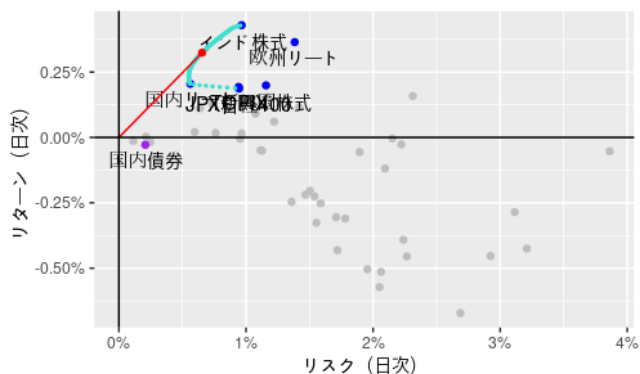


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

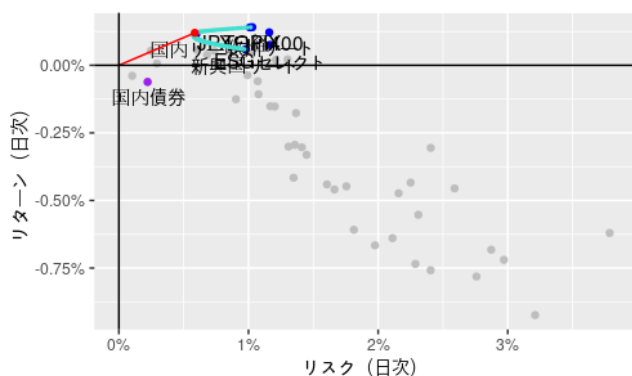
2025年3月21日

【半月】



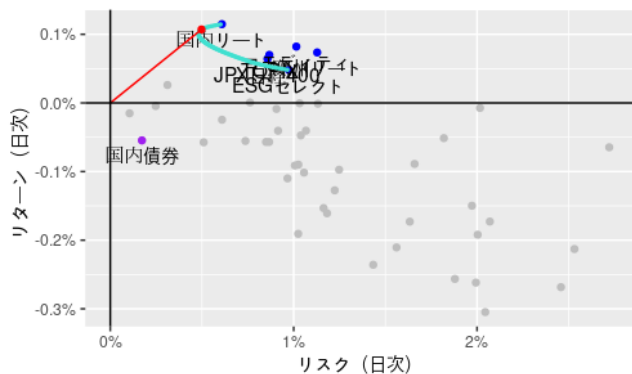
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.324%	0.654%	0.495	—
インド株式	0.429%	0.966%	0.444	48.6%
欧州リート	0.364%	1.383%	0.263	6.2%
国内リート	0.205%	0.563%	0.364	45.2%
新興国株式	0.199%	1.158%	0.172	0.0%
TOPIX	0.193%	0.943%	0.205	0.0%
JPX 日経 400	0.187%	0.945%	0.198	0.0%

【一ヶ月】



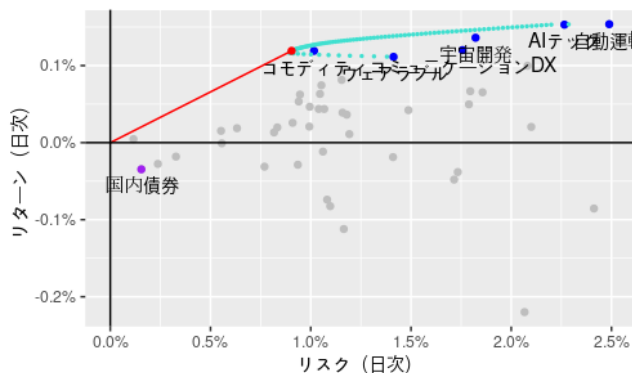
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.120%	0.586%	0.205	—
TOPIX	0.141%	1.029%	0.137	0.0%
JPX 日経 400	0.140%	1.010%	0.139	21.2%
欧州リート	0.122%	1.160%	0.105	2.6%
国内リート	0.114%	0.596%	0.192	76.1%
ESG セレクト	0.075%	1.165%	0.064	0.0%
新興国リート	0.059%	0.977%	0.060	0.0%

【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	0.107%	0.497%	0.215	—
国内リート	0.115%	0.609%	0.189	76.5%
コモディティ	0.082%	1.014%	0.081	23.5%
欧州リート	0.074%	1.128%	0.065	0.0%
TOPIX	0.070%	0.867%	0.081	0.0%
JPX 日経 400	0.064%	0.857%	0.075	0.0%
ESG セレクト	0.048%	0.974%	0.049	0.0%

【半年】

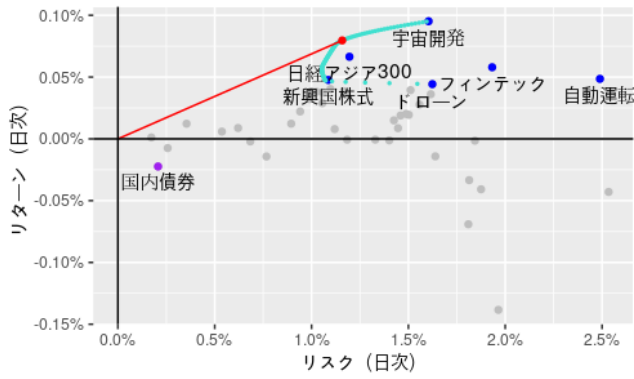


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.119%	0.904%	0.132	—
自動運転	0.154%	2.489%	0.062	2.4%
AI テック	0.153%	2.265%	0.068	0.0%
宇宙開発	0.136%	1.822%	0.075	5.3%
コミュニケーション DX	0.120%	1.757%	0.068	0.0%
コモディティ	0.119%	1.016%	0.117	70.1%
ウェアラブル	0.111%	1.413%	0.079	22.1%

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。

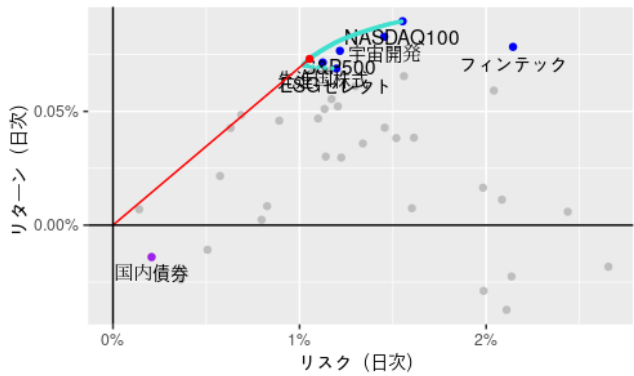
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.080%	1.158%	0.069	—
宇宙開発	0.095%	1.604%	0.059	45.9%
日経アジア 300	0.066%	1.196%	0.056	54.1%
フィンテック	0.058%	1.933%	0.030	0.0%
自動運転	0.049%	2.489%	0.020	0.0%
新興国株式	0.048%	1.086%	0.044	0.0%
ドローン	0.044%	1.624%	0.027	0.0%

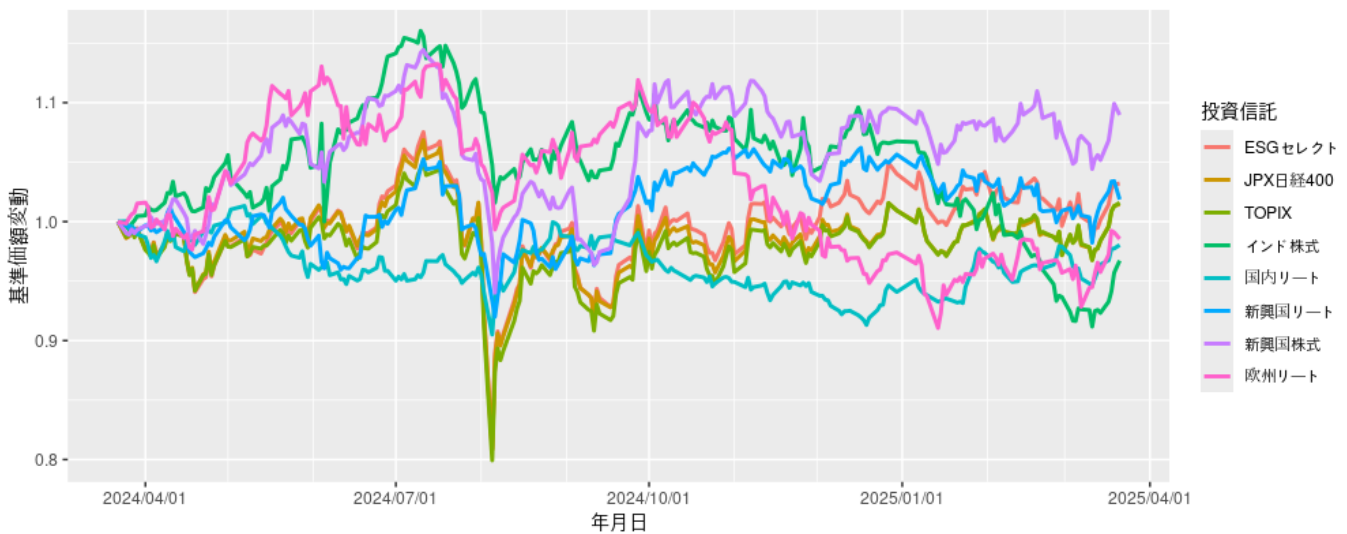
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.073%	1.054%	0.069	—
NASDAQ100	0.090%	1.552%	0.058	0.0%
宇宙開発	0.083%	1.454%	0.057	9.2%
フィンテック	0.078%	2.144%	0.037	0.0%
S&P500	0.077%	1.216%	0.063	32.2%
先進国株式	0.071%	1.124%	0.064	17.5%
ESG セレクト	0.069%	1.198%	0.057	41.1%

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。