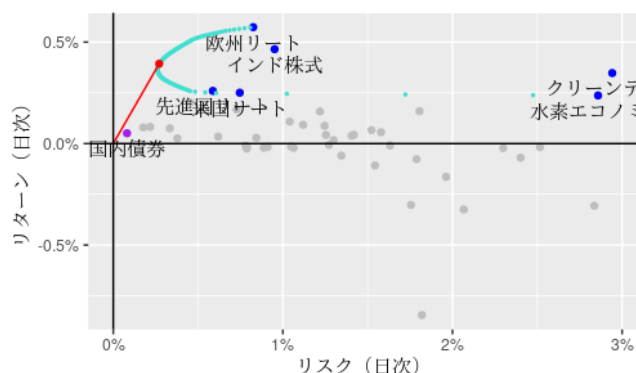


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

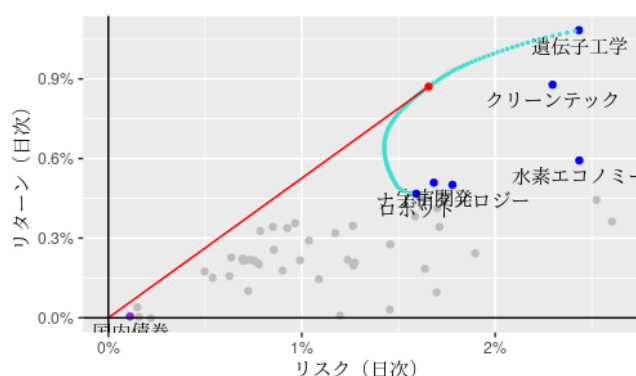
2025 年 10 月 24 日

【半月】



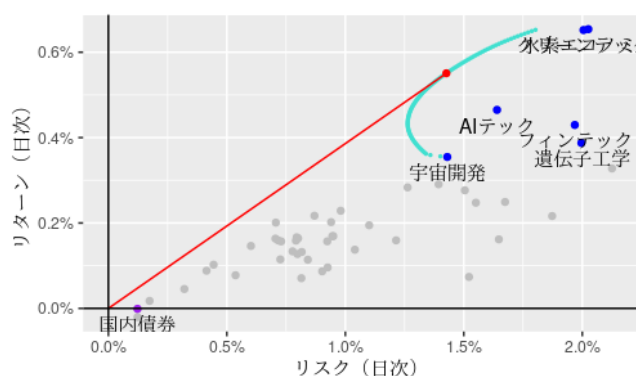
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.393%	0.271%	1.453	—
欧州リート	0.574%	0.825%	0.695	18.8%
インド株式	0.465%	0.951%	0.489	35.5%
クリーンテック	0.347%	2.942%	0.118	4.9%
先進国リート	0.260%	0.587%	0.442	29.6%
米国リート	0.251%	0.746%	0.336	0.0%
水素エコノミー	0.237%	2.858%	0.083	11.2%

【一ヶ月】



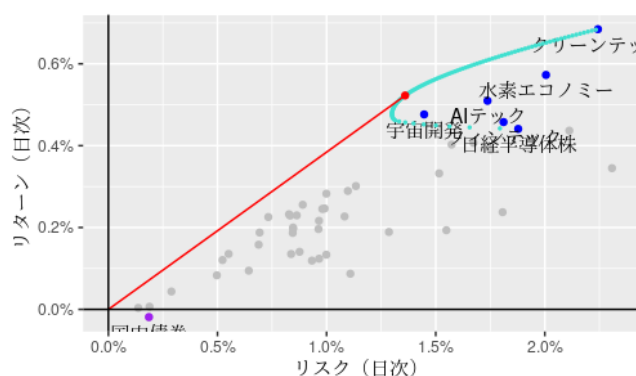
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.871%	1.656%	0.526	—
遺伝子工学	1.084%	2.433%	0.445	54.8%
クリーンテック	0.878%	2.297%	0.382	7.3%
水素エコノミー	0.593%	2.435%	0.243	28.6%
宇宙開発	0.509%	1.683%	0.303	0.0%
ナノテクノロジー	0.501%	1.779%	0.282	0.0%
ロボット	0.467%	1.592%	0.294	9.3%

【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	0.551%	1.426%	0.386	—
水素エコノミー	0.654%	2.026%	0.323	34.0%
クリーンテック	0.652%	2.005%	0.325	22.3%
AI テック	0.465%	1.640%	0.283	22.9%
フィンテック	0.430%	1.969%	0.218	0.0%
遺伝子工学	0.388%	1.996%	0.194	8.9%
宇宙開発	0.355%	1.430%	0.248	11.9%

【半年】

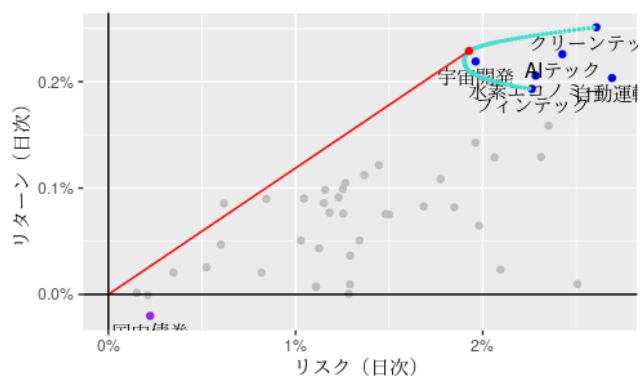


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.523%	1.360%	0.384	—
クリーンテック	0.685%	2.243%	0.305	20.5%
水素エコノミー	0.573%	2.005%	0.286	9.7%
AI テック	0.510%	1.737%	0.293	3.2%
宇宙開発	0.476%	1.447%	0.329	47.1%
フィンテック	0.458%	1.811%	0.253	0.0%
日経半導体株	0.441%	1.878%	0.235	19.5%

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。

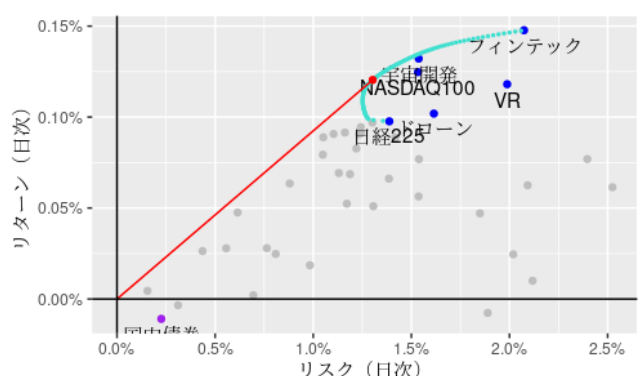
（２）リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.229%	1.926%	0.119	—
クリーンテック	0.251%	2.606%	0.096	30.6%
AI テック	0.226%	2.425%	0.093	0.0%
宇宙開発	0.219%	1.962%	0.112	69.4%
水素エコノミー	0.206%	2.283%	0.090	0.0%
自動運転	0.203%	2.691%	0.076	0.0%
フィンテック	0.193%	2.262%	0.085	0.0%

【三年】

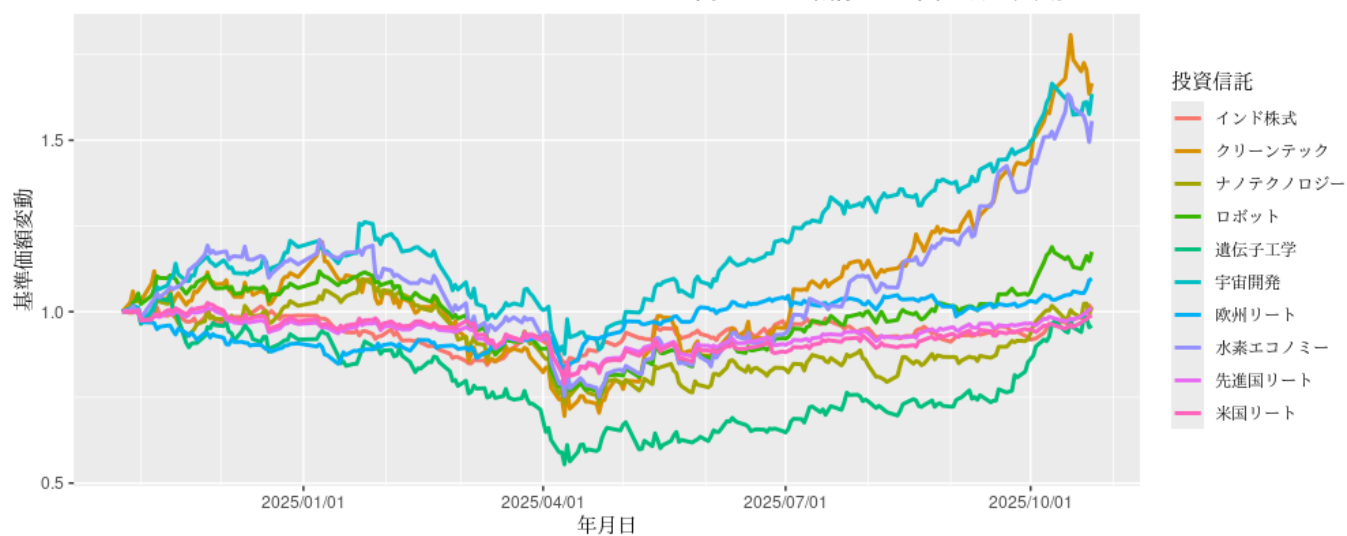


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.120%	1.303%	0.092	—
フィンテック	0.148%	2.074%	0.071	1.8%
宇宙開発	0.132%	1.537%	0.086	46.4%
NASDAQ100	0.125%	1.534%	0.081	21.7%
VR	0.118%	1.988%	0.059	0.0%
ドローン	0.102%	1.615%	0.063	0.0%
日経 225	0.098%	1.388%	0.070	30.1%

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。