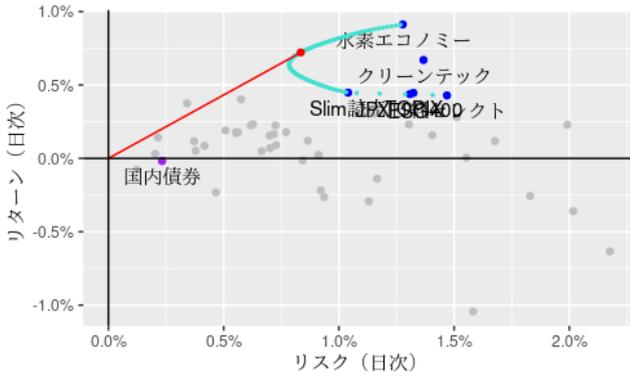


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

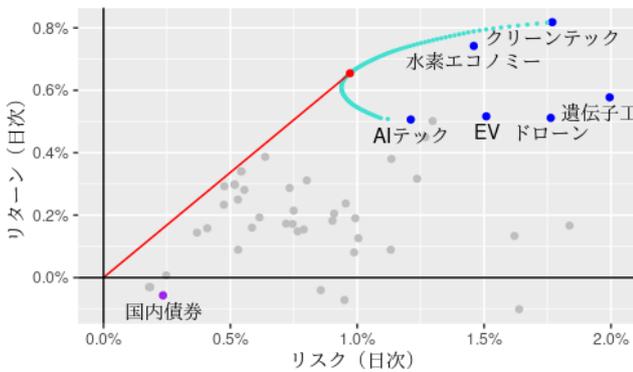
2025年8月3日

【半月】



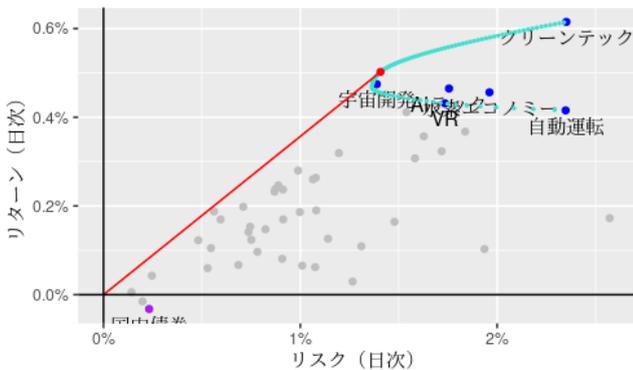
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.722%	0.835%	0.864	—
水素エコノミー	0.913%	1.277%	0.715	49.4%
クリーンテック	0.670%	1.367%	0.490	19.9%
Slim 読売	0.448%	1.040%	0.431	30.7%
TOPIX	0.446%	1.323%	0.337	0.0%
JPX 日経 400	0.438%	1.308%	0.335	0.0%
ESG セレクト	0.429%	1.469%	0.292	0.0%

【一ヶ月】



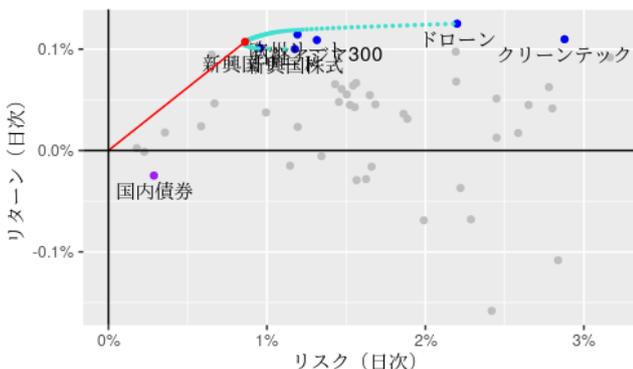
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.655%	0.971%	0.674	—
クリーンテック	0.818%	1.769%	0.463	21.5%
水素エコノミー	0.742%	1.459%	0.508	33.9%
遺伝子工学	0.577%	1.995%	0.289	0.0%
EV	0.517%	1.509%	0.342	0.0%
ドローン	0.512%	1.763%	0.290	22.4%
AI テック	0.506%	1.211%	0.418	22.1%

【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	0.502%	1.407%	0.357	—
クリーンテック	0.615%	2.352%	0.261	19.7%
宇宙開発	0.475%	1.388%	0.342	80.3%
AI テック	0.465%	1.755%	0.265	0.0%
水素エコノミー	0.456%	1.961%	0.233	0.0%
VR	0.431%	1.735%	0.249	0.0%
自動運転	0.415%	2.348%	0.177	0.0%

【半年】

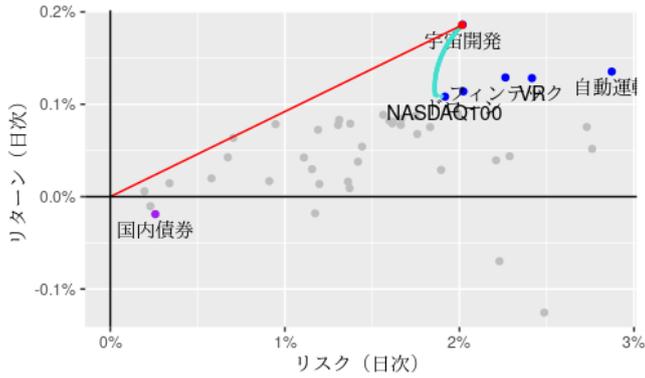


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.107%	0.863%	0.124	—
ドローン	0.125%	2.200%	0.057	0.9%
欧州リート	0.114%	1.193%	0.096	36.9%
クリーンテック	0.110%	2.878%	0.038	0.0%
日経アジア 300	0.109%	1.315%	0.083	11.9%
新興国リート	0.101%	0.957%	0.106	50.3%
新興国株式	0.100%	1.176%	0.085	0.0%

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。

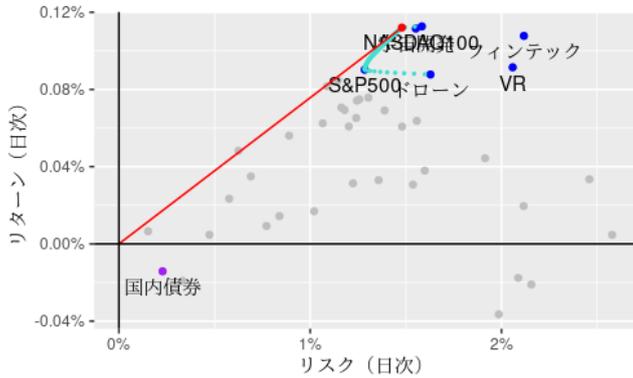
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.186%	2.016%	0.092	—
宇宙開発	0.186%	2.018%	0.092	99.5%
自動運転	0.135%	2.872%	0.047	0.0%
フィンテック	0.129%	2.263%	0.057	0.0%
VR	0.128%	2.415%	0.053	0.0%
ドローン	0.114%	2.022%	0.056	0.0%
NASDAQ100	0.108%	1.917%	0.056	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	0.112%	1.479%	0.076	—
NASDAQ100	0.113%	1.584%	0.071	47.1%
宇宙開発	0.112%	1.552%	0.072	52.7%
フィンテック	0.108%	2.117%	0.051	0.0%
VR	0.091%	2.059%	0.044	0.0%
S&P500	0.090%	1.285%	0.070	0.1%
ドローン	0.088%	1.629%	0.054	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。