

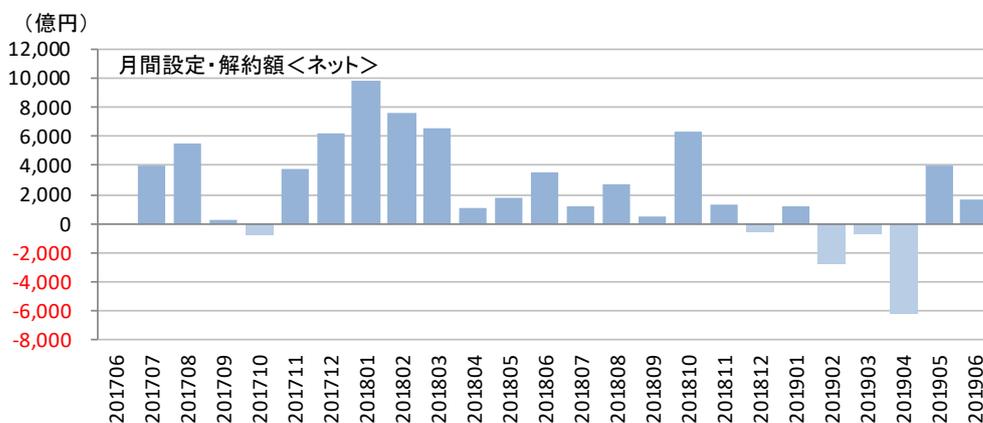
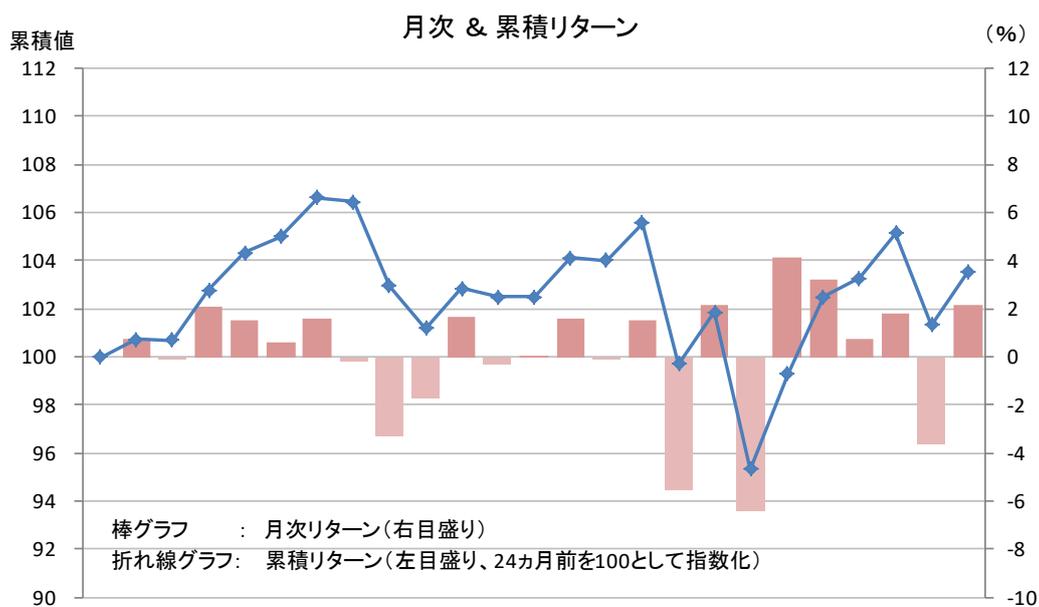
# 投信指数 MAB-FPI

## パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

### 2019年6月

**「総合」 +2.15 %**  
**(前月 -3.62 %)**



# 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		12,713	12,445	267	2.15	
国内株式		14,794	14,438	356	2.46	
一般		14,442	14,096	347	2.46	
フリー		13,587	13,290	297	2.24	
バリュー		18,494	17,889	605	3.38	
小型		31,395	31,209	186	0.60	
その他		14,481	14,037	443	3.16	
日経225		13,842	13,390	452	3.37	
TOPIX		14,310	13,931	379	2.72	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	13,477	13,107	370	2.83	
国内債券		13,405	13,327	78	0.59	
一般		13,405	13,327	78	0.59	
外国株式(先進国)		14,127	13,600	526	3.87	
グローバル		15,531	14,920	610	4.09	
除く日本		21,868	21,127	742	3.51	
含む日本		14,125	13,549	575	4.25	
その他		11,275	10,935	339	3.10	
北米		11,231	10,849	382	3.52	
米国		16,594	16,061	533	3.32	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	16,549	16,192	357	2.20	
欧州		17,502	16,914	588	3.48	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	8,469	8,169	300	3.67	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	8,654	8,571	82	0.96	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	32,576	31,646	931	2.94	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	15,603	15,260	344	2.25	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	33,909	32,334	1,575	4.87	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	8,679	8,547	132	1.55	
エマージング株式		14,449	14,111	338	2.40	
グローバル		13,999	13,341	658	4.93	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	23,262	22,064	1,197	5.43	
その他		15,076	14,868	208	1.40	
欧州		25,416	23,801	1,615	6.79	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	10,184	9,446	738	7.81	
アジア・オセアニア		15,303	14,616	688	4.71	
中国		31,410	29,649	1,761	5.94	
インド	10,000 (2004.09.30)	32,613	33,108	-495	-1.50	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	14,266	13,355	910	6.82	
タイ		24,566	22,873	1,693	7.40	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,400	8,151	249	3.05	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	14,089	14,786	-697	-4.71	
韓国	10,000 (1997.06.30)	20,772	20,118	653	3.25	
香港		23,518	22,393	1,125	5.02	
台湾	10,000 (2008.03.31)	14,392	13,586	807	5.94	
中南米	7,427 (2006.04.28)	8,459	8,037	422	5.25	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,809	9,289	520	5.60	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	8,956	8,914	42	0.47	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	9,268	9,069	199	2.19	
南アフリカ	10,000 (2010.06.30)	6,280	5,775	505	8.74	
トルコ		19,583	18,310	1,274	6.96	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	20,275	19,413	862	4.44	

※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		12,713	12,445	267	2.15
外国債券(先進国)		17,615	17,423	192	1.10
グローバル		17,947	17,727	220	1.24
除く日本		19,094	18,843	251	1.33
含む日本		17,360	17,164	196	1.14
その他		16,677	16,556	121	0.73
北米	9,052 (2013.05.31)	10,333	10,293	40	0.39
米国		15,433	15,440	-8	-0.05
カナダ	10,000 (2003.05.30)	13,925	13,601	324	2.38
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,366	15,199	167	1.10
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	18,335	18,161	174	0.96
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	22,571	22,383	188	0.84
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	10,874	10,626	249	2.34
複合地域	10,000 (2001.11.30)	16,334	16,235	99	0.61
エマーGING債券		17,063	16,635	427	2.57
グローバル		18,383	17,844	539	3.02
米ドル建て		19,021	18,510	511	2.76
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,621	12,120	501	4.14
その他	8,647 (2005.03.31)	12,577	12,306	271	2.20
ロシア	10,000 (2008.05.30)	10,731	10,276	456	4.44
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	13,937	13,870	67	0.48
インド	10,000 (2011.08.31)	15,673	15,623	50	0.32
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	12,947	12,316	631	5.12
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	13,112	12,543	569	4.54
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	11,357	11,138	219	1.97
南アフリカ	10,000 (2010.03.31)	10,869	10,396	473	4.55
トルコ	10,000 (2011.04.28)	5,007	4,468	539	12.07
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,705	10,467	238	2.28
ハイイールド債券		21,406	21,106	300	1.42
グローバル	10,000 (1997.06.30)	21,887	21,493	394	1.83
北米		20,676	20,456	221	1.08
その他	10,000 (2004.03.31)	21,742	21,259	483	2.27
欧州	10,000 (2006.04.28)	21,793	21,220	573	2.70
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,204	14,116	88	0.63
複合地域	10,000 (2004.03.31)	18,926	18,649	277	1.49
複合資産		16,880	16,592	288	1.74
安定	10,000 (1998.10.30)	15,285	15,043	242	1.61
安定成長		18,034	17,699	336	1.90
成長		19,684	19,246	438	2.28
国内バランス		13,051	12,968	83	0.64
安定		14,038	13,957	80	0.58
一般		13,692	13,501	191	1.41

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

## &lt;1&gt;パフォーマンス・サマリー

## (1) 当月リターン

## 「総合」およびファンド分類別③

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)	
総合		12,713	12,445	267	2.15	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	31,414	30,998	417	1.34	
日本	10,000 (2003.10.31)	31,414	30,998	417	1.34	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	25,728	25,601	128	0.50	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	22,380	22,330	50	0.23	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	24,017	23,908	109	0.46	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	22,502	22,463	38	0.17	
北米	10,000 (2003.09.30)	25,380	25,387	-7	-0.03	
その他	10,000 (2004.04.30)	27,606	26,548	1,058	3.99	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,330	5,434	-104	-1.92	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	20,870	19,896	974	4.90	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	15,108	14,574	535	3.67	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	6,961	6,787	174	2.56	
複数国	10,000 (2004.04.30)	33,732	33,652	81	0.24	
その他		5,752	5,611	140	2.50	
絶対収益型		7,647	7,593	54	0.71	
ロング・ショート		8,973	8,907	66	0.74	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	9,075	9,108	-33	-0.36	
GTAA		10,692	10,535	157	1.49	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,264	7,203	61	0.85	
CB		18,451	18,165	286	1.58	
欧州	8,078 (2014.03.31)	6,427	6,408	19	0.29	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	15,119	14,818	301	2.03	
日本		19,802	19,731	71	0.36	
グローバル		32,361	31,844	517	1.62	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	7,734	7,431	302	4.07	
全業種	10,000 (2004.12.30)	6,434	6,466	-32	-0.50	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	14,229	13,123	1,106	8.43	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	4,722	4,780	-57	-1.20	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	10,026	9,743	283	2.91	

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

## ＜1＞パフォーマンス・サマリー

## (2) 期間別リターン

## 「総合」およびファンド分類別①

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	0.22	8.56	0.98	8.56
国内株式	-1.46	6.78	-9.80	6.78
一般	-1.57	6.75	-10.70	6.75
フリー	-1.43	7.51	-10.81	7.51
バリュー	-2.14	3.68	-10.24	3.68
小型	-2.49	8.96	-13.70	8.96
その他	-0.84	6.06	-5.88	6.06
日経225	0.42	7.13	-3.03	7.13
TOPIX	-2.42	5.04	-8.53	5.04
JPX日経400	-2.42	5.29	-7.99	5.29
国内債券	0.81	2.14	2.22	2.14
一般	0.81	2.14	2.22	2.14
外国株式(先進国)	1.04	15.70	2.55	15.70
グローバル	0.88	15.76	2.37	15.76
除く日本	1.18	14.72	3.06	14.72
含む日本	0.80	16.02	2.20	16.02
その他	1.61	15.54	3.14	15.54
北米	0.32	16.18	0.34	16.18
米国	1.54	16.50	4.94	16.50
カナダ	1.48	12.61	-0.62	12.61
欧州	2.42	14.64	-0.94	14.64
ドイツ	4.76	12.89	-4.95	12.89
イギリス	-6.06	4.31	-5.82	4.31
アジア・オセアニア	-1.56	7.51	0.93	7.51
オーストラリア	1.80	12.80	-0.15	12.80
ニュージーランド	1.35	13.91	10.65	13.91
複合地域	-4.95	7.29	-19.00	7.29
エマージング株式	-0.13	9.44	2.08	9.44
グローバル	1.17	14.26	2.79	14.26
BRICS	3.70	16.73	12.13	16.73
その他	-0.72	7.46	1.55	7.46
欧州	7.95	17.74	10.95	17.74
ロシア	11.26	24.58	19.08	24.58
アジア・オセアニア	-1.38	9.56	-0.56	9.56
中国	-1.13	22.14	-1.52	22.14
インド	-0.36	3.79	1.69	3.79
インドネシア	-1.11	4.21	16.00	4.21
タイ	5.14	11.41	7.93	11.41
フィリピン	1.50	6.62	12.48	6.62
ベトナム	-8.08	-2.23	-10.99	-2.23
韓国	-6.04	-6.01	-17.63	-6.01
香港	-1.67	10.94	1.00	10.94
台湾	-4.49	1.11	-16.02	1.11
中南米	3.75	10.77	17.63	10.77
ブラジル	5.46	13.49	34.55	13.49
メキシコ	-1.07	3.76	-6.29	3.76
中東・アフリカ	-0.11	6.13	-2.46	6.13
南アフリカ	2.15	7.41	-5.42	7.41
トルコ	-1.62	-3.68	-20.98	-3.68
複合地域	-0.14	8.84	-1.28	8.84

## &lt;1&gt;パフォーマンス・サマリー

## (2) 期間別リターン

## 「総合」およびファンド分類別②

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	0.22	8.56	0.98	8.56
外国債券(先進国)	0.34	3.18	2.54	3.18
グローバル	0.86	3.57	3.26	3.57
除く日本	0.51	3.09	2.99	3.09
含む日本	1.27	4.11	3.57	4.11
その他	-1.07	2.14	0.63	2.14
北米	1.04	2.76	1.67	2.76
米国	0.02	3.65	2.88	3.65
カナダ	0.43	4.18	2.41	4.18
欧州	0.65	2.34	2.08	2.34
アジア・オセアニア	-2.04	1.27	-0.69	1.27
オーストラリア	-1.90	1.27	-0.95	1.27
ニュージーランド	-2.64	1.35	3.61	1.35
複合地域	-0.52	1.79	1.97	1.79
エマージング債券	1.61	5.60	7.06	5.60
グローバル	2.39	7.10	6.23	7.10
米ドル建て	2.43	7.50	6.65	7.50
現地通貨建て	2.21	5.34	4.32	5.34
その他	0.98	4.36	7.78	4.36
ロシア	4.58	16.06	7.11	16.06
アジア・オセアニア	-0.28	4.03	5.14	4.03
インド	-0.14	3.86	6.30	3.86
インドネシア	1.21	6.01	8.08	6.01
ブラジル	3.29	4.84	12.84	4.84
メキシコ	1.41	8.30	7.04	8.30
南アフリカ	3.17	5.36	3.18	5.36
トルコ	6.85	-3.17	-14.91	-3.17
複合地域	0.45	4.74	3.98	4.74
ハイイールド債券	0.70	6.92	3.19	6.92
グローバル	1.31	6.41	4.44	6.41
北米	0.39	7.44	3.01	7.44
その他	1.30	5.68	2.93	5.68
欧州	1.65	5.39	2.08	5.39
アジア・オセアニア	-0.14	6.69	6.52	6.69
複合地域	0.28	4.14	2.36	4.14
複合資産	0.47	5.67	1.22	5.67
安定	0.87	5.02	1.51	5.02
安定成長	0.49	6.21	1.76	6.21
成長	-0.20	7.40	-0.71	7.40
国内バランス	-0.02	2.56	0.24	2.56
安定	0.03	2.41	0.63	2.41
一般	-0.75	4.45	-4.38	4.45

## <1>パフォーマンス・サマリー

### (2) 期間別リターン

#### 「総合」およびファンド分類別③

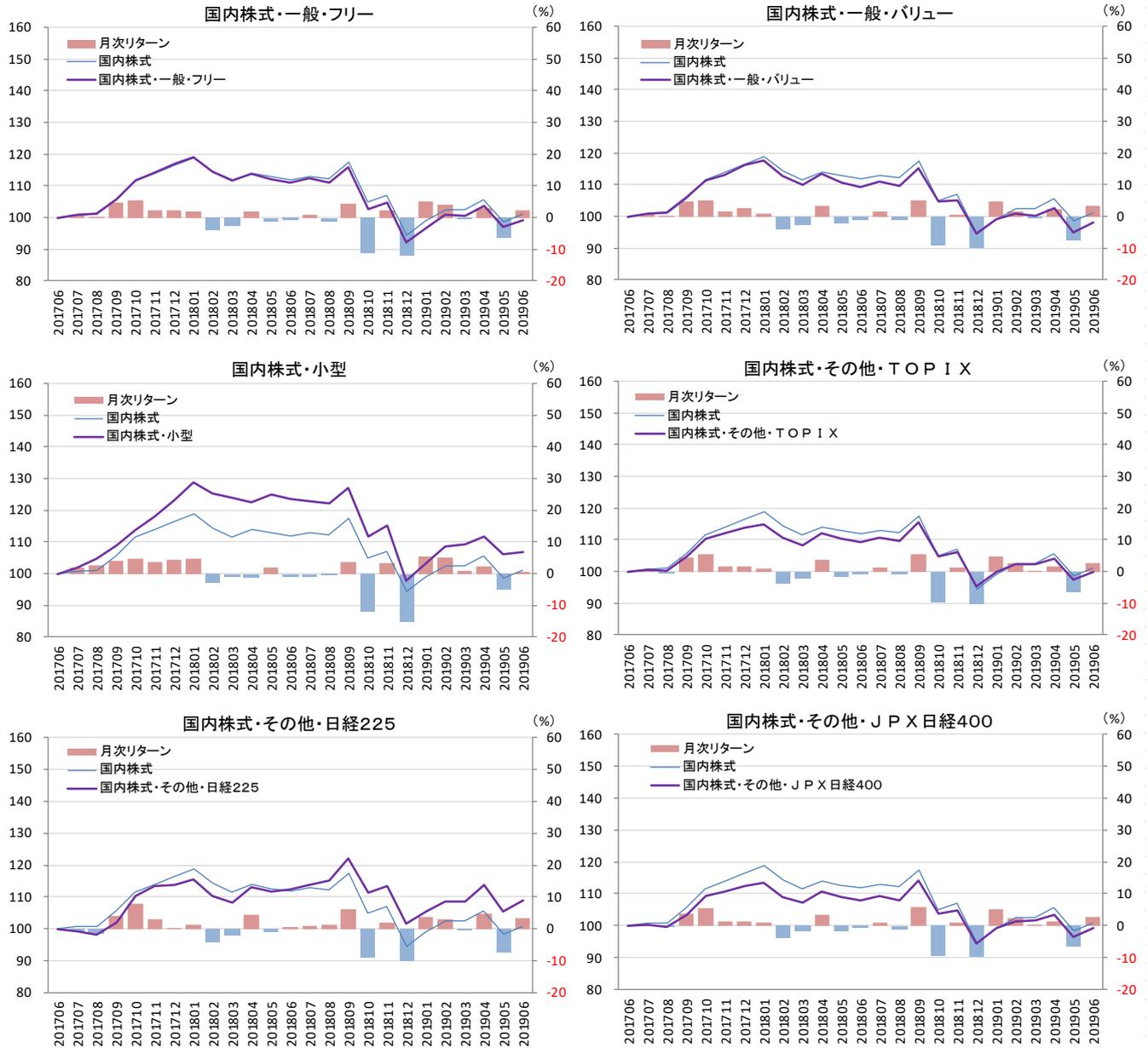
	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	0.22	8.56	0.98	8.56
国内REIT	1.96	10.84	13.18	10.84
日本	1.96	10.84	13.18	10.84
外国REIT	-1.73	13.28	7.17	13.28
グローバル	-2.84	10.82	3.97	10.82
除く日本	-2.53	11.99	5.29	11.99
含む日本	-2.91	10.57	3.71	10.57
北米	-1.73	14.55	7.95	14.55
その他	2.29	15.88	15.58	15.88
欧州	-4.44	5.35	-8.33	5.35
アジア・オセアニア	3.95	18.54	20.95	18.54
オーストラリア	-1.14	9.91	9.10	9.91
複合地域	-1.79	9.01	-3.12	9.01
複数国	-1.16	13.38	9.82	13.38
その他	1.49	5.77	-2.36	5.77
絶対収益型	1.20	2.31	-0.52	2.31
ロング・ショート	1.28	3.93	0.70	3.93
マーケットニュートラル	1.20	1.04	0.35	1.04
GTAA	1.49	4.76	2.36	4.76
その他スタイル	1.15	1.87	-1.20	1.87
CB	0.80	5.13	0.26	5.13
欧州	0.96	1.62	-7.05	1.62
アジア・オセアニア	-1.96	5.17	4.06	5.17
日本	-0.64	-0.59	-4.09	-0.59
グローバル	0.94	5.42	0.41	5.42
コモディティ	1.57	6.11	-1.29	6.11
全業種	-4.05	3.00	-9.55	3.00
貴金属	7.05	7.79	8.32	7.79
エネルギー	-3.75	20.45	-14.37	20.45
その他コモディティ	-3.12	2.73	-7.64	2.73

<1>パフォーマンス・サマリー

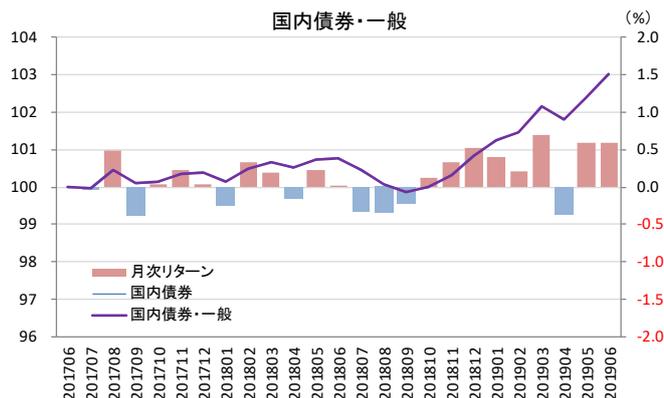
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

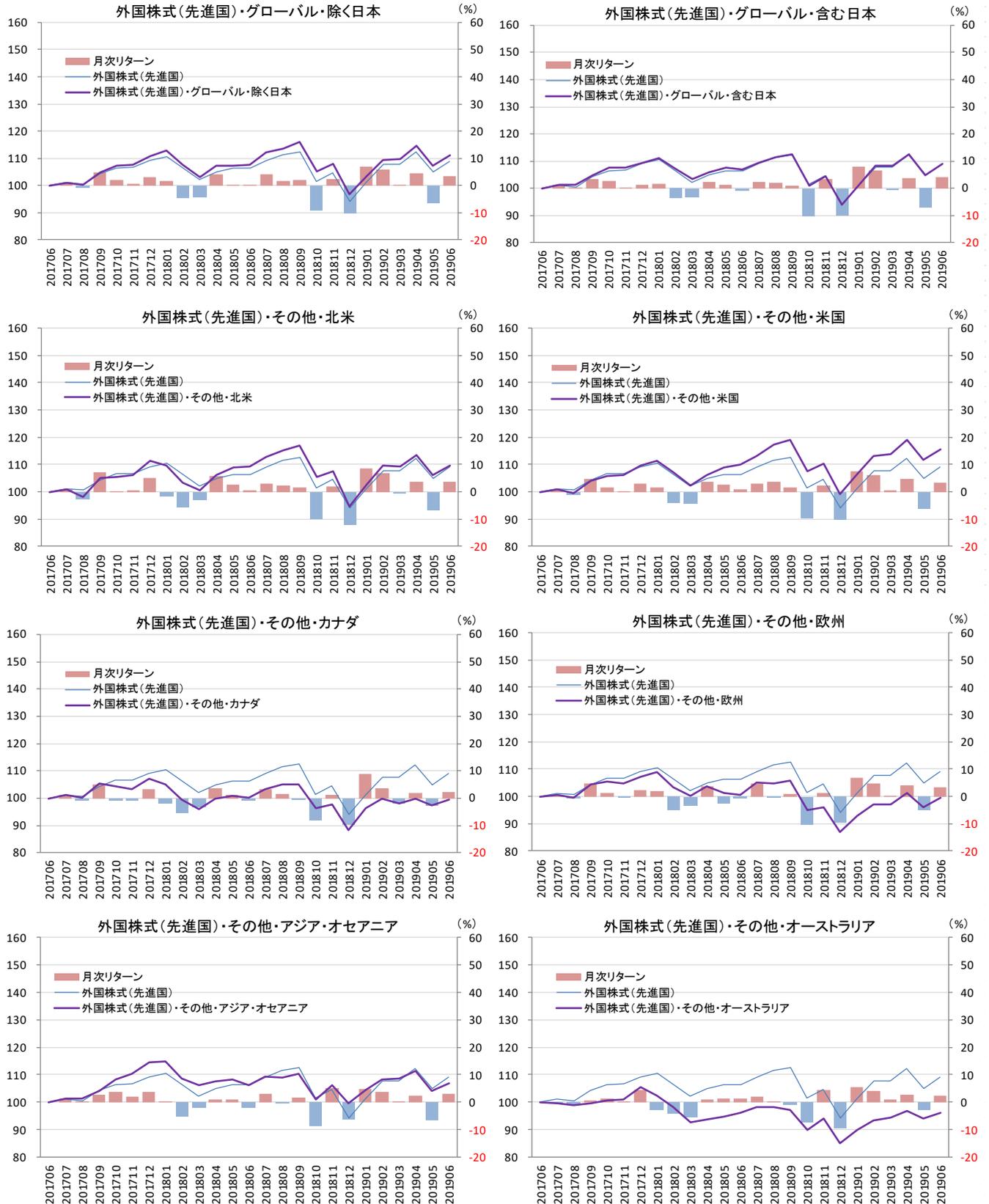


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

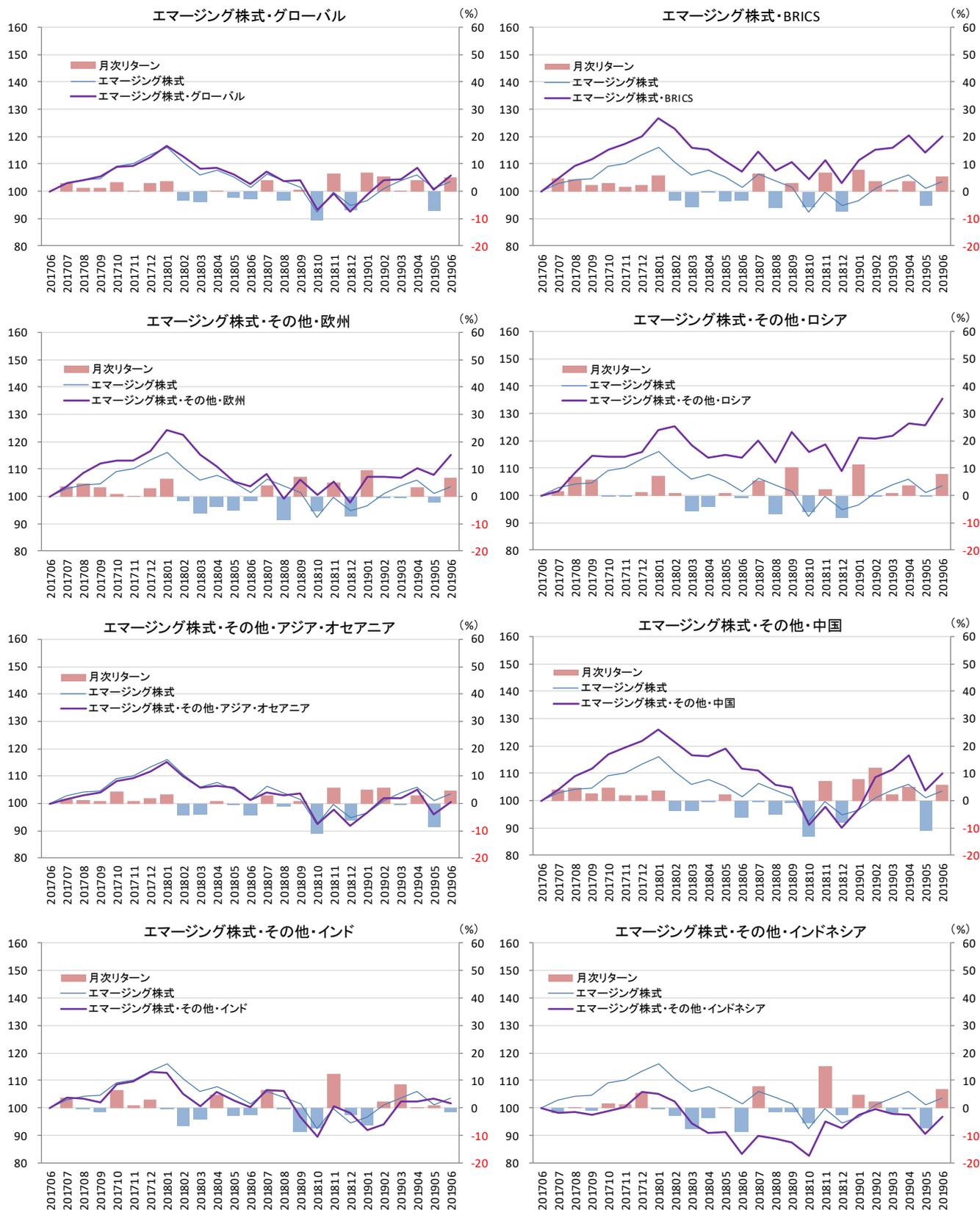


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

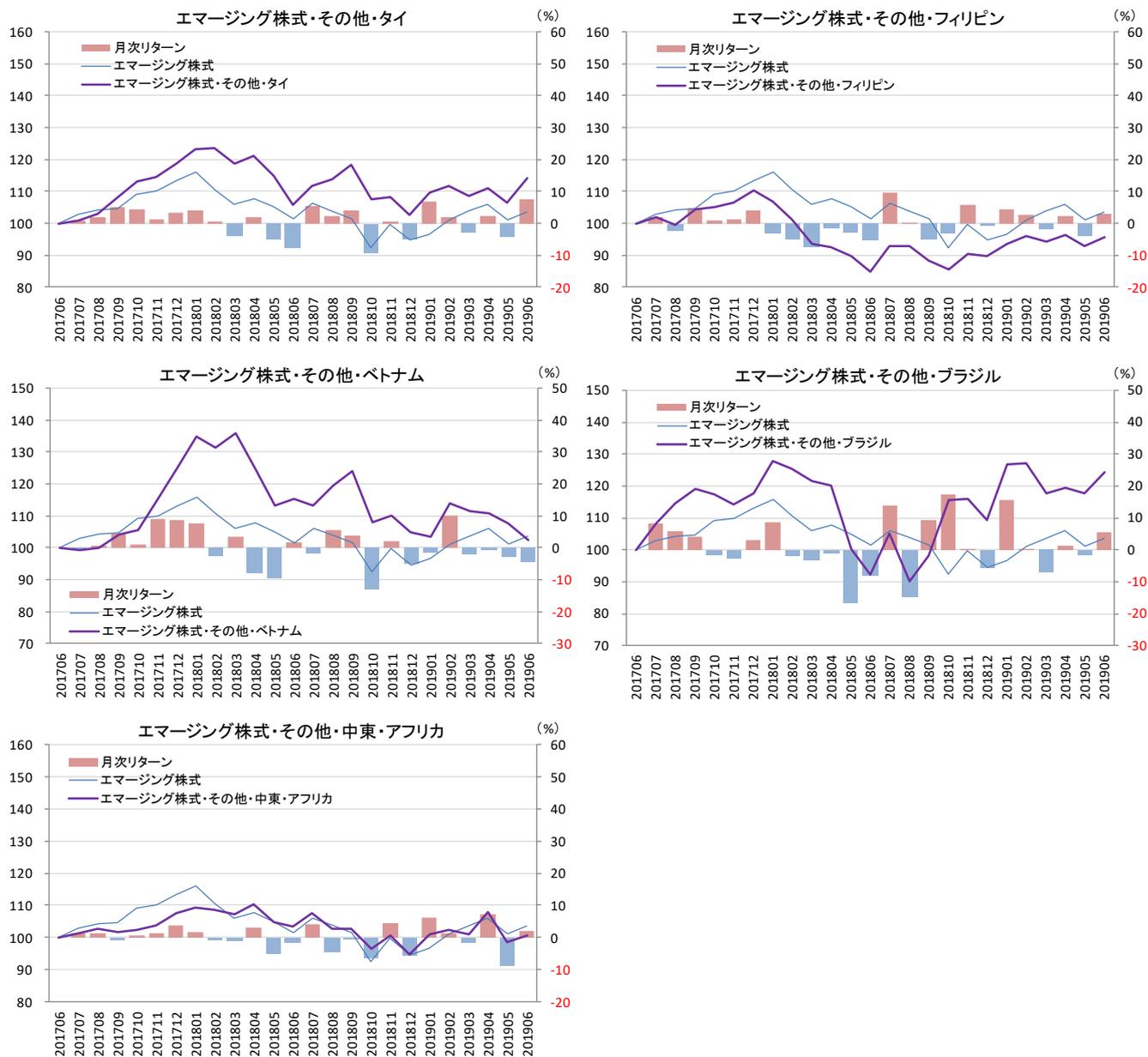


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

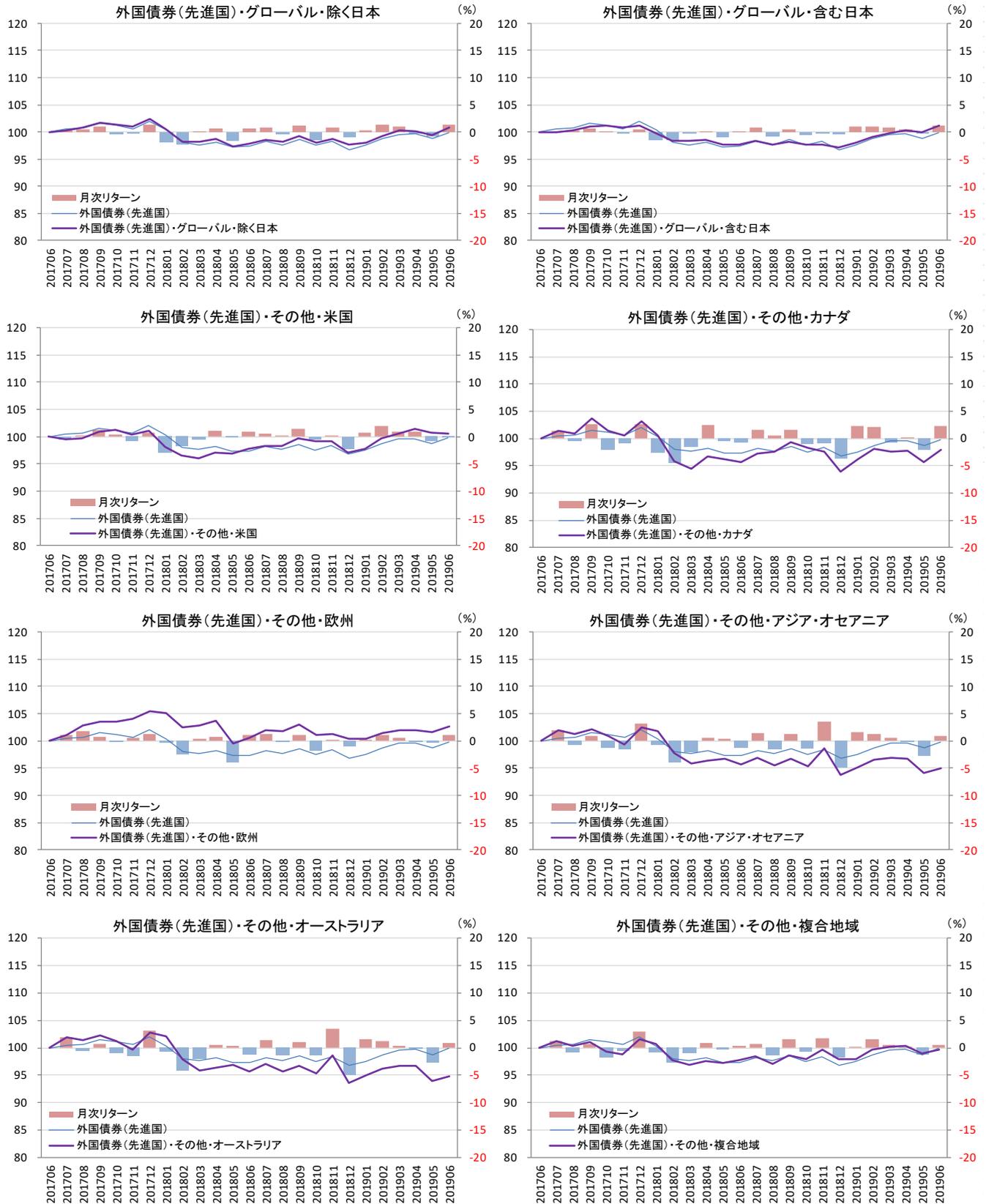


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

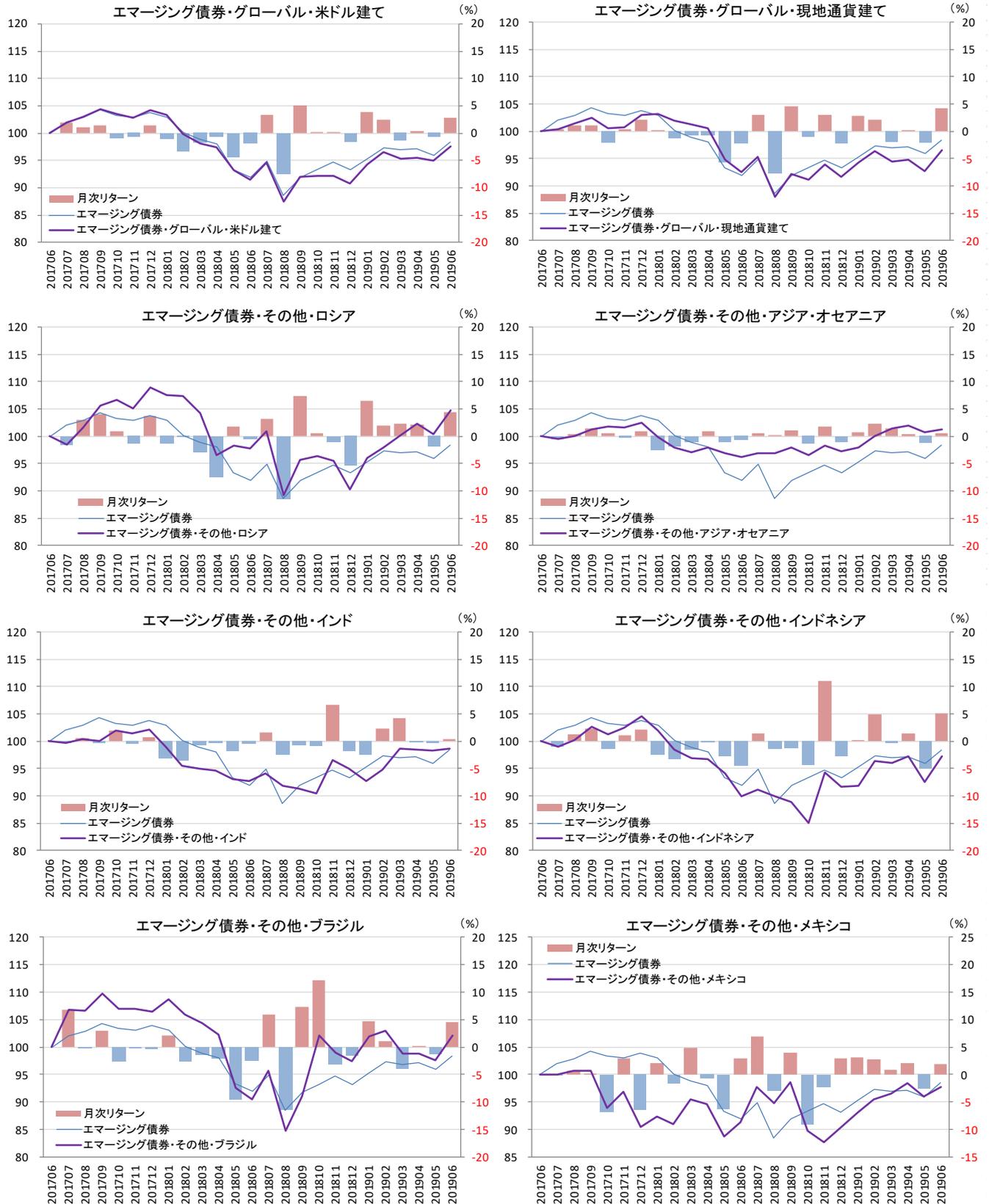


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

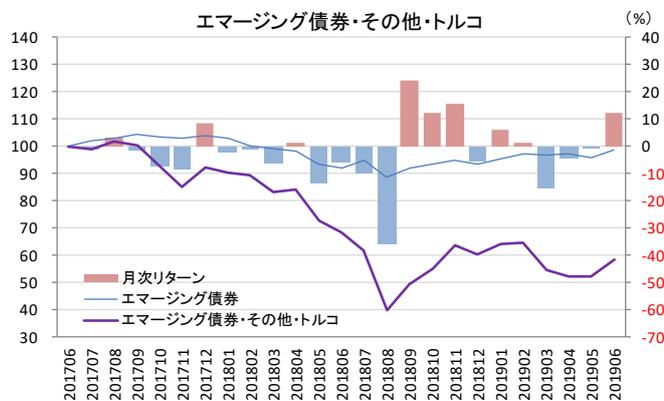


<1>パフォーマンス・サマリー

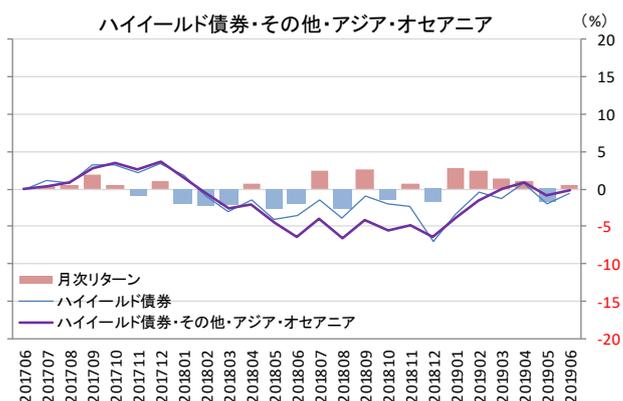
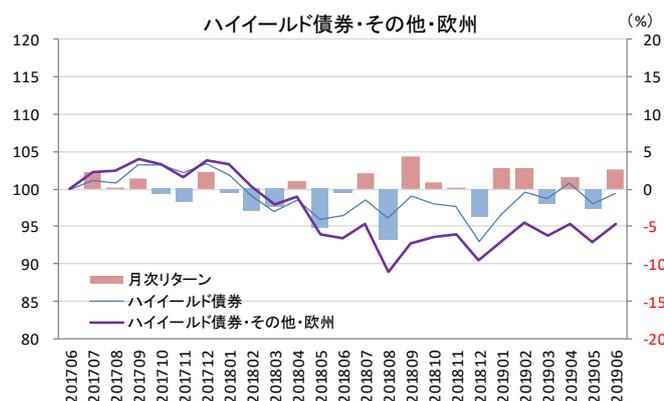
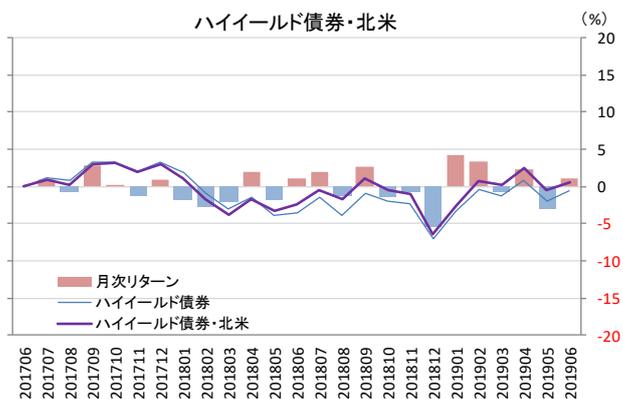
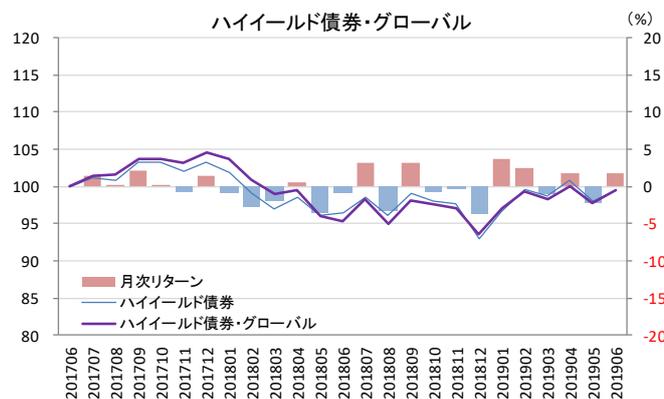
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

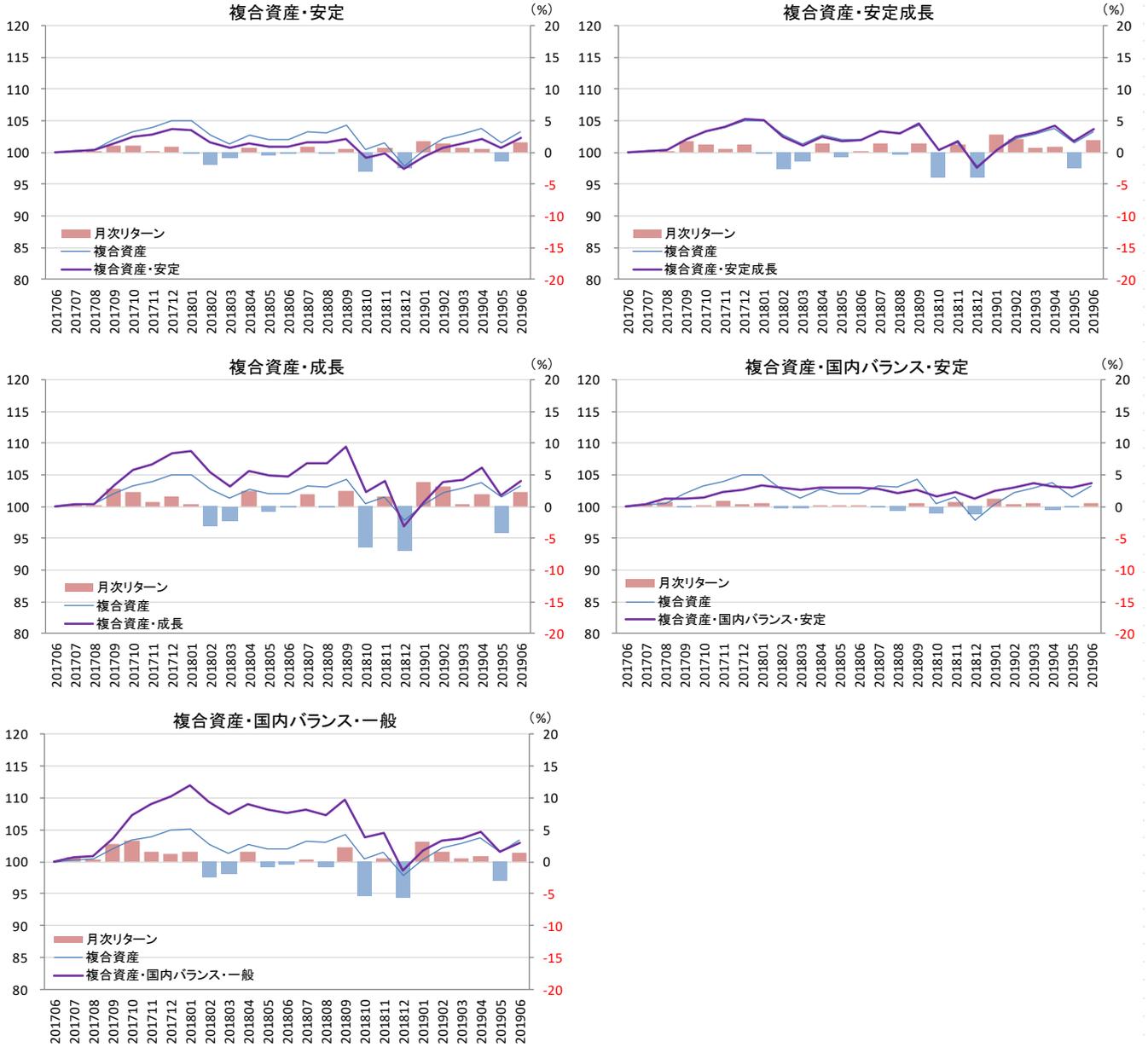


<1>パフォーマンス・サマリー

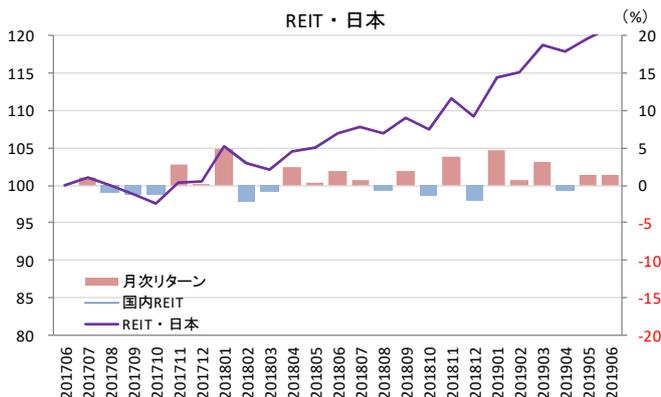
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

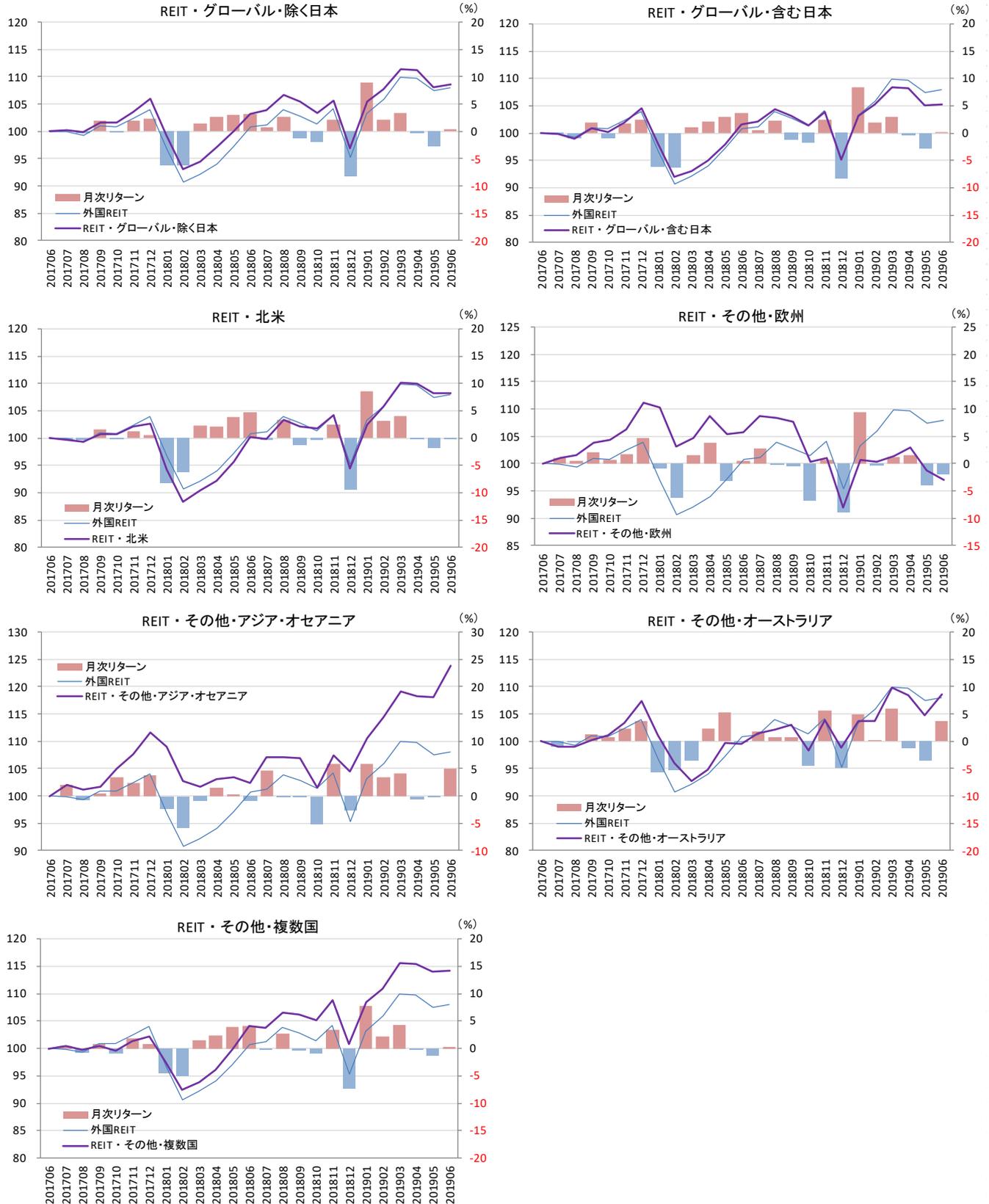


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

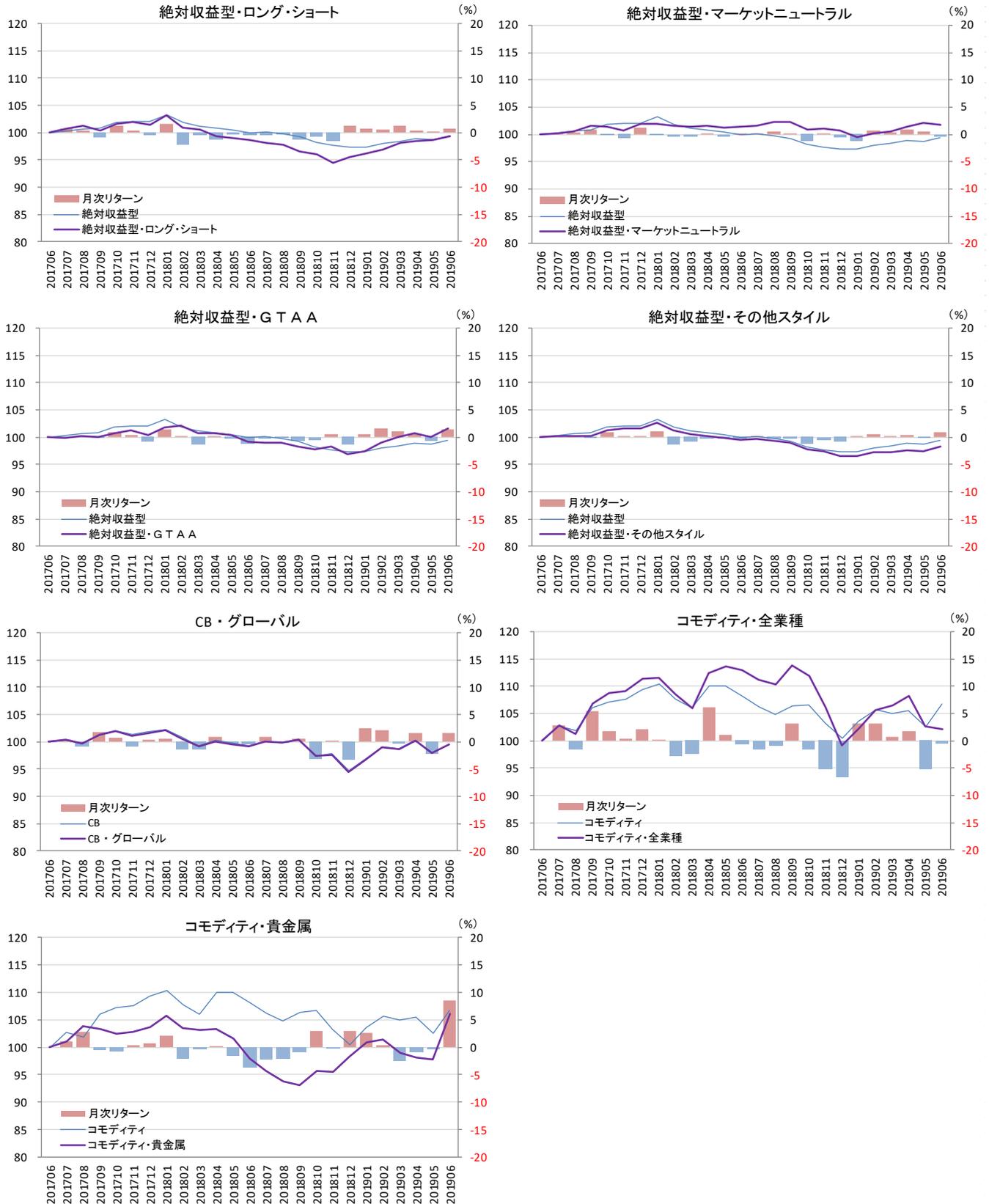


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]





## &lt;1&gt;パフォーマンス・サマリー

## (4) 対「総合」寄与度分析

## ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	2.15		
1	外国株式(先進国)・グローバル	4.09	17.84	0.73
2	国内株式・一般	2.46	9.70	0.24
3	外国株式(先進国)・その他	3.10	5.14	0.16
4	国内株式・その他	3.16	4.83	0.15
5	外国債券(先進国)・グローバル	1.24	10.22	0.13
6	複合資産・安定成長	1.90	6.63	0.13
7	複合資産・安定	1.61	4.51	0.07
8	エマージング株式・グローバル	4.93	1.41	0.07
9	REIT・日本	1.34	4.44	0.06
10	エマージング株式・その他	1.40	3.91	0.05
11	エマージング債券・グローバル	3.02	1.46	0.04
12	複合資産・成長	2.28	1.93	0.04
13	エマージング債券・その他	2.20	1.78	0.04
14	REIT・その他	3.99	0.82	0.03
15	国内債券・一般	0.59	5.47	0.03
16	外国債券(先進国)・その他	0.73	3.80	0.03
17	ハイイールド債券・北米	1.08	2.52	0.03
18	ハイイールド債券・その他	2.27	0.73	0.02
19	コモディティ	4.07	0.29	0.01
20	ハイイールド債券・グローバル	1.83	0.59	0.01
21	国内株式・小型	0.60	1.68	0.01
22	複合資産・国内バランス	0.64	1.38	0.01
23	絶対収益型	0.71	1.12	0.01
24	REIT・グローバル	0.23	2.95	0.01
25	エマージング株式・BRICS	5.43	0.11	0.01
26	CB	1.58	0.27	0.00
27	REIT・北米	-0.03	3.90	-0.00
	合計		99.45	2.12

## ◆計算定義

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

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

## <1>パフォーマンス・サマリー

### (4) 対「総合」寄与度分析

#### ファンド中分類別

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	0.98		
1	REIT・日本	13.18	4.12	0.54
2	外国株式(先進国)・グローバル	2.37	16.34	0.39
3	REIT・北米	7.95	4.56	0.36
4	外国債券(先進国)・グローバル	3.26	10.65	0.35
5	外国株式(先進国)・その他	3.14	4.96	0.16
6	エマージング債券・その他	7.78	1.84	0.14
7	REIT・グローバル	3.97	3.16	0.13
8	REIT・その他	15.58	0.78	0.12
9	国内債券・一般	2.22	5.02	0.11
10	複合資産・安定成長	1.76	6.12	0.11
11	エマージング債券・グローバル	6.23	1.58	0.10
12	ハイイールド債券・北米	3.01	3.03	0.09
13	エマージング株式・その他	1.55	4.17	0.06
14	複合資産・安定	1.51	4.23	0.06
15	エマージング株式・グローバル	2.79	1.66	0.05
16	ハイイールド債券・グローバル	4.44	0.69	0.03
17	ハイイールド債券・その他	2.93	0.95	0.03
18	外国債券(先進国)・その他	0.63	4.15	0.03
19	エマージング株式・BRICS	12.13	0.11	0.01
20	複合資産・国内バランス	0.24	0.94	0.00
21	CB	0.26	0.32	0.00
22	コモディティ	-1.29	0.24	-0.00
23	絶対収益型	-0.52	1.00	-0.01
24	複合資産・成長	-0.71	1.73	-0.01
25	国内株式・小型	-13.70	1.82	-0.25
26	国内株式・その他	-5.88	4.51	-0.27
27	国内株式・一般	-10.70	10.81	-1.16
	合計		99.51	1.18

#### ◆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	19.31	16.78	78.75	8.30 ↓	9.72	11.52	0.74	0.33	0.52
国内株式	32.88	34.75	108.44	13.78 ↓	15.90	17.42	0.73	0.39	0.44
一般	30.67	30.28	95.20	13.94 ↓	16.27	17.68	0.67	0.33	0.39
フリー	31.02	30.09	95.65	14.21 ↓	16.65	18.35	0.67	0.33	0.38
バリュー	29.47	31.05	97.50	13.28 ↓	15.24	16.36	0.68	0.37	0.43
小型	37.42	64.52	204.09	15.54 ↓	15.37	17.28	0.72	0.68	0.68
その他	36.41	40.50	123.11	13.59 ↓	15.65	17.38	0.81	0.45	0.48
日経225	41.53	48.72	141.09	14.08 ↓	15.85	17.68	0.88	0.52	0.52
TOPIX	31.70	34.18	98.27	13.09 ↓	15.40	16.85	0.74	0.39	0.42
JPX日経400	27.99	28.75	-	12.79 ↓	14.96	-	0.67	0.35	-
国内債券	-0.21	7.62	18.48	1.37	1.53	1.48	-0.01	0.98	1.13
一般	-0.21	7.62	18.48	1.37	1.53	1.48	-0.01	0.98	1.13
外国株式(先進国)	36.32	21.38	113.73	13.70	15.10	16.33	0.80	0.26	0.48
グローバル	36.80	25.91	122.49	13.78	14.94	16.22	0.80	0.32	0.51
除く日本	43.70	35.56	176.57	14.21	16.27	17.92	0.91	0.39	0.60
含む日本	34.82	23.29	111.45	13.75	14.66	15.91	0.77	0.29	0.49
その他	35.63	12.46	110.81	13.67 ↓	15.63	17.69	0.79	0.15	0.44
北米	33.16	9.75	65.03	16.62	17.42	21.00	0.61	0.11	0.24
米国	45.68	21.19	138.66	14.39	16.85	17.99	0.93	0.23	0.50
カナダ	14.61	-18.32	18.83	12.32	13.82	16.89 ↓	0.38	-0.29	0.10
欧州	30.95	13.10	104.46	13.65 ↓	15.32	18.69	0.69	0.16	0.39
ドイツ	30.15	2.50	-	17.08 ↓	20.31	-	0.54	0.03	-
イギリス	8.47	-10.47	-	13.32	15.01	-	0.21	-0.15	-
アジア・オセアニア	34.49	28.73	157.20	11.81 ↓	15.05	18.07 ↓	0.88	0.34	0.55
オーストラリア	20.59	6.69	105.28	13.95 ↓	15.29	19.97	0.47	0.09	0.37
ニュージーランド	42.76	70.54	-	13.35	16.62	-	0.95	0.68	-
複合地域	-2.74	-29.90	-	18.83	19.36	-	-0.05	-0.35	-
エマージング株式	36.35	18.89	64.63	12.60 ↓	15.25	18.19	0.87	0.23	0.28
グローバル	38.31	10.65	63.50	14.13	16.37	18.48	0.81	0.13	0.27
BRICS	61.48	37.91	90.51	14.41	18.23	20.77	1.21	0.36	0.32
その他	34.80	22.03	69.10	12.56 ↓	15.17	18.15 ↓	0.84	0.27	0.30
欧州	54.73	6.89	70.30	16.85 ↓	19.78	24.23	0.93	0.07	0.22
ロシア	72.89	33.80	104.35	19.37	24.10	26.58 ↓	1.04	0.25	0.28
アジア・オセアニア	30.54	16.72	81.64	13.97	15.85	17.51	0.67	0.20	0.35
中国	50.89	73.44	87.69	18.36	23.28	22.42	0.80	0.50	0.29
インド	40.86	41.04	91.74	16.67 ↓	19.01	23.86	0.73	0.38	0.28
インドネシア	16.34	12.41	-	17.25	20.22	-	0.30	0.12	-
タイ	38.22	32.62	251.34	14.35	14.55	17.36	0.80	0.40	0.77
フィリピン	-2.80	4.00	-	13.76 ↓	15.28	-	-0.06	0.05	-
ベトナム	30.43	30.14	-	17.31	16.57	-	0.54	0.33	-
韓国	-4.34	-18.04	48.32	15.43	15.69	20.57	-0.09	-0.25	0.19
香港	49.33	30.04	79.43	15.69	19.20	18.74	0.91	0.28	0.32
台湾	24.61	14.27	122.91	18.75	18.25 ↑	19.69	0.41	0.15	0.42
中南米	42.99	-2.90	27.51	20.96	22.94	23.26	0.61	-0.03	0.10
ブラジル	50.10	-7.01	3.10	26.96 ↓	31.43	29.17	0.54	-0.05	0.01
メキシコ	-5.64	-26.38	-	21.30	20.04	-	-0.09	-0.30	-
中東・アフリカ	23.14	-2.86	68.63	13.29	15.49	16.83	0.54	-0.04	0.32
南アフリカ	8.67	-40.00	-	19.03 ↑	20.30 ↑	-	0.15	-0.48	-
トルコ	-31.65	-48.27	-12.54	30.79	28.61	31.97	-0.39	-0.43	-0.04
複合地域	21.21	2.53	84.32	13.72	14.68	16.18	0.49	0.03	0.39

※[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	19.31	16.78	78.75	8.30 ↓	9.72	11.52	0.74	0.33	0.52
外国債券(先進国)	8.15	1.32	34.02	3.96 ↓	5.68	8.23	0.68	0.05	0.36
グローバル	8.10	4.09	31.89	3.51 ↓	5.18	7.51	0.76	0.16	0.37
除く日本	8.02	2.46	36.71	4.08 ↓	5.90	8.25	0.65	0.08	0.38
含む日本	8.17	6.17	25.88	3.09 ↓	4.48	6.73	0.88	0.27	0.34
その他	7.50	-3.70	40.84	5.91 ↓	7.36	9.98	0.42	-0.10	0.35
北米	5.40	9.97	-	2.39 ↓	4.08	-	0.76	0.47	-
米国	8.22	11.58	47.47	4.46 ↓	5.89	6.52	0.61	0.38	0.60
カナダ	4.25	-8.64	16.50	7.65 ↓	9.23	9.94	0.19	-0.19	0.15
欧州	11.88	0.47	25.32	5.18 ↓	7.25	10.13	0.75	0.01	0.22
アジア・オセアニア	6.92	-6.50	49.36	7.36 ↓	8.63	11.11	0.31	-0.15	0.37
オーストラリア	6.88	-7.08	46.41	7.44 ↓	8.69	11.45	0.31	-0.17	0.34
ニュージーランド	9.54	3.53	-	8.71	10.28	-	0.36	0.07	-
複合地域	11.19	-1.60	32.72	5.23 ↓	7.35	9.95	0.70	-0.04	0.29
エマージング債券	15.42	2.39	50.66	8.07	10.57	12.80	0.61	0.05	0.32
グローバル	12.70	1.21	53.68	8.63	10.49	12.69	0.48	0.02	0.34
米ドル建て	13.06	2.46	58.98	8.65	10.66	12.86	0.49	0.05	0.37
現地通貨建て	11.06	-5.98	27.09	9.09	10.23	11.95	0.40	-0.12	0.20
その他	18.55	3.12	42.05	8.22	11.66	13.79	0.72	0.05	0.26
ロシア	33.69	-10.74	52.32	14.88	24.55	21.77	0.69	-0.09	0.20
アジア・オセアニア	11.62	14.89	58.27	4.59 ↓	6.80	8.92	0.82	0.42	0.52
インド	21.59	26.98	-	8.26 ↓	9.86	-	0.82	0.50	-
インドネシア	11.12	19.87	-	11.22	14.06	-	0.32	0.26	-
ブラジル	23.32	5.42	48.53	16.28	19.01	17.62	0.45	0.06	0.23
メキシコ	9.84	-15.82	-	15.07	14.40	-	0.21	-0.23	-
南アフリカ	33.73	7.69	-	20.73	19.43	-	0.49	0.08	-
トルコ	-46.09	-55.82	-	34.32	28.90	-	-0.54	-0.52	-
複合地域	19.09	-8.21	24.30	8.89 ↓	11.40	13.25	0.68	-0.15	0.16
ハイイールド債券	21.00	10.04	101.91	7.94 ↓	9.63	12.18	0.83	0.20	0.59
グローバル	22.23	8.87	81.67	7.78 ↓	9.62	12.16	0.90	0.18	0.50
北米	23.06	13.51	111.85	8.36 ↓	9.74	11.85	0.86	0.26	0.66
その他	15.27	2.89	116.92	8.07 ↓	10.14	15.53	0.61	0.06	0.52
欧州	14.98	1.10	148.12	8.82 ↓	10.91	16.97	0.55	0.02	0.56
アジア・オセアニア	17.07	12.61	-	6.54 ↓	8.32	-	0.83	0.29	-
複合地域	20.84	8.78	98.68	7.03 ↓	8.69	11.99	0.93	0.20	0.59
複合資産	15.09	15.55	71.36	5.52 ↓	7.21	9.44	0.88	0.41	0.58
安定	10.34	10.96	58.59	4.09 ↓	5.62	7.94	0.83	0.38	0.59
安定成長	16.39	16.34	73.31	6.03 ↓	7.59	9.86	0.87	0.41	0.57
成長	24.71	24.33	99.62	9.17 ↓	10.79	12.06	0.84	0.41	0.59
国内バランス	5.48	13.55	36.91	2.37	3.97 ↓	6.67	0.78	0.65	0.47
安定	3.40	14.19	37.80	2.14	2.46	3.63	0.55	1.10	0.89
一般	17.11	14.65	45.15	7.28 ↓	8.99	9.84	0.75	0.31	0.38

※[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	19.31	16.78	78.75	8.30 ↓	9.72	11.52	0.74	0.33	0.52
国内REIT	16.98	38.22	183.05	7.23	8.70	16.32	0.75	0.77	0.67
日本	16.98	38.22	183.05	7.23	8.70	16.32	0.75	0.77	0.67
外国REIT	15.79	35.38	221.34	12.67	14.01	16.40	0.40	0.45	0.75
グローバル	12.91	24.66	193.47	12.47	13.55	16.06	0.34	0.33	0.71
除く日本	19.24	34.81	213.83	12.52	13.65	16.09	0.49	0.45	0.75
含む日本	12.14	23.59	191.93	12.47	13.54	16.07	0.32	0.32	0.70
北米	15.44	41.79	258.75	13.58	15.09	18.04	0.37	0.48	0.75
その他	34.47	49.78	244.58	10.58	12.04	15.43	0.99	0.70	0.85
欧州	12.36	5.10	31.33	13.31 ↓	15.48	20.61	0.30	0.07	0.13
アジア・オセアニア	46.34	61.84	278.57	10.46	12.23	14.90	1.30	0.83	0.95
オーストラリア	17.28	29.91	185.63	13.65	14.09	17.60 ↓	0.40	0.38	0.63
複合地域	6.93	3.24	122.90	14.05	15.32	18.40	0.16	0.04	0.45
複数国	19.09	54.90	285.69	11.15	12.68	15.86	0.54	0.72	0.91
その他									
絶対収益型	0.24	-0.50	-6.52	1.99	2.19	3.44	0.07	-0.04	-0.21
ロング・ショート	1.14	-1.04	1.21	3.02	2.97	3.53	0.14	-0.07	0.02
マーケットニュートラル	3.64	5.25	2.36	2.17	1.97	2.04	0.58	0.53	0.10
GTAA	2.09	3.86	11.94	2.56	2.16	2.66	0.29	0.36	0.41
その他スタイル	0.23	-0.52	-10.69	2.02	2.40	5.20	0.06	-0.04	-0.22
CB	13.57	3.86	44.89	5.10 ↓	6.59	9.75	0.86	0.12	0.38
欧州	-8.80	-19.85	-	15.61	14.76	-	-0.19	-0.29	-
アジア・オセアニア	26.36	31.87	67.31	8.13 ↓	10.99	10.92	1.00	0.52	0.48
日本	1.87	15.38	53.13	4.78	5.51	6.09	0.14	0.53	0.71
グローバル	13.91	3.07	49.52	5.12 ↓	6.50	10.25	0.88	0.10	0.40
コモディティ	6.17	-33.32	-20.40	9.27 ↓	12.25	15.10	0.22	-0.63	-0.15
全業種	1.47	-38.80	-28.15	11.81 ↓	14.03	15.74	0.05	-0.67	-0.21
貴金属	7.06	-7.48	-	7.94 ↑	9.66	-	0.30	-0.16	-
エネルギー	11.71	-50.17	-35.44	27.21	27.86	25.24	0.14	-0.47	-0.17
その他コモディティ	-6.36	-29.34	14.90	13.12	14.68	17.91	-0.16	-0.46	0.08

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

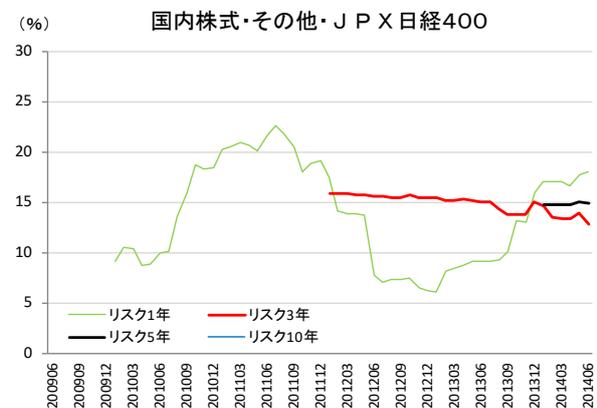
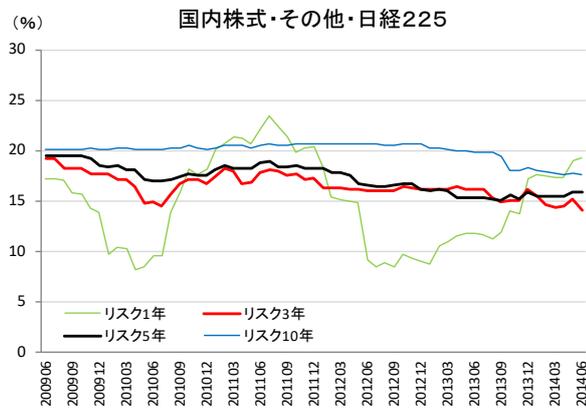
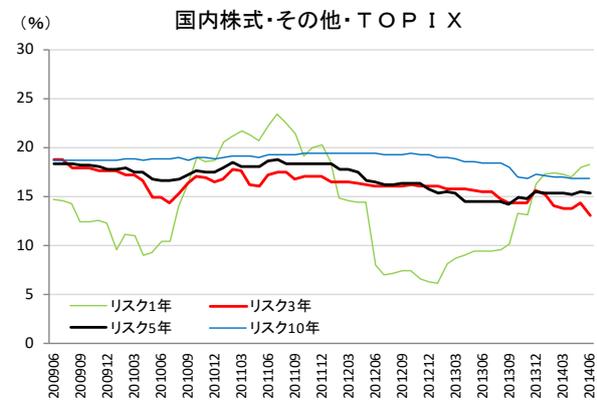
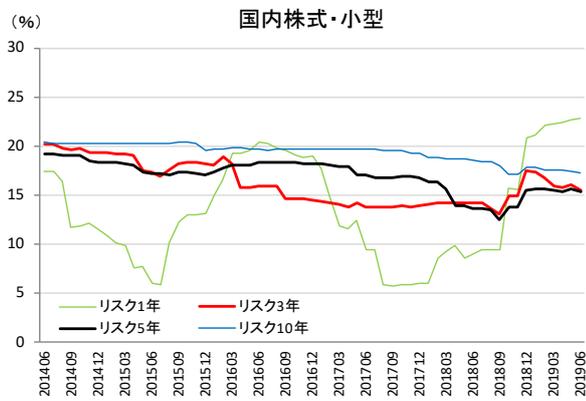
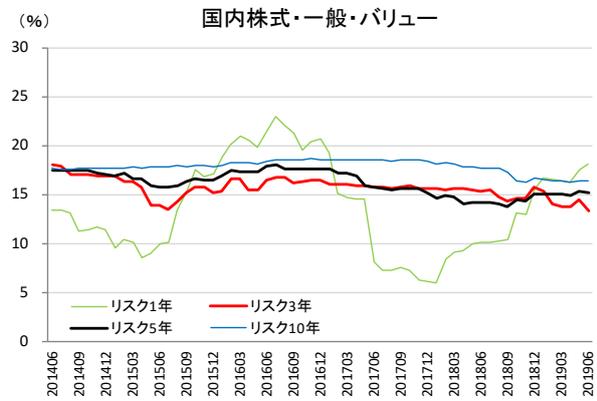
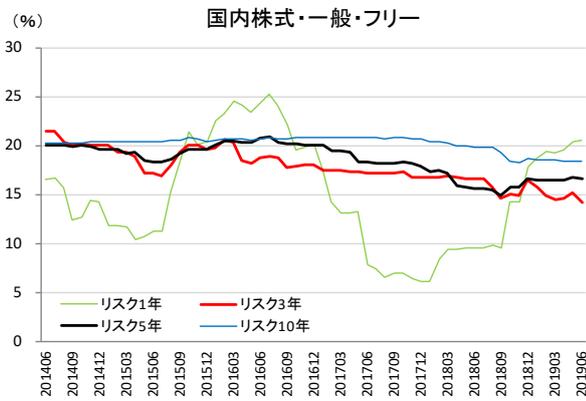
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

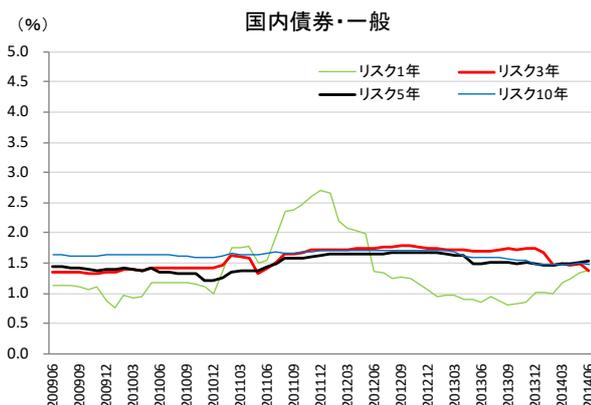
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

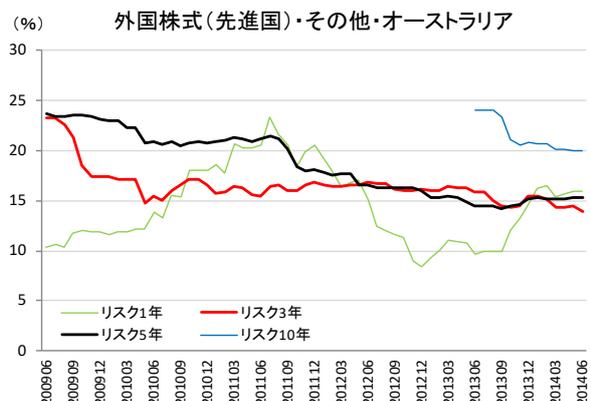
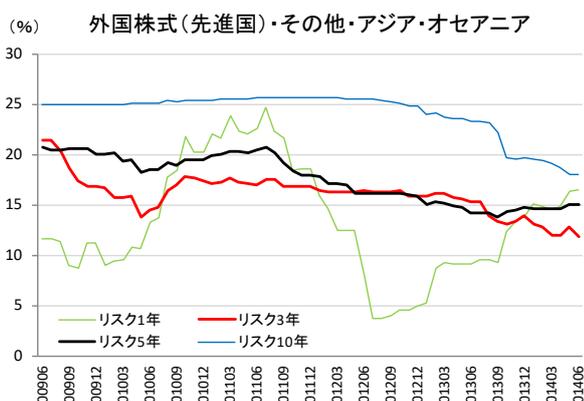
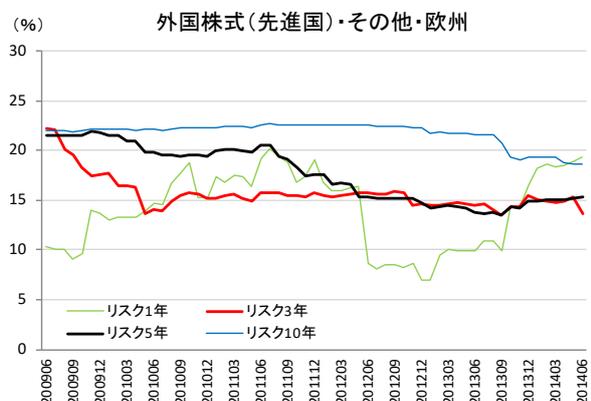
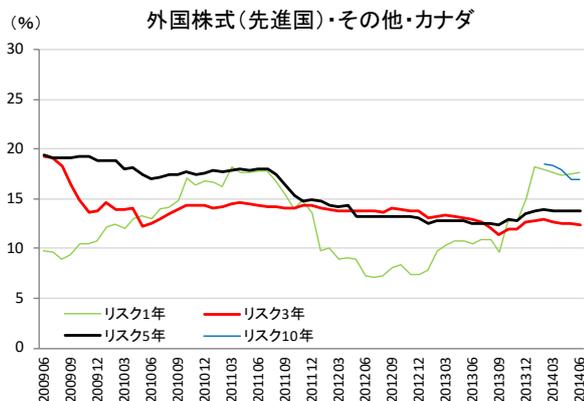
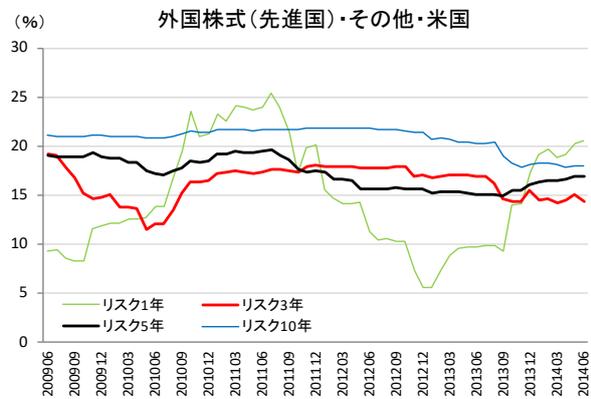
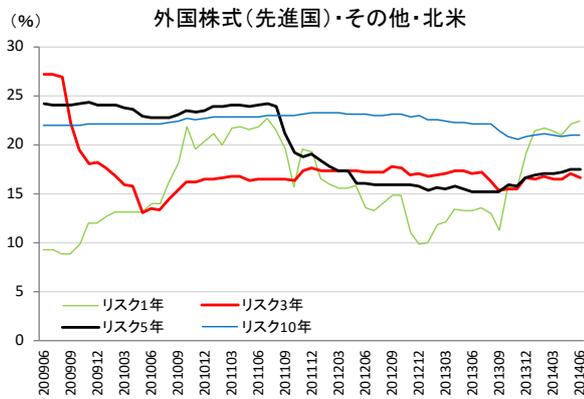
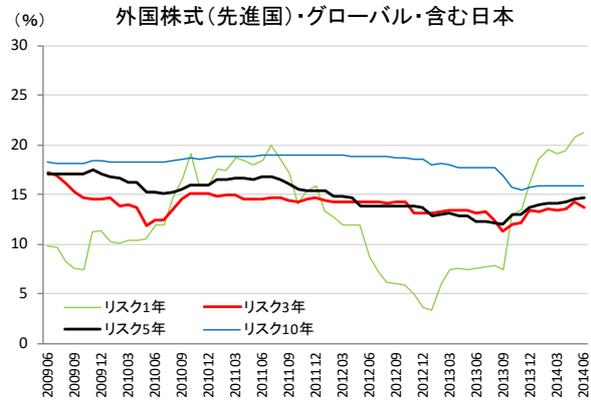
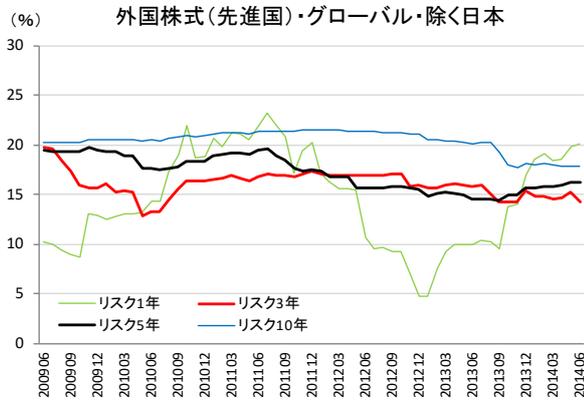


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

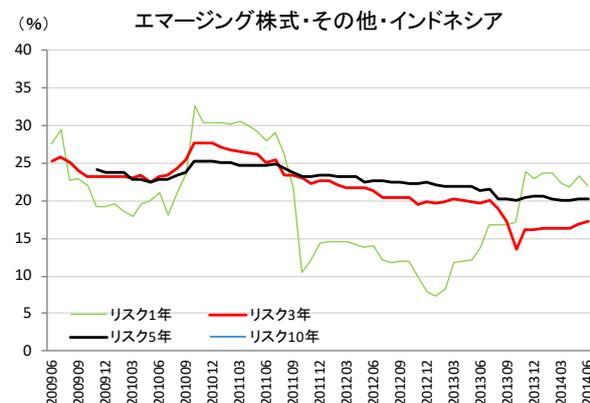
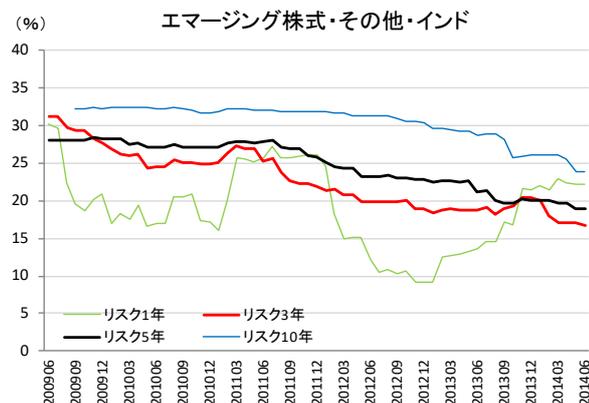
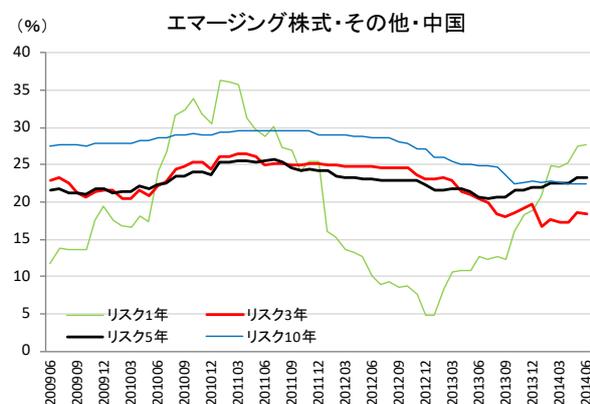
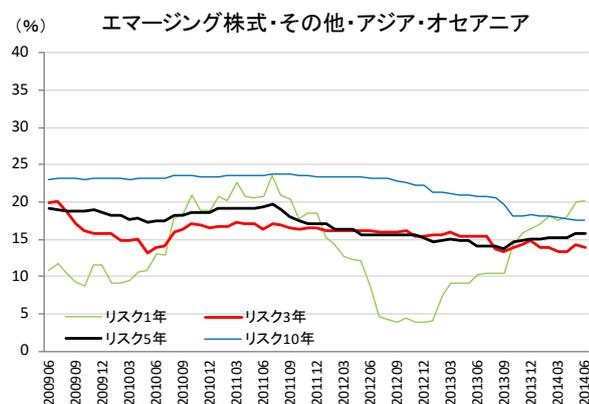
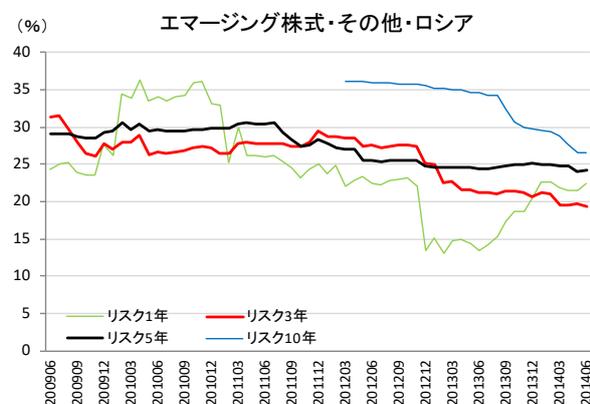
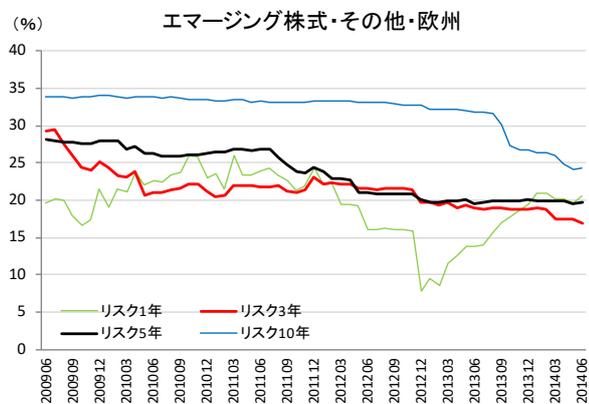
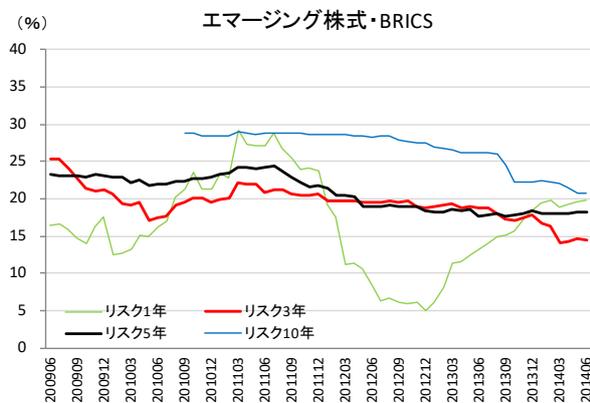
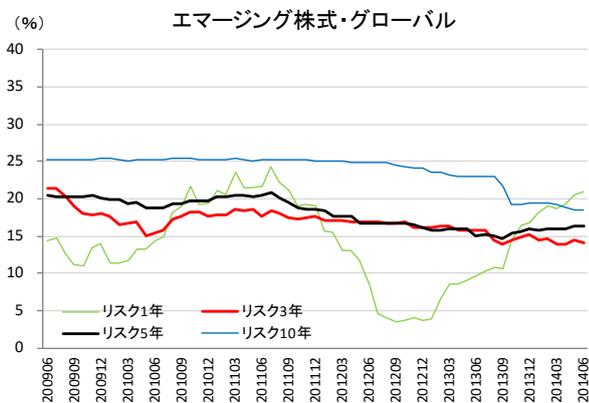


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

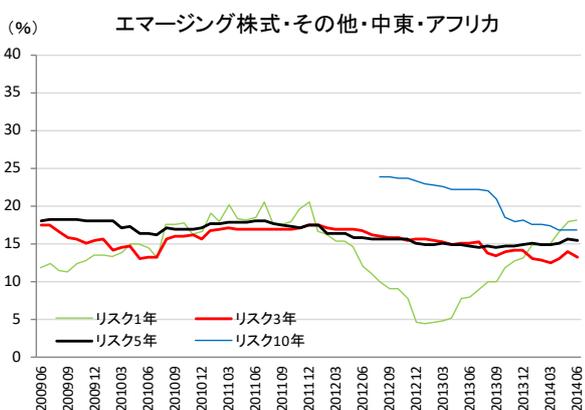
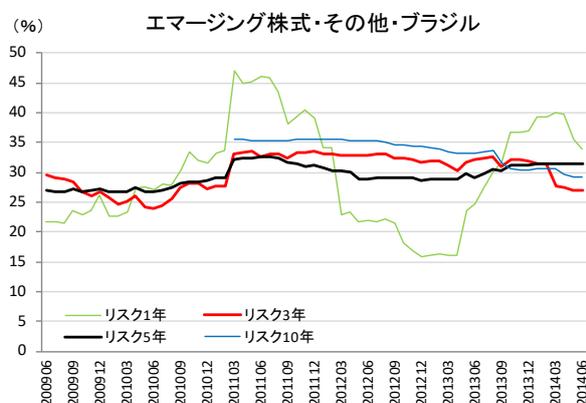
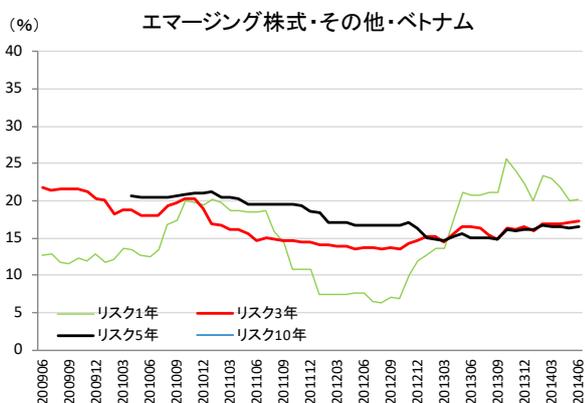
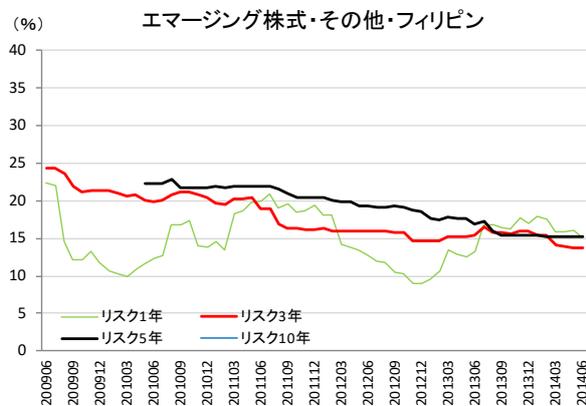
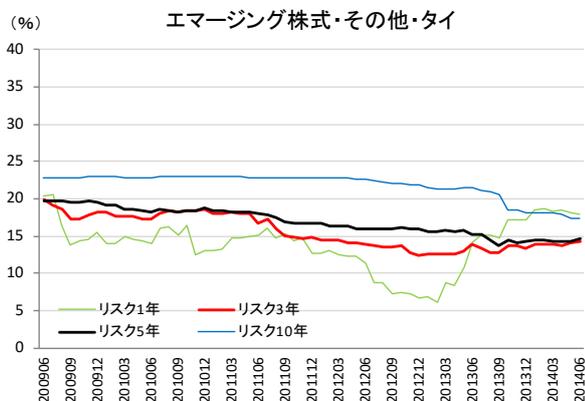


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

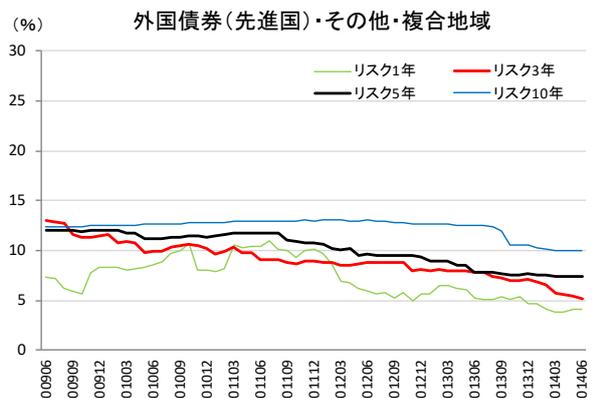
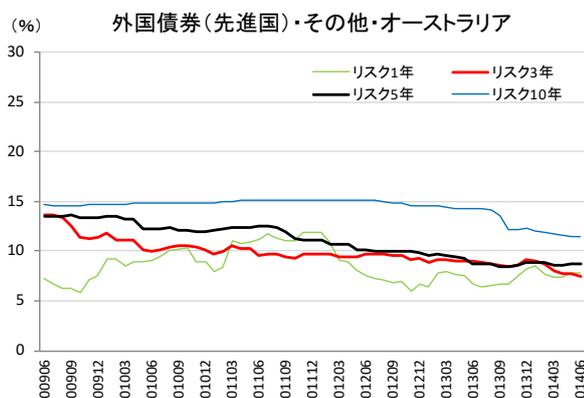
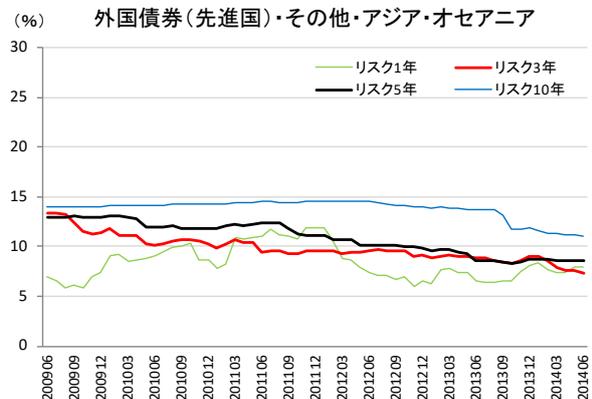
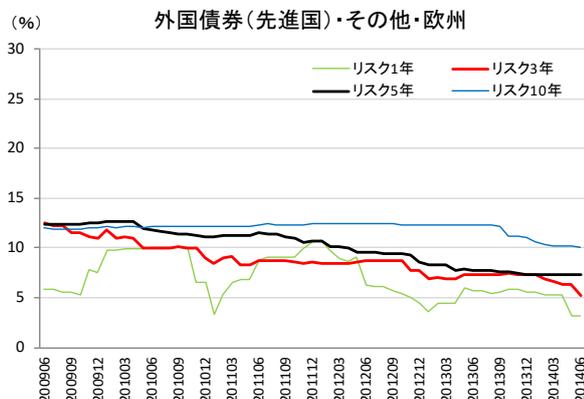
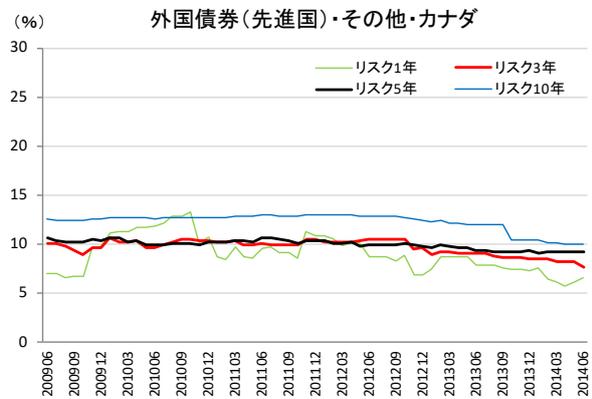
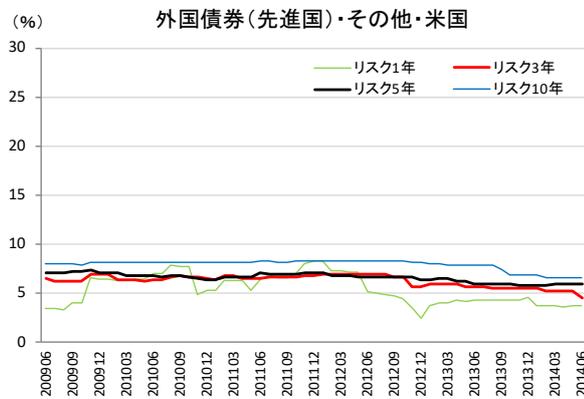
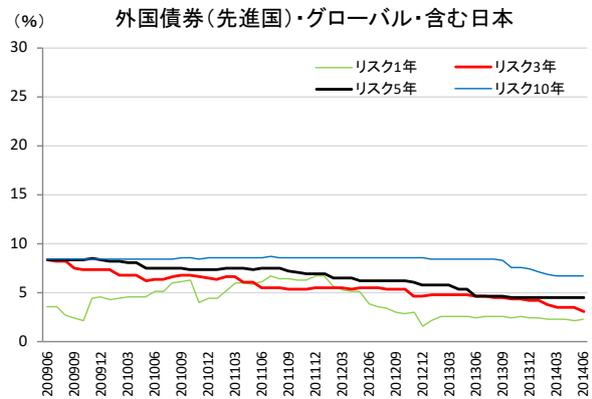
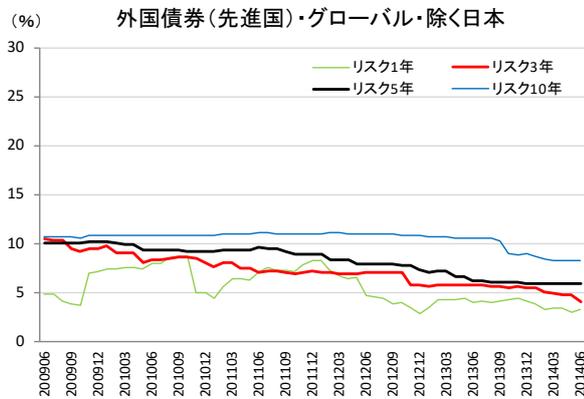


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

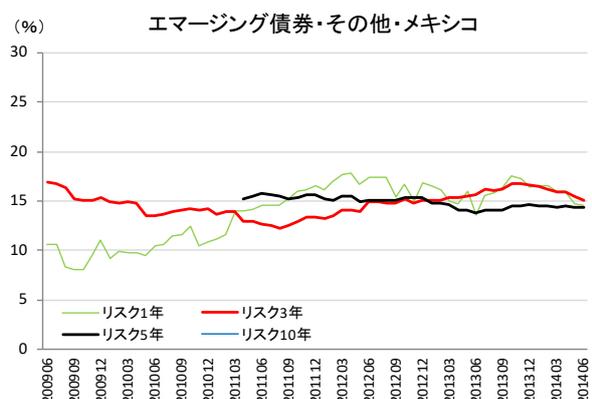
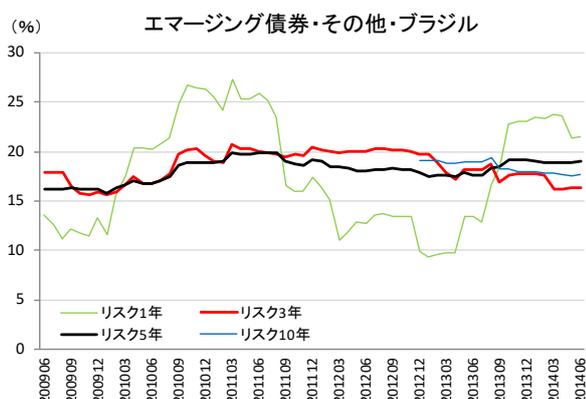
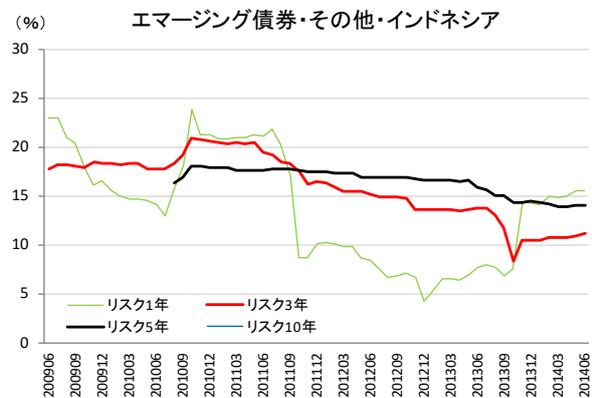
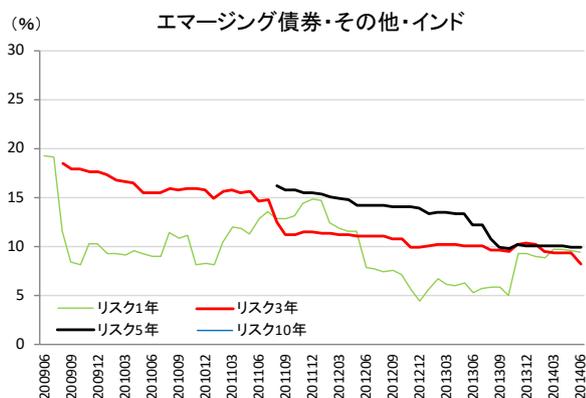
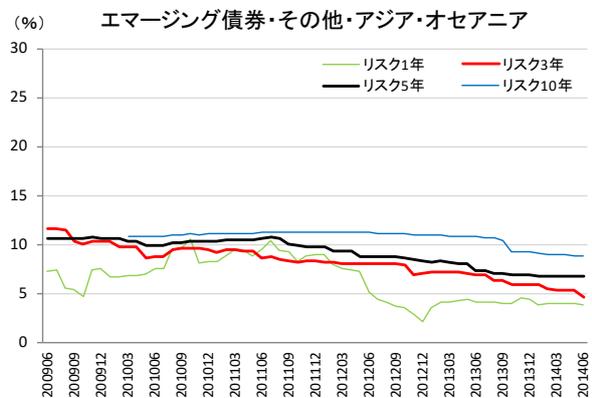
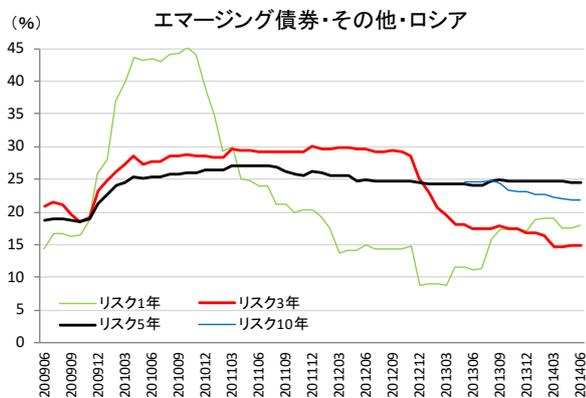
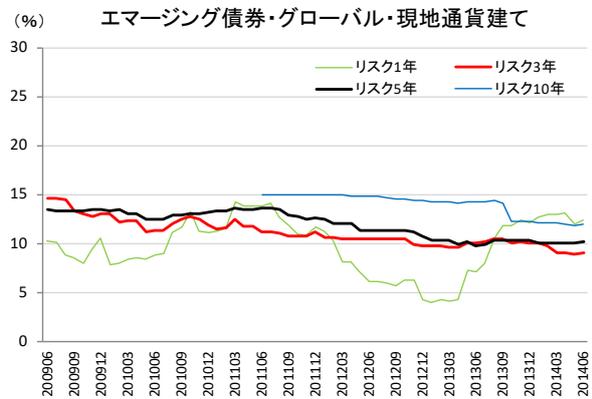
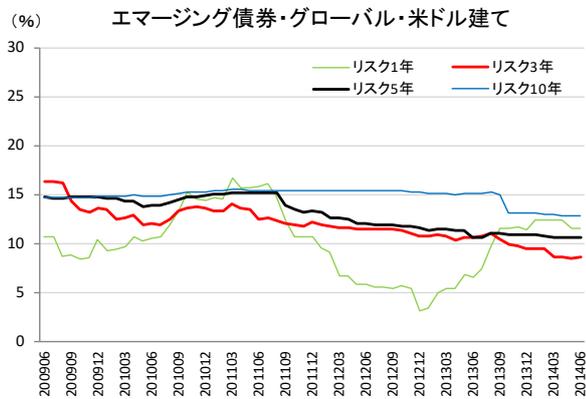


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

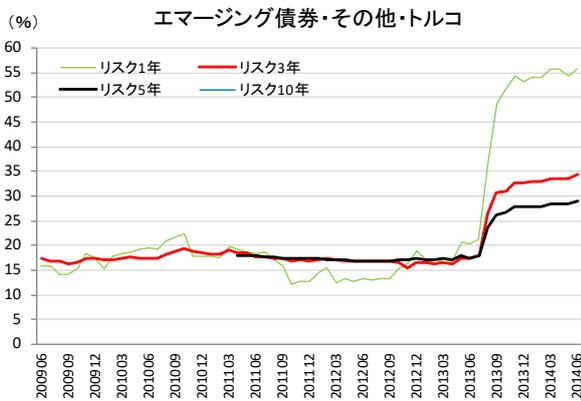


<2> リスク・サマリー

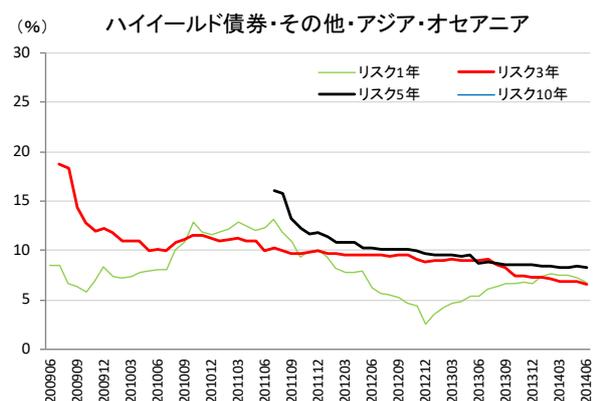
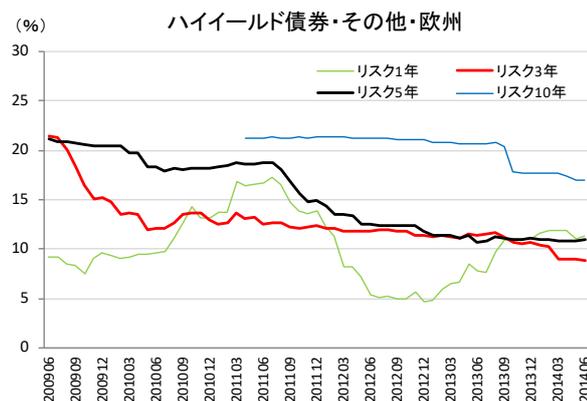
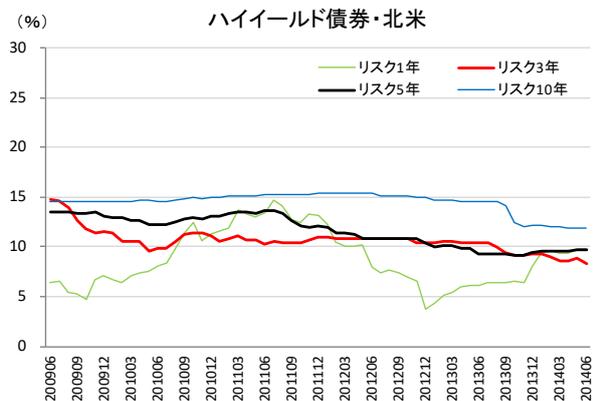
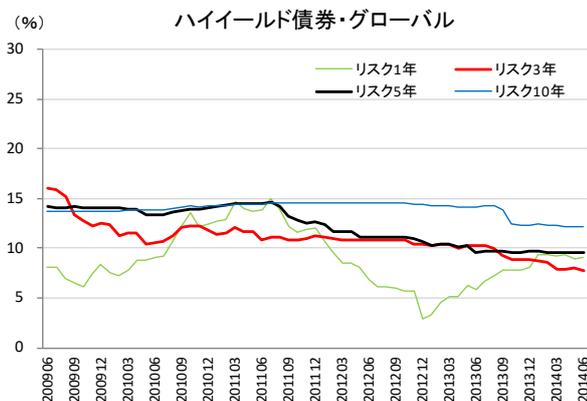
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

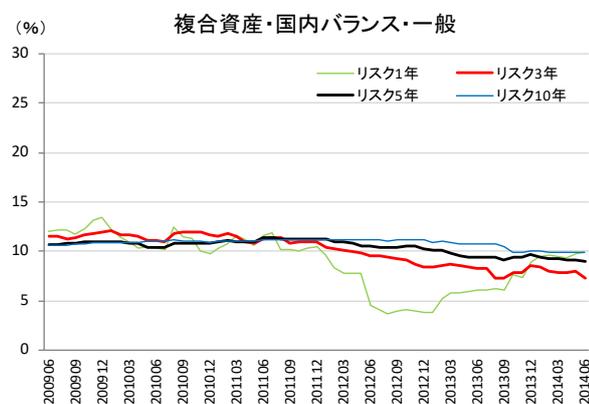
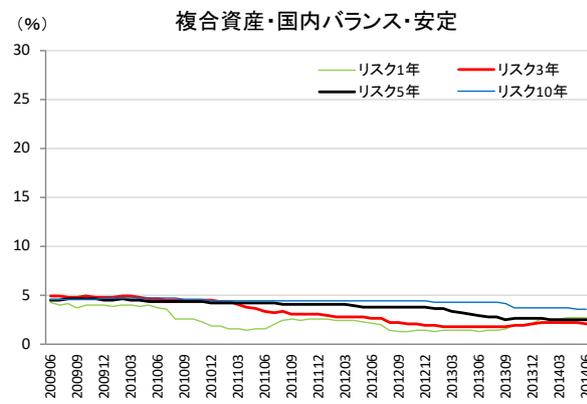
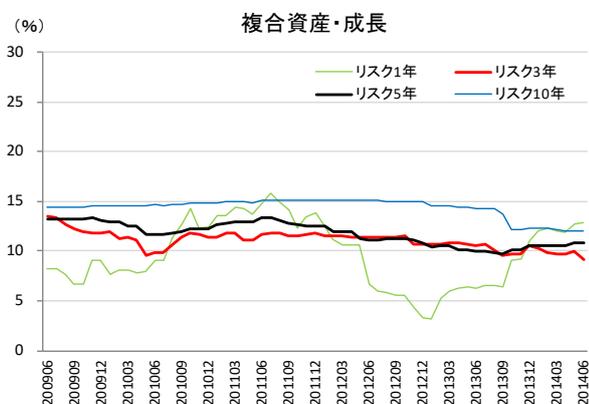
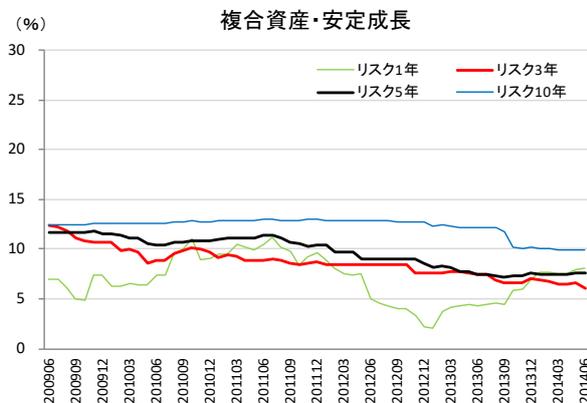
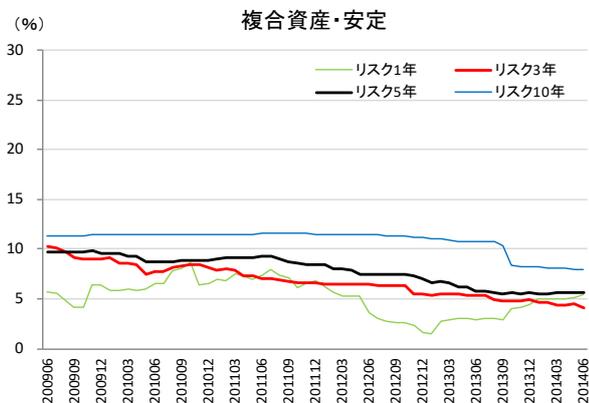


<2> リスク・サマリー

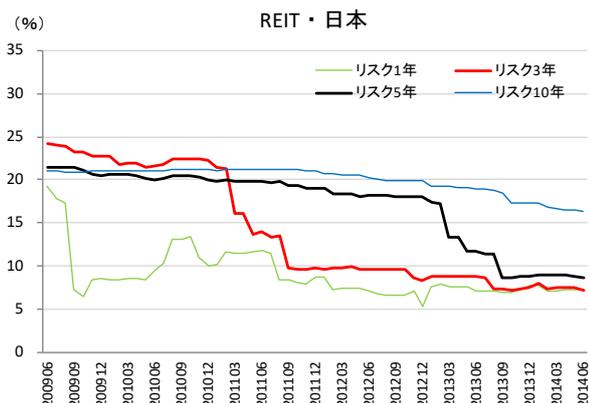
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

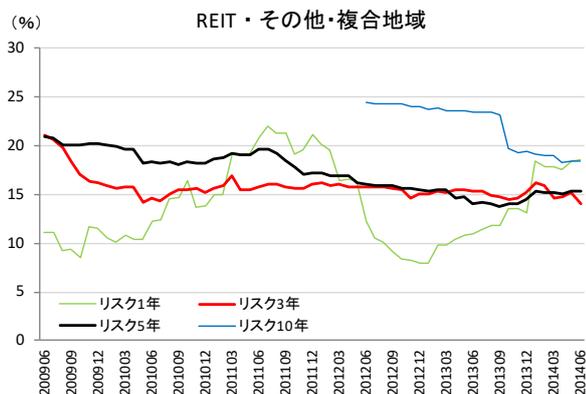
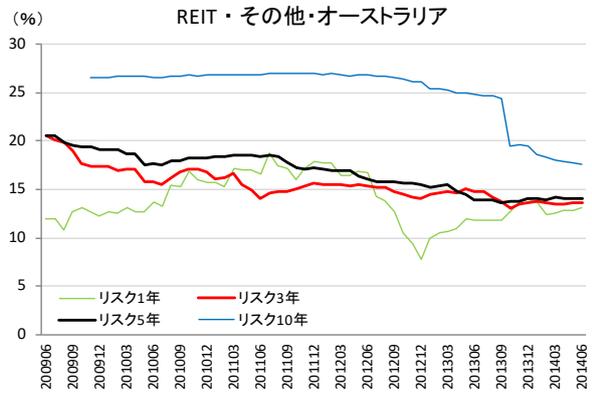
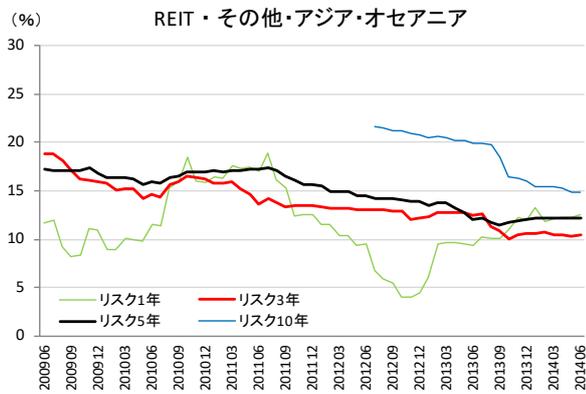
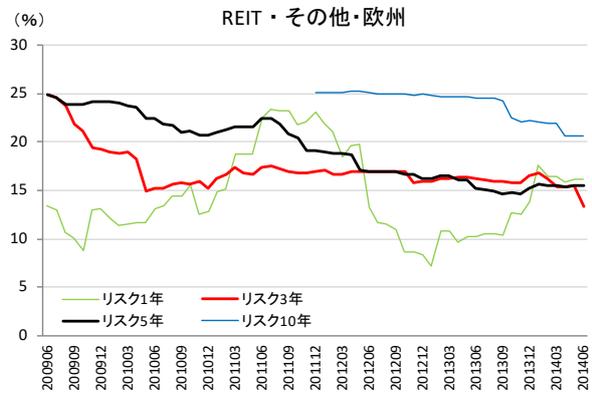
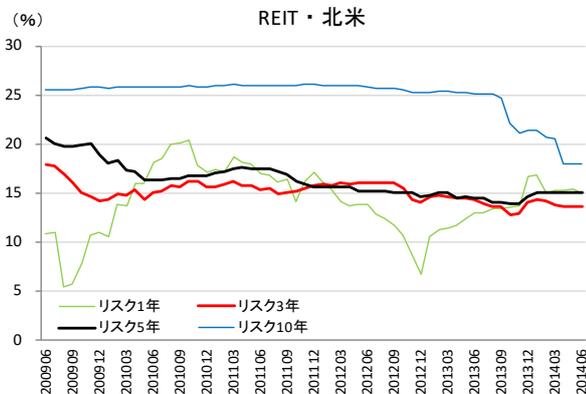
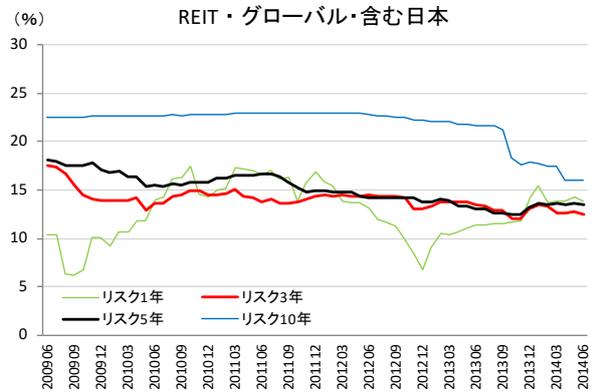
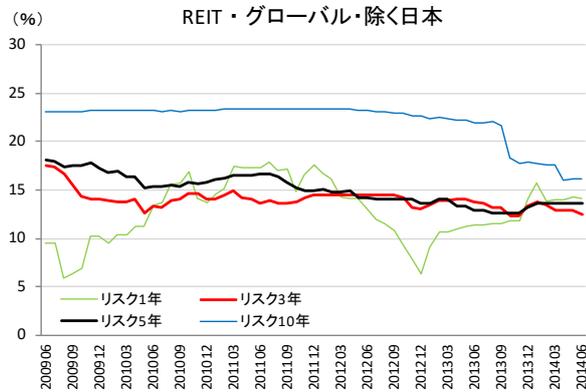


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国REIT]

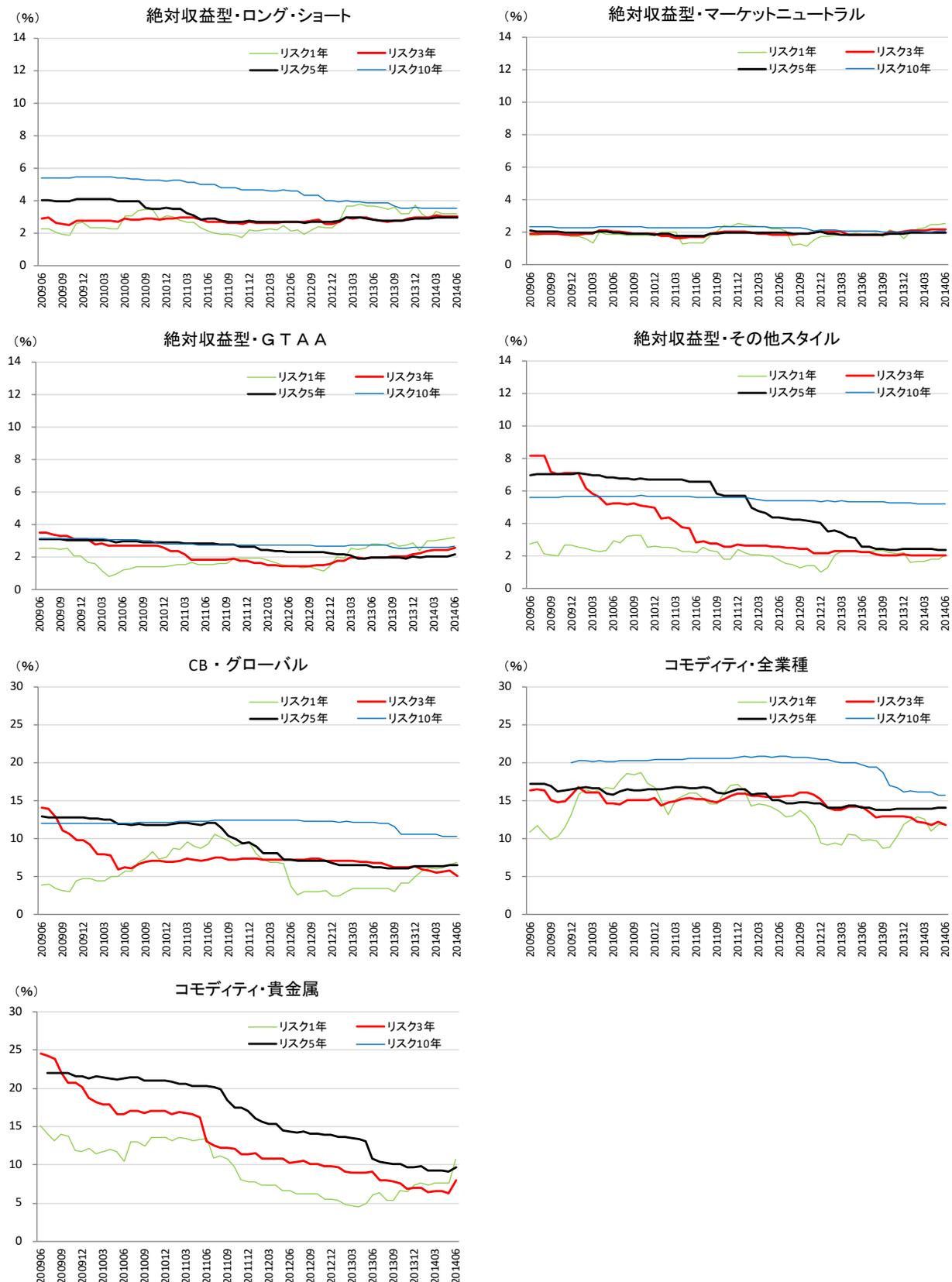


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



## &lt; 3 &gt; 設定・解約額 [ネット金額]

## 「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	1,639	-538	-2,801	8,569
国内株式	-687	-2,735	-2,334	4,171
一般	-424	-1,606	-1,704	657
フリー	-408	-1,449	-1,464	648
バリュー	-17	-158	-240	8
小型	-184	-501	-404	148
その他	-74	-611	-198	3,344
日経225	101	-521	-456	2,111
TOPIX	-192	-75	265	1,065
JPX日経400	6	-6	-11	33
国内債券	-15	31	204	1,078
一般	-15	31	204	1,078
外国株式(先進国)	1,628	1,550	1,093	13,736
グローバル	1,599	1,899	2,098	11,315
除く日本	133	469	898	2,524
含む日本	1,466	1,430	1,200	8,791
その他	29	-349	-1,005	2,421
北米	2	11	27	44
米国	85	-186	-682	3,573
カナダ	-10	-26	-61	-110
欧州	-34	-96	-214	-422
ドイツ	0	0	0	1
イギリス	-1	-1	-3	-7
アジア・オセアニア	-3	-10	-29	-59
オーストラリア	-11	-42	-43	-597
ニュージーランド	1	1	1	1
複合地域	0	0	-1	-2
エマージング株式	-604	-1,683	-2,643	-3,689
グローバル	-317	-790	-1,259	-1,826
BRICS	-5	-19	-41	-81
その他	-282	-874	-1,343	-1,782
欧州	-3	-12	-35	-66
ロシア	-4	-11	-20	-44
アジア・オセアニア	-88	-250	-442	-957
中国	-39	-139	-183	65
インド	-130	-455	-774	-1,279
インドネシア	-5	-15	-24	-47
タイ	-3	-7	-13	-24
フィリピン	-6	-11	-32	-64
ベトナム	-2	5	174	657
韓国	-2	-3	-3	3
香港	0	0	-1	0
台湾	0	0	0	0
中南米	-1	-2	-9	-16
ブラジル	4	32	34	10
メキシコ	0	0	-2	-4
中東・アフリカ	-2	-5	-7	-16
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	-1	0	-4	2
複合地域	0	-1	-1	-3

## &lt;3&gt; 設定・解約額 [ネット金額]

## 「総合」およびファンド分類別②

(単位:億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	1,639	-538	-2,801	8,569
外国債券(先進国)	-73	-521	-2,308	-6,845
グローバル	-165	-623	-1,994	-5,078
除く日本	-158	-379	-700	-1,629
含む日本	-7	-244	-1,294	-3,449
その他	92	103	-314	-1,767
北米	-2	-7	-15	-39
米国	202	318	218	-351
カナダ	-21	-75	-171	-384
欧州	10	168	304	548
アジア・オセアニア	-38	-123	-274	-646
オーストラリア	-48	-131	-269	-665
ニュージーランド	-1	-8	-20	-39
複合地域	-9	-38	-85	-181
エマージング債券	-60	-88	2	-1,305
グローバル	-28	-57	-183	-732
米ドル建て	-30	-80	-238	-774
現地通貨建て	2	24	55	43
その他	-32	-32	185	-573
ロシア	-10	-30	-62	-136
アジア・オセアニア	-3	-11	-29	-100
インド	4	-38	-142	-489
インドネシア	0	-7	-18	-66
ブラジル	-23	-54	-134	-398
メキシコ	-1	5	-20	-98
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	0	2	4	11
複合地域	0	-1	-3	-6
ハイイールド債券	-114	-530	-1,430	-4,539
グローバル	-27	-88	-239	-622
北米	-53	-267	-804	-2,886
その他	-34	-175	-387	-1,031
欧州	-29	-150	-295	-720
アジア・オセアニア	-2	-17	-77	-279
複合地域	0	-1	-2	-5
複合資産	759	1,828	3,264	8,189
安定	10	44	98	839
安定成長	273	638	1,086	3,044
成長	128	168	379	1,331
国内バランス	349	978	1,702	2,974
安定	347	963	1,683	2,984
一般	1	7	9	-5

## ＜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	1,639	-538	-2,801	8,569
国内REIT	406	786	1,186	849
日本	406	786	1,186	849
外国REIT	-26	-312	-935	-4,853
グローバル	122	248	43	-772
除く日本	62	221	440	697
含む日本	60	27	-397	-1,469
北米	-118	-402	-1,271	-4,033
その他	-30	-159	292	-48
欧州	-3	-14	-35	-81
アジア・オセアニア	-43	-135	414	237
オーストラリア	19	1	-58	-140
複合地域	0	0	0	0
複数国	-3	-11	-29	-64
その他	424	1,136	1,099	1,779
絶対収益型	-11	40	-92	357
ロング・ショート	-46	-110	-176	-244
マーケットニュートラル	6	51	131	370
GTAA	-4	-15	-25	-58
その他スタイル	33	115	-22	281
CB	-28	-71	-133	-363
欧州	-1	-1	-2	-3
アジア・オセアニア	0	2	1	-6
日本	-1	-3	-5	-10
グローバル	-27	-69	-127	-343
コモディティ	8	46	232	369
全業種	6	6	21	64
貴金属	1	41	211	308
エネルギー	1	-1	-1	-5
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
総合	627,062	100.00%	5,478	100.00%
国内株式	101,942	16.26%	884	16.14%
一般	60,557	9.66%	583	10.64%
フリー	48,681	7.76%	465	8.49%
バリュー	11,876	1.89%	118	2.15%
小型	10,196	1.63%	93	1.70%
その他	30,488	4.86%	200	3.65%
日経225	16,156	2.58%	70	1.28%
TOPIX	11,868	1.89%	75	1.37%
JPX日経400	806	0.13%	20	0.37%
国内債券	33,806	5.39%	131	2.39%
一般	33,806	5.39%	131	2.39%
外国株式(先進国)	147,767	23.56%	973	17.76%
グローバル	115,374	18.40%	612	11.17%
除く日本	24,203	3.86%	171	3.12%
含む日本	91,171	14.54%	441	8.05%
その他	32,392	5.17%	361	6.59%
北米	387	0.06%	17	0.31%
米国	23,442	3.74%	238	4.34%
カナダ	390	0.06%	3	0.05%
欧州	1,736	0.28%	58	1.06%
ドイツ	27	0.00%	1	0.02%
イギリス	24	0.00%	2	0.04%
アジア・オセアニア	101	0.02%	8	0.15%
オーストラリア	6,263	1.00%	32	0.58%
ニュージーランド	14	0.00%	1	0.02%
複合地域	8	0.00%	1	0.02%
エマージング株式	33,491	5.34%	369	6.74%
グローバル	8,738	1.39%	101	1.84%
BRICS	712	0.11%	8	0.15%
その他	24,040	3.83%	260	4.75%
欧州	237	0.04%	9	0.16%
ロシア	130	0.02%	5	0.09%
アジア・オセアニア	6,919	1.10%	116	2.12%
中国	2,364	0.38%	29	0.53%
インド	11,512	1.84%	30	0.55%
インドネシア	212	0.03%	8	0.15%
タイ	102	0.02%	4	0.07%
フィリピン	99	0.02%	5	0.09%
ベトナム	1,088	0.17%	9	0.16%
韓国	5	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	1,041	0.17%	21	0.38%
メキシコ	21	0.00%	3	0.05%
中東・アフリカ	118	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	22	0.00%	2	0.04%

## &lt;4&gt; 純資産額、ファンド本数

## 「総合」およびファンド分類別②

	純資産額 (億円)	構成比	本数	構成比
総合	627,062	100.00%	5,478	100.00%
外国債券(先進国)	86,800	13.84%	888	16.21%
グローバル	63,304	10.10%	590	10.77%
除く日本	33,716	5.38%	247	4.51%
含む日本	29,588	4.72%	343	6.26%
その他	23,496	3.75%	298	5.44%
北米	98	0.02%	6	0.11%
米国	5,963	0.95%	161	2.94%
カナダ	1,484	0.24%	7	0.13%
欧州	1,416	0.23%	35	0.64%
アジア・オセアニア	2,601	0.41%	12	0.22%
オーストラリア	10,077	1.61%	43	0.78%
ニュージーランド	185	0.03%	14	0.26%
複合地域	1,639	0.26%	12	0.22%
エマージング債券	20,211	3.22%	306	5.59%
グローバル	9,168	1.46%	195	3.56%
米ドル建て	7,428	1.18%	154	2.81%
現地通貨建て	1,740	0.28%	41	0.75%
その他	11,043	1.76%	111	2.03%
ロシア	272	0.04%	5	0.09%
アジア・オセアニア	527	0.08%	21	0.38%
インド	4,700	0.75%	22	0.40%
インドネシア	617	0.10%	12	0.22%
ブラジル	3,438	0.55%	25	0.46%
メキシコ	592	0.09%	9	0.16%
南アフリカ	3	0.00%	1	0.02%
トルコ	161	0.03%	6	0.11%
複合地域	54	0.01%	1	0.02%
ハイイールド債券	23,692	3.78%	315	5.75%
グローバル	3,667	0.58%	62	1.13%
北米	15,509	2.47%	164	2.99%
その他	4,517	0.72%	89	1.62%
欧州	3,550	0.57%	51	0.93%
アジア・オセアニア	839	0.13%	32	0.58%
複合地域	49	0.01%	1	0.02%
複合資産	91,002	14.51%	969	17.69%
安定	28,132	4.49%	293	5.35%
安定成長	41,725	6.65%	411	7.50%
成長	12,254	1.95%	231	4.22%
国内バランス	8,891	1.42%	34	0.62%
安定	8,258	1.32%	10	0.18%
一般	499	0.08%	18	0.33%

## &lt; 4 &gt; 純資産額、ファンド本数

## 「総合」およびファンド分類別③

	純資産額 (億円)	構成比	本数	構成比
総合	627,062	100.0%	5,478	100.0%
国内REIT	27,857	4.4%	125	2.3%
日本	27,857	4.4%	125	2.3%
外国REIT	46,920	7.5%	297	5.4%
グローバル	18,153	2.9%	136	2.5%
除く日本	3,514	0.6%	45	0.8%
含む日本	14,640	2.3%	91	1.7%
北米	23,619	3.8%	91	1.7%
その他	5,148	0.8%	70	1.3%
欧州	283	0.0%	18	0.3%
アジア・オセアニア	3,702	0.6%	34	0.6%
オーストラリア	799	0.1%	13	0.2%
複合地域	50	0.0%	3	0.1%
複数国	314	0.1%	2	0.0%
その他	13,574	2.2%	221	4.0%
絶対収益型	6,922	1.1%	95	1.7%
ロング・ショート	1,029	0.2%	27	0.5%
マーケットニュートラル	924	0.1%	12	0.2%
GTAA	453	0.1%	16	0.3%
その他スタイル	4,515	0.7%	40	0.7%
CB	1,637	0.3%	51	0.9%
欧州	3	0.0%	3	0.1%
アジア・オセアニア	42	0.0%	1	0.0%
日本	69	0.0%	3	0.1%
グローバル	1,523	0.2%	44	0.8%
コモディティ	1,872	0.3%	32	0.6%
全業種	852	0.1%	14	0.3%
貴金属	992	0.2%	16	0.3%
エネルギー	21	0.0%	1	0.0%
その他コモディティ	8	0.0%	1	0.0%

## &lt; 5 &gt; 属性、指標等（平均値）

## 「総合」およびファンド分類別①

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	11,308	7.9	3.94	4.30	1.302
国内株式	13,474	10.9	1.38	1.81	1.176
一般	12,377	10.5	1.88	2.54	1.419
フリー	12,036	9.9	2.18	2.97	1.465
バリュー	13,722	12.8	0.64	0.74	1.230
小型	19,075	11.4	1.13	1.33	1.715
その他	14,212	11.8	0.49	0.53	0.504
日経225	14,781	13.2	0.50	0.53	0.585
TOPIX	14,775	13.0	0.36	0.40	0.341
JPX日経400	12,630	4.9	0.04	0.05	0.551
国内債券	11,263	10.4	0.33	0.33	0.360
一般	11,263	10.4	0.33	0.33	0.360
外国株式(先進国)	12,268	6.4	3.96	4.42	1.600
グローバル	12,863	6.8	2.87	3.20	1.575
除く日本	15,555	8.9	0.93	1.03	0.786
含む日本	11,819	6.0	3.43	3.81	1.785
その他	11,261	5.7	7.61	8.60	1.690
北米	10,788	6.0	4.76	4.98	1.881
米国	11,827	5.2	5.78	6.06	1.655
カナダ	6,700	7.3	19.50	24.87	1.967
欧州	10,988	8.1	3.33	3.75	1.692
ドイツ	10,255	5.3	0.00	0.00	0.756
イギリス	5,626	5.1	17.17	22.47	1.922
アジア・オセアニア	9,601	5.2	5.43	6.56	1.679
オーストラリア	9,046	5.0	15.09	18.66	1.795
ニュージーランド	13,970	6.9	3.81	3.58	1.642
複合地域	7,950	6.2	1.01	1.26	1.674
エマージング株式	11,800	8.4	3.23	3.71	1.815
グローバル	10,932	6.2	2.36	2.51	1.540
BRICS	13,861	11.5	0.95	0.90	2.033
その他	12,074	9.1	3.60	4.23	1.909
欧州	9,291	13.2	0.20	0.17	1.967
ロシア	10,059	10.3	0.50	0.42	1.969
アジア・オセアニア	12,500	9.1	8.18	9.73	1.699
中国	17,400	9.4	0.76	0.92	1.936
インド	12,348	9.5	1.22	1.24	2.044
インドネシア	10,790	8.0	0.33	0.29	1.824
タイ	12,145	11.2	0.58	0.55	1.682
フィリピン	11,365	5.9	0.59	0.52	1.766
ベトナム	11,365	3.8	0.91	1.09	1.835
韓国	9,959	5.1	3.28	3.96	1.774
香港	16,010	9.8	1.92	1.94	0.842
台湾	12,671	8.2	0.85	1.02	1.693
中南米	8,248	12.5	0.00	0.00	2.003
ブラジル	7,011	9.2	12.36	15.76	1.831
メキシコ	8,011	5.6	0.00	0.00	1.883
中東・アフリカ	9,934	9.8	0.34	0.37	2.089
南アフリカ	8,883	8.9	0.00	0.00	1.577
トルコ	5,771	12.9	0.00	0.00	2.006
複合地域	17,932	11.1	2.84	2.96	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

目録見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

## &lt; 5 &gt; 属性、指標等（平均値）

## 「総合」およびファンド分類別②

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	11,308	7.9	3.94	4.30	1.302
外国債券(先進国)	9,753	7.4	3.04	3.20	1.133
グローバル	10,219	7.6	2.07	2.13	1.083
除く日本	10,790	9.9	2.07	2.13	0.866
含む日本	9,807	5.9	2.07	2.12	1.329
その他	8,832	7.1	5.68	6.12	1.269
北米	10,196	5.2	1.89	1.93	1.803
米国	9,456	5.8	4.50	4.78	1.321
カナダ	8,056	7.0	6.36	6.64	1.343
欧州	8,440	9.9	1.99	2.01	1.032
アジア・オセアニア	7,771	8.7	4.19	4.47	1.398
オーストラリア	7,935	9.9	7.24	7.96	1.237
ニュージーランド	9,306	4.7	3.37	3.38	1.315
複合地域	5,696	9.6	4.94	5.16	1.172
エマージング債券	8,770	7.9	8.08	8.21	1.578
グローバル	9,030	8.7	7.31	7.75	1.573
米ドル建て	9,134	9.0	7.70	8.17	1.614
現地通貨建て	8,641	7.5	5.64	5.95	1.396
その他	8,314	6.3	8.77	8.59	1.583
ロシア	8,423	6.4	6.09	6.24	1.588
アジア・オセアニア	8,902	6.1	12.14	13.58	1.618
インド	9,201	4.6	8.30	8.72	1.674
インドネシア	7,288	6.9	7.13	7.13	1.635
ブラジル	9,111	9.4	9.57	9.50	1.562
メキシコ	6,348	6.6	8.33	8.65	1.371
南アフリカ	7,221	7.2	7.17	7.48	1.404
トルコ	3,165	6.5	8.35	10.98	1.428
複合地域	4,161	12.8	5.66	5.77	1.188
ハイイールド債券	8,637	8.1	9.07	9.86	1.676
グローバル	7,419	7.7	7.99	8.50	1.595
北米	9,496	9.2	8.62	9.28	1.675
その他	7,903	6.4	11.46	12.92	1.748
欧州	7,539	6.1	11.91	13.60	1.729
アジア・オセアニア	8,381	7.2	10.81	11.52	1.849
複合地域	4,489	15.3	5.19	5.35	1.780
複合資産	11,496	7.7	1.60	1.69	1.102
安定	10,987	7.2	0.70	0.76	1.168
安定成長	11,161	8.0	2.46	2.62	1.123
成長	12,835	7.8	0.26	0.27	0.992
国内バランス	10,847	7.4	2.17	2.21	0.942
安定	10,612	8.2	2.25	2.29	0.912
一般	11,156	8.6	1.10	1.17	1.353

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

## &lt; 5 &gt; 属性、指標等（平均値）

## 「総合」およびファンド分類別③

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	11,308	7.9	3.94	4.30	1.302
国内REIT	13,521	7.6	9.84	10.10	0.954
日本	13,521	7.6	9.84	10.10	0.954
外国REIT	10,745	6.6	11.78	12.74	1.550
グローバル	11,385	7.5	10.05	11.37	1.411
除く日本	13,533	6.2	4.78	6.01	1.098
含む日本	10,323	8.2	11.31	12.66	1.486
北米	9,845	6.4	13.29	14.27	1.602
その他	10,673	5.3	10.93	10.55	1.805
欧州	8,497	4.9	5.21	6.16	1.844
アジア・オセアニア	12,474	5.1	13.39	12.81	1.855
オーストラリア	9,671	4.6	5.38	5.31	1.688
複合地域	7,277	7.4	1.33	1.43	0.836
複数国	11,223	12.2	2.78	2.60	1.627
その他					
絶対収益型	10,213	5.2	0.10	0.11	1.596
ロング・ショート	10,318	5.2	0.45	0.46	1.603
マーケットニュートラル	10,575	4.4	0.07	0.07	1.223
GTAA	10,642	6.8	0.05	0.05	1.614
その他スタイル	9,863	4.9	0.03	0.03	1.669
CB	10,585	5.8	0.98	1.01	1.487
欧州	6,037	5.3	10.08	12.38	1.751
アジア・オセアニア	8,132	9.0	3.46	3.44	1.804
日本	10,831	8.1	0.17	0.18	1.051
グローバル	10,934	5.7	0.93	0.96	1.498
コモディティ	8,079	6.9	0.01	0.01	0.885
全業種	5,944	7.8	0.00	0.00	1.240
貴金属	9,695	6.1	0.02	0.02	0.580
エネルギー	9,119	10.3	0.00	0.00	1.059
その他コモディティ	11,075	2.8	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 川真田 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