

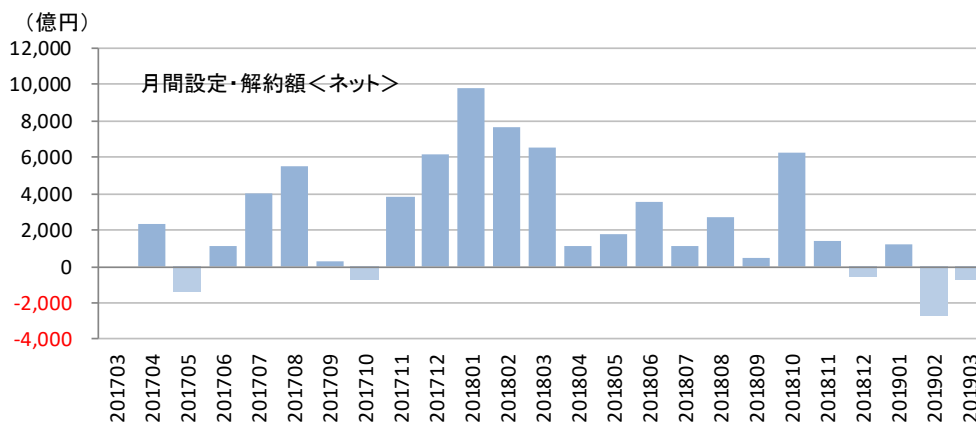
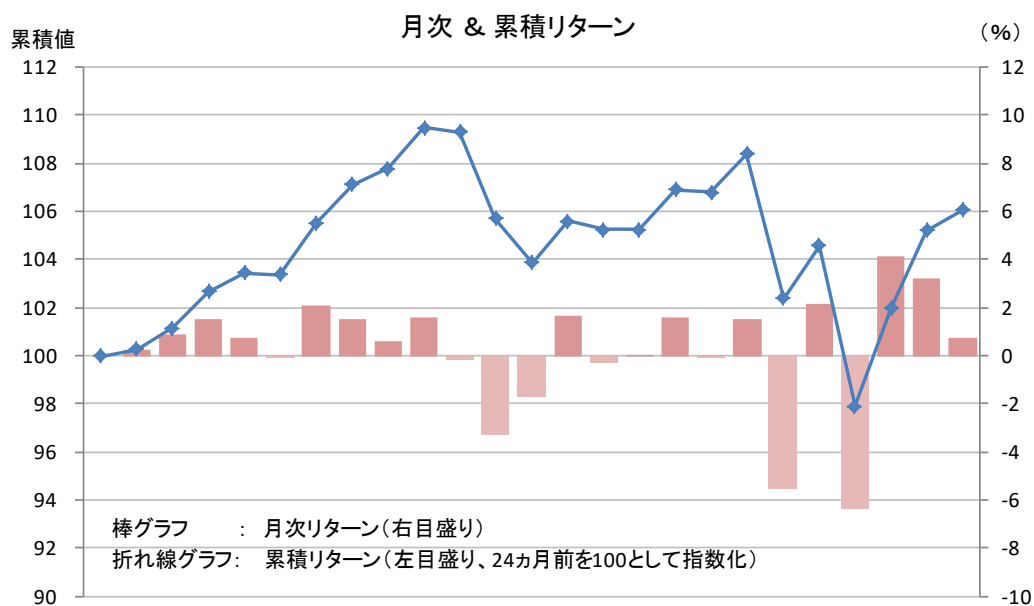
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2019年3月

「総合」 +0.78 %
(前月 +3.22 %)



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		12,685	12,587	98	0.78
国内株式		15,014	15,025	-12	-0.08
一般		14,673	14,703	-30	-0.20
フリー		13,785	13,804	-19	-0.14
バリュー		18,899	18,993	-94	-0.49
小型		32,198	31,961	237	0.74
その他		14,603	14,619	-16	-0.11
日経225		13,783	13,795	-11	-0.08
TOPIX		14,664	14,656	8	0.06
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	13,812	13,764	48	0.35
国内債券		13,297	13,205	92	0.69
一般		13,297	13,205	92	0.69
外国株式(先進国)		13,981	13,960	21	0.15
グローバル		15,395	15,388	7	0.04
除く日本		21,614	21,567	47	0.22
含む日本		14,013	14,013	-0	-0.00
その他		11,096	11,041	56	0.50
北米		11,195	11,222	-27	-0.24
米国		16,343	16,271	72	0.44
カナダ	10,000 (2009.02.27)	16,307	16,602	-294	-1.77
欧州		17,088	17,080	8	0.04
ドイツ	8,368 (2014.04.01)	8,084	8,232	-148	-1.80
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	33,094	32,983	111	0.34
オーストラリア	12,670 (2008.07.01)	15,327	15,162	165	1.09
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	33,458	32,116	1,342	4.18
複合地域	10,000 (2013.04.30)	9,131	8,993	138	1.53
エマージング株式		14,467	14,098	370	2.62
グローバル		13,837	13,805	32	0.23
BRICS	10,000 (2005.09.30)	22,431	22,292	139	0.63
その他		15,185	14,655	530	3.61
欧州		23,544	23,673	-129	-0.54
ロシア	10,000 (2007.03.30)	9,153	9,077	76	0.84
アジア・オセアニア		15,518	15,521	-4	-0.02
中国		31,769	31,016	753	2.43
インド	10,000 (2004.09.30)	32,732	30,145	2,588	8.58
インドネシア	7,330 (2009.12.01)	14,426	14,688	-262	-1.78
タイ		23,366	24,036	-671	-2.79
フィリピン	3,209 (2010.06.01)	8,276	8,437	-162	-1.92
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	15,329	15,655	-326	-2.08
韓国	10,000 (1997.06.30)	22,106	22,826	-721	-3.16
香港		23,917	23,882	35	0.15
台湾	10,000 (2008.03.31)	15,069	15,140	-70	-0.47
中南米	7,448 (2006.05.01)	8,153	8,670	-516	-5.95
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,302	10,022	-720	-7.18
メキシコ	10,514 (2013.03.01)	9,053	9,260	-207	-2.23
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	9,278	9,408	-130	-1.38
南アフリカ	10,000 (2010.06.30)	6,148	6,582	-434	-6.60
トルコ		19,906	22,966	-3,060	-13.32
複合地域	10,000 (2005.08.31)	20,303	20,472	-169	-0.82

※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		12,685	12,587	98	0.78
外国債券(先進国)		17,556	17,418	138	0.79
グローバル		17,793	17,634	159	0.90
除く日本		18,997	18,808	189	1.00
含む日本		17,142	17,008	134	0.79
その他		16,857	16,772	85	0.51
北米	9,017 (2013.06.03)	10,226	10,127	99	0.98
米国		15,430	15,288	143	0.93
カナダ	10,000 (2003.05.30)	13,865	13,955	-90	-0.64
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,266	15,182	84	0.55
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	18,716	18,628	88	0.47
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	23,009	22,909	100	0.44
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,169	11,063	106	0.96
複合地域	10,000 (2001.11.30)	16,419	16,328	92	0.56
エマージング債券		16,792	16,870	-78	-0.46
グローバル		17,954	18,216	-262	-1.44
米ドル建て		18,570	18,820	-250	-1.33
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,348	12,589	-241	-1.92
その他	8,652 (2005.04.01)	12,455	12,410	45	0.36
ロシア	10,000 (2008.05.30)	10,261	10,025	236	2.36
アジア・オセアニア	8,652 (2005.04.01)	13,976	13,787	189	1.37
インド	10,000 (2011.08.31)	15,695	15,065	629	4.18
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	12,792	12,831	-39	-0.31
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	12,694	13,226	-532	-4.02
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	11,199	11,097	102	0.92
南アフリカ	10,000 (2010.03.31)	10,535	11,052	-517	-4.67
トルコ	10,000 (2011.04.28)	4,686	5,549	-863	-15.55
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,657	10,722	-65	-0.61
ハイイールド債券		21,256	21,424	-167	-0.78
グローバル	10,000 (1997.06.30)	21,605	21,845	-240	-1.10
北米		20,595	20,719	-123	-0.60
その他	10,000 (2004.03.31)	21,463	21,713	-250	-1.15
欧州	10,000 (2006.04.28)	21,439	21,833	-394	-1.80
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,224	14,018	206	1.47
複合地域	10,000 (2004.03.31)	18,872	18,847	25	0.13
複合資産		16,802	16,692	110	0.66
安定	10,000 (1998.10.30)	15,154	15,036	119	0.79
安定成長		17,947	17,829	118	0.66
成長		19,723	19,647	76	0.39
国内バランス		13,054	12,975	78	0.60
安定		14,033	13,947	87	0.62
一般		13,795	13,730	65	0.47

※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		12,685	12,587	98	0.78	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	30,812	29,873	938	3.14	
日本	10,000 (2003.10.31)	30,812	29,873	938	3.14	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	26,182	25,244	938	3.72	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	23,033	22,337	696	3.12	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	24,641	23,841	800	3.35	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	23,175	22,486	689	3.07	
北米	10,000 (2003.09.30)	25,827	24,816	1,011	4.07	
その他	10,000 (2004.04.30)	26,987	25,908	1,079	4.17	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,578	5,515	63	1.15	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	20,077	19,288	788	4.09	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	15,282	14,418	864	5.99	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,088	7,065	23	0.33	
複数国	10,000 (2004.04.30)	34,127	32,724	1,404	4.29	
その他		5,667	5,670	-2	-0.04	
絶対収益型		7,556	7,530	26	0.34	
ロング・ショート		8,859	8,750	110	1.25	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	8,968	8,937	31	0.35	
GTAA		10,535	10,416	119	1.14	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,181	7,180	1	0.02	
CB		18,305	18,358	-53	-0.29	
欧州	8,044 (2014.04.01)	6,366	6,678	-313	-4.68	
アジア・オセアニア	13,897 (2007.11.01)	15,421	15,379	42	0.27	
日本		19,929	20,140	-212	-1.05	
グローバル		32,060	32,142	-82	-0.25	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	7,614	7,663	-49	-0.64	
全業種	10,000 (2004.12.30)	6,706	6,654	52	0.78	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	13,291	13,607	-316	-2.32	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	4,906	4,834	73	1.50	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	10,349	10,426	-77	-0.74	

※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	8.32	-2.16	2.09	8.32
国内株式	8.36	-12.76	-8.17	8.36
一般	8.46	-13.06	-9.63	8.46
フリー	9.08	-13.08	-9.83	9.08
バリュー	5.95	-12.93	-8.73	5.95
小型	11.75	-13.84	-11.82	11.75
その他	6.95	-11.44	-2.88	6.95
日経225	6.68	-11.18	0.35	6.68
TOPIX	7.64	-11.39	-5.36	7.64
JPX日経400	7.90	-10.87	-4.88	7.90
国内債券	1.31	2.30	1.50	1.31
一般	1.31	2.30	1.50	1.31
外国株式(先進国)	14.51	-4.15	5.50	14.51
グローバル	14.75	-4.11	4.92	14.75
除く日本	13.38	-5.30	6.56	13.38
含む日本	15.10	-3.80	4.52	15.10
その他	13.71	-4.29	7.42	13.71
北米	15.82	-6.52	8.94	15.82
米国	14.74	-4.39	11.03	14.74
カナダ	10.97	-6.61	1.99	10.97
欧州	11.93	-8.12	-2.87	11.93
ドイツ	7.76	-13.68	-11.30	7.76
アジア・オセアニア	9.22	-1.59	2.28	9.22
オーストラリア	10.80	-2.74	1.99	10.80
ニュージーランド	12.39	5.48	11.80	12.39
複合地域	12.87	-17.03	-6.05	12.87
エマージング株式	9.57	2.22	-2.18	9.57
グローバル	12.94	0.25	-3.44	12.94
BRICS	12.56	4.89	0.19	12.56
その他	8.24	2.92	-1.74	8.24
欧州	9.07	0.62	-7.30	9.07
ロシア	11.97	-1.24	3.01	11.97
アジア・オセアニア	11.10	-1.72	-3.39	11.10
中国	23.54	6.08	-4.73	23.54
インド	4.17	5.48	1.44	4.17
インドネシア	5.38	11.99	3.55	5.38
タイ	5.97	-8.30	-8.42	5.97
フィリピン	5.04	6.71	0.51	5.04
ベトナム	6.37	-10.01	-17.98	6.37
韓国	0.03	-16.64	-17.64	0.03
香港	12.83	1.17	2.18	12.83
台湾	5.87	-9.24	-12.13	5.87
中南米	6.77	3.49	-5.49	6.77
ブラジル	7.62	19.85	-2.97	7.62
メキシコ	4.89	-17.36	-8.39	4.89
中東・アフリカ	6.25	-1.88	-6.06	6.25
南アフリカ	5.15	-7.57	-15.28	5.15
トルコ	-2.09	-1.31	-37.80	-2.09
複合地域	8.99	-1.88	-3.71	8.99

<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	8.32	-2.16	2.09	8.32
外国債券(先進国)	2.83	0.99	1.93	2.83
グローバル	2.68	1.29	1.82	2.68
除く日本	2.57	0.93	2.12	2.57
含む日本	2.80	1.68	1.51	2.80
その他	3.24	0.22	2.16	3.24
北米	1.70	0.53	1.16	1.70
米国	3.63	0.94	4.81	3.63
カナダ	3.73	-1.75	3.31	3.73
欧州	1.68	-0.91	-0.83	1.68
アジア・オセアニア	3.37	0.31	1.17	3.37
オーストラリア	3.23	-0.08	0.81	3.23
ニュージーランド	4.09	4.51	4.13	4.09
複合地域	2.32	1.55	3.44	2.32
エマージング債券	3.93	5.48	-2.00	3.93
グローバル	4.60	3.33	-3.58	4.60
米ドル建て	4.95	3.50	-2.92	4.95
現地通貨建て	3.06	2.59	-6.63	3.06
その他	3.35	7.33	-0.64	3.35
ロシア	10.97	4.64	-3.82	10.97
アジア・オセアニア	4.32	3.67	4.61	4.32
インド	4.00	8.17	3.87	4.00
インドネシア	4.75	8.13	-0.96	4.75
ブラジル	1.50	8.61	-5.34	1.50
メキシコ	6.79	-2.19	1.09	6.79
南アフリカ	2.12	-1.10	-15.15	2.12
トルコ	-9.37	10.86	-34.52	-9.37
複合地域	4.27	0.12	-2.49	4.27
ハイイールド債券	6.18	-0.22	1.88	6.18
グローバル	5.04	0.17	-0.67	5.04
北米	7.02	-0.84	4.03	7.02
その他	4.32	1.58	-2.77	4.32
欧州	3.68	1.05	-4.21	3.68
アジア・オセアニア	6.84	4.27	2.62	6.84
複合地域	3.85	-2.07	2.67	3.85
複合資産	5.17	-1.44	1.44	5.17
安定	4.12	-0.69	0.80	4.12
安定成長	5.69	-1.26	2.12	5.69
成長	7.62	-4.69	1.10	7.62
国内バランス	2.58	0.29	0.57	2.58
安定	2.37	0.89	0.90	2.37
一般	5.23	-5.45	-3.41	5.23

<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

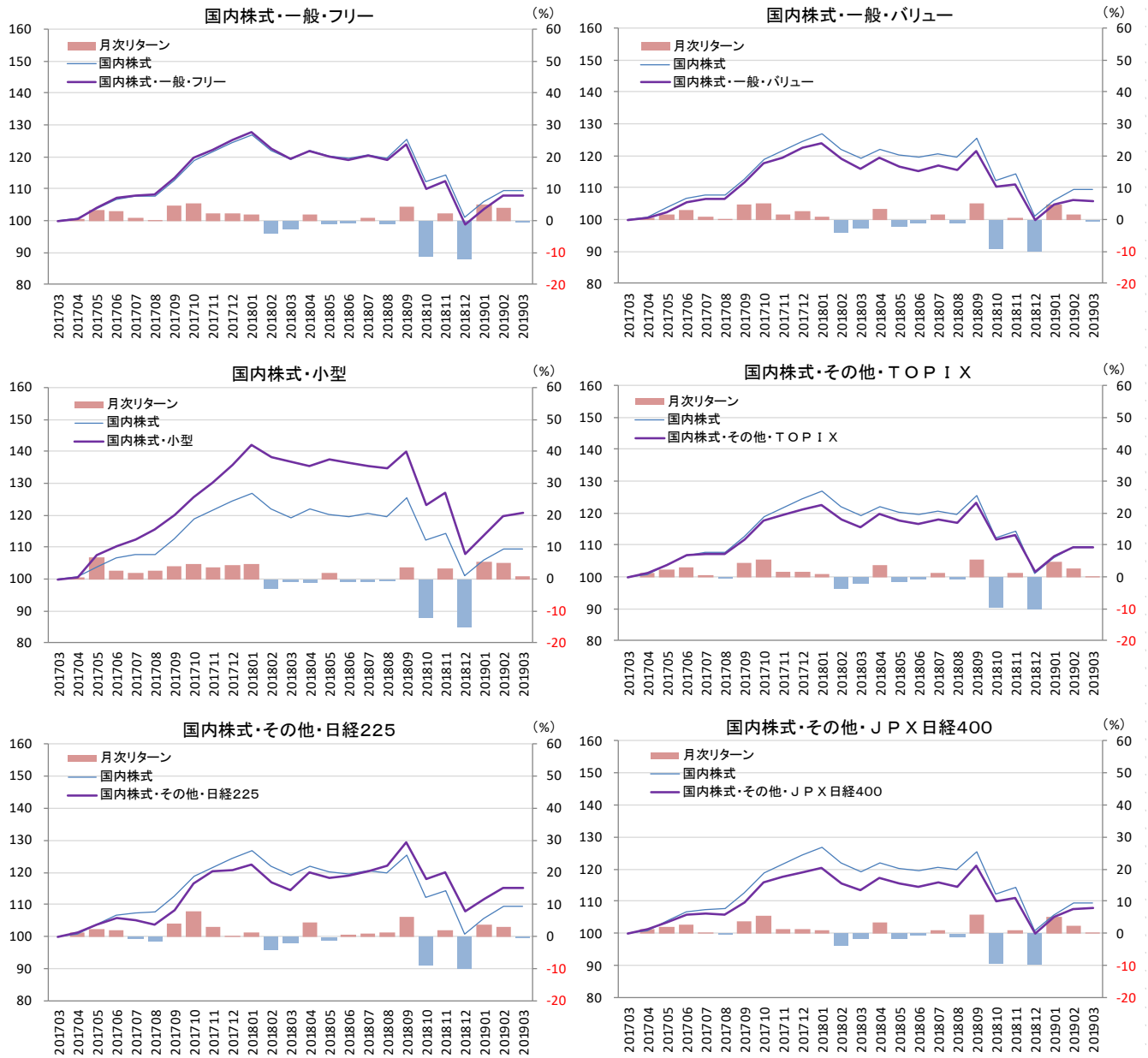
	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	8.32	-2.16	2.09	8.32
国内REIT	8.72	8.98	16.30	8.72
日本	8.72	8.98	16.30	8.72
外国REIT	15.28	6.94	19.30	15.28
グローバル	14.05	5.19	16.70	14.05
除く日本	14.90	5.73	17.94	14.90
含む日本	13.88	5.08	16.48	13.88
北米	16.57	7.88	21.84	16.57
その他	13.29	8.82	15.84	13.29
欧州	10.24	-5.80	-3.12	10.24
アジア・オセアニア	14.03	11.38	17.14	14.03
オーストラリア	11.17	6.71	18.57	11.17
複合地域	11.01	-2.48	-2.79	11.01
複数国	14.70	8.91	23.21	14.70
その他	4.22	-6.63	-2.48	4.22
絶対収益型	1.10	-1.01	-2.78	1.10
ロング・ショート	2.61	1.54	-2.51	2.61
マーケットニュートラル	-0.15	-1.65	-0.77	-0.15
GTAA	3.23	1.87	-0.55	3.23
その他スタイル	0.71	-1.84	-3.29	0.71
CB	4.30	-1.80	-0.61	4.30
欧州	0.66	3.56	-12.22	0.66
アジア・オセアニア	7.27	6.48	2.66	7.27
日本	0.04	-6.38	-2.85	0.04
グローバル	4.44	-1.79	-0.54	4.44
コモディティ	4.47	-1.31	-0.99	4.47
全業種	7.36	-6.43	0.39	7.36
貴金属	0.69	6.47	-3.92	0.69
エネルギー	25.14	-18.17	2.60	25.14
その他コモディティ	6.04	-6.09	1.70	6.04

<1>パフォーマンス・サマリー

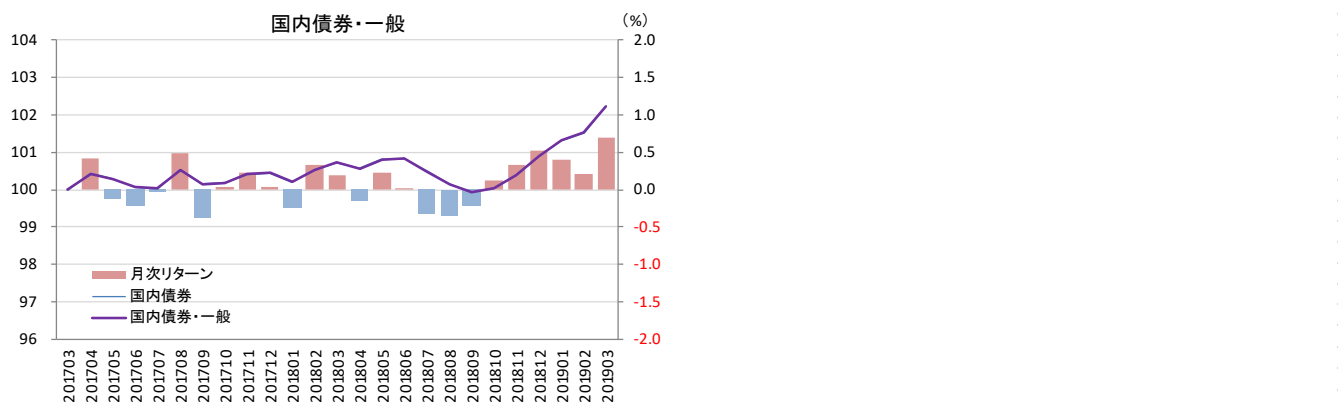
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

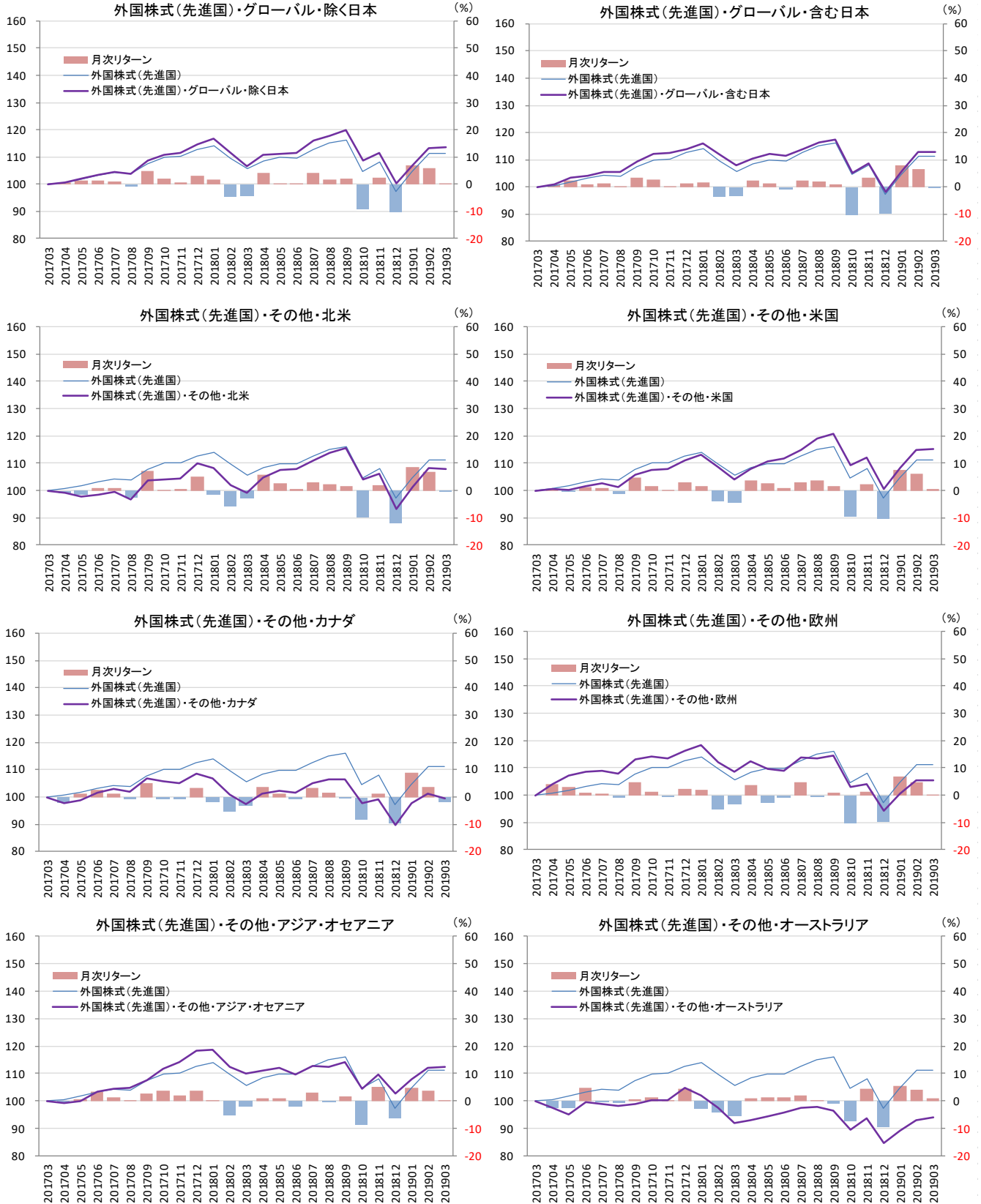


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

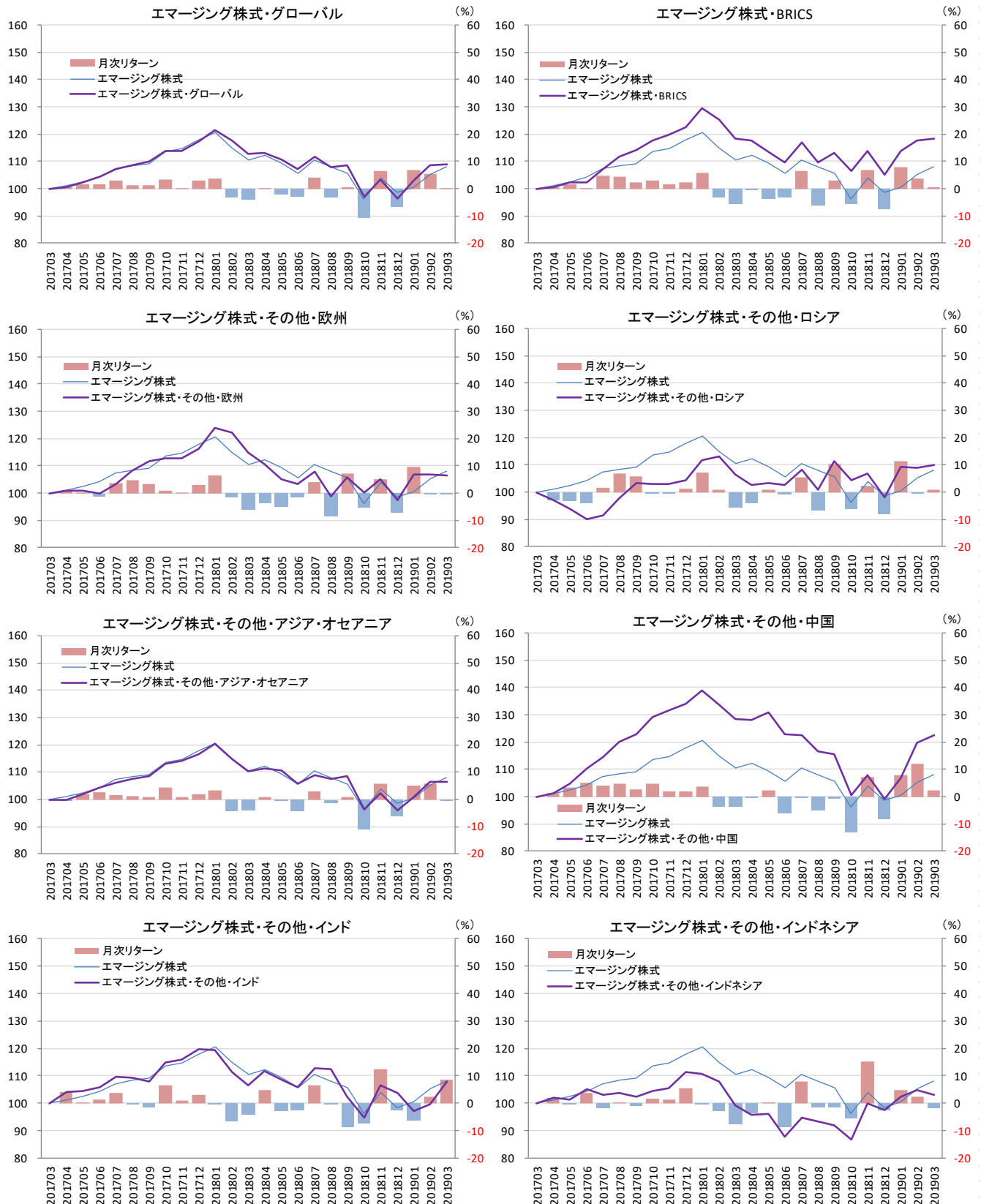


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

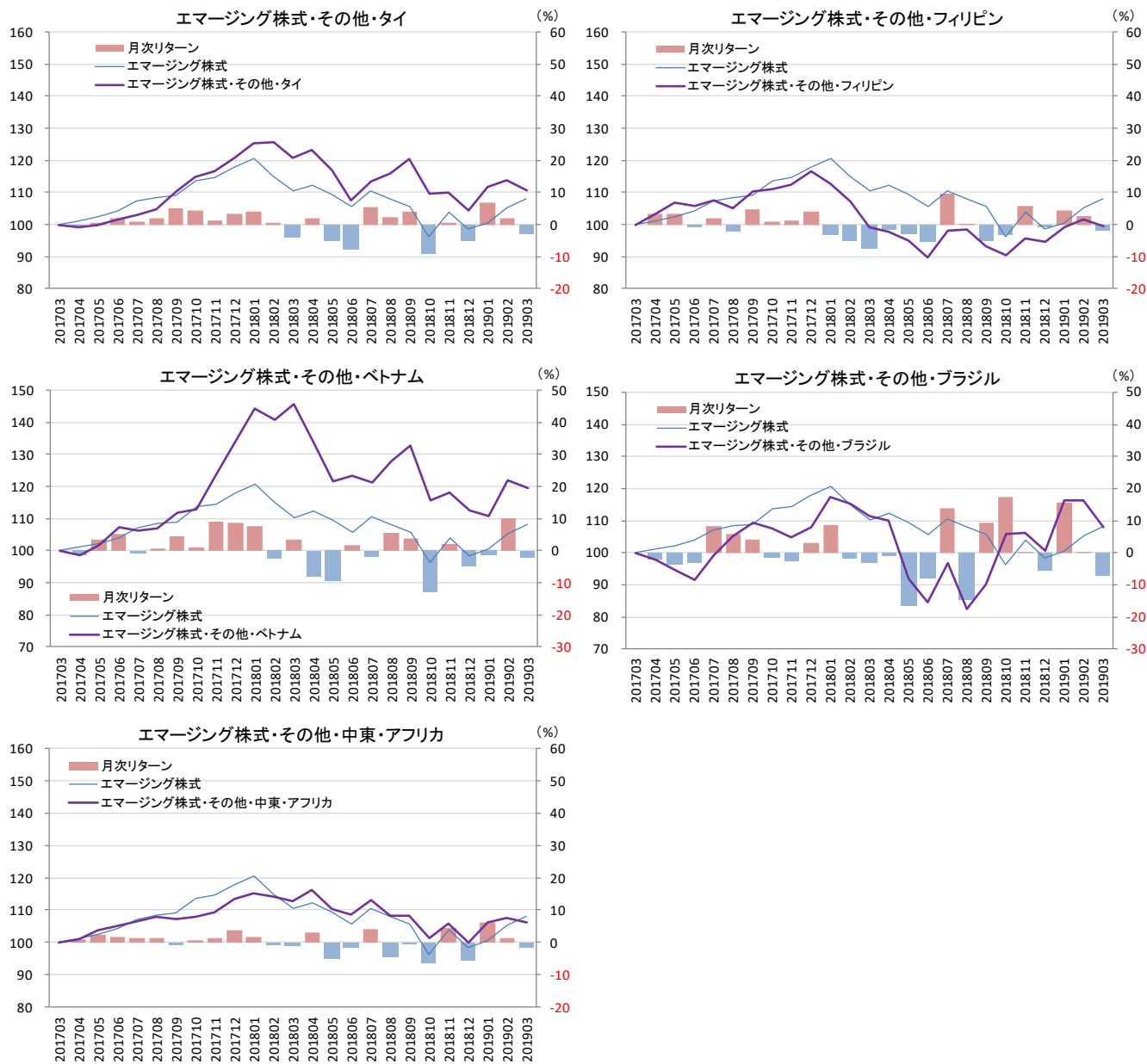


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

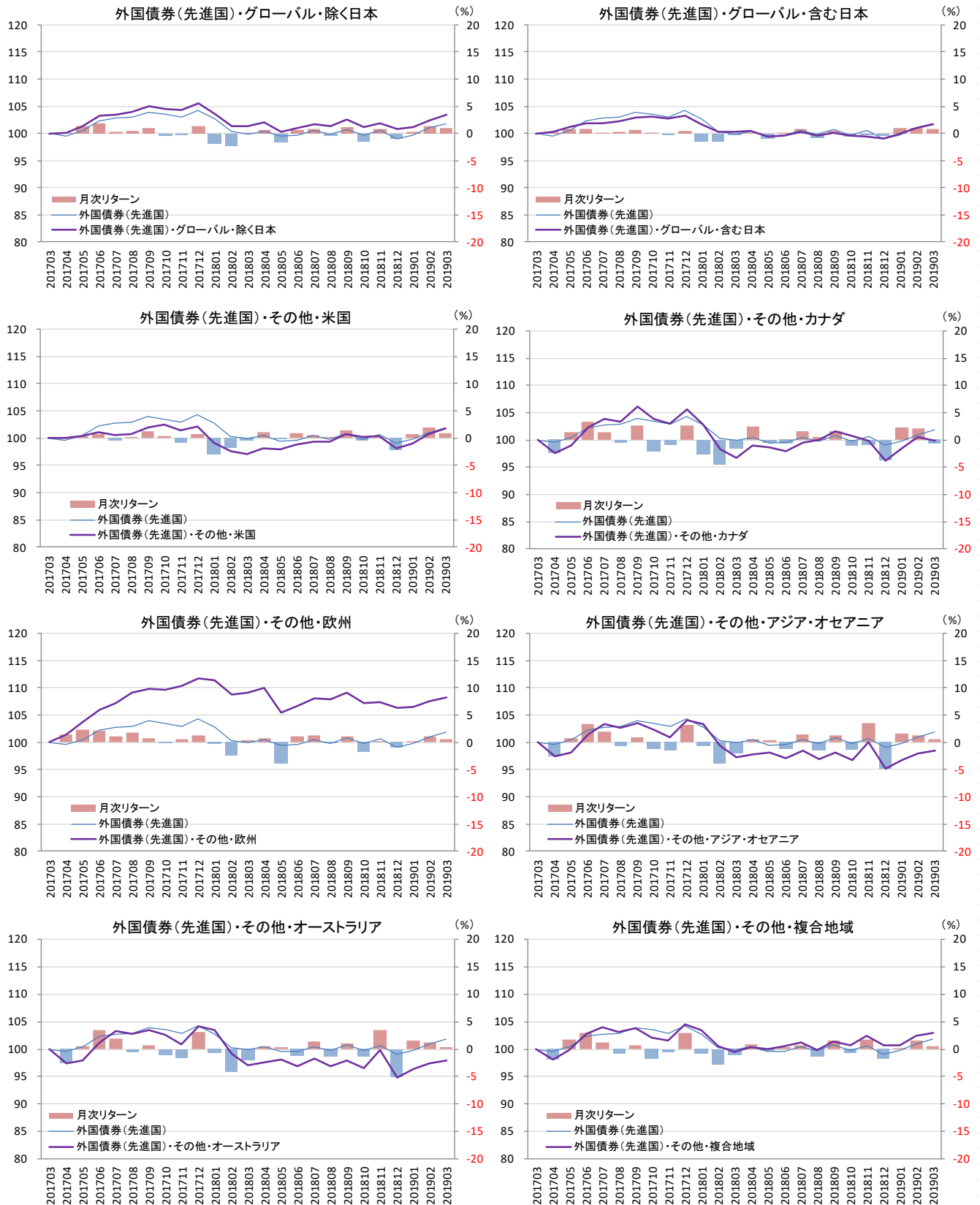


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

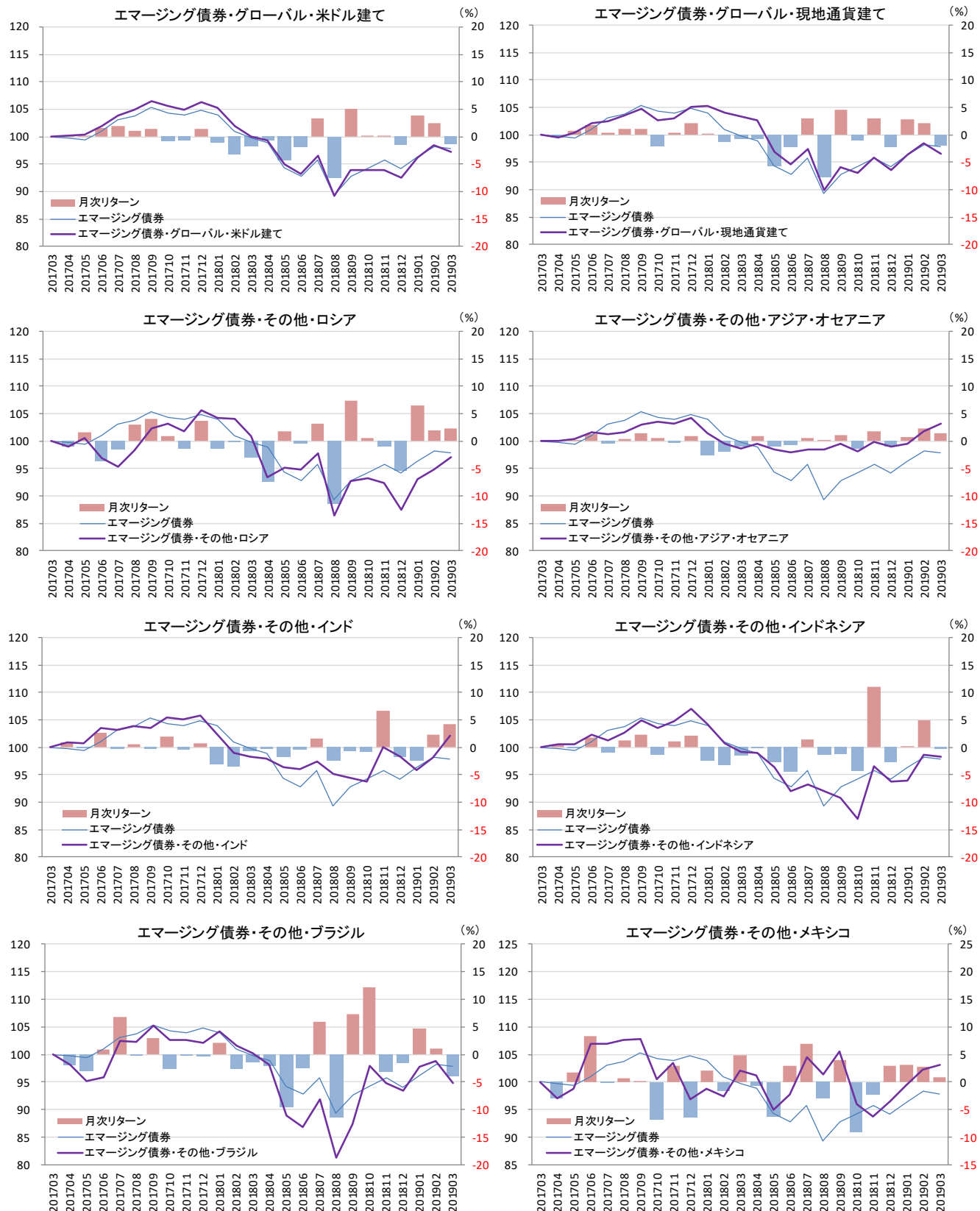


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

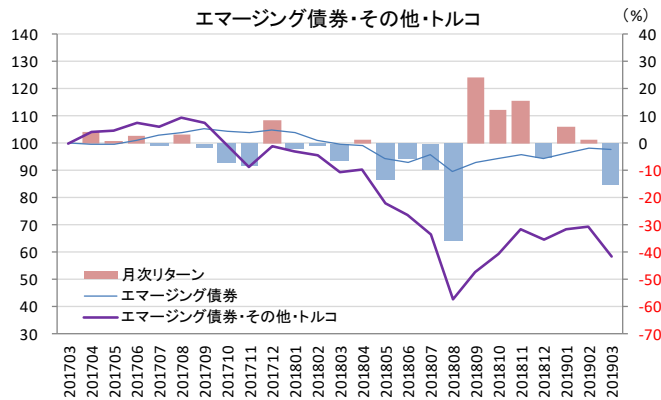


<1>パフォーマンス・サマリー

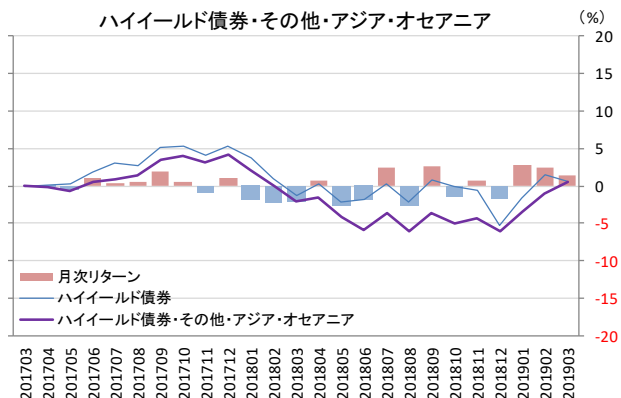
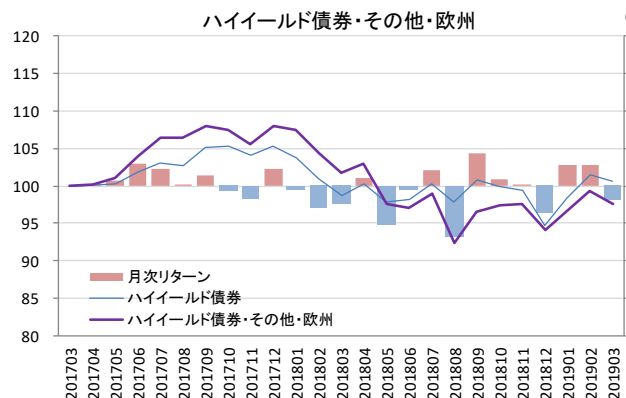
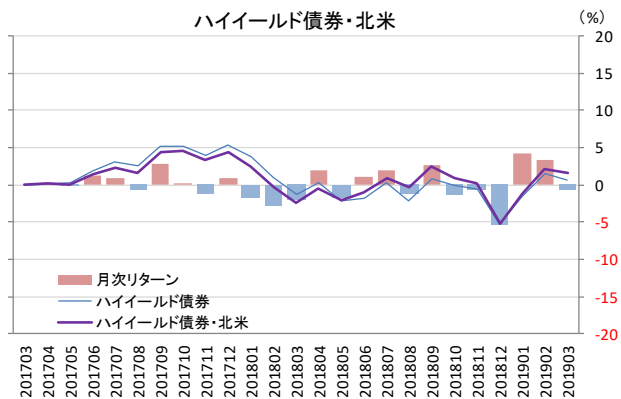
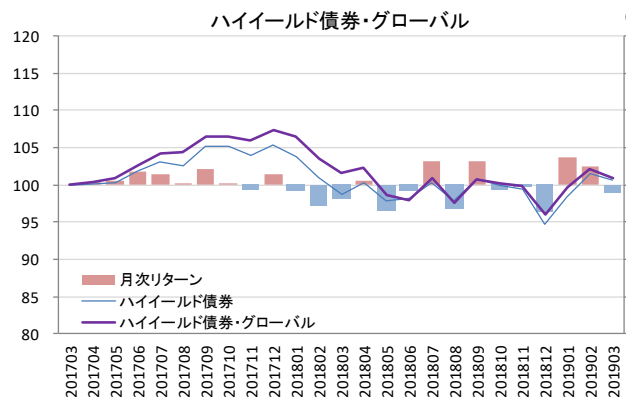
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

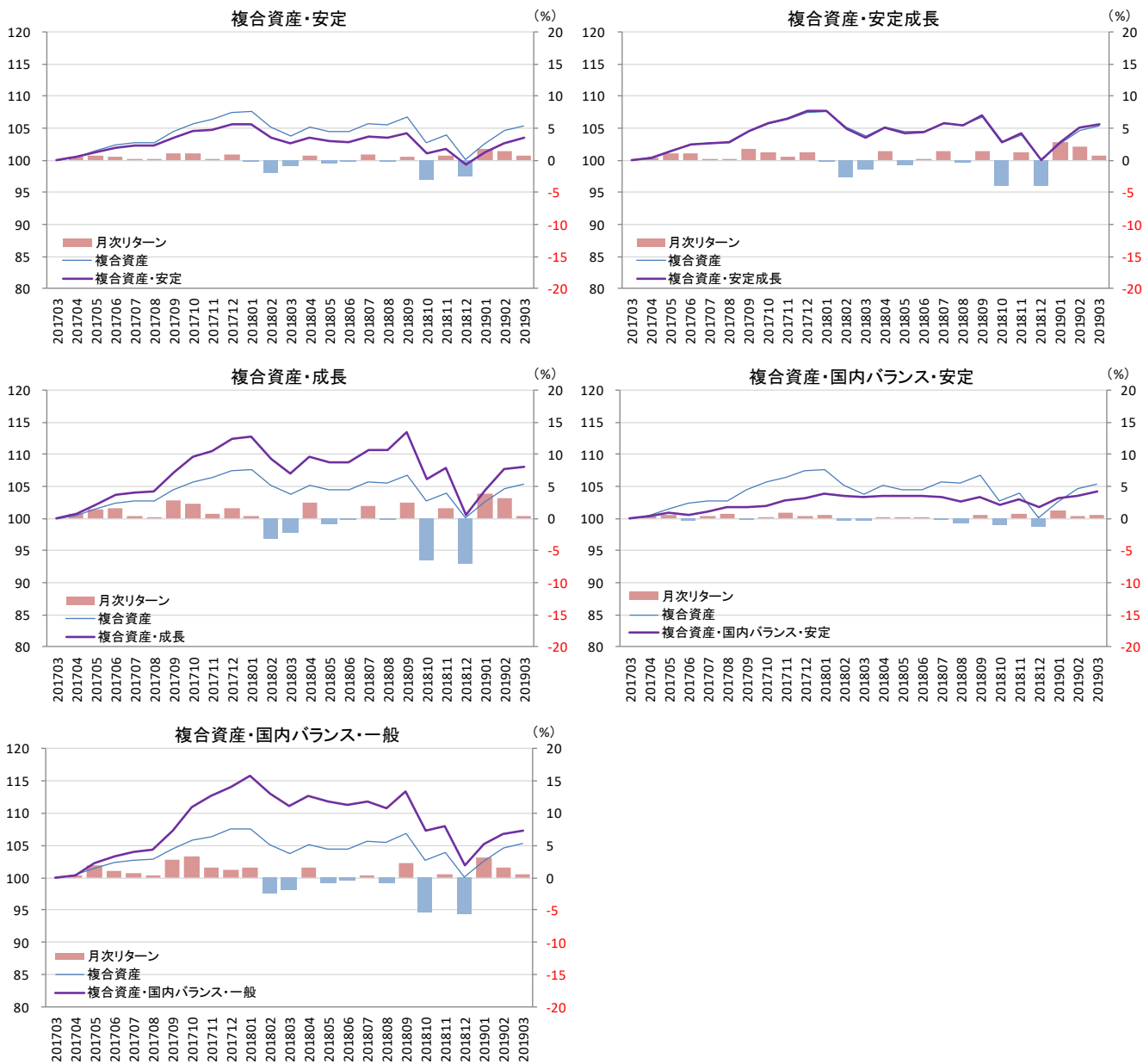


<1>パフォーマンス・サマリー

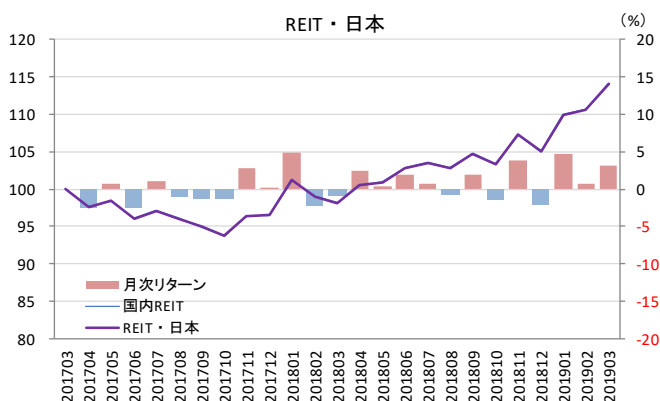
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

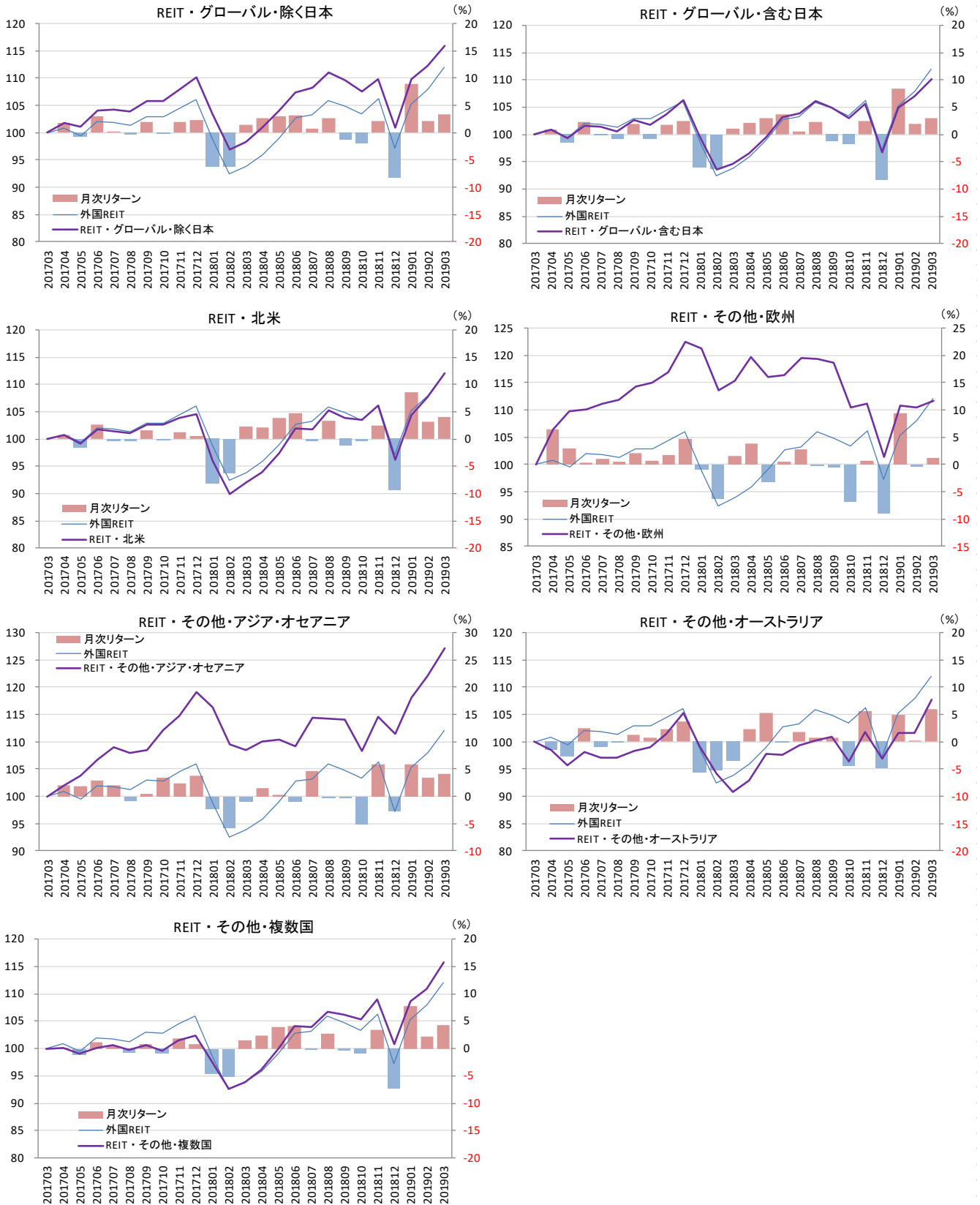


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

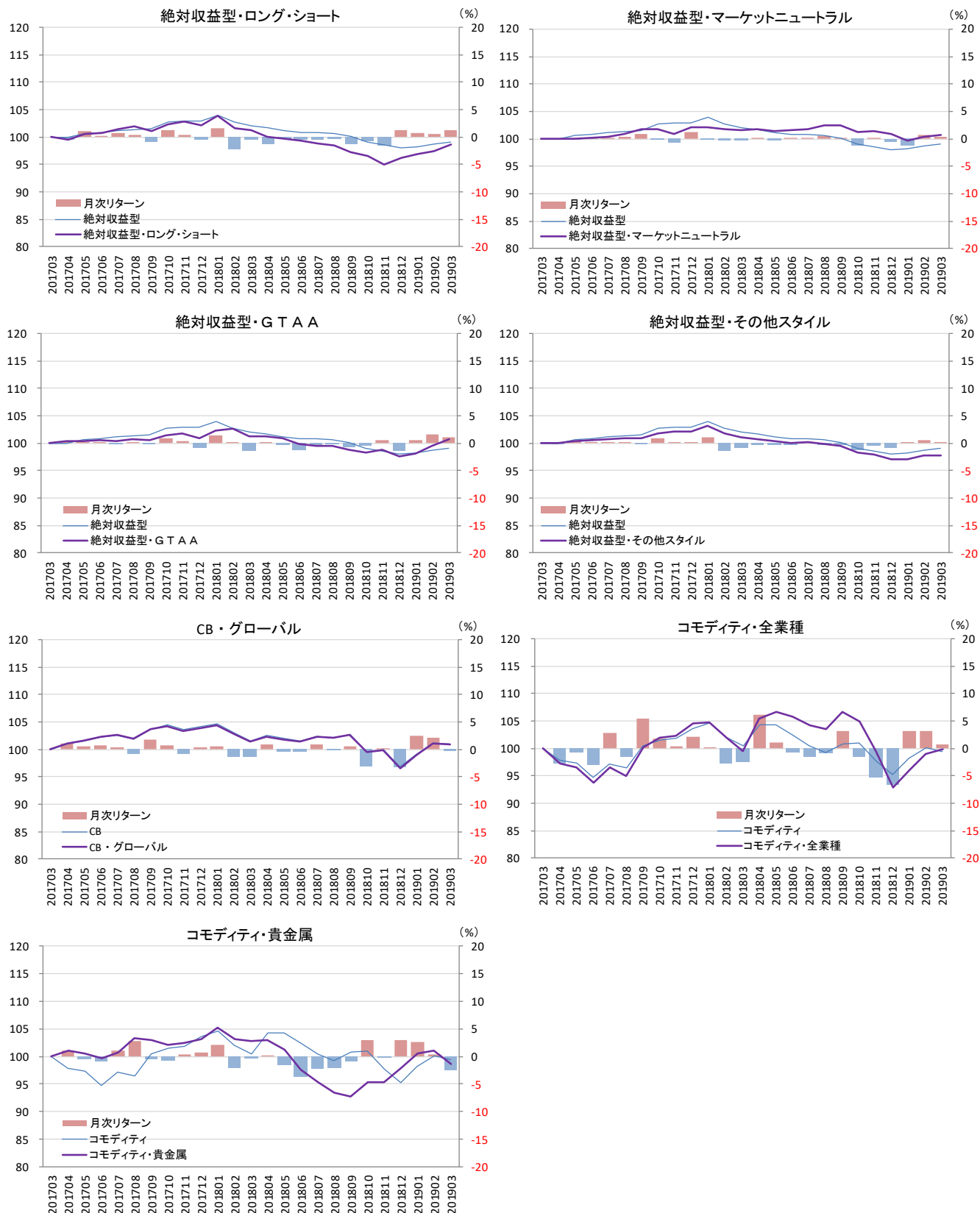


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	0.78		
1	REIT・北米	4.07	3.94	0.16
2	エマージング株式・その他	3.61	3.92	0.14
3	REIT・日本	3.14	4.16	0.13
4	REIT・グローバル	3.12	2.94	0.09
5	外国債券(先進国)・グローバル	0.90	10.09	0.09
6	複合資産・安定成長	0.66	6.48	0.04
7	国内債券・一般	0.69	5.25	0.04
8	複合資産・安定	0.79	4.39	0.03
9	REIT・その他	4.17	0.79	0.03
10	外国株式(先進国)・その他	0.50	5.28	0.03
11	外国債券(先進国)・その他	0.51	3.81	0.02
12	国内株式・小型	0.74	1.73	0.01
13	外国株式(先進国)・グローバル	0.04	18.03	0.01
14	複合資産・成長	0.39	1.91	0.01
15	複合資産・国内バランス	0.60	1.22	0.01
16	エマージング債券・その他	0.36	1.76	0.01
17	絶対収益型	0.34	1.07	0.00
18	エマージング株式・グローバル	0.23	1.53	0.00
19	エマージング株式・BRICS	0.63	0.11	0.00
20	CB	-0.29	0.28	-0.00
21	コモディティ	-0.64	0.26	-0.00
22	国内株式・その他	-0.11	4.93	-0.01
23	ハイイールド債券・グローバル	-1.10	0.62	-0.01
24	ハイイールド債券・その他	-1.15	0.79	-0.01
25	ハイイールド債券・北米	-0.60	2.62	-0.02
26	国内株式・一般	-0.20	10.15	-0.02
27	エマージング債券・グローバル	-1.44	1.49	-0.02
	合計		99.54	0.78

◆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	2.09		
1	REIT・北米	21.84	4.66	1.02
2	外国株式(先進国)・グローバル	4.92	15.36	0.76
3	REIT・日本	16.30	4.18	0.68
4	REIT・グローバル	16.70	3.13	0.52
5	外国株式(先進国)・その他	7.42	4.72	0.35
6	外国債券(先進国)・グローバル	1.82	11.05	0.20
7	ハイイールド債券・北米	4.03	3.29	0.13
8	REIT・その他	15.84	0.83	0.13
9	複合資産・安定成長	2.12	6.01	0.13
10	外国債券(先進国)・その他	2.16	4.39	0.09
11	国内債券・一般	1.50	4.93	0.07
12	複合資産・安定	0.80	4.00	0.03
13	複合資産・成長	1.10	1.65	0.02
14	複合資産・国内バランス	0.57	0.86	0.00
15	エマージング株式・BRICS	0.19	0.13	0.00
16	CB	-0.61	0.34	-0.00
17	コモディティ	-0.99	0.22	-0.00
18	ハイイールド債券・グローバル	-0.67	0.78	-0.01
19	エマージング債券・その他	-0.64	2.12	-0.01
20	絶対収益型	-2.78	1.00	-0.03
21	ハイイールド債券・その他	-2.77	1.08	-0.03
22	エマージング株式・グローバル	-3.44	1.73	-0.06
23	エマージング債券・グローバル	-3.58	1.82	-0.07
24	エマージング株式・その他	-1.74	4.25	-0.07
25	国内株式・その他	-2.88	4.48	-0.13
26	国内株式・小型	-11.82	1.72	-0.20
27	国内株式・一般	-9.63	10.75	-1.04
	合計		99.51	2.50

◆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	13.07	21.66	101.49	8.43 ↓	9.55	11.62 ↓	0.50	0.42	0.62
国内株式	24.98	43.62	156.92	14.19 ↓	15.76	17.56	0.55	0.48	0.56
一般	22.66	39.77	139.92	14.30 ↓	16.14	17.82	0.50	0.43	0.51
フリー	22.97	39.37	142.13	14.53 ↓	16.54	18.52	0.49	0.42	0.50
バリュー	21.65	41.40	141.62	13.79 ↓	14.99	16.43	0.49	0.48	0.56
小型	37.34	79.50	289.45	15.87	15.54	17.60	0.71	0.80	0.83
その他	27.36	46.36	174.36	14.10 ↓	15.39	17.50	0.60	0.51	0.60
日経225	31.17	51.35	194.22	14.36 ↓	15.44	17.76 ↓	0.66	0.56	0.64
TOPIX	24.91	44.38	143.61	13.81 ↓	15.31	16.98	0.56	0.50	0.55
JPX日経400	21.64	38.76	-	13.42 ↓	14.84	-	0.51	0.46	-
国内債券	1.01	7.55	18.53	1.48	1.49	1.48	0.26	0.99	1.13
一般	1.01	7.55	18.53	1.48	1.49	1.48	0.26	0.99	1.13
外国株式(先進国)	26.25	26.52	148.75	13.55	14.63	16.42	0.60	0.33	0.58
グローバル	26.51	31.93	158.49	13.55	14.42	16.29	0.61	0.40	0.61
除く日本	30.18	39.35	227.79	14.54	15.81 ↑	18.07	0.64	0.43	0.70
含む日本	25.42	29.83	145.06	13.38	14.14	15.97	0.59	0.38	0.58
その他	25.80	15.62	160.65	13.76	15.29	18.19	0.58	0.19	0.55
北米	27.13	17.77	88.96	16.46	17.11	21.01	0.51	0.19	0.31
米国	36.57	25.13	180.80	14.25	16.47	18.19	0.77	0.28	0.60
カナダ	11.33	-14.51	52.46	12.62	13.83	18.41	0.29	-0.22	0.23
欧州	13.94	11.22	153.53	14.82	14.99	19.31	0.30	0.14	0.50
ドイツ	5.94	-	-	18.19 ↓	-	-	0.11	-	-
アジア・オセアニア	25.17	34.65	267.24	12.03 ↓	14.64	19.14 ↓	0.65	0.42	0.72
オーストラリア	9.31	9.32	146.80	14.36	15.20	20.21 ↓	0.21	0.12	0.47
ニュージーランド	34.22	63.58	-	13.20 ↓	16.56	-	0.78	0.62	-
複合地域	-3.30	-21.17	-	18.36	18.89	-	-0.06	-0.25	-
エマージング株式	26.20	26.57	128.36	12.78 ↓	15.12	19.41 ↓	0.64	0.32	0.44
グローバル	23.53	16.35	113.77	13.83	15.88	19.24 ↓	0.53	0.19	0.41
BRICS	47.89	43.63	158.37	14.10 ↓	17.97	22.05 ↓	0.99	0.42	0.45
その他	26.38	30.55	136.78	12.88 ↓	15.12	19.41 ↓	0.63	0.36	0.46
欧州	30.64	8.86	124.11	17.37	19.87	25.91 ↓	0.54	0.09	0.32
ロシア	49.46	37.62	166.39	19.56	24.72	28.70 ↓	0.74	0.27	0.36
アジア・オセアニア	20.19	23.22	138.93	13.34	15.16	17.95 ↓	0.48	0.28	0.50
中国	37.29	76.21	149.54	17.23 ↓	22.48	22.54	0.65	0.53	0.42
インド	36.56	63.89	202.23	17.15 ↓	19.70	26.10	0.64	0.53	0.45
インドネシア	13.33	7.70	-	16.37	20.02	-	0.26	0.07	-
タイ	26.61	35.88	368.27	13.79	14.33	18.18	0.60	0.44	0.92
フィリピン	-8.75	11.64	-	14.15 ↓	15.26	-	-0.21	0.15	-
ベトナム	41.67	29.48	-	16.96 ↑	16.60	-	0.73	0.32	-
韓国	-7.79	-8.48	91.94	14.69	15.14	20.99 ↓	-0.18	-0.12	0.32
香港	46.49	40.87	150.62	14.45 ↓	18.56	19.58	0.94	0.38	0.49
台湾	14.96	32.29	184.94	16.76	16.71	20.26	0.29	0.34	0.54
中南米	28.21	-0.20	69.39	21.13	22.82	24.39	0.41	-0.00	0.22
ブラジル	47.61	-5.11	46.92	27.57 ↓	31.39	30.66	0.50	-0.03	0.13
メキシコ	-19.82	-20.23	-	21.31	19.65	-	-0.33	-0.22	-
中東・アフリカ	13.47	-2.26	117.31	12.50 ↓	14.82	17.42 ↓	0.35	-0.03	0.46
南アフリカ	0.89	-40.57	-	17.33	19.23	-	0.02	-0.51	-
トルコ	-40.89	-39.33	38.03	31.01	29.01	33.40	-0.52	-0.33	0.10
複合地域	9.47	8.10	135.03	13.49	14.15 ↑	16.74 ↓	0.23	0.11	0.53

※[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	13.07	21.66	101.49	8.43 ↓	9.55	11.62 ↓	0.50	0.42	0.62
外国債券(先進国)	1.13	2.76	40.68	4.64 ↓	5.66	8.26 ↓	0.09	0.10	0.42
グローバル	1.56	4.70	36.63	4.20 ↓	5.15	7.53 ↓	0.14	0.18	0.42
除く日本	0.46	3.40	45.27	4.93	5.87	8.31 ↓	0.04	0.12	0.45
含む日本	2.99	6.37	26.19	3.54 ↓	4.46	6.73 ↓	0.29	0.28	0.34
その他	0.05	-0.50	55.30	6.48 ↓	7.33	10.06 ↓	0.01	-0.01	0.44
北米	3.16	10.77	-	2.62 ↓	4.11	-	0.42	0.50	-
米国	3.13	12.03	51.08	5.16	5.87	6.53 ↓	0.21	0.39	0.64
カナダ	-4.15	-6.47	22.03	8.23	9.15	10.15 ↓	-0.16	-0.14	0.19
欧州	1.69	0.29	31.28	6.58 ↓	7.26	10.16 ↓	0.09	0.01	0.27
アジア・オセアニア	-0.61	-1.98	71.82	7.84 ↓	8.57	11.26 ↓	-0.02	-0.05	0.49
オーストラリア	-1.07	-3.03	72.38	7.96 ↓	8.63	11.71 ↓	-0.04	-0.07	0.47
ニュージーランド	7.91	7.41	-	8.49 ↓	10.15	-	0.31	0.14	-
複合地域	3.93	1.66	45.37	5.79 ↓	7.36	10.05 ↓	0.23	0.05	0.38
エマージング債券	12.46	6.37	68.78	8.01 ↓	10.59	13.01 ↓	0.50	0.12	0.41
グローバル	9.25	4.75	69.10	8.60 ↓	10.52	12.86 ↓	0.35	0.09	0.42
米ドル建て	10.44	6.35	74.70	8.67 ↓	10.71	13.03 ↓	0.39	0.12	0.44
現地通貨建て	2.40	-4.62	40.58	9.06 ↓	10.07	12.11 ↓	0.09	-0.09	0.28
その他	15.85	6.90	63.74	8.16 ↓	11.65	14.06	0.62	0.12	0.36
ロシア	30.95	-6.59	79.37	14.73 ↓	24.66	22.20 ↓	0.64	-0.05	0.27
アジア・オセアニア	4.93	16.83	69.65	5.39 ↓	6.78	8.99 ↓	0.31	0.47	0.60
インド	12.03	30.03	-	9.34	10.03	-	0.42	0.54	-
インドネシア	5.32	10.40	-	10.72	13.87	-	0.17	0.14	-
ブラジル	27.21	7.99	70.03	16.24	18.94	17.84	0.52	0.08	0.30
メキシコ	-6.47	-14.58	-	15.86	14.39	-	-0.14	-0.22	-
南アフリカ	25.53	4.98	-	21.27	19.25	-	0.37	0.05	-
トルコ	-52.78	-54.67	-	33.47	28.51	-	-0.66	-0.51	-
複合地域	8.48	-5.86	35.51	9.47 ↓	11.33	13.42 ↓	0.30	-0.11	0.23
ハイイールド債券	16.05	12.67	131.95	8.11 ↓	9.51	12.38	0.63	0.25	0.71
グローバル	17.46	11.67	102.61	7.89 ↓	9.55	12.31	0.71	0.23	0.59
北米	19.22	15.93	143.86	8.59 ↓	9.59	12.03	0.71	0.31	0.77
その他	7.97	5.82	167.92	8.26 ↓	10.09	16.09	0.32	0.11	0.64
欧州	6.81	3.61	214.08	9.00 ↓	10.84	17.64	0.25	0.07	0.69
アジア・オセアニア	13.39	18.03	-	6.79 ↓	8.32	-	0.64	0.41	-
複合地域	10.98	8.89	138.05	8.12 ↓	8.58	12.42 ↓	0.44	0.20	0.73
複合資産	9.58	18.66	90.82	5.93	7.14	9.59 ↓	0.53	0.49	0.69
安定	5.65	12.98	73.45	4.40	5.57	8.10 ↓	0.43	0.44	0.69
安定成長	10.44	19.52	93.36	6.43	7.50	9.99 ↓	0.53	0.48	0.68
成長	16.98	29.02	132.30	9.67	10.59 ↑	12.24 ↓	0.56	0.49	0.71
国内バランス	6.27	18.08	49.11	2.36	4.49	6.82 ↓	0.89	0.75	0.59
安定	5.39	16.85	43.71	2.17	2.55	3.68	0.84	1.24	0.99
一般	13.20	20.75	61.17	7.78	9.21	9.90	0.55	0.42	0.49

※[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	13.07	21.66	101.49	8.43 ↓	9.55	11.62 ↓	0.50	0.42	0.62
国内REIT	11.15	48.55	216.25	7.57	8.92	16.59 ↓	0.48	0.92	0.73
日本	11.15	48.55	216.25	7.57	8.92	16.59 ↓	0.48	0.92	0.73
外国REIT	12.79	47.02	321.21	12.84	14.03 ↑	17.85	0.32	0.57	0.86
グローバル	9.53	37.77	290.16	12.69	13.56 ↑	17.50	0.25	0.49	0.83
除く日本	15.55	47.89	318.87	12.91	13.64 ↑	17.56	0.39	0.60	0.87
含む日本	8.85	36.73	287.63	12.67	13.55 ↑	17.50	0.23	0.48	0.83
北米	13.68	53.19	385.22	13.77	15.09 ↑	20.61 ↓	0.32	0.59	0.83
その他	25.16	57.78	319.98	10.66	12.01	16.61	0.73	0.80	0.93
欧州	2.06	18.50	80.54	15.33	15.44	21.96 ↓	0.05	0.22	0.28
アジア・オセアニア	36.56	67.53	350.91	10.47	12.20	15.35 ↓	1.05	0.89	1.06
オーストラリア	14.56	44.59	269.17	13.42	14.14	17.98 ↓	0.35	0.54	0.77
複合地域	-3.54	14.23	192.30	14.67	15.15	19.01 ↓	-0.08	0.18	0.59
複数国	16.38	68.92	382.98	11.33	12.70 ↑	17.12	0.46	0.87	0.99
その他									
絶対収益型	-2.31	-0.47	-6.62	1.98	2.20	3.44	-0.37	-0.04	-0.21
ロング・ショート	-2.09	-1.36	0.75	3.07	2.98	3.54	-0.21	-0.09	0.01
マーケットニュートラル	1.85	4.48	1.46	2.13	1.94	2.01	0.31	0.46	0.05
GTAA	1.24	2.85	12.15	2.43	2.06	2.62	0.19	0.28	0.42
その他スタイル	-2.51	-0.16	-10.56	2.02	2.42	5.22	-0.39	-0.01	-0.22
CB	7.49	4.84	60.68	5.53 ↓	6.45	9.94	0.45	0.15	0.48
欧州	-18.19	-	-	16.21	-	-	-0.40	-	-
アジア・オセアニア	16.12	34.86	82.95	8.77	10.68	10.84 ↓	0.59	0.58	0.57
日本	3.11	16.89	61.97	4.96	5.54	6.12	0.22	0.57	0.80
グローバル	7.80	4.02	67.73	5.53 ↓	6.36	10.50 ↓	0.47	0.13	0.50
コモディティ	6.66	-34.40	-8.40	9.52 ↓	12.12	15.59 ↓	0.23	-0.67	-0.06
全業種	7.73	-36.43	-14.16	12.02	13.92	16.15 ↓	0.21	-0.62	-0.10
貴金属	-1.84	-11.74	-	6.55	9.24	-	-0.09	-0.27	-
エネルギー	28.41	-44.45	-18.08	26.93	27.36	25.38	0.32	-0.41	-0.08
その他コモディティ	-4.48	-27.31	46.33	12.43 ↓	14.39	18.61 ↓	-0.12	-0.43	0.21

※[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

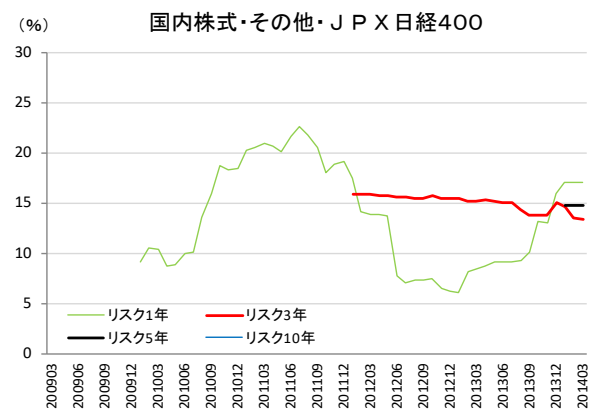
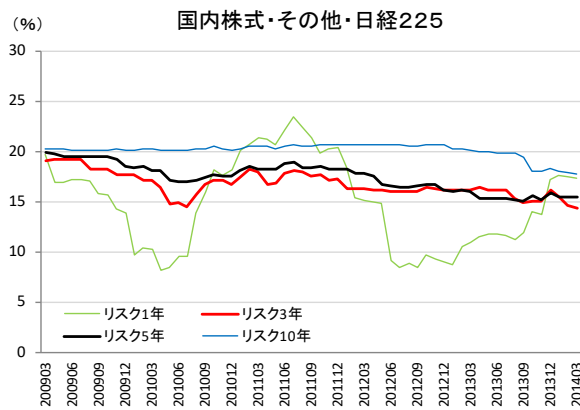
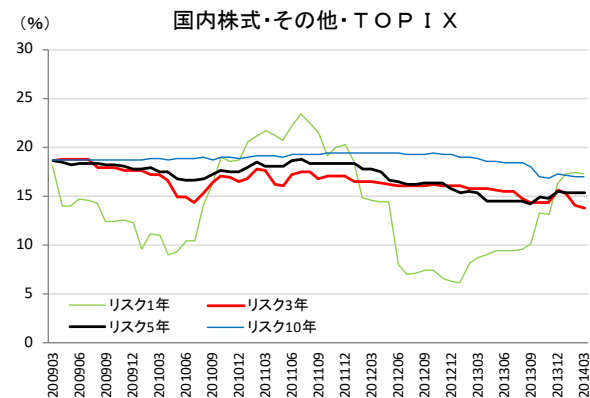
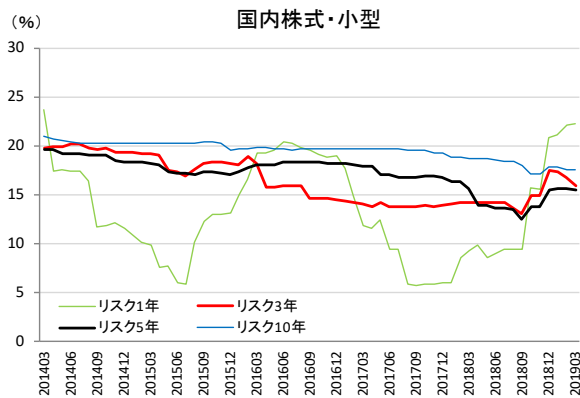
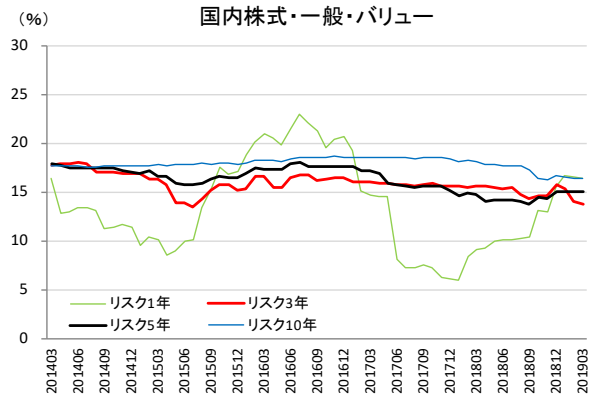
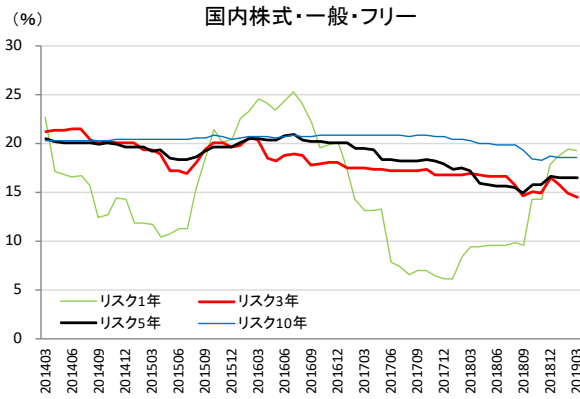
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

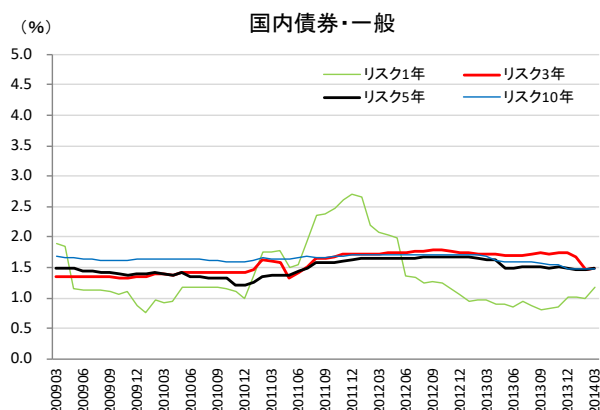
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

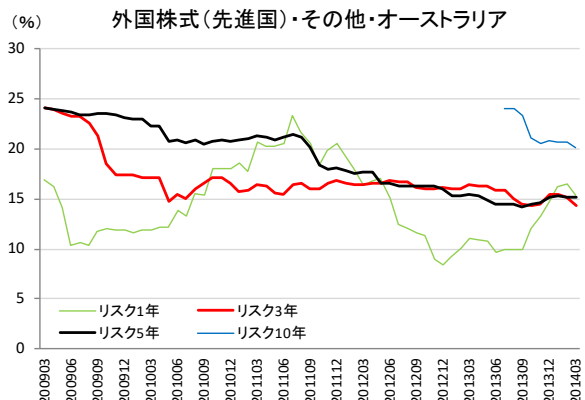
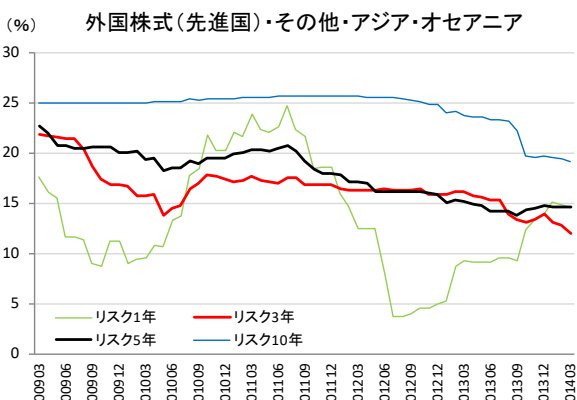
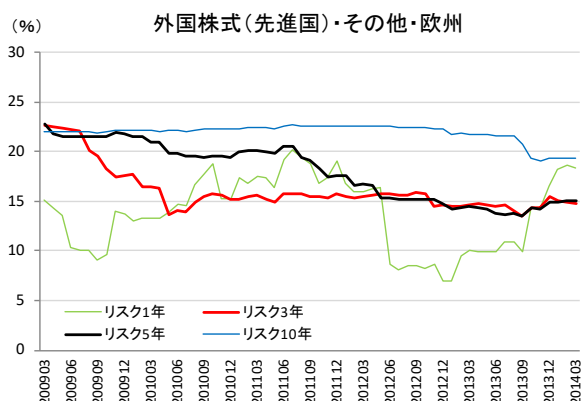
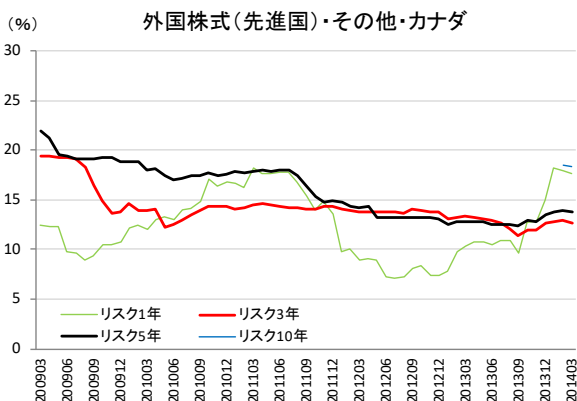
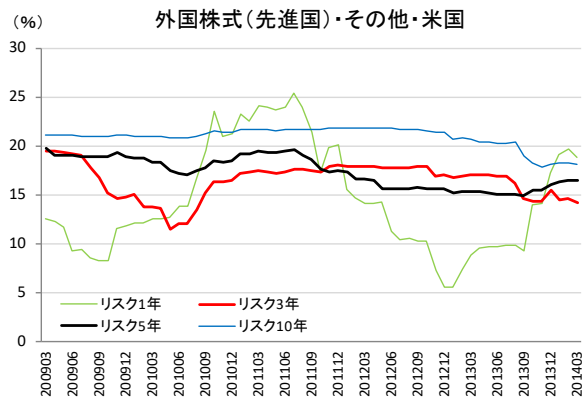
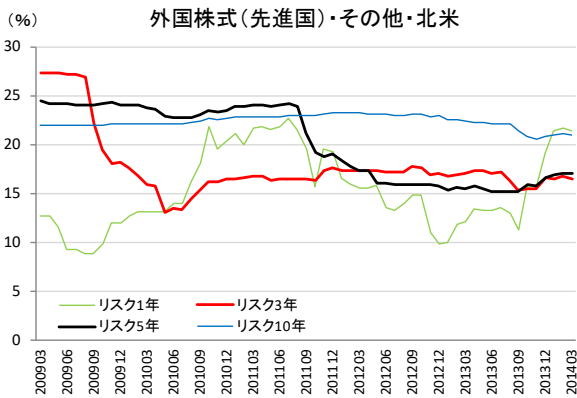
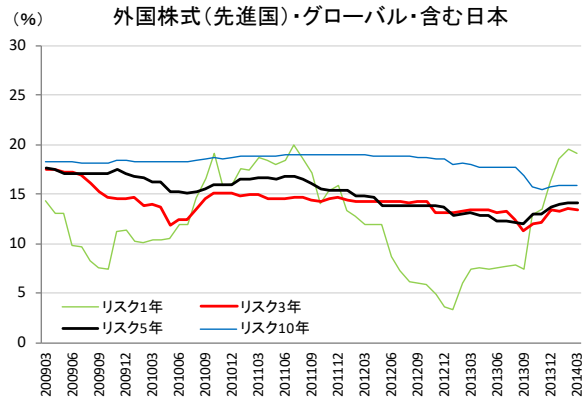
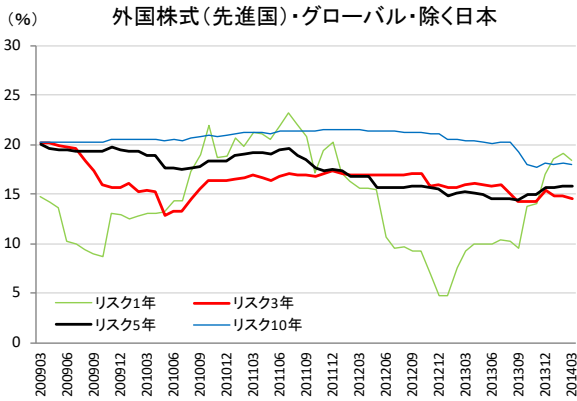


<2> リスク・サマリー

(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)]

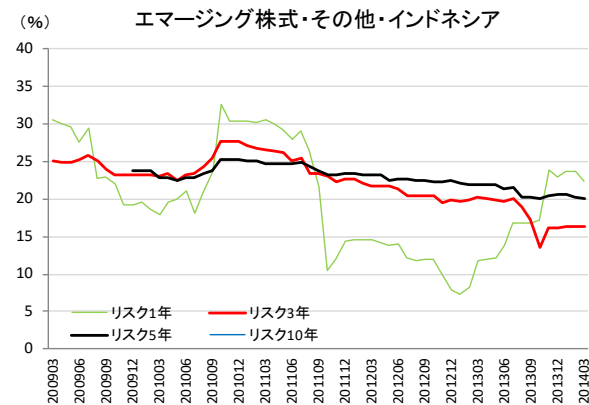
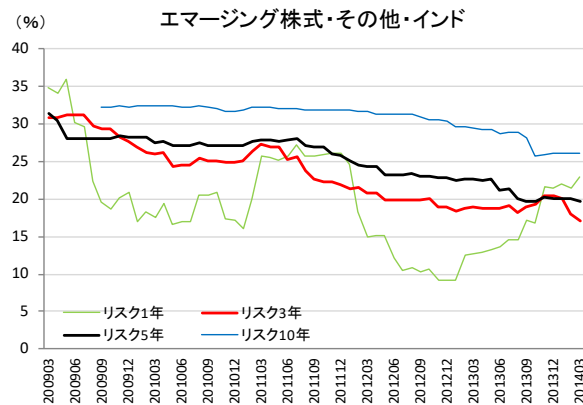
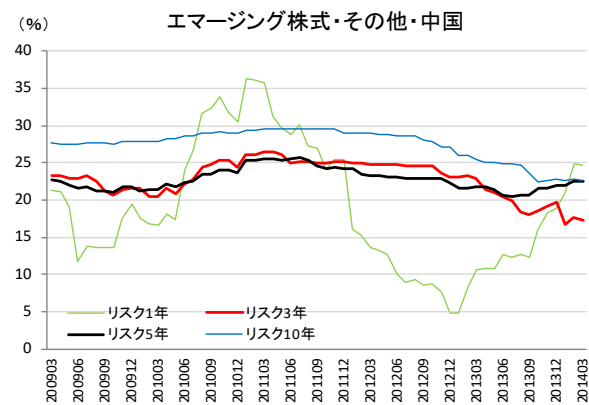
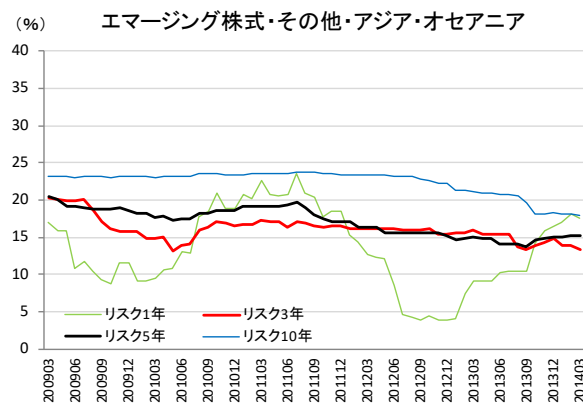
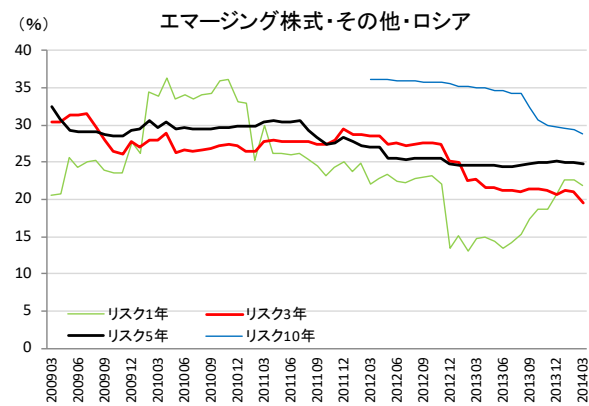
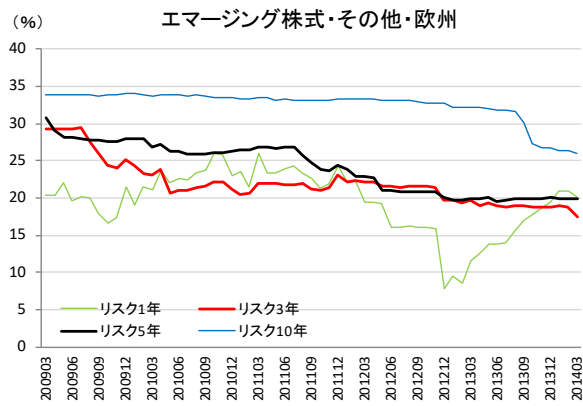
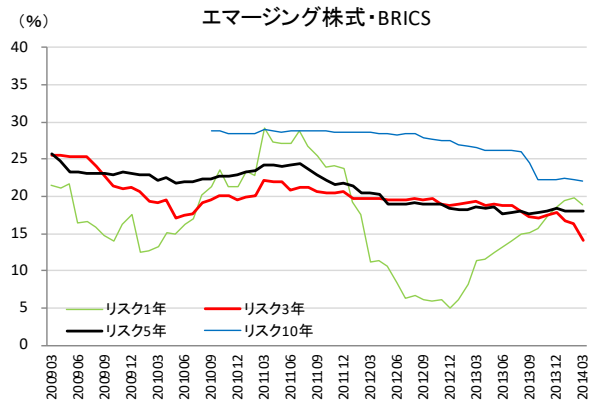
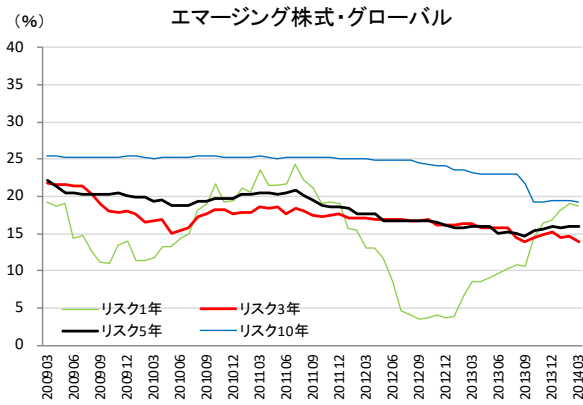


<2>リスク・サマリー

(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]

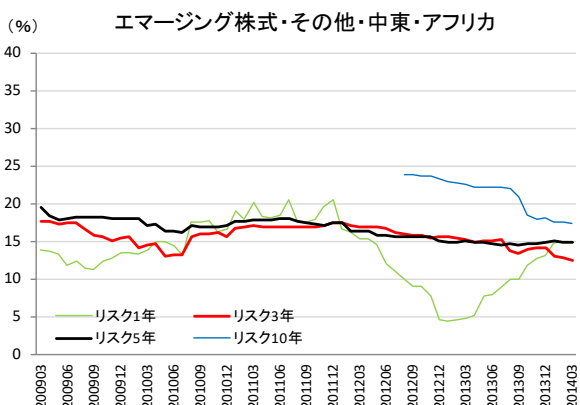
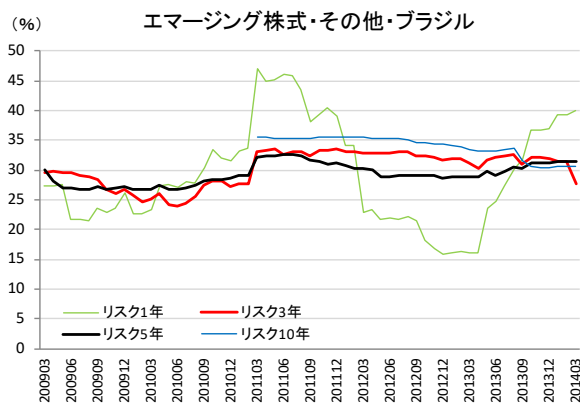
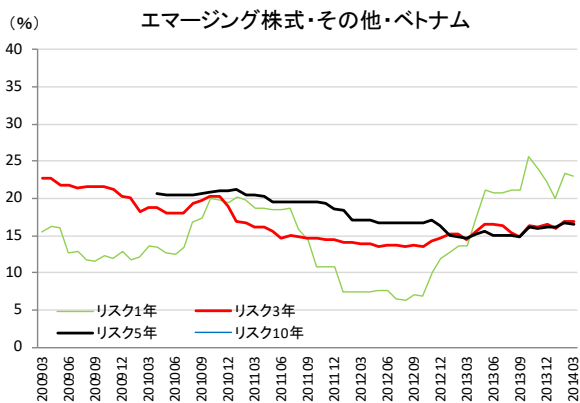
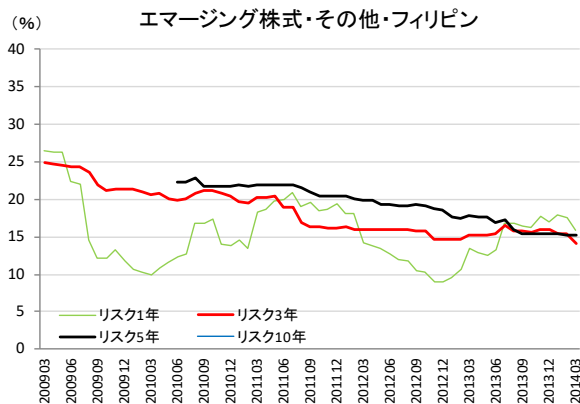
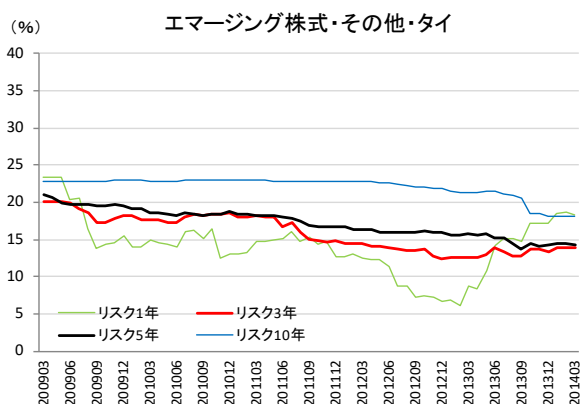


＜2＞リスク・サマリー

(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]

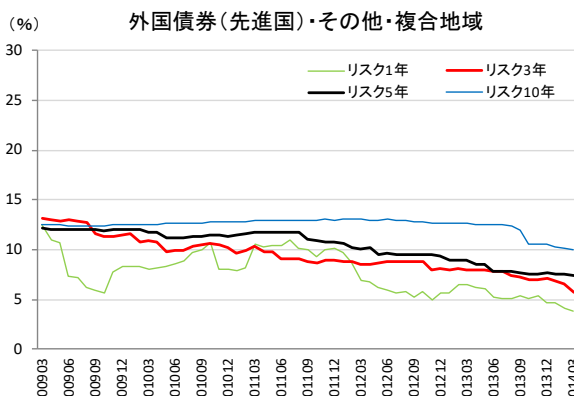
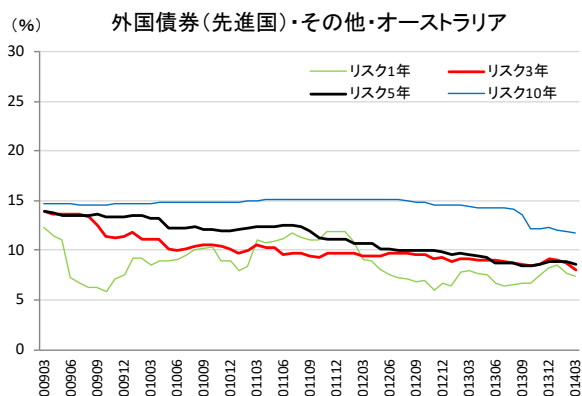
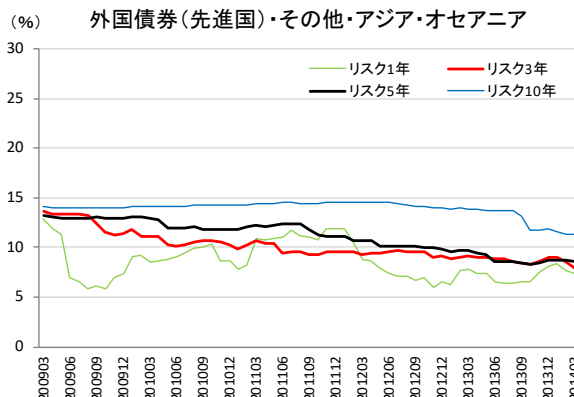
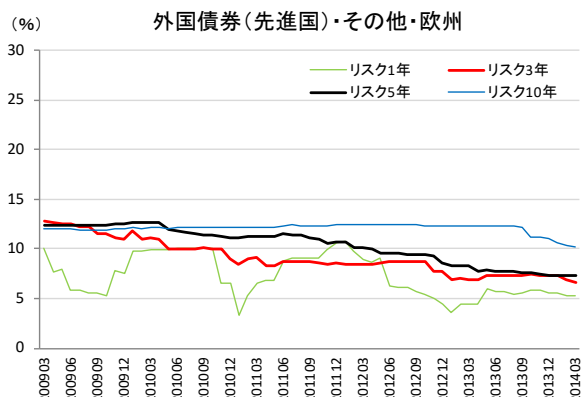
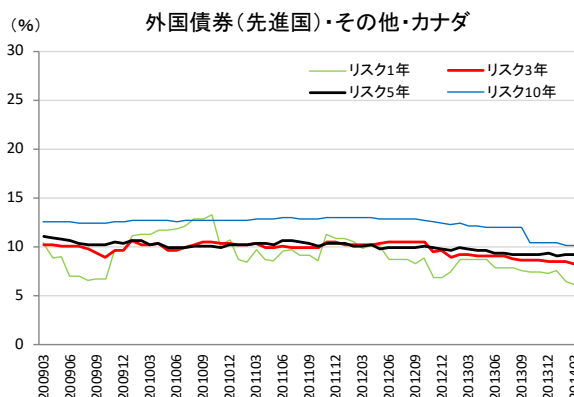
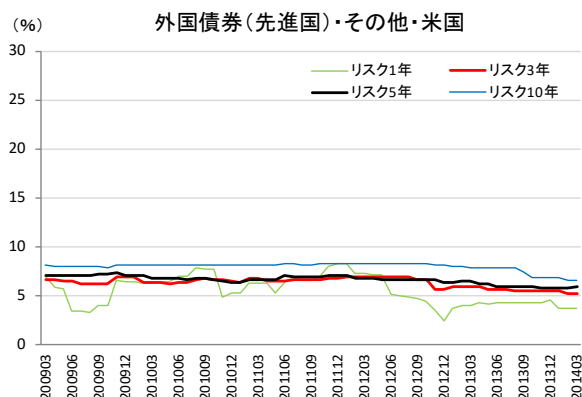
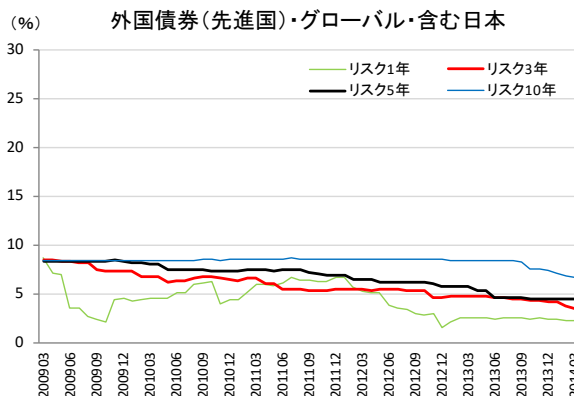
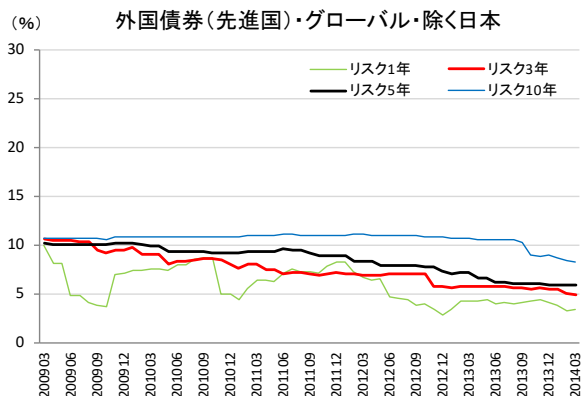


<2> リスク・サマリー

(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)]

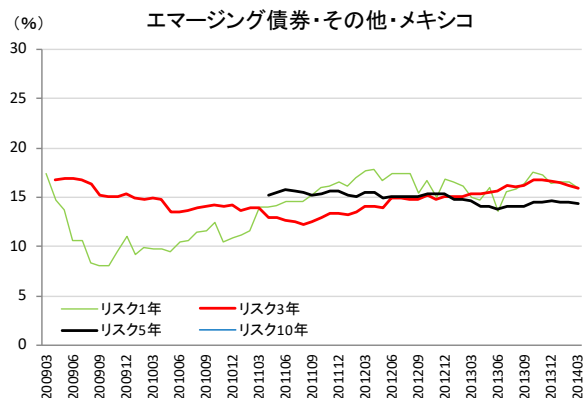
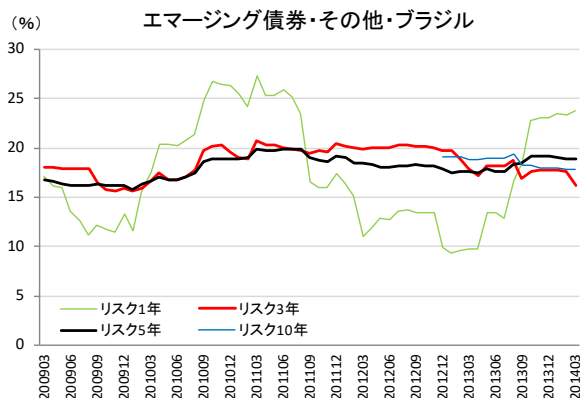
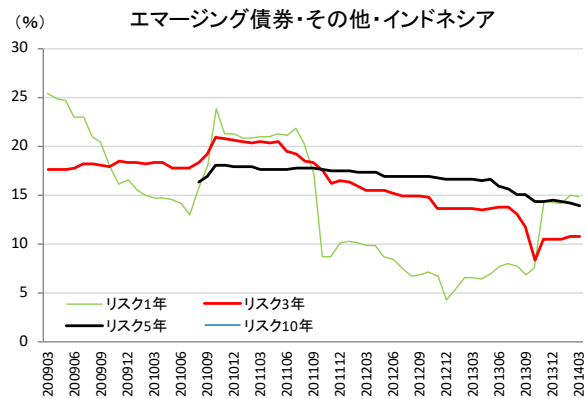
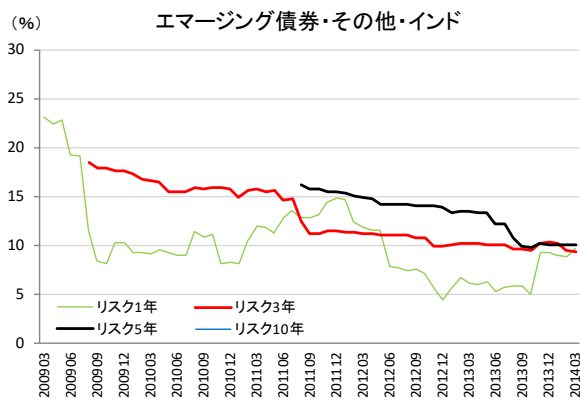
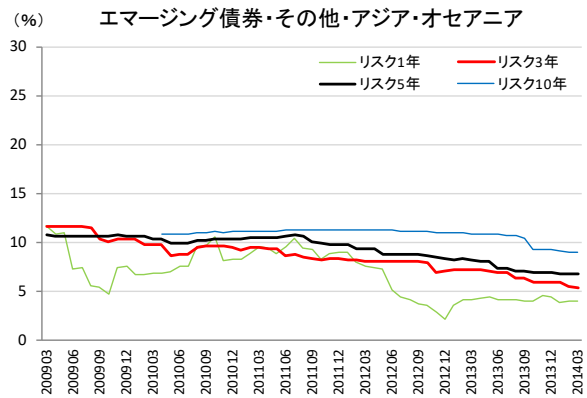
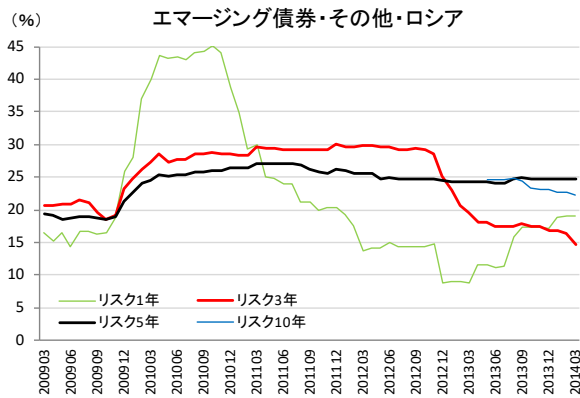
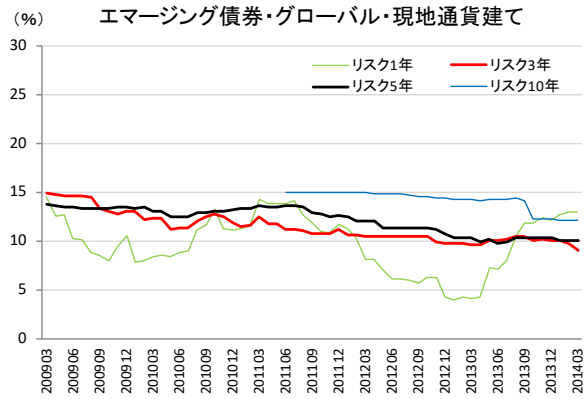
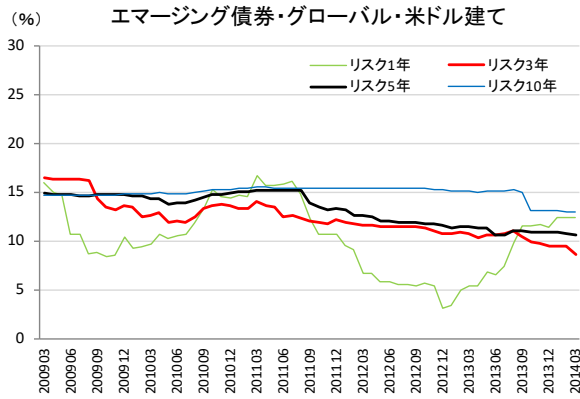


<2> リスク・サマリー

(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]

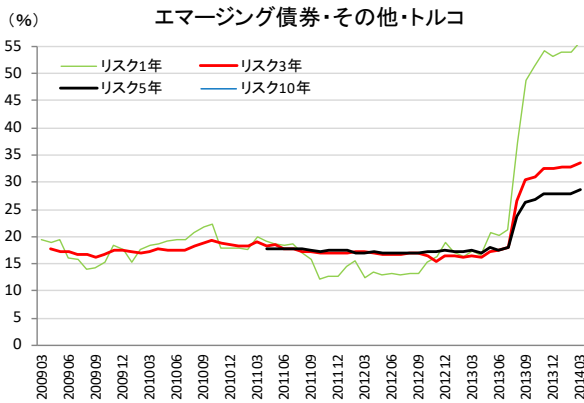


<2>リスク・サマリー

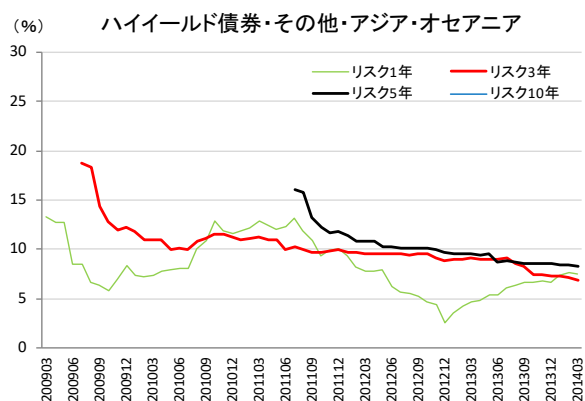
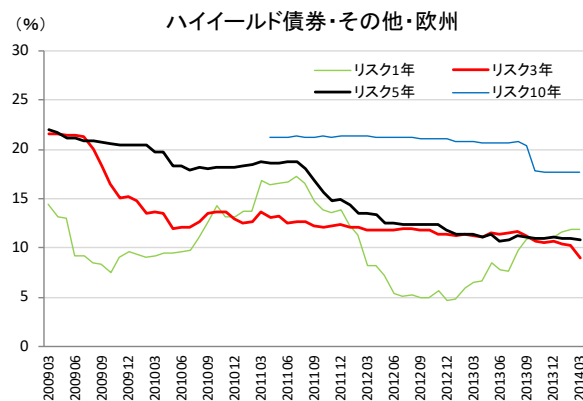
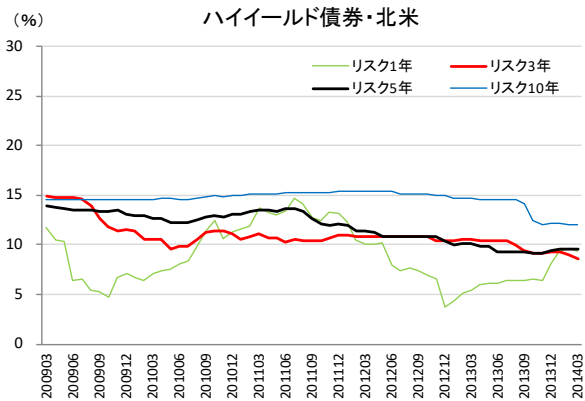
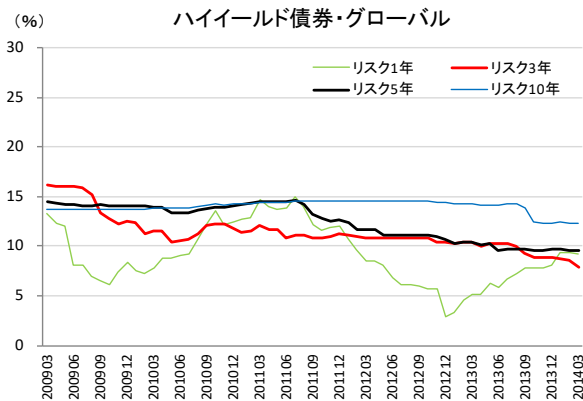
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

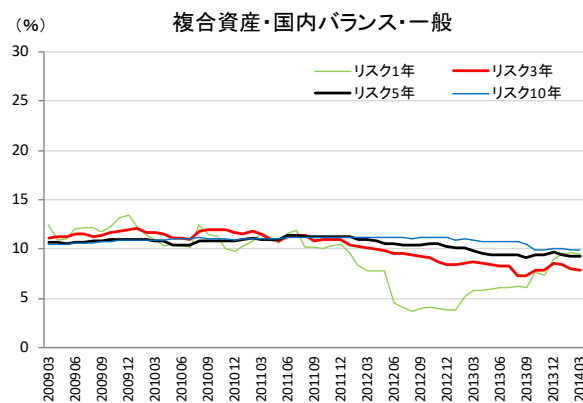
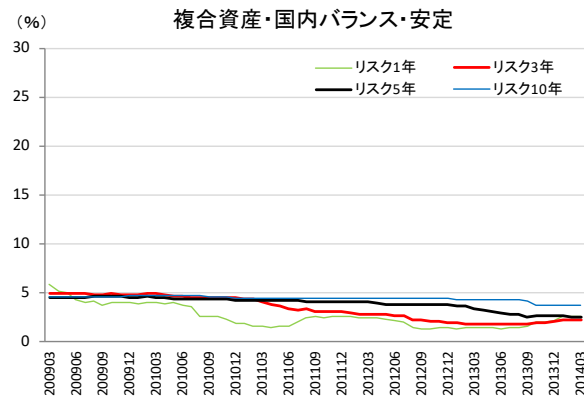
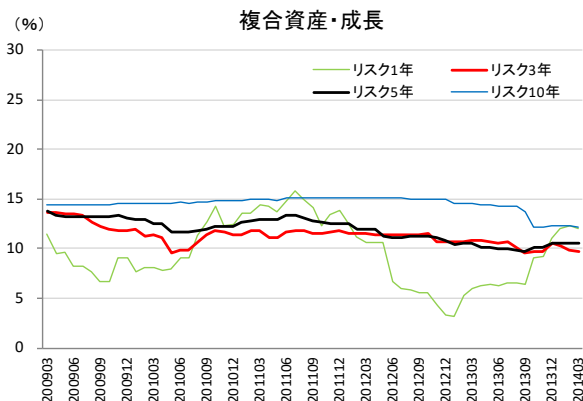
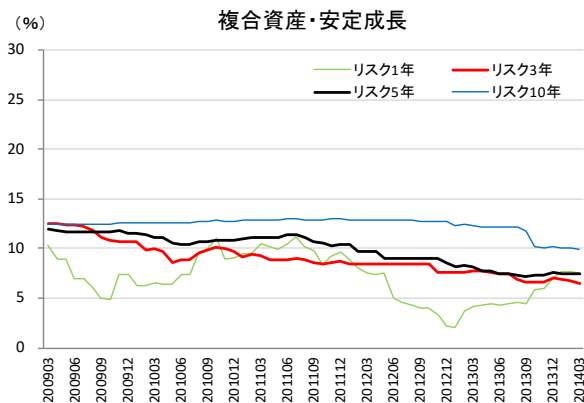
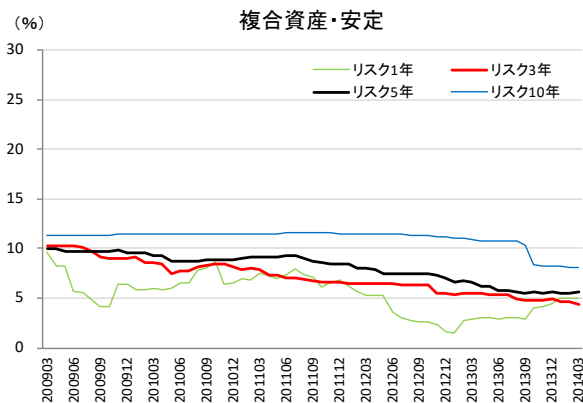


<2> リスク・サマリー

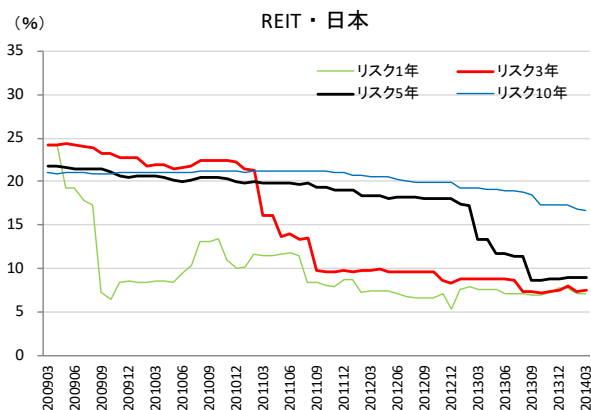
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

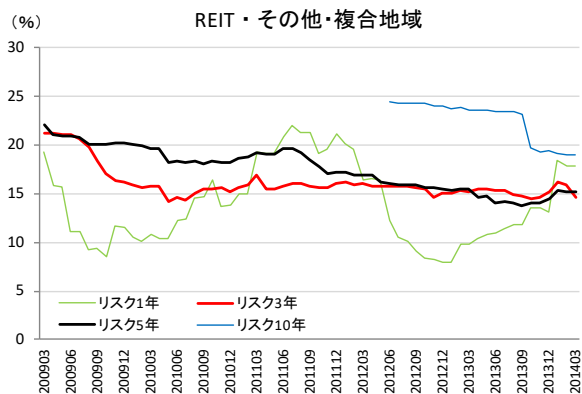
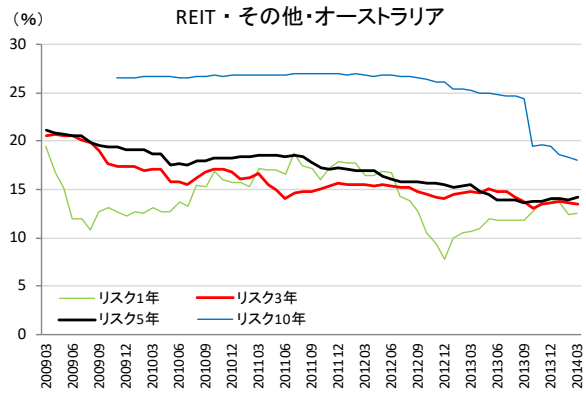
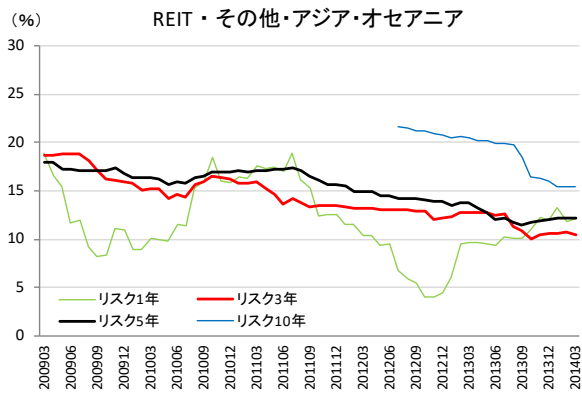
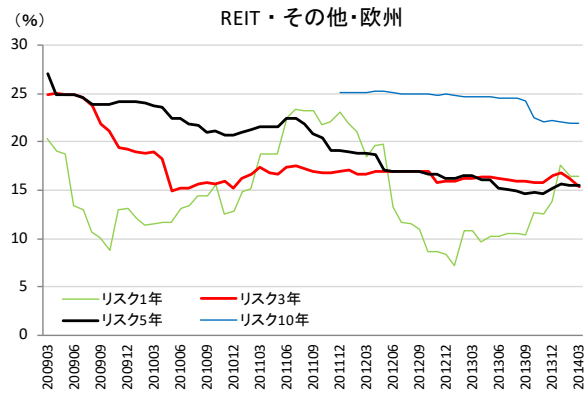
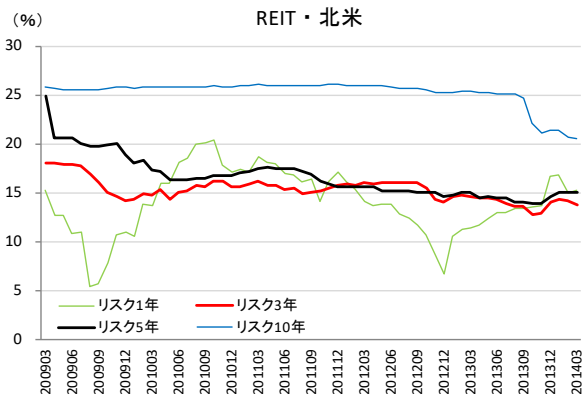
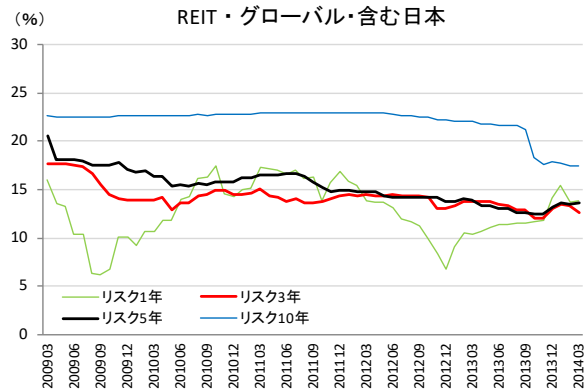
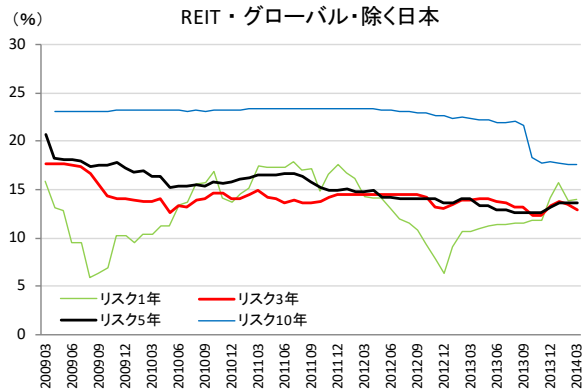


<2> リスク・サマリー

(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]

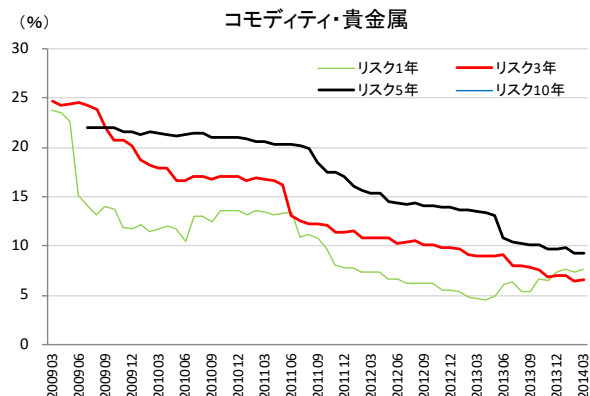
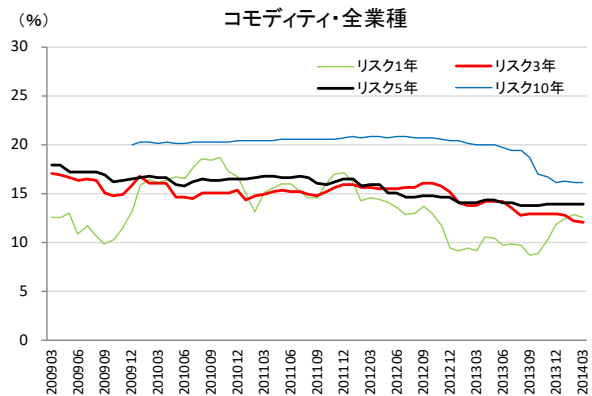
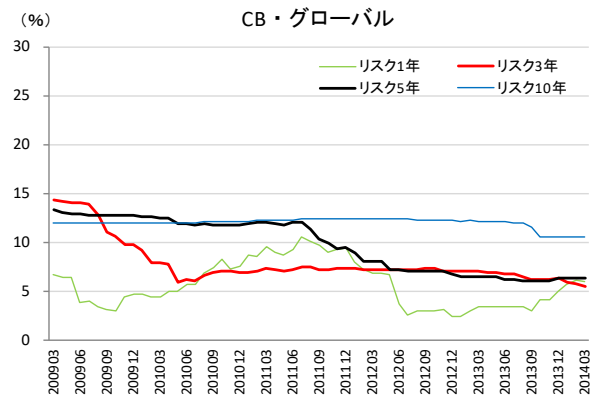
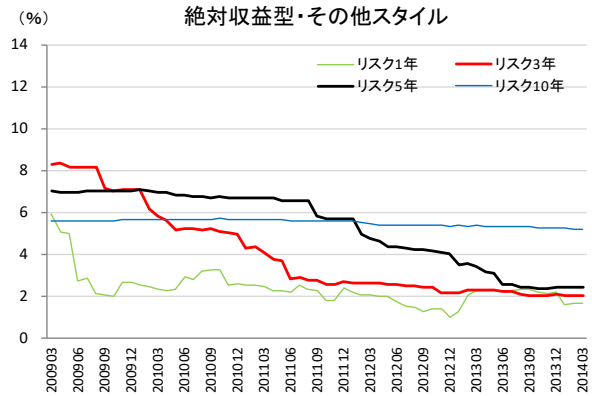
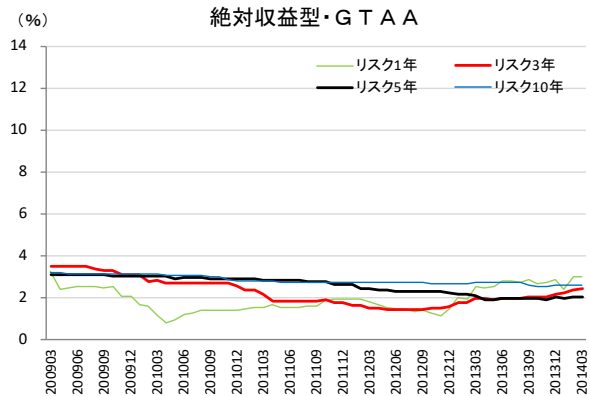
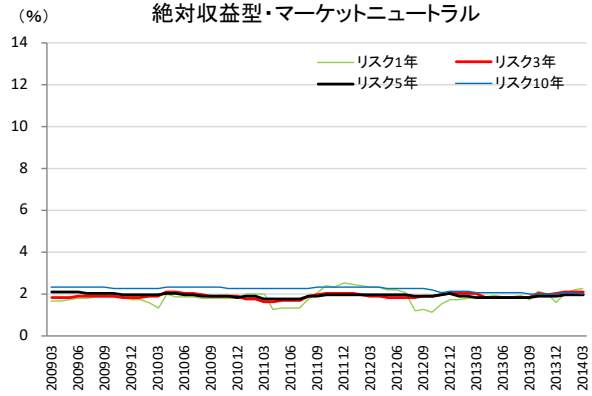
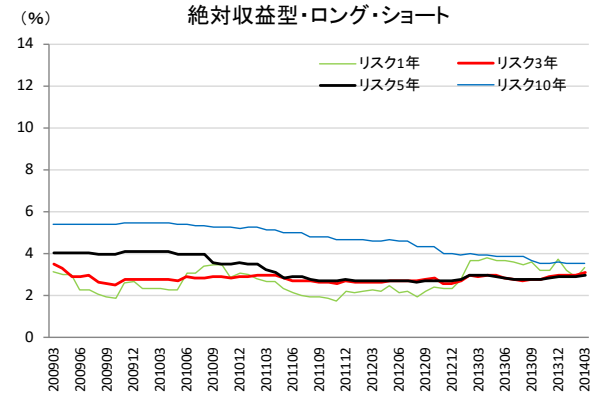


<2> リスク・サマリー

(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]



< 3 > 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	-706	-2,258	4,792	15,457
国内株式	47	406	5,955	9,615
一般	-265	-98	830	4,178
フリー	-224	-17	685	3,390
バリュー	-42	-82	144	788
小型	-17	97	392	1,451
その他	338	419	4,738	3,841
日経225	128	68	3,630	2,240
TOPIX	195	343	928	1,460
JPX日経400	2	-5	77	7
国内債券	245	173	-142	1,884
一般	245	173	-142	1,884
外国株式(先進国)	-664	-458	5,666	17,900
グローバル	-297	198	4,571	14,187
除く日本	13	429	1,366	2,755
含む日本	-310	-231	3,205	11,432
その他	-366	-656	1,094	3,713
北米	10	16	35	6
米国	-329	-496	1,513	4,948
カナダ	-17	-35	-54	-107
欧州	-46	-119	-214	-375
ドイツ	0	0	-1	3
アジア・オセアニア	-7	-18	-31	-43
オーストラリア	24	-1	-148	-710
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	0	-1	-1	-1
エマージング株式	-409	-962	-1,919	-524
グローバル	-205	-469	-803	-689
BRICS	-9	-21	-44	-71
その他	-195	-472	-1,072	237
欧州	-5	-23	-47	-50
ロシア	-2	-9	-22	-37
アジア・オセアニア	-118	-193	-447	-545
中国	-7	-44	-6	1,045
インド	-164	-320	-643	-801
インドネシア	-2	-9	-27	-30
タイ	-3	-6	-12	-17
フィリピン	-3	-21	-50	-51
ベトナム	104	168	247	732
韓国	0	0	6	6
香港	-1	-1	-1	1
台湾	0	0	0	0
中南米	-1	-7	-11	-16
ブラジル	11	2	-46	20
メキシコ	0	-2	-1	-4
中東・アフリカ	-1	-2	-8	-11
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	-3	-4	-3	-1
複合地域	0	-1	-1	-3

<3> 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か月	6か月	1年
総合	-706	-2,258	4,792	15,457
外国債券(先進国)	-430	-1,787	-4,510	-8,199
グローバル	-342	-1,370	-3,184	-5,405
除く日本	-15	-320	-1,033	-1,563
含む日本	-327	-1,050	-2,151	-3,842
その他	-88	-416	-1,326	-2,794
北米	1	-7	-21	-45
米国	-48	-100	-380	-1,003
カナダ	-34	-96	-197	-459
欧州	108	136	149	413
アジア・オセアニア	-57	-150	-365	-686
オーストラリア	-35	-138	-390	-777
ニュージーランド	-6	-12	-24	-47
複合地域	-16	-47	-94	-182
エマージング債券	128	91	-550	-1,974
グローバル	-24	-126	-369	-1,073
米ドル建て	-41	-157	-399	-1,093
現地通貨建て	16	31	30	20
その他	152	217	-181	-900
ロシア	-10	-32	-63	-157
アジア・オセアニア	-6	-18	-55	-111
インド	-56	-104	-283	-475
インドネシア	-3	-10	-34	-87
ブラジル	-15	-79	-298	-537
メキシコ	-3	-25	-45	-137
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	1	2	7	3
複合地域	0	-1	-3	-7
ハイイールド債券	-360	-902	-2,240	-5,782
グローバル	-59	-151	-348	-748
北米	-218	-538	-1,407	-3,874
その他	-84	-212	-485	-1,160
欧州	-58	-144	-322	-784
アジア・オセアニア	-22	-60	-148	-346
複合地域	-1	-1	-3	-6
複合資産	446	1,438	3,390	10,213
安定	13	55	197	2,026
安定成長	150	448	1,251	3,951
成長	40	211	664	1,625
国内バランス	242	724	1,278	2,610
安定	242	721	1,286	2,636
一般	0	1	-7	3

<3> 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	-706	-2,258	4,792	15,457
国内REIT	355	399	271	-585
日本	355	399	271	-585
外国REIT	-247	-624	-2,067	-7,587
グローバル	-67	-206	-450	-1,744
除く日本	126	219	325	526
含む日本	-193	-424	-775	-2,270
北米	-337	-870	-1,934	-5,708
その他	156	452	317	-135
欧州	-9	-21	-39	-92
アジア・オセアニア	199	549	475	217
オーストラリア	-28	-59	-87	-195
複合地域	0	0	0	0
複数国	-7	-18	-32	-64
その他	183	-33	939	496
絶対収益型	28	-131	0	469
ロング・ショート	-22	-66	-117	-41
マーケットニュートラル	31	80	109	415
GTAA	-5	-9	-23	-144
その他スタイル	24	-137	24	232
CB	-19	-62	-151	-417
欧州	-1	-1	-1	-4
アジア・オセアニア	0	-1	-6	-8
日本	-1	-2	-3	-6
グローバル	-17	-58	-140	-398
コモディティ	171	185	223	397
全業種	5	15	32	62
貴金属	166	170	191	347
エネルギー	-1	0	-1	-14
その他コモディティ	0	1	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	632,539	100.00%	5,478	100.00%	
国内株式	106,466	16.83%	879	16.05%	
一般	63,411	10.02%	579	10.57%	
フリー	51,105	8.08%	461	8.42%	
バリュー	12,306	1.95%	118	2.15%	
小型	10,969	1.73%	93	1.70%	
その他	31,345	4.96%	199	3.63%	
日経225	16,586	2.62%	70	1.28%	
TOPIX	12,251	1.94%	74	1.35%	
JPX日経400	831	0.13%	20	0.37%	
国内債券	33,533	5.30%	131	2.39%	
一般	33,533	5.30%	131	2.39%	
外国株式(先進国)	146,143	23.10%	964	17.60%	
グローバル	113,202	17.90%	597	10.90%	
除く日本	23,532	3.72%	169	3.09%	
含む日本	89,670	14.18%	428	7.81%	
その他	32,941	5.21%	367	6.70%	
北米	376	0.06%	17	0.31%	
米国	23,670	3.74%	240	4.38%	
カナダ	428	0.07%	3	0.05%	
欧州	1,831	0.29%	62	1.13%	
ドイツ	26	0.00%	1	0.02%	
アジア・オセアニア	115	0.02%	8	0.15%	
オーストラリア	6,445	1.02%	32	0.58%	
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	35,493	5.61%	372	6.79%	
グローバル	9,471	1.50%	100	1.83%	
BRICS	707	0.11%	8	0.15%	
その他	25,315	4.00%	264	4.82%	
欧州	231	0.04%	9	0.16%	
ロシア	127	0.02%	5	0.09%	
アジア・オセアニア	7,418	1.17%	119	2.17%	
中国	2,565	0.41%	30	0.55%	
インド	12,016	1.90%	30	0.55%	
インドネシア	229	0.04%	8	0.15%	
タイ	104	0.02%	4	0.07%	
フィリピン	108	0.02%	5	0.09%	
ベトナム	1,181	0.19%	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	82	0.01%	2	0.04%	
ブラジル	989	0.16%	21	0.38%	
メキシコ	22	0.00%	3	0.05%	
中東・アフリカ	123	0.02%	7	0.13%	
南アフリカ	1	0.00%	1	0.02%	
トルコ	75	0.01%	4	0.07%	
複合地域	23	0.00%	2	0.04%	

＜4＞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	632,539	100.00%	5,478	100.00%	
外国債券(先進国)	87,694	13.86%	894	16.32%	
グローバル	63,728	10.07%	597	10.90%	
除く日本	34,102	5.39%	245	4.47%	
含む日本	29,626	4.68%	352	6.43%	
その他	23,966	3.79%	297	5.42%	
北米	105	0.02%	6	0.11%	
米国	5,723	0.90%	161	2.94%	
カナダ	1,569	0.25%	6	0.11%	
欧州	1,246	0.20%	34	0.62%	
アジア・オセアニア	2,801	0.44%	12	0.22%	
オーストラリア	10,584	1.67%	44	0.80%	
ニュージーランド	199	0.03%	14	0.26%	
複合地域	1,702	0.27%	12	0.22%	
エマージング債券	20,366	3.22%	313	5.71%	
グローバル	9,174	1.45%	199	3.63%	
米ドル建て	7,471	1.18%	158	2.88%	
現地通貨建て	1,703	0.27%	41	0.75%	
その他	11,192	1.77%	114	2.08%	
ロシア	295	0.05%	5	0.09%	
アジア・オセアニア	564	0.09%	26	0.47%	
インド	4,843	0.77%	22	0.40%	
インドネシア	628	0.10%	12	0.22%	
ブラジル	3,453	0.55%	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	152	0.02%	6	0.11%	
複合地域	55	0.01%	1	0.02%	
ハイイールド債券	24,613	3.89%	313	5.71%	
グローバル	3,775	0.60%	58	1.06%	
北米	16,056	2.54%	164	2.99%	
その他	4,782	0.76%	91	1.66%	
欧州	3,757	0.59%	51	0.93%	
アジア・オセアニア	890	0.14%	34	0.62%	
複合地域	51	0.01%	1	0.02%	
複合資産	89,115	14.09%	962	17.56%	
安定	27,884	4.41%	292	5.33%	
安定成長	41,157	6.51%	407	7.43%	
成長	12,114	1.92%	229	4.18%	
国内バランス	7,959	1.26%	34	0.62%	
安定	7,334	1.16%	10	0.18%	
一般	497	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	632,539	100.0%	5,478	100.0%
国内REIT	27,202	4.3%	125	2.3%
日本	27,202	4.3%	125	2.3%
外国REIT	49,466	7.8%	302	5.5%
グローバル	18,904	3.0%	135	2.5%
除く日本	3,431	0.5%	44	0.8%
含む日本	15,474	2.4%	91	1.7%
北米	25,244	4.0%	95	1.7%
その他	5,317	0.8%	72	1.3%
欧州	315	0.0%	20	0.4%
アジア・オセアニア	3,805	0.6%	34	0.6%
オーストラリア	815	0.1%	13	0.2%
複合地域	51	0.0%	3	0.1%
複数国	331	0.1%	2	0.0%
その他	12,449	2.0%	223	4.1%
絶対収益型	6,810	1.1%	97	1.8%
ロング・ショート	1,136	0.2%	30	0.5%
マーケットニュートラル	863	0.1%	12	0.2%
GTAA	462	0.1%	16	0.3%
その他スタイル	4,350	0.7%	39	0.7%
CB	1,697	0.3%	47	0.9%
欧州	4	0.0%	3	0.1%
アジア・オセアニア	41	0.0%	1	0.0%
日本	73	0.0%	3	0.1%
グローバル	1,580	0.2%	40	0.7%
コモディティ	1,796	0.3%	32	0.6%
全業種	881	0.1%	14	0.3%
貴金属	885	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%

< 5 > 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	11,328	7.8	4.25	4.56	1.314
国内株式	13,780	10.8	1.61	2.12	1.186
一般	12,659	10.3	2.22	3.04	1.425
フリー	12,293	9.8	2.57	3.55	1.471
バリュー	14,090	12.5	0.72	0.83	1.233
小型	19,664	11.1	1.33	1.52	1.714
その他	14,441	11.6	0.51	0.54	0.507
日経225	14,722	13.0	0.52	0.52	0.590
TOPIX	15,221	12.9	0.36	0.38	0.343
JPX日経400	12,942	4.6	0.17	0.18	0.553
国内債券	11,177	10.2	0.35	0.36	0.350
一般	11,177	10.2	0.35	0.36	0.350
外国株式(先進国)	12,200	6.3	4.33	4.71	1.612
グローバル	12,859	6.9	3.07	3.31	1.587
除く日本	15,443	8.8	1.00	1.08	0.816
含む日本	11,839	6.1	3.64	3.92	1.789
その他	11,129	5.5	8.67	9.50	1.698
北米	10,778	5.7	4.87	4.66	1.873
米国	11,742	4.9	6.64	6.62	1.664
カナダ	6,621	7.1	22.34	28.48	1.967
欧州	10,580	7.8	4.01	4.74	1.711
ドイツ	9,789	5.0	0.00	0.00	0.756
アジア・オセアニア	9,664	5.0	7.25	8.68	1.681
オーストラリア	8,918	4.7	16.34	19.95	1.794
ニュージーランド	13,784	6.7	3.90	3.63	1.642
複合地域	8,364	5.9	1.11	1.20	1.674
エマージング株式	11,902	8.2	3.33	4.11	1.822
グローバル	10,971	6.1	2.53	3.08	1.579
BRICS	13,445	11.3	1.01	1.02	2.033
その他	12,208	8.9	3.70	4.60	1.907
欧州	8,641	13.0	0.19	0.19	1.967
ロシア	9,043	10.0	0.48	0.46	1.968
アジア・オセアニア	12,718	8.9	8.98	11.06	1.699
中国	17,657	9.1	0.78	0.90	1.940
インド	12,452	9.2	1.18	1.20	2.043
インドネシア	10,822	7.8	0.30	0.30	1.823
タイ	11,584	10.9	0.55	0.61	1.686
フィリピン	11,215	5.6	0.43	0.43	1.765
ベトナム	12,284	3.6	1.04	1.36	1.832
韓国	10,586	4.9	3.08	3.74	1.774
香港	16,282	9.6	1.91	1.90	0.842
台湾	13,240	7.9	0.89	1.05	1.698
中南米	7,928	12.2	0.00	0.00	2.004
ブラジル	6,695	8.9	13.49	22.71	1.831
メキシコ	8,061	5.3	0.00	0.00	1.884
中東・アフリカ	10,114	9.5	0.35	0.40	2.089
南アフリカ	8,696	8.7	0.00	0.00	1.577
トルコ	5,867	12.7	0.00	0.00	2.009
複合地域	17,991	10.8	2.75	2.95	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(%)=(予想分配金×(決算回数÷実績計算回数))÷当月末の基準価額×100

<5> 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	11,328	7.8	4.25	4.56	1.314
外国債券(先進国)	9,721	7.2	3.21	3.38	1.140
グローバル	10,138	7.4	2.16	2.25	1.091
除く日本	10,748	9.9	2.18	2.25	0.877
含む日本	9,713	5.7	2.14	2.24	1.337
その他	8,883	6.9	6.02	6.39	1.269
北米	10,117	4.9	1.83	1.84	1.808
米国	9,469	5.7	4.37	4.56	1.311
カナダ	7,622	6.7	7.10	7.40	1.341
欧州	8,385	9.9	1.89	1.84	1.061
アジア・オセアニア	7,954	8.4	4.82	5.09	1.398
オーストラリア	8,144	9.6	7.62	8.28	1.234
ニュージーランド	9,596	4.5	3.31	3.30	1.318
複合地域	5,726	9.3	5.51	5.70	1.175
エマーシング債券	8,598	7.7	8.01	9.05	1.584
グローバル	8,847	8.5	7.27	8.68	1.580
米ドル建て	8,936	8.8	7.72	9.21	1.620
現地通貨建て	8,506	7.3	5.34	6.35	1.406
その他	8,164	6.3	8.65	9.36	1.587
ロシア	8,095	6.1	5.60	6.38	1.589
アジア・オセアニア	8,383	6.5	11.88	13.15	1.618
インド	9,315	4.4	8.64	9.38	1.674
インドネシア	7,300	6.7	6.52	7.08	1.652
ブラジル	8,874	9.2	8.75	10.49	1.562
メキシコ	6,333	6.3	9.20	10.28	1.372
南アフリカ	7,131	6.9	5.98	7.57	1.404
トルコ	3,046	6.2	8.77	15.28	1.428
複合地域	4,202	12.6	5.26	5.71	1.188
ハイールド債券	8,628	8.0	9.29	10.32	1.677
グローバル	7,212	8.0	8.05	9.23	1.593
北米	9,487	8.9	8.97	9.58	1.675
その他	7,984	6.2	11.33	13.66	1.749
欧州	7,524	5.9	11.78	14.44	1.730
アジア・オセアニア	8,587	6.9	10.66	11.93	1.849
複合地域	4,536	15.0	5.16	5.29	1.780
複合資産	11,510	7.6	1.61	1.70	1.117
安定	10,933	7.0	0.73	0.78	1.186
安定成長	11,161	7.9	2.46	2.63	1.133
成長	12,959	7.7	0.27	0.28	1.017
国内バランス	10,895	7.2	2.25	2.29	0.948
安定	10,596	7.9	2.36	2.40	0.914
一般	11,243	8.4	1.03	1.08	1.364

(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

< 5 > 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	11,328	7.8	4.25	4.56	1.314
国内REIT	13,371	7.3	10.13	10.19	0.958
日本	13,371	7.3	10.13	10.19	0.958
外国REIT	10,924	6.3	13.18	12.93	1.554
グローバル	11,666	7.3	11.18	11.20	1.419
除く日本	13,984	6.1	4.28	4.60	1.086
含む日本	10,545	7.9	12.70	12.66	1.493
北米	10,042	6.0	15.07	14.58	1.602
その他	10,695	5.0	11.33	11.28	1.808
欧州	9,097	4.6	5.67	6.45	1.834
アジア・オセアニア	12,225	4.9	13.73	13.74	1.860
オーストラリア	9,830	4.3	6.30	5.82	1.689
複合地域	7,259	7.1	1.45	1.43	0.845
複数国	11,444	12.0	3.07	2.56	1.627
その他					
絶対収益型	10,064	5.4	0.15	0.17	1.596
ロング・ショート	10,049	6.0	0.47	0.50	1.633
マーケットニュートラル	10,528	4.1	0.03	0.09	1.210
GTAA	10,501	6.5	0.64	0.68	1.625
その他スタイル	9,754	4.8	0.04	0.04	1.660
CB	10,624	6.1	1.08	1.16	1.487
欧州	6,081	5.0	8.73	11.37	1.751
アジア・オセアニア	8,355	8.8	3.67	3.71	1.804
日本	10,955	7.9	0.18	0.18	1.051
グローバル	10,996	6.0	1.03	1.11	1.499
コモディティ	7,898	6.6	0.01	0.01	0.902
全業種	6,168	7.6	0.00	0.00	1.240
貴金属	9,092	5.9	0.02	0.02	0.565
エネルギー	9,474	10.1	0.00	0.00	1.059
その他コモディティ	11,432	2.5	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 : <https://www.mab.jp/business/information/mab-fpi/>

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