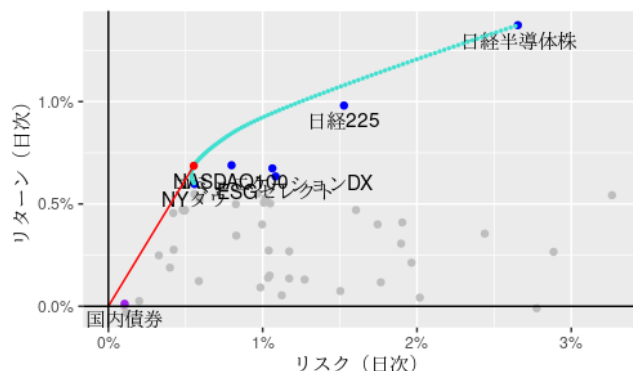


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

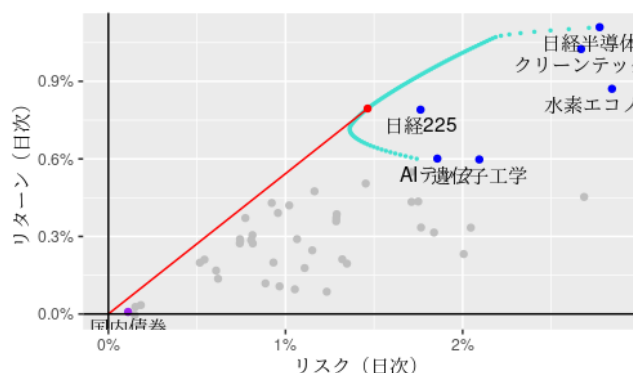
2025 年 10 月 31 日

【半月】



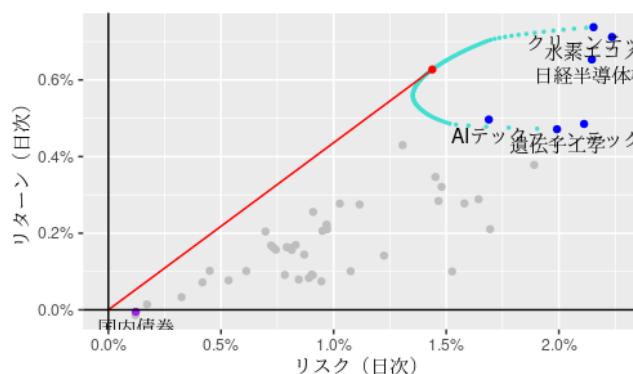
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.686%	0.553%	1.240	—
日経半導体株	1.373%	2.654%	0.518	9.2%
日経 225	0.981%	1.527%	0.642	0.0%
NASDAQ100	0.689%	0.798%	0.863	19.6%
コミュニケーション DX	0.674%	1.063%	0.634	0.0%
ESG セレクト	0.634%	1.084%	0.585	0.0%
NY ダウ	0.597%	0.559%	1.068	71.2%

【一ヶ月】



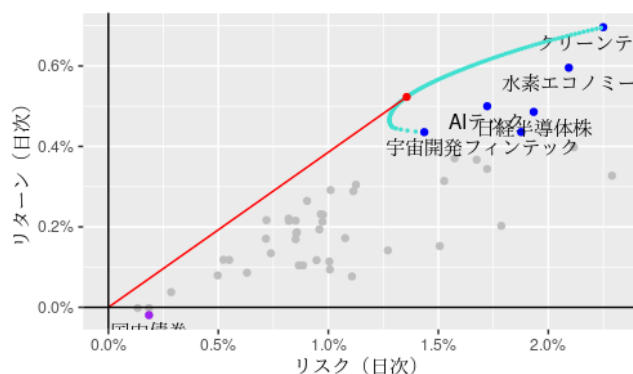
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.795%	1.464%	0.543	—
日経半導体株	1.110%	2.773%	0.400	0.0%
クリーンテック	1.025%	2.669%	0.384	15.7%
水素エコノミー	0.871%	2.843%	0.306	7.4%
日経 225	0.790%	1.762%	0.448	56.6%
AI テック	0.601%	1.857%	0.324	20.3%
遺伝子工学	0.598%	2.094%	0.285	0.0%

【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	0.627%	1.438%	0.436	—
クリーンテック	0.738%	2.154%	0.343	17.4%
水素エコノミー	0.712%	2.236%	0.318	21.2%
日経半導体株	0.653%	2.146%	0.304	30.5%
AI テック	0.497%	1.689%	0.294	12.8%
フィンテック	0.485%	2.112%	0.230	0.0%
遺伝子工学	0.471%	1.992%	0.237	18.2%

【半年】

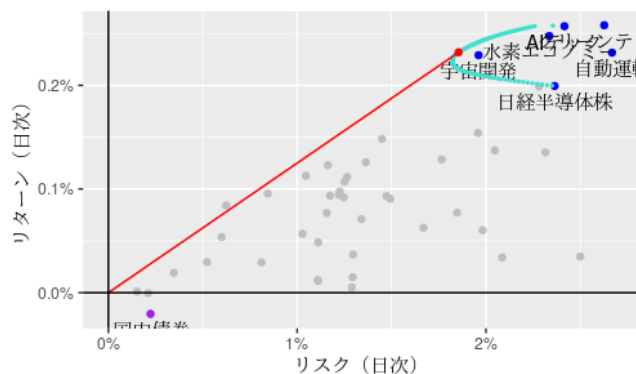


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.523%	1.356%	0.386	—
クリーンテック	0.696%	2.250%	0.310	20.3%
水素エコノミー	0.596%	2.093%	0.285	9.7%
AI テック	0.500%	1.722%	0.290	9.1%
日経半導体株	0.486%	1.934%	0.251	26.1%
フィンテック	0.436%	1.876%	0.232	0.0%
宇宙開発	0.436%	1.436%	0.303	34.8%

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。

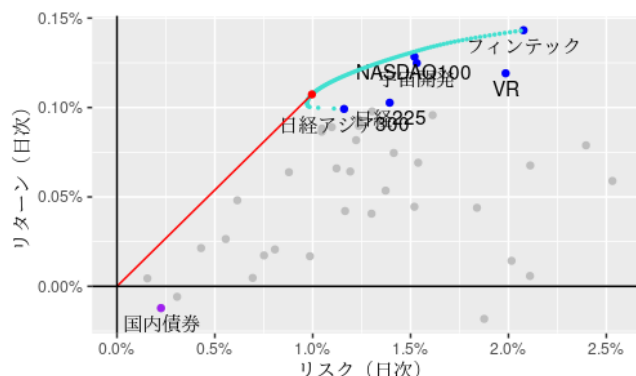
（２）リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.232%	1.855%	0.125	—
クリーンテック	0.258%	2.627%	0.098	16.6%
AI テック	0.257%	2.416%	0.106	0.0%
水素エコノミー	0.248%	2.336%	0.106	12.0%
自動運転	0.232%	2.668%	0.087	0.0%
宇宙開発	0.229%	1.961%	0.117	57.2%
日経半導体株	0.199%	2.364%	0.084	14.1%

【三年】

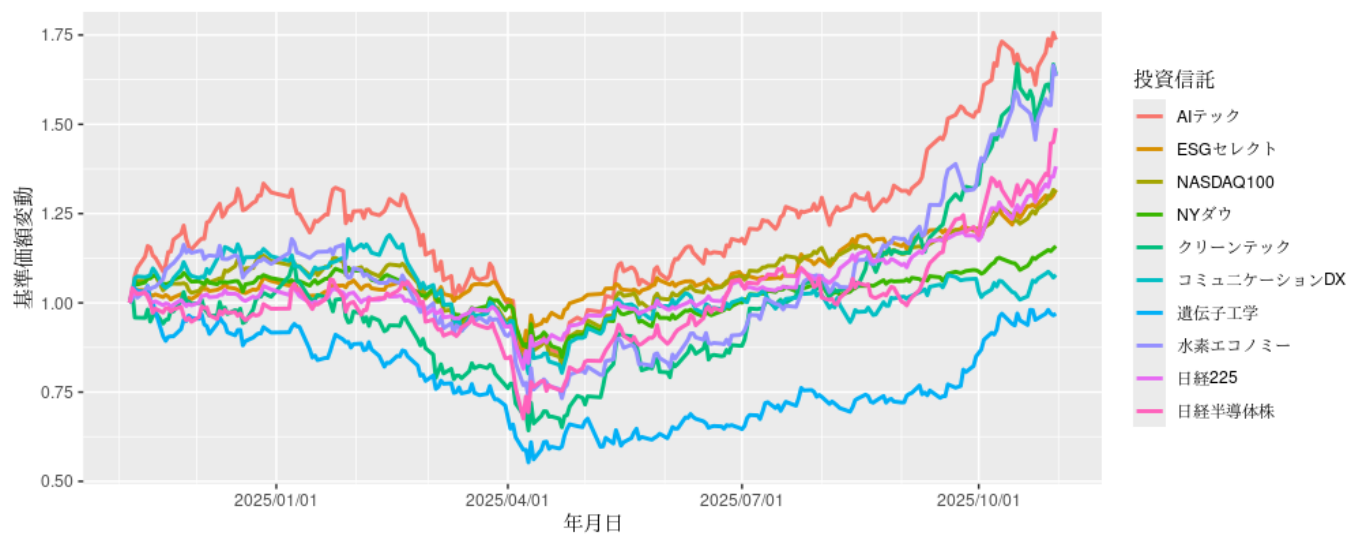


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.107%	0.996%	0.108	—
フィンテック	0.143%	2.077%	0.069	0.0%
NASDAQ100	0.128%	1.520%	0.085	10.4%
宇宙開発	0.125%	1.532%	0.082	16.5%
VR	0.119%	1.986%	0.060	0.0%
日経 225	0.103%	1.393%	0.074	24.8%
日経アジア 300	0.099%	1.160%	0.085	48.3%

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。