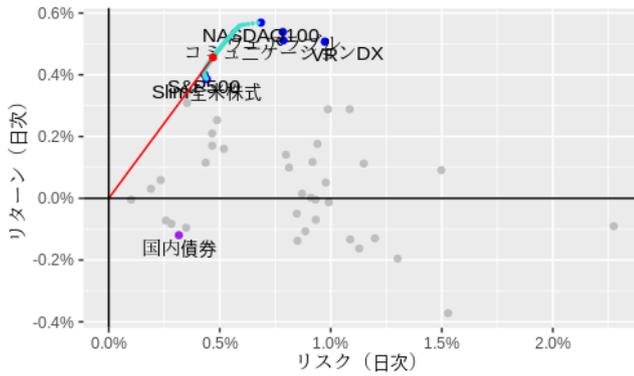


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

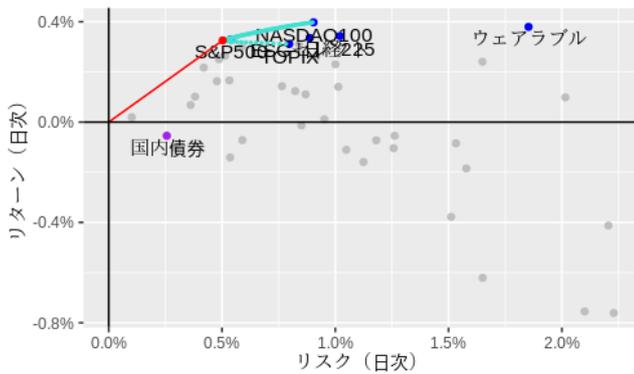
2024年1月27日

【半月】



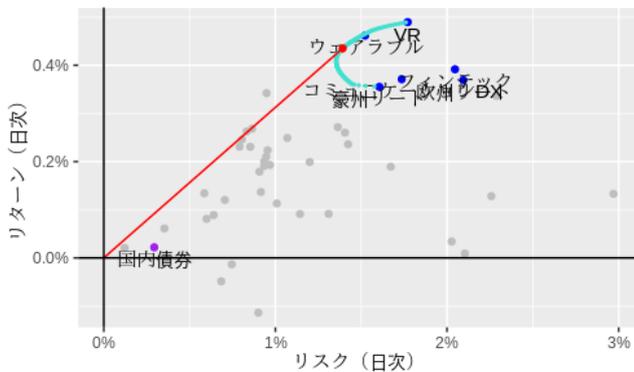
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.456%	0.469%	0.972	—
NASDAQ100	0.569%	0.686%	0.830	15.6%
ウェアラブル	0.539%	0.784%	0.687	21.1%
コミュニケーション DX	0.512%	0.786%	0.651	0.0%
VR	0.507%	0.973%	0.521	0.0%
S&P500	0.401%	0.430%	0.932	63.3%
Slim 全米株式	0.386%	0.442%	0.874	0.0%

【一ヶ月】



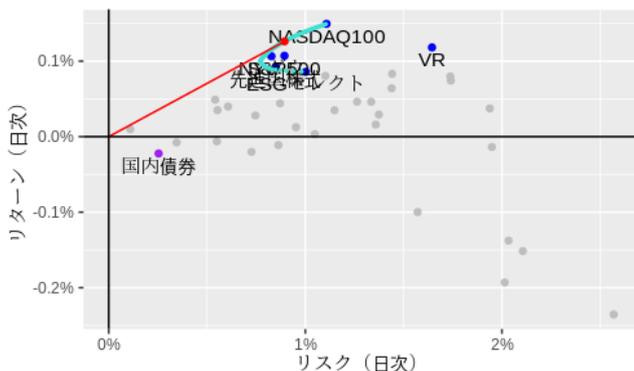
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.326%	0.503%	0.648	—
NASDAQ100	0.398%	0.904%	0.440	0.0%
ウェアラブル	0.380%	1.853%	0.205	0.0%
日経 225	0.343%	1.021%	0.336	0.0%
ESG セレクト	0.336%	0.887%	0.378	0.0%
S&P500	0.330%	0.539%	0.612	75.9%
TOPIX	0.311%	0.797%	0.391	24.1%

【四半期】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
VR	0.490%	1.771%	0.276	0.1%
ウェアラブル	0.462%	1.523%	0.303	74.8%
フィンテック	0.392%	2.046%	0.191	0.0%
コミュニケーション DX	0.371%	1.736%	0.214	0.0%
欧州リート	0.369%	2.095%	0.176	1.6%
豪州リート	0.355%	1.606%	0.221	23.5%

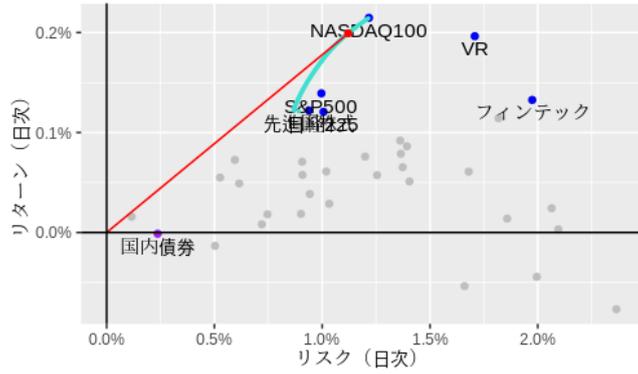
【半年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.126%	0.894%	0.141	—
NASDAQ100	0.149%	1.108%	0.135	48.0%
VR	0.118%	1.644%	0.072	0.0%
S&P500	0.107%	0.894%	0.120	0.0%
NY ダウ	0.106%	0.828%	0.129	47.5%
先進国株式	0.093%	0.850%	0.109	0.0%
ESG セレクト	0.086%	1.002%	0.086	4.5%

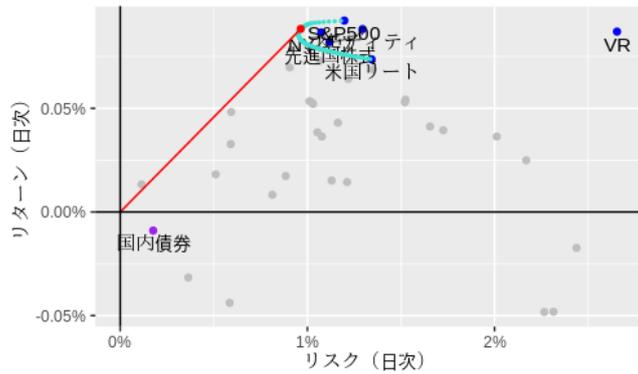
備考 グラフ中の赤点（・）は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.199%	1.121%	0.178	—
NASDAQ100	0.215%	1.217%	0.176	83.5%
VR	0.196%	1.708%	0.115	0.0%
S&P500	0.139%	0.996%	0.140	0.0%
フィンテック	0.133%	1.974%	0.067	0.0%
先進国株式	0.122%	0.938%	0.130	0.0%
日経 225	0.121%	1.006%	0.120	16.5%

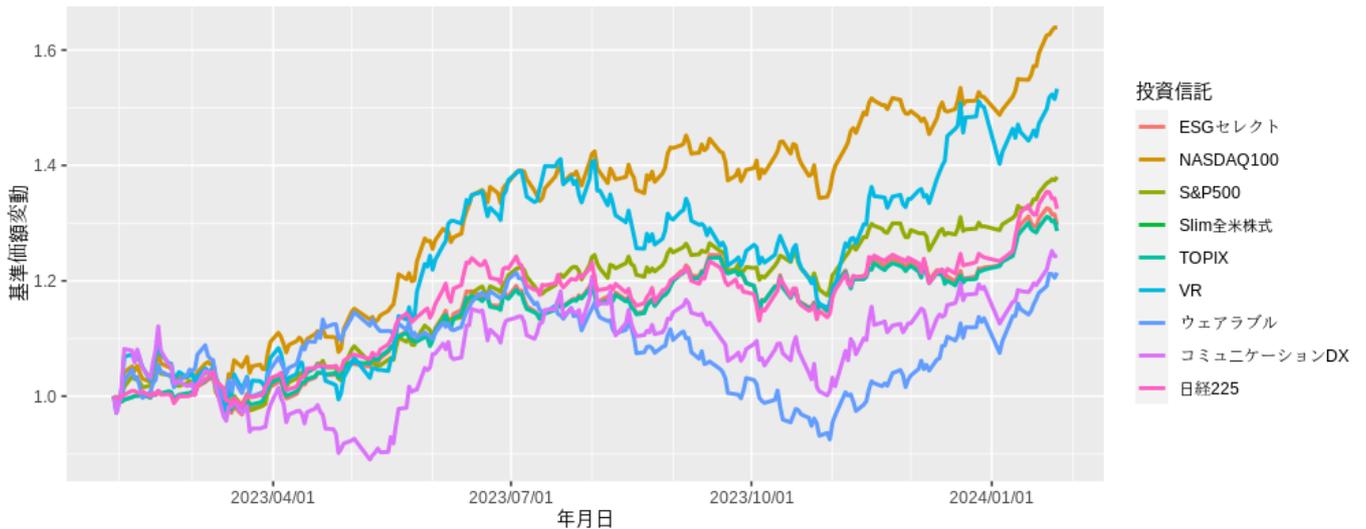
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.088%	0.964%	0.092	—
S&P500	0.092%	1.197%	0.077	18.9%
コモディティ	0.088%	1.295%	0.068	37.6%
VR	0.087%	2.654%	0.033	0.0%
NY ダウ	0.087%	1.075%	0.081	43.5%
先進国株式	0.082%	1.118%	0.073	0.0%
米国リート	0.074%	1.343%	0.055	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。