

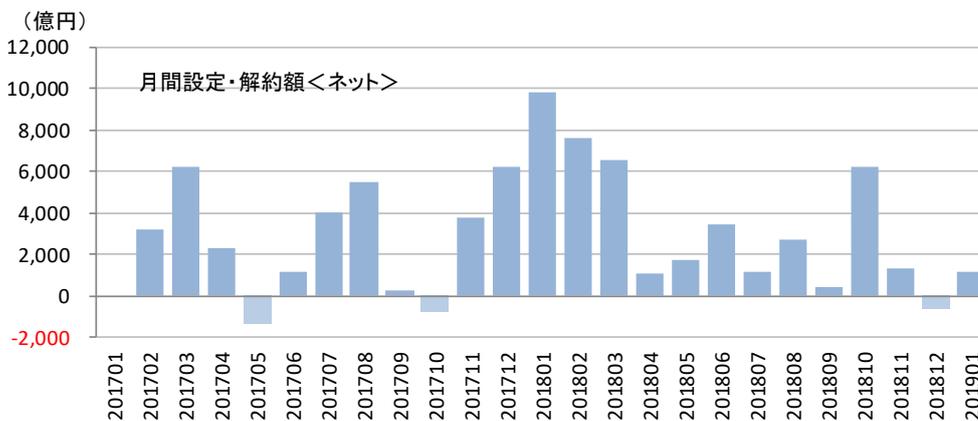
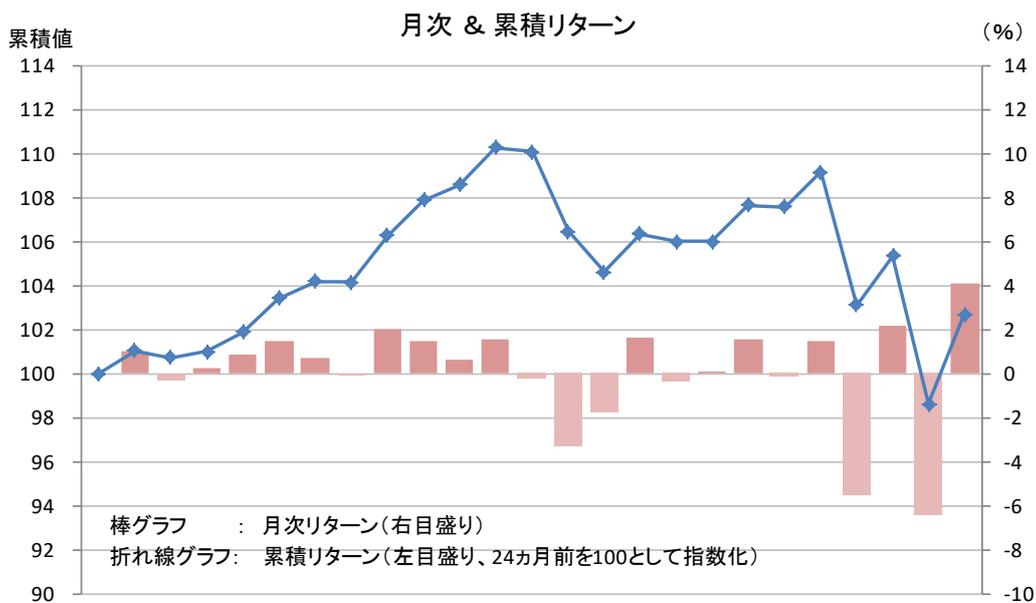
# 投信指数 MAB-FPI

## パフォーマンス・サマリー

— Vol.2 ファンド分類 詳細編 —

### 2019年1月

**「総合」 +4.14 %**  
**(前月 -6.40 %)**



# MAB-FPI について

MAB-FPI とは日本の公募追加型株式投資信託全体の動向を表す指数で、弊社が独自に開発したものです。

(FPI は Fund Performance Index の略)

## ■主な特徴

- ・国内籍の公募追加型株式投資信託をユニバースとします（但し、ETF は除く）。
- ・月末に翌月の採用ファンドを選定します（月次リバランス）。
- ・総合および各カテゴリー別の日次収益率は、個々の投資信託の日次収益率を前日の純資産額によって加重した平均値として計算します。
- ・指数は算出開始時点（原則、1997年3月31日）を10,000（単位：ポイント）とし、各カテゴリーの日次収益率を乗じて算出します。
- ・カテゴリーは全体を表す「総合」のほかファンド分類別（大分類、中分類、小分類）、各種区分別（ヘッジ種別、アクティブ/パッシブ別、他）など、様々なサブ・カテゴリー指数を算出します。

詳細については『MAB 投信指数「MAB-FPI」算出要領』をご参照下さい。

## ■本レポートの内容

掲載対象カテゴリー：「総合」

|--- ファンド分類別「大分類」  
|--- " " 「中分類」  
|--- " " 「小分類」

なお、「中分類」と「小分類」の掲載対象は直近5年以上指数算出が可能なカテゴリーからの抜粋

### <1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン	・ ・ ・ ・ ・	P. 3
(2) 期間別リターン	・ ・ ・ ・ ・	P. 6
(3) リターン推移	・ ・ ・ ・ ・	P. 9
(4) 対「総合」寄与度分析	・ ・ ・ ・ ・	P. 20

### <2>リスク・サマリー

・ ・ ・ ・ ・ P. 22

### <3>設定・解約額 [ネット金額]

・ ・ ・ ・ ・ P. 35

### <4>純資産額、ファンド本数

・ ・ ・ ・ ・ P. 38

### <5>属性、指標等

・ ・ ・ ・ ・ P. 41

## ＜1＞パフォーマンス・サマリー

## (1) 当月リターン

## 「総合」およびファンド分類別①

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)	
総合		12,195	11,710	485	4.14	
国内株式		14,520	13,855	665	4.80	
一般		14,191	13,529	663	4.90	
フリー		13,258	12,638	620	4.90	
バリュー		18,708	17,837	872	4.89	
小型		30,398	28,814	1,585	5.50	
その他		14,237	13,654	583	4.27	
日経225		13,399	12,920	479	3.71	
TOPIX		14,288	13,623	666	4.89	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	13,444	12,800	644	5.03	
国内債券		13,177	13,124	53	0.40	
一般		13,177	13,124	53	0.40	
外国株式(先進国)		13,125	12,210	915	7.50	
グローバル		14,439	13,417	1,022	7.62	
除く日本		20,359	19,063	1,296	6.80	
含む日本		13,128	12,174	954	7.83	
その他		10,450	9,758	692	7.09	
北米		10,496	9,666	829	8.58	
米国		15,319	14,244	1,075	7.55	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	16,004	14,695	1,309	8.90	
欧州		16,308	15,267	1,041	6.82	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	31,798	30,301	1,497	4.94	
オーストラリア	12,670 (2008.07.01)	14,580	13,833	748	5.40	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	30,509	29,768	740	2.49	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	8,791	8,089	702	8.68	
エマージング株式		13,466	13,203	263	1.99	
グローバル		13,087	12,252	836	6.82	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	21,525	19,927	1,597	8.02	
その他		14,035	14,029	6	0.05	
欧州		23,680	21,586	2,094	9.70	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	9,104	8,174	930	11.37	
アジア・オセアニア		14,692	13,968	725	5.19	
中国		27,698	25,716	1,982	7.71	
インド	10,000 (2004.09.30)	29,467	31,423	-1,956	-6.23	
インドネシア	7,330 (2009.12.01)	14,365	13,689	676	4.94	
タイ		23,587	22,050	1,538	6.97	
フィリピン	3,209 (2010.06.01)	8,233	7,878	354	4.50	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	14,210	14,411	-200	-1.39	
韓国	10,000 (1997.06.30)	22,048	22,099	-51	-0.23	
香港		22,528	21,198	1,329	6.27	
台湾	10,000 (2008.03.31)	14,274	14,234	41	0.29	
中南米	7,448 (2006.05.01)	8,570	7,637	933	12.22	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,995	8,643	1,351	15.64	
メキシコ	10,514 (2013.03.01)	9,143	8,631	512	5.93	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	9,279	8,733	546	6.25	
南アフリカ	10,000 (2010.06.30)	6,432	5,847	585	10.01	
トルコ		22,809	20,331	2,478	12.19	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	19,536	18,628	908	4.87	

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

## &lt;1&gt;パフォーマンス・サマリー

## (1) 当月リターン

## 「総合」およびファンド分類別②

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		12,195	11,710	485	4.14
外国債券(先進国)		17,203	17,073	130	0.76
グローバル		17,430	17,329	101	0.58
除く日本		18,573	18,522	51	0.28
含む日本		16,830	16,675	155	0.93
その他		16,530	16,328	202	1.24
北米	9,017 (2013.06.03)	10,057	10,056	1	0.01
米国		15,007	14,890	118	0.79
カナダ	10,000 (2003.05.30)	13,670	13,366	304	2.27
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,028	15,015	14	0.09
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	18,388	18,105	283	1.56
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	22,632	22,288	343	1.54
複合地域	10,000 (2001.11.30)	16,065	16,047	17	0.11
エマーGING債券		16,515	16,157	357	2.21
グローバル		17,791	17,164	627	3.65
米ドル建て		18,373	17,693	680	3.84
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,320	11,982	338	2.82
その他	8,652 (2005.04.01)	12,173	12,051	121	1.01
ロシア	10,000 (2008.05.30)	9,841	9,247	594	6.42
アジア・オセアニア	8,652 (2005.04.01)	13,486	13,397	89	0.67
インド	10,000 (2011.08.31)	14,739	15,091	-352	-2.33
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	12,234	12,212	22	0.18
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	13,093	12,506	587	4.69
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	10,805	10,487	319	3.04
南アフリカ	10,000 (2010.03.31)	11,211	10,316	895	8.68
トルコ	10,000 (2011.04.28)	5,489	5,171	318	6.16
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,569	10,221	348	3.41
ハイイールド債券		20,785	20,020	765	3.82
グローバル	10,000 (1997.06.30)	21,321	20,568	752	3.66
北米		20,047	19,244	804	4.18
その他	10,000 (2004.03.31)	21,150	20,574	576	2.80
欧州	10,000 (2006.04.28)	21,256	20,678	578	2.79
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	13,681	13,313	368	2.77
複合地域	10,000 (2004.03.31)	18,380	18,173	207	1.14
複合資産		16,376	15,975	401	2.51
安定	10,000 (1998.10.30)	14,823	14,555	268	1.84
安定成長		17,451	16,980	471	2.77
成長		19,043	18,327	715	3.90
国内バランス		12,908	12,725	182	1.43
安定		13,883	13,708	175	1.28
一般		13,528	13,109	419	3.19

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

## ＜1＞パフォーマンス・サマリー

## (1) 当月リターン

## 「総合」およびファンド分類別③

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)	
総合		12,195	11,710	485	4.14	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	29,685	28,341	1,344	4.74	
日本	10,000 (2003.10.31)	29,685	28,341	1,344	4.74	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	24,593	22,712	1,881	8.28	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	21,904	20,196	1,709	8.46	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	23,340	21,445	1,895	8.84	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	22,058	20,351	1,706	8.39	
北米	10,000 (2003.09.30)	24,054	22,157	1,897	8.56	
その他	10,000 (2004.04.30)	25,283	23,822	1,460	6.13	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,531	5,060	471	9.31	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	18,646	17,606	1,039	5.90	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	14,410	13,746	664	4.83	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,112	6,385	727	11.39	
複数国	10,000 (2004.04.30)	32,035	29,753	2,282	7.67	
その他		5,556	5,438	118	2.17	
絶対収益型		7,480	7,474	6	0.08	
ロング・ショート		8,696	8,634	62	0.72	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	8,868	8,982	-114	-1.26	
GTAA		10,260	10,205	55	0.54	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,138	7,130	8	0.11	
CB		17,963	17,550	413	2.35	
アジア・オセアニア	13,897 (2007.11.01)	14,700	14,376	325	2.26	
日本		20,012	19,920	92	0.46	
グローバル		31,449	30,698	750	2.44	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	7,513	7,288	225	3.09	
全業種	10,000 (2004.12.30)	6,447	6,247	200	3.20	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	13,551	13,201	350	2.65	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	4,507	3,921	587	14.97	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	10,131	9,760	371	3.80	

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

## ＜1＞パフォーマンス・サマリー

## (2) 期間別リターン

## 「総合」およびファンド分類別①

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	-0.42	-4.62	-6.72	4.14
国内株式	-5.63	-12.29	-16.54	4.80
一般	-5.63	-13.21	-18.15	4.90
フリー	-5.74	-13.85	-18.78	4.90
バリュー	-5.24	-10.49	-15.47	4.89
小型	-7.56	-15.83	-19.80	5.50
その他	-4.82	-8.54	-11.06	4.27
日経225	-5.12	-7.11	-8.57	3.71
TOPIX	-4.66	-9.80	-13.05	4.89
JPX日経400	-4.33	-9.27	-12.58	5.03
国内債券	1.25	0.81	1.10	0.40
一般	1.25	0.81	1.10	0.40
外国株式(先進国)	-0.17	-7.25	-8.39	7.50
グローバル	0.06	-7.34	-8.66	7.62
除く日本	-1.74	-7.73	-8.31	6.80
含む日本	0.53	-7.24	-8.74	7.83
その他	-0.92	-6.97	-7.48	7.09
北米	-2.61	-8.95	-6.50	8.58
米国	-1.06	-5.81	-4.29	7.55
カナダ	-0.06	-7.00	-8.48	8.90
欧州	-2.32	-11.77	-14.98	6.82
アジア・オセアニア	3.52	-4.34	-8.97	4.94
オーストラリア	-0.17	-8.49	-12.39	5.40
ニュージーランド	4.20	-0.43	-0.03	2.49
複合地域	-8.11	-19.14	-16.69	8.68
エマージング株式	4.52	-9.03	-16.71	1.99
グローバル	6.15	-7.71	-15.33	6.82
BRICS	6.76	-2.69	-12.30	8.02
その他	3.83	-9.71	-17.34	0.05
欧州	6.90	-0.77	-13.63	9.70
ロシア	4.57	0.82	-2.29	11.37
アジア・オセアニア	4.56	-7.23	-16.09	5.19
中国	6.27	-12.79	-23.12	7.71
インド	2.63	-13.72	-18.38	-6.23
インドネシア	18.05	8.09	-7.55	4.94
タイ	1.92	-1.70	-10.95	6.97
フィリピン	9.64	0.74	-12.27	4.50
ベトナム	-4.18	-8.65	-23.25	-1.39
韓国	-1.53	-12.70	-23.27	-0.23
香港	8.04	-5.06	-13.46	6.27
台湾	4.29	-19.84	-17.42	0.29
中南米	4.69	5.10	-4.51	12.22
ブラジル	9.66	20.21	-1.02	15.64
メキシコ	1.50	-15.99	-12.66	5.93
中東・アフリカ	4.69	-6.18	-7.77	6.25
南アフリカ	9.01	-8.95	-17.80	10.01
トルコ	13.53	-2.11	-34.64	12.19
複合地域	6.97	-7.55	-13.26	4.87

## <1>パフォーマンス・サマリー

### (2) 期間別リターン

#### 「総合」およびファンド分類別②

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	-0.42	-4.62	-6.72	4.14
外国債券(先進国)	-0.01	-0.72	-2.84	0.76
グローバル	0.22	-0.47	-2.09	0.58
除く日本	0.07	-0.60	-2.40	0.28
含む日本	0.39	-0.32	-1.77	0.93
その他	-0.61	-1.38	-4.66	1.24
北米	-0.15	-0.93	-1.62	0.01
米国	-1.34	-0.48	-0.24	0.79
カナダ	-2.20	-1.06	-4.30	2.27
欧州	-0.70	-1.46	-4.39	0.09
アジア・オセアニア	-0.06	-1.77	-6.46	1.56
オーストラリア	-0.29	-2.03	-6.92	1.54
複合地域	0.04	-0.40	-2.65	0.11
エマージング債券	2.19	0.42	-7.47	2.21
グローバル	2.46	-0.51	-8.76	3.65
米ドル建て	2.26	-0.37	-8.74	3.84
現地通貨建て	3.40	-1.16	-8.56	2.82
その他	1.95	1.22	-6.34	1.01
ロシア	-0.27	-4.76	-10.64	6.42
アジア・オセアニア	1.39	1.14	-1.89	0.67
インド	2.38	-1.58	-6.33	-2.33
インドネシア	8.02	0.74	-9.86	0.18
ブラジル	-0.08	6.47	-6.19	4.69
メキシコ	3.73	-4.73	0.67	3.04
南アフリカ	10.79	-1.48	-4.73	8.68
トルコ	15.62	3.30	-29.21	6.16
複合地域	4.14	-1.75	-1.17	3.41
ハイイールド債券	-1.50	-1.94	-5.14	3.82
グローバル	-0.53	-1.33	-6.42	3.66
北米	-2.09	-2.09	-3.56	4.18
その他	-0.27	-1.92	-8.99	2.80
欧州	-0.72	-2.40	-10.01	2.79
アジア・オセアニア	1.70	0.17	-5.43	2.77
複合地域	-2.05	-2.32	-4.07	1.14
複合資産	-0.16	-2.93	-4.59	2.51
安定	0.12	-2.37	-4.07	1.84
安定成長	-0.08	-2.87	-4.56	2.77
成長	-1.62	-5.72	-7.46	3.90
国内バランス	0.67	-0.76	-1.57	1.43
安定	0.92	-0.28	-0.75	1.28
一般	-2.01	-5.91	-9.19	3.19

## <1>パフォーマンス・サマリー

### (2) 期間別リターン

#### 「総合」およびファンド分類別③

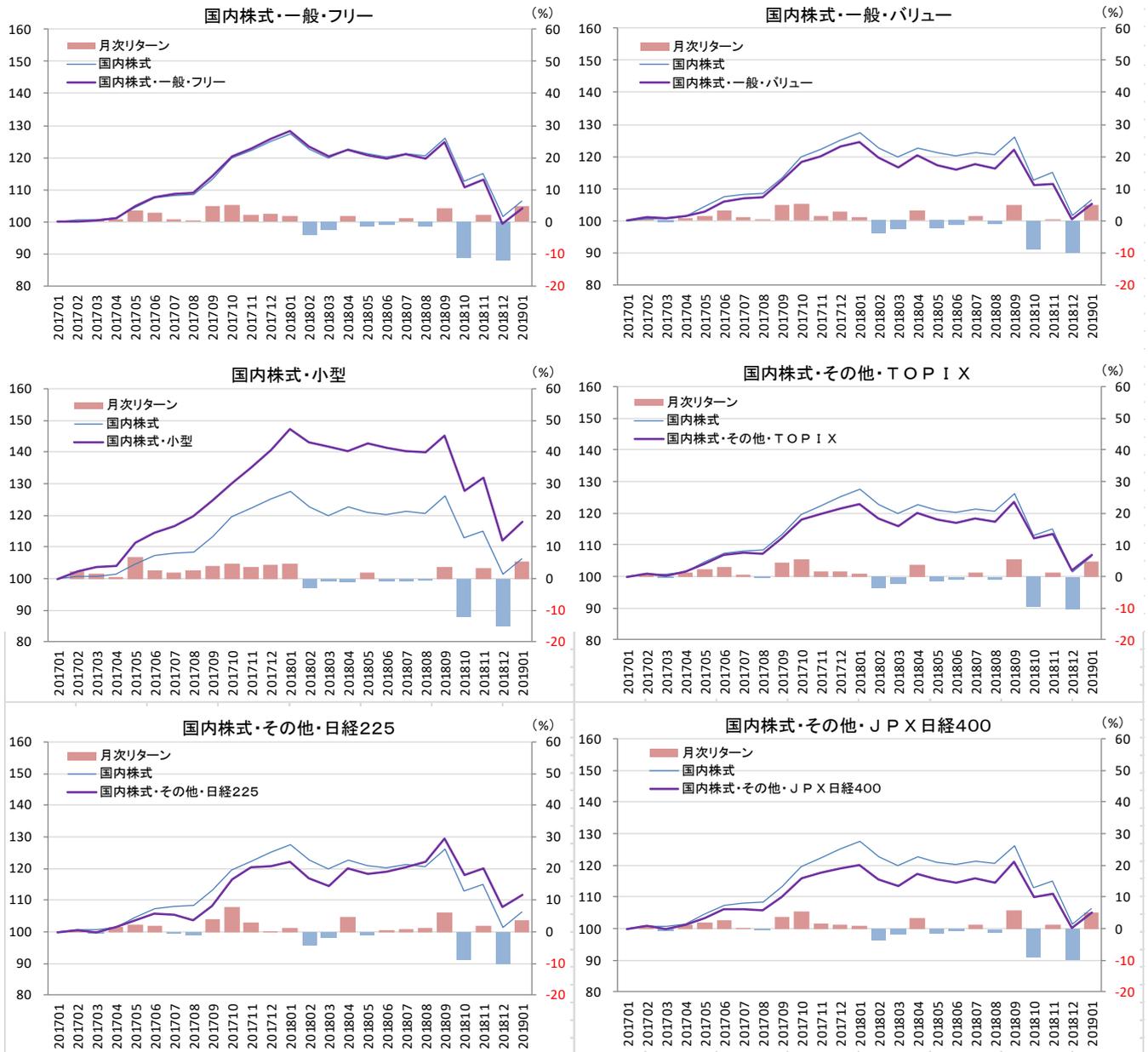
	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	-0.42	-4.62	-6.72	4.14
国内REIT	6.43	6.21	8.69	4.74
日本	6.43	6.21	8.69	4.74
外国REIT	1.79	2.00	6.72	8.28
グローバル	1.86	1.10	5.31	8.46
除く日本	2.12	1.50	6.32	8.84
含む日本	1.80	1.02	5.15	8.39
北米	0.82	2.59	8.72	8.56
その他	7.12	2.18	1.24	6.13
欧州	0.24	-7.39	-8.69	9.31
アジア・オセアニア	8.97	3.26	1.43	5.90
オーストラリア	5.32	2.21	2.42	4.83
複合地域	4.96	-3.95	-8.36	11.39
複数国	3.16	4.59	11.29	7.67
その他	-3.97	-6.02	-8.65	2.17
絶対収益型	-0.96	-2.73	-5.67	0.08
ロング・ショート	0.29	-1.89	-6.75	0.72
マーケットニュートラル	-1.51	-2.13	-2.40	-1.26
GTAA	-0.25	-1.48	-4.25	0.54
その他スタイル	-1.26	-3.12	-5.87	0.11
CB	-0.56	-3.22	-5.30	2.35
アジア・オセアニア	4.71	0.82	-5.93	2.26
日本	-2.17	-4.18	-5.31	0.46
グローバル	-0.62	-3.26	-5.22	2.44
コモディティ	-2.80	-2.38	-6.15	3.09
全業種	-8.57	-7.98	-8.34	3.20
貴金属	5.46	5.49	-4.44	2.65
エネルギー	-20.15	-18.23	-6.49	14.96
その他コモディティ	-4.17	-6.24	-7.33	3.80

<1>パフォーマンス・サマリー

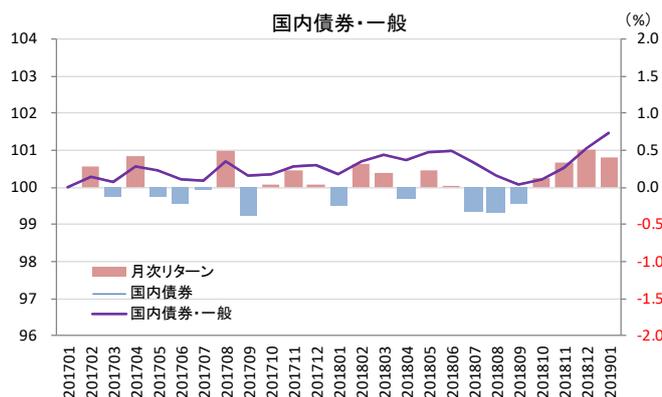
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

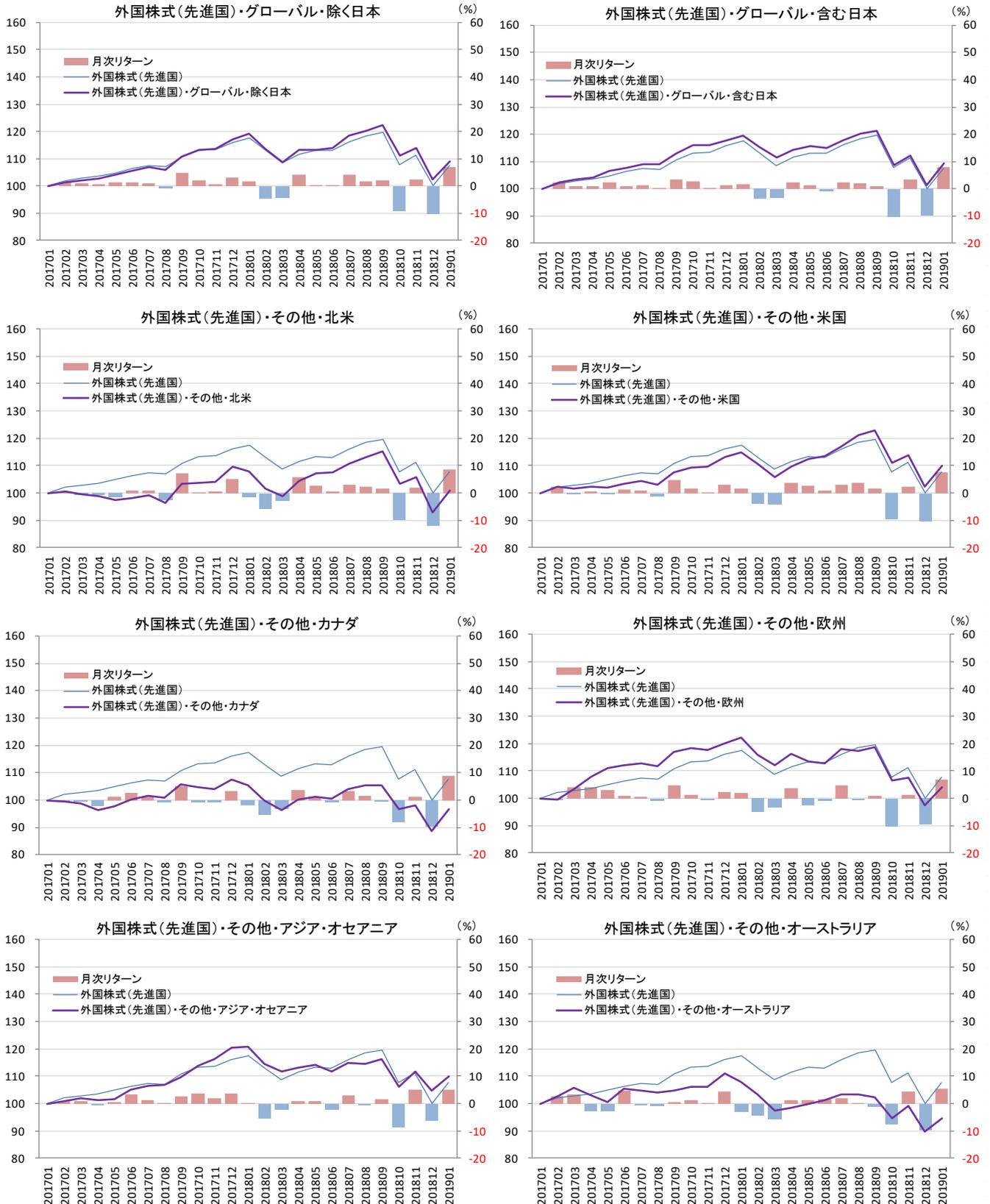


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

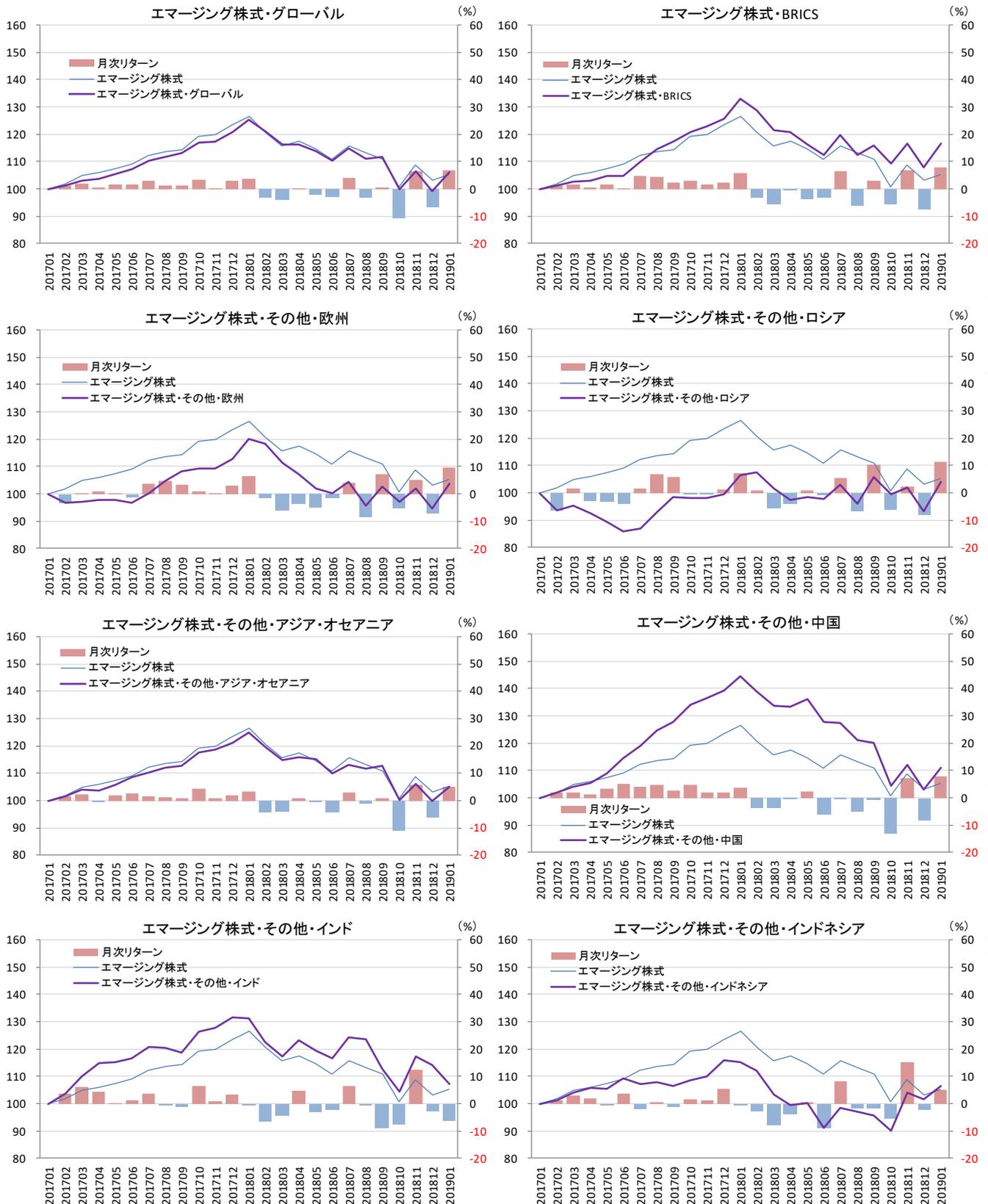


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別③

[エマージング株式]

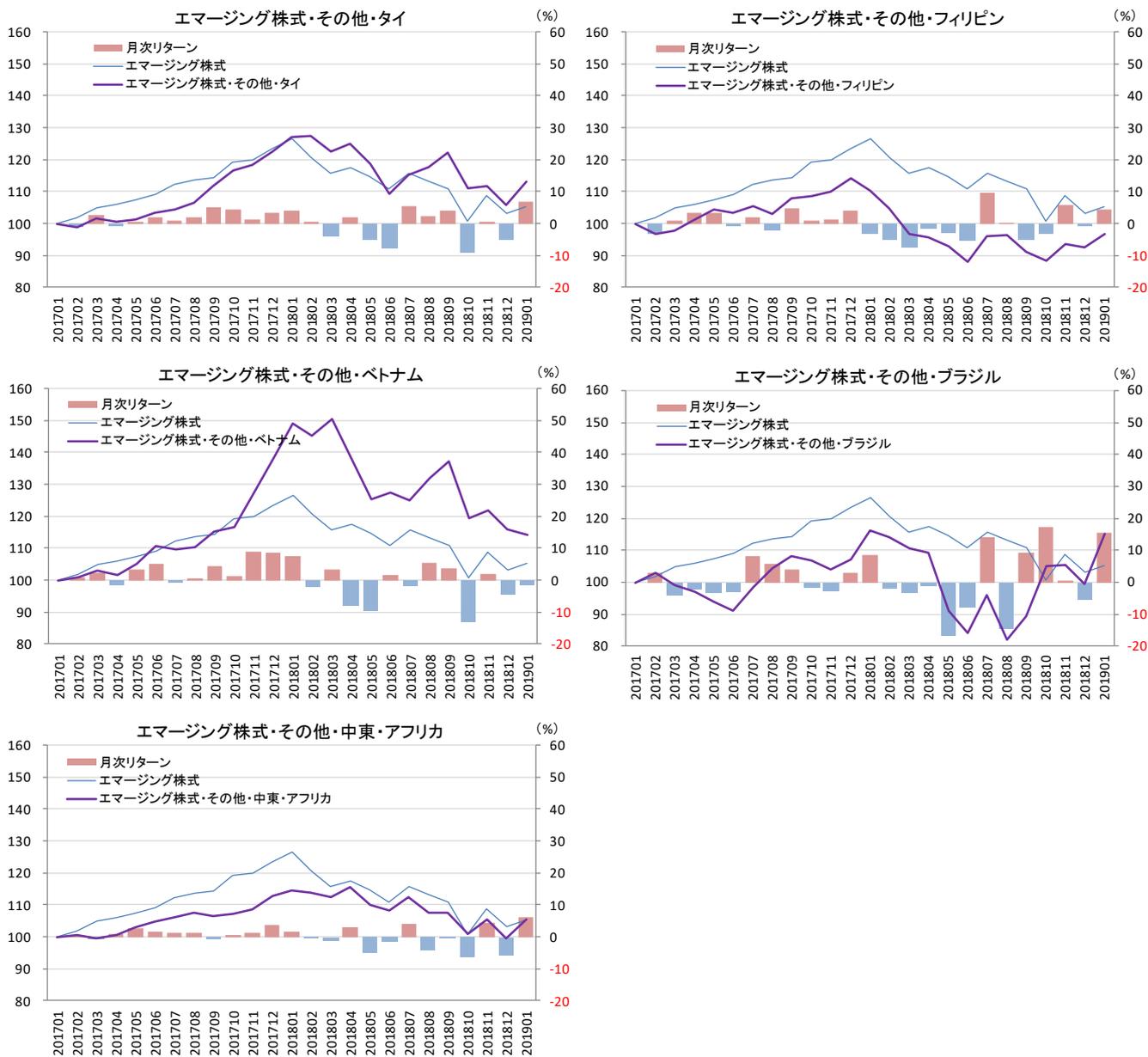


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別④

[エマージング株式]

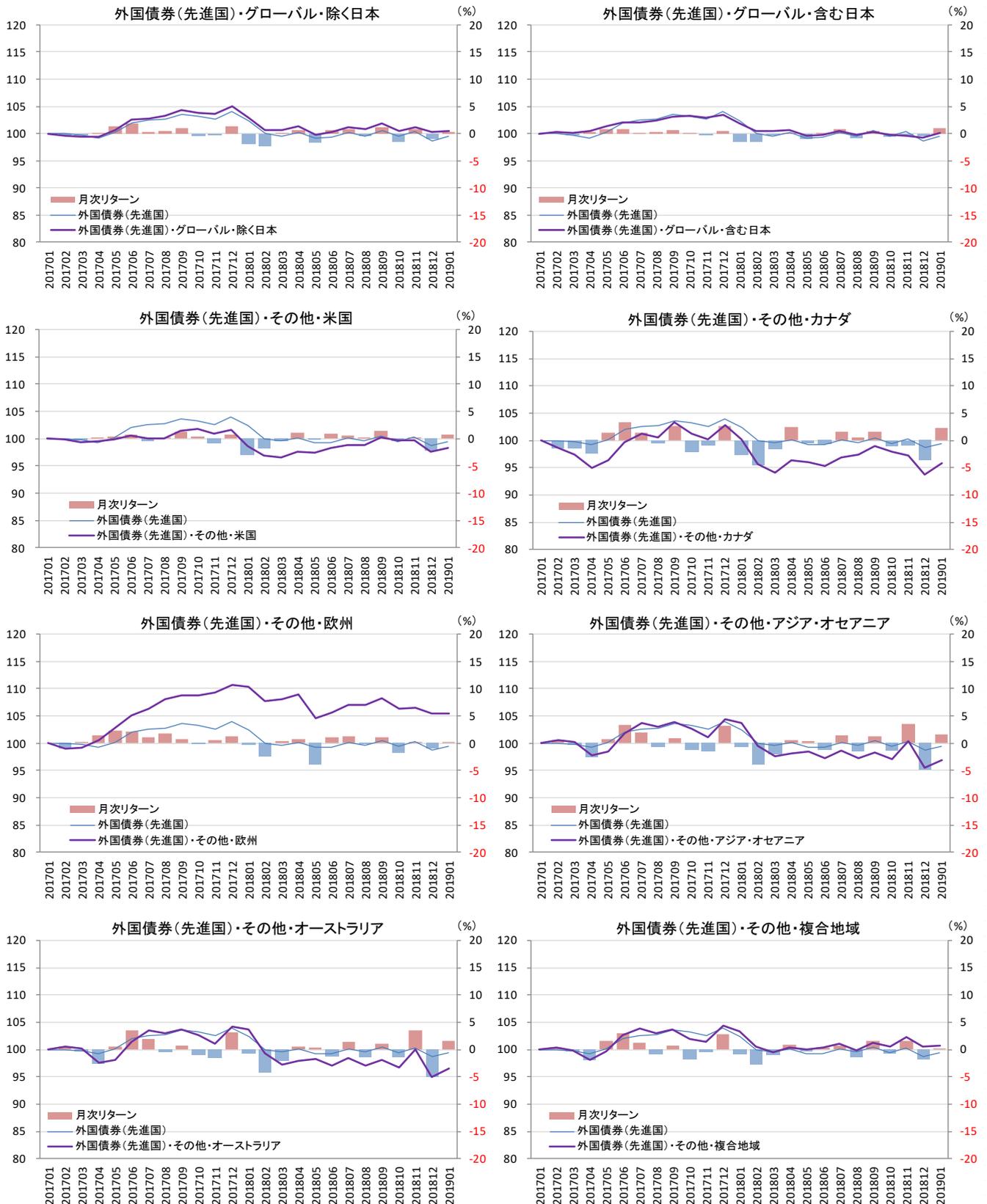


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

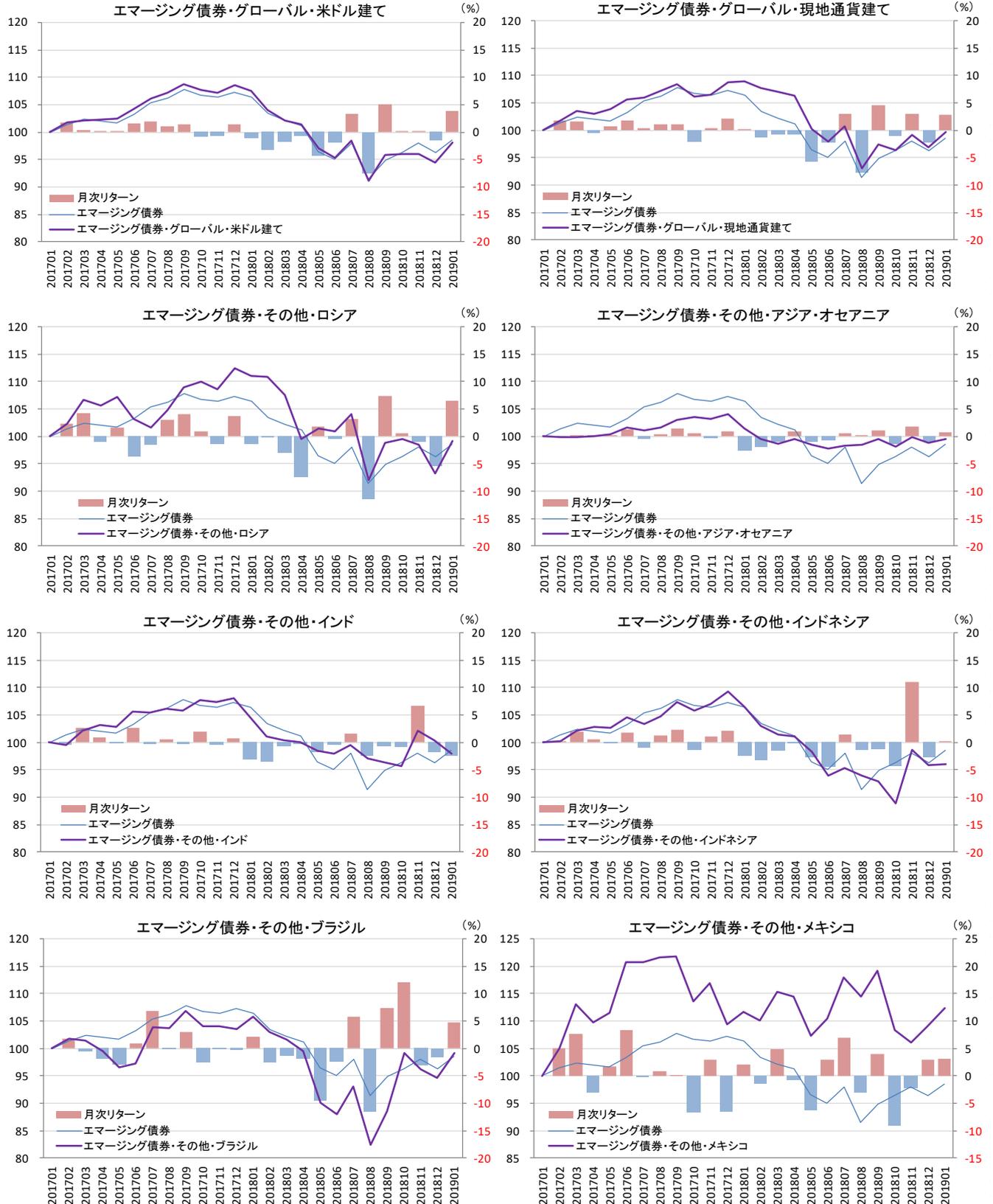


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

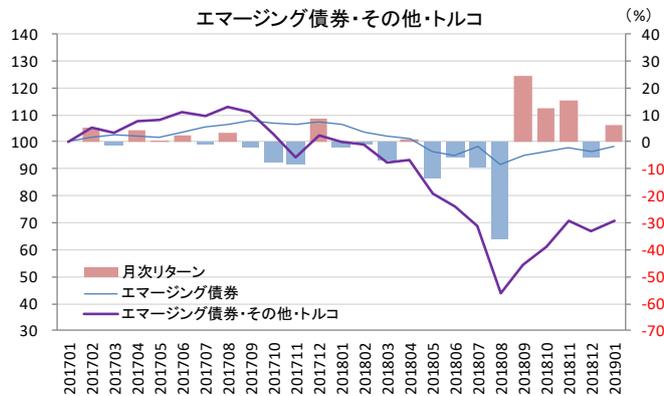


<1>パフォーマンス・サマリー

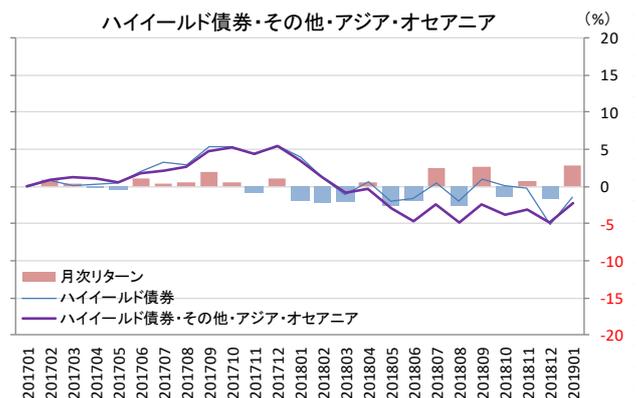
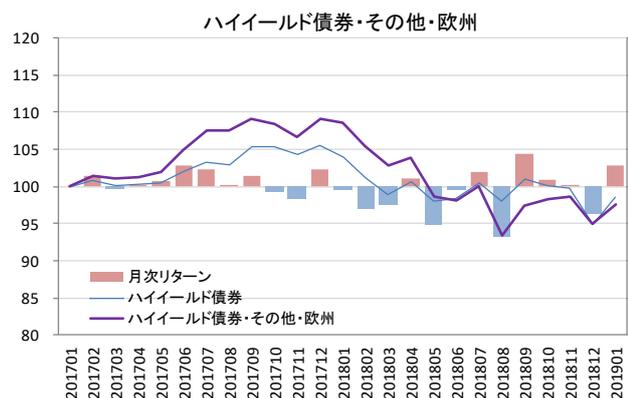
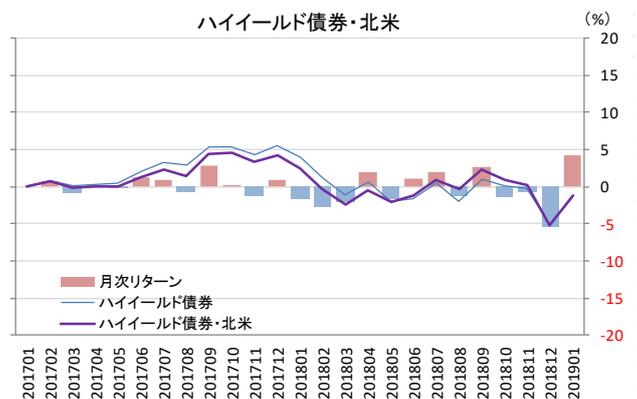
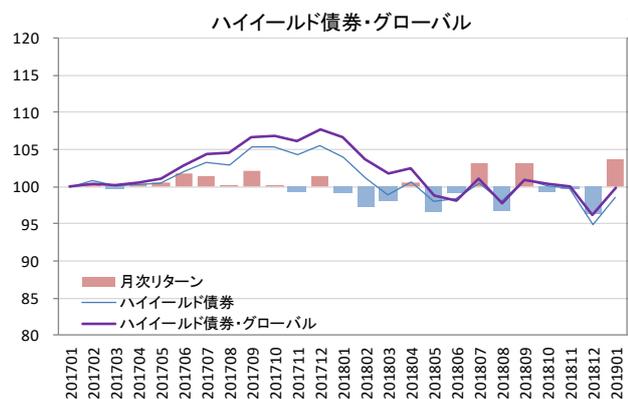
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

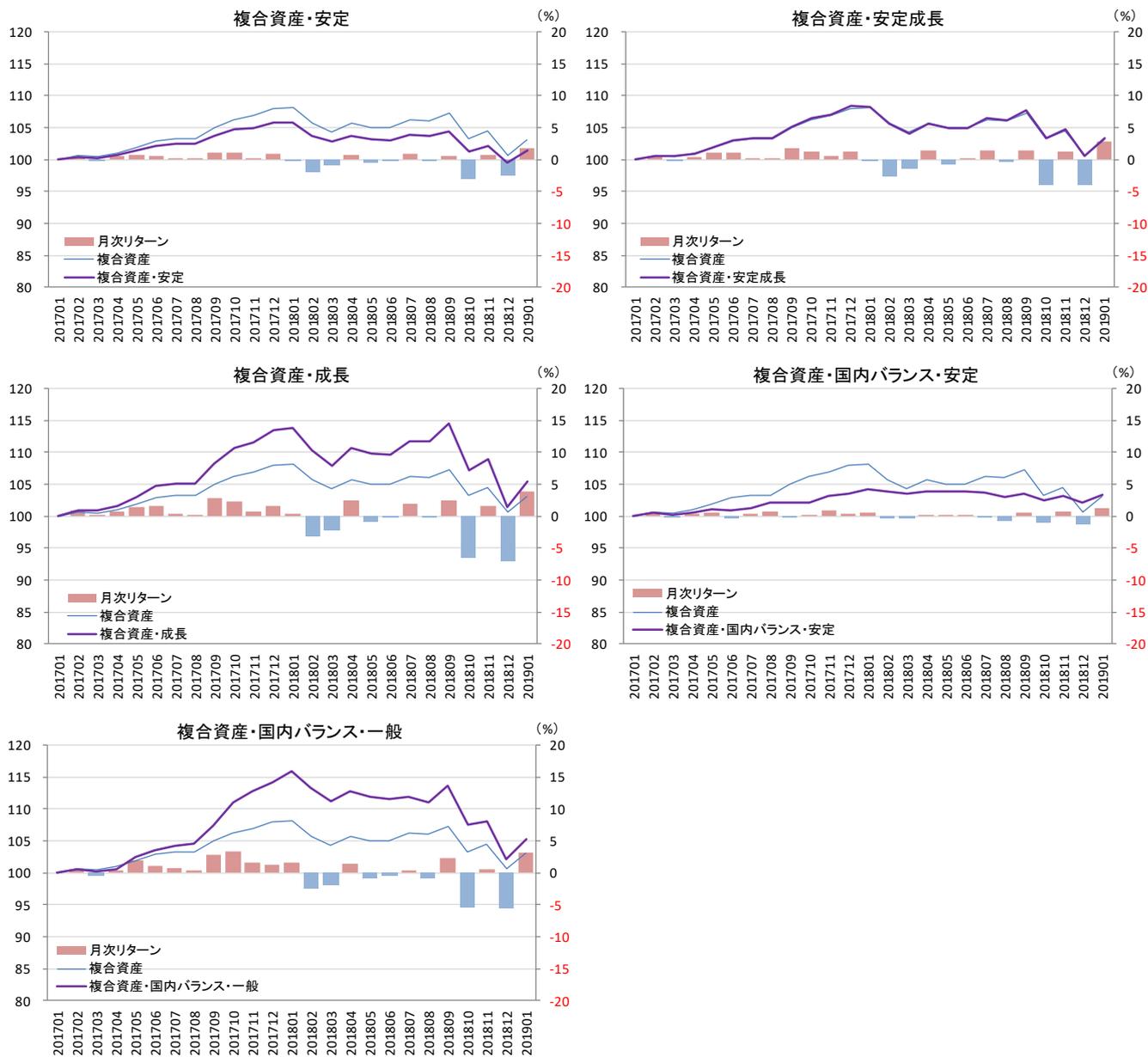


<1>パフォーマンス・サマリー

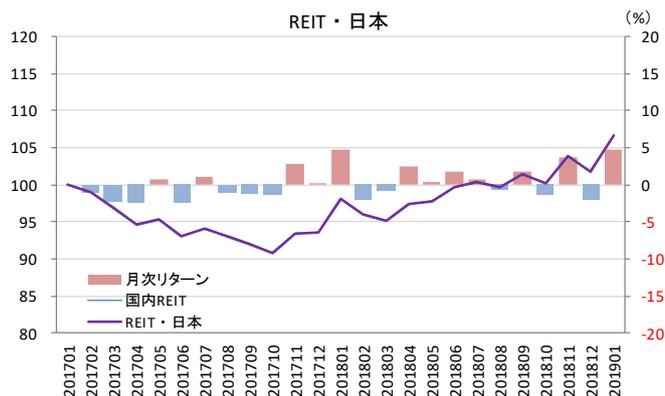
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

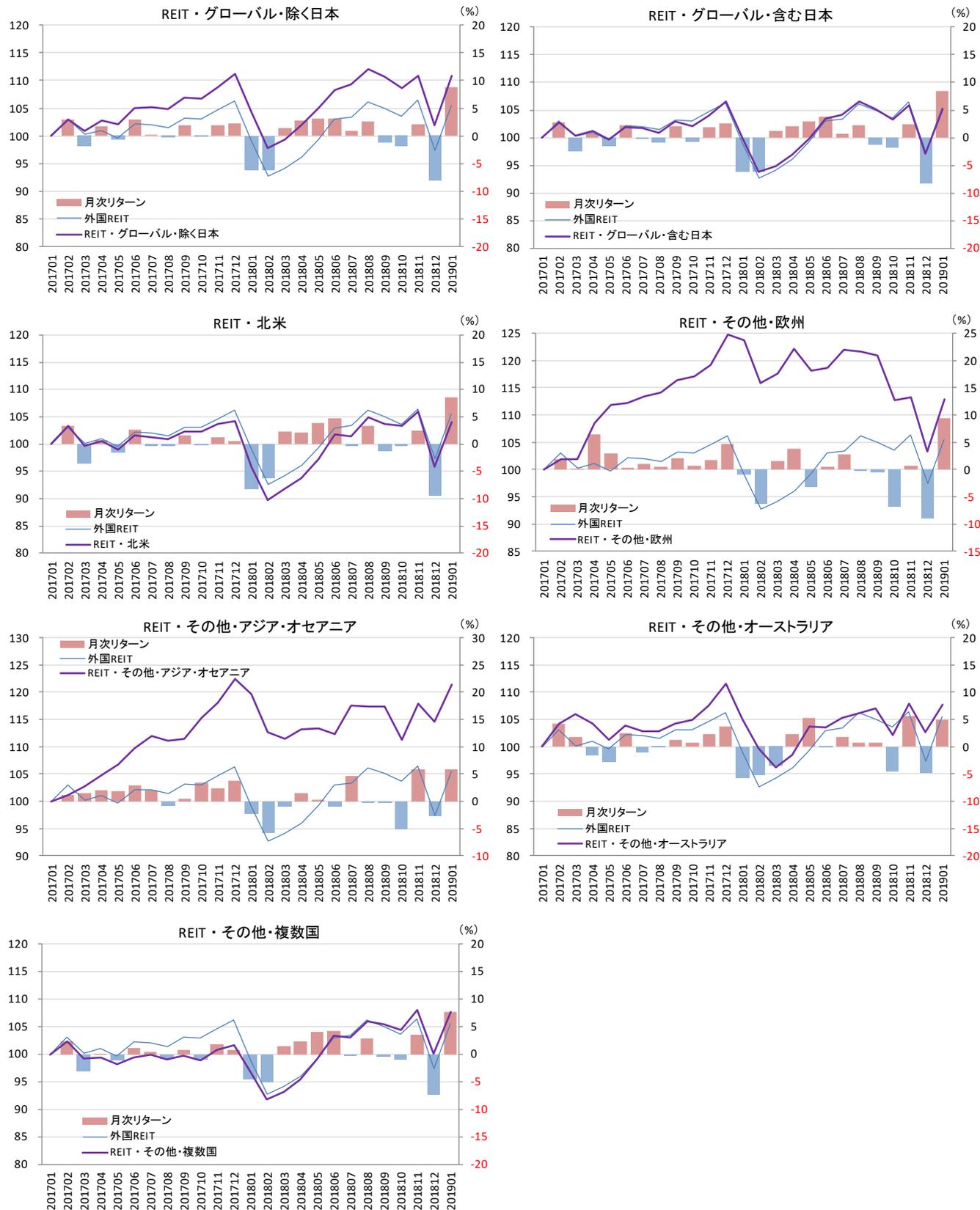


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

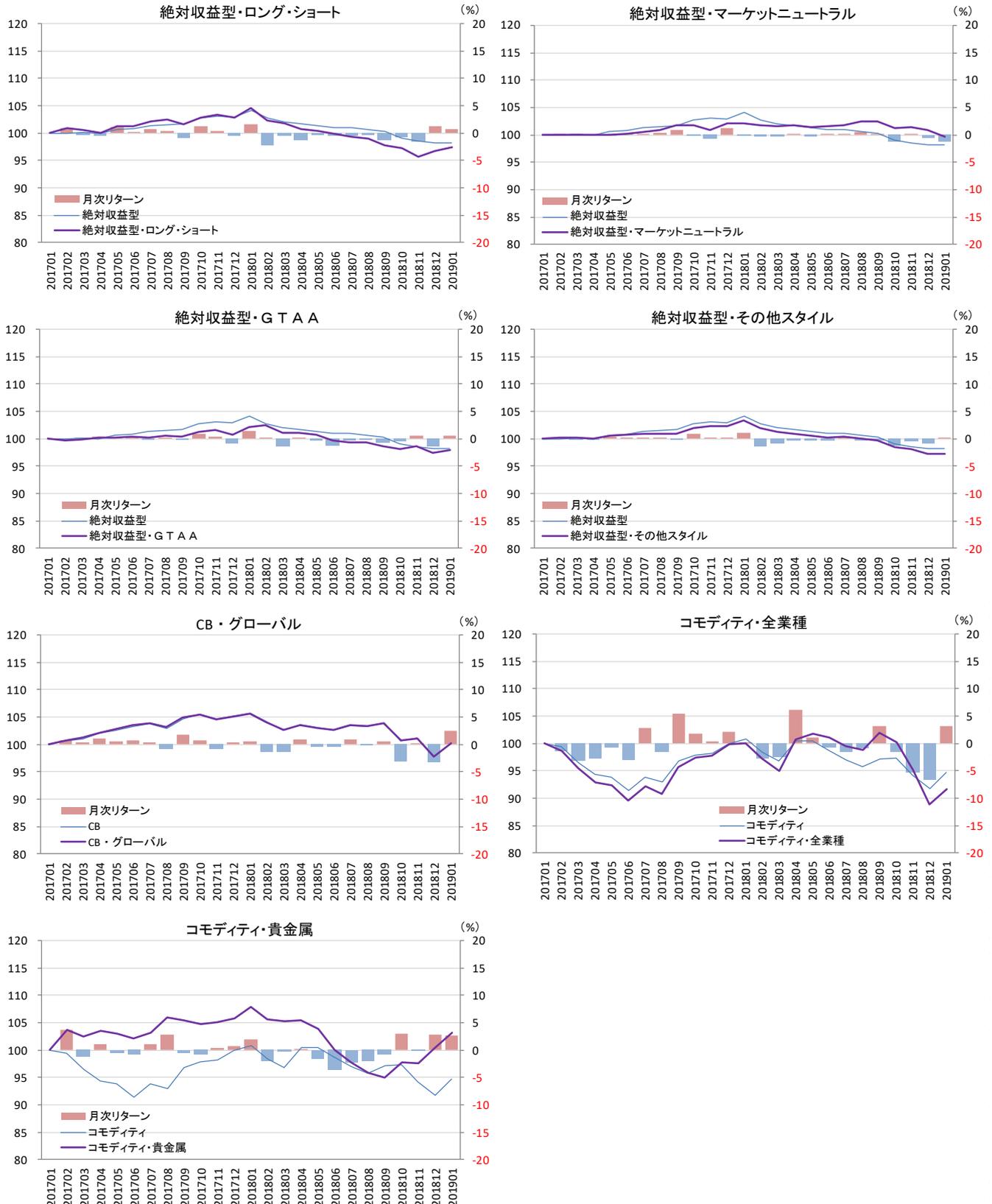


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑩

[その他]





## <1>パフォーマンス・サマリー

### (4) 対「総合」寄与度分析

#### ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	4.14		
1	外国株式(先進国)・グローバル	7.62	16.73	1.27
2	国内株式・一般	4.90	9.95	0.49
3	外国株式(先進国)・その他	7.09	5.07	0.36
4	REIT・北米	8.56	3.92	0.34
5	REIT・グローバル	8.46	2.91	0.25
6	国内株式・その他	4.27	4.89	0.21
7	REIT・日本	4.74	4.27	0.20
8	複合資産・安定成長	2.77	6.55	0.18
9	ハイイールド債券・北米	4.18	2.68	0.11
10	エマージング株式・グローバル	6.82	1.50	0.10
11	国内株式・小型	5.50	1.65	0.09
12	複合資産・安定	1.84	4.53	0.08
13	複合資産・成長	3.90	1.87	0.07
14	外国債券(先進国)・グローバル	0.58	10.77	0.06
15	エマージング債券・グローバル	3.65	1.53	0.06
16	外国債券(先進国)・その他	1.24	4.05	0.05
17	REIT・その他	6.13	0.74	0.05
18	ハイイールド債券・グローバル	3.66	0.64	0.02
19	ハイイールド債券・その他	2.80	0.83	0.02
20	国内債券・一般	0.40	5.57	0.02
21	エマージング債券・その他	1.01	1.83	0.02
22	複合資産・国内バランス	1.43	1.20	0.02
23	エマージング株式・BRICS	8.02	0.11	0.01
24	コモディティ	3.09	0.26	0.01
25	CB	2.35	0.29	0.01
26	エマージング株式・その他	0.05	4.07	0.00
27	絶対収益型	0.08	1.16	0.00
	合計		99.55	4.10

#### ◆計算定義

$$\text{寄与度(％)} = \text{累積リターン(％)} \times \text{スタート時点の純資産額構成比(％)}$$

※「総合」の累積リターンとカテゴリー別寄与度の合計の差について  
分析期間が長期になるにつれ、累積計算で発生する交差項の影響が大きくなります。

## <1>パフォーマンス・サマリー

### (4) 対「総合」寄与度分析

#### ファンド中分類別

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	-6.72		
1	REIT・北米	8.72	5.06	0.44
2	REIT・日本	8.69	4.25	0.37
3	REIT・グローバル	5.31	3.37	0.18
4	国内債券・一般	1.10	4.60	0.05
5	REIT・その他	1.24	0.89	0.01
6	複合資産・国内バランス	-1.57	0.82	-0.01
7	コモディティ	-6.15	0.23	-0.01
8	エマージング株式・BRICS	-12.30	0.14	-0.02
9	CB	-5.30	0.34	-0.02
10	ハイイールド債券・グローバル	-6.42	0.82	-0.05
11	絶対収益型	-5.67	0.97	-0.05
12	ハイイールド債券・その他	-8.99	1.13	-0.10
13	複合資産・成長	-7.46	1.60	-0.12
14	ハイイールド債券・北米	-3.56	3.52	-0.13
15	エマージング債券・その他	-6.34	2.16	-0.14
16	複合資産・安定	-4.07	3.77	-0.15
17	エマージング債券・グローバル	-8.76	1.89	-0.17
18	外国債券(先進国)・その他	-4.66	4.57	-0.21
19	外国債券(先進国)・グローバル	-2.10	10.77	-0.23
20	エマージング株式・グローバル	-15.33	1.73	-0.26
21	複合資産・安定成長	-4.56	5.86	-0.27
22	国内株式・小型	-19.80	1.63	-0.32
23	外国株式(先進国)・その他	-7.48	4.99	-0.37
24	国内株式・その他	-11.06	4.18	-0.46
25	エマージング株式・その他	-17.34	4.41	-0.77
26	外国株式(先進国)・グローバル	-8.66	15.23	-1.32
27	国内株式・一般	-18.15	10.64	-1.93
	合計		99.55	-6.06

#### ◆計算定義

$$\text{寄与度(％)} = \text{累積リターン(％)} \times \text{スタート時点の純資産額構成比(％)}$$

※「総合」の累積リターンとカテゴリー別寄与度の合計の差について  
分析期間が長期になるにつれ、累積計算で発生する交差項の影響が大きくなります。

## <2>リスク・サマリー

### (1) 期間別リスク・リターン

#### 「総合」およびファンド分類別①

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	9.98	21.00	106.80	9.04	9.50	11.66	0.36	0.41	0.64
国内株式	17.06	37.25	147.74	15.50	15.72	17.67	0.35	0.42	0.53
一般	15.19	33.51	130.61	15.61	16.10	17.92	0.31	0.37	0.48
フリー	15.49	32.41	130.28	15.76	16.48	18.61	0.32	0.35	0.47
バリュー	14.27	38.14	139.18	15.35	15.00	16.54	0.30	0.45	0.55
小型	31.89	62.99	245.33	17.32	15.56 ↑	17.79	0.56	0.66	0.74
その他	18.50	42.43	172.36	15.37	15.37	17.66	0.38	0.48	0.59
日経225	22.91	47.29	192.95	15.49	15.42	18.00	0.46	0.52	0.63
TOPIX	15.53	39.95	133.86	15.15	15.30	17.08	0.33	0.45	0.52
JPX日経400	12.57	34.44	-	14.60	14.83	-	0.28	0.41	-
国内債券	2.19	6.66	17.05	1.68	1.47	1.48	0.46	0.88	1.04
一般	2.19	6.66	17.05	1.68	1.47	1.48	0.46	0.88	1.04
外国株式(先進国)	21.51	25.26	135.67	13.62	14.47 ↑	16.33	0.50	0.32	0.55
グローバル	21.37	30.82	144.41	13.56	14.26 ↑	16.18	0.50	0.39	0.58
除く日本	25.47	37.56	219.56	14.80	15.69 ↑	18.04	0.53	0.42	0.68
含む日本	20.17	28.88	130.63	13.31	13.97 ↑	15.86	0.48	0.37	0.55
その他	22.13	14.12	152.80	14.02	15.17 ↑	18.17	0.50	0.18	0.53
北米	24.05	15.28	83.31	16.47	16.89 ↑	20.97	0.46	0.17	0.30
米国	32.10	22.07	177.37	14.42	16.31	18.21	0.68	0.25	0.59
カナダ	18.29	-11.17	-	12.86	13.84 ↑	-	0.45	-0.17	-
欧州	8.20	11.48	143.53	15.06	14.97 ↑	19.28 ↓	0.18	0.15	0.48
アジア・オセアニア	24.54	35.78	282.83	13.14	14.63	19.52 ↓	0.58	0.43	0.73
オーストラリア	7.98	11.68	184.47	15.41	15.27	20.68 ↓	0.17	0.15	0.53
ニュージーランド	33.09	67.19	-	14.56 ↓	16.82	-	0.69	0.64	-
複合地域	-3.61	-19.74	-	19.09	18.95 ↑	-	-0.06	-0.23	-
エマーGING株式	23.19	25.04	142.05	14.01 ↓	15.06	19.57 ↓	0.52	0.30	0.47
グローバル	26.03	16.36	125.95	14.50	15.82	19.37	0.56	0.19	0.44
BRICS	55.91	44.15	192.55	16.72 ↓	17.96	22.32	0.96	0.42	0.51
その他	21.06	28.38	148.82	14.25 ↓	15.05	19.55 ↓	0.47	0.34	0.49
欧州	43.91	4.10	169.63	18.87	19.96	26.34 ↓	0.69	0.04	0.39
ロシア	64.54	23.81	264.67	21.19	24.98	29.60 ↓	0.85	0.17	0.47
アジア・オセアニア	18.42	22.19	159.40	13.88	15.03	18.12	0.42	0.27	0.55
中国	24.94	47.53	165.35	16.63 ↓	22.01	22.68	0.47	0.37	0.45
インド	20.01	69.57	195.39	20.01	19.99	26.03	0.32	0.56	0.44
インドネシア	16.75	25.09	-	16.34	20.56	-	0.33	0.22	-
タイ	36.38	47.58	373.58	13.87	14.38	18.14	0.79	0.56	0.93
フィリピン	-1.95	19.21	-	15.44	15.45	-	-0.04	0.23	-
ベトナム	33.48	25.98	-	16.00	16.07	-	0.63	0.29	-
韓国	-9.63	-5.72	107.74	16.48	15.04	21.68 ↓	-0.20	-0.08	0.35
香港	46.72	34.55	142.23	14.80 ↓	18.51	19.57	0.92	0.33	0.47
台湾	13.88	30.61	242.07	16.70	16.55	20.84 ↓	0.27	0.33	0.63
中南米	57.33	13.49	98.50	22.77	22.82	24.42	0.72	0.11	0.29
ブラジル	108.33	13.27	76.30	31.51	31.38	30.64	0.88	0.08	0.19
メキシコ	-11.89	-18.31	-	22.22	19.85	-	-0.18	-0.20	-
中東・アフリカ	17.91	7.36	143.90	13.03 ↓	15.09	17.56 ↓	0.44	0.09	0.53
南アフリカ	14.84	-31.36	-	17.82	19.36 ↑	-	0.27	-0.37	-
トルコ	-24.63	-20.40	61.29	31.59 ↑	29.15	33.11	-0.28	-0.15	0.15
複合地域	8.72	7.44	151.99	13.69	14.03	16.87 ↓	0.21	0.10	0.57

※[色塗りの基準] 累積リターン>総合、リスク<総合、シャープ・レシオ>=0.5

[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑:上昇傾向、↓:低下傾向

## ＜2＞リスク・サマリー

### (1) 期間別リスク・リターン

#### 「総合」およびファンド分類別②

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	9.98	21.00	106.80	9.04	9.50	11.66	0.36	0.41	0.64
外国債券(先進国)	-1.51	3.87	53.46	5.41	5.72	8.60 ↓	-0.08	0.13	0.50
グローバル	-1.70	5.12	48.76	4.85	5.17	7.90 ↓	-0.11	0.19	0.51
除く日本	-3.24	4.11	58.30	5.56	5.91	8.66 ↓	-0.19	0.14	0.54
含む日本	0.32	6.39	37.20	4.18 ↓	4.46	7.11 ↓	0.04	0.28	0.45
その他	-1.43	1.61	70.87	7.39	7.45	10.38 ↓	-0.06	0.04	0.53
北米	0.52	10.82	-	2.91 ↓	4.11	-	0.08	0.51	-
米国	-2.76	9.86	59.39	5.53	5.81	6.82 ↓	-0.16	0.33	0.69
カナダ	-4.54	-6.68	30.68	8.55	9.12	10.38 ↓	-0.17	-0.15	0.26
欧州	-1.39	1.30	46.77	7.39	7.29	10.56 ↓	-0.06	0.04	0.37
アジア・オセアニア	-1.24	1.32	92.68	8.98	8.76	11.62 ↓	-0.04	0.03	0.58
オーストラリア	-1.20	0.49	93.83	9.07	8.83	12.07 ↓	-0.04	0.01	0.56
複合地域	3.43	4.21	58.92	6.89 ↓	7.50	10.34 ↓	0.17	0.11	0.45
エマージング債券	16.14	12.71	80.96	9.19 ↓	10.79	13.12 ↓	0.56	0.22	0.46
グローバル	14.31	11.32	81.94	9.46 ↓	10.67	12.94 ↓	0.49	0.20	0.47
米ドル建て	15.85	13.26	87.97	9.51 ↓	10.88	13.12 ↓	0.53	0.23	0.49
現地通貨建て	5.15	-0.60	51.40	10.03	10.09	12.18 ↓	0.17	-0.01	0.34
その他	17.95	13.70	76.40	9.70 ↓	11.92	14.21	0.59	0.22	0.41
ロシア	36.73	-13.17	111.71	16.77	24.66	22.73	0.66	-0.11	0.34
アジア・オセアニア	0.12	16.81	78.64	5.87 ↓	6.78	9.16 ↓	0.02	0.47	0.65
インド	2.75	30.24	-	10.28	10.08	-	0.09	0.54	-
インドネシア	3.67	20.46	-	10.51	14.32	-	0.12	0.26	-
ブラジル	44.82	21.75	94.07	17.72	19.03	17.93	0.74	0.21	0.38
メキシコ	-9.01	-12.47	-	16.40	14.49	-	-0.19	-0.18	-
南アフリカ	34.54	21.63	-	21.42 ↑	19.27	-	0.49	0.21	-
トルコ	-43.37	-43.93	-	32.90 ↑	27.81 ↑	-	-0.52	-0.39	-
複合地域	8.29	0.63	43.54	10.73	11.57	13.48 ↓	0.26	0.01	0.27
ハイイールド債券	15.93	16.27	143.48	9.00	9.55	12.46	0.57	0.32	0.74
グローバル	19.40	16.99	112.12	8.72 ↓	9.64	12.39	0.70	0.33	0.63
北米	17.01	18.28	155.71	9.35	9.58	12.10 ↓	0.58	0.36	0.81
その他	10.83	11.80	188.54	9.41 ↓	10.24	16.18	0.38	0.22	0.69
欧州	11.43	10.65	240.68	10.33 ↓	10.99	17.71 ↓	0.36	0.19	0.73
アジア・オセアニア	9.92	19.88	-	7.24 ↓	8.40	-	0.45	0.44	-
複合地域	6.13	8.81	153.24	8.97	8.54	12.55	0.23	0.20	0.77
複合資産	7.05	17.69	95.25	6.38	7.11	9.64 ↓	0.37	0.47	0.71
安定	3.70	12.48	80.49	4.71	5.56	8.19 ↓	0.27	0.43	0.74
安定成長	7.88	18.68	96.92	6.89	7.46	10.04 ↓	0.38	0.47	0.69
成長	11.97	26.92	129.64	10.23	10.52	12.26	0.38	0.46	0.70
国内バランス	6.20	10.94	45.84	2.46	4.83	6.93 ↓	0.84	0.43	0.55
安定	6.13	14.11	41.79	2.23	2.62	3.69 ↓	0.92	1.02	0.95
一般	10.39	11.32	55.98	8.38	9.44	10.02	0.41	0.23	0.45

※[色塗りの基準] 累積リターン>総合、リスク<総合、シャープ・レシオ>=0.5

[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑:上昇傾向、↓:低下傾向

## ＜2＞リスク・サマリー

### (1) 期間別リスク・リターン

#### 「総合」およびファンド分類別③

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	9.98	21.00	106.80	9.04	9.50	11.66	0.36	0.41	0.64
国内REIT	14.38	42.09	190.48	7.98	8.93	17.36	0.58	0.82	0.65
日本	14.38	42.09	190.48	7.98	8.93	17.36	0.58	0.82	0.65
外国REIT	9.68	45.32	256.71	13.52 ↑	14.00 ↑	18.16 ↓	0.23	0.55	0.74
グローバル	8.15	38.00	239.26	13.44 ↑	13.58 ↑	17.76 ↓	0.20	0.49	0.73
除く日本	13.15	47.31	263.52	13.79 ↑	13.64 ↑	17.79 ↓	0.31	0.59	0.77
含む日本	7.60	37.09	237.11	13.41 ↑	13.58 ↑	17.77 ↓	0.19	0.48	0.72
北米	9.05	50.07	258.38	14.41 ↑	15.04 ↑	21.42	0.21	0.56	0.63
その他	23.83	54.03	249.64	11.04	11.92	17.15 ↓	0.67	0.76	0.78
欧州	3.75	24.56	72.59	16.73	15.69	22.00 ↓	0.08	0.29	0.25
アジア・オセアニア	35.60	63.10	351.50	10.59	12.10	15.44 ↓	1.01	0.85	1.05
オーストラリア	13.38	46.05	244.82	13.72	14.06	18.67 ↓	0.32	0.56	0.70
複合地域	1.54	21.89	189.48	16.18 ↑	15.30 ↑	19.13 ↓	0.03	0.26	0.58
複数国	14.56	63.65	295.08	11.51 ↑	12.63	17.77	0.41	0.82	0.83
その他	0.39	2.13	32.60	9.96 ↓	10.64	11.35	0.02	0.04	0.25
絶対収益型	-4.21	-1.53	-8.16	1.95	2.18	3.44	-0.71	-0.14	-0.26
ロング・ショート	-4.80	-2.91	-1.56	2.98	2.92	3.56	-0.53	-0.20	-0.06
マーケットニュートラル	0.05	1.57	-1.73	2.10	1.99	2.05	0.03	0.16	-0.11
GTAA	-1.65	-1.27	8.52	2.21	1.95	2.58	-0.23	-0.13	0.30
その他スタイル	-4.15	-0.71	-10.42	2.03	2.41	5.27	-0.67	-0.06	-0.22
CB	5.83	6.23	65.57	5.92 ↓	6.46	9.98	0.33	0.19	0.51
アジア・オセアニア	10.75	34.26	101.02	8.92	10.58	11.33	0.39	0.57	0.63
日本	1.80	15.80	59.94	5.19	5.54	6.17	0.12	0.54	0.77
グローバル	6.18	5.39	74.73	5.91 ↓	6.37	10.55	0.35	0.17	0.54
コモディティ	3.48	-31.00	-3.24	10.36 ↓	12.34	15.65	0.12	-0.58	-0.02
全業種	0.75	-35.48	-11.45	12.79	13.98	16.20	0.02	-0.60	-0.08
貴金属	5.68	-3.17	-	6.92 ↓	9.79	-	0.28	-0.07	-
エネルギー	17.54	-44.41	-16.90	27.40 ↑	27.34 ↑	25.38	0.20	-0.41	-0.07
その他コモディティ	0.63	-19.55	51.57	14.39	14.94	18.63 ↓	0.02	-0.28	0.23

※[色塗りの基準] 累積リターン>総合、リスク<総合、シャープ・レシオ>=0.5

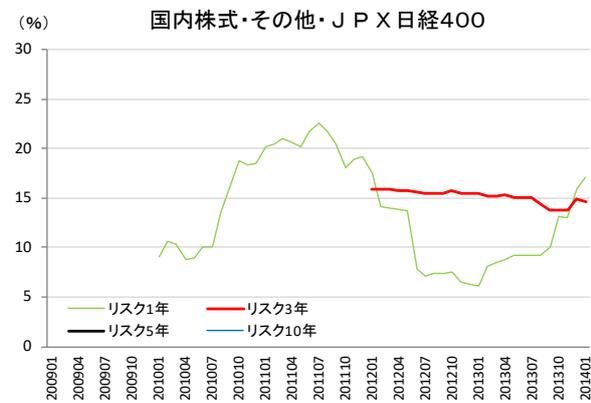
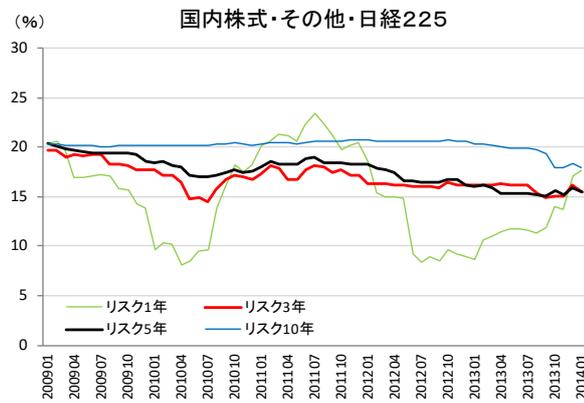
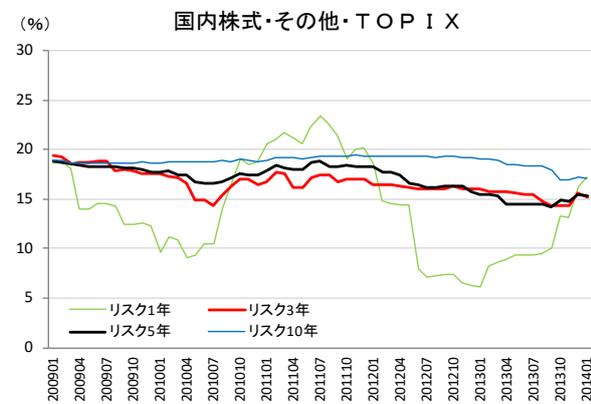
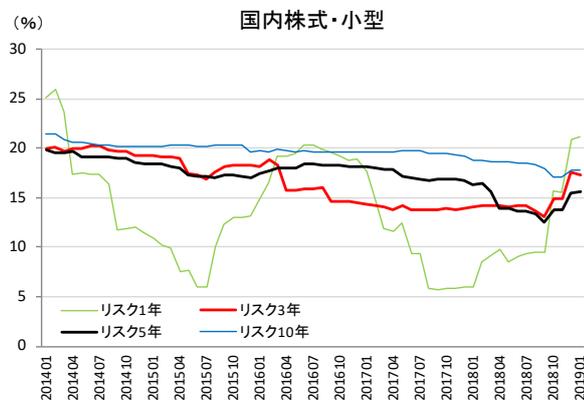
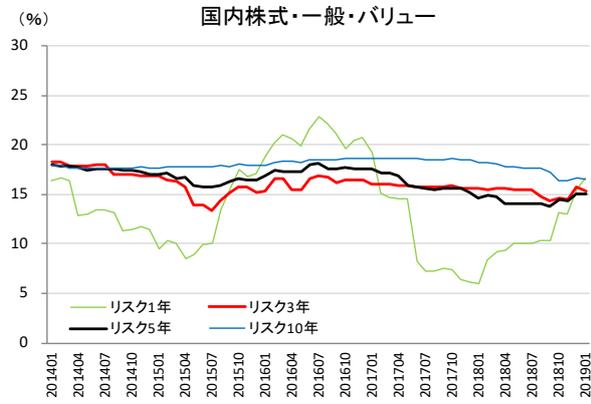
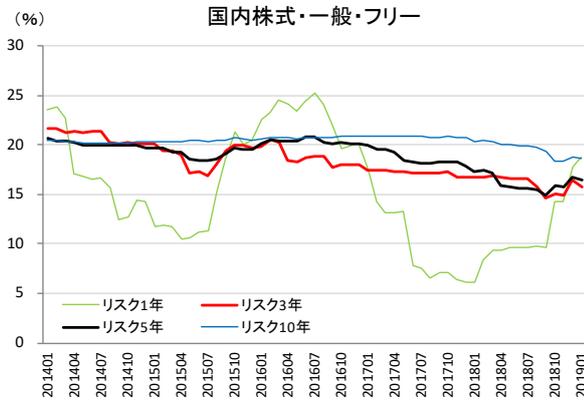
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2>リスク・サマリー

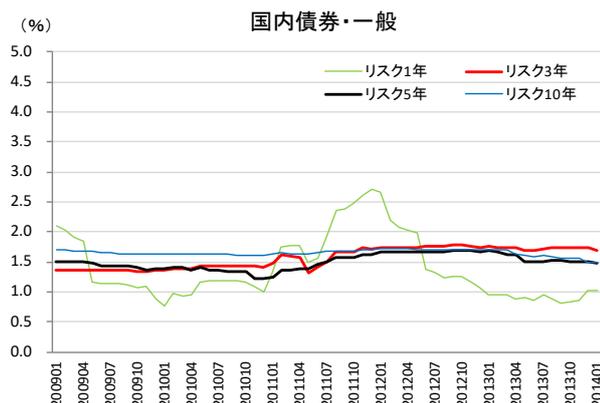
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

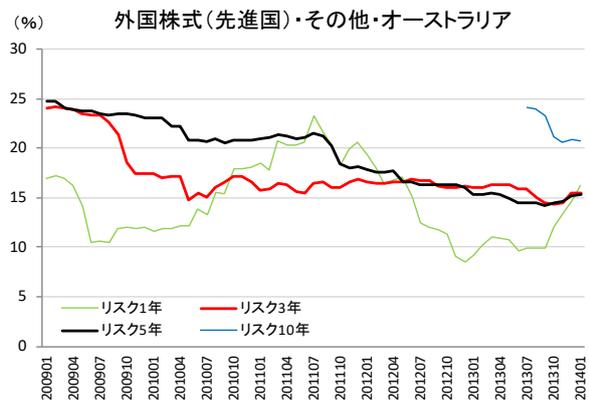
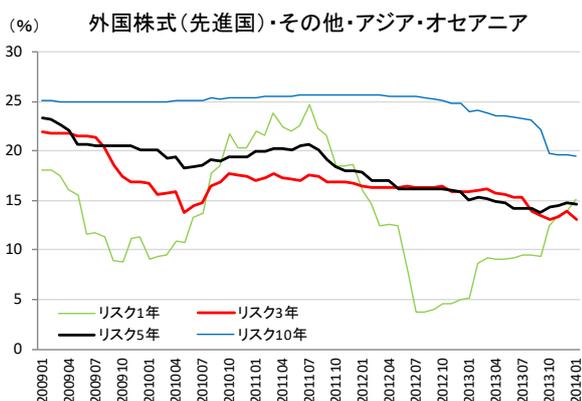
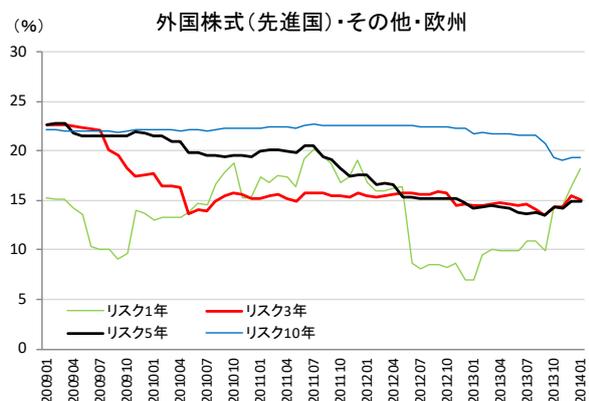
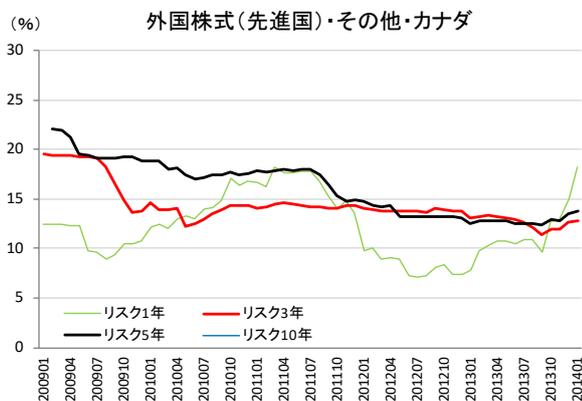
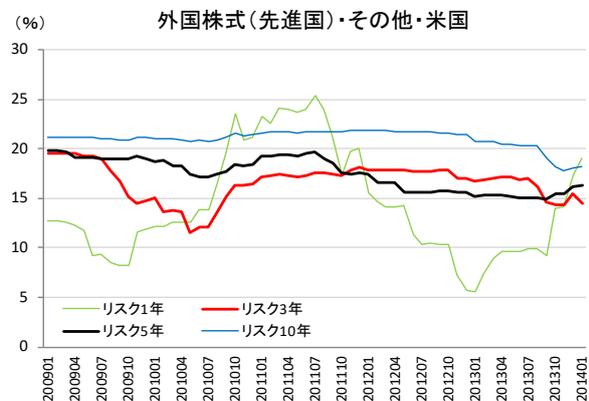
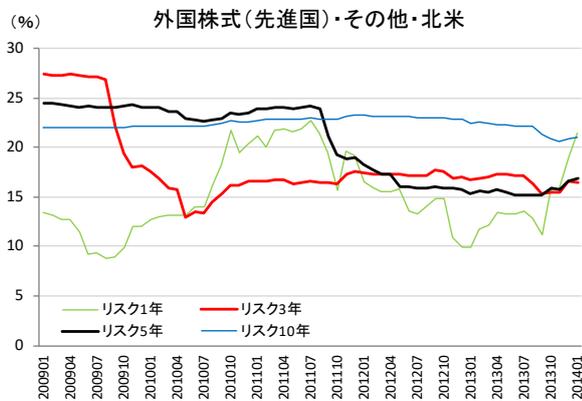
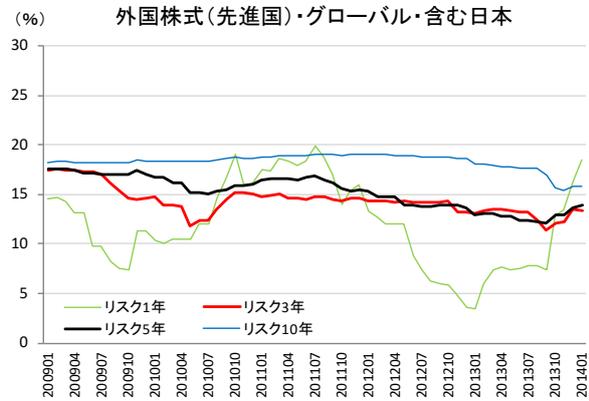
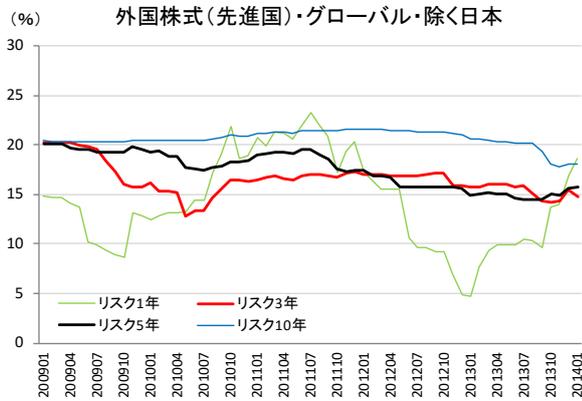


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

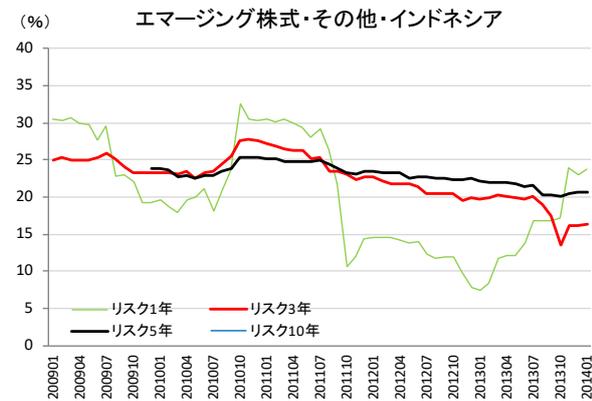
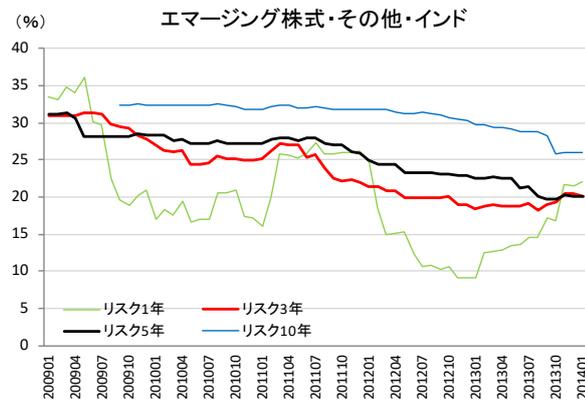
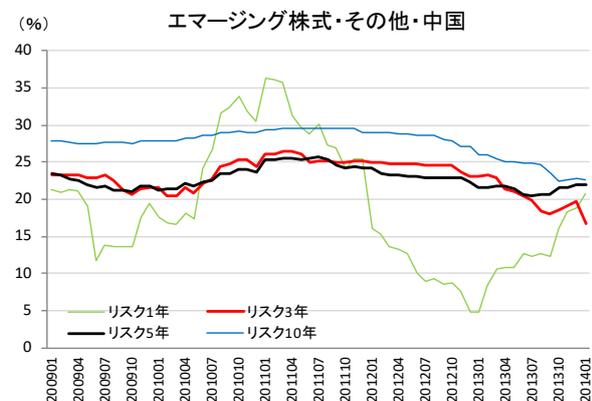
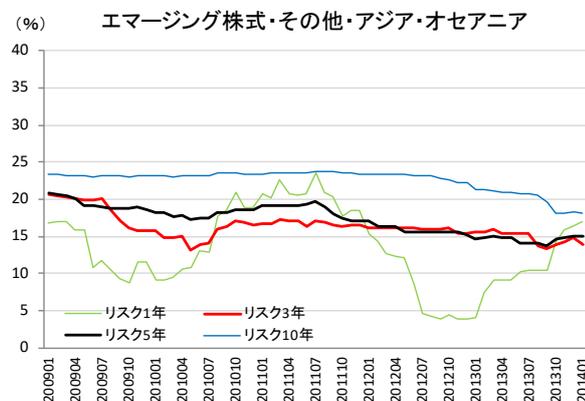
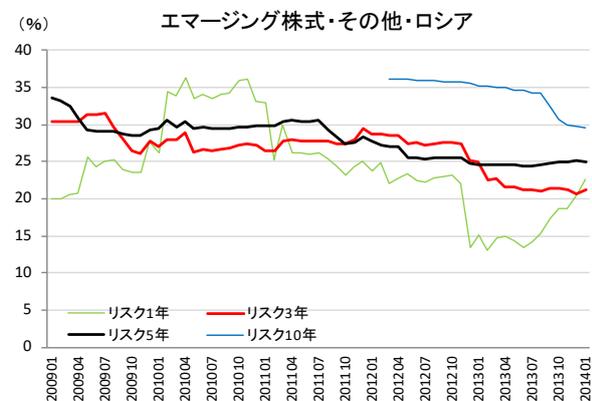
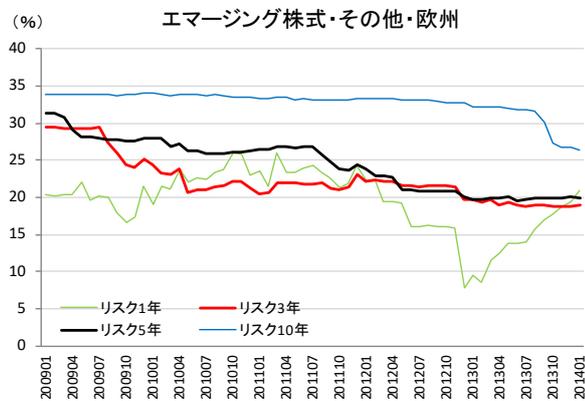
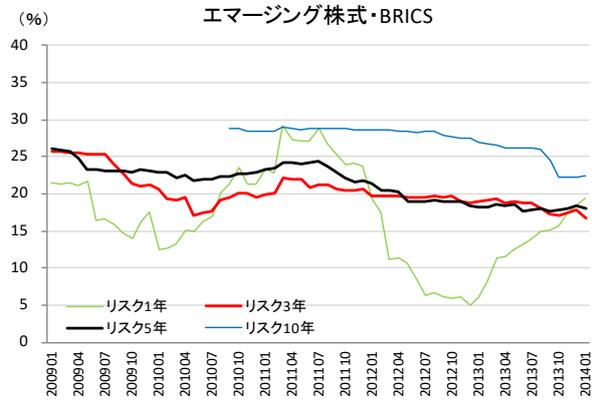
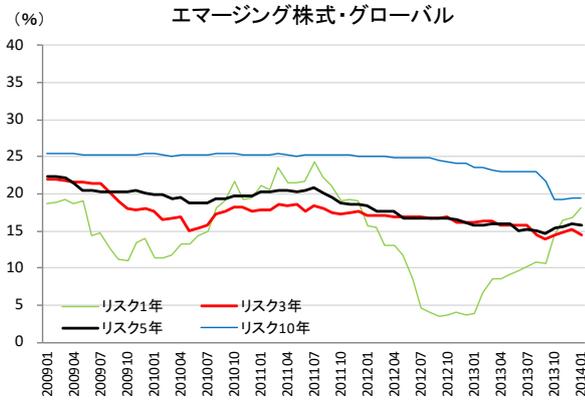


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

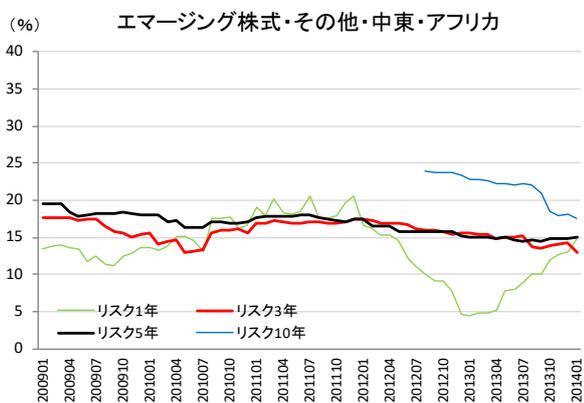
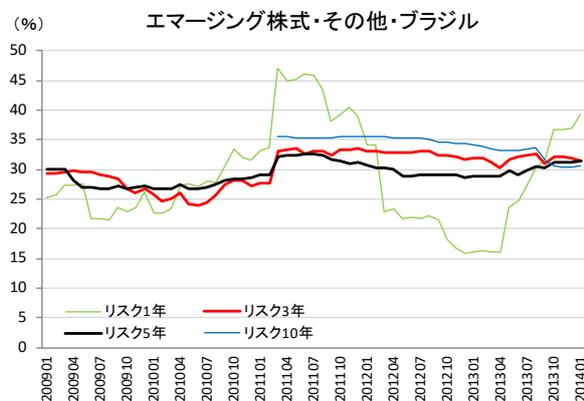
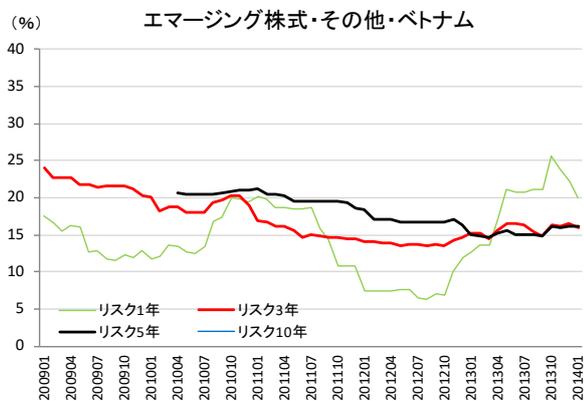
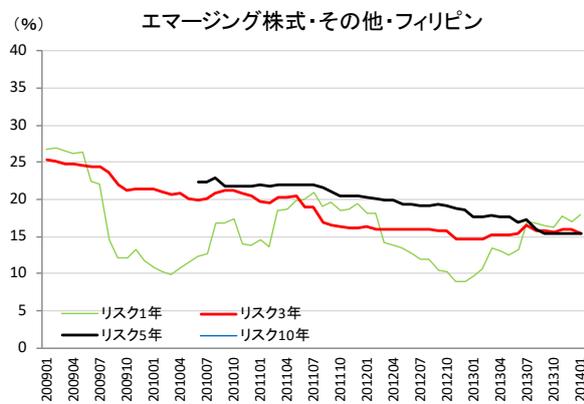
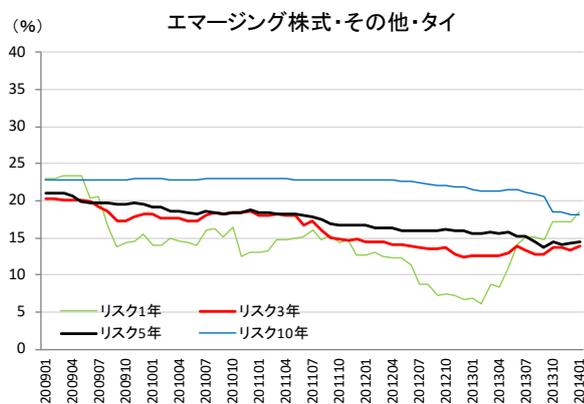


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

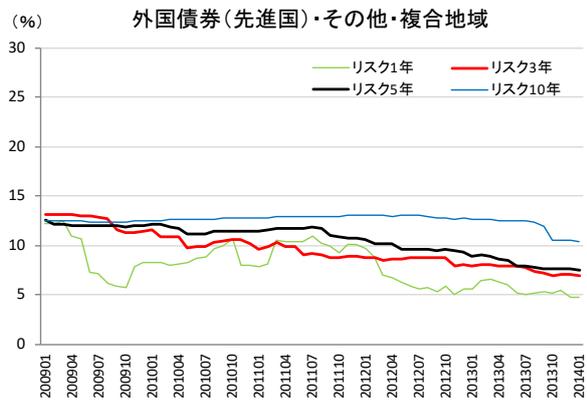
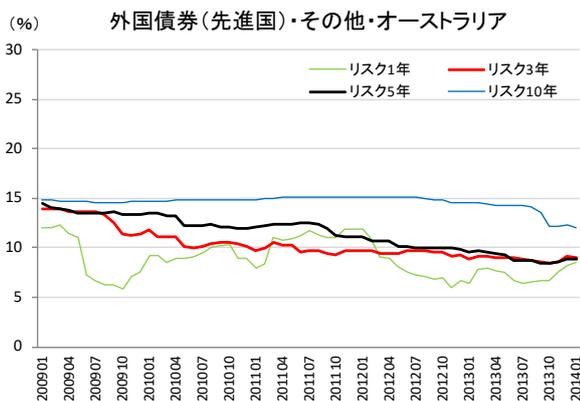
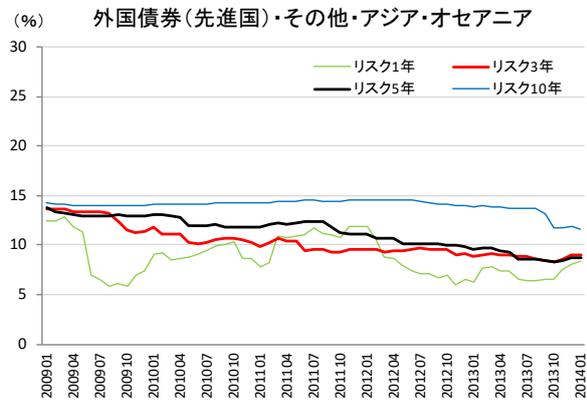
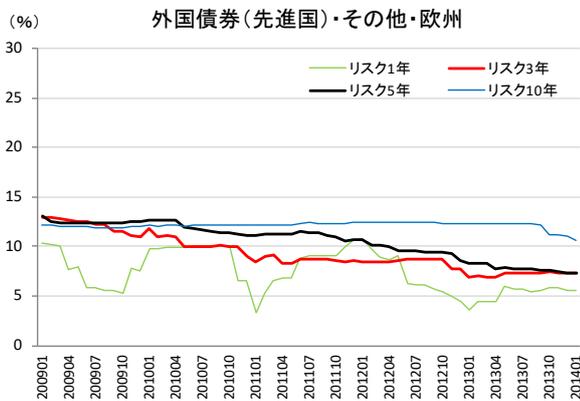
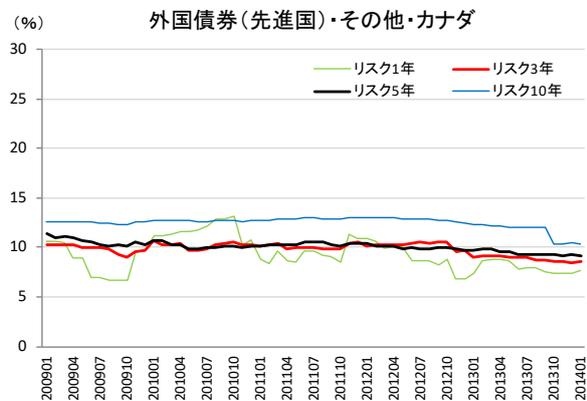
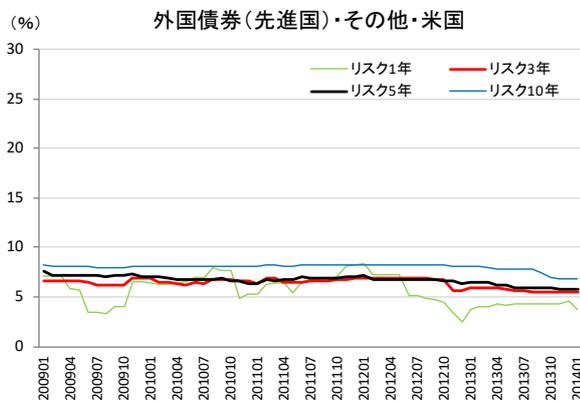
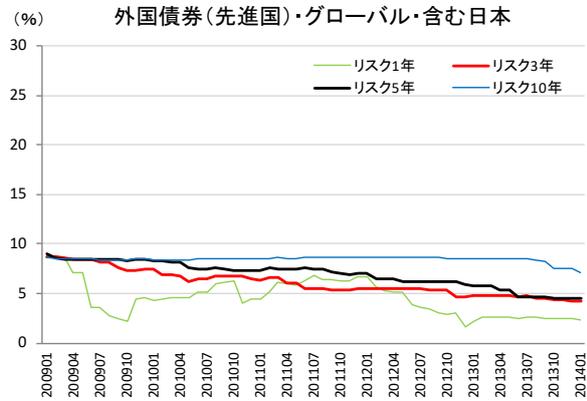
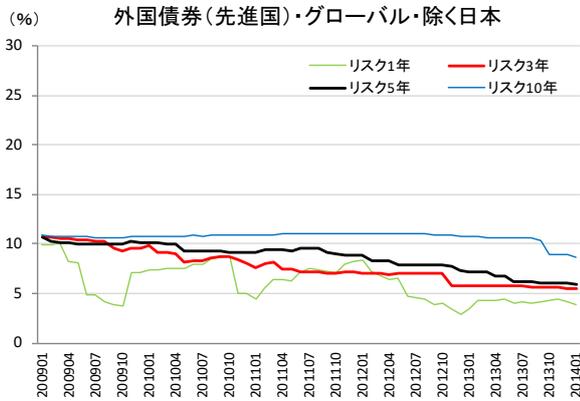


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

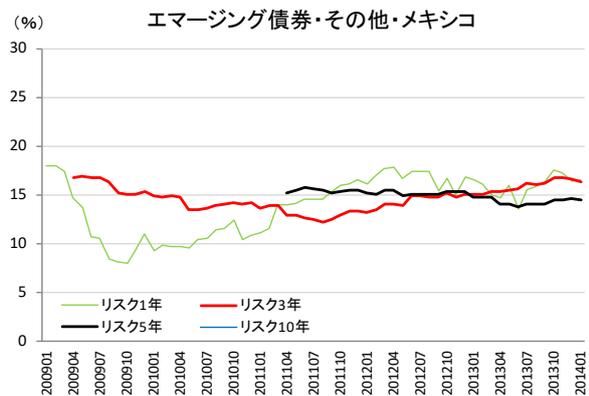
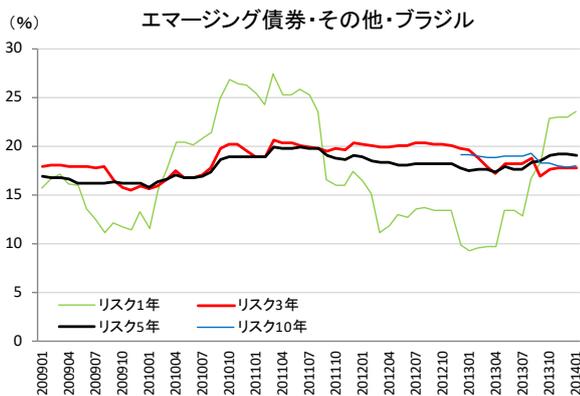
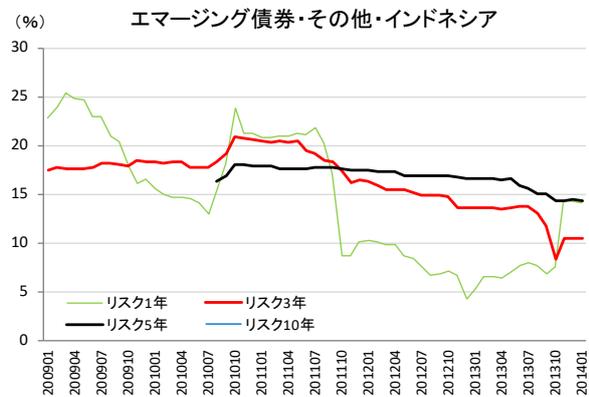
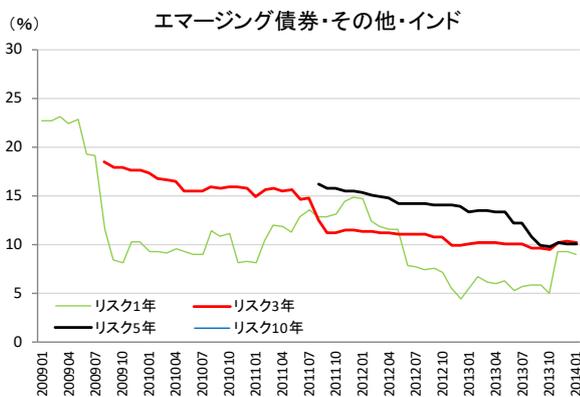
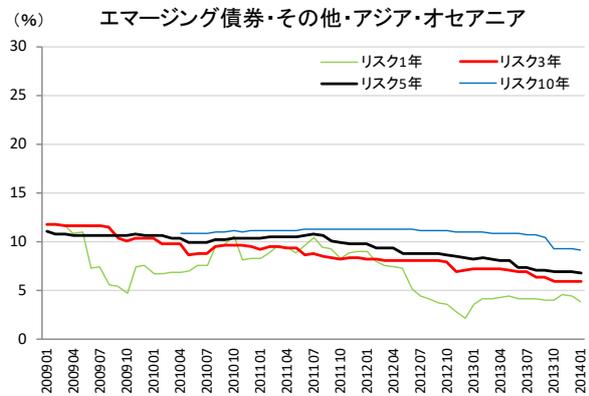
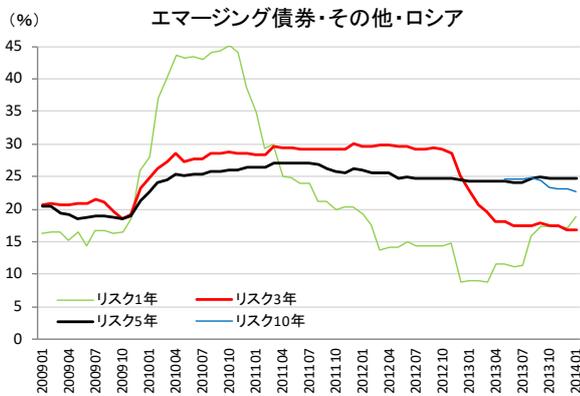
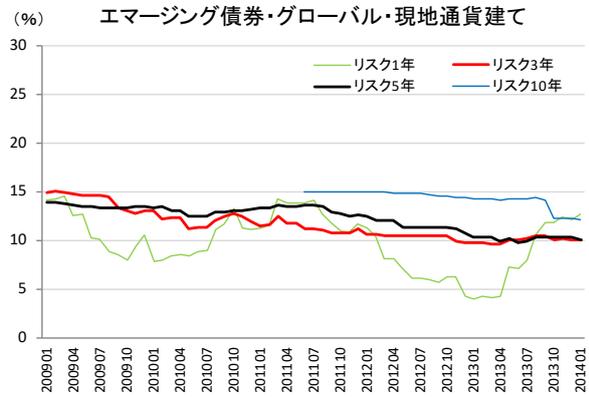
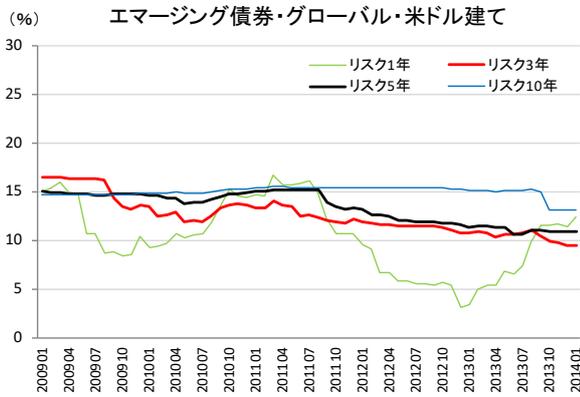


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

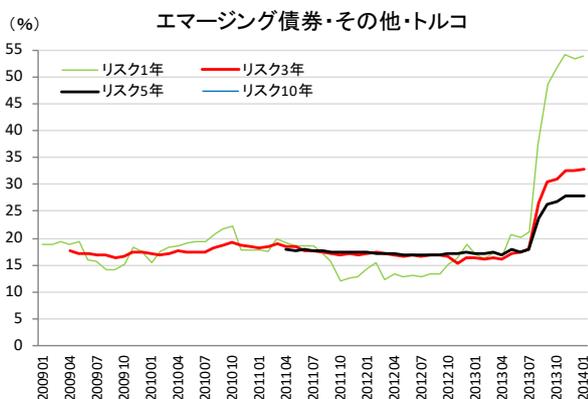


<2> リスク・サマリー

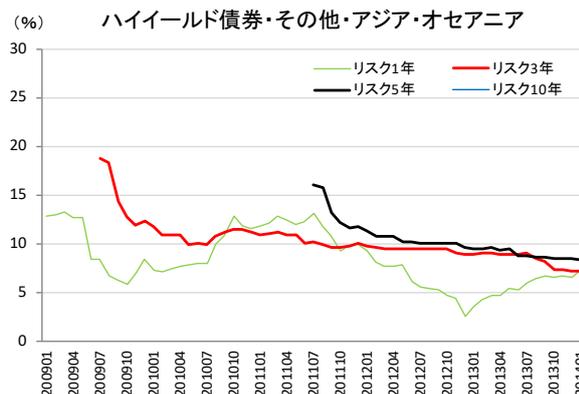
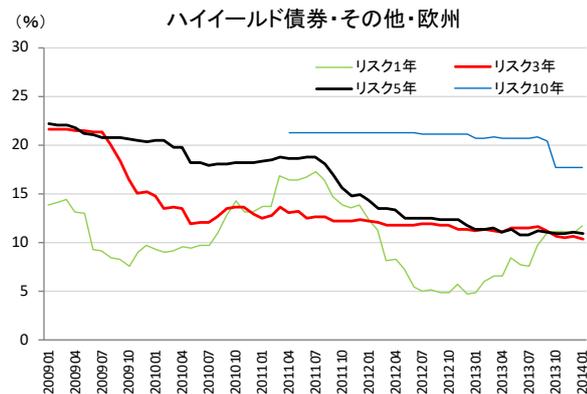
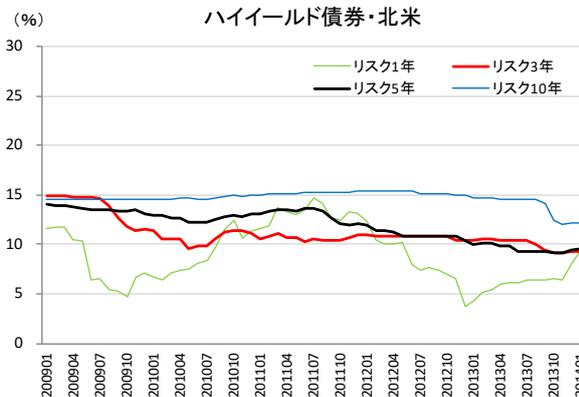
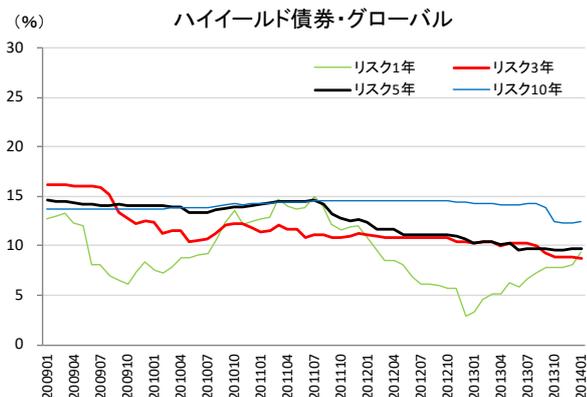
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

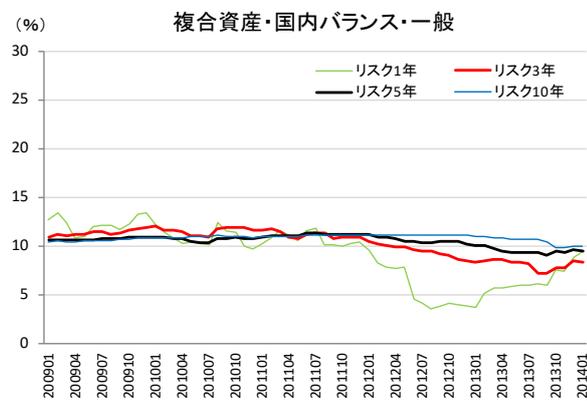
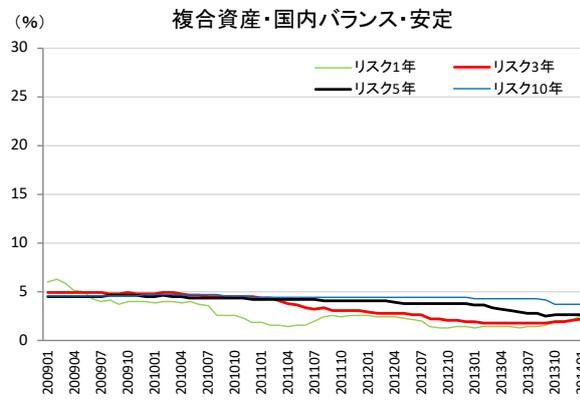
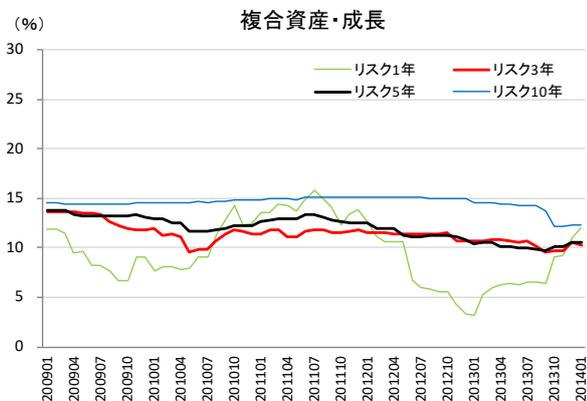
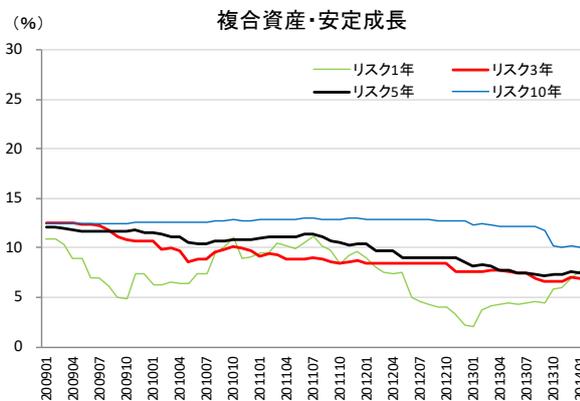
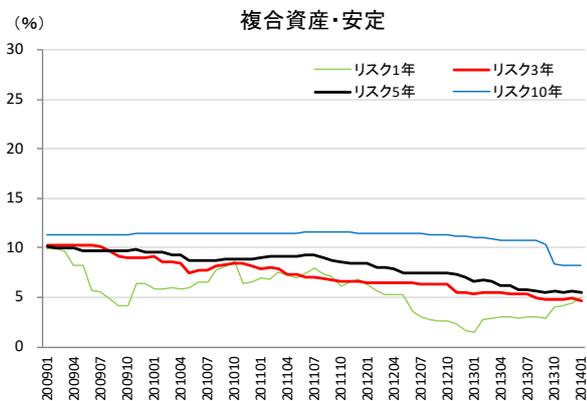


<2> リスク・サマリー

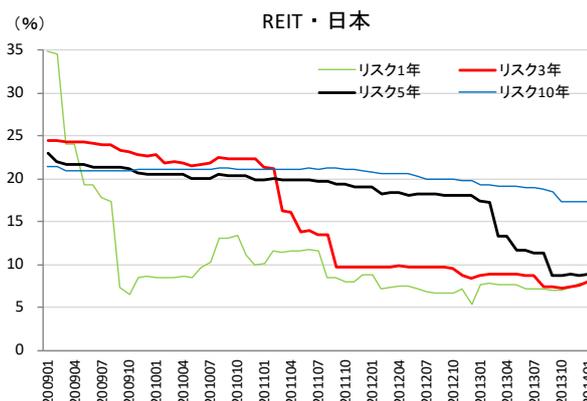
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

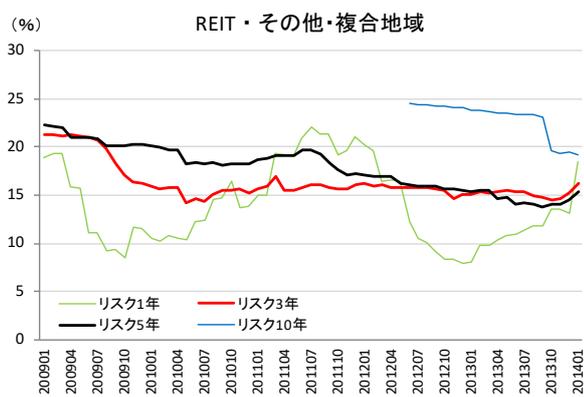
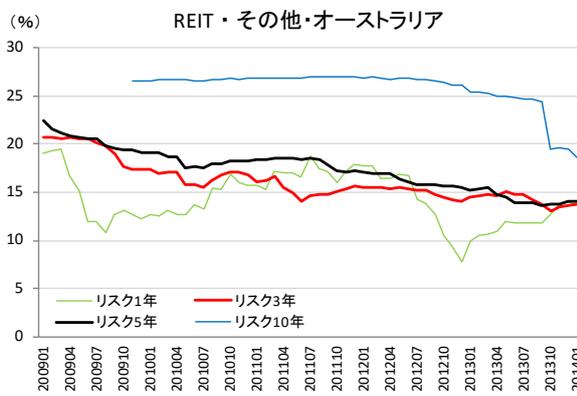
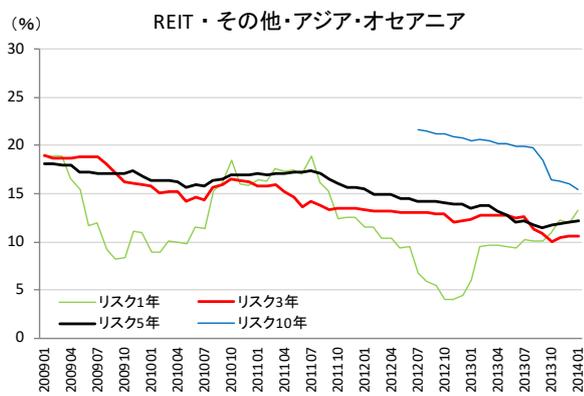
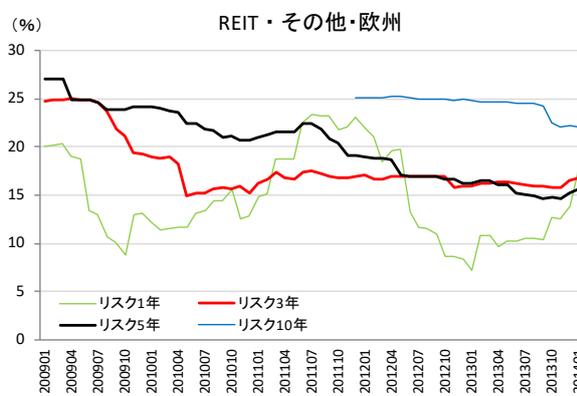
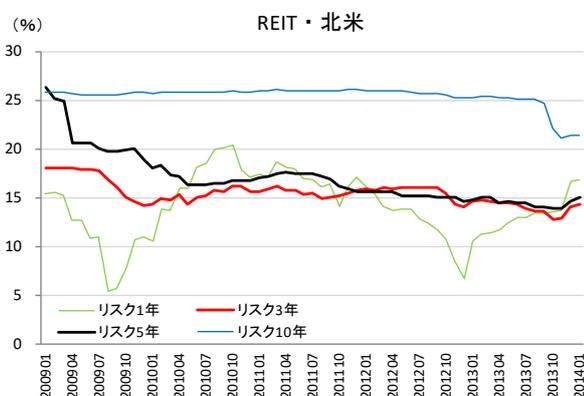
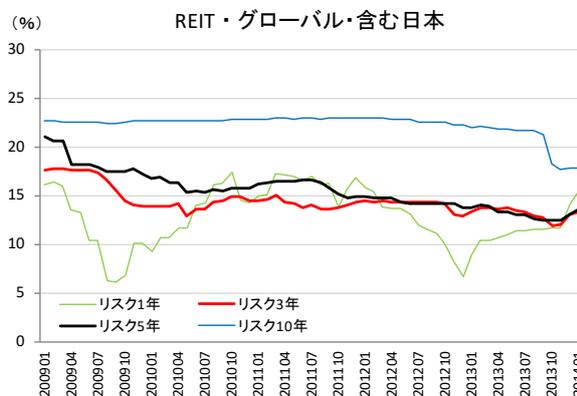
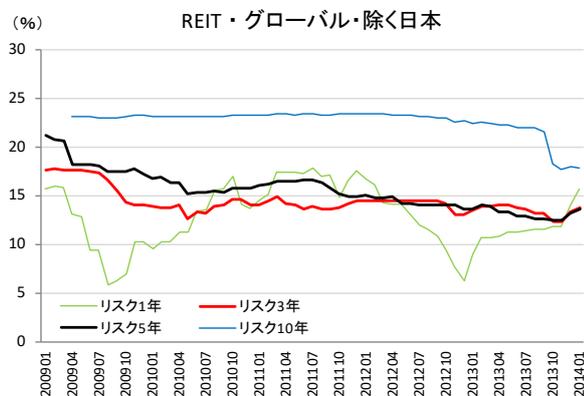


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

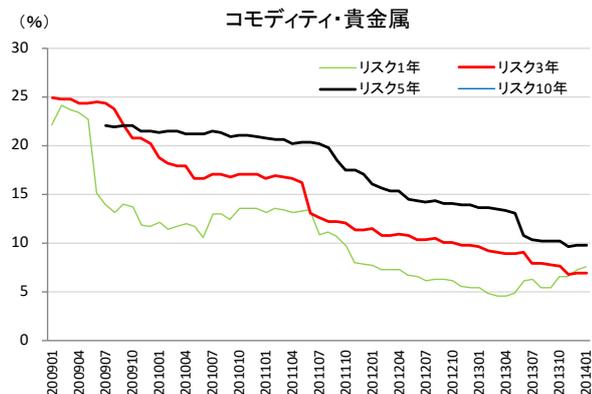
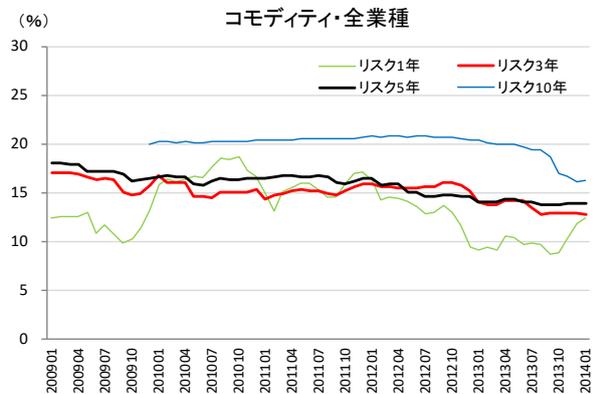
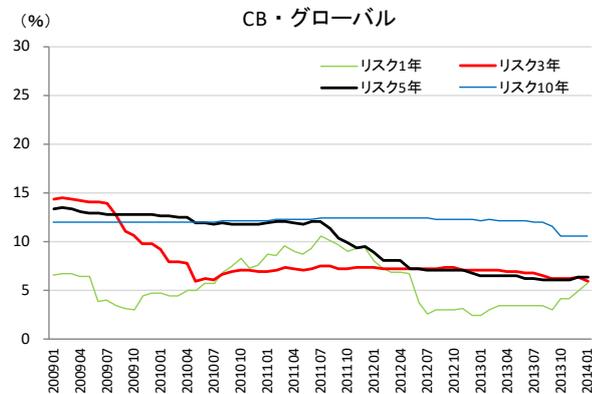
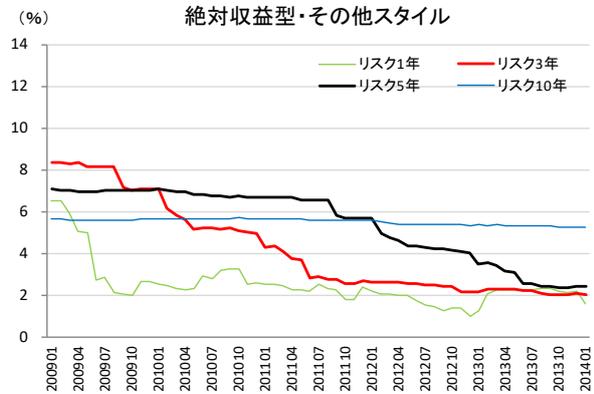
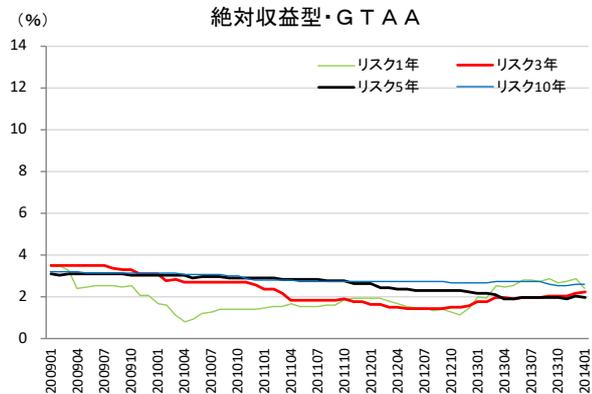
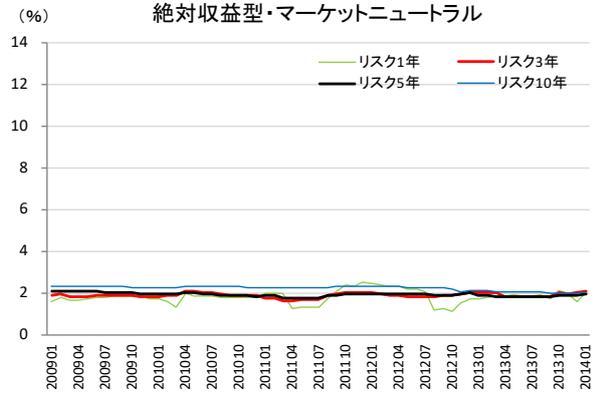
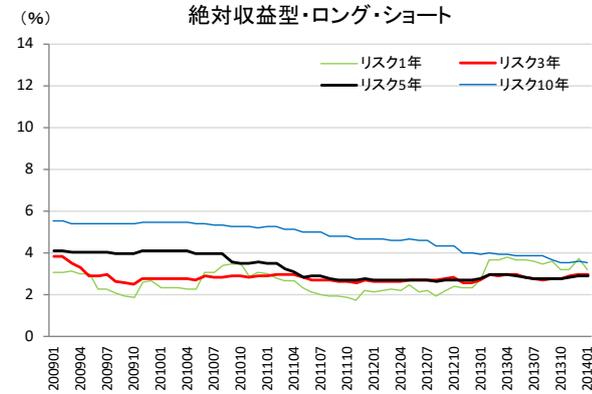


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



## &lt; 3 &gt; 設定・解約額 [ネット金額]

## 「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	1,189	1,972	11,398	33,046
国内株式	611	3,049	6,153	16,115
一般	305	885	1,850	7,546
フリー	309	732	1,659	6,453
バリュー	-3	153	190	1,093
小型	57	133	439	2,069
その他	250	2,034	3,841	6,194
日経225	143	1,553	2,842	4,532
TOPIX	106	405	827	1,320
JPX日経400	1	42	52	101
国内債券	-83	-272	525	2,434
一般	-83	-272	525	2,434
外国株式(先進国)	973	3,194	11,950	24,679
グローバル	934	2,472	8,678	19,878
除く日本	346	902	1,738	2,963
含む日本	587	1,570	6,940	16,915
その他	40	722	3,272	4,801
北米	3	13	29	-20
米国	80	957	3,799	5,873
カナダ	-5	-15	-44	-94
欧州	-34	-98	-207	-241
アジア・オセアニア	-4	-13	-31	6
オーストラリア	0	-120	-268	-724
ニュージーランド	0	0	0	-1
複合地域	0	0	-1	-1
エマージング株式	-240	-899	-1,355	1,450
グローバル	-103	-338	-646	178
BRICS	-5	-21	-41	-75
その他	-133	-540	-668	1,347
欧州	-9	-25	-39	-37
ロシア	-2	-9	-19	-48
アジア・オセアニア	-34	-221	-461	-144
中国	-19	7	97	1,426
インド	-64	-258	-576	-309
インドネシア	-5	-19	-25	-36
タイ	-1	-5	-10	-11
フィリピン	-10	-28	-40	-34
ベトナム	20	50	456	560
韓国	0	6	6	6
香港	0	0	1	2
台湾	0	0	0	0
中南米	-2	-4	-7	-13
ブラジル	-4	-27	-40	11
メキシコ	-1	0	-2	-4
中東・アフリカ	-1	-5	-11	-18
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	-1	-3	5	-3
複合地域	0	0	-1	-3

## &lt; 3 &gt; 設定・解約額 [ネット金額]

## 「総合」およびファンド分類別②

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	1,189	1,972	11,398	33,046
外国債券(先進国)	-562	-2,653	-4,405	-6,659
グローバル	-424	-1,886	-3,060	-3,657
除く日本	-75	-745	-898	-1,015
含む日本	-349	-1,141	-2,162	-2,642
その他	-138	-766	-1,345	-3,002
北米	-6	-14	-26	-47
米国	-23	-178	-459	-1,084
カナダ	-30	-95	-200	-447
欧州	4	6	175	278
アジア・オセアニア	-43	-206	-362	-658
オーストラリア	-23	-221	-362	-813
複合地域	-15	-44	-90	-196
エマージング債券	-67	-472	-1,127	-2,252
グローバル	-53	-199	-499	-1,075
米ドル建て	-62	-209	-488	-1,058
現地通貨建て	8	10	-10	-16
その他	-14	-273	-628	-1,177
ロシア	-9	-29	-65	-204
アジア・オセアニア	-6	-25	-67	-111
インド	-27	-154	-301	-229
インドネシア	-3	-19	-46	-98
ブラジル	-14	-144	-256	-562
メキシコ	-8	-10	-59	-138
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	-1	1	8	-2
複合地域	0	-2	-3	-7
ハイイールド債券	-225	-985	-2,747	-6,053
グローバル	-44	-158	-369	-737
北米	-120	-603	-1,780	-4,276
その他	-60	-225	-598	-1,040
欧州	-41	-147	-397	-712
アジア・オセアニア	-17	-71	-187	-351
複合地域	0	-1	-2	-5
複合資産	667	1,835	4,606	12,393
安定	72	134	665	3,295
安定成長	243	731	1,830	4,863
成長	114	344	904	1,990
国内バランス	239	626	1,207	2,245
安定	237	628	1,236	2,240
一般	2	0	-16	35

## &lt; 3 &gt; 設定・解約額 [ネット金額]

## 「総合」およびファンド分類別③

(単位: 億円)	当月	3か月	6か月	1年
総合	1,189	1,972	11,398	33,046
国内REIT	18	-52	-122	-1,167
日本	18	-52	-122	-1,167
外国REIT	86	-957	-2,874	-9,126
グローバル	45	-147	-505	-2,298
除く日本	55	128	306	434
含む日本	-10	-275	-811	-2,732
北米	-72	-827	-2,247	-6,277
その他	113	17	-122	-552
欧州	-4	-15	-39	-87
アジア・オセアニア	123	83	5	-251
オーストラリア	-4	-39	-60	-160
複合地域	0	0	0	0
複数国	-1	-13	-28	-53
その他	12	183	794	1,232
絶対収益型	14	81	370	753
ロング・ショート	-16	-55	-75	144
マーケットニュートラル	19	23	218	369
GTAA	1	-7	-28	-250
その他スタイル	9	120	248	482
CB	-21	-73	-213	-386
アジア・オセアニア	0	-1	-7	-9
日本	-1	-1	-5	-5
グローバル	-20	-71	-201	-369
コモディティ	-8	15	97	214
全業種	7	19	43	70
貴金属	-15	-5	56	157
エネルギー	0	1	-2	-16
その他コモディティ	0	0	1	2

## ＜4＞純資産額、ファンド本数

## 「総合」およびファンド分類別①

	純資産額 (億円)	構成比	本数	構成比	構成比
総合	615,511	100.00%	5,485	100.00%	
国内株式	103,474	16.81%	882	16.08%	
一般	61,962	10.07%	580	10.57%	
フリー	49,699	8.07%	461	8.40%	
バリュー	12,264	1.99%	119	2.17%	
小型	10,365	1.68%	94	1.71%	
その他	30,415	4.94%	200	3.65%	
日経225	16,197	2.63%	70	1.28%	
TOPIX	11,712	1.90%	74	1.35%	
JPX日経400	824	0.13%	21	0.38%	
国内債券	32,997	5.36%	131	2.39%	
一般	32,997	5.36%	131	2.39%	
外国株式(先進国)	139,299	22.63%	962	17.54%	
グローバル	107,280	17.43%	593	10.81%	
除く日本	22,110	3.59%	168	3.06%	
含む日本	85,170	13.84%	425	7.75%	
その他	32,019	5.20%	369	6.73%	
北米	341	0.06%	17	0.31%	
米国	22,870	3.72%	239	4.36%	
カナダ	462	0.08%	3	0.05%	
欧州	1,839	0.30%	64	1.17%	
アジア・オセアニア	125	0.02%	8	0.15%	
オーストラリア	6,304	1.02%	33	0.60%	
ニュージーランド	12	0.00%	1	0.02%	
複合地域	9	0.00%	1	0.02%	
エマージング株式	33,897	5.51%	373	6.80%	
グローバル	9,341	1.52%	100	1.82%	
BRICS	695	0.11%	7	0.13%	
その他	23,861	3.88%	266	4.85%	
欧州	246	0.04%	9	0.16%	
ロシア	134	0.02%	5	0.09%	
アジア・オセアニア	7,294	1.19%	121	2.21%	
中国	2,260	0.37%	30	0.55%	
インド	11,059	1.80%	30	0.55%	
インドネシア	233	0.04%	8	0.15%	
タイ	110	0.02%	4	0.07%	
フィリピン	119	0.02%	5	0.09%	
ベトナム	960	0.16%	9	0.16%	
韓国	8	0.00%	2	0.04%	
香港	10	0.00%	1	0.02%	
台湾	2	0.00%	2	0.04%	
中南米	92	0.01%	2	0.04%	
ブラジル	1,075	0.17%	21	0.38%	
メキシコ	23	0.00%	3	0.05%	
中東・アフリカ	124	0.02%	7	0.13%	
南アフリカ	1	0.00%	1	0.02%	
トルコ	90	0.01%	4	0.07%	
複合地域	23	0.00%	2	0.04%	

## &lt;4&gt; 純資産額、ファンド本数

## 「総合」およびファンド分類別②

	純資産額 (億円)	構成比	本数	構成比	構成比
総合	615,511	100.00%	5,485	100.00%	
外国債券(先進国)	87,581	14.23%	891	16.24%	
グローバル	63,591	10.33%	592	10.79%	
除く日本	33,706	5.48%	245	4.47%	
含む日本	29,885	4.86%	347	6.33%	
その他	23,990	3.90%	299	5.45%	
北米	105	0.02%	6	0.11%	
米国	5,678	0.92%	161	2.94%	
カナダ	1,626	0.26%	6	0.11%	
欧州	1,105	0.18%	36	0.66%	
アジア・オセアニア	2,874	0.47%	12	0.22%	
オーストラリア	10,650	1.73%	44	0.80%	
複合地域	1,708	0.28%	12	0.22%	
エマージング債券	20,128	3.27%	310	5.65%	
グローバル	9,270	1.51%	199	3.63%	
米ドル建て	7,577	1.23%	158	2.88%	
現地通貨建て	1,693	0.28%	41	0.75%	
その他	10,858	1.76%	111	2.02%	
ロシア	308	0.05%	5	0.09%	
アジア・オセアニア	569	0.09%	26	0.47%	
インド	4,686	0.76%	22	0.40%	
インドネシア	614	0.10%	12	0.22%	
ブラジル	3,676	0.60%	25	0.46%	
メキシコ	590	0.10%	9	0.16%	
南アフリカ	3	0.00%	1	0.02%	
トルコ	178	0.03%	6	0.11%	
複合地域	56	0.01%	1	0.02%	
ハイイールド債券	25,116	4.08%	318	5.80%	
グローバル	3,877	0.63%	58	1.06%	
北米	16,280	2.64%	169	3.08%	
その他	4,959	0.81%	91	1.66%	
欧州	3,907	0.63%	51	0.93%	
アジア・オセアニア	914	0.15%	34	0.62%	
複合地域	51	0.01%	1	0.02%	
複合資産	86,342	14.03%	954	17.39%	
安定	27,324	4.44%	290	5.29%	
安定成長	39,991	6.50%	403	7.35%	
成長	11,613	1.89%	227	4.14%	
国内バランス	7,415	1.20%	34	0.62%	
安定	6,801	1.10%	10	0.18%	
一般	489	0.08%	18	0.33%	

## ＜4＞純資産額、ファンド本数

## 「総合」およびファンド分類別③

	純資産額 (億円)	構成比	本数	構成比
総合	615,511	100.0%	5,485	100.0%
国内REIT	26,233	4.3%	124	2.3%
日本	26,233	4.3%	124	2.3%
外国REIT	48,097	7.8%	308	5.6%
グローバル	18,525	3.0%	135	2.5%
除く日本	3,113	0.5%	44	0.8%
含む日本	15,412	2.5%	91	1.7%
北米	24,828	4.0%	95	1.7%
その他	4,744	0.8%	78	1.4%
欧州	341	0.1%	24	0.4%
アジア・オセアニア	3,195	0.5%	34	0.6%
オーストラリア	828	0.1%	15	0.3%
複合地域	52	0.0%	3	0.1%
複数国	328	0.1%	2	0.0%
その他	12,347	2.0%	232	4.2%
絶対収益型	6,886	1.1%	95	1.7%
ロング・ショート	1,171	0.2%	31	0.6%
マーケットニュートラル	793	0.1%	12	0.2%
GTAA	461	0.1%	15	0.3%
その他スタイル	4,461	0.7%	37	0.7%
CB	1,722	0.3%	59	1.1%
アジア・オセアニア	40	0.0%	1	0.0%
日本	74	0.0%	3	0.1%
グローバル	1,603	0.3%	52	0.9%
コモディティ	1,581	0.3%	32	0.6%
全業種	838	0.1%	14	0.3%
貴金属	715	0.1%	16	0.3%
エネルギー	21	0.0%	1	0.0%
その他コモディティ	7	0.0%	1	0.0%

## &lt; 5 &gt; 属性、指標等（平均値）

## 「総合」およびファンド分類別①

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	10,974	7.6	4.22	5.02	1.318
国内株式	13,349	10.7	1.76	2.58	1.188
一般	12,310	10.3	2.39	3.62	1.428
フリー	11,897	9.7	2.77	4.24	1.476
バリュー	13,911	12.3	0.75	0.93	1.235
小型	18,502	11.1	1.76	2.26	1.715
その他	14,092	11.4	0.49	0.56	0.511
日経225	14,341	12.8	0.48	0.54	0.592
TOPIX	14,842	12.7	0.34	0.39	0.344
JPX日経400	12,567	4.5	0.47	0.55	0.556
国内債券	11,091	10.0	0.37	0.37	0.358
一般	11,091	10.0	0.37	0.37	0.358
外国株式(先進国)	11,568	6.2	4.22	5.22	1.619
グローバル	12,185	6.8	2.99	3.61	1.594
除く日本	14,591	8.7	1.03	1.28	0.830
含む日本	11,234	6.0	3.53	4.25	1.793
その他	10,577	5.3	8.32	10.58	1.703
北米	10,288	5.6	4.29	4.68	1.865
米国	11,153	4.8	6.37	7.34	1.670
カナダ	6,425	6.9	22.59	33.06	1.967
欧州	10,093	7.5	4.02	5.32	1.715
アジア・オセアニア	9,268	4.8	6.40	8.65	1.684
オーストラリア	8,498	4.4	15.43	22.00	1.794
ニュージーランド	12,569	6.5	3.83	3.98	1.642
複合地域	8,053	5.8	1.02	1.24	1.674
エマージング株式	11,368	8.1	3.44	4.85	1.821
グローバル	10,715	5.9	2.75	3.67	1.596
BRICS	13,384	12.7	0.91	1.06	2.034
その他	11,561	8.8	3.80	5.44	1.903
欧州	8,607	12.8	0.18	0.20	1.971
ロシア	8,992	9.9	0.32	0.33	1.967
アジア・オセアニア	12,056	8.8	8.70	12.60	1.699
中国	15,764	9.0	1.08	1.47	1.938
インド	11,164	9.0	1.19	1.49	2.042
インドネシア	10,718	7.6	0.28	0.30	1.824
タイ	11,640	10.7	2.78	3.24	1.689
フィリピン	11,122	5.5	0.34	0.39	1.764
ベトナム	11,424	3.4	1.35	1.86	1.845
韓国	10,673	4.7	2.87	3.65	1.774
香港	15,336	9.4	1.72	2.02	0.842
台湾	12,595	7.8	0.92	1.17	1.702
中南米	8,374	12.0	0.00	0.00	2.005
ブラジル	7,247	8.8	8.01	13.13	1.845
メキシコ	8,107	5.1	0.00	0.00	1.883
中東・アフリカ	9,932	9.4	0.52	0.64	2.090
南アフリカ	9,098	8.5	0.00	0.00	1.577
トルコ	6,723	12.5	0.00	0.00	2.008
複合地域	17,380	10.7	2.57	3.05	1.923

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

実績分配金利回り(%)、予想分配金利回り(%)、運用管理費用(%)は純資産額加重平均値

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

実績分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数÷実績計算回数))÷1年前もしくは設定日の基準価額×100

予想分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数÷実績計算回数))÷当月末の基準価額×100

## &lt;5&gt; 属性、指標等（平均値）

## 「総合」およびファンド分類別②

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	10,974	7.6	4.22	5.02	1.318
外国債券(先進国)	9,548	7.1	3.21	3.60	1.146
グローバル	9,969	7.3	2.17	2.37	1.099
除く日本	10,518	9.7	2.19	2.38	0.884
含む日本	9,581	5.6	2.15	2.36	1.343
その他	8,716	6.8	5.97	6.85	1.271
北米	9,916	4.8	1.96	2.07	1.809
米国	9,287	5.5	4.27	4.72	1.316
カナダ	7,487	6.6	7.72	8.80	1.341
欧州	8,167	9.8	1.94	1.99	1.085
アジア・オセアニア	7,838	8.3	5.03	5.76	1.399
オーストラリア	8,019	9.4	7.38	8.69	1.231
複合地域	5,773	9.1	5.63	6.20	1.176
エマージング債券	8,497	7.6	8.18	10.14	1.593
グローバル	8,756	8.3	7.46	9.49	1.585
米ドル建て	8,821	8.6	7.94	10.16	1.624
現地通貨建て	8,504	7.1	5.35	6.50	1.412
その他	8,032	6.3	8.80	10.71	1.600
ロシア	7,824	5.9	5.30	6.48	1.589
アジア・オセアニア	8,192	6.3	11.38	13.43	1.619
インド	8,835	4.2	8.76	10.63	1.675
インドネシア	7,072	6.5	6.16	7.34	1.651
ブラジル	9,213	9.0	9.01	11.08	1.562
メキシコ	6,168	6.1	10.16	11.51	1.373
南アフリカ	7,683	6.8	6.25	7.03	1.404
トルコ	3,569	6.1	9.26	15.07	1.428
複合地域	4,207	12.4	5.33	5.70	1.188
ハイールド債券	8,530	7.7	9.10	10.87	1.678
グローバル	7,134	7.8	8.03	9.83	1.597
北米	9,373	8.7	8.74	10.11	1.676
その他	7,855	6.0	11.15	14.16	1.750
欧州	7,476	5.7	11.44	14.88	1.730
アジア・オセアニア	8,345	6.7	10.46	12.75	1.850
複合地域	4,457	14.8	4.91	5.38	1.780
複合資産	11,220	7.5	1.57	1.76	1.124
安定	10,715	6.9	0.75	0.86	1.193
安定成長	10,876	7.8	2.37	2.69	1.139
成長	12,548	7.7	0.24	0.31	1.022
国内バランス	10,743	7.0	2.25	2.33	0.951
安定	10,494	7.8	2.37	2.45	0.916
一般	11,041	8.2	1.02	1.12	1.367

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

実績分配金利回り(%)、予想分配金利回り(%)、運用管理費用(%)は純資産額加重平均値

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

実績分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数÷実績計算回数))÷1年前もしくは設定日の基準価額×100

予想分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数÷実績計算回数))÷当月末の基準価額×100

## &lt;5&gt; 属性、指標等（平均値）

## 「総合」およびファンド分類別③

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	10,974	7.6	4.22	5.02	1.318
国内REIT	12,931	7.2	9.82	10.66	0.961
日本	12,931	7.2	9.82	10.66	0.961
外国REIT	10,444	6.1	12.83	14.20	1.553
グローバル	11,141	7.1	10.75	11.97	1.427
除く日本	13,237	5.9	3.14	3.62	1.067
含む日本	10,127	7.7	12.28	13.66	1.500
北米	9,572	5.8	14.90	16.35	1.603
その他	10,298	4.8	10.15	11.64	1.788
欧州	9,258	4.5	5.87	7.20	1.832
アジア・オセアニア	11,569	4.7	12.56	14.52	1.840
オーストラリア	9,542	3.9	6.04	6.50	1.690
複合地域	7,524	7.0	1.31	1.43	0.840
複数国	11,002	11.8	2.93	2.71	1.627
その他	9,559	5.3	0.33	0.38	1.424
絶対収益型	9,957	5.3	0.22	0.25	1.634
ロング・ショート	9,839	6.2	0.63	0.71	1.628
マーケットニュートラル	10,472	4.0	0.46	0.53	1.188
GTAA	10,308	6.8	0.77	0.85	1.631
その他スタイル	9,747	4.5	0.01	0.02	1.715
CB	10,318	5.9	1.29	1.50	1.489
アジア・オセアニア	8,003	8.6	3.73	4.12	1.804
日本	10,949	7.7	0.17	0.18	1.052
グローバル	10,562	5.9	1.25	1.46	1.501
コモディティ	7,917	6.5	0.01	0.01	0.943
全業種	6,009	7.4	0.00	0.00	1.239
貴金属	9,332	5.7	0.03	0.03	0.597
エネルギー	8,704	9.9	0.00	0.00	1.059
その他コモディティ	11,191	2.3	0.00	0.00	0.497

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

実績分配金利回り(%)、予想分配金利回り(%)、運用管理費用(%)は純資産額加重平均値

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

実績分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数÷実績計算回数))÷1年前もしくは設定日の基準価額×100

予想分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数÷実績計算回数))÷当月末の基準価額×100

本レポートに関する著作権、知的財産権等一切の権利は三菱アセット・ブレインズ株式会社（以下、MAB）に帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。

- 本レポートは、MABが信頼できると判断した情報源から入手した本レポート作成基準日現在における情報をもとに作成しておりますが、当該情報の正確性を保証するものではありません。
- MABは、本レポートの利用に関連して発生した一切の損害について何らの責任も負いません。
- 本レポート中のグラフ・数値等は、あくまでも本レポート作成基準日までの過去の実績を示すものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。
- 本レポートは、情報提供を目的としたものであり、投資信託の勧誘のために作成されたものではありません。
- MAB 投信指数「MAB-FPI」（以下、本指数）に関する著作権、知的財産権等一切の権利は MAB に帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。また、本指数を商業的に利用する場合には MAB の利用許諾が必要です。

【照会先】

三菱アセット・ブレインズ株式会社

コンサルティンググループ 川眞田 隆志

電話番号 : 03-6721-1033

Eメール : mab-index@mab.co.jp

〒107-0062 東京都港区南青山1丁目1番1号 新青山ビル西館8階

URL : <http://www.mab.jp/mab-index/>

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第1085号 助言・代理業、投資運用業

加入協会名 一般社団法人 日本投資顧問業協会