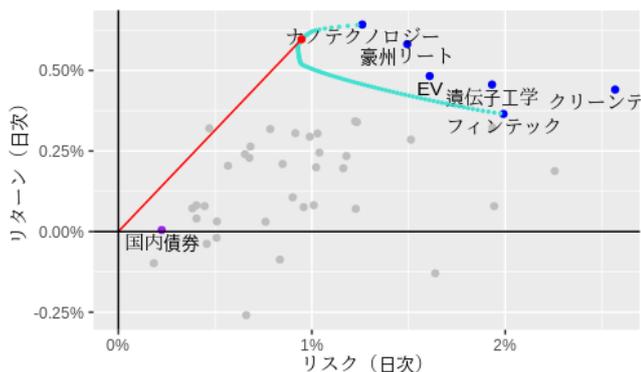


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

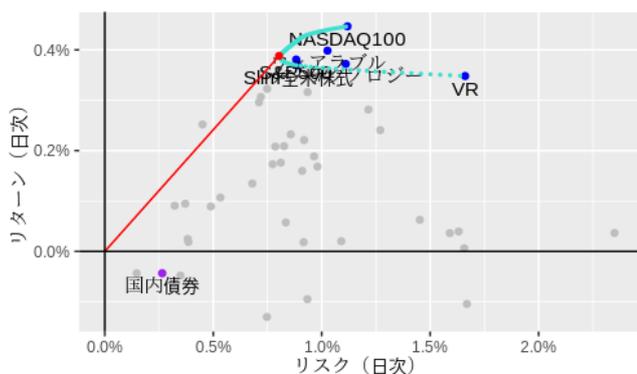
2024年2月10日

【半月】



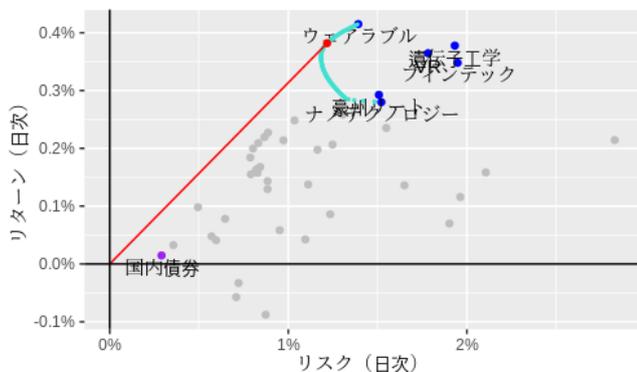
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.597%	0.947%	0.630	—
ナノテクノロジー	0.642%	1.261%	0.509	47.8%
豪州リート	0.582%	1.493%	0.390	40.9%
EV	0.483%	1.609%	0.300	0.0%
遺伝子工学	0.456%	1.932%	0.236	11.3%
クリーンテック	0.441%	2.568%	0.172	0.0%
フィンテック	0.365%	1.991%	0.183	0.0%

【一ヶ月】



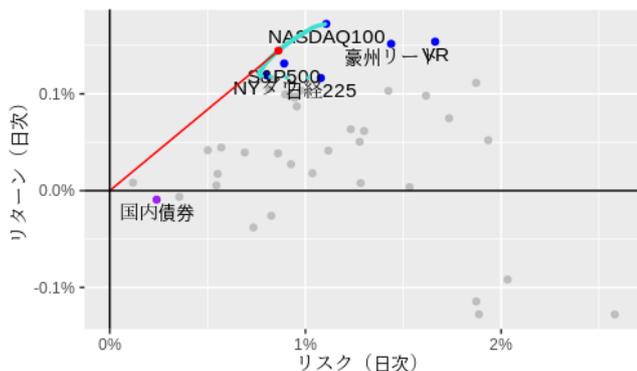
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.388%	0.804%	0.483	—
NASDAQ100	0.447%	1.119%	0.399	0.3%
ウェアラブル	0.398%	1.027%	0.388	39.8%
S&P500	0.381%	0.882%	0.432	59.8%
ナノテクノロジー	0.372%	1.111%	0.335	0.0%
Slim 全米株式	0.369%	0.891%	0.415	0.0%
VR	0.348%	1.661%	0.210	0.0%

【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	0.382%	1.217%	0.314	—
ウェアラブル	0.415%	1.392%	0.298	73.0%
遺伝子工学	0.378%	1.933%	0.195	0.0%
VR	0.365%	1.783%	0.204	0.0%
フィンテック	0.348%	1.948%	0.179	0.0%
豪州リート	0.293%	1.508%	0.194	27.0%
ナノテクノロジー	0.280%	1.521%	0.184	0.0%

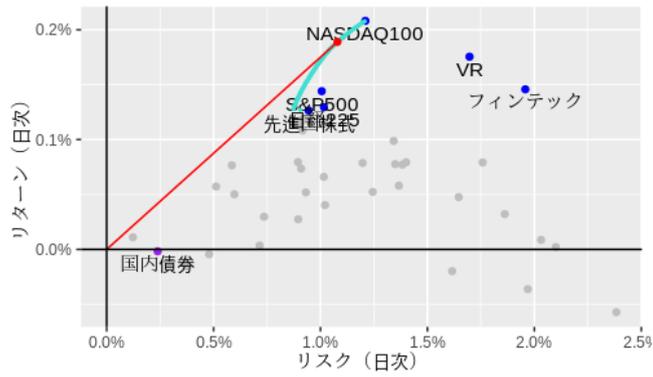
【半年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.145%	0.862%	0.168	—
NASDAQ100	0.172%	1.107%	0.156	39.0%
VR	0.154%	1.663%	0.093	0.0%
豪州リート	0.152%	1.438%	0.105	14.9%
S&P500	0.131%	0.891%	0.147	0.0%
NY ダウ	0.119%	0.801%	0.149	41.4%
日経 225	0.116%	1.079%	0.108	4.8%

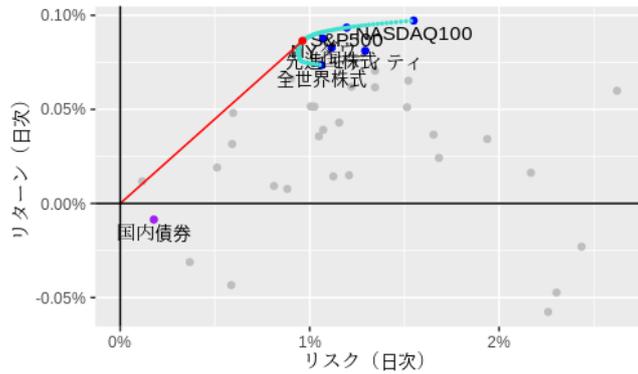
備考 グラフ中の赤点（・）は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.189%	1.079%	0.175	—
NASDAQ100	0.208%	1.210%	0.172	75.6%
VR	0.175%	1.697%	0.103	0.0%
フィンテック	0.146%	1.958%	0.074	0.0%
S&P500	0.144%	1.006%	0.143	0.0%
日経 225	0.129%	1.016%	0.127	24.4%
先進国株式	0.126%	0.945%	0.134	0.0%

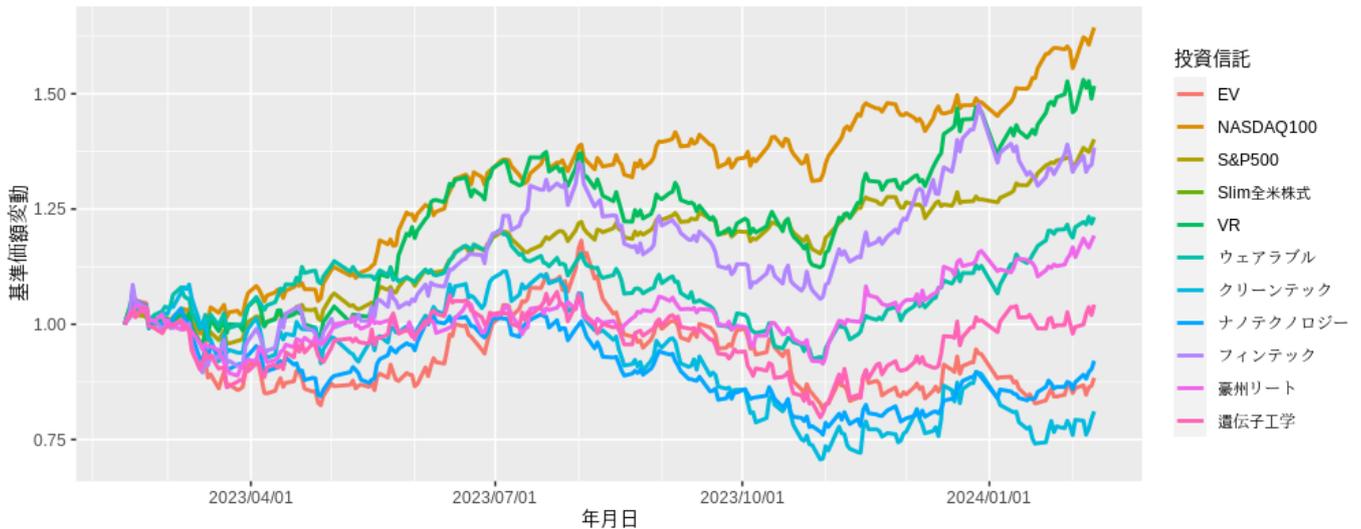
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.086%	0.962%	0.090	—
NASDAQ100	0.097%	1.549%	0.063	0.0%
S&P500	0.093%	1.196%	0.078	16.3%
NY ダウ	0.088%	1.071%	0.082	50.9%
先進国株式	0.083%	1.116%	0.074	0.0%
コモディティ	0.081%	1.293%	0.063	32.8%
全世界株式	0.074%	1.063%	0.069	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。