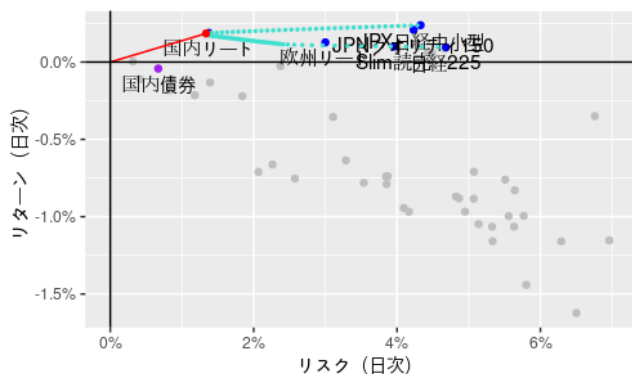


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

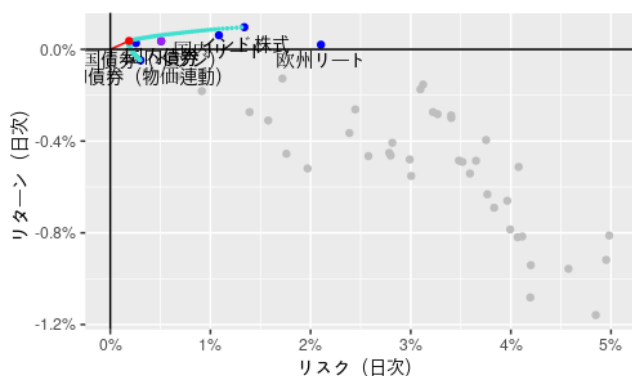
2025年4月18日

【半月】



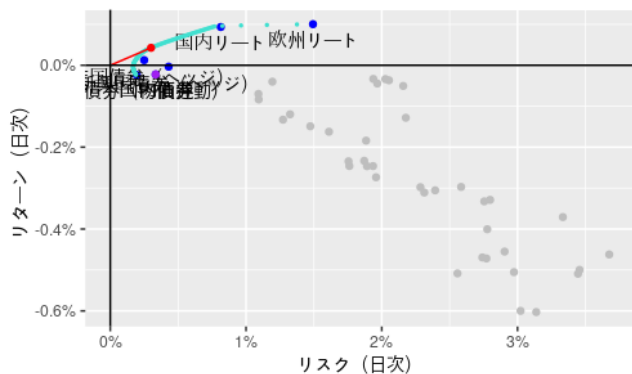
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.185%	1.336%	0.138	—
JPX 日経中小型	0.238%	4.328%	0.055	0.0%
JPN クオリティ 150	0.208%	4.231%	0.049	0.0%
国内リート	0.188%	1.374%	0.137	94.3%
欧州リート	0.127%	3.000%	0.042	5.7%
Slim 読売	0.100%	3.958%	0.025	0.0%
日経 225	0.096%	4.682%	0.020	0.0%

【一ヶ月】



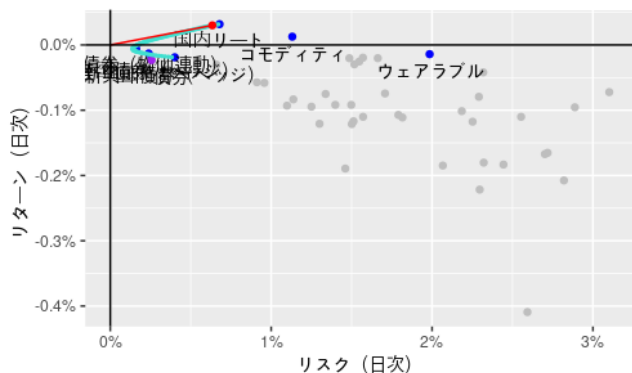
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.037%	0.188%	0.196	—
インド株式	0.097%	1.338%	0.072	5.8%
国内リート	0.062%	1.085%	0.057	15.5%
国内債券	0.036%	0.508%	0.071	0.0%
先進国債券 (ヘッジ)	0.027%	0.257%	0.107	78.8%
欧州リート	0.020%	2.104%	0.010	0.0%
国内債券 (物価連動)	-0.048%	0.302%	-0.158	0.0%

【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	0.043%	0.300%	0.142	—
欧州リート	0.100%	1.493%	0.067	4.6%
国内リート	0.094%	0.814%	0.115	32.3%
先進国債券 (ヘッジ)	0.013%	0.250%	0.050	63.2%
新興国債券 (ヘッジ)	-0.003%	0.430%	-0.008	0.0%
国内債券	-0.022%	0.334%	-0.067	0.0%
国内債券 (物価連動)	-0.024%	0.194%	-0.122	0.0%

【半年】

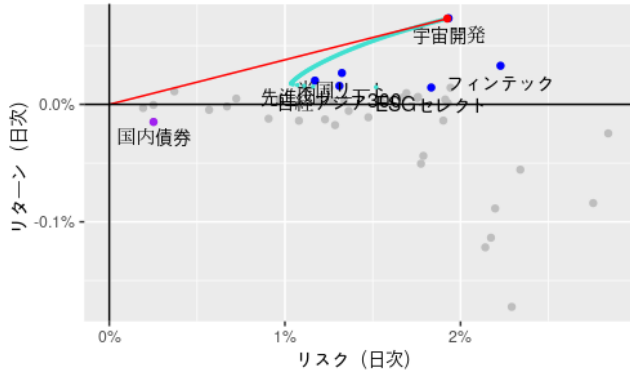


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.030%	0.634%	0.047	—
国内リート	0.032%	0.679%	0.047	90.7%
コモディティ	0.013%	1.131%	0.011	9.3%
国内債券 (物価連動)	-0.006%	0.161%	-0.038	0.0%
先進国債券 (ヘッジ)	-0.013%	0.239%	-0.055	0.0%
ウェアラブル	-0.014%	1.985%	-0.007	0.0%
新興国債券 (ヘッジ)	-0.019%	0.401%	-0.047	0.0%

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。

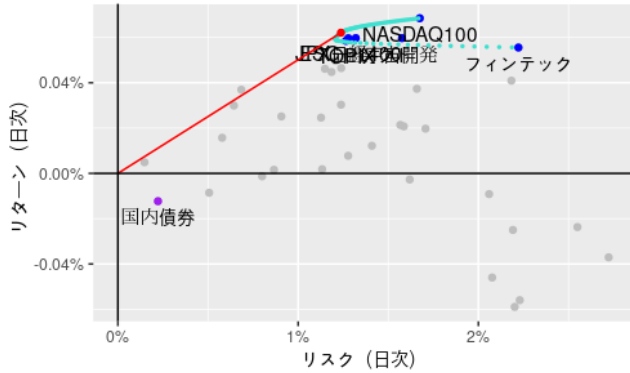
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.073%	1.925%	0.038	—
宇宙開発	0.073%	1.932%	0.038	99.5%
フィンテック	0.033%	2.228%	0.015	0.0%
米国リート	0.027%	1.325%	0.020	0.0%
先進国リート	0.020%	1.171%	0.017	0.0%
日経アジア 300	0.016%	1.310%	0.012	0.5%
ESG セレクト	0.014%	1.833%	0.008	0.0%

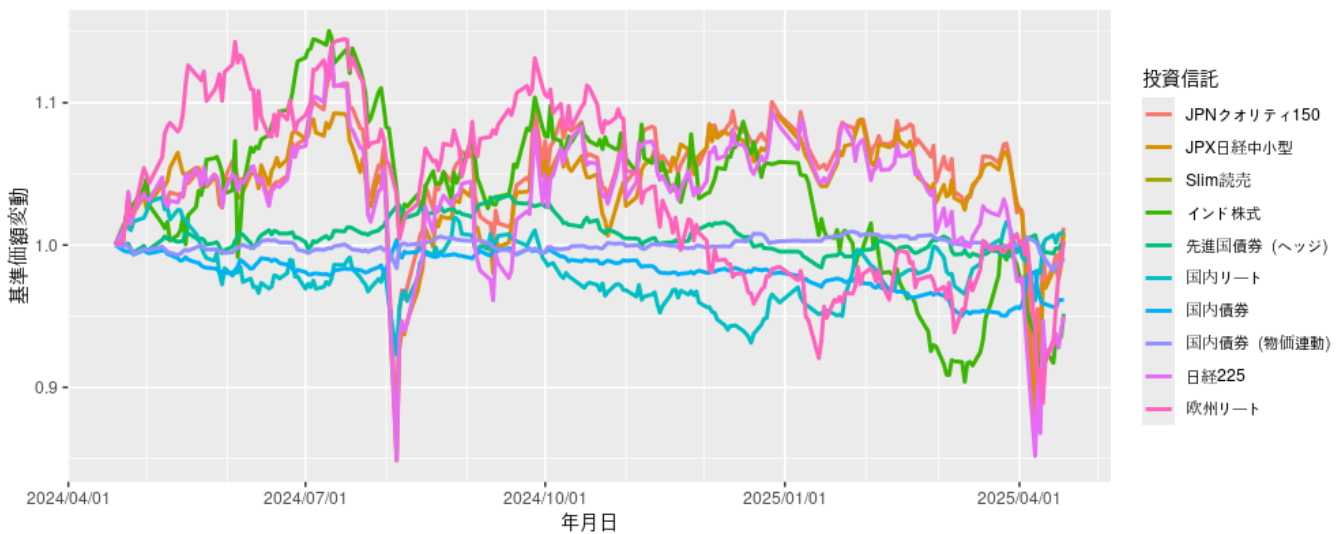
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.062%	1.237%	0.050	—
NASDAQ100	0.068%	1.675%	0.041	27.4%
宇宙開発	0.060%	1.576%	0.038	7.4%
ESG セレクト	0.060%	1.320%	0.045	0.0%
JPX 日経 400	0.060%	1.278%	0.047	65.2%
TOPIX	0.058%	1.265%	0.046	0.0%
フィンテック	0.056%	2.222%	0.025	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。