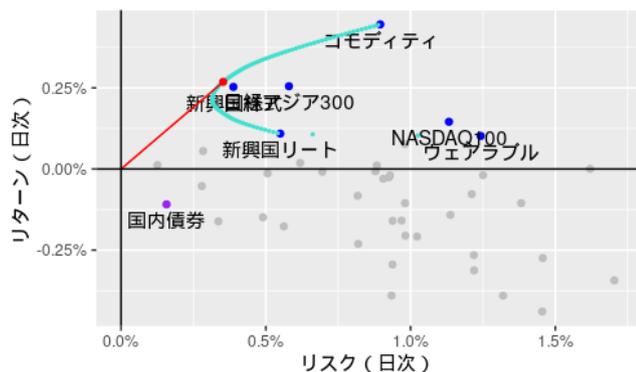


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

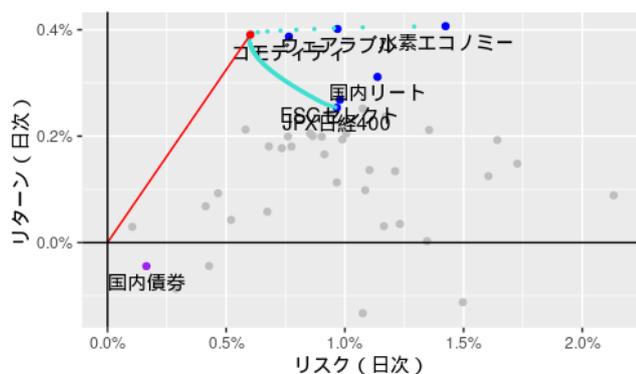
2024年4月13日

【半月】



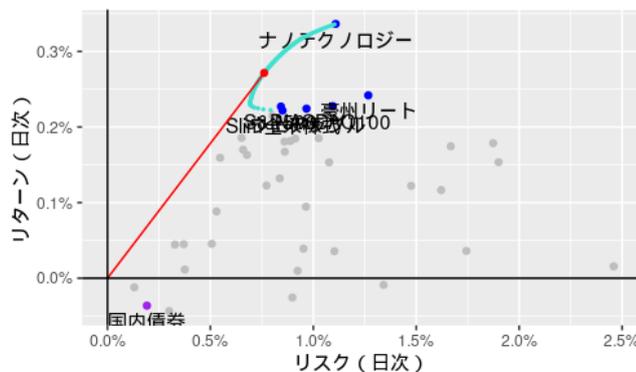
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.269%	0.353%	0.762	—
コモディティ	0.446%	0.895%	0.498	18.1%
日経アジア 300	0.255%	0.580%	0.440	0.0%
新興国株式	0.253%	0.388%	0.652	67.7%
NASDAQ100	0.146%	1.133%	0.129	2.9%
新興国リート	0.109%	0.550%	0.198	11.3%
ウェアラブル	0.102%	1.242%	0.082	0.0%

【一ヶ月】



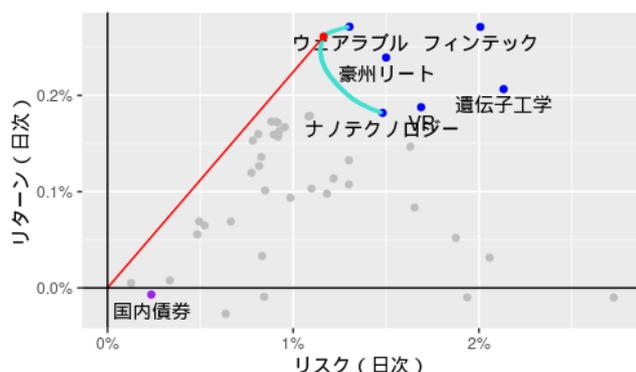
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.391%	0.602%	0.649	—
水素エコノミー	0.407%	1.424%	0.286	2.2%
ウェアラブル	0.401%	0.969%	0.414	35.9%
コモディティ	0.387%	0.764%	0.506	59.2%
国内リート	0.311%	1.137%	0.274	2.6%
ESG セレクト	0.268%	0.979%	0.274	0.0%
JPX 日経 400	0.254%	0.966%	0.262	0.0%

【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	0.272%	0.761%	0.357	—
ナノテクノロジー	0.336%	1.109%	0.303	37.6%
豪州リート	0.242%	1.267%	0.191	26.6%
NASDAQ100	0.228%	1.094%	0.208	0.0%
S&P500	0.227%	0.843%	0.270	15.7%
ウェアラブル	0.224%	0.967%	0.232	20.0%
Slim 全米株式	0.222%	0.850%	0.261	0.0%

【半年】

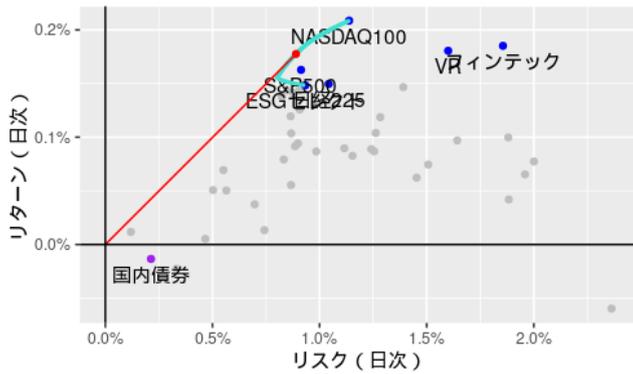


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.261%	1.164%	0.224	—
ウェアラブル	0.271%	1.303%	0.208	67.9%
フィンテック	0.271%	2.008%	0.135	0.0%
豪州リート	0.239%	1.500%	0.160	32.1%
遺伝子工学	0.207%	2.133%	0.097	0.0%
VR	0.188%	1.689%	0.111	0.0%
ナノテクノロジー	0.182%	1.482%	0.123	0.0%

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。

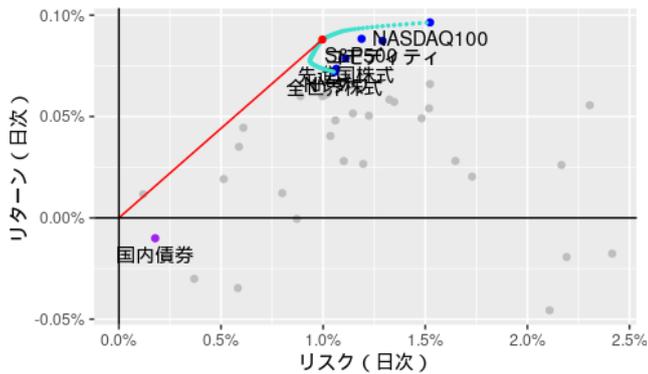
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



効率的ポートフォリオ	0.178%	0.890%	0.200	—
NASDAQ100	0.209%	1.138%	0.183	45.6%
フィンテック	0.185%	1.856%	0.100	0.0%
VR	0.181%	1.600%	0.113	0.0%
S&P500	0.163%	0.914%	0.178	12.1%
日経 225	0.150%	1.043%	0.144	0.0%
ESG セレクト	0.148%	0.933%	0.159	42.3%

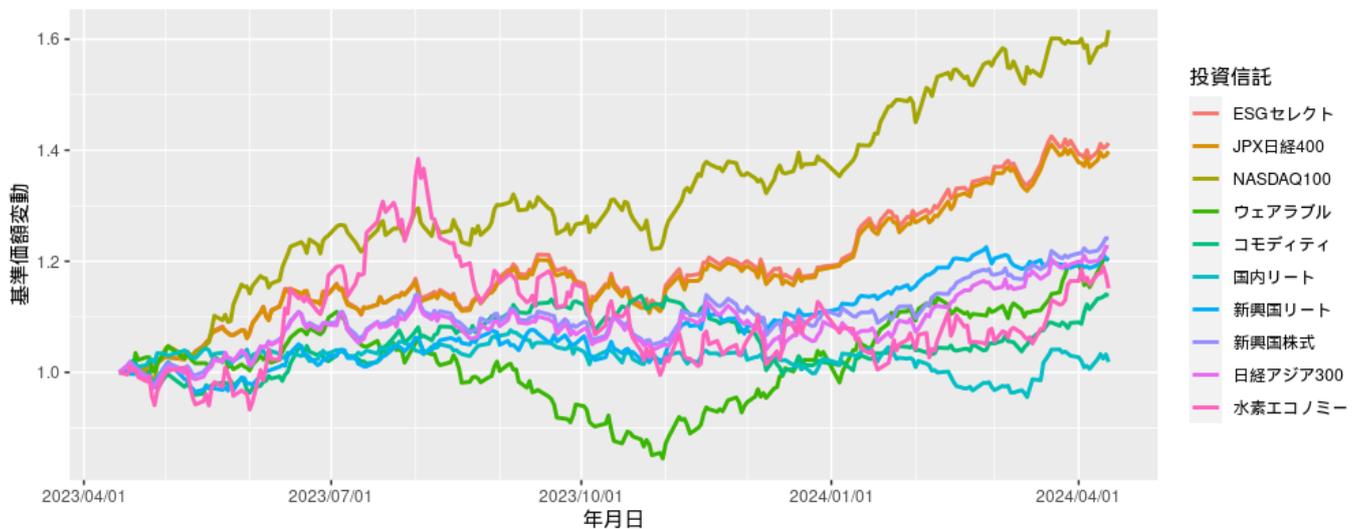
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.088%	0.996%	0.088	—
NASDAQ100	0.096%	1.523%	0.063	1.2%
S&P500	0.088%	1.188%	0.074	55.1%
コモディティ	0.087%	1.291%	0.068	43.6%
先進国株式	0.079%	1.110%	0.071	0.0%
NY ダウ	0.074%	1.065%	0.069	0.0%
全世界株式	0.072%	1.057%	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。