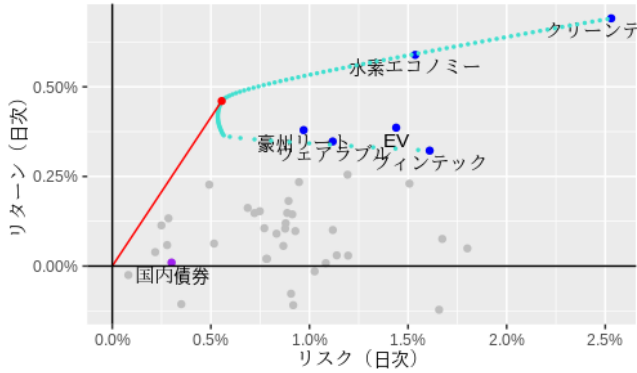


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

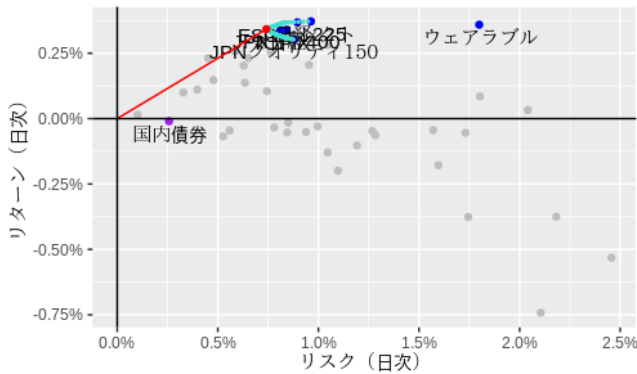
2024年2月3日

【半月】



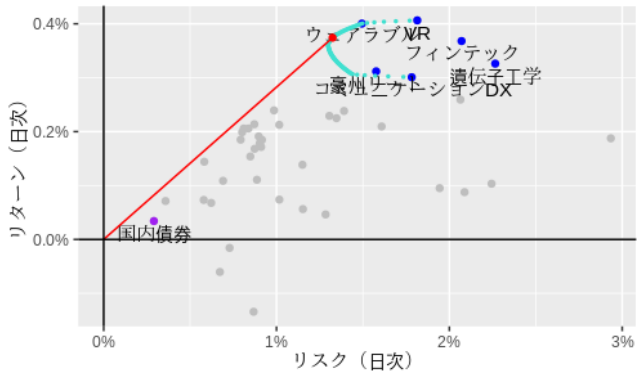
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.460%	0.555%	0.829	—
クリーンテック	0.691%	2.530%	0.273	0.0%
水素エコノミー	0.589%	1.536%	0.383	38.7%
EV	0.386%	1.440%	0.268	0.0%
豪州リート	0.379%	0.970%	0.391	61.3%
ウェアラブル	0.347%	1.118%	0.311	0.0%
フィンテック	0.322%	1.610%	0.200	0.0%

【一ヶ月】



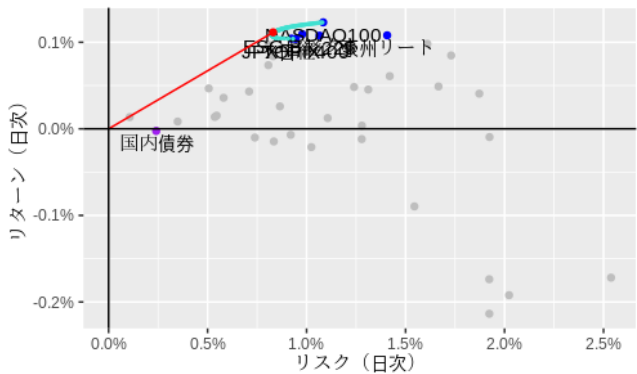
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.342%	0.741%	0.462	—
日経 225	0.372%	0.963%	0.386	0.0%
ESG セレクト	0.368%	0.896%	0.411	0.3%
ウェアラブル	0.359%	1.799%	0.200	18.0%
JPN 日経 400	0.340%	0.842%	0.403	0.0%
TOPIX	0.338%	0.811%	0.417	81.7%
JPN クオリティ 150	0.302%	0.880%	0.344	0.0%

【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	0.374%	1.324%	0.283	—
VR	0.406%	1.814%	0.224	0.0%
ウェアラブル	0.400%	1.494%	0.268	70.5%
フィンテック	0.368%	2.071%	0.178	0.0%
遺伝子工学	0.326%	2.265%	0.144	0.0%
豪州リート	0.312%	1.577%	0.198	29.5%
コミュニケーション DX	0.301%	1.782%	0.169	0.0%

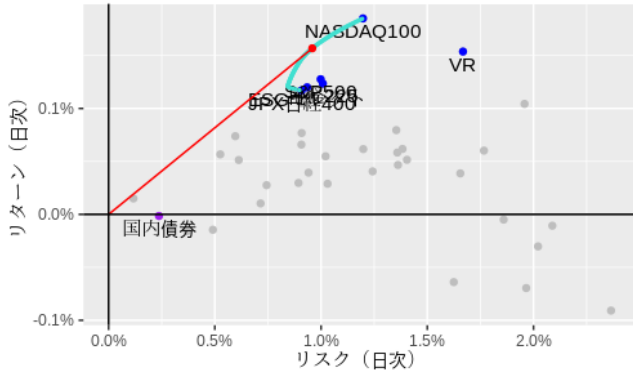
【半年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.111%	0.831%	0.134	—
NASDAQ100	0.123%	1.084%	0.113	35.4%
ESG セレクト	0.109%	0.978%	0.112	0.0%
豪州リート	0.108%	1.407%	0.077	16.0%
日経 225	0.108%	1.066%	0.101	0.0%
TOPIX	0.104%	0.923%	0.113	48.5%
JPN 日経 400	0.104%	0.945%	0.110	0.0%

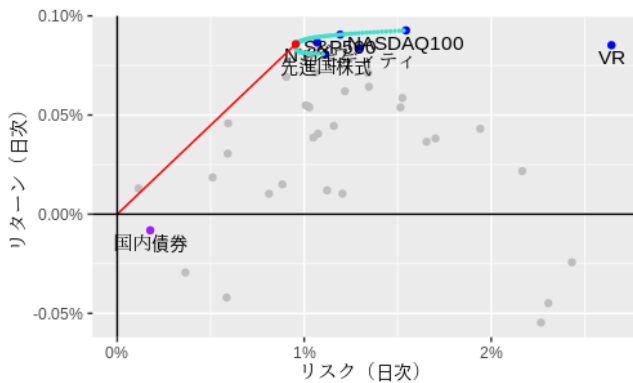
備考 グラフ中の赤点（・）は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.157%	0.959%	0.164	—
NASDAQ100	0.185%	1.197%	0.155	58.5%
VR	0.154%	1.668%	0.092	0.0%
S&P500	0.128%	0.998%	0.128	0.0%
日経 225	0.123%	1.008%	0.122	0.0%
ESG セレクト	0.120%	0.934%	0.128	0.0%
JPX 日経 400	0.117%	0.909%	0.129	41.5%

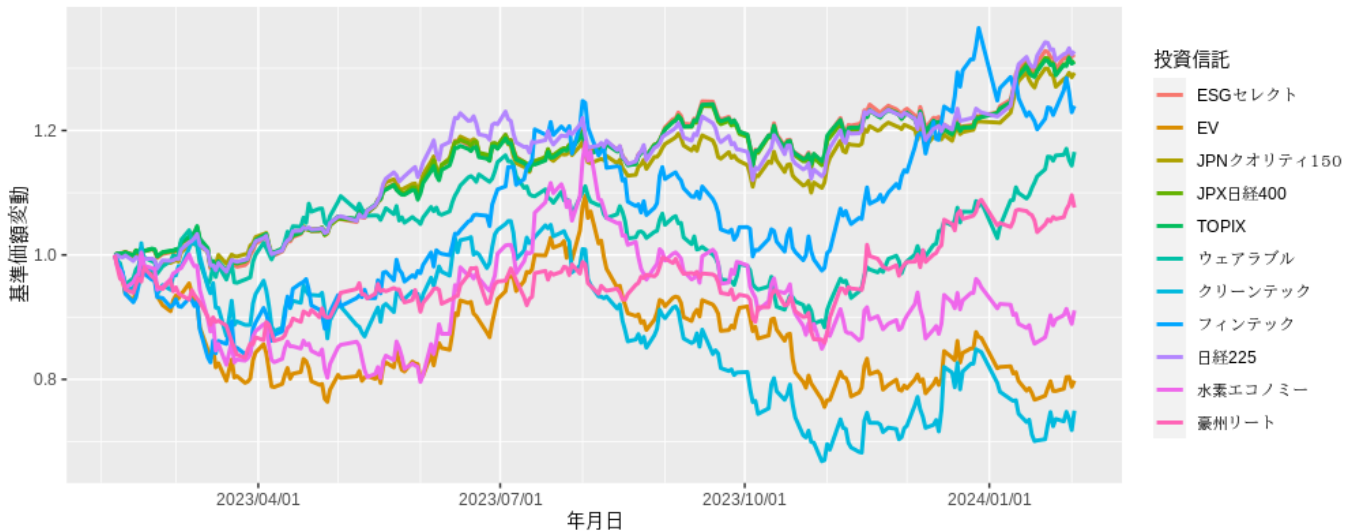
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.086%	0.955%	0.090	—
NASDAQ100	0.093%	1.544%	0.060	0.0%
S&P500	0.091%	1.193%	0.076	4.9%
NY ダウ	0.087%	1.070%	0.081	60.7%
VR	0.085%	2.643%	0.032	0.0%
コモディティ	0.084%	1.294%	0.065	34.4%
先進国株式	0.081%	1.114%	0.072	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。