

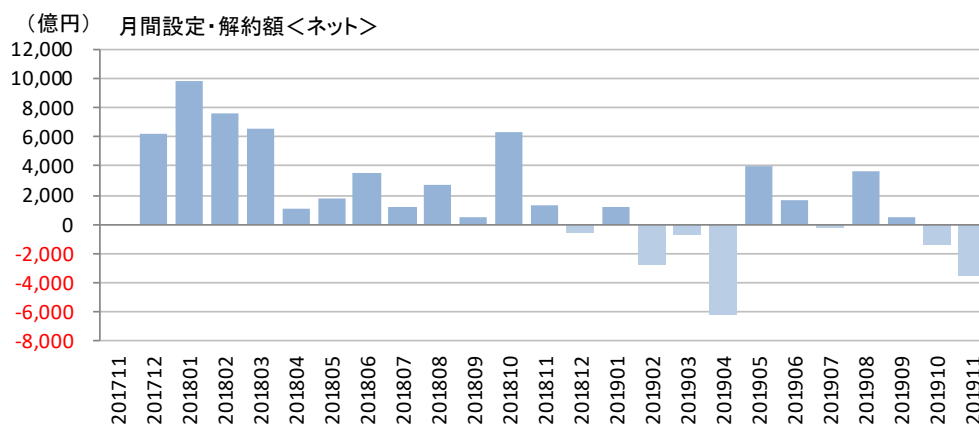
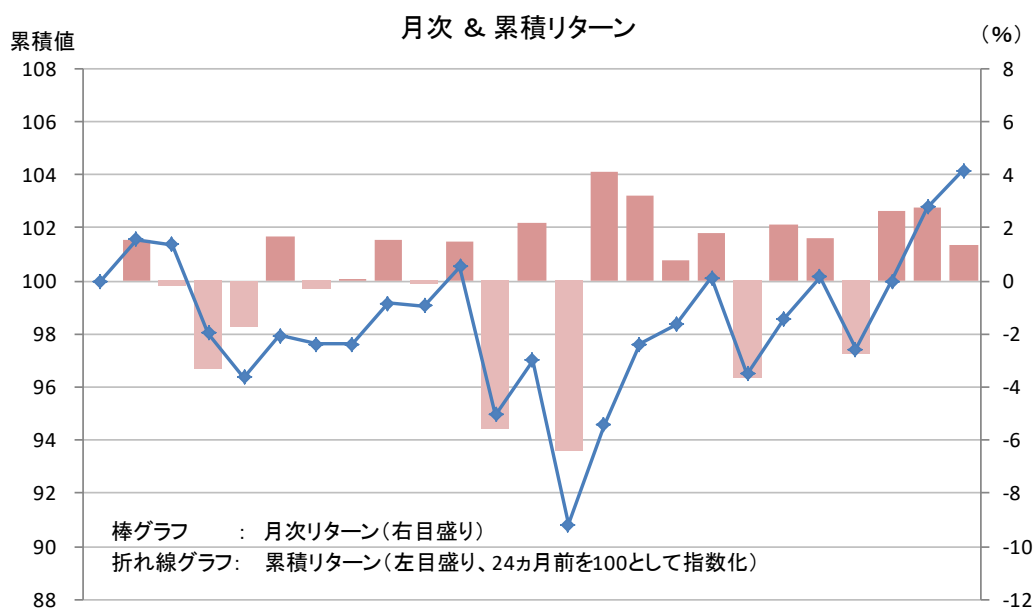
# 投信指数 MAB-FPI

## パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

### 2019年11月

**「総合」 +1.36 %**  
**(前月 +2.77 %)**



# 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

## &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		13,434	13,254	180	1.36	
国内株式		16,301	15,907	395	2.48	
一般		15,894	15,506	387	2.50	
フリー		14,960	14,577	383	2.63	
バリュー		20,316	19,920	396	1.99	
小型		34,541	32,987	1,554	4.71	
その他		15,983	15,719	264	1.68	
日経225		15,240	15,006	234	1.56	
TOPIX		15,815	15,517	298	1.92	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	14,915	14,655	260	1.78	
国内債券		13,368	13,400	-32	-0.24	
一般		13,368	13,400	-32	-0.24	
外国株式(先進国)		15,152	14,573	579	3.97	
グローバル		16,713	16,031	681	4.25	
除く日本		23,548	22,741	806	3.54	
含む日本		15,198	14,551	648	4.45	
その他		11,951	11,605	346	2.99	
北米		11,779	11,185	594	5.31	
米国		17,761	17,117	644	3.76	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	17,196	16,718	478	2.86	
欧州		18,572	18,079	493	2.73	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	8,973	8,804	168	1.91	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	8,904	8,715	189	2.17	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	34,481	33,835	645	1.91	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	15,954	15,983	-30	-0.19	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	34,507	33,397	1,110	3.32	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	8,190	8,096	94	1.16	
エマージング株式		14,823	14,678	146	0.99	
グローバル		14,667	14,380	286	1.99	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	23,945	23,694	252	1.06	
その他		15,347	15,250	97	0.64	
欧州		26,201	26,313	-112	-0.43	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	10,548	10,572	-25	-0.23	
アジア・オセアニア		15,514	15,342	172	1.12	
中国		34,315	33,443	872	2.61	
インド	10,000 (2004.09.30)	32,898	32,591	307	0.94	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	13,329	14,171	-842	-5.94	
タイ		22,869	22,923	-54	-0.24	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,237	8,387	-150	-1.79	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	14,572	15,079	-507	-3.36	
韓国	10,000 (1997.06.30)	19,432	19,768	-336	-1.70	
香港		22,618	22,252	367	1.65	
台湾	10,000 (2008.03.31)	16,486	16,122	364	2.26	
中南米	7,427 (2006.04.28)	8,387	8,578	-191	-2.23	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,720	10,069	-349	-3.47	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	9,184	9,373	-189	-2.02	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	9,149	8,986	163	1.81	
トルコ		22,032	20,360	1,672	8.21	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	20,633	20,176	458	2.27	

※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		13,434	13,254	180	1.36
外国債券(先進国)		17,822	17,821	1	0.00
グローバル		18,173	18,156	17	0.09
除く日本		19,407	19,394	14	0.07
含む日本		17,503	17,483	20	0.12
その他		16,832	16,872	-40	-0.23
北米	9,052 (2013.05.31)	10,461	10,427	35	0.33
米国		15,970	15,882	88	0.56
カナダ	10,000 (2003.05.30)	13,962	13,968	-6	-0.04
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,263	15,302	-39	-0.25
イギリス	10,069 (2014.07.31)	9,623	9,564	59	0.62
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	18,289	18,431	-142	-0.77
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	22,532	22,709	-178	-0.78
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	10,773	10,727	45	0.42
複合地域	10,000 (2001.11.30)	16,750	16,680	70	0.42
エマージング債券		17,135	17,382	-247	-1.42
グローバル		18,424	18,628	-204	-1.09
米ドル建て		19,024	19,226	-202	-1.05
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,760	12,924	-164	-1.27
その他	8,647 (2005.03.31)	12,653	12,872	-219	-1.70
ロシア	10,000 (2008.05.30)	11,496	11,418	77	0.68
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	14,393	14,305	88	0.61
インド	10,000 (2011.08.31)	15,918	15,911	7	0.04
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	13,596	13,599	-3	-0.02
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	12,559	13,292	-733	-5.51
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	11,995	12,274	-279	-2.28
南アフリカ	10,000 (2010.03.31)	10,673	10,465	208	1.99
トルコ	10,000 (2011.04.28)	6,160	6,003	157	2.62
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,965	10,930	34	0.31
ハイイールド債券		21,759	21,794	-35	-0.16
グローバル	10,000 (1997.06.30)	21,969	22,113	-144	-0.65
北米		21,046	21,069	-23	-0.11
その他	10,000 (2004.03.31)	22,223	22,210	12	0.06
欧州	10,000 (2006.04.28)	22,350	22,336	14	0.06
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,326	14,328	-2	-0.01
複合地域	10,000 (2004.03.31)	19,199	19,185	13	0.07
複合資産		17,551	17,434	116	0.67
安定	10,000 (1998.10.30)	15,666	15,600	65	0.42
安定成長		18,808	18,679	129	0.69
成長		20,914	20,573	341	1.66
国内バランス		13,468	13,472	-4	-0.03
安定		13,812	13,823	-11	-0.08
一般		14,594	14,461	133	0.92

※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		13,434	13,254	180	1.36
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	36,256	36,585	-329	-0.90
日本	10,000 (2003.10.31)	36,256	36,585	-329	-0.90
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	27,806	27,973	-168	-0.60
グローバル	10,000 (2004.01.30)	24,276	24,358	-82	-0.33
除く日本	10,000 (2004.04.30)	26,313	26,334	-22	-0.08
含む日本	10,000 (2004.01.30)	24,347	24,445	-98	-0.40
北米	10,000 (2003.09.30)	27,728	27,967	-238	-0.85
その他	10,000 (2004.04.30)	27,955	28,060	-104	-0.37
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,892	5,823	69	1.19
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	20,737	20,863	-126	-0.60
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	15,508	15,504	4	0.03
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,441	7,334	107	1.46
複数国	10,000 (2004.04.30)	37,537	37,720	-183	-0.48
その他		6,014	5,970	44	0.73
絶対収益型		7,764	7,731	32	0.42
ロング・ショート		9,033	8,989	44	0.49
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,780	11,727	53	0.46
GTAA		10,765	10,706	58	0.55
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,278	7,250	28	0.39
CB		18,749	18,578	170	0.92
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	15,300	15,144	156	1.03
日本		20,201	20,225	-24	-0.12
グローバル		32,883	32,569	314	0.96
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	7,837	7,938	-101	-1.27
全業種	10,000 (2004.12.30)	6,430	6,418	12	0.18
貴金属	10,000 (2009.07.31)	14,588	14,985	-398	-2.65
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	4,744	4,474	270	6.03
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	10,097	9,999	98	0.98

※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	6.92	7.94	7.37	14.71
国内株式	14.07	12.90	3.96	17.65
一般	14.43	12.75	3.78	17.48
フリー	14.44	12.57	4.10	18.37
バリュー	14.42	13.57	2.51	13.90
小型	13.79	10.68	1.75	19.88
その他	13.32	13.86	5.10	17.06
日経225	13.14	13.81	5.89	17.95
TOPIX	13.41	13.52	4.17	16.09
JPX日経400	13.45	13.80	5.01	16.53
国内債券	-1.74	0.31	2.38	1.86
一般	-1.74	0.31	2.38	1.86
外国株式(先進国)	10.19	11.41	11.75	24.10
グローバル	10.63	12.01	12.19	24.57
除く日本	10.86	11.46	10.83	23.52
含む日本	10.58	12.17	12.55	24.84
その他	8.61	9.29	10.22	22.47
北米	8.22	8.57	7.05	21.86
米国	8.65	10.58	11.96	24.69
カナダ	6.35	6.20	5.96	17.02
欧州	10.53	9.80	10.02	21.65
ドイツ	14.54	9.84	7.93	19.61
イギリス	9.75	3.88	-1.44	7.33
アジア・オセアニア	12.19	8.96	6.70	13.79
オーストラリア	7.93	4.55	4.48	15.33
ニュージーランド	8.88	6.72	10.08	15.92
複合地域	2.61	-4.18	-12.07	1.24
エマージング株式	10.92	5.05	6.52	12.27
グローバル	11.53	9.94	11.61	19.71
BRICS	11.85	8.53	11.23	20.16
その他	10.68	3.23	4.55	9.40
欧州	12.59	10.08	12.62	21.38
ロシア	11.07	11.66	18.39	29.03
アジア・オセアニア	9.55	6.15	4.25	11.07
中国	11.02	15.74	22.75	33.44
インド	12.94	-0.63	2.08	4.69
インドネシア	-1.44	-0.20	-4.89	-2.63
タイ	-0.91	-0.02	-1.68	3.72
フィリピン	4.03	1.06	3.57	4.56
ベトナム	0.85	-1.45	-3.78	1.12
韓国	7.43	-3.41	-16.82	-12.07
香港	8.33	1.01	0.32	6.70
台湾	14.84	21.35	10.04	15.82
中南米	9.75	4.35	3.58	9.82
ブラジル	9.11	4.64	6.24	12.45
メキシコ	12.56	3.03	5.72	6.40
中東・アフリカ	5.45	0.88	-1.18	4.77
トルコ	15.30	20.33	-0.17	8.37
複合地域	9.44	6.29	5.41	10.77

## &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	6.92	7.94	7.37	14.71
外国債券(先進国)	1.39	2.29	2.71	4.39
グローバル	0.90	2.52	4.08	4.87
除く日本	1.10	2.99	3.75	4.78
含む日本	0.66	1.98	4.45	4.97
その他	2.73	1.67	-0.84	3.09
北米	0.11	1.64	4.00	4.04
米国	2.38	3.43	4.93	7.26
カナダ	2.05	2.65	0.72	4.46
欧州	-0.20	0.42	0.65	1.65
イギリス	7.65	3.54	0.54	3.46
アジア・オセアニア	3.43	0.71	-3.95	1.02
オーストラリア	3.43	0.67	-4.03	1.09
ニュージーランド	3.41	1.38	-2.92	0.40
複合地域	2.48	3.17	2.57	4.38
エマージング債券	4.27	3.00	4.30	6.05
グローバル	3.23	3.25	5.56	7.34
米ドル建て	2.73	2.78	5.88	7.52
現地通貨建て	5.39	5.28	4.04	6.50
その他	5.16	2.81	3.28	4.99
ロシア	11.40	11.87	17.62	24.32
アジア・オセアニア	3.58	3.76	6.38	7.43
インド	4.40	1.89	3.63	5.48
インドネシア	6.53	10.39	8.20	11.33
ブラジル	4.71	0.13	-1.13	0.42
メキシコ	8.10	7.69	17.74	14.38
南アフリカ	6.37	2.67	-4.85	3.46
トルコ	19.54	37.87	12.41	19.12
複合地域	5.67	4.76	5.34	7.28
ハイイールド債券	3.58	3.09	3.54	8.69
グローバル	3.72	2.22	2.87	6.81
北米	3.40	2.89	3.45	9.37
その他	4.12	4.53	4.43	8.01
欧州	4.05	5.32	4.10	8.08
アジア・オセアニア	4.75	1.49	5.79	7.61
複合地域	2.98	2.95	2.50	5.64
複合資産	3.83	5.75	5.77	9.85
安定	1.84	4.14	5.04	7.63
安定成長	4.36	6.27	6.27	10.77
成長	7.90	8.66	6.29	14.11
国内バランス	2.20	4.43	4.94	6.47
安定	1.88	4.14	4.99	6.08
一般	6.71	8.10	5.06	11.33

## ＜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	6.92	7.94	7.37	14.71
国内REIT	7.07	16.96	25.26	27.93
日本	7.07	16.96	25.26	27.93
外国REIT	5.62	8.61	12.04	22.43
グローバル	7.12	8.72	10.25	20.21
除く日本	7.65	10.06	12.71	22.70
含む日本	6.99	8.39	9.69	19.63
北米	4.69	9.22	13.35	25.15
その他	4.67	5.30	12.64	17.35
欧州	12.49	8.42	6.16	16.45
アジア・オセアニア	3.71	4.23	14.51	17.78
オーストラリア	5.16	6.41	7.34	12.82
複合地域	12.15	9.63	7.32	16.53
複数国	6.50	11.55	16.82	26.16
その他	4.26	6.99	3.62	10.34
絶対収益型	-0.77	0.57	1.50	2.14
ロング・ショート	-1.49	1.42	5.89	4.62
マーケットニュートラル	-0.55	-2.50	-2.30	-1.15
GTAA	-0.08	2.18	4.04	5.48
その他スタイル	-0.74	1.05	1.15	2.07
CB	2.88	3.22	3.36	6.83
アジア・オセアニア	6.71	3.25	3.53	6.43
日本	3.62	2.38	-1.59	1.41
グローバル	2.75	3.26	3.61	7.12
コモディティ	-0.04	5.46	4.76	7.53
全業種	5.93	-0.56	-3.89	2.93
貴金属	-4.89	11.16	13.70	10.51
エネルギー	7.54	-0.75	5.23	21.00
その他コモディティ	4.91	3.63	-5.15	3.45

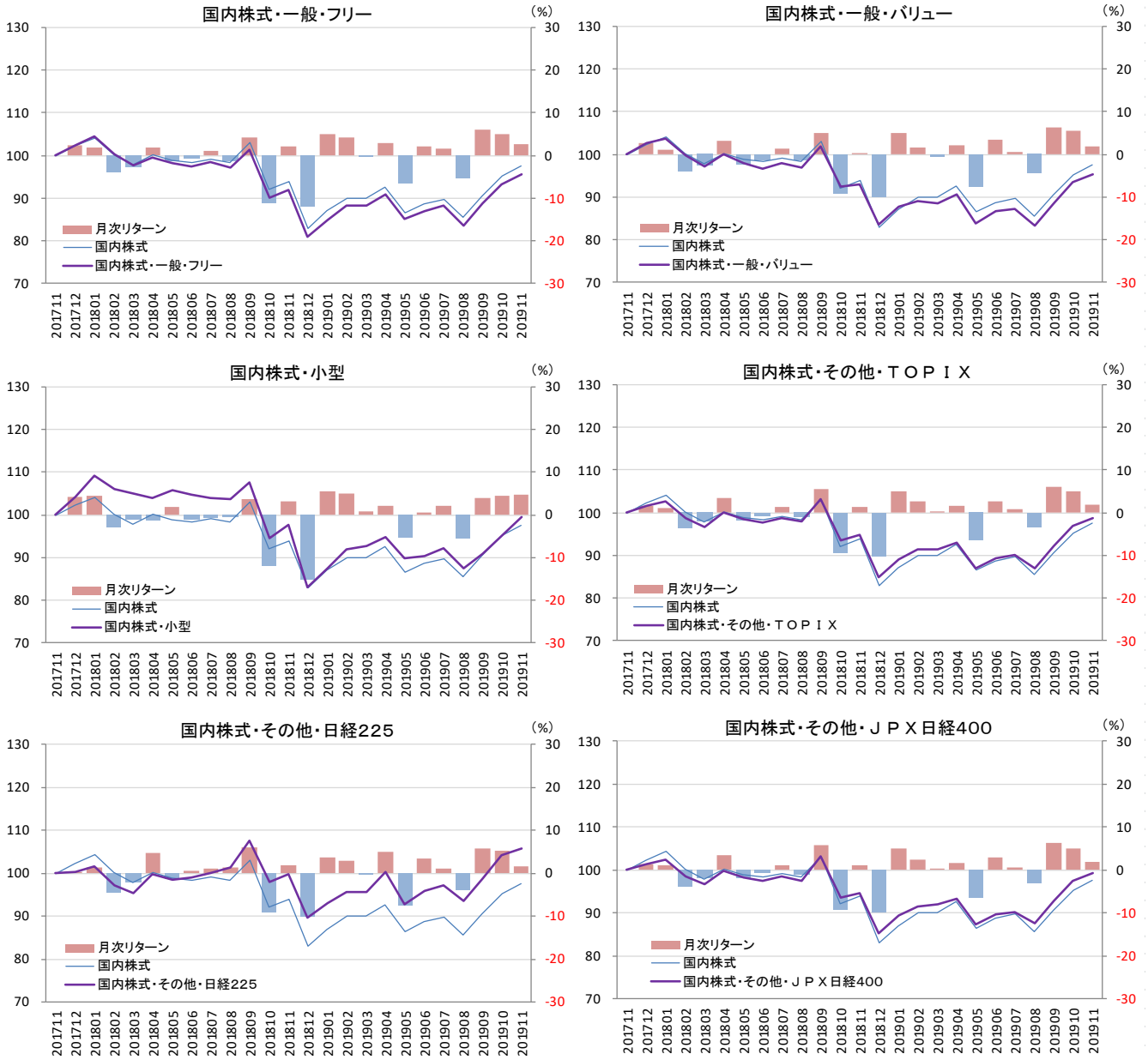


<1>パフォーマンス・サマリー

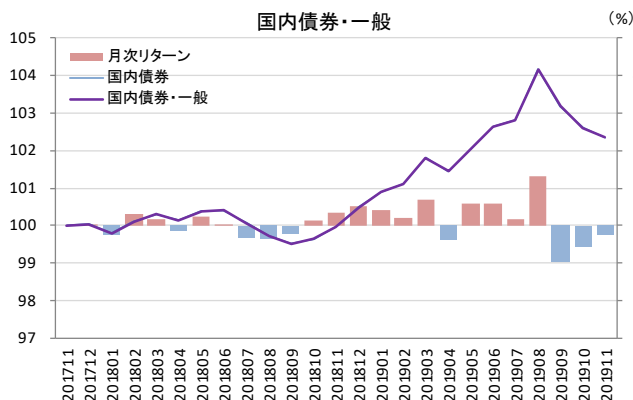
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

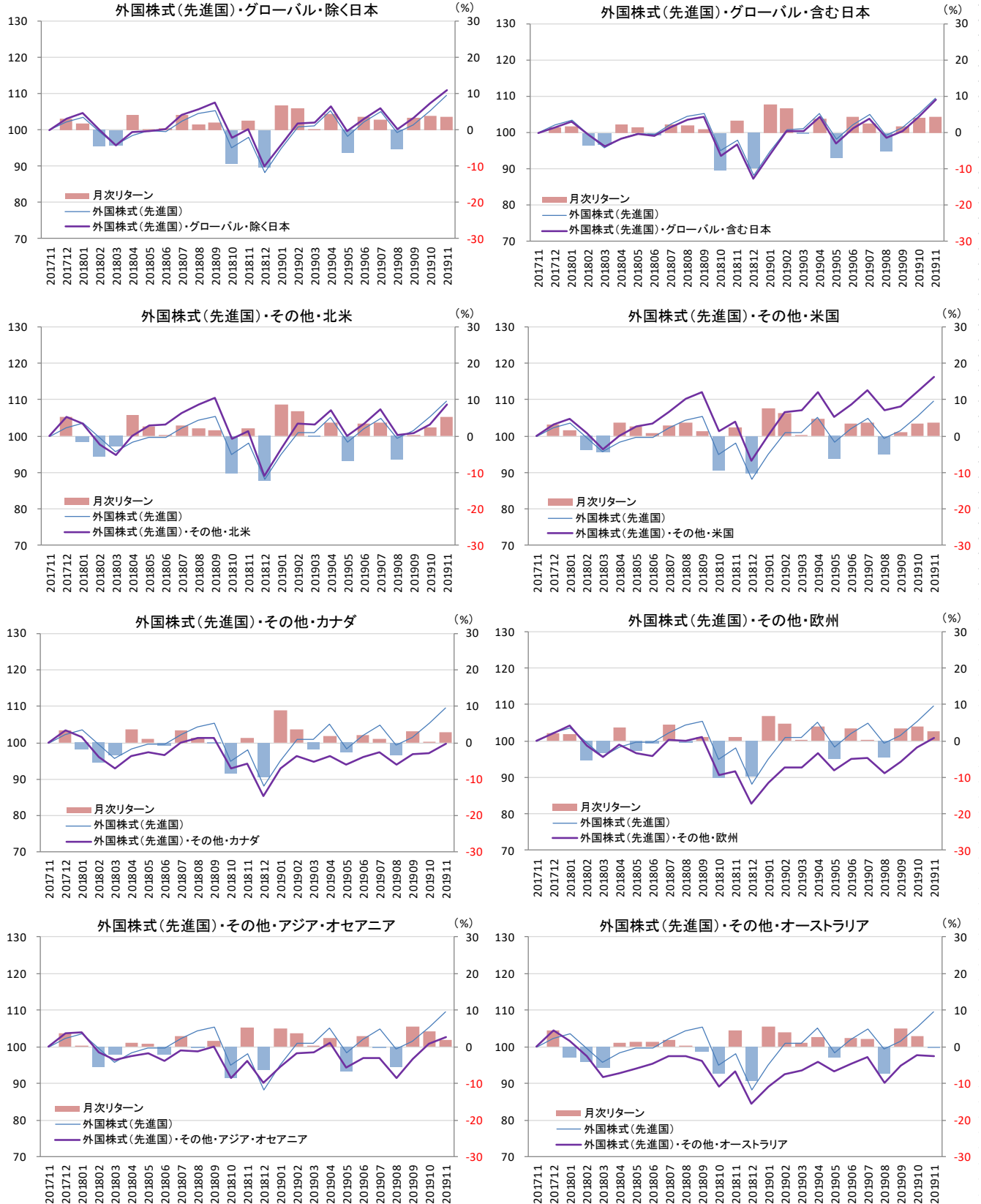


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

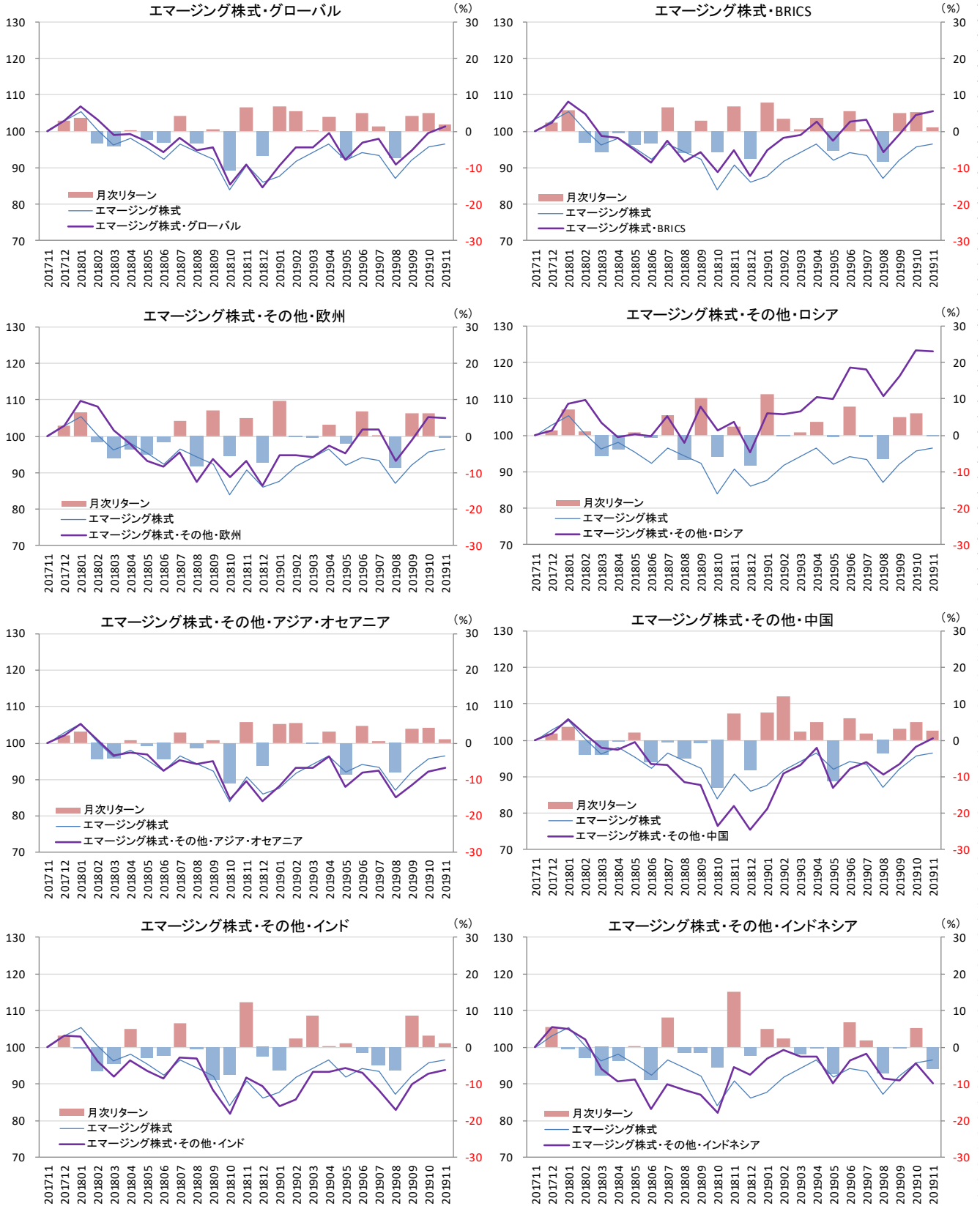


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

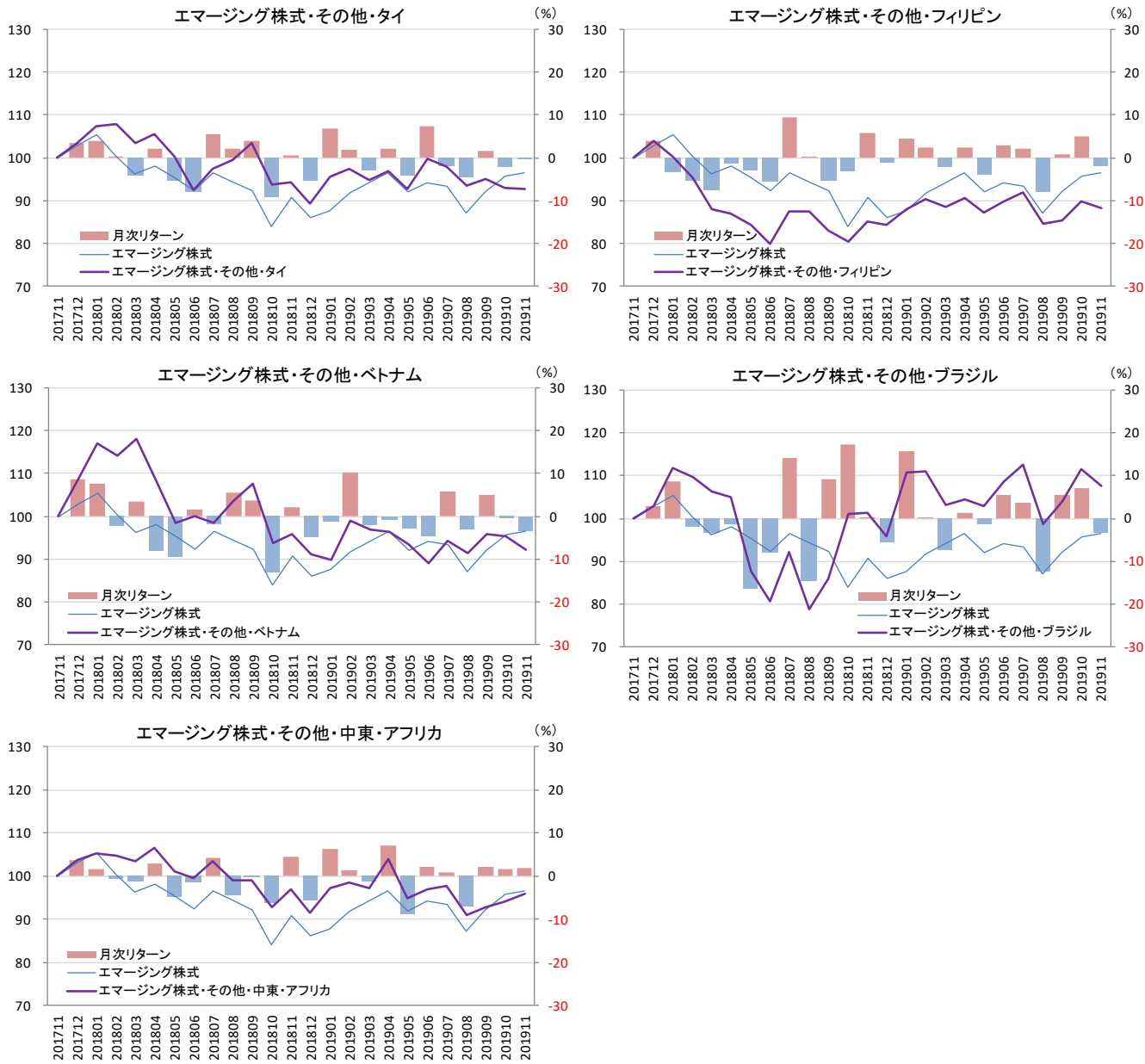


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

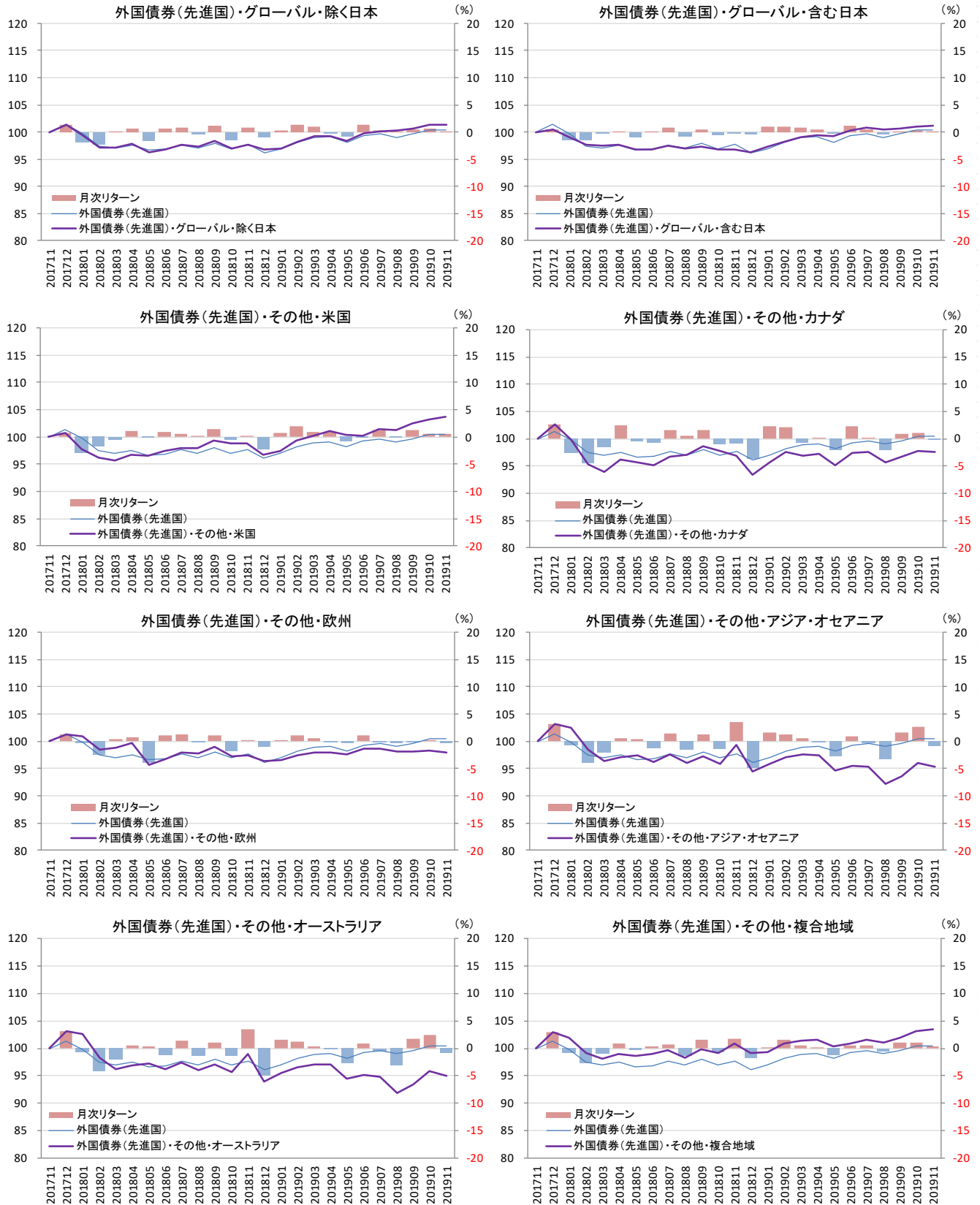


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

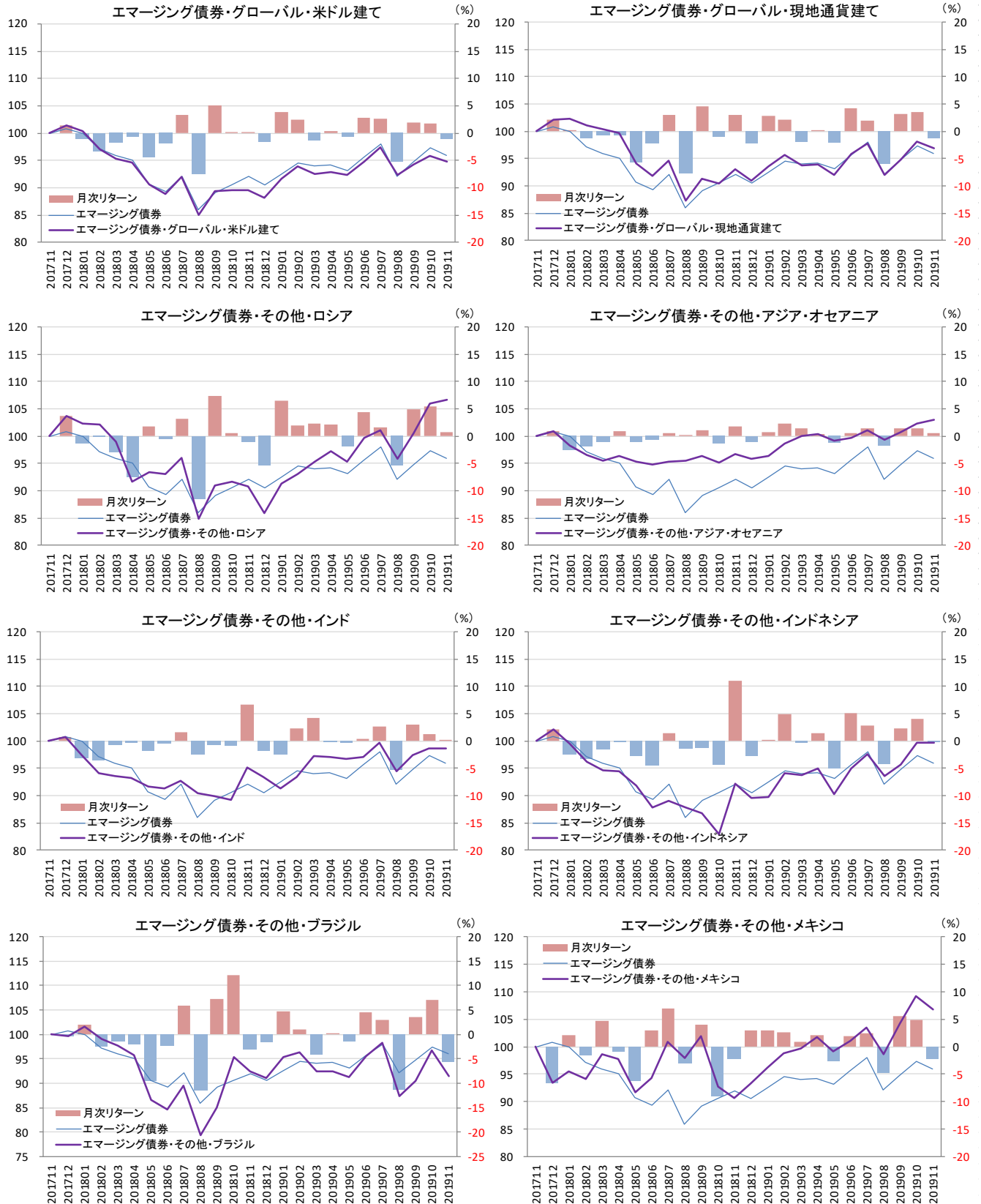


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

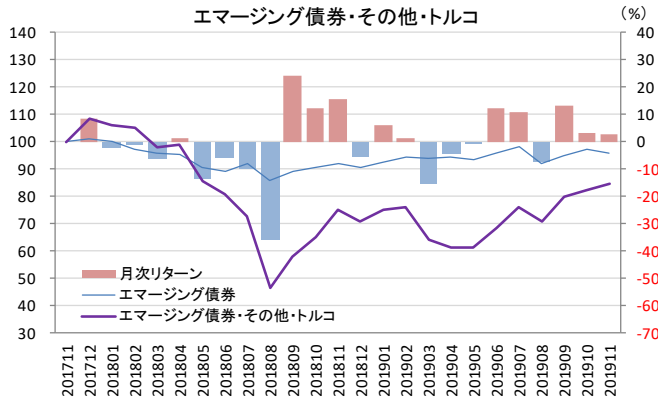


<1>パフォーマンス・サマリー

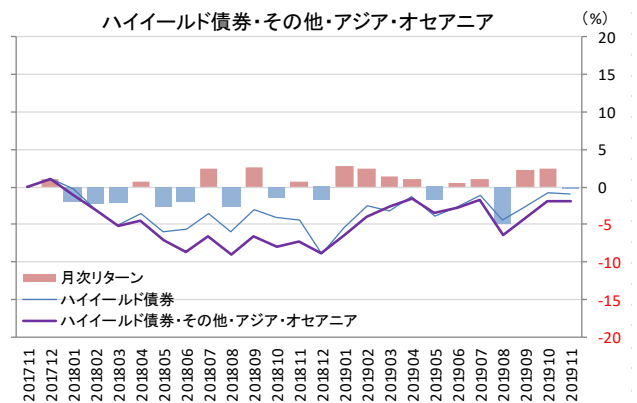
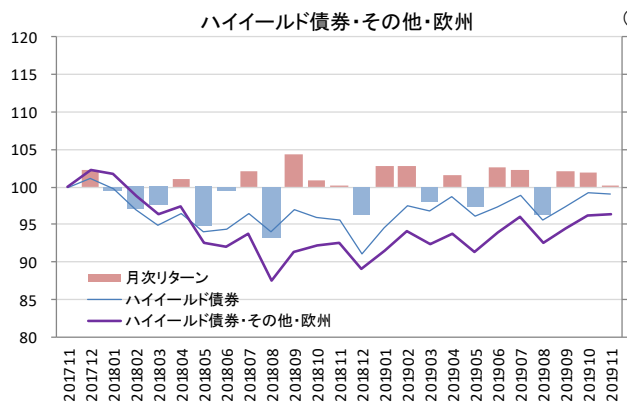
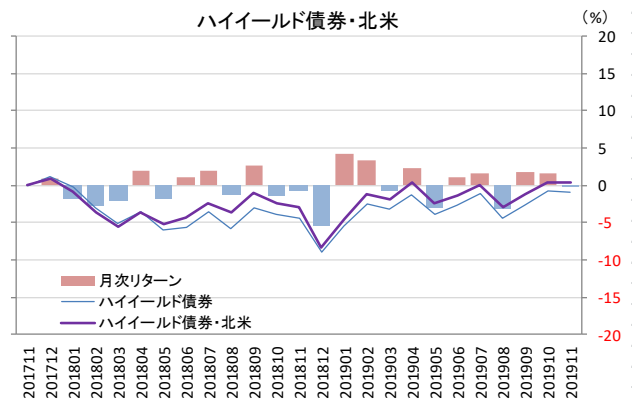
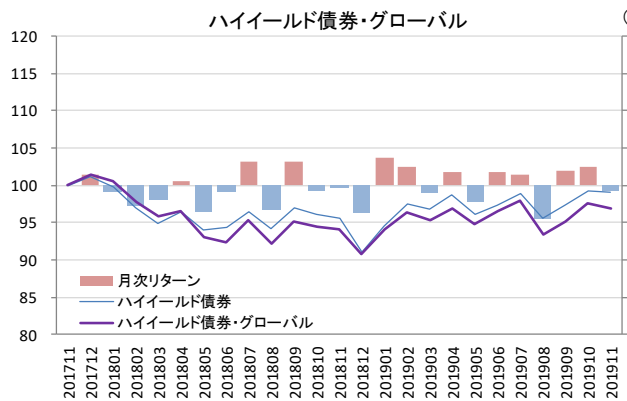
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

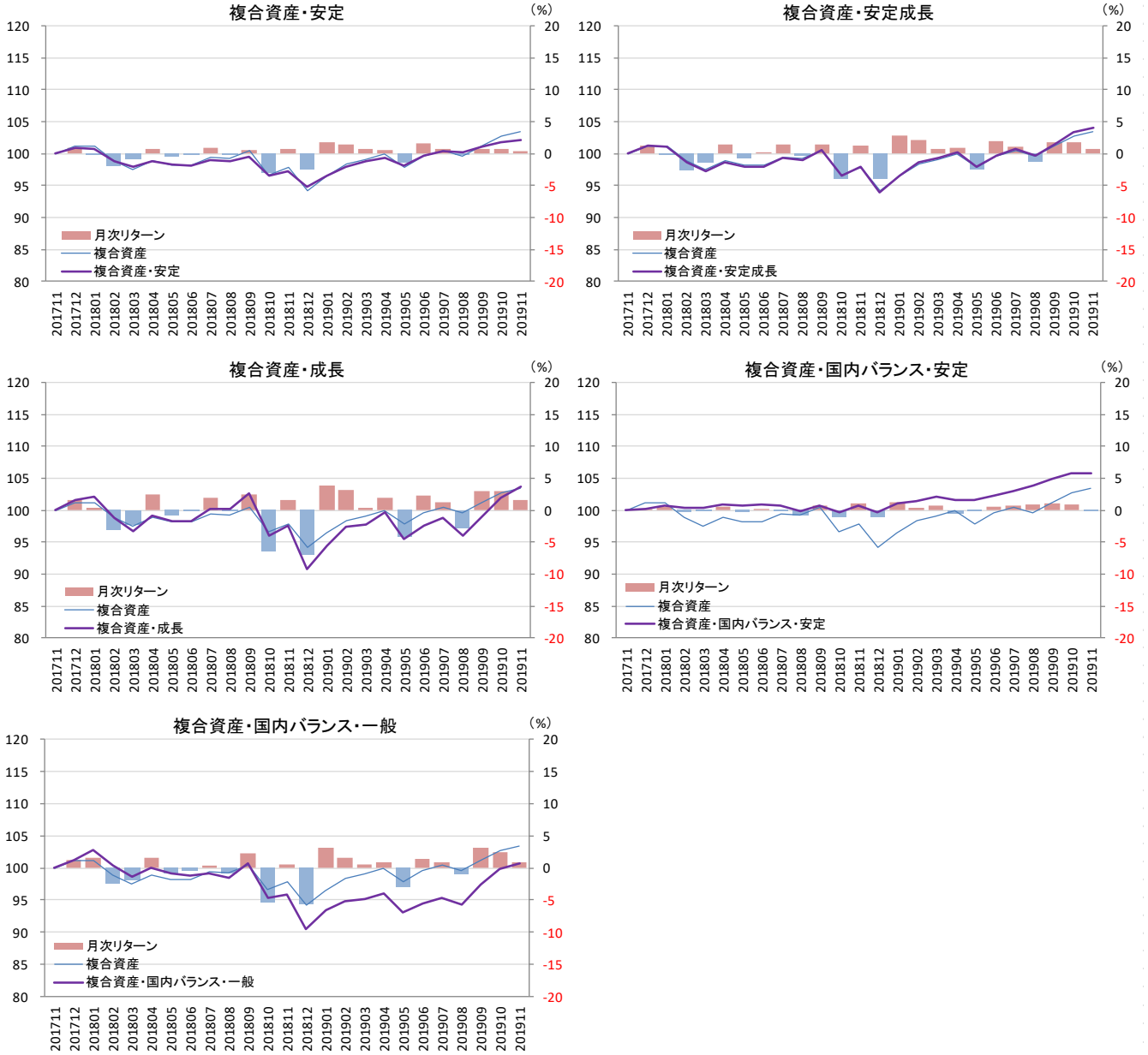


<1>パフォーマンス・サマリー

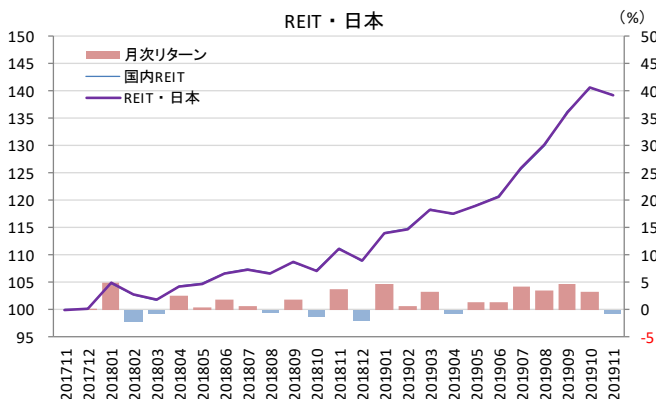
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]





<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

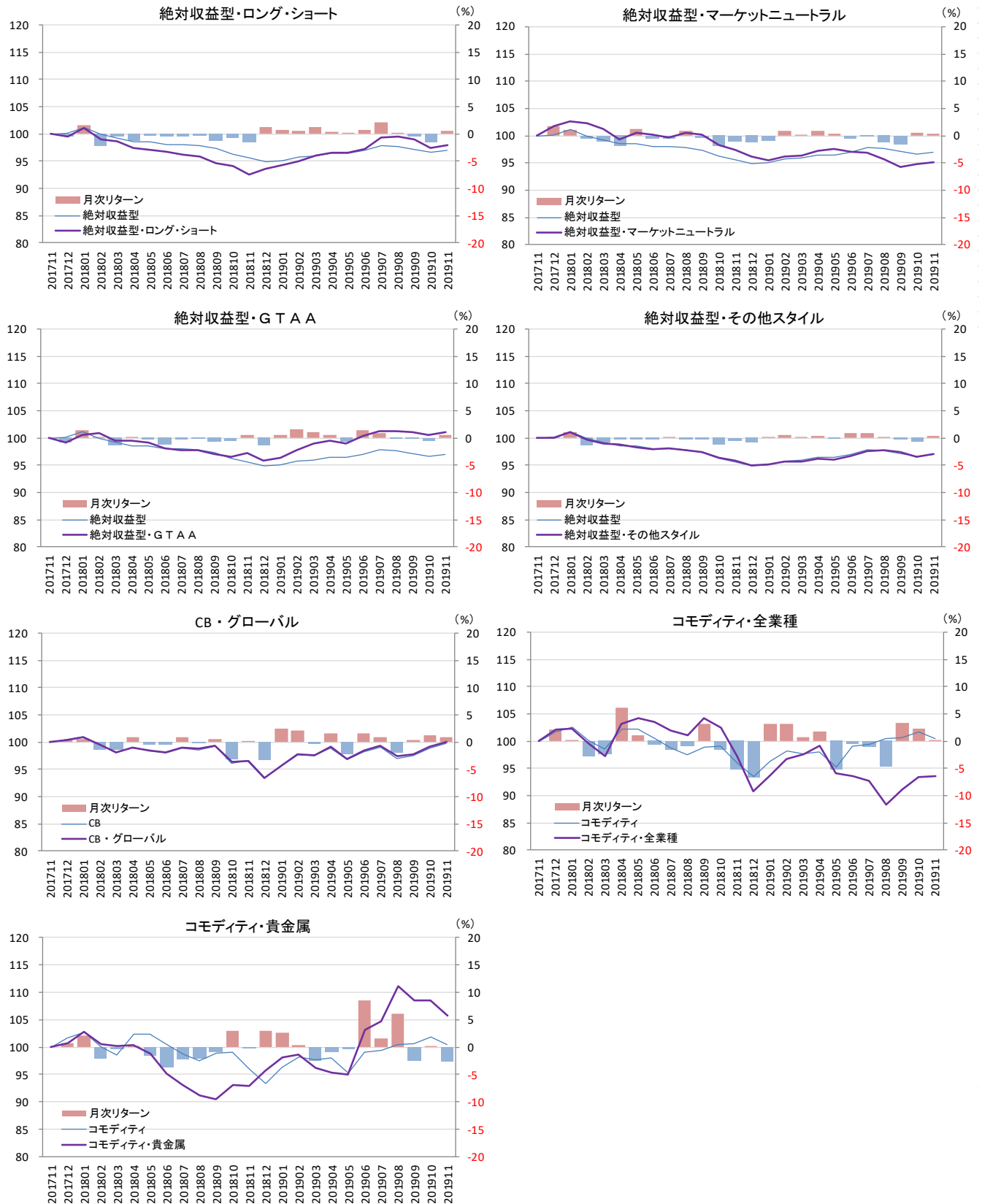


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]





## &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	1.36		
1	外国株式(先進国)・グローバル	4.25	18.78	0.79
2	国内株式・一般	2.50	9.62	0.24
3	外国株式(先進国)・その他	2.99	5.25	0.16
4	国内株式・その他	1.68	4.82	0.08
5	国内株式・小型	4.71	1.53	0.07
6	複合資産・安定成長	0.69	7.14	0.05
7	複合資産・成長	1.66	2.05	0.03
8	エマージング株式・グローバル	1.99	1.26	0.02
9	エマージング株式・その他	0.64	3.51	0.02
10	複合資産・安定	0.42	4.32	0.02
11	ブルベア	1.66	0.96	0.02
12	外国債券(先進国)・グローバル	0.09	9.59	0.01
13	国内株式・業種特化	5.44	0.11	0.01
14	絶対収益型	0.42	1.13	0.00
15	CB	0.92	0.23	0.00
16	エマージング株式・BRICS	1.06	0.11	0.00
17	ハイイールド債券・その他	0.06	0.65	0.00
18	複合資産・国内バランス	-0.03	1.58	-0.00
19	ハイイールド債券・北米	-0.11	2.29	-0.00
20	REIT・その他	-0.37	0.79	-0.00
21	ハイイールド債券・グローバル	-0.65	0.54	-0.00
22	コモディティ	-1.27	0.30	-0.00
23	外国債券(先進国)・その他	-0.23	3.58	-0.01
24	REIT・グローバル	-0.33	2.99	-0.01
25	国内債券・一般	-0.24	5.26	-0.01
26	エマージング債券・グローバル	-1.09	1.38	-0.02
27	エマージング債券・その他	-1.70	1.58	-0.03
28	REIT・北米	-0.85	3.85	-0.03
29	REIT・日本	-0.90	4.80	-0.05
	合計		100.00	1.36

## ◆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	7.37				
1	外国株式(先進国)・グローバル	12.19		18.06		2.24
2	REIT・日本	25.26		4.48		1.06
3	外国株式(先進国)・その他	10.22		5.20		0.55
4	REIT・北米	13.35		3.93		0.51
5	複合資産・安定成長	6.27		6.66		0.43
6	外国債券(先進国)・グローバル	4.08		10.08		0.41
7	REIT・グローバル	10.25		2.96		0.30
8	国内株式・一般	3.78		9.79		0.29
9	国内株式・その他	5.10		4.89		0.28
10	複合資産・安定	5.04		4.46		0.23
11	エマージング株式・グローバル	11.61		1.40		0.15
12	エマージング株式・その他	4.55		3.79		0.15
13	複合資産・成長	6.29		1.95		0.13
14	国内債券・一般	2.38		5.35		0.13
15	REIT・その他	12.64		0.80		0.10
16	ハイイールド債券・北米	3.45		2.51		0.08
17	エマージング債券・グローバル	5.56		1.45		0.08
18	複合資産・国内バランス	4.94		1.33		0.07
19	エマージング債券・その他	3.28		1.73		0.06
20	ブルベア	0.63		0.53		0.05
21	ハイイールド債券・その他	4.43		0.74		0.03
22	ハイイールド債券・グローバル	2.87		0.59		0.02
23	絶対収益型	1.50		1.15		0.02
24	コモディティ	4.76		0.28		0.01
25	エマージング株式・BRICS	11.23		0.11		0.01
26	CB	3.36		0.26		0.01
27	国内株式・小型	1.75		1.64		0.01
28	国内株式・業種特化	3.18		0.11		0.00
29	外国債券(先進国)・その他	-0.84		3.77		-0.04
	合計			100.00		7.37

## ◆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	17.49	9.92	86.09	8.15	9.42	11.51	0.68	0.20	0.55
国内株式	25.41	30.19	147.43	13.99	15.98	17.38	0.56	0.34	0.54
一般	23.31	25.28	132.05	14.23	16.32	17.68	0.51	0.28	0.50
フリー	24.37	24.31	131.44	14.52	16.63	18.34	0.52	0.27	0.48
バリュー	19.40	28.42	136.01	13.35	15.46	16.35	0.46	0.33	0.55
小型	40.33	64.73	256.60	15.79	15.72	17.13	0.76	0.67	0.79
その他	26.86	35.73	164.38	13.42 ↓	15.71	17.30	0.62	0.40	0.59
日経225	32.22	41.79	181.94	13.93	15.88	17.61	0.70	0.46	0.62
TOPIX	22.48	31.98	141.26	12.98	15.53	16.77	0.54	0.37	0.55
JPX日経400	20.58	26.91	-	12.76	15.11	-	0.51	0.32	-
国内債券	1.97	5.98	16.33	1.51	1.71	1.55	0.47	0.69	0.97
一般	1.97	5.98	16.33	1.51	1.71	1.55	0.47	0.69	0.97
外国株式(先進国)	31.24	14.72	118.15	13.56	14.91	16.43	0.70	0.19	0.49
グローバル	33.19	17.96	128.37	13.73	14.69	16.34	0.73	0.23	0.53
除く日本	35.01	26.31	170.57	13.87	15.90	17.95	0.76	0.30	0.58
含む日本	32.69	15.67	118.60	13.77	14.46	16.04	0.72	0.21	0.51
その他	26.63	7.97	102.74	13.23 ↓	15.53	17.72	0.62	0.10	0.41
北米	19.40	4.98	64.12	16.22	17.40	21.12	0.38	0.06	0.24
米国	35.69	13.40	132.70	13.89	16.62	18.04	0.78	0.15	0.49
カナダ	8.59	-14.26	16.03	12.30	13.81	16.74	0.23	-0.22	0.09
欧州	28.01	12.37	95.12	13.84	14.81	18.67	0.62	0.16	0.37
ドイツ	19.99	1.10	-	17.23	19.28	-	0.37	0.01	-
イギリス	5.04	-13.44	-	13.42 ↓	14.99	-	0.13	-0.19	-
アジア・オセアニア	24.00	20.28	157.29	12.01	15.09	18.05	0.62	0.25	0.55
オーストラリア	9.04	4.37	74.08	12.99 ↓	15.35	19.77	0.23	0.06	0.29
ニュージーランド	34.53	56.92	-	13.53	16.61	-	0.77	0.57	-
複合地域	-16.40	-35.16	-	18.46	18.87	-	-0.31	-0.44	-
エマージング株式	23.89	5.34	54.23	12.96	15.21	18.25	0.58	0.07	0.24
グローバル	27.73	3.33	53.44	14.41	16.41	18.53	0.59	0.04	0.23
BRICS	41.73	25.57	71.13	15.19	18.37	20.87	0.82	0.25	0.26
その他	21.90	5.71	58.30	12.96	15.11	18.21	0.53	0.08	0.26
欧州	34.26	15.93	39.52	17.95	20.30	24.06	0.58	0.15	0.14
ロシア	43.62	53.15	62.55	19.61	24.18	26.31	0.66	0.37	0.19
アジア・オセアニア	15.80	1.60	74.69	14.15	15.83	17.46	0.36	0.02	0.33
中国	38.58	45.46	104.67	18.04	22.50	22.05	0.64	0.35	0.34
インド	29.90	13.13	80.23	17.09	18.98	24.13	0.54	0.13	0.25
インドネシア	5.02	-14.76	80.97	17.35	19.57	22.10	0.10	-0.16	0.28
タイ	17.82	1.54	193.84	13.75	13.79	17.20	0.41	0.02	0.66
フィリピン	4.87	-16.08	-	13.87	14.83	-	0.12	-0.23	-
ベトナム	19.96	22.19	-	17.67	16.75	-	0.36	0.25	-
韓国	-10.76	-26.14	24.60	16.45	16.25	20.16	-0.22	-0.36	0.11
香港	22.95	14.96	56.29	16.33	19.42	18.86	0.44	0.15	0.24
台湾	21.26	18.46	136.37	18.79	18.30	19.41	0.36	0.19	0.46
中南米	27.91	-10.23	1.72	21.10	23.18	23.46	0.41	-0.09	0.01
ブラジル	29.58	-8.78	-23.42	26.86	31.45	29.20	0.34	-0.06	-0.09
メキシコ	-0.34	-32.81	-	21.28	20.55	-	-0.00	-0.37	-
中東・アフリカ	11.33	-19.30	61.85	12.90	15.05	16.81	0.29	-0.28	0.29
トルコ	-13.02	-51.81	-11.96	33.36	28.92	31.93	-0.13	-0.47	-0.04
複合地域	12.12	-7.61	73.18	13.65	14.91	16.12	0.29	-0.10	0.35

※[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	17.49	9.92	86.09	8.15	9.42	11.51	0.68	0.20	0.55
外国債券(先進国)	4.87	-5.96	35.96	3.34 ↓	5.01	8.11	0.49	-0.24	0.38
グローバル	6.26	-3.64	34.72	3.02 ↓	4.40 ↓	7.38	0.69	-0.16	0.41
除く日本	6.44	-5.75	39.27	3.53 ↓	4.99 ↓	8.12	0.61	-0.23	0.41
含む日本	6.05	-0.87	29.17	2.66 ↓	3.92 ↓	6.60	0.76	-0.04	0.39
その他	1.42	-10.40	39.26	5.26 ↓	6.93	9.86	0.10	-0.31	0.34
北米	4.27	1.50	-	1.95 ↓	3.41 ↓	-	0.75	0.09	-
米国	5.97	2.79	55.98	3.78 ↓	5.05 ↓	6.38	0.53	0.11	0.71
カナダ	0.71	-17.59	15.41	6.77 ↓	8.50	9.67	0.04	-0.44	0.15
欧州	8.32	-8.54	25.60	4.71 ↓	6.49 ↓	10.05	0.59	-0.27	0.23
イギリス	3.41	-13.36	-	7.42 ↓	10.17	-	0.16	-0.28	-
アジア・オセアニア	-1.37	-13.14	42.34	7.01	8.39	11.01	-0.06	-0.33	0.32
オーストラリア	-1.59	-13.43	39.55	7.03	8.48	11.31	-0.07	-0.33	0.30
ニュージーランド	0.35	-5.08	-	8.33	9.69	-	0.02	-0.10	-
複合地域	7.56	-6.80	33.75	4.57 ↓	6.75	9.82	0.55	-0.20	0.30
エマージング債券	9.28	-4.42	46.45	9.06 ↑	10.80	12.91	0.34	-0.08	0.30
グローバル	8.05	-5.42	49.12	9.26	10.60	12.76	0.29	-0.10	0.32
米ドル建て	8.04	-4.27	52.93	9.21	10.73	12.92	0.29	-0.08	0.33
現地通貨建て	8.20	-12.36	27.65	10.03 ↑	10.48	12.10	0.27	-0.25	0.20
その他	10.52	-4.21	38.41	9.34 ↑	11.89	13.86	0.37	-0.07	0.24
ロシア	30.32	23.19	42.76	15.29	24.03	21.59	0.61	0.18	0.17
アジア・オセアニア	8.65	4.20	65.33	4.03 ↓	6.08	8.84	0.71	0.14	0.58
インド	8.85	9.88	-	8.09 ↓	9.50	-	0.36	0.20	-
インドネシア	12.79	3.51	-	11.36	13.27	-	0.37	0.05	-
ブラジル	8.89	-4.01	37.19	18.19 ↑	19.91	18.07	0.16	-0.04	0.18
メキシコ	24.74	-19.75	-	14.57	14.68	-	0.53	-0.29	-
南アフリカ	11.84	-10.54	-	20.44	19.25	-	0.19	-0.11	-
トルコ	-26.80	-53.88	-	36.07	29.48	-	-0.27	-0.49	-
複合地域	19.06	-16.76	26.87	9.04	11.09	13.29	0.67	-0.32	0.18
ハイイールド債券	9.45	2.86	88.85	7.55 ↓	9.46	12.07	0.41	0.06	0.54
グローバル	9.84	1.59	72.12	7.79	9.65	12.13	0.41	0.04	0.46
北米	10.18	5.27	99.37	7.71 ↓	9.52	11.75	0.43	0.11	0.61
その他	7.43	-1.91	87.46	8.11	9.99	15.15	0.31	-0.04	0.43
欧州	7.73	-3.00	108.02	8.88	10.74	16.49	0.29	-0.05	0.46
アジア・オセアニア	7.02	4.09	-	6.60	8.40	-	0.35	0.10	-
複合地域	11.19	0.72	84.52	6.25 ↓	8.19	11.74	0.58	0.02	0.54
複合資産	13.18	8.80	76.54	5.20 ↓	6.72	9.35	0.82	0.26	0.62
安定	9.17	4.34	59.63	3.76 ↓	4.96	7.81	0.80	0.18	0.61
安定成長	14.39	9.56	80.09	5.70 ↓	7.12	9.76	0.81	0.26	0.62
成長	19.86	17.77	107.88	8.91 ↓	10.51	12.02	0.70	0.32	0.63
国内バランス	9.09	9.56	48.33	2.39	3.33 ↓	6.80	1.26	0.56	0.59
安定	7.93	13.22	37.36	2.06	2.09	3.08	1.28	1.21	1.04
一般	16.26	12.79	64.00	7.21	8.38 ↓	9.75	0.72	0.29	0.52

※[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	17.49	9.92	86.09	8.15	9.42	11.51	0.68	0.20	0.55
国内REIT	35.26	37.69	270.09	7.92	8.59	15.92	1.34	0.77	0.88
日本	35.26	37.69	270.09	7.92	8.59	15.92	1.34	0.77	0.88
外国REIT	23.18	20.79	198.17	11.45 ↓	13.15	15.93	0.63	0.29	0.72
グローバル	20.87	14.15	171.27	11.41 ↓	12.85	15.60	0.58	0.21	0.67
除く日本	28.81	24.86	193.39	11.38 ↓	12.96	15.61	0.78	0.35	0.73
含む日本	19.75	12.88	169.13	11.41 ↓	12.85	15.62	0.55	0.19	0.66
北米	24.02	25.35	235.75	12.38 ↓	14.16	17.45	0.61	0.33	0.74
その他	34.02	29.55	219.82	9.46 ↓	11.42	15.09	1.09	0.47	0.82
欧州	22.97	5.63	18.66	13.00	15.14	20.09	0.55	0.07	0.08
アジア・オセアニア	41.52	37.59	230.31	9.80	11.73	14.87	1.26	0.56	0.85
オーストラリア	21.12	19.54	148.58	11.60 ↓	13.52	16.71	0.57	0.27	0.57
複合地域	14.01	-3.04	97.27	13.98	15.06	17.94	0.32	-0.04	0.39
複数国	29.97	39.26	302.54	10.37	11.75	15.47	0.89	0.58	0.96
その他									
絶対収益型	1.74	-3.18	-4.99	2.10	1.98	3.47	0.30	-0.31	-0.16
ロング・ショート	2.44	-3.16	-0.20	3.36	3.06	3.60	0.26	-0.20	-0.01
マーケットニュートラル	5.30	12.22	37.19	3.81 ↓	5.52	5.21	0.47	0.43	0.61
GTAA	2.94	3.59	12.53	2.54	2.22	2.66	0.40	0.33	0.44
その他スタイル	0.40	-4.12	-9.84	2.05	2.14	5.19	0.09	-0.38	-0.20
CB	7.70	1.42	35.58	4.83 ↓	6.44	9.65	0.53	0.05	0.32
アジア・オセアニア	13.71	14.30	64.81	8.57	10.72	11.17	0.52	0.25	0.46
日本	0.81	12.84	52.99	4.60	5.34	6.09	0.07	0.46	0.71
グローバル	8.02	1.31	38.11	4.83 ↓	6.38	10.11	0.55	0.04	0.32
コモディティ	3.79	-30.72	-18.64	8.14 ↓	11.96	14.55	0.16	-0.59	-0.14
全業種	-4.04	-37.13	-26.12	11.13 ↓	14.00	15.23	-0.12	-0.63	-0.20
貴金属	13.45	-3.13	23.58	8.62 ↑	9.80	16.69	0.50	-0.06	0.13
エネルギー	16.51	-43.33	-37.90	26.08	27.92	24.96	0.20	-0.38	-0.19
その他コモディティ	-7.07	-26.60	11.09	12.36	14.28	17.72	-0.19	-0.42	0.06

※[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

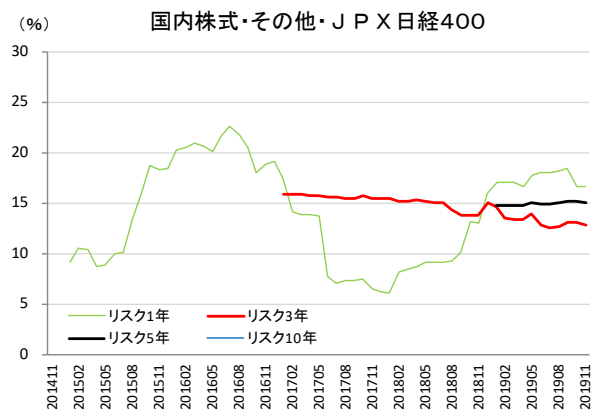
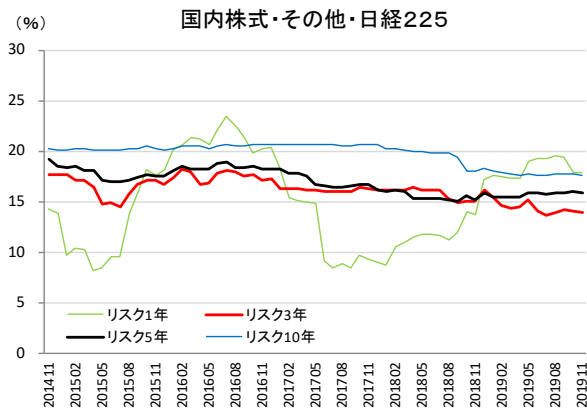
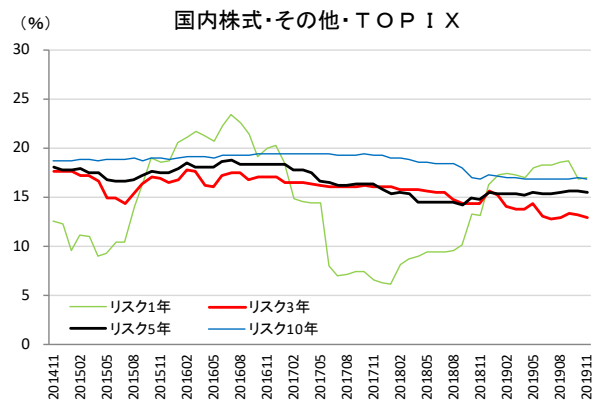
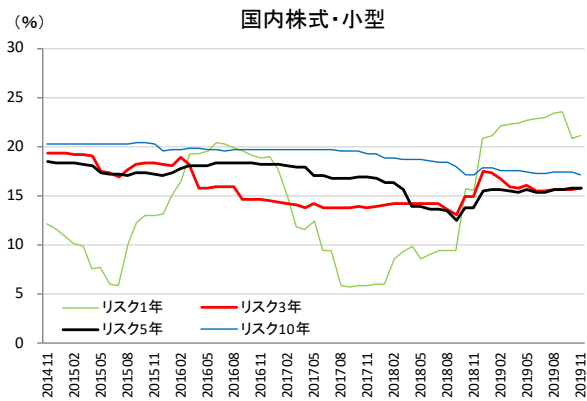
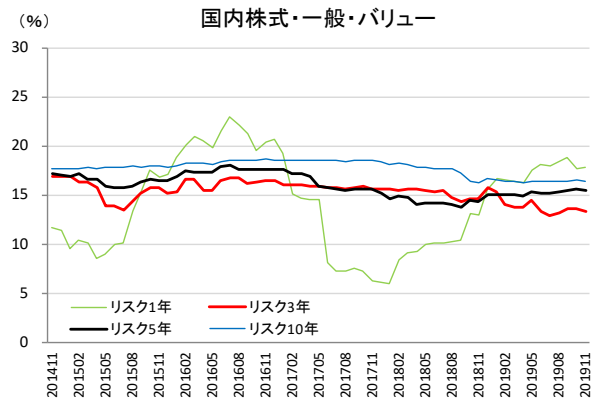
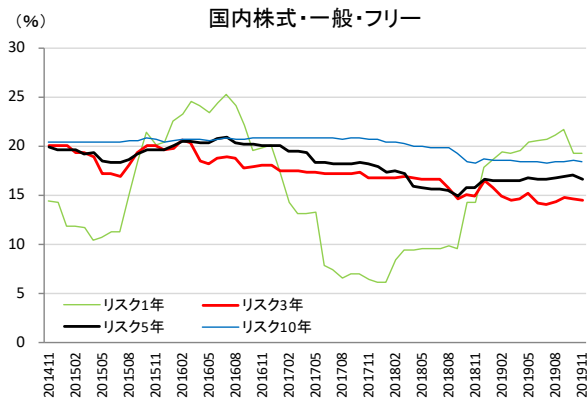


<2> リスク・サマリー

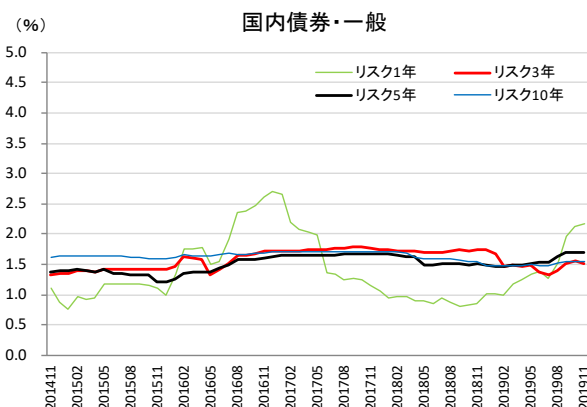
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

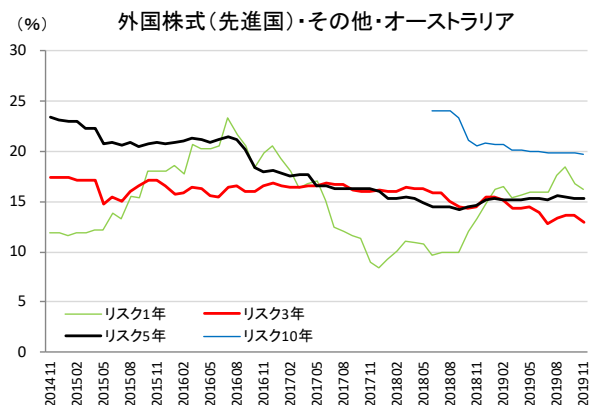
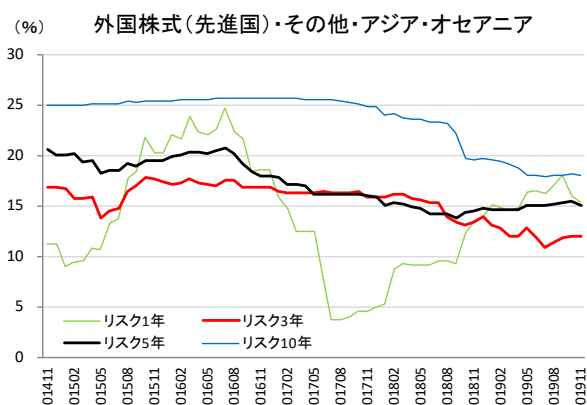
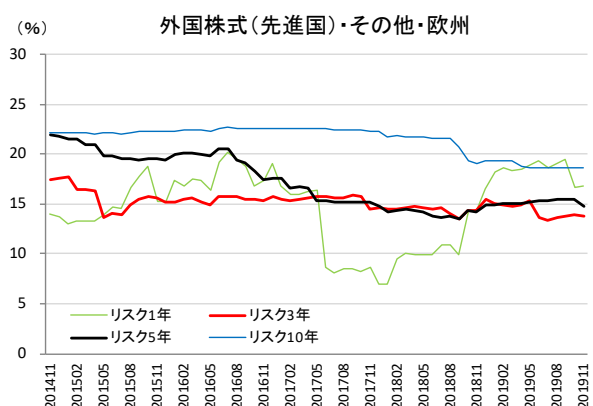
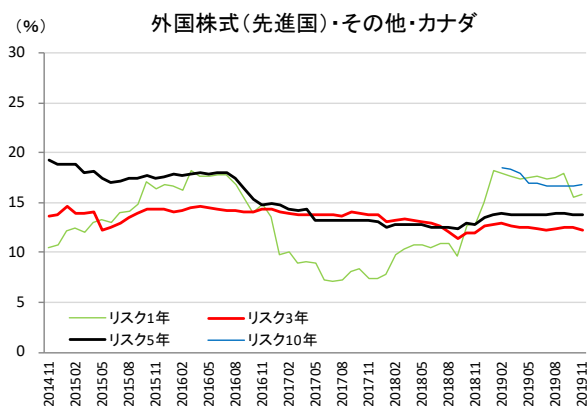
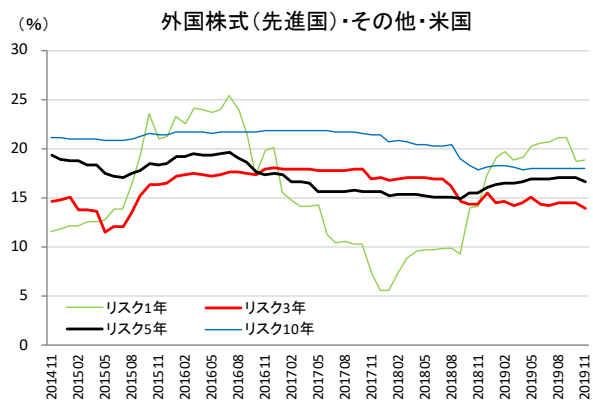
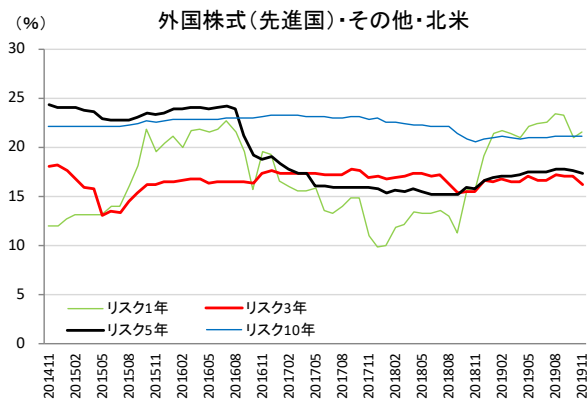
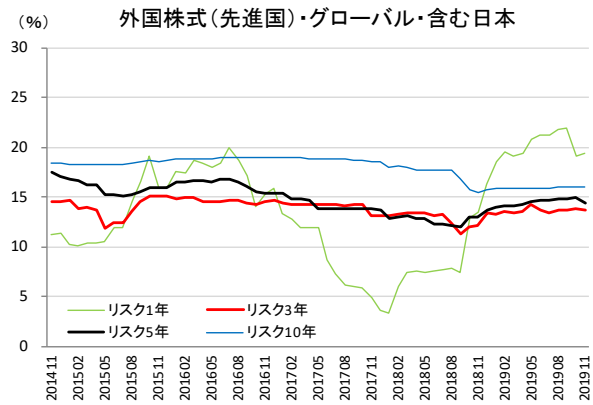
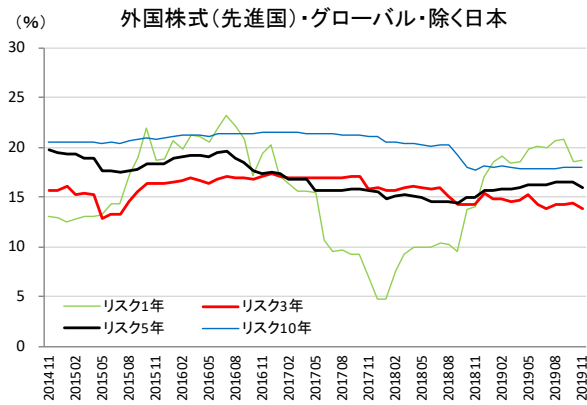


<2> リスク・サマリー

(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)]

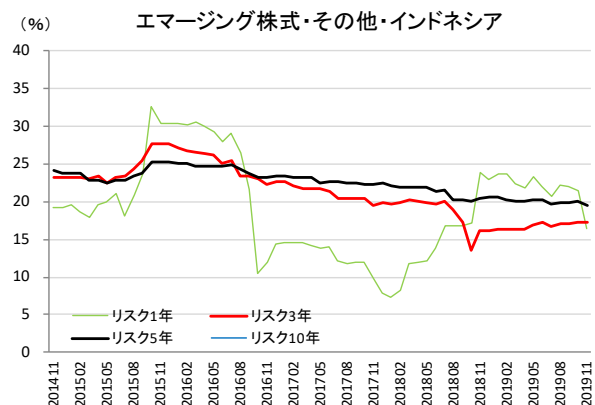
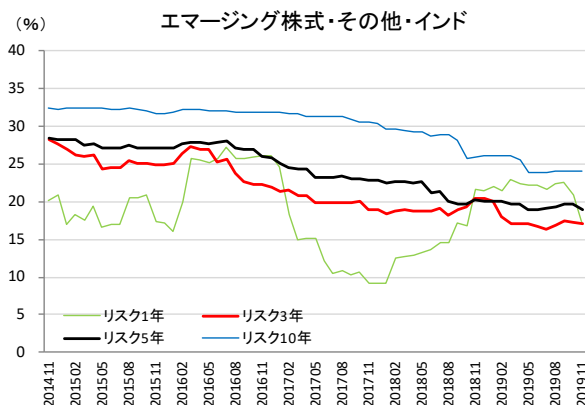
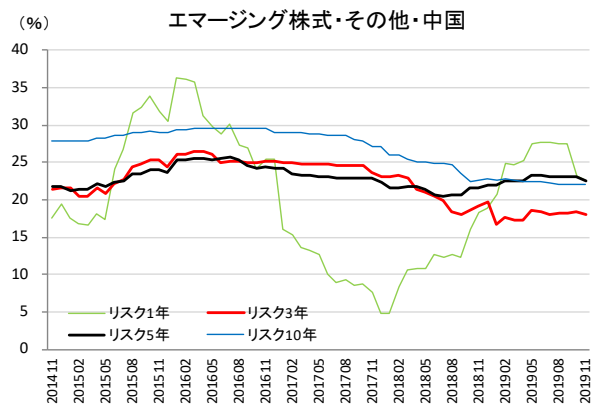
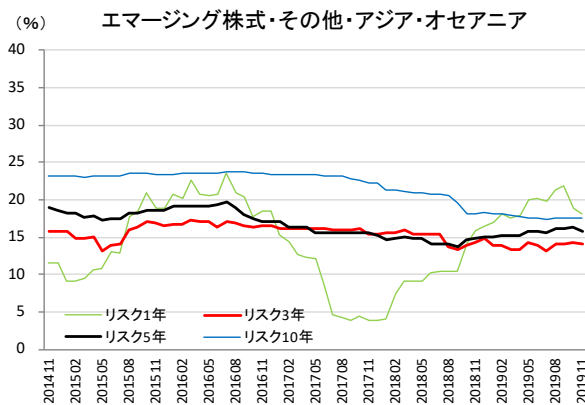
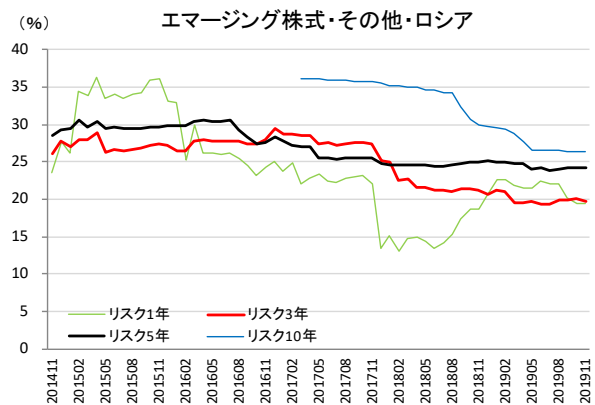
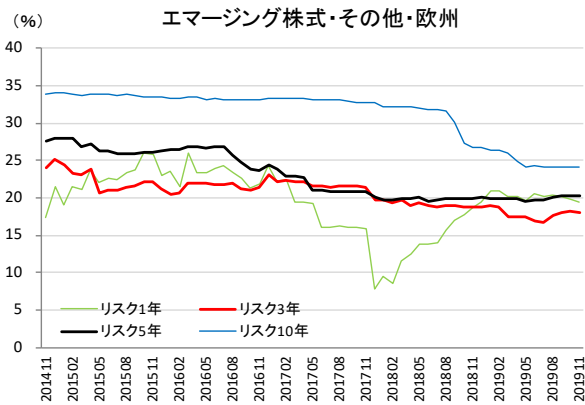
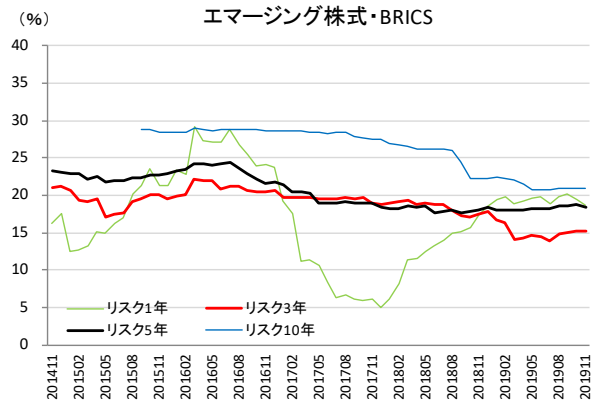
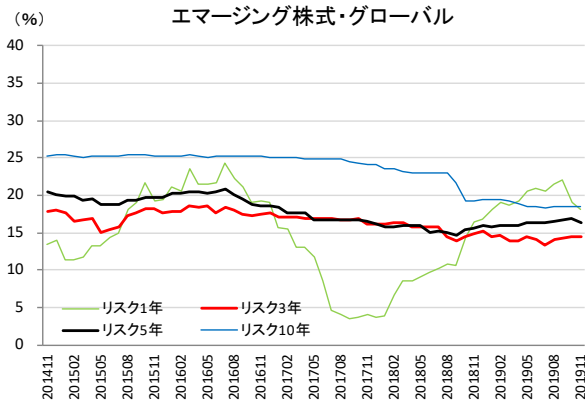


<2> リスク・サマリー

(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]

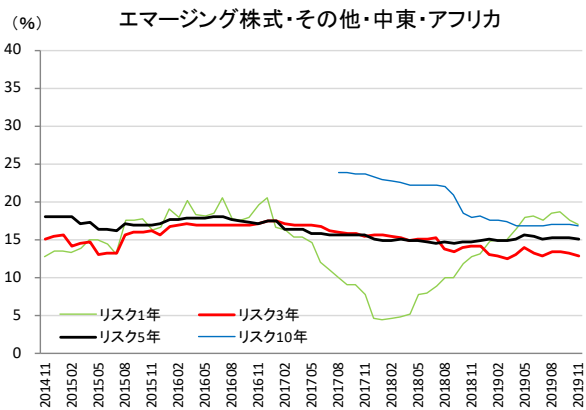
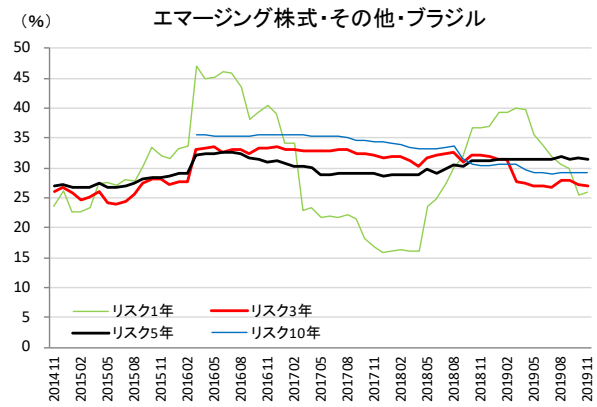
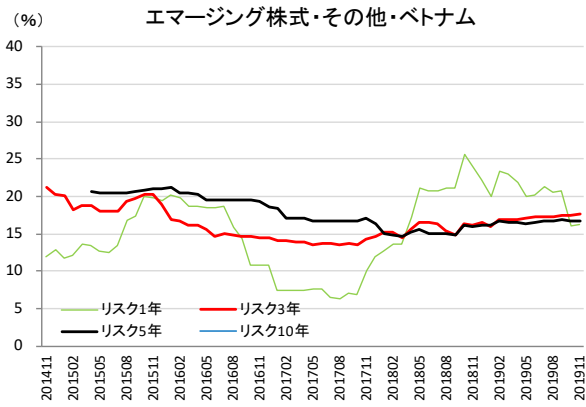
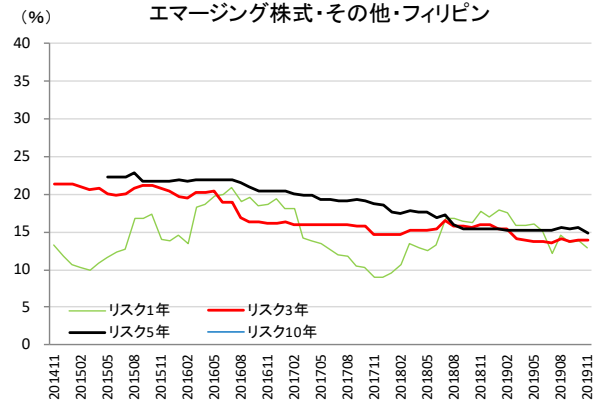
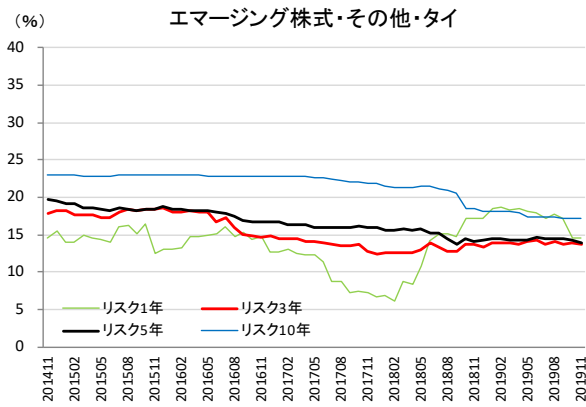


<2> リスク・サマリー

(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]

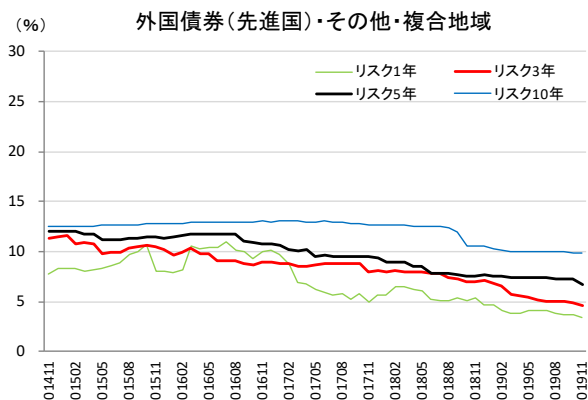
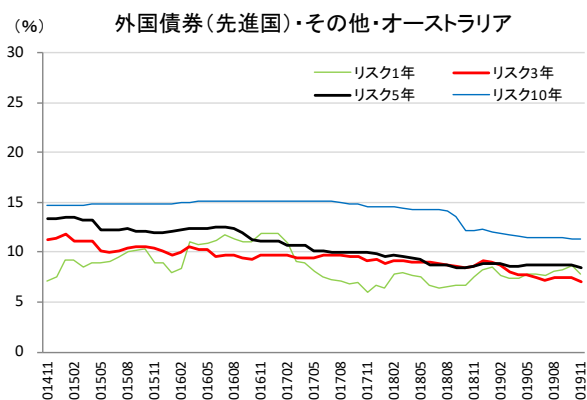
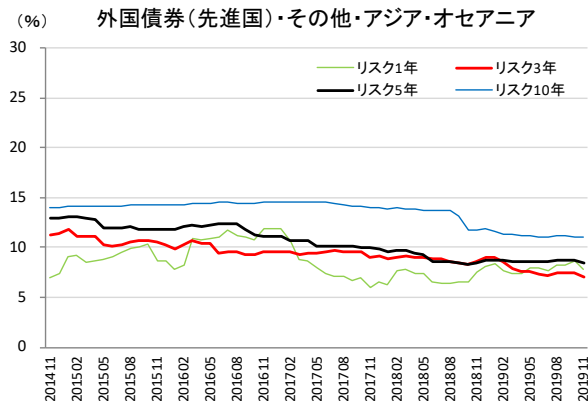
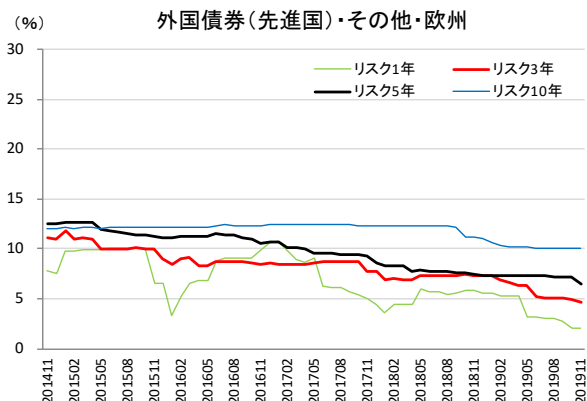
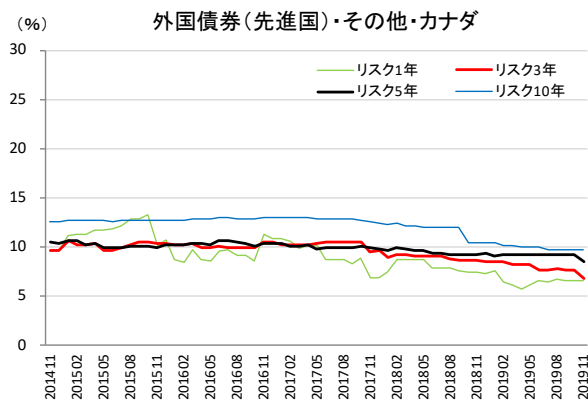
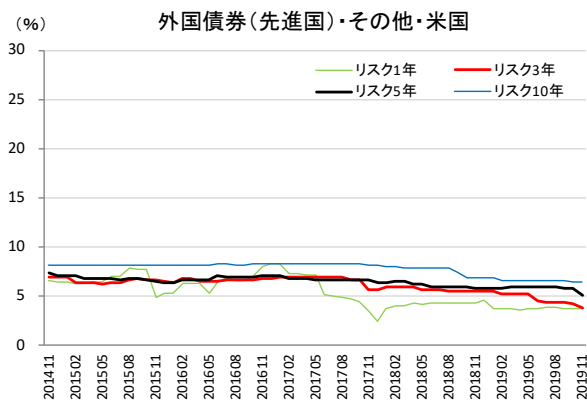
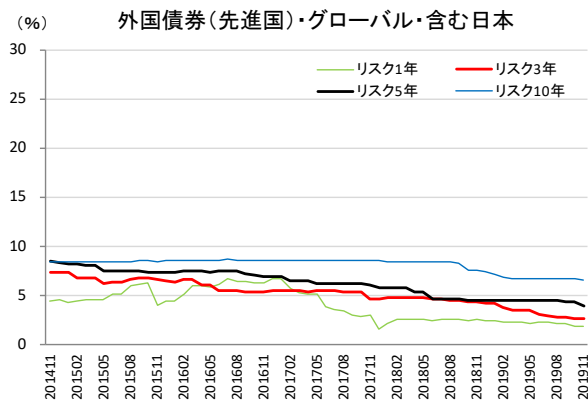
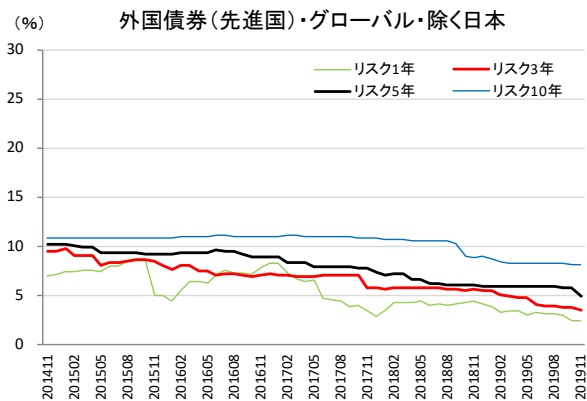


<2> リスク・サマリー

(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)]

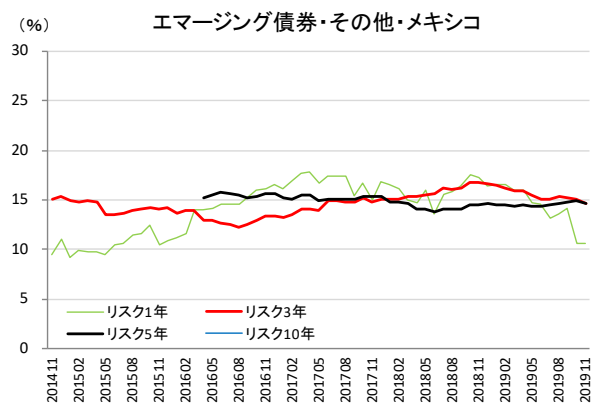
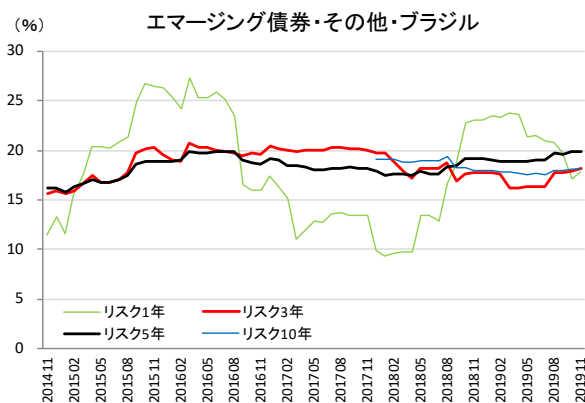
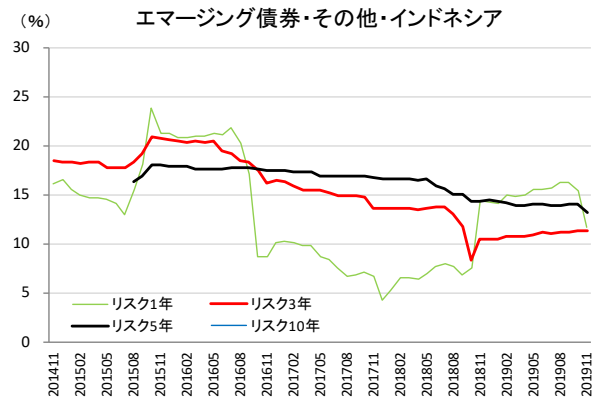
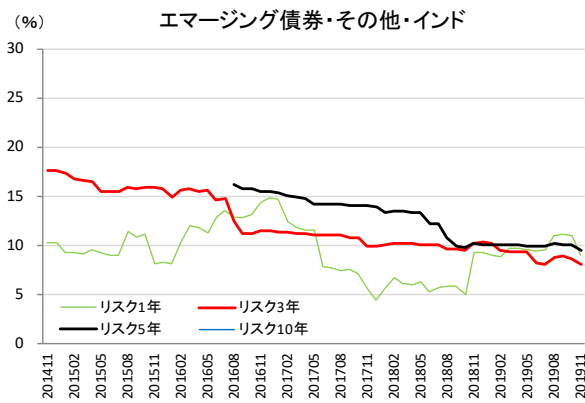
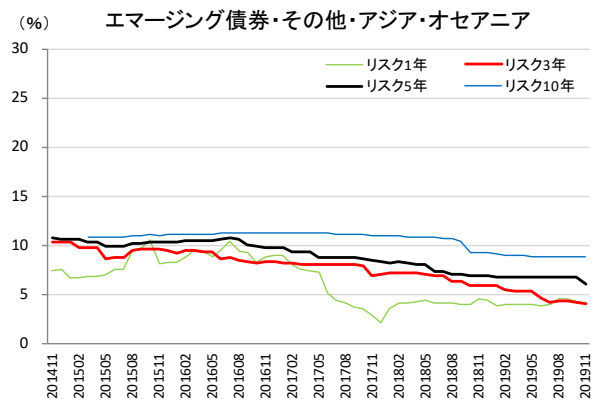
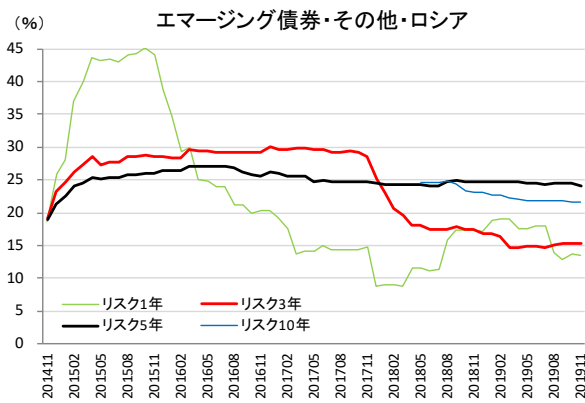
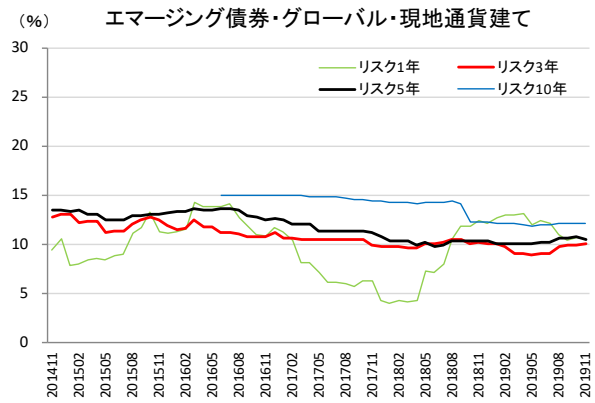
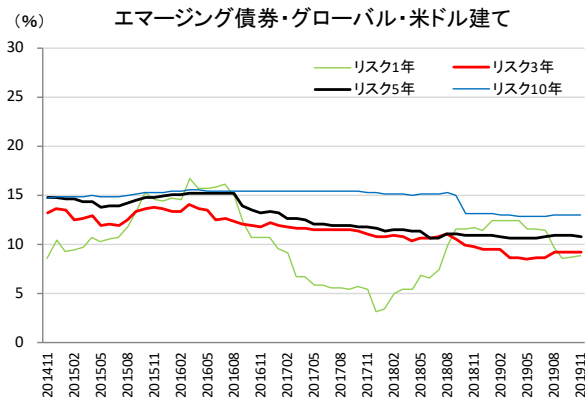


<2> リスク・サマリー

(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]

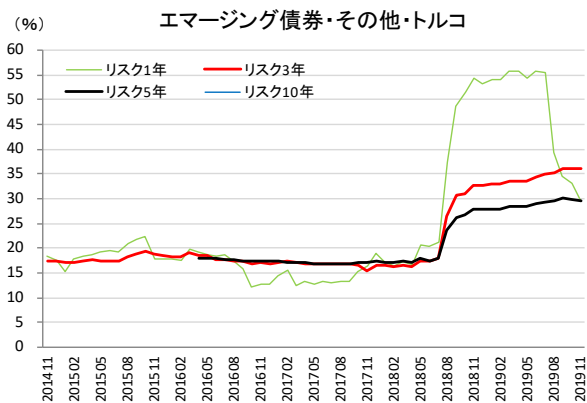


<2> リスク・サマリー

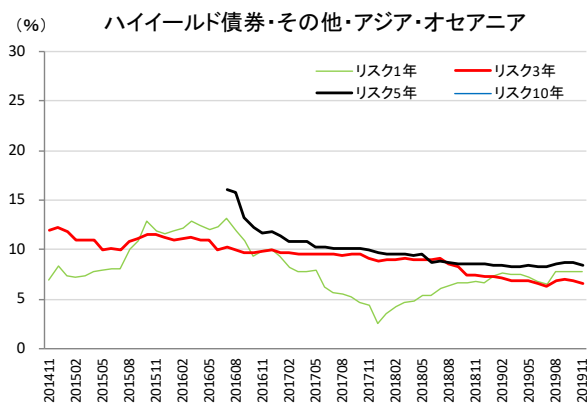
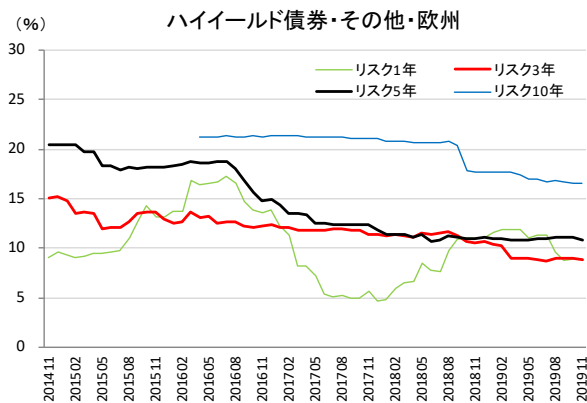
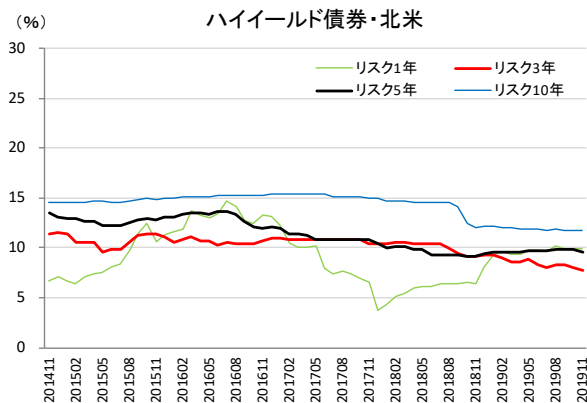
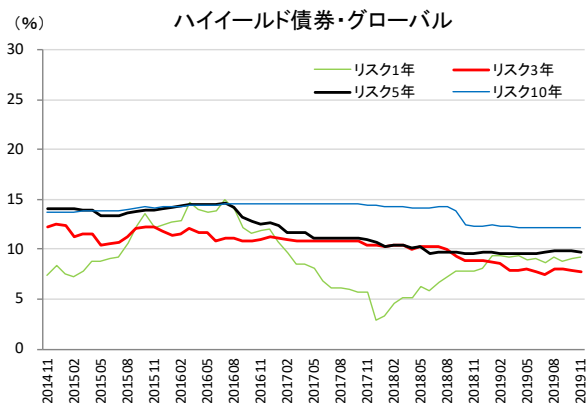
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

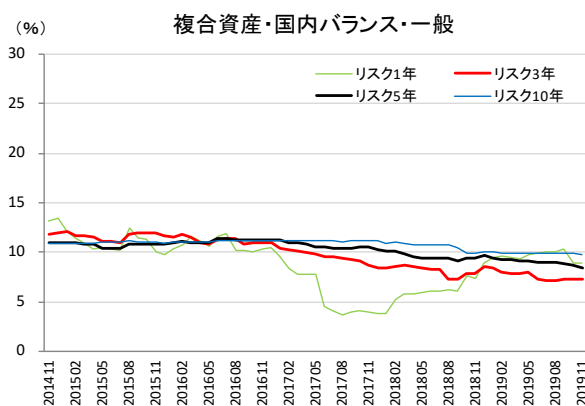
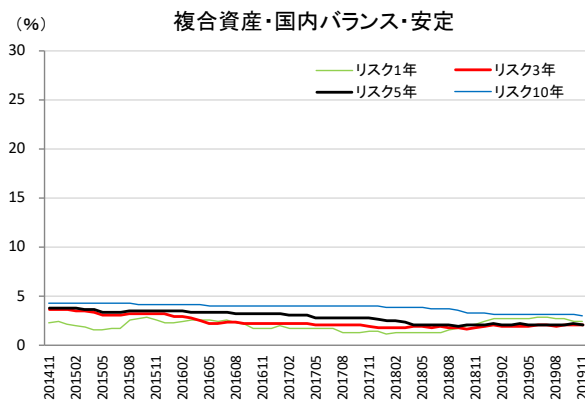
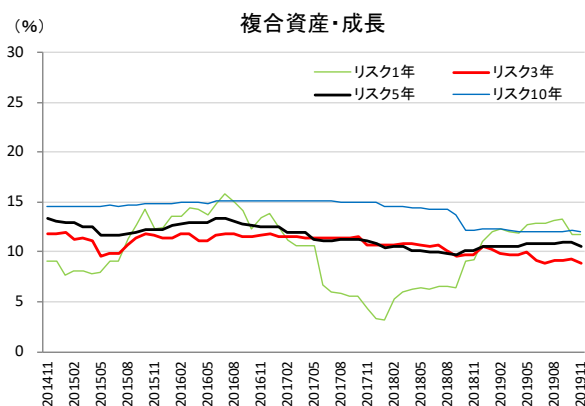
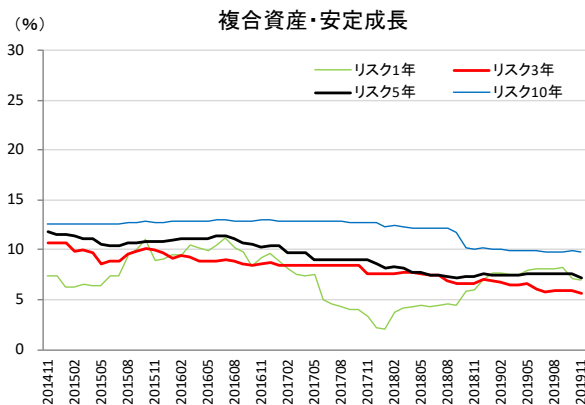
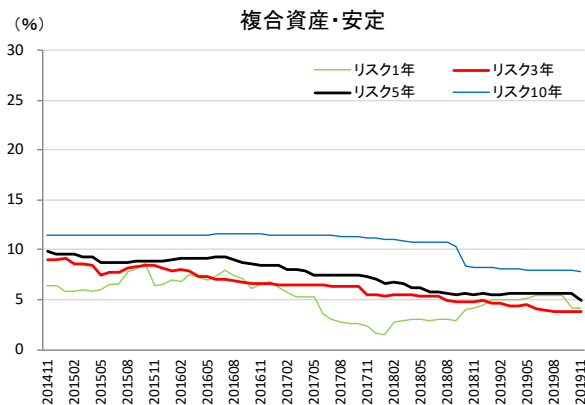


<2> リスク・サマリー

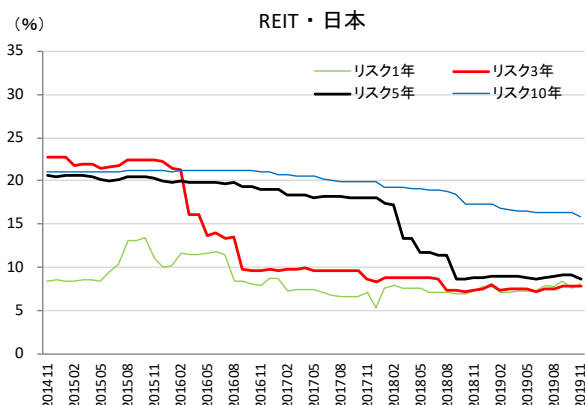
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]



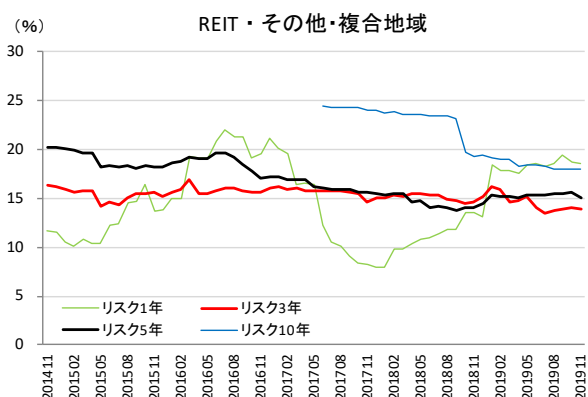
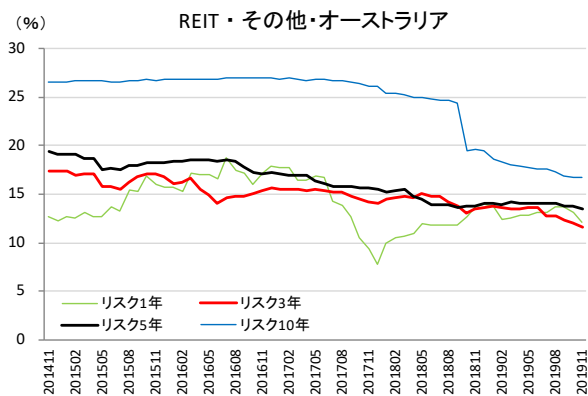
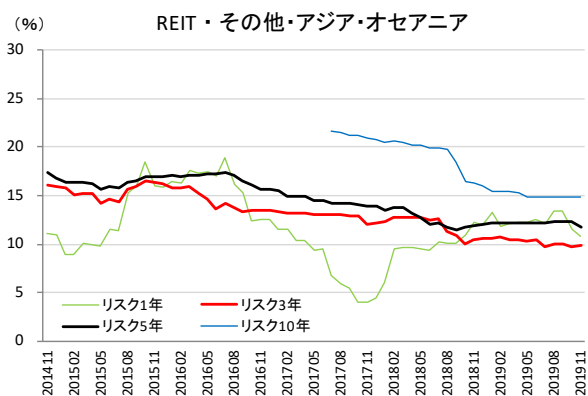
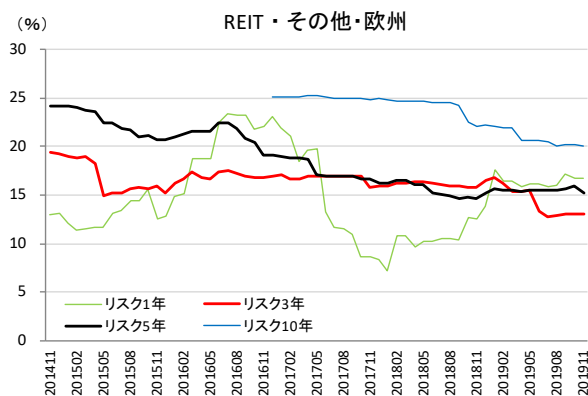
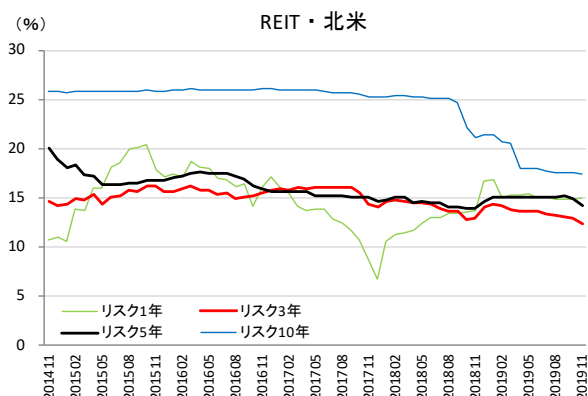
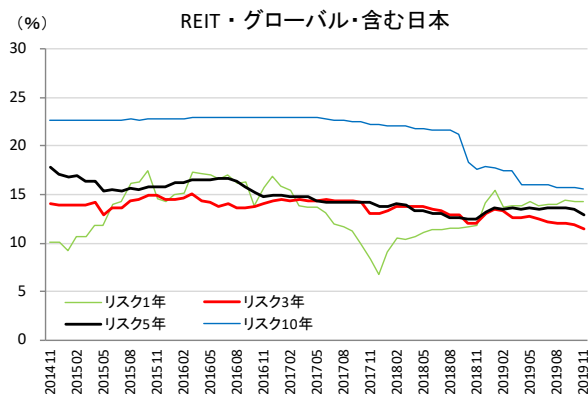
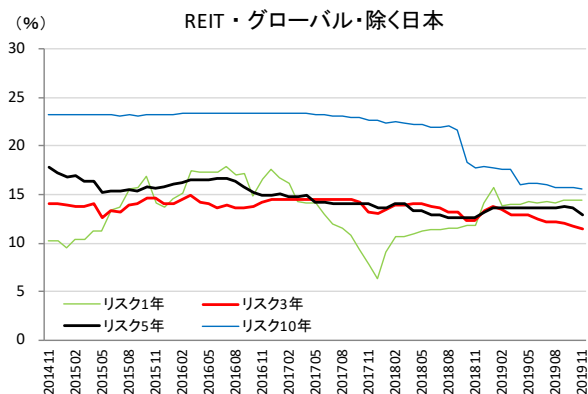


<2> リスク・サマリー

(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]

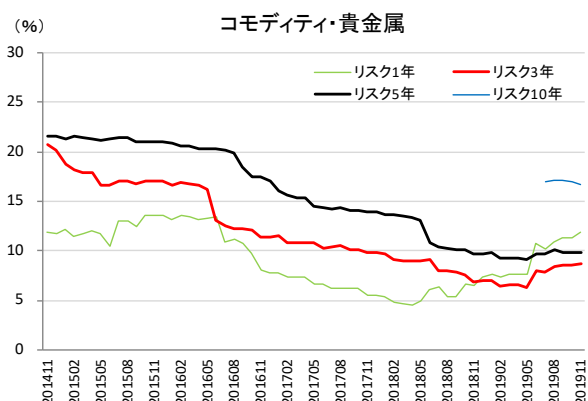
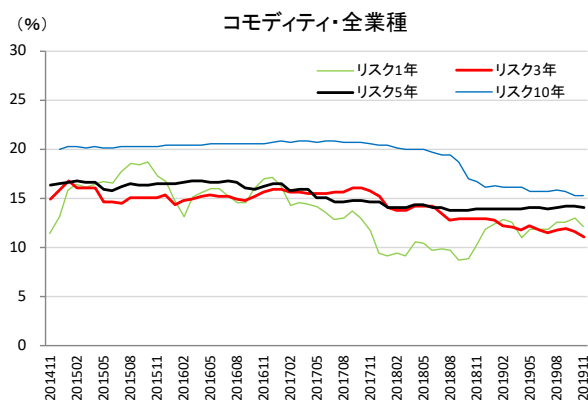
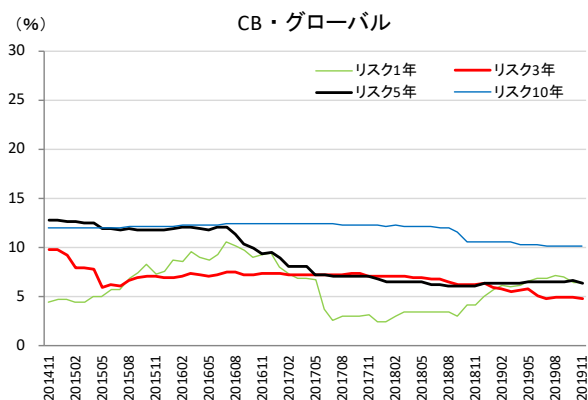
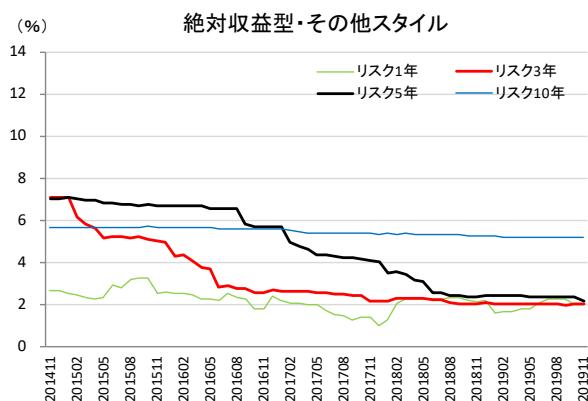
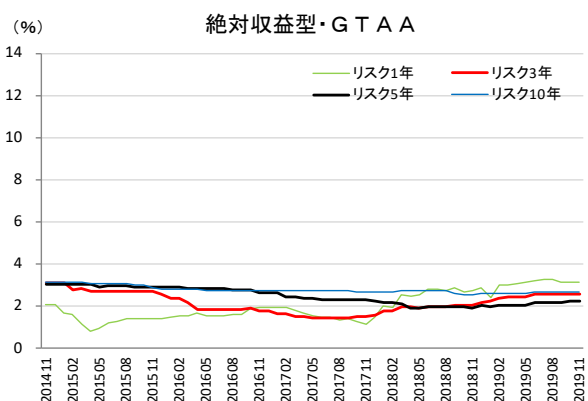
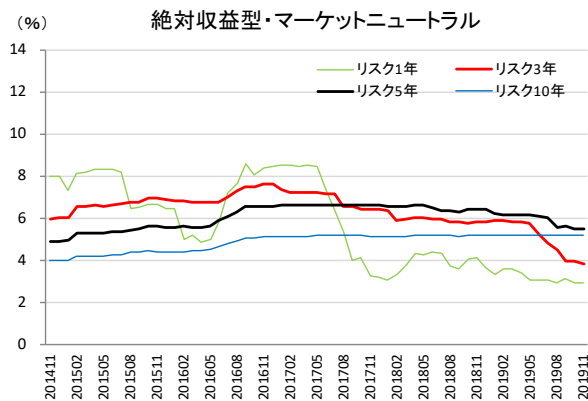
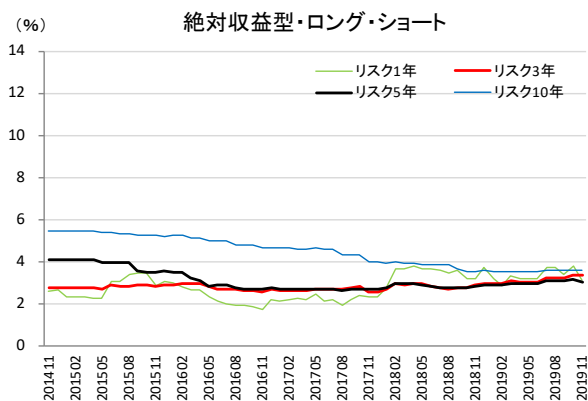


<2>リスク・サマリー

(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	-3,438	-4,283	840	-4,189
国内株式	-3,205	-7,974	-8,862	-9,546
一般	-1,702	-3,353	-4,564	-5,857
フリー	-1,563	-3,097	-4,224	-5,323
バリュー	-138	-256	-340	-534
小型	-374	-856	-1,383	-1,641
その他	-1,117	-3,739	-2,872	-1,980
日経225	-860	-3,298	-2,681	-2,307
TOPIX	-167	-165	74	584
JPX日経400	-50	-131	-126	-123
国内債券	243	395	452	526
一般	243	395	452	526
外国株式(先進国)	-1,129	-54	3,571	3,276
グローバル	-1,546	-998	2,057	2,667
除く日本	105	631	1,208	2,099
含む日本	-1,651	-1,629	849	568
その他	418	944	1,514	609
北米	4	19	42	71
米国	421	954	1,540	996
カナダ	-17	-32	-52	-111
欧州	-42	-103	-198	-405
ドイツ	-1	-1	-2	-2
イギリス	-1	-2	-5	-7
アジア・オセアニア	-2	-9	-16	-48
オーストラリア	56	118	205	116
ニュージーランド	0	0	0	1
複合地域	0	0	-1	-2
エマージング株式	-744	-1,654	-3,091	-5,578
グローバル	-175	-485	-1,237	-2,327
BRICS	-12	-25	-37	-81
その他	-558	-1,144	-1,817	-3,169
欧州	-5	-7	-18	-57
ロシア	-3	-7	-13	-32
アジア・オセアニア	-113	-299	-571	-1,020
中国	-152	-353	-531	-704
インド	-317	-528	-753	-1,536
インドネシア	-1	-3	-12	-39
タイ	-2	-4	-9	-20
フィリピン	-2	-8	-21	-55
ベトナム	31	36	31	212
韓国	-1	-1	-2	3
香港	0	0	1	0
台湾	0	0	0	0
中南米	-1	-4	-7	-17
ブラジル	11	39	56	79
メキシコ	0	-1	-1	-3
中東・アフリカ	-1	0	41	34
トルコ	-1	-2	-5	-10
複合地域	0	0	-1	-2

## &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か月	6か月	1年
総合	-3,438	-4,283	840	-4,189
外国債券(先進国)	-536	-822	-1,475	-4,578
グローバル	-448	-705	-1,527	-3,923
除く日本	-275	-454	-1,114	-1,891
含む日本	-173	-251	-413	-2,032
その他	-89	-117	52	-655
北米	-1	-4	-7	-24
米国	40	257	673	616
カナダ	-36	-96	-159	-344
欧州	94	219	362	659
イギリス	-1	-2	-3	-7
アジア・オセアニア	-43	-126	-237	-556
オーストラリア	-124	-314	-489	-798
ニュージーランド	-3	-9	-13	-38
複合地域	-17	-42	-73	-162
エマージング債券	-147	-535	-764	-856
グローバル	15	-28	-69	-288
米ドル建て	17	-25	-60	-334
現地通貨建て	-2	-3	-9	46
その他	-162	-507	-695	-569
ロシア	-9	-38	-68	-130
アジア・オセアニア	-4	-9	-12	-50
インド	-74	-134	-156	-356
インドネシア	-24	-37	-46	-71
ブラジル	-5	-44	-101	-248
メキシコ	-29	-67	-76	-95
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	-6	-13	-16	-13
複合地域	0	-1	-2	-5
ハイイールド債券	-162	-576	-931	-2,595
グローバル	-6	-54	-127	-393
北米	-117	-384	-558	-1,519
その他	-39	-138	-246	-683
欧州	-30	-102	-190	-510
アジア・オセアニア	-7	-26	-38	-139
複合地域	0	-1	-2	-4
複合資産	999	3,607	5,915	8,993
安定	288	931	1,159	1,267
安定成長	410	1,573	2,390	3,394
成長	-69	103	432	769
国内バランス	370	1,000	1,933	3,563
安定	388	1,076	2,018	3,634
一般	-12	-49	-55	-49

## ＜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	-3,438	-4,283	840	-4,189
国内REIT	-358	-102	643	1,507
日本	-358	-102	643	1,507
外国REIT	691	1,308	1,852	450
グローバル	251	524	946	794
除く日本	83	185	365	774
含む日本	167	339	582	19
北米	408	719	782	-741
その他	33	64	124	397
欧州	-6	-16	-29	-67
アジア・オセアニア	43	73	88	534
オーストラリア	2	23	89	-12
複合地域	0	-1	-1	-1
複数国	-5	-15	-24	-56
その他	909	2,124	3,530	4,211
絶対収益型	98	216	197	59
ロング・ショート	-16	-42	-174	-321
マーケットニュートラル	-8	-36	-75	-8
GTAA	-5	-17	-32	-58
その他スタイル	127	310	479	446
CB	-55	-112	-186	-314
アジア・オセアニア	0	-3	-3	-3
日本	-1	-4	-7	-11
グローバル	-53	-106	-175	-298
コモディティ	27	47	42	274
全業種	-1	5	22	42
貴金属	28	41	16	230
エネルギー	0	0	2	0
その他コモディティ	0	1	2	2

## &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①

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	651,052	100.00	5,459	100.00
国内株式	103,177	15.85	885	16.21
一般	61,796	9.49	583	10.68
フリー	49,132	7.55	463	8.48
バリュー	12,664	1.95	120	2.20
小型	9,894	1.52	93	1.70
その他	30,736	4.72	201	3.68
日経225	14,905	2.29	69	1.26
TOPIX	13,400	2.06	75	1.37
JPX日経400	756	0.12	20	0.37
国内債券	34,118	5.24	135	2.47
一般	34,118	5.24	135	2.47
外国株式(先進国)	158,396	24.33	984	18.03
グローバル	123,438	18.96	624	11.43
除く日本	27,108	4.16	172	3.15
含む日本	96,329	14.80	452	8.28
その他	34,959	5.37	360	6.59
北米	426	0.07	13	0.24
米国	26,201	4.02	241	4.41
カナダ	335	0.05	3	0.05
欧州	1,654	0.25	58	1.06
ドイツ	27	0.00	1	0.02
イギリス	20	0.00	2	0.04
アジア・オセアニア	92	0.01	8	0.15
オーストラリア	6,184	0.95	32	0.59
ニュージーランド	14	0.00	1	0.02
複合地域	7	0.00	1	0.02
エマージング株式	31,260	4.80	362	6.63
グローバル	8,111	1.25	102	1.87
BRICS	694	0.11	8	0.15
その他	22,455	3.45	252	4.62
欧州	228	0.04	9	0.16
ロシア	126	0.02	5	0.09
アジア・オセアニア	6,295	0.97	111	2.03
中国	2,051	0.32	29	0.53
インド	10,849	1.67	30	0.55
インドネシア	191	0.03	8	0.15
タイ	88	0.01	4	0.07
フィリピン	82	0.01	5	0.09
ベトナム	1,153	0.18	9	0.16
韓国	3	0.00	1	0.02
香港	10	0.00	1	0.02
台湾	1	0.00	1	0.02
中南米	76	0.01	2	0.04
ブラジル	1,021	0.16	20	0.37
メキシコ	21	0.00	3	0.05
中東・アフリカ	160	0.02	8	0.15
トルコ	79	0.01	4	0.07
複合地域	22	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	651,052	100.00	5,459	100.00
外国債券(先進国)	85,113	13.07	855	15.66
グローバル	61,956	9.52	556	10.19
除く日本	33,001	5.07	241	4.41
含む日本	28,955	4.45	315	5.77
その他	23,156	3.56	299	5.48
北米	94	0.01	6	0.11
米国	6,515	1.00	163	2.99
カナダ	1,323	0.20	7	0.13
欧州	1,739	0.27	35	0.64
イギリス	31	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	2,360	0.36	12	0.22
オーストラリア	9,358	1.44	43	0.79
ニュージーランド	169	0.03	14	0.26
複合地域	1,567	0.24	11	0.20
エマージング債券	18,958	2.91	299	5.48
グローバル	8,861	1.36	191	3.50
米ドル建て	7,151	1.10	150	2.75
現地通貨建て	1,710	0.26	41	0.75
その他	10,097	1.55	108	1.98
ロシア	225	0.03	5	0.09
アジア・オセアニア	504	0.08	19	0.35
インド	4,460	0.69	22	0.40
インドネシア	579	0.09	11	0.20
ブラジル	3,114	0.48	25	0.46
メキシコ	536	0.08	9	0.16
南アフリカ	3	0.00	1	0.02
トルコ	174	0.03	6	0.11
複合地域	52	0.01	1	0.02
ハイイールド債券	22,343	3.43	320	5.86
グローバル	3,462	0.53	64	1.17
北米	14,702	2.26	163	2.99
その他	4,180	0.64	93	1.70
欧州	3,291	0.51	51	0.93
アジア・オセアニア	776	0.12	32	0.59
複合地域	47	0.01	1	0.02
複合資産	98,810	15.18	990	18.14
安定	28,245	4.34	295	5.40
安定成長	46,799	7.19	419	7.68
成長	13,327	2.05	243	4.45
国内バランス	10,438	1.60	33	0.60
安定	9,850	1.51	9	0.16
一般	472	0.07	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	651,052	100.00		5,459	100.00
国内REIT	31,107	4.78		122	2.23
日本	31,107	4.78		122	2.23
外国REIT	50,213	7.71		293	5.37
グローバル	19,686	3.02		135	2.47
除く日本	4,060	0.62		48	0.88
含む日本	15,626	2.40		87	1.59
北米	25,356	3.89		88	1.61
その他	5,170	0.79		70	1.28
欧州	280	0.04		18	0.33
アジア・オセアニア	3,636	0.56		34	0.62
オーストラリア	877	0.13		13	0.24
複合地域	52	0.01		3	0.05
複数国	324	0.05		2	0.04
その他	17,557	2.70		214	3.92
絶対収益型	7,407	1.14		96	1.76
ロング・ショート	907	0.14		30	0.55
マーケットニュートラル	1,111	0.17		15	0.27
GTAA	419	0.06		14	0.26
その他スタイル	4,971	0.76		37	0.68
CB	1,477	0.23		45	0.82
アジア・オセアニア	39	0.01		1	0.02
日本	64	0.01		3	0.05
グローバル	1,374	0.21		41	0.75
コモディティ	1,923	0.30		27	0.49
全業種	868	0.13		14	0.26
貴金属	1,024	0.16		11	0.20
エネルギー	22	0.00		1	0.02
その他コモディティ	9	0.00		1	0.02



## &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	11,853	8.2	3.76	3.90	1.302
国内株式	14,824	11.2	1.14	1.32	1.183
一般	13,640	10.8	1.54	1.84	1.432
フリー	13,312	10.3	1.83	2.22	1.479
バリュー	14,907	12.8	0.52	0.52	1.250
小型	20,884	11.8	0.85	0.88	1.744
その他	15,600	12.1	0.49	0.47	0.490
日経225	16,208	13.7	0.47	0.45	0.584
TOPIX	16,322	13.4	0.34	0.33	0.337
JPX日経400	13,973	5.3	0.04	0.04	0.555
国内債券	11,147	10.3	0.35	0.35	0.358
一般	11,147	10.3	0.35	0.35	0.358
外国株式(先進国)	12,956	6.7	3.75	3.97	1.602
グローバル	13,613	7.1	2.76	2.94	1.577
除く日本	16,596	9.2	0.91	0.95	0.765
含む日本	12,478	6.2	3.26	3.48	1.805
その他	11,816	6.0	7.06	7.43	1.693
北米	11,184	6.6	6.07	5.94	1.927
米国	12,451	5.4	5.26	5.08	1.654
カナダ	7,018	7.7	17.29	20.08	1.992
欧州	11,623	8.5	3.14	3.25	1.706
ドイツ	10,865	5.7	0.00	0.00	0.770
イギリス	5,648	5.5	15.33	18.89	1.945
アジア・オセアニア	9,737	5.6	4.58	4.89	1.701
オーストラリア	9,092	5.4	15.00	17.60	1.827
ニュージーランド	14,017	7.3	3.05	2.85	1.672
複合地域	7,502	6.6	0.00	0.00	1.705
エマージング株式	11,934	8.8	2.93	3.30	1.838
グローバル	11,068	6.6	2.07	2.11	1.511
BRICS	14,177	11.9	1.15	1.06	2.068
その他	12,214	9.5	3.31	3.80	1.949
欧州	9,507	13.6	0.23	0.21	1.994
ロシア	10,329	10.7	0.61	0.52	2.008
アジア・オセアニア	12,641	9.5	7.34	8.16	1.745
中国	18,266	9.8	1.34	1.19	1.966
インド	12,299	9.9	1.12	1.11	2.075
インドネシア	9,956	8.4	0.44	0.46	1.854
タイ	11,338	11.6	0.66	0.69	1.709
フィリピン	11,109	6.3	0.62	0.59	1.795
ベトナム	11,678	4.2	0.72	0.76	1.870
韓国	8,741	0.9	-	-	1.804
香港	15,055	10.3	2.02	2.06	0.858
台湾	10,732	7.0	0.00	0.00	1.661
中南米	8,073	12.9	0.00	0.00	2.041
ブラジル	6,852	9.6	11.64	17.81	1.939
メキシコ	8,335	6.0	0.00	0.00	1.917
中東・アフリカ	9,769	9.0	0.19	0.22	2.067
トルコ	6,495	13.3	0.00	0.00	2.041
複合地域	18,159	11.5	3.02	2.96	1.941

(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	11,853	8.2	3.76	3.90	1.302
外国債券(先進国)	9,867	7.9	2.82	2.97	1.138
グローバル	10,388	8.1	2.00	2.05	1.078
除く日本	11,026	10.4	1.98	2.03	0.855
含む日本	9,899	6.4	2.04	2.08	1.332
その他	8,898	7.4	4.96	5.37	1.299
北米	10,364	5.6	1.82	1.81	1.814
米国	9,586	6.1	4.99	5.12	1.379
カナダ	8,005	7.4	4.84	5.06	1.367
欧州	8,375	10.1	1.38	1.41	1.046
イギリス	7,893	5.0	3.79	3.93	1.278
アジア・オセアニア	7,675	9.1	3.14	3.41	1.422
オーストラリア	7,866	10.3	6.30	7.11	1.261
ニュージーランド	9,190	5.1	2.91	3.12	1.337
複合地域	5,718	9.9	3.92	4.08	1.191
エマージング債券	8,751	8.2	7.08	7.57	1.602
グローバル	9,020	9.0	6.59	7.05	1.586
米ドル建て	9,105	9.3	6.90	7.41	1.634
現地通貨建て	8,711	8.0	5.28	5.58	1.383
その他	8,276	6.8	7.52	8.02	1.617
ロシア	8,924	6.8	6.47	6.03	1.608
アジア・オセアニア	8,861	6.7	12.33	13.72	1.640
インド	9,198	5.1	7.65	8.15	1.701
インドネシア	7,438	7.3	7.00	6.98	1.664
ブラジル	8,613	9.8	7.72	8.56	1.591
メキシコ	6,551	7.0	6.69	6.14	1.395
南アフリカ	6,865	7.6	6.94	7.87	1.430
トルコ	3,761	6.9	8.35	8.19	1.453
複合地域	4,160	13.3	5.74	5.77	1.210
ハイイールド債券	8,661	8.3	8.86	9.59	1.700
グローバル	7,534	7.7	7.25	7.78	1.609
北米	9,522	9.6	8.54	9.18	1.702
その他	7,929	6.5	11.34	12.52	1.769
欧州	7,464	6.6	11.92	13.26	1.748
アジア・オセアニア	8,277	7.6	10.03	10.70	1.875
複合地域	4,452	15.7	5.24	5.39	1.800
複合資産	11,913	7.9	1.58	1.60	1.089
安定	11,182	7.5	0.81	0.86	1.152
安定成長	11,570	8.2	2.28	2.31	1.122
成長	13,441	7.8	0.28	0.27	0.953
国内バランス	11,553	7.9	2.18	2.14	0.945
安定	11,035	8.8	2.25	2.21	0.921
一般	11,936	9.1	0.89	0.85	1.366

(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	11,853	8.2	3.76	3.90	1.302
国内REIT	15,526	8.1	9.82	9.00	0.958
日本	15,526	8.1	9.82	9.00	0.958
外国REIT	11,394	7.0	11.21	11.56	1.570
グローバル	12,318	7.7	9.62	10.26	1.430
除く日本	14,412	6.2	6.03	6.96	1.115
含む日本	11,163	8.6	10.53	11.09	1.511
北米	10,371	6.9	12.77	12.95	1.629
その他	10,899	5.7	9.59	9.68	1.810
欧州	9,553	5.3	4.73	4.87	1.858
アジア・オセアニア	12,289	5.5	11.96	12.12	1.857
オーストラリア	9,770	5.0	4.35	4.33	1.717
複合地域	7,564	7.8	1.43	1.33	0.853
複数国	11,718	12.6	2.69	2.37	1.656
その他					
絶対収益型	10,231	5.1	0.09	0.09	1.666
ロング・ショート	10,412	5.0	0.48	0.46	1.592
マーケットニュートラル	10,319	4.3	0.09	0.09	1.240
GTAA	10,636	5.8	0.00	0.00	1.593
その他スタイル	9,897	5.2	0.02	0.02	1.781
CB	11,136	6.1	0.90	0.91	1.515
アジア・オセアニア	8,127	9.4	2.97	2.95	1.823
日本	11,093	8.6	0.18	0.19	1.054
グローバル	11,213	5.9	0.87	0.89	1.528
コモディティ	7,972	6.4	0.00	0.00	0.910
全業種	5,861	8.3	0.00	0.00	1.246
貴金属	10,262	3.9	0.00	0.00	0.625
エネルギー	9,161	10.8	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	11,153	3.2	0.00	0.00	0.506

(注1) 平均値

基準価額（円）と設定来年数（年）は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り（%）

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

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

- 本レポートに関する著作権、知的財産権等一切の権利は三菱アセット・ブレインズ株式会社（以下、MAB）に帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。
- 本レポートは、MABが信頼できると判断した情報源から入手した本レポート作成基準日現在における情報をもとに作成しておりますが、当該情報の正確性を保証するものではありません。
- MABは、本レポートの利用に関連して発生した一切の損害について何らの責任も負いません。
- 本レポート中のグラフ・数値等は、あくまでも本レポート作成基準日までの過去の実績を示すものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。
- 本レポートは、情報提供を目的としたものであり、投資信託の勧誘のために作成されたものではありません。
- MAB 投信指数「MAB-FPI」（以下、本指数）に関する著作権、知的財産権等一切の権利は MAB に帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。また、本指数を商業的に利用する場合には MAB の利用許諾が必要です。

**【照会先】**

三菱アセット・ブレインズ株式会社

コンサルティンググループ 川眞田 隆志

電話番号 : 03-6721-1013

Eメール : mab-index@mab.co.jp

〒107-0062 東京都港区南青山1丁目1番1号 新青山ビル西館8階

URL : <https://www.mab.jp/business/information/mab-fpi/>

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第1085号 助言・代理業、投資運用業

加入協会名 一般社団法人 日本投資顧問業協会