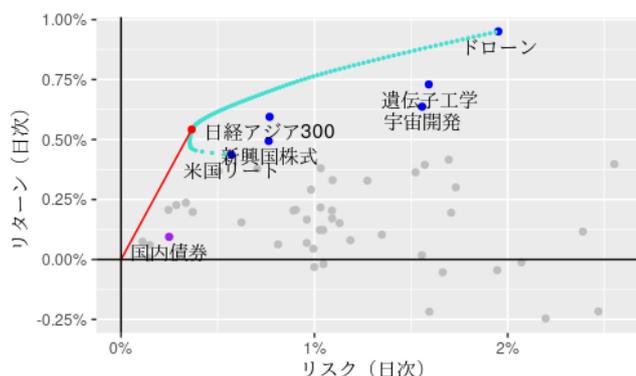


eMAXIS シリーズ (+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド) を使った効率的ポートフォリオ

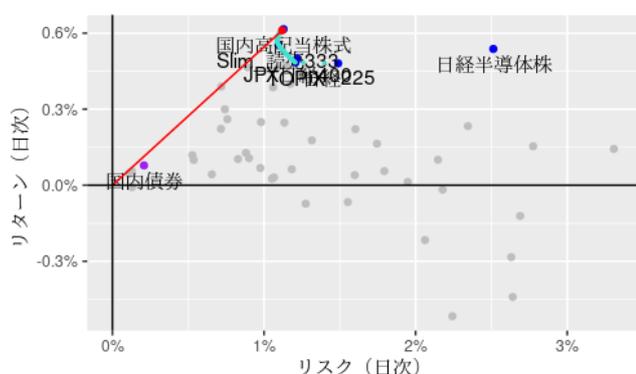
2026 年 2 月 27 日

【半月】



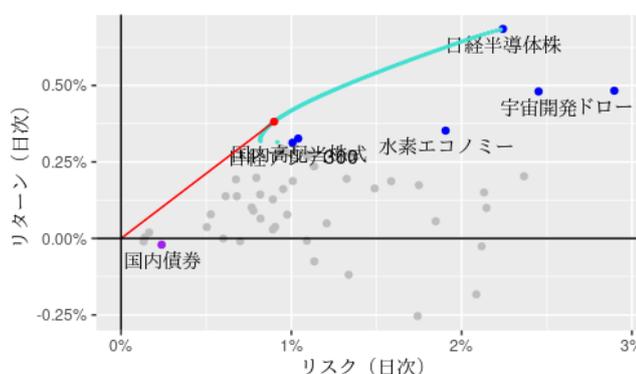
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.542%	0.365%	1.484	—
ドローン	0.951%	1.951%	0.487	8.9%
遺伝子工学	0.730%	1.592%	0.459	0.0%
宇宙開発	0.637%	1.557%	0.409	0.0%
日経アジア 300	0.595%	0.768%	0.774	37.6%
新興国株式	0.494%	0.764%	0.647	0.0%
米国リート	0.437%	0.571%	0.764	53.4%

【一ヶ月】



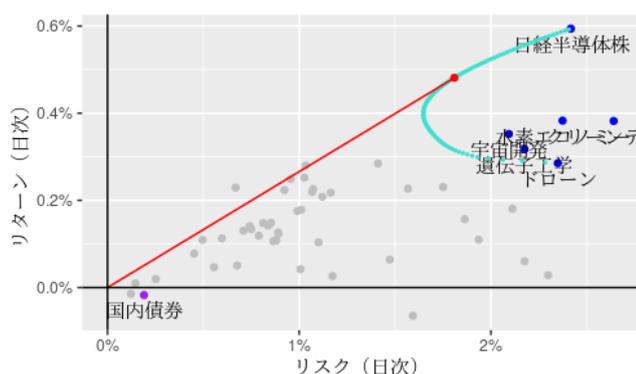
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.611%	1.120%	0.546	—
国内高配当株式	0.616%	1.129%	0.546	92.3%
Slim_読売 333	0.555%	1.095%	0.507	7.7%
日経半導体株	0.538%	2.513%	0.214	0.0%
JPX 日経 400	0.500%	1.220%	0.410	0.0%
TOPIX	0.484%	1.207%	0.401	0.0%
日経 225	0.481%	1.489%	0.323	0.0%

【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	0.382%	0.899%	0.425	—
日経半導体株	0.685%	2.242%	0.305	16.8%
ドローン	0.483%	2.896%	0.167	0.0%
宇宙開発	0.480%	2.452%	0.196	0.9%
水素エコノミー	0.352%	1.906%	0.185	0.0%
国内高配当株式	0.327%	1.040%	0.314	35.2%
日経アジア 300	0.313%	1.007%	0.311	47.2%

【半年】

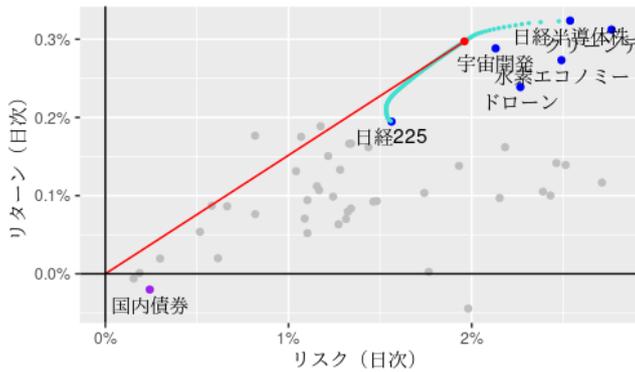


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.481%	1.809%	0.266	—
日経半導体株	0.594%	2.417%	0.246	55.7%
水素エコノミー	0.383%	2.374%	0.161	7.4%
クリーンテック	0.382%	2.640%	0.145	0.0%
宇宙開発	0.352%	2.094%	0.168	14.5%
遺伝子工学	0.317%	2.175%	0.146	22.4%
ドローン	0.285%	2.349%	0.121	0.0%

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。

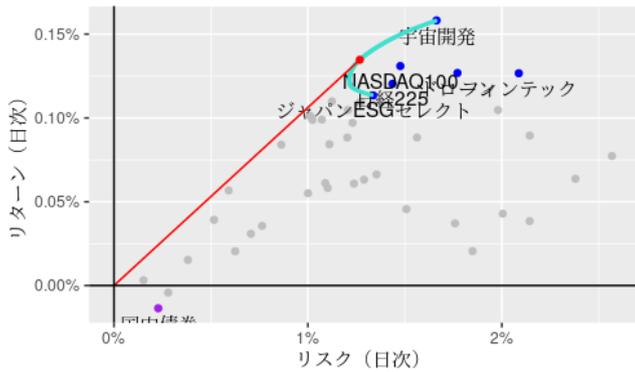
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.297%	1.960%	0.152	—
日経半導体株	0.324%	2.537%	0.128	36.0%
クリーンテック	0.312%	2.763%	0.113	6.7%
宇宙開発	0.288%	2.130%	0.135	51.5%
水素エコノミー	0.273%	2.490%	0.110	0.0%
ドローン	0.239%	2.266%	0.105	0.0%
日経 225	0.195%	1.562%	0.125	5.7%

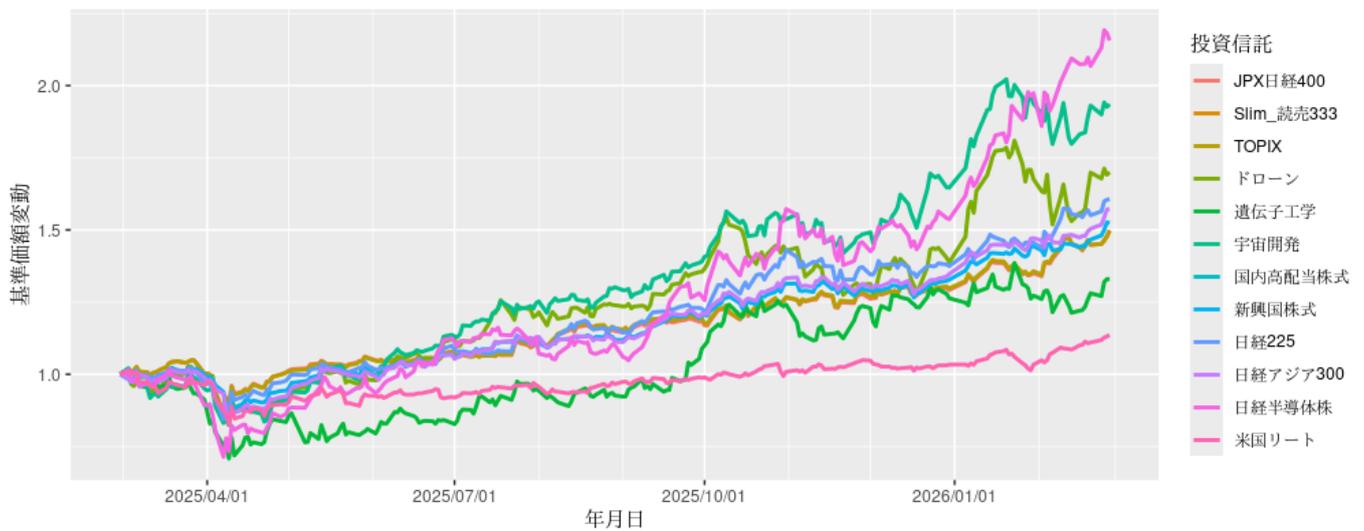
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.135%	1.268%	0.106	—
宇宙開発	0.158%	1.663%	0.095	40.1%
NASDAQ100	0.131%	1.477%	0.089	18.9%
ドローン	0.127%	1.771%	0.072	0.0%
フィンテック	0.127%	2.088%	0.061	0.0%
日経 225	0.120%	1.436%	0.084	0.0%
ジャパン ESG セレクト	0.113%	1.336%	0.085	41.0%

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。