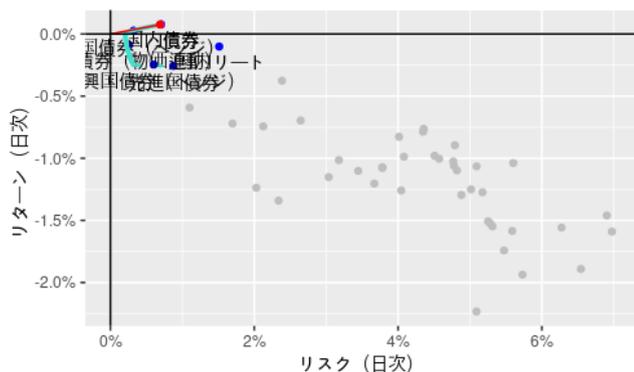


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

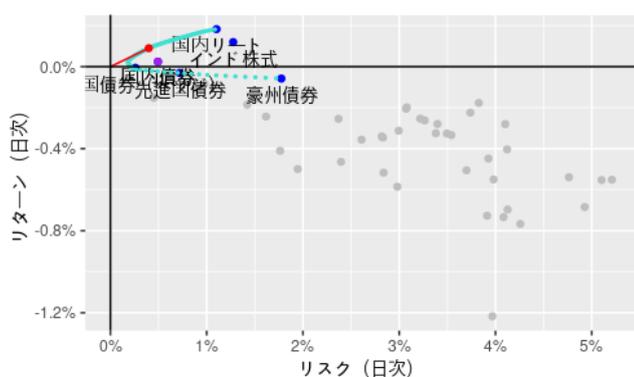
2025 年 4 月 11 日

【半月】



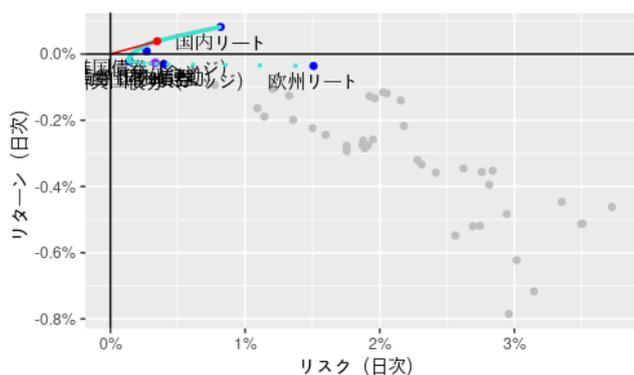
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.075%	0.690%	0.109	—
国内債券	0.077%	0.704%	0.110	96.7%
先進国債券 (ヘッジ)	0.027%	0.323%	0.082	3.3%
国内債券 (物価連動)	-0.088%	0.259%	-0.339	0.0%
国内リート	-0.101%	1.512%	-0.067	0.0%
新興国債券 (ヘッジ)	-0.246%	0.601%	-0.408	0.0%
先進国債券	-0.257%	0.874%	-0.294	0.0%

【一ヶ月】



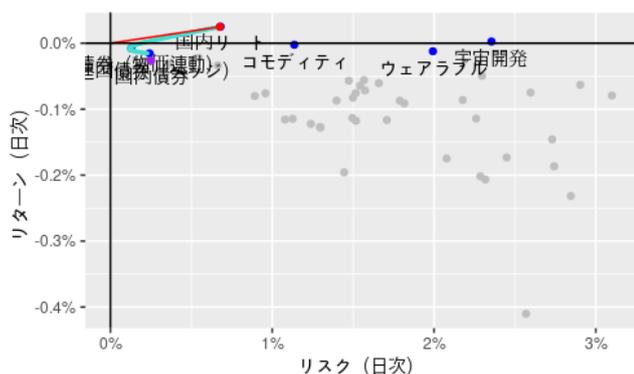
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.090%	0.399%	0.226	—
国内リート	0.183%	1.102%	0.166	36.1%
インド株式	0.120%	1.275%	0.094	8.9%
国内債券	0.024%	0.493%	0.049	54.9%
先進国債券 (ヘッジ)	-0.005%	0.260%	-0.021	0.0%
先進国債券	-0.030%	0.718%	-0.042	0.0%
豪州債券	-0.058%	1.776%	-0.033	0.0%

【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	0.039%	0.347%	0.112	—
国内リート	0.082%	0.818%	0.100	41.0%
先進国債券 (ヘッジ)	0.009%	0.269%	0.033	59.0%
国内債券 (物価連動)	-0.022%	0.141%	-0.155	0.0%
国内債券	-0.027%	0.333%	-0.080	0.0%
新興国債券 (ヘッジ)	-0.030%	0.397%	-0.077	0.0%
欧州リート	-0.036%	1.509%	-0.024	0.0%

【半年】

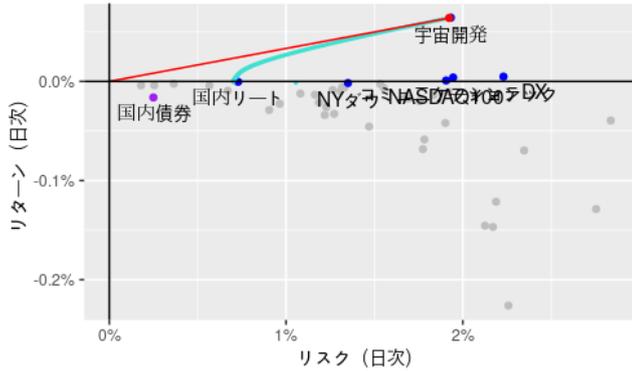


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.025%	0.676%	0.037	—
国内リート	0.025%	0.680%	0.037	99.4%
宇宙開発	0.003%	2.355%	0.001	0.0%
コモディティ	-0.002%	1.137%	-0.002	0.1%
国内債券 (物価連動)	-0.008%	0.128%	-0.062	0.5%
ウェアラブル	-0.012%	1.993%	-0.006	0.0%
先進国債券 (ヘッジ)	-0.015%	0.242%	-0.064	0.0%

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。

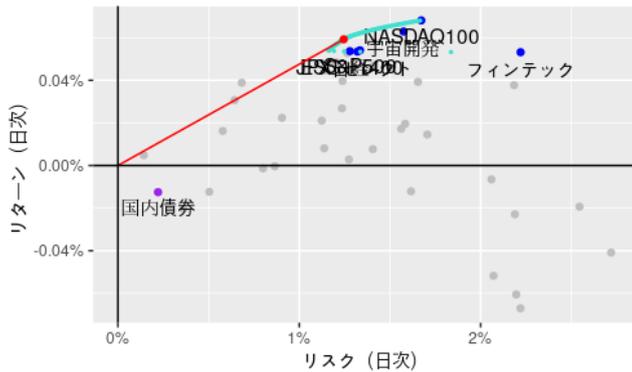
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.064%	1.923%	0.033	—
宇宙開発	0.064%	1.932%	0.033	99.5%
フィンテック	0.005%	2.230%	0.002	0.0%
コミュニケーション DX	0.004%	1.946%	0.002	0.0%
NASDAQ100	0.001%	1.906%	0.000	0.0%
国内リート	-0.000%	0.729%	-0.001	0.5%
NY ダウ	-0.002%	1.351%	-0.001	0.0%

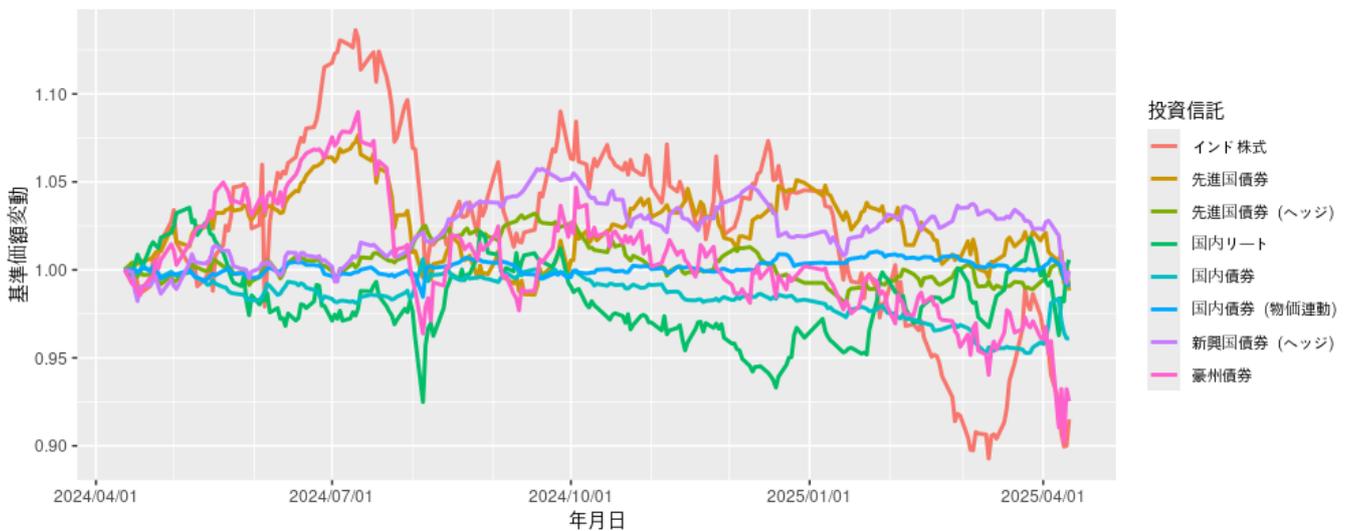
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.059%	1.245%	0.048	—
NASDAQ100	0.068%	1.673%	0.041	24.2%
宇宙開発	0.063%	1.575%	0.040	22.4%
S&P500	0.054%	1.335%	0.041	0.0%
JPX 日経 400	0.054%	1.279%	0.042	53.5%
ESG セレクト	0.053%	1.320%	0.041	0.0%
フィンテック	0.053%	2.221%	0.024	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。