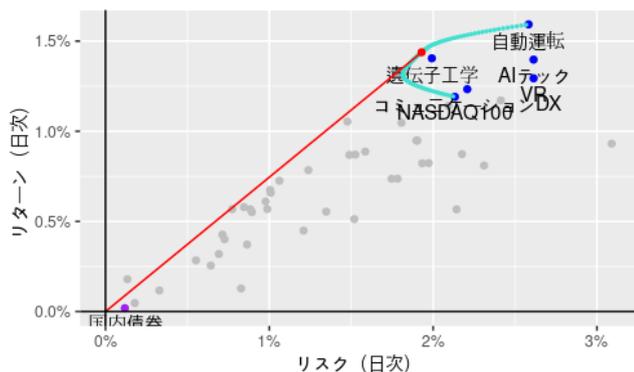


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

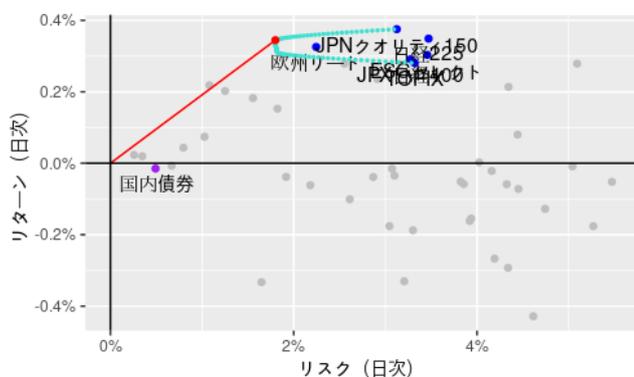
2025年5月3日

【半月】



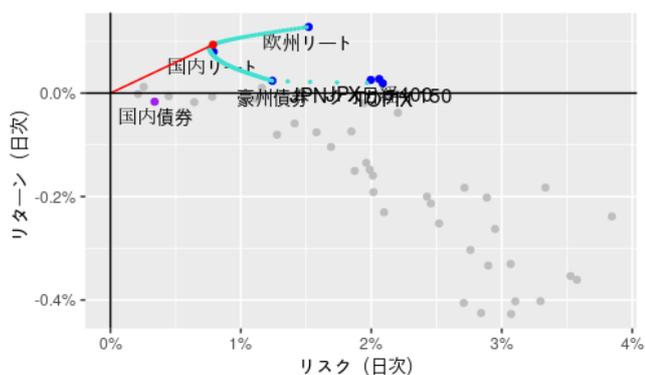
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	1.438%	1.930%	0.745	—
自動運転	1.593%	2.583%	0.617	25.6%
遺伝子工学	1.405%	1.992%	0.705	67.4%
AI テック	1.397%	2.613%	0.535	0.0%
VR	1.294%	2.613%	0.495	0.1%
コミュニケーション DX	1.234%	2.209%	0.559	0.0%
NASDAQ100	1.191%	2.133%	0.558	6.8%

【一ヶ月】



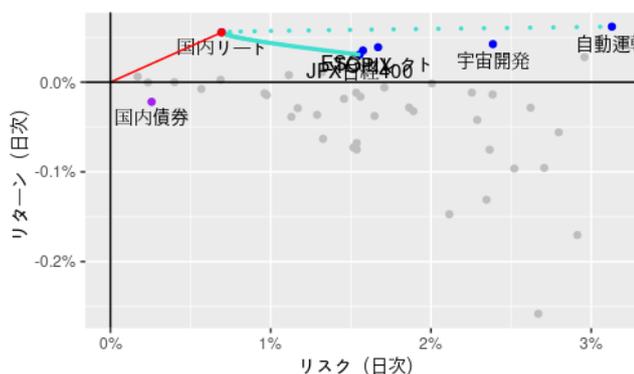
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.344%	1.800%	0.191	—
JPN クオリティ 150	0.375%	3.124%	0.120	38.2%
日経 225	0.349%	3.471%	0.100	0.0%
欧州リート	0.325%	2.245%	0.145	61.8%
ESG セレクト	0.303%	3.456%	0.088	0.0%
JPX 日経 400	0.291%	3.273%	0.089	0.0%
TOPIX	0.280%	3.319%	0.084	0.0%

【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	0.094%	0.787%	0.119	—
欧州リート	0.128%	1.520%	0.084	28.4%
国内リート	0.080%	0.790%	0.101	71.6%
JPX 日経 400	0.027%	2.061%	0.013	0.0%
JPN クオリティ 150	0.026%	1.996%	0.013	0.0%
豪州債券	0.024%	1.241%	0.019	0.0%
TOPIX	0.019%	2.088%	0.009	0.0%

【半年】

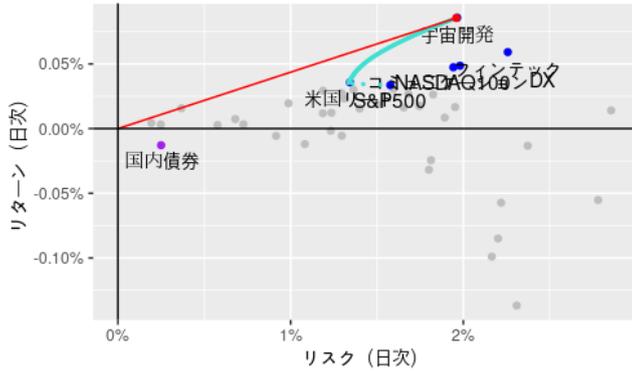


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.055%	0.694%	0.080	—
自動運転	0.062%	3.129%	0.020	0.0%
国内リート	0.056%	0.694%	0.080	99.0%
宇宙開発	0.042%	2.387%	0.018	1.0%
ESG セレクト	0.039%	1.670%	0.023	0.0%
TOPIX	0.035%	1.576%	0.022	0.0%
JPX 日経 400	0.031%	1.555%	0.020	0.0%

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。

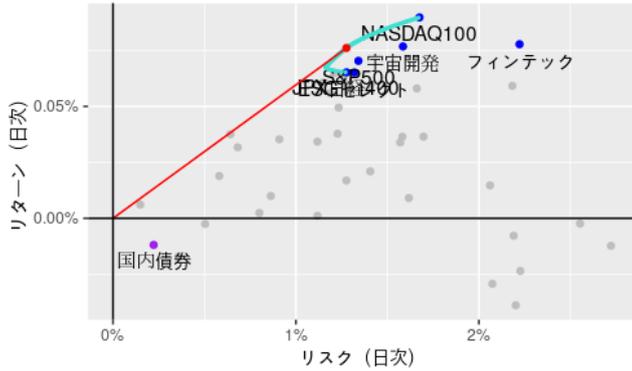
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.085%	1.959%	0.044	—
宇宙開発	0.086%	1.964%	0.044	99.5%
フィンテック	0.059%	2.258%	0.026	0.0%
コミュニケーション DX	0.049%	1.981%	0.025	0.0%
NASDAQ100	0.047%	1.942%	0.024	0.0%
米国リート	0.036%	1.344%	0.027	0.5%
S&P500	0.034%	1.577%	0.021	0.0%

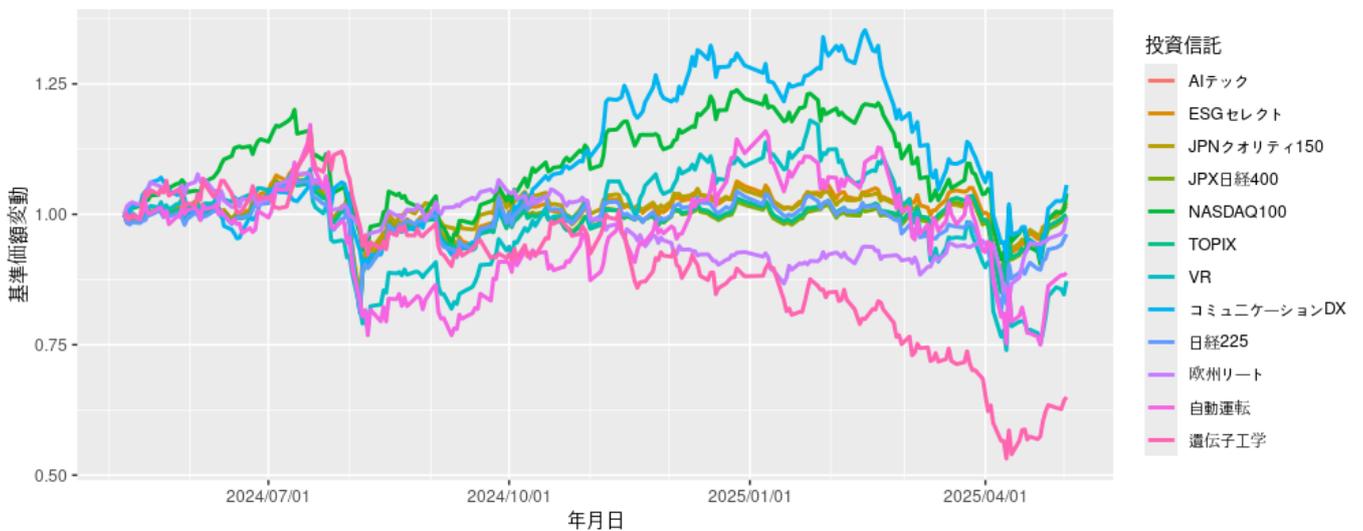
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.076%	1.276%	0.060	—
NASDAQ100	0.090%	1.675%	0.054	39.5%
フィンテック	0.078%	2.222%	0.035	0.0%
宇宙開発	0.077%	1.585%	0.048	10.4%
S&P500	0.070%	1.342%	0.052	0.0%
JPX 日経 400	0.065%	1.277%	0.051	50.1%
ESG セレクト	0.065%	1.320%	0.049	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。

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。