

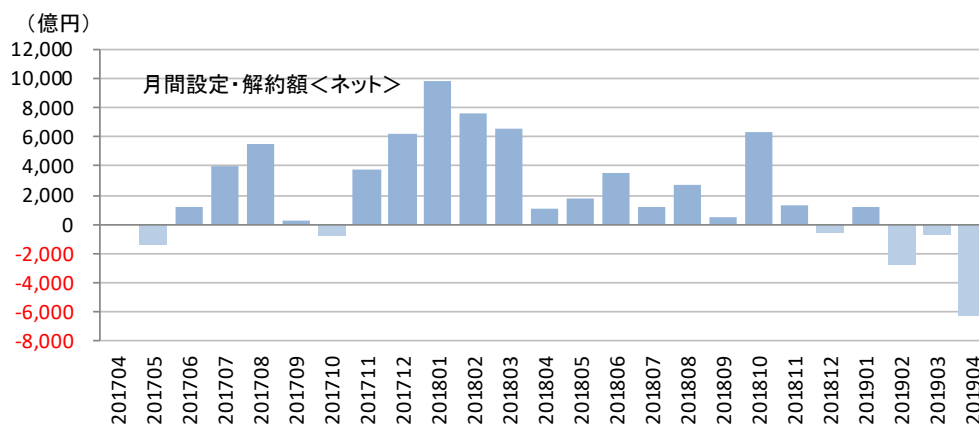
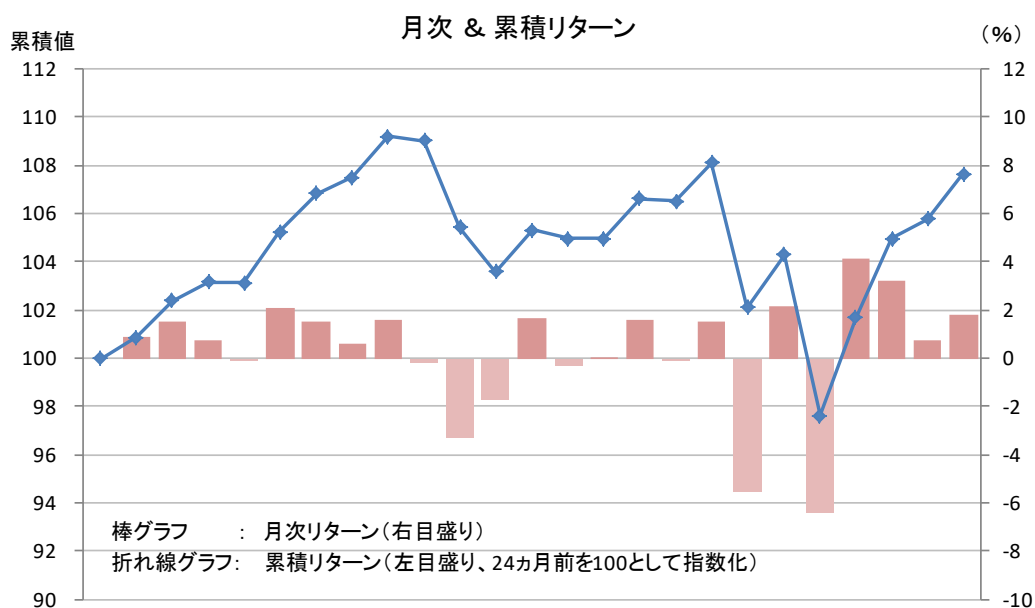
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2019年4月

「総合」 +1.79 %
(前月 +0.78 %)



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		12,912	12,685	227	1.79	
国内株式		15,465	15,014	452	3.01	
一般		15,095	14,673	422	2.88	
フリー		14,204	13,785	419	3.04	
バリュー		19,319	18,899	420	2.22	
小型		32,914	32,198	716	2.22	
その他		15,118	14,603	516	3.53	
日経225		14,463	13,783	679	4.93	
TOPIX		14,904	14,664	240	1.63	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	14,014	13,812	202	1.46	
国内債券		13,248	13,297	-49	-0.37	
一般		13,248	13,297	-49	-0.37	
外国株式(先進国)		14,553	13,981	572	4.09	
グローバル		16,020	15,395	624	4.06	
除く日本		22,582	21,614	968	4.48	
含む日本		14,565	14,013	552	3.94	
その他		11,565	11,096	468	4.22	
北米		11,619	11,195	423	3.78	
米国		17,118	16,343	775	4.74	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	16,611	16,307	304	1.86	
欧州		17,784	17,088	696	4.07	
ドイツ	8,368 (2014.04.01)	8,669	8,084	585	7.23	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	33,911	33,094	817	2.47	
オーストラリア	12,670 (2008.07.01)	15,718	15,327	392	2.56	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	33,924	33,458	466	1.39	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	9,473	9,131	343	3.75	
エマージング株式		14,800	14,467	332	2.30	
グローバル		14,386	13,837	550	3.97	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	23,279	22,431	848	3.78	
その他		15,433	15,185	248	1.63	
欧州		24,322	23,544	777	3.30	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	9,491	9,153	338	3.69	
アジア・オセアニア		16,003	15,518	485	3.12	
中国		33,353	31,769	1,585	4.99	
インド	10,000 (2004.09.30)	32,789	32,732	57	0.17	
インドネシア	7,330 (2009.12.01)	14,406	14,426	-20	-0.14	
タイ		23,882	23,366	516	2.21	
フィリピン	3,209 (2010.06.01)	8,476	8,276	201	2.43	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	15,229	15,329	-100	-0.65	
韓国	10,000 (1997.06.30)	22,185	22,106	80	0.36	
香港		24,761	23,917	843	3.53	
台湾	10,000 (2008.03.31)	15,944	15,069	875	5.80	
中南米	7,448 (2006.05.01)	8,324	8,153	170	2.09	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,417	9,302	115	1.24	
メキシコ	10,514 (2013.03.01)	9,669	9,053	616	6.81	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	9,936	9,278	658	7.09	
南アフリカ	10,000 (2010.06.30)	6,448	6,148	300	4.88	
トルコ		19,354	19,906	-552	-2.77	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	20,974	20,303	671	3.31	

※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		12,912	12,685	227	1.79
外国債券(先進国)		17,584	17,556	28	0.16
グローバル		17,820	17,793	27	0.15
除く日本		18,984	18,997	-13	-0.07
含む日本		17,212	17,142	70	0.41
その他		16,888	16,857	30	0.18
北米	9,017 (2013.06.03)	10,227	10,226	1	0.01
米国		15,560	15,430	130	0.84
カナダ	10,000 (2003.05.30)	13,895	13,865	30	0.21
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,255	15,266	-12	-0.08
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	18,681	18,716	-35	-0.19
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	23,005	23,009	-4	-0.02
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	10,964	11,169	-205	-1.83
複合地域	10,000 (2001.11.30)	16,443	16,419	24	0.14
エマーGING債券		16,826	16,792	34	0.21
グローバル		18,011	17,954	56	0.31
米ドル建て		18,631	18,570	61	0.33
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,379	12,348	32	0.26
その他	8,652 (2005.04.01)	12,470	12,455	15	0.12
ロシア	10,000 (2008.05.30)	10,474	10,261	213	2.08
アジア・オセアニア	8,652 (2005.04.01)	14,033	13,976	57	0.41
インド	10,000 (2011.08.31)	15,671	15,695	-23	-0.15
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	12,965	12,792	173	1.35
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	12,700	12,694	6	0.04
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	11,432	11,199	233	2.08
南アフリカ	10,000 (2010.03.31)	10,828	10,535	293	2.78
トルコ	10,000 (2011.04.28)	4,486	4,686	-201	-4.28
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,778	10,657	121	1.14
ハイイールド債券		21,695	21,256	439	2.06
グローバル	10,000 (1997.06.30)	21,972	21,605	367	1.70
北米		21,073	20,595	477	2.32
その他	10,000 (2004.03.31)	21,784	21,463	320	1.49
欧州	10,000 (2006.04.28)	21,782	21,439	343	1.60
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,370	14,224	146	1.03
複合地域	10,000 (2004.03.31)	19,155	18,872	283	1.50
複合資産		16,945	16,802	143	0.85
安定	10,000 (1998.10.30)	15,244	15,154	89	0.59
安定成長		18,121	17,947	174	0.97
成長		20,092	19,723	369	1.87
国内バランス		13,002	13,054	-52	-0.40
安定		13,963	14,033	-70	-0.50
一般		13,914	13,795	119	0.86

※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		12,912	12,685	227	1.79	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	30,588	30,812	-224	-0.73	
日本	10,000 (2003.10.31)	30,588	30,812	-224	-0.73	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	26,136	26,182	-46	-0.17	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	22,977	23,033	-56	-0.25	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	24,581	24,641	-60	-0.24	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	23,118	23,175	-57	-0.25	
北米	10,000 (2003.09.30)	25,817	25,827	-10	-0.04	
その他	10,000 (2004.04.30)	26,838	26,987	-149	-0.55	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,664	5,578	86	1.54	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	19,948	20,077	-128	-0.64	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	15,088	15,282	-194	-1.27	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,246	7,088	158	2.23	
複数国	10,000 (2004.04.30)	34,062	34,127	-65	-0.19	
その他		5,800	5,667	132	2.34	
絶対収益型		7,594	7,556	38	0.51	
ロング・ショート		8,895	8,859	36	0.40	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	9,052	8,968	84	0.93	
GTAA		10,602	10,535	67	0.64	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,212	7,181	31	0.43	
CB		18,584	18,305	279	1.52	
欧州	8,044 (2014.04.01)	6,493	6,366	127	2.00	
アジア・オセアニア	13,897 (2007.11.01)	15,621	15,421	201	1.30	
日本		19,932	19,929	3	0.02	
グローバル		32,573	32,060	513	1.60	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	7,652	7,614	38	0.50	
全業種	10,000 (2004.12.30)	6,823	6,706	117	1.74	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	13,168	13,291	-124	-0.93	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	5,317	4,906	411	8.38	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	10,471	10,349	121	1.17	

※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	5.88	5.44	2.23	10.26
国内株式	6.51	0.51	-7.51	11.62
一般	6.37	0.38	-8.94	11.58
フリー	7.14	0.99	-8.79	12.39
バリュー	3.26	-2.14	-9.56	8.31
小型	8.27	0.09	-8.81	14.23
その他	6.19	1.07	-3.38	10.73
日経225	7.94	2.41	0.65	11.94
TOPIX	4.31	-0.56	-7.11	9.40
JPX日経400	4.24	-0.28	-6.66	9.48
国内債券	0.54	1.80	1.28	0.94
一般	0.54	1.80	1.28	0.94
外国株式(先進国)	10.88	10.69	6.89	19.19
グローバル	10.95	11.02	6.36	19.40
除く日本	10.92	8.99	7.07	18.46
含む日本	10.95	11.54	6.18	19.64
その他	10.66	9.64	8.64	18.51
北米	10.70	7.81	6.99	20.20
米国	11.75	10.57	12.05	20.18
カナダ	3.80	3.73	0.17	13.04
欧州	9.05	6.52	-2.47	16.49
ドイツ	8.84	4.91	-9.05	15.55
アジア・オセアニア	6.65	10.40	3.71	11.91
オーストラリア	7.81	7.62	3.45	13.63
ニュージーランド	11.19	15.87	14.21	13.96
複合地域	7.76	-0.98	-10.86	17.11
エマージング株式	9.90	14.87	-1.56	12.09
グローバル	9.92	16.69	0.14	17.42
BRICS	8.15	15.46	4.43	16.82
その他	9.96	14.17	-2.36	10.01
欧州	2.71	9.79	-0.58	12.67
ロシア	4.25	9.01	11.12	16.11
アジア・オセアニア	8.92	13.89	-1.24	14.57
中国	20.42	27.97	0.35	29.70
インド	11.27	14.20	-3.12	4.35
インドネシア	0.28	18.38	7.24	5.24
タイ	1.25	3.19	-8.30	8.31
フィリピン	2.96	12.88	4.40	7.59
ベトナム	7.17	2.69	-11.41	5.68
韓国	0.62	-0.91	-19.88	0.39
香港	9.91	18.75	2.96	16.80
台湾	11.70	16.49	-4.05	12.02
中南米	-2.87	1.69	-4.45	8.99
ブラジル	-5.78	3.32	-0.57	8.95
メキシコ	5.76	7.35	-5.80	12.03
中東・アフリカ	7.08	12.10	-2.25	13.78
南アフリカ	0.24	9.27	-13.53	10.28
トルコ	-15.15	-3.66	-35.95	-4.80
複合地域	7.37	14.84	-1.67	12.60

＜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か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	5.88	5.44	2.23	10.26
外国債券(先進国)	2.22	2.21	1.55	3.00
グローバル	2.24	2.46	1.57	2.83
除く日本	2.21	2.28	1.39	2.49
含む日本	2.27	2.67	1.77	3.22
その他	2.16	1.54	1.45	3.43
北米	1.70	1.54	1.23	1.71
米国	3.68	2.30	4.49	4.50
カナダ	1.64	-0.59	1.08	3.95
欧州	1.50	0.80	-1.67	1.60
アジア・オセアニア	1.60	1.54	0.39	3.18
オーストラリア	1.65	1.36	0.23	3.22
ニュージーランド	0.64	3.25	2.36	2.19
複合地域	2.35	2.39	2.70	2.46
エマージング債券	1.89	4.12	-0.87	4.14
グローバル	1.23	3.72	-2.57	4.93
米ドル建て	1.40	3.70	-1.88	5.30
現地通貨建て	0.48	3.90	-5.75	3.32
その他	2.44	4.44	0.59	3.47
ロシア	6.44	6.15	6.02	13.28
アジア・オセアニア	4.05	5.50	4.08	4.75
インド	6.33	8.86	4.12	3.84
インドネシア	5.97	14.47	0.59	6.16
ブラジル	-3.00	-3.08	-3.39	1.55
メキシコ	5.80	9.74	4.00	9.02
南アフリカ	-3.42	7.00	-9.98	4.96
トルコ	-18.28	-5.52	-37.96	-13.25
複合地域	1.98	6.21	-0.46	5.46
ハイイールド債券	4.38	2.81	2.35	8.37
グローバル	3.05	2.50	0.39	6.82
北米	5.11	2.91	4.33	9.50
その他	3.00	2.71	-2.30	5.88
欧州	2.48	1.74	-3.72	5.34
アジア・オセアニア	5.03	6.82	3.02	7.94
複合地域	4.22	2.08	1.61	5.40
複合資産	3.47	3.30	0.99	6.07
安定	2.84	2.96	0.65	4.73
安定成長	3.84	3.76	1.60	6.72
成長	5.51	3.80	0.50	9.63
国内バランス	0.73	1.40	-0.23	2.17
安定	0.58	1.50	0.18	1.86
一般	2.86	0.79	-4.02	6.14

<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

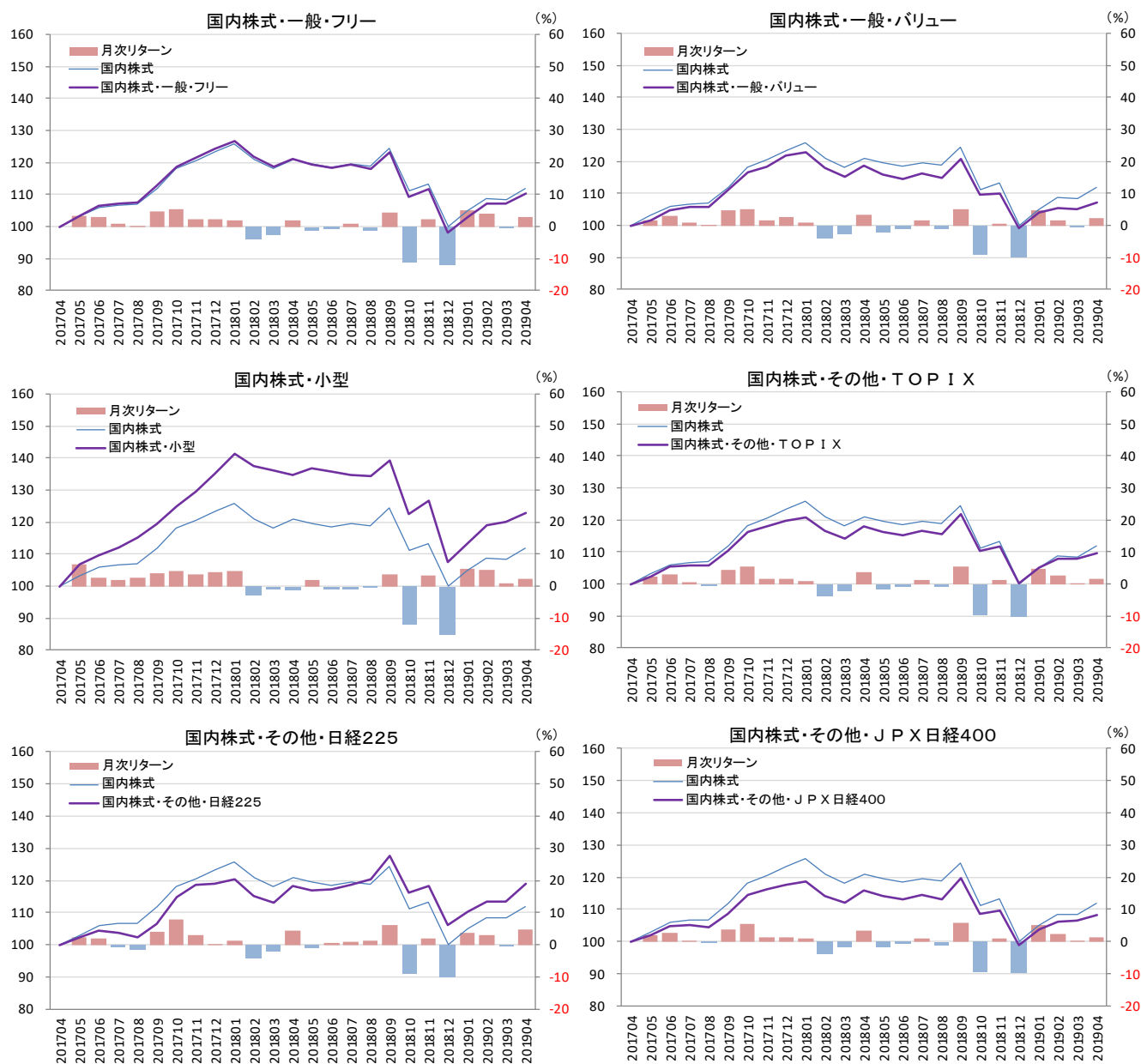
	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	5.88	5.44	2.23	10.26
国内REIT	3.04	9.66	12.74	7.93
日本	3.04	9.66	12.74	7.93
外国REIT	6.28	8.18	16.64	15.08
グローバル	4.90	6.84	13.95	13.77
除く日本	5.31	7.55	14.54	14.62
含む日本	4.81	6.70	13.82	13.60
北米	7.33	8.21	19.28	16.52
その他	6.15	13.71	13.07	12.66
欧州	2.41	2.65	-5.27	11.94
アジア・オセアニア	6.99	16.58	14.72	13.30
オーストラリア	4.70	10.27	14.48	9.76
複合地域	1.89	6.94	-4.16	13.49
複数国	6.33	9.69	20.12	14.48
その他	4.39	0.25	-2.65	6.66
絶対収益型	1.53	0.56	-1.93	1.61
ロング・ショート	2.29	2.58	-0.99	3.02
マーケットニュートラル	2.07	0.53	-0.03	0.78
GTAA	3.34	3.08	0.03	3.89
その他スタイル	1.04	-0.23	-2.65	1.15
CB	3.46	2.88	-0.05	5.89
欧州	0.52	2.54	-13.41	2.67
アジア・オセアニア	6.27	11.27	3.07	8.67
日本	-0.40	-2.56	-4.77	0.06
グローバル	3.57	2.93	0.16	6.11
コモディティ	1.85	-1.01	-4.10	4.99
全業種	5.83	-3.24	-3.74	9.22
貴金属	-2.83	2.48	-4.99	-0.25
エネルギー	17.97	-5.81	2.84	35.62
その他コモディティ	3.35	-0.96	-3.25	7.28

<1>パフォーマンス・サマリー

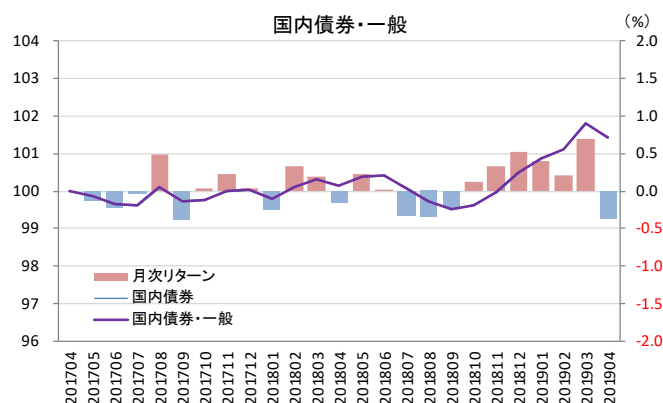
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

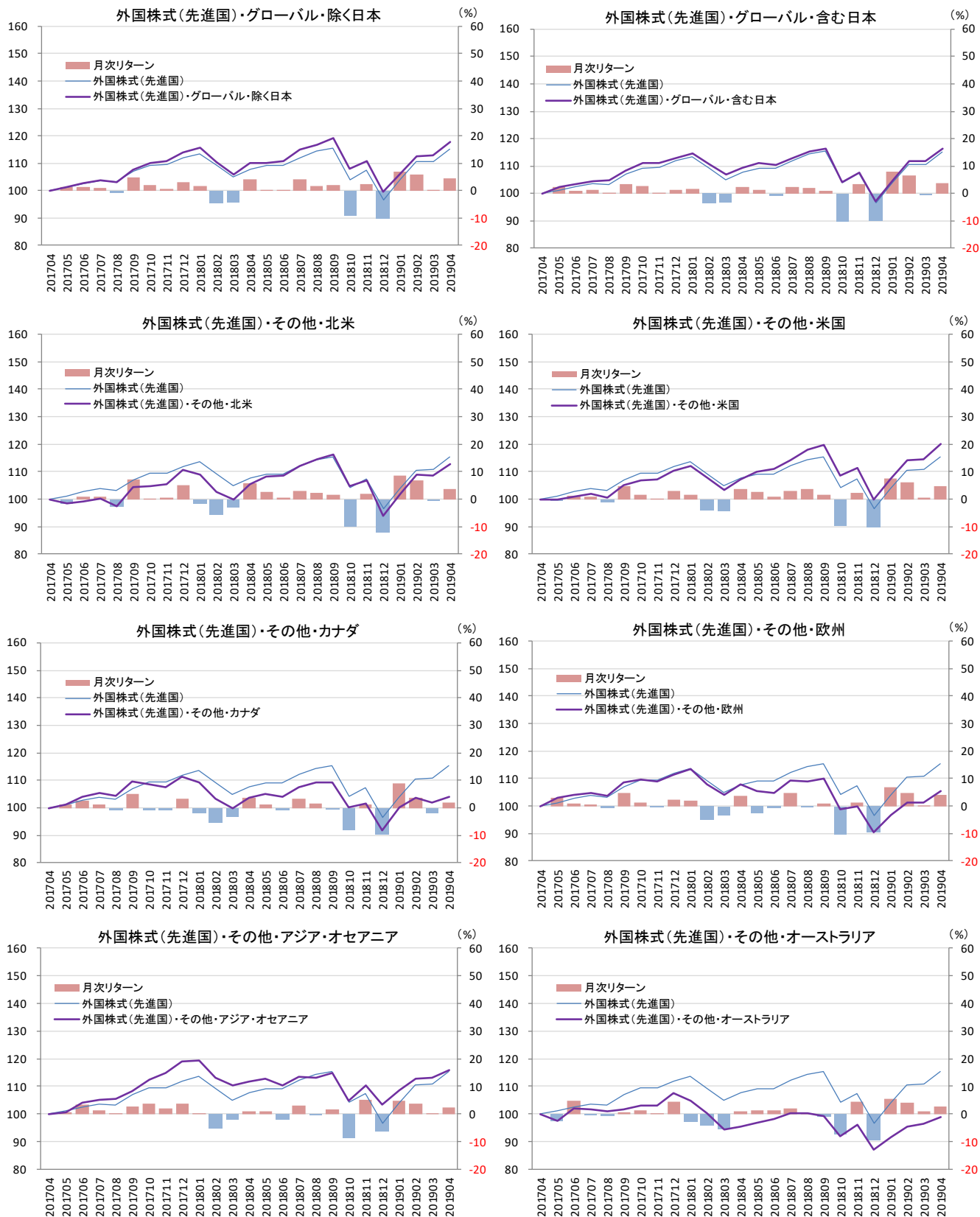


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

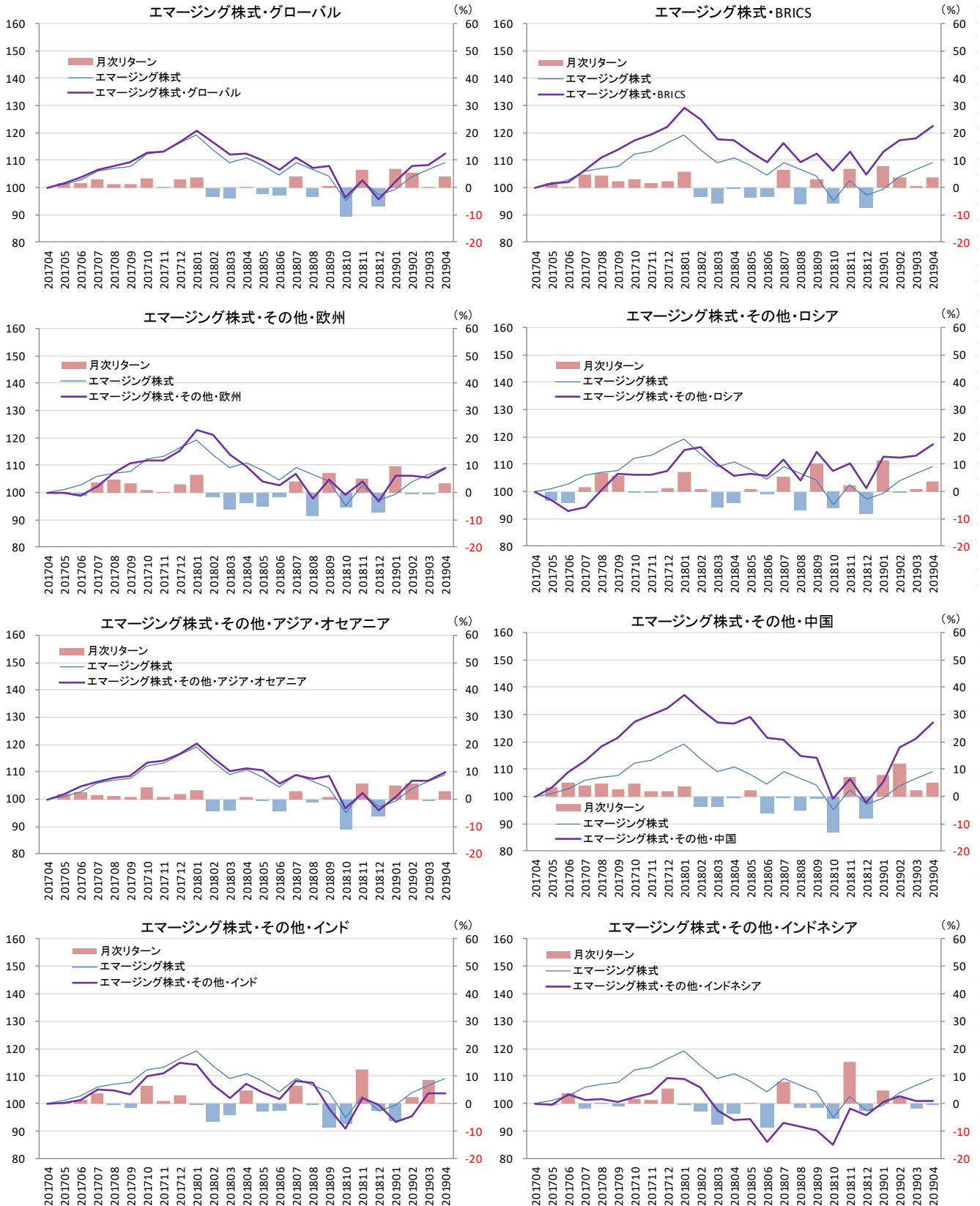


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

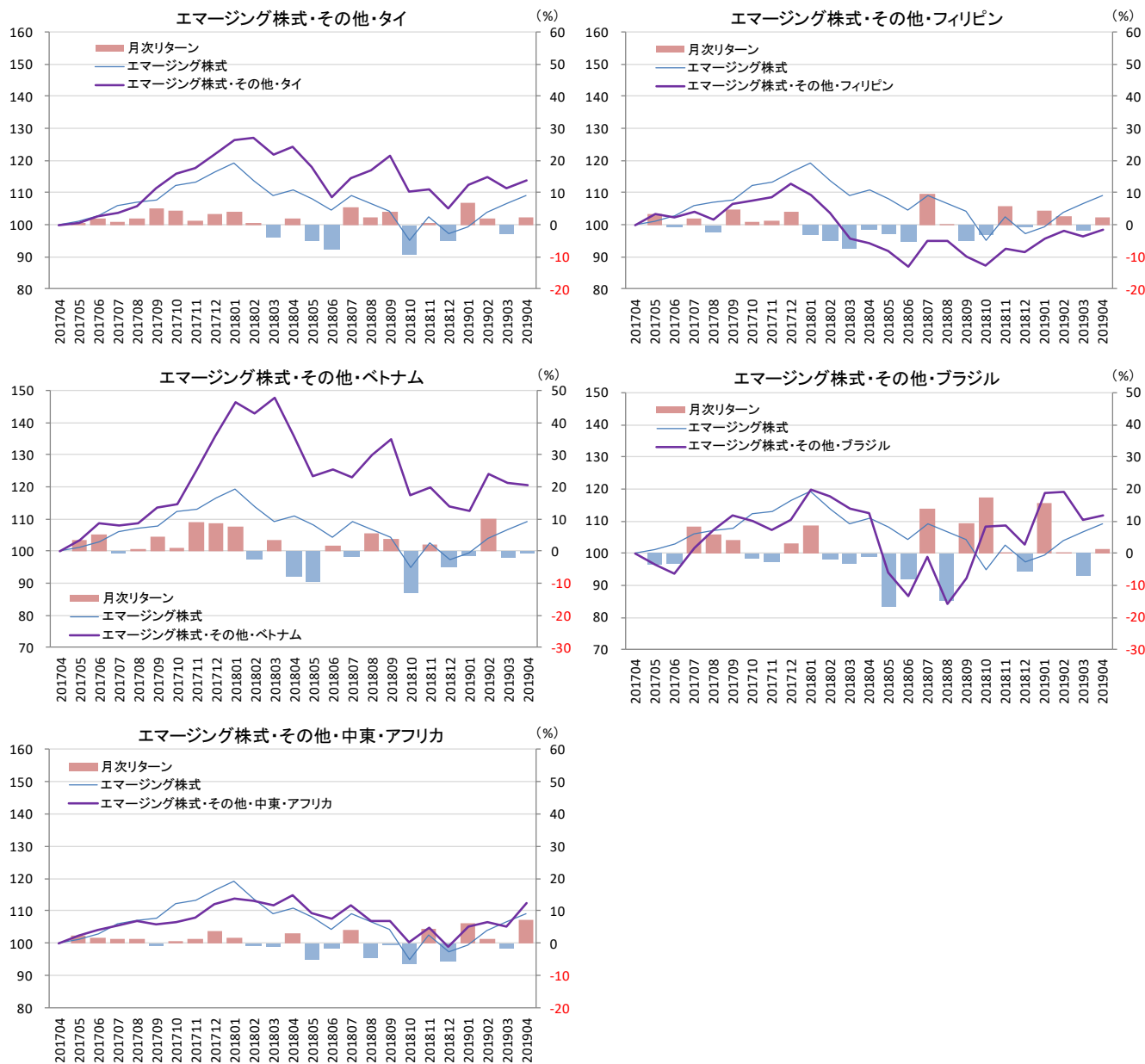


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

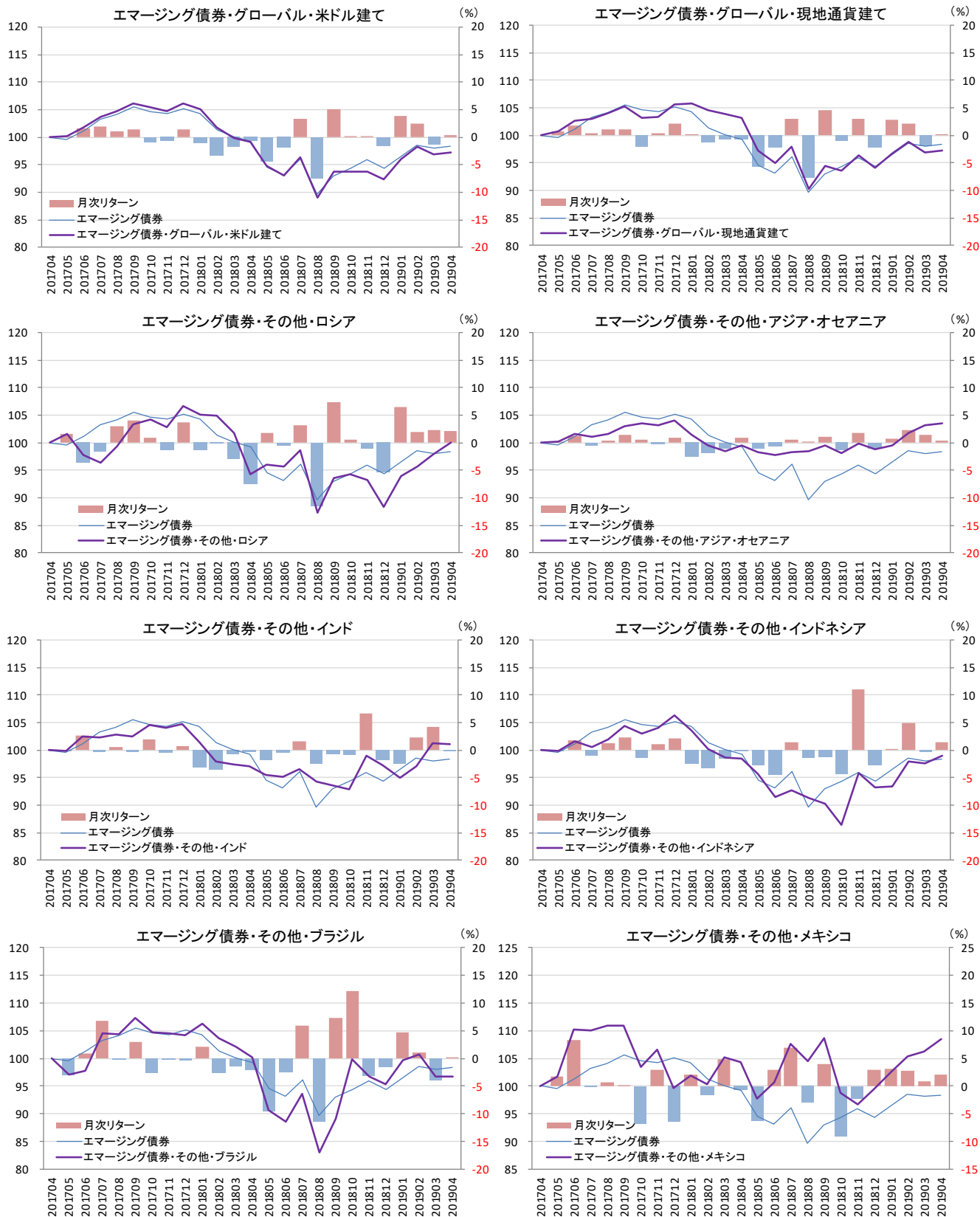


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

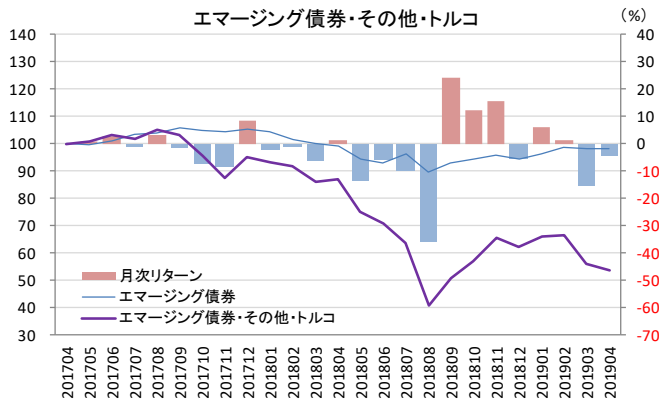


<1>パフォーマンス・サマリー

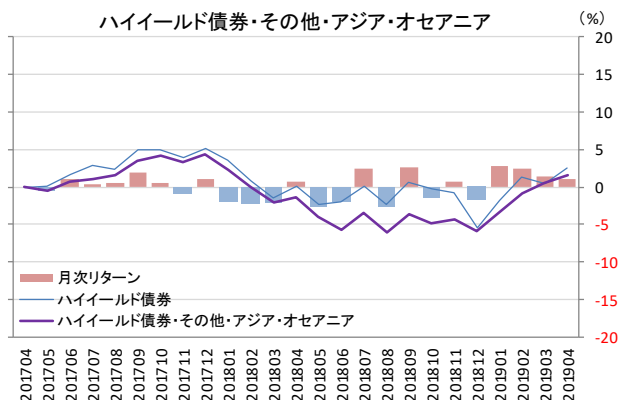
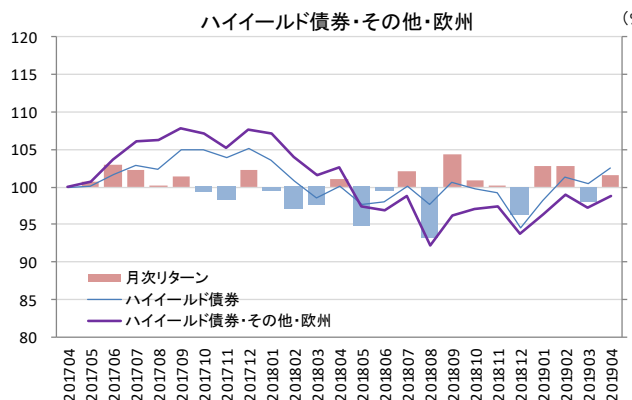
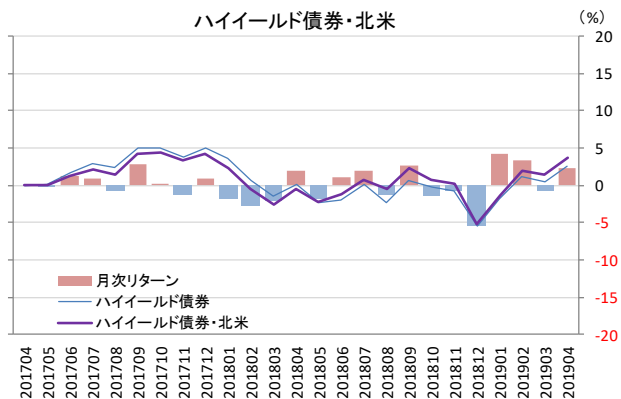
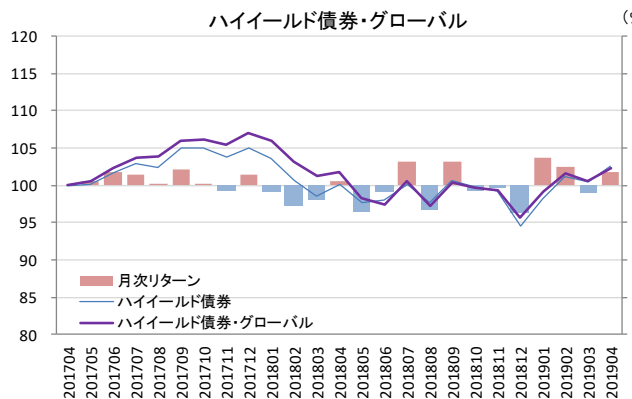
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

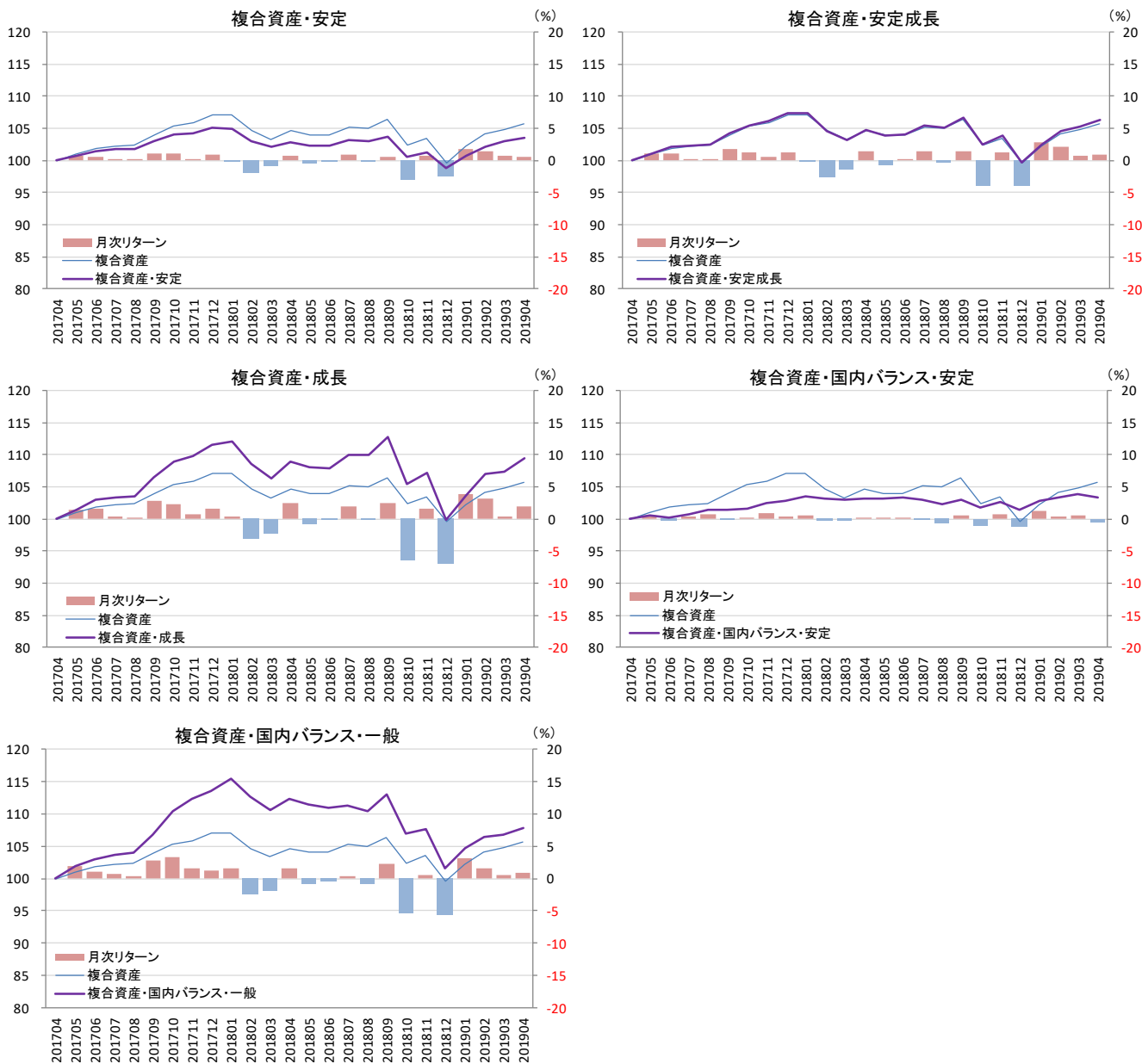


<1>パフォーマンス・サマリー

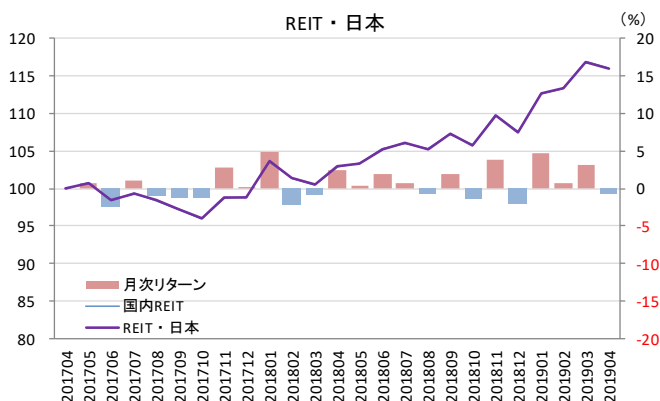
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

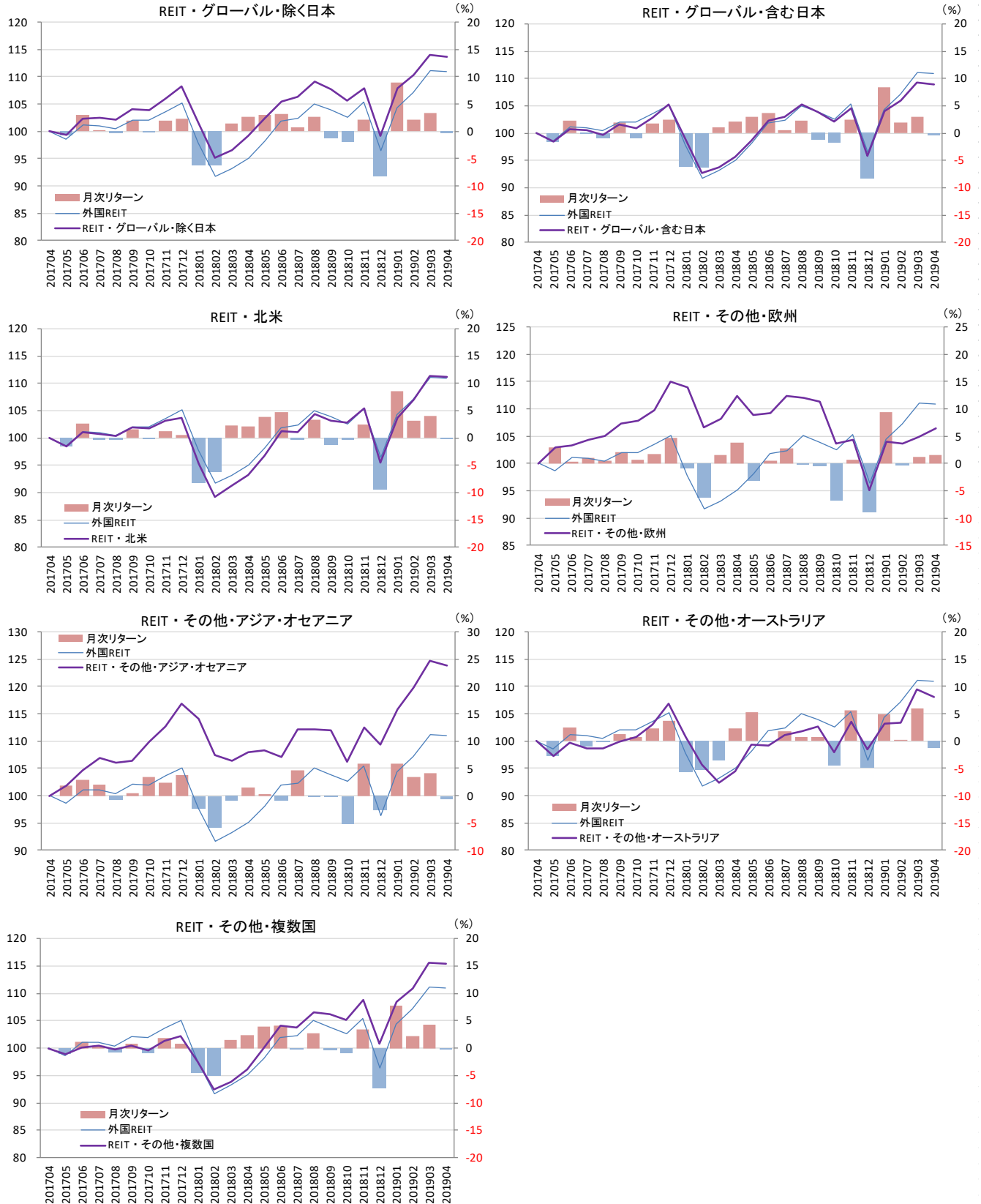


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

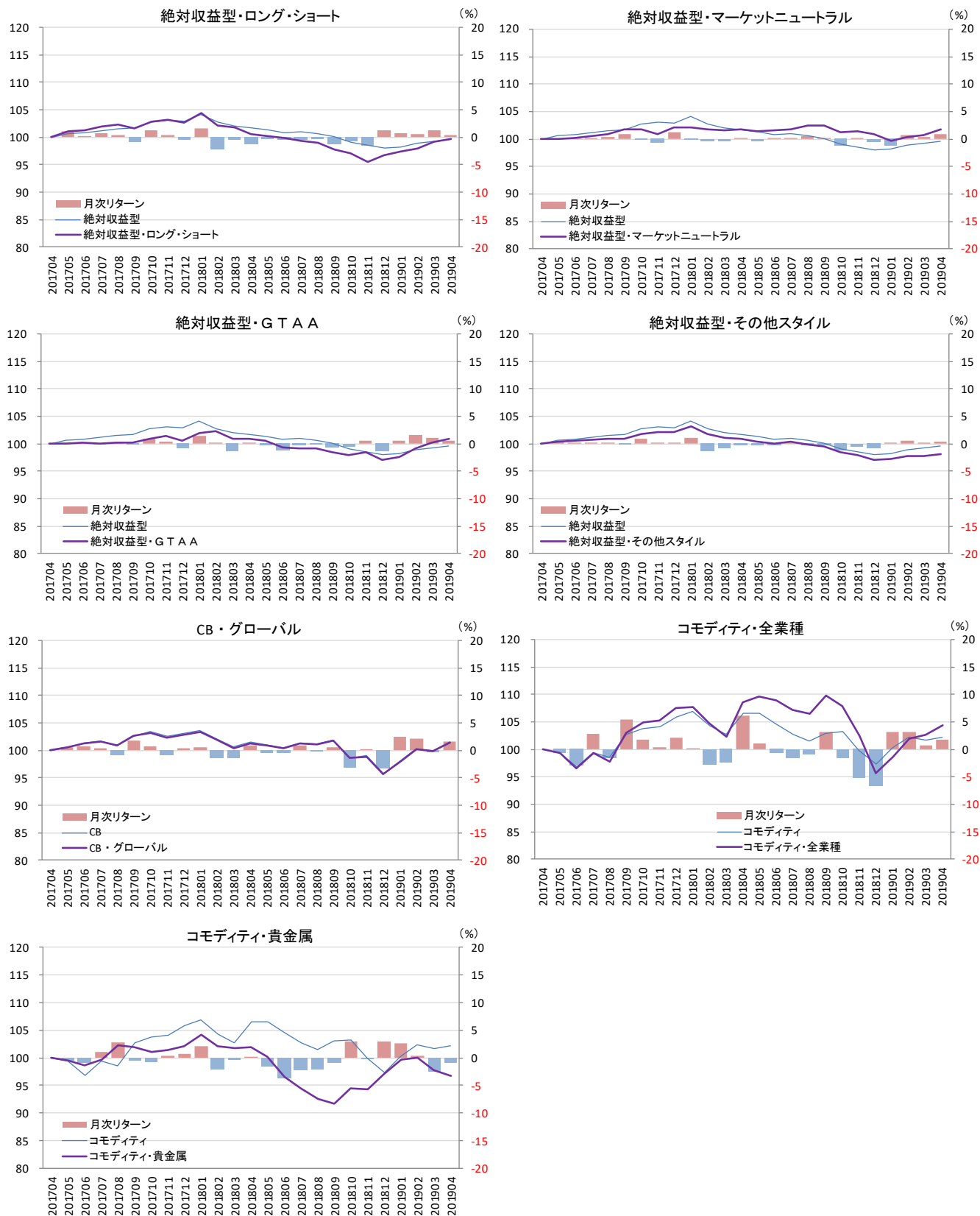


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	1.79				
1	外国株式(先進国)・グローバル	4.06		17.90		0.73
2	国内株式・一般	2.88		10.02		0.29
3	外国株式(先進国)・その他	4.22		5.21		0.22
4	国内株式・その他	3.53		4.96		0.18
5	エマージング株式・その他	1.63		4.00		0.07
6	複合資産・安定成長	0.97		6.51		0.06
7	エマージング株式・グローバル	3.97		1.50		0.06
8	ハイイールド債券・北米	2.32		2.54		0.06
9	国内株式・小型	2.22		1.73		0.04
10	複合資産・成長	1.87		1.92		0.04
11	複合資産・安定	0.59		4.41		0.03
12	外国債券(先進国)・グローバル	0.15		10.07		0.02
13	ハイイールド債券・その他	1.49		0.76		0.01
14	ハイイールド債券・グローバル	1.70		0.60		0.01
15	外国債券(先進国)・その他	0.18		3.79		0.01
16	絶対収益型	0.51		1.08		0.01
17	エマージング債券・グローバル	0.31		1.45		0.00
18	エマージング株式・BRICS	3.78		0.11		0.00
19	CB	1.52		0.27		0.00
20	エマージング債券・その他	0.12		1.77		0.00
21	コモディティ	0.50		0.28		0.00
22	REIT・北米	-0.04		3.99		-0.00
23	REIT・その他	-0.55		0.84		-0.00
24	複合資産・国内バランス	-0.40		1.26		-0.01
25	REIT・グローバル	-0.25		2.99		-0.01
26	国内債券・一般	-0.37		5.30		-0.02
27	REIT・日本	-0.73		4.30		-0.03
	合計			99.54		1.75

◆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	2.23		
1	外国株式(先進国)・グローバル	6.36	15.76	1.00
2	REIT・北米	19.28	4.48	0.86
3	REIT・日本	12.74	4.16	0.53
4	REIT・グローバル	13.95	3.08	0.43
5	外国株式(先進国)・その他	8.64	4.80	0.41
6	外国債券(先進国)・グローバル	1.57	10.86	0.17
7	ハイイールド債券・北米	4.33	3.23	0.14
8	REIT・その他	13.07	0.82	0.11
9	複合資産・安定成長	1.60	6.06	0.10
10	国内債券・一般	1.28	4.89	0.06
11	外国債券(先進国)・その他	1.45	4.30	0.06
12	複合資産・安定	0.65	4.01	0.03
13	エマージング債券・その他	0.59	2.04	0.01
14	複合資産・成長	0.50	1.68	0.01
15	エマージング株式・BRICS	4.43	0.12	0.01
16	ハイイールド債券・グローバル	0.39	0.76	0.00
17	エマージング株式・グローバル	0.14	1.72	0.00
18	CB	-0.05	0.33	-0.00
19	複合資産・国内バランス	-0.23	0.87	-0.00
20	コモディティ	-4.10	0.24	-0.01
21	絶対収益型	-1.93	0.98	-0.02
22	ハイイールド債券・その他	-2.30	1.06	-0.02
23	エマージング債券・グローバル	-2.57	1.75	-0.04
24	エマージング株式・その他	-2.36	4.32	-0.10
25	国内株式・小型	-8.81	1.72	-0.15
26	国内株式・その他	-3.38	4.56	-0.15
27	国内株式・一般	-8.94	10.89	-0.97
	合計		99.49	2.46

◆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	15.68	23.00	95.20	8.45	9.57	11.54	0.60	0.44	0.60
国内株式	29.34	52.67	145.61	14.23	15.69	17.44	0.63	0.56	0.54
一般	26.59	47.91	129.73	14.35	16.09	17.71	0.57	0.51	0.49
フリー	26.90	47.77	131.02	14.58	16.49	18.39	0.57	0.49	0.47
バリュー	25.56	48.52	131.35	13.79 ↓	14.93	16.33	0.58	0.55	0.53
小型	42.29	90.83	281.85	15.83	15.39	17.58	0.79	0.90	0.81
その他	32.78	57.11	160.14	14.16	15.31	17.32	0.70	0.62	0.58
日経225	38.48	64.70	183.87	14.52	15.42	17.63	0.79	0.68	0.62
TOPIX	27.64	51.90	128.85	13.80	15.20	16.82	0.62	0.57	0.51
JPX日経400	23.90	45.01	-	13.41 ↓	14.76	-	0.56	0.52	-
国内債券	0.11	6.99	18.09	1.46	1.50	1.49	0.06	0.91	1.10
一般	0.11	6.99	18.09	1.46	1.50	1.49	0.06	0.91	1.10
外国株式(先進国)	30.69	29.94	141.51	13.69	14.71 ↑	16.33	0.69	0.37	0.56
グローバル	31.21	35.21	151.68	13.68 ↑	14.50 ↑	16.21	0.70	0.43	0.59
除く日本	35.52	43.67	210.38	14.69	15.90	17.86	0.73	0.47	0.67
含む日本	29.95	32.85	139.44	13.51 ↑	14.22 ↑	15.90	0.68	0.41	0.57
その他	29.72	19.35	138.01	13.90	15.39 ↑	17.73	0.66	0.23	0.51
北米	28.72	19.50	80.50	16.52	17.16	20.89	0.53	0.21	0.29
米国	40.99	30.92	161.46	14.42	16.58	17.86	0.85	0.33	0.56
カナダ	9.38	-15.06	36.41	12.49	13.81	17.91	0.25	-0.23	0.17
欧州	19.02	14.20	128.89	14.96	15.08	18.79	0.40	0.18	0.46
ドイツ	14.37	4.00	-	18.61	20.08	-	0.25	0.04	-
アジア・オセアニア	28.86	36.39	230.53	12.05	14.66	18.72	0.74	0.44	0.68
オーストラリア	13.04	9.51	134.35	14.40	15.21	20.09	0.29	0.12	0.44
ニュージーランド	39.75	74.23	-	13.04 ↓	16.35	-	0.91	0.72	-
複合地域	-2.83	-20.41	-	18.39	18.93	-	-0.05	-0.24	-
エマージング株式	29.78	27.65	105.17	12.79	15.13	18.97	0.71	0.33	0.39
グローバル	28.49	19.00	96.34	13.96	15.95	18.86	0.63	0.22	0.37
BRICS	51.96	48.27	131.09	14.18	18.02	21.54	1.06	0.46	0.40
その他	29.42	30.85	111.66	12.86 ↓	15.12	18.98	0.70	0.37	0.41
欧州	33.67	13.45	87.40	17.43	19.90	24.90	0.59	0.13	0.26
ロシア	50.89	48.04	122.12	19.59	24.67	27.74	0.75	0.33	0.30
アジア・オセアニア	26.57	25.10	125.97	13.32	15.20	17.78	0.62	0.30	0.48
中国	47.69	88.23	141.37	17.26	22.51	22.45	0.81	0.60	0.41
インド	34.96	62.76	156.90	17.15	19.70	25.56	0.62	0.52	0.39
インドネシア	15.43	7.89	-	16.31	20.02	-	0.30	0.08	-
タイ	31.74	31.84	325.98	13.73	14.19	17.84	0.70	0.40	0.87
フィリピン	-1.46	9.12	-	13.91 ↓	15.16	-	-0.03	0.12	-
ベトナム	43.08	32.53	-	16.92	16.54	-	0.75	0.35	-
韓国	-5.40	-10.30	68.33	14.64 ↓	15.10	20.53 ↓	-0.12	-0.14	0.26
香港	49.72	44.86	134.75	14.51	18.60	19.36	1.00	0.41	0.46
台湾	28.85	34.92	179.13	16.63	16.82	20.19	0.53	0.37	0.53
中南米	31.55	-1.45	47.72	21.12	22.79	23.83	0.46	-0.01	0.17
ブラジル	42.40	-7.35	18.88	27.49 ↓	31.35	29.66	0.46	-0.05	0.06
メキシコ	-10.71	-15.58	-	21.60	19.89	-	-0.17	-0.17	-
中東・アフリカ	18.71	1.97	101.30	13.04	15.11	16.89 ↓	0.46	0.03	0.43
南アフリカ	4.50	-38.85	-	17.54	19.36	-	0.09	-0.48	-
トルコ	-43.36	-45.02	4.35	30.99	28.82	32.21	-0.56	-0.39	0.01
複合地域	13.43	8.57	117.37	13.59	14.17	16.39	0.32	0.12	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	15.68	23.00	95.20	8.45	9.57	11.54	0.60	0.44	0.60
外国債券(先進国)	3.04	2.35	38.36	4.52 ↓	5.66	8.24	0.23	0.08	0.40
グローバル	3.17	4.32	34.88	4.11 ↓	5.15	7.52	0.27	0.17	0.40
除く日本	2.49	2.82	41.79	4.77 ↓	5.87	8.29	0.18	0.10	0.42
含む日本	4.02	6.23	26.39	3.53 ↓	4.46	6.73	0.39	0.27	0.35
その他	2.50	-0.95	50.15	6.35 ↓	7.32	10.00	0.14	-0.03	0.41
北米	2.31	10.08	-	2.59 ↓	4.10	-	0.32	0.47	-
米国	4.70	12.77	50.70	5.16	5.87	6.53	0.31	0.42	0.64
カナダ	-3.96	-6.88	17.21	8.23	9.15	10.06	-0.16	-0.15	0.16
欧州	4.54	-0.45	29.86	6.35 ↓	7.26	10.16	0.24	-0.01	0.26
アジア・オセアニア	2.35	-2.91	62.54	7.63 ↓	8.56	11.15	0.11	-0.07	0.44
オーストラリア	2.02	-3.70	61.79	7.76 ↓	8.63	11.56	0.09	-0.09	0.42
ニュージーランド	8.12	6.43	-	8.47	10.18	-	0.32	0.12	-
複合地域	6.73	1.06	40.36	5.58 ↓	7.35	10.00	0.40	0.03	0.34
エマージング債券	11.97	4.69	58.88	8.01 ↓	10.56	12.87	0.49	0.09	0.37
グローバル	8.69	3.13	59.41	8.60 ↓	10.49	12.72	0.33	0.06	0.37
米ドル建て	9.73	4.57	64.60	8.66 ↓	10.68	12.90	0.37	0.08	0.39
現地通貨建て	2.81	-5.21	32.77	9.06	10.06	11.97	0.11	-0.11	0.24
その他	15.55	5.27	53.88	8.16	11.63	13.93	0.61	0.09	0.31
ロシア	30.32	-3.63	66.92	14.71 ↓	24.67	22.02	0.63	-0.03	0.24
アジア・オセアニア	6.34	16.88	64.63	5.35	6.78	8.94	0.40	0.47	0.57
インド	12.88	29.74	-	9.31	10.03	-	0.45	0.53	-
インドネシア	5.75	13.45	-	10.73 ↑	13.86	-	0.18	0.19	-
ブラジル	25.47	5.96	59.73	16.24	18.93	17.74	0.49	0.06	0.27
メキシコ	-2.77	-12.22	-	15.87	14.43	-	-0.06	-0.18	-
南アフリカ	26.47	7.64	-	21.29	19.28	-	0.39	0.08	-
トルコ	-55.29	-59.15	-	33.47	28.36	-	-0.70	-0.58	-
複合地域	10.46	-5.18	26.89	9.46 ↓	11.34	13.19	0.36	-0.09	0.18
ハイイールド債券	16.96	13.65	123.74	8.15	9.54	12.29	0.66	0.27	0.68
グローバル	17.72	12.16	96.54	7.90	9.56	12.24	0.71	0.24	0.57
北米	20.10	17.70	135.87	8.63	9.63	11.93	0.74	0.34	0.75
その他	8.93	4.98	148.64	8.29	10.06	15.86	0.36	0.10	0.60
欧州	7.69	2.74	189.25	9.03	10.80	17.39	0.28	0.05	0.64
アジア・オセアニア	14.53	17.31	-	6.79	8.31	-	0.69	0.39	-
複合地域	12.95	9.93	123.02	8.14	8.60	12.19	0.52	0.22	0.68
複合資産	10.85	19.52	84.05	5.93	7.14	9.50	0.60	0.51	0.66
安定	6.30	13.15	69.36	4.40	5.57	8.06	0.48	0.45	0.67
安定成長	11.98	20.36	85.95	6.43	7.50	9.89	0.61	0.50	0.64
成長	19.83	32.04	120.12	9.68	10.60	12.06	0.65	0.54	0.68
国内バランス	5.60	20.14	44.47	2.38	4.37 ↓	6.78	0.79	0.86	0.55
安定	4.40	16.47	40.61	2.19	2.57	3.66	0.68	1.21	0.94
一般	14.68	25.09	57.65	7.77	9.11	9.87	0.61	0.50	0.47

※[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	15.68	23.00	95.20	8.45	9.57	11.54	0.60	0.44	0.60
国内REIT	8.66	44.49	217.66	7.56	8.92	16.58	0.38	0.86	0.74
日本	8.66	44.49	217.66	7.56	8.92	16.58	0.38	0.86	0.74
外国REIT	15.42	41.71	240.09	12.74	13.97	16.37 ↓	0.39	0.52	0.79
グローバル	11.53	32.43	215.54	12.62	13.49	16.03 ↓	0.30	0.43	0.76
除く日本	17.71	42.42	238.02	12.83	13.58	16.07 ↓	0.44	0.54	0.80
含む日本	10.82	31.41	213.68	12.60	13.48	16.03 ↓	0.28	0.42	0.75
北米	17.18	48.07	265.03	13.62	15.05	18.02 ↓	0.40	0.54	0.76
その他	24.85	51.72	245.30	10.67	11.96	15.39 ↓	0.72	0.73	0.85
欧州	5.26	15.86	46.90	15.31	15.37	20.57	0.12	0.19	0.19
アジア・オセアニア	35.11	60.47	327.25	10.51	12.15	15.33	1.01	0.82	1.02
オーストラリア	13.90	35.20	233.13	13.44	13.99	17.81 ↓	0.33	0.45	0.72
複合地域	-0.94	11.38	156.19	14.73	15.04	18.35	-0.02	0.15	0.54
複数国	18.08	63.98	295.71	11.27	12.68	15.84 ↓	0.51	0.82	0.93
その他									
絶対収益型	-1.45	0.15	-6.55	2.00	2.21	3.44	-0.22	0.02	-0.21
ロング・ショート	-1.03	-0.75	0.11	3.06	2.98	3.53	-0.09	-0.05	-0.01
マーケットニュートラル	3.09	5.19	2.46	2.18	1.98	2.03	0.49	0.52	0.10
GTAA	1.17	4.07	12.21	2.42	2.06	2.63	0.18	0.39	0.43
その他スタイル	-1.60	0.29	-9.47	2.02	2.42	5.22	-0.24	0.03	-0.20
CB	8.63	6.00	54.81	5.58	6.48	9.82	0.51	0.18	0.45
欧州	-15.98	-19.55	-	16.27	14.75	-	-0.34	-0.29	-
アジア・オセアニア	17.98	36.65	78.73	8.78	10.69	10.80	0.65	0.60	0.55
日本	3.24	18.40	58.06	4.95	5.50	6.09	0.23	0.63	0.76
グローバル	8.97	5.19	60.79	5.59	6.39	10.35	0.53	0.16	0.47
コモディティ	3.09	-34.92	-10.03	9.25 ↓	12.10	15.58	0.12	-0.68	-0.07
全業種	5.34	-36.21	-13.00	11.84 ↓	13.93	16.16	0.15	-0.62	-0.09
貴金属	-2.12	-12.77	-	6.56	9.25	-	-0.10	-0.29	-
エネルギー	26.05	-40.21	-13.65	26.71	27.65 ↑	25.50	0.30	-0.35	-0.06
その他コモディティ	-4.68	-28.13	34.79	12.43 ↓	14.35	18.37	-0.12	-0.44	0.16

※[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

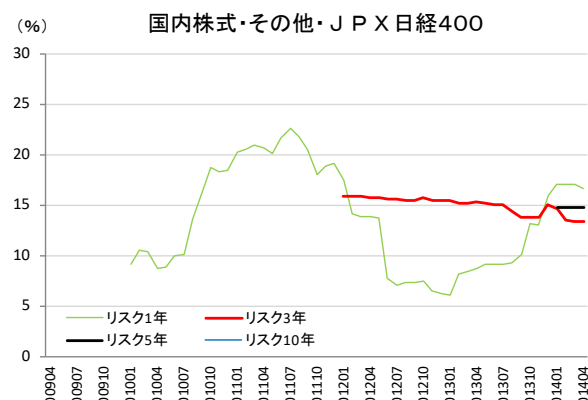
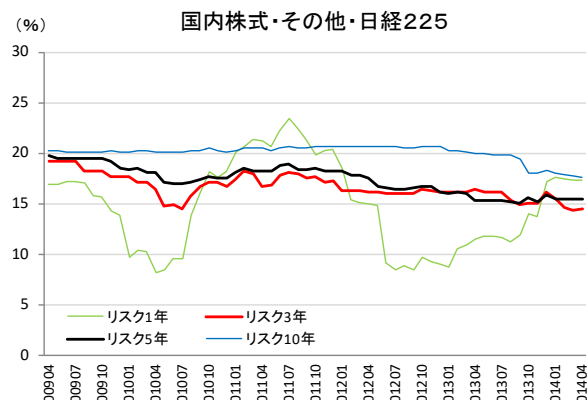
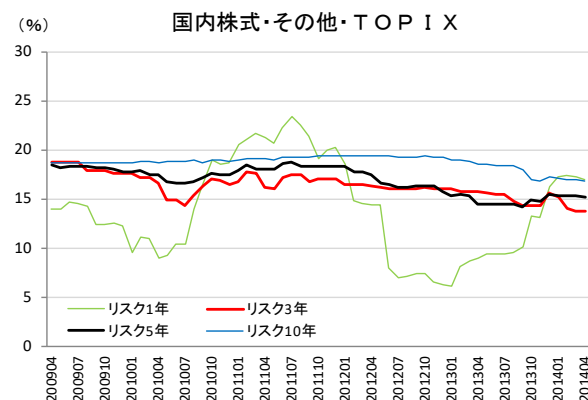
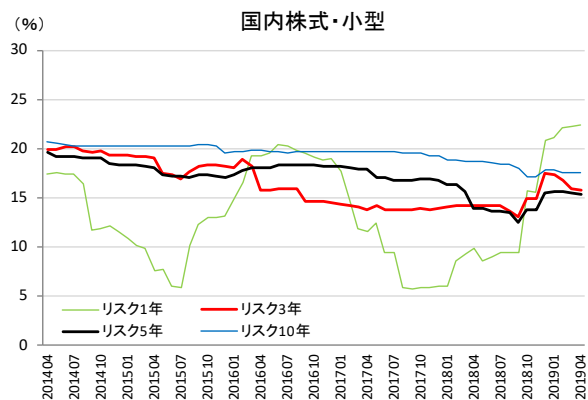
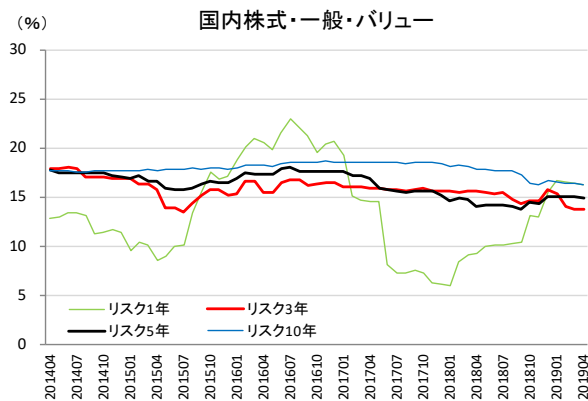
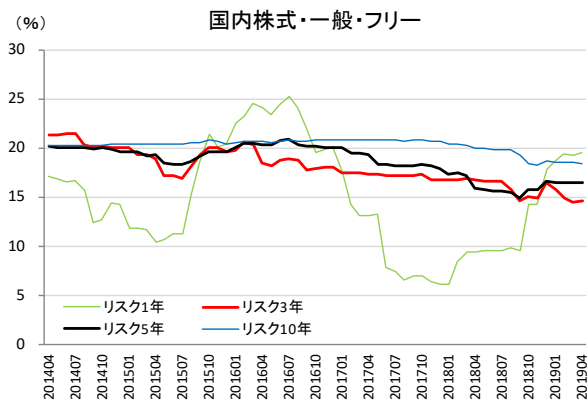
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

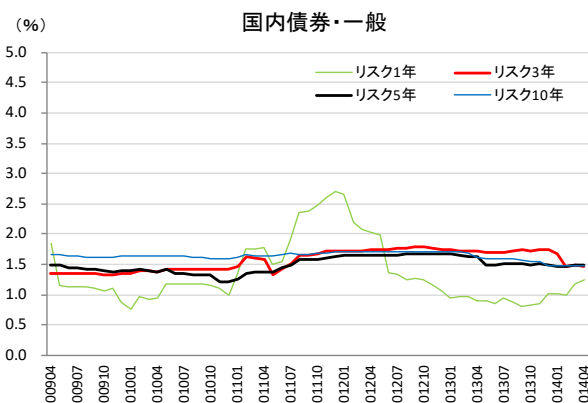
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

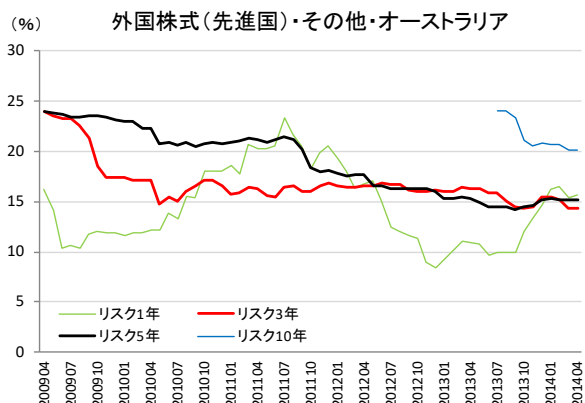
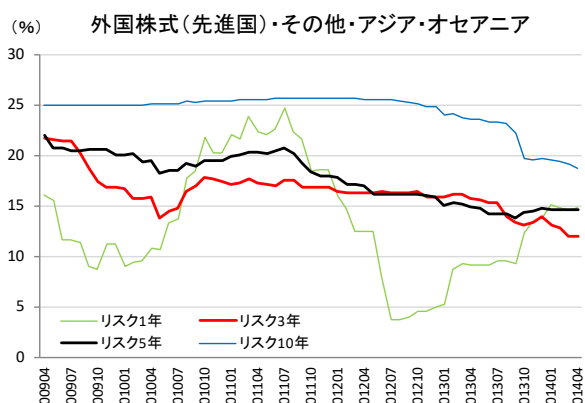
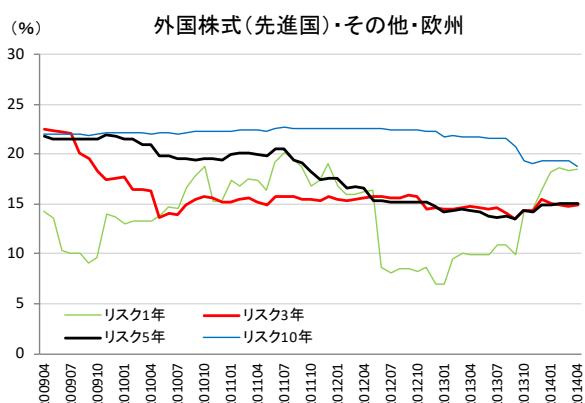
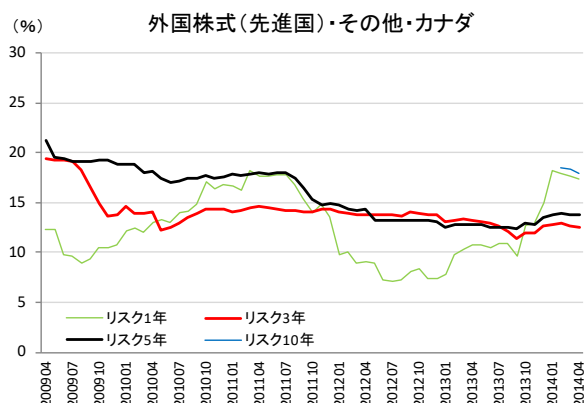
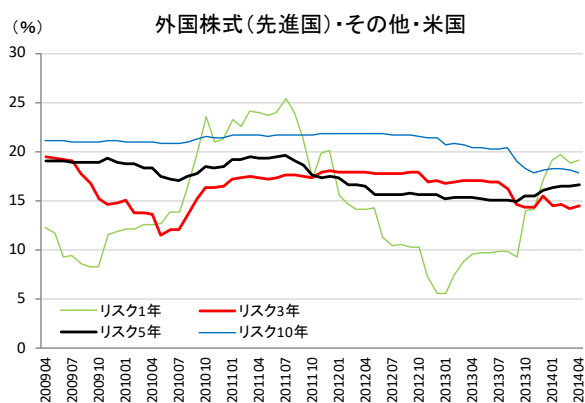
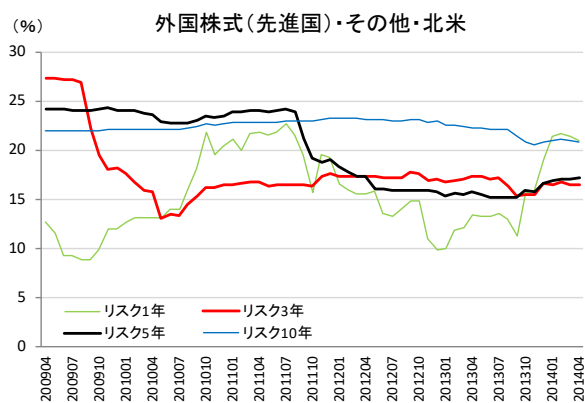
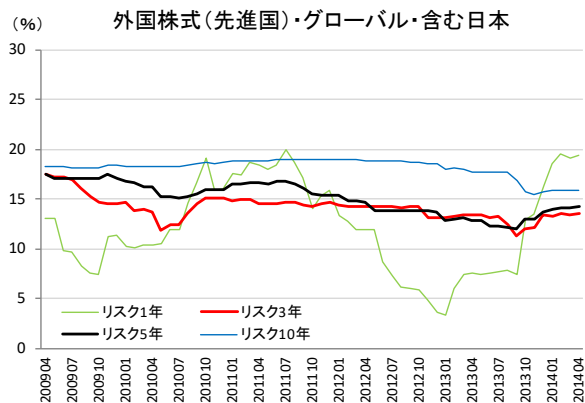
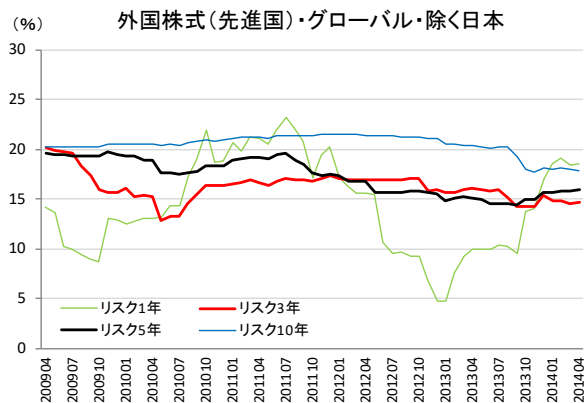


<2> リスク・サマリー

(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)]

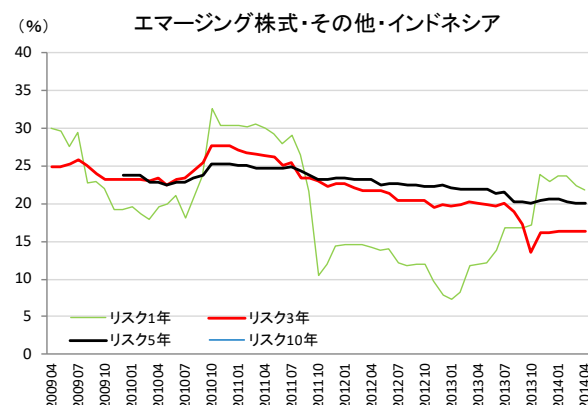
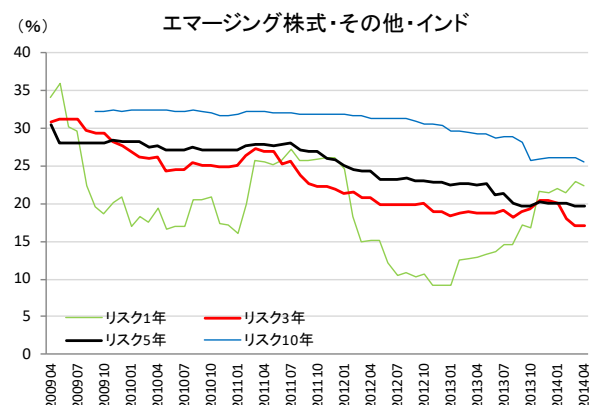
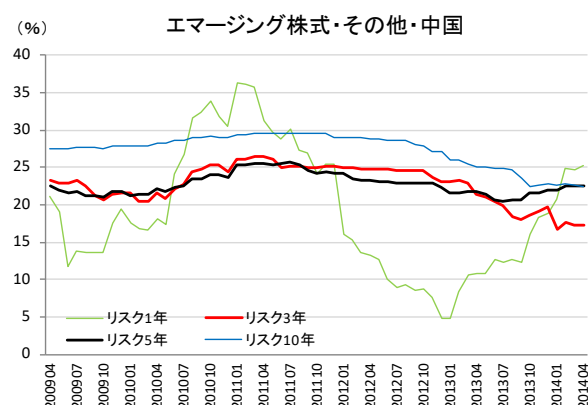
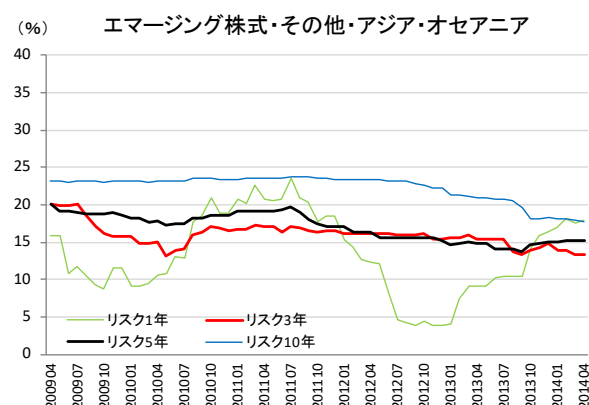
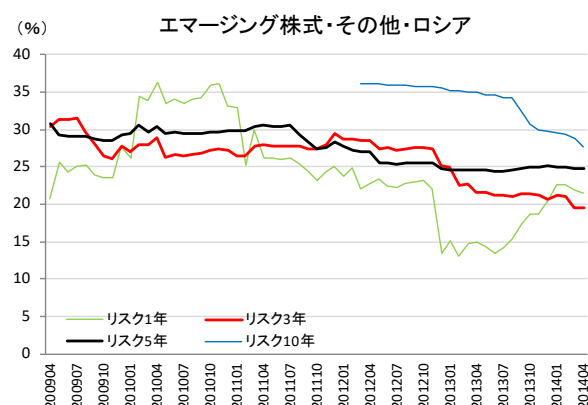
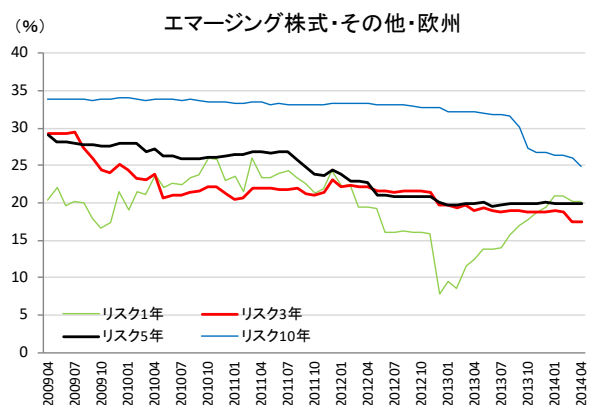
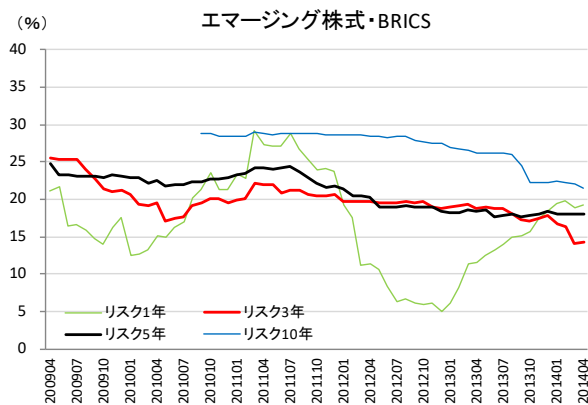
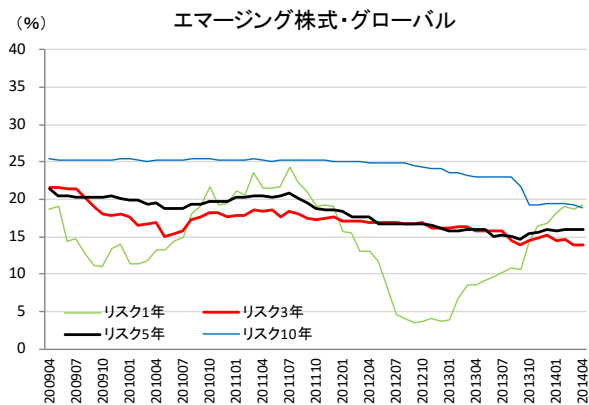


<2>リスク・サマリー

(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]

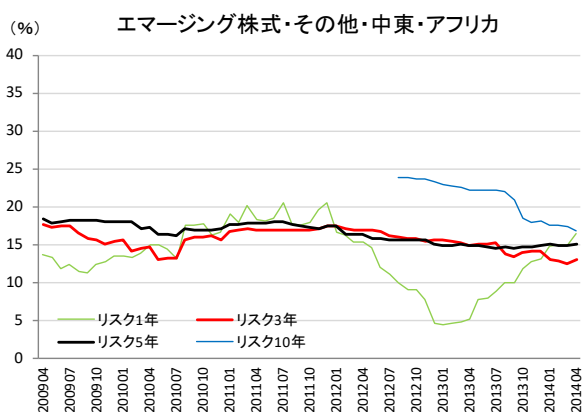
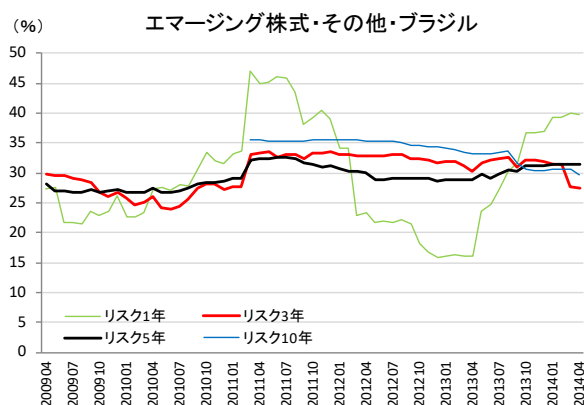
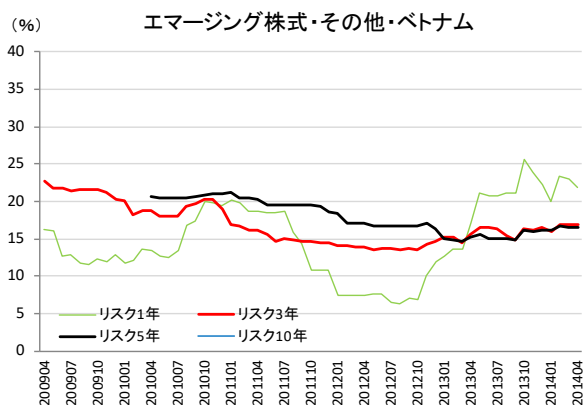
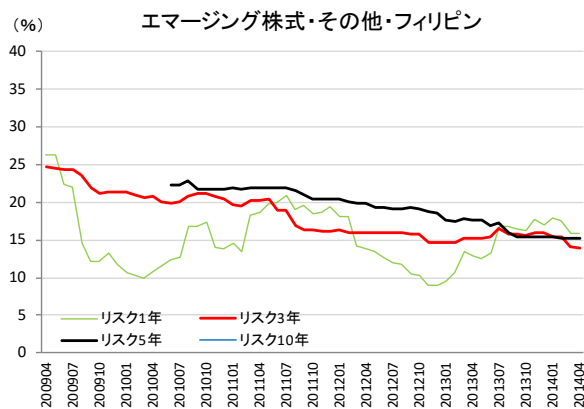
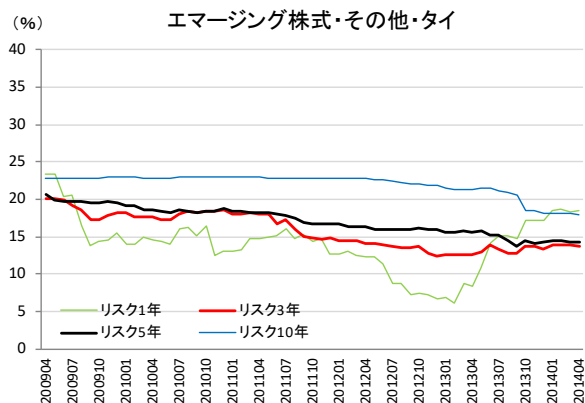


<2> リスク・サマリー

(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]

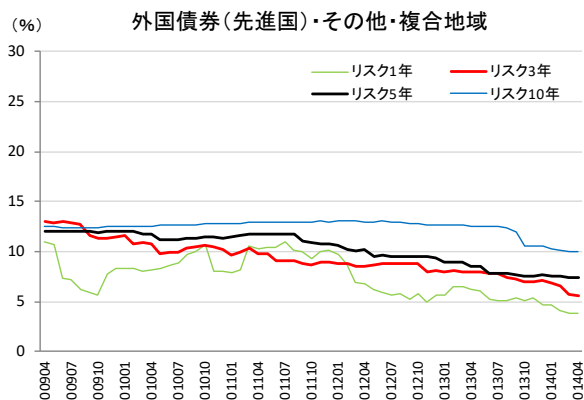
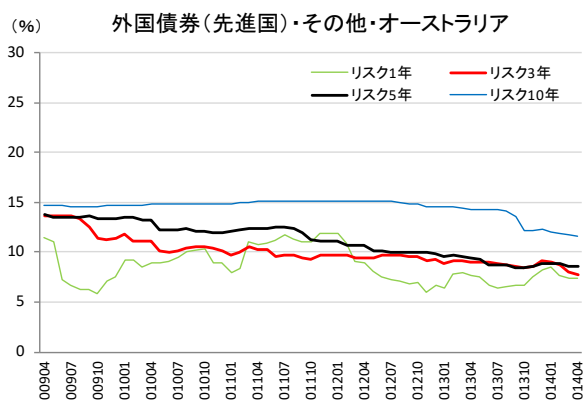
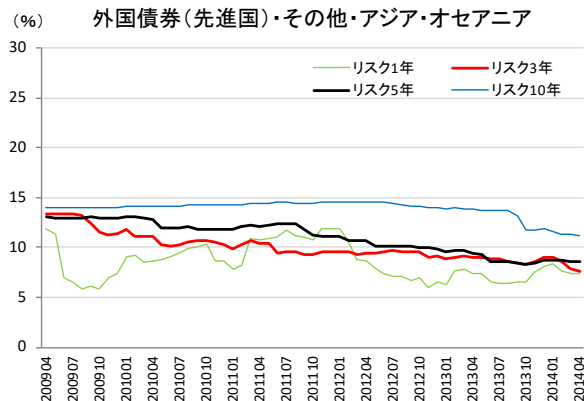
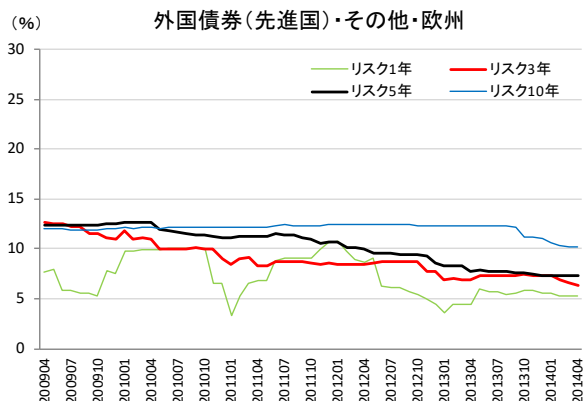
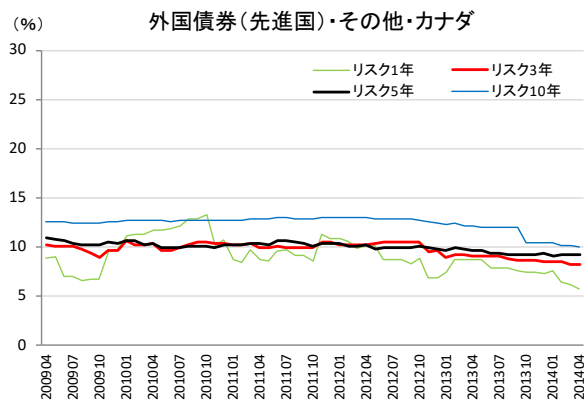
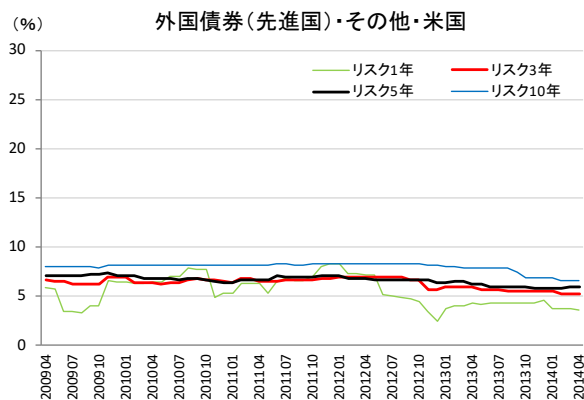
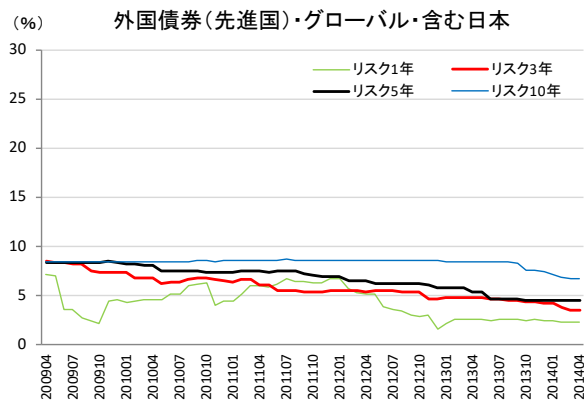
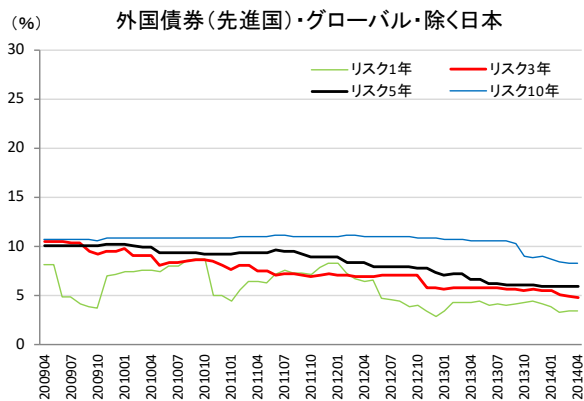


<2> リスク・サマリー

(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)]

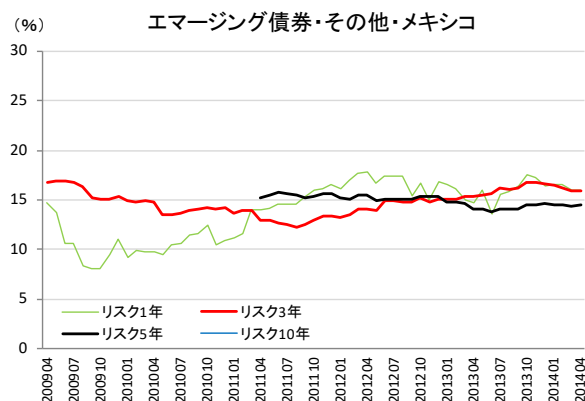
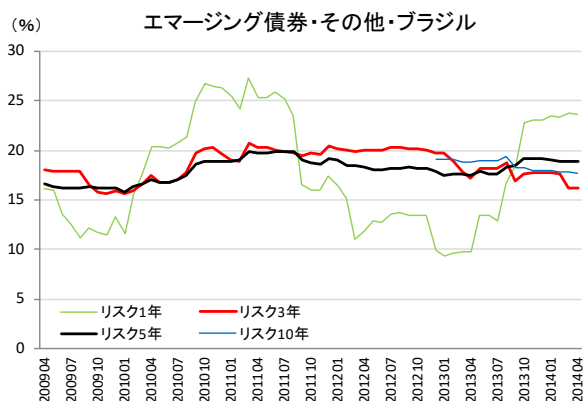
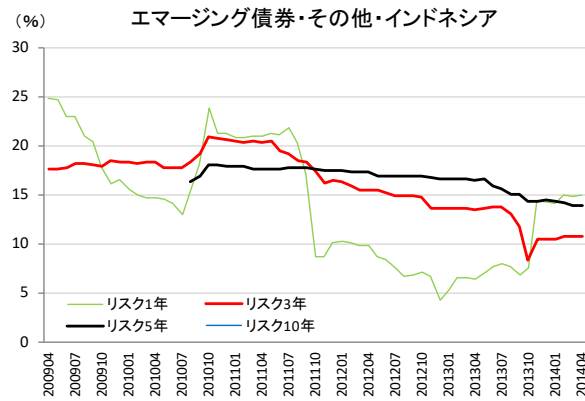
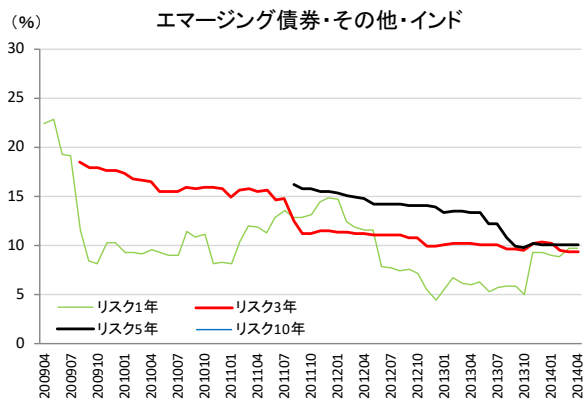
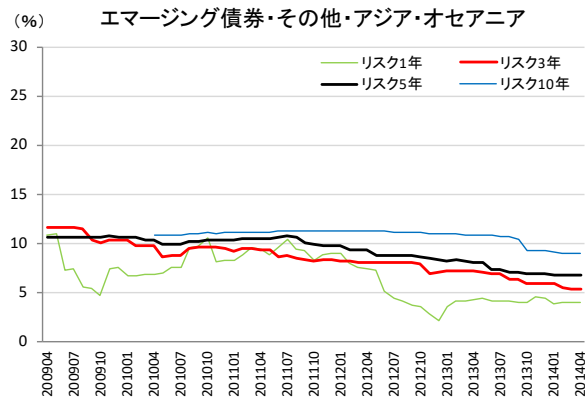
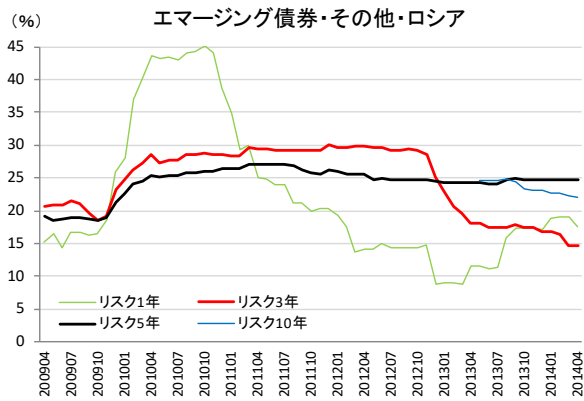
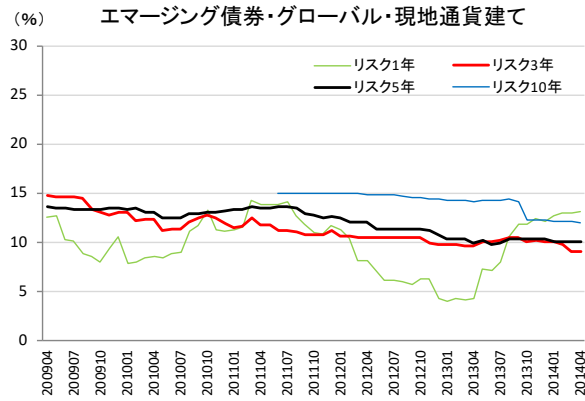
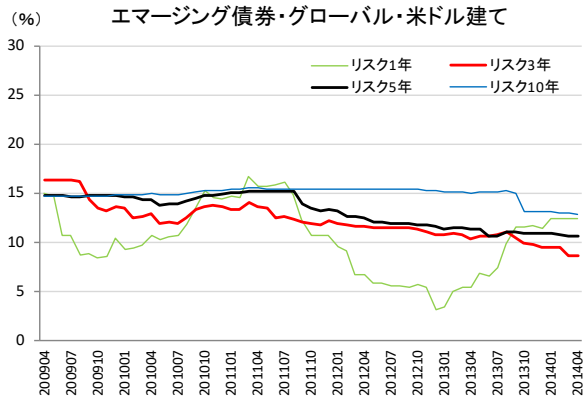


<2> リスク・サマリー

(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]

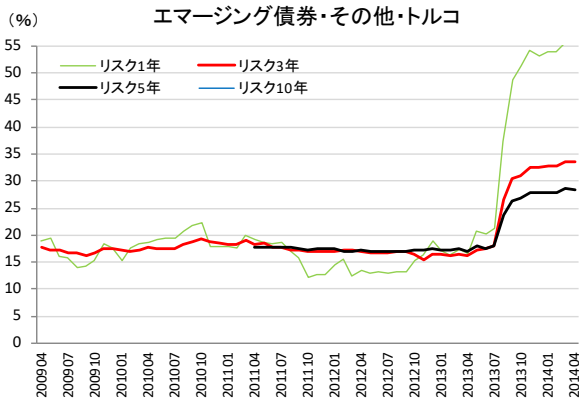


<2> リスク・サマリー

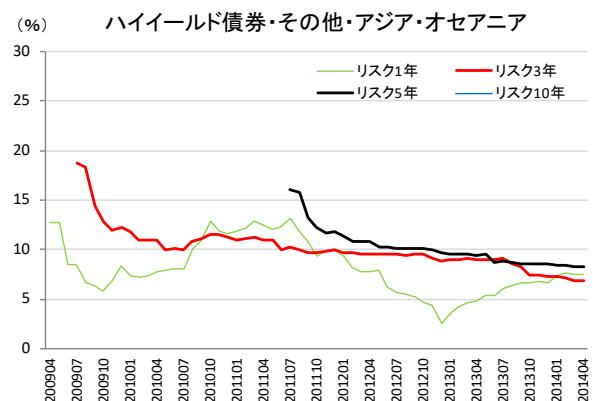
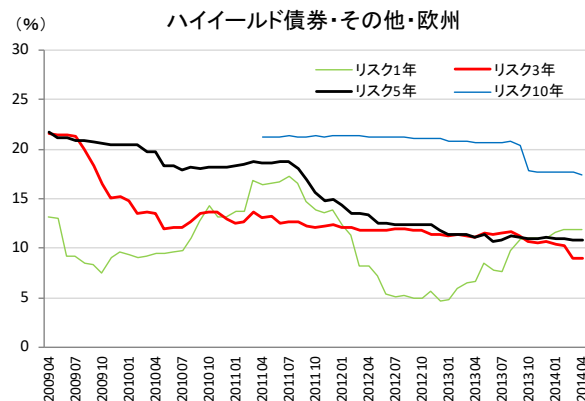
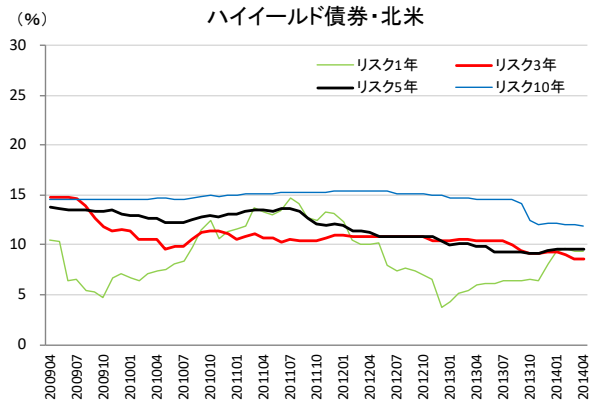
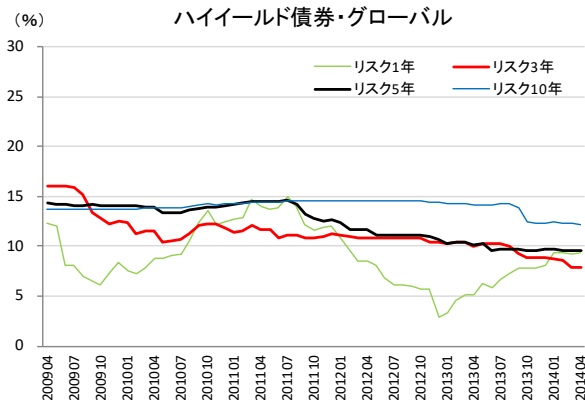
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

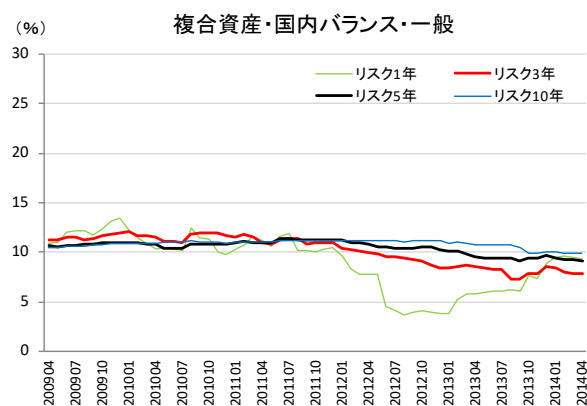
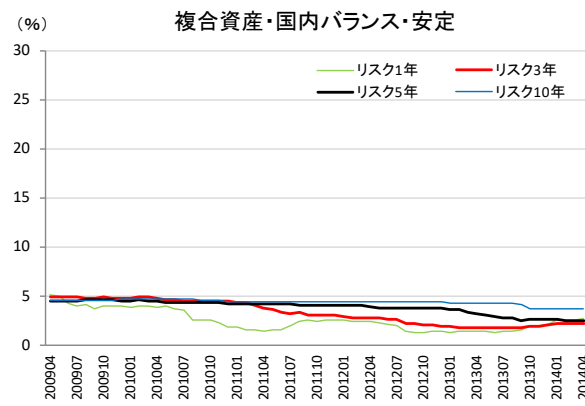
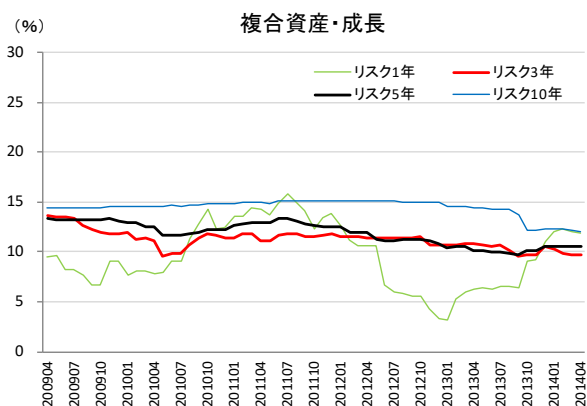
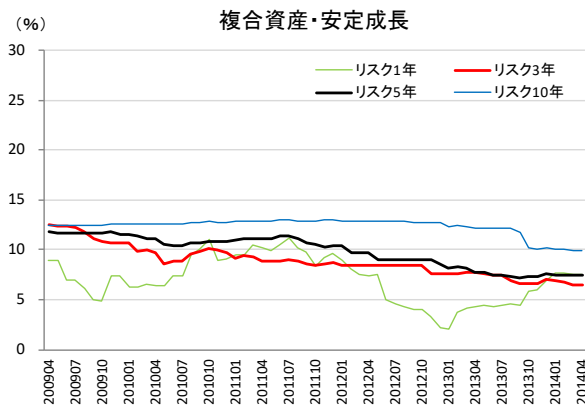
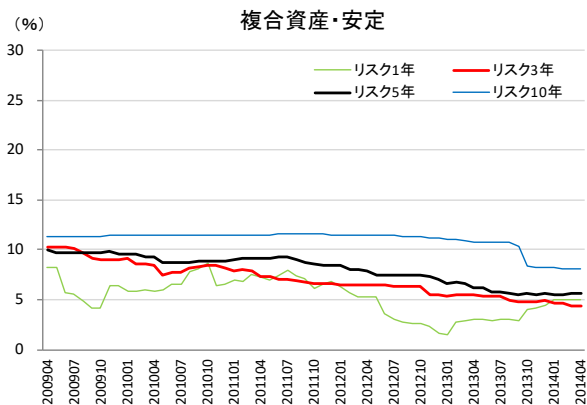


<2> リスク・サマリー

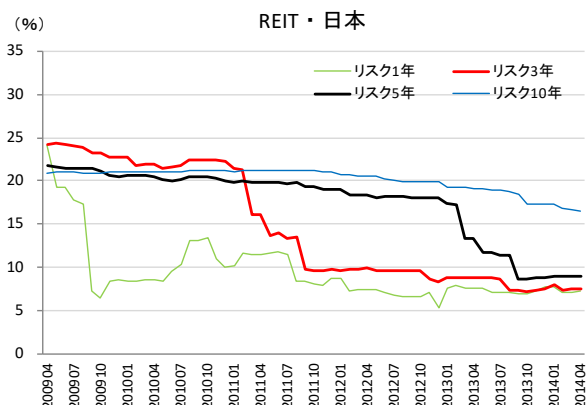
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

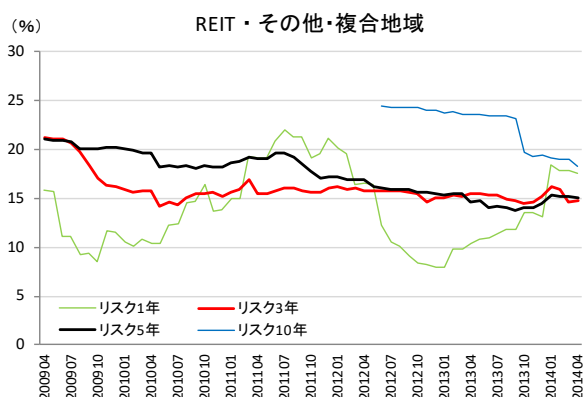
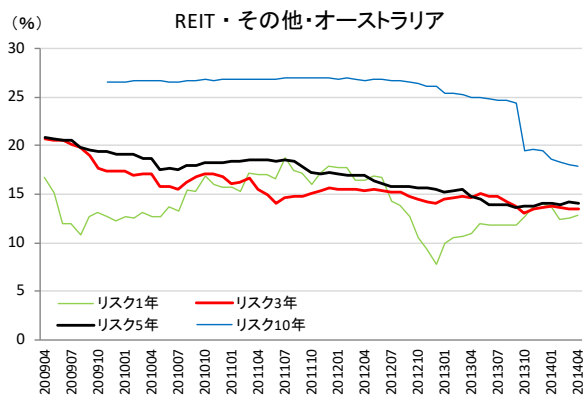
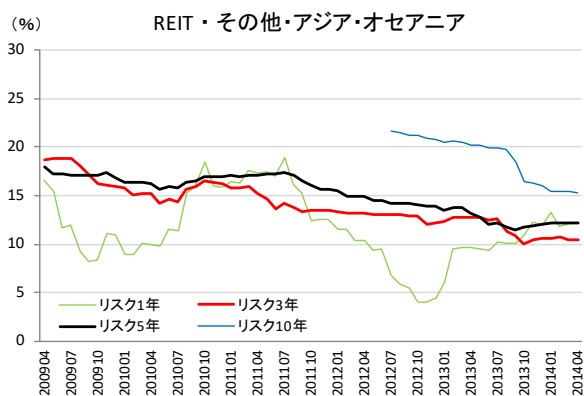
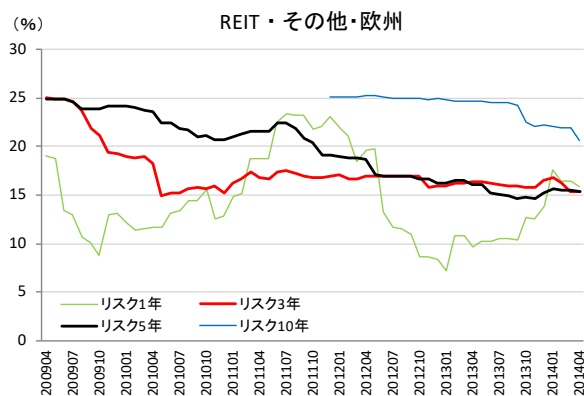
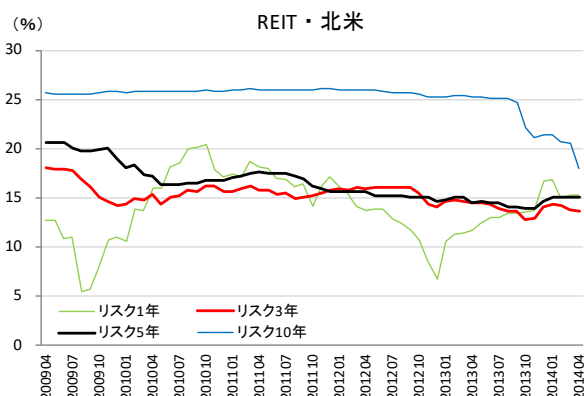
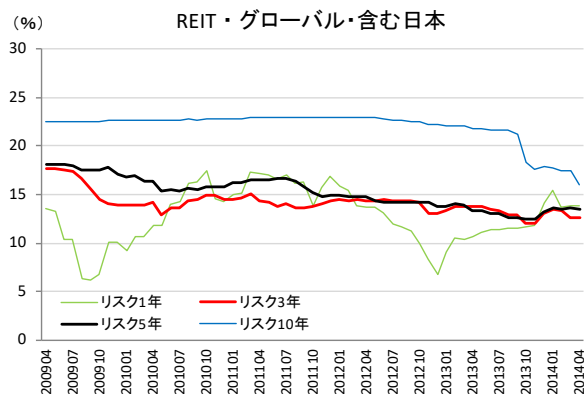
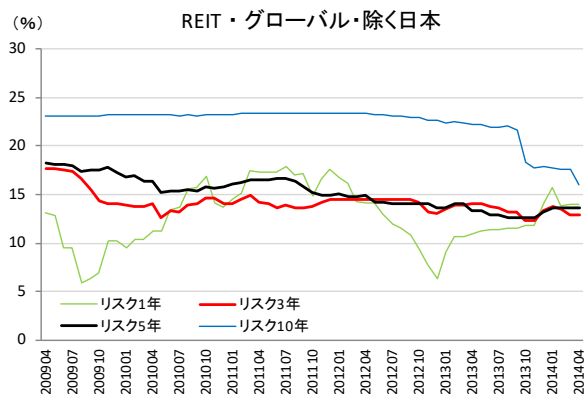


<2> リスク・サマリー

(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]

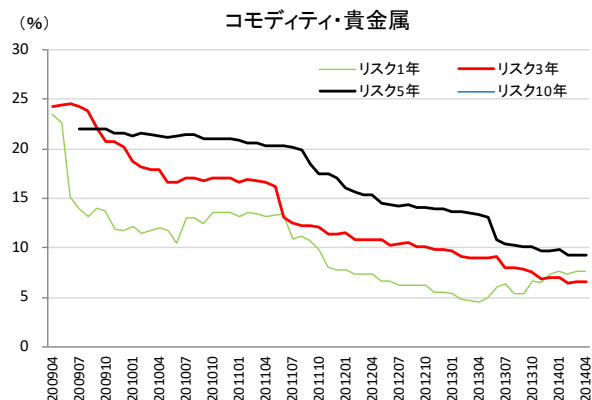
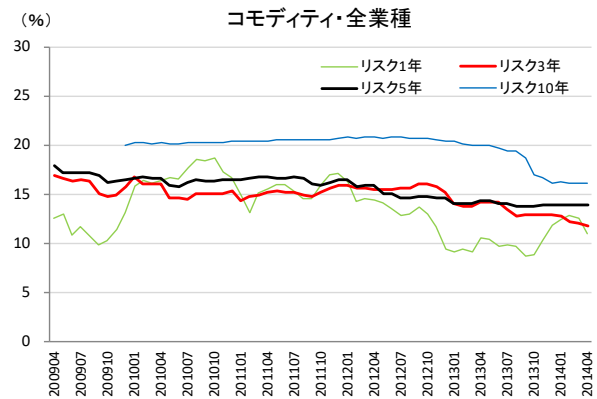
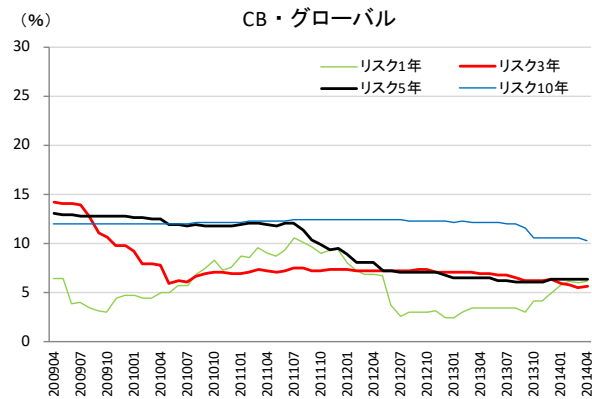
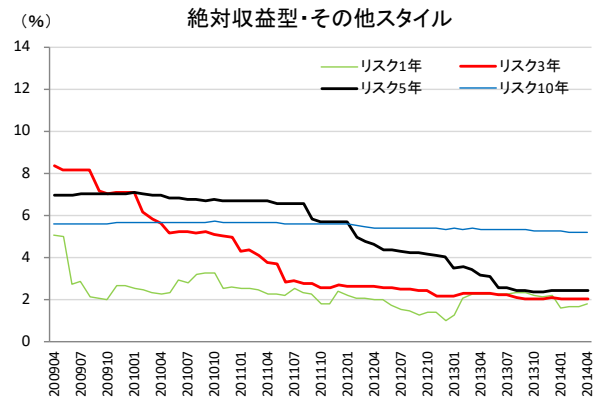
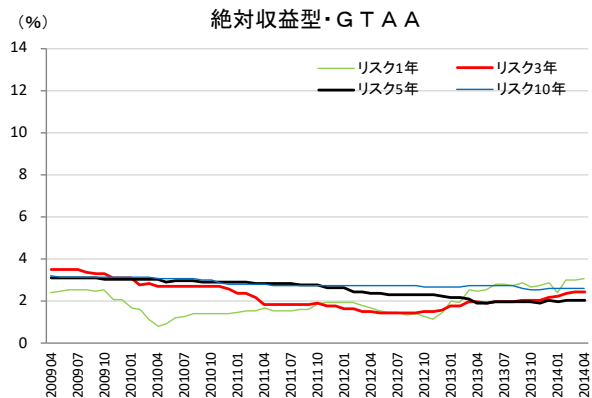
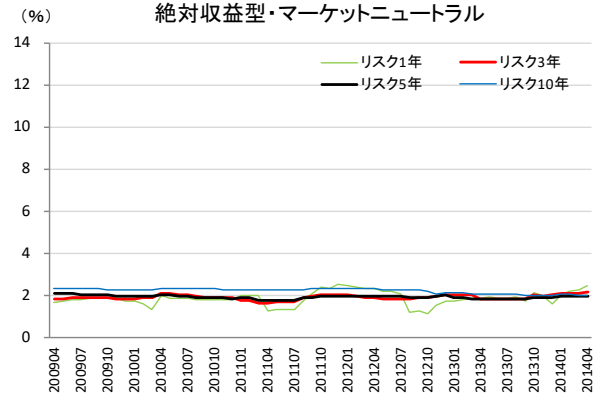
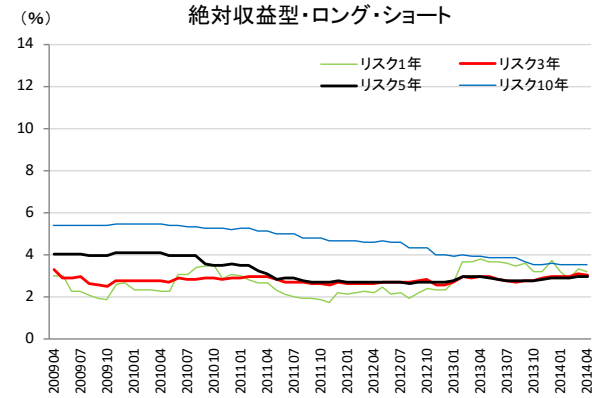


<2> リスク・サマリー

(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	-6,202	-9,648	-7,683	8,155
国内株式	-2,722	-2,931	118	6,185
一般	-1,009	-1,412	-527	2,555
フリー	-876	-1,200	-468	1,984
バリュー	-133	-212	-59	571
小型	-215	-174	-41	955
その他	-1,490	-1,327	706	2,562
日経225	-1,348	-1,426	125	1,161
TOPIX	-57	177	582	1,324
JPX日経400	-27	-33	9	4
国内債券	-138	119	-154	1,535
一般	-138	119	-154	1,535
外国株式(先進国)	-1,856	-3,286	-92	14,342
グローバル	-1,223	-1,958	514	11,437
除く日本	148	232	1,132	2,672
含む日本	-1,371	-2,190	-618	8,765
その他	-633	-1,328	-606	2,905
北米	6	19	32	20
米国	-560	-1,135	-178	4,192
カナダ	-9	-39	-55	-113
欧州	-37	-121	-220	-393
ドイツ	0	0	0	3
アジア・オセアニア	-4	-18	-31	-51
オーストラリア	-31	-32	-151	-745
ニュージーランド	0	0	0	-1
複合地域	0	-1	-1	-1
エマージング株式	-728	-1,447	-2,346	-1,744
グローバル	-325	-692	-1,030	-1,163
BRICS	-12	-29	-50	-80
その他	-390	-726	-1,266	-501
欧州	-6	-19	-44	-60
ロシア	-4	-11	-19	-43
アジア・オセアニア	-108	-266	-488	-672
中国	-78	-103	-96	674
インド	-207	-462	-720	-1,018
インドネシア	-4	-9	-28	-32
タイ	-2	-7	-11	-20
フィリピン	-2	-14	-42	-54
ベトナム	8	156	206	733
韓国	0	0	7	6
香港	-1	-1	-1	0
台湾	0	0	0	0
中南米	-1	-6	-10	-16
ブラジル	17	23	-3	19
メキシコ	0	-1	-1	-4
中東・アフリカ	-2	-3	-8	-13
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	1	-3	-6	2
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ヵ月	6ヵ月	1年
総合	-6,202	-9,648	-7,683	8,155
外国債券(先進国)	-437	-1,660	-4,314	-7,965
グローバル	-347	-1,292	-3,179	-5,346
除く日本	-181	-426	-1,172	-1,523
含む日本	-166	-866	-2,007	-3,823
その他	-90	-368	-1,135	-2,619
北米	-2	-4	-18	-43
米国	10	-67	-245	-927
カナダ	-37	-103	-197	-442
欧州	93	226	231	512
アジア・オセアニア	-54	-161	-368	-686
オーストラリア	-73	-188	-409	-786
ニュージーランド	-6	-16	-28	-46
複合地域	-21	-52	-96	-192
エマージング債券	-36	121	-350	-1,809
グローバル	-28	-102	-301	-951
米ドル建て	-38	-134	-343	-981
現地通貨建て	10	32	42	29
その他	-8	223	-50	-857
ロシア	-11	-34	-63	-148
アジア・オセアニア	-7	-20	-44	-115
インド	-42	-119	-272	-563
インドネシア	-4	-11	-30	-85
ブラジル	-20	-86	-230	-506
メキシコ	3	-15	-25	-119
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	0	3	4	4
複合地域	-1	-2	-3	-7
ハイイールド債券	-342	-1,017	-2,003	-5,588
グローバル	-49	-156	-314	-732
北米	-190	-607	-1,210	-3,671
その他	-102	-254	-480	-1,185
欧州	-86	-189	-336	-813
アジア・オセアニア	-13	-56	-127	-336
複合地域	0	-2	-2	-5
複合資産	-73	700	2,533	9,282
安定	-183	-199	-66	1,617
安定成長	-97	109	839	3,482
成長	-90	8	351	1,434
国内バランス	298	783	1,408	2,748
安定	294	778	1,406	2,769
一般	1	0	0	-1

<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か月	6か月	1年
総合	-6,202	-9,648	-7,683	8,155
国内REIT	218	599	549	-245
日本	218	599	549	-245
外国REIT	-317	-1,024	-1,984	-6,703
グローバル	16	-233	-381	-1,529
除く日本	82	247	375	591
含む日本	-66	-480	-756	-2,121
北米	-241	-1,038	-1,864	-5,011
その他	-92	246	262	-164
欧州	-8	-24	-39	-93
アジア・オセアニア	-41	385	468	221
オーストラリア	-38	-92	-131	-225
複合地域	0	0	0	0
複数国	-6	-22	-35	-67
その他	226	179	361	865
絶対収益型	32	-114	-33	529
ロング・ショート	-27	-77	-132	-67
マーケットニュートラル	42	103	126	456
GTAA	-9	-19	-26	-148
その他スタイル	25	-121	-1	281
CB	-25	-66	-139	-400
欧州	0	-1	-1	-4
アジア・オセアニア	2	1	0	-6
日本	-2	-3	-4	-8
グローバル	-25	-64	-135	-382
コモディティ	7	201	216	346
全業種	-6	3	22	57
貴金属	13	199	194	299
エネルギー	-1	-1	0	-11
その他コモディティ	0	0	1	2

< 4 > 純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別①

	純資産額 (億円)	構成比	本数	構成比	構成比
総合	635,737	100.00%	5,479	100.00%	
国内株式	106,826	16.80%	881	16.08%	
一般	64,119	10.09%	581	10.60%	
フリー	51,683	8.13%	463	8.45%	
バリュー	12,437	1.96%	118	2.15%	
小型	10,992	1.73%	93	1.70%	
その他	30,955	4.87%	199	3.63%	
日経225	16,041	2.52%	70	1.28%	
TOPIX	12,394	1.95%	74	1.35%	
JPX日経400	816	0.13%	20	0.37%	
国内債券	33,264	5.23%	131	2.39%	
一般	33,264	5.23%	131	2.39%	
外国株式(先進国)	149,866	23.57%	966	17.63%	
グローバル	116,335	18.30%	602	10.99%	
除く日本	24,720	3.89%	171	3.12%	
含む日本	91,615	14.41%	431	7.87%	
その他	33,531	5.27%	364	6.64%	
北米	397	0.06%	17	0.31%	
米国	24,124	3.79%	239	4.36%	
カナダ	421	0.07%	3	0.05%	
欧州	1,853	0.29%	60	1.10%	
ドイツ	28	0.00%	1	0.02%	
アジア・オセアニア	113	0.02%	8	0.15%	
オーストラリア	6,544	1.03%	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	35,517	5.59%	372	6.79%	
グローバル	9,506	1.50%	100	1.83%	
BRICS	721	0.11%	8	0.15%	
その他	25,290	3.98%	264	4.82%	
欧州	233	0.04%	9	0.16%	
ロシア	128	0.02%	5	0.09%	
アジア・オセアニア	7,500	1.18%	119	2.17%	
中国	2,616	0.41%	30	0.55%	
インド	11,833	1.86%	30	0.55%	
インドネシア	225	0.04%	8	0.15%	
タイ	104	0.02%	4	0.07%	
フィリピン	109	0.02%	5	0.09%	
ベトナム	1,181	0.19%	9	0.16%	
韓国	9	0.00%	2	0.04%	
香港	9	0.00%	1	0.02%	
台湾	2	0.00%	2	0.04%	
中南米	83	0.01%	2	0.04%	
ブラジル	1,007	0.16%	21	0.38%	
メキシコ	23	0.00%	3	0.05%	
中東・アフリカ	130	0.02%	7	0.13%	
南アフリカ	1	0.00%	1	0.02%	
トルコ	74	0.01%	4	0.07%	
複合地域	24	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	635,737	100.00%	5,479	100.00%	
外国債券(先進国)	87,183	13.71%	887	16.19%	
グローバル	63,367	9.97%	590	10.77%	
除く日本	33,841	5.32%	246	4.49%	
含む日本	29,527	4.64%	344	6.28%	
その他	23,815	3.75%	297	5.42%	
北米	103	0.02%	6	0.11%	
米国	5,758	0.91%	161	2.94%	
カナダ	1,530	0.24%	6	0.11%	
欧州	1,334	0.21%	34	0.62%	
アジア・オセアニア	2,735	0.43%	12	0.22%	
オーストラリア	10,452	1.64%	44	0.80%	
ニュージーランド	189	0.03%	14	0.26%	
複合地域	1,678	0.26%	12	0.22%	
エマージング債券	20,246	3.18%	311	5.68%	
グローバル	9,120	1.43%	197	3.60%	
米ドル建て	7,411	1.17%	156	2.85%	
現地通貨建て	1,709	0.27%	41	0.75%	
その他	11,126	1.75%	114	2.08%	
ロシア	288	0.05%	5	0.09%	
アジア・オセアニア	554	0.09%	26	0.47%	
インド	4,762	0.75%	22	0.40%	
インドネシア	629	0.10%	12	0.22%	
ブラジル	3,411	0.54%	25	0.46%	
メキシコ	599	0.09%	9	0.16%	
南アフリカ	3	0.00%	1	0.02%	
トルコ	144	0.02%	6	0.11%	
複合地域	55	0.01%	1	0.02%	
ハイイールド債券	24,599	3.87%	313	5.71%	
グローバル	3,772	0.59%	58	1.06%	
北米	16,122	2.54%	164	2.99%	
その他	4,705	0.74%	91	1.66%	
欧州	3,693	0.58%	51	0.93%	
アジア・オセアニア	879	0.14%	34	0.62%	
複合地域	51	0.01%	1	0.02%	
複合資産	89,697	14.11%	965	17.61%	
安定	27,862	4.38%	291	5.31%	
安定成長	41,376	6.51%	408	7.45%	
成長	12,249	1.93%	232	4.23%	
国内バランス	8,210	1.29%	34	0.62%	
安定	7,578	1.19%	10	0.18%	
一般	502	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	635,737	100.0%	5,479	100.0%
国内REIT	26,980	4.2%	125	2.3%
日本	26,980	4.2%	125	2.3%
外国REIT	48,594	7.6%	302	5.5%
グローバル	18,721	2.9%	135	2.5%
除く日本	3,490	0.5%	44	0.8%
含む日本	15,231	2.4%	91	1.7%
北米	24,721	3.9%	95	1.7%
その他	5,152	0.8%	72	1.3%
欧州	311	0.0%	20	0.4%
アジア・オセアニア	3,701	0.6%	34	0.6%
オーストラリア	764	0.1%	13	0.2%
複合地域	52	0.0%	3	0.1%
複数国	324	0.1%	2	0.0%
その他	12,964	2.0%	226	4.1%
絶対収益型	6,876	1.1%	99	1.8%
ロング・ショート	1,114	0.2%	31	0.6%
マーケットニュートラル	912	0.1%	12	0.2%
GTAA	456	0.1%	16	0.3%
その他スタイル	4,394	0.7%	40	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	44	0.0%	1	0.0%
日本	71	0.0%	3	0.1%
グローバル	1,578	0.2%	40	0.7%
コモディティ	1,811	0.3%	32	0.6%
全業種	891	0.1%	14	0.3%
貴金属	890	0.1%	16	0.3%
エネルギー	23	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	11,518	7.8	4.12	4.44	1.313
国内株式	14,135	10.8	1.50	1.96	1.188
一般	12,992	10.4	2.05	2.78	1.423
フリー	12,650	9.8	2.37	3.24	1.469
バリュー	14,337	12.6	0.67	0.78	1.232
小型	20,058	11.2	1.29	1.43	1.715
その他	14,852	11.6	0.49	0.51	0.502
日経225	15,398	13.0	0.51	0.51	0.586
TOPIX	15,469	13.0	0.35	0.38	0.342
JPX日経400	13,132	4.7	0.16	0.18	0.553
国内債券	11,138	10.2	0.35	0.35	0.349
一般	11,138	10.2	0.35	0.35	0.349
外国株式(先進国)	12,620	6.4	4.22	4.58	1.606
グローバル	13,259	6.9	2.98	3.25	1.579
除く日本	15,988	8.8	0.94	1.02	0.809
含む日本	12,176	6.1	3.57	3.88	1.787
その他	11,563	5.5	8.49	9.15	1.698
北米	11,054	5.8	4.84	4.60	1.877
米国	12,211	5.0	6.60	6.50	1.666
カナダ	6,797	7.1	20.34	25.97	1.967
欧州	11,162	7.9	3.55	4.12	1.696
ドイツ	10,497	5.1	0.00	0.00	0.756
アジア・オセアニア	9,749	5.0	7.15	8.44	1.679
オーストラリア	9,018	4.8	15.93	19.15	1.795
ニュージーランド	13,976	6.8	3.93	3.58	1.642
複合地域	8,678	6.0	1.02	1.15	1.674
エマージング株式	12,255	8.3	3.18	3.85	1.817
グローバル	11,349	6.1	2.34	2.72	1.566
BRICS	13,895	11.3	1.00	0.99	2.033
その他	12,549	9.0	3.57	4.36	1.906
欧州	8,968	13.1	0.20	0.19	1.967
ロシア	9,395	10.1	0.50	0.45	1.968
アジア・オセアニア	13,093	9.0	8.55	10.26	1.698
中国	18,558	9.2	0.80	0.90	1.941
インド	12,459	9.3	1.14	1.20	2.044
インドネシア	10,915	7.8	0.32	0.30	1.823
タイ	11,819	11.0	0.54	0.60	1.685
フィリピン	11,505	5.7	0.52	0.49	1.766
ベトナム	12,252	3.7	1.13	1.36	1.833
韓国	10,622	5.0	2.98	3.73	1.774
香港	16,856	9.7	1.86	1.84	0.842
台湾	13,959	8.0	0.96	1.04	1.700
中南米	8,100	12.3	0.00	0.00	2.004
ブラジル	6,749	9.0	9.50	15.52	1.828
メキシコ	8,640	5.4	0.00	0.00	1.883
中東・アフリカ	10,777	9.6	0.35	0.37	2.088
南アフリカ	9,120	8.8	0.00	0.00	1.577
トルコ	5,701	12.8	0.00	0.00	2.008
複合地域	18,551	10.9	2.72	2.85	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	11,518	7.8	4.12	4.44	1.313
外国債券(先進国)	9,750	7.3	3.13	3.30	1.139
グローバル	10,180	7.5	2.11	2.20	1.091
除く日本	10,731	9.9	2.13	2.21	0.875
含む日本	9,786	5.8	2.09	2.19	1.338
その他	8,897	7.0	5.86	6.26	1.266
北米	10,163	5.0	1.83	1.85	1.806
米国	9,527	5.8	4.31	4.48	1.308
カナダ	7,587	6.8	6.73	7.16	1.344
欧州	8,358	10.0	1.99	2.06	1.037
アジア・オセアニア	7,930	8.5	4.58	4.86	1.398
オーストラリア	8,122	9.7	7.47	8.14	1.235
ニュージーランド	9,409	4.6	3.30	3.35	1.316
複合地域	5,726	9.4	5.28	5.50	1.174
エマージング債券	8,613	7.8	7.88	8.75	1.581
グローバル	8,881	8.6	7.13	8.38	1.577
米ドル建て	8,973	8.9	7.55	8.86	1.617
現地通貨建て	8,528	7.4	5.32	6.27	1.406
その他	8,151	6.4	8.54	9.05	1.585
ロシア	8,227	6.2	6.03	6.24	1.588
アジア・オセアニア	8,359	6.5	11.86	13.24	1.618
インド	9,226	4.5	8.42	9.09	1.674
インドネシア	7,357	6.8	6.56	7.02	1.652
ブラジル	8,867	9.2	8.79	10.29	1.562
メキシコ	6,429	6.4	8.77	9.48	1.372
南アフリカ	7,286	7.0	6.21	7.41	1.404
トルコ	2,895	6.3	8.06	14.75	1.428
複合地域	4,230	12.7	5.34	5.67	1.188
ハイイールド債券	8,750	8.0	9.04	9.97	1.677
グローバル	7,278	8.1	7.92	8.90	1.593
北米	9,649	9.0	8.71	9.26	1.675
その他	8,068	6.2	11.05	13.27	1.749
欧州	7,639	6.0	11.48	14.03	1.729
アジア・オセアニア	8,619	7.0	10.45	11.62	1.848
複合地域	4,584	15.1	5.05	5.24	1.780
複合資産	11,630	7.6	1.59	1.69	1.113
安定	10,990	7.1	0.72	0.77	1.183
安定成長	11,275	7.9	2.45	2.62	1.130
成長	13,154	7.7	0.27	0.27	1.013
国内バランス	10,980	7.3	2.17	2.23	0.946
安定	10,591	8.0	2.27	2.33	0.913
一般	11,384	8.5	1.04	1.09	1.360

(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	11,518	7.8	4.12	4.44	1.313
国内REIT	13,256	7.4	10.00	10.36	0.958
日本	13,256	7.4	10.00	10.36	0.958
外国REIT	10,866	6.4	12.85	12.85	1.552
グローバル	11,624	7.4	10.88	11.16	1.417
除く日本	13,932	6.1	4.62	5.17	1.095
含む日本	10,508	8.0	12.31	12.54	1.491
北米	9,969	6.1	14.71	14.45	1.602
その他	10,629	5.1	11.11	11.29	1.807
欧州	9,154	4.7	5.44	6.28	1.841
アジア・オセアニア	12,080	5.0	13.48	13.75	1.858
オーストラリア	9,688	4.4	6.06	5.80	1.689
複合地域	7,531	7.2	1.36	1.39	0.841
複数国	11,470	12.0	3.00	2.57	1.627
その他					
絶対収益型	10,168	5.3	0.15	0.16	1.600
ロング・ショート	10,145	5.9	0.47	0.49	1.629
マーケットニュートラル	10,561	4.2	0.08	0.08	1.214
GTAA	10,561	6.6	0.64	0.68	1.622
その他スタイル	9,910	4.8	0.04	0.03	1.671
CB	10,771	6.2	1.04	1.10	1.490
欧州	6,170	5.1	8.33	11.01	1.751
アジア・オセアニア	8,444	8.8	3.53	3.55	1.804
日本	10,984	8.0	0.17	0.18	1.055
グローバル	11,158	6.1	0.99	1.05	1.501
コモディティ	7,924	6.7	0.01	0.01	0.906
全業種	6,261	7.7	0.00	0.00	1.240
貴金属	9,005	5.9	0.02	0.02	0.571
エネルギー	10,268	10.2	0.00	0.00	1.059
その他コモディティ	11,566	2.6	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 : 03-6721-1013

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