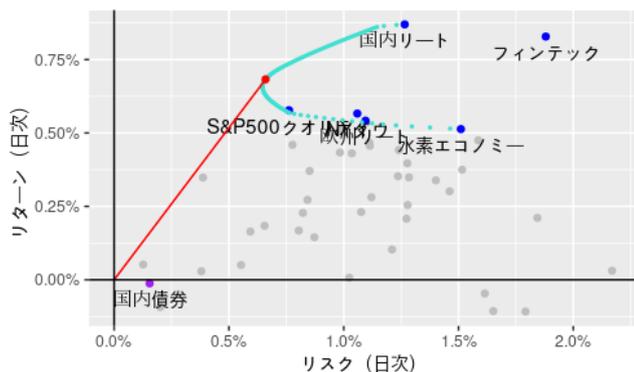


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

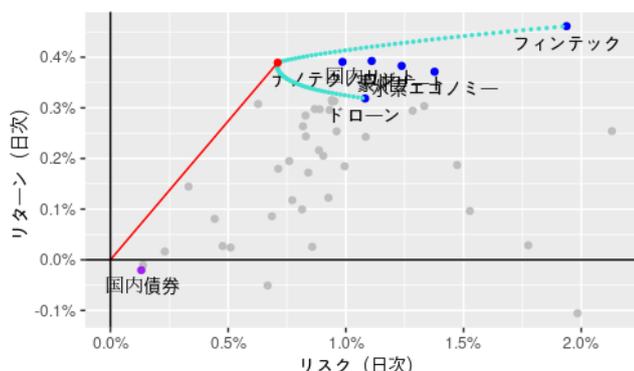
2024年3月23日

【半月】



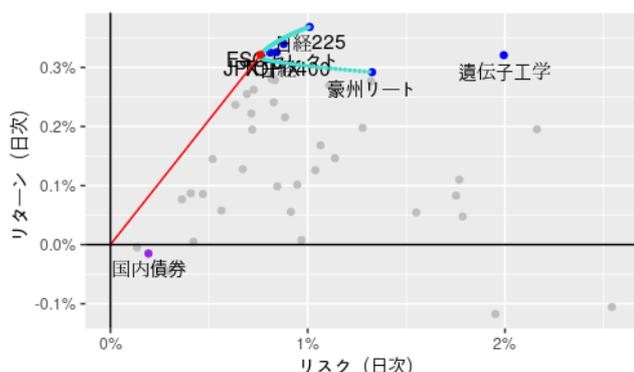
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.683%	0.659%	1.035	—
国内リート	0.870%	1.265%	0.687	36.0%
フィンテック	0.828%	1.880%	0.441	0.0%
S&P500 クオリティ	0.577%	0.762%	0.758	64.0%
NY ダウ	0.566%	1.059%	0.535	0.0%
欧州リート	0.542%	1.095%	0.495	0.0%
水素エコノミー	0.513%	1.510%	0.340	0.0%

【一ヶ月】



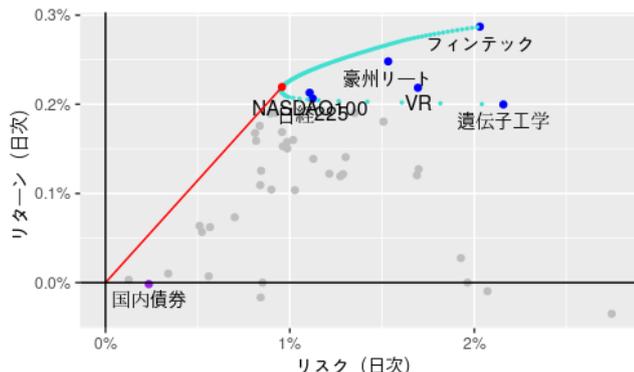
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.389%	0.711%	0.548	—
フィンテック	0.461%	1.938%	0.238	0.0%
国内リート	0.393%	1.110%	0.354	43.9%
ナノテクノロジー	0.391%	0.986%	0.396	32.4%
豪州リート	0.383%	1.237%	0.309	23.0%
水素エコノミー	0.371%	1.377%	0.270	0.0%
ドローン	0.319%	1.082%	0.295	0.7%

【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	0.322%	0.761%	0.423	—
日経 225	0.369%	1.010%	0.365	3.8%
ESG セレクト	0.340%	0.878%	0.387	0.0%
JPX 日経 400	0.326%	0.843%	0.387	0.0%
TOPIX	0.325%	0.810%	0.401	75.3%
遺伝子工学	0.321%	1.994%	0.161	5.7%
豪州リート	0.292%	1.326%	0.220	15.2%

【半年】

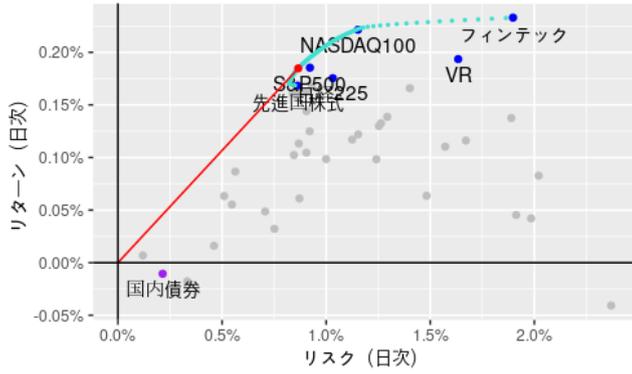


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.219%	0.957%	0.229	—
フィンテック	0.287%	2.030%	0.141	0.0%
豪州リート	0.248%	1.533%	0.162	25.0%
VR	0.219%	1.694%	0.129	0.0%
NASDAQ100	0.213%	1.107%	0.192	39.6%
日経 225	0.206%	1.124%	0.184	35.4%
遺伝子工学	0.200%	2.158%	0.093	0.0%

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。

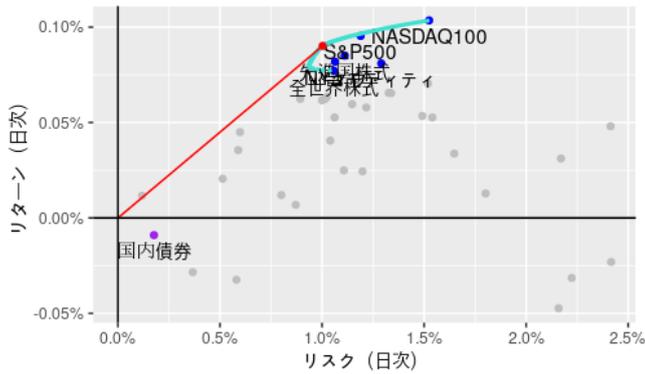
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.185%	0.866%	0.213	—
フィンテック	0.233%	1.897%	0.123	0.0%
NASDAQ100	0.221%	1.153%	0.192	7.4%
VR	0.194%	1.634%	0.118	0.0%
S&P500	0.185%	0.922%	0.201	59.7%
日経 225	0.175%	1.032%	0.170	32.9%
先進国株式	0.168%	0.862%	0.195	0.0%

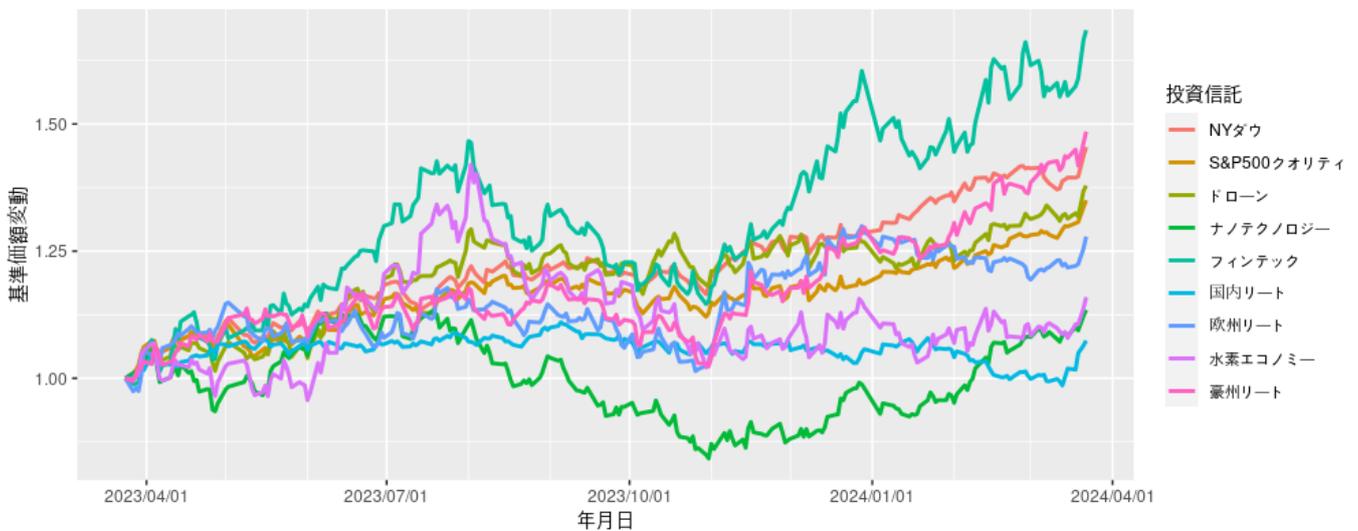
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.090%	1.003%	0.090	—
NASDAQ100	0.103%	1.525%	0.068	0.0%
S&P500	0.095%	1.189%	0.080	64.0%
先進国株式	0.085%	1.111%	0.077	0.0%
NY ダウ	0.082%	1.064%	0.077	0.0%
コモディティ	0.081%	1.290%	0.063	36.0%
全世界株式	0.077%	1.058%	0.073	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。