

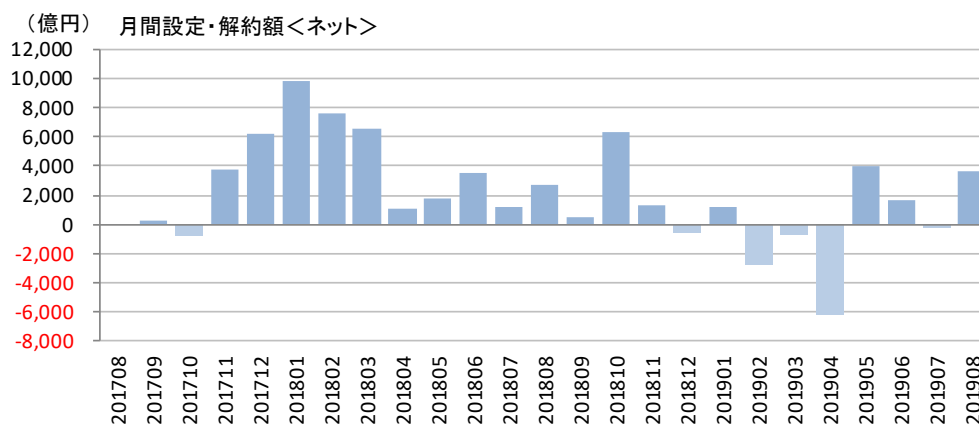
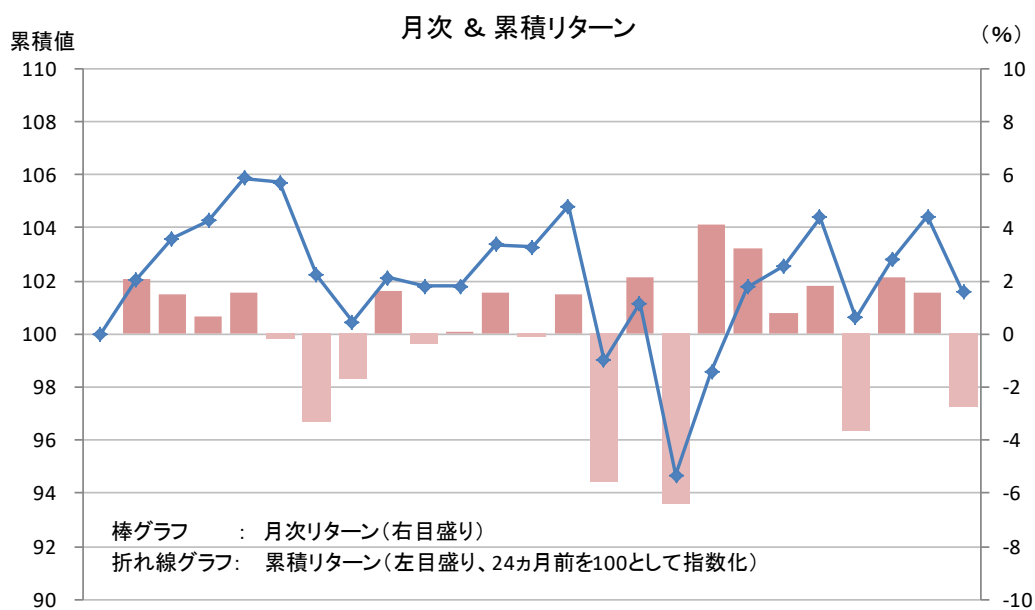
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2019年8月

「総合」 **-2.72 %**
 (前月 **+1.59 %**)



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		12,564	12,915	-351	-2.72
国内株式		14,290	14,993	-702	-4.68
一般		13,889	14,641	-752	-5.13
フリー		13,072	13,805	-732	-5.31
バリュー		17,755	18,579	-824	-4.43
小型		30,354	32,066	-1,711	-5.34
その他		14,104	14,626	-522	-3.57
日経225		13,470	13,994	-524	-3.74
TOPIX		13,945	14,436	-491	-3.40
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	13,147	13,566	-419	-3.09
国内債券		13,605	13,428	178	1.32
一般		13,605	13,428	178	1.32
外国株式(先進国)		13,751	14,516	-765	-5.27
グローバル		15,106	15,943	-836	-5.25
除く日本		21,241	22,456	-1,216	-5.41
含む日本		13,744	14,498	-754	-5.20
その他		11,003	11,628	-625	-5.37
北米		10,884	11,648	-764	-6.56
米国		16,347	17,204	-857	-4.98
カナダ	10,000 (2009.02.27)	16,169	16,749	-580	-3.46
欧州		16,803	17,557	-754	-4.29
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	7,834	8,287	-453	-5.47
イギリス	9,683 (2014.05.30)	8,113	8,595	-483	-5.62
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	30,735	32,532	-1,798	-5.53
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	14,781	15,930	-1,148	-7.21
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	31,694	34,867	-3,173	-9.10
複合地域	10,000 (2013.04.30)	7,981	8,508	-527	-6.20
エマージング株式		13,364	14,343	-979	-6.83
グローバル		13,150	14,172	-1,022	-7.21
BRICS	10,000 (2005.09.30)	21,408	23,378	-1,970	-8.43
その他		13,867	14,853	-986	-6.64
欧州		23,272	25,452	-2,180	-8.57
ロシア	10,000 (2007.03.30)	9,496	10,142	-646	-6.37
アジア・オセアニア		14,162	15,381	-1,219	-7.93
中国		30,909	32,040	-1,131	-3.53
インド	10,000 (2004.09.30)	29,128	31,050	-1,922	-6.19
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	13,524	14,527	-1,003	-6.91
タイ		23,079	24,140	-1,061	-4.39
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,918	8,581	-663	-7.72
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	14,449	14,901	-453	-3.04
韓国	10,000 (1997.06.30)	18,087	19,021	-934	-4.91
香港		20,879	23,359	-2,481	-10.62
台湾	10,000 (2008.03.31)	14,355	14,812	-457	-3.08
中南米	7,427 (2006.04.28)	7,642	8,662	-1,020	-11.78
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	8,908	10,164	-1,256	-12.36
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	8,159	8,659	-500	-5.77
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	8,676	9,335	-659	-7.06
南アフリカ	10,000 (2010.06.30)	5,431	6,186	-755	-12.21
トルコ		19,109	21,847	-2,738	-12.53
複合地域	10,000 (2005.08.31)	18,853	20,529	-1,676	-8.16

※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		12,564	12,915	-351	-2.72
外国債券(先進国)		17,577	17,677	-100	-0.57
グローバル		18,011	18,025	-14	-0.08
除く日本		19,196	19,163	33	0.17
含む日本		17,388	17,450	-62	-0.36
その他		16,385	16,699	-314	-1.88
北米	9,052 (2013.05.31)	10,450	10,343	107	1.03
米国		15,599	15,614	-15	-0.09
カナダ	10,000 (2003.05.30)	13,682	13,962	-279	-2.00
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,293	15,353	-60	-0.39
イギリス	10,069 (2014.07.31)	8,939	9,047	-108	-1.20
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	17,683	18,271	-588	-3.22
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	21,784	22,473	-689	-3.07
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	10,418	10,887	-469	-4.31
複合地域	10,000 (2001.11.30)	16,345	16,434	-89	-0.54
エマージング債券		16,434	17,506	-1,072	-6.12
グローバル		17,848	18,843	-995	-5.28
米ドル建て		18,518	19,522	-1,004	-5.14
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,108	12,864	-756	-5.88
その他	8,647 (2005.03.31)	12,032	12,913	-881	-6.83
ロシア	10,000 (2008.05.30)	10,319	10,894	-576	-5.28
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	13,895	14,131	-236	-1.67
インド	10,000 (2011.08.31)	15,248	16,090	-843	-5.24
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	12,763	13,304	-541	-4.07
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	11,994	13,503	-1,509	-11.18
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	11,096	11,634	-538	-4.62
南アフリカ	10,000 (2010.03.31)	10,034	10,923	-888	-8.13
トルコ	10,000 (2011.04.28)	5,153	5,547	-394	-7.11
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,376	10,849	-472	-4.35
ハイイールド債券		21,006	21,747	-741	-3.41
グローバル	10,000 (1997.06.30)	21,182	22,191	-1,010	-4.55
北米		20,353	20,990	-637	-3.03
その他	10,000 (2004.03.31)	21,344	22,179	-835	-3.77
欧州	10,000 (2006.04.28)	21,479	22,287	-808	-3.62
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	13,676	14,363	-687	-4.78
複合地域	10,000 (2004.03.31)	18,643	19,032	-389	-2.04
複合資産		16,903	17,050	-146	-0.86
安定	10,000 (1998.10.30)	15,383	15,400	-18	-0.11
安定成長		18,023	18,227	-204	-1.12
成長		19,382	19,937	-555	-2.78
国内バランス		13,179	13,087	92	0.70
安定		13,558	13,446	111	0.83
一般		13,676	13,823	-146	-1.06

※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		12,564	12,915	-351	-2.72	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	33,862	32,762	1,101	3.36	
日本	10,000 (2003.10.31)	33,862	32,762	1,101	3.36	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	26,325	26,420	-95	-0.36	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	22,663	22,928	-265	-1.15	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	24,444	24,607	-163	-0.66	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	22,757	23,051	-294	-1.28	
北米	10,000 (2003.09.30)	26,486	26,230	256	0.98	
その他	10,000 (2004.04.30)	26,707	27,748	-1,041	-3.75	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,238	5,404	-167	-3.08	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	19,996	20,894	-898	-4.30	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	14,747	15,254	-506	-3.32	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	6,634	6,973	-339	-4.86	
複数国	10,000 (2004.04.30)	35,246	34,868	378	1.08	
その他		5,769	5,830	-61	-1.05	
絶対収益型		7,824	7,838	-13	-0.17	
ロング・ショート		9,169	9,164	5	0.05	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,845	11,998	-152	-1.27	
GTAA		10,773	10,788	-15	-0.14	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,332	7,328	4	0.06	
CB		18,224	18,604	-380	-2.04	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	14,337	15,327	-990	-6.46	
日本		19,496	19,736	-240	-1.22	
グローバル		32,004	32,642	-638	-1.95	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	7,840	7,761	78	1.01	
全業種	10,000 (2004.12.30)	6,070	6,372	-302	-4.74	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	15,338	14,449	889	6.15	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	4,412	4,671	-259	-5.55	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	9,624	10,083	-459	-4.55	

※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	0.95	-0.18	-1.65	7.29
国内株式	-1.03	-4.89	-13.01	3.14
一般	-1.47	-5.54	-14.03	2.66
フリー	-1.64	-5.30	-14.02	3.43
バリュー	-0.75	-6.51	-14.08	-0.46
小型	-2.74	-5.03	-15.66	5.35
その他	0.48	-3.52	-9.46	3.30
日経225	0.59	-2.36	-7.90	4.25
TOPIX	0.10	-4.85	-11.06	2.37
JPX日経400	0.31	-4.48	-10.30	2.71
国内債券	2.09	3.03	4.45	3.66
一般	2.09	3.03	4.45	3.66
外国株式(先進国)	1.11	-1.50	-4.79	12.62
グローバル	1.25	-1.83	-4.92	12.59
除く日本	0.54	-1.51	-5.17	11.42
含む日本	1.44	-1.92	-4.85	12.90
その他	0.62	-0.34	-4.33	12.76
北米	0.32	-3.02	-7.67	12.60
米国	1.78	0.46	-2.97	14.77
カナダ	-0.14	-2.60	-7.41	10.03
欧州	-0.66	-1.62	-8.71	10.06
ドイツ	-4.10	-4.84	-15.23	4.43
イギリス	-5.35	-12.57	-11.88	-2.21
アジア・オセアニア	-2.88	-6.82	-7.22	1.43
オーストラリア	-3.14	-2.51	-7.36	6.86
ニュージーランド	-1.98	-1.31	1.11	6.47
複合地域	-6.62	-11.25	-25.40	-1.34
エマージング株式	-5.29	-5.21	-7.71	1.22
グローバル	-1.43	-4.74	-4.15	7.33
BRICS	-2.97	-3.96	3.05	7.43
その他	-6.73	-5.38	-9.29	-1.16
欧州	-2.22	-1.69	6.45	7.81
ロシア	0.53	4.62	12.85	16.17
アジア・オセアニア	-3.10	-8.76	-9.55	1.39
中国	4.25	-0.35	2.32	20.19
インド	-12.02	-3.37	-14.35	-7.30
インドネシア	1.26	-7.92	3.33	-1.20
タイ	0.90	-3.98	-5.83	4.67
フィリピン	-2.85	-6.15	-3.14	0.51
ベトナム	-2.28	-7.71	-11.93	0.26
韓国	-10.09	-20.76	-28.57	-18.15
香港	-6.76	-12.58	-10.50	-1.51
台湾	5.66	-5.18	-16.40	0.85
中南米	-4.92	-11.85	5.05	0.07
ブラジル	-4.10	-11.11	25.37	3.06
メキシコ	-8.47	-11.89	-22.23	-5.47
中東・アフリカ	-4.33	-7.78	-8.25	-0.65
南アフリカ	-5.96	-17.49	-17.71	-7.11
トルコ	4.36	-16.79	14.10	-6.01
複合地域	-2.89	-7.91	-10.71	1.21

＜1＞パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別②

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	0.95	-0.18	-1.65	7.29
外国債券(先進国)	0.89	0.92	2.08	2.96
グローバル	1.61	2.14	3.39	3.94
除く日本	1.87	2.06	3.13	3.64
含む日本	1.30	2.23	3.69	4.27
その他	-1.03	-2.31	-1.38	0.35
北米	1.53	3.18	2.58	3.92
米国	1.03	2.04	3.43	4.77
カナダ	0.60	-1.95	-1.44	2.36
欧州	0.62	0.73	0.38	1.86
イギリス	-3.82	-8.66	-6.70	-3.89
アジア・オセアニア	-2.63	-5.07	-4.07	-2.33
オーストラリア	-2.68	-4.91	-4.36	-2.26
ニュージーランド	-1.96	-5.83	-0.98	-2.91
複合地域	0.68	0.10	2.66	1.85
エマージング債券	-1.21	-2.58	7.11	1.71
グローバル	0.02	-2.02	7.91	3.98
米ドル建て	0.05	-1.60	8.53	4.66
現地通貨建て	-0.10	-3.82	5.24	1.06
その他	-2.23	-3.05	6.45	-0.16
ロシア	0.42	2.93	12.92	11.59
アジア・オセアニア	0.18	0.79	4.10	3.72
インド	-2.41	1.21	4.34	1.04
インドネシア	3.63	-0.53	6.60	4.51
ブラジル	-4.38	-9.32	10.12	-4.10
メキシコ	-0.38	-0.01	0.80	5.81
南アフリカ	-3.47	-9.20	0.76	-2.73
トルコ	15.34	-7.15	51.44	-0.35
複合地域	-0.86	-3.23	1.22	1.52
ハイイールド債券	-0.47	-1.95	1.58	4.92
グローバル	-1.45	-3.04	1.36	2.98
北米	-0.50	-1.76	0.64	5.77
その他	0.40	-1.70	5.00	3.74
欧州	1.22	-1.62	5.71	3.87
アジア・オセアニア	-3.11	-2.44	2.83	2.73
複合地域	-0.03	-1.09	-1.25	2.58
複合資産	1.85	1.24	0.44	5.80
安定	2.26	2.31	1.42	5.69
安定成長	1.83	1.09	0.64	6.14
成長	0.70	-1.35	-4.03	5.76
国内バランス	2.18	2.13	3.23	4.18
安定	2.22	2.31	3.92	4.12
一般	1.30	-0.39	-4.08	4.33

<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

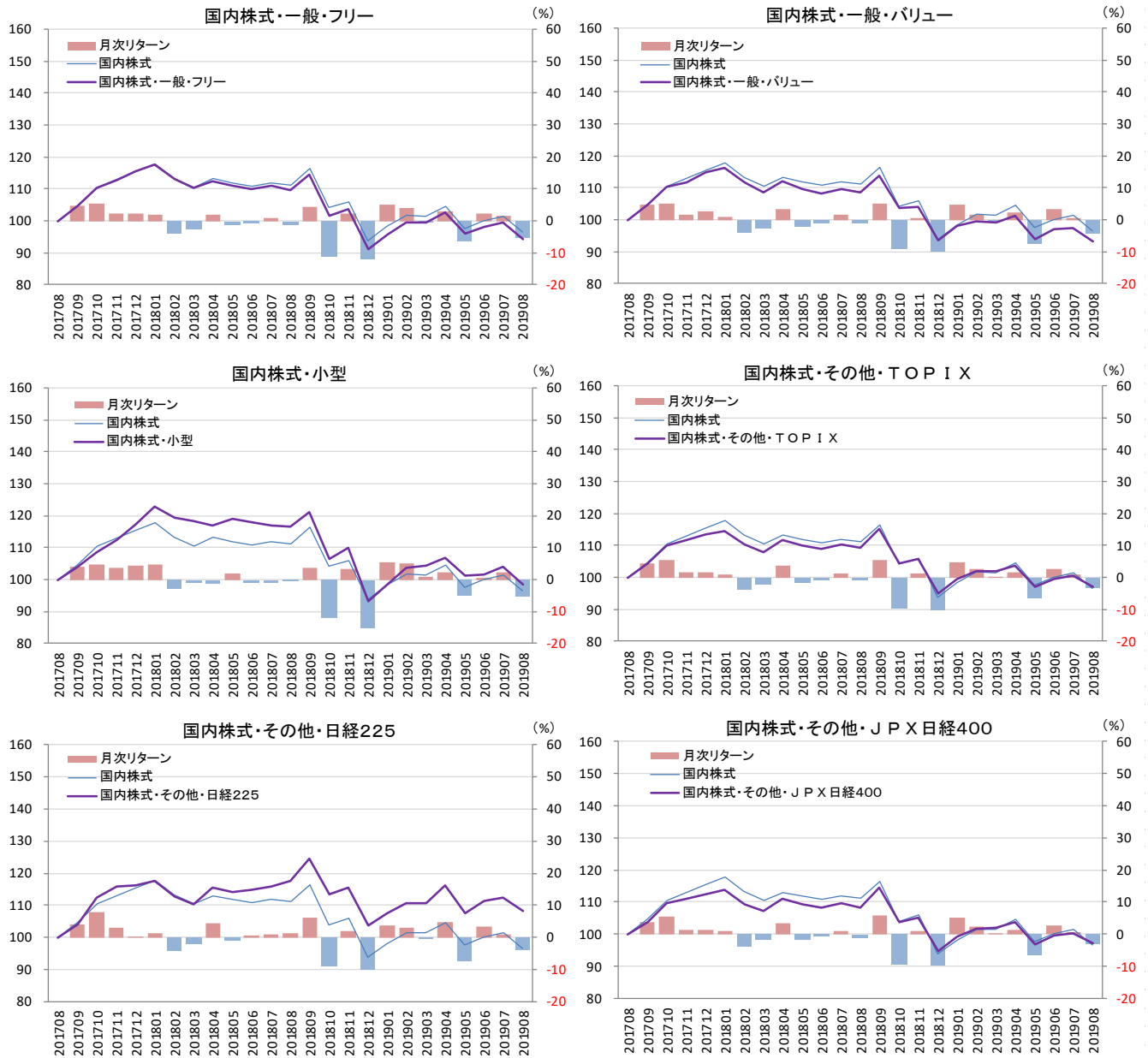
	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	0.95	-0.18	-1.65	7.29
国内REIT	9.24	13.35	21.99	19.48
日本	9.24	13.35	21.99	19.48
外国REIT	2.83	4.28	6.33	15.91
グローバル	1.49	1.46	2.26	12.22
除く日本	2.24	2.53	3.65	13.98
含む日本	1.31	1.21	1.94	11.82
北米	4.33	6.73	9.25	19.54
その他	0.60	3.09	7.67	12.11
欧州	-3.62	-5.02	-12.08	3.52
アジア・オセアニア	0.50	3.67	10.80	13.57
オーストラリア	1.19	2.28	3.77	7.28
複合地域	-2.25	-6.09	-7.55	3.90
複数国	4.74	7.71	11.97	18.46
その他	2.62	1.58	-2.98	5.83
絶対収益型	1.35	2.15	-0.12	2.94
ロング・ショート	2.94	4.79	3.76	6.20
マーケットニュートラル	-1.97	-0.59	-4.88	-0.60
GTAA	2.26	3.43	3.46	5.57
その他スタイル	1.80	2.12	-0.12	2.83
CB	0.33	-0.73	-1.58	3.84
アジア・オセアニア	-3.24	-6.77	-1.27	-0.27
日本	-1.19	-3.20	-6.67	-2.13
グローバル	0.50	-0.43	-1.37	4.25
コモディティ	5.50	2.31	3.14	7.57
全業種	-6.13	-8.78	-12.68	-2.83
貴金属	16.88	12.72	21.83	16.19
エネルギー	-7.70	-8.73	-21.61	12.52
その他コモディティ	-1.22	-7.69	-9.64	-1.39

<1>パフォーマンス・サマリー

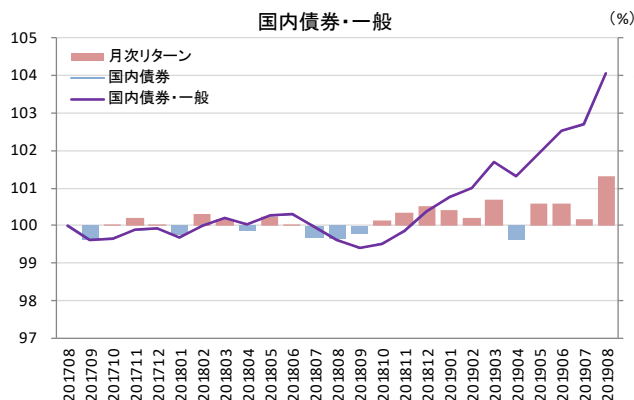
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

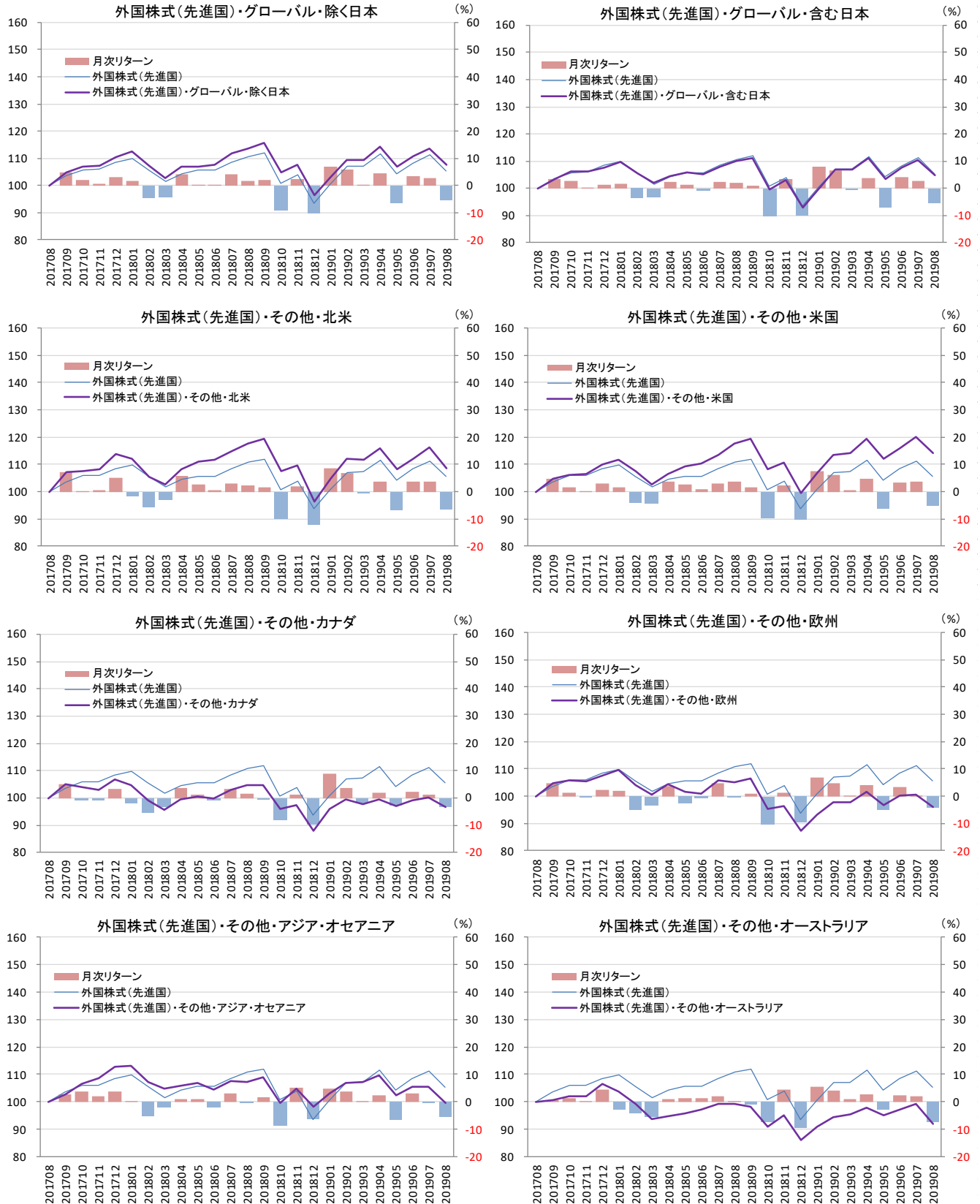


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

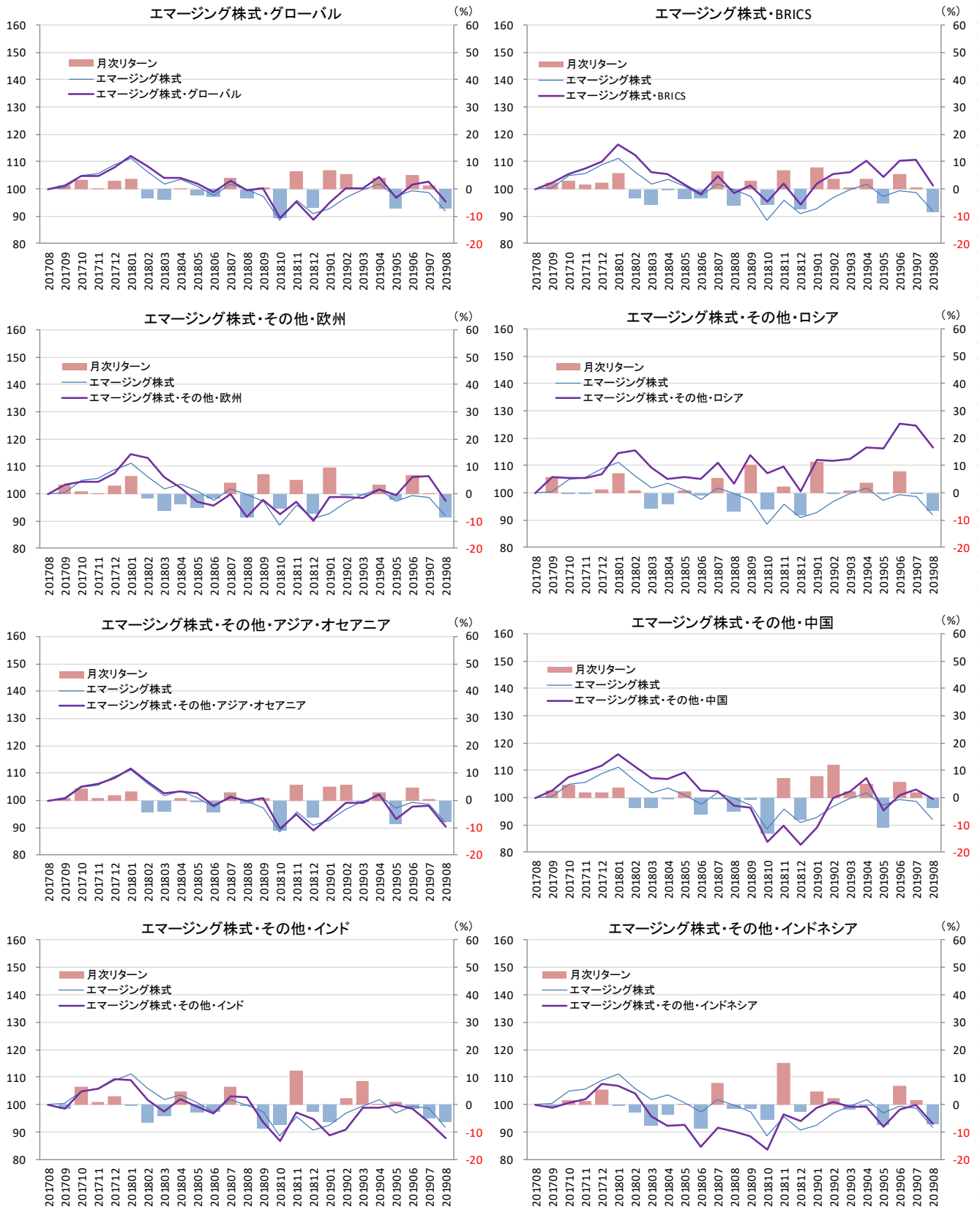


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマージング株式]

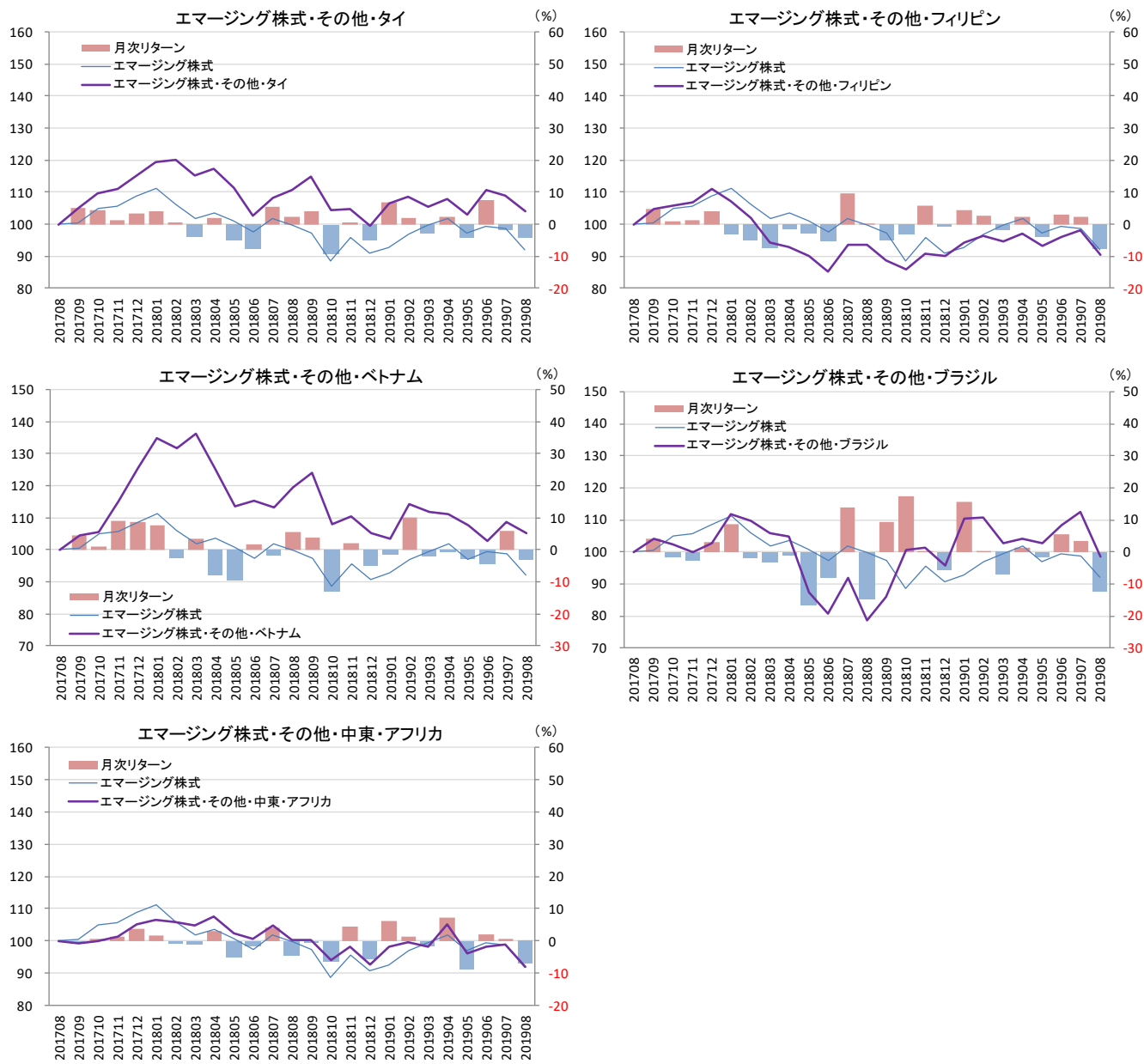


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

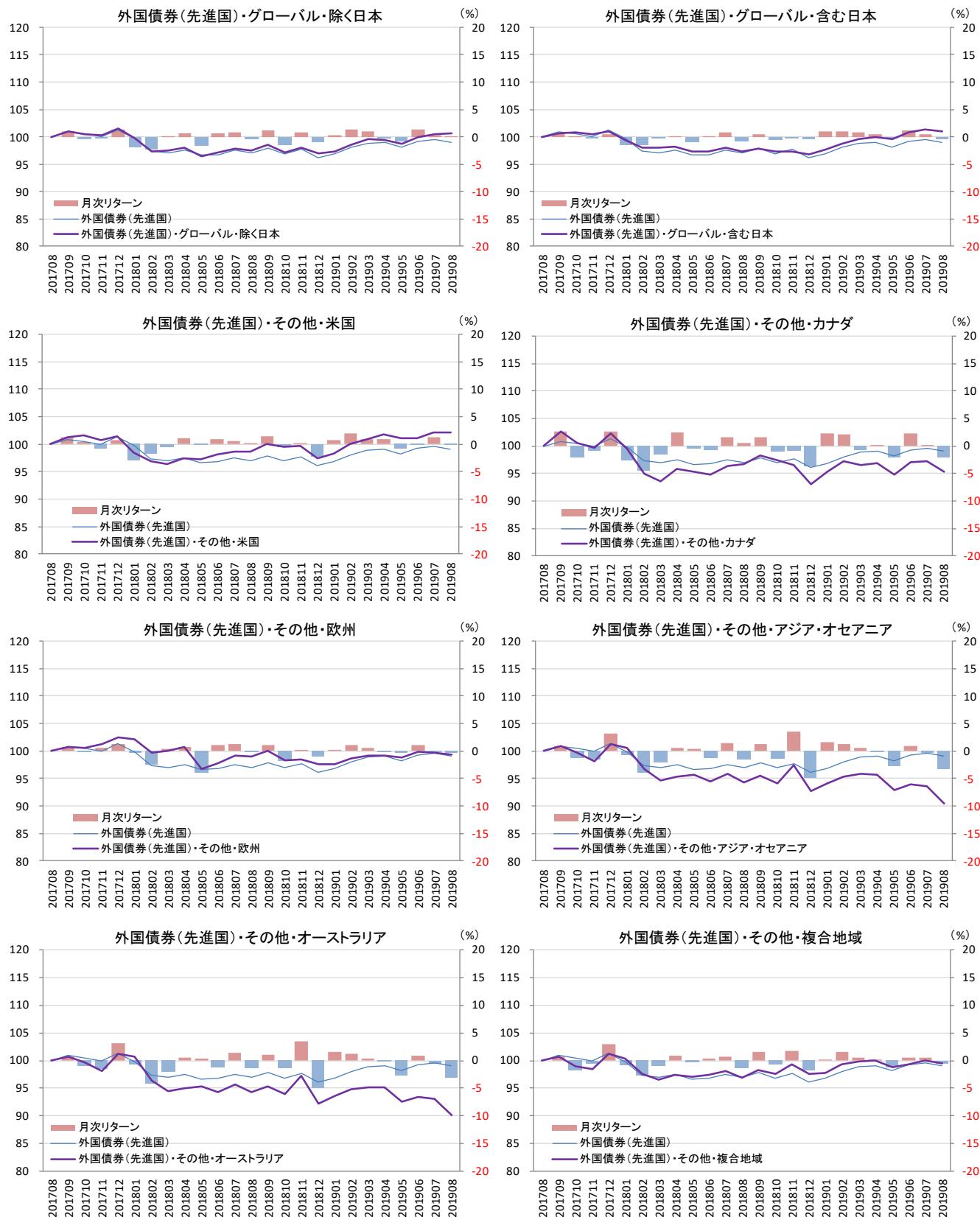


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

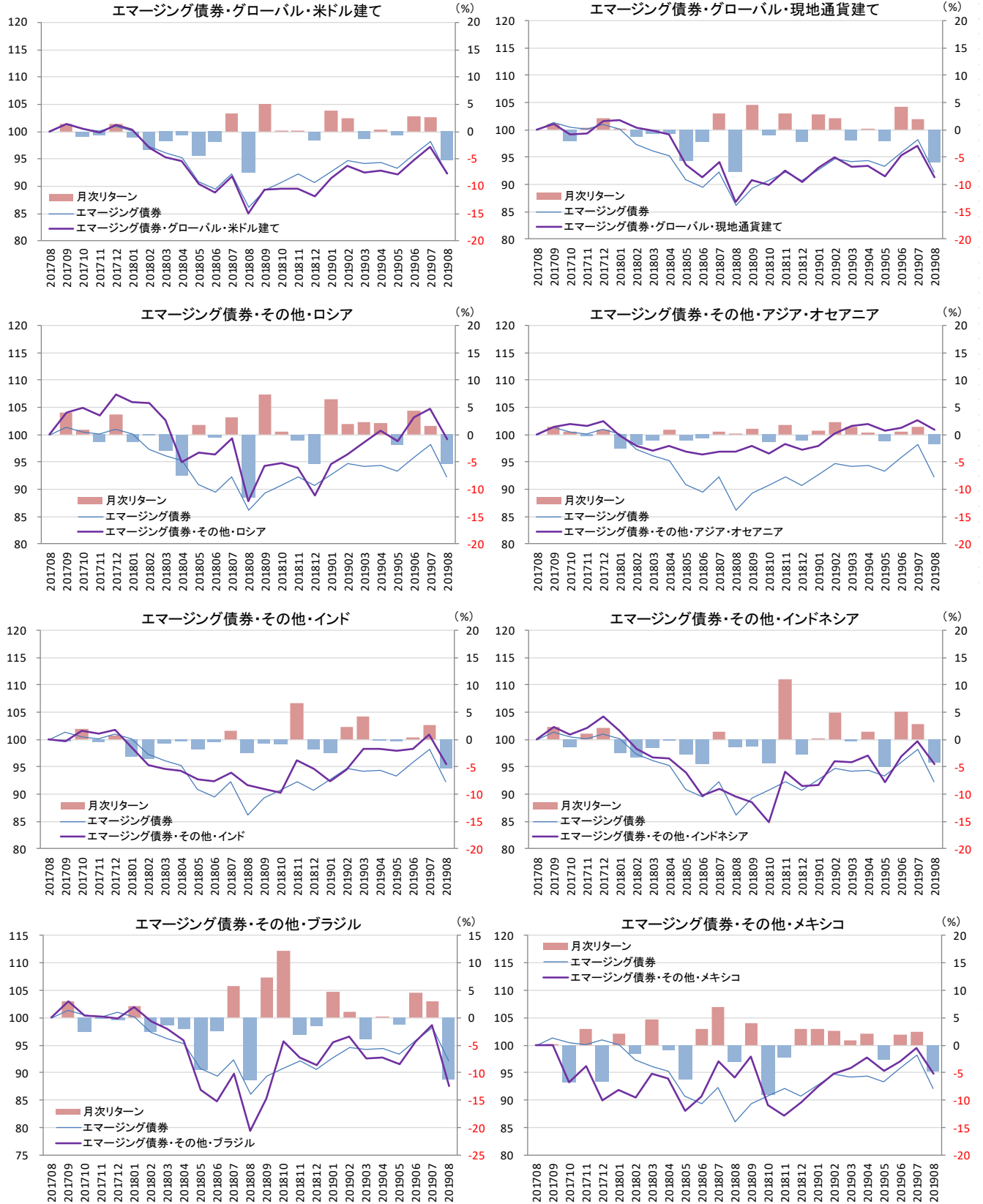


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24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]

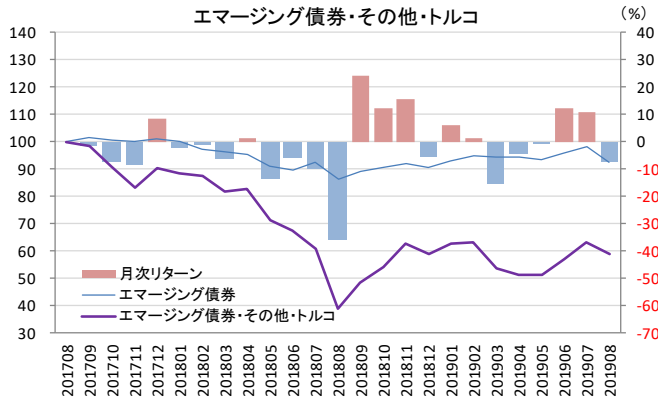


<1>パフォーマンス・サマリー

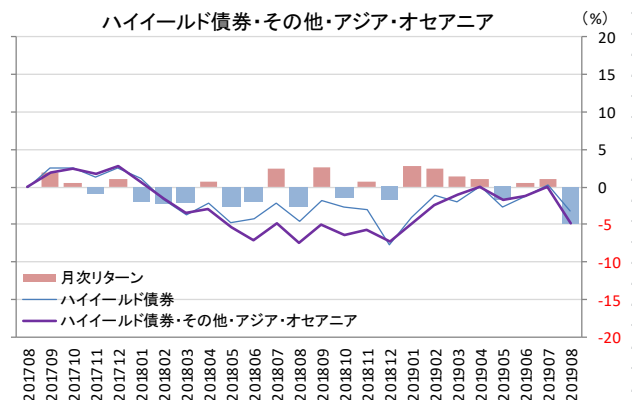
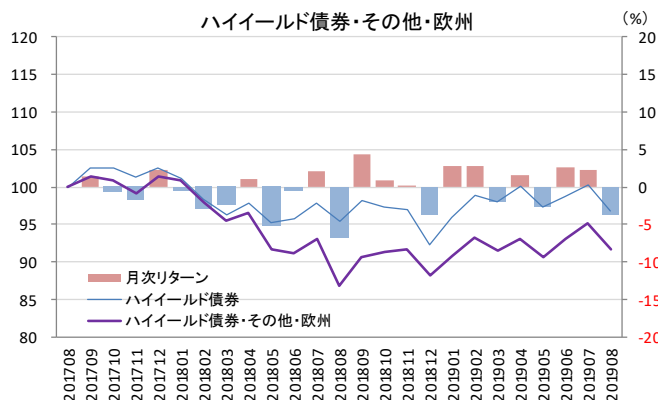
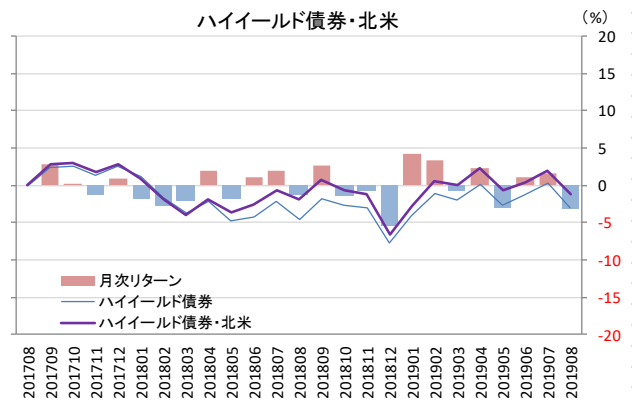
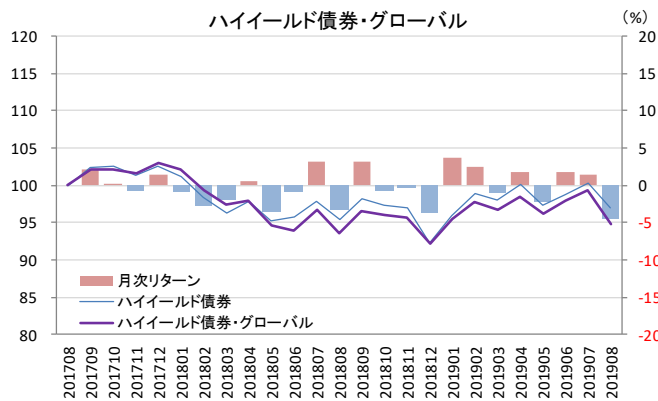
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

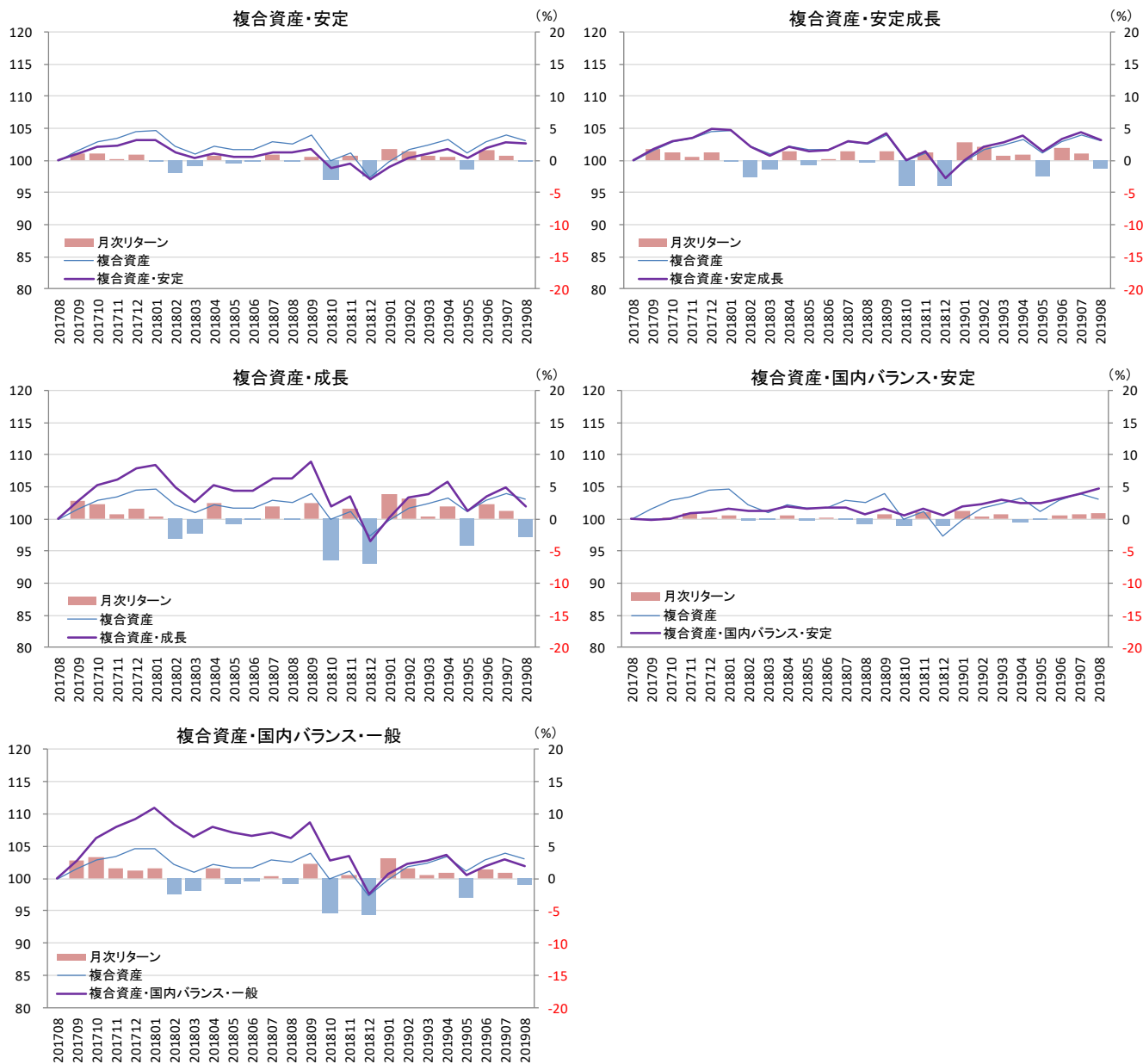


<1>パフォーマンス・サマリー

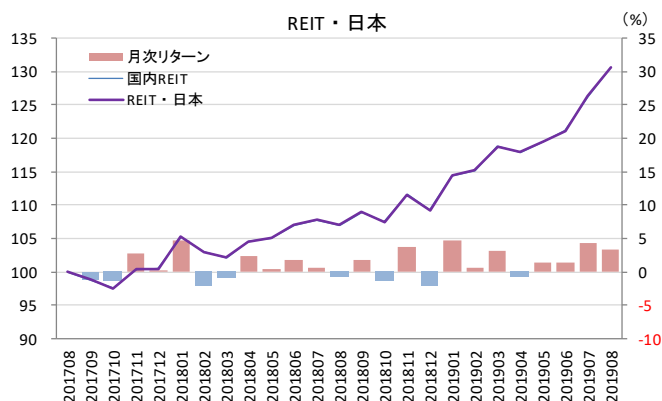
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

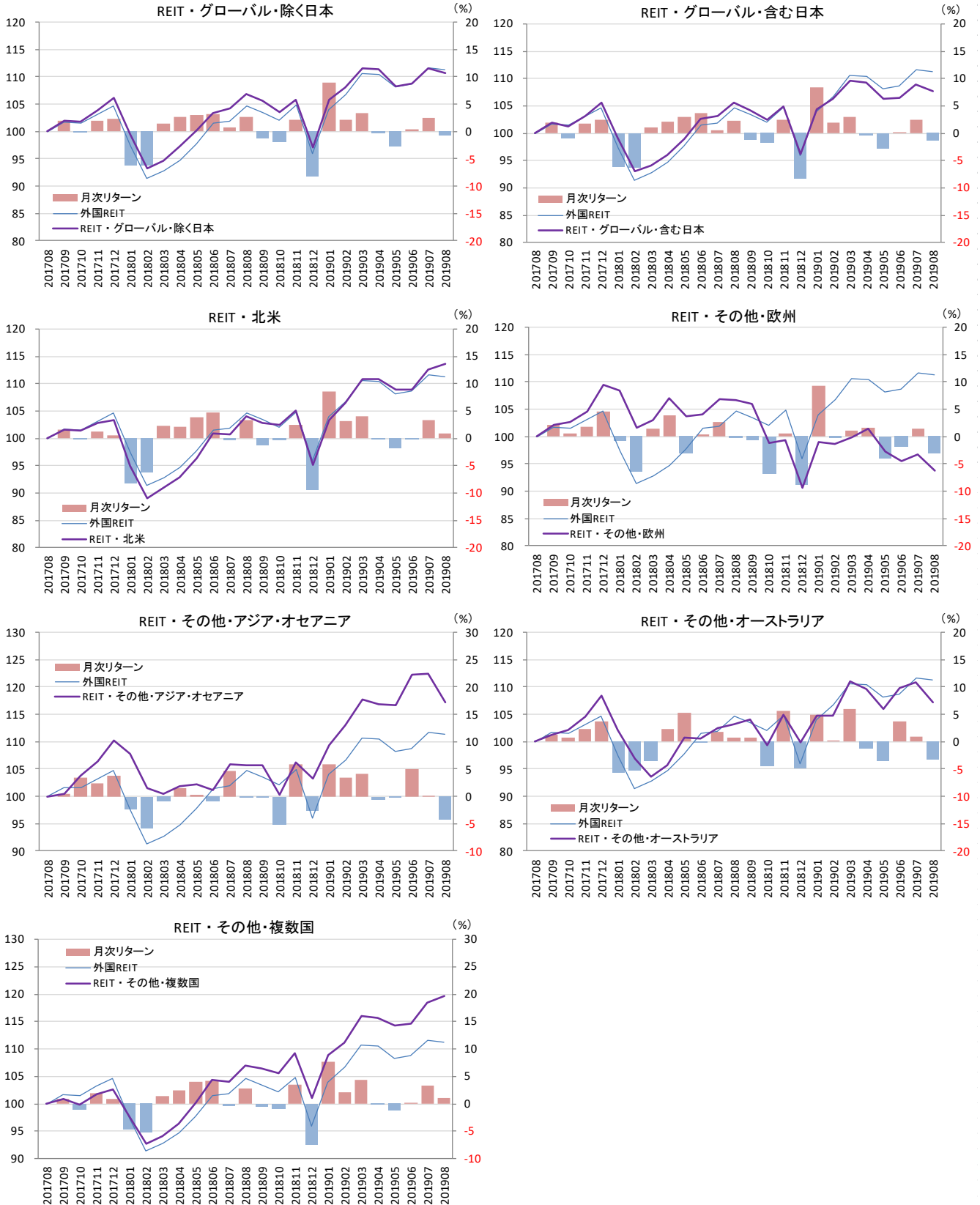


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

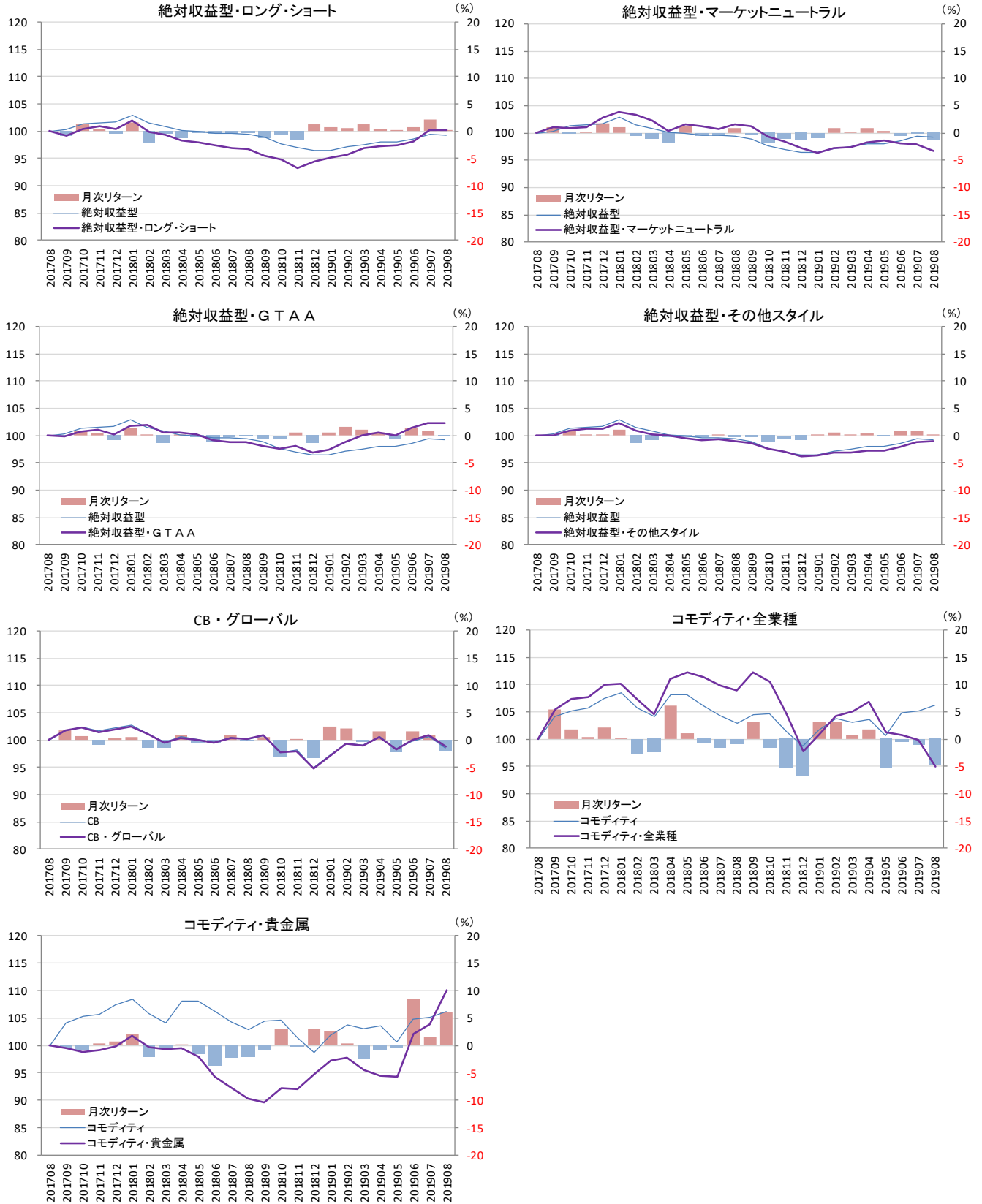


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



＜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	-2.72		
1	REIT・日本	3.36	4.76	0.16
2	国内債券・一般	1.32	5.53	0.07
3	REIT・北米	0.98	3.87	0.05
4	複合資産・国内バランス	0.70	1.48	0.01
5	コモディティ	1.01	0.30	0.00
6	絶対収益型	-0.17	1.17	-0.00
7	複合資産・安定	-0.11	4.58	-0.00
8	外国債券(先進国)・グローバル	-0.07	10.14	-0.00
9	CB	-2.04	0.25	-0.01
10	国内株式・業種特化	-6.39	0.11	-0.01
11	エマージング株式・BRICS	-8.43	0.11	-0.01
12	ブルベア	-3.48	0.62	-0.02
13	ハイイールド債券・グローバル	-4.55	0.57	-0.03
14	ハイイールド債券・その他	-3.77	0.70	-0.03
15	REIT・グローバル	-1.15	2.94	-0.03
16	REIT・その他	-3.75	0.81	-0.03
17	複合資産・成長	-2.78	1.97	-0.05
18	外国債券(先進国)・その他	-1.88	3.73	-0.07
19	複合資産・安定成長	-1.12	6.76	-0.07
20	ハイイールド債券・北米	-3.03	2.43	-0.08
21	エマージング債券・グローバル	-5.28	1.45	-0.08
22	国内株式・小型	-5.34	1.57	-0.09
23	エマージング株式・グローバル	-7.21	1.28	-0.10
24	エマージング債券・その他	-6.83	1.71	-0.12
25	国内株式・その他	-3.57	4.89	-0.17
26	エマージング株式・その他	-6.64	3.55	-0.25
27	外国株式(先進国)・その他	-5.37	5.11	-0.28
28	国内株式・一般	-5.13	9.35	-0.50
29	外国株式(先進国)・グローバル	-5.25	18.27	-0.98
	合計		100.00	-2.72

◆計算定義

$$\text{日次寄与度(％)} = \text{日次リターン(％)} \times \text{前日の純資産額構成比}$$

当月および直近1年間の寄与度は日次寄与度について累積計算したものの
また、上表の「構成比(％)」は期間中の平均値

＜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	-1.65		
1	REIT・日本	21.99	4.27	0.85
2	REIT・北米	9.25	4.01	0.35
3	外国債券(先進国)・グローバル	3.39	10.24	0.33
4	国内債券・一般	4.45	5.31	0.23
5	エマージング債券・グローバル	7.91	1.48	0.11
6	エマージング債券・その他	6.45	1.76	0.10
7	REIT・グローバル	2.26	2.97	0.07
8	複合資産・安定	1.42	4.42	0.06
9	REIT・その他	7.67	0.78	0.06
10	複合資産・安定成長	0.64	6.50	0.05
11	複合資産・国内バランス	3.23	1.19	0.04
12	ハイイールド債券・その他	5.00	0.78	0.04
13	ハイイールド債券・北米	0.64	2.63	0.02
14	ハイイールド債券・グローバル	1.36	0.62	0.01
15	コモディティ	3.14	0.27	0.01
16	エマージング株式・BRICS	3.05	0.11	0.00
17	絶対収益型	-0.12	1.15	-0.00
18	CB	-1.58	0.28	-0.00
19	国内株式・業種特化	-21.57	0.12	-0.03
20	外国債券(先進国)・その他	-1.38	3.86	-0.05
21	エマージング株式・グローバル	-4.15	1.48	-0.06
22	ブルベア	-16.28	0.41	-0.06
23	複合資産・成長	-4.03	1.90	-0.07
24	外国株式(先進国)・その他	-4.33	5.21	-0.21
25	国内株式・小型	-15.66	1.70	-0.30
26	エマージング株式・その他	-9.29	3.90	-0.39
27	国内株式・その他	-9.46	4.84	-0.42
28	外国株式(先進国)・グローバル	-4.92	17.74	-0.82
29	国内株式・一般	-14.03	10.09	-1.56
	合計		100.00	-1.65

◆計算定義

$$\text{日次寄与度(}\%) = \text{日次リターン(}\%) \times \text{前日の純資産額構成比}$$

当月および直近1年間の寄与度は日次寄与度について累積計算したものの
また、上表の「構成比(%)」は期間中の平均値

<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	14.52	12.37	70.51	8.21	9.81	11.54	0.57	0.24	0.47
国内株式	22.79	26.77	91.63	13.88	16.04	17.48	0.51	0.30	0.38
一般	21.23	21.56	78.92	14.10	16.43	17.76	0.47	0.24	0.34
フリー	22.49	21.01	78.83	14.39	16.81	18.42	0.49	0.23	0.32
バリュー	16.55	23.35	81.47	13.24	15.37	16.43	0.40	0.28	0.37
小型	37.09	52.30	174.72	15.66	15.60	17.37	0.71	0.56	0.61
その他	23.05	35.12	107.08	13.42	15.72	17.41	0.54	0.40	0.43
日経225	27.23	42.34	122.83	13.98	15.92	17.71	0.60	0.46	0.47
TOPIX	20.28	29.24	86.06	12.93	15.47	16.89	0.50	0.34	0.38
JPX日経400	17.66	24.28	-	12.67	15.01	-	0.44	0.30	-
国内債券	2.89	8.76	19.32	1.40	1.62	1.52	0.72	1.06	1.15
一般	2.89	8.76	19.32	1.40	1.62	1.52	0.72	1.06	1.15
外国株式(先進国)	26.91	14.88	95.06	13.76	15.33	16.39	0.60	0.18	0.42
グローバル	27.89	18.95	103.13	13.82	15.17	16.29	0.62	0.23	0.45
除く日本	31.68	28.26	146.43	14.34	16.51	17.94	0.67	0.31	0.52
含む日本	26.78	16.44	93.78	13.75	14.89	15.99	0.60	0.21	0.43
その他	25.14	6.98	88.75	13.77	15.86	17.72	0.57	0.09	0.37
北米	22.30	3.24	51.40	17.14	17.71	21.09	0.41	0.04	0.20
米国	35.92	15.40	118.78	14.55	17.04	18.02	0.74	0.17	0.45
カナダ	9.13	-21.69	9.22	12.45	13.86	16.71	0.24	-0.34	0.05
欧州	18.53	10.19	78.87	13.66	15.44	18.66	0.43	0.13	0.32
ドイツ	8.28	-0.25	-	16.93	20.42	-	0.16	-0.00	-
イギリス	-0.35	-17.13	-	13.56	15.20	-	-0.00	-0.24	-
アジア・オセアニア	16.54	14.40	120.14	11.50	15.20	18.04	0.46	0.18	0.45
オーストラリア	6.06	-3.60	68.45	13.44	15.59	19.89	0.15	-0.05	0.27
ニュージーランド	24.58	62.35	-	14.23	17.17	-	0.54	0.59	-
複合地域	-13.64	-36.25	-	19.13	19.52	-	-0.25	-0.44	-
エマージング株式	15.78	2.90	45.16	12.56	15.44	18.19	0.40	0.04	0.21
グローバル	19.76	-2.21	40.95	14.10	16.60	18.47	0.44	-0.03	0.19
BRICS	34.91	19.57	66.33	14.91	18.59	20.88	0.71	0.20	0.25
その他	13.73	4.77	49.08	12.52	15.34	18.14	0.35	0.06	0.22
欧州	32.63	2.41	34.22	17.68	20.04	24.18	0.56	0.02	0.12
ロシア	49.56	30.30	70.63	19.84	24.08	26.59	0.73	0.23	0.21
アジア・オセアニア	10.89	1.01	62.43	14.01	16.07	17.45	0.25	0.01	0.28
中国	35.46	56.45	89.79	18.21	23.11	22.08	0.59	0.41	0.30
インド	14.88	18.71	64.16	16.85	19.35	24.01	0.28	0.18	0.21
インドネシア	4.04	-5.74	-	17.10	19.86	-	0.08	-0.06	-
タイ	18.66	13.96	203.23	14.07	14.51	17.40	0.42	0.18	0.67
フィリピン	-9.87	-6.92	-	14.17	15.62	-	-0.24	-0.09	-
ベトナム	22.63	24.44	-	17.35	16.69	-	0.41	0.27	-
韓国	-19.70	-32.86	10.78	16.04	16.07	20.37	-0.44	-0.48	0.05
香港	18.66	7.31	48.04	16.40	19.61	18.86	0.36	0.07	0.21
台湾	12.02	10.64	108.48	18.28	18.34	19.42	0.21	0.11	0.39
中南米	18.90	-19.89	6.19	22.04	23.38	23.50	0.27	-0.18	0.02
ブラジル	22.85	-23.19	-17.25	27.79	31.81	29.30	0.26	-0.16	-0.07
メキシコ	-16.93	-37.11	-	21.58	20.08	-	-0.28	-0.44	-
中東・アフリカ	12.03	-19.00	47.31	13.48	15.30	16.92	0.29	-0.27	0.23
南アフリカ	-7.59	-48.92	-	19.65	20.66	-	-0.13	-0.61	-
トルコ	-30.53	-51.28	-32.95	32.24	29.28	31.84	-0.35	-0.46	-0.12
複合地域	6.15	-9.02	54.52	13.52	15.07	16.13	0.15	-0.12	0.27

※[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	14.52	12.37	70.51	8.21	9.81	11.54	0.57	0.24	0.47
外国債券(先進国)	6.47	-0.84	33.07	3.79 ↓	5.65	8.23	0.57	-0.03	0.35
グローバル	7.12	2.58	31.87	3.34 ↓	5.15	7.51	0.71	0.10	0.37
除く日本	7.44	1.10	36.27	3.95 ↓	5.87	8.24	0.63	0.04	0.38
含む日本	6.70	4.47	26.46	2.87 ↓	4.45	6.72	0.78	0.20	0.35
その他	4.03	-7.36	37.01	5.85	7.37	9.99	0.24	-0.20	0.32
北米	4.75	8.72	-	2.00	4.04	-	0.80	0.42	-
米国	8.26	10.45	48.67	4.33 ↓	5.88	6.51	0.63	0.34	0.62
カナダ	3.46	-11.41	11.21	7.73	9.22	9.74	0.15	-0.26	0.11
欧州	9.58	-1.32	24.59	5.09	7.24	10.13	0.62	-0.03	0.22
イギリス	-1.94	-10.77	-	8.80	10.32	-	-0.07	-0.22	-
アジア・オセアニア	1.05	-12.05	42.09	7.41	8.69	11.16	0.05	-0.29	0.32
オーストラリア	1.11	-12.41	39.10	7.44	8.75	11.49	0.06	-0.30	0.29
ニュージーランド	1.71	-0.41	-	9.01	10.46	-	0.07	-0.01	-
複合地域	9.06	-3.05	31.39	5.07	7.34	9.94	0.59	-0.08	0.28
エマージング債券	8.04	-3.56	41.93	8.93	10.96	12.95	0.30	-0.06	0.27
グローバル	5.66	-3.53	45.62	9.20	10.80	12.80	0.21	-0.06	0.30
米ドル建て	5.91	-2.18	50.64	9.19	10.96	12.97	0.22	-0.04	0.32
現地通貨建て	5.25	-10.84	20.21	9.79	10.59	12.08	0.18	-0.21	0.15
その他	11.20	-4.36	33.66	9.30	12.07	13.94	0.39	-0.07	0.21
ロシア	29.10	-6.71	43.79	15.09	24.43	21.84	0.59	-0.06	0.17
アジア・オセアニア	8.82	10.83	57.82	4.36	6.80	8.91	0.67	0.31	0.52
インド	14.30	20.11	-	8.74	10.21	-	0.53	0.37	-
インドネシア	7.46	11.51	-	11.15	13.98	-	0.22	0.16	-
ブラジル	11.00	-6.62	33.44	17.72	19.68	17.97	0.20	-0.07	0.16
メキシコ	7.44	-19.42	-	15.39	14.56	-	0.16	-0.29	-
南アフリカ	21.11	-4.80	-	20.85	19.74	-	0.32	-0.05	-
トルコ	-43.06	-54.64	-	35.15	29.48	-	-0.49	-0.50	-
複合地域	14.49	-13.66	18.68	9.16	11.52	13.30	0.51	-0.25	0.13
ハイイールド債券	12.94	6.09	87.12	7.95	9.76	12.17	0.53	0.12	0.53
グローバル	12.82	3.59	66.22	8.00	9.85	12.20	0.52	0.07	0.42
北米	14.70	9.66	98.16	8.27	9.84	11.83	0.57	0.19	0.60
その他	8.51	-0.58	91.47	8.25	10.31	15.40	0.34	-0.01	0.43
欧州	8.42	-1.68	115.15	8.98	11.06	16.78	0.31	-0.03	0.47
アジア・オセアニア	8.97	4.94	-	6.90	8.58	-	0.43	0.11	-
複合地域	14.81	6.45	84.93	6.94	8.75	11.91	0.69	0.15	0.53
複合資産	12.68	13.43	64.29	5.37	7.25	9.43	0.77	0.35	0.54
安定	9.43	9.72	52.68	3.87 ↓	5.61	7.90	0.80	0.34	0.54
安定成長	13.44	13.93	66.27	5.87	7.61	9.84	0.74	0.35	0.53
成長	18.03	19.72	85.54	9.10	10.88	12.06	0.63	0.34	0.53
国内バランス	8.22	13.24	35.44	2.28	4.30 ↓	6.95	1.19	0.59	0.44
安定	6.59	14.29	31.46	1.95	2.13	3.12	1.13	1.28	0.88
一般	15.14	12.62	41.74	7.16 ↓	8.93	9.84	0.68	0.27	0.36

※[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カ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	14.52	12.37	70.51	8.21	9.81	11.54	0.57	0.24	0.47
国内REIT	26.18	43.37	192.16	7.51	8.90	16.37	1.08	0.84	0.69
日本	26.18	43.37	192.16	7.51	8.90	16.37	1.08	0.84	0.69
外国REIT	15.75	33.40	176.61	12.24 ↓	14.02	16.01 ↓	0.41	0.42	0.67
グローバル	11.36	21.94	149.72	12.06 ↓	13.57	15.65 ↓	0.31	0.30	0.61
除く日本	17.95	31.99	168.10	12.10 ↓	13.66	15.64 ↓	0.47	0.42	0.66
含む日本	10.48	20.78	148.25	12.06 ↓	13.56	15.66 ↓	0.28	0.28	0.61
北米	18.23	42.22	206.65	13.23	15.11	17.56 ↓	0.44	0.48	0.67
その他	24.32	38.62	188.84	10.00	12.15	15.24	0.76	0.56	0.73
欧州	3.07	2.13	5.54	12.87	15.56	20.08	0.08	0.03	0.03
アジア・オセアニア	33.95	46.57	237.40	10.01	12.36	14.88	1.03	0.64	0.87
オーストラリア	9.44	19.28	138.52	12.74	14.08	17.23	0.24	0.26	0.53
複合地域	-2.11	-5.13	76.45	13.71	15.43	17.96	-0.05	-0.07	0.32
複数国	22.74	55.29	251.44	10.88	12.70	15.64	0.65	0.73	0.85
その他									
絶対収益型	1.81	-0.80	-4.62	2.05	2.12	3.46	0.32	-0.07	-0.15
ロング・ショート	3.77	0.31	1.67	3.21	3.10	3.57	0.40	0.03	0.04
マーケットニュートラル	9.21	11.33	36.04	4.52 ↓	5.56	5.19	0.67	0.39	0.60
GTAA	3.58	4.18	12.11	2.58	2.19	2.67	0.48	0.38	0.42
その他スタイル	0.71	-1.22	-9.36	2.01	2.36	5.21	0.14	-0.10	-0.19
CB	7.96	1.95	33.66	4.91	6.66	9.66	0.54	0.06	0.30
アジア・オセアニア	14.80	19.62	54.83	8.76	11.33	11.12	0.54	0.32	0.40
日本	1.27	14.08	45.53	4.64	5.55	6.08	0.10	0.48	0.62
グローバル	8.33	1.44	36.94	4.91	6.57	10.13	0.56	0.05	0.31
コモディティ	11.68	-29.19	-17.60	8.82	12.20	15.09	0.43	-0.55	-0.13
全業種	-0.70	-39.23	-30.51	11.82	14.08	15.80	-0.02	-0.67	-0.23
貴金属	15.04	0.46	58.31	8.46 ↑	10.07 ↑	17.08	0.57	0.01	0.27
エネルギー	12.98	-50.20	-40.19	26.01	27.90	25.30	0.16	-0.47	-0.20
その他コモディティ	-1.81	-27.71	9.27	12.87	14.60	17.97	-0.04	-0.43	0.05

※[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

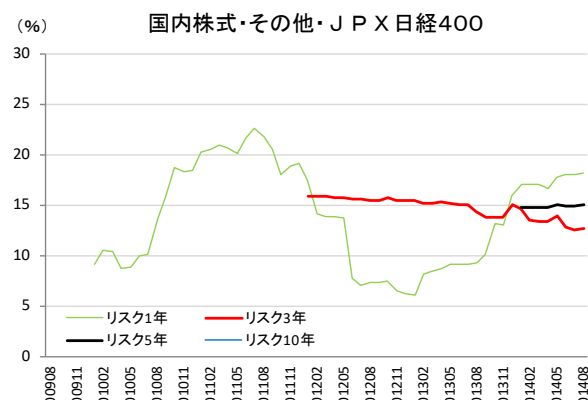
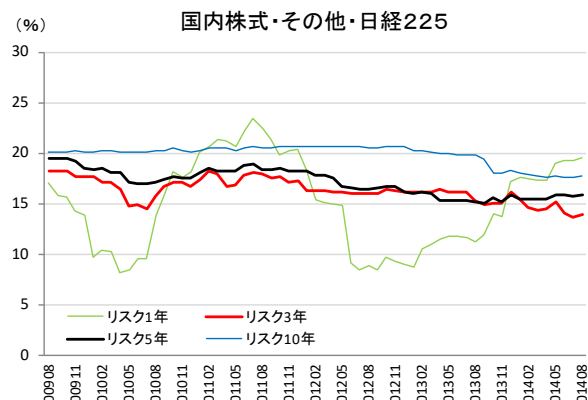
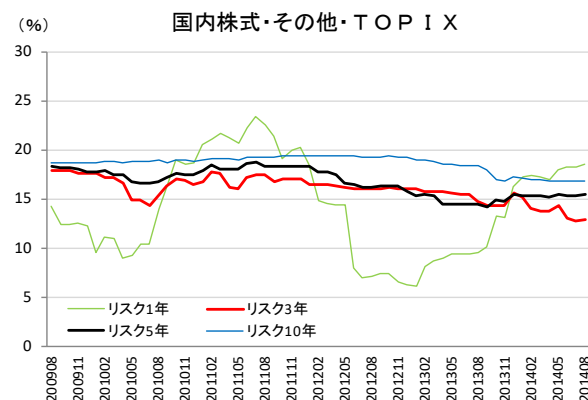
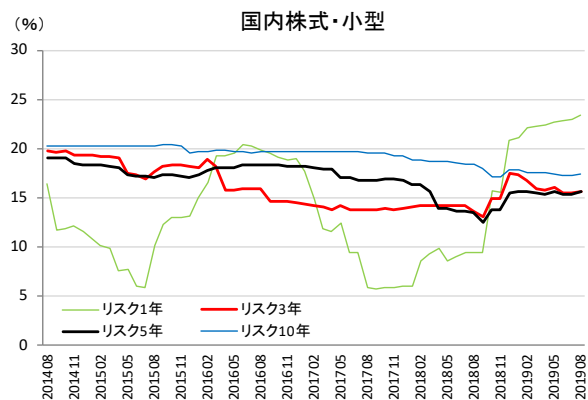
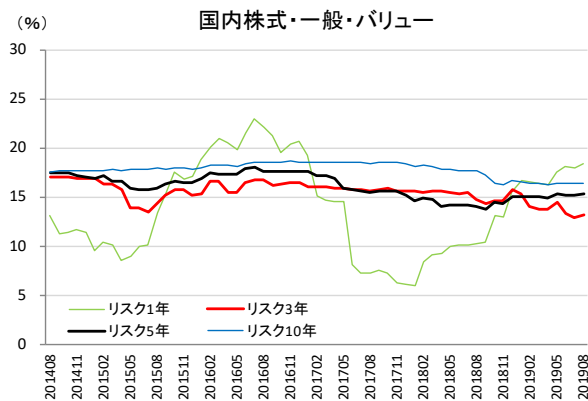
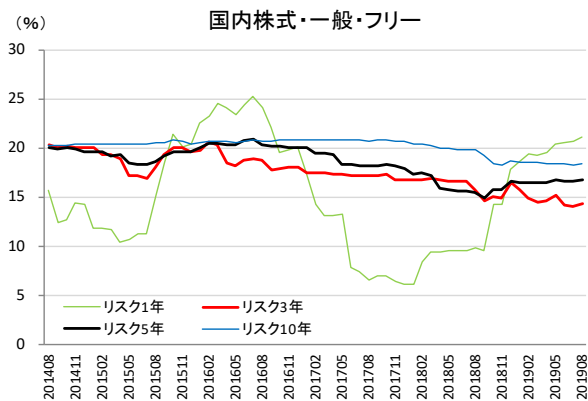
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

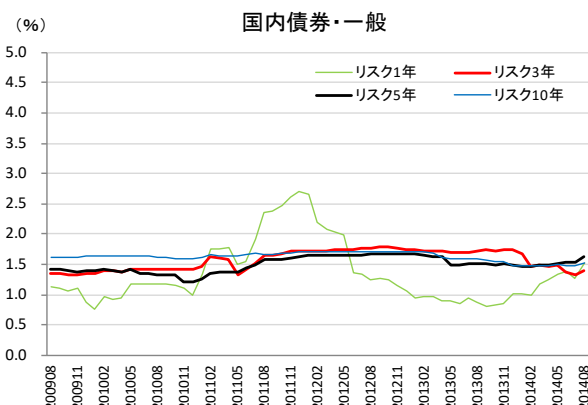
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

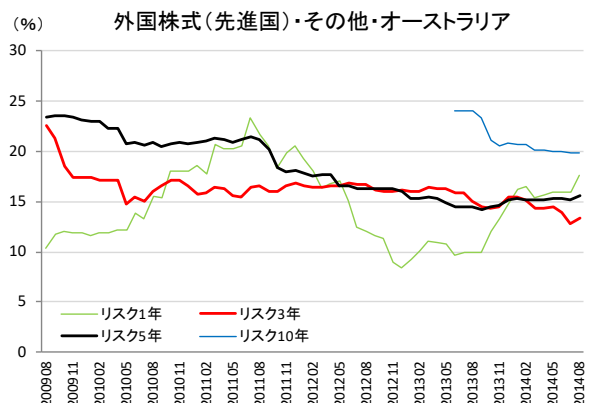
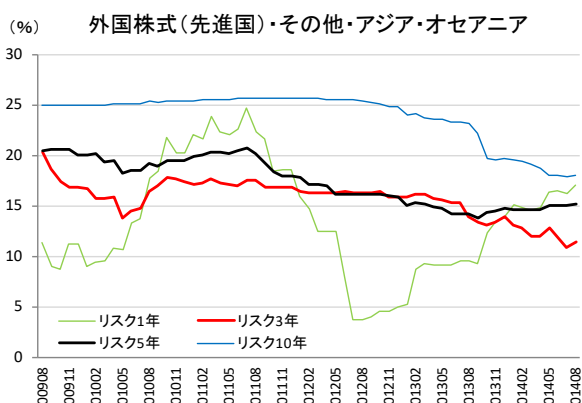
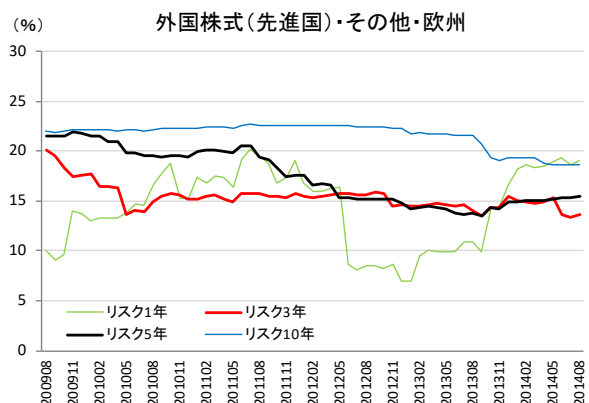
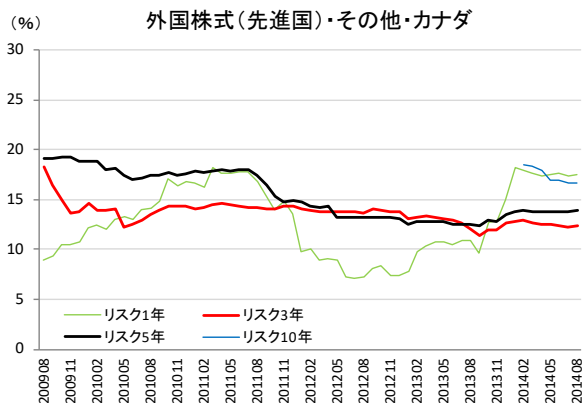
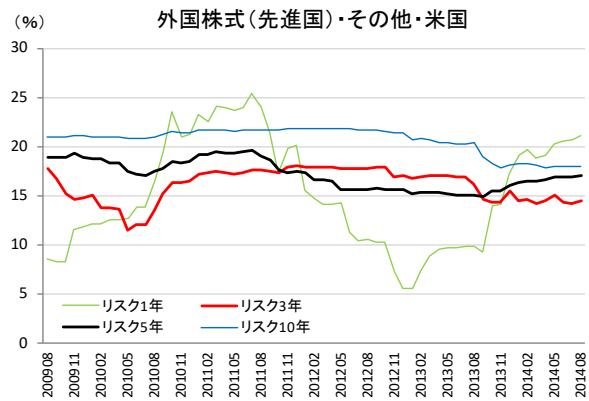
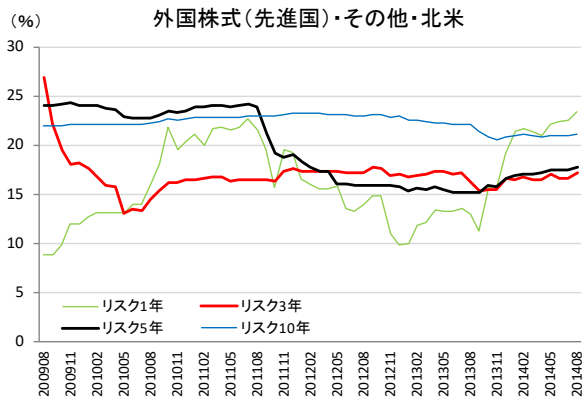
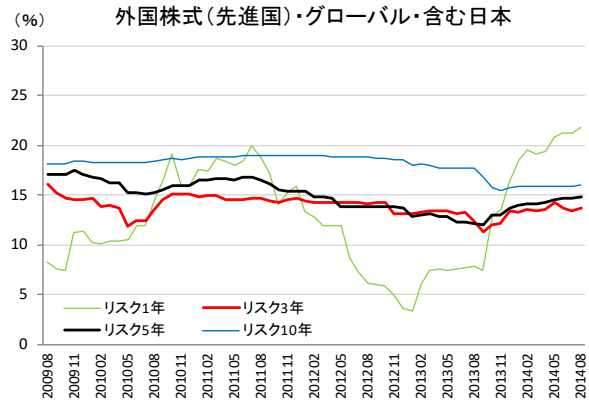
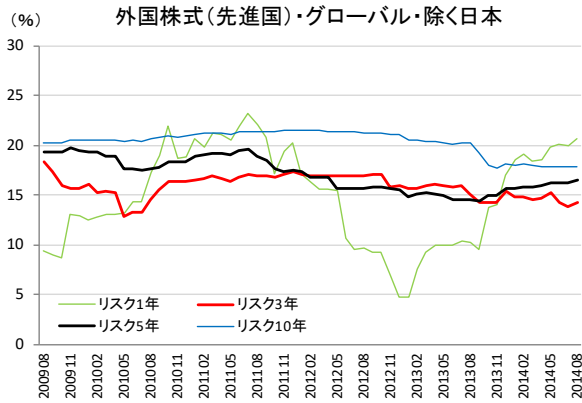


<2> リスク・サマリー

(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)]

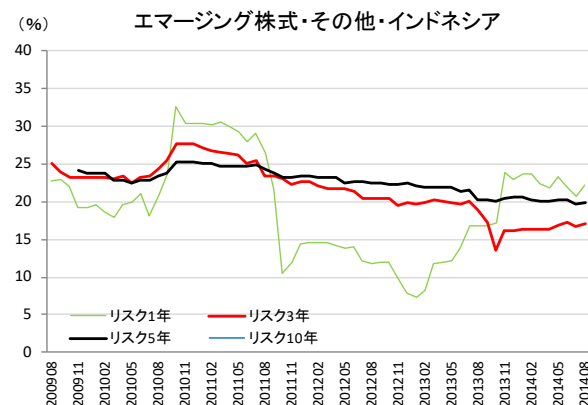
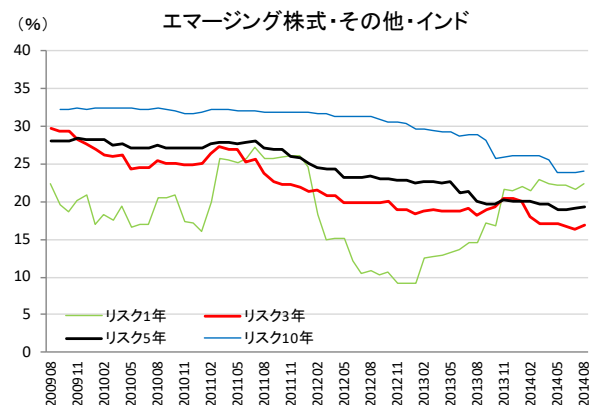
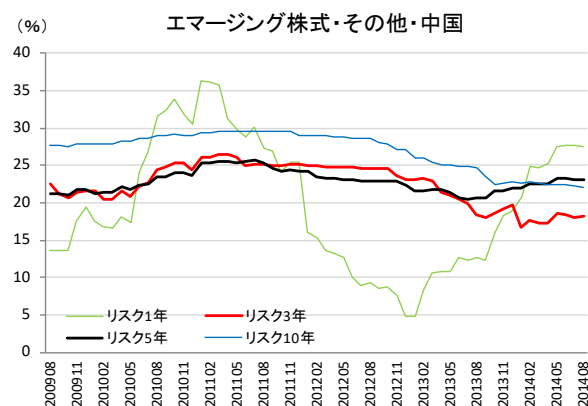
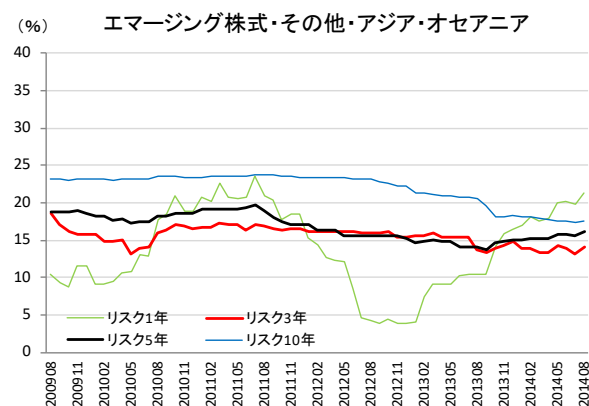
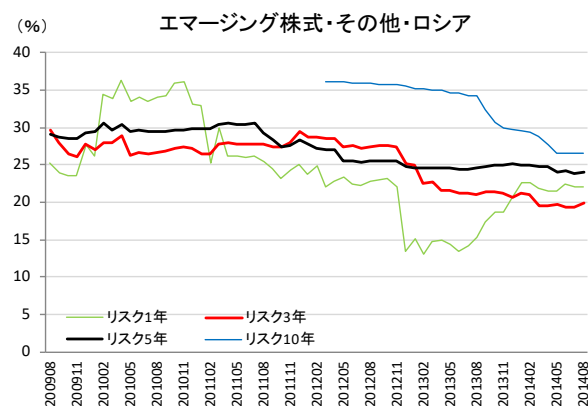
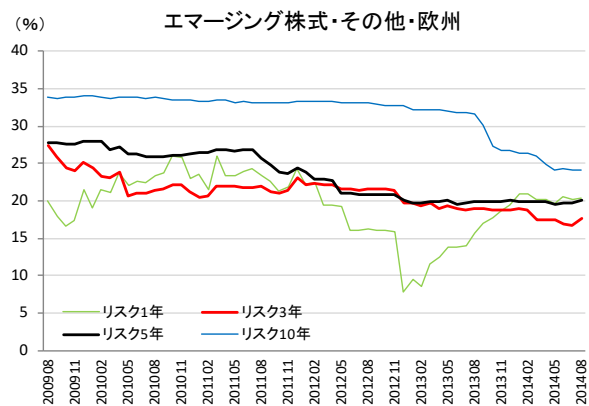
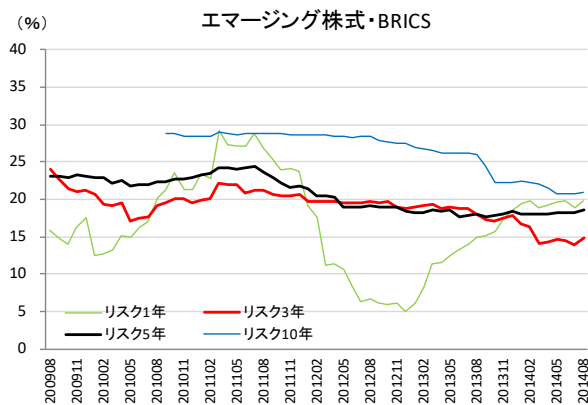
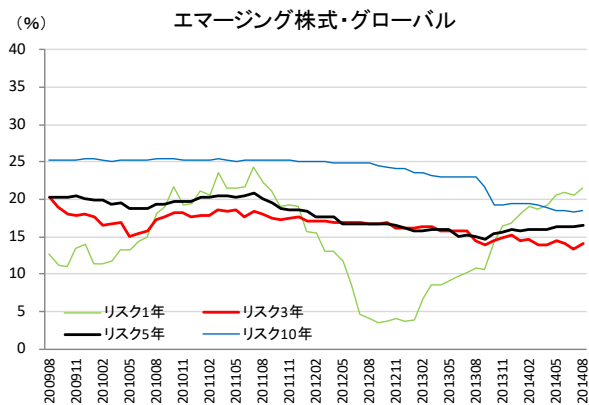


<2> リスク・サマリー

(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]

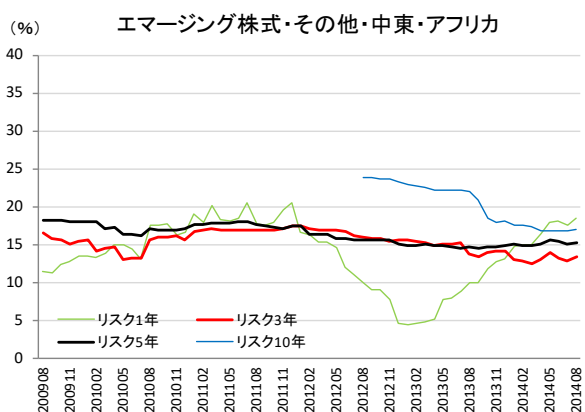
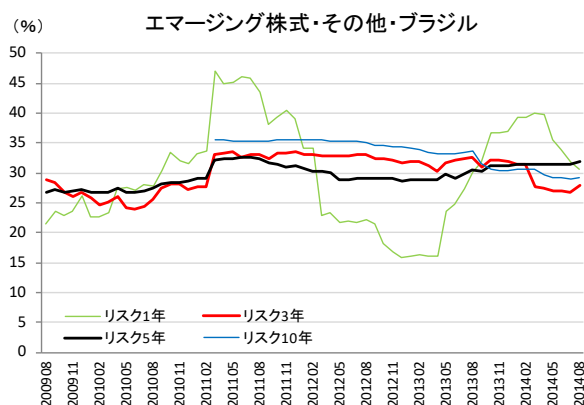
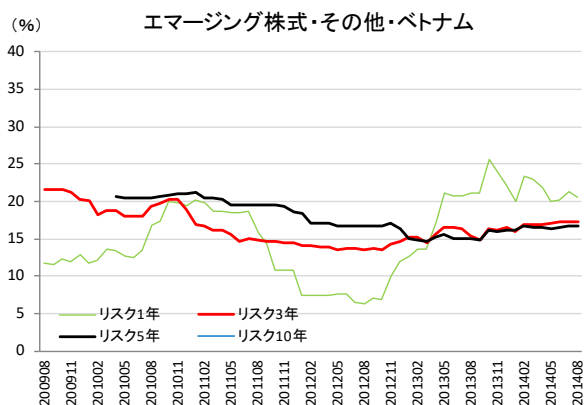
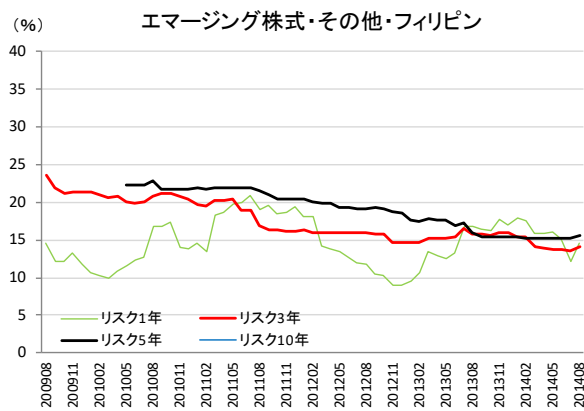
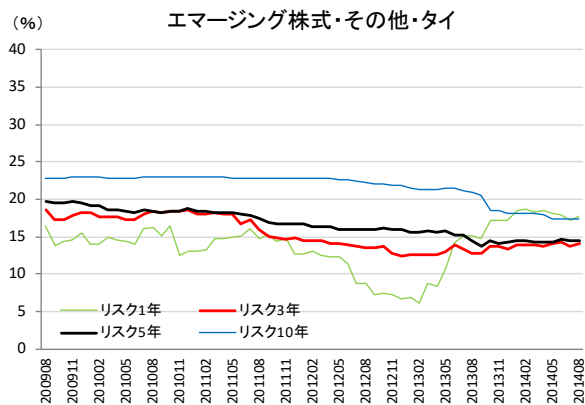


<2> リスク・サマリー

(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]

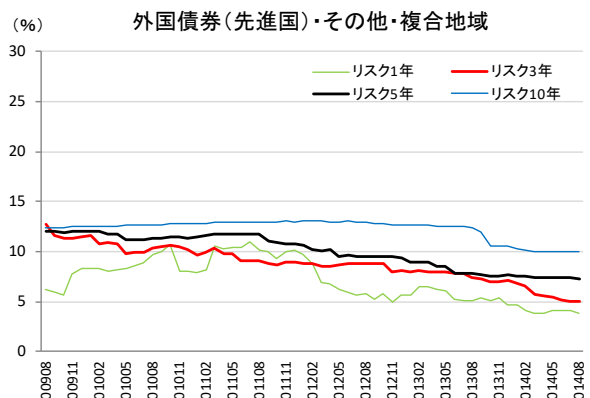
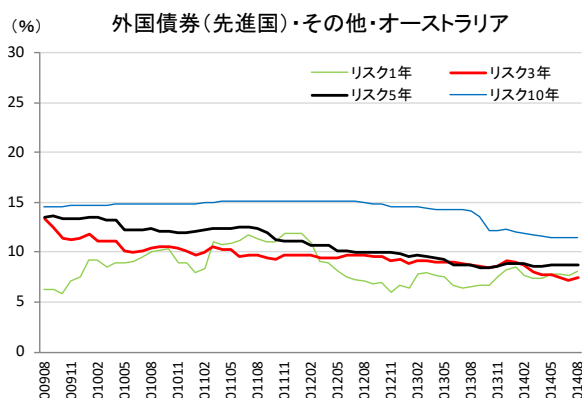
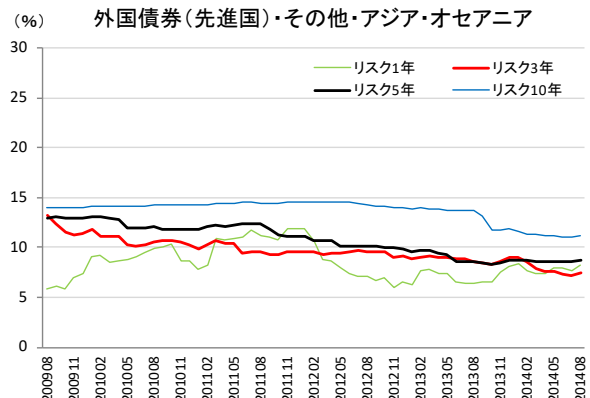
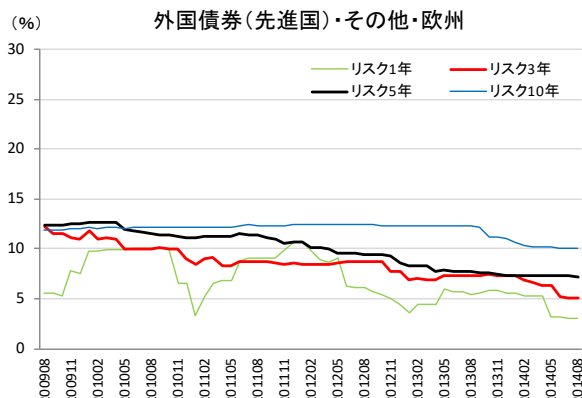
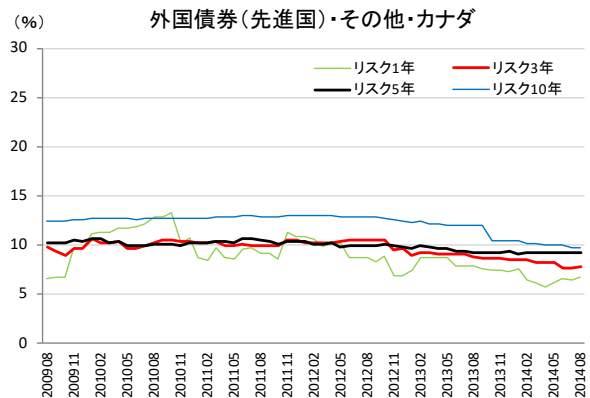
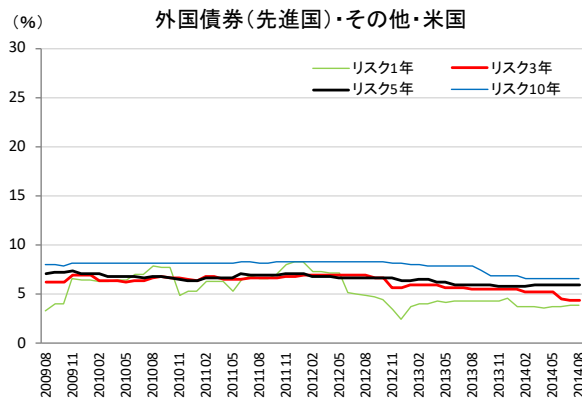
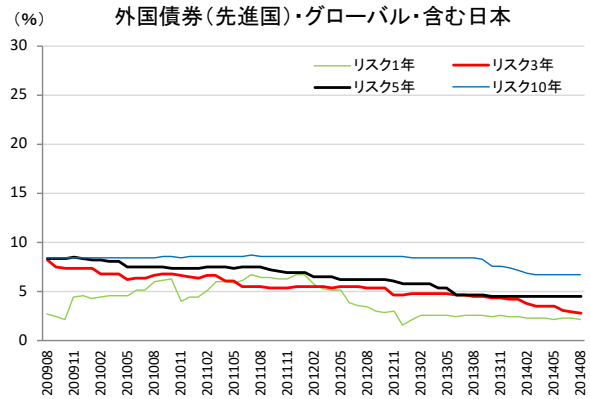
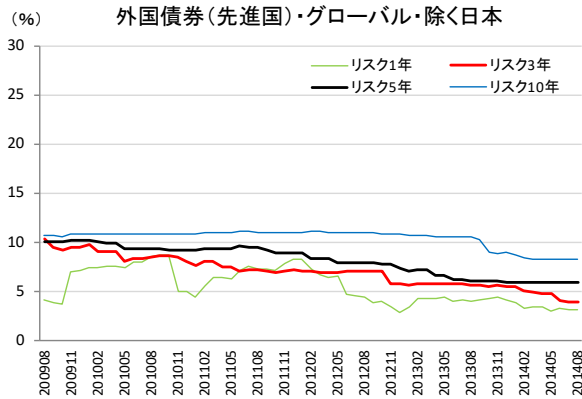


<2> リスク・サマリー

(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)]

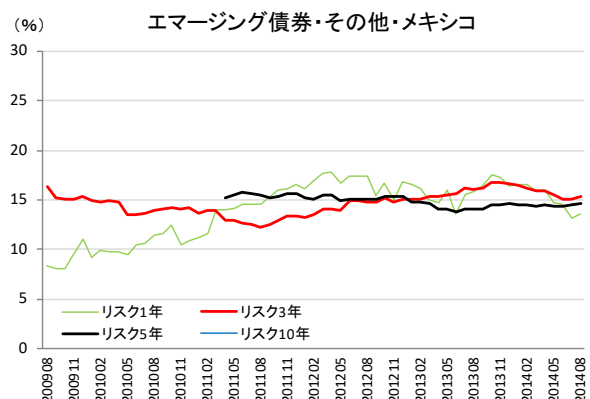
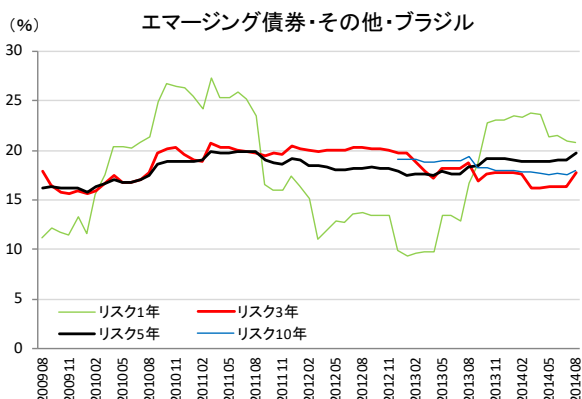
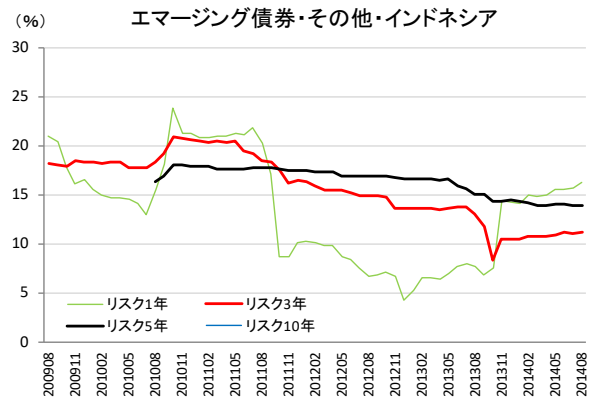
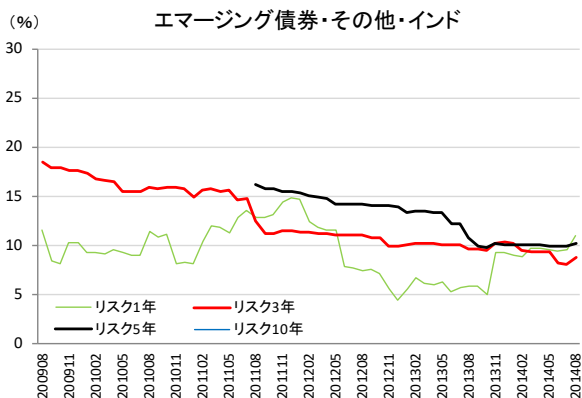
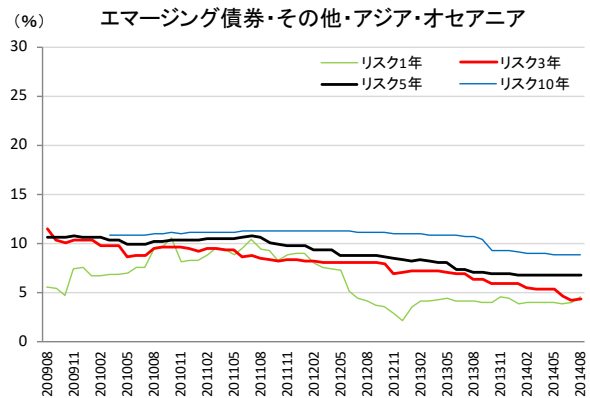
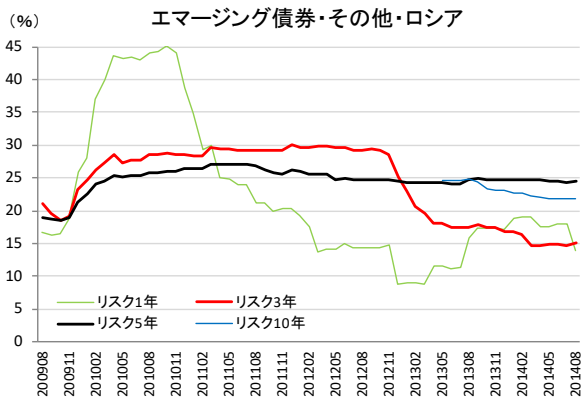
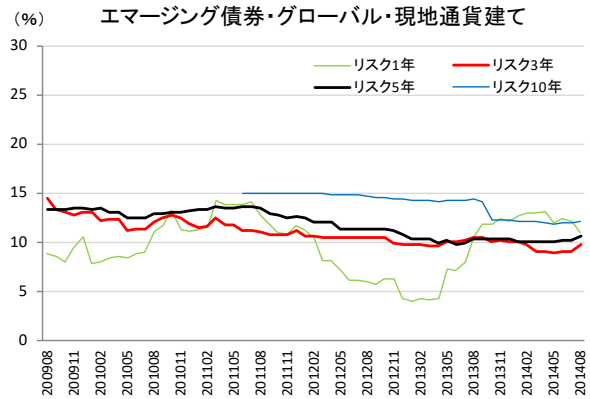
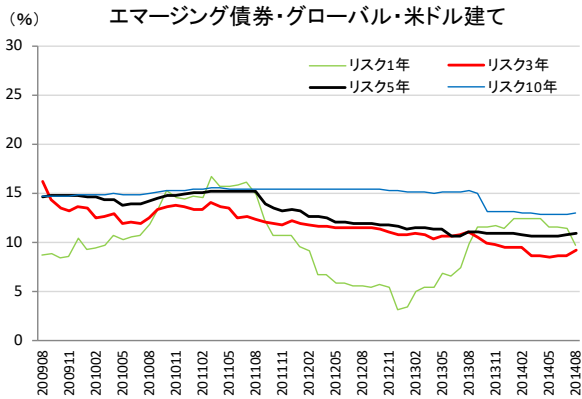


<2> リスク・サマリー

(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]

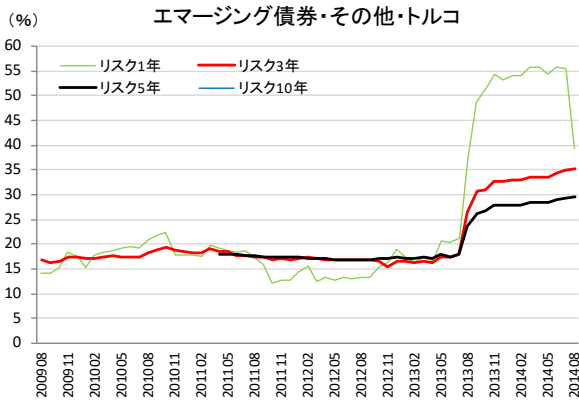


<2> リスク・サマリー

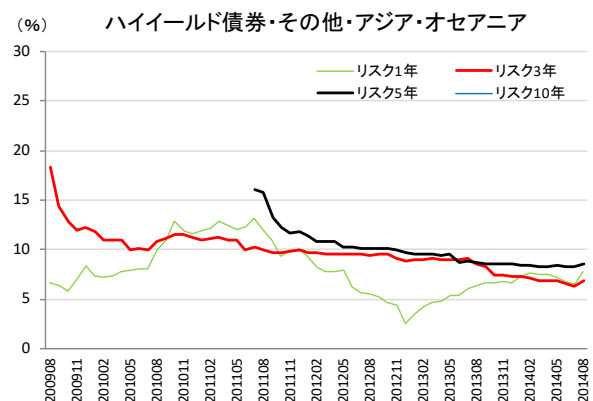
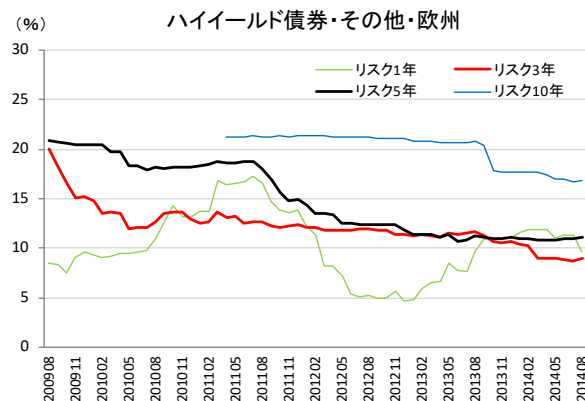
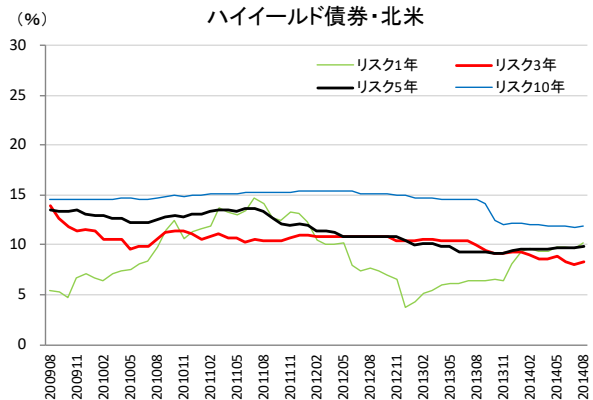
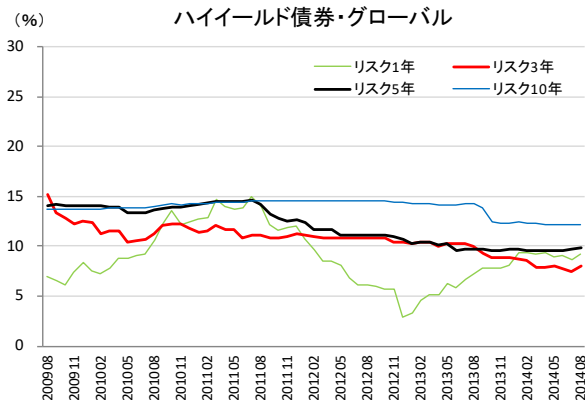
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

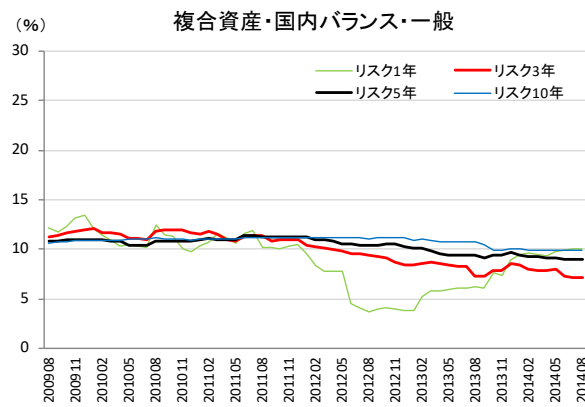
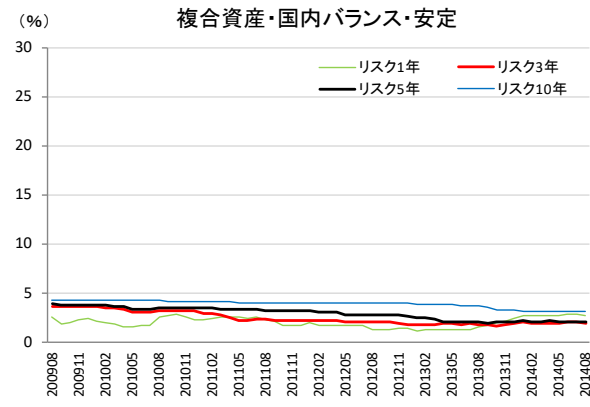
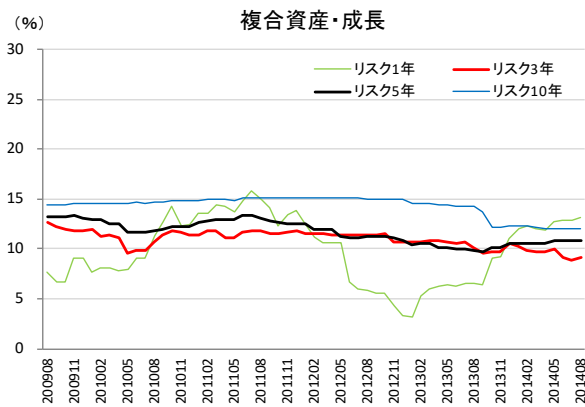
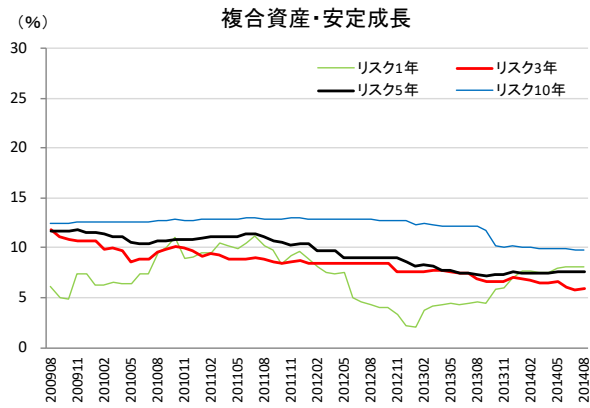
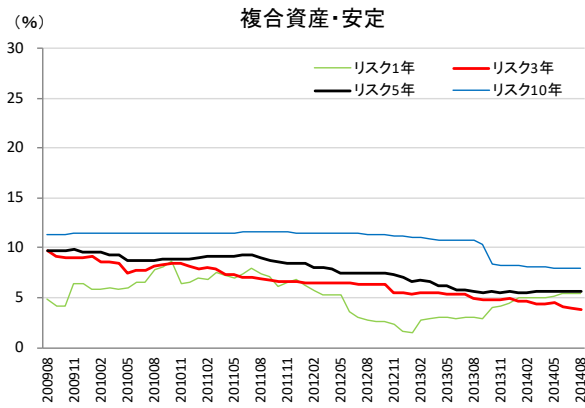


<2> リスク・サマリー

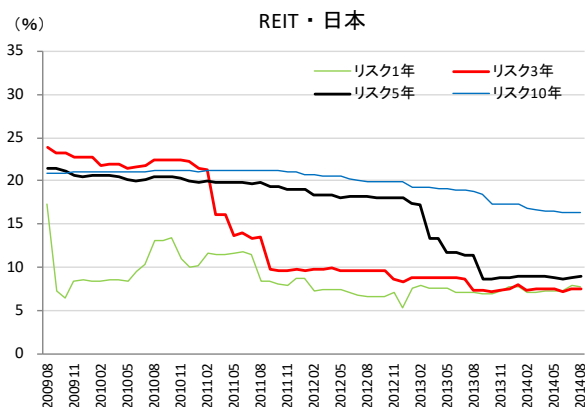
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

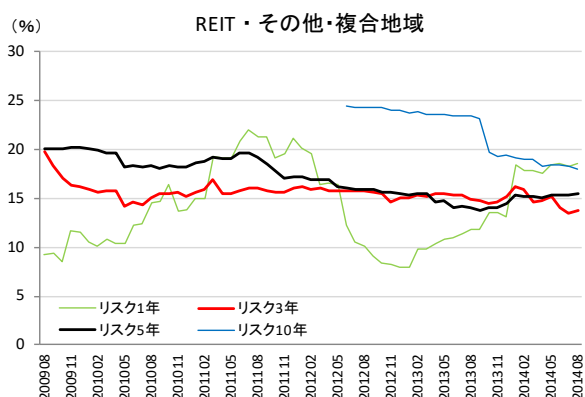
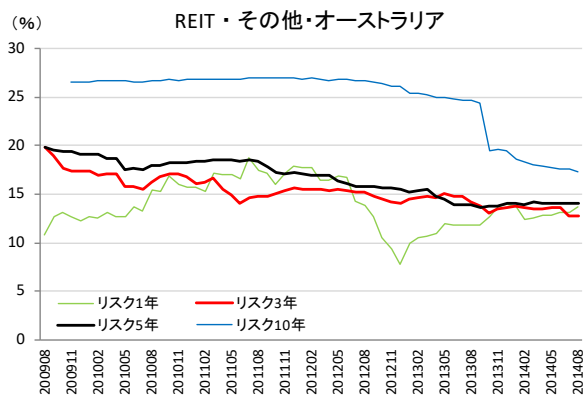
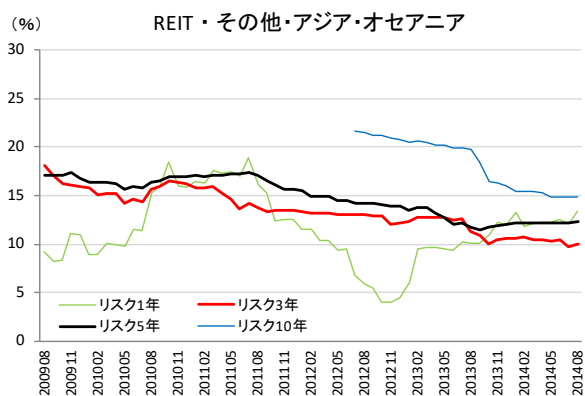
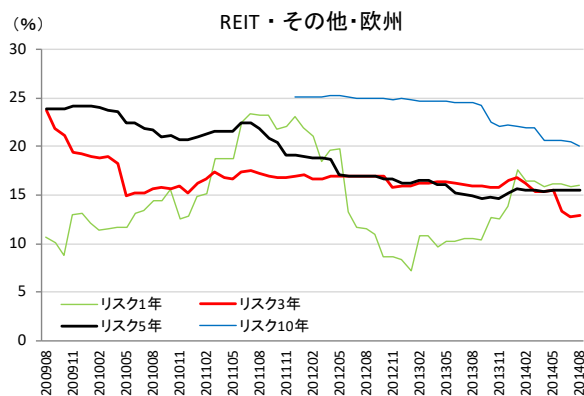
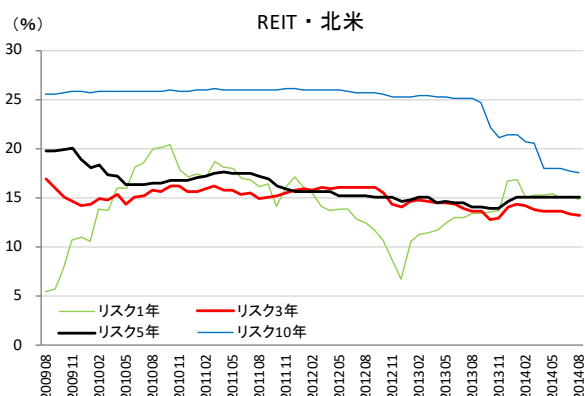
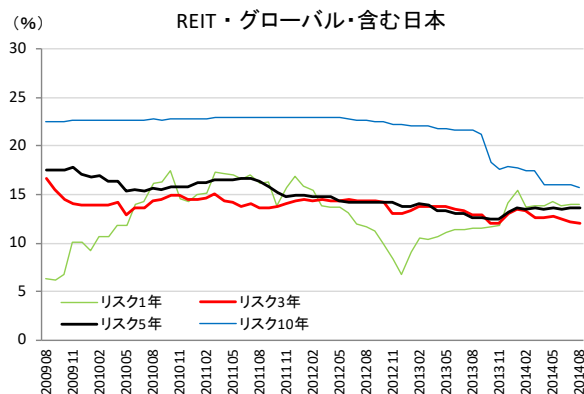
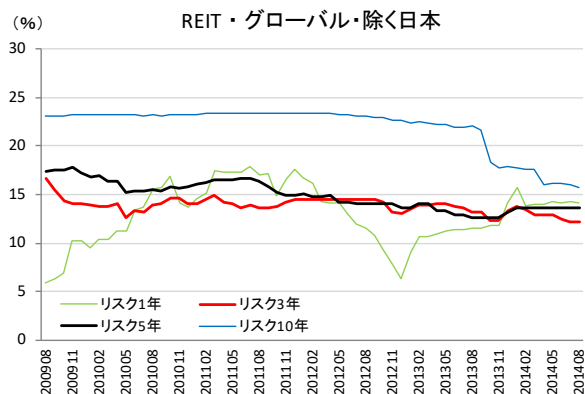


<2> リスク・サマリー

(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]

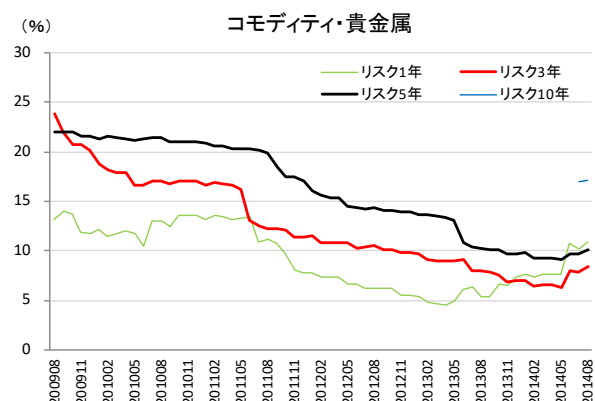
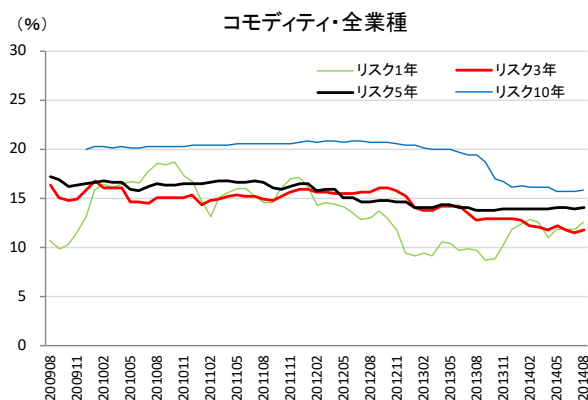
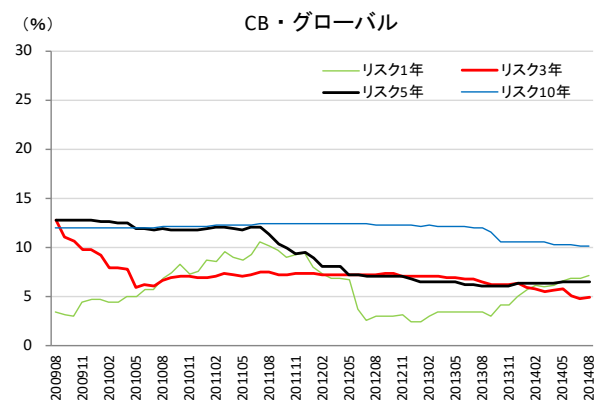
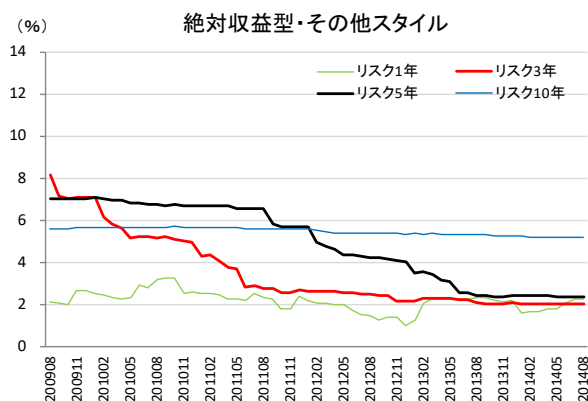
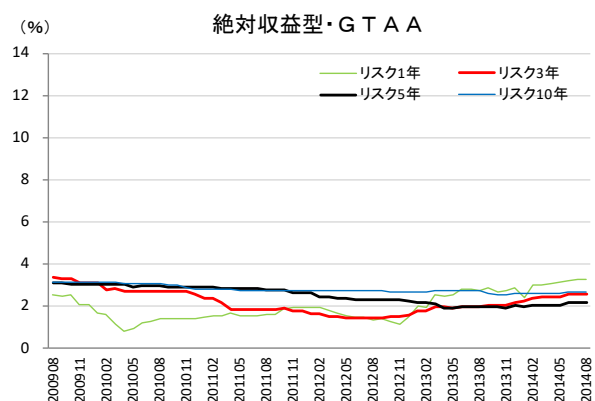
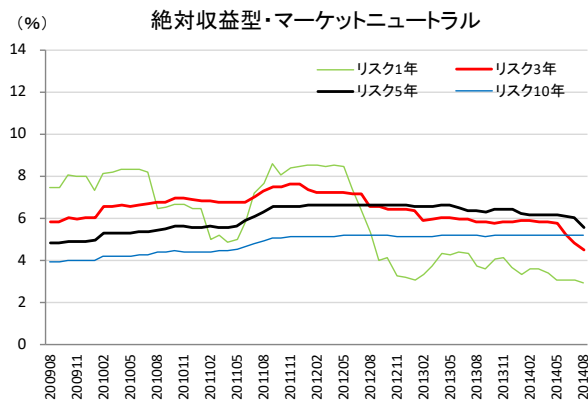
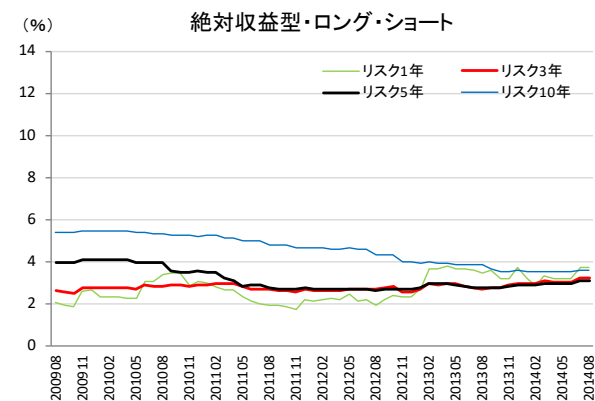


<2> リスク・サマリー

(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	3,669	5,134	2,246	8,190
国内株式	638	-889	-2,894	2,242
一般	-189	-1,210	-2,656	-1,520
フリー	-180	-1,126	-2,389	-1,384
バリュー	-9	-84	-267	-137
小型	-147	-525	-860	-431
その他	978	863	658	4,225
日経225	795	614	116	2,856
TOPIX	149	239	547	1,235
JPX日経400	15	4	-6	34
国内債券	5	57	348	788
一般	5	57	348	788
外国株式(先進国)	1,820	3,635	2,894	11,118
グローバル	1,172	3,063	3,067	8,888
除く日本	253	579	927	2,410
含む日本	919	2,484	2,140	6,478
その他	648	572	-172	2,230
北米	23	22	41	70
米国	584	588	-11	2,847
カナダ	-4	-20	-53	-99
欧州	-19	-94	-201	-409
ドイツ	0	-1	-1	0
イギリス	-1	-2	-3	-8
アジア・オセアニア	-2	-8	-21	-51
オーストラリア	68	86	79	-118
ニュージーランド	0	0	1	0
複合地域	0	-1	-1	-2
エマージング株式	-270	-1,437	-2,922	-4,671
グローバル	-96	-752	-1,430	-2,209
BRICS	-1	-11	-35	-76
その他	-174	-673	-1,458	-2,386
欧州	-3	-11	-25	-71
ロシア	0	-6	-15	-37
アジア・オセアニア	-81	-271	-550	-964
中国	-70	-178	-285	-271
インド	-38	-226	-714	-1,268
インドネシア	-3	-9	-19	-46
タイ	-1	-5	-12	-22
フィリピン	-2	-13	-21	-69
ベトナム	-5	-5	106	350
韓国	0	-2	-2	4
香港	1	1	0	0
台湾	0	0	0	0
中南米	-1	-4	-6	-17
ブラジル	24	17	56	1
メキシコ	0	0	-1	-2
中東・アフリカ	6	41	37	28
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	-1	-3	-5	-2
複合地域	0	-1	-1	-2

<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	3,669	5,134	2,246	8,190
外国債券(先進国)	-316	-652	-1,530	-6,186
グローバル	-375	-822	-1,623	-4,897
除く日本	-269	-659	-896	-1,988
含む日本	-106	-163	-727	-2,909
その他	59	171	93	-1,289
北米	0	-2	-7	-33
米国	82	416	484	57
カナダ	-17	-64	-151	-347
欧州	84	143	410	524
イギリス	0	-1	-4	-7
アジア・オセアニア	-36	-111	-253	-614
オーストラリア	-46	-176	-294	-669
ニュージーランド	-1	-4	-17	-37
複合地域	-8	-31	-75	-163
エマージング債券	-37	-229	-130	-1,010
グローバル	17	-41	-94	-530
米ドル建て	10	-35	-127	-565
現地通貨建て	7	-6	33	35
その他	-54	-188	-36	-480
ロシア	-5	-30	-60	-120
アジア・オセアニア	-1	-3	-18	-80
インド	-4	-23	-120	-402
インドネシア	-1	-9	-19	-59
ブラジル	3	-57	-103	-403
メキシコ	-5	-9	-5	-59
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	-2	-3	0	10
複合地域	0	-1	-2	-5
ハイイールド債券	-79	-352	-1,127	-3,554
グローバル	-16	-72	-192	-540
北米	-45	-173	-604	-2,167
その他	-18	-107	-331	-847
欧州	-13	-87	-267	-605
アジア・オセアニア	-4	-12	-48	-211
複合地域	0	-1	-2	-5
複合資産	877	2,311	3,849	7,652
安定	180	230	276	648
安定成長	322	819	1,334	2,743
成長	108	330	409	1,159
国内バランス	267	933	1,829	3,102
安定	269	942	1,825	3,117
一般	0	-6	0	-13

<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	3,669	5,134	2,246	8,190
国内REIT	133	744	1,480	1,412
日本	133	744	1,480	1,412
外国REIT	310	546	12	-2,426
グローバル	139	424	484	37
除く日本	51	180	466	768
含む日本	88	244	18	-731
北米	101	63	-557	-2,682
その他	70	59	86	219
欧州	-3	-13	-32	-73
アジア・オセアニア	45	15	122	390
オーストラリア	29	66	20	-43
複合地域	1	0	0	0
複数国	-2	-9	-25	-56
その他	587	1,400	2,266	2,826
絶対収益型	41	-17	36	17
ロング・ショート	-45	-132	-219	-322
マーケットニュートラル	-16	-40	11	102
GTAA	-2	-15	-31	-54
その他スタイル	103	169	275	284
CB	-20	-74	-136	-309
アジア・オセアニア	0	0	1	-5
日本	-2	-3	-6	-9
グローバル	-19	-69	-129	-293
コモディティ	0	-5	205	298
全業種	5	17	22	60
貴金属	-5	-25	182	236
エネルギー	0	2	0	-1
その他コモディティ	0	1	1	2

< 4 > 純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別①

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	618,968	100.00	5,443	100.00
国内株式	98,049	15.84	884	16.24
一般	57,255	9.25	582	10.69
フリー	45,945	7.42	465	8.54
バリュー	11,310	1.83	117	2.15
小型	9,500	1.53	93	1.71
その他	30,635	4.95	201	3.69
日経225	16,252	2.63	71	1.30
TOPIX	11,976	1.93	75	1.38
JPX日経400	786	0.13	20	0.37
国内債券	34,365	5.55	131	2.41
一般	34,365	5.55	131	2.41
外国株式(先進国)	145,017	23.43	972	17.86
グローバル	113,204	18.29	617	11.34
除く日本	23,884	3.86	171	3.14
含む日本	89,320	14.43	446	8.19
その他	31,813	5.14	355	6.52
北米	380	0.06	13	0.24
米国	23,454	3.79	236	4.34
カナダ	360	0.06	3	0.06
欧州	1,603	0.26	58	1.07
ドイツ	25	0.00	1	0.02
イギリス	21	0.00	2	0.04
アジア・オセアニア	91	0.01	8	0.15
オーストラリア	5,861	0.95	32	0.59
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	7	0.00	1	0.02
エマージング株式	29,964	4.84	365	6.71
グローバル	7,768	1.25	101	1.86
BRICS	647	0.10	8	0.15
その他	21,550	3.48	256	4.70
欧州	209	0.03	9	0.17
ロシア	119	0.02	5	0.09
アジア・オセアニア	6,148	0.99	112	2.06
中国	2,187	0.35	29	0.53
インド	10,115	1.63	30	0.55
インドネシア	197	0.03	8	0.15
タイ	94	0.02	4	0.07
フィリピン	86	0.01	5	0.09
ベトナム	1,111	0.18	9	0.17
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	72	0.01	2	0.04
ブラジル	932	0.15	20	0.37
メキシコ	20	0.00	3	0.06
中東・アフリカ	152	0.02	8	0.15
南アフリカ	0	0.00	1	0.02
トルコ	70	0.01	4	0.07
複合地域	20	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(%)
総合	618,968	100.00	5,443	100.00
外国債券(先進国)	85,464	13.81	875	16.08
グローバル	62,517	10.10	577	10.60
除く日本	33,275	5.38	246	4.52
含む日本	29,242	4.72	331	6.08
その他	22,947	3.71	298	5.47
北米	99	0.02	6	0.11
米国	6,192	1.00	161	2.96
カナダ	1,404	0.23	7	0.13
欧州	1,540	0.25	36	0.66
イギリス	31	0.01	7	0.13
アジア・オセアニア	2,424	0.39	12	0.22
オーストラリア	9,498	1.53	43	0.79
ニュージーランド	173	0.03	14	0.26
複合地域	1,587	0.26	11	0.20
エマージング債券	19,067	3.08	307	5.64
グローバル	8,791	1.42	197	3.62
米ドル建て	7,143	1.15	156	2.87
現地通貨建て	1,647	0.27	41	0.75
その他	10,277	1.66	110	2.02
ロシア	241	0.04	5	0.09
アジア・オセアニア	513	0.08	20	0.37
インド	4,485	0.72	22	0.40
インドネシア	592	0.10	12	0.22
ブラジル	3,074	0.50	25	0.46
メキシコ	566	0.09	9	0.17
南アフリカ	3	0.00	1	0.02
トルコ	160	0.03	6	0.11
複合地域	51	0.01	1	0.02
ハイイールド債券	22,654	3.66	315	5.79
グローバル	3,460	0.56	62	1.14
北米	14,919	2.41	164	3.01
その他	4,275	0.69	89	1.64
欧州	3,369	0.54	51	0.94
アジア・オセアニア	786	0.13	32	0.59
複合地域	47	0.01	1	0.02
複合資産	92,088	14.88	968	17.78
安定	28,468	4.60	290	5.33
安定成長	42,076	6.80	412	7.57
成長	12,263	1.98	233	4.28
国内バランス	9,281	1.50	33	0.61
安定	8,658	1.40	9	0.17
一般	491	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	618,968	100.00	5,443	100.00
国内REIT	29,831	4.82	123	2.26
日本	29,831	4.82	123	2.26
外国REIT	47,649	7.70	291	5.35
グローバル	18,346	2.96	132	2.43
除く日本	3,657	0.59	45	0.83
含む日本	14,689	2.37	87	1.60
北米	24,311	3.93	89	1.64
その他	4,992	0.81	70	1.29
欧州	267	0.04	18	0.33
アジア・オセアニア	3,537	0.57	34	0.62
オーストラリア	820	0.13	13	0.24
複合地域	48	0.01	3	0.06
複数国	320	0.05	2	0.04
その他	14,820	2.39	212	3.89
絶対収益型	7,247	1.17	93	1.71
ロング・ショート	963	0.16	29	0.53
マーケットニュートラル	1,153	0.19	13	0.24
GTAA	436	0.07	14	0.26
その他スタイル	4,695	0.76	37	0.68
CB	1,549	0.25	45	0.83
アジア・オセアニア	39	0.01	1	0.02
日本	66	0.01	3	0.06
グローバル	1,444	0.23	41	0.75
コモディティ	1,884	0.30	32	0.59
全業種	814	0.13	14	0.26
貴金属	1,041	0.17	16	0.29
エネルギー	20	0.00	1	0.02
その他コモディティ	8	0.00	1	0.02

< 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	11,113	8.1	3.78	4.17	1.286
国内株式	13,018	11.0	1.17	1.59	1.158
一般	11,928	10.6	1.61	2.27	1.413
フリー	11,615	10.0	1.87	2.66	1.458
バリュー	13,171	12.9	0.53	0.65	1.229
小型	18,413	11.5	0.89	1.08	1.714
その他	13,815	11.9	0.46	0.52	0.500
日経225	14,340	13.2	0.48	0.53	0.585
TOPIX	14,395	13.1	0.31	0.36	0.336
JPX日経400	12,322	5.0	0.04	0.05	0.548
国内債券	11,392	10.4	0.32	0.32	0.358
一般	11,392	10.4	0.32	0.32	0.358
外国株式(先進国)	11,919	6.5	3.57	4.24	1.593
グローバル	12,484	6.9	2.59	3.04	1.569
除く日本	15,143	9.1	0.84	1.02	0.771
含む日本	11,465	6.1	3.10	3.62	1.782
その他	10,937	5.9	6.83	8.29	1.677
北米	10,460	6.4	4.05	4.75	1.881
米国	11,544	5.4	5.05	5.64	1.640
カナダ	6,561	7.5	17.78	24.15	1.967
欧州	10,575	8.3	2.96	3.62	1.689
ドイツ	9,486	5.4	0.00	0.00	0.756
イギリス	5,210	5.3	15.97	22.08	1.921
アジア・オセアニア	9,062	5.4	5.12	6.58	1.678
オーストラリア	8,645	5.1	14.56	19.40	1.794
ニュージーランド	12,874	7.1	3.05	3.11	1.642
複合地域	7,311	6.3	1.01	1.37	1.674
エマージング株式	10,995	8.6	3.01	3.82	1.815
グローバル	10,086	6.4	1.99	2.36	1.514
BRICS	12,604	11.7	1.07	1.08	2.033
その他	11,303	9.3	3.44	4.43	1.917
欧州	8,447	13.4	0.23	0.22	1.967
ロシア	9,285	10.5	0.64	0.57	1.972
アジア・オセアニア	11,729	9.4	7.51	9.83	1.718
中国	16,722	9.5	0.92	1.07	1.933
インド	10,893	9.6	1.13	1.33	2.046
インドネシア	10,220	8.2	0.31	0.30	1.824
タイ	11,360	11.3	0.55	0.60	1.679
フィリピン	10,737	6.0	0.51	0.52	1.766
ベトナム	11,615	4.0	0.72	0.83	1.837
韓国	8,739	5.3	3.26	4.45	1.773
香港	13,897	10.0	1.95	2.23	0.842
台湾	12,650	8.3	0.72	0.86	1.683
中南米	7,373	12.6	0.00	0.00	2.004
ブラジル	6,327	9.3	14.32	19.50	1.902
メキシコ	7,399	5.7	0.00	0.00	1.884
中東・アフリカ	9,552	8.7	0.30	0.36	2.039
南アフリカ	7,682	9.1	0.00	0.00	1.577
トルコ	5,645	13.1	0.00	0.00	2.005
複合地域	16,728	11.3	2.77	3.20	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

< 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	11,113	8.1	3.78	4.17	1.286
外国債券(先進国)	9,761	7.6	2.92	3.11	1.125
グローバル	10,266	7.8	2.02	2.08	1.071
除く日本	10,856	10.1	1.98	2.06	0.856
含む日本	9,828	6.1	2.06	2.11	1.315
その他	8,782	7.2	5.41	5.96	1.272
北米	10,289	5.3	1.93	1.96	1.799
米国	9,484	6.0	4.69	4.95	1.334
カナダ	7,990	7.2	5.78	6.25	1.343
欧州	8,420	9.8	1.77	1.84	1.042
イギリス	7,573	4.7	4.13	4.67	1.256
アジア・オセアニア	7,475	8.8	3.75	4.12	1.398
オーストラリア	7,699	10.1	6.95	7.89	1.239
ニュージーランド	8,924	4.9	3.37	3.54	1.315
複合地域	5,623	9.7	4.55	4.73	1.168
エマージング債券	8,461	8.0	8.12	8.21	1.577
グローバル	8,753	8.8	7.36	7.60	1.567
米ドル建て	8,867	9.1	7.73	7.96	1.610
現地通貨建て	8,319	7.7	5.77	6.04	1.380
その他	7,939	6.5	8.80	8.73	1.585
ロシア	8,048	6.5	6.77	6.59	1.587
アジア・オセアニア	8,687	6.4	12.33	14.01	1.618
インド	8,917	4.8	8.23	8.80	1.673
インドネシア	7,088	7.1	7.24	7.34	1.635
ブラジル	8,300	9.6	9.65	9.70	1.563
メキシコ	6,162	6.7	7.32	8.00	1.372
南アフリカ	6,581	7.3	7.67	8.21	1.404
トルコ	3,207	6.6	13.14	9.59	1.428
複合地域	3,994	13.0	5.74	6.01	1.188
ハイイールド債券	8,415	8.3	9.13	9.94	1.676
グローバル	7,216	7.9	7.67	8.35	1.590
北米	9,267	9.4	8.53	9.42	1.675
その他	7,678	6.6	12.40	13.06	1.747
欧州	7,347	6.3	13.14	13.73	1.728
アジア・オセアニア	8,068	7.3	10.66	11.66	1.849
複合地域	4,382	15.4	5.13	5.48	1.780
複合資産	11,421	7.8	1.59	1.67	1.091
安定	11,022	7.4	0.70	0.77	1.155
安定成長	11,060	8.1	2.42	2.56	1.116
成長	12,626	7.9	0.25	0.26	0.978
国内バランス	10,927	7.6	2.23	2.21	0.932
安定	10,901	8.5	2.32	2.30	0.904
一般	11,111	8.8	0.92	0.94	1.343

(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

< 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	11,113	8.1	3.78	4.17	1.286
国内REIT	14,535	7.9	9.98	9.46	0.948
日本	14,535	7.9	9.98	9.46	0.948
外国REIT	10,829	6.8	11.28	12.27	1.546
グローバル	11,618	7.6	9.66	11.17	1.405
除く日本	13,773	6.3	4.94	6.44	1.095
含む日本	10,503	8.3	10.84	12.35	1.482
北米	10,050	6.6	12.77	13.48	1.602
その他	10,334	5.4	9.94	10.40	1.796
欧州	8,419	5.0	4.88	6.01	1.840
アジア・オセアニア	12,009	5.3	12.28	12.83	1.846
オーストラリア	9,382	4.7	4.77	4.95	1.688
複合地域	6,821	7.6	1.33	1.48	0.836
複数国	10,556	12.4	2.73	2.50	1.625
その他					
絶対収益型	10,304	5.1	0.10	0.09	1.592
ロング・ショート	10,326	5.0	0.46	0.45	1.583
マーケットニュートラル	10,365	4.7	0.06	0.06	1.215
GTAA	10,632	5.5	0.00	0.00	1.587
その他スタイル	10,140	5.1	0.03	0.03	1.687
CB	10,790	5.9	0.89	0.96	1.479
アジア・オセアニア	7,673	9.2	3.24	3.39	1.804
日本	10,640	8.3	0.18	0.19	1.041
グローバル	10,877	5.6	0.86	0.93	1.490
コモディティ	8,148	7.1	0.01	0.01	0.875
全業種	5,630	8.0	0.00	0.00	1.235
貴金属	10,172	6.3	0.01	0.01	0.593
エネルギー	8,519	10.5	0.00	0.00	1.059
その他コモディティ	10,631	2.9	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