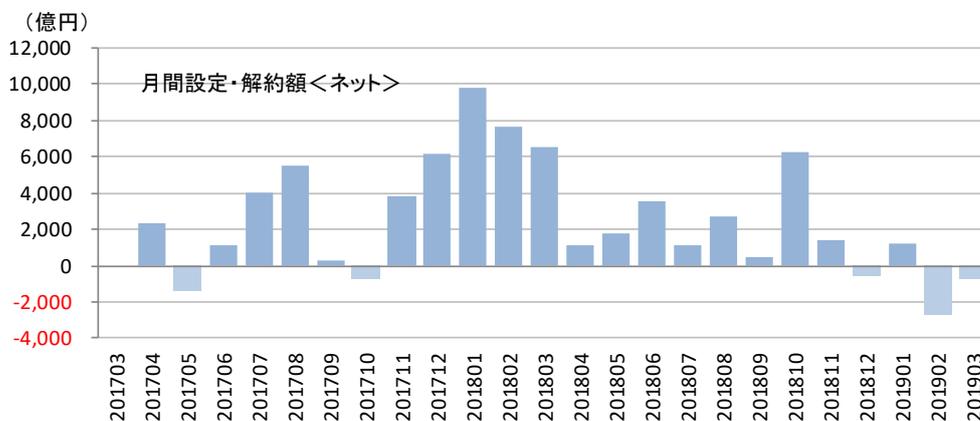
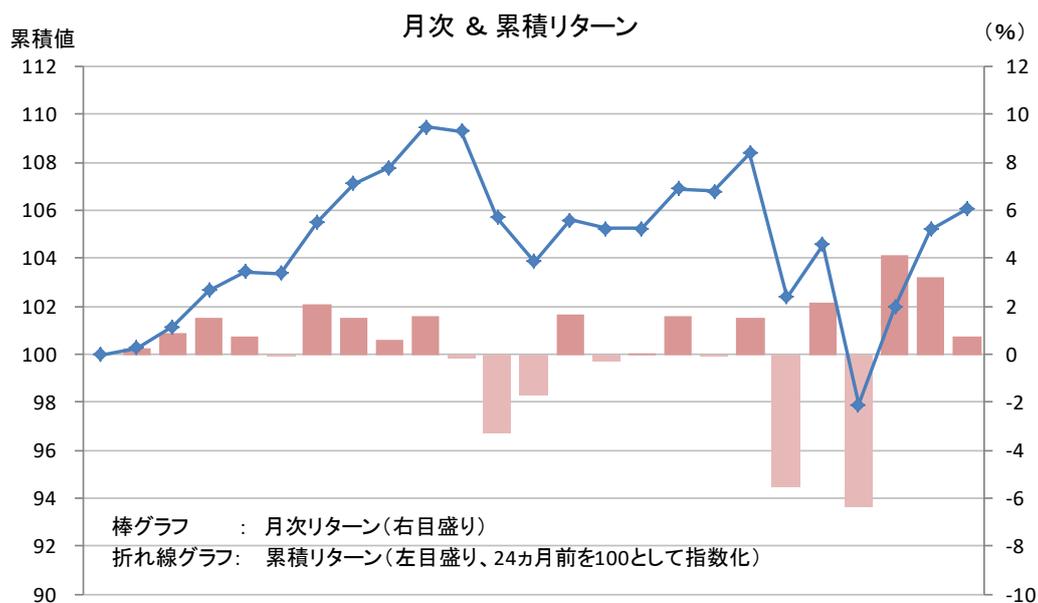


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ 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

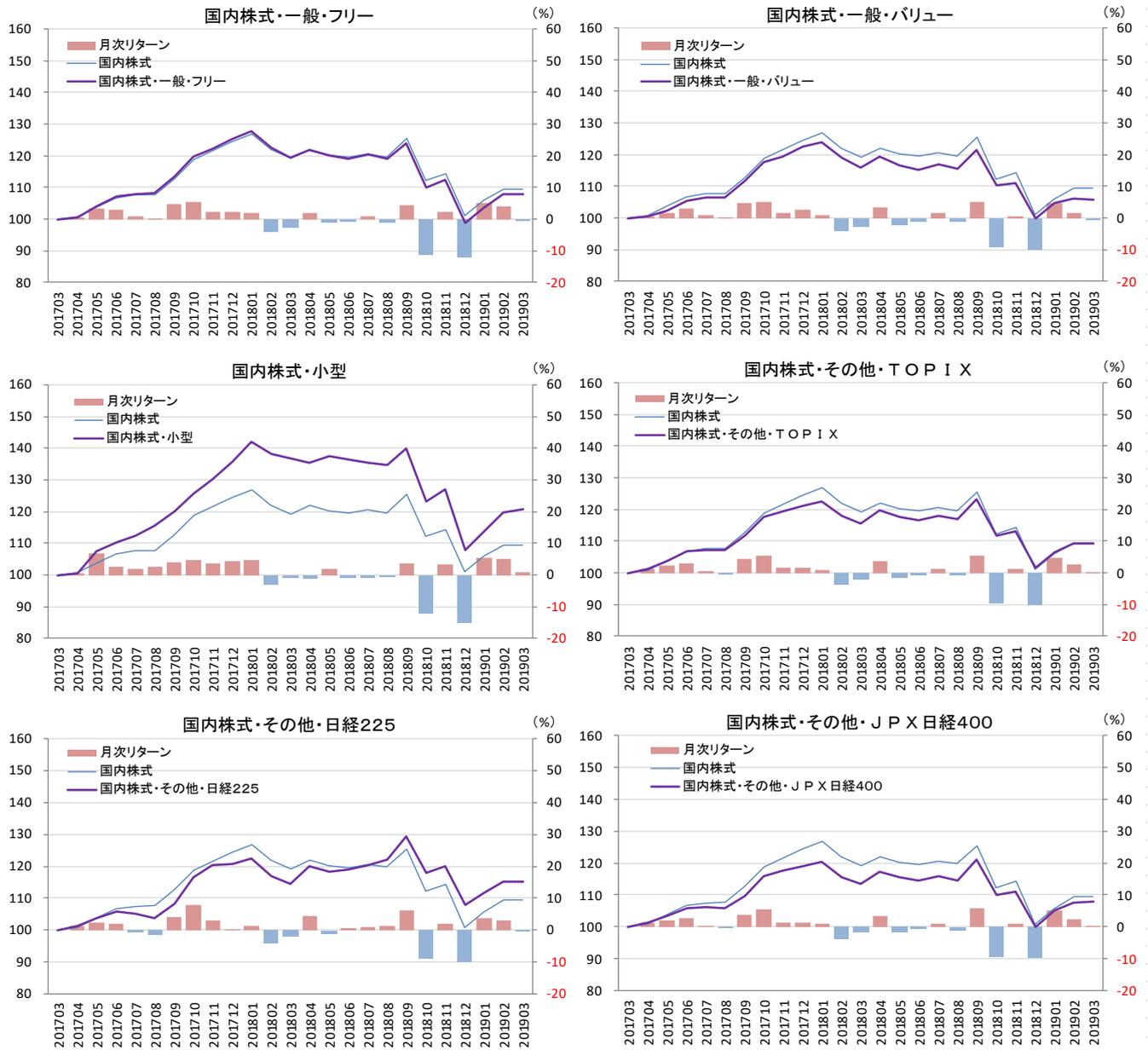
| | 3か月(%) | 6か月(%) | 1年(%) | 年初来(%) |
|-------------|--------|--------|--------|--------|
| 総合 | 8.32 | -2.16 | 2.09 | 8.32 |
| 国内REIT | 8.72 | 8.98 | 16.30 | 8.72 |
| 日本 | 8.72 | 8.98 | 16.30 | 8.72 |
| 外国REIT | 15.28 | 6.94 | 19.30 | 15.28 |
| グローバル | 14.05 | 5.19 | 16.70 | 14.05 |
| 除く日本 | 14.90 | 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

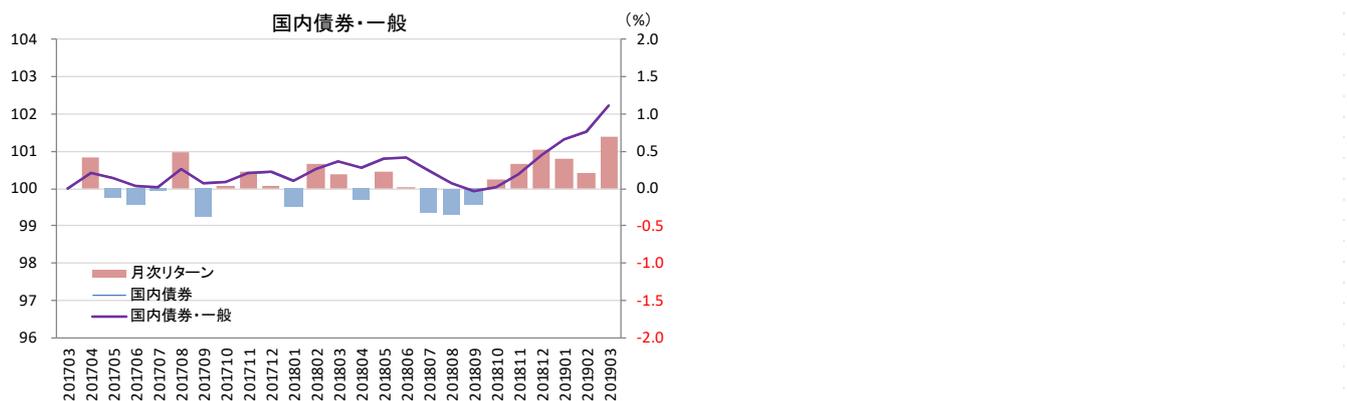
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

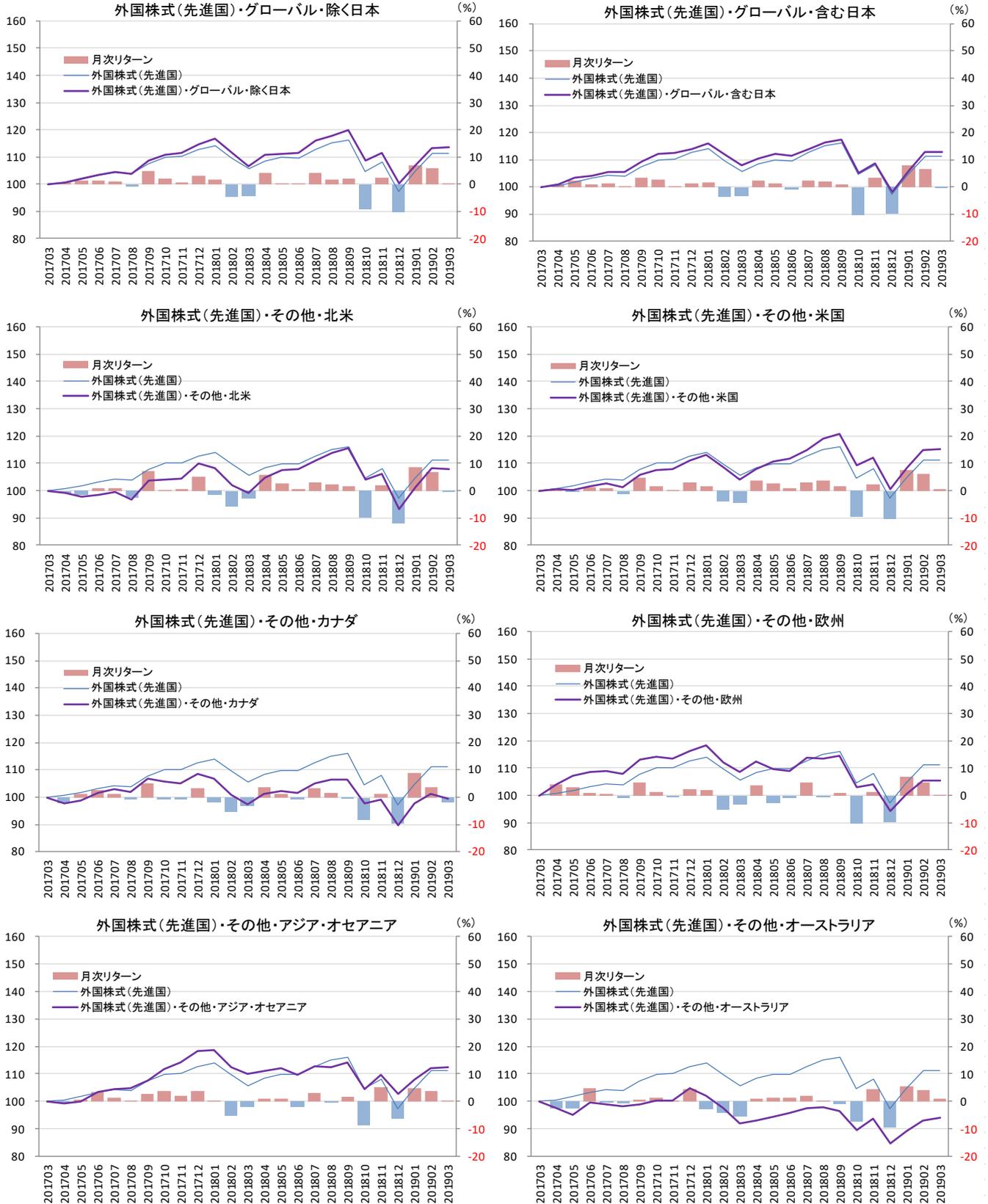


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

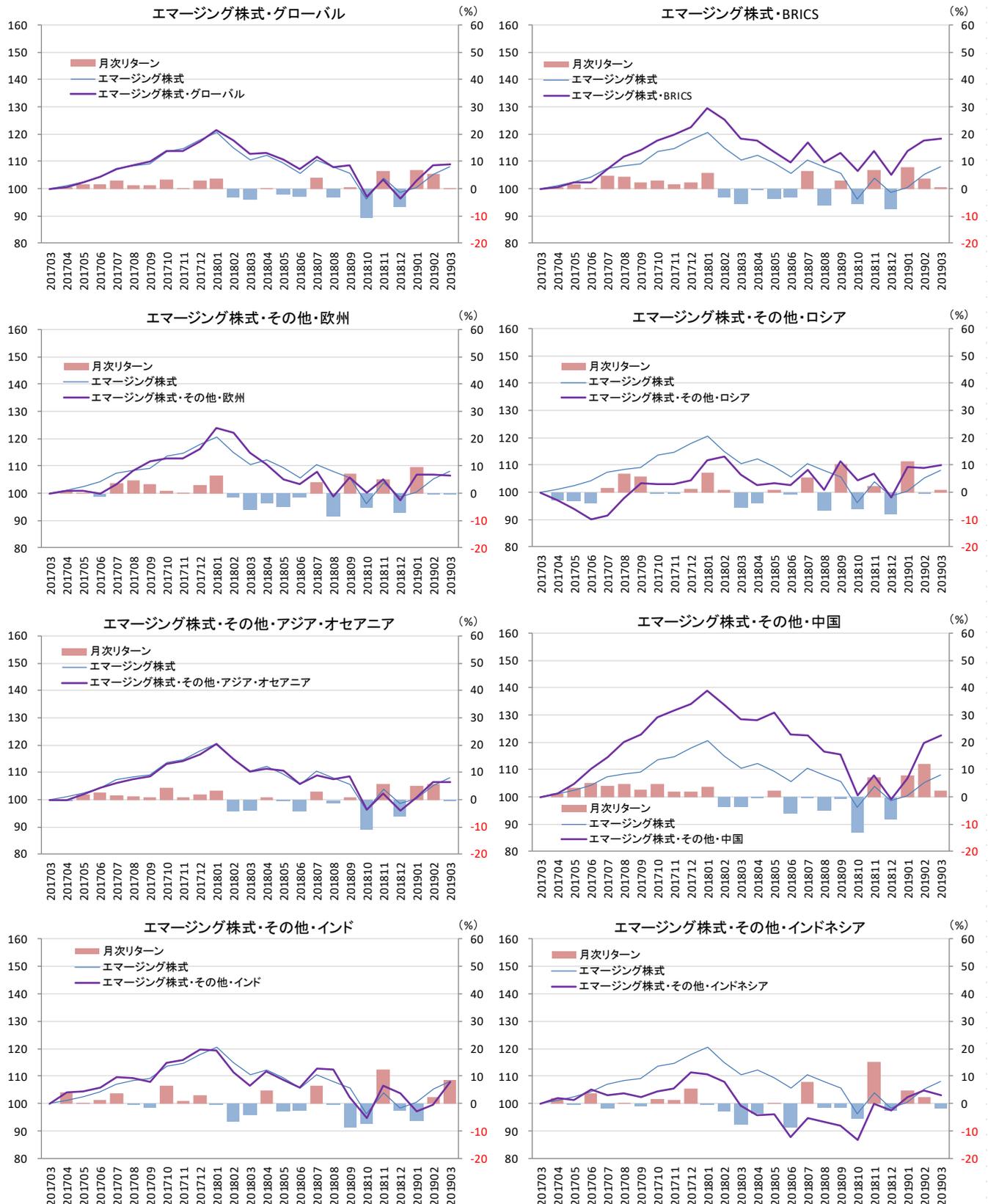


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

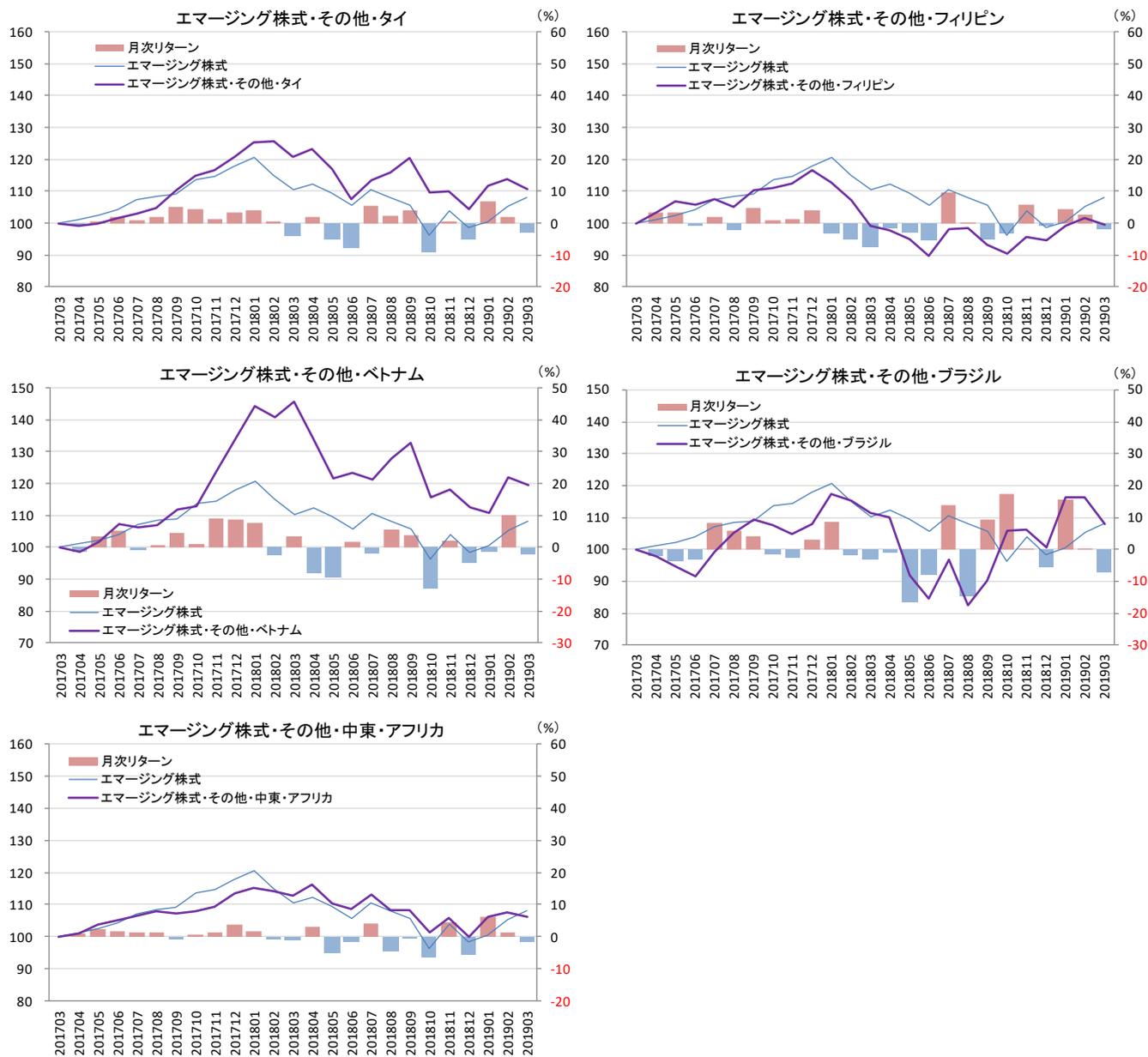


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

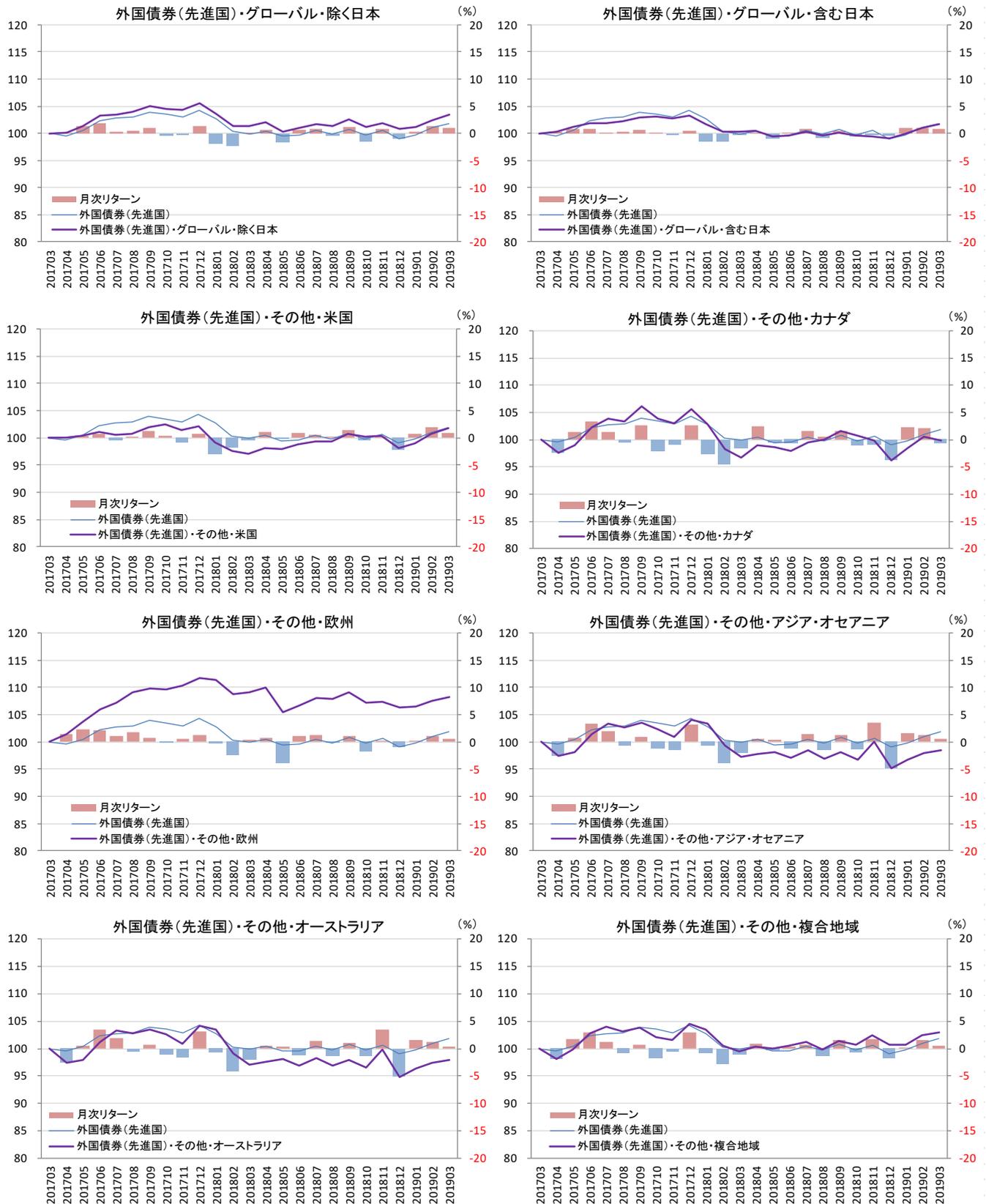


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

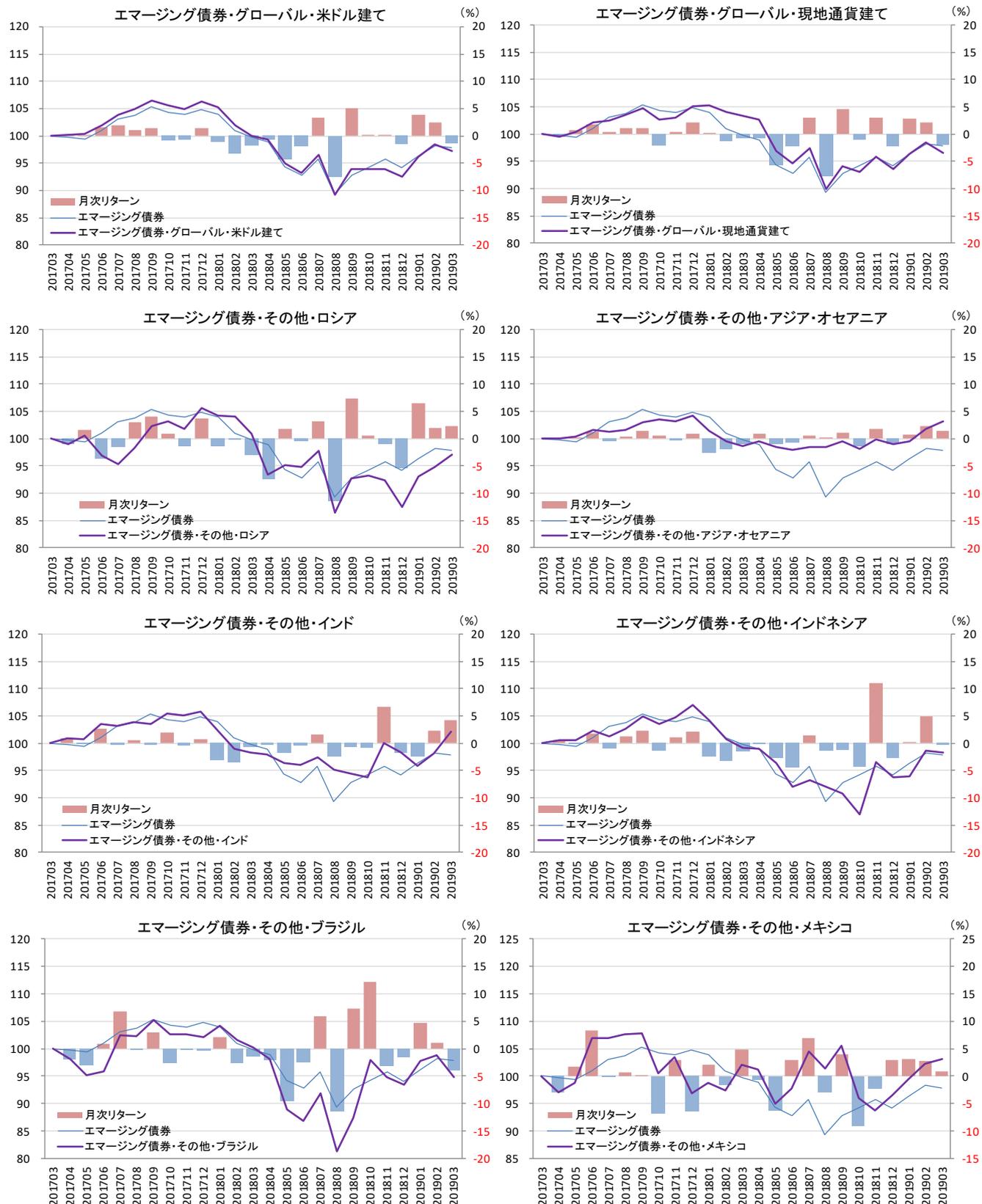


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

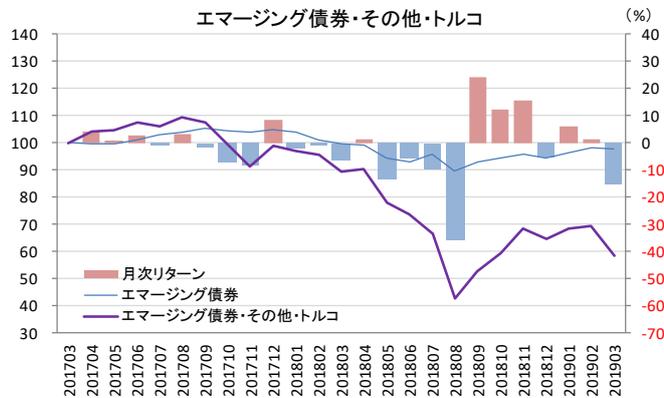


<1>パフォーマンス・サマリー

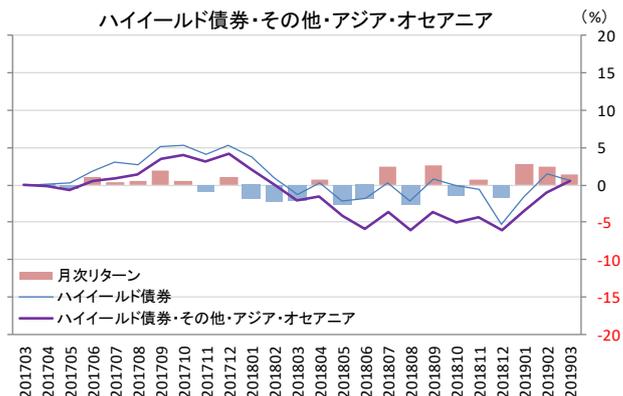
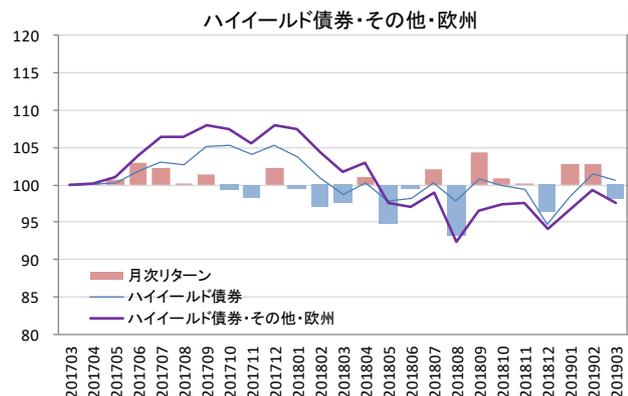
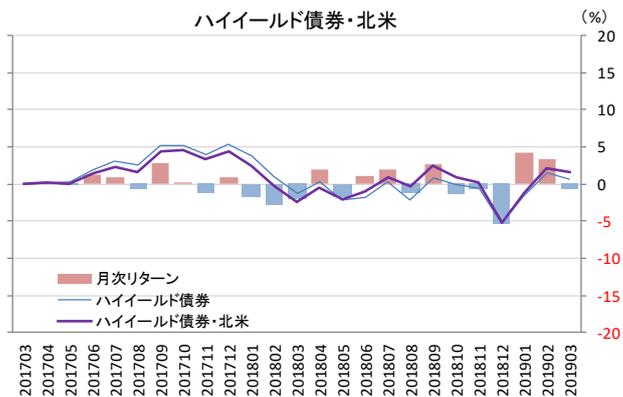
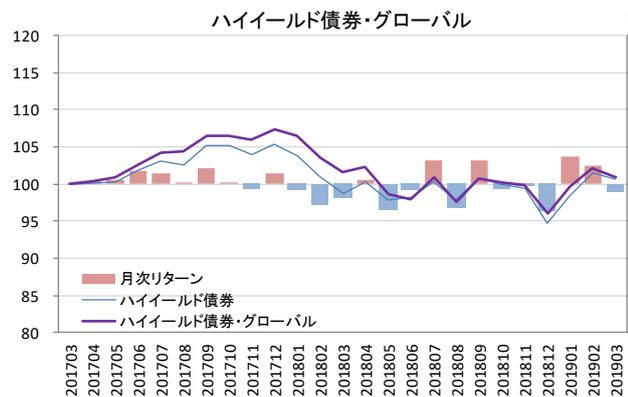
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

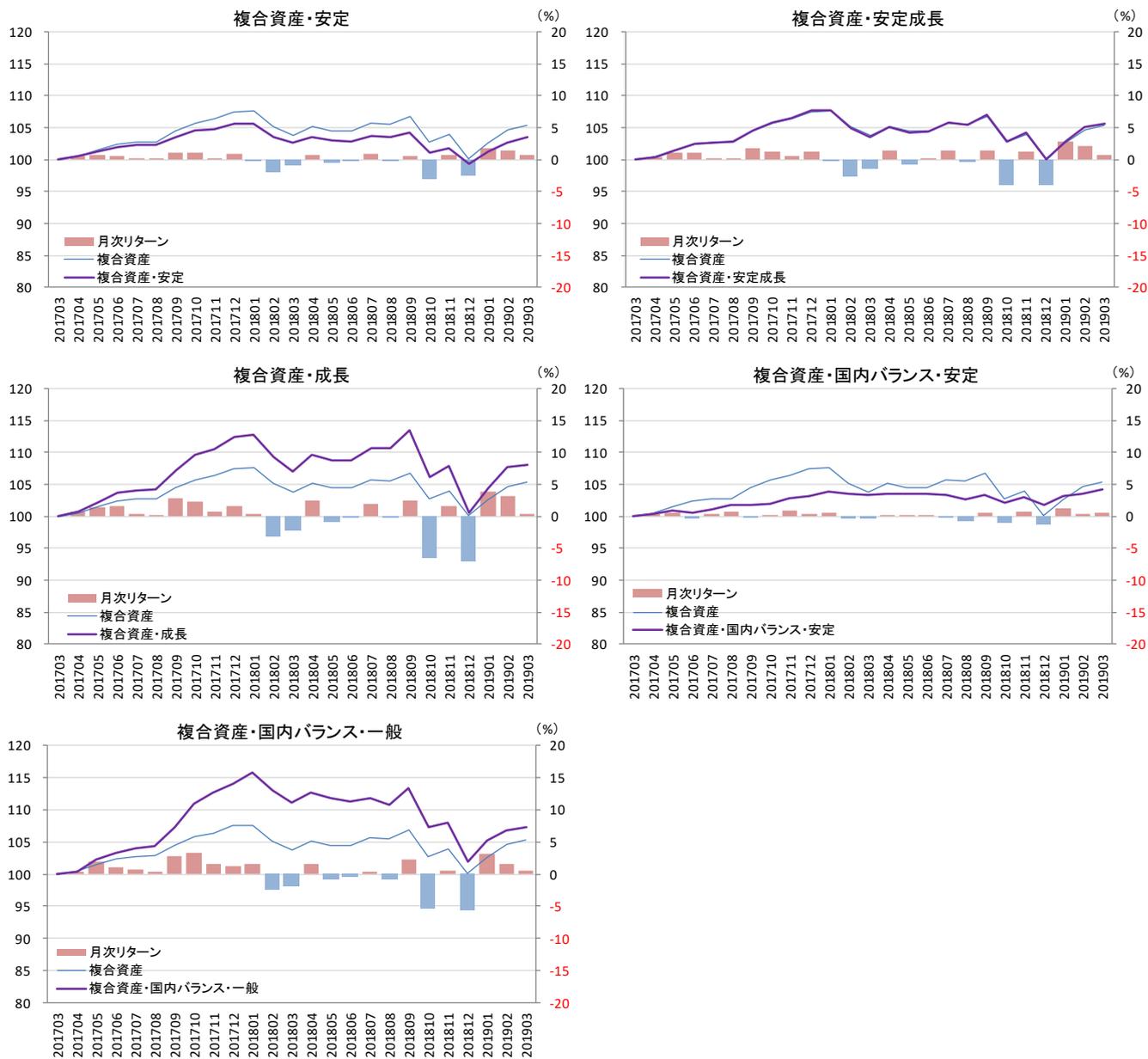


<1>パフォーマンス・サマリー

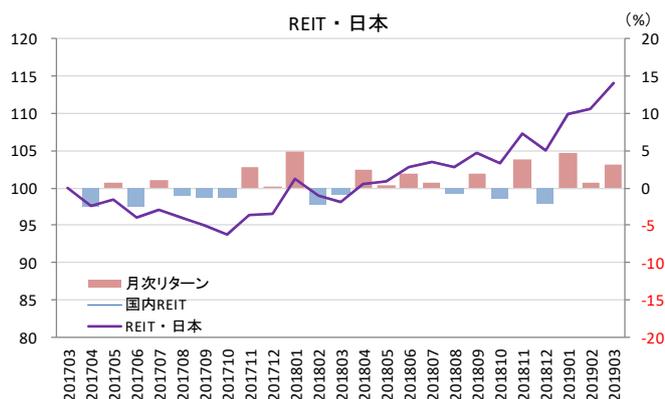
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

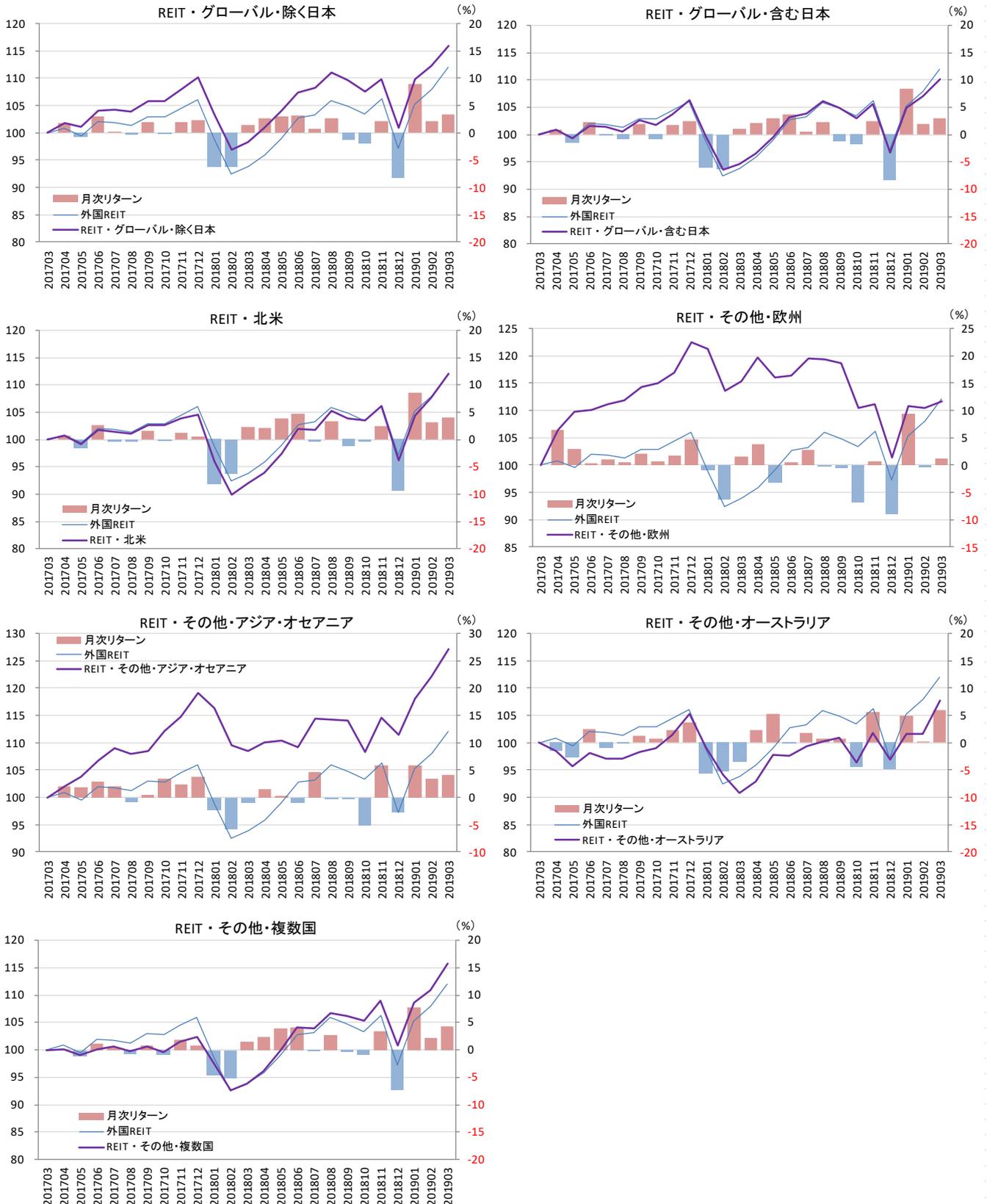


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

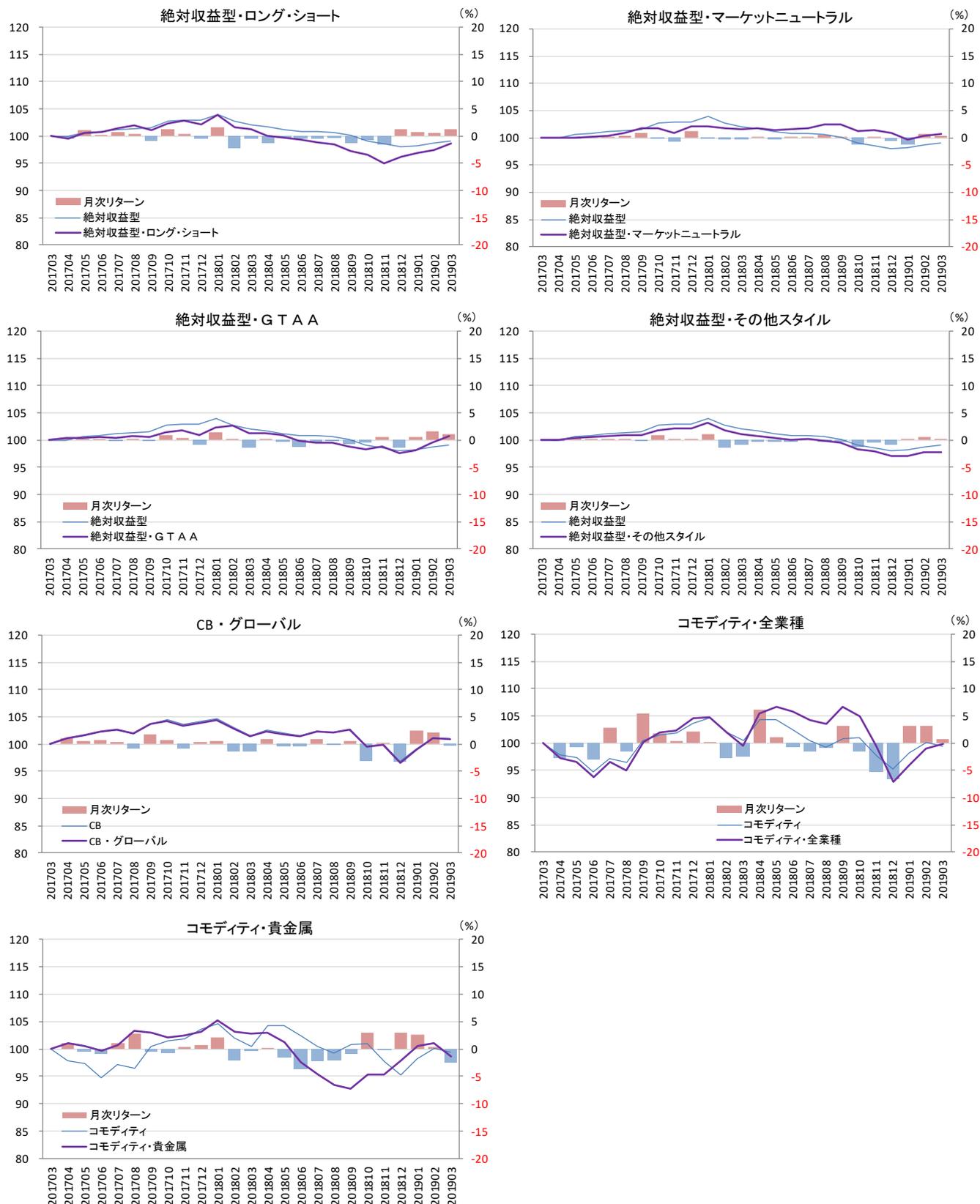


<1>パフォーマンス・サマリー

(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 | 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

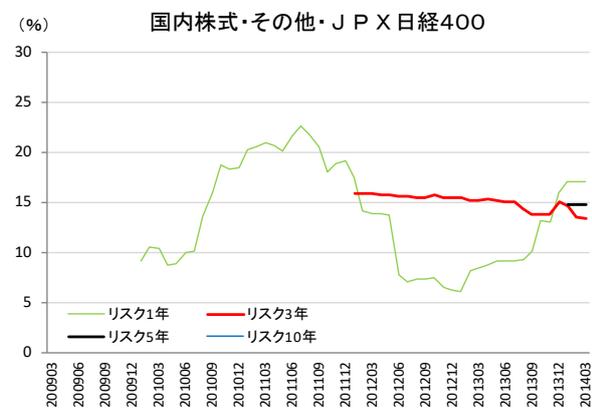
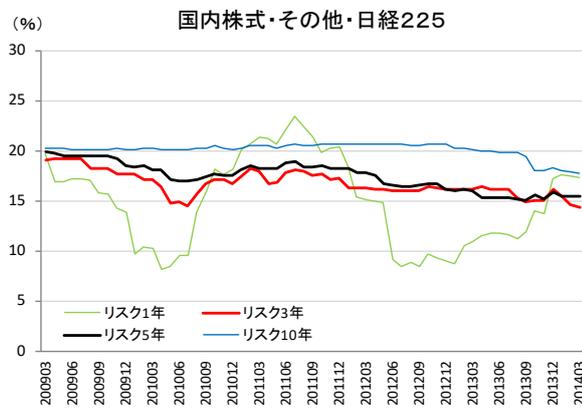
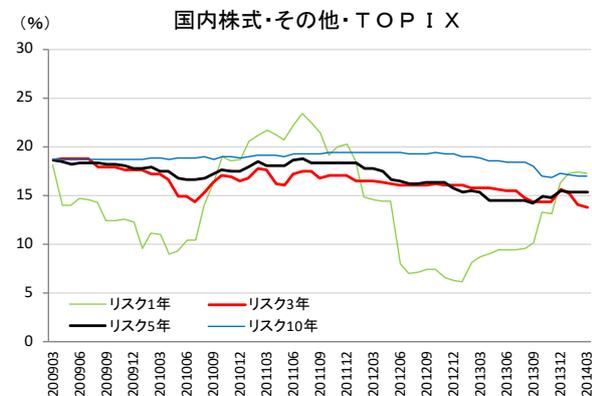
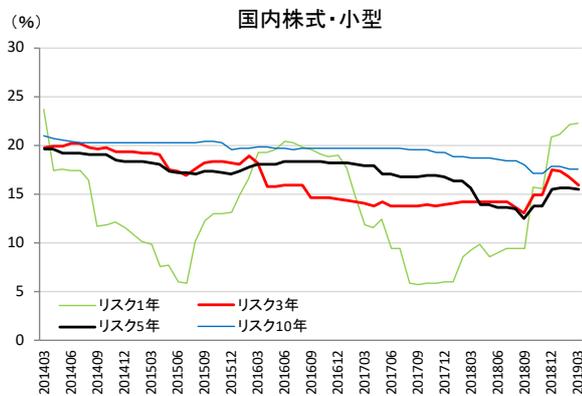
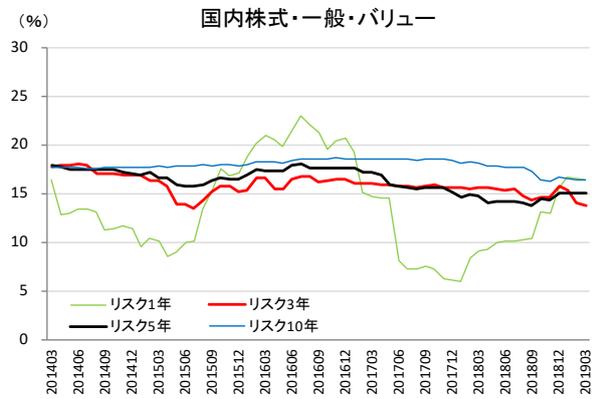
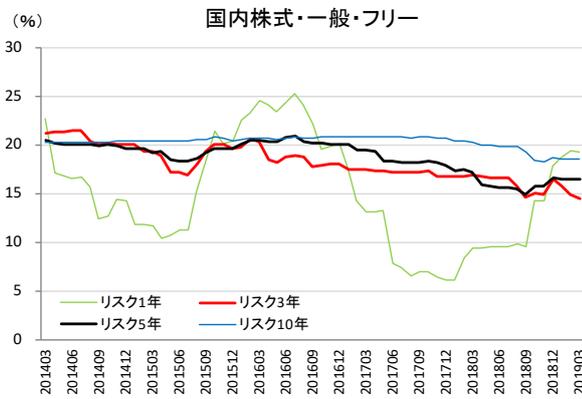
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

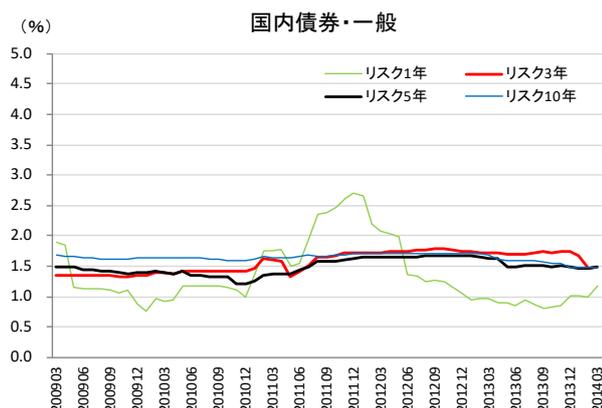
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

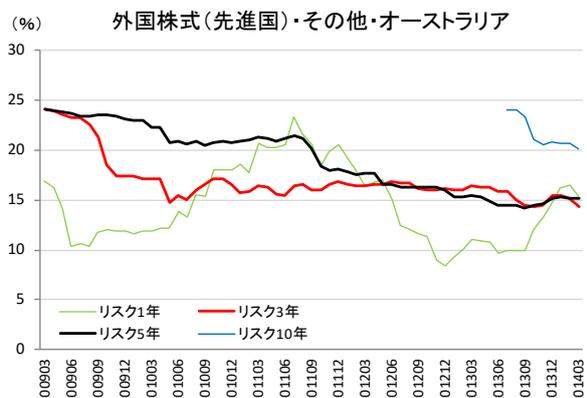
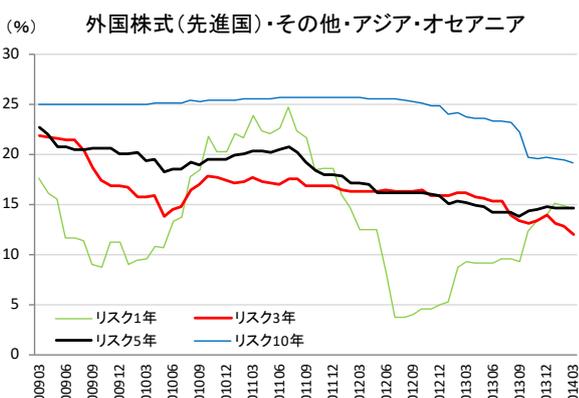
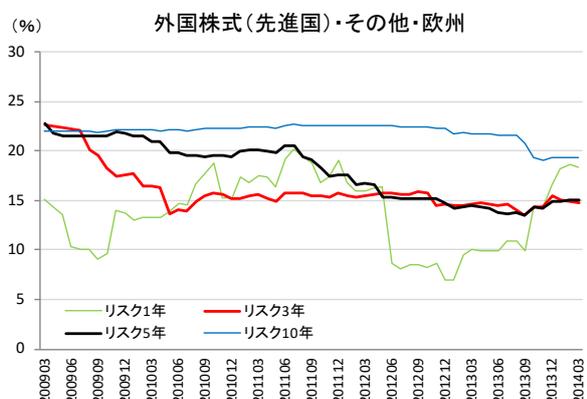
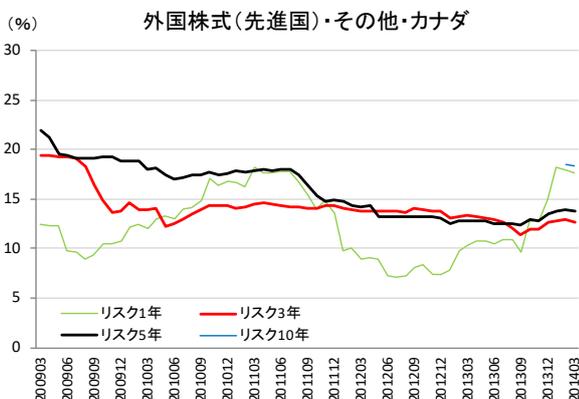
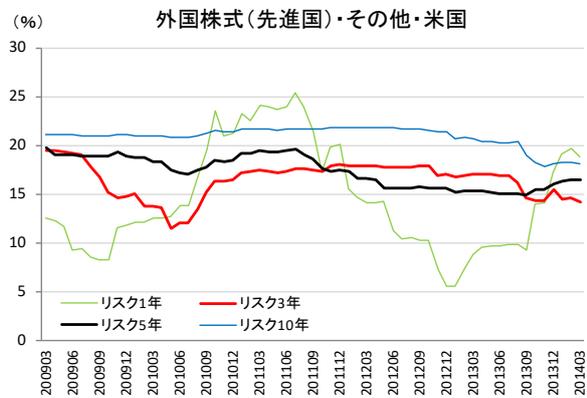
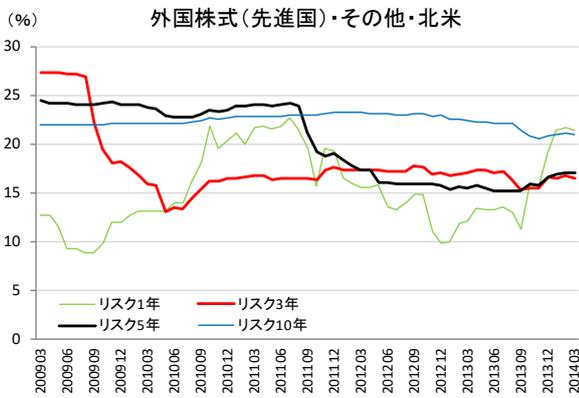
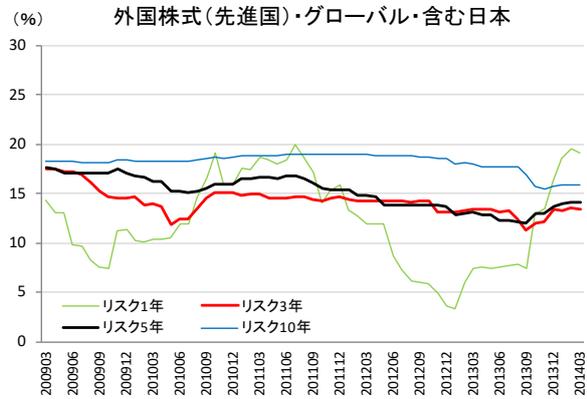
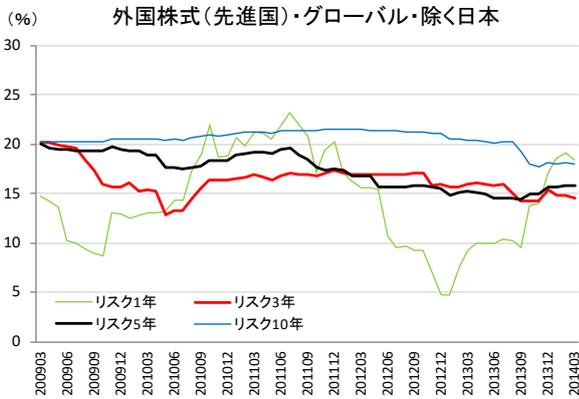


<2> リスク・サマリー

(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)]

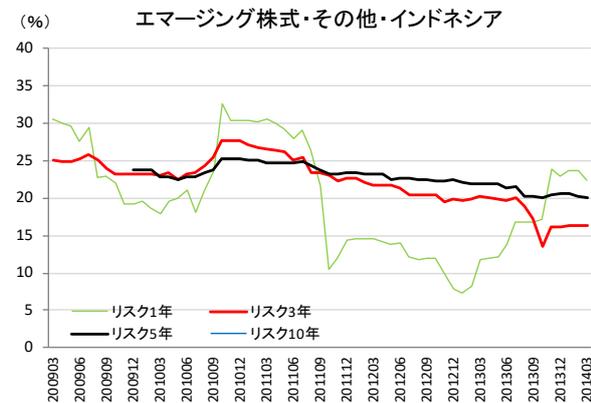
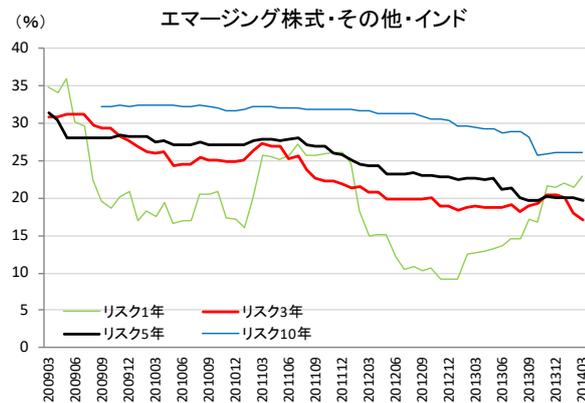
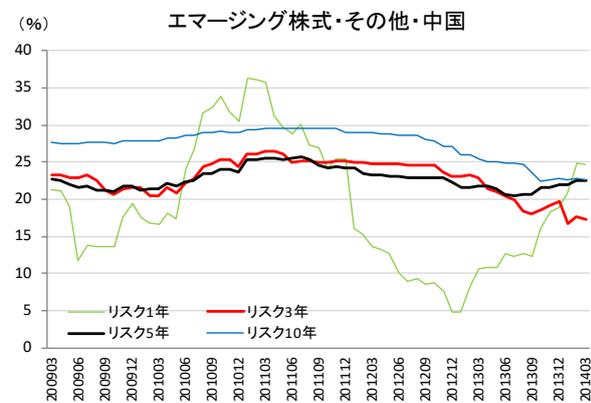
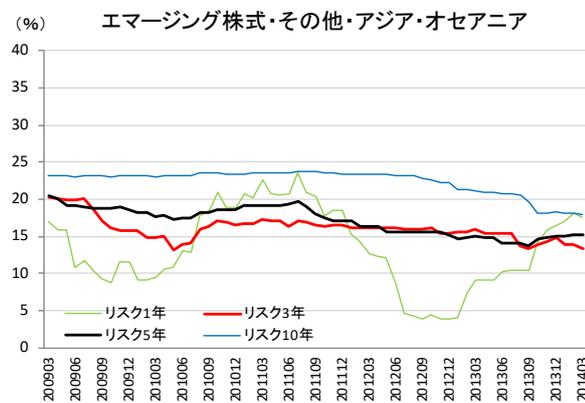
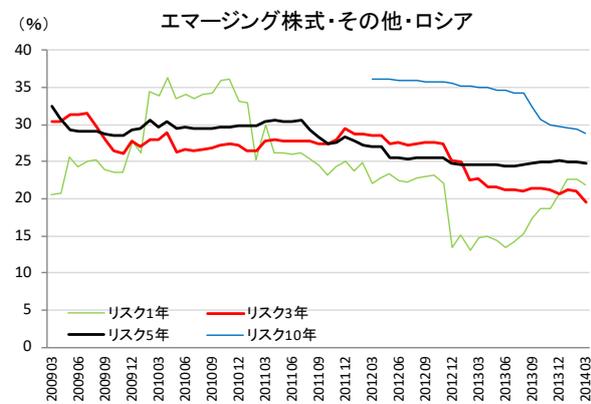
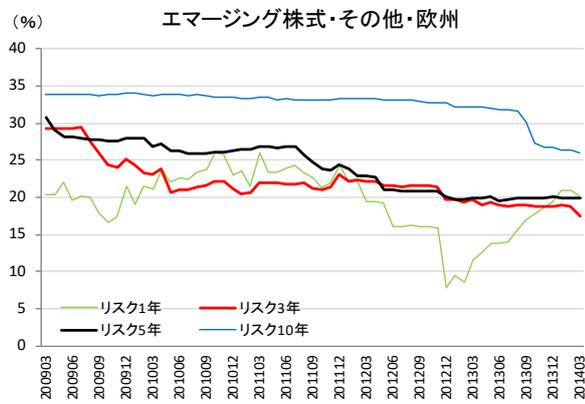
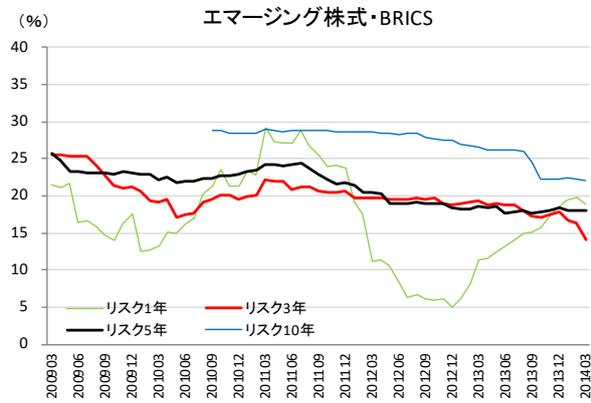
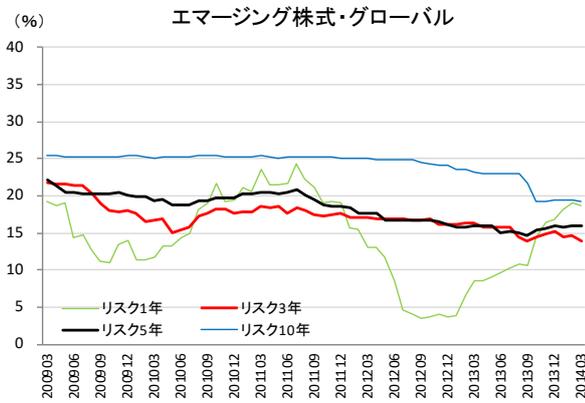


<2>リスク・サマリー

(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]

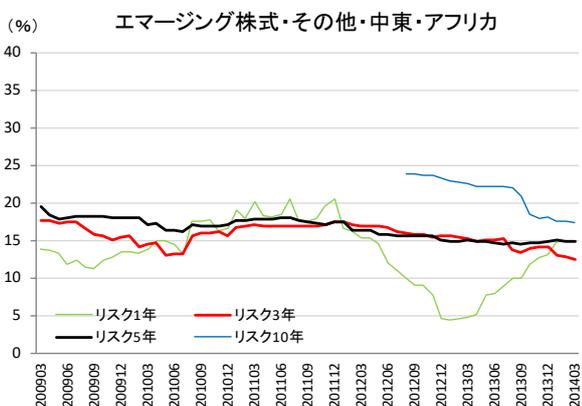
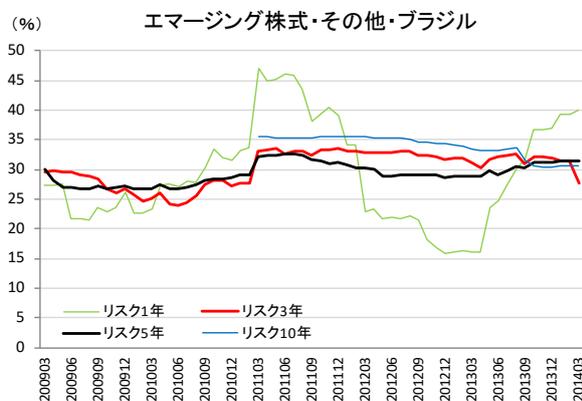
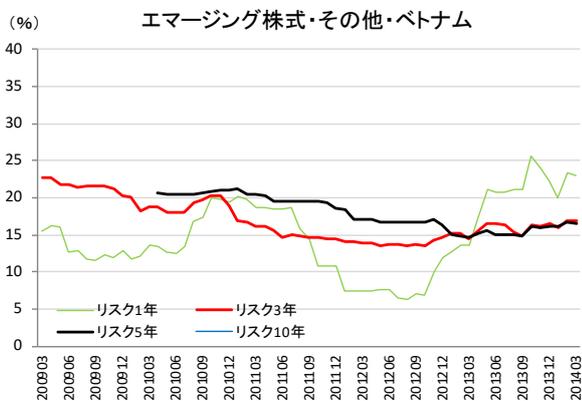
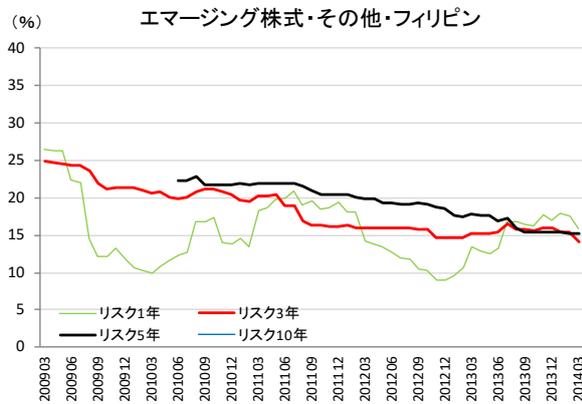
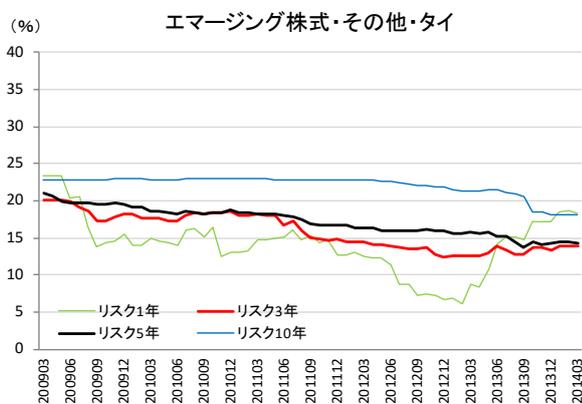


<2> リスク・サマリー

(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]

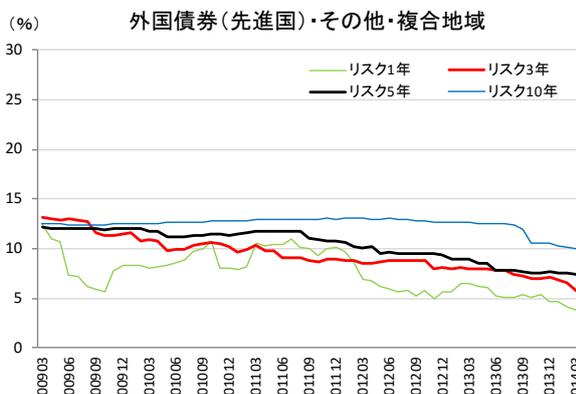
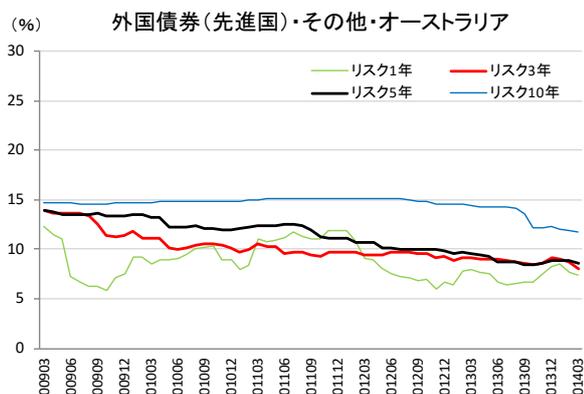
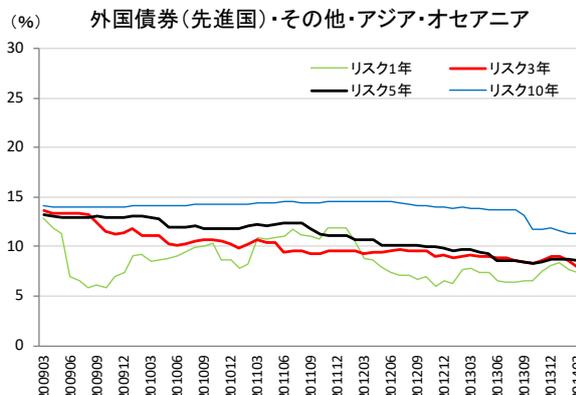
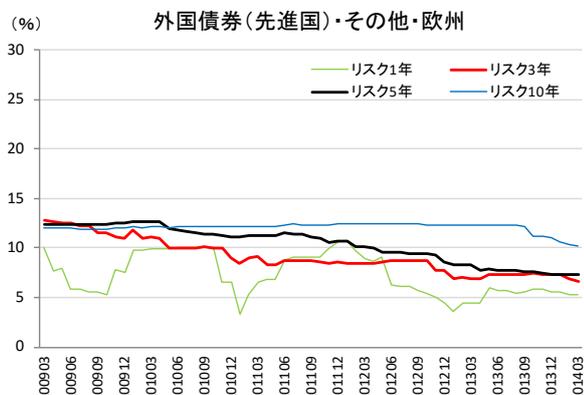
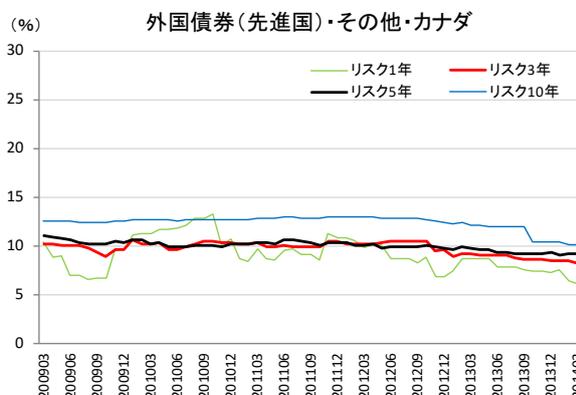
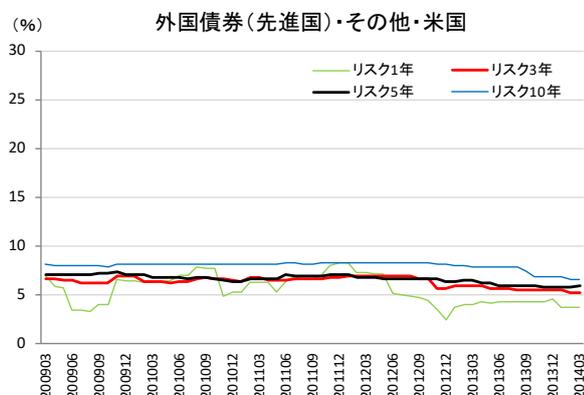
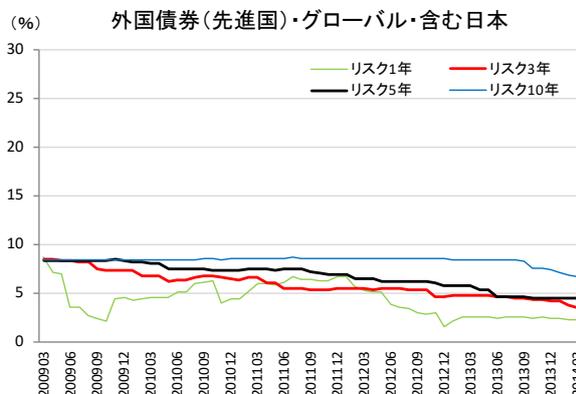
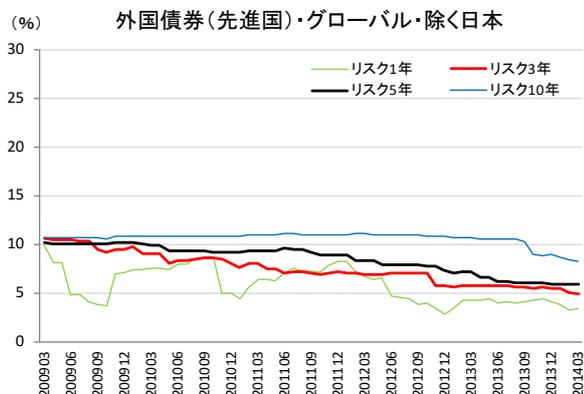


<2> リスク・サマリー

(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)]

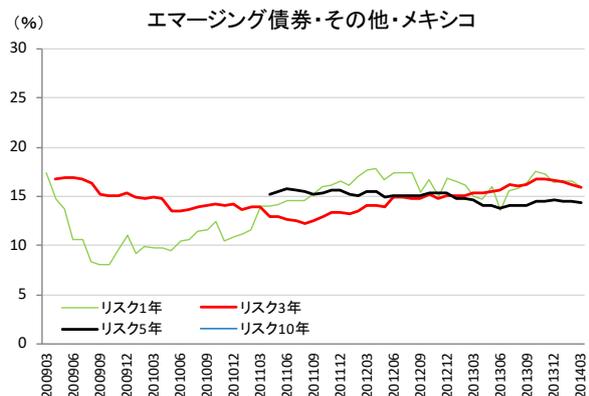
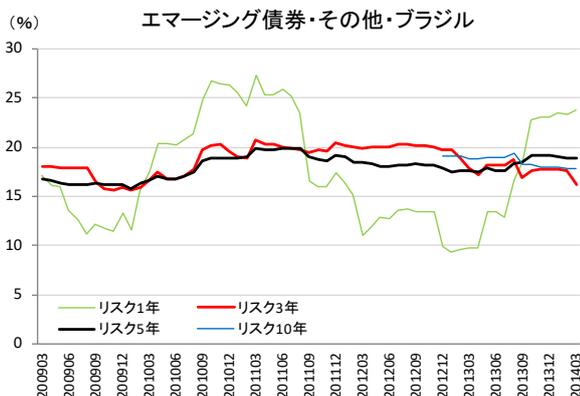
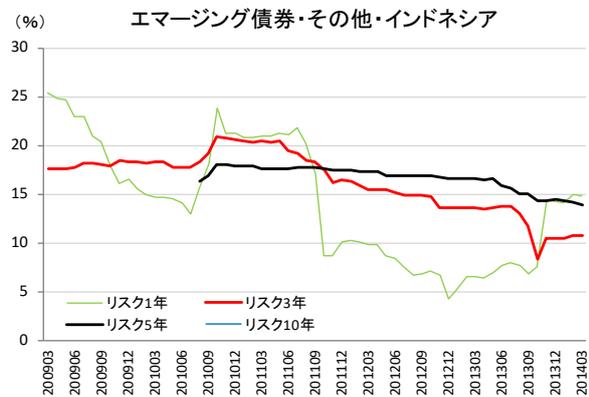
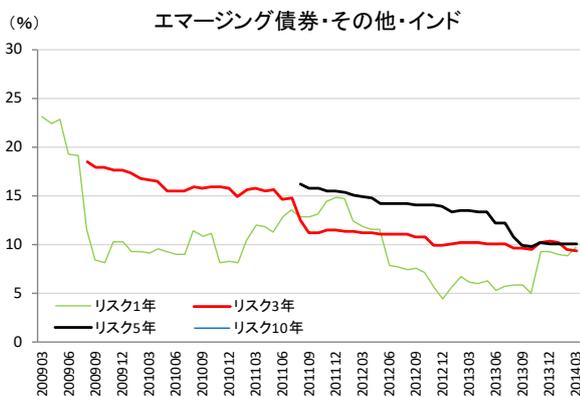
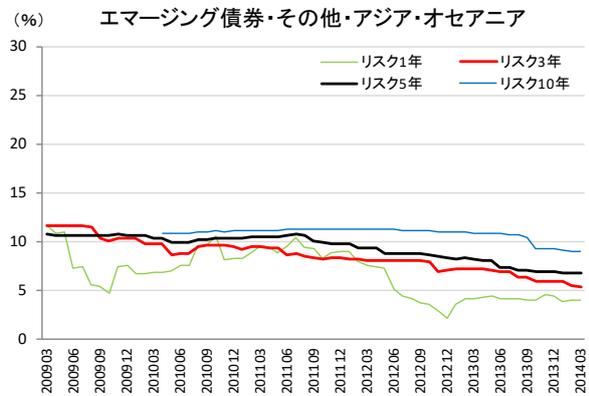
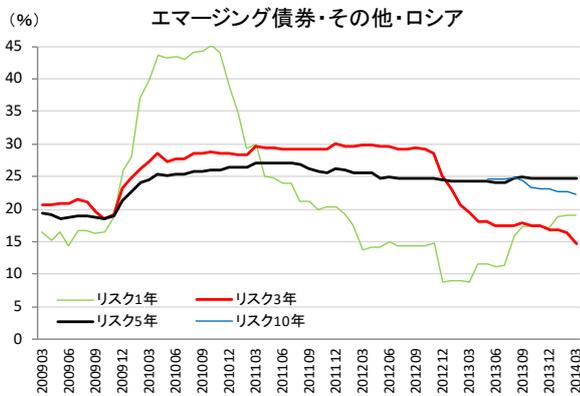
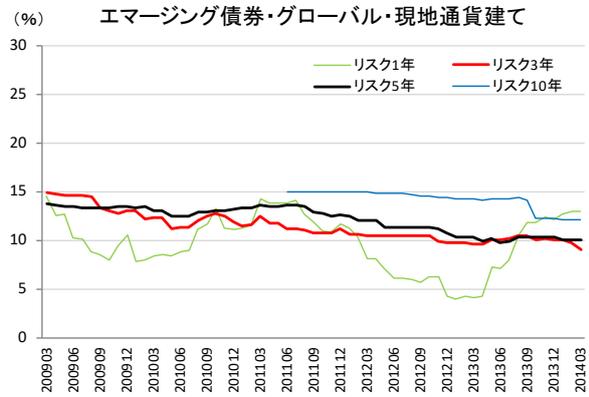
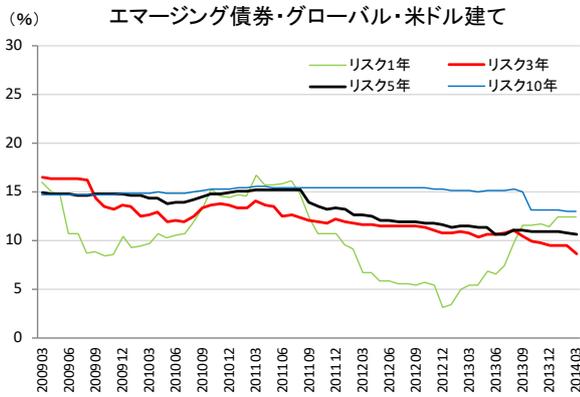


<2> リスク・サマリー

(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]

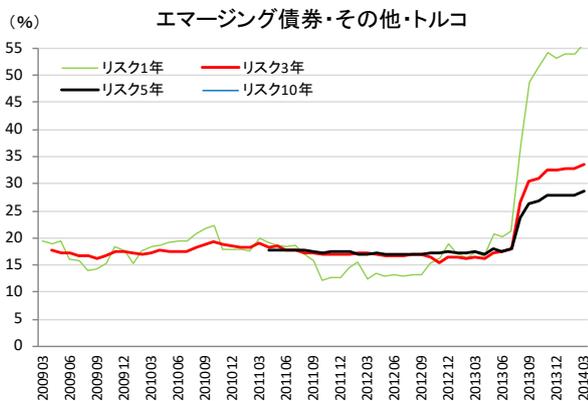


<2> リスク・サマリー

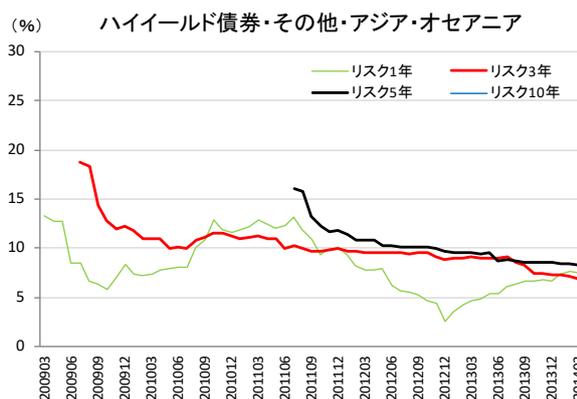
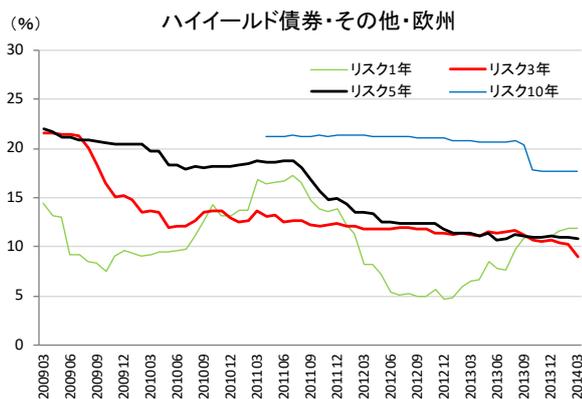
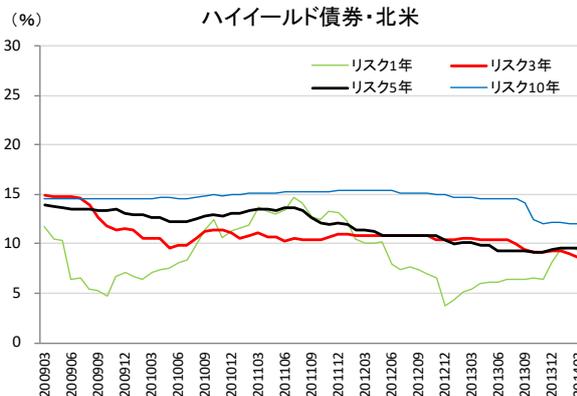
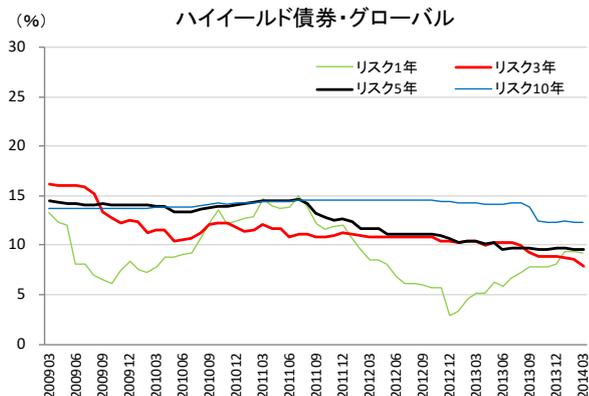
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

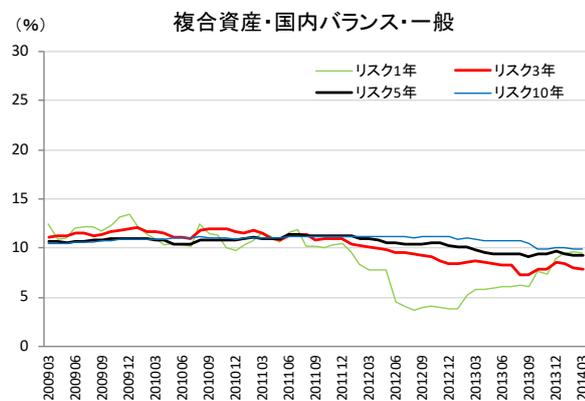
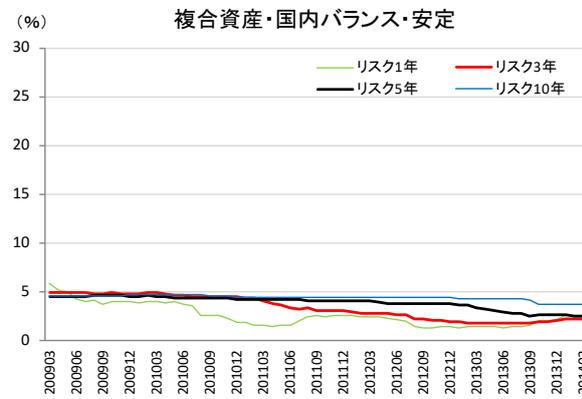
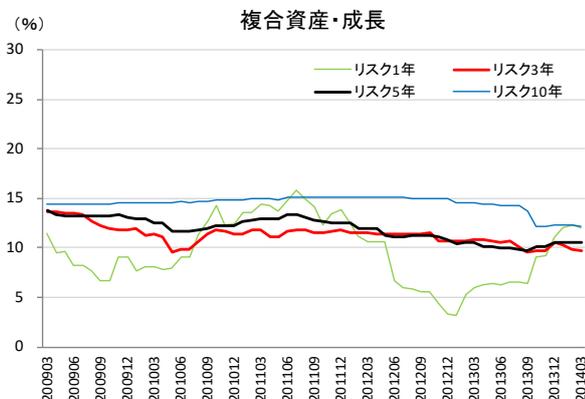
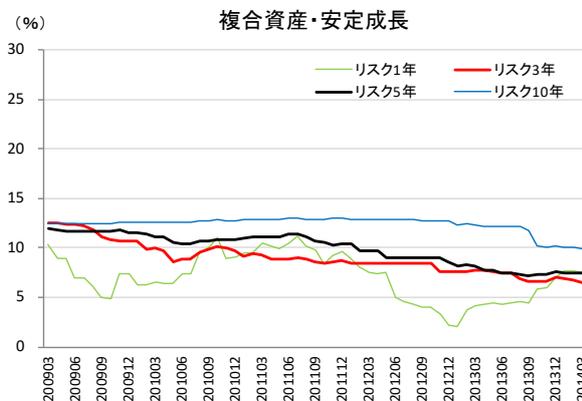
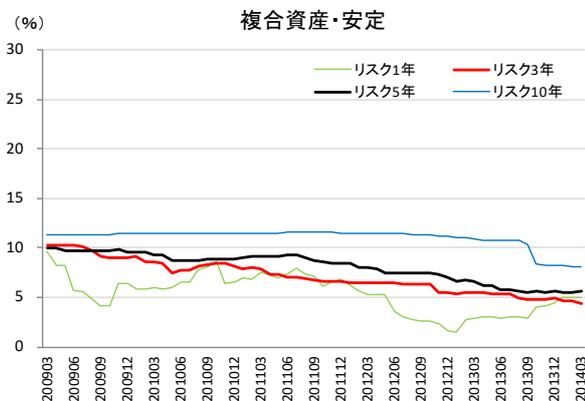


<2> リスク・サマリー

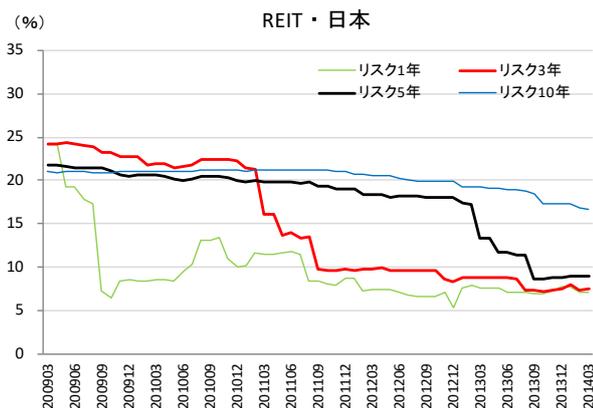
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

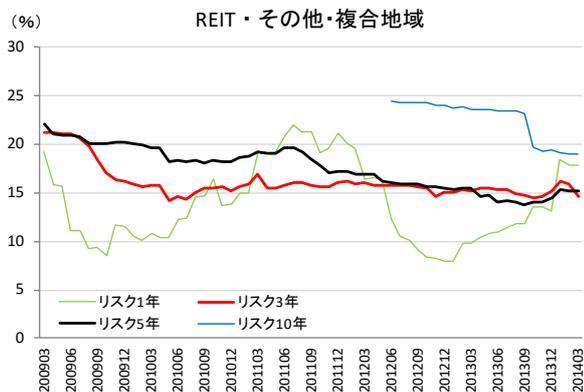
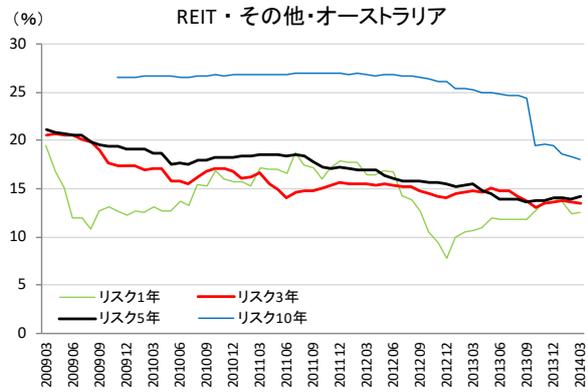
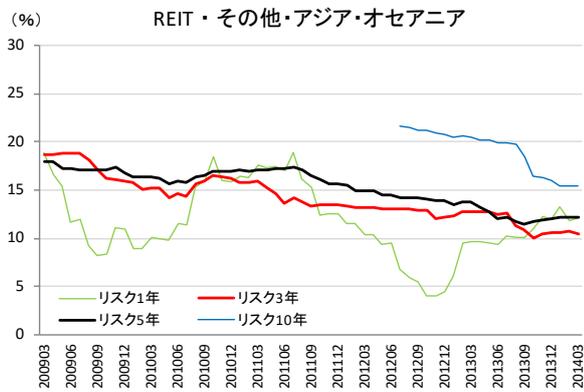
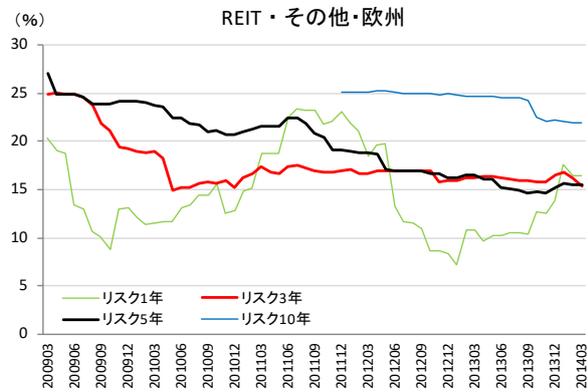
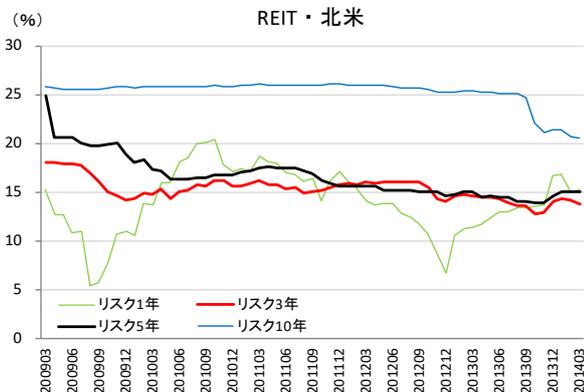
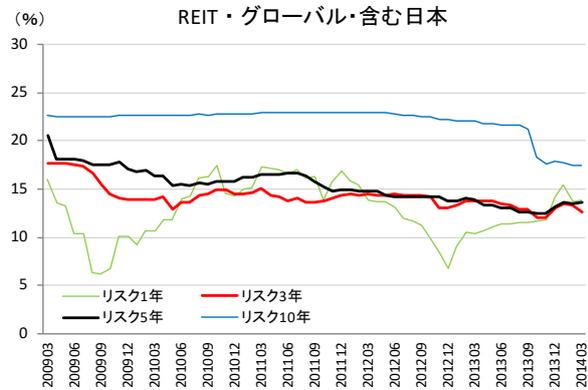
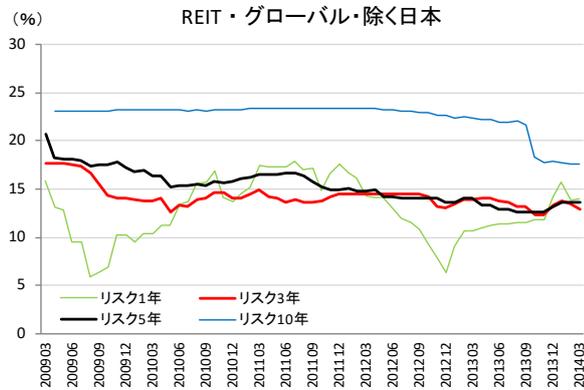


<2> リスク・サマリー

(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]

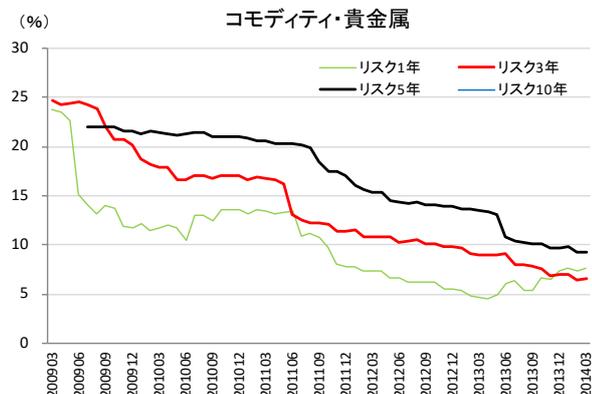
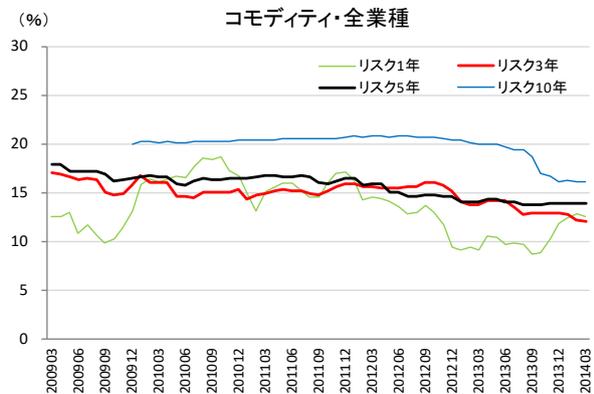
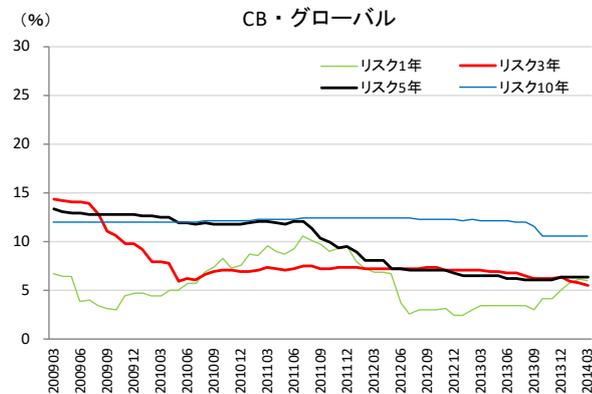
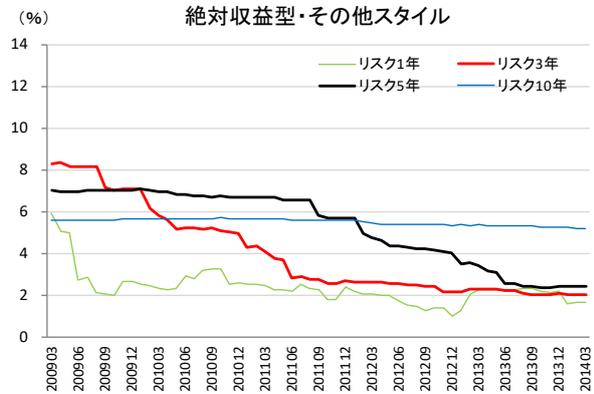
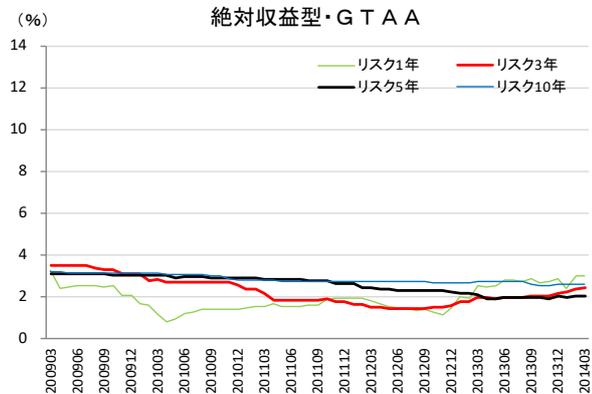
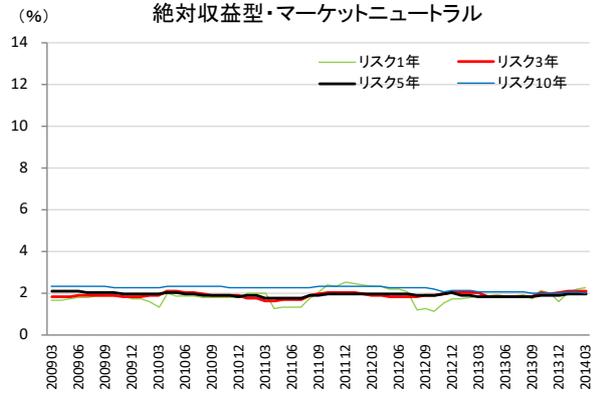
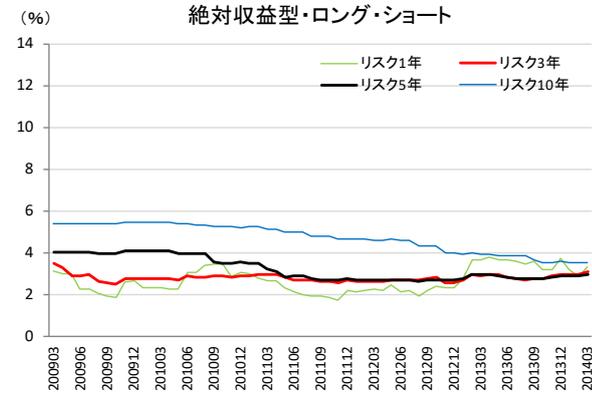


<2> リスク・サマリー

(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(%)=(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 |
| エマージング債券 | 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