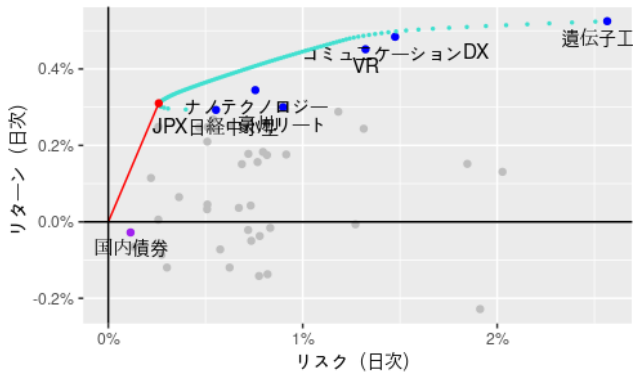


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

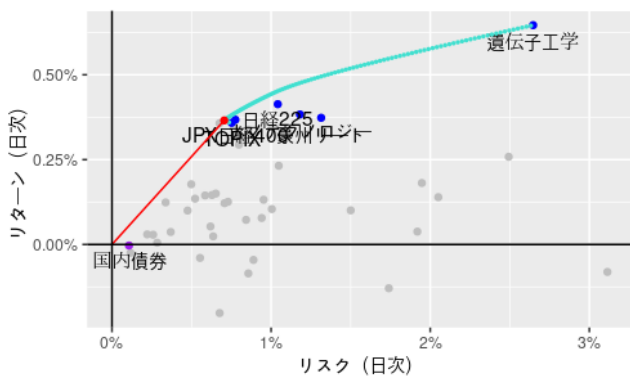
2024年3月9日

【半月】



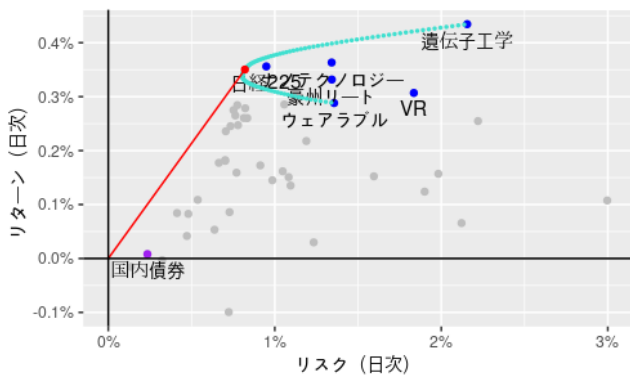
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.310%	0.260%	1.195	—
遺伝子工学	0.525%	2.566%	0.205	3.3%
コミュニケーション DX	0.484%	1.475%	0.328	0.0%
VR	0.452%	1.323%	0.341	0.0%
ナノテクノロジー	0.345%	0.756%	0.456	14.8%
豪州リート	0.300%	0.899%	0.334	28.1%
JPX 日経中小型	0.293%	0.554%	0.529	53.7%

【一ヶ月】



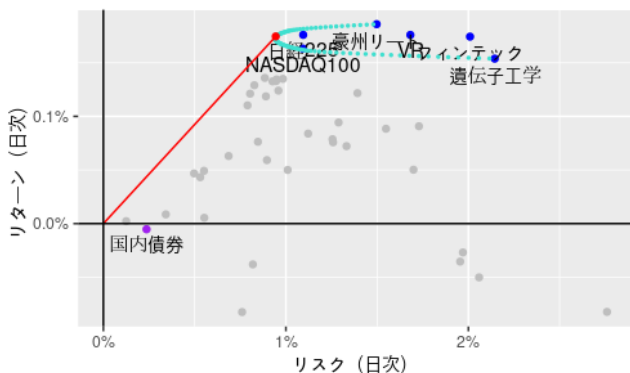
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.366%	0.705%	0.518	—
遺伝子工学	0.646%	2.647%	0.244	0.0%
日経 225	0.413%	1.042%	0.397	0.0%
ナノテクノロジー	0.383%	1.181%	0.324	21.0%
豪州リート	0.373%	1.315%	0.284	13.4%
JPX 日経 400	0.368%	0.775%	0.474	0.0%
TOPIX	0.358%	0.753%	0.476	65.7%

【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	0.350%	0.821%	0.427	—
遺伝子工学	0.434%	2.156%	0.201	2.9%
ナノテクノロジー	0.363%	1.342%	0.271	12.2%
日経 225	0.356%	0.949%	0.375	60.4%
豪州リート	0.332%	1.342%	0.247	17.8%
VR	0.307%	1.835%	0.167	0.0%
ウェアラブル	0.288%	1.356%	0.212	6.7%

【半年】

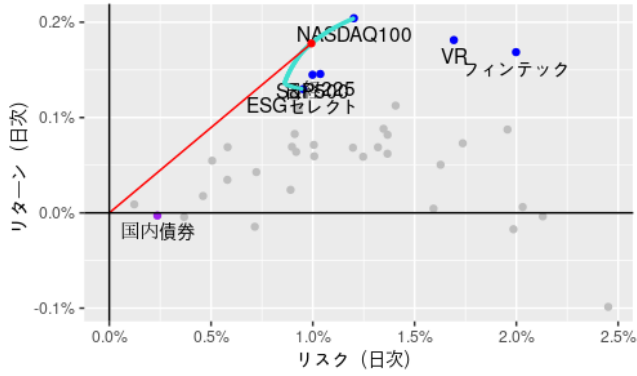


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.175%	0.944%	0.185	—
豪州リート	0.186%	1.497%	0.124	22.6%
日経 225	0.176%	1.095%	0.161	48.4%
VR	0.176%	1.682%	0.105	0.0%
フィンテック	0.174%	2.009%	0.087	0.0%
NASDAQ100	0.163%	1.093%	0.149	29.1%
遺伝子工学	0.154%	2.144%	0.072	0.0%

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。

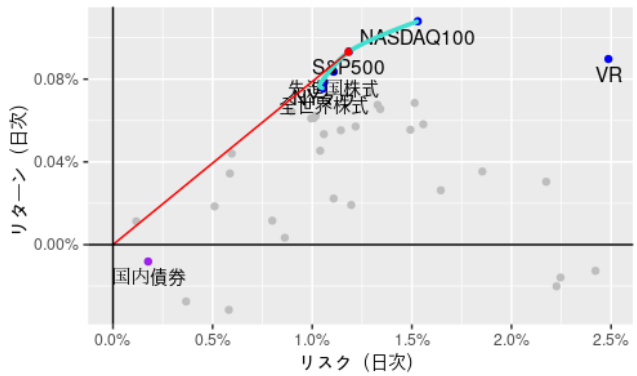
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.178%	0.993%	0.179	—
NASDAQ100	0.204%	1.202%	0.170	61.8%
VR	0.181%	1.693%	0.107	0.0%
フィンテック	0.169%	1.999%	0.084	0.0%
日経 225	0.146%	1.037%	0.141	12.6%
S&P500	0.145%	0.999%	0.145	0.0%
ESG セレクト	0.130%	0.953%	0.136	25.6%

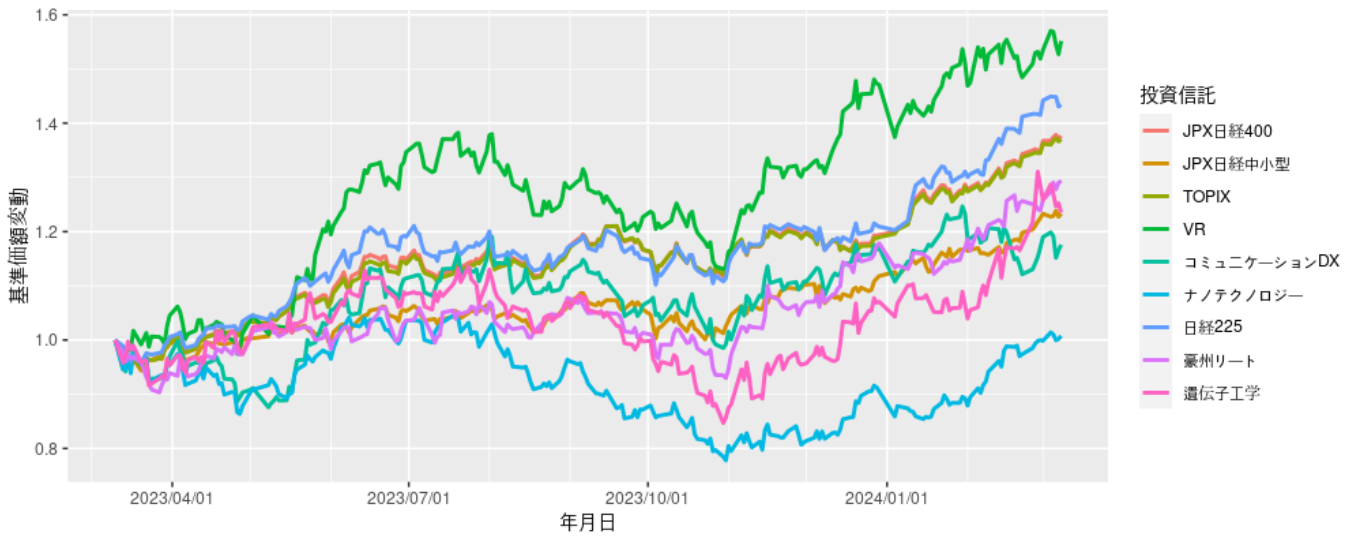
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.093%	1.182%	0.079	—
NASDAQ100	0.108%	1.530%	0.071	0.0%
S&P500	0.093%	1.185%	0.079	98.4%
VR	0.090%	2.487%	0.036	0.0%
先進国株式	0.084%	1.108%	0.075	0.0%
NY ダウ	0.079%	1.060%	0.074	1.6%
全世界株式	0.075%	1.055%	0.072	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。