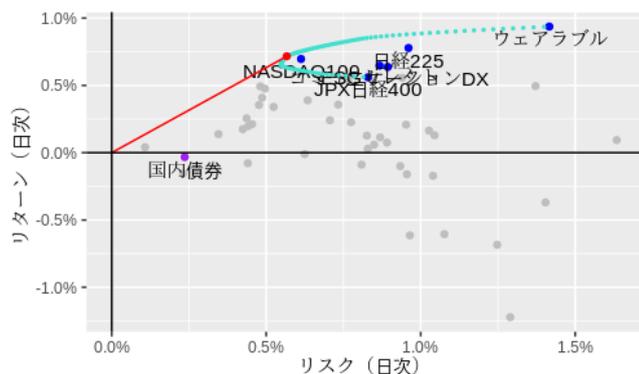


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

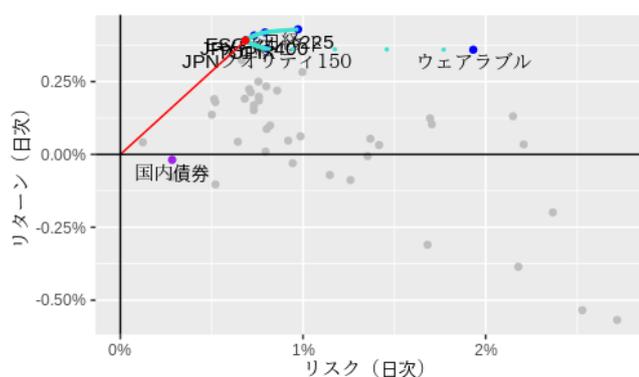
2024年1月20日

【半月】



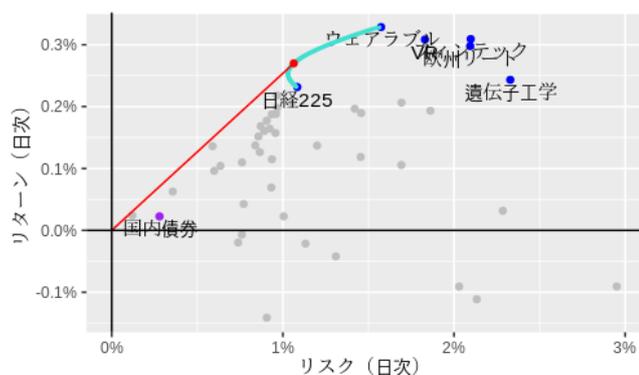
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.717%	0.567%	1.265	—
ウェアラブル	0.937%	1.416%	0.662	0.0%
日経 225	0.778%	0.961%	0.810	25.1%
NASDAQ100	0.696%	0.613%	1.137	74.7%
ESG セレクト	0.647%	0.867%	0.746	0.0%
コミュニケーション DX	0.638%	0.894%	0.713	0.0%
JPX 日経 400	0.560%	0.830%	0.675	0.2%

【一ヶ月】



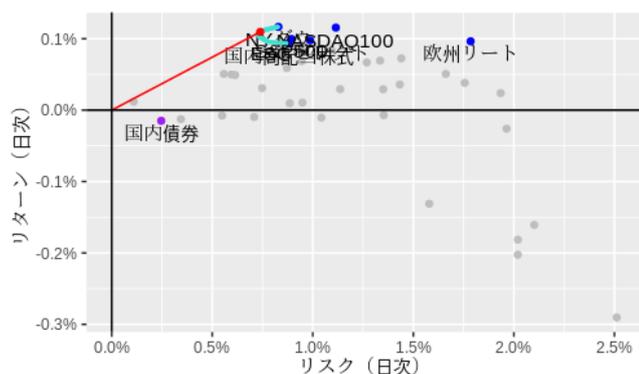
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.391%	0.685%	0.571	—
日経 225	0.429%	0.973%	0.441	0.0%
ESG セレクト	0.418%	0.792%	0.529	0.0%
JPX 日経 400	0.408%	0.733%	0.557	0.0%
TOPIX	0.392%	0.687%	0.570	98.4%
JPN クオリティ 150	0.363%	0.802%	0.452	0.0%
ウェアラブル	0.359%	1.932%	0.186	1.6%

【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	0.270%	1.064%	0.254	—
ウェアラブル	0.328%	1.574%	0.209	39.5%
フィンテック	0.309%	2.098%	0.147	0.0%
VR	0.308%	1.830%	0.168	0.0%
欧州リート	0.298%	2.095%	0.142	0.0%
遺伝子工学	0.243%	2.329%	0.104	0.0%
日経 225	0.232%	1.085%	0.213	60.5%

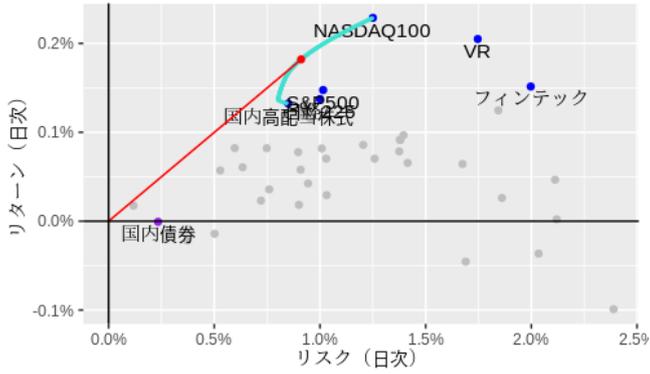
【半年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.110%	0.739%	0.148	—
NY ダウ	0.117%	0.829%	0.141	69.5%
NASDAQ100	0.116%	1.115%	0.104	0.0%
S&P500	0.100%	0.895%	0.111	0.0%
ESG セレクト	0.098%	0.987%	0.099	0.0%
欧州リート	0.096%	1.785%	0.054	0.0%
国内高配当株式	0.094%	0.878%	0.107	30.5%

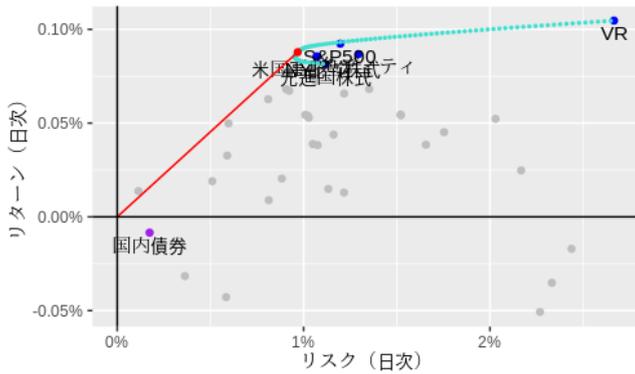
備考 グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.182%	0.911%	0.200	—
NASDAQ100	0.229%	1.251%	0.183	51.5%
VR	0.205%	1.747%	0.117	0.0%
フィンテック	0.151%	1.997%	0.076	0.0%
S&P500	0.148%	1.015%	0.145	0.0%
日経 225	0.137%	1.000%	0.137	0.0%
国内高配当株式	0.132%	0.850%	0.156	48.5%

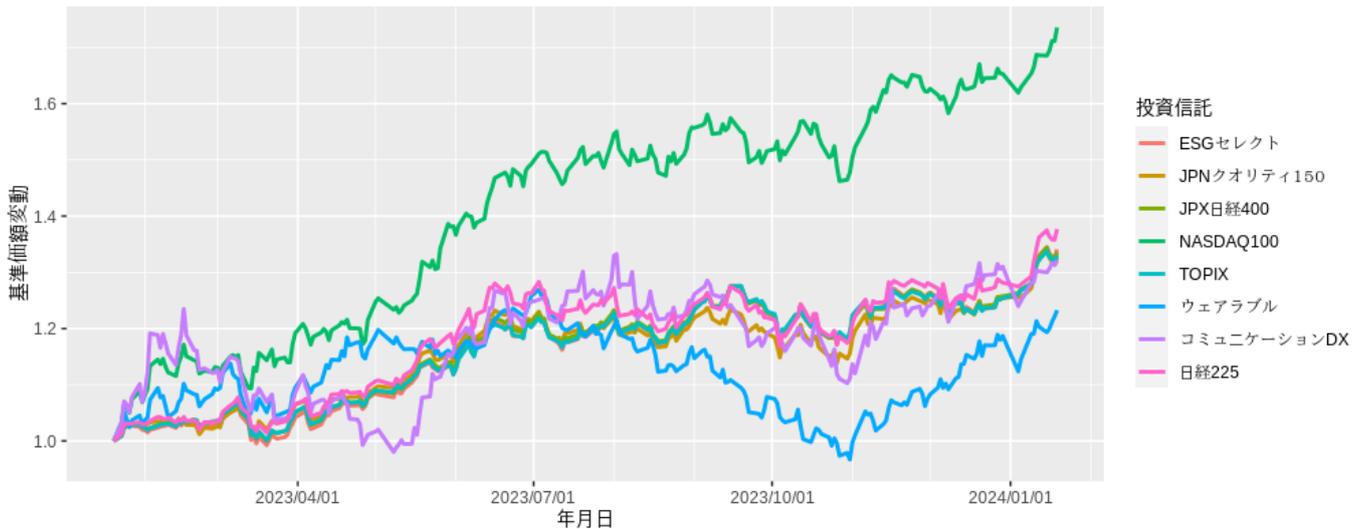
【三年】



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	0.105%	2.665%	0.039	0.0%
S&P500	0.092%	1.197%	0.077	27.4%
コモディティ	0.087%	1.294%	0.067	36.8%
米国高配当株式	0.085%	1.069%	0.080	15.3%
NYダウ	0.085%	1.074%	0.080	20.5%
先進国株式	0.081%	1.118%	0.073	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。