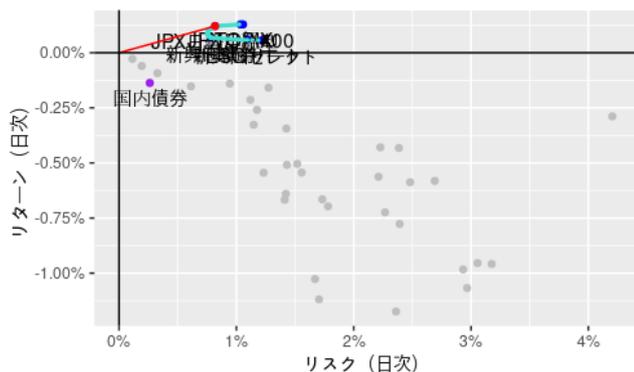


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

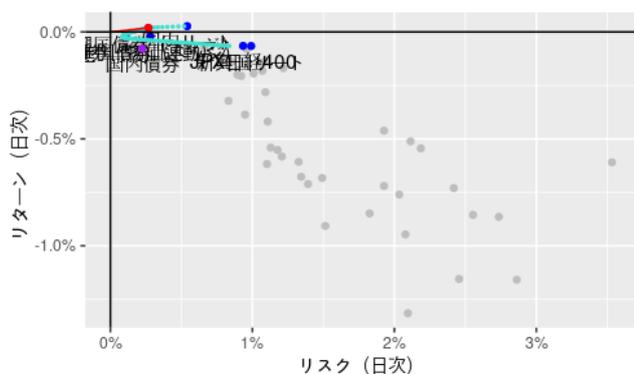
2025年3月15日

【半月】



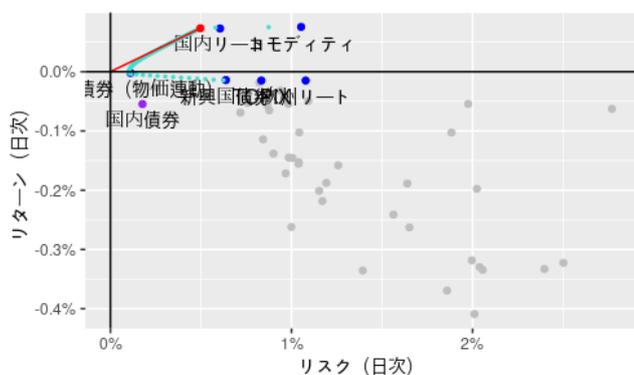
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.121%	0.819%	0.148	—
TOPIX	0.128%	1.057%	0.122	0.0%
JPX 日経 400	0.128%	1.035%	0.124	0.0%
JPX 日経中小型	0.121%	0.819%	0.148	100.0%
新興国債券	0.069%	0.781%	0.088	0.0%
新興国リート	0.061%	1.092%	0.056	0.0%
ESG セレクト	0.056%	1.217%	0.046	0.0%

【一ヶ月】



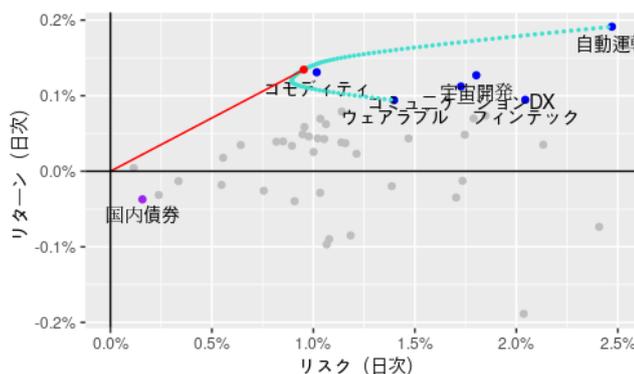
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.019%	0.268%	0.071	—
国内リート	0.027%	0.540%	0.050	21.9%
新興国債券 (ヘッジ)	0.017%	0.265%	0.064	78.1%
先進国債券 (ヘッジ)	-0.022%	0.281%	-0.078	0.0%
国内債券 (物価連動)	-0.024%	0.107%	-0.226	0.0%
JPX 日経 400	-0.065%	0.934%	-0.070	0.0%
新興国リート	-0.066%	0.991%	-0.066	0.0%

【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	0.073%	0.497%	0.148	—
コモディティ	0.076%	1.053%	0.072	27.5%
国内リート	0.073%	0.605%	0.120	72.2%
国内債券 (物価連動)	-0.002%	0.111%	-0.018	0.4%
新興国債券	-0.014%	0.638%	-0.022	0.0%
TOPIX	-0.015%	0.833%	-0.018	0.0%
欧州リート	-0.015%	1.078%	-0.014	0.0%

【半年】

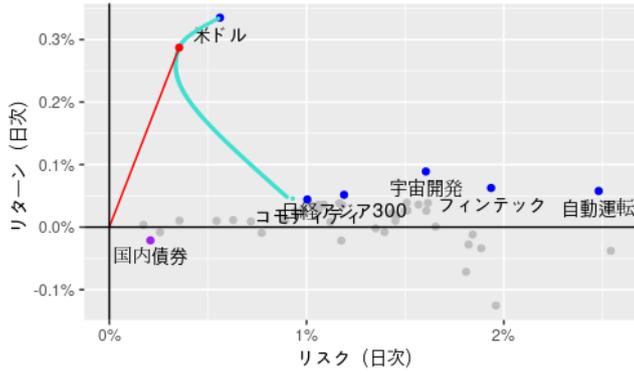


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.134%	0.953%	0.141	—
自動運転	0.191%	2.471%	0.077	12.2%
コモディティ	0.131%	1.017%	0.129	77.3%
宇宙開発	0.127%	1.803%	0.070	0.0%
コミュニケーション DX	0.112%	1.727%	0.065	0.0%
フィンテック	0.095%	2.044%	0.046	0.0%
ウェアラブル	0.094%	1.398%	0.067	10.5%

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。

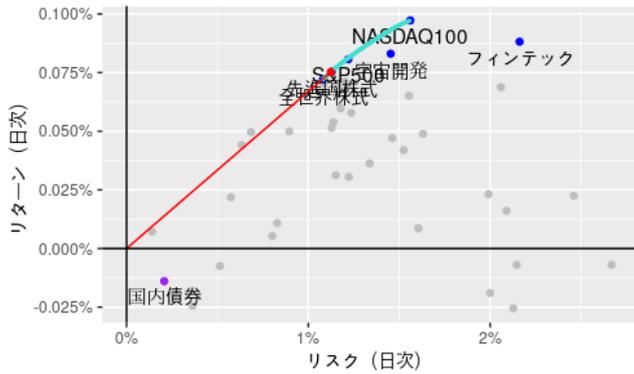
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.287%	0.354%	0.810	—
米ドル	0.335%	0.561%	0.597	80.6%
宇宙開発	0.089%	1.605%	0.055	18.7%
フィンテック	0.063%	1.935%	0.032	0.0%
自動運転	0.058%	2.481%	0.023	0.0%
日経アジア 300	0.052%	1.190%	0.043	0.7%
コモディティ	0.044%	1.004%	0.044	0.0%

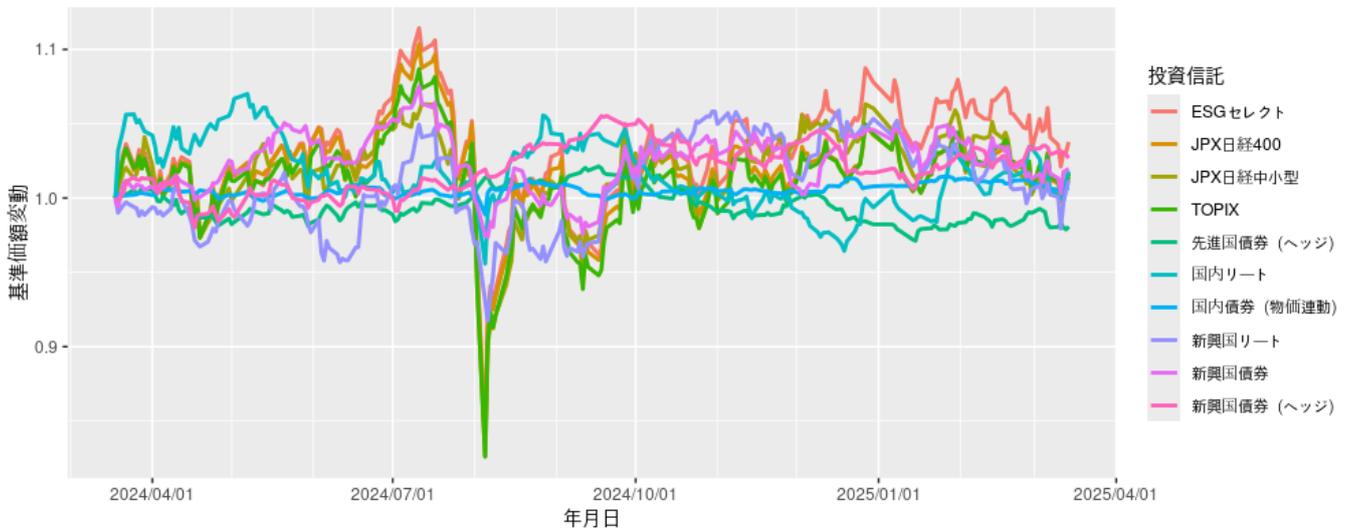
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.075%	1.124%	0.067	—
NASDAQ100	0.097%	1.561%	0.062	0.3%
フィンテック	0.088%	2.162%	0.041	0.0%
宇宙開発	0.083%	1.453%	0.057	6.1%
S&P500	0.081%	1.220%	0.066	24.7%
先進国株式	0.075%	1.129%	0.067	8.6%
全世界株式	0.072%	1.081%	0.067	60.3%

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。