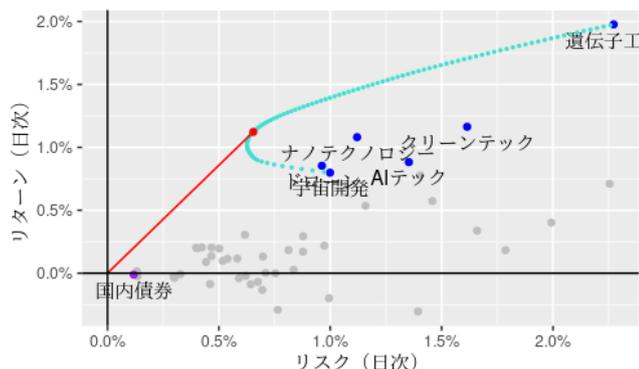


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

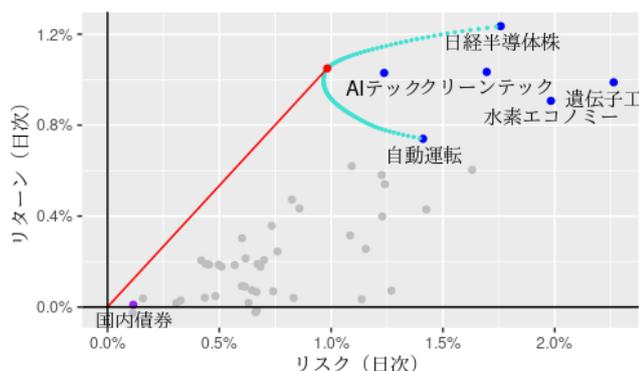
2025 年 10 月 4 日

【半月】



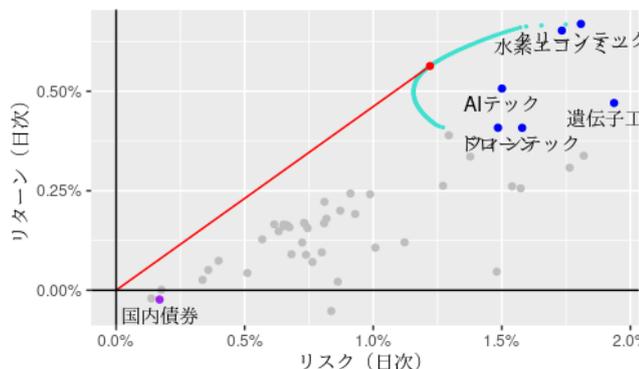
| eMAXIS     | リターン   | リスク    | t 値   | 割合    |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 1.123% | 0.655% | 1.715 | —     |
| 遺伝子工学      | 1.977% | 2.272% | 0.870 | 17.8% |
| クリーンテック    | 1.163% | 1.615% | 0.721 | 24.1% |
| ナノテクノロジー   | 1.081% | 1.121% | 0.964 | 0.0%  |
| AI テック     | 0.883% | 1.353% | 0.652 | 0.0%  |
| ドローン       | 0.854% | 0.963% | 0.887 | 46.6% |
| 宇宙開発       | 0.798% | 0.999% | 0.799 | 11.4% |

【一ヶ月】



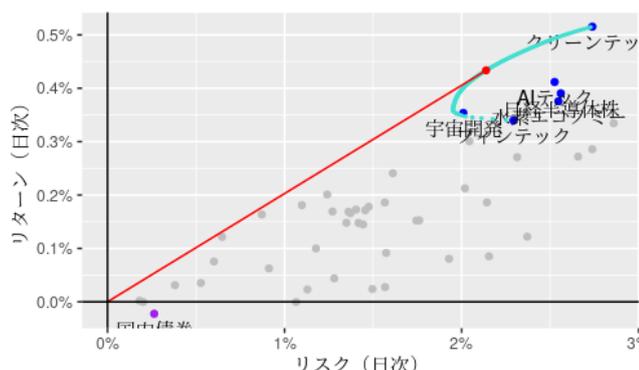
| eMAXIS     | リターン   | リスク    | t 値   | 割合    |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 1.050% | 0.983% | 1.068 | —     |
| 日経半導体株     | 1.235% | 1.758% | 0.703 | 16.8% |
| クリーンテック    | 1.034% | 1.696% | 0.610 | 12.6% |
| AI テック     | 1.030% | 1.237% | 0.832 | 46.5% |
| 遺伝子工学      | 0.988% | 2.263% | 0.437 | 17.7% |
| 水素エコノミー    | 0.907% | 1.983% | 0.457 | 6.4%  |
| 自動運転       | 0.740% | 1.411% | 0.525 | 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 | 0.564% | 1.221% | 0.462 | —     |
| クリーンテック    | 0.669% | 1.808% | 0.370 | 28.2% |
| 水素エコノミー    | 0.653% | 1.734% | 0.377 | 23.8% |
| AI テック     | 0.507% | 1.501% | 0.338 | 18.7% |
| 遺伝子工学      | 0.471% | 1.937% | 0.243 | 8.1%  |
| ドローン       | 0.408% | 1.485% | 0.275 | 21.3% |
| フィンテック     | 0.408% | 1.579% | 0.258 | 0.0%  |

【半年】

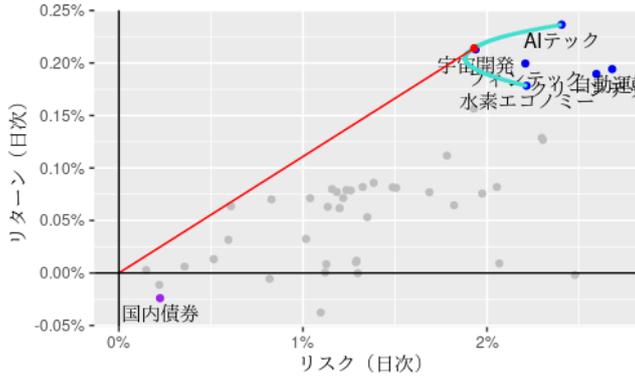


| eMAXIS     | リターン   | リスク    | t 値   | 割合    |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.434% | 2.138% | 0.203 | —     |
| クリーンテック    | 0.515% | 2.738% | 0.188 | 44.5% |
| AI テック     | 0.412% | 2.525% | 0.163 | 0.0%  |
| 日経半導体株     | 0.391% | 2.560% | 0.153 | 21.7% |
| 水素エコノミー    | 0.376% | 2.547% | 0.148 | 0.0%  |
| 宇宙開発       | 0.354% | 2.010% | 0.176 | 33.8% |
| フィンテック     | 0.340% | 2.292% | 0.148 | 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。

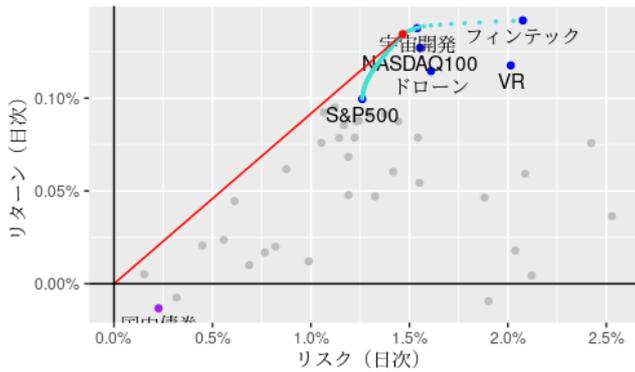
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



| eMAXIS     | リターン   | リスク    | t 値   | 割合    |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.214% | 1.931% | 0.111 | —     |
| AI テック     | 0.236% | 2.406% | 0.098 | 12.5% |
| 宇宙開発       | 0.213% | 1.939% | 0.110 | 80.0% |
| フィンテック     | 0.200% | 2.209% | 0.090 | 0.0%  |
| 自動運転       | 0.194% | 2.681% | 0.072 | 0.0%  |
| クリーンテック    | 0.190% | 2.595% | 0.073 | 7.5%  |
| 水素エコノミー    | 0.178% | 2.215% | 0.080 | 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 | 0.134% | 1.466% | 0.092 | —     |
| フィンテック     | 0.142% | 2.076% | 0.068 | 0.0%  |
| 宇宙開発       | 0.138% | 1.540% | 0.089 | 69.3% |
| NASDAQ100  | 0.127% | 1.553% | 0.082 | 30.7% |
| VR         | 0.118% | 2.015% | 0.058 | 0.0%  |
| ドローン       | 0.115% | 1.610% | 0.071 | 0.0%  |
| S&P500     | 0.099% | 1.260% | 0.079 | 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。