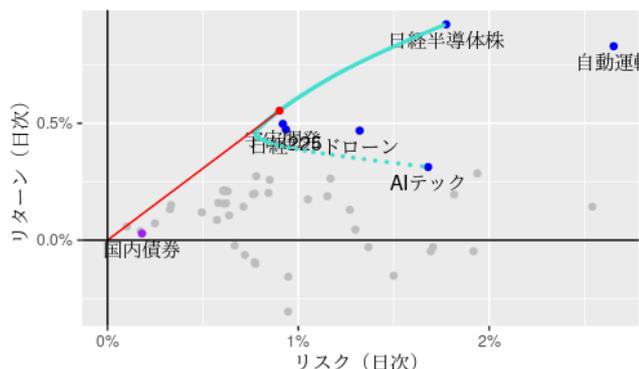


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

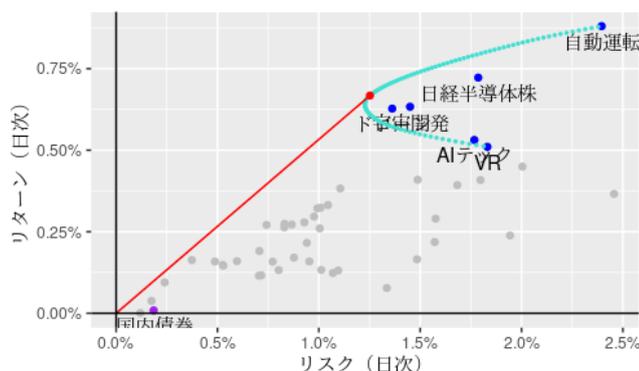
2025年6月28日

【半月】



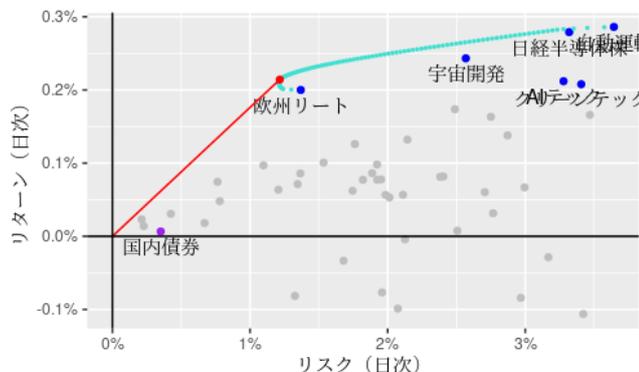
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.554%	0.901%	0.614	—
日経半導体株	0.923%	1.775%	0.520	11.4%
自動運転	0.829%	2.652%	0.313	4.9%
宇宙開発	0.497%	0.919%	0.541	48.4%
日経 225	0.474%	0.935%	0.507	35.3%
ドローン	0.468%	1.322%	0.355	0.0%
AI テック	0.313%	1.680%	0.186	0.0%

【一ヶ月】



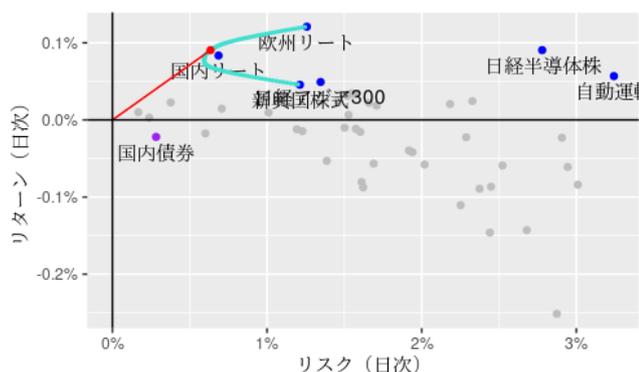
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.668%	1.252%	0.533	—
自動運転	0.880%	2.395%	0.368	4.8%
日経半導体株	0.723%	1.786%	0.405	27.5%
宇宙開発	0.633%	1.450%	0.437	29.9%
ドローン	0.628%	1.362%	0.461	37.8%
AI テック	0.531%	1.767%	0.301	0.0%
VR	0.510%	1.832%	0.279	0.0%

【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	0.214%	1.216%	0.176	—
自動運転	0.286%	3.644%	0.079	0.0%
日経半導体株	0.279%	3.319%	0.084	8.5%
宇宙開発	0.243%	2.568%	0.095	17.4%
AI テック	0.212%	3.278%	0.065	0.0%
クリーンテック	0.208%	3.407%	0.061	0.0%
欧州リート	0.200%	1.369%	0.146	74.1%

【半年】

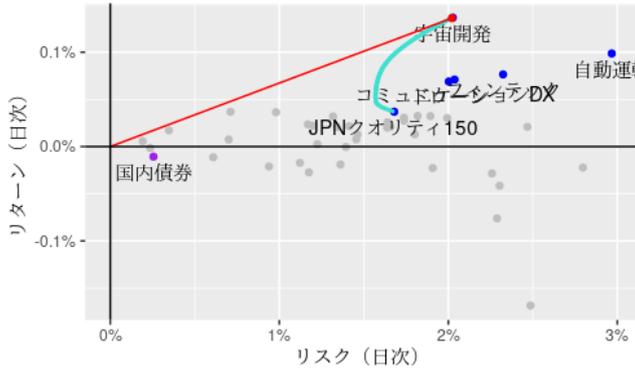


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.090%	0.634%	0.143	—
欧州リート	0.121%	1.258%	0.096	23.8%
日経半導体株	0.091%	2.779%	0.033	0.0%
国内リート	0.083%	0.686%	0.122	70.5%
自動運転	0.057%	3.243%	0.018	0.0%
日経アジア 300	0.049%	1.347%	0.036	5.7%
新興国株式	0.046%	1.212%	0.038	0.0%

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。

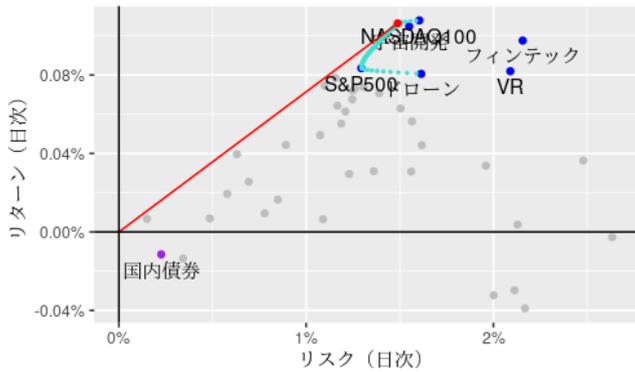
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.136%	2.021%	0.067	—
宇宙開発	0.137%	2.026%	0.067	99.5%
自動運転	0.099%	2.967%	0.033	0.0%
フィンテック	0.076%	2.324%	0.033	0.0%
コミュニケーション DX	0.071%	2.037%	0.035	0.0%
ドローン	0.069%	2.002%	0.034	0.0%
JPN クオリティ 150	0.037%	1.680%	0.022	0.5%

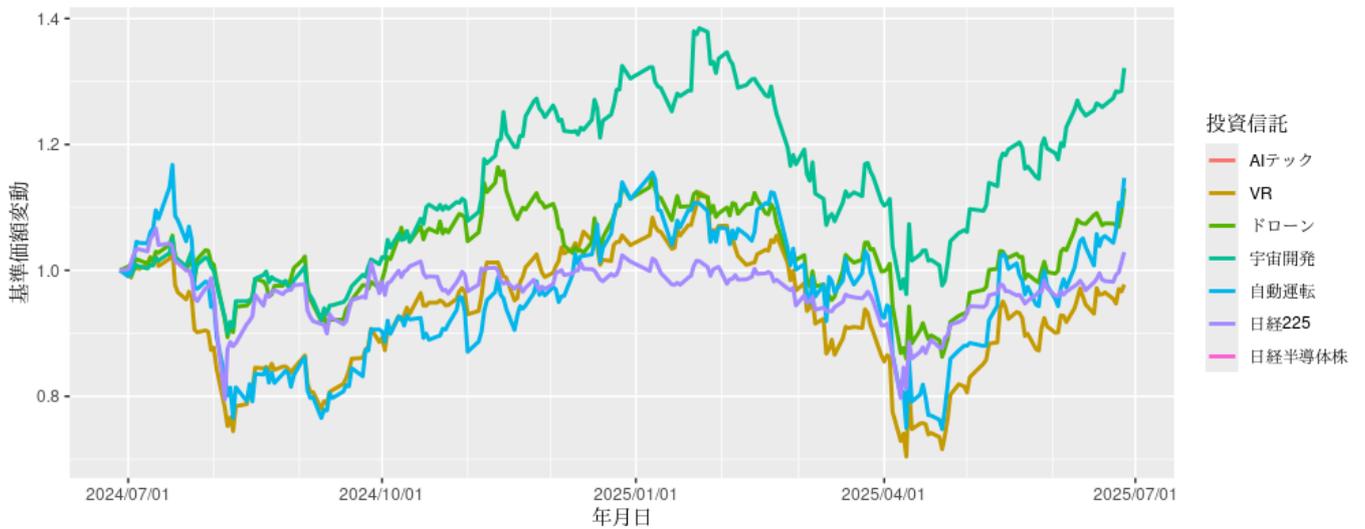
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.106%	1.489%	0.071	—
NASDAQ100	0.108%	1.604%	0.067	50.9%
宇宙開発	0.105%	1.550%	0.068	49.1%
フィンテック	0.098%	2.156%	0.045	0.0%
S&P500	0.083%	1.295%	0.064	0.0%
VR	0.082%	2.090%	0.039	0.0%
ドローン	0.081%	1.615%	0.050	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。