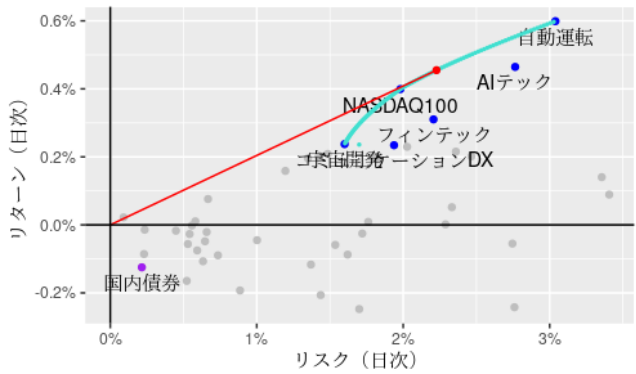


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

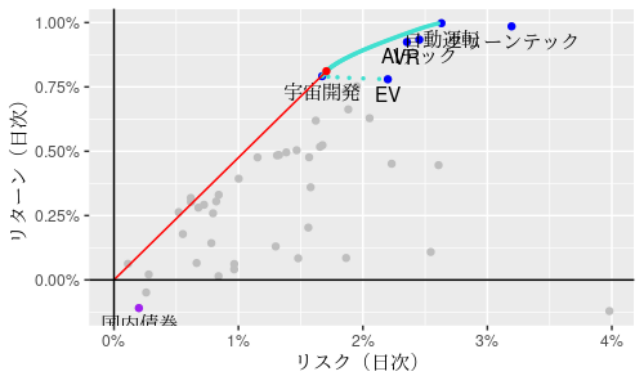
2025 年 5 月 24 日

【半月】



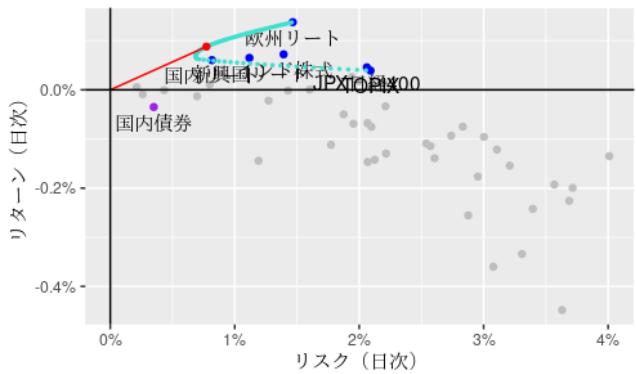
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.455%	2.227%	0.204	—
自動運転	0.599%	3.039%	0.197	27.9%
AI テック	0.465%	2.764%	0.168	0.0%
NASDAQ100	0.399%	1.981%	0.202	72.1%
フィンテック	0.310%	2.207%	0.141	0.0%
宇宙開発	0.238%	1.600%	0.148	0.0%
コミュニケーション DX	0.234%	1.937%	0.121	0.0%

【一ヶ月】



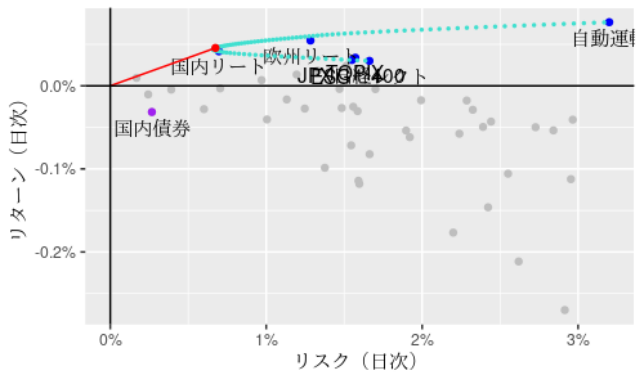
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.811%	1.707%	0.475	—
自動運転	0.998%	2.631%	0.379	9.5%
クリーンテック	0.985%	3.195%	0.308	0.0%
AI テック	0.934%	2.453%	0.381	0.0%
VR	0.924%	2.354%	0.393	0.0%
宇宙開発	0.792%	1.673%	0.473	90.5%
EV	0.780%	2.200%	0.354	0.0%

【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	0.088%	0.773%	0.114	—
欧州リート	0.138%	1.467%	0.094	33.2%
インド株式	0.072%	1.393%	0.052	14.1%
新興国リート	0.065%	1.118%	0.058	2.9%
国内リート	0.060%	0.817%	0.074	49.8%
JPX 日経 400	0.046%	2.061%	0.022	0.0%
TOPIX	0.039%	2.091%	0.019	0.0%

【半年】

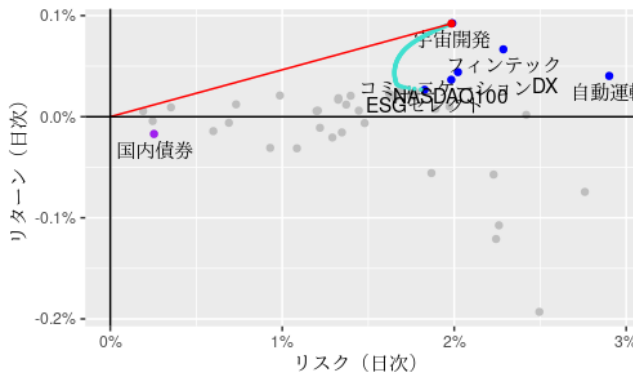


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.046%	0.674%	0.068	—
自動運転	0.077%	3.200%	0.024	2.6%
欧州リート	0.055%	1.284%	0.042	24.3%
国内リート	0.042%	0.697%	0.060	73.2%
TOPIX	0.034%	1.572%	0.021	0.0%
JPX 日経 400	0.031%	1.550%	0.020	0.0%
ESG セレクト	0.030%	1.662%	0.018	0.0%

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。

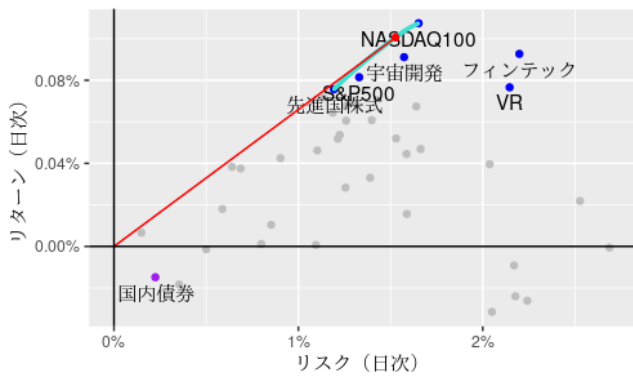
（２）リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.092%	1.984%	0.046	—
宇宙開発	0.092%	1.989%	0.046	99.5%
フィンテック	0.067%	2.286%	0.029	0.0%
コミュニケーション DX	0.044%	2.021%	0.022	0.0%
自動運転	0.040%	2.901%	0.014	0.0%
NASDAQ100	0.037%	1.983%	0.018	0.0%
ESG セレクト	0.027%	1.828%	0.015	0.5%

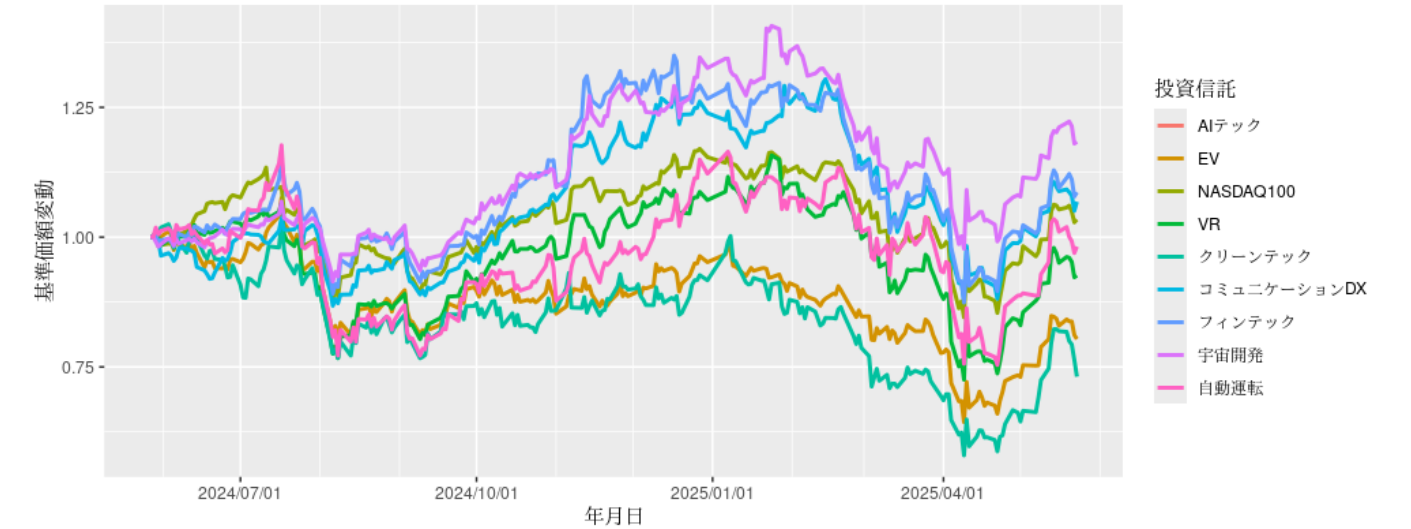
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.101%	1.527%	0.066	—
NASDAQ100	0.107%	1.653%	0.065	67.2%
フィンテック	0.093%	2.199%	0.042	0.0%
宇宙開発	0.091%	1.574%	0.058	23.2%
S&P500	0.081%	1.330%	0.061	0.0%
VR	0.077%	2.146%	0.036	0.0%
先進国株式	0.076%	1.193%	0.063	9.6%

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。