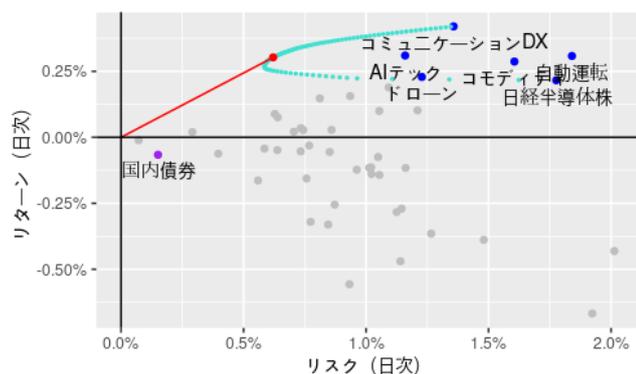


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

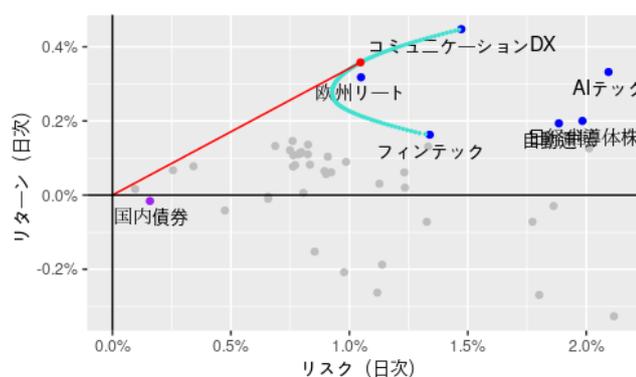
2025年2月15日

【半月】



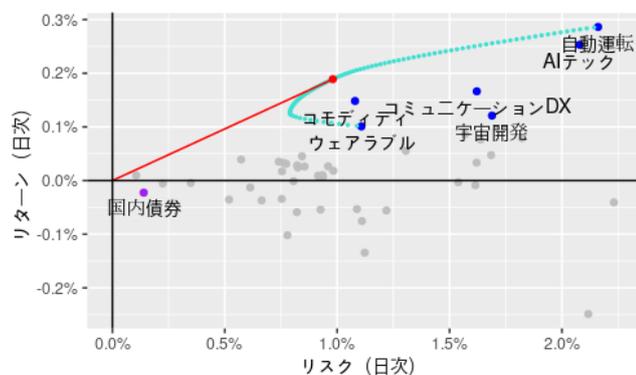
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.303%	0.621%	0.488	—
コミュニケーションDX	0.420%	1.357%	0.310	26.1%
AI テック	0.310%	1.159%	0.267	0.0%
自動運転	0.308%	1.840%	0.167	21.0%
コモディティ	0.287%	1.605%	0.179	17.5%
ドローン	0.229%	1.228%	0.186	13.7%
日経半導体株	0.216%	1.776%	0.122	21.7%

【一ヶ月】



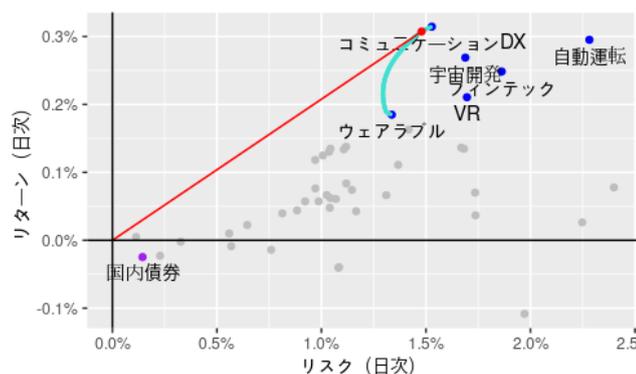
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.358%	1.047%	0.342	—
コミュニケーションDX	0.447%	1.473%	0.304	38.0%
AI テック	0.332%	2.094%	0.159	2.3%
欧州リート	0.318%	1.049%	0.303	51.5%
日経半導体株	0.200%	1.984%	0.101	8.1%
自動運転	0.194%	1.884%	0.103	0.0%
フィンテック	0.163%	1.339%	0.122	0.0%

【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	0.189%	0.981%	0.193	—
自動運転	0.286%	2.161%	0.133	28.2%
AI テック	0.253%	2.078%	0.122	2.7%
コミュニケーションDX	0.166%	1.621%	0.103	1.8%
コモディティ	0.148%	1.080%	0.137	64.5%
宇宙開発	0.121%	1.689%	0.072	0.0%
ウェアラブル	0.101%	1.108%	0.091	2.9%

【半年】

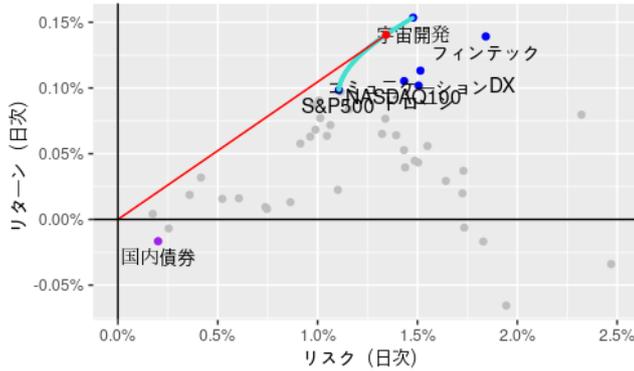


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.307%	1.479%	0.208	—
コミュニケーションDX	0.314%	1.528%	0.206	84.4%
自動運転	0.295%	2.282%	0.129	0.0%
宇宙開発	0.269%	1.688%	0.159	15.6%
フィンテック	0.248%	1.862%	0.133	0.0%
VR	0.211%	1.696%	0.124	0.0%
ウェアラブル	0.185%	1.337%	0.138	0.0%

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。

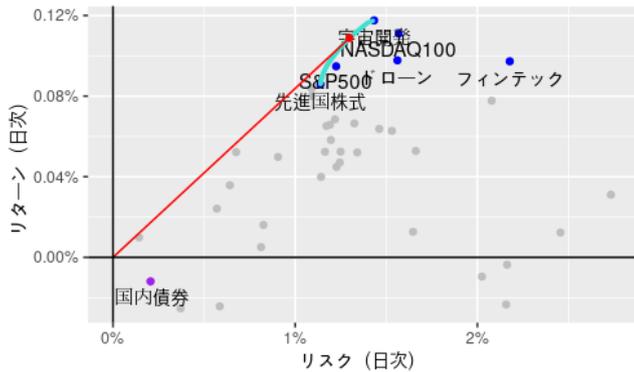
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.141%	1.343%	0.105	—
宇宙開発	0.154%	1.479%	0.104	75.9%
フィンテック	0.139%	1.842%	0.076	0.0%
コミュニケーション DX	0.113%	1.515%	0.075	2.1%
NASDAQ100	0.105%	1.434%	0.073	0.0%
ドローン	0.102%	1.506%	0.068	0.0%
S&P500	0.098%	1.107%	0.089	22.0%

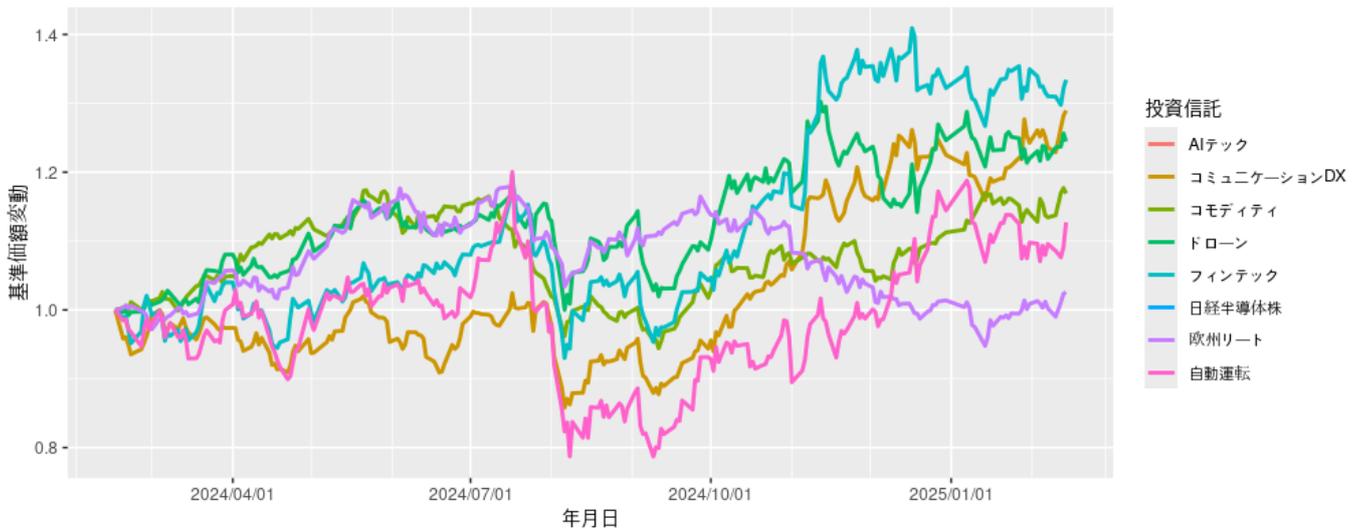
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.109%	1.298%	0.084	—
宇宙開発	0.118%	1.433%	0.082	61.7%
NASDAQ100	0.111%	1.568%	0.071	0.0%
ドローン	0.098%	1.561%	0.063	0.0%
フィンテック	0.097%	2.178%	0.045	0.0%
S&P500	0.095%	1.225%	0.077	38.3%
先進国株式	0.086%	1.139%	0.075	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。