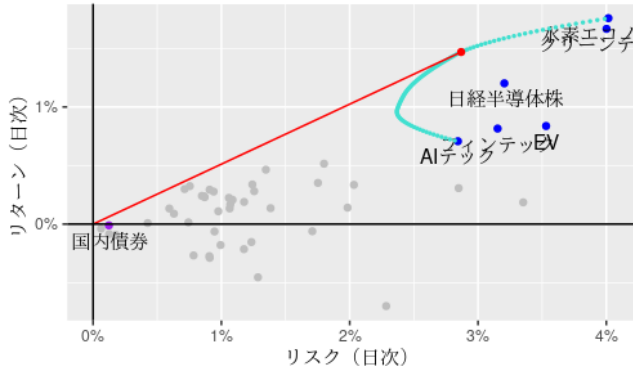


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

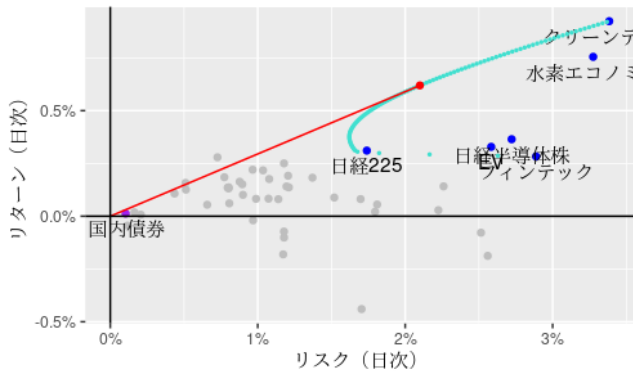
2025 年 11 月 7 日

【半月】



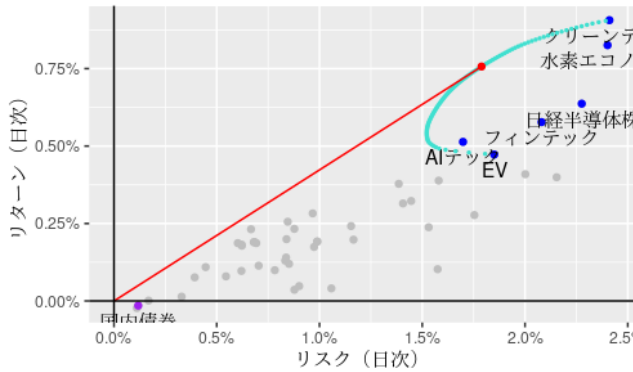
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	1.469%	2.869%	0.512	—
水素エコノミー	1.758%	4.016%	0.438	29.5%
クリーンテック	1.667%	4.002%	0.417	22.2%
日経半導体株	1.202%	3.205%	0.375	48.3%
EV	0.838%	3.531%	0.237	0.0%
フィンテック	0.816%	3.153%	0.259	0.0%
AI テック	0.708%	2.844%	0.249	0.0%

【一ヶ月】



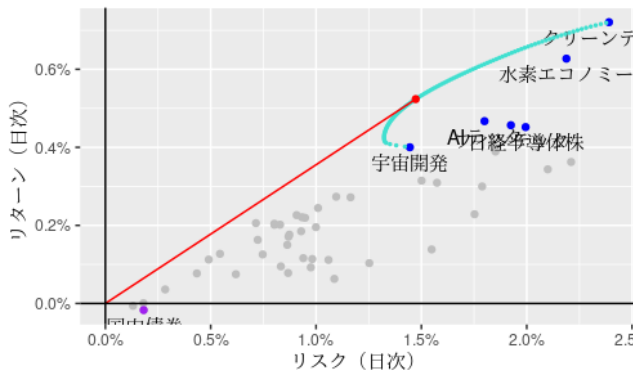
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.619%	2.100%	0.295	—
クリーンテック	0.924%	3.384%	0.273	44.1%
水素エコノミー	0.755%	3.275%	0.231	8.6%
日経半導体株	0.365%	2.722%	0.134	0.0%
EV	0.329%	2.583%	0.127	0.0%
日経 225	0.311%	1.740%	0.179	47.3%
フィンテック	0.283%	2.888%	0.098	0.0%

【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	0.757%	1.789%	0.423	—
クリーンテック	0.906%	2.411%	0.376	36.8%
水素エコノミー	0.826%	2.402%	0.344	20.7%
日経半導体株	0.637%	2.276%	0.280	27.4%
フィンテック	0.577%	2.081%	0.277	0.0%
AI テック	0.514%	1.698%	0.302	15.1%
EV	0.473%	1.850%	0.255	0.0%

【半年】

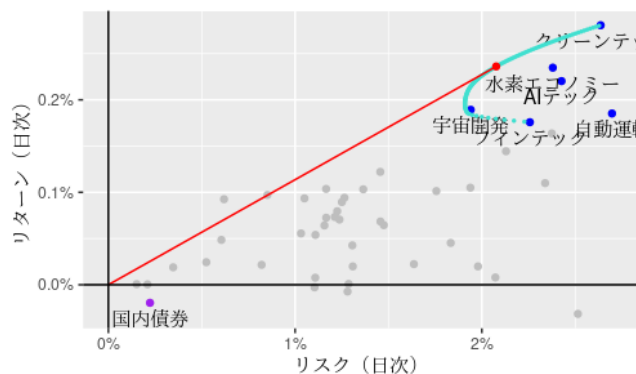


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.524%	1.473%	0.355	—
クリーンテック	0.721%	2.391%	0.302	23.7%
水素エコノミー	0.627%	2.188%	0.287	15.6%
AI テック	0.467%	1.800%	0.260	0.0%
フィンテック	0.457%	1.925%	0.237	0.0%
日経半導体株	0.452%	1.995%	0.227	23.4%
宇宙開発	0.400%	1.445%	0.277	37.3%

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。

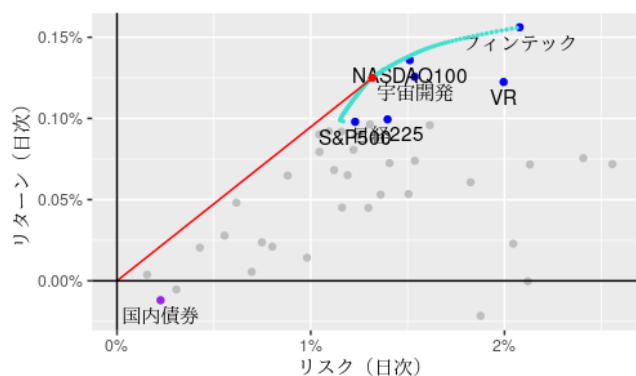
（２）リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.236%	2.077%	0.114	—
クリーンテック	0.281%	2.636%	0.106	47.9%
水素エコノミー	0.235%	2.380%	0.099	6.8%
AI テック	0.220%	2.427%	0.091	0.0%
宇宙開発	0.189%	1.940%	0.098	45.3%
自動運転	0.185%	2.697%	0.069	0.0%
フィンテック	0.176%	2.257%	0.078	0.0%

【三年】

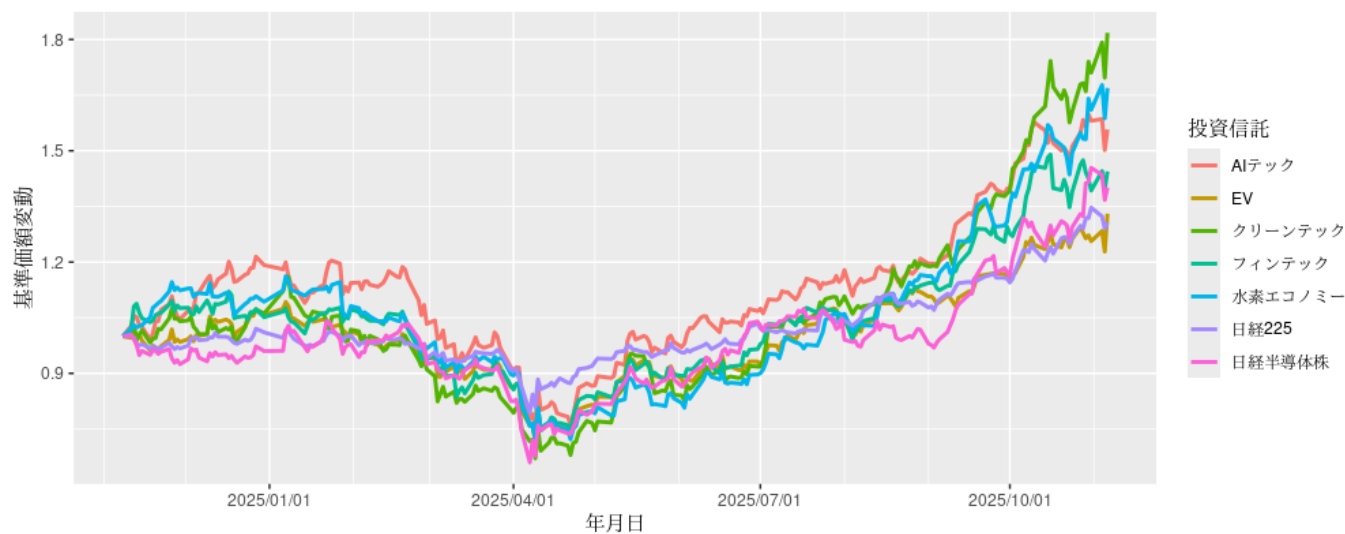


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.125%	1.319%	0.095	—
フィンテック	0.156%	2.078%	0.075	5.6%
NASDAQ100	0.136%	1.511%	0.090	46.6%
宇宙開発	0.126%	1.536%	0.082	20.7%
VR	0.122%	1.996%	0.061	0.0%
日経 225	0.099%	1.397%	0.071	27.1%
S&P500	0.098%	1.229%	0.080	0.0%

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。