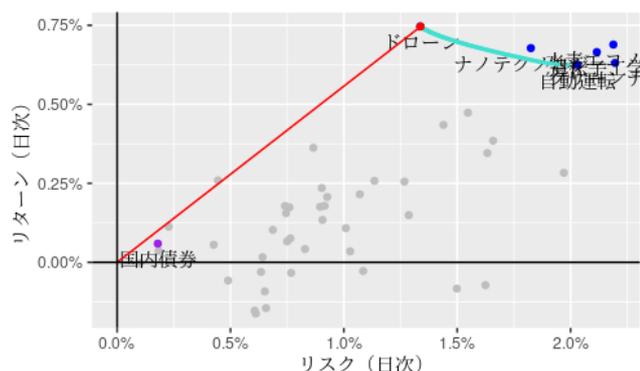


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

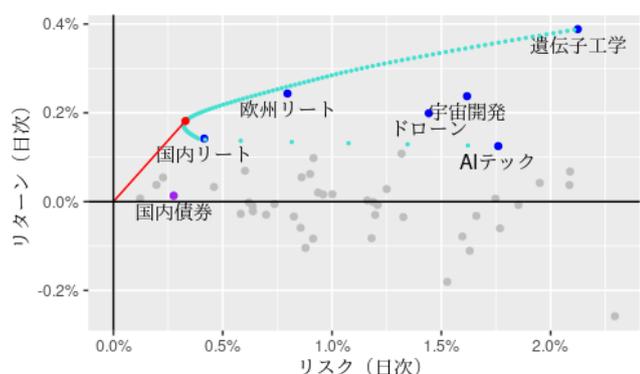
2025 年 6 月 14 日

【半月】



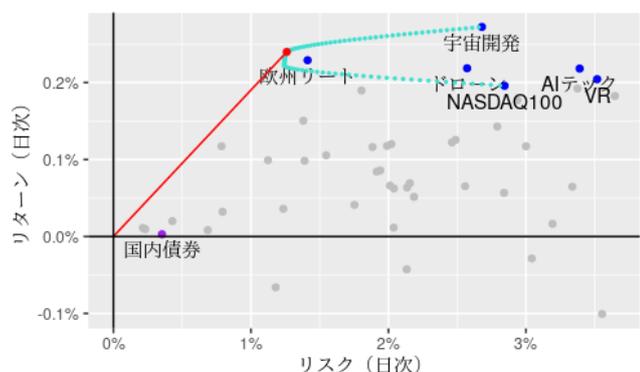
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.746%	1.338%	0.557	—
ドローン	0.747%	1.337%	0.558	99.5%
水素エコノミー	0.689%	2.189%	0.315	0.0%
ナノテクノロジー	0.678%	1.825%	0.371	0.0%
遺伝子工学	0.665%	2.116%	0.314	0.0%
クリーンテック	0.631%	2.196%	0.287	0.0%
自動運転	0.625%	2.030%	0.308	0.5%

【一ヶ月】



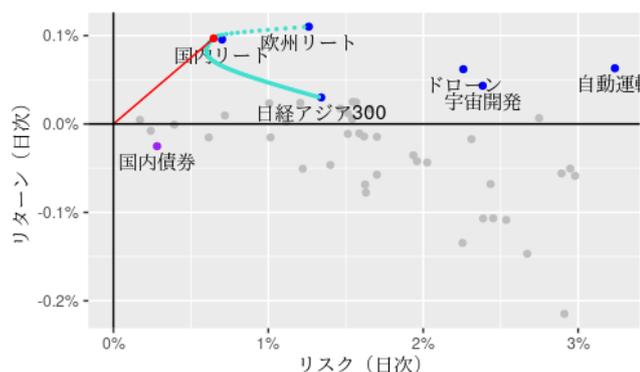
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.182%	0.330%	0.551	—
遺伝子工学	0.388%	2.124%	0.183	9.1%
欧州リート	0.243%	0.796%	0.306	16.9%
宇宙開発	0.237%	1.618%	0.147	0.0%
ドローン	0.199%	1.443%	0.138	0.0%
国内リート	0.142%	0.415%	0.342	74.0%
AI テック	0.125%	1.760%	0.071	0.0%

【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	0.240%	1.260%	0.190	—
宇宙開発	0.272%	2.680%	0.102	25.0%
欧州リート	0.229%	1.412%	0.162	75.0%
ドローン	0.219%	2.572%	0.085	0.0%
AI テック	0.218%	3.391%	0.064	0.0%
VR	0.204%	3.518%	0.058	0.0%
NASDAQ100	0.196%	2.844%	0.069	0.0%

【半年】

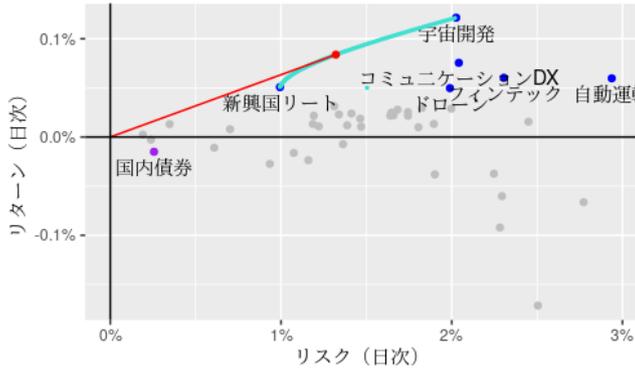


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.097%	0.647%	0.150	—
欧州リート	0.110%	1.261%	0.087	20.5%
国内リート	0.096%	0.701%	0.136	76.9%
自動運転	0.063%	3.238%	0.019	0.0%
ドローン	0.062%	2.259%	0.027	0.0%
宇宙開発	0.043%	2.384%	0.018	0.0%
日経アジア 300	0.030%	1.342%	0.022	2.6%

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。

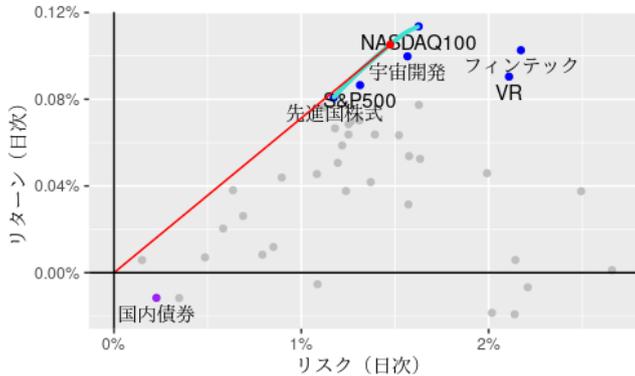
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.084%	1.321%	0.063	—
宇宙開発	0.121%	2.026%	0.060	46.8%
コミュニケーション DX	0.076%	2.041%	0.037	0.0%
フィンテック	0.060%	2.305%	0.026	0.0%
自動運転	0.060%	2.937%	0.020	0.0%
新興国リート	0.051%	0.994%	0.051	53.2%
ドローン	0.050%	1.989%	0.025	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	0.105%	1.476%	0.071	—
NASDAQ100	0.114%	1.626%	0.070	58.8%
フィンテック	0.103%	2.172%	0.047	0.0%
宇宙開発	0.100%	1.567%	0.064	27.2%
VR	0.090%	2.109%	0.043	0.0%
S&P500	0.086%	1.314%	0.066	0.0%
先進国株式	0.081%	1.174%	0.069	14.1%

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。