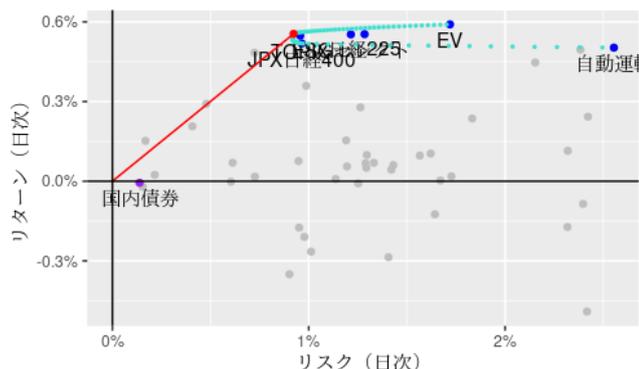


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

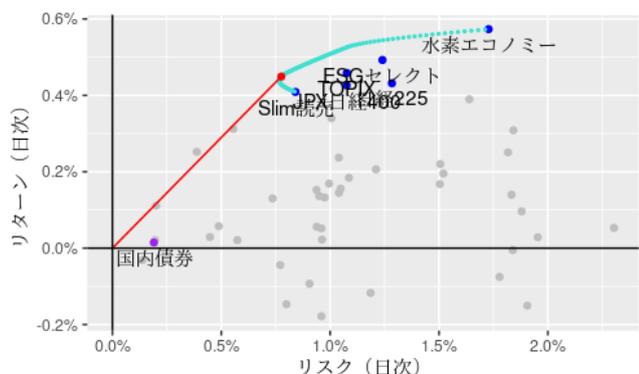
2025年8月16日

【半月】



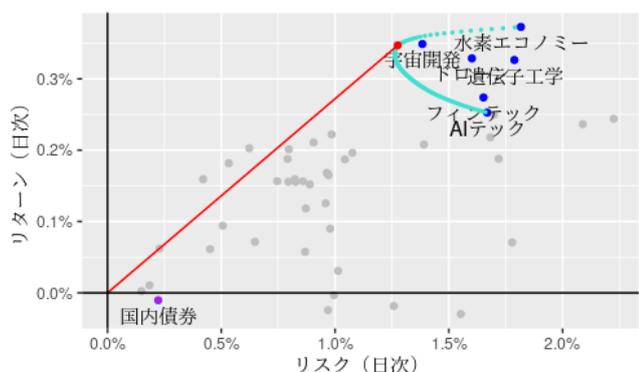
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.555%	0.923%	0.601	—
EV	0.590%	1.719%	0.343	16.3%
日経 225	0.554%	1.284%	0.431	0.0%
ESG セレクト	0.553%	1.215%	0.455	0.0%
TOPIX	0.548%	0.957%	0.573	83.7%
JPX 日経 400	0.518%	0.964%	0.538	0.0%
自動運転	0.503%	2.554%	0.197	0.0%

【一ヶ月】



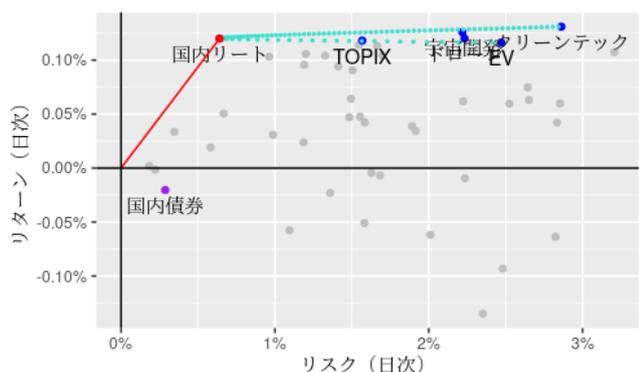
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.449%	0.775%	0.579	—
水素エコノミー	0.573%	1.728%	0.332	24.5%
ESG セレクト	0.493%	1.240%	0.397	0.0%
TOPIX	0.459%	1.077%	0.426	0.0%
日経 225	0.432%	1.284%	0.336	0.0%
JPX 日経 400	0.426%	1.076%	0.396	0.0%
Slim 読売	0.409%	0.841%	0.486	75.5%

【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	0.347%	1.275%	0.272	—
水素エコノミー	0.373%	1.817%	0.205	15.5%
宇宙開発	0.349%	1.384%	0.252	58.8%
ドローン	0.329%	1.601%	0.205	8.0%
遺伝子工学	0.326%	1.788%	0.183	17.7%
フィンテック	0.274%	1.652%	0.166	0.0%
AI テック	0.253%	1.669%	0.151	0.0%

【半年】

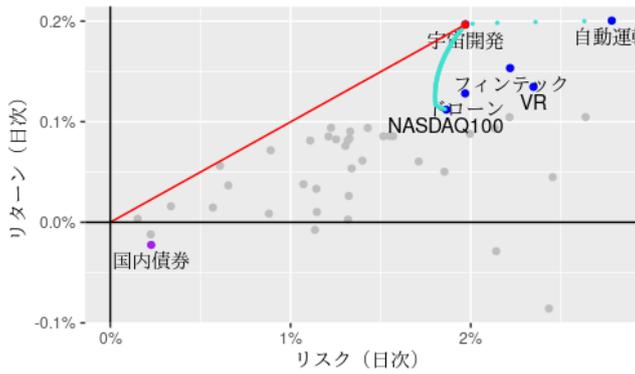


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.120%	0.640%	0.187	—
クリーンテック	0.131%	2.862%	0.046	0.4%
宇宙開発	0.126%	2.218%	0.057	0.0%
ドローン	0.120%	2.232%	0.054	0.0%
国内リート	0.120%	0.641%	0.187	98.8%
TOPIX	0.118%	1.567%	0.075	0.0%
EV	0.116%	2.471%	0.047	0.8%

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。

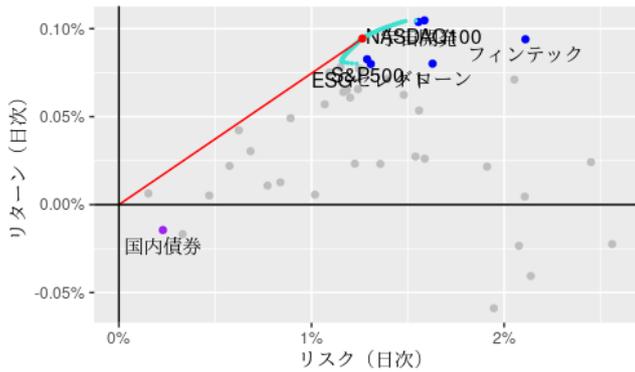
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.197%	1.969%	0.100	—
自動運転	0.200%	2.782%	0.072	0.0%
宇宙開発	0.197%	1.971%	0.100	99.6%
フィンテック	0.153%	2.218%	0.069	0.0%
VR	0.135%	2.348%	0.057	0.0%
ドローン	0.128%	1.969%	0.065	0.0%
NASDAQ100	0.112%	1.865%	0.060	0.4%

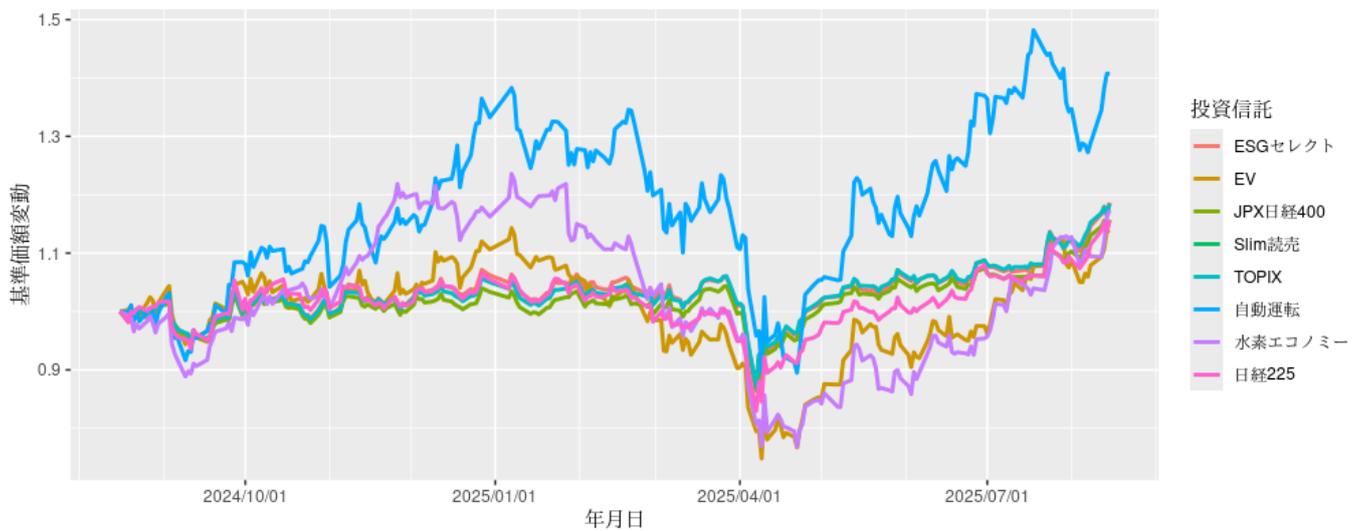
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.094%	1.264%	0.075	—
NASDAQ100	0.105%	1.586%	0.066	25.7%
宇宙開発	0.104%	1.555%	0.067	34.1%
フィンテック	0.094%	2.110%	0.045	0.0%
S&P500	0.083%	1.289%	0.064	0.0%
ドローン	0.080%	1.628%	0.049	0.0%
ESG セレクト	0.080%	1.308%	0.061	40.3%

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。