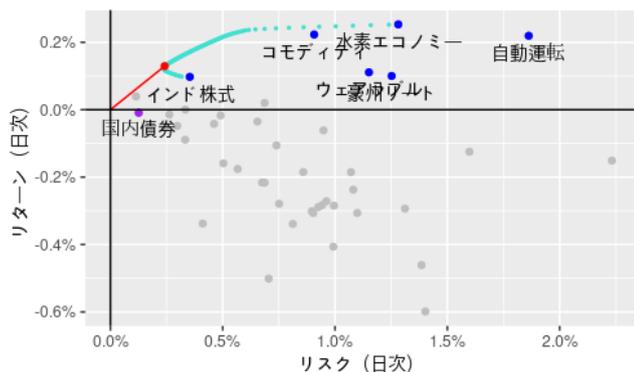


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

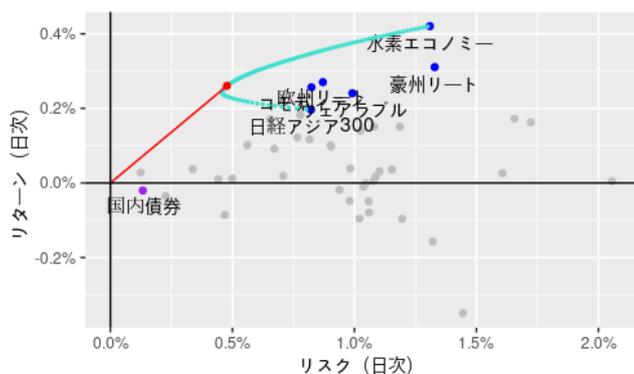
2024年4月6日

【半月】



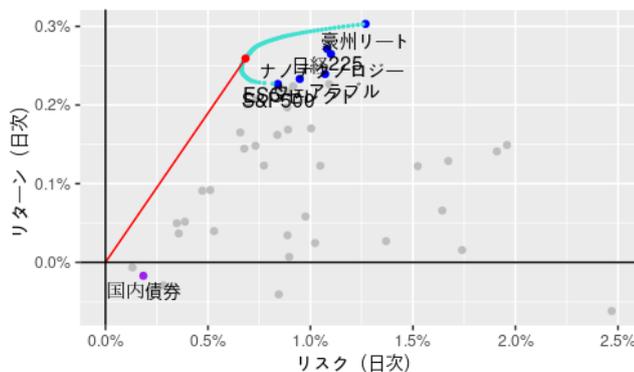
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.129%	0.241%	0.535	—
水素エコノミー	0.253%	1.282%	0.197	0.0%
コモディティ	0.223%	0.907%	0.246	24.4%
自動運転	0.219%	1.862%	0.118	0.0%
ウェアラブル	0.111%	1.151%	0.096	7.9%
豪州リート	0.100%	1.252%	0.080	7.2%
インド株式	0.097%	0.353%	0.275	60.5%

【一ヶ月】



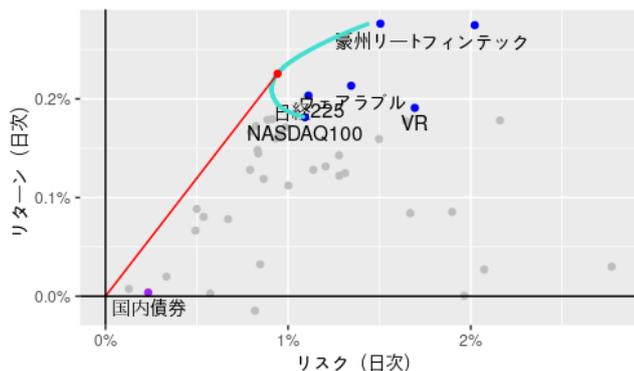
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.260%	0.477%	0.545	—
水素エコノミー	0.421%	1.309%	0.321	9.0%
豪州リート	0.311%	1.329%	0.234	0.0%
欧州リート	0.270%	0.871%	0.311	24.8%
コモディティ	0.257%	0.824%	0.312	36.3%
ウェアラブル	0.241%	0.992%	0.243	8.3%
日経アジア 300	0.197%	0.822%	0.239	21.6%

【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	0.259%	0.683%	0.379	—
豪州リート	0.303%	1.269%	0.239	25.8%
日経 225	0.271%	1.082%	0.251	9.0%
ナノテクノロジー	0.265%	1.100%	0.241	12.4%
ウェアラブル	0.239%	1.072%	0.223	23.0%
ESG セレクト	0.233%	0.948%	0.246	17.7%
S&P500	0.227%	0.841%	0.270	12.1%

【半年】

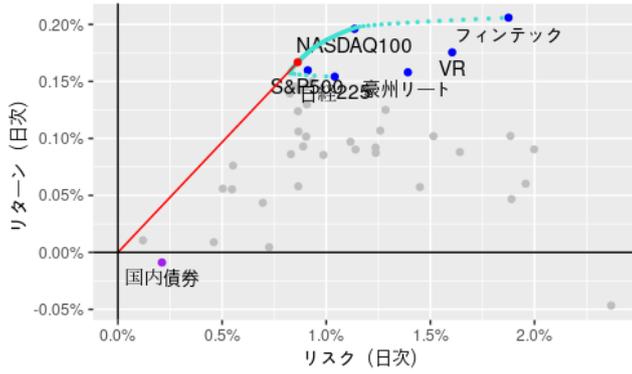


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.225%	0.942%	0.239	—
豪州リート	0.276%	1.505%	0.184	29.8%
フィンテック	0.275%	2.022%	0.136	0.0%
ウェアラブル	0.213%	1.345%	0.159	20.5%
日経 225	0.203%	1.111%	0.183	42.3%
VR	0.191%	1.693%	0.113	0.0%
NASDAQ100	0.181%	1.093%	0.166	7.4%

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。

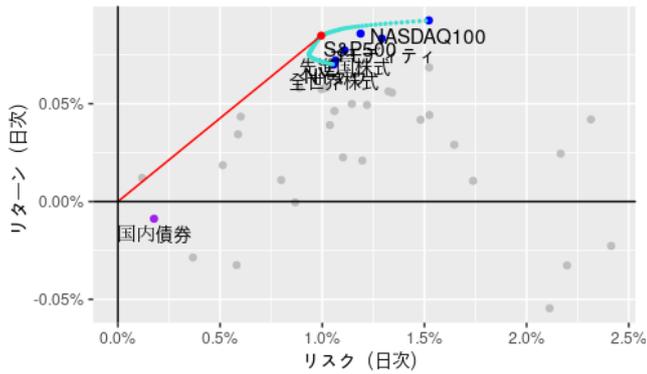
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.167%	0.863%	0.193	—
フィンテック	0.206%	1.875%	0.110	0.0%
NASDAQ100	0.196%	1.136%	0.173	24.7%
VR	0.175%	1.605%	0.109	0.0%
S&P500	0.160%	0.912%	0.175	30.1%
豪州リート	0.158%	1.392%	0.113	17.2%
日経 225	0.154%	1.041%	0.148	28.0%

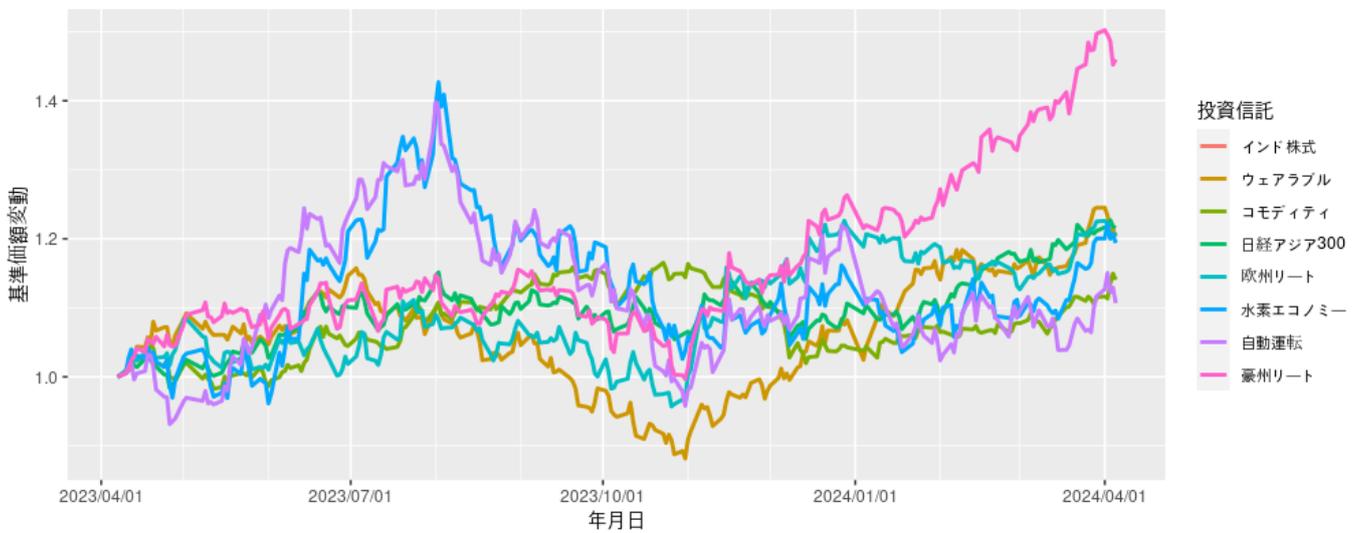
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.085%	0.995%	0.085	—
NASDAQ100	0.093%	1.522%	0.061	0.3%
S&P500	0.086%	1.188%	0.072	57.9%
コモディティ	0.083%	1.291%	0.065	41.8%
先進国株式	0.077%	1.110%	0.070	0.0%
NYダウ	0.072%	1.065%	0.068	0.0%
全世界株式	0.070%	1.056%	0.066	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。