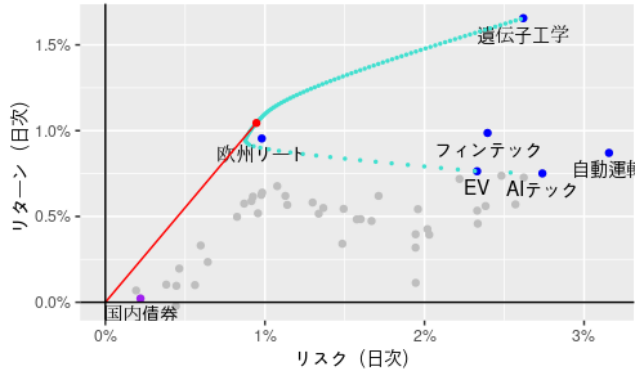


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

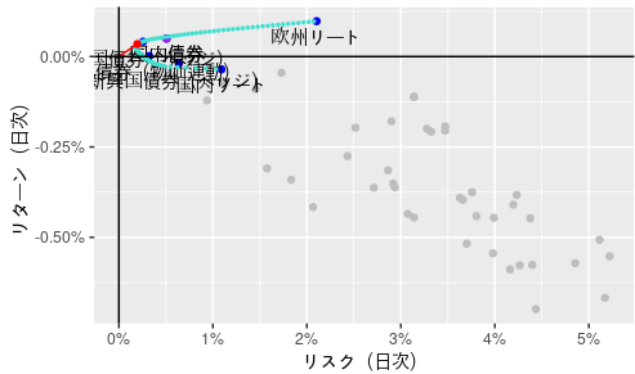
2025 年 4 月 26 日

【半月】



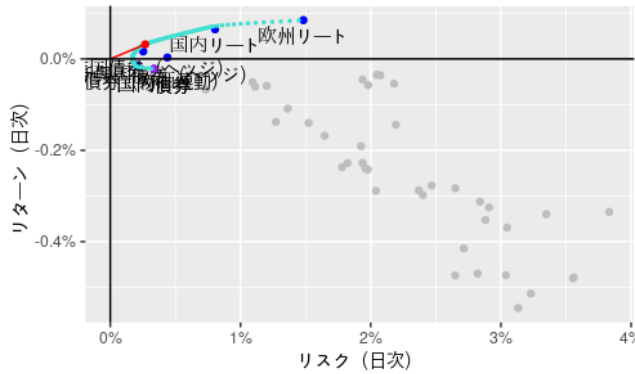
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	1.045%	0.947%	1.104	—
遺伝子工学	1.656%	2.619%	0.632	13.4%
フィンテック	0.987%	2.395%	0.412	0.0%
欧州リート	0.954%	0.980%	0.974	82.8%
自動運転	0.871%	3.156%	0.276	3.8%
EV	0.763%	2.330%	0.328	0.0%
AI テック	0.751%	2.739%	0.274	0.0%

【一ヶ月】



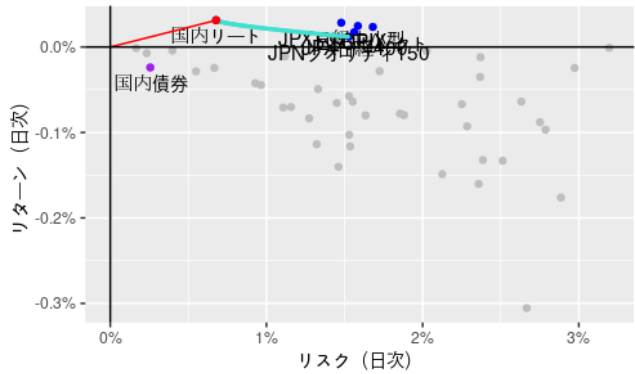
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.034%	0.196%	0.176	—
欧州リート	0.098%	2.104%	0.046	0.2%
国内債券	0.050%	0.508%	0.098	0.0%
先進国債券（ヘッジ）	0.041%	0.258%	0.159	91.1%
国内債券（物価連動）	0.001%	0.322%	0.004	0.0%
新興国債券（ヘッジ）	-0.020%	0.638%	-0.032	0.0%
国内リート	-0.035%	1.092%	-0.033	8.7%

【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	0.032%	0.269%	0.119	—
欧州リート	0.085%	1.483%	0.057	4.5%
国内リート	0.065%	0.804%	0.081	25.9%
先進国債券（ヘッジ）	0.016%	0.253%	0.065	69.7%
新興国債券（ヘッジ）	0.003%	0.439%	0.007	0.0%
国内債券（物価連動）	-0.014%	0.204%	-0.069	0.0%
国内債券	-0.022%	0.335%	-0.065	0.0%

【半年】

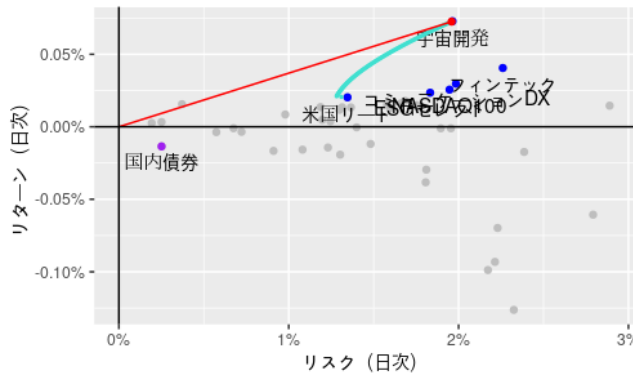


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.031%	0.678%	0.046	—
国内リート	0.031%	0.677%	0.046	99.5%
JPN 日経中小型	0.028%	1.479%	0.019	0.0%
TOPIX	0.025%	1.585%	0.016	0.0%
ESG セレクト	0.023%	1.681%	0.014	0.0%
JPN 日経 400	0.017%	1.562%	0.011	0.0%
JPN クオリティ 150	0.012%	1.528%	0.008	0.5%

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。

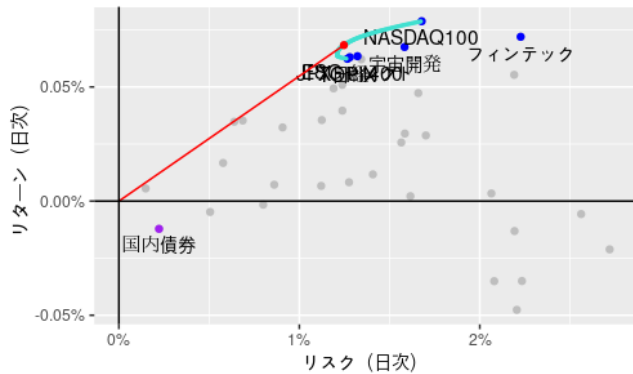
（２）リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.073%	1.959%	0.037	—
宇宙開発	0.073%	1.964%	0.037	99.5%
フィンテック	0.041%	2.260%	0.018	0.0%
コミュニケーション DX	0.030%	1.984%	0.015	0.0%
NASDAQ100	0.026%	1.947%	0.013	0.0%
ESG セレクト	0.023%	1.833%	0.013	0.5%
米国リート	0.020%	1.346%	0.015	0.0%

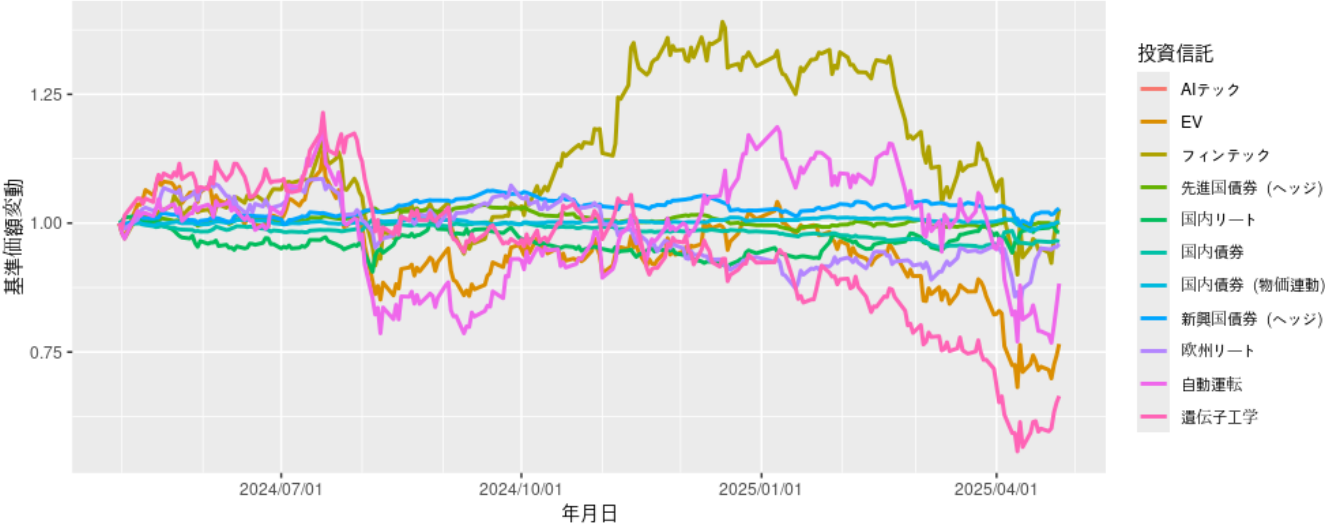
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.068%	1.247%	0.055	—
NASDAQ100	0.079%	1.678%	0.047	34.3%
フィンテック	0.072%	2.227%	0.032	0.0%
宇宙開発	0.067%	1.583%	0.043	7.1%
ESG セレクト	0.063%	1.322%	0.048	0.0%
JPX 日経 400	0.063%	1.280%	0.049	0.0%
TOPIX	0.062%	1.267%	0.049	58.6%

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。