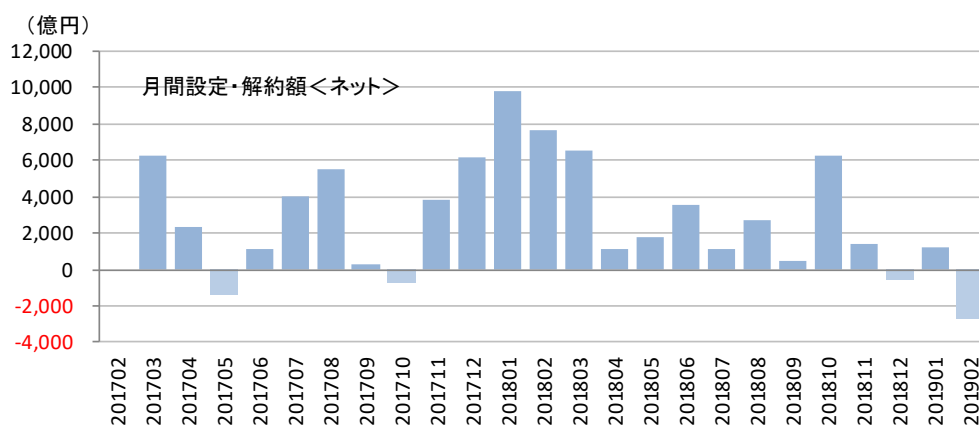
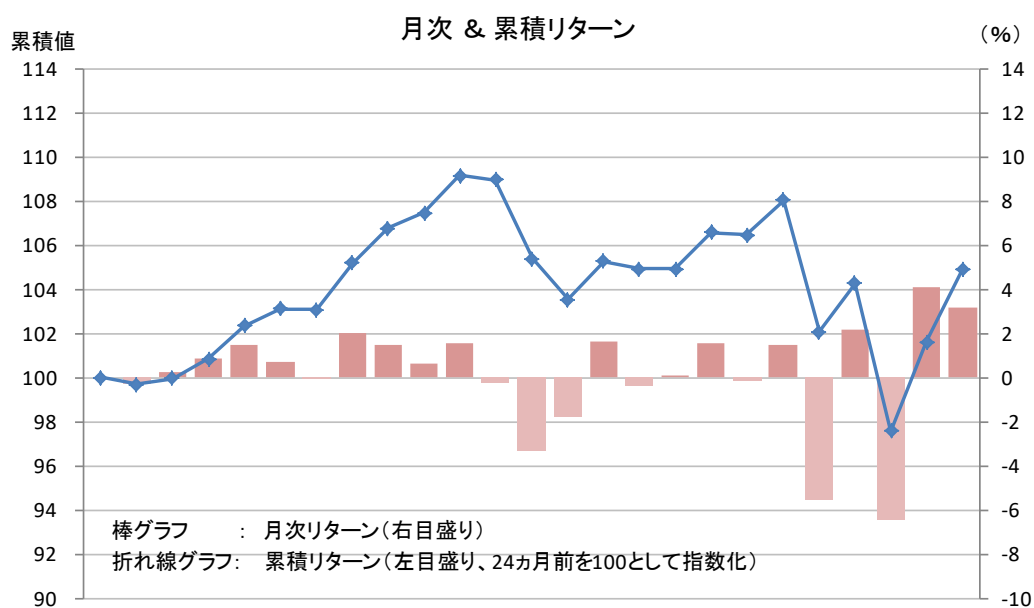


# 投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2019年2月

「総合」 +3.22 %  
 (前月 +4.14 %)



# 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

## &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		12,587	12,195	392	3.22	
国内株式		15,025	14,520	505	3.48	
一般		14,703	14,191	512	3.61	
フリー		13,804	13,258	546	4.12	
バリュー		18,993	18,708	284	1.52	
小型		31,961	30,398	1,563	5.14	
その他		14,619	14,237	382	2.68	
日経225		13,795	13,399	396	2.95	
TOPIX		14,656	14,288	367	2.57	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	13,764	13,444	320	2.38	
国内債券		13,205	13,177	29	0.22	
一般		13,205	13,177	29	0.22	
外国株式(先進国)		13,960	13,125	835	6.36	
グローバル		15,388	14,439	949	6.57	
除く日本		21,567	20,359	1,208	5.93	
含む日本		14,013	13,128	885	6.74	
その他		11,041	10,450	590	5.65	
北米		11,222	10,496	727	6.93	
米国		16,271	15,319	953	6.22	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	16,602	16,004	598	3.74	
欧州		17,080	16,308	772	4.73	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	32,983	31,798	1,185	3.73	
オーストラリア	12,670 (2008.07.01)	15,162	14,580	582	3.99	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	32,116	30,509	1,607	5.27	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	8,993	8,791	202	2.30	
エマージング株式		14,098	13,466	632	4.69	
グローバル		13,805	13,087	718	5.48	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	22,292	21,525	767	3.56	
その他		14,655	14,035	620	4.42	
欧州		23,673	23,680	-7	-0.03	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	9,077	9,104	-27	-0.30	
アジア・オセアニア		15,521	14,692	829	5.64	
中国		31,016	27,698	3,318	11.98	
インド	10,000 (2004.09.30)	30,145	29,467	678	2.30	
インドネシア	7,330 (2009.12.01)	14,688	14,365	323	2.25	
タイ		24,036	23,587	449	1.90	
フィリピン	3,209 (2010.06.01)	8,437	8,233	204	2.48	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	15,655	14,210	1,445	10.17	
韓国	10,000 (1997.06.30)	22,826	22,048	778	3.53	
香港		23,882	22,528	1,354	6.01	
台湾	10,000 (2008.03.31)	15,140	14,274	865	6.06	
中南米	7,448 (2006.05.01)	8,670	8,570	100	1.17	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	10,022	9,995	27	0.27	
メキシコ	10,514 (2013.03.01)	9,260	9,143	117	1.28	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	9,408	9,279	130	1.40	
南アフリカ	10,000 (2010.06.30)	6,582	6,432	150	2.33	
トルコ		22,966	22,809	157	0.69	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	20,472	19,536	936	4.79	

※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		12,587	12,195	392	3.22	
外国債券(先進国)		17,418	17,203	215	1.25	
グローバル		17,634	17,430	204	1.17	
除く日本		18,808	18,573	235	1.27	
含む日本		17,008	16,830	178	1.06	
その他		16,772	16,530	243	1.47	
北米	9,017 (2013.06.03)	10,127	10,057	71	0.70	
米国		15,288	15,007	280	1.87	
カナダ	10,000 (2003.05.30)	13,955	13,670	285	2.08	
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,182	15,028	154	1.02	
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	18,628	18,388	240	1.31	
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	22,909	22,632	277	1.22	
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,063	10,894	168	1.54	
複合地域	10,000 (2001.11.30)	16,328	16,065	263	1.64	
エマージング債券		16,870	16,515	355	2.15	
グローバル		18,216	17,791	424	2.39	
米ドル建て		18,820	18,373	447	2.43	
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,589	12,320	269	2.18	
その他	8,652 (2005.04.01)	12,410	12,173	237	1.95	
ロシア	10,000 (2008.05.30)	10,025	9,841	185	1.88	
アジア・オセアニア	8,652 (2005.04.01)	13,787	13,486	301	2.23	
インド	10,000 (2011.08.31)	15,065	14,739	326	2.21	
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	12,831	12,234	597	4.88	
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	13,226	13,093	133	1.01	
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	11,097	10,805	291	2.70	
南アフリカ	10,000 (2010.03.31)	11,052	11,211	-160	-1.43	
トルコ	10,000 (2011.04.28)	5,549	5,489	60	1.09	
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,722	10,569	153	1.45	
ハイイールド債券		21,424	20,785	639	3.08	
グローバル	10,000 (1997.06.30)	21,845	21,321	524	2.46	
北米		20,719	20,047	671	3.35	
その他	10,000 (2004.03.31)	21,713	21,150	563	2.66	
欧州	10,000 (2006.04.28)	21,833	21,256	577	2.71	
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,018	13,681	336	2.46	
複合地域	10,000 (2004.03.31)	18,847	18,380	467	2.54	
複合資産		16,692	16,376	316	1.93	
安定	10,000 (1998.10.30)	15,036	14,823	213	1.43	
安定成長		17,829	17,451	378	2.16	
成長		19,647	19,043	604	3.17	
国内バランス		12,975	12,908	68	0.53	
安定		13,947	13,883	64	0.46	
一般		13,730	13,528	202	1.50	

※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		12,587	12,195	392	3.22	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	29,873	29,685	188	0.63	
日本	10,000 (2003.10.31)	29,873	29,685	188	0.63	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	25,244	24,593	651	2.65	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	22,337	21,904	433	1.98	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	23,841	23,340	501	2.15	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	22,486	22,058	428	1.94	
北米	10,000 (2003.09.30)	24,816	24,054	763	3.17	
その他	10,000 (2004.04.30)	25,908	25,283	625	2.47	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,515	5,531	-16	-0.29	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	19,288	18,646	643	3.45	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	14,418	14,410	8	0.05	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,065	7,112	-48	-0.67	
複数国	10,000 (2004.04.30)	32,724	32,035	688	2.15	
その他		5,670	5,556	114	2.05	
絶対収益型		7,530	7,480	50	0.67	
ロング・ショート		8,750	8,696	54	0.62	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	8,937	8,868	69	0.77	
GTAA		10,416	10,260	156	1.52	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,180	7,138	42	0.58	
CB		18,358	17,963	394	2.20	
アジア・オセアニア	13,897 (2007.11.01)	15,379	14,700	679	4.62	
日本		20,140	20,012	128	0.64	
グローバル		32,142	31,449	693	2.20	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	7,663	7,513	150	1.99	
全業種	10,000 (2004.12.30)	6,654	6,447	208	3.22	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	13,607	13,551	56	0.41	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	4,834	4,507	326	7.24	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	10,426	10,131	295	2.91	

※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

## (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	0.61	-1.46	-0.44	7.49
国内株式	-4.18	-8.54	-10.18	8.44
一般	-3.99	-9.00	-11.73	8.68
フリー	-3.95	-9.21	-11.97	9.22
バリュー	-4.16	-8.09	-10.67	6.48
小型	-5.85	-11.20	-13.26	10.92
その他	-3.87	-6.16	-4.85	7.07
日経225	-4.15	-5.68	-1.61	6.77
TOPIX	-3.46	-6.53	-7.37	7.58
JPX日経400	-3.10	-6.09	-6.97	7.53
国内債券	1.14	1.38	0.99	0.62
一般	1.14	1.38	0.99	0.62
外国株式(先進国)	2.96	-3.34	1.36	14.34
グローバル	3.30	-3.14	1.18	14.69
除く日本	1.51	-3.71	1.71	13.13
含む日本	3.77	-2.99	1.06	15.10
その他	1.83	-4.01	1.96	13.14
北米	1.99	-4.80	6.03	16.10
米国	2.57	-3.42	5.72	14.24
カナダ	2.30	-4.93	0.37	12.97
欧州	1.19	-7.20	-6.13	11.88
アジア・オセアニア	2.07	-0.43	-0.27	8.85
オーストラリア	-0.70	-4.97	-4.87	9.61
ニュージーランド	2.45	2.46	5.71	7.88
複合地域	-3.45	-15.94	-7.27	11.17
エマージング株式	1.31	-2.64	-8.58	6.77
グローバル	5.06	0.62	-7.54	12.68
BRICS	3.55	7.30	-6.16	11.87
その他	-0.17	-4.13	-9.02	4.46
欧州	1.75	8.28	-12.41	9.67
ロシア	1.88	7.87	-3.54	11.05
アジア・オセアニア	4.29	-0.87	-7.31	11.12
中国	10.95	2.68	-10.52	20.61
インド	-6.47	-11.36	-10.62	-4.07
インドネシア	4.81	12.22	-2.83	7.30
タイ	3.34	-1.93	-9.61	9.01
フィリピン	6.08	3.20	-5.30	7.09
ベトナム	3.38	-4.58	-13.36	8.64
韓国	-2.29	-9.86	-15.82	3.29
香港	5.92	2.37	-3.14	12.66
台湾	1.06	-11.83	-12.04	6.37
中南米	7.08	19.17	-1.47	13.53
ブラジル	9.54	41.05	1.14	15.94
メキシコ	6.59	-11.74	-6.78	7.28
中東・アフリカ	1.63	-0.51	-5.88	7.73
南アフリカ	5.20	-0.27	-14.83	12.58
トルコ	4.06	37.13	-32.71	12.96
複合地域	4.58	-3.04	-5.91	9.90

## &lt;1&gt;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	0.61	-1.46	-0.44	7.49
外国債券(先進国)	0.38	1.15	0.70	2.02
グローバル	0.99	1.22	0.93	1.76
除く日本	0.55	1.04	1.17	1.54
含む日本	1.49	1.42	0.68	2.00
その他	-1.19	0.96	0.14	2.72
北米	0.68	-0.58	0.28	0.71
米国	0.45	1.37	3.33	2.67
カナダ	0.67	0.52	2.33	4.41
欧州	0.12	-0.35	-1.05	1.12
アジア・オセアニア	-2.17	1.06	-1.33	2.89
オーストラリア	-2.42	0.58	-1.69	2.78
ニュージーランド	-0.31	5.14	2.45	3.10
複合地域	-0.01	2.55	1.80	1.75
エマージング債券	2.69	9.95	-2.72	4.41
グローバル	4.36	10.14	-3.74	6.13
米ドル建て	4.75	10.29	-3.36	6.37
現地通貨建て	2.65	9.42	-5.41	5.07
その他	1.30	9.80	-1.84	2.98
ロシア	2.57	9.70	-8.82	8.42
アジア・オセアニア	1.90	3.28	2.22	2.91
インド	-1.92	3.10	-0.88	-0.17
インドネシア	2.11	7.17	-2.19	5.07
ブラジル	4.12	21.44	-2.76	5.75
メキシコ	8.92	0.81	4.96	5.82
南アフリカ	-1.47	10.98	-10.83	7.13
トルコ	1.27	63.10	-27.53	7.32
複合地域	3.01	4.59	-0.16	4.91
ハイイールド債券	1.95	3.60	0.52	7.01
グローバル	2.29	4.53	-1.44	6.20
北米	1.84	2.44	2.46	7.66
その他	2.04	6.82	-3.92	5.54
欧州	1.69	7.44	-4.82	5.58
アジア・オセアニア	3.52	5.40	-0.95	5.29
複合地域	0.62	-0.17	1.21	3.71
複合資産	0.61	-0.82	-0.51	4.49
安定	0.81	-0.87	-0.87	3.30
安定成長	0.74	-0.45	0.02	5.00
成長	-0.15	-2.72	-1.49	7.20
国内バランス	0.44	0.49	-0.45	1.97
安定	0.60	0.90	0.04	1.74
一般	-1.16	-3.71	-5.59	4.74

## &lt;1&gt;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ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来 (%)
総合	0.61	-1.46	-0.44	7.49
国内REIT	3.21	7.62	11.78	5.41
日本	3.21	7.62	11.78	5.41
外国REIT	1.72	1.96	16.81	11.15
グローバル	1.44	0.79	14.52	10.60
除く日本	2.13	1.09	15.79	11.17
含む日本	1.30	0.73	14.31	10.49
北米	1.45	2.36	19.74	12.00
その他	4.39	4.45	10.04	8.75
欧州	-0.64	-7.44	-2.80	8.99
アジア・オセアニア	6.51	6.88	11.45	9.55
オーストラリア	-0.21	1.45	8.03	4.89
複合地域	1.89	-1.56	-4.13	10.64
複数国	1.84	3.95	19.89	9.98
その他	-2.17	-4.35	-4.27	4.26
絶対収益型	0.23	-1.83	-3.79	0.76
ロング・ショート	2.57	-0.99	-4.11	1.34
マーケットニュートラル	-0.93	-1.96	-1.38	-0.50
GTAA	0.67	0.03	-3.05	2.07
その他スタイル	-0.22	-2.19	-4.05	0.69
CB	1.20	-0.86	-1.76	4.60
アジア・オセアニア	4.06	5.90	1.56	6.98
日本	-1.88	-3.58	-3.50	1.11
グローバル	1.28	-0.94	-1.71	4.70
コモディティ	2.43	0.81	-1.86	5.14
全業種	-0.54	-4.27	-2.78	6.53
貴金属	6.05	8.08	-2.00	3.08
エネルギー	7.21	-14.11	3.22	23.29
その他コモディティ	-2.05	-2.11	0.30	6.83

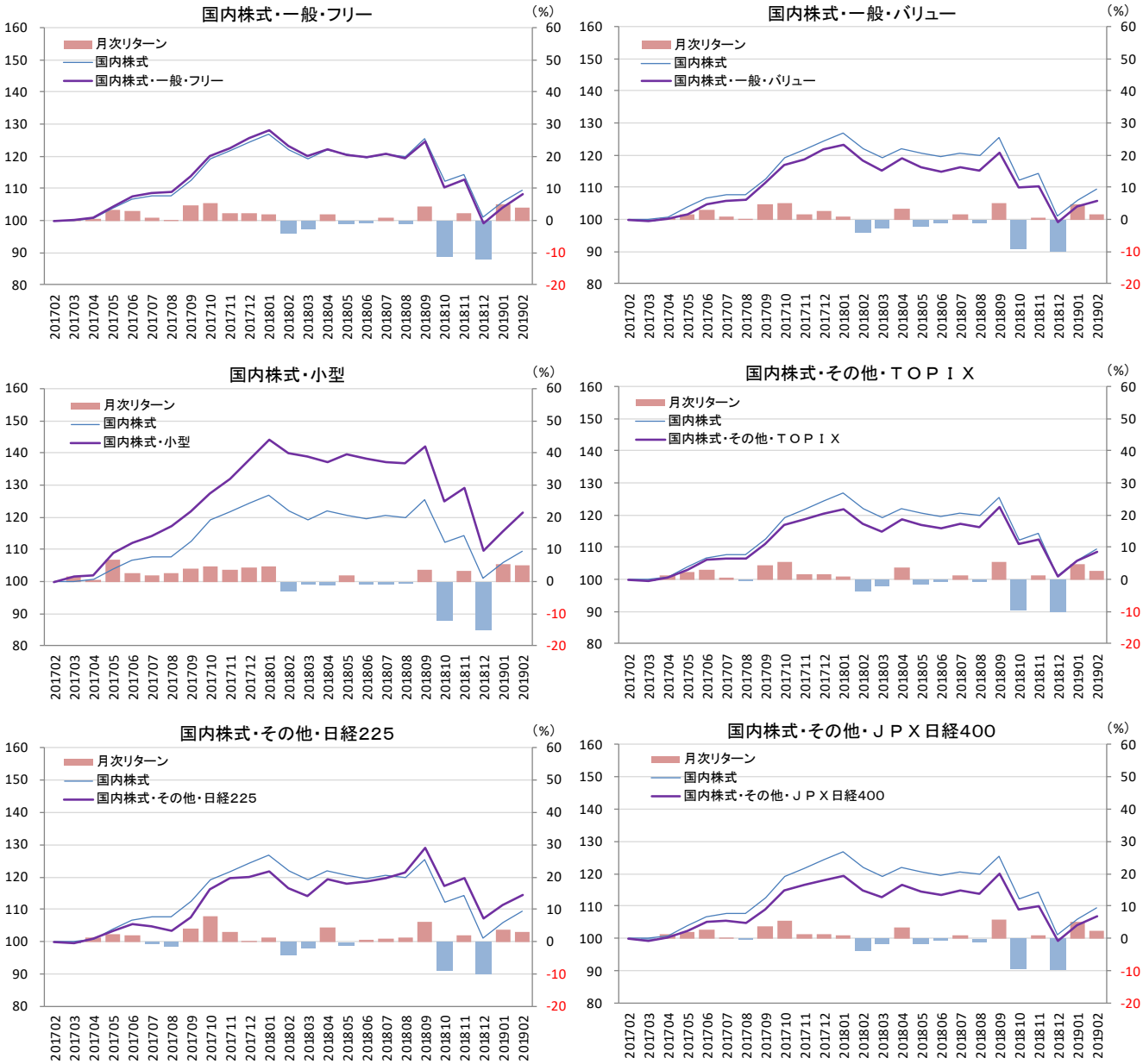


＜1＞パフォーマンス・サマリー

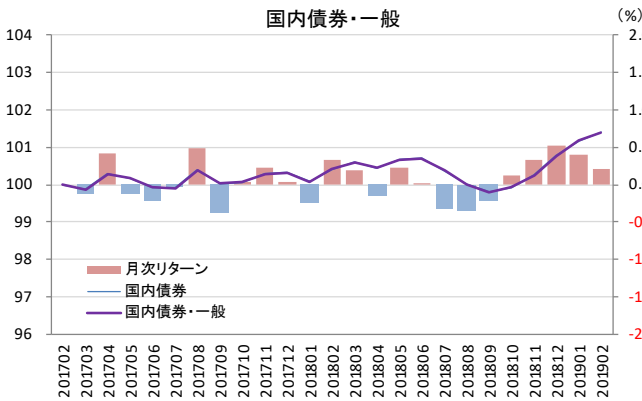
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

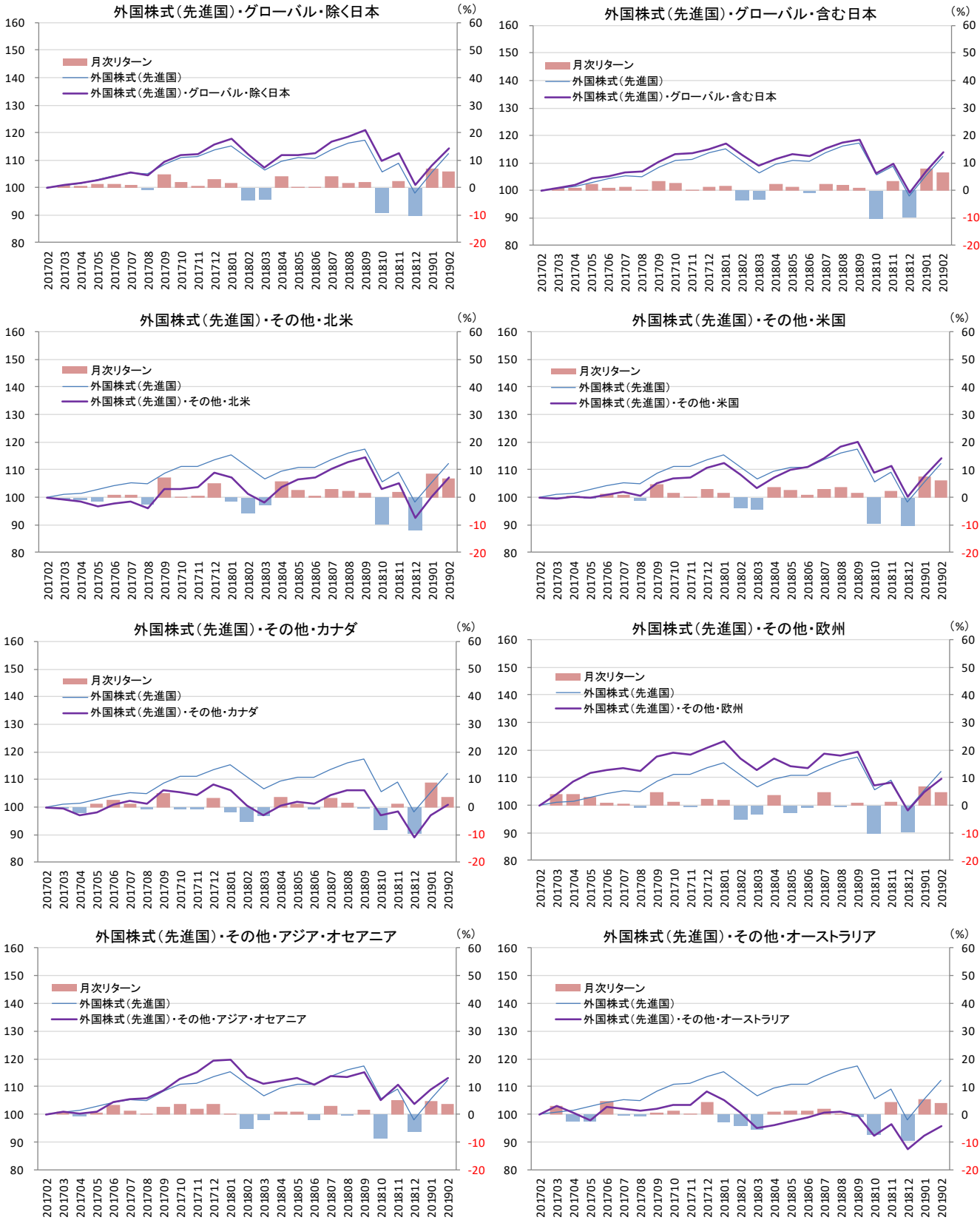


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24 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)]

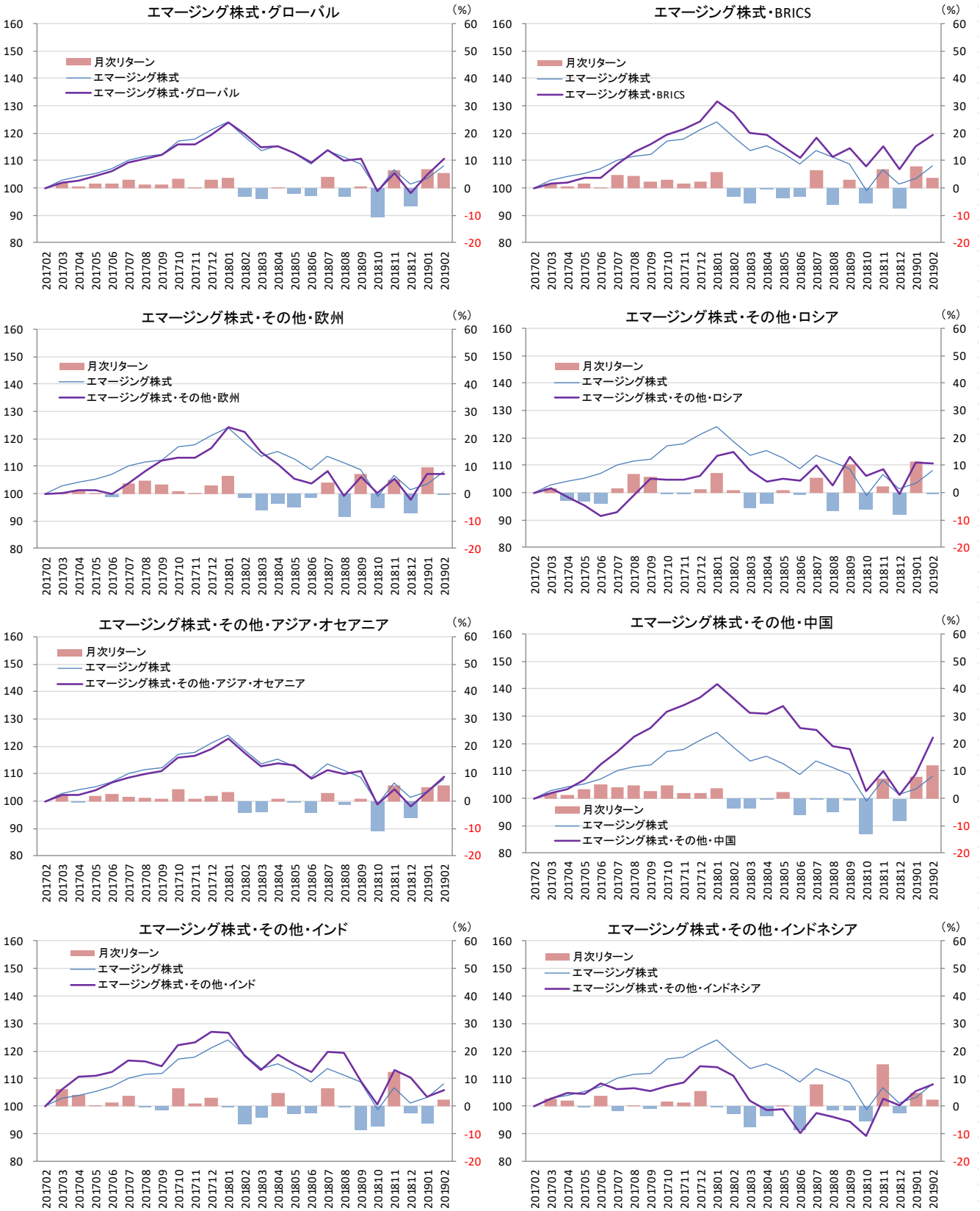


＜1＞パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24 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]

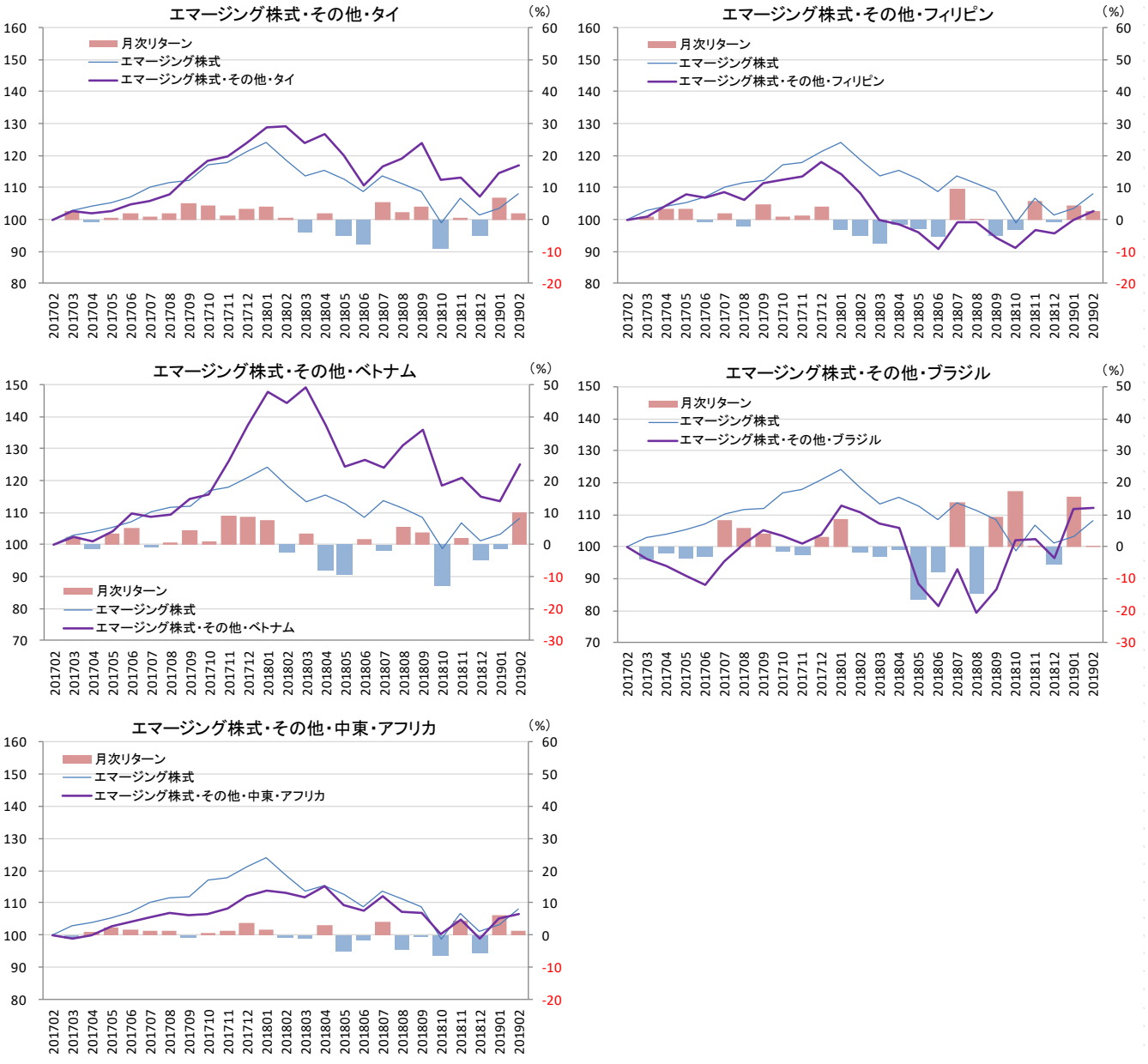


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24 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]

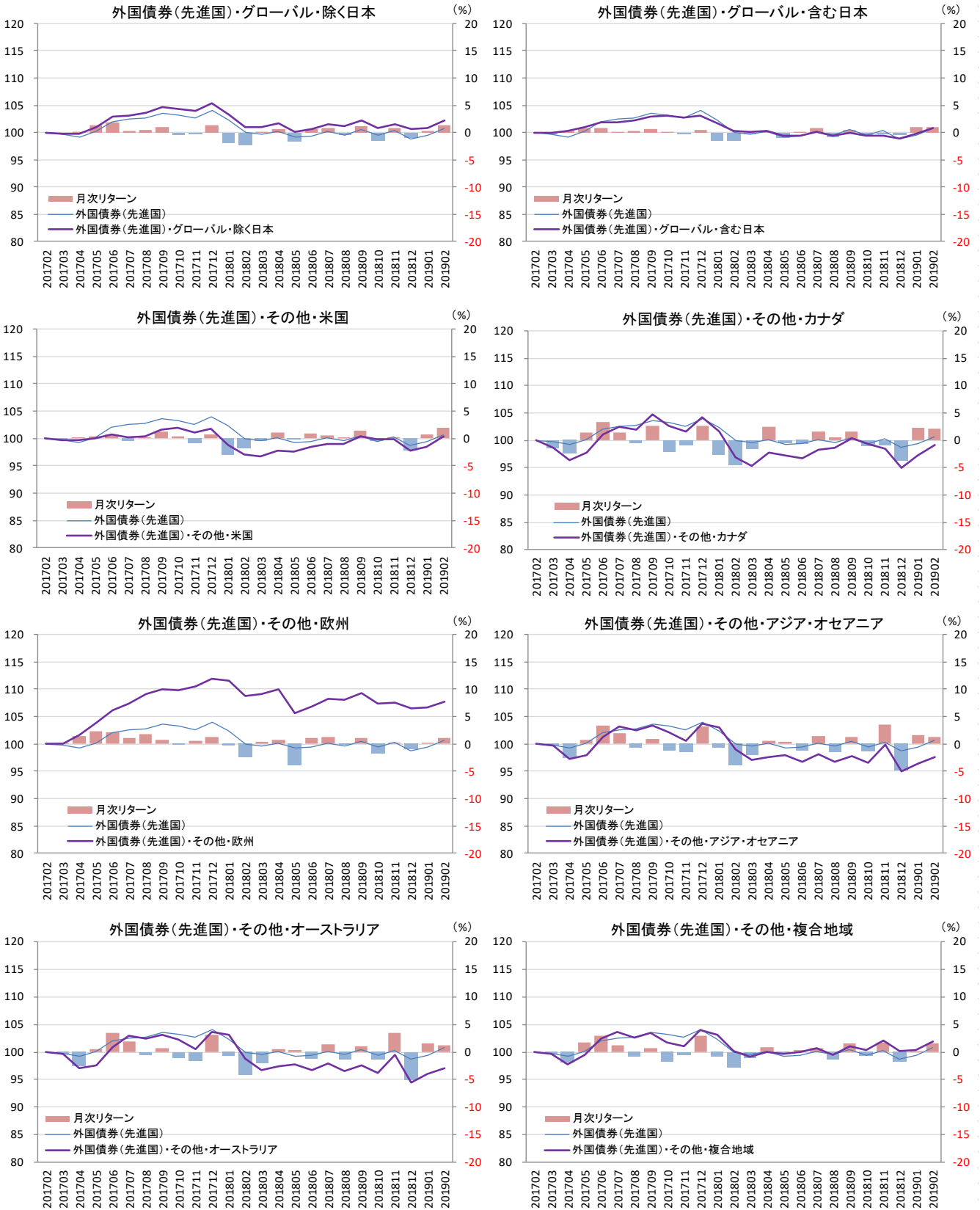


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

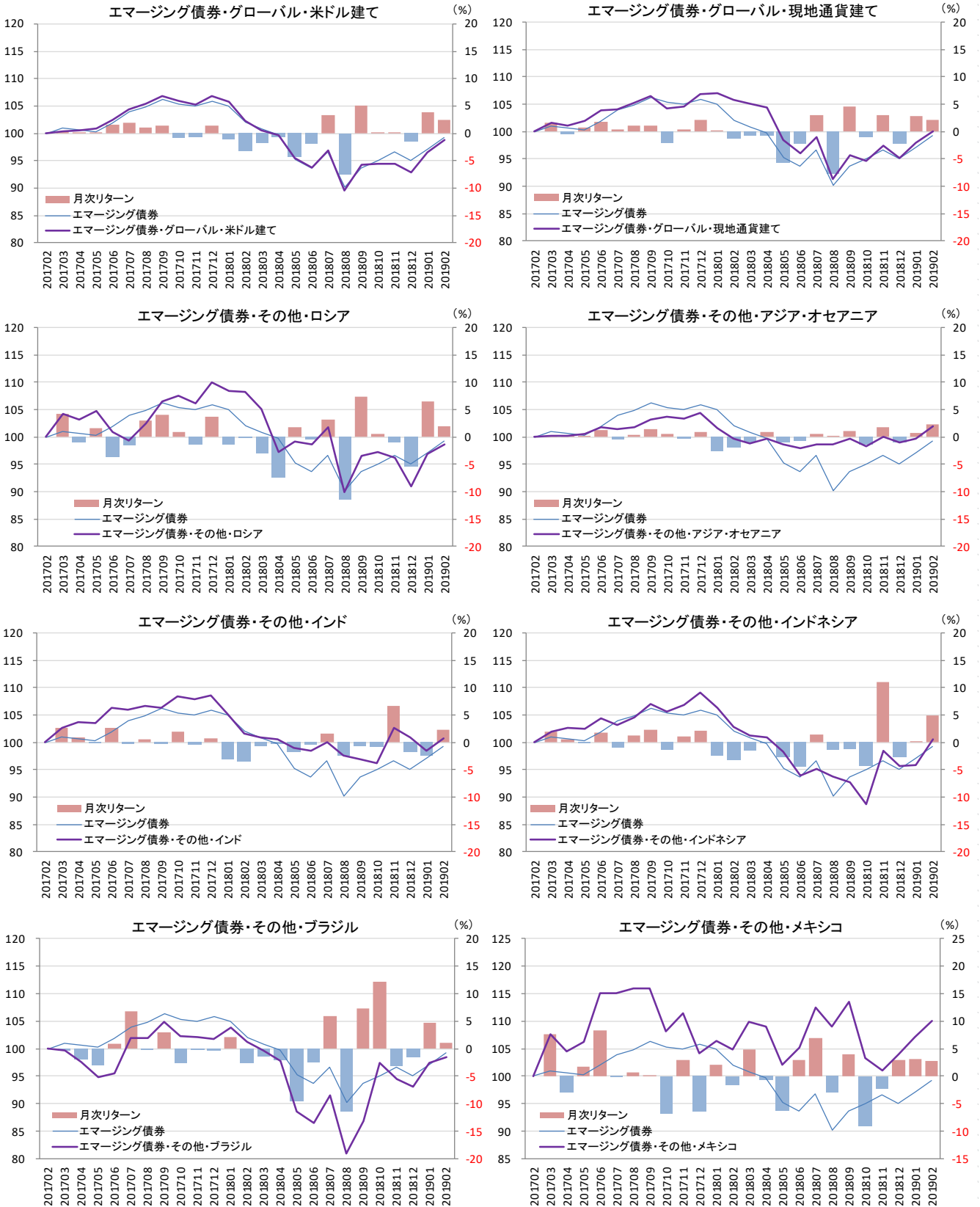


＜1＞パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24 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]

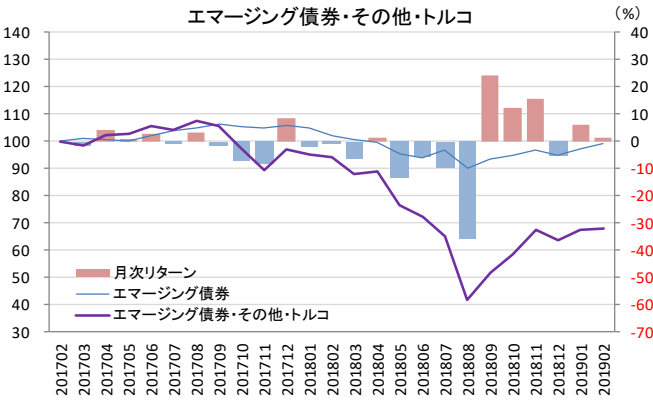


<1>パフォーマンス・サマリー

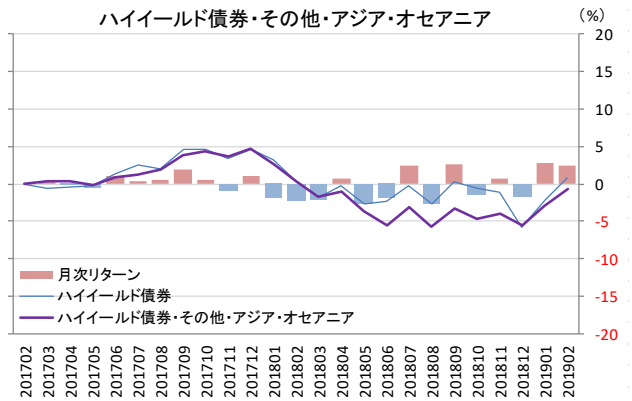
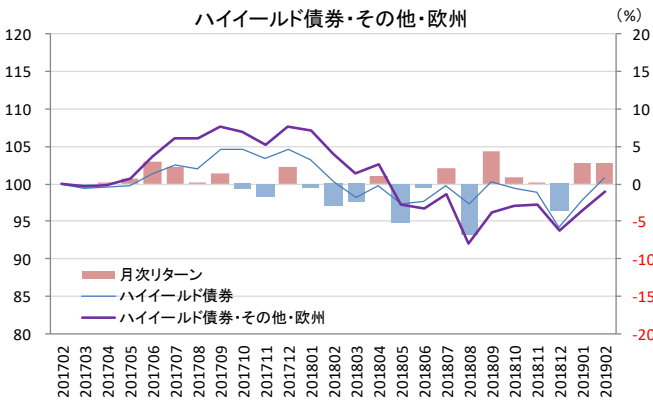
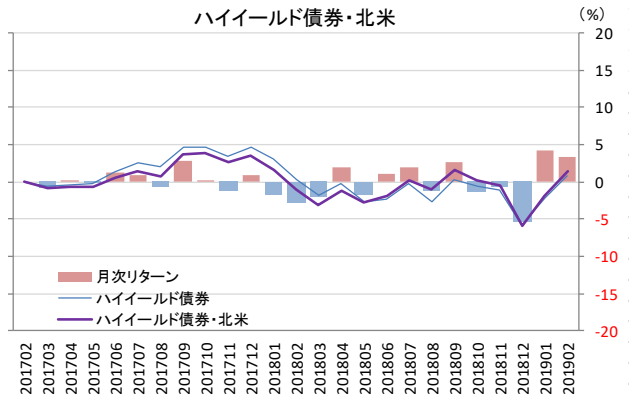
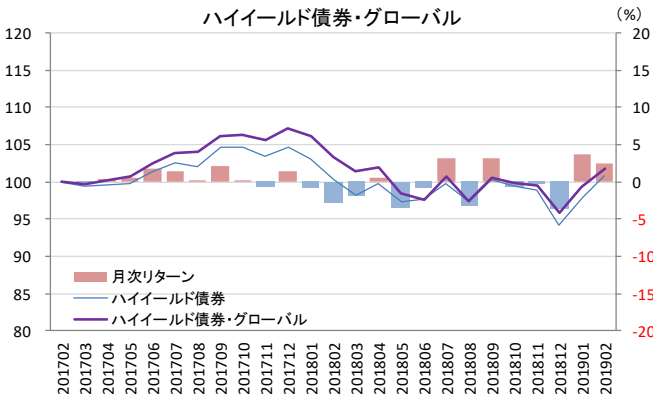
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

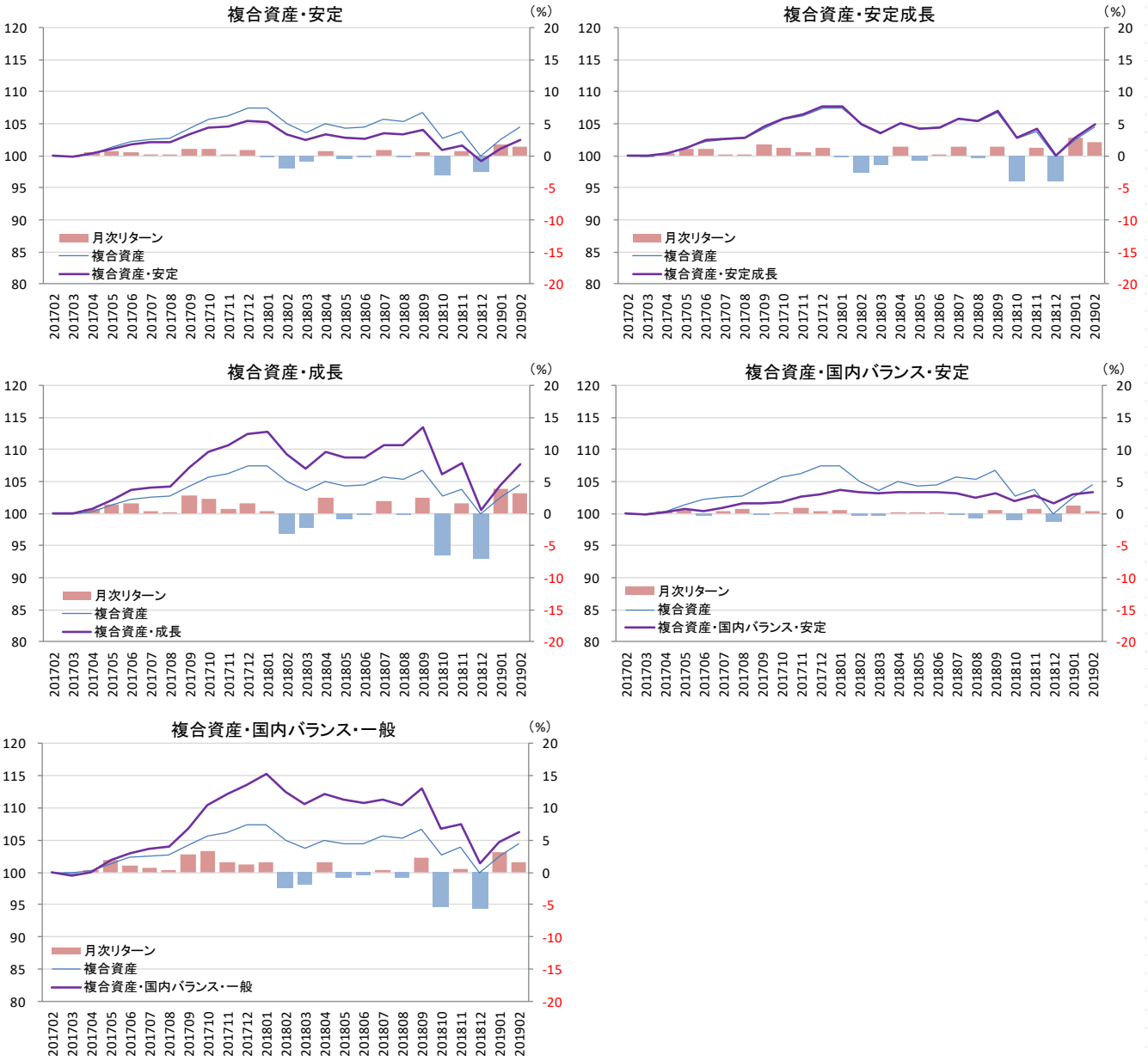


<1>パフォーマンス・サマリー

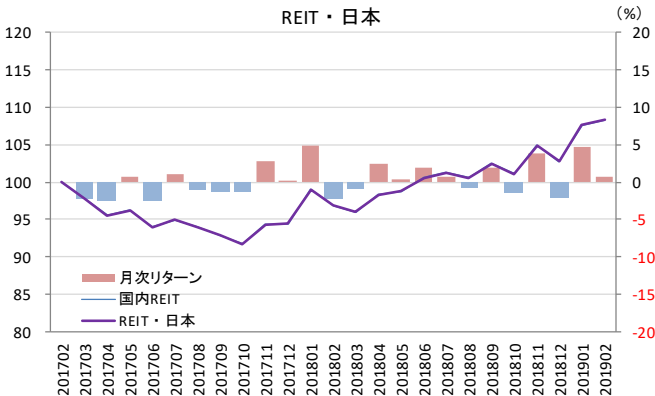
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]



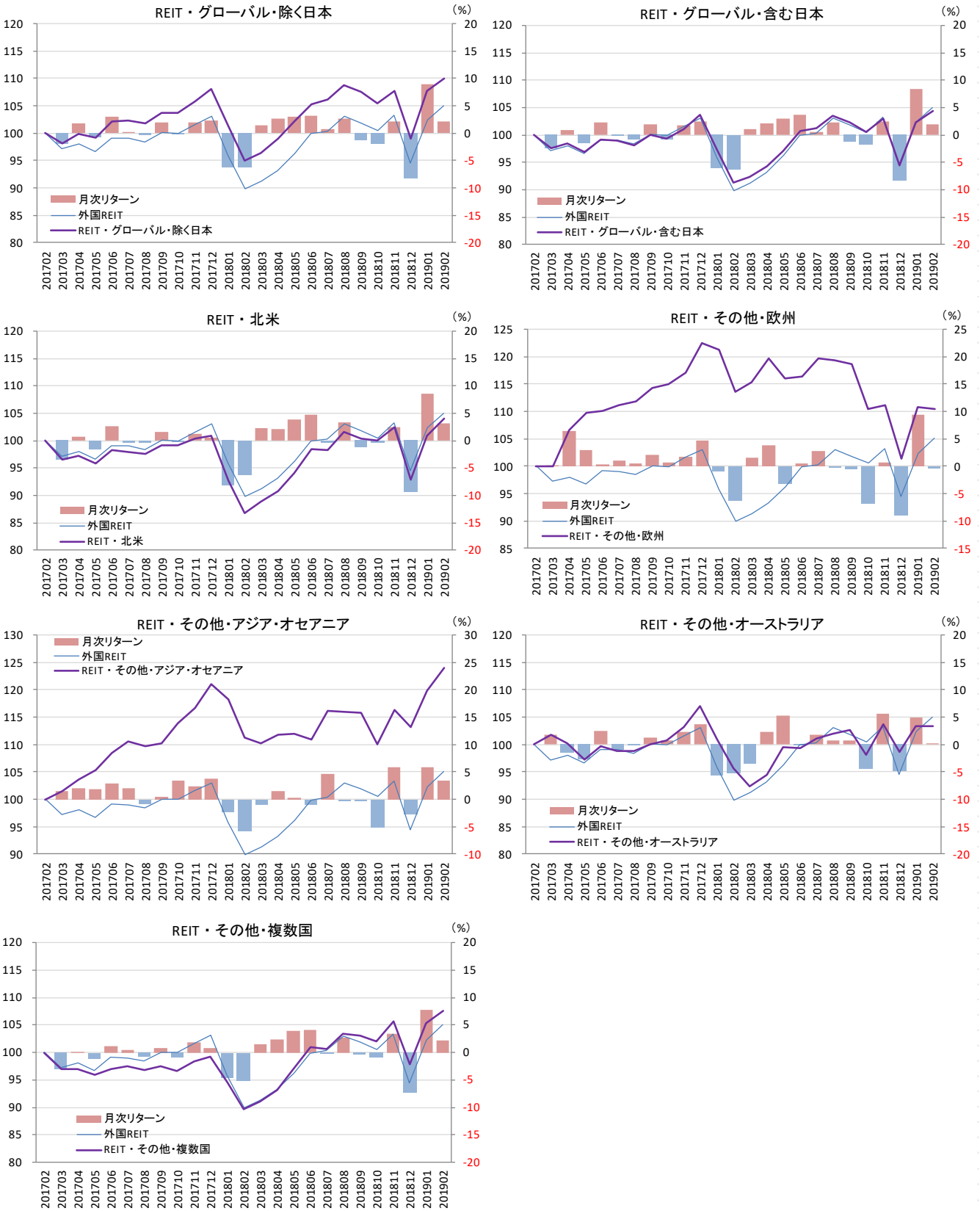


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24 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]

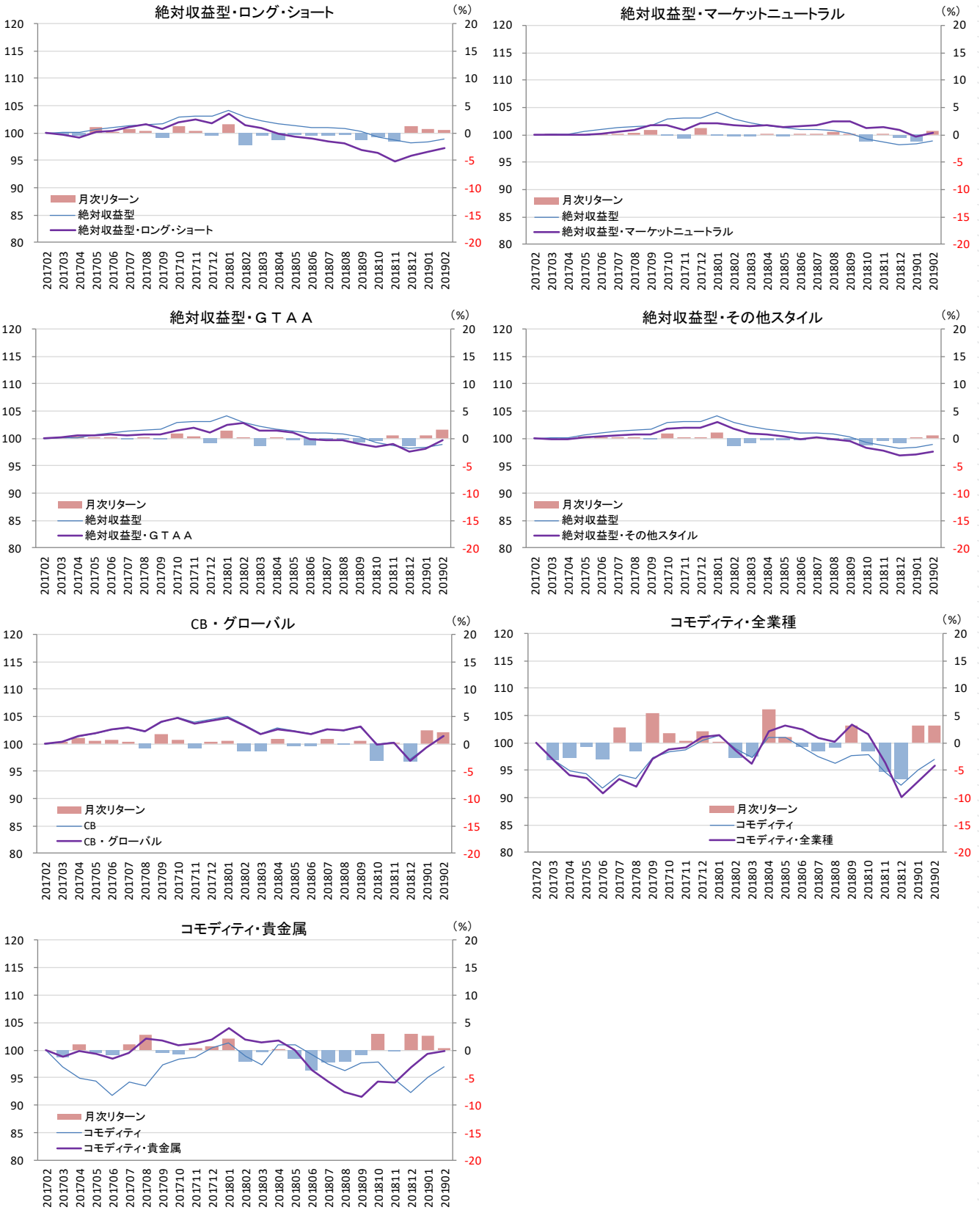


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]





## &lt;1&gt;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	3.22				
1	外国株式(先進国)・グローバル	6.57		17.43		1.15
2	国内株式・一般	3.61		10.07		0.36
3	外国株式(先進国)・その他	5.65		5.20		0.29
4	エマージング株式・その他	4.42		3.88		0.17
5	複合資産・安定成長	2.16		6.50		0.14
6	国内株式・その他	2.68		4.94		0.13
7	REIT・北米	3.17		4.03		0.13
8	外国債券(先進国)・グローバル	1.17		10.33		0.12
9	ハイイールド債券・北米	3.35		2.64		0.09
10	国内株式・小型	5.14		1.68		0.09
11	エマージング株式・グローバル	5.48		1.52		0.08
12	複合資産・安定	1.43		4.44		0.06
13	複合資産・成長	3.17		1.89		0.06
14	REIT・グローバル	1.98		3.01		0.06
15	外国債券(先進国)・その他	1.47		3.90		0.06
16	エマージング債券・グローバル	2.39		1.51		0.04
17	エマージング債券・その他	1.95		1.76		0.03
18	REIT・日本	0.63		4.26		0.03
19	ハイイールド債券・その他	2.66		0.81		0.02
20	REIT・その他	2.47		0.77		0.02
21	ハイイールド債券・グローバル	2.46		0.63		0.02
22	国内債券・一般	0.22		5.36		0.01
23	絶対収益型	0.67		1.12		0.01
24	複合資産・国内バランス	0.53		1.20		0.01
25	CB	2.20		0.28		0.01
26	コモディティ	1.99		0.26		0.01
27	エマージング株式・BRICS	3.56		0.11		0.00
	合計			99.53		3.19

## ◆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	-0.44		
1	REIT・北米	19.74	4.67	0.92
2	REIT・日本	11.78	4.23	0.50
3	REIT・グローバル	14.52	3.14	0.46
4	外国株式(先進国)・グローバル	1.18	15.46	0.18
5	外国債券(先進国)・グローバル	0.93	10.94	0.10
6	外国株式(先進国)・その他	1.96	4.89	0.10
7	REIT・その他	10.04	0.85	0.09
8	ハイイールド債券・北米	2.46	3.43	0.08
9	国内債券・一般	0.99	4.73	0.05
10	外国債券(先進国)・その他	0.14	4.47	0.01
11	複合資産・安定成長	0.02	5.95	0.00
12	複合資産・国内バランス	-0.45	0.85	-0.00
13	コモディティ	-1.86	0.23	-0.00
14	CB	-1.76	0.35	-0.01
15	エマージング株式・BRICS	-6.16	0.14	-0.01
16	ハイイールド債券・グローバル	-1.44	0.81	-0.01
17	複合資産・成長	-1.49	1.62	-0.02
18	複合資産・安定	-0.87	3.88	-0.03
19	絶対収益型	-3.79	0.99	-0.04
20	エマージング債券・その他	-1.84	2.13	-0.04
21	ハイイールド債券・その他	-3.92	1.12	-0.04
22	エマージング債券・グローバル	-3.74	1.86	-0.07
23	エマージング株式・グローバル	-7.54	1.75	-0.13
24	国内株式・その他	-4.85	4.32	-0.21
25	国内株式・小型	-13.26	1.67	-0.22
26	エマージング株式・その他	-9.02	4.35	-0.39
27	国内株式・一般	-11.73	10.74	-1.26
	合計		99.54	-0.02

◆計算定義

寄与度 (%) = 累積リターン (%) × 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。

## &lt;2&gt; 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	17.95	22.65	107.57	8.86	9.56	11.66	0.64	0.44	0.65
国内株式	32.91	43.46	169.34	14.54	15.76 ↑	17.60	0.69	0.48	0.59
一般	30.91	39.57	150.66	14.68	16.14	17.85	0.64	0.43	0.54
フリー	31.49	39.08	152.42	14.94	16.54	18.54	0.64	0.41	0.52
バリュー	28.86	41.61	153.62	14.05	14.99	16.47	0.63	0.48	0.59
小型	50.11	76.83	293.63	16.72	15.56 ↑	17.60	0.87	0.78	0.83
その他	33.86	47.10	192.60	14.29	15.38	17.58	0.72	0.52	0.64
日経225	38.13	52.32	218.39	14.57	15.44	17.89 ↓	0.78	0.57	0.68
TOPIX	30.79	44.58	151.44	14.00	15.31	17.00	0.67	0.50	0.57
JPX日経400	26.33	38.44	-	13.58	14.84	-	0.60	0.45	-
国内債券	0.95	6.62	17.47	1.47	1.47	1.48	0.25	0.88	1.07
一般	0.95	6.62	17.47	1.47	1.47	1.48	0.25	0.88	1.07
外国株式(先進国)	33.22	28.29	150.77	13.84 ↑	14.64 ↑	16.42	0.73	0.35	0.58
グローバル	33.29	34.00	160.46	13.81 ↑	14.43 ↑	16.28	0.73	0.42	0.61
除く日本	37.96	40.58	240.36	14.86	15.81 ↑	18.09	0.77	0.45	0.72
含む日本	31.91	32.10	145.97	13.62 ↑	14.15 ↑	15.96	0.71	0.40	0.59
その他	33.08	16.60	169.90	14.13	15.30 ↑	18.22	0.71	0.20	0.57
北米	35.58	20.12	98.25	16.76	17.12 ↑	21.05	0.64	0.22	0.33
米国	44.40	25.63	197.83	14.57	16.47	18.27	0.90	0.28	0.63
カナダ	20.20	-9.89	66.02	12.96 ↑	13.91 ↑	18.51	0.49	-0.15	0.28
欧州	18.80	11.88	156.91	14.98	14.99 ↑	19.31	0.40	0.15	0.51
アジア・オセアニア	35.48	36.26	311.81	12.86 ↓	14.65	19.47 ↓	0.83	0.44	0.78
オーストラリア	18.04	10.82	178.60	15.24	15.23	20.64	0.38	0.14	0.52
ニュージーランド	44.40	71.47	-	14.59	16.91	-	0.90	0.67	-
複合地域	3.12	-20.62	-	18.95	18.91	-	0.06	-0.24	-
エマージング株式	35.31	28.23	141.98	13.83	15.17	19.57 ↓	0.77	0.34	0.47
グローバル	34.72	20.95	132.84	14.70	15.97	19.42	0.71	0.24	0.45
BRICS	69.79	47.09	184.60	16.35 ↓	18.00	22.26	1.18	0.45	0.49
その他	34.29	30.96	147.82	13.88	15.13	19.54 ↓	0.75	0.37	0.48
欧州	48.52	5.14	161.35	18.72	19.95	26.33 ↓	0.76	0.05	0.38
ロシア	69.87	28.21	215.30	21.02	24.91	29.27 ↓	0.92	0.20	0.41
アジア・オセアニア	29.63	25.92	160.65	13.97	15.18 ↑	18.13	0.65	0.31	0.55
中国	44.60	67.78	172.32	17.67	22.53	22.80	0.74	0.48	0.46
インド	42.52	68.40	193.34	18.06 ↓	19.98	26.03	0.70	0.55	0.43
インドネシア	18.71	18.11	-	16.37	20.27	-	0.36	0.17	-
タイ	37.21	46.27	383.70	13.88 ↑	14.36	18.13 ↓	0.81	0.55	0.94
フィリピン	2.99	14.68	-	15.43	15.23	-	0.07	0.18	-
ベトナム	46.89	37.75	-	16.86 ↑	16.64 ↑	-	0.81	0.40	-
韓国	3.98	-5.07	131.34	15.53	15.07	21.55 ↓	0.09	-0.07	0.40
香港	58.05	37.35	162.18	14.97	18.61	19.62	1.10	0.35	0.51
台湾	21.79	36.38	225.57	16.99	16.73 ↑	20.64 ↓	0.40	0.38	0.61
中南米	59.87	13.08	94.53	22.74	22.82	24.41	0.75	0.11	0.28
ブラジル	106.04	9.68	69.37	31.53	31.35	30.62	0.87	0.06	0.18
メキシコ	-9.25	-13.96	-	22.22	19.79	-	-0.14	-0.15	-
中東・アフリカ	22.47	3.79	134.47	12.92 ↓	14.95	17.50 ↓	0.54	0.05	0.51
南アフリカ	19.15	-34.04	-	17.82	19.14	-	0.34	-0.42	-
トルコ	-21.32	-20.02	64.88	31.54	29.15	33.10	-0.24	-0.15	0.15
複合地域	16.74	9.94	157.35	13.83	14.15 ↑	16.91	0.39	0.14	0.58

※[色塗りの基準] 累積リターン&gt; 総合、リスク&lt;総合、シャープ・レシオ&gt;=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	17.95	22.65	107.57	8.86	9.56	11.66	0.64	0.44	0.65
外国債券(先進国)	3.62	4.25	45.07	4.99	5.74	8.33 ↓	0.25	0.15	0.45
グローバル	3.17	5.35	40.65	4.41 ↓	5.18	7.61 ↓	0.25	0.20	0.45
除く日本	2.01	4.36	49.51	5.11	5.92	8.39 ↓	0.14	0.15	0.48
含む日本	4.67	6.60	29.92	3.78 ↓	4.47	6.82 ↓	0.42	0.29	0.38
その他	4.25	2.28	61.09	7.03	7.47	10.13 ↓	0.21	0.06	0.48
北米	3.38	10.52	-	2.65 ↓	4.10	-	0.44	0.49	-
米国	3.06	11.87	52.15	5.16	5.86	6.54 ↓	0.21	0.39	0.65
カナダ	0.05	-4.50	24.37	8.51	9.17	10.15 ↓	0.01	-0.10	0.21
欧州	4.58	1.24	37.19	6.85	7.29	10.28 ↓	0.23	0.03	0.31
アジア・オセアニア	4.91	1.64	80.72	8.58	8.77	11.38 ↓	0.19	0.04	0.53
オーストラリア	4.55	0.60	81.09	8.72	8.84	11.82 ↓	0.18	0.01	0.51
ニュージーランド	11.81	10.63	-	8.85 ↓	10.29	-	0.43	0.20	-
複合地域	9.07	4.62	50.95	6.58 ↓	7.51	10.13 ↓	0.45	0.12	0.41
エマージング債券	21.75	10.97	75.60	9.07 ↓	10.71	13.04 ↓	0.75	0.20	0.44
グローバル	18.95	10.35	77.78	9.45 ↓	10.62	12.88 ↓	0.64	0.19	0.46
米ドル建て	20.17	12.10	83.51	9.52	10.83	13.06 ↓	0.67	0.21	0.48
現地通貨建て	11.69	-0.24	48.36	9.81	10.10	12.13 ↓	0.39	-0.00	0.33
その他	25.16	10.63	68.78	9.37 ↓	11.77	14.09 ↓	0.83	0.17	0.38
ロシア	45.47	-8.92	101.45	16.48	24.64	22.65 ↓	0.81	-0.08	0.32
アジア・オセアニア	6.37	17.92	72.68	5.55 ↓	6.83	9.03 ↓	0.38	0.49	0.62
インド	12.84	31.03	-	9.46	10.09	-	0.44	0.55	-
インドネシア	9.06	18.28	-	10.85	14.17	-	0.28	0.24	-
ブラジル	50.46	16.77	82.38	17.57	18.90	17.80 ↓	0.83	0.17	0.35
メキシコ	-1.77	-12.01	-	16.23	14.51	-	-0.03	-0.17	-
南アフリカ	39.25	14.21	-	21.20	19.18	-	0.55	0.14	-
トルコ	-39.70	-44.35	-	32.84	27.80	-	-0.47	-0.40	-
複合地域	16.45	-1.91	41.35	10.15 ↓	11.44	13.46 ↓	0.52	-0.03	0.26
ハイイールド債券	24.29	16.59	137.03	8.75 ↓	9.56	12.38	0.87	0.33	0.73
グローバル	26.27	16.21	105.55	8.52 ↓	9.60	12.30	0.96	0.32	0.60
北米	26.53	19.20	149.62	9.03	9.62	12.02	0.91	0.37	0.79
その他	17.60	11.17	177.07	9.26 ↓	10.20	16.08 ↓	0.61	0.21	0.66
欧州	18.33	9.87	226.41	10.18 ↓	10.95	17.62 ↓	0.57	0.17	0.71
アジア・オセアニア	16.16	19.63	-	7.07 ↓	8.39	-	0.73	0.44	-
複合地域	15.23	10.24	143.66	8.39	8.60	12.43 ↓	0.58	0.23	0.75
複合資産	12.41	18.61	96.87	6.18	7.14	9.64	0.65	0.49	0.72
安定	7.41	12.64	78.30	4.58	5.56	8.16 ↓	0.54	0.43	0.72
安定成長	13.63	19.76	99.97	6.70	7.50	10.05	0.66	0.49	0.71
成長	21.29	29.19	139.14	9.89	10.59	12.27	0.68	0.50	0.74
国内バランス	7.10	14.92	51.49	2.45	4.61 ↓	6.84 ↓	0.96	0.61	0.61
安定	5.49	15.90	43.57	2.18	2.55	3.68 ↓	0.85	1.17	0.99
一般	16.72	17.04	64.75	8.01	9.30	9.93	0.67	0.34	0.51

※[色塗りの基準] 累積リターン&gt;総合、リスク&lt;総合、シャープ・レシオ&gt;=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

## &lt;2&gt; 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	17.95	22.65	107.57	8.86	9.56	11.66	0.64	0.44	0.65
国内REIT	9.23	41.28	235.58	7.41	8.92	16.79 ↓	0.41	0.80	0.76
日本	9.23	41.28	235.58	7.41	8.92	16.79 ↓	0.41	0.80	0.76
外国REIT	16.96	43.87	305.11	13.36	13.96	17.84 ↓	0.41	0.54	0.84
グローバル	14.29	35.49	278.06	13.28	13.51	17.50 ↓	0.35	0.46	0.81
除く日本	20.78	45.02	302.91	13.53	13.59	17.56 ↓	0.48	0.57	0.85
含む日本	13.60	34.55	276.33	13.26	13.51	17.49 ↓	0.33	0.45	0.81
北米	17.57	49.48	339.04	14.23	15.03	20.72 ↓	0.39	0.56	0.77
その他	28.20	53.46	309.58	11.04	11.91	16.59 ↓	0.79	0.75	0.91
欧州	10.57	16.48	72.81	16.26	15.44	21.99 ↓	0.21	0.20	0.25
アジア・オセアニア	38.76	64.76	365.00	10.69	12.13	15.45	1.08	0.87	1.07
オーストラリア	16.03	39.98	289.74	13.64	13.96	18.24 ↓	0.38	0.50	0.80
複合地域	6.26	15.19	203.66	15.89	15.16	19.03 ↓	0.13	0.19	0.62
複数国	18.00	62.65	368.96	11.52 ↑	12.61	17.09 ↓	0.50	0.81	0.98
その他									
絶対収益型	-2.88	-0.94	-6.91	1.97	2.20	3.44	-0.47	-0.08	-0.22
ロング・ショート	-3.32	-2.13	0.51	2.97	2.93	3.53	-0.36	-0.15	0.00
マーケットニュートラル	1.33	3.15	-0.09	2.12	1.99	2.04	0.23	0.32	-0.02
GTAA	-0.58	0.55	11.08	2.37	2.07	2.60	-0.06	0.05	0.39
その他スタイル	-2.75	-0.50	-11.62	2.02	2.42	5.23	-0.43	-0.04	-0.24
CB	11.18	6.21	66.88	5.77 ↓	6.46	9.99	0.63	0.19	0.52
アジア・オセアニア	20.01	37.10	88.92	8.96	10.70	10.88 ↓	0.71	0.61	0.60
日本	5.27	17.64	64.80	4.94	5.52	6.11	0.36	0.60	0.83
グローバル	11.49	5.33	75.14	5.78	6.37	10.56	0.65	0.16	0.54
コモディティ	12.01	-32.72	-4.72	9.79 ↓	12.17	15.63 ↓	0.40	-0.63	-0.03
全業種	11.55	-35.81	-11.96	12.24	13.95	16.19 ↓	0.31	-0.61	-0.08
貴金属	1.57	-9.50	-	6.43 ↓	9.19	-	0.09	-0.21	-
エネルギー	36.22	-44.12	-15.99	27.20	27.37 ↑	25.41	0.40	-0.40	-0.07
その他コモディティ	7.87	-22.59	52.96	14.27	14.65	18.64	0.18	-0.34	0.23

※[色塗りの基準] 累積リターン&gt; 総合、リスク&lt; 総合、シャープ・レシオ&gt;=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

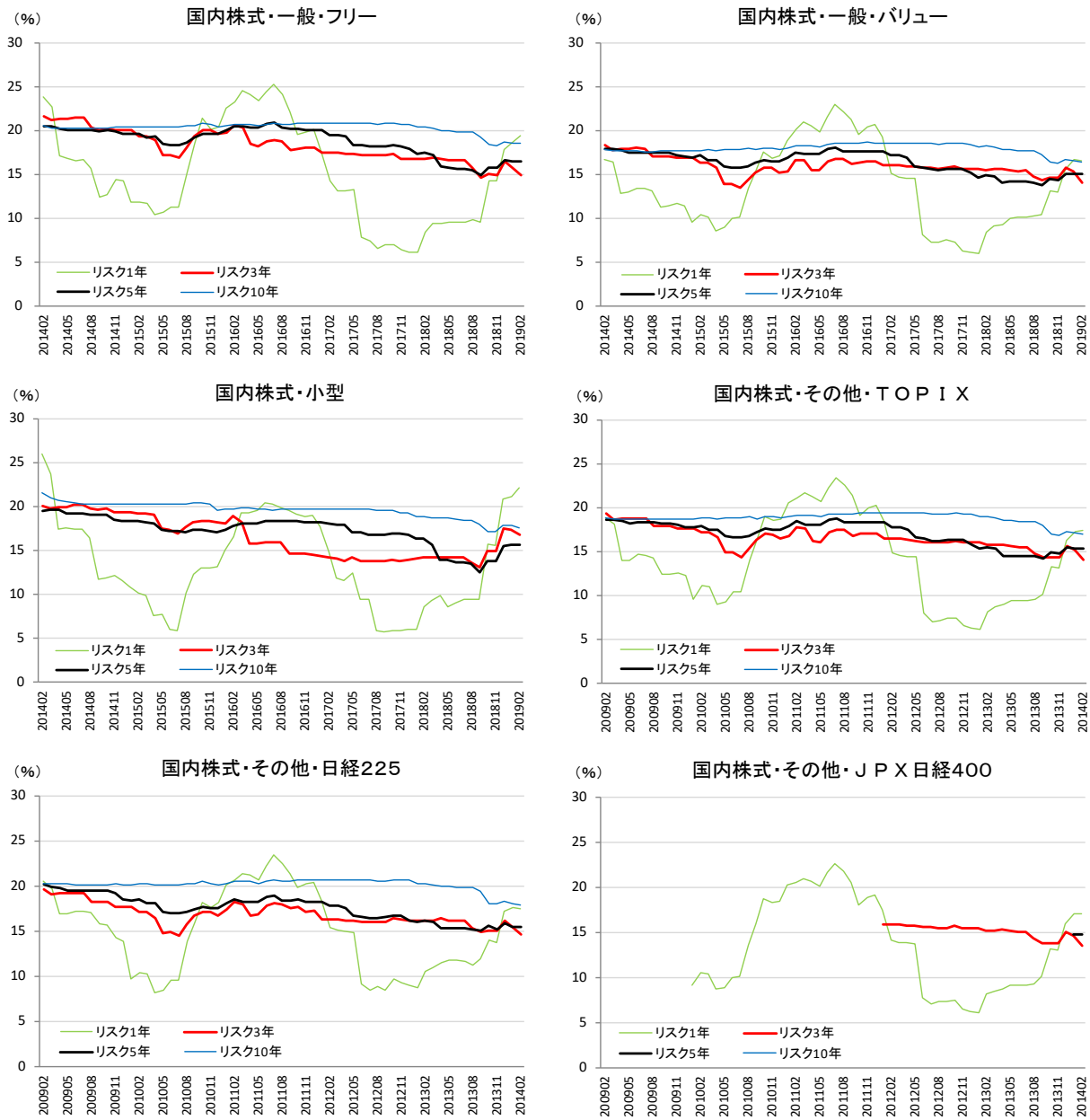


＜2＞リスク・サマリー

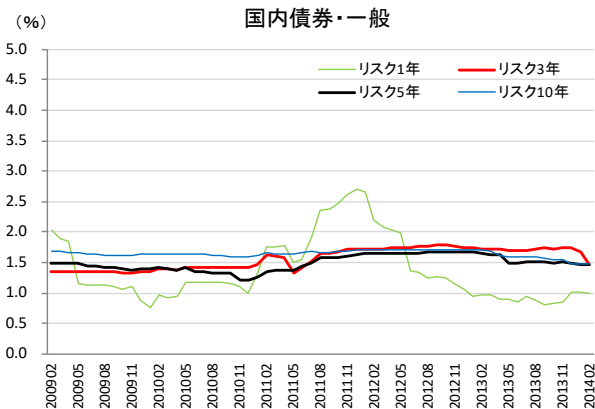
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

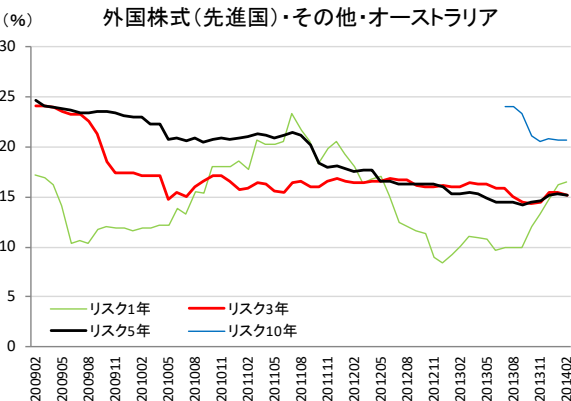
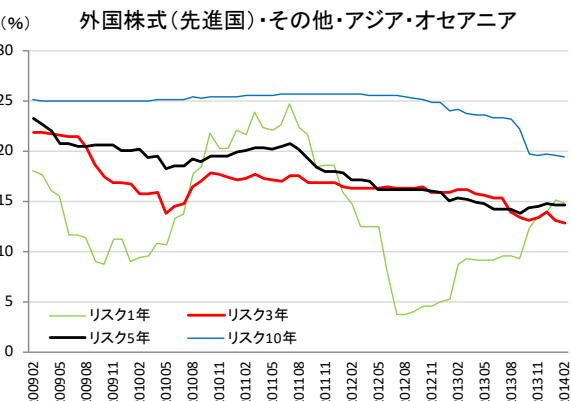
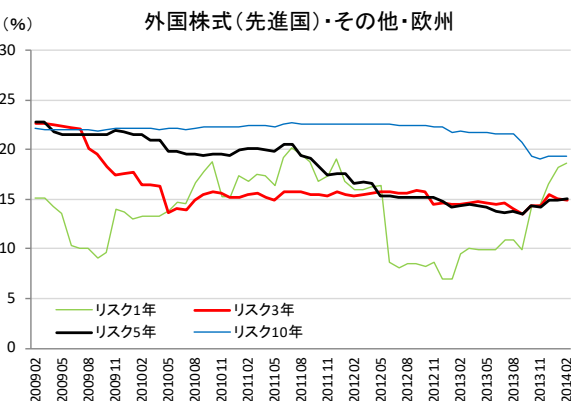
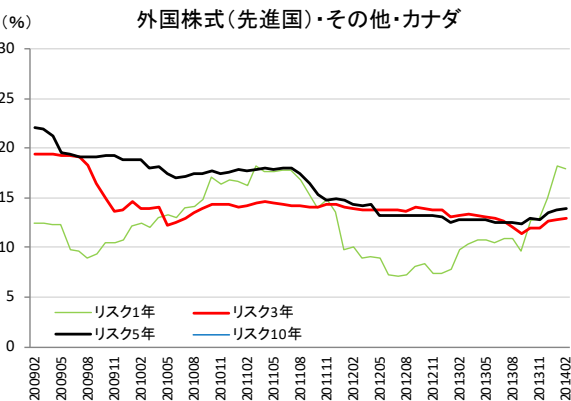
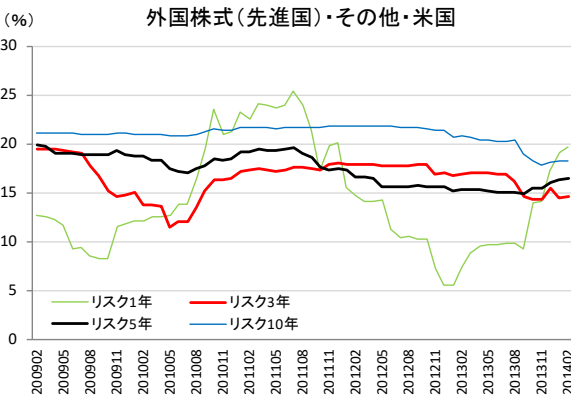
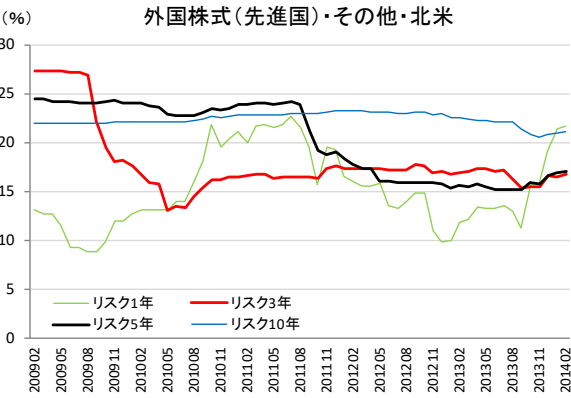
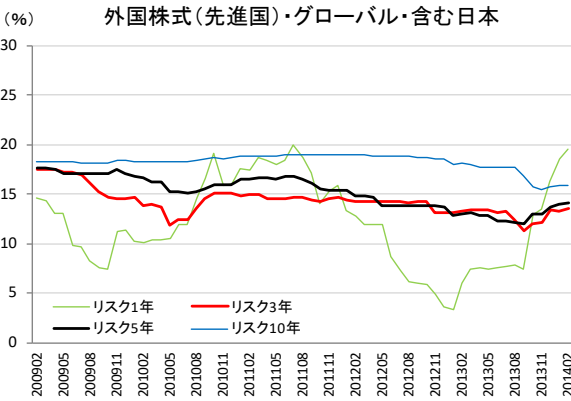
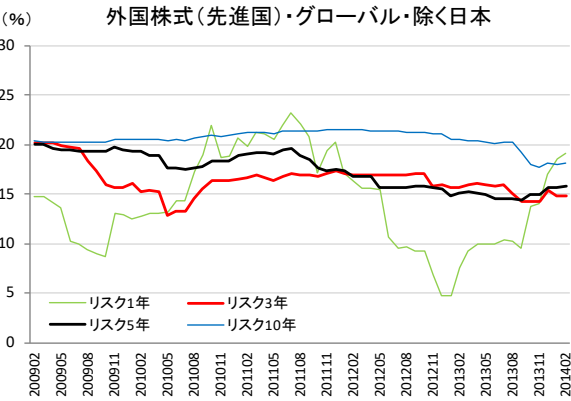


＜2＞リスク・サマリー

(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)]

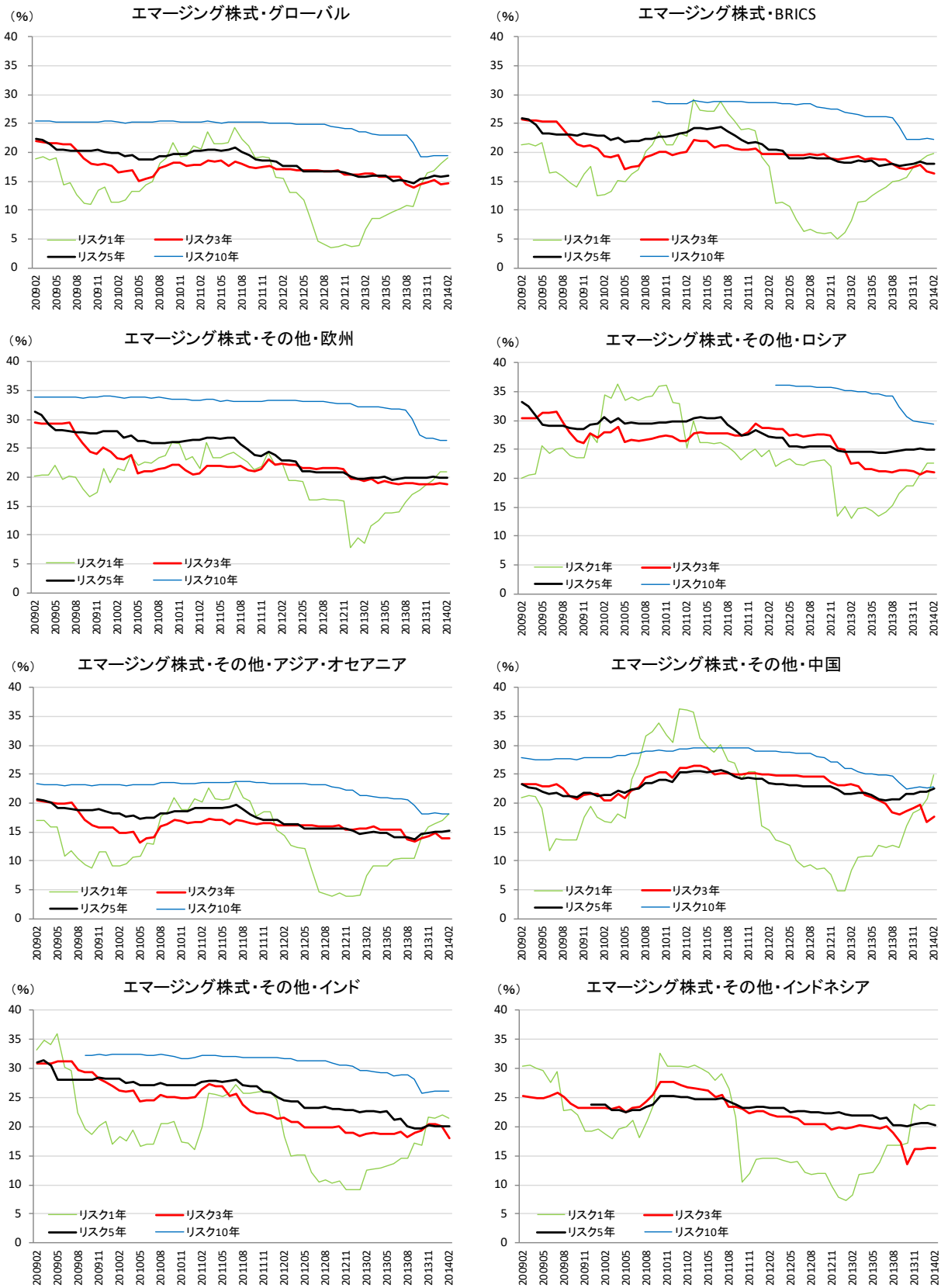


＜2＞リスク・サマリー

(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]

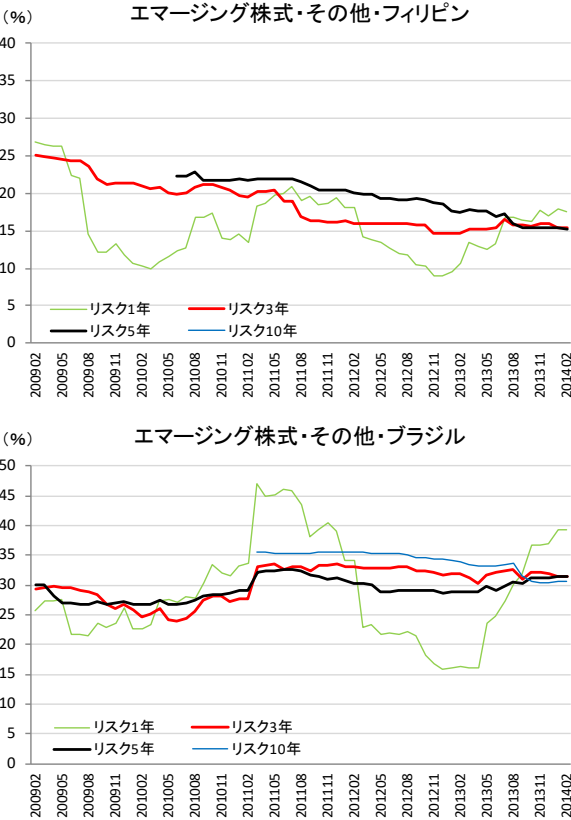
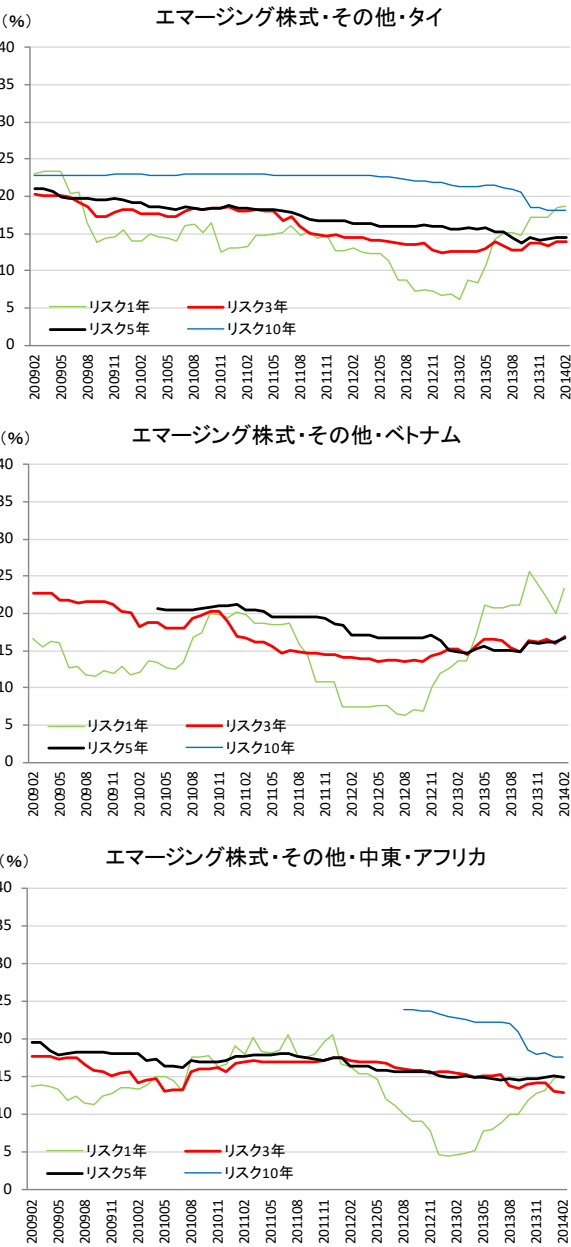


＜2＞リスク・サマリー

(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]

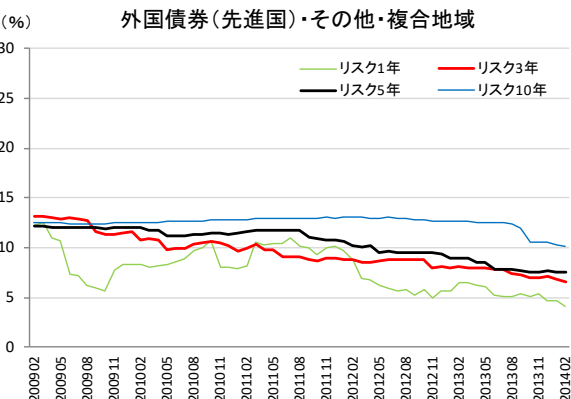
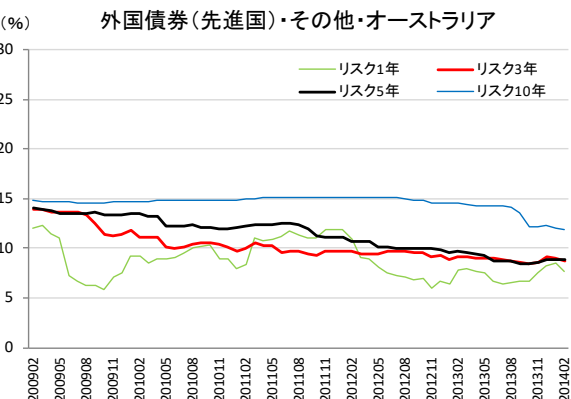
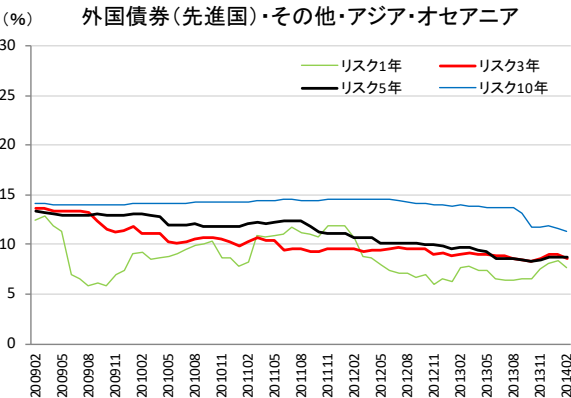
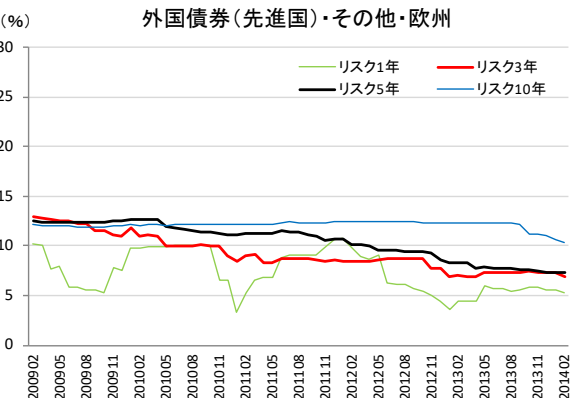
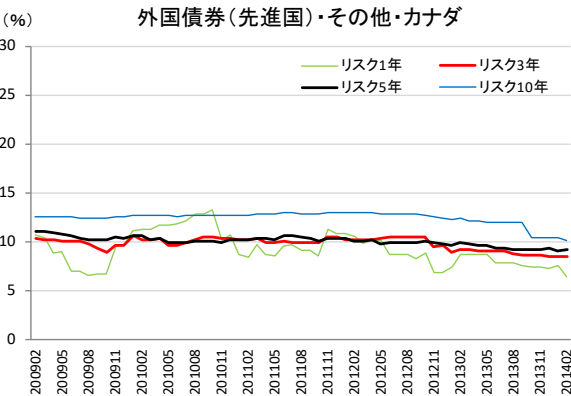
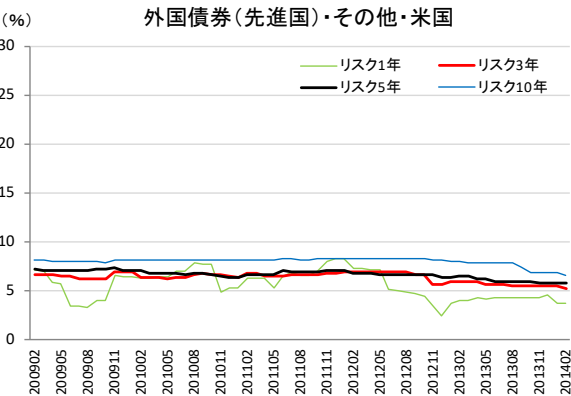
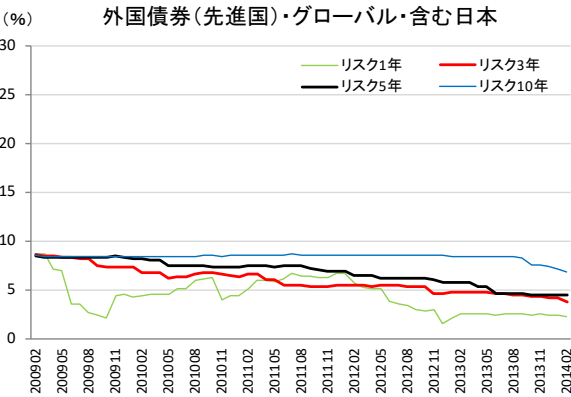
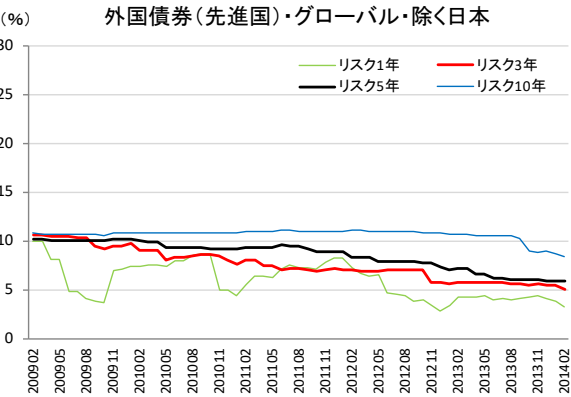


＜2＞リスク・サマリー

(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)]

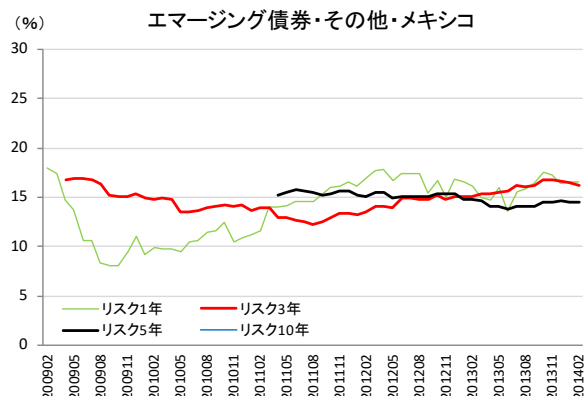
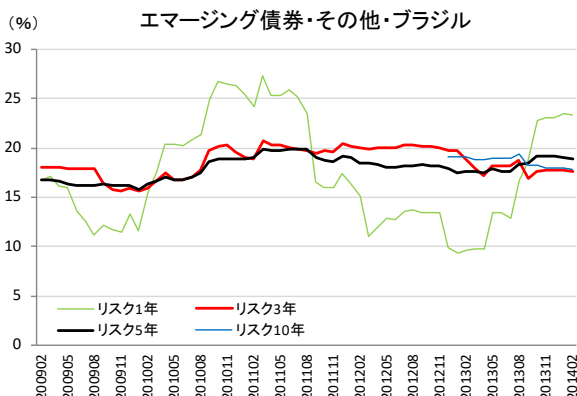
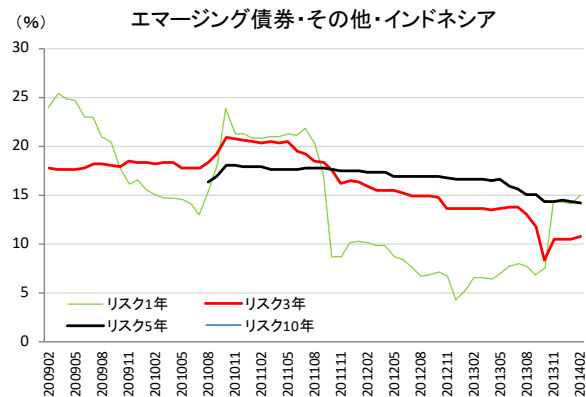
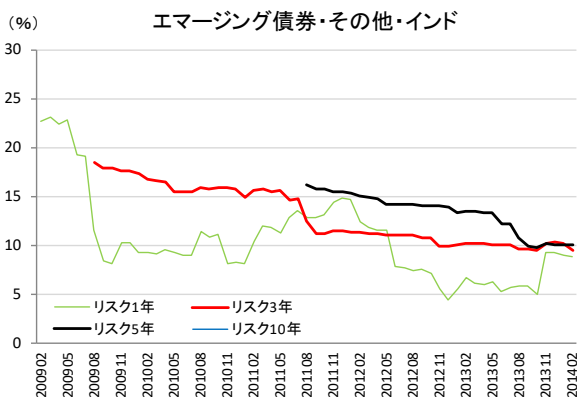
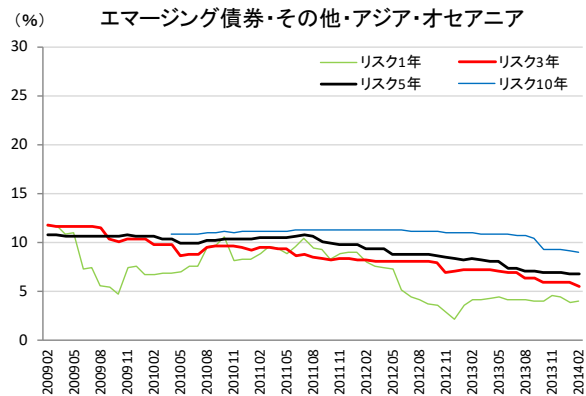
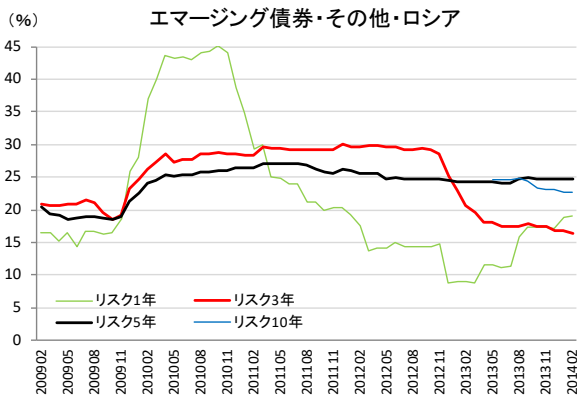
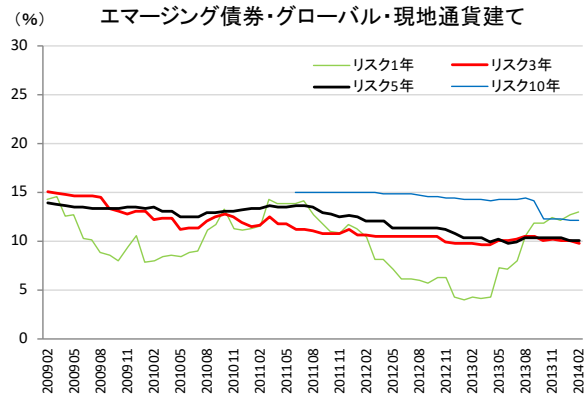
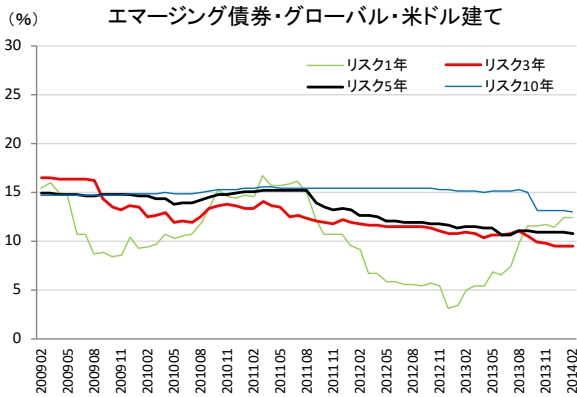


＜2＞リスク・サマリー

(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]

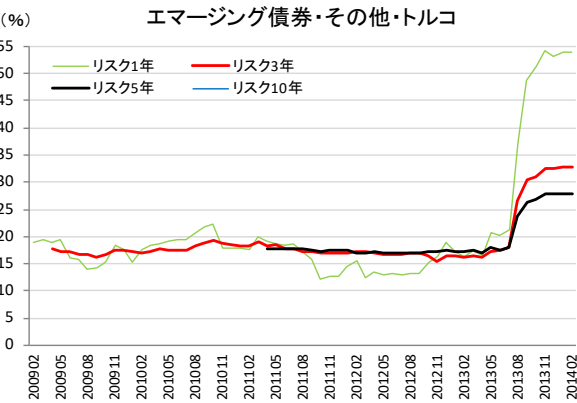


＜2＞リスク・サマリー

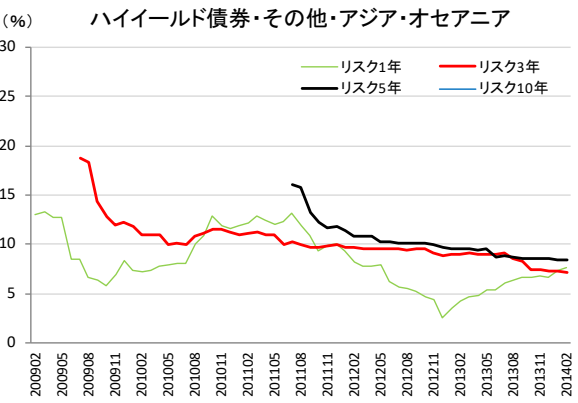
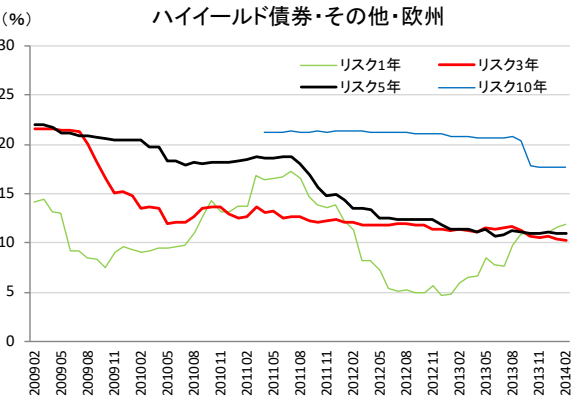
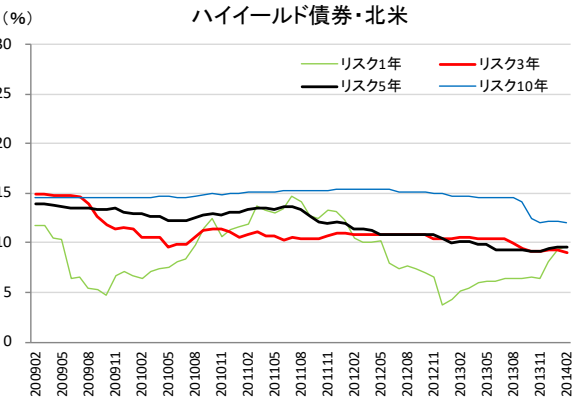
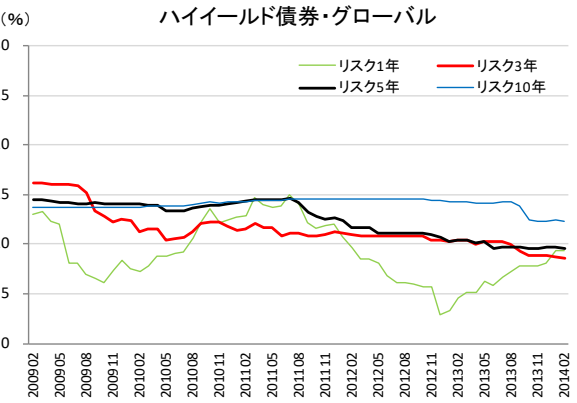
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

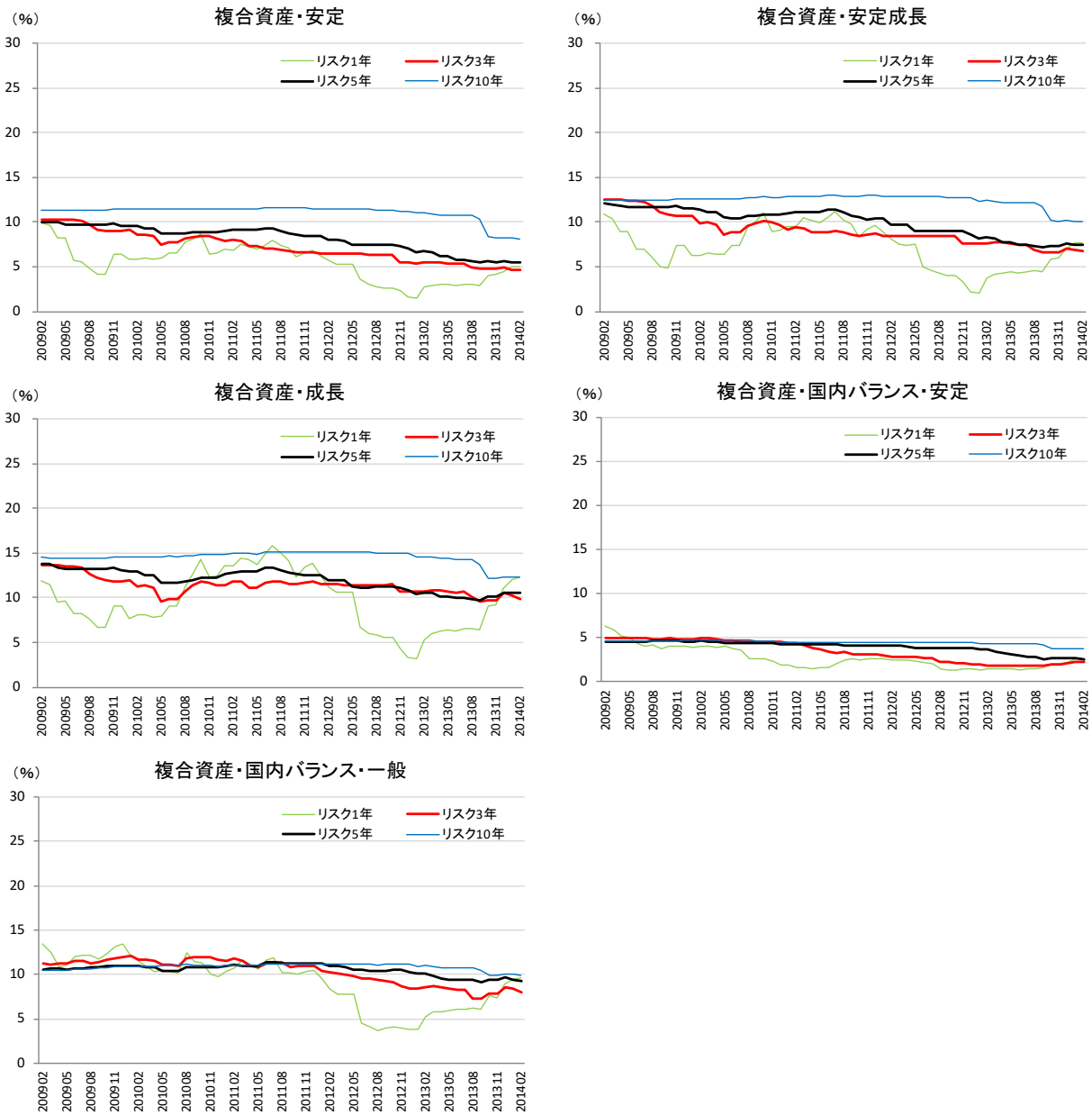


＜2＞リスク・サマリー

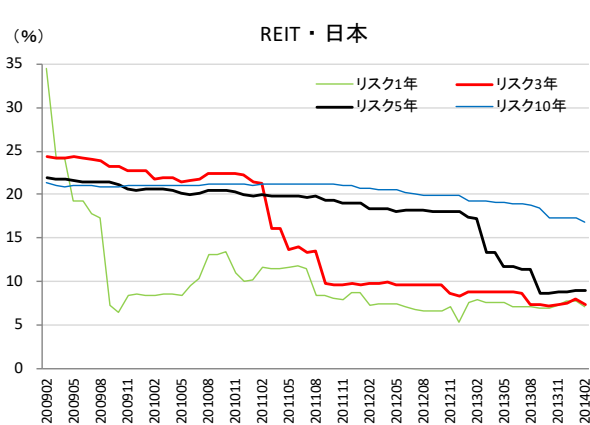
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]



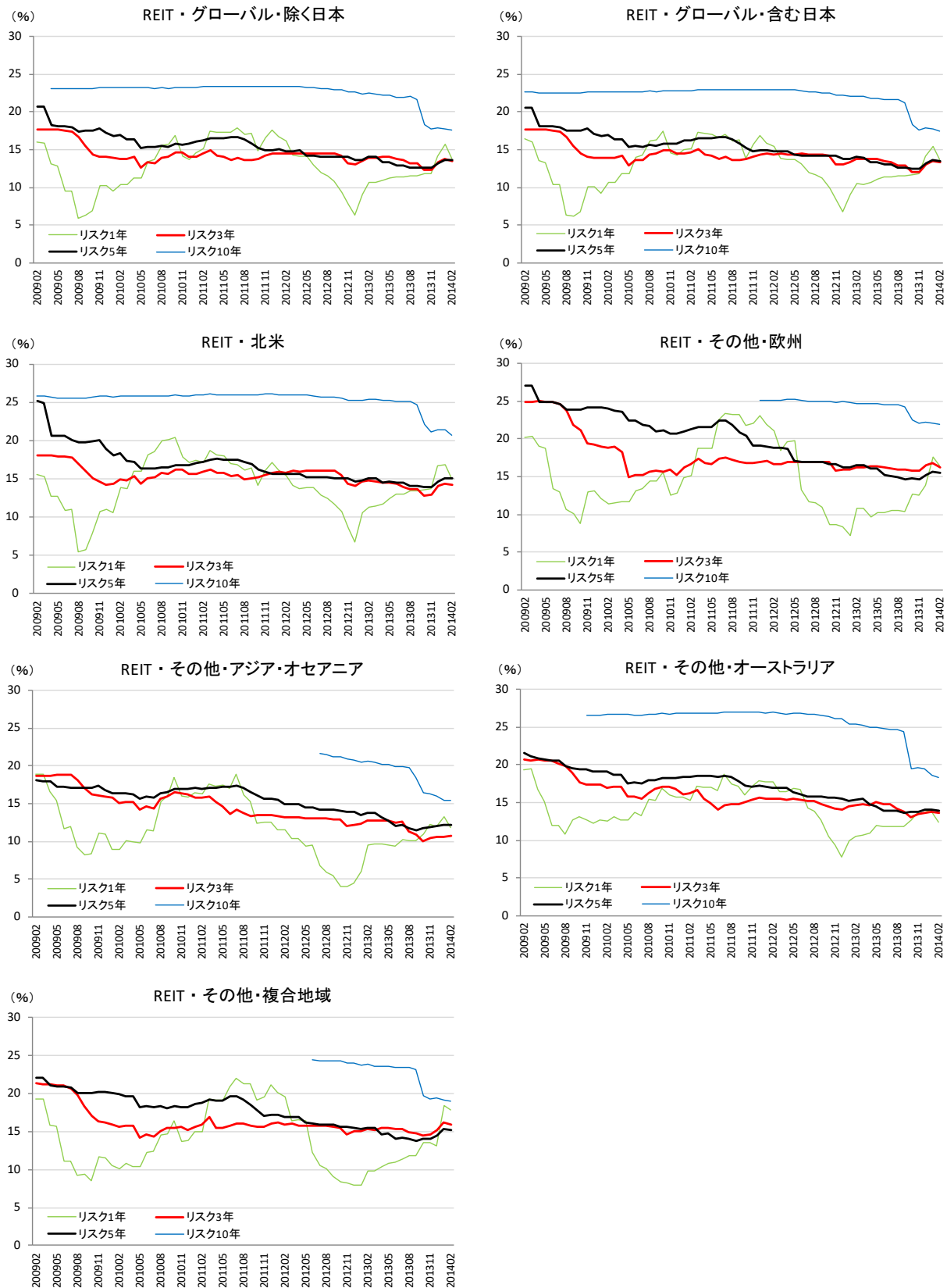


<2> リスク・サマリー

(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]

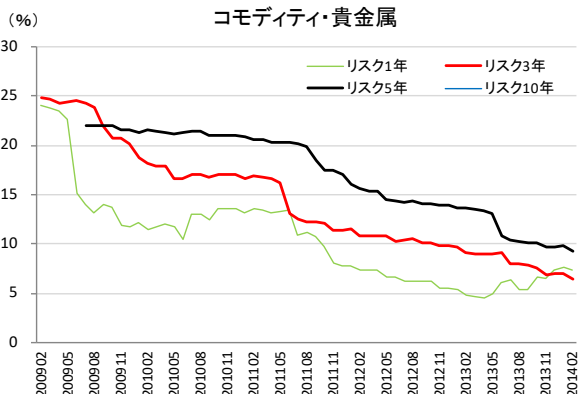
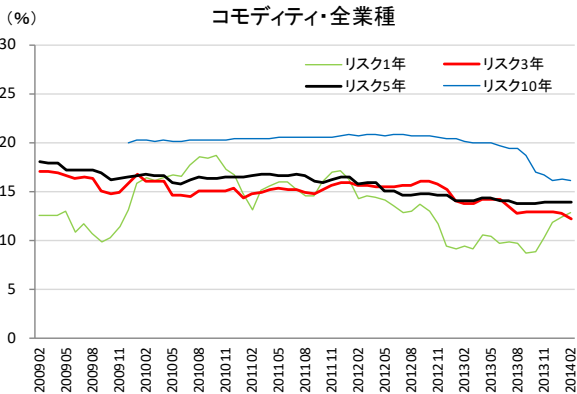
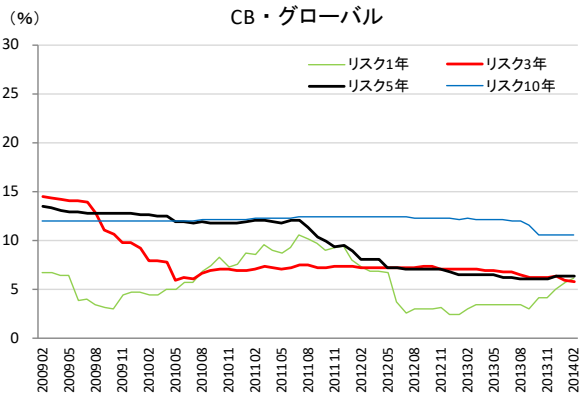
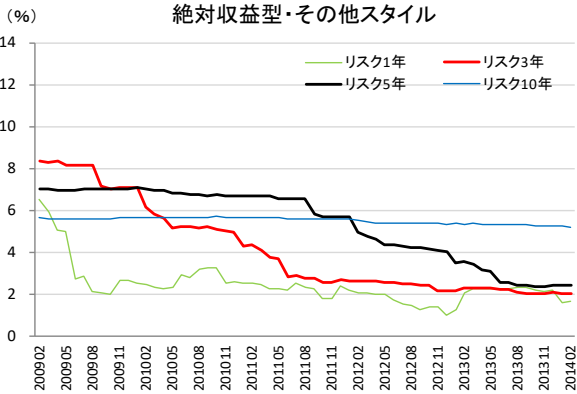
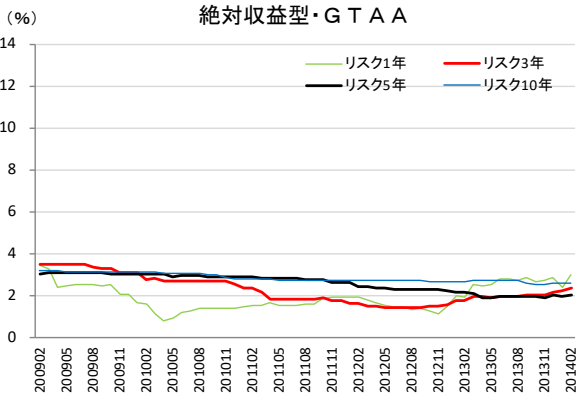
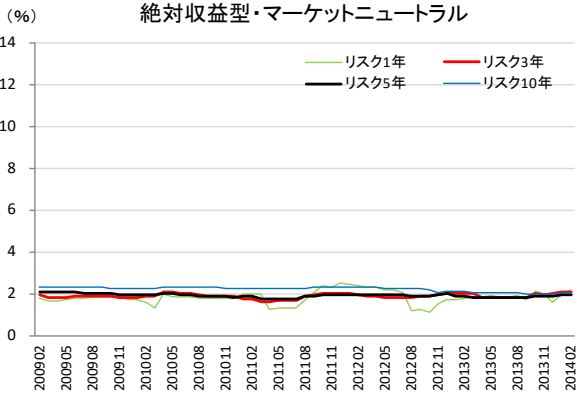
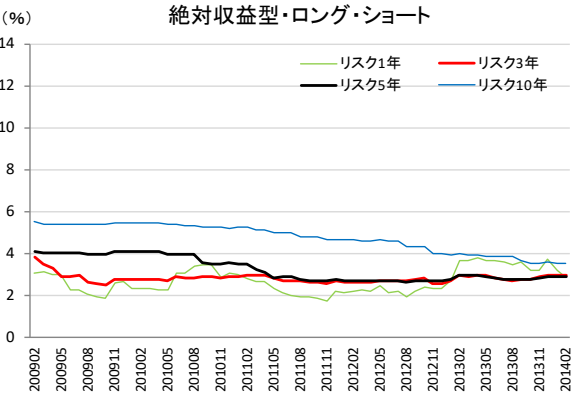


<2> リスク・サマリー

(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	-2,735	-2,141	5,945	22,698
国内株式	-250	1,323	5,137	12,496
一般	-139	152	1,136	5,738
フリー	-103	163	1,005	4,817
バリュー	-36	-11	130	920
小型	57	76	429	1,783
その他	-167	1,099	3,568	4,730
日経225	-201	873	2,741	3,054
TOPIX	43	202	688	1,455
JPX日経400	-8	14	40	40
国内債券	12	-217	440	2,550
一般	12	-217	440	2,550
外国株式(先進国)	-770	443	8,222	20,857
グローバル	-440	605	5,820	16,543
除く日本	71	542	1,482	2,884
含む日本	-511	63	4,338	13,659
その他	-330	-162	2,402	4,315
北米	4	11	30	-12
米国	-247	55	2,858	5,429
カナダ	-14	-27	-46	-104
欧州	-39	-101	-208	-322
アジア・オセアニア	-7	-18	-29	-22
オーストラリア	-25	-81	-197	-650
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	0	0	-1	-1
エマージング株式	-316	-1,003	-1,751	459
グローバル	-163	-414	-781	-253
BRICS	-8	-21	-41	-71
その他	-144	-569	-929	782
欧州	-8	-24	-46	-46
ロシア	-5	-10	-21	-41
アジア・オセアニア	-41	-171	-414	-301
中国	-18	-66	14	1,211
インド	-93	-295	-554	-550
インドネシア	-3	-16	-26	-32
タイ	-2	-5	-11	-11
フィリピン	-8	-26	-47	-46
ベトナム	44	70	243	615
韓国	0	6	6	6
香港	0	0	0	1
台湾	0	0	0	0
中南米	-4	-7	-10	-16
ブラジル	-6	-16	-55	12
メキシコ	-1	-1	-1	-5
中東・アフリカ	1	-3	-8	-11
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	-1	-3	3	-3
複合地域	0	-1	-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	-2,735	-2,141	5,945	22,698
外国債券(先進国)	-792	-2,223	-4,655	-7,947
グローバル	-603	-1,595	-3,274	-4,980
除く日本	-229	-540	-1,092	-1,485
含む日本	-374	-1,055	-2,182	-3,495
その他	-189	-629	-1,381	-2,967
北米	-2	-12	-25	-48
米国	-28	-124	-426	-1,055
カナダ	-33	-97	-196	-455
欧州	25	30	114	304
アジア・オセアニア	-50	-177	-361	-685
オーストラリア	-81	-190	-375	-784
ニュージーランド	-4	-13	-20	-44
複合地域	-16	-45	-88	-191
エマージング債券	30	-190	-879	-2,186
グローバル	-49	-166	-436	-1,110
米ドル建て	-55	-182	-439	-1,117
現地通貨建て	6	16	3	7
その他	80	-24	-443	-1,076
ロシア	-13	-32	-61	-174
アジア・オセアニア	-6	-23	-62	-112
インド	-21	-102	-282	-347
インドネシア	-4	-16	-41	-93
ブラジル	-51	-100	-300	-563
メキシコ	-15	-22	-54	-142
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	2	0	10	-1
複合地域	0	-1	-3	-7
ハイイールド債券	-317	-890	-2,428	-5,996
グローバル	-48	-146	-348	-764
北米	-201	-531	-1,564	-4,112
その他	-68	-212	-516	-1,120
欧州	-44	-140	-338	-750
アジア・オセアニア	-21	-65	-164	-351
複合地域	0	-1	-2	-5
複合資産	332	1,520	3,739	11,276
安定	-28	62	372	2,692
安定成長	57	490	1,411	4,325
成長	59	258	750	1,834
国内バランス	243	710	1,205	2,425
安定	242	709	1,225	2,433
一般	-1	0	-13	23

## &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ヵ月	6ヵ月	1年
総合	-2,735	-2,141	5,945	22,698
国内REIT	24	127	-69	-1,069
日本	24	127	-69	-1,069
外国REIT	-462	-871	-2,441	-8,305
グローバル	-184	-214	-448	-2,010
除く日本	38	124	302	432
含む日本	-221	-338	-750	-2,442
北米	-462	-904	-2,126	-5,955
その他	183	247	133	-340
欧州	-8	-19	-41	-89
アジア・オセアニア	227	339	268	-15
オーストラリア	-27	-56	-63	-177
複合地域	0	0	0	0
複数国	-10	-17	-31	-60
その他	-225	-159	629	564
絶対収益型	-173	-167	49	489
ロング・ショート	-28	-60	-103	-8
マーケットニュートラル	30	41	159	397
GTAA	-6	-10	-23	-156
その他スタイル	-170	-138	9	249
CB	-22	-66	-174	-431
アジア・オセアニア	0	-1	-6	-9
日本	0	-1	-3	-6
グローバル	-21	-64	-164	-414
コモディティ	23	23	93	236
全業種	4	15	38	67
貴金属	18	7	54	181
エネルギー	0	0	-1	-14
その他コモディティ	0	0	1	2

## &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①

	純資産額 (億円)	構成比	本数	構成比	構成比
総合	630,421	100.00%	5,485	100.00%	
国内株式	106,684	16.92%	883	16.10%	
一般	63,962	10.15%	580	10.57%	
フリー	51,550	8.18%	461	8.40%	
バリュー	12,412	1.97%	119	2.17%	
小型	10,922	1.73%	95	1.73%	
その他	31,054	4.93%	200	3.65%	
日経225	16,470	2.61%	70	1.28%	
TOPIX	12,050	1.91%	74	1.35%	
JPX日経400	835	0.13%	21	0.38%	
国内債券	33,071	5.25%	131	2.39%	
一般	33,071	5.25%	131	2.39%	
外国株式(先進国)	146,969	23.31%	964	17.58%	
グローバル	113,656	18.03%	595	10.85%	
除く日本	23,479	3.72%	169	3.08%	
含む日本	90,177	14.30%	426	7.77%	
その他	33,312	5.28%	369	6.73%	
北米	368	0.06%	17	0.31%	
米国	23,964	3.80%	240	4.38%	
カナダ	459	0.07%	3	0.05%	
欧州	1,880	0.30%	63	1.15%	
アジア・オセアニア	122	0.02%	8	0.15%	
オーストラリア	6,441	1.02%	33	0.60%	
ニュージーランド	13	0.00%	1	0.02%	
複合地域	9	0.00%	1	0.02%	
エマージング株式	35,070	5.56%	374	6.82%	
グローバル	9,670	1.53%	100	1.82%	
BRICS	711	0.11%	8	0.15%	
その他	24,690	3.92%	266	4.85%	
欧州	238	0.04%	9	0.16%	
ロシア	129	0.02%	5	0.09%	
アジア・オセアニア	7,597	1.21%	121	2.21%	
中国	2,511	0.40%	30	0.55%	
インド	11,220	1.78%	30	0.55%	
インドネシア	235	0.04%	8	0.15%	
タイ	110	0.02%	4	0.07%	
フィリピン	114	0.02%	5	0.09%	
ベトナム	1,101	0.17%	9	0.16%	
韓国	9	0.00%	2	0.04%	
香港	10	0.00%	1	0.02%	
台湾	2	0.00%	2	0.04%	
中南米	88	0.01%	2	0.04%	
ブラジル	1,064	0.17%	21	0.38%	
メキシコ	23	0.00%	3	0.05%	
中東・アフリカ	126	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	24	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	630,421	100.00%	5,485	100.00%	
外国債券(先進国)	87,655	13.90%	892	16.26%	
グローバル	63,610	10.09%	593	10.81%	
除く日本	33,838	5.37%	245	4.47%	
含む日本	29,772	4.72%	348	6.34%	
その他	24,045	3.81%	299	5.45%	
北米	103	0.02%	6	0.11%	
米国	5,737	0.91%	161	2.94%	
カナダ	1,620	0.26%	6	0.11%	
欧州	1,139	0.18%	36	0.66%	
アジア・オセアニア	2,852	0.45%	12	0.22%	
オーストラリア	10,637	1.69%	44	0.80%	
ニュージーランド	204	0.03%	14	0.26%	
複合地域	1,714	0.27%	12	0.22%	
エマージング債券	20,460	3.25%	311	5.67%	
グローバル	9,387	1.49%	199	3.63%	
米ドル建て	7,659	1.21%	158	2.88%	
現地通貨建て	1,728	0.27%	41	0.75%	
その他	11,074	1.76%	112	2.04%	
ロシア	299	0.05%	5	0.09%	
アジア・オセアニア	569	0.09%	26	0.47%	
インド	4,736	0.75%	22	0.40%	
インドネシア	636	0.10%	12	0.22%	
ブラジル	3,637	0.58%	25	0.46%	
メキシコ	588	0.09%	9	0.16%	
南アフリカ	3	0.00%	1	0.02%	
トルコ	180	0.03%	6	0.11%	
複合地域	57	0.01%	1	0.02%	
ハイイールド債券	25,361	4.02%	317	5.78%	
グローバル	3,900	0.62%	58	1.06%	
北米	16,492	2.62%	168	3.06%	
その他	4,969	0.79%	91	1.66%	
欧州	3,925	0.62%	51	0.93%	
アジア・オセアニア	906	0.14%	34	0.62%	
複合地域	51	0.01%	1	0.02%	
複合資産	88,226	13.99%	953	17.37%	
安定	27,679	4.39%	290	5.29%	
安定成長	40,830	6.48%	403	7.35%	
成長	12,033	1.91%	226	4.12%	
国内バランス	7,684	1.22%	34	0.62%	
安定	7,061	1.12%	10	0.18%	
一般	495	0.08%	18	0.33%	

## &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③

	純資産額 (億円)	構成比	本数	構成比
総合	630,421	100.0%	5,485	100.0%
国内REIT	26,227	4.2%	124	2.3%
日本	26,227	4.2%	124	2.3%
外国REIT	48,412	7.7%	304	5.5%
グローバル	18,552	2.9%	135	2.5%
除く日本	3,207	0.5%	44	0.8%
含む日本	15,345	2.4%	91	1.7%
北米	24,864	3.9%	95	1.7%
その他	4,995	0.8%	74	1.3%
欧州	322	0.1%	20	0.4%
アジア・オセアニア	3,499	0.6%	34	0.6%
オーストラリア	799	0.1%	15	0.3%
複合地域	51	0.0%	3	0.1%
複数国	325	0.1%	2	0.0%
その他	12,288	1.9%	232	4.2%
絶対収益型	6,761	1.1%	95	1.7%
ロング・ショート	1,144	0.2%	30	0.5%
マーケットニュートラル	829	0.1%	12	0.2%
GTAA	462	0.1%	15	0.3%
その他スタイル	4,326	0.7%	38	0.7%
CB	1,736	0.3%	59	1.1%
アジア・オセアニア	42	0.0%	1	0.0%
日本	74	0.0%	3	0.1%
グローバル	1,616	0.3%	52	0.9%
コモディティ	1,635	0.3%	32	0.6%
全業種	870	0.1%	14	0.3%
貴金属	736	0.1%	16	0.3%
エネルギー	22	0.0%	1	0.0%
その他コモディティ	8	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	11,291	7.7	4.30	4.75	1.320
国内株式	13,788	10.7	1.75	2.36	1.191
一般	12,705	10.3	2.43	3.36	1.428
フリー	12,329	9.8	2.80	3.92	1.474
バリュー	14,161	12.4	0.76	0.89	1.234
小型	19,328	11.1	1.29	1.53	1.715
その他	14,454	11.4	0.51	0.55	0.509
日経225	14,731	12.9	0.51	0.52	0.590
TOPIX	15,218	12.8	0.36	0.40	0.343
JPX日経400	12,856	4.6	0.49	0.54	0.556
国内債券	11,109	10.1	0.36	0.37	0.356
一般	11,109	10.1	0.36	0.37	0.356
外国株式(先進国)	12,193	6.3	4.30	4.87	1.616
グローバル	12,853	6.8	3.09	3.40	1.591
除く日本	15,369	8.7	1.07	1.20	0.828
含む日本	11,854	6.0	3.65	4.02	1.790
その他	11,129	5.4	8.40	9.77	1.700
北米	10,700	5.7	4.38	4.23	1.869
米国	11,791	4.9	6.44	6.78	1.667
カナダ	6,756	7.0	22.74	29.94	1.967
欧州	10,545	7.6	4.07	4.96	1.713
アジア・オセアニア	9,557	4.9	6.92	8.53	1.682
オーストラリア	8,788	4.5	15.75	20.64	1.794
ニュージーランド	13,231	6.6	3.84	3.78	1.642
複合地域	8,238	5.8	1.11	1.21	1.674
エマージング株式	11,914	8.1	3.39	4.37	1.818
グローバル	11,112	6.0	2.62	3.29	1.590
BRICS	13,363	11.2	0.95	1.03	2.033
その他	12,172	8.8	3.76	4.90	1.901
欧州	8,658	12.9	0.18	0.19	1.968
ロシア	8,936	10.0	0.45	0.47	1.967
アジア・オセアニア	12,731	8.9	9.00	11.66	1.699
中国	17,461	9.0	0.74	0.88	1.935
インド	11,394	9.1	1.14	1.30	2.043
インドネシア	11,075	7.7	0.28	0.30	1.823
タイ	11,926	10.8	0.54	0.60	1.688
フィリピン	11,431	5.5	0.38	0.40	1.764
ベトナム	12,547	3.5	1.20	1.47	1.841
韓国	11,017	4.8	3.05	3.55	1.774
香港	16,258	9.5	1.81	1.91	0.842
台湾	13,288	7.8	0.93	1.08	1.699
中南米	8,480	12.1	0.00	0.00	2.003
ブラジル	7,260	8.8	8.47	13.71	1.838
メキシコ	8,235	5.2	0.00	0.00	1.880
中東・アフリカ	10,159	9.5	0.51	0.60	2.090
南アフリカ	9,310	8.6	0.00	0.00	1.577
トルコ	6,760	12.6	0.00	0.00	2.010
複合地域	18,157	10.8	2.66	2.91	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	11,291	7.7	4.30	4.75	1.320
外国債券(先進国)	9,652	7.2	3.25	3.48	1.145
グローバル	10,069	7.4	2.20	2.31	1.097
除く日本	10,642	9.8	2.23	2.32	0.882
含む日本	9,666	5.6	2.17	2.29	1.341
その他	8,826	6.9	6.05	6.58	1.271
北米	10,040	4.8	2.02	2.06	1.809
米国	9,420	5.6	4.36	4.62	1.316
カナダ	7,581	6.6	7.54	7.98	1.341
欧州	8,223	9.9	1.97	1.94	1.081
アジア・オセアニア	7,929	8.3	4.93	5.35	1.399
オーストラリア	8,107	9.5	7.58	8.45	1.232
ニュージーランド	9,516	4.4	3.31	3.36	1.319
複合地域	5,799	9.2	5.64	5.92	1.176
エマージング債券	8,664	7.6	8.16	9.56	1.589
グローバル	8,938	8.4	7.41	8.85	1.583
米ドル建て	9,007	8.7	7.87	9.42	1.622
現地通貨建て	8,671	7.2	5.38	6.31	1.410
その他	8,179	6.3	8.82	10.19	1.594
ロシア	7,936	6.0	5.36	6.43	1.589
アジア・オセアニア	8,328	6.4	11.68	13.24	1.618
インド	8,982	4.3	8.83	10.09	1.674
インドネシア	7,369	6.6	6.37	7.01	1.651
ブラジル	9,285	9.1	8.96	10.54	1.562
メキシコ	6,312	6.2	10.01	10.82	1.373
南アフリカ	7,527	6.8	5.96	7.17	1.404
トルコ	3,595	6.1	8.77	13.88	1.428
複合地域	4,248	12.5	5.33	5.65	1.188
ハイイールド債券	8,713	7.8	9.24	10.41	1.678
グローバル	7,263	7.9	8.11	9.36	1.596
北米	9,598	8.8	8.90	9.66	1.676
その他	8,003	6.1	11.25	13.69	1.749
欧州	7,619	5.8	11.68	14.38	1.730
アジア・オセアニア	8,478	6.8	10.64	12.35	1.849
複合地域	4,550	14.9	5.07	5.27	1.780
複合資産	11,462	7.5	1.58	1.71	1.121
安定	10,863	7.0	0.73	0.80	1.190
安定成長	11,112	7.9	2.43	2.63	1.136
成長	12,949	7.8	0.23	0.28	1.022
国内バランス	10,855	7.1	2.25	2.31	0.950
安定	10,545	7.9	2.36	2.42	0.916
一般	11,202	8.3	1.04	1.11	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	11,291	7.7	4.30	4.75	1.320
国内REIT	13,011	7.3	10.04	10.55	0.960
日本	13,011	7.3	10.04	10.55	0.960
外国REIT	10,629	6.2	13.55	13.63	1.554
グローバル	11,339	7.2	11.38	11.62	1.424
除く日本	13,512	6.0	3.67	3.94	1.073
含む日本	10,289	7.8	12.99	13.22	1.497
北米	9,787	5.9	15.68	15.53	1.602
その他	10,413	4.8	11.05	11.60	1.800
欧州	8,910	4.5	6.02	6.87	1.837
アジア・オセアニア	11,897	4.8	13.50	14.22	1.852
オーストラリア	9,566	4.0	6.22	6.31	1.690
複合地域	7,448	7.1	1.40	1.44	0.840
複数国	11,007	11.9	3.10	2.66	1.627
その他					
絶対収益型	10,029	5.4	0.20	0.22	1.625
ロング・ショート	10,008	5.9	0.47	0.51	1.632
マーケットニュートラル	10,573	4.1	0.43	0.49	1.202
GTAA	10,440	6.9	0.76	0.84	1.628
その他スタイル	9,710	4.9	0.02	0.02	1.704
CB	10,523	6.0	1.22	1.34	1.491
アジア・オセアニア	8,352	8.7	3.74	3.83	1.804
日本	11,065	7.8	0.17	0.18	1.052
グローバル	10,771	5.9	1.18	1.30	1.502
コモディティ	8,060	6.6	0.01	0.01	0.950
全業種	6,172	7.5	0.00	0.00	1.240
貴金属	9,417	5.8	0.02	0.03	0.609
エネルギー	9,334	10.0	0.00	0.00	1.059
その他コモディティ	11,517	2.4	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