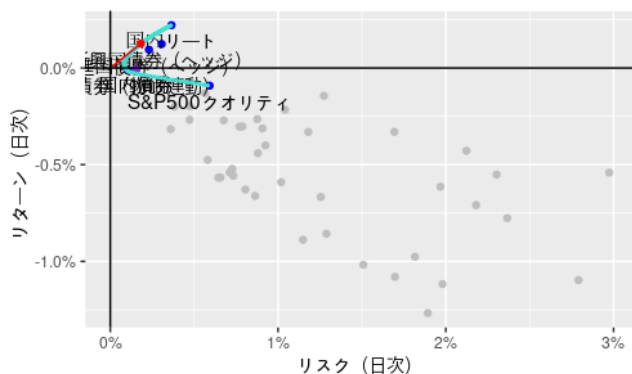


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

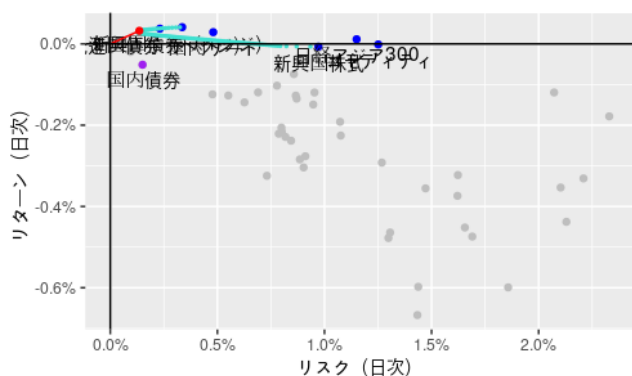
2025 年 2 月 28 日

【半月】



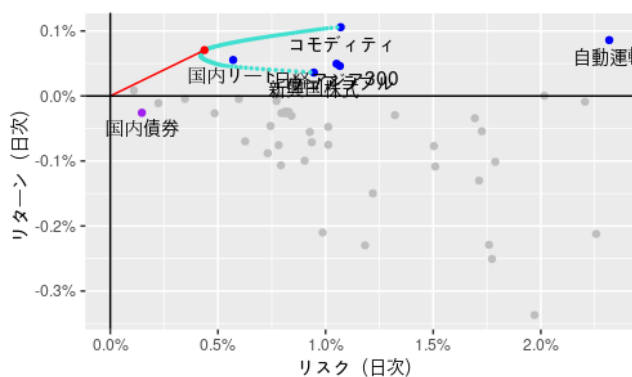
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.126%	0.182%	0.691	—
国内リート	0.221%	0.365%	0.607	51.6%
新興国債券 (ヘッジ)	0.124%	0.306%	0.405	0.0%
先進国債券 (ヘッジ)	0.095%	0.231%	0.411	30.0%
国内債券	-0.008%	0.152%	-0.050	0.0%
国内債券 (物価連動)	-0.012%	0.104%	-0.115	0.0%
S&P500 クオリティ	-0.091%	0.592%	-0.154	18.3%

【一ヶ月】



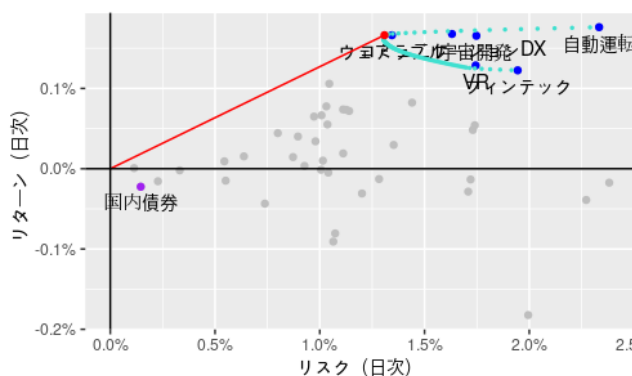
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.032%	0.136%	0.238	—
新興国債券 (ヘッジ)	0.041%	0.336%	0.123	15.5%
先進国債券 (ヘッジ)	0.037%	0.232%	0.162	67.2%
国内リート	0.029%	0.481%	0.060	0.0%
日経アジア 300	0.011%	1.150%	0.010	7.3%
コモディティ	-0.001%	1.251%	-0.001	9.9%
新興国株式	-0.007%	0.972%	-0.007	0.2%

【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	0.071%	0.438%	0.161	—
コモディティ	0.106%	1.070%	0.099	30.8%
自動運転	0.086%	2.318%	0.037	1.2%
国内リート	0.055%	0.571%	0.097	56.0%
日経アジア 300	0.050%	1.051%	0.047	12.0%
ウェアラブル	0.046%	1.067%	0.043	0.0%
新興国株式	0.036%	0.946%	0.038	0.0%

【半年】

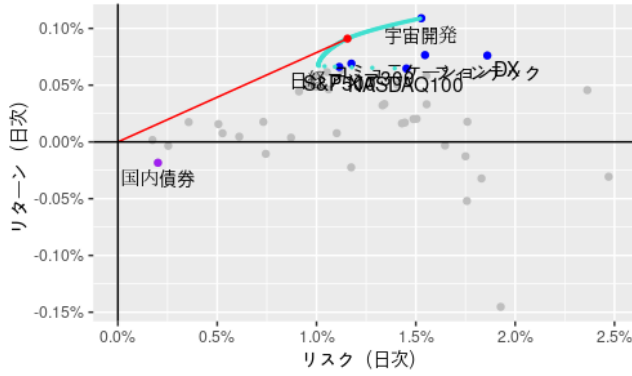


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.166%	1.309%	0.127	—
自動運転	0.176%	2.333%	0.076	0.0%
コミュニケーション DX	0.168%	1.631%	0.103	19.6%
ウェアラブル	0.166%	1.345%	0.124	73.0%
宇宙開発	0.166%	1.747%	0.095	6.9%
VR	0.129%	1.744%	0.074	0.5%
フィンテック	0.123%	1.945%	0.063	0.0%

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。

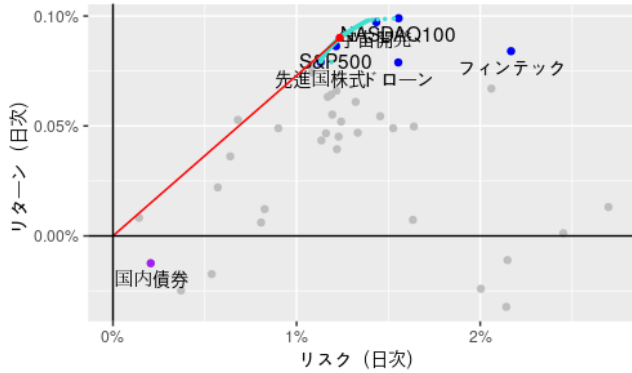
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.091%	1.156%	0.079	—
宇宙開発	0.109%	1.528%	0.071	55.1%
コミュニケーション DX	0.076%	1.546%	0.049	0.0%
フィンテック	0.076%	1.860%	0.041	0.0%
日経アジア 300	0.069%	1.176%	0.059	44.9%
S&P500	0.066%	1.115%	0.059	0.0%
NASDAQ100	0.065%	1.453%	0.044	0.0%

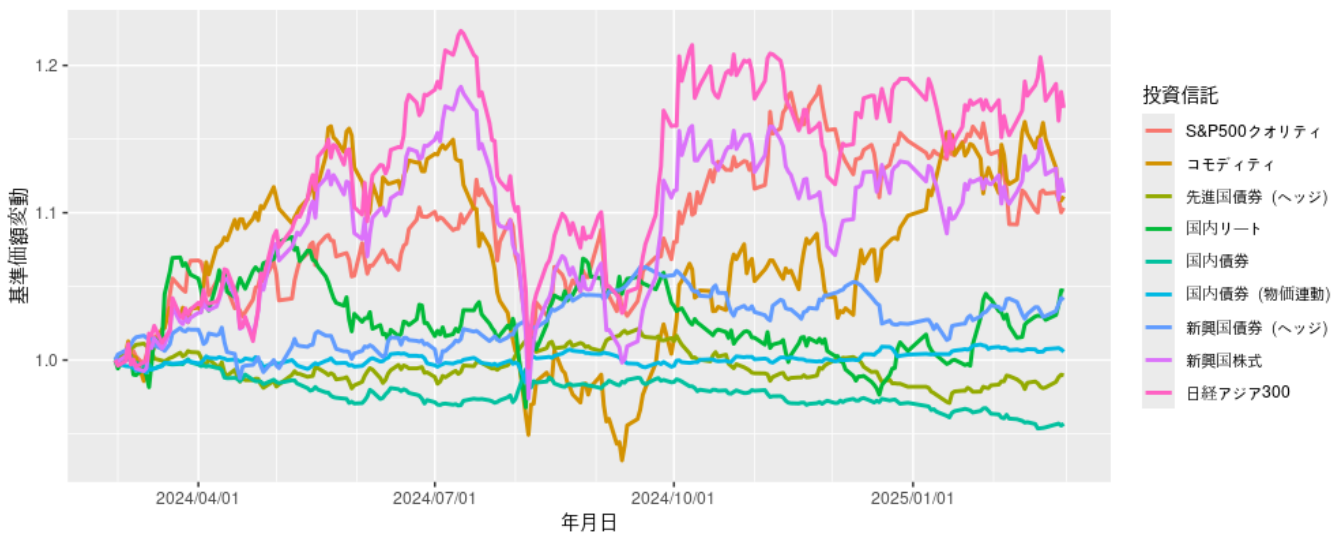
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.090%	1.235%	0.073	—
NASDAQ100	0.099%	1.556%	0.064	0.0%
宇宙開発	0.097%	1.434%	0.068	34.3%
S&P500	0.086%	1.215%	0.071	65.7%
フィンテック	0.084%	2.168%	0.039	0.0%
先進国株式	0.079%	1.131%	0.070	0.0%
ドローン	0.079%	1.554%	0.051	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。