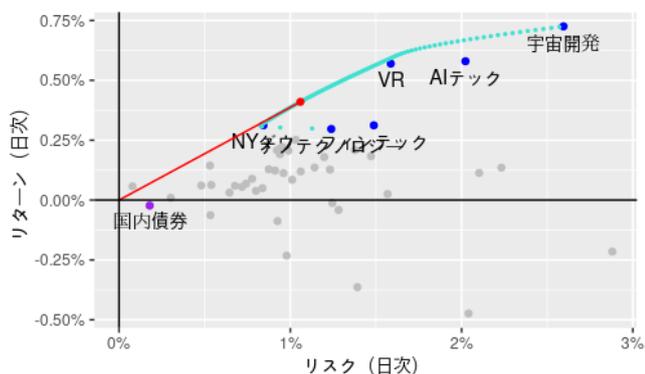


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

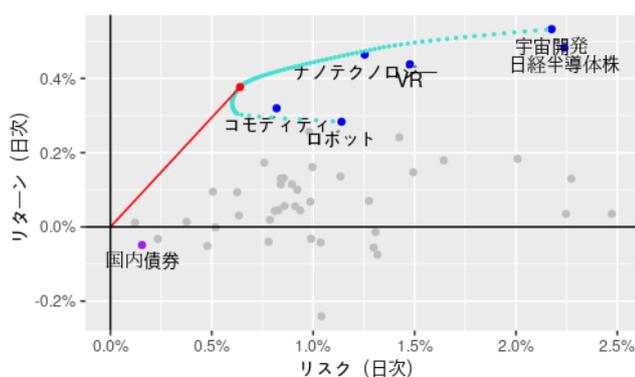
2025 年 1 月 24 日

【半月】



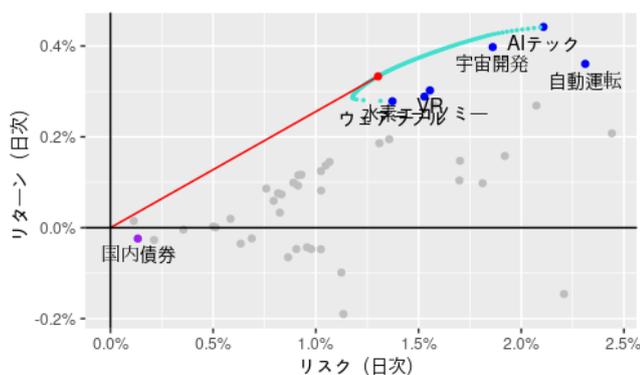
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.410%	1.059%	0.387	—
宇宙開発	0.725%	2.595%	0.279	9.8%
AI テック	0.580%	2.023%	0.287	0.0%
VR	0.570%	1.587%	0.359	22.3%
NY ダウ	0.312%	0.843%	0.370	67.8%
フィンテック	0.312%	1.488%	0.210	0.0%
ナノテクノロジー	0.297%	1.239%	0.239	0.0%

【一ヶ月】



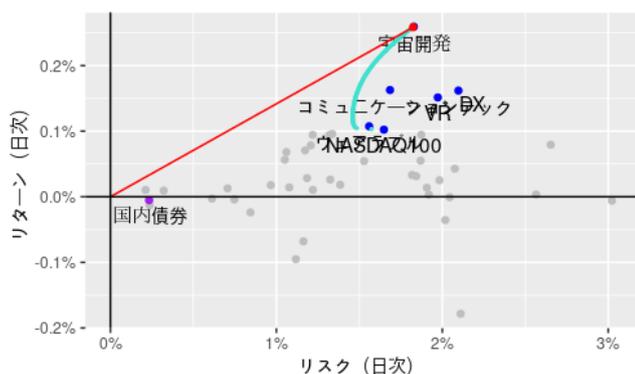
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.377%	0.639%	0.590	—
宇宙開発	0.533%	2.176%	0.245	6.1%
日経半導体株	0.483%	2.239%	0.216	1.7%
ナノテクノロジー	0.464%	1.254%	0.370	23.2%
VR	0.438%	1.477%	0.297	6.8%
コモディティ	0.320%	0.820%	0.390	61.8%
ロボット	0.283%	1.140%	0.249	0.4%

【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	0.333%	1.303%	0.256	—
AI テック	0.442%	2.108%	0.210	16.7%
宇宙開発	0.398%	1.861%	0.214	19.8%
自動運転	0.361%	2.312%	0.156	0.0%
VR	0.302%	1.555%	0.194	3.2%
水素エコノミー	0.289%	1.529%	0.189	30.6%
ウェアラブル	0.278%	1.373%	0.203	29.7%

【半年】

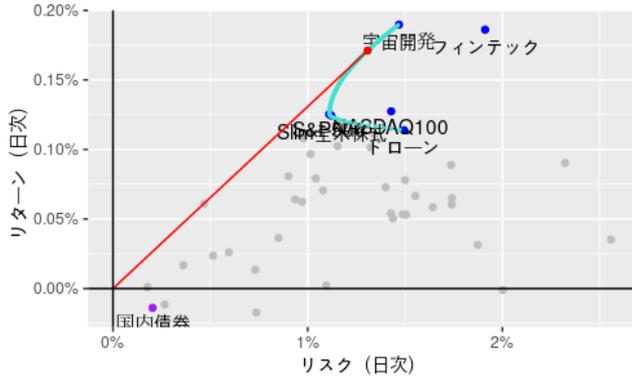


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.259%	1.824%	0.142	—
宇宙開発	0.259%	1.828%	0.142	99.2%
コミュニケーション DX	0.163%	1.685%	0.097	0.8%
フィンテック	0.162%	2.097%	0.077	0.0%
VR	0.151%	1.973%	0.077	0.0%
ウェアラブル	0.107%	1.559%	0.069	0.0%
NASDAQ100	0.102%	1.648%	0.062	0.0%

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。

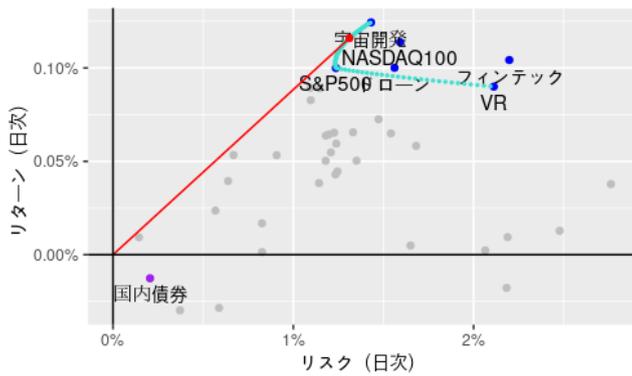
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.171%	1.308%	0.131	—
宇宙開発	0.190%	1.469%	0.129	71.1%
フィンテック	0.186%	1.911%	0.097	0.0%
NASDAQ100	0.127%	1.429%	0.089	0.0%
S&P500	0.125%	1.110%	0.113	28.9%
Slim 全米株式	0.124%	1.122%	0.111	0.0%
ドローン	0.114%	1.495%	0.076	0.0%

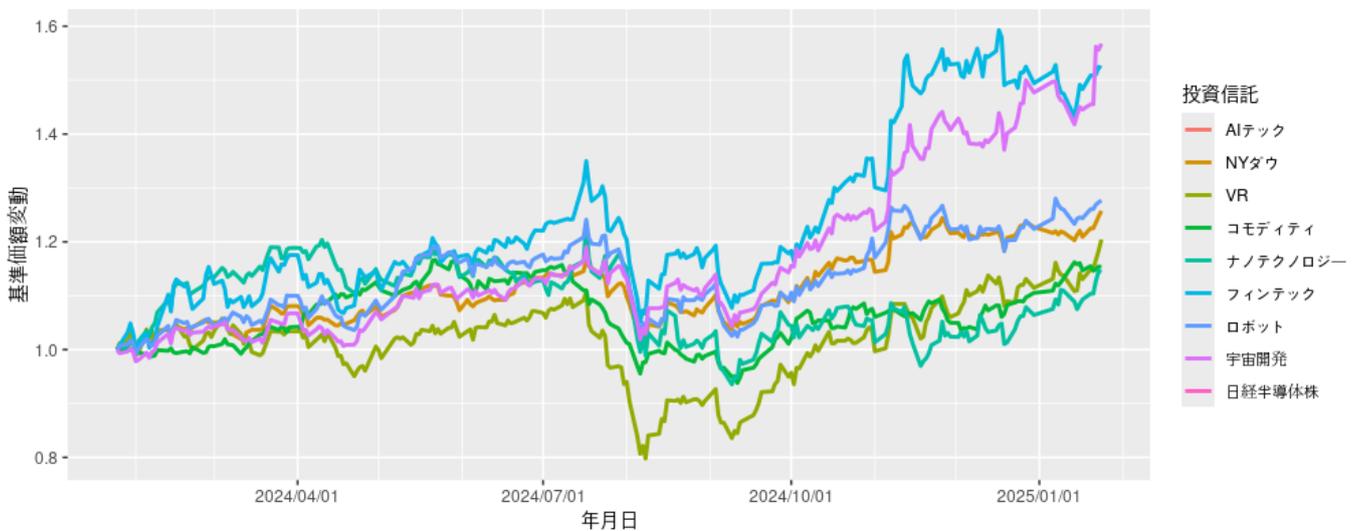
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.116%	1.311%	0.088	—
宇宙開発	0.124%	1.431%	0.087	65.5%
NASDAQ100	0.114%	1.592%	0.071	0.0%
フィンテック	0.104%	2.198%	0.047	0.0%
ドローン	0.100%	1.562%	0.064	0.0%
S&P500	0.100%	1.236%	0.081	34.5%
VR	0.090%	2.112%	0.043	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。