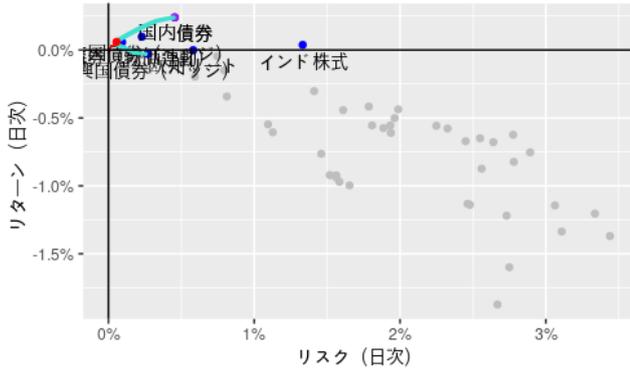


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

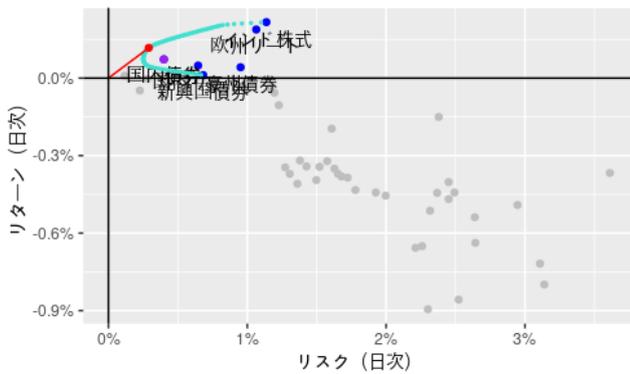
2025年4月4日

【半月】



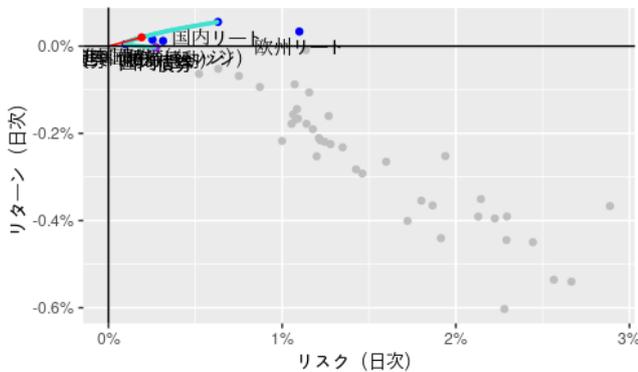
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.060%	0.056%	1.076	—
国内債券	0.240%	0.455%	0.527	1.9%
先進国債券 (ヘッジ)	0.097%	0.229%	0.425	0.0%
国内債券 (物価連動)	0.058%	0.094%	0.614	92.4%
インド株式	0.037%	1.332%	0.028	5.7%
欧州リート	-0.001%	0.581%	-0.002	0.0%
新興国債券 (ヘッジ)	-0.031%	0.273%	-0.113	0.0%

【一ヶ月】



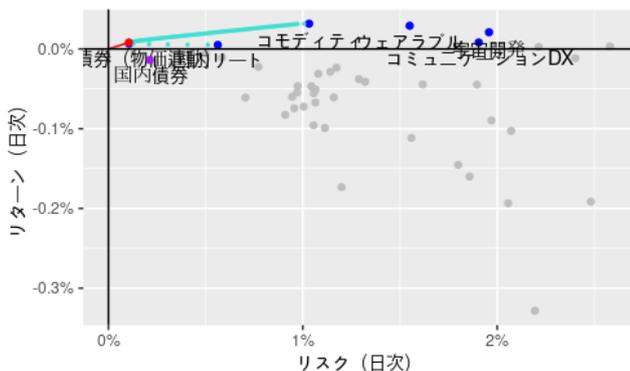
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.117%	0.291%	0.403	—
インド株式	0.216%	1.138%	0.190	23.5%
欧州リート	0.188%	1.065%	0.177	9.1%
国内債券	0.073%	0.399%	0.182	67.3%
国内リート	0.049%	0.646%	0.075	0.0%
豪州債券	0.042%	0.952%	0.044	0.0%
新興国債券	0.011%	0.683%	0.017	0.0%

【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	0.020%	0.191%	0.105	—
国内リート	0.056%	0.631%	0.088	24.3%
欧州リート	0.034%	1.099%	0.031	0.0%
先進国債券 (ヘッジ)	0.015%	0.253%	0.058	31.9%
新興国債券 (ヘッジ)	0.012%	0.315%	0.038	0.0%
国内債券 (物価連動)	0.004%	0.098%	0.046	43.8%
国内債券	-0.003%	0.273%	-0.011	0.0%

【半年】

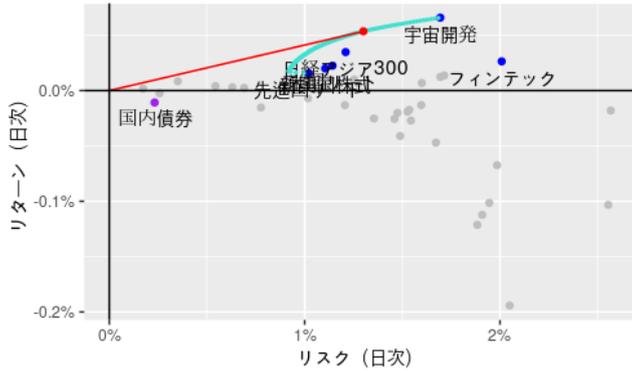


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.008%	0.105%	0.078	—
コモディティ	0.032%	1.032%	0.031	5.6%
ウェアラブル	0.029%	1.550%	0.019	1.0%
宇宙開発	0.021%	1.958%	0.011	0.2%
コミュニケーションDX	0.008%	1.905%	0.004	0.0%
国内債券 (物価連動)	0.007%	0.106%	0.062	90.4%
国内リート	0.005%	0.563%	0.009	2.8%

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。

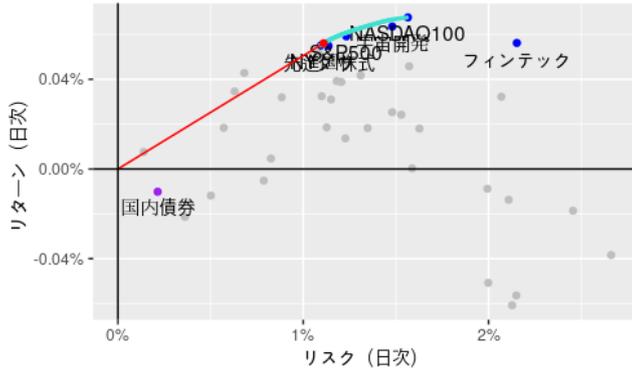
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.054%	1.301%	0.041	—
宇宙開発	0.066%	1.694%	0.039	60.4%
日経アジア 300	0.035%	1.210%	0.029	39.6%
フィンテック	0.026%	2.009%	0.013	0.0%
米国リート	0.022%	1.143%	0.020	0.0%
新興国株式	0.020%	1.106%	0.018	0.0%
先進国リート	0.016%	1.021%	0.015	0.0%

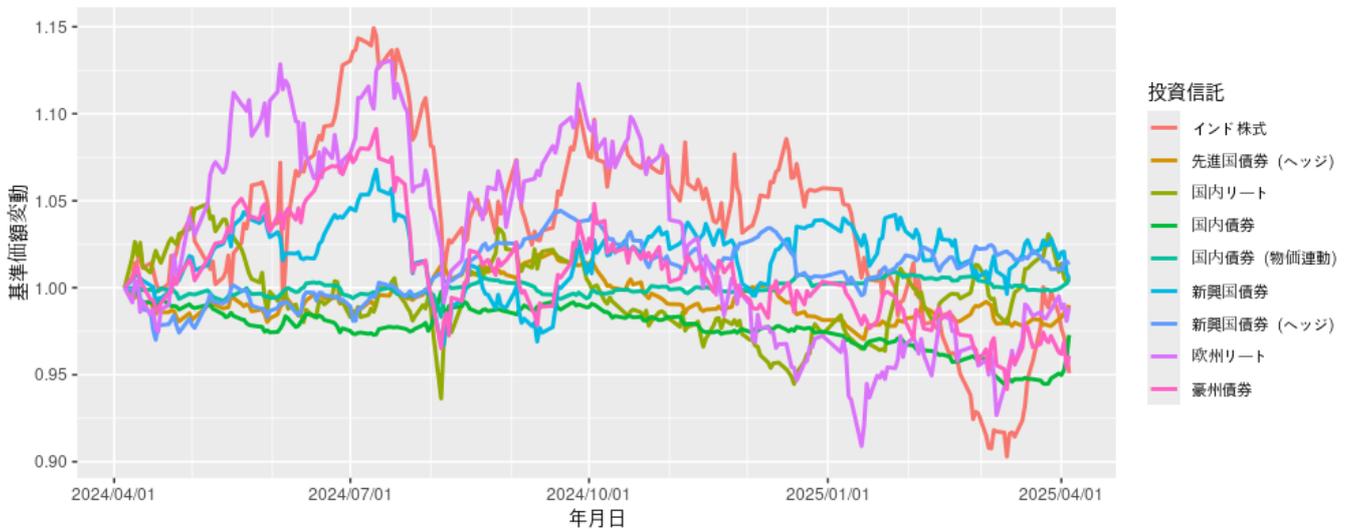
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.056%	1.110%	0.051	—
NASDAQ100	0.068%	1.565%	0.043	4.9%
宇宙開発	0.064%	1.481%	0.043	4.2%
S&P500	0.059%	1.233%	0.048	0.0%
フィンテック	0.056%	2.153%	0.026	0.0%
NY ダウ	0.055%	1.096%	0.050	80.3%
先進国株式	0.055%	1.136%	0.048	10.5%

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。