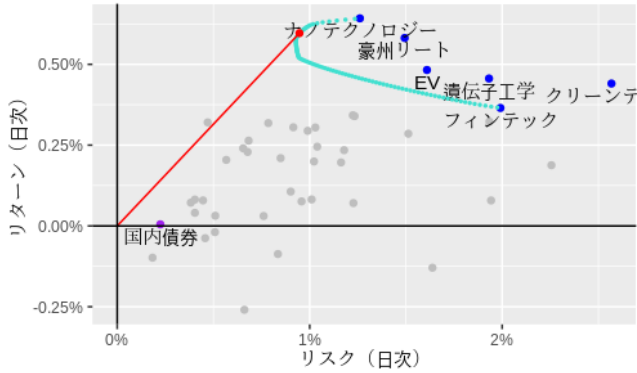


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

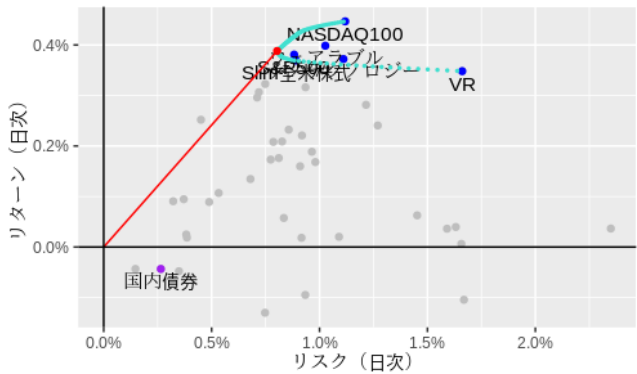
2024年2月10日

【半月】



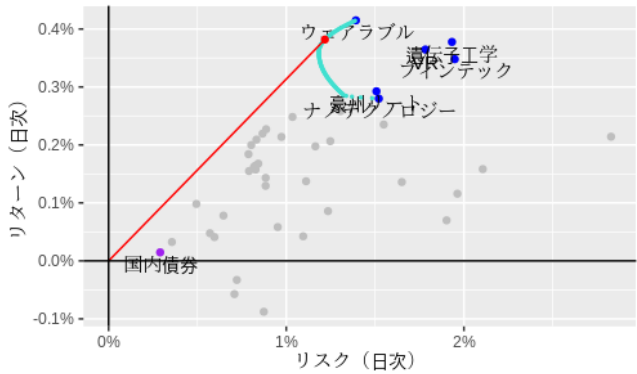
| eMAXIS | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.597% | 0.947% | 0.630 | — |
| ナノテクノロジー | 0.642% | 1.261% | 0.509 | 47.8% |
| 豪州リート | 0.582% | 1.493% | 0.390 | 40.9% |
| EV | 0.483% | 1.609% | 0.300 | 0.0% |
| 遺伝子工学 | 0.456% | 1.932% | 0.236 | 11.3% |
| 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】



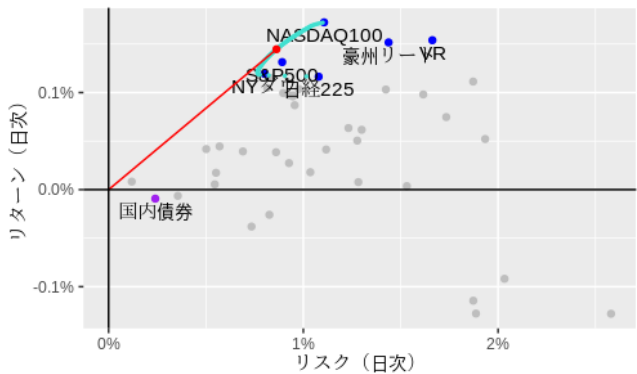
| eMAXIS | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.388% | 0.804% | 0.483 | — |
| NASDAQ100 | 0.447% | 1.119% | 0.399 | 0.3% |
| ウェアラブル | 0.398% | 1.027% | 0.388 | 39.8% |
| S&P500 | 0.381% | 0.882% | 0.432 | 59.8% |
| ナノテクノロジー | 0.372% | 1.111% | 0.335 | 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% |

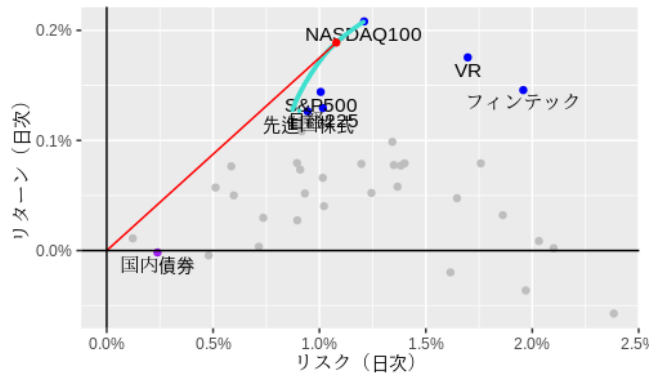
【半年】



| 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% |

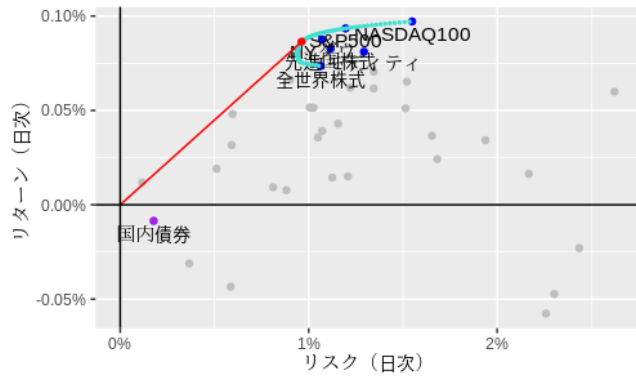
備考 グラフ中の赤点（・）は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

【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% |

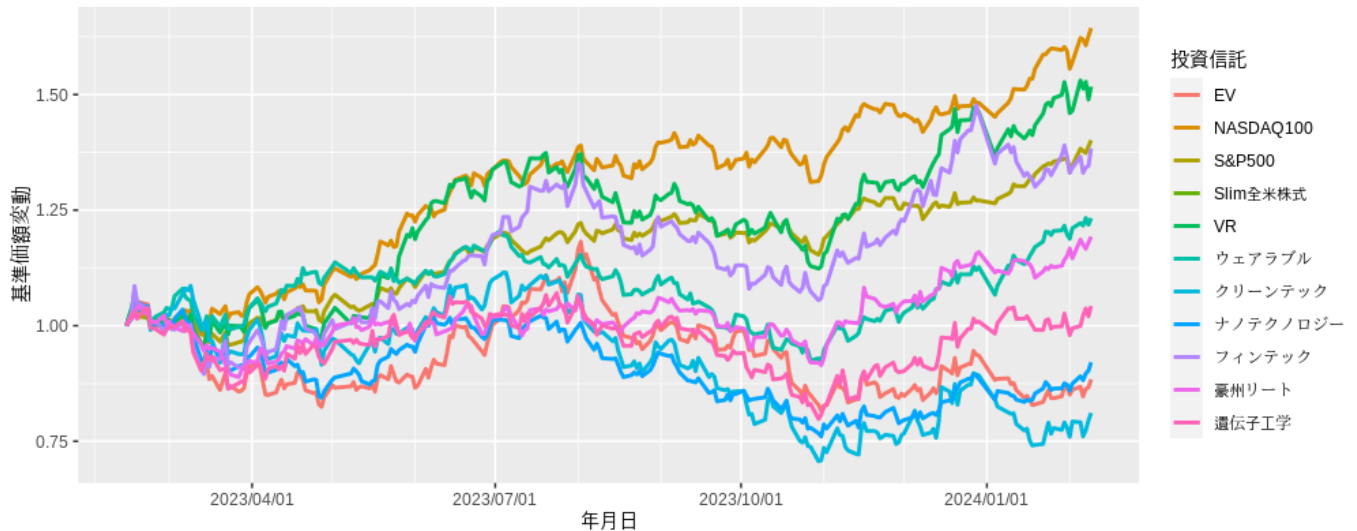
【三年】



| 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。