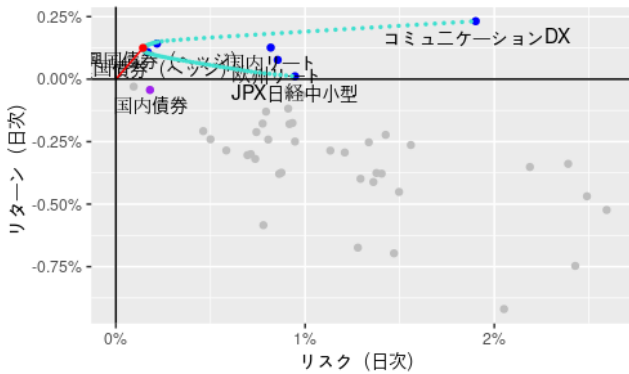


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

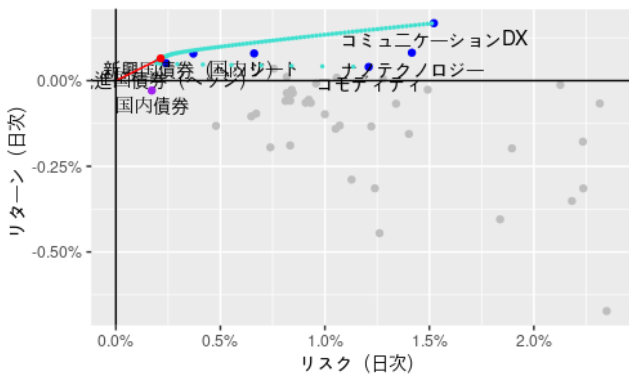
2025年2月8日

【半月】



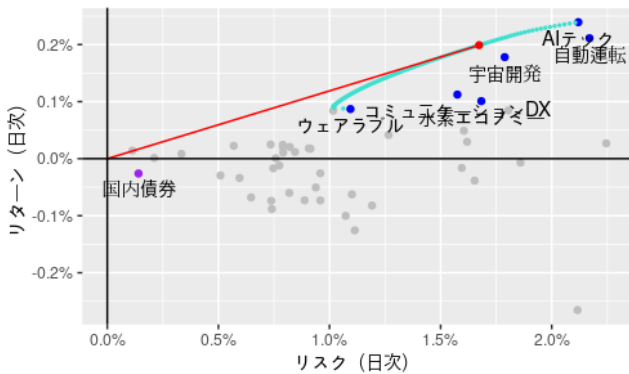
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.125%	0.143%	0.872	—
コミュニケーションDX	0.232%	1.902%	0.122	3.8%
新興国債券 (ヘッジ)	0.142%	0.217%	0.655	34.9%
国内リート	0.126%	0.818%	0.154	0.0%
先進国債券 (ヘッジ)	0.108%	0.168%	0.646	61.3%
欧州リート	0.077%	0.855%	0.090	0.0%
JPX 日経中小型	0.011%	0.947%	0.012	0.0%

【一ヶ月】



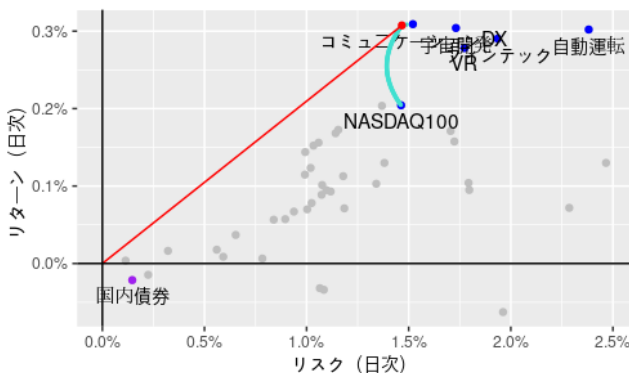
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.065%	0.214%	0.303	—
コミュニケーションDX	0.168%	1.522%	0.110	0.9%
ナノテクノロジー	0.082%	1.416%	0.058	0.9%
国内リート	0.079%	0.662%	0.120	13.4%
新興国債券 (ヘッジ)	0.079%	0.371%	0.213	36.2%
先進国債券 (ヘッジ)	0.051%	0.240%	0.214	35.8%
コモディティ	0.040%	1.210%	0.033	12.8%

【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	0.199%	1.673%	0.119	—
AI テック	0.239%	2.120%	0.113	46.9%
自動運転	0.211%	2.170%	0.097	10.8%
宇宙開発	0.178%	1.788%	0.100	29.7%
コミュニケーションDX	0.112%	1.575%	0.071	0.0%
水素エコノミー	0.101%	1.683%	0.060	0.0%
ウェアラブル	0.087%	1.094%	0.080	12.5%

【半年】

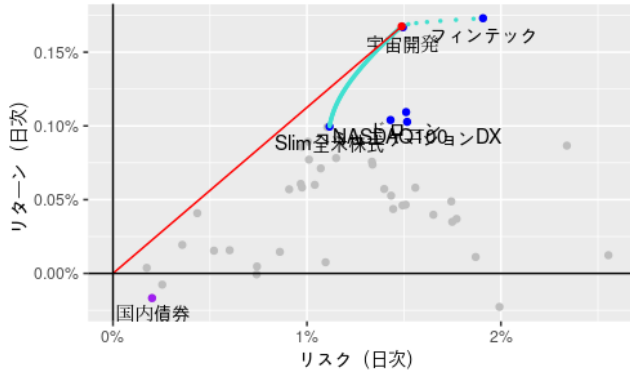


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.307%	1.467%	0.210	—
コミュニケーションDX	0.309%	1.521%	0.203	70.6%
宇宙開発	0.304%	1.731%	0.176	29.0%
自動運転	0.302%	2.382%	0.127	0.0%
フィンテック	0.290%	1.936%	0.150	0.0%
VR	0.278%	1.773%	0.157	0.4%
NASDAQ100	0.204%	1.463%	0.140	0.0%

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。

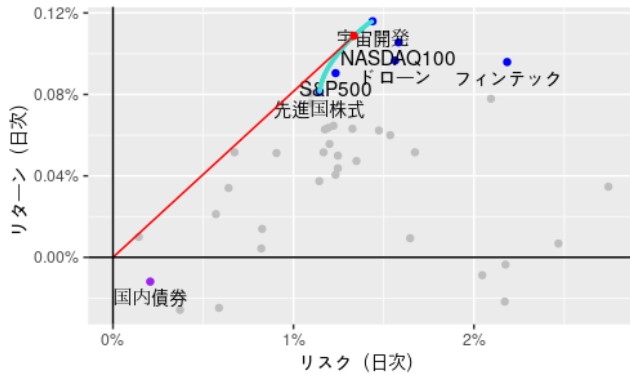
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.167%	1.488%	0.113	—
フィンテック	0.173%	1.908%	0.091	14.0%
宇宙開発	0.167%	1.495%	0.112	85.6%
ドローン	0.109%	1.511%	0.072	0.0%
NASDAQ100	0.104%	1.431%	0.073	0.0%
コミュニケーション DX	0.103%	1.517%	0.068	0.0%
Slim 全米株式	0.100%	1.116%	0.089	0.4%

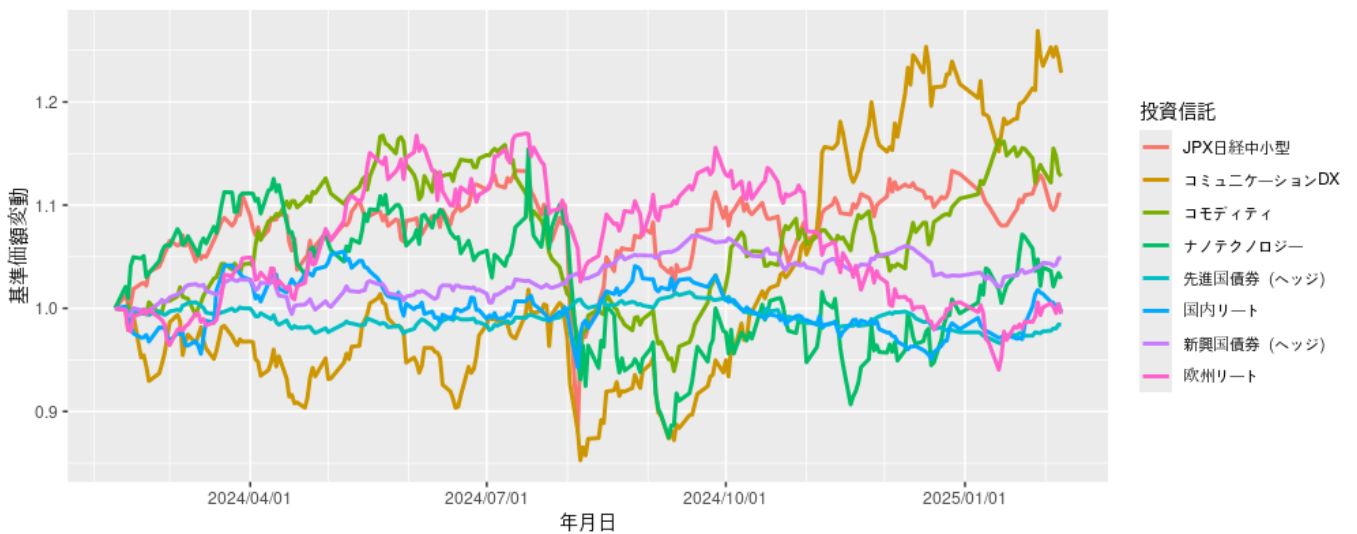
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.109%	1.335%	0.081	—
宇宙開発	0.116%	1.438%	0.081	72.1%
NASDAQ100	0.106%	1.582%	0.067	0.0%
ドローン	0.097%	1.563%	0.062	0.0%
フィンテック	0.096%	2.184%	0.044	0.0%
S&P500	0.090%	1.233%	0.073	27.9%
先進国株式	0.081%	1.145%	0.071	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。