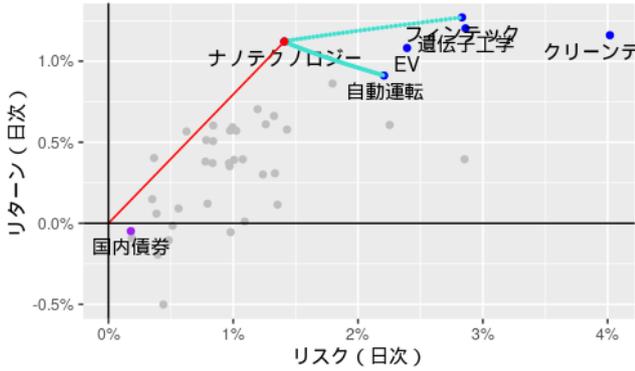


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

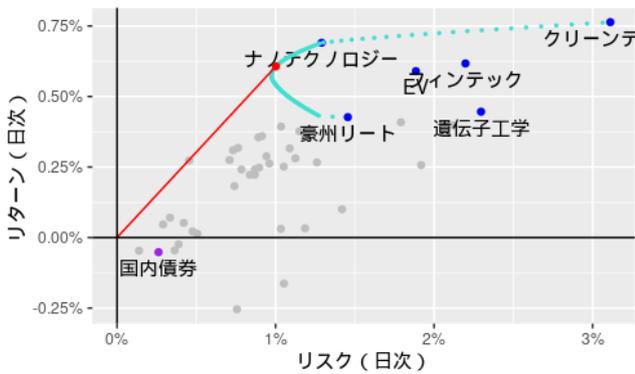
2024年2月17日

【半月】



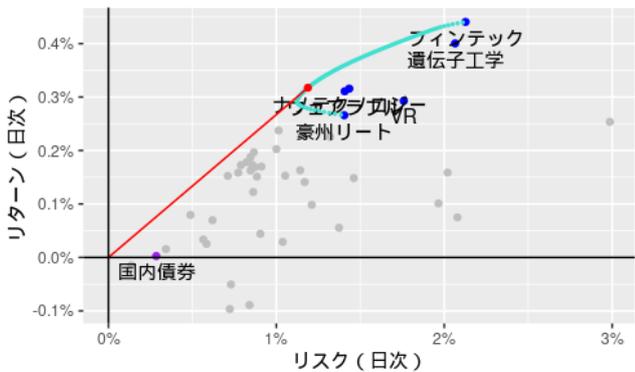
効率的ポートフォリオ	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	1.121%	1.410%	0.795	—
フィンテック	1.270%	2.833%	0.448	0.0%
遺伝子工学	1.203%	2.861%	0.420	0.0%
クリーンテック	1.160%	4.018%	0.289	0.0%
ナノテクノロジー	1.122%	1.410%	0.796	100.0%
EV	1.082%	2.393%	0.452	0.0%
自動運転	0.912%	2.209%	0.413	0.0%

【一ヶ月】



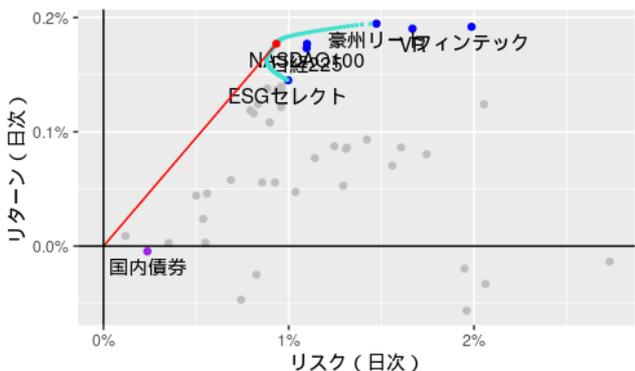
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.607%	1.002%	0.605	—
クリーンテック	0.763%	3.112%	0.245	0.0%
ナノテクノロジー	0.690%	1.291%	0.535	68.3%
フィンテック	0.617%	2.198%	0.281	0.0%
EV	0.590%	1.885%	0.313	0.0%
遺伝子工学	0.446%	2.296%	0.194	0.0%
豪州リート	0.427%	1.456%	0.293	31.7%

【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	0.317%	1.188%	0.267	—
フィンテック	0.441%	2.127%	0.207	9.3%
遺伝子工学	0.400%	2.065%	0.194	10.8%
ナノテクノロジー	0.316%	1.434%	0.220	9.0%
ウェアラブル	0.311%	1.407%	0.221	36.6%
VR	0.293%	1.759%	0.166	0.0%
豪州リート	0.266%	1.405%	0.189	34.4%

【半年】

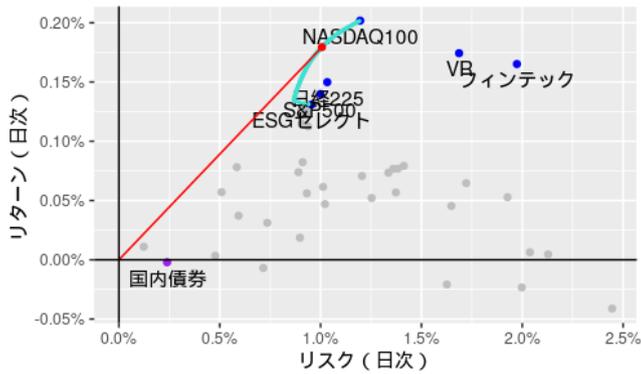


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.177%	0.933%	0.190	—
豪州リート	0.195%	1.473%	0.132	24.9%
フィンテック	0.192%	1.987%	0.097	0.0%
VR	0.190%	1.668%	0.114	0.0%
NASDAQ100	0.177%	1.099%	0.161	35.4%
日経225	0.173%	1.097%	0.158	29.7%
ESGセレクト	0.145%	0.997%	0.146	10.0%

備考 (1) 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。

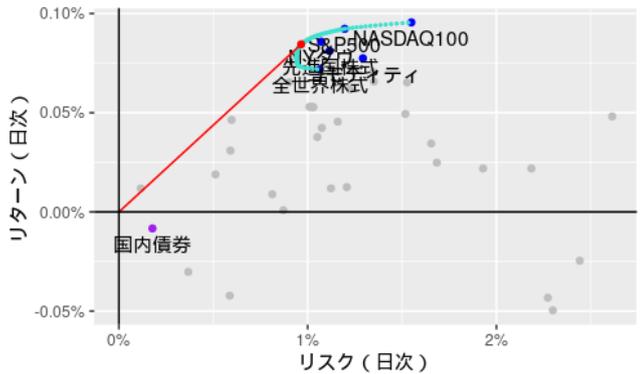
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.179%	1.007%	0.178	—
NASDAQ100	0.202%	1.196%	0.169	60.1%
VR	0.174%	1.687%	0.103	0.0%
フィンテック	0.165%	1.974%	0.084	0.0%
日経 225	0.150%	1.033%	0.145	31.2%
S&P500	0.140%	0.999%	0.140	0.0%
ESG セレクト	0.131%	0.955%	0.137	8.6%

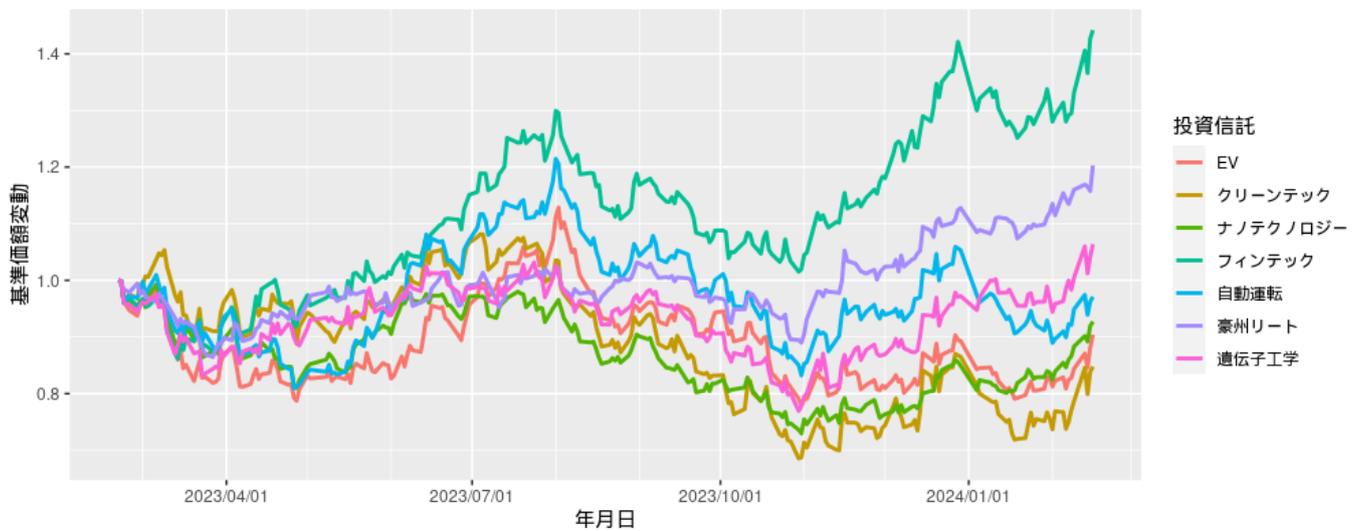
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.084%	0.965%	0.088	—
NASDAQ100	0.096%	1.549%	0.062	0.0%
S&P500	0.092%	1.196%	0.077	20.9%
NY ダウ	0.086%	1.071%	0.080	47.2%
先進国株式	0.081%	1.116%	0.073	0.0%
コモディティ	0.077%	1.293%	0.060	31.9%
全世界株式	0.072%	1.063%	0.068	0.0%

備考 (1) 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。
 (2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

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の銘柄について一年前を1として直近一年間の価額変動を示す。