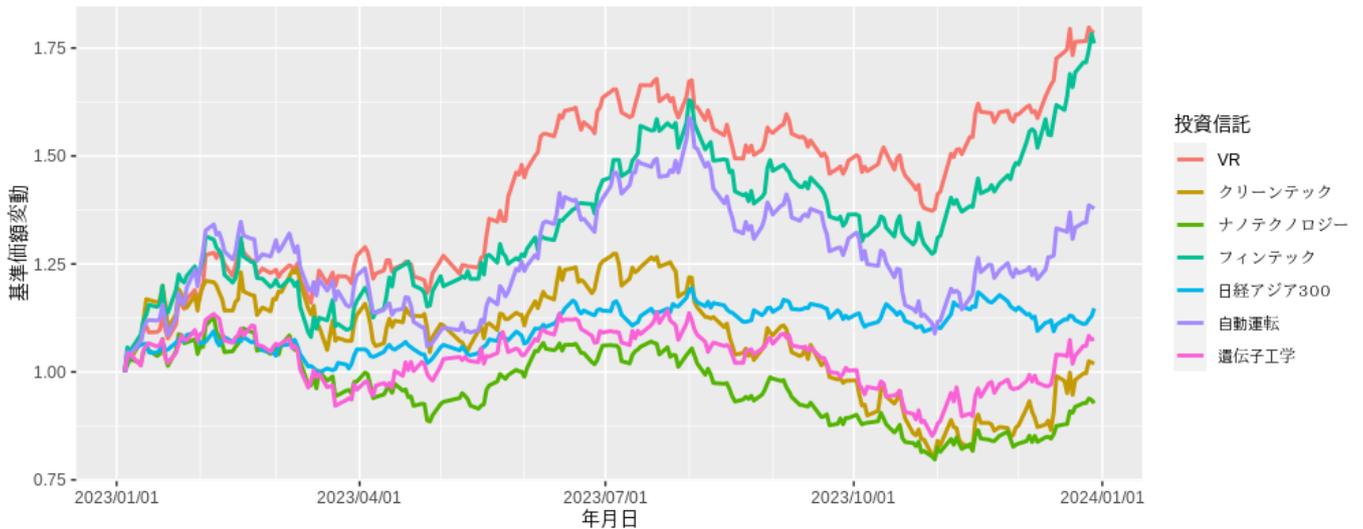
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.092%	0.995%	0.092	—
VR	0.134%	2.723%	0.049	6.4%
コモディティ	0.090%	1.296%	0.070	37.9%
S&P500	0.088%	1.200%	0.074	0.0%
米国高配当株式	0.088%	1.076%	0.082	55.7%
NYダウ	0.083%	1.076%	0.077	0.0%
米国リート	0.079%	1.346%	0.059	0.0%

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。

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にランクされた銘柄について一年前を 1.00 として直近一年間の価額変動を示す。