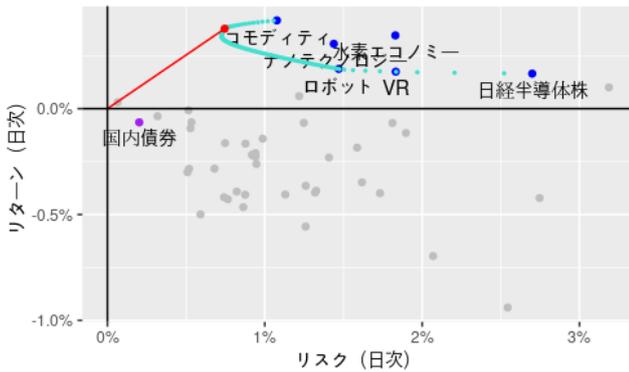


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

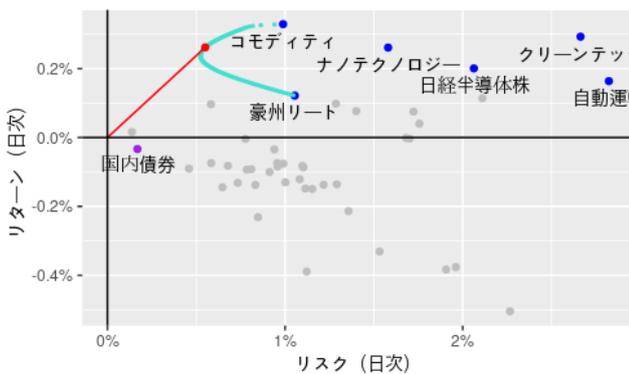
2025年1月17日

【半月】



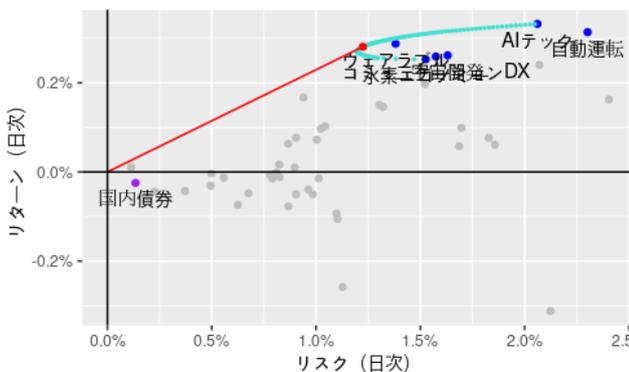
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.378%	0.745%	0.507	—
コモディティ	0.417%	1.077%	0.387	60.3%
水素エコノミー	0.346%	1.830%	0.189	12.5%
ナノテクノロジー	0.306%	1.439%	0.213	27.2%
ロボット	0.188%	1.470%	0.128	0.0%
VR	0.175%	1.832%	0.095	0.0%
日経半導体株	0.165%	2.699%	0.061	0.0%

【一ヶ月】



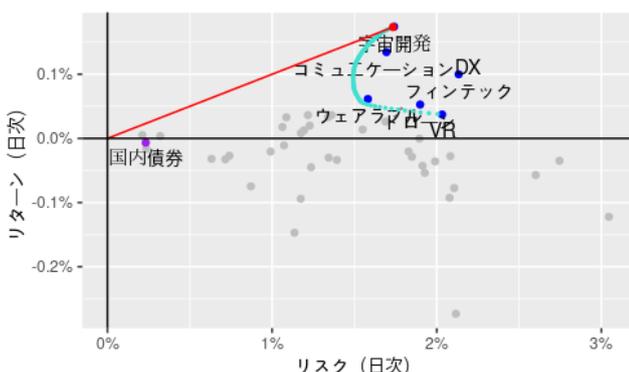
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.262%	0.550%	0.475	—
コモディティ	0.329%	0.989%	0.333	58.4%
クリーンテック	0.293%	2.663%	0.110	5.0%
ナノテクノロジー	0.261%	1.580%	0.165	7.5%
日経半導体株	0.201%	2.063%	0.097	0.0%
自動運転	0.164%	2.823%	0.058	0.0%
豪州リート	0.122%	1.055%	0.115	29.2%

【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	0.281%	1.225%	0.229	—
AI テック	0.332%	2.061%	0.161	9.1%
自動運転	0.314%	2.302%	0.136	0.0%
ウェアラブル	0.288%	1.381%	0.208	59.9%
宇宙開発	0.262%	1.631%	0.160	0.0%
コミュニケーション DX	0.259%	1.575%	0.164	0.0%
水素エコノミー	0.253%	1.526%	0.166	31.0%

【半年】

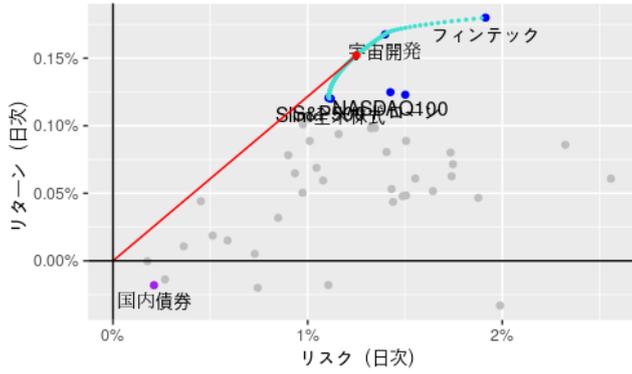


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.173%	1.734%	0.100	—
宇宙開発	0.174%	1.741%	0.100	98.3%
コミュニケーション DX	0.134%	1.695%	0.079	1.7%
フィンテック	0.100%	2.133%	0.047	0.0%
ウェアラブル	0.061%	1.582%	0.039	0.0%
ドローン	0.053%	1.899%	0.028	0.0%
VR	0.037%	2.033%	0.018	0.0%

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。

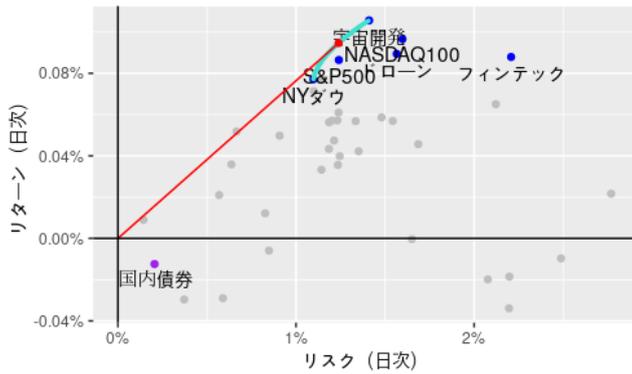
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.152%	1.250%	0.122	—
フィンテック	0.180%	1.914%	0.094	0.0%
宇宙開発	0.168%	1.398%	0.120	67.0%
NASDAQ100	0.125%	1.425%	0.088	0.0%
ドローン	0.123%	1.502%	0.082	0.0%
S&P500	0.121%	1.107%	0.109	33.0%
Slim 全米株式	0.120%	1.119%	0.107	0.0%

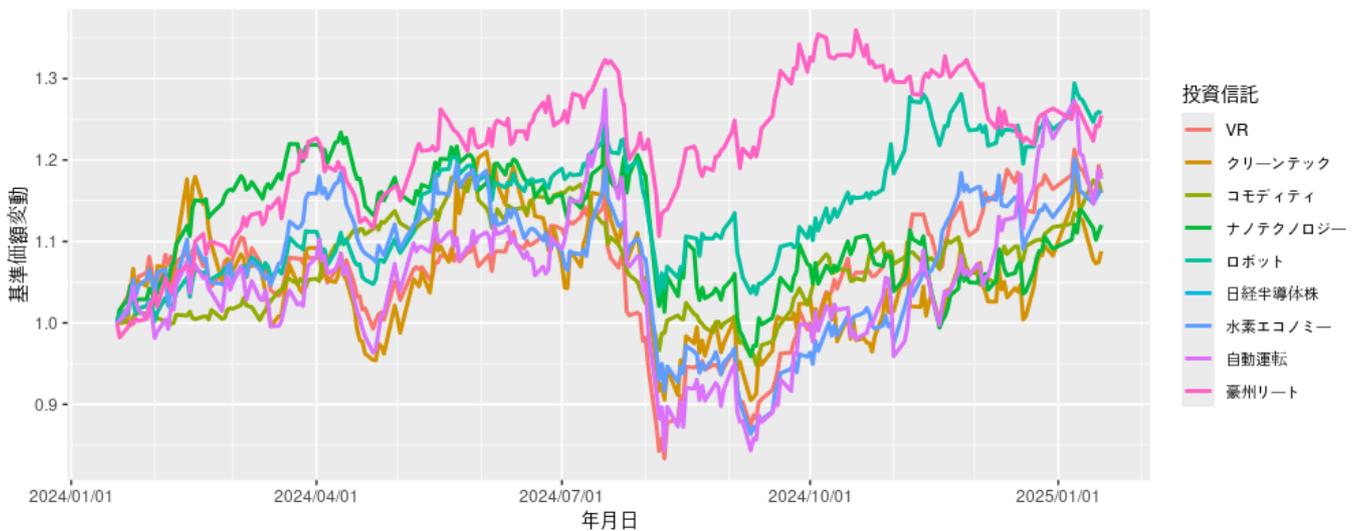
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.095%	1.239%	0.076	—
宇宙開発	0.106%	1.410%	0.075	60.2%
NASDAQ100	0.097%	1.597%	0.060	0.0%
ドローン	0.089%	1.565%	0.057	0.0%
フィンテック	0.088%	2.208%	0.040	0.0%
S&P500	0.086%	1.241%	0.070	3.9%
NY ダウ	0.077%	1.098%	0.070	35.8%

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。

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。