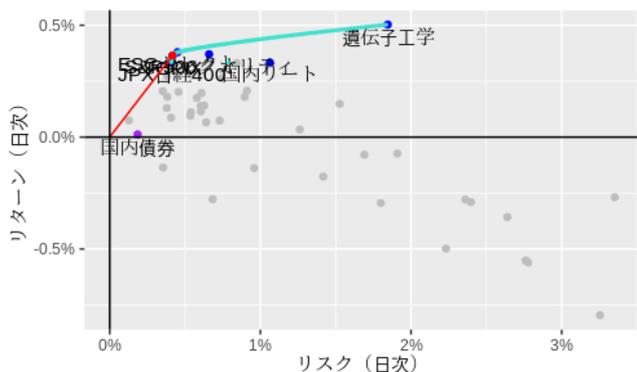


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

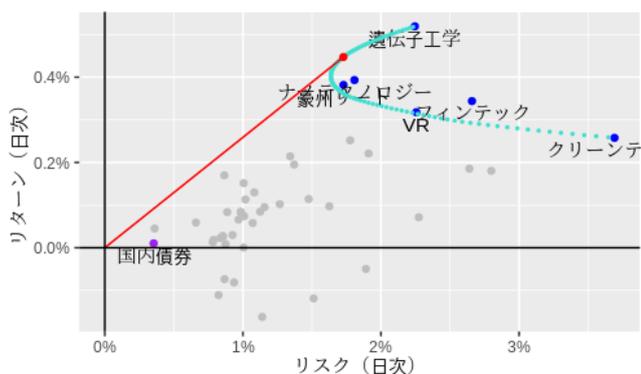
2024年1月6日

【半月】



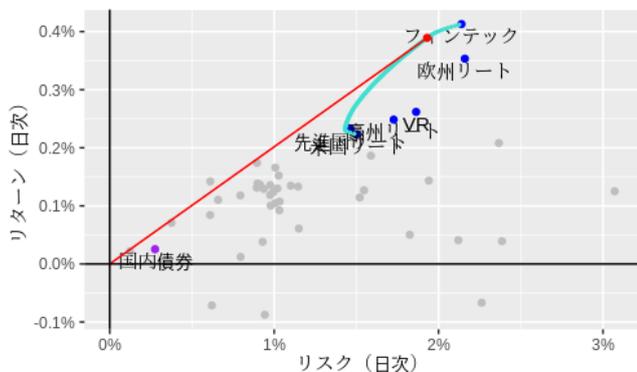
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.365%	0.417%	0.875	—
遺伝子工学	0.503%	1.846%	0.273	0.0%
ESG セレクト	0.379%	0.450%	0.843	11.3%
S&P500 クオリティ	0.371%	0.660%	0.562	0.0%
TOPIX	0.364%	0.417%	0.872	86.4%
JPX 日経 400	0.336%	0.413%	0.815	0.0%
国内リート	0.334%	1.063%	0.314	2.2%

【一ヶ月】



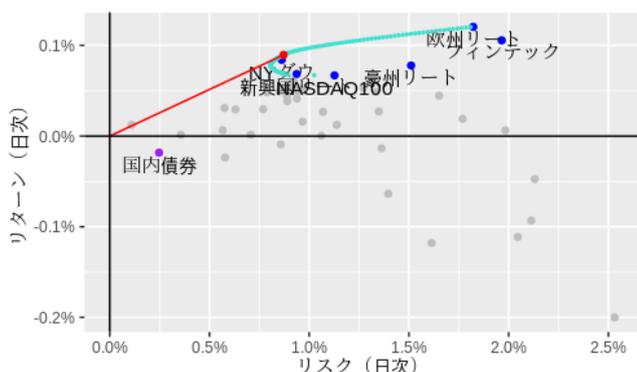
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.447%	1.728%	0.259	—
遺伝子工学	0.519%	2.245%	0.231	47.6%
ナノテクノロジー	0.393%	1.808%	0.217	0.4%
豪州リート	0.382%	1.729%	0.221	52.0%
フィンテック	0.344%	2.659%	0.129	0.0%
VR	0.318%	2.255%	0.141	0.0%
クリーンテック	0.258%	3.691%	0.070	0.0%

【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	0.389%	1.930%	0.202	—
フィンテック	0.413%	2.139%	0.193	65.4%
欧州リート	0.353%	2.160%	0.164	31.7%
VR	0.262%	1.864%	0.140	0.0%
豪州リート	0.248%	1.727%	0.144	2.9%
先進国リート	0.232%	1.465%	0.158	0.0%
米国リート	0.223%	1.504%	0.148	0.0%

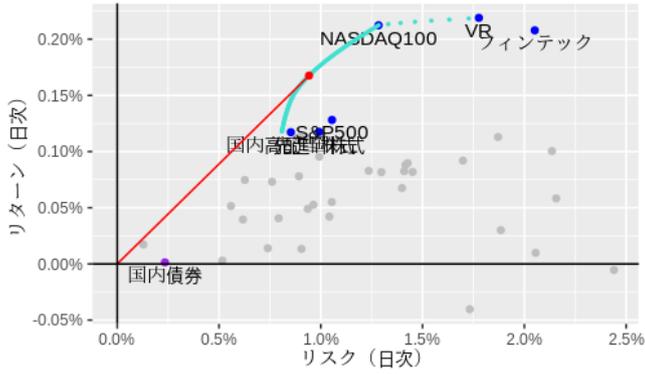
【半年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.090%	0.872%	0.103	—
欧州リート	0.121%	1.822%	0.066	15.7%
フィンテック	0.106%	1.965%	0.054	0.0%
NY ダウ	0.084%	0.862%	0.097	83.0%
豪州リート	0.078%	1.511%	0.052	1.3%
新興国リート	0.068%	0.937%	0.073	0.0%
NASDAQ100	0.067%	1.127%	0.059	0.0%

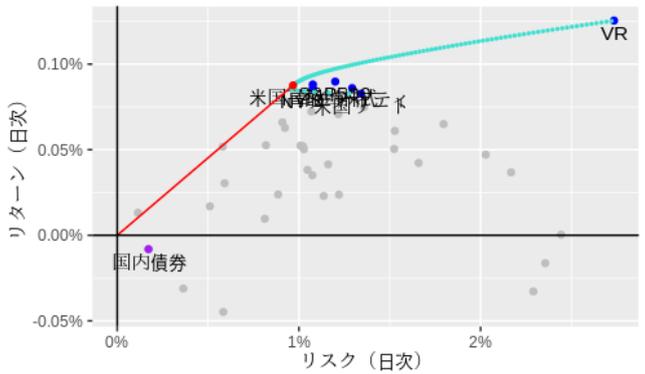
備考 グラフ中の赤点（・）は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.168%	0.942%	0.178	—
VR	0.219%	1.776%	0.123	0.0%
NASDAQ100	0.212%	1.284%	0.165	52.9%
フィンテック	0.208%	2.051%	0.101	0.0%
S&P500	0.128%	1.055%	0.121	0.0%
先進国株式	0.118%	0.992%	0.119	0.0%
国内高配当株式	0.117%	0.853%	0.137	47.1%

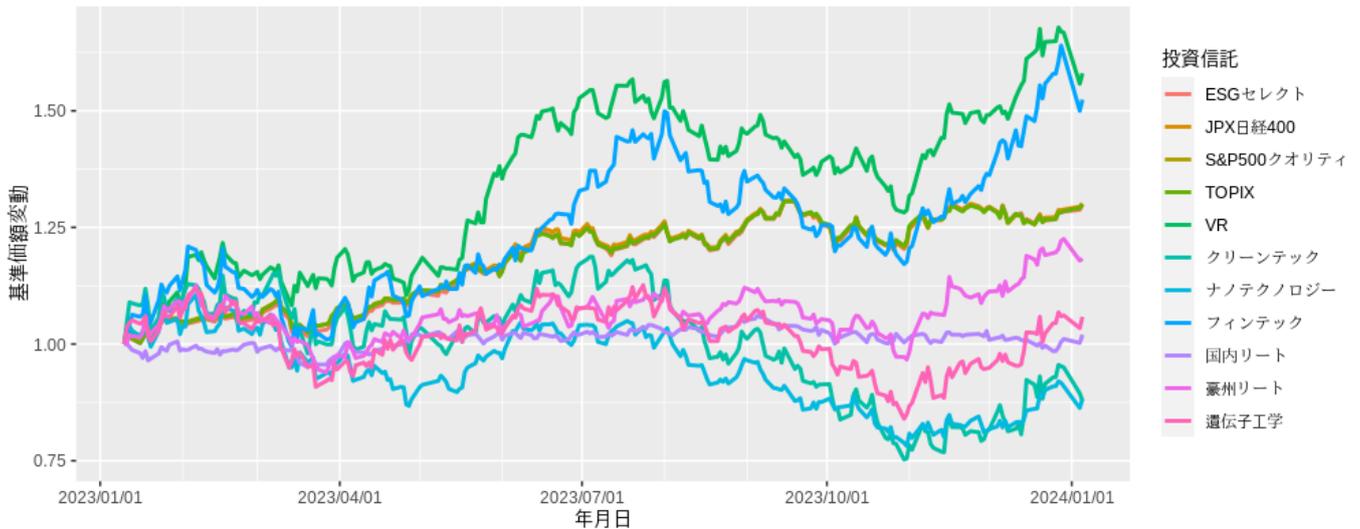
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.088%	0.968%	0.091	—
VR	0.125%	2.734%	0.046	2.6%
S&P500	0.090%	1.200%	0.075	0.0%
米国高配当株式	0.088%	1.077%	0.082	33.8%
コモディティ	0.086%	1.293%	0.066	34.7%
NY ダウ	0.086%	1.077%	0.080	27.1%
米国リート	0.083%	1.342%	0.062	1.8%

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。

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。