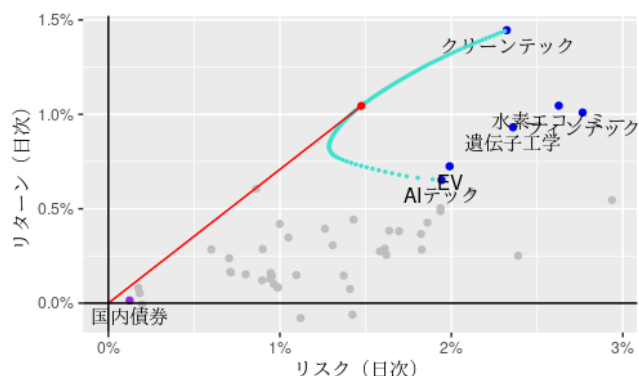


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

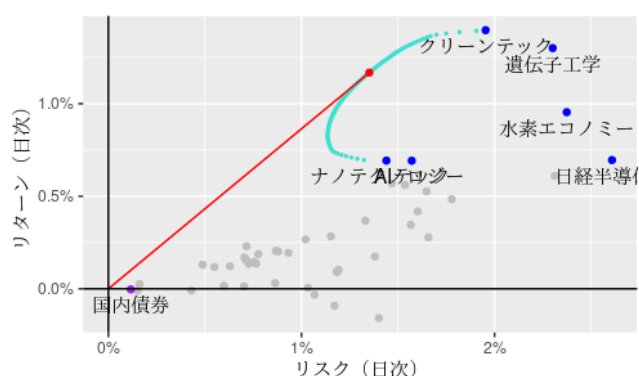
2025 年 10 月 18 日

【半月】



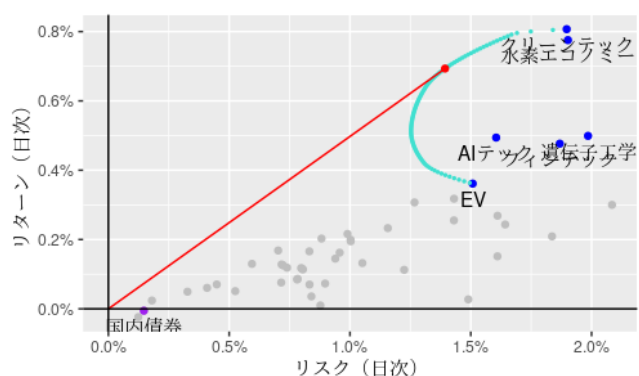
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	1.045%	1.475%	0.708	—
クリーンテック	1.446%	2.323%	0.622	27.8%
水素エコノミー	1.046%	2.626%	0.398	29.8%
フィンテック	1.010%	2.765%	0.365	0.0%
遺伝子工学	0.931%	2.360%	0.395	19.6%
EV	0.725%	1.990%	0.364	0.0%
AI テック	0.652%	1.943%	0.336	22.8%

【一ヶ月】



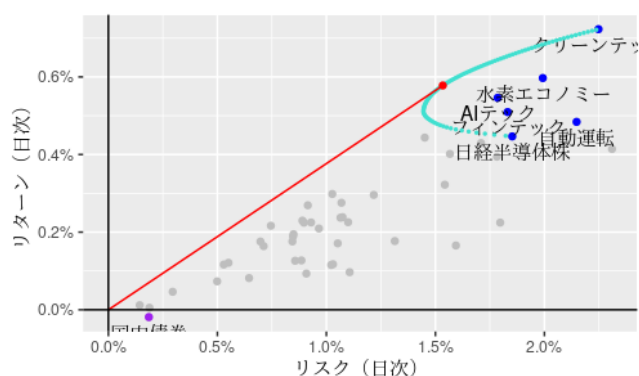
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	1.168%	1.351%	0.864	—
クリーンテック	1.397%	1.954%	0.715	31.3%
遺伝子工学	1.300%	2.301%	0.565	32.5%
水素エコノミー	0.954%	2.374%	0.402	22.0%
日経半導体株	0.695%	2.608%	0.267	0.0%
ナノテクノロジー	0.692%	1.440%	0.481	3.1%
AI テック	0.692%	1.571%	0.440	11.1%

【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	0.693%	1.393%	0.498	—
クリーンテック	0.807%	1.897%	0.425	31.9%
水素エコノミー	0.776%	1.902%	0.408	35.1%
遺伝子工学	0.499%	1.985%	0.251	11.6%
AI テック	0.494%	1.605%	0.308	21.4%
フィンテック	0.477%	1.868%	0.255	0.0%
EV	0.361%	1.508%	0.240	0.0%

【半年】

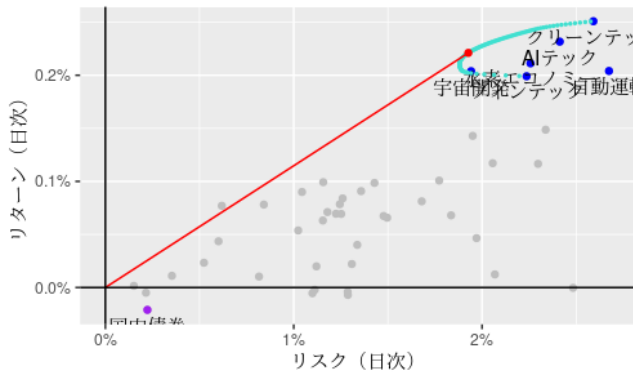


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.578%	1.534%	0.377	—
クリーンテック	0.723%	2.248%	0.322	27.4%
水素エコノミー	0.597%	1.993%	0.300	16.5%
AI テック	0.546%	1.786%	0.306	30.7%
フィンテック	0.509%	1.831%	0.278	0.0%
自動運転	0.484%	2.148%	0.225	0.0%
日経半導体株	0.447%	1.852%	0.241	25.3%

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。

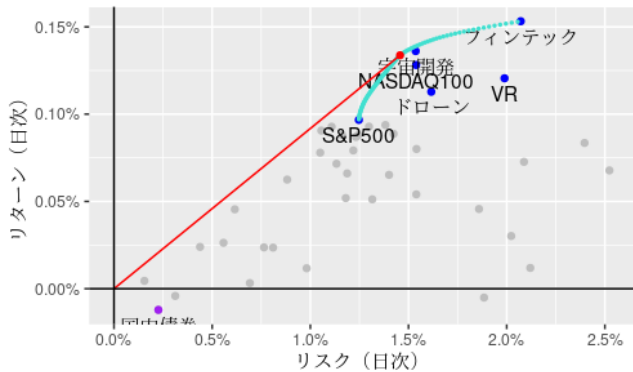
（２）リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.221%	1.927%	0.115	—
クリーンテック	0.251%	2.591%	0.097	35.9%
AI テック	0.232%	2.412%	0.096	1.2%
水素エコノミー	0.211%	2.257%	0.094	0.0%
自動運転	0.204%	2.674%	0.076	0.0%
宇宙開発	0.204%	1.942%	0.105	62.8%
フィンテック	0.199%	2.236%	0.089	0.0%

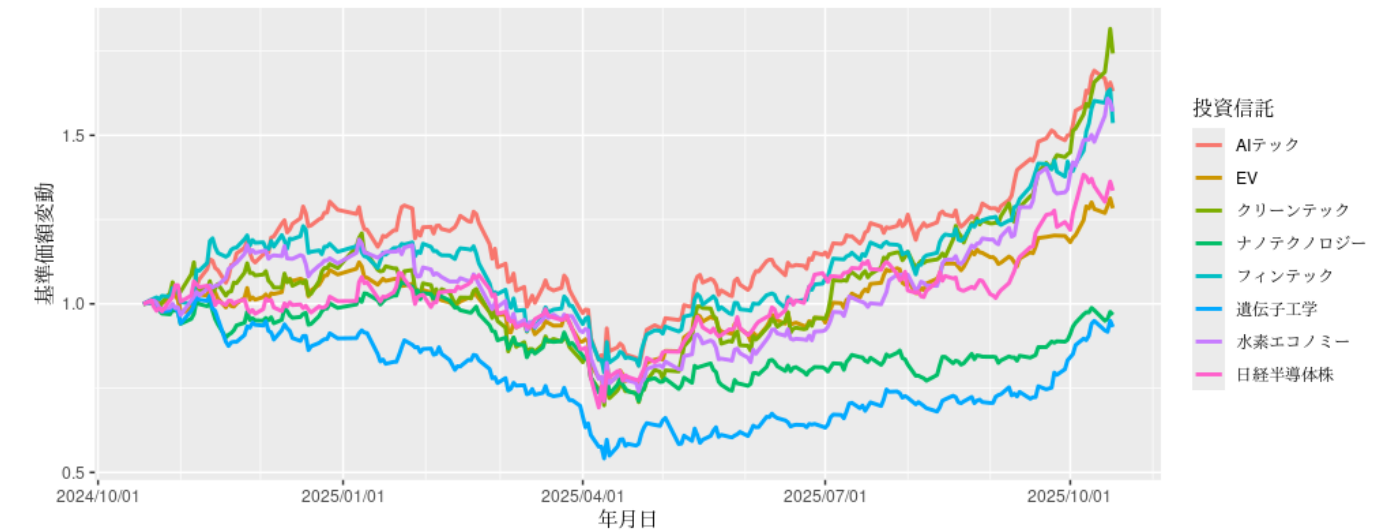
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.134%	1.457%	0.092	—
フィンテック	0.153%	2.072%	0.074	3.1%
宇宙開発	0.136%	1.536%	0.089	60.0%
NASDAQ100	0.128%	1.539%	0.083	36.8%
VR	0.121%	1.989%	0.061	0.0%
ドローン	0.113%	1.616%	0.070	0.0%
S&P500	0.097%	1.247%	0.078	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。