

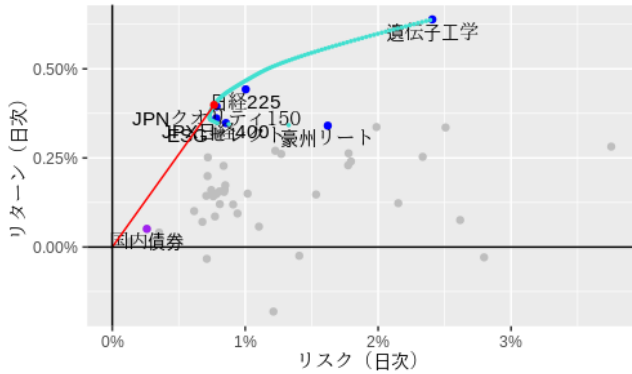
eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

2024年1月13日

【半月】

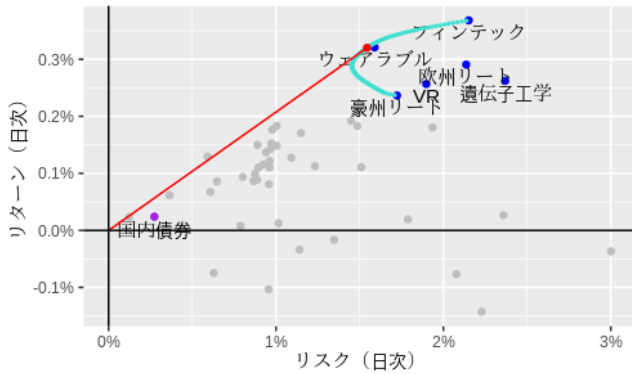
データ不足のため削除

【一ヶ月】



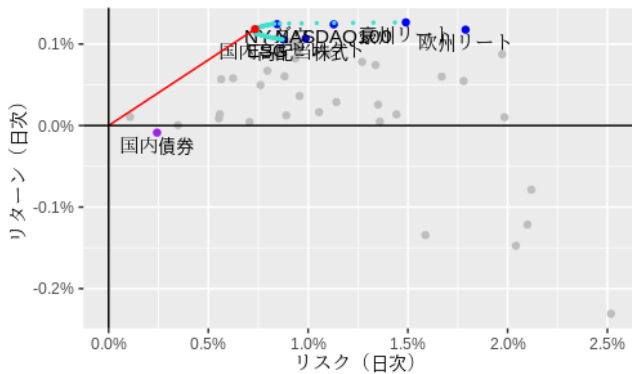
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.399%	0.766%	0.520	—
遺伝子工学	0.639%	2.408%	0.265	5.8%
日経 225	0.443%	1.004%	0.441	0.0%
JPN クオリティ 150	0.395%	0.785%	0.503	68.2%
JPX 日経 400	0.361%	0.782%	0.462	19.3%
ESG セレクト	0.348%	0.855%	0.407	0.0%
豪州リート	0.341%	1.621%	0.210	6.7%

【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	0.320%	1.544%	0.207	—
フィンテック	0.368%	2.151%	0.171	10.9%
ウェアラブル	0.321%	1.589%	0.202	74.2%
欧州リート	0.291%	2.136%	0.136	12.4%
遺伝子工学	0.262%	2.369%	0.111	0.0%
VR	0.257%	1.898%	0.135	0.0%
豪州リート	0.237%	1.723%	0.137	2.5%

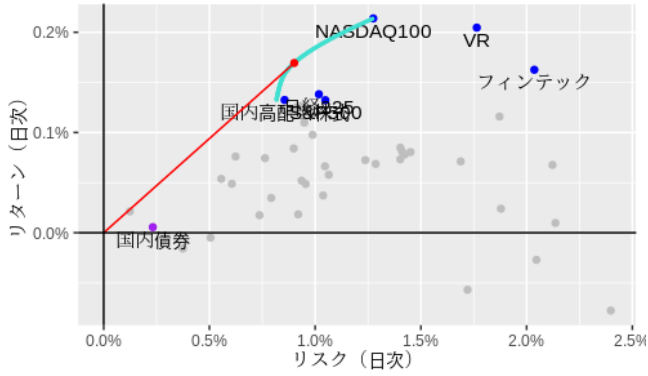
【半年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.118%	0.734%	0.161	—
豪州リート	0.127%	1.490%	0.085	11.3%
NY ダウ	0.124%	0.844%	0.147	55.0%
NASDAQ100	0.124%	1.129%	0.110	0.0%
欧州リート	0.118%	1.789%	0.066	0.0%
ESG セレクト	0.107%	0.988%	0.108	0.0%
国内高配当株式	0.106%	0.876%	0.120	33.7%

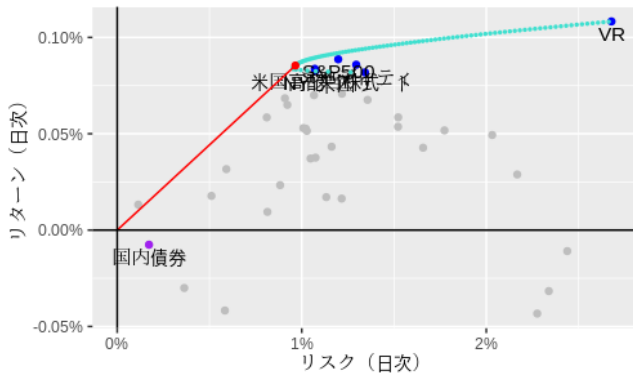
備考 グラフ中の赤点（・）は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.169%	0.901%	0.188	—
NASDAQ100	0.214%	1.275%	0.168	45.4%
VR	0.205%	1.764%	0.116	0.0%
フィンテック	0.163%	2.036%	0.080	0.0%
日経 225	0.138%	1.018%	0.136	0.0%
国内高配当株式	0.132%	0.856%	0.155	54.6%
S&P500	0.132%	1.048%	0.126	0.0%

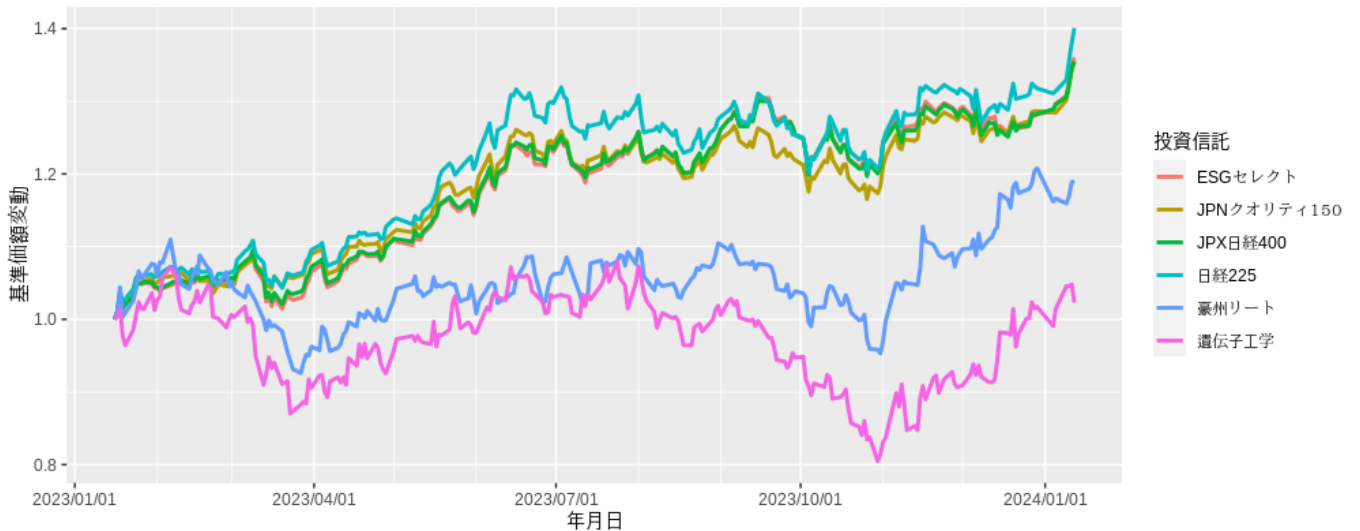
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.085%	0.966%	0.088	—
VR	0.108%	2.678%	0.040	0.0%
S&P500	0.089%	1.198%	0.074	22.8%
コモディティ	0.086%	1.295%	0.066	37.3%
米国高配当株式	0.084%	1.071%	0.078	21.9%
NYダウ	0.083%	1.074%	0.077	14.5%
米国リート	0.082%	1.343%	0.061	3.5%

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。

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。