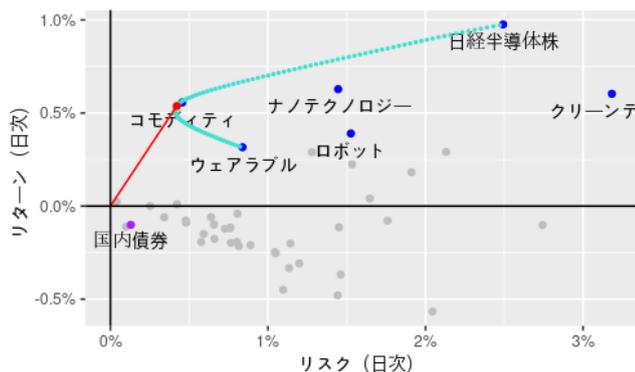


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

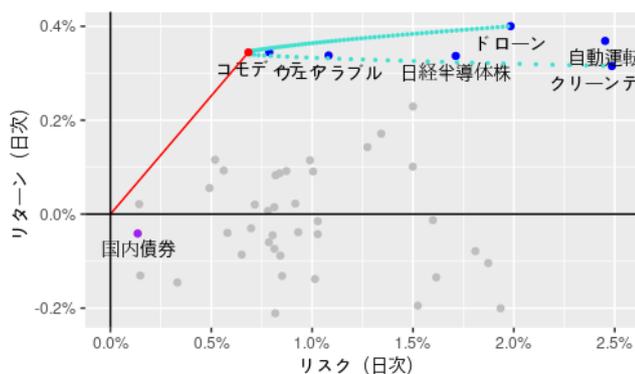
2025年1月11日

【半月】



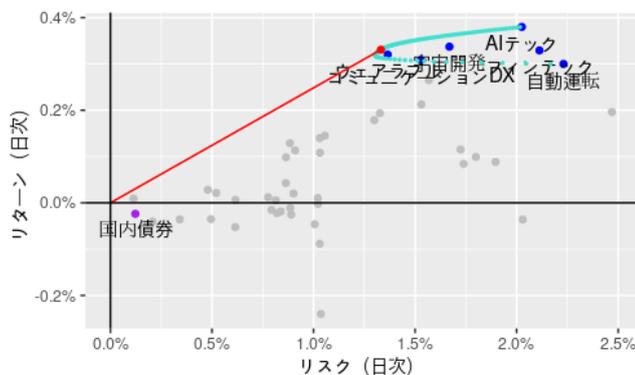
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.537%	0.421%	1.277	—
日経半導体株	0.976%	2.493%	0.392	0.0%
ナノテクノロジー	0.628%	1.446%	0.434	0.0%
クリーンテック	0.603%	3.183%	0.189	3.3%
コモディティ	0.557%	0.456%	1.221	88.0%
ロボット	0.390%	1.526%	0.255	0.0%
ウェアラブル	0.316%	0.838%	0.377	8.7%

【一ヶ月】



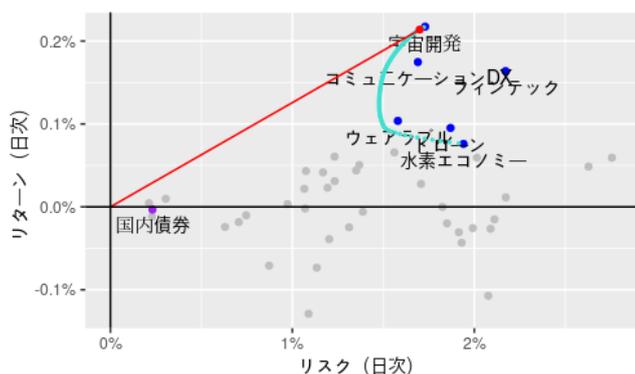
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.345%	0.684%	0.504	—
ドローン	0.400%	1.984%	0.202	0.0%
自動運転	0.369%	2.453%	0.150	6.4%
コモディティ	0.345%	0.787%	0.438	70.3%
ウェアラブル	0.338%	1.082%	0.312	16.1%
日経半導体株	0.337%	1.712%	0.197	7.3%
クリーンテック	0.315%	2.486%	0.127	0.0%

【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	0.331%	1.332%	0.248	—
AI テック	0.380%	2.026%	0.188	15.5%
宇宙開発	0.337%	1.669%	0.202	13.3%
フィンテック	0.329%	2.112%	0.156	0.0%
ウェアラブル	0.320%	1.365%	0.234	63.3%
コミュニケーション DX	0.308%	1.528%	0.202	7.9%
自動運転	0.300%	2.231%	0.134	0.0%

【半年】

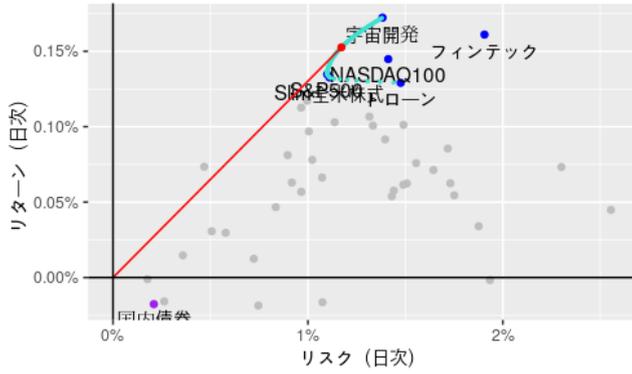


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.214%	1.700%	0.126	—
宇宙開発	0.217%	1.730%	0.126	91.7%
コミュニケーション DX	0.175%	1.690%	0.103	8.3%
フィンテック	0.164%	2.172%	0.075	0.0%
ウェアラブル	0.104%	1.580%	0.066	0.0%
ドローン	0.095%	1.869%	0.051	0.0%
水素エコノミー	0.076%	1.941%	0.039	0.0%

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。

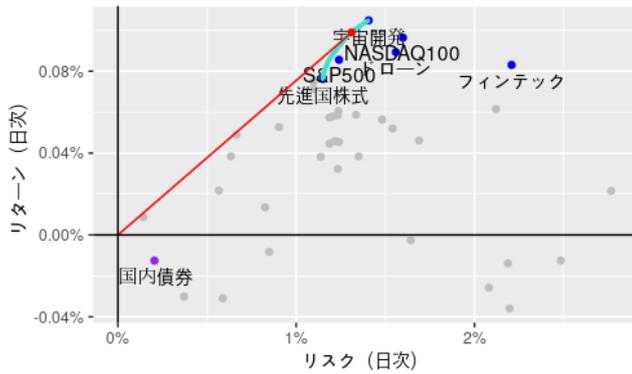
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.153%	1.172%	0.130	—
宇宙開発	0.172%	1.383%	0.125	47.6%
フィンテック	0.161%	1.906%	0.085	0.0%
NASDAQ100	0.145%	1.412%	0.103	0.0%
S&P500	0.135%	1.099%	0.123	52.4%
Slim 全米株式	0.133%	1.111%	0.119	0.0%
ドローン	0.129%	1.476%	0.087	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	0.099%	1.311%	0.075	—
宇宙開発	0.105%	1.407%	0.075	69.5%
NASDAQ100	0.096%	1.599%	0.060	0.0%
ドローン	0.089%	1.559%	0.057	0.0%
S&P500	0.086%	1.240%	0.069	30.5%
フィンテック	0.083%	2.208%	0.038	0.0%
先進国株式	0.076%	1.150%	0.066	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。