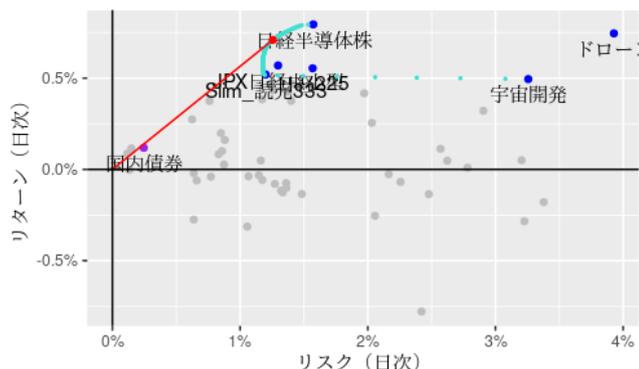


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

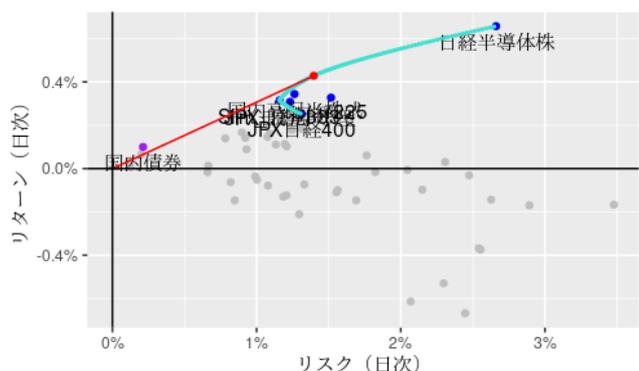
2026年2月20日

【半月】



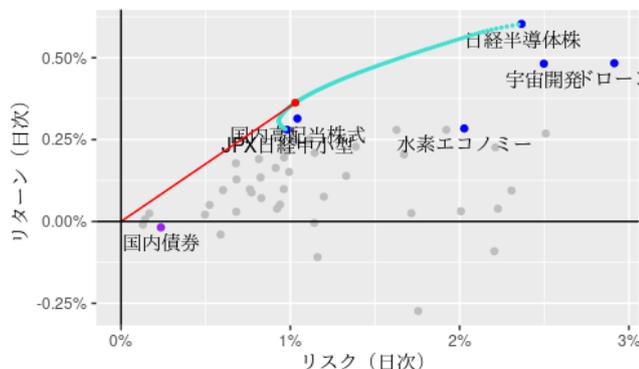
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.709%	1.256%	0.565	—
日経半導体株	0.795%	1.573%	0.505	56.9%
ドローン	0.745%	3.927%	0.190	6.6%
JPX 日経中小型	0.570%	1.297%	0.439	36.5%
日経 225	0.554%	1.568%	0.353	0.0%
Slim_読売 333	0.520%	1.200%	0.433	0.0%
宇宙開発	0.495%	3.257%	0.152	0.0%

【一ヶ月】



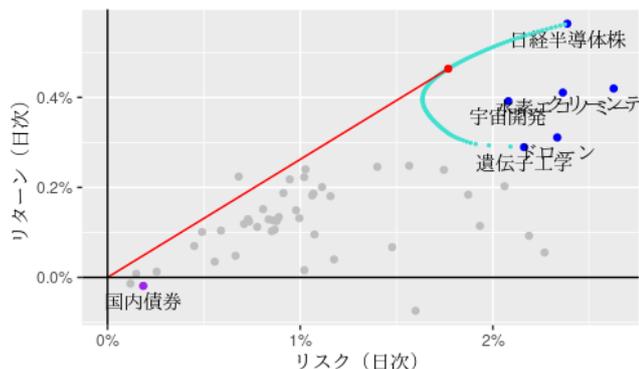
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.428%	1.397%	0.307	—
日経半導体株	0.657%	2.661%	0.247	26.9%
国内高配当株式	0.344%	1.263%	0.272	72.8%
日経 225	0.327%	1.516%	0.216	0.0%
Slim_読売 333	0.315%	1.160%	0.272	0.0%
JPX 日経中小型	0.308%	1.232%	0.250	0.3%
JPX 日経 400	0.252%	1.314%	0.192	0.0%

【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	0.362%	1.029%	0.352	—
日経半導体株	0.603%	2.366%	0.255	12.5%
ドローン	0.483%	2.914%	0.166	0.0%
宇宙開発	0.482%	2.498%	0.193	13.2%
国内高配当株式	0.314%	1.042%	0.302	45.0%
水素エコノミー	0.284%	2.028%	0.140	0.0%
JPX 日経中小型	0.280%	0.980%	0.286	29.3%

【半年】

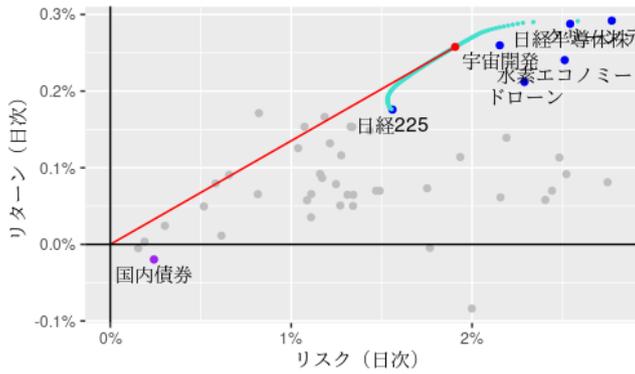


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.464%	1.768%	0.262	—
日経半導体株	0.564%	2.386%	0.236	50.0%
クリーンテック	0.420%	2.627%	0.160	0.0%
水素エコノミー	0.411%	2.363%	0.174	9.8%
宇宙開発	0.392%	2.080%	0.188	24.6%
ドローン	0.311%	2.334%	0.133	0.0%
遺伝子工学	0.289%	2.162%	0.134	15.5%

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。

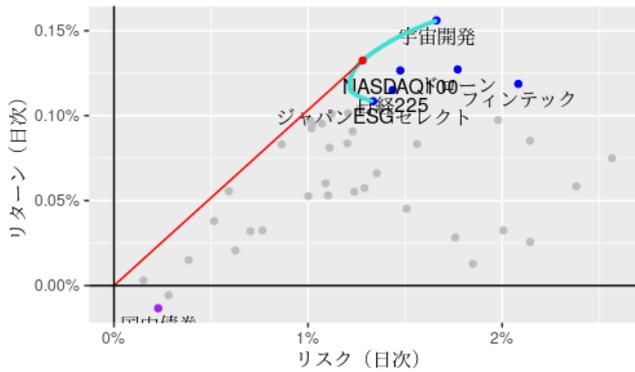
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.258%	1.906%	0.135	—
クリーンテック	0.292%	2.772%	0.105	10.9%
日経半導体株	0.288%	2.542%	0.113	28.2%
宇宙開発	0.260%	2.153%	0.121	44.8%
水素エコノミー	0.240%	2.512%	0.096	0.0%
ドローン	0.212%	2.289%	0.093	0.0%
日経 225	0.176%	1.560%	0.113	16.1%

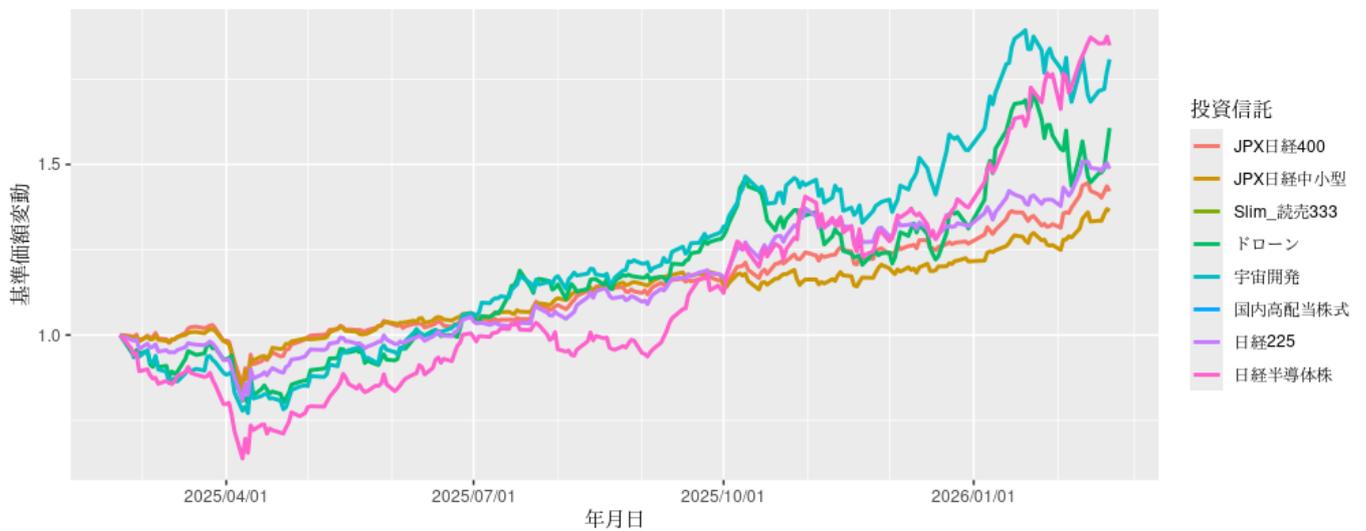
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.132%	1.281%	0.103	—
宇宙開発	0.156%	1.661%	0.094	44.2%
ドローン	0.127%	1.771%	0.072	0.0%
NASDAQ100	0.127%	1.475%	0.086	16.6%
フィンテック	0.119%	2.083%	0.057	0.0%
日経 225	0.115%	1.435%	0.080	0.0%
ジャパン ESG セレクト	0.108%	1.335%	0.081	39.3%

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。