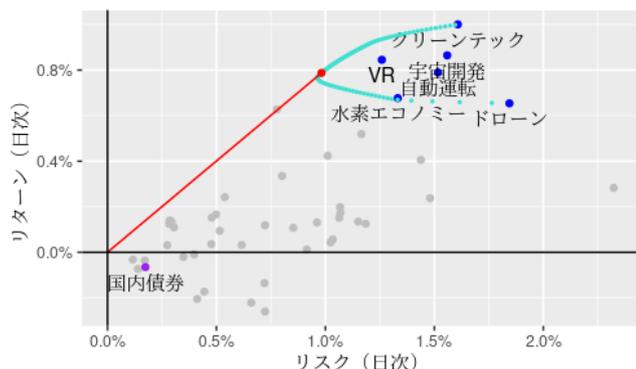


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

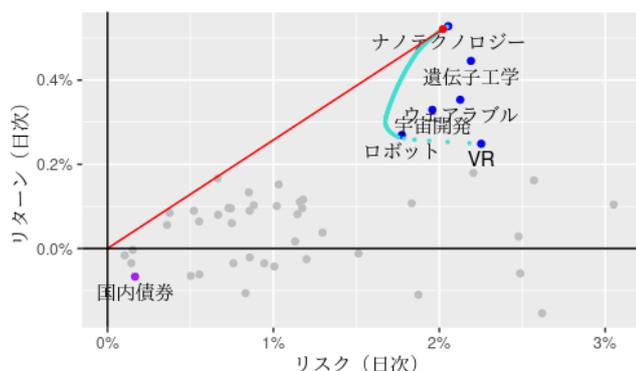
2025 年 12 月 12 日

【半月】



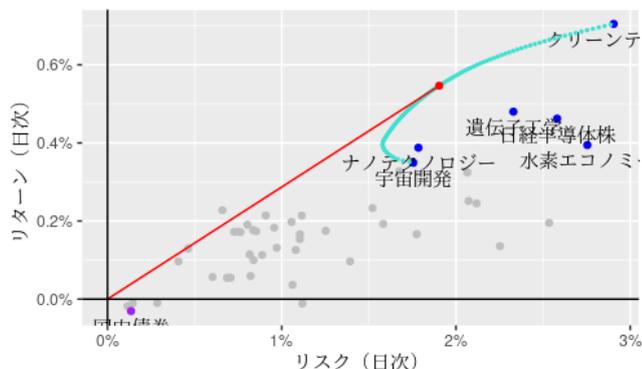
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.788%	0.982%	0.802	—
クリーンテック	1.001%	1.607%	0.623	3.5%
宇宙開発	0.865%	1.559%	0.555	0.0%
VR	0.845%	1.259%	0.671	59.0%
自動運転	0.790%	1.517%	0.521	0.0%
水素エコノミー	0.677%	1.332%	0.508	37.5%
ドローン	0.654%	1.844%	0.355	0.0%

【一ヶ月】



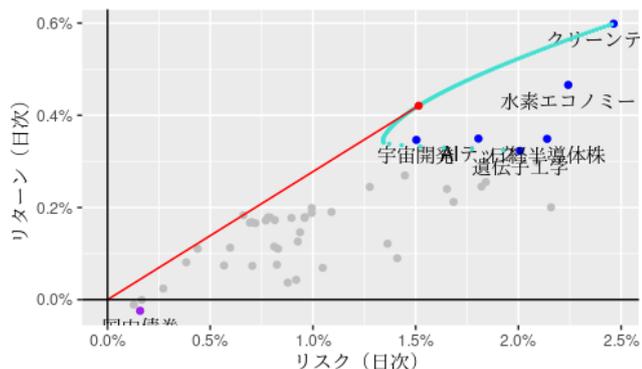
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.521%	2.022%	0.258	—
ナノテクノロジー	0.528%	2.054%	0.257	91.5%
遺伝子工学	0.446%	2.191%	0.203	8.5%
ウェアラブル	0.353%	2.126%	0.166	0.0%
宇宙開発	0.329%	1.958%	0.168	0.0%
ロボット	0.270%	1.775%	0.152	0.0%
VR	0.249%	2.253%	0.110	0.0%

【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	0.546%	1.904%	0.287	—
クリーンテック	0.705%	2.905%	0.243	36.1%
遺伝子工学	0.480%	2.329%	0.206	34.9%
日経半導体株	0.462%	2.581%	0.179	16.2%
水素エコノミー	0.394%	2.754%	0.143	0.0%
ナノテクノロジー	0.388%	1.784%	0.217	12.7%
宇宙開発	0.349%	1.755%	0.199	0.0%

【半年】

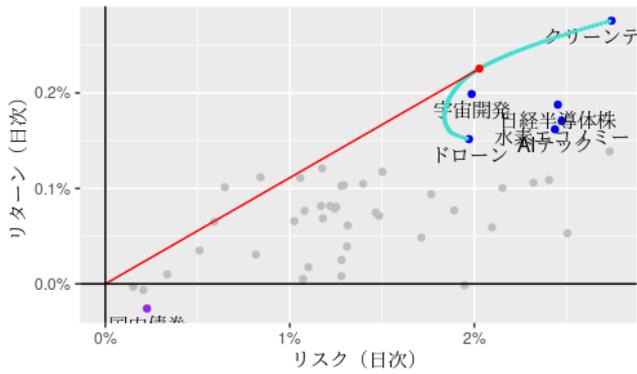


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.421%	1.515%	0.278	—
クリーンテック	0.599%	2.464%	0.243	29.1%
水素エコノミー	0.466%	2.243%	0.208	3.6%
AI テック	0.349%	1.805%	0.194	0.0%
日経半導体株	0.349%	2.140%	0.163	14.9%
宇宙開発	0.347%	1.503%	0.231	36.1%
遺伝子工学	0.323%	2.007%	0.161	16.3%

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。

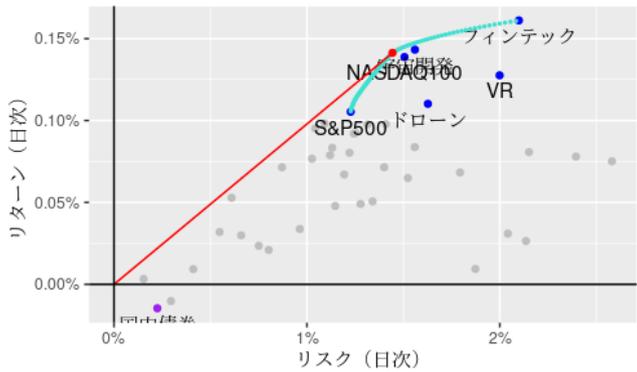
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.225%	2.028%	0.111	—
クリーンテック	0.276%	2.744%	0.100	36.9%
宇宙開発	0.199%	1.986%	0.100	47.6%
日経半導体株	0.188%	2.453%	0.077	15.5%
水素エコノミー	0.171%	2.474%	0.069	0.0%
AI テック	0.162%	2.437%	0.066	0.0%
ドローン	0.152%	1.971%	0.077	0.0%

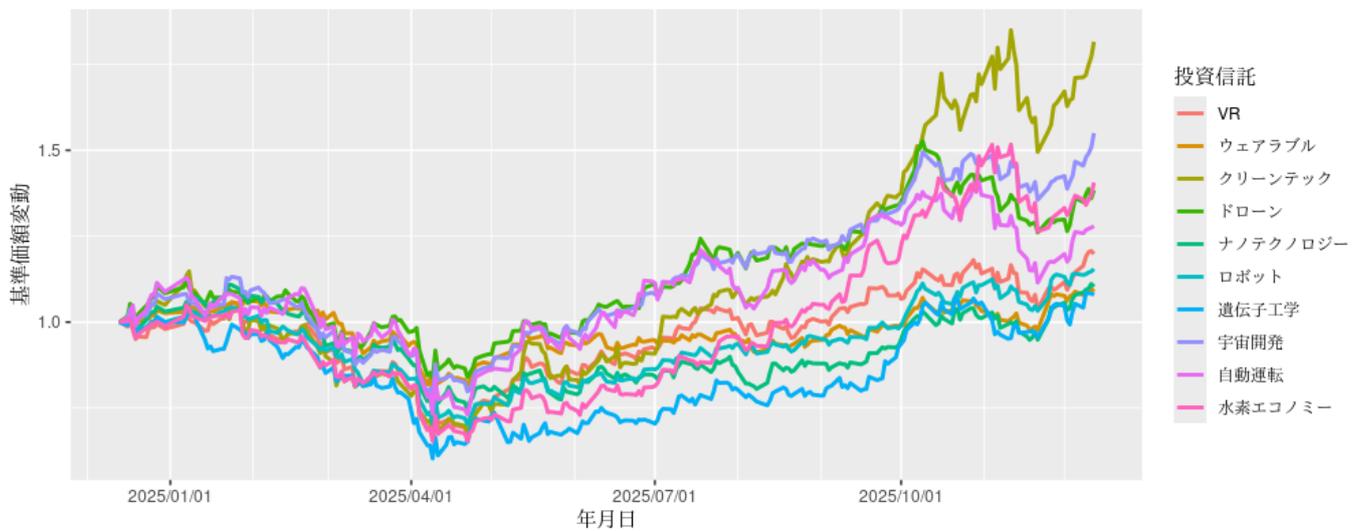
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.141%	1.444%	0.098	—
フィンテック	0.161%	2.099%	0.077	1.7%
宇宙開発	0.143%	1.560%	0.092	48.5%
NASDAQ100	0.139%	1.506%	0.092	49.8%
VR	0.128%	1.999%	0.064	0.0%
ドローン	0.110%	1.627%	0.068	0.0%
S&P500	0.105%	1.227%	0.086	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。