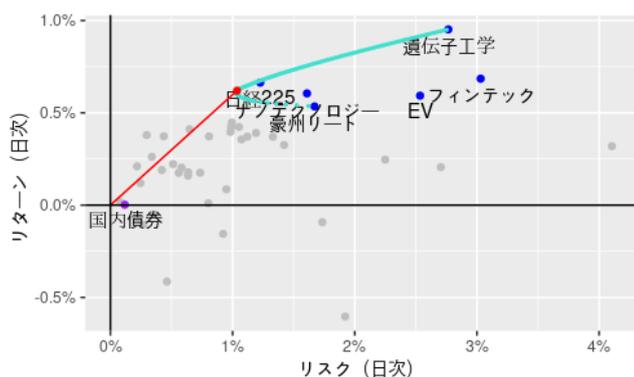


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

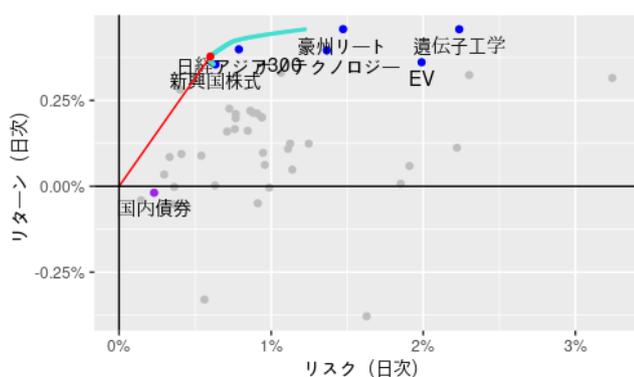
2024年2月23日

【半月】



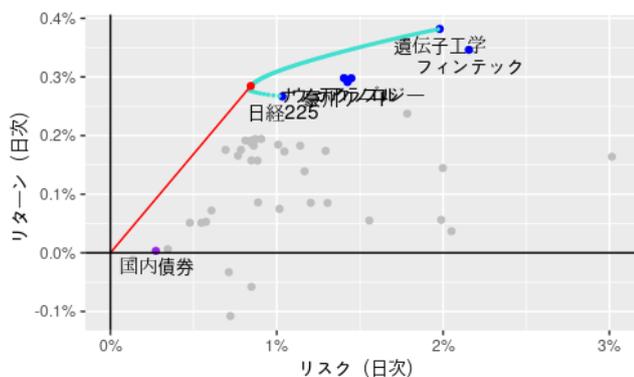
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.620%	1.036%	0.598	—
遺伝子工学	0.952%	2.766%	0.344	0.0%
フィンテック	0.685%	3.030%	0.226	0.0%
日経 225	0.664%	1.226%	0.541	57.5%
ナノテクノロジー	0.605%	1.609%	0.376	16.0%
EV	0.593%	2.535%	0.234	0.0%
豪州リート	0.534%	1.671%	0.320	26.5%

【一ヶ月】



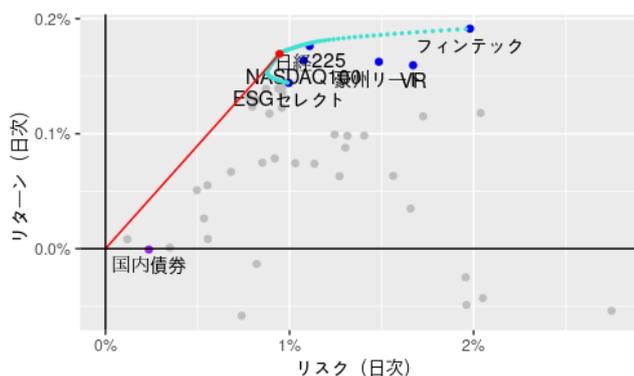
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.378%	0.600%	0.630	—
豪州リート	0.458%	1.473%	0.311	14.3%
遺伝子工学	0.457%	2.236%	0.205	7.5%
日経アジア 300	0.399%	0.788%	0.506	0.0%
ナノテクノロジー	0.396%	1.366%	0.290	1.9%
EV	0.361%	1.989%	0.182	0.0%
新興国株式	0.355%	0.634%	0.560	76.4%

【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	0.285%	0.844%	0.337	—
遺伝子工学	0.382%	1.980%	0.193	4.8%
フィンテック	0.346%	2.155%	0.161	0.0%
ウェアラブル	0.298%	1.404%	0.212	20.7%
ナノテクノロジー	0.298%	1.448%	0.206	0.0%
豪州リート	0.291%	1.425%	0.204	23.8%
日経 225	0.267%	1.034%	0.258	50.7%

【半年】

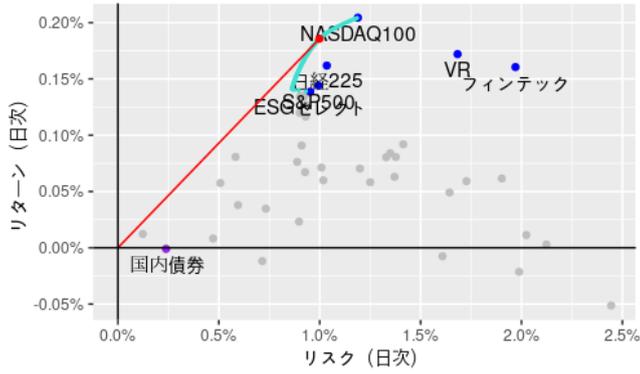


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.169%	0.945%	0.179	—
フィンテック	0.191%	1.980%	0.097	0.0%
日経 225	0.176%	1.109%	0.159	47.4%
NASDAQ100	0.164%	1.077%	0.152	34.6%
豪州リート	0.163%	1.485%	0.109	17.7%
VR	0.160%	1.671%	0.095	0.0%
ESGセレクト	0.144%	0.996%	0.145	0.3%

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。

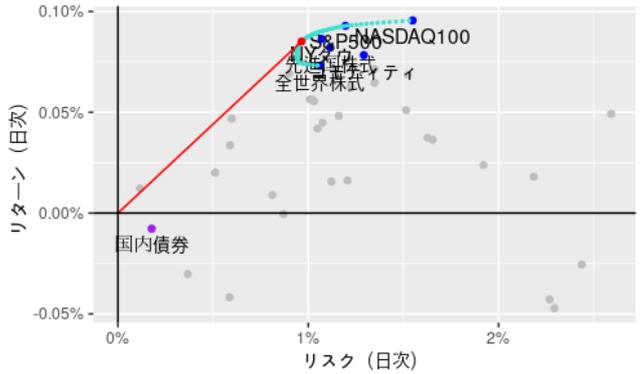
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.186%	0.999%	0.186	—
NASDAQ100	0.204%	1.189%	0.172	55.9%
VR	0.172%	1.683%	0.102	0.0%
日経 225	0.162%	1.035%	0.156	44.1%
フィンテック	0.161%	1.970%	0.081	0.0%
S&P500	0.144%	0.994%	0.145	0.0%
ESG セレクト	0.139%	0.953%	0.145	0.0%

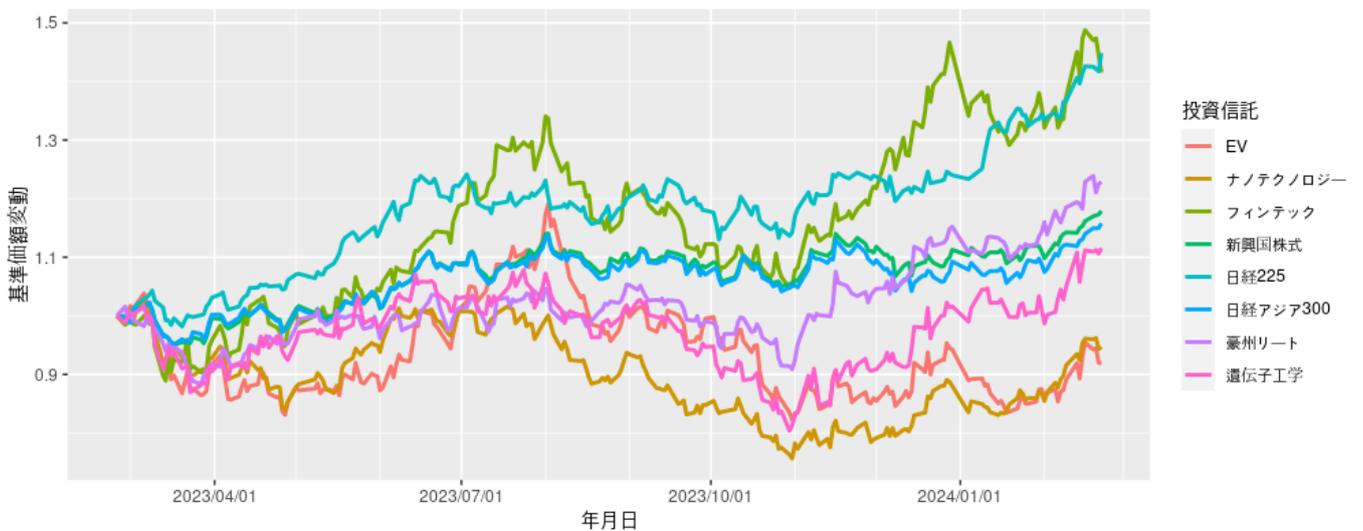
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.085%	0.965%	0.088	—
NASDAQ100	0.096%	1.548%	0.062	0.0%
S&P500	0.093%	1.195%	0.078	20.5%
NY ダウ	0.086%	1.071%	0.081	47.4%
先進国株式	0.082%	1.115%	0.074	0.0%
コモディティ	0.078%	1.292%	0.061	32.1%
全世界株式	0.073%	1.062%	0.069	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。