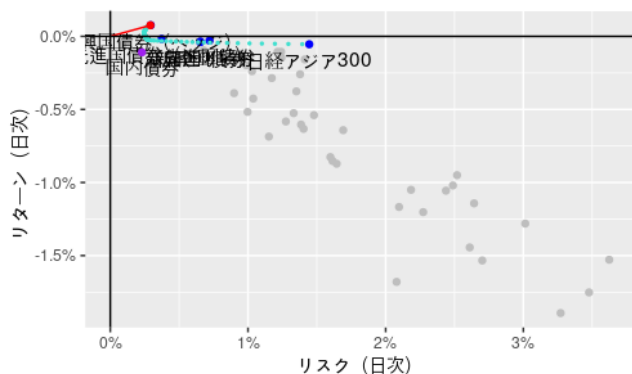


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

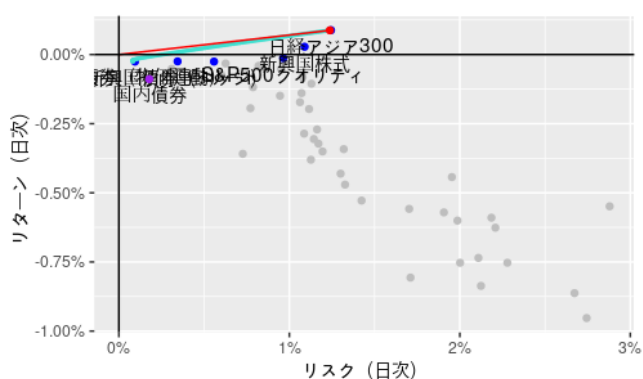
2025年3月8日

【半月】



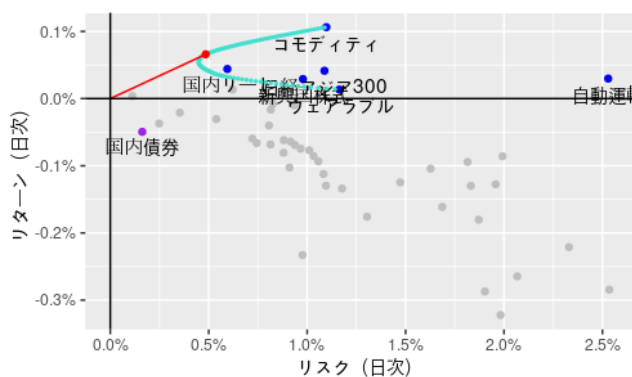
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.076%	0.291%	0.260	—
新興国債券 (ヘッジ)	0.076%	0.294%	0.260	99.5%
先進国債券 (ヘッジ)	-0.017%	0.373%	-0.047	0.0%
先進国債券	-0.029%	0.721%	-0.040	0.0%
新興国リート	-0.036%	0.654%	-0.054	0.0%
新興国債券	-0.040%	0.654%	-0.061	0.0%
日経アジア 300	-0.054%	1.445%	-0.037	0.5%

【一ヶ月】



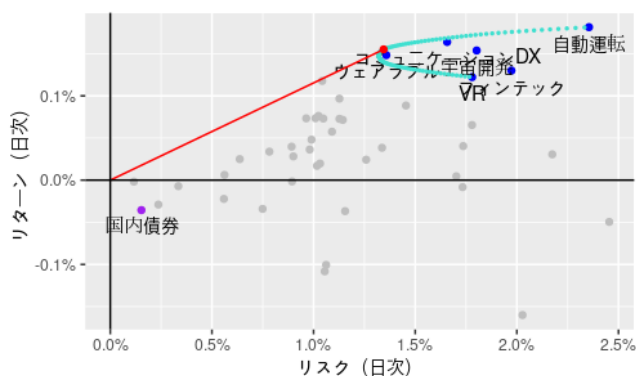
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.087%	1.238%	0.071	—
日経アジア 300	0.088%	1.244%	0.071	99.4%
新興国株式	0.028%	1.089%	0.026	0.0%
S&P500 クオリティ	-0.013%	0.964%	-0.013	0.6%
新興国債券 (ヘッジ)	-0.025%	0.344%	-0.072	0.0%
国内リート	-0.025%	0.558%	-0.046	0.0%
国内債券 (物価連動)	-0.026%	0.094%	-0.271	0.0%

【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	0.066%	0.485%	0.136	—
コモディティ	0.106%	1.098%	0.097	35.6%
国内リート	0.044%	0.595%	0.074	52.2%
日経アジア 300	0.041%	1.088%	0.038	12.2%
自動運転	0.030%	2.529%	0.012	0.0%
新興国株式	0.029%	0.979%	0.030	0.0%
ウェアラブル	0.013%	1.164%	0.012	0.0%

【半年】

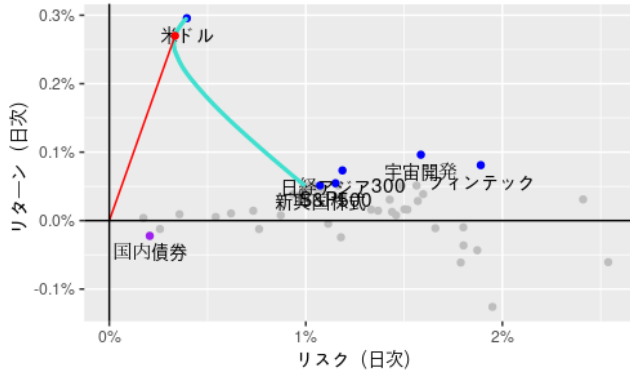


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.155%	1.345%	0.115	—
自動運転	0.181%	2.355%	0.077	6.7%
コミュニケーション DX	0.164%	1.657%	0.099	29.1%
宇宙開発	0.154%	1.802%	0.085	0.0%
ウェアラブル	0.148%	1.358%	0.109	64.2%
フィンテック	0.130%	1.973%	0.066	0.0%
VR	0.122%	1.780%	0.069	0.0%

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。

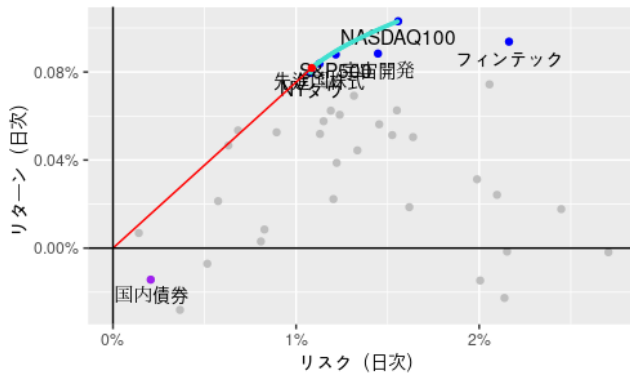
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.270%	0.335%	0.806	—
米ドル	0.296%	0.395%	0.749	88.0%
宇宙開発	0.096%	1.585%	0.061	4.2%
フィンテック	0.081%	1.890%	0.043	1.1%
日経アジア 300	0.073%	1.186%	0.062	6.8%
S&P500	0.055%	1.151%	0.047	0.0%
新興国株式	0.051%	1.073%	0.048	0.0%

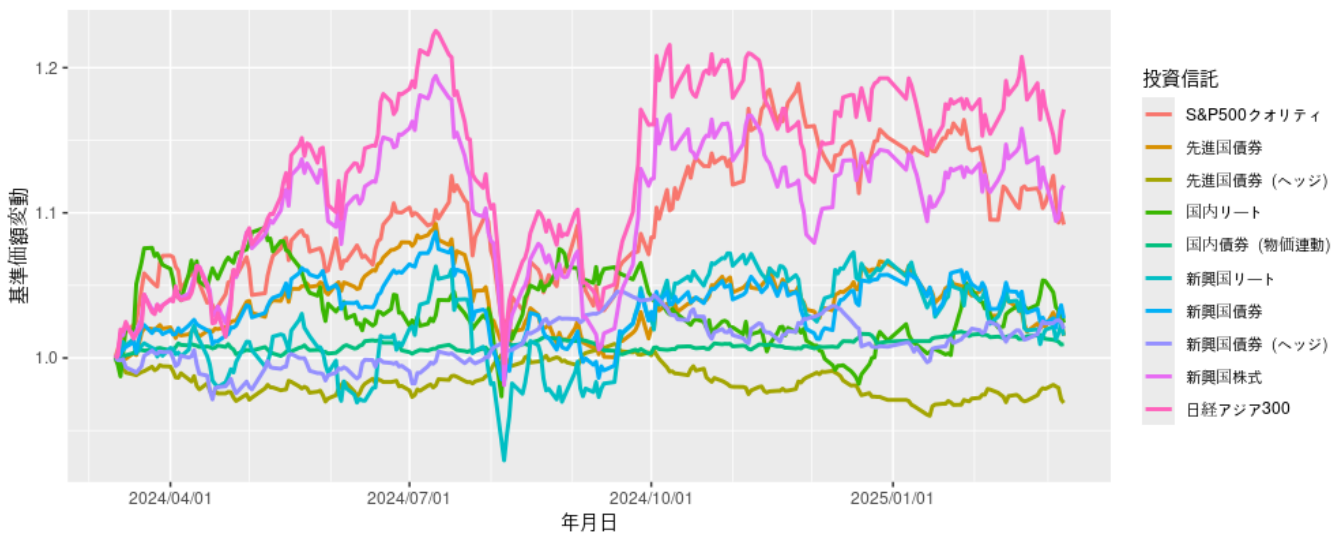
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.082%	1.086%	0.075	—
NASDAQ100	0.103%	1.557%	0.066	0.0%
フィンテック	0.094%	2.163%	0.043	0.0%
宇宙開発	0.088%	1.447%	0.061	0.0%
S&P500	0.088%	1.217%	0.072	0.0%
先進国株式	0.084%	1.129%	0.074	53.1%
NY ダウ	0.080%	1.081%	0.074	46.9%

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。