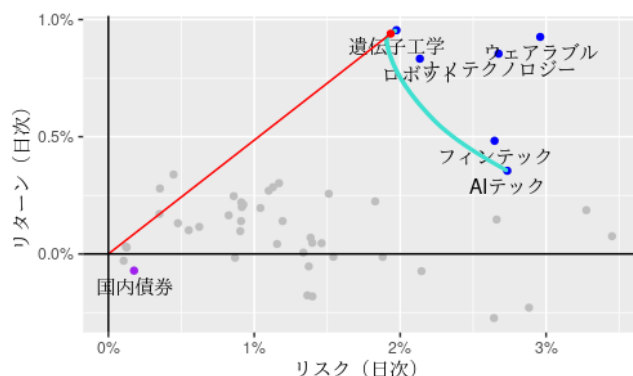


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

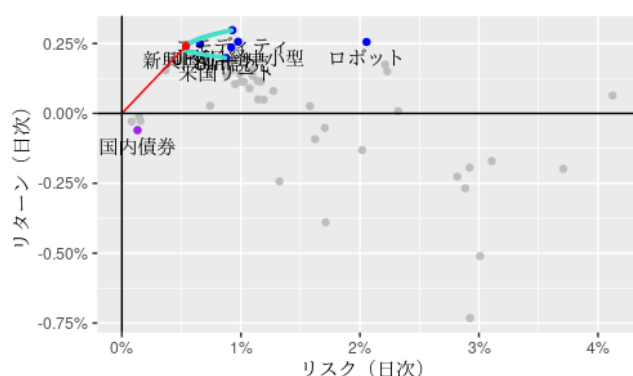
2025 年 11 月 29 日

【半月】



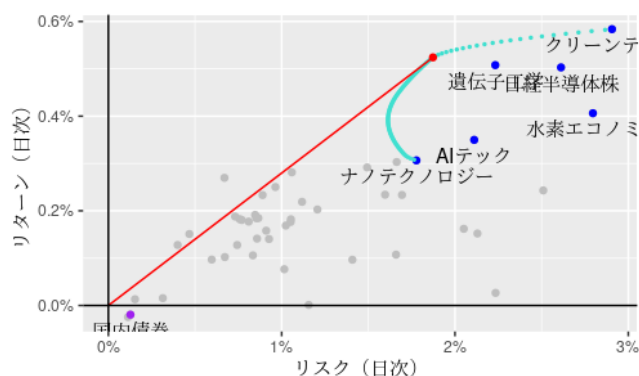
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.940%	1.935%	0.486	—
遺伝子工学	0.955%	1.974%	0.484	87.7%
ウェアラブル	0.926%	2.960%	0.313	0.0%
ナノテクノロジー	0.854%	2.674%	0.319	0.0%
ロボット	0.833%	2.135%	0.390	12.3%
フィンテック	0.483%	2.647%	0.182	0.0%
AI テック	0.355%	2.734%	0.130	0.0%

【一ヶ月】



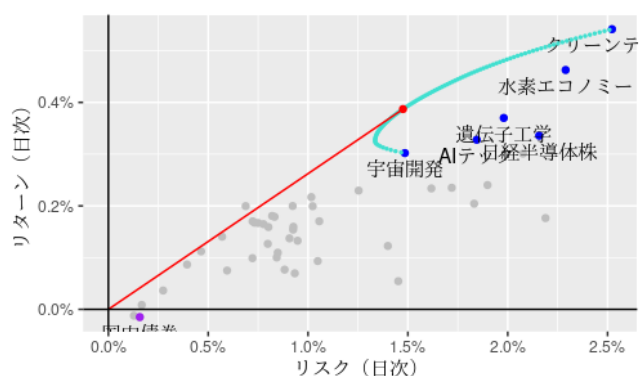
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.241%	0.538%	0.448	—
コモディティ	0.298%	0.928%	0.321	10.1%
JPX 日経中小型	0.256%	0.977%	0.262	4.8%
ロボット	0.256%	2.056%	0.124	0.0%
新興国リート	0.248%	0.657%	0.377	53.7%
Slim 読売	0.236%	0.919%	0.257	7.7%
米国リート	0.198%	0.876%	0.227	23.7%

【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	0.524%	1.873%	0.280	—
クリーンテック	0.584%	2.906%	0.201	23.1%
遺伝子工学	0.508%	2.233%	0.227	50.8%
日経半導体株	0.503%	2.612%	0.193	26.0%
水素エコノミー	0.406%	2.796%	0.145	0.0%
AI テック	0.350%	2.111%	0.166	0.0%
ナノテクノロジー	0.307%	1.777%	0.172	0.0%

【半年】

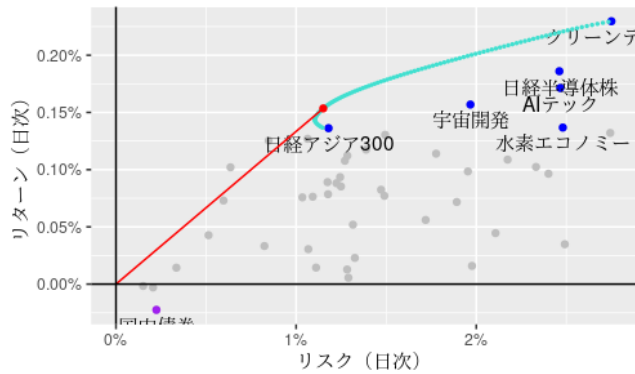


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.387%	1.476%	0.262	—
クリーンテック	0.542%	2.522%	0.215	15.4%
水素エコノミー	0.463%	2.290%	0.202	14.3%
遺伝子工学	0.370%	1.980%	0.187	30.8%
日経半導体株	0.336%	2.158%	0.156	12.8%
AI テック	0.328%	1.845%	0.178	0.0%
宇宙開発	0.302%	1.485%	0.203	26.7%

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。

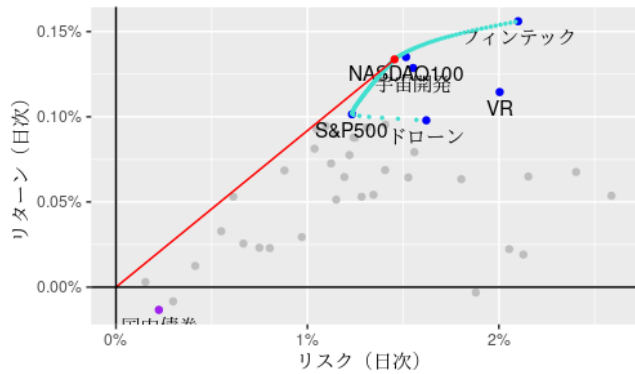
（２）リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.154%	1.151%	0.133	—
クリーンテック	0.230%	2.750%	0.084	9.9%
日経半導体株	0.186%	2.461%	0.076	15.2%
AI テック	0.171%	2.466%	0.069	0.0%
宇宙開発	0.157%	1.967%	0.080	2.3%
水素エコノミー	0.137%	2.480%	0.055	0.0%
日経アジア 300	0.136%	1.180%	0.115	72.6%

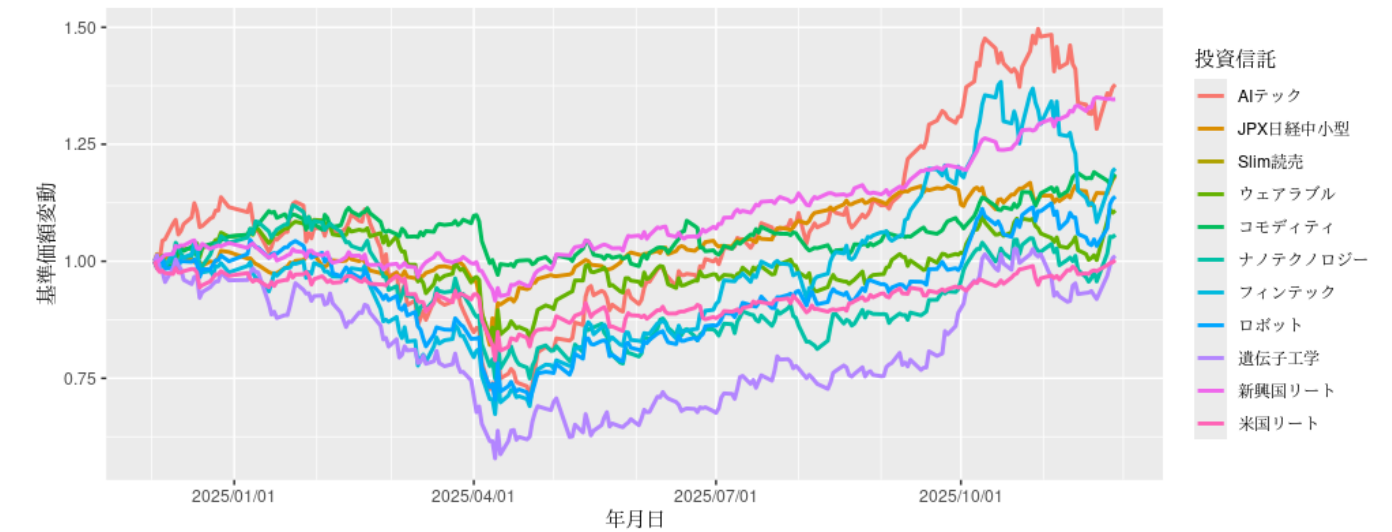
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.134%	1.455%	0.092	—
フィンテック	0.156%	2.101%	0.074	3.7%
NASDAQ100	0.135%	1.515%	0.089	62.9%
宇宙開発	0.129%	1.552%	0.083	33.4%
VR	0.115%	2.004%	0.057	0.0%
S&P500	0.101%	1.233%	0.082	0.0%
ドローン	0.098%	1.621%	0.060	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。