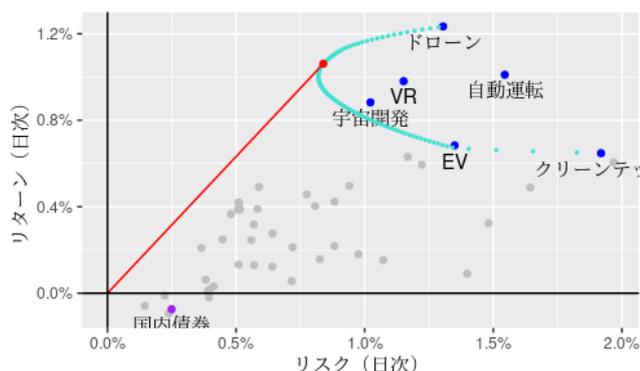


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

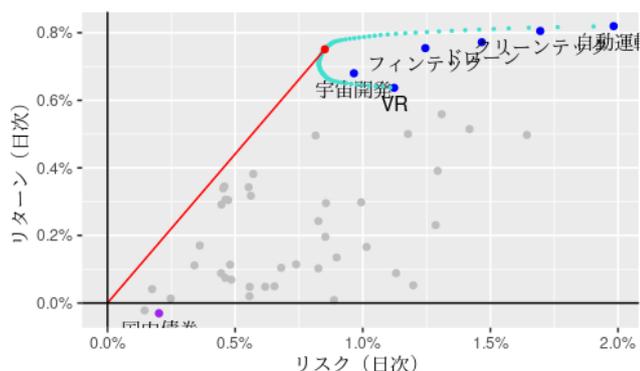
2025 年 7 月 19 日

【半月】



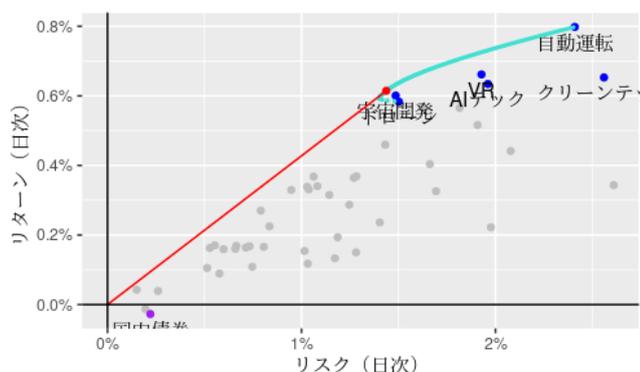
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	1.061%	0.839%	1.265	—
ドローン	1.234%	1.305%	0.946	42.7%
自動運転	1.010%	1.545%	0.654	0.0%
VR	0.981%	1.151%	0.852	33.6%
宇宙開発	0.883%	1.022%	0.863	21.8%
EV	0.684%	1.350%	0.507	0.0%
クリーンテック	0.648%	1.919%	0.338	1.9%

【一ヶ月】



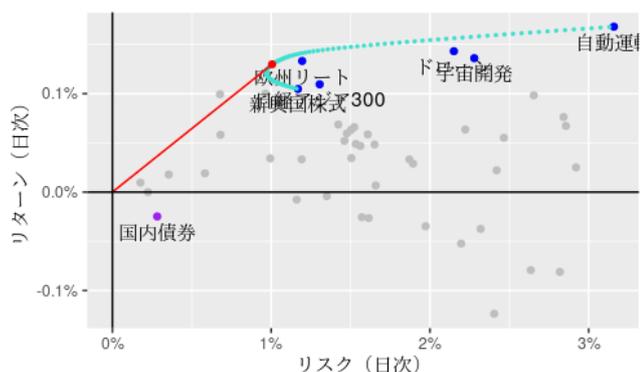
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.751%	0.851%	0.882	—
自動運転	0.819%	1.983%	0.413	0.0%
クリーンテック	0.805%	1.695%	0.475	9.7%
ドローン	0.772%	1.466%	0.526	33.8%
フィンテック	0.754%	1.245%	0.606	37.3%
宇宙開発	0.680%	0.965%	0.704	19.2%
VR	0.637%	1.123%	0.567	0.0%

【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	0.614%	1.437%	0.428	—
自動運転	0.798%	2.409%	0.331	9.8%
VR	0.662%	1.928%	0.343	2.0%
クリーンテック	0.653%	2.559%	0.255	0.0%
AI テック	0.634%	1.961%	0.323	0.0%
宇宙開発	0.601%	1.486%	0.404	48.8%
ドローン	0.583%	1.502%	0.388	39.3%

【半年】

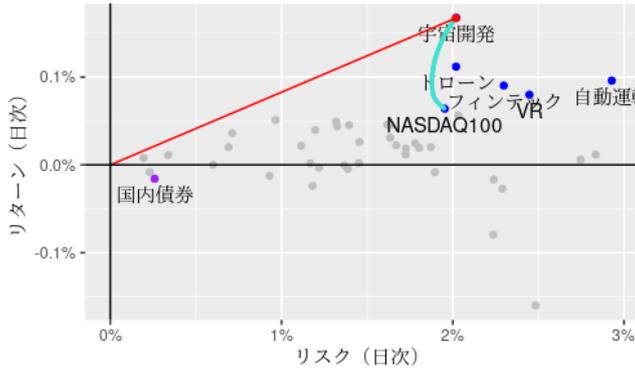


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.130%	1.005%	0.129	—
自動運転	0.168%	3.159%	0.053	0.0%
ドローン	0.143%	2.151%	0.067	16.4%
宇宙開発	0.136%	2.279%	0.060	0.0%
欧州リート	0.133%	1.195%	0.111	62.3%
日経アジア 300	0.109%	1.306%	0.084	21.3%
新興国株式	0.105%	1.169%	0.090	0.0%

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。

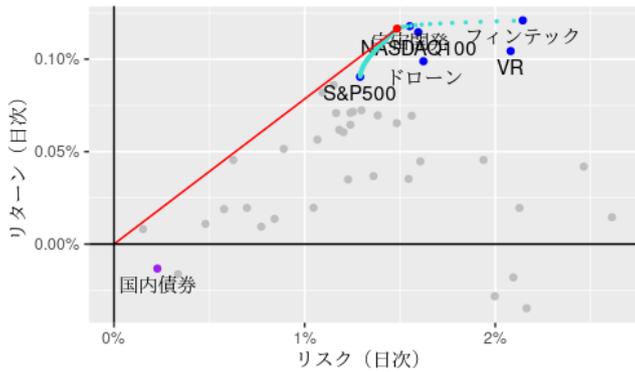
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.167%	2.018%	0.083	—
宇宙開発	0.168%	2.020%	0.083	99.1%
ドローン	0.112%	2.019%	0.055	0.9%
自動運転	0.096%	2.928%	0.033	0.0%
フィンテック	0.090%	2.298%	0.039	0.0%
VR	0.080%	2.447%	0.033	0.0%
NASDAQ100	0.064%	1.954%	0.033	0.0%

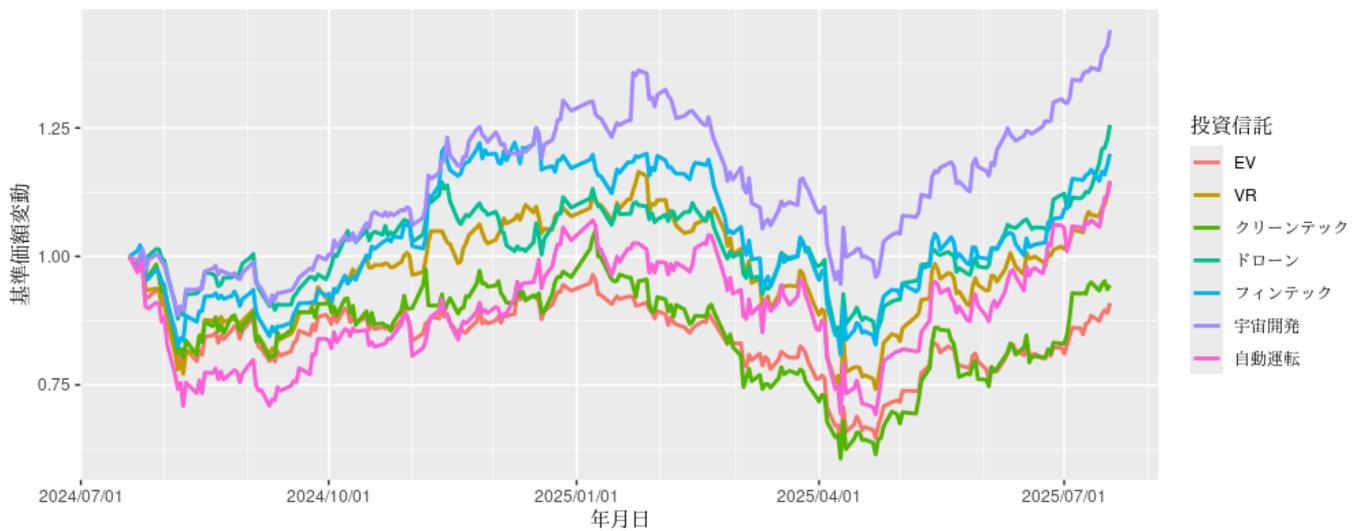
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.117%	1.485%	0.078	—
フィンテック	0.121%	2.144%	0.056	0.0%
宇宙開発	0.118%	1.551%	0.076	61.0%
NASDAQ100	0.115%	1.596%	0.072	38.8%
VR	0.104%	2.081%	0.050	0.0%
ドローン	0.099%	1.623%	0.061	0.0%
S&P500	0.090%	1.291%	0.070	0.2%

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。