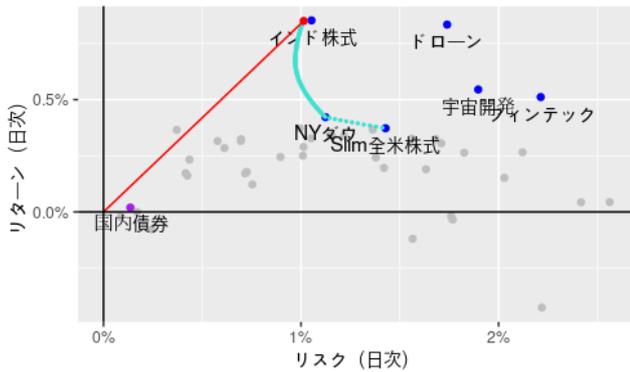


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

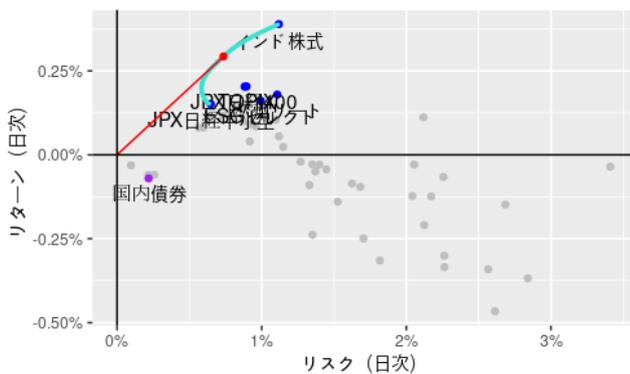
2025年3月29日

【半月】



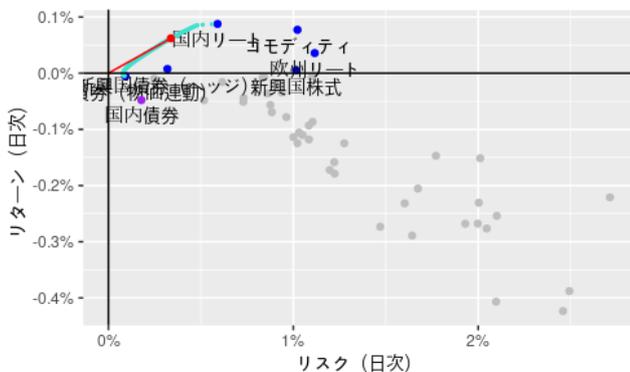
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.850%	1.013%	0.839	—
インド株式	0.853%	1.053%	0.810	87.1%
ドローン	0.834%	1.740%	0.479	12.9%
宇宙開発	0.545%	1.897%	0.287	0.0%
フィンテック	0.511%	2.213%	0.231	0.0%
NYダウ	0.422%	1.124%	0.375	0.0%
Slim 全米株式	0.373%	1.428%	0.261	0.0%

【一ヶ月】



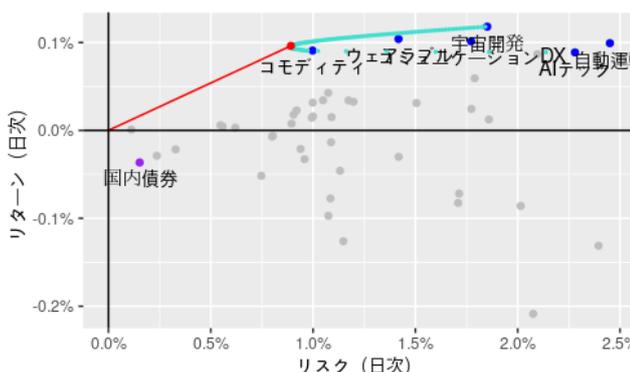
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.293%	0.736%	0.398	—
インド株式	0.389%	1.118%	0.348	52.4%
TOPIX	0.204%	0.895%	0.228	0.0%
JPX 日経 400	0.203%	0.882%	0.230	26.3%
欧州リート	0.180%	1.107%	0.162	11.4%
ESG セレクト	0.161%	0.994%	0.162	0.0%
JPX 日経中小型	0.151%	0.648%	0.234	9.8%

【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	0.062%	0.338%	0.183	—
国内リート	0.088%	0.590%	0.148	48.5%
コモディティ	0.077%	1.023%	0.075	22.5%
欧州リート	0.036%	1.116%	0.032	0.0%
新興国債券（ヘッジ）	0.007%	0.319%	0.023	29.0%
新興国株式	0.005%	1.015%	0.005	0.0%
国内債券（物価連動）	-0.006%	0.093%	-0.061	0.0%

【半年】

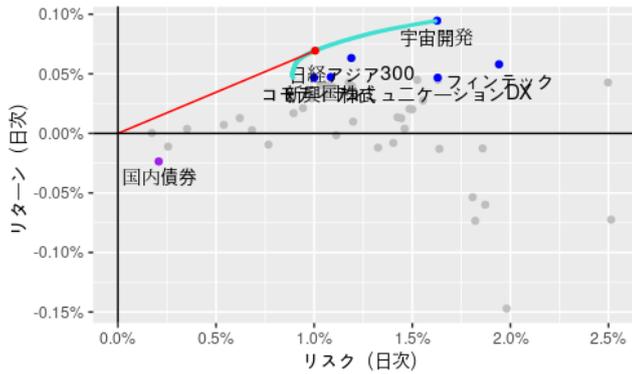


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.096%	0.892%	0.108	—
宇宙開発	0.118%	1.851%	0.064	5.6%
ウェアラブル	0.104%	1.418%	0.073	29.3%
コミュニケーション DX	0.101%	1.772%	0.057	0.0%
自動運転	0.099%	2.451%	0.040	0.0%
コモディティ	0.091%	0.998%	0.091	65.1%
AI テック	0.089%	2.280%	0.039	0.0%

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。

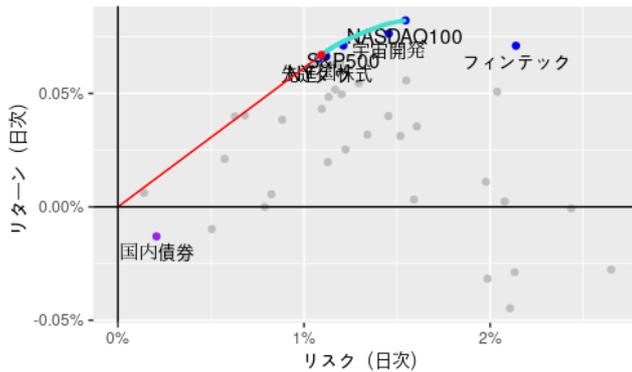
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.069%	1.005%	0.069	—
宇宙開発	0.095%	1.627%	0.058	35.5%
日経アジア 300	0.063%	1.189%	0.053	34.6%
フィンテック	0.058%	1.942%	0.030	0.0%
新興国株式	0.047%	1.084%	0.044	0.0%
コミュニケーション DX	0.047%	1.630%	0.029	0.0%
コモディティ	0.047%	1.000%	0.047	29.9%

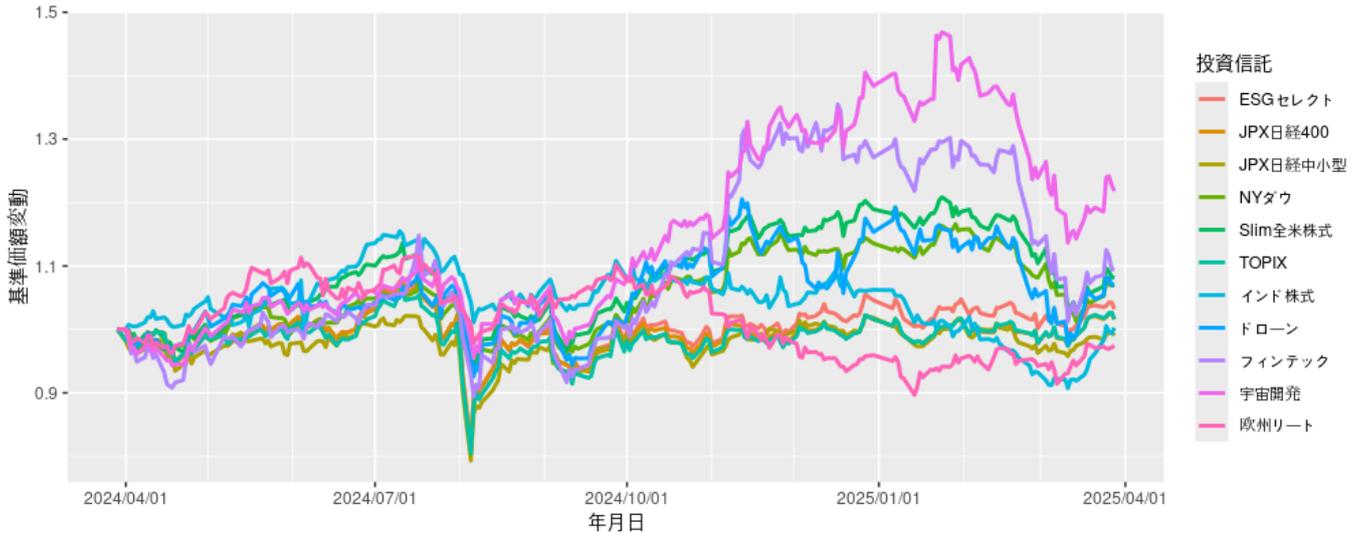
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.067%	1.093%	0.061	—
NASDAQ100	0.082%	1.546%	0.053	4.4%
宇宙開発	0.076%	1.456%	0.052	5.8%
S&P500	0.071%	1.212%	0.059	0.0%
フィンテック	0.071%	2.139%	0.033	0.0%
先進国株式	0.066%	1.120%	0.059	22.2%
NY ダウ	0.065%	1.078%	0.061	67.5%

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。

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。