

投信指数 MAB-FPI

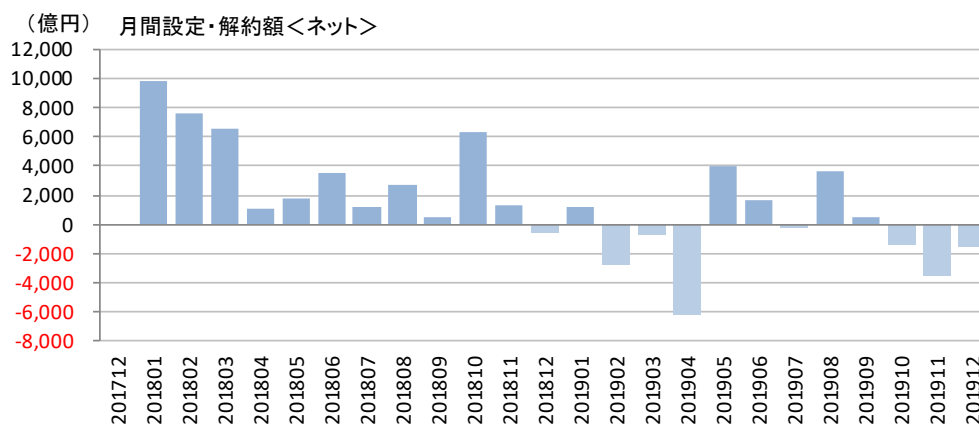
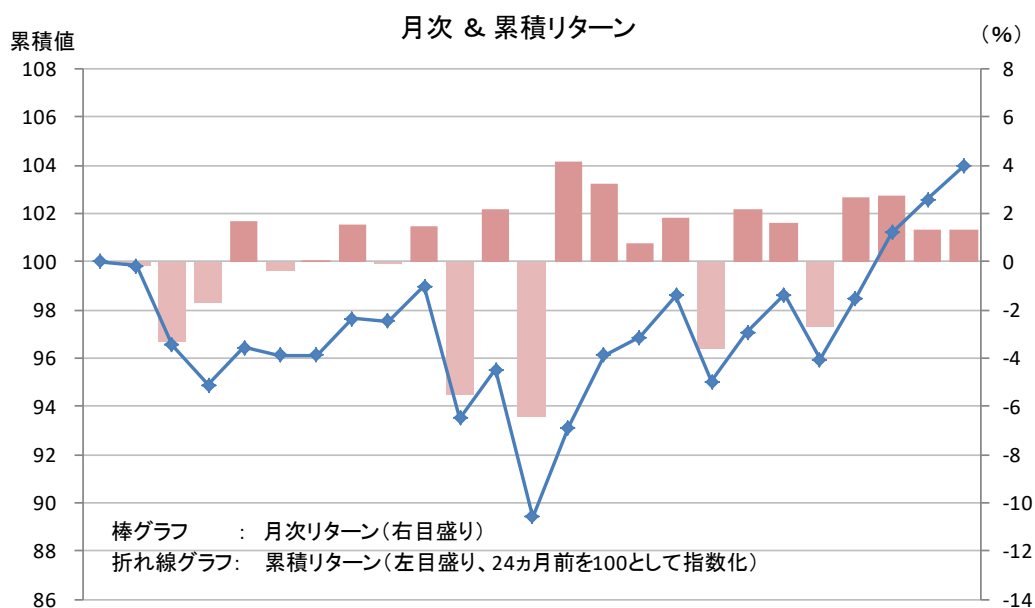
パフォーマンス・サマリー

— Vol.2 ファンド分類 詳細編 —

2019年12月

「総合」 +1.33 %

(前月 +1.36 %)



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		13,613	13,434	179	1.33
国内株式		16,586	16,304	281	1.73
一般		16,188	15,902	285	1.80
フリー		15,224	14,948	277	1.85
バリュー		20,849	20,523	326	1.59
小型		35,162	34,532	630	1.82
その他		16,226	15,983	243	1.52
日経225		15,495	15,240	255	1.68
TOPIX		16,039	15,815	225	1.42
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	15,123	14,915	208	1.39
国内債券		13,322	13,368	-45	-0.34
一般		13,322	13,368	-45	-0.34
外国株式(先進国)		15,598	15,152	446	2.94
グローバル		17,220	16,713	507	3.03
除く日本		24,291	23,548	744	3.16
含む日本		15,654	15,198	456	3.00
その他		12,265	11,951	314	2.62
北米		11,956	11,779	177	1.50
米国		18,255	17,761	494	2.78
カナダ	10,000 (2009.02.27)	17,462	17,196	266	1.55
欧州		19,314	18,572	742	4.00
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	9,173	8,973	201	2.24
イギリス	9,683 (2014.05.30)	9,195	8,904	291	3.26
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	35,629	34,481	1,148	3.33
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	16,226	15,954	272	1.71
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	36,760	34,507	2,253	6.53
複合地域	10,000 (2013.04.30)	8,757	8,190	568	6.93
エマージング株式		15,321	14,823	497	3.35
グローバル		15,459	14,667	793	5.41
BRICS	10,000 (2005.09.30)	25,521	23,945	1,575	6.58
その他		15,733	15,347	386	2.51
欧州		27,866	26,201	1,665	6.36
ロシア	10,000 (2007.03.30)	11,411	10,548	864	8.19
アジア・オセアニア		16,242	15,514	728	4.69
中国		35,870	34,315	1,555	4.53
インド	10,000 (2004.09.30)	32,962	32,898	63	0.19
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	14,359	13,329	1,030	7.73
タイ		22,455	22,869	-414	-1.81
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,261	8,237	23	0.29
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	14,399	14,572	-173	-1.19
韓国	10,000 (1997.06.30)	20,810	19,432	1,378	7.09
香港		23,849	22,618	1,230	5.44
台湾	10,000 (2008.03.31)	17,274	16,486	788	4.78
中南米	7,427 (2006.04.28)	9,244	8,387	858	10.23
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	10,794	9,720	1,075	11.06
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	9,709	9,184	525	5.72
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	9,494	9,149	344	3.77
トルコ		22,681	22,032	649	2.95
複合地域	10,000 (2005.08.31)	21,390	20,633	756	3.67

※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		13,613	13,434	179	1.33
外国債券(先進国)		17,950	17,822	129	0.72
グローバル		18,270	18,173	97	0.54
除く日本		19,509	19,407	102	0.53
含む日本		17,599	17,503	96	0.55
その他		17,038	16,832	206	1.22
北米	9,052 (2013.05.31)	10,446	10,461	-16	-0.15
米国		16,028	15,970	58	0.36
カナダ	10,000 (2003.05.30)	14,140	13,962	178	1.28
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,310	15,263	47	0.31
イギリス	10,069 (2014.07.31)	9,739	9,623	116	1.21
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	18,656	18,289	367	2.01
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	22,957	22,532	426	1.89
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,096	10,773	324	3.01
複合地域	10,000 (2001.11.30)	16,844	16,750	94	0.56
エマージング債券		17,574	17,135	439	2.56
グローバル		19,021	18,424	597	3.24
米ドル建て		19,637	19,024	613	3.22
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	13,182	12,760	422	3.30
その他	8,647 (2005.03.31)	12,901	12,653	249	1.97
ロシア	10,000 (2008.05.30)	11,994	11,496	499	4.34
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	14,487	14,393	95	0.66
インド	10,000 (2011.08.31)	15,944	15,918	26	0.16
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	13,781	13,596	184	1.36
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	13,114	12,559	555	4.42
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	12,617	11,995	622	5.19
南アフリカ	10,000 (2010.03.31)	11,510	10,673	836	7.84
トルコ	10,000 (2011.04.28)	6,067	6,160	-93	-1.51
複合地域	10,000 (2006.08.31)	11,421	10,965	457	4.17
ハイイールド債券		22,335	21,759	576	2.65
グローバル	10,000 (1997.06.30)	22,643	21,969	674	3.07
北米		21,607	21,046	561	2.67
その他	10,000 (2004.03.31)	22,716	22,223	493	2.22
欧州	10,000 (2006.04.28)	22,880	22,350	530	2.37
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,565	14,326	239	1.67
複合地域	10,000 (2004.03.31)	19,562	19,199	364	1.89
複合資産		17,715	17,587	128	0.73
安定	10,000 (1998.10.30)	15,759	15,666	94	0.60
安定成長		18,994	18,808	186	0.99
成長		21,240	20,915	326	1.56
国内バランス		13,405	13,468	-63	-0.47
安定		13,740	13,812	-72	-0.52
一般		14,669	14,594	76	0.52
その他	10,000 (2018.10.31)	12,999	13,079	-80	-0.62

※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		13,613	13,434	179	1.33
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	35,294	36,256	-963	-2.66
日本	10,000 (2003.10.31)	35,294	36,256	-963	-2.66
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	27,557	27,806	-249	-0.90
グローバル	10,000 (2004.01.30)	24,109	24,276	-167	-0.69
除く日本	10,000 (2004.04.30)	26,141	26,313	-172	-0.65
含む日本	10,000 (2004.01.30)	24,177	24,347	-170	-0.70
北米	10,000 (2003.09.30)	27,346	27,728	-382	-1.38
その他	10,000 (2004.04.30)	28,143	27,955	187	0.67
欧州	10,000 (2006.12.29)	6,068	5,892	176	2.98
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	20,871	20,737	134	0.65
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	15,655	15,508	146	0.94
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,569	7,441	129	1.73
複数国	10,000 (2004.04.30)	36,795	37,537	-742	-1.98
その他		6,003	5,929	74	1.25
絶対収益型		7,788	7,764	25	0.32
ロング・ショート		9,012	9,033	-21	-0.23
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,885	11,780	105	0.89
GTAA		10,863	10,765	98	0.91
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,296	7,278	18	0.24
CB		19,026	18,749	277	1.48
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	15,595	15,300	296	1.93
日本		20,263	20,201	62	0.31
グローバル		33,384	32,883	501	1.52
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	8,104	7,837	267	3.40
全業種	10,000 (2004.12.30)	6,644	6,430	214	3.33
貴金属	10,000 (2009.07.31)	15,088	14,588	500	3.43
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	4,983	4,744	239	5.03
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	10,512	10,097	415	4.11

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

＜1＞パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別①

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	5.56	7.08	16.25	16.25
国内株式	9.63	12.09	19.69	19.69
一般	9.78	12.02	19.59	19.59
フリー	9.90	12.14	20.57	20.57
バリュー	9.35	11.60	15.71	15.71
小型	11.32	12.03	22.06	22.06
その他	8.63	12.05	18.84	18.84
日経225	8.76	11.95	19.93	19.93
TOPIX	8.51	12.09	17.74	17.74
JPX日経400	8.33	12.21	18.15	18.15
国内債券	-1.13	-0.62	1.51	1.51
一般	-1.13	-0.62	1.51	1.51
外国株式(先進国)	11.11	10.41	27.75	27.75
グローバル	11.63	10.88	28.35	28.35
除く日本	10.80	11.08	27.43	27.43
含む日本	11.86	10.83	28.59	28.59
その他	9.28	8.78	25.69	25.69
北米	9.43	6.46	23.68	23.68
米国	10.42	10.01	28.16	28.16
カナダ	4.77	5.52	18.83	18.83
欧州	11.20	10.35	26.51	26.51
ドイツ	11.72	8.32	22.28	22.28
イギリス	8.74	6.25	10.83	10.83
アジア・オセアニア	9.82	9.37	17.58	17.58
オーストラリア	4.48	3.99	17.30	17.30
ニュージーランド	12.98	8.41	23.49	23.49
複合地域	6.29	0.91	8.26	8.26
エマージング株式	8.55	6.03	16.04	16.04
グローバル	12.88	10.43	26.18	26.18
BRICS	13.40	9.71	28.07	28.07
その他	6.89	4.36	12.15	12.15
欧州	12.71	9.64	29.09	29.09
ロシア	14.50	12.05	39.60	39.60
アジア・オセアニア	10.31	6.14	16.29	16.29
中国	12.50	14.20	39.49	39.49
インド	4.28	1.07	4.90	4.90
インドネシア	6.53	0.65	4.89	4.89
タイ	-4.15	-8.59	1.84	1.84
フィリピン	3.53	-1.66	4.85	4.85
ベトナム	-4.99	2.20	-0.08	-0.08
韓国	10.74	0.19	-5.83	-5.83
香港	11.20	1.41	12.50	12.50
台湾	15.50	20.02	21.36	21.36
中南米	14.90	9.28	21.05	21.05
ブラジル	14.94	10.04	24.89	24.89
メキシコ	10.26	8.41	12.49	12.49
中東・アフリカ	7.28	2.43	8.71	8.71
トルコ	5.14	15.82	11.56	11.56
複合地域	10.44	5.50	14.83	14.83

<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	5.56	7.08	16.25	16.25
外国債券(先進国)	1.53	1.90	5.14	5.14
グローバル	1.12	1.80	5.43	5.43
除く日本	1.21	2.18	5.33	5.33
含む日本	1.02	1.38	5.54	5.54
その他	2.64	2.17	4.35	4.35
北米	0.01	1.09	3.88	3.88
米国	1.53	3.86	7.64	7.64
カナダ	2.34	1.55	5.79	5.79
欧州	0.17	-0.36	1.97	1.97
イギリス	6.84	5.07	4.71	4.71
アジア・オセアニア	3.92	1.75	3.04	3.04
オーストラリア	3.64	1.71	3.00	3.00
ニュージーランド	5.81	2.04	3.42	3.42
複合地域	2.05	3.12	4.96	4.96
エマージング債券	4.02	2.99	8.76	8.76
グローバル	4.27	3.47	10.82	10.82
米ドル建て	3.97	3.24	10.98	10.98
現地通貨建て	5.57	4.44	10.02	10.02
その他	3.78	2.58	7.06	7.06
ロシア	10.72	11.77	29.72	29.72
アジア・オセアニア	2.81	3.95	8.14	8.14
インド	1.49	1.73	5.65	5.65
インドネシア	5.52	6.44	12.84	12.84
ブラジル	5.56	0.02	4.86	4.86
メキシコ	7.78	11.10	20.31	20.31
南アフリカ	11.92	5.90	11.57	11.57
トルコ	4.05	21.17	17.33	17.33
複合地域	6.89	6.69	11.75	11.75
ハイイールド債券	4.34	4.34	11.56	11.56
グローバル	4.89	3.46	10.08	10.08
北米	4.22	4.50	12.28	12.28
その他	4.30	4.48	10.41	10.41
欧州	4.40	4.99	10.64	10.64
アジア・オセアニア	4.09	2.54	9.40	9.40
複合地域	3.91	3.36	7.64	7.64
複合資産	3.01	4.87	10.88	10.88
安定	1.73	3.10	8.27	8.27
安定成長	3.52	5.32	11.86	11.86
成長	6.33	7.91	15.89	15.89
国内バランス	0.48	3.22	5.97	5.97
安定	0.26	2.94	5.52	5.52
一般	3.97	7.14	11.90	11.90
その他	2.46	10.65	32.16	32.16

＜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

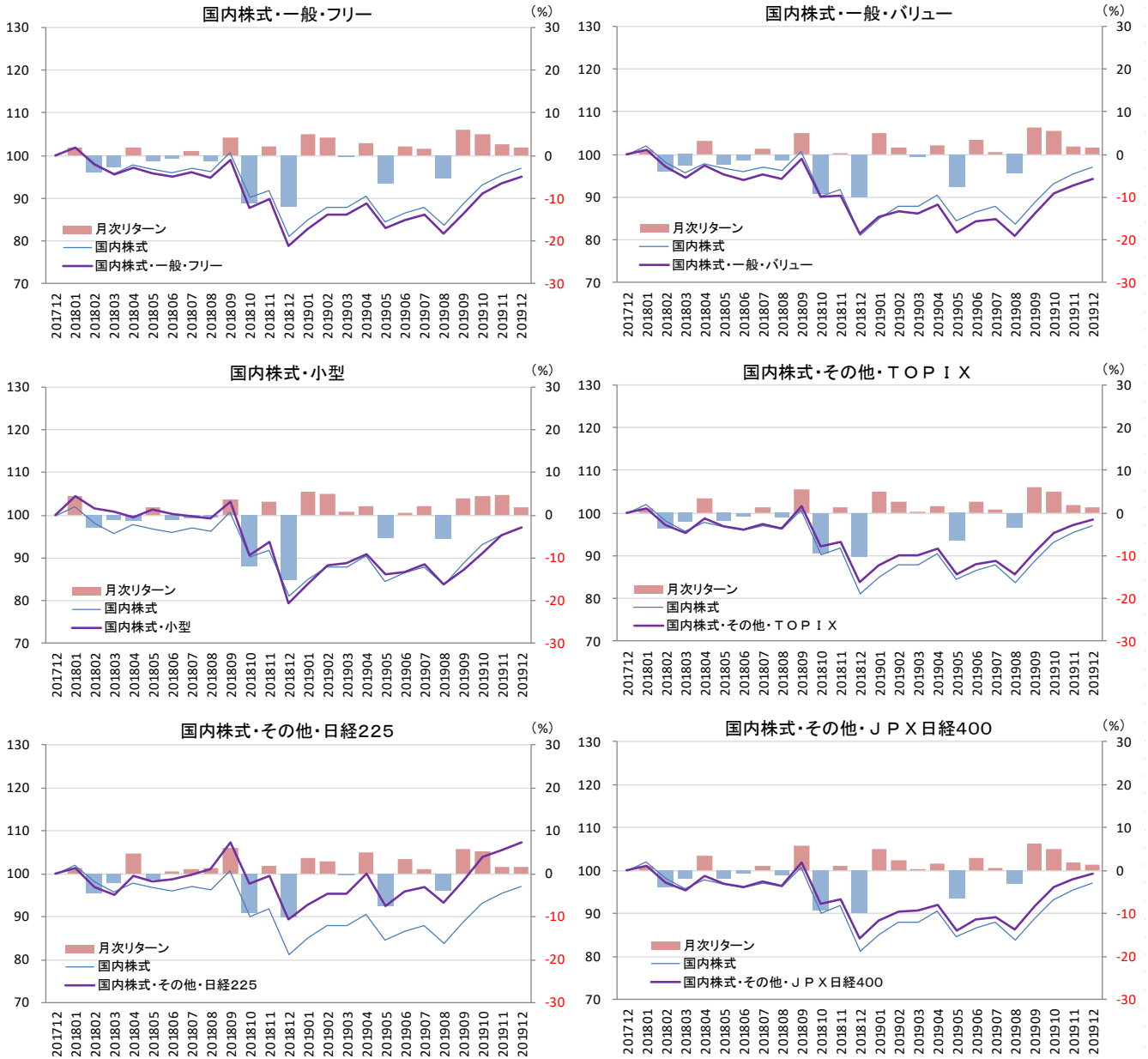
	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	5.56	7.08	16.25	16.25
国内REIT	-0.46	12.35	24.53	24.53
日本	-0.46	12.35	24.53	24.53
外国REIT	1.18	7.11	21.33	21.33
グローバル	2.21	7.73	19.38	19.38
除く日本	2.91	8.84	21.90	21.90
含む日本	2.03	7.45	18.80	18.80
北米	0.03	7.75	23.42	23.42
その他	3.01	1.95	18.13	18.13
欧州	10.19	13.83	19.92	19.92
アジア・オセアニア	2.11	0.01	18.54	18.54
オーストラリア	5.19	3.62	13.88	13.88
複合地域	8.58	8.74	18.55	18.55
複数国	0.47	9.08	23.67	23.67
その他	3.12	4.51	10.14	10.14
絶対収益型	0.11	0.24	2.47	2.47
ロング・ショート	-1.21	0.43	4.38	4.38
マーケットニュートラル	1.84	-1.16	-0.27	-0.27
GTAA	0.93	1.60	6.44	6.44
その他スタイル	-0.10	0.44	2.32	2.32
CB	3.82	3.12	8.41	8.41
アジア・オセアニア	5.45	3.15	8.48	8.48
日本	1.95	2.33	1.72	1.72
グローバル	3.86	3.16	8.75	8.75
コモディティ	3.20	4.78	11.18	11.18
全業種	5.93	3.27	6.37	6.37
貴金属	0.75	6.04	14.30	14.30
エネルギー	12.29	5.52	27.09	27.09
その他コモディティ	6.48	4.84	7.70	7.70

<1>パフォーマンス・サマリー

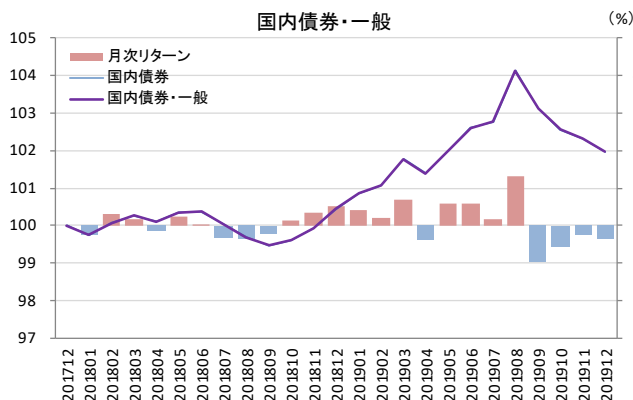
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

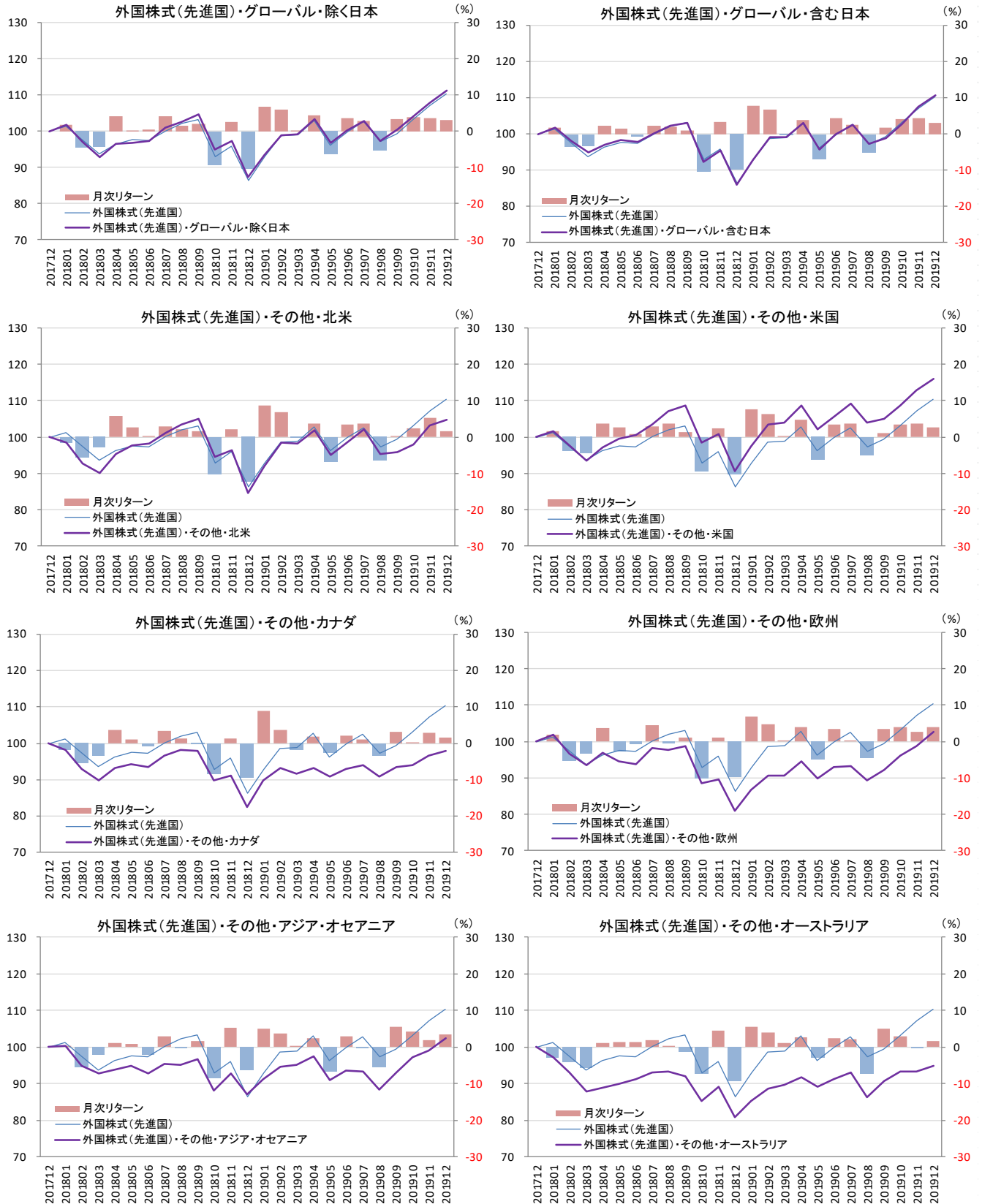


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24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)]

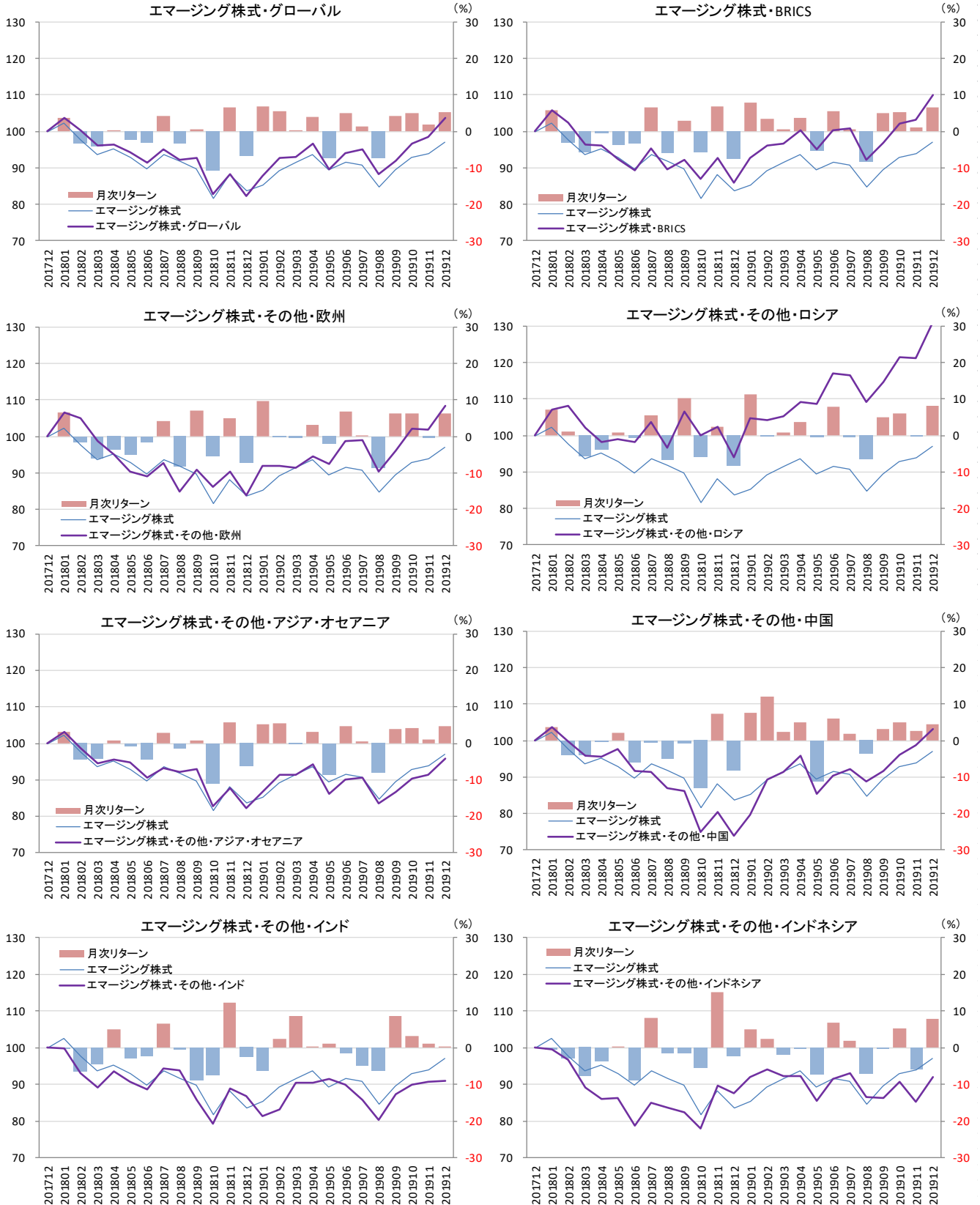


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

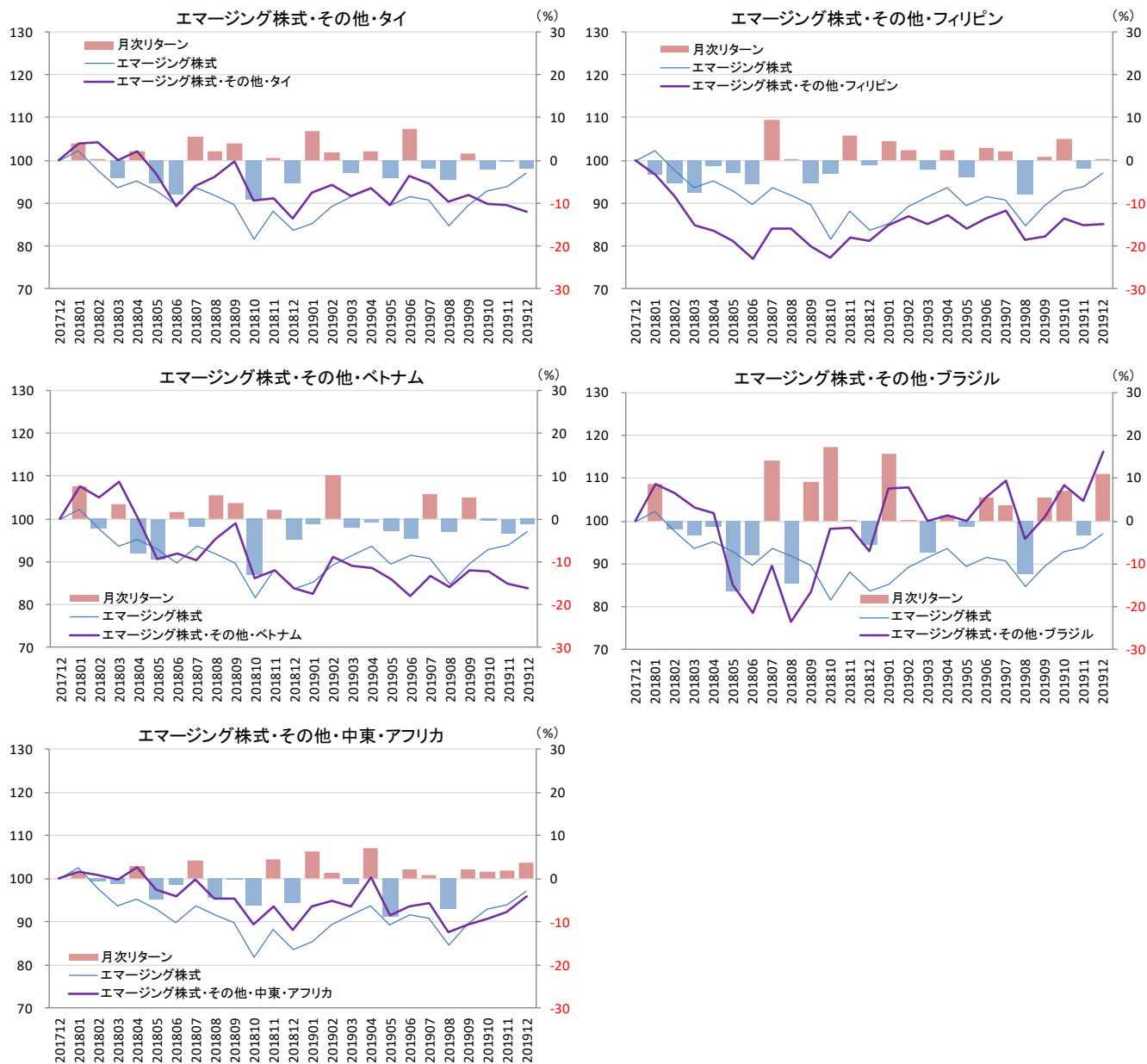


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

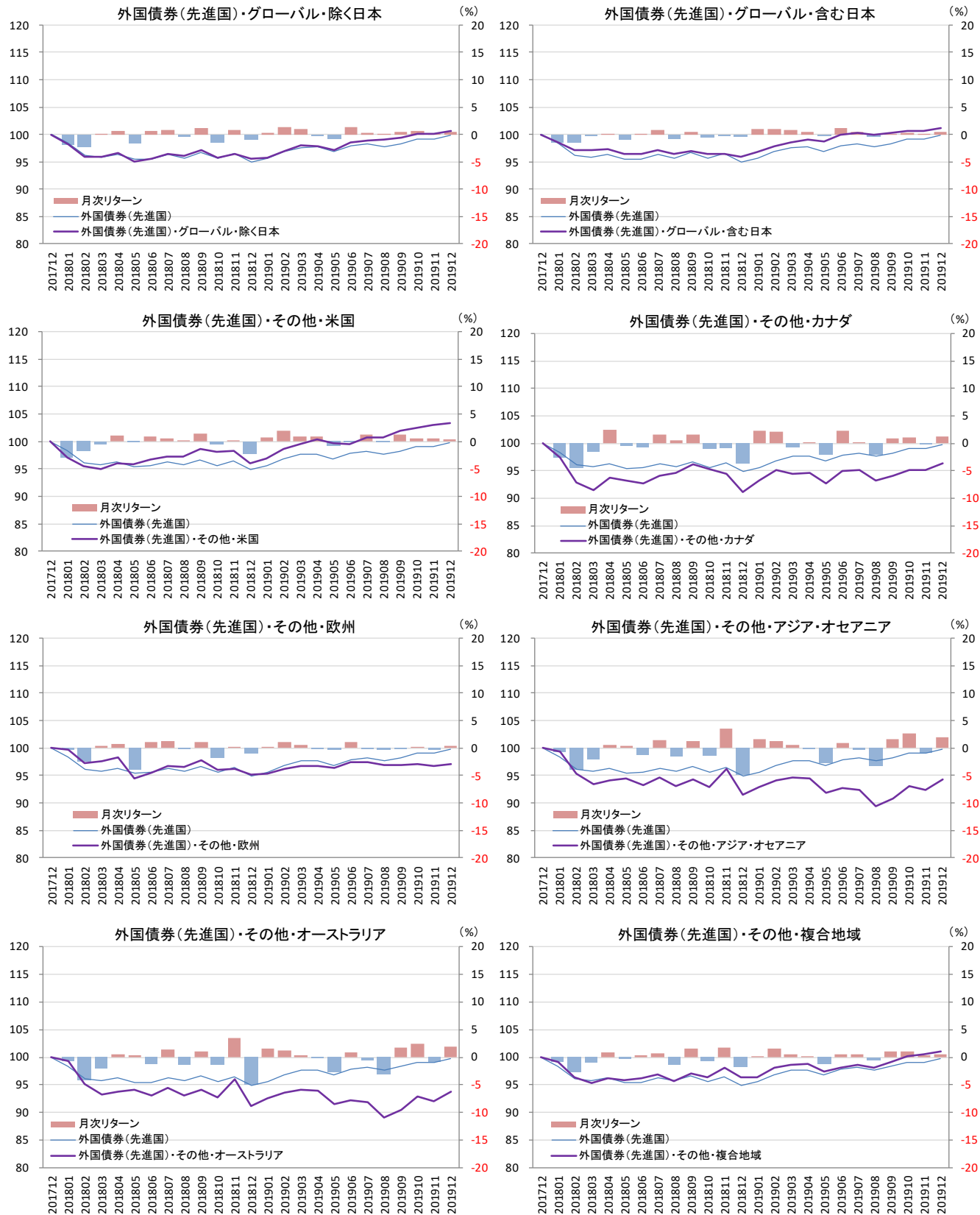


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

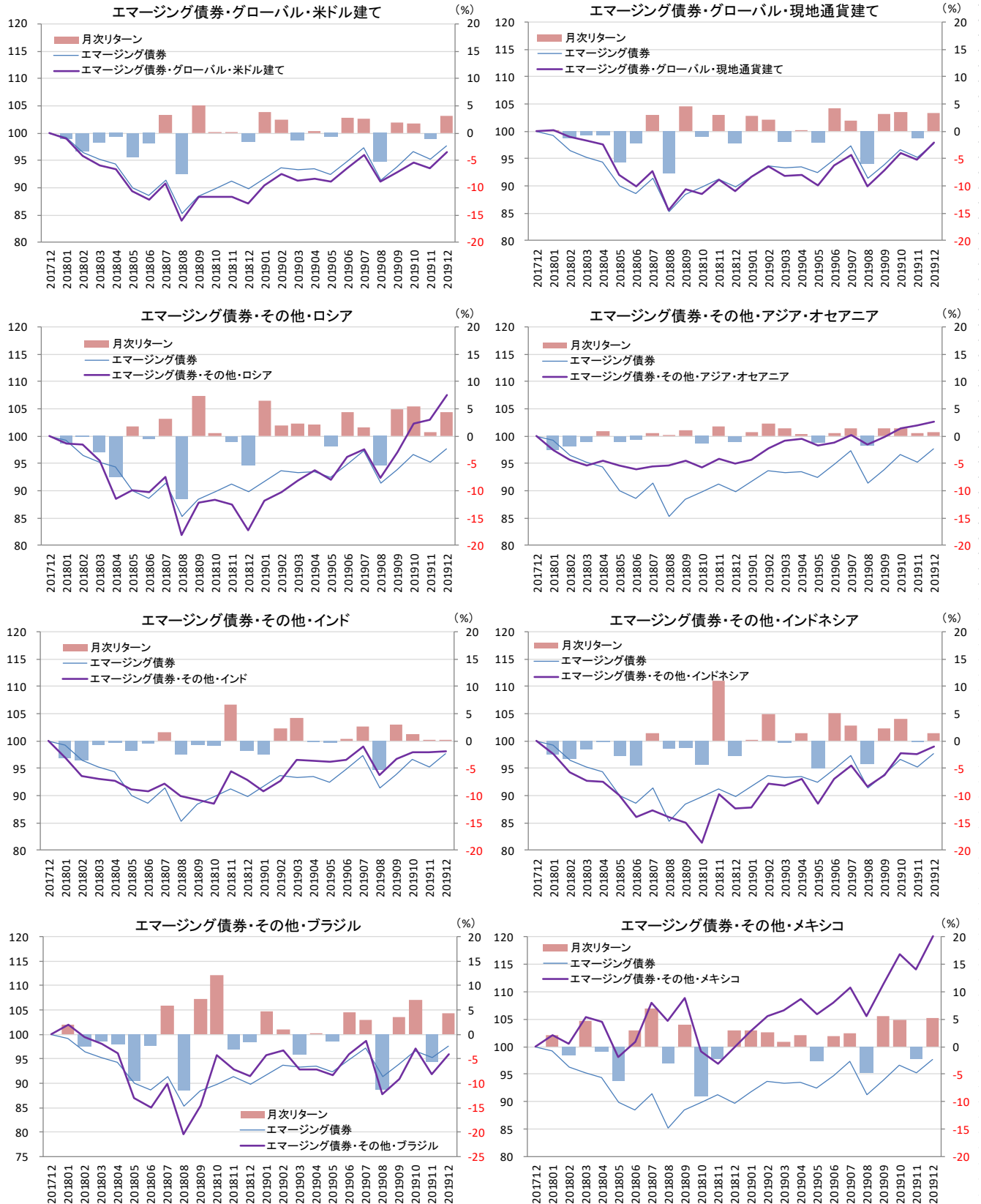


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

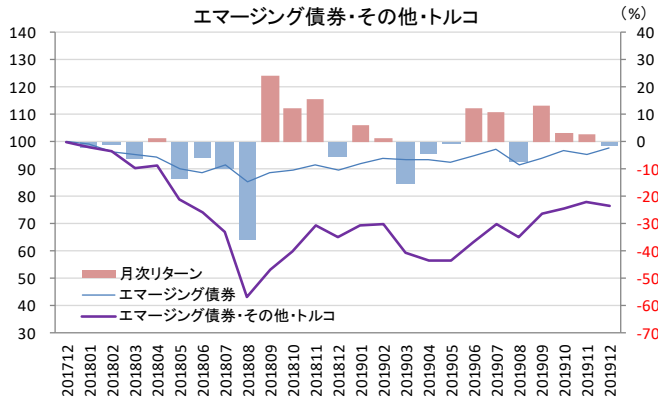


<1>パフォーマンス・サマリー

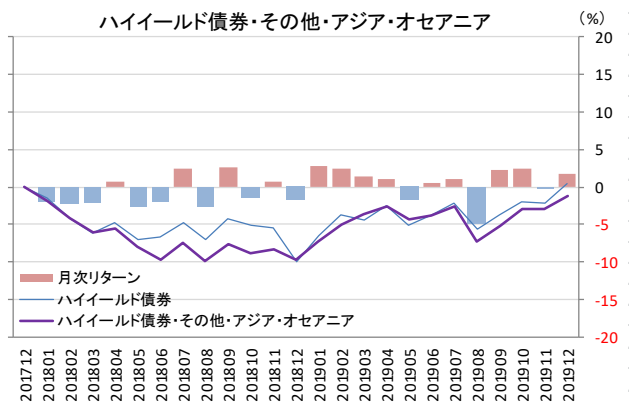
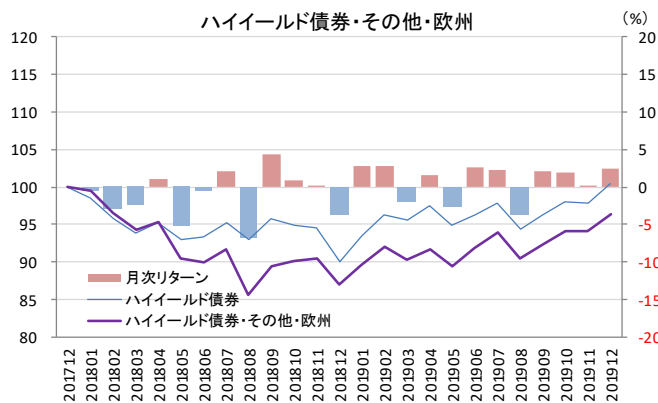
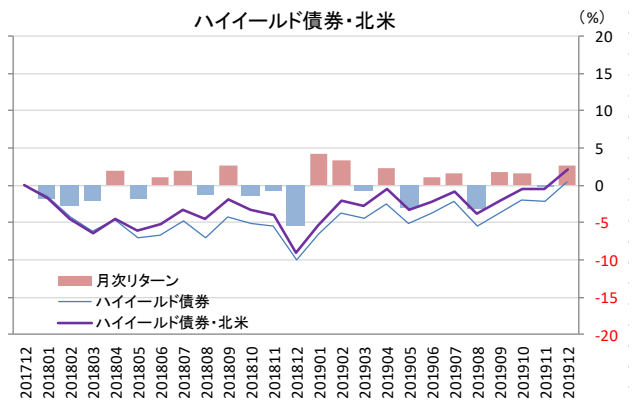
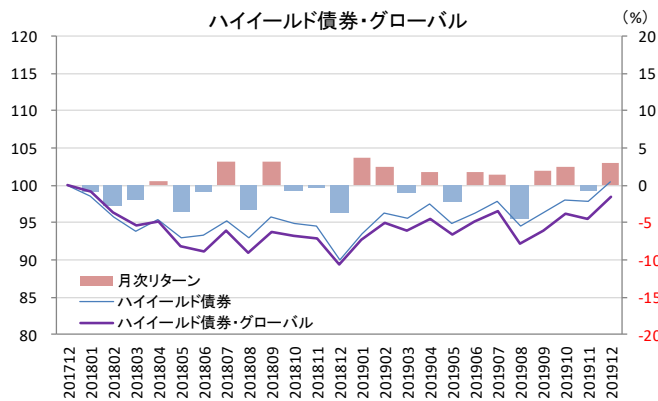
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

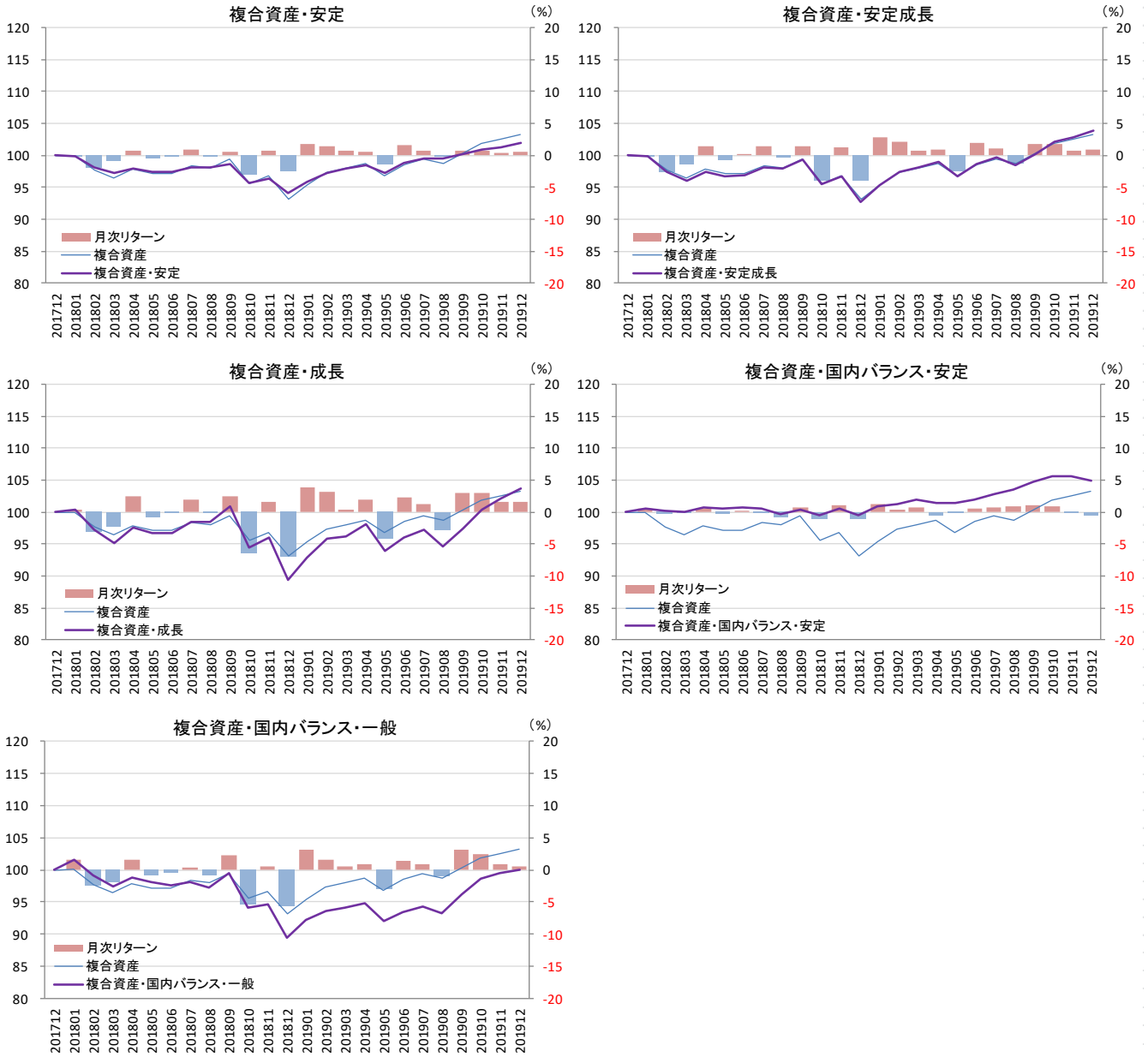


<1>パフォーマンス・サマリー

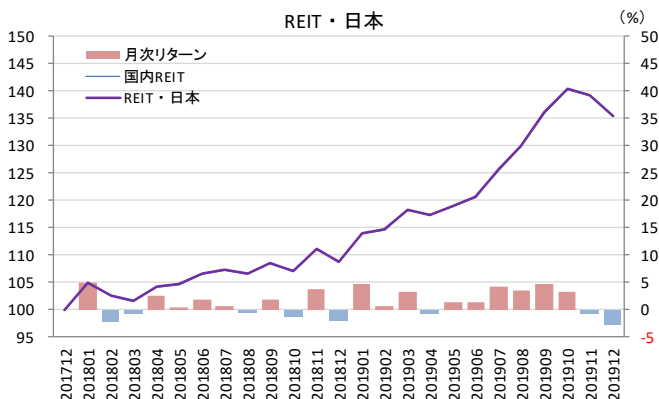
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

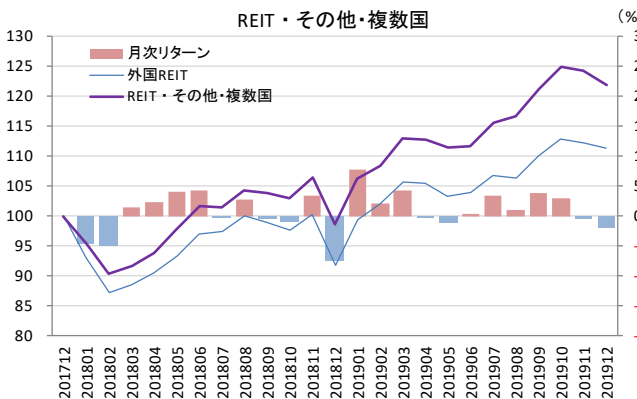
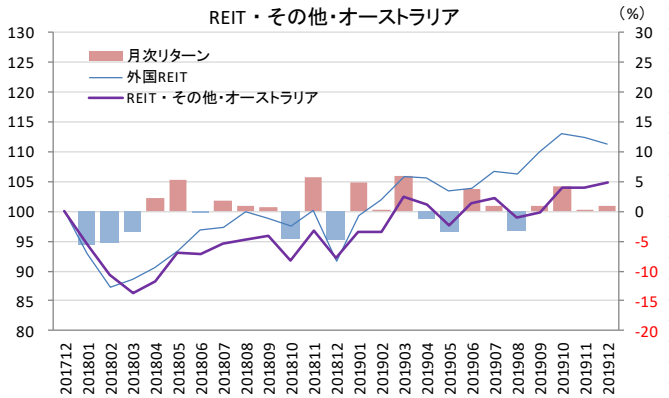
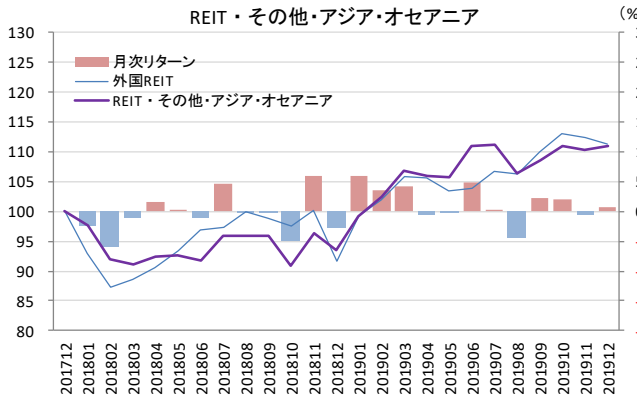
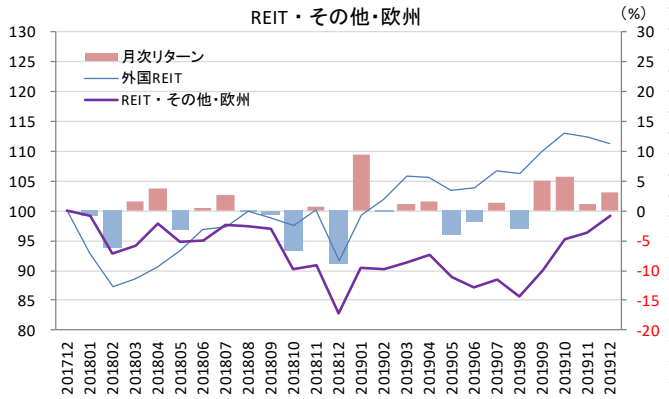
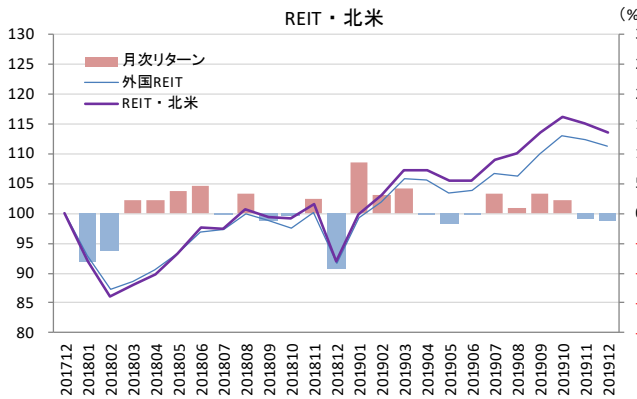
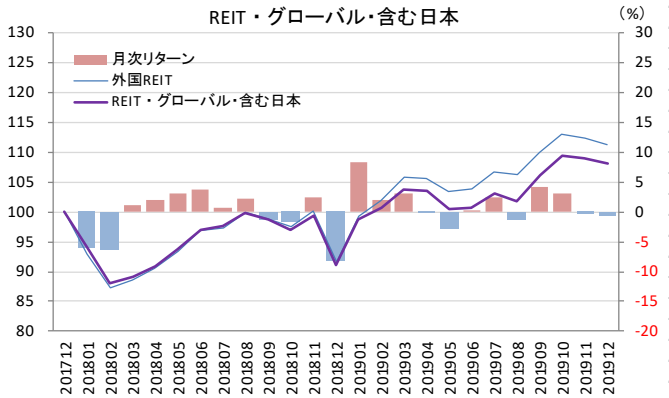
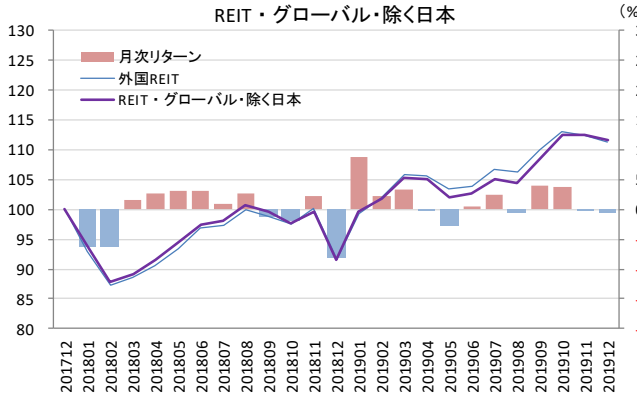


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

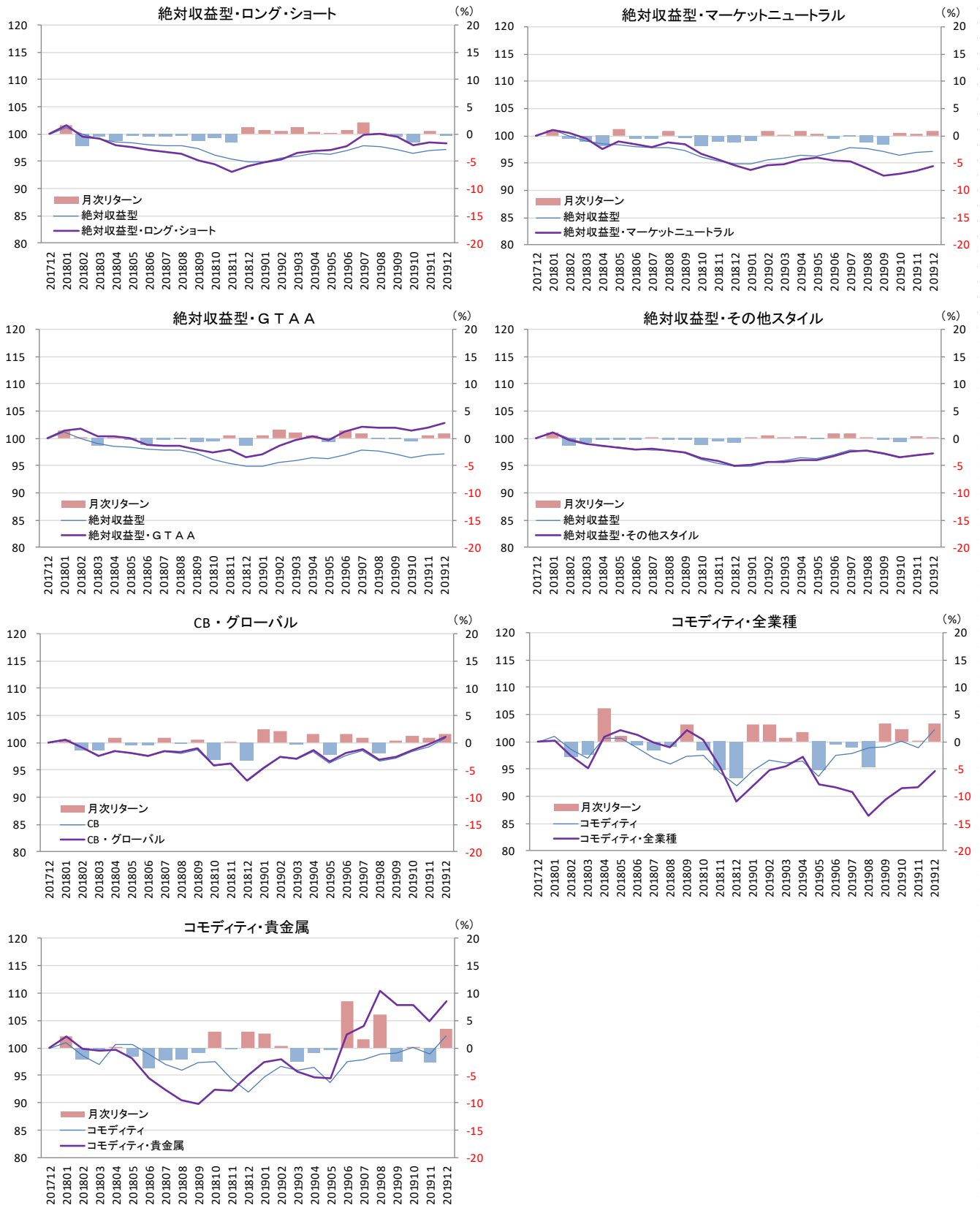


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



＜1＞パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	1.33		
1	外国株式(先進国)・グローバル	3.03	18.94	0.57
2	国内株式・一般	1.80	9.50	0.17
3	外国株式(先進国)・その他	2.62	5.39	0.14
4	エマージング株式・その他	2.51	3.43	0.09
5	国内株式・その他	1.52	4.75	0.07
6	複合資産・安定成長	0.99	7.17	0.07
7	エマージング株式・グローバル	5.41	1.25	0.07
8	ハイイールド債券・北米	2.67	2.27	0.06
9	外国債券(先進国)・グローバル	0.54	9.53	0.05
10	エマージング債券・グローバル	3.24	1.38	0.04
11	外国債券(先進国)・その他	1.22	3.55	0.04
12	複合資産・成長	1.56	2.06	0.03
13	エマージング債券・その他	1.97	1.55	0.03
14	国内株式・小型	1.82	1.49	0.03
15	複合資産・安定	0.60	4.38	0.03
16	ハイイールド債券・グローバル	3.07	0.54	0.02
17	ハイイールド債券・その他	2.22	0.64	0.01
18	コモディティ	3.40	0.30	0.01
19	ブルベア	2.37	0.29	0.01
20	エマージング株式・BRICS	6.58	0.11	0.01
21	REIT・その他	0.67	0.79	0.01
22	国内株式・業種特化	3.39	0.11	0.00
23	絶対収益型	0.32	1.15	0.00
24	CB	1.48	0.22	0.00
25	複合資産・その他	-0.62	0.87	-0.00
26	複合資産・国内バランス	-0.47	1.63	-0.01
27	国内債券・一般	-0.34	5.25	-0.02
28	REIT・グローバル	-0.69	2.98	-0.02
29	REIT・北米	-1.38	3.82	-0.05
30	REIT・日本	-2.66	4.64	-0.13
	合計		100.00	1.33

◆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
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	16.25		
1	外国株式(先進国)・グローバル	28.35	18.21	4.88
2	国内株式・一般	19.59	9.73	1.89
3	外国株式(先進国)・その他	25.69	5.22	1.29
4	REIT・日本	24.53	4.52	1.05
5	国内株式・その他	18.84	4.89	0.94
6	REIT・北米	23.42	3.91	0.90
7	複合資産・安定成長	11.86	6.72	0.81
8	REIT・グローバル	19.38	2.96	0.57
9	外国債券(先進国)・グローバル	5.43	10.00	0.56
10	エマージング株式・その他	12.15	3.74	0.44
11	複合資産・安定	8.27	4.46	0.38
12	エマージング株式・グローバル	26.18	1.38	0.34
13	国内株式・小型	22.06	1.62	0.34
14	複合資産・成長	15.89	1.96	0.31
15	ハイイールド債券・北米	12.28	2.47	0.31
16	外国債券(先進国)・その他	4.35	3.73	0.18
17	エマージング債券・グローバル	10.82	1.44	0.16
18	REIT・その他	18.13	0.80	0.14
19	ブルベア	41.54	0.32	0.13
20	エマージング債券・その他	7.06	1.71	0.12
21	国内債券・一般	1.51	5.34	0.09
22	複合資産・国内バランス	5.97	1.38	0.08
23	ハイイールド債券・その他	10.41	0.72	0.08
24	ハイイールド債券・グローバル	10.08	0.58	0.06
25	複合資産・その他	32.16	0.28	0.05
26	コモディティ	11.18	0.29	0.03
27	エマージング株式・BRICS	28.07	0.11	0.03
28	国内株式・業種特化	26.17	0.11	0.03
29	絶対収益型	2.47	1.15	0.03
30	CB	8.41	0.26	0.02
	合計		100.00	16.25

◆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
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	14.67	11.32	77.74	7.92	9.44	11.38	0.60	0.23	0.52
国内株式	22.66	32.18	130.03	13.87	15.99	17.17	0.51	0.36	0.50
一般	20.57	27.36	117.37	14.10	16.33	17.51	0.46	0.30	0.46
フリー	21.57	26.61	115.89	14.39	16.64	18.15	0.47	0.29	0.44
バリュー	16.89	29.80	122.03	13.23	15.47	16.20	0.41	0.35	0.51
小型	39.00	65.34	241.78	15.76	15.73	17.06	0.74	0.67	0.77
その他	23.88	37.69	140.61	13.29	15.71	16.97	0.56	0.42	0.54
日経225	28.73	44.12	153.85	13.78	15.89	17.19	0.64	0.48	0.57
TOPIX	20.08	34.02	126.34	12.88	15.53	16.61	0.49	0.39	0.51
JPX日経400	18.37	29.23	-	12.67	15.11	-	0.46	0.35	-
国内債券	2.06	4.95	15.74	1.50	1.71	1.56	0.49	0.58	0.93
一般	2.06	4.95	15.74	1.50	1.71	1.56	0.49	0.58	0.93
外国株式(先進国)	28.29	18.70	105.80	13.36	14.95	16.23	0.65	0.23	0.46
グローバル	30.61	21.53	115.52	13.57	14.74	16.13	0.69	0.27	0.49
除く日本	30.83	29.37	157.52	13.54	15.94	17.81	0.70	0.33	0.56
含む日本	30.62	19.35	106.00	13.64	14.50	15.82	0.69	0.25	0.47
その他	22.73	12.61	92.70	12.92	15.54	17.58	0.55	0.16	0.38
北米	13.19	8.25	51.84	15.77	17.39	20.92	0.27	0.09	0.20
米国	31.57	18.85	116.83	13.60	16.62	17.79	0.71	0.21	0.45
カナダ	6.55	-10.72	7.40	12.17	13.79	16.47	0.18	-0.16	0.04
欧州	24.55	17.82	91.70	13.50	14.89	18.63	0.57	0.23	0.36
ドイツ	11.34	4.49	-	16.31	19.29	-	0.23	0.05	-
イギリス	5.45	-10.32	-	13.45	15.07	-	0.14	-0.14	-
アジア・オセアニア	25.64	24.59	139.79	12.09	15.15	17.78	0.66	0.30	0.51
オーストラリア	4.98	6.59	61.95	12.63 ↓	15.36	19.58	0.13	0.09	0.25
ニュージーランド	43.28	58.08	-	13.90	16.67	-	0.92	0.58	-
複合地域	-16.27	-28.01	-	18.48	19.11	-	-0.31	-0.33	-
エマージング株式	24.27	11.02	45.98	12.98	15.25	18.06	0.58	0.14	0.21
グローバル	29.41	12.40	47.04	14.54	16.50	18.34	0.62	0.14	0.21
BRICS	42.99	41.05	67.57	15.29	18.39	20.79	0.83	0.39	0.25
その他	21.79	9.72	48.70	12.95	15.13	18.01	0.53	0.13	0.22
欧州	24.12	43.79	34.19	16.23 ↓	19.34	23.92	0.46	0.39	0.12
ロシア	32.13	102.15	59.86	17.55 ↓	22.80	26.25	0.56	0.66	0.18
アジア・オセアニア	19.22	6.19	67.20	14.34	15.96	17.28	0.42	0.08	0.30
中国	49.12	38.31	95.64	18.00	22.18	21.91	0.79	0.30	0.32
インド	26.68	16.33	64.49	17.05	18.93	23.96	0.48	0.16	0.21
インドネシア	4.42	-7.71	74.80	17.26	19.89	21.94	0.09	-0.08	0.26
タイ	10.00	5.21	163.31	13.53	13.61	17.00	0.24	0.08	0.60
フィリピン	1.16	-17.55	-	13.69	14.80	-	0.03	-0.25	-
ベトナム	16.29	25.71	-	17.68	16.65	-	0.29	0.28	-
韓国	-4.14	-20.79	15.56	16.98 ↑	16.59	19.70	-0.08	-0.27	0.07
香港	30.73	23.67	58.00	16.53	19.52	18.88	0.57	0.22	0.25
台湾	25.41	24.35	117.39	18.93	18.40	19.00	0.42	0.24	0.42
中南米	33.52	10.84	4.52	21.62	23.09	23.57	0.47	0.09	0.02
ブラジル	34.41	13.56	-20.74	27.27	31.41	29.32	0.38	0.08	-0.08
メキシコ	0.71	-23.05	-	21.37	20.47	-	0.01	-0.25	-
中東・アフリカ	7.41	-13.92	58.99	12.35 ↓	15.12	16.76	0.20	-0.19	0.28
トルコ	-14.98	-48.75	-25.77	33.26	28.95	31.18	-0.16	-0.43	-0.10
複合地域	16.07	-0.89	65.82	13.77	14.92	15.96	0.37	-0.01	0.32

※[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	14.67	11.32	77.74	7.92	9.44	11.38	0.60	0.23	0.52
外国債券(先進国)	3.66	-4.97	33.42	3.20 ↓	5.02	8.07	0.39	-0.20	0.36
グローバル	4.28	-3.21	32.15	2.72 ↓	4.41	7.35	0.54	-0.14	0.38
除く日本	4.64	-5.26	35.95	3.32 ↓	5.00	8.08	0.48	-0.21	0.38
含む日本	3.83	-0.53	27.52	2.21 ↓	3.92	6.58	0.59	-0.02	0.37
その他	1.80	-8.43	36.64	5.29	6.95	9.82	0.12	-0.25	0.32
北米	3.14	0.50	-	1.89	3.39 ↓	-	0.58	0.04	-
米国	3.74	2.22	48.89	3.51 ↓	5.03 ↓	6.20	0.37	0.09	0.65
カナダ	-0.56	-16.20	10.36	6.64 ↓	8.52	9.50	-0.02	-0.40	0.10
欧州	5.40	-8.73	24.90	4.39 ↓	6.49 ↓	10.04	0.41	-0.28	0.22
イギリス	2.56	-12.78	-	7.36 ↓	10.18	-	0.12	-0.26	-
アジア・オセアニア	0.79	-10.25	41.42	7.10	8.43	11.00	0.04	-0.25	0.32
オーストラリア	0.38	-10.40	37.75	7.12	8.51	11.28	0.03	-0.25	0.29
ニュージーランド	3.29	-4.00	-	8.50	9.75	-	0.13	-0.08	-
複合地域	7.28	-4.76	30.54	4.56	6.72	9.78	0.53	-0.14	0.27
エマージング債券	5.82	2.46	42.22	8.53	10.68	12.82	0.23	0.05	0.28
グローバル	5.95	2.08	46.07	8.95	10.52	12.69	0.22	0.04	0.30
米ドル建て	5.96	3.37	49.68	8.90	10.64	12.85	0.23	0.06	0.32
現地通貨建て	5.99	-5.75	25.59	9.72	10.45	12.04	0.21	-0.11	0.19
その他	5.64	2.00	33.02	8.61	11.76	13.75	0.22	0.04	0.21
ロシア	20.49	64.70	42.10	13.71 ↓	21.79 ↓	21.58	0.47	0.48	0.16
アジア・オセアニア	6.89	4.94	57.79	3.85 ↓	6.09	8.69	0.60	0.16	0.53
インド	4.85	10.42	-	7.78 ↓	9.50	-	0.21	0.21	-
インドネシア	7.84	6.67	-	10.87	13.26	-	0.24	0.10	-
ブラジル	3.36	5.87	34.83	17.45	19.85	18.02	0.07	0.06	0.17
メキシコ	27.96	-11.66	-	14.76	14.75	-	0.58	-0.16	-
南アフリカ	12.44	1.12	-	20.51	19.45	-	0.20	0.01	-
トルコ	-28.10	-53.41	-	36.07	29.47	-	-0.29	-0.48	-
複合地域	18.61	-10.28	25.88	8.99	11.17	13.27	0.66	-0.19	0.17
ハイイールド債券	6.59	7.54	80.00	7.06 ↓	9.48	11.88	0.31	0.16	0.51
グローバル	7.14	7.61	67.95	7.30	9.66	12.05	0.33	0.16	0.44
北米	6.96	9.60	88.73	7.15 ↓	9.56	11.50	0.32	0.20	0.57
その他	5.36	2.49	79.47	7.85	9.99	15.03	0.23	0.05	0.40
欧州	5.75	1.35	98.93	8.64	10.75	16.37	0.22	0.03	0.43
アジア・オセアニア	4.60	9.50	-	6.27	8.28	-	0.25	0.22	-
複合地域	8.60	3.21	77.14	5.86 ↓	8.23	11.61	0.48	0.08	0.50
複合資産	11.05	9.67	68.83	5.00	6.73	9.21	0.72	0.28	0.58
安定	7.43	4.61	53.08	3.58 ↓	4.96	7.68	0.69	0.19	0.56
安定成長	11.97	10.58	72.15	5.47	7.13	9.62	0.71	0.29	0.58
成長	17.30	19.08	97.52	8.73	10.52	11.86	0.63	0.34	0.59
国内バランス	7.68	10.73	41.76	2.39	3.25 ↓	6.70	1.06	0.64	0.53
安定	6.73	11.18	33.77	2.09	2.05	3.03	1.08	1.05	0.96
一般	14.42	16.44	57.45	7.14	8.28	9.66	0.65	0.38	0.48

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

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

<2> リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別③

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	14.67	11.32	77.74	7.92	9.44	11.38	0.60	0.23	0.52
国内REIT	26.44	28.59	235.34	7.93	8.55	15.84	1.03	0.61	0.81
日本	26.44	28.59	235.34	7.93	8.55	15.84	1.03	0.61	0.81
外国REIT	15.78	15.00	161.33	11.12 ↓	13.05 ↓	15.47	0.46	0.22	0.65
グローバル	13.68	10.10	140.53	11.03 ↓	12.80	15.20	0.40	0.15	0.60
除く日本	21.42	19.81	161.14	11.06 ↓	12.89	15.24	0.61	0.29	0.66
含む日本	12.60	8.91	138.34	11.03 ↓	12.80	15.21	0.37	0.14	0.59
北米	15.92	17.62	182.85	12.09 ↓	14.02	16.72	0.42	0.24	0.65
その他	29.81	26.72	183.29	9.28 ↓	11.37	14.54	0.98	0.43	0.75
欧州	20.14	7.57	20.50	12.77	15.19	20.11	0.50	0.10	0.09
アジア・オセアニア	40.05	35.78	198.45	9.79	11.71	14.51	1.22	0.54	0.79
オーストラリア	14.79	15.17	132.02	11.06 ↓	13.37	16.55	0.43	0.22	0.53
複合地域	8.49	-2.14	92.24	13.47	15.08	17.90	0.21	-0.03	0.38
複数国	21.64	28.69	240.65	10.22	11.54 ↓	14.79	0.67	0.45	0.88
その他									
絶対収益型	1.04	-3.00	-4.68	2.03	1.99	3.47	0.20	-0.29	-0.15
ロング・ショート	1.07	-2.84	-0.66	3.30	3.05	3.60	0.12	-0.18	-0.03
マーケットニュートラル	6.30	11.66	38.20	3.83	5.50	5.21	0.55	0.41	0.63
GTAA	4.12	4.71	14.20	2.58	2.25	2.67	0.55	0.42	0.49
その他スタイル	-0.59	-4.15	-10.01	1.92	2.14	5.19	-0.08	-0.38	-0.21
CB	6.64	3.97	32.45	4.70	6.45	9.59	0.47	0.12	0.29
アジア・オセアニア	12.33	17.42	65.11	8.46	10.73	11.17	0.47	0.31	0.46
日本	0.42	13.79	49.53	4.59	5.33	6.05	0.04	0.50	0.67
グローバル	6.98	3.96	34.66	4.70	6.40	10.04	0.50	0.13	0.30
コモディティ	0.43	-22.69	-21.21	7.37 ↓	11.68	14.43	0.03	-0.43	-0.17
全業種	-7.48	-28.92	-28.70	10.47 ↓	13.64	15.10	-0.24	-0.48	-0.22
貴金属	17.58	1.04	29.19	8.79 ↑	9.92	16.71	0.64	0.02	0.15
エネルギー	3.05	-26.29	-39.14	23.95 ↓	26.71	24.91	0.04	-0.22	-0.20
その他コモディティ	-3.51	-20.29	7.92	12.60	14.32	17.63	-0.09	-0.31	0.04

※[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

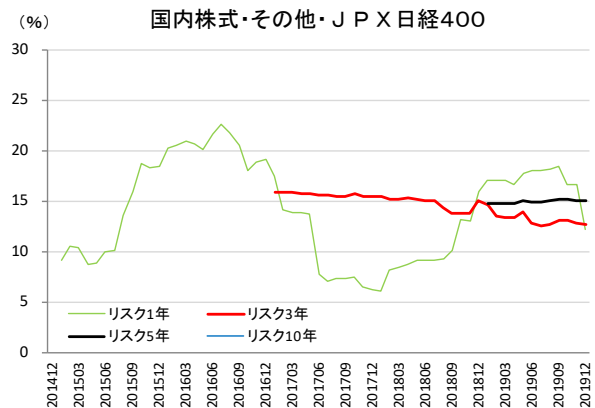
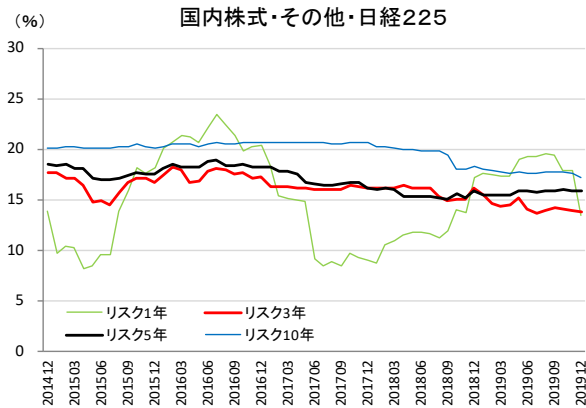
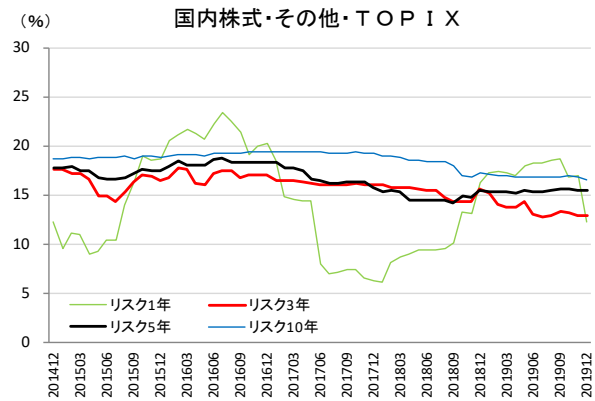
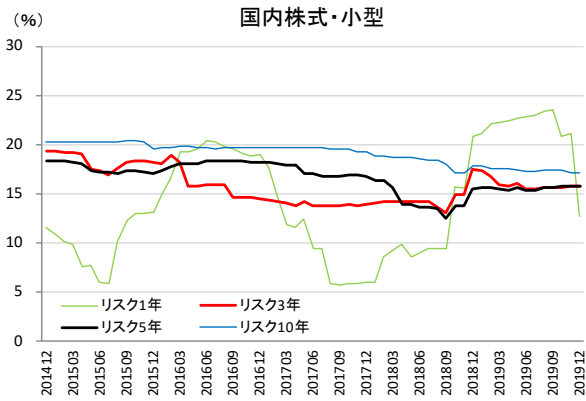
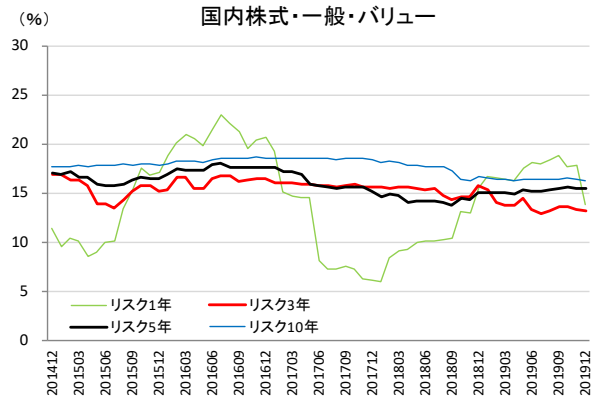
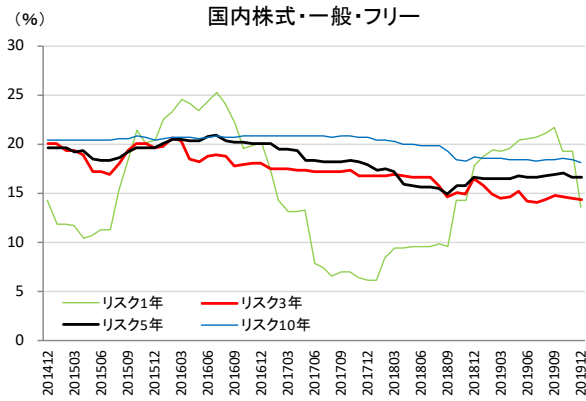
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

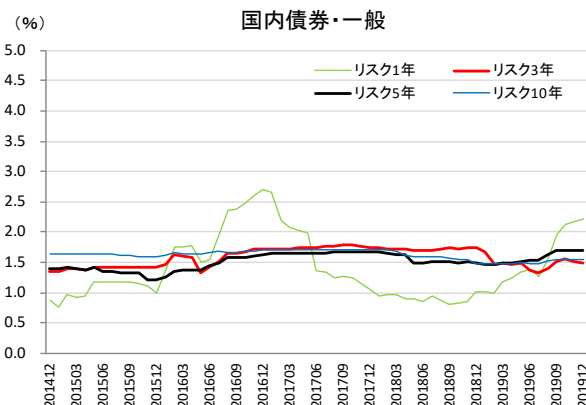
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

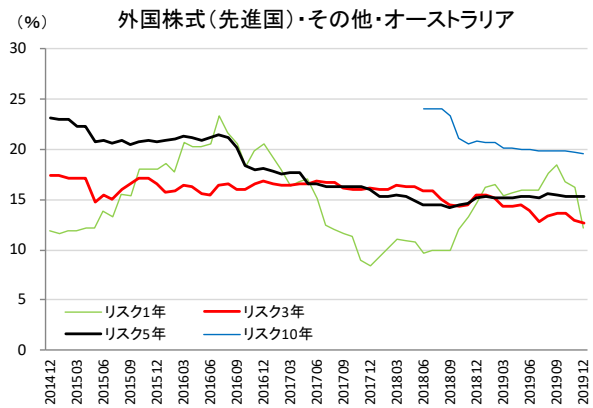
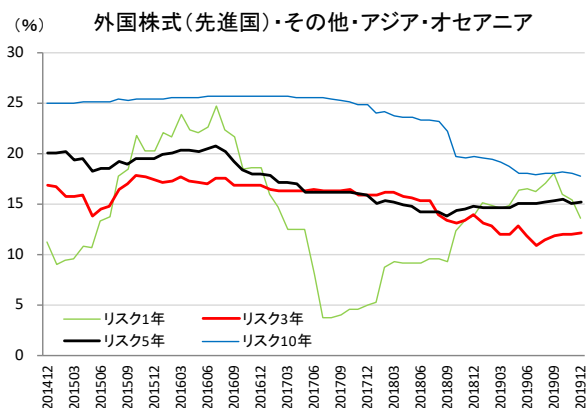
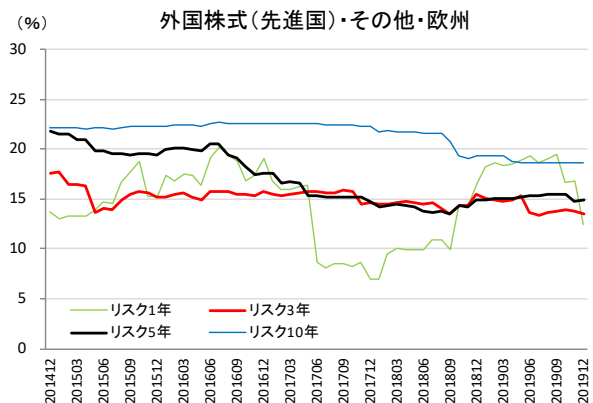
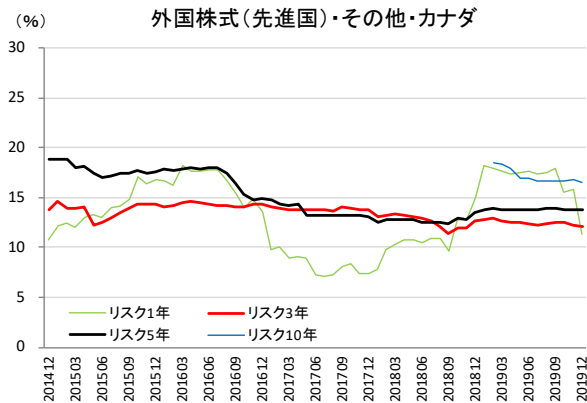
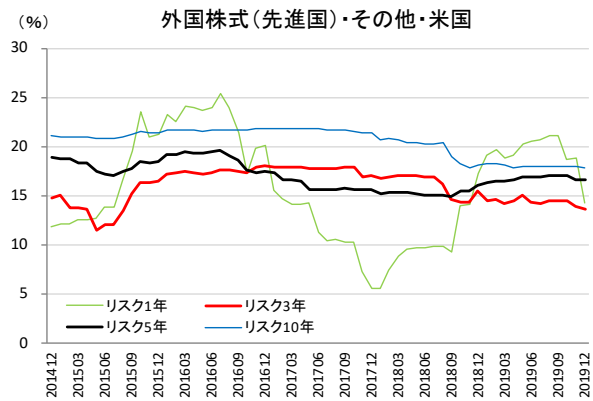
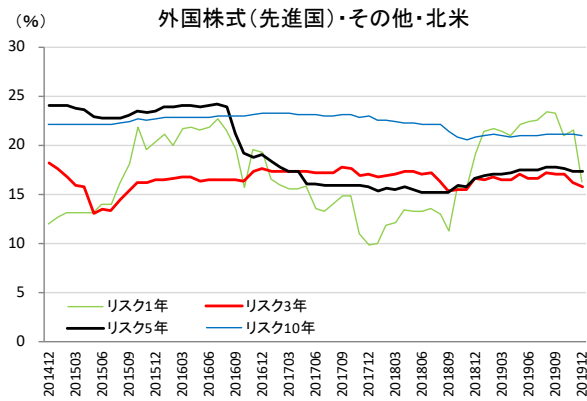
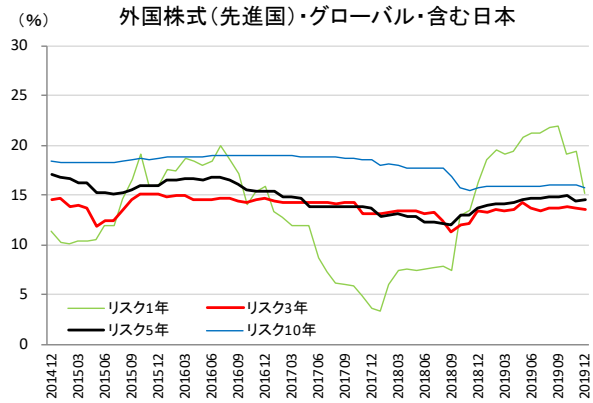
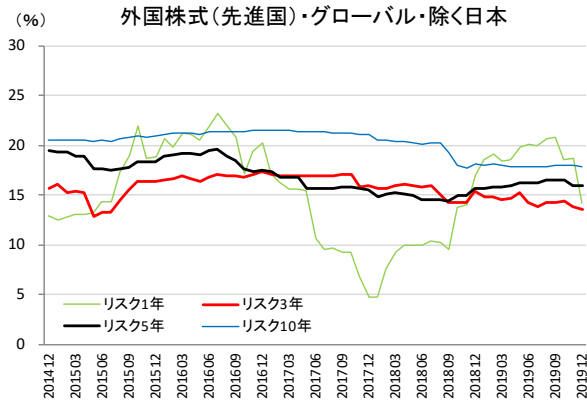


<2> リスク・サマリー

(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)]

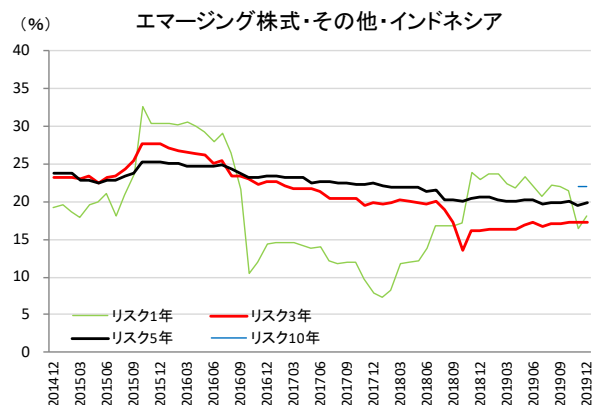
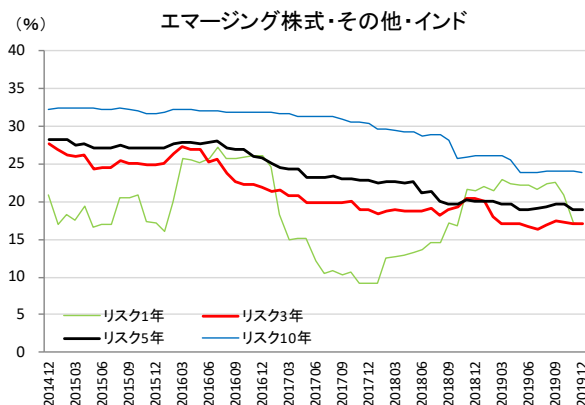
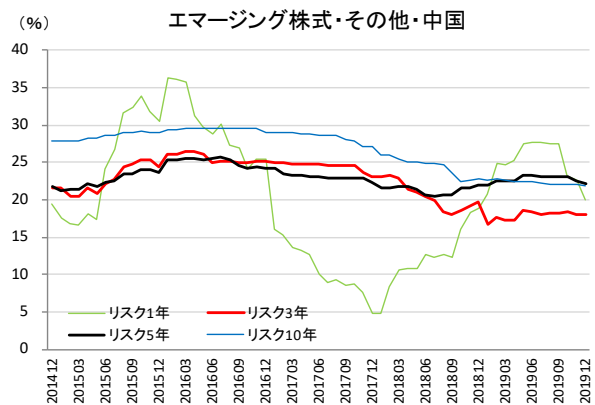
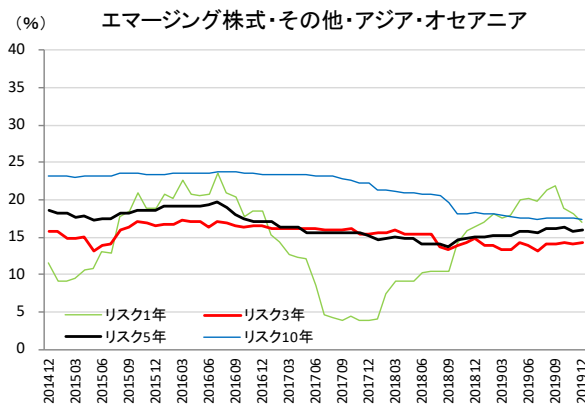
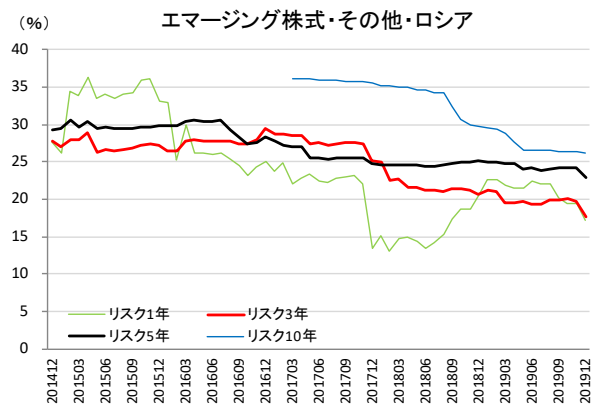
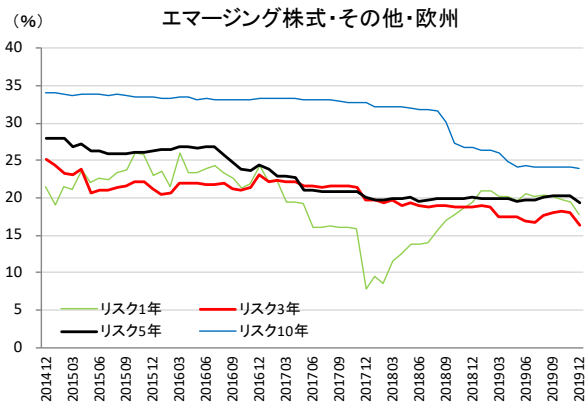
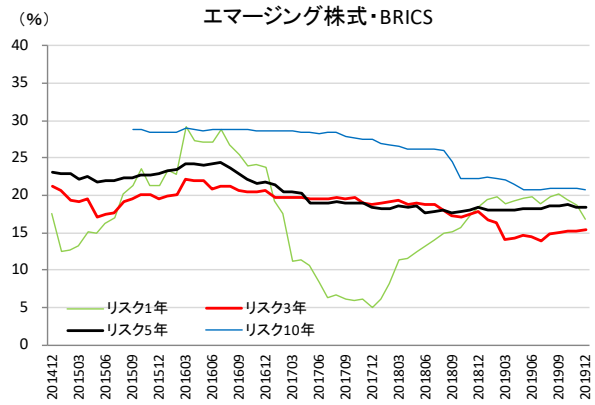
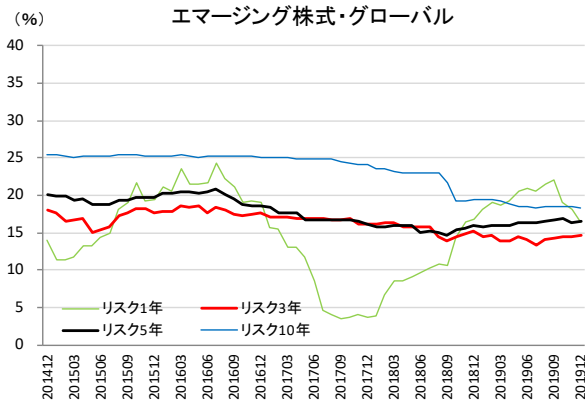


<2> リスク・サマリー

(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]

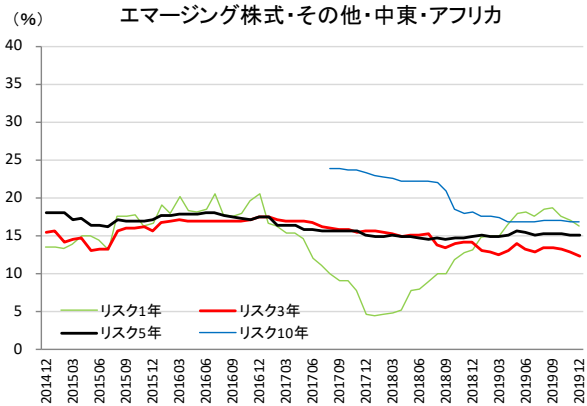
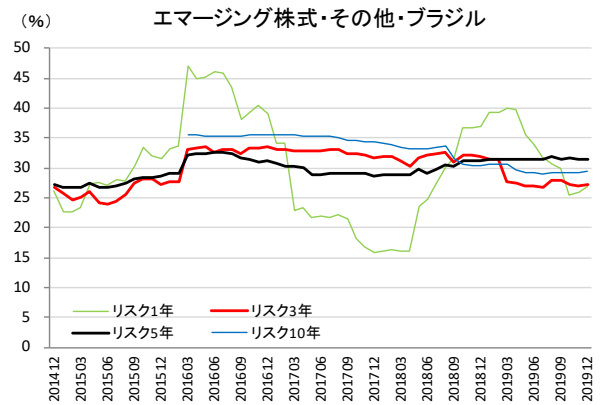
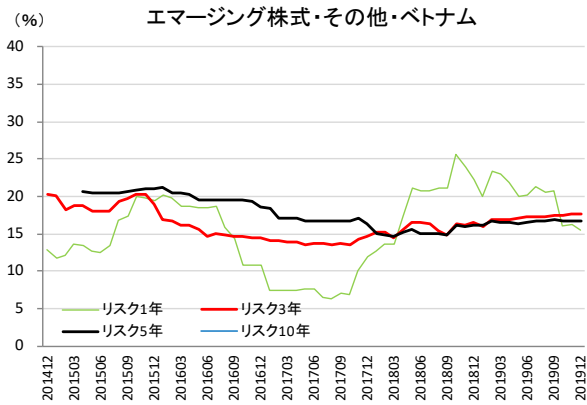
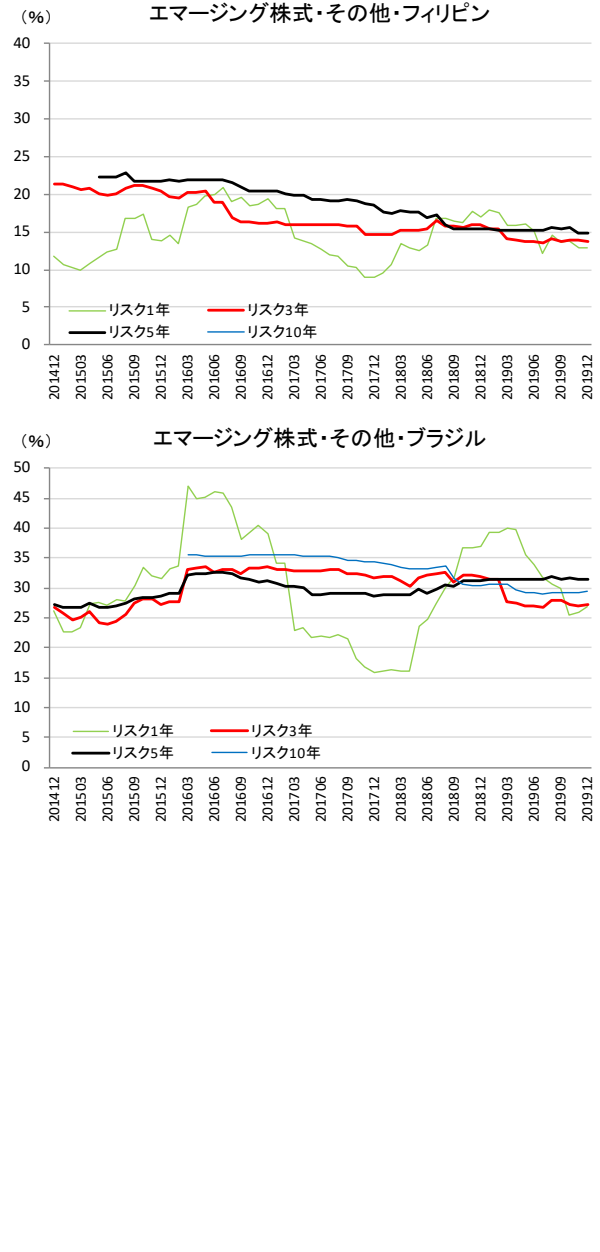
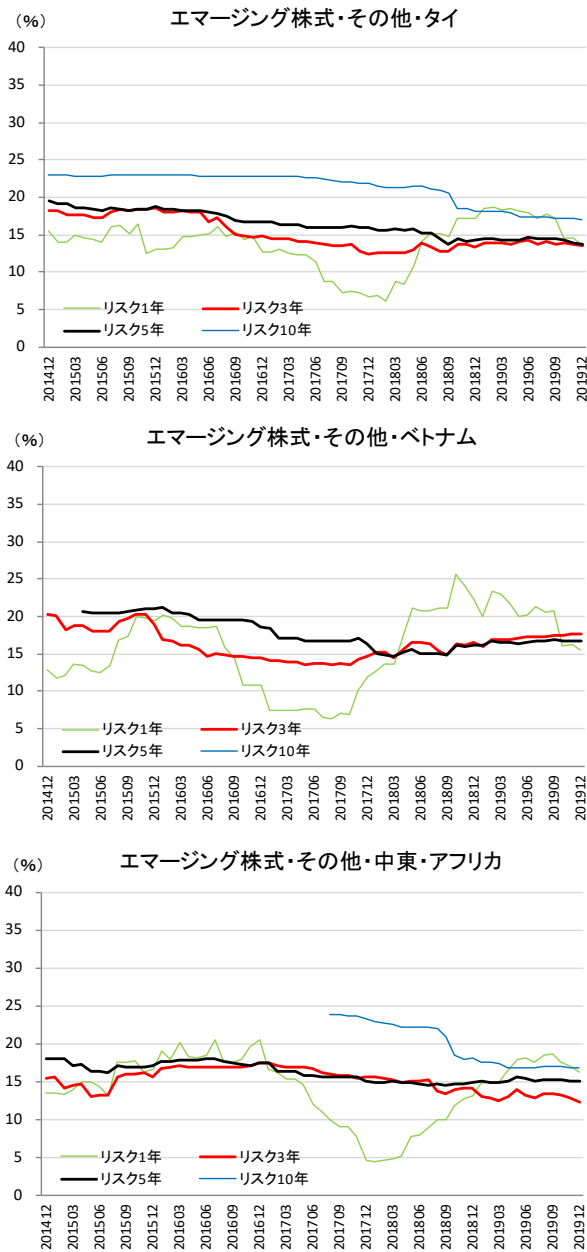


<2>リスク・サマリー

(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]

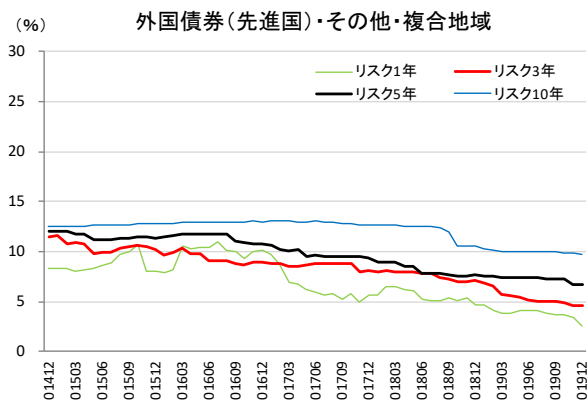
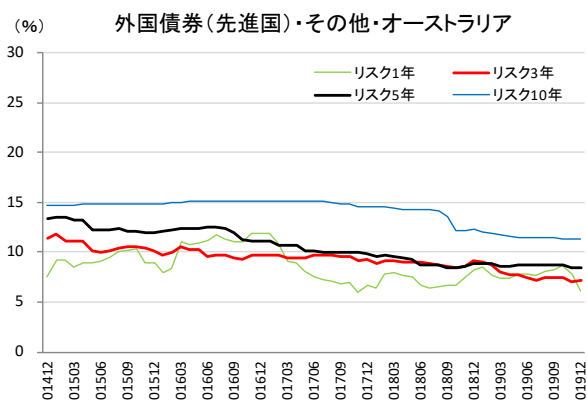
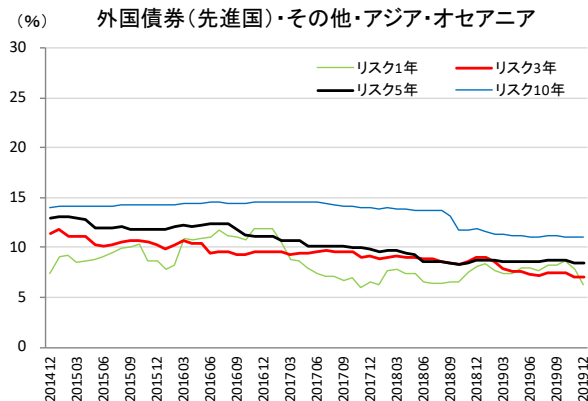
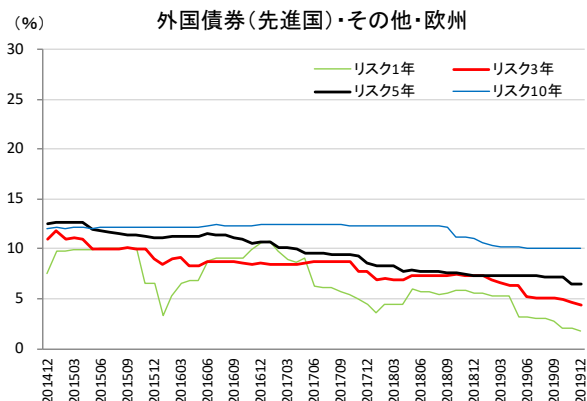
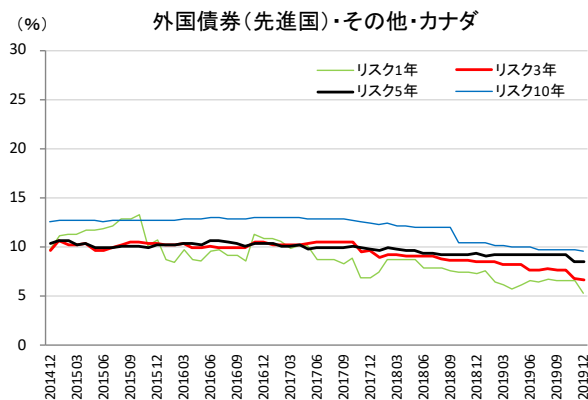
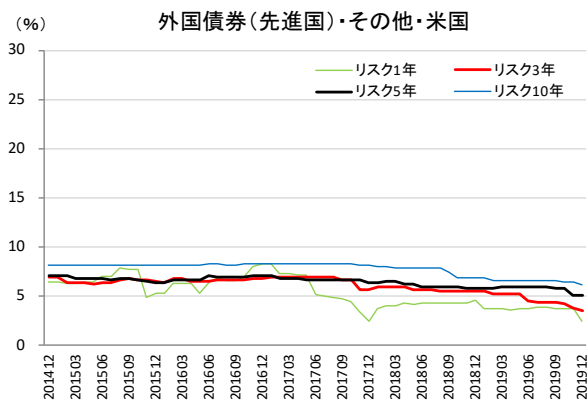
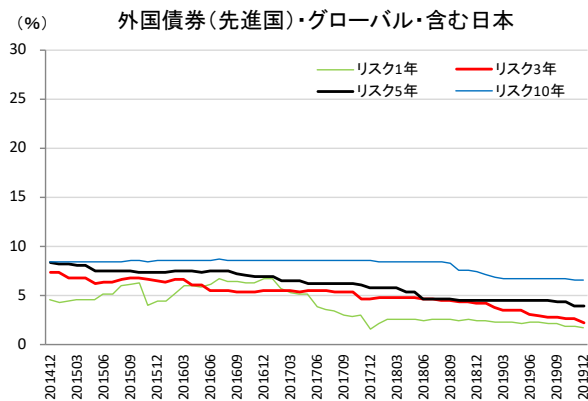
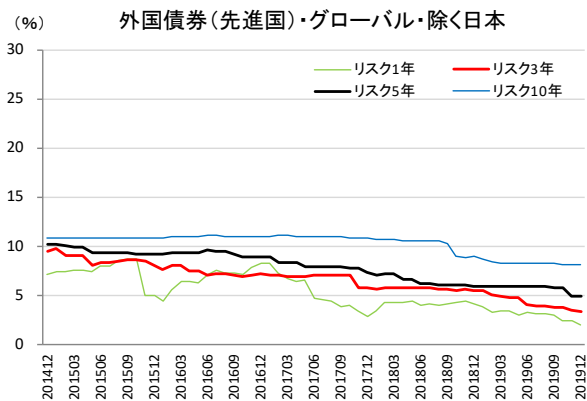


<2> リスク・サマリー

(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)]

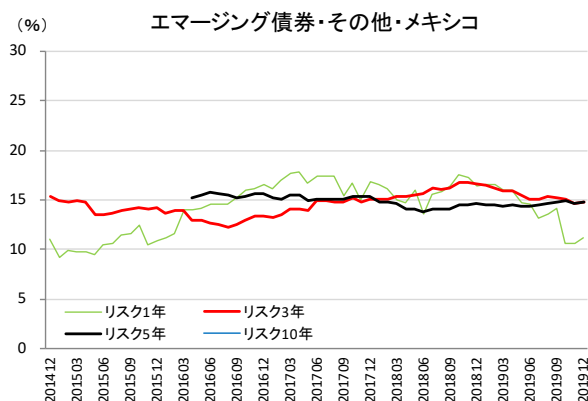
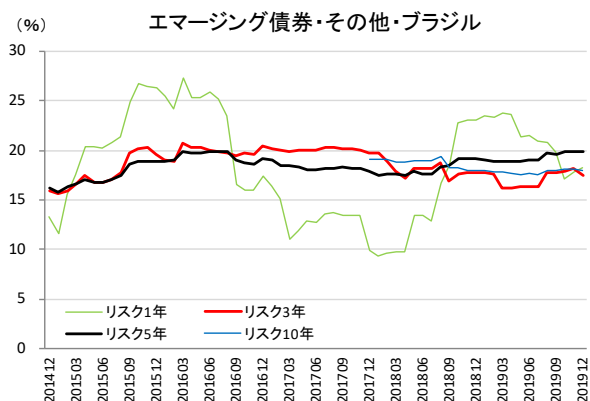
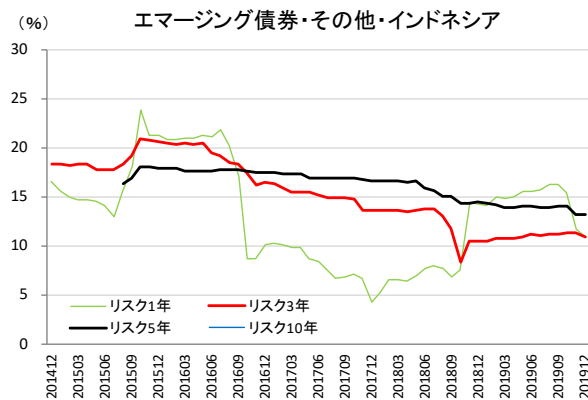
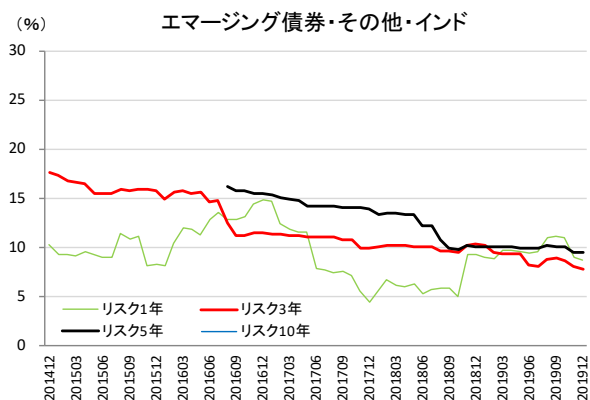
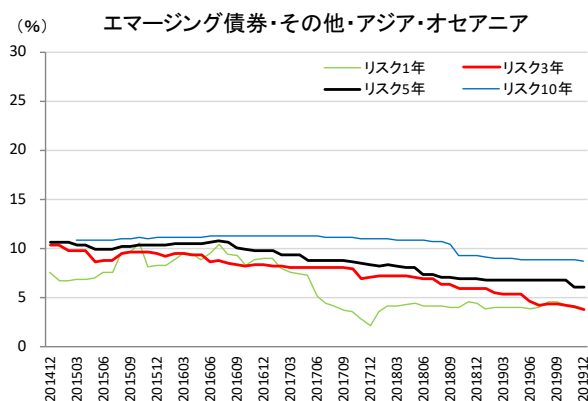
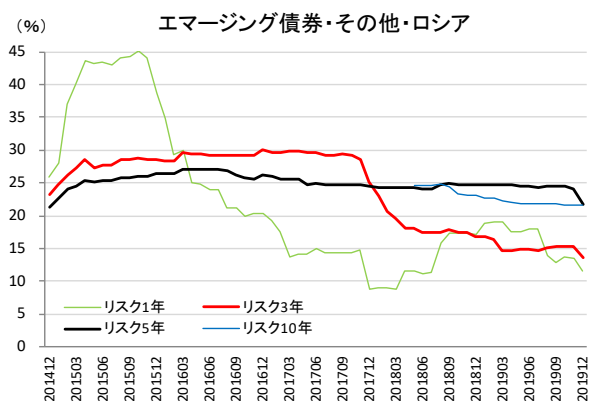
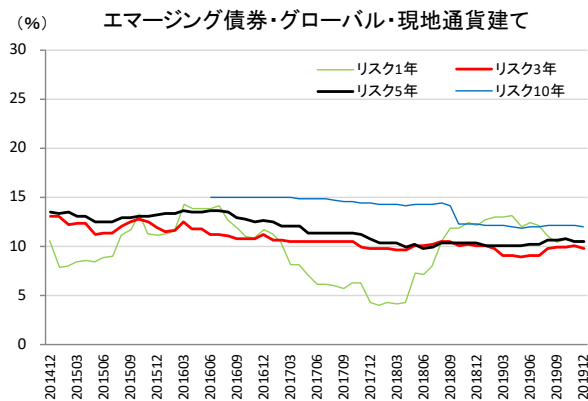
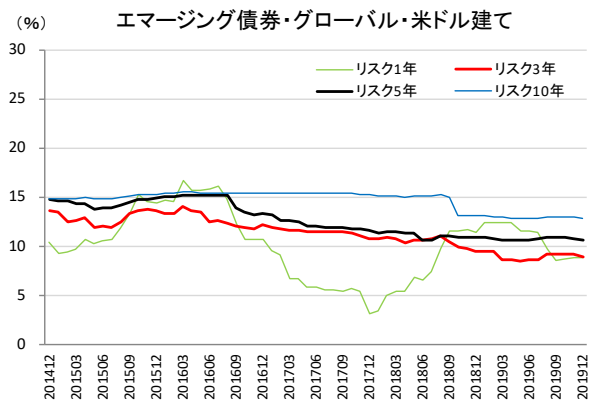


<2> リスク・サマリー

(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]

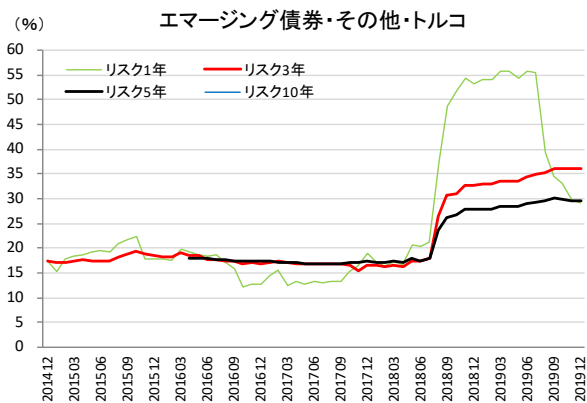


<2> リスク・サマリー

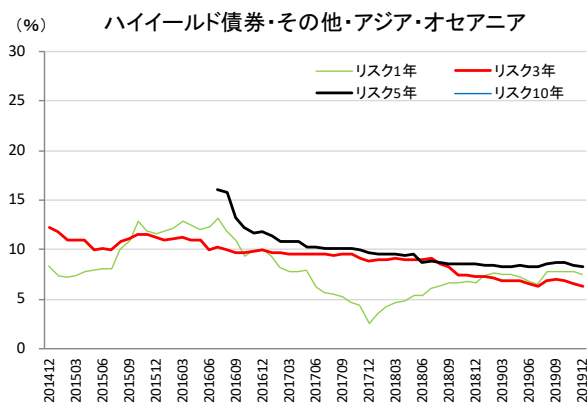
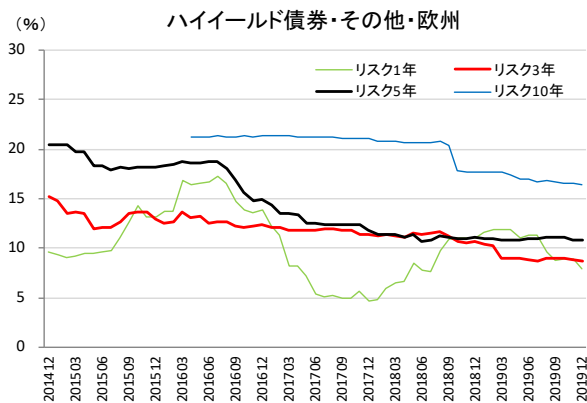
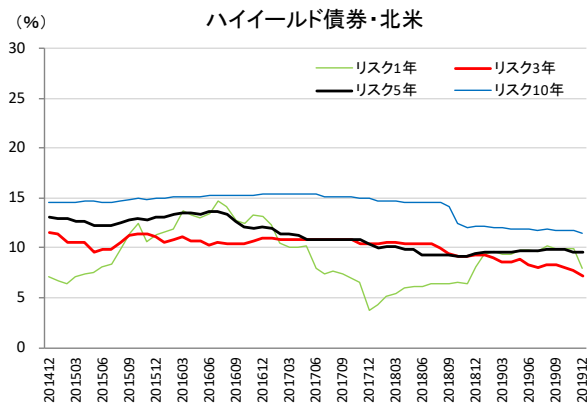
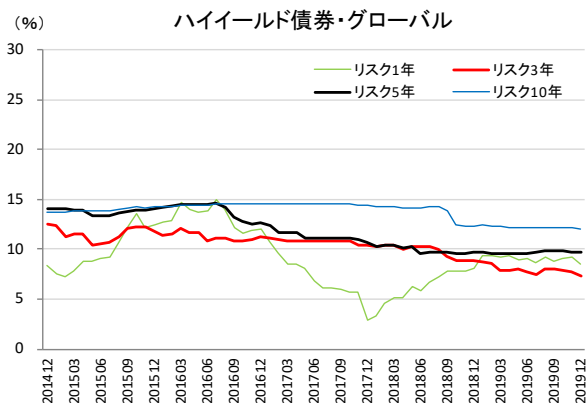
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

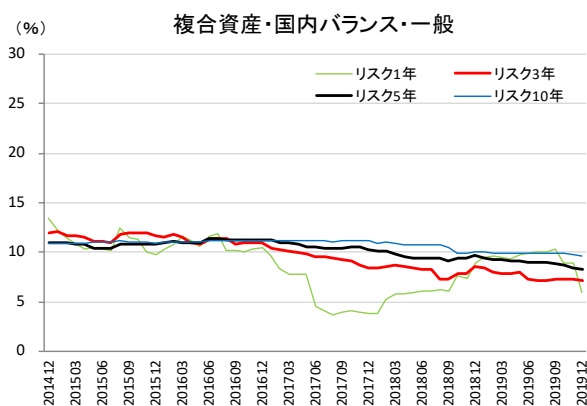
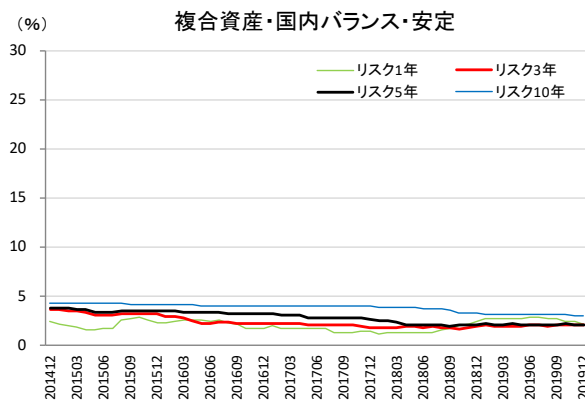
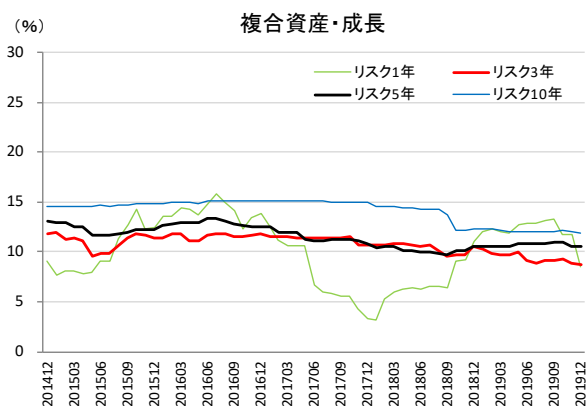
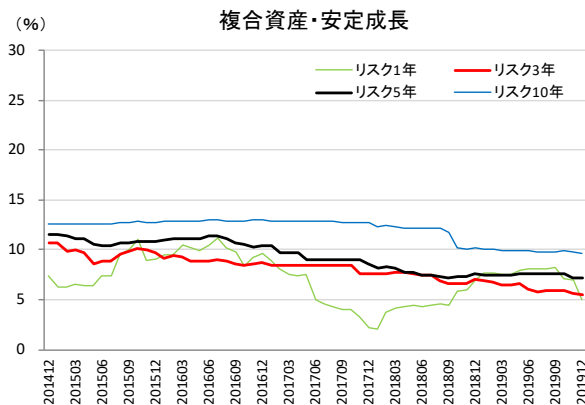
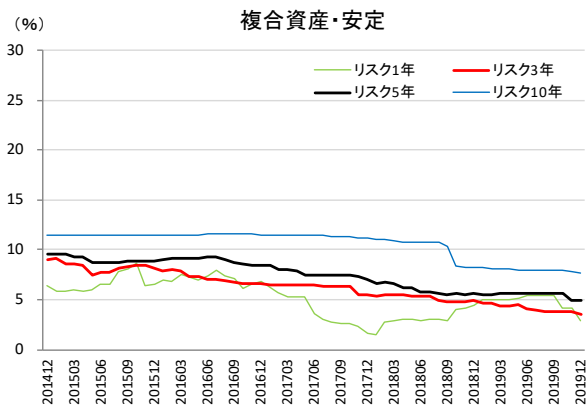


<2> リスク・サマリー

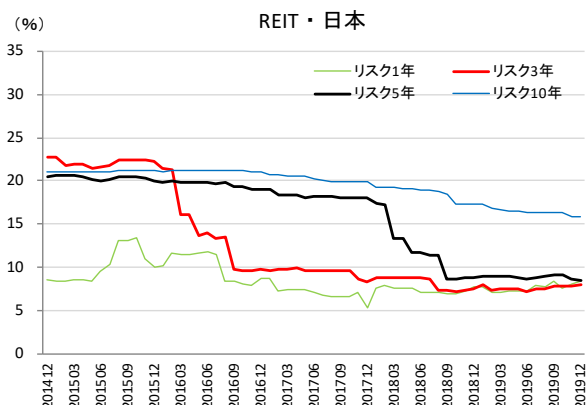
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

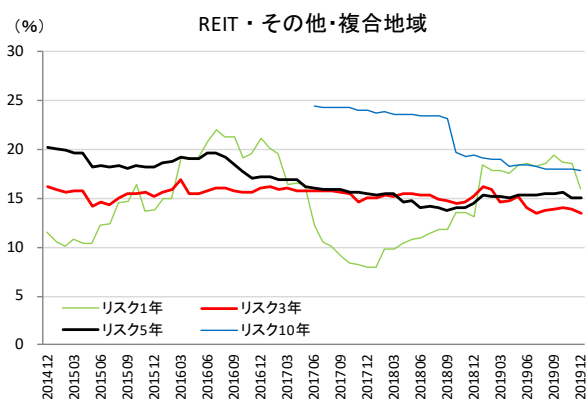
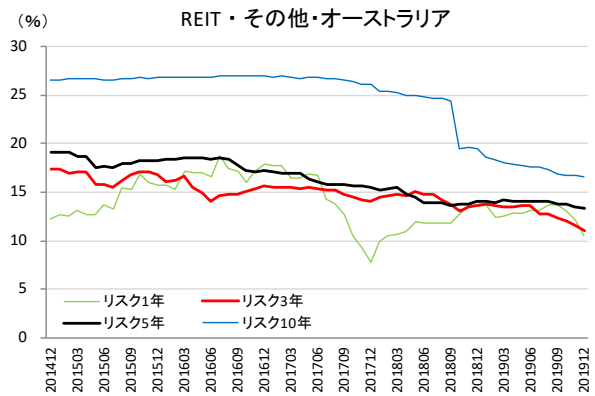
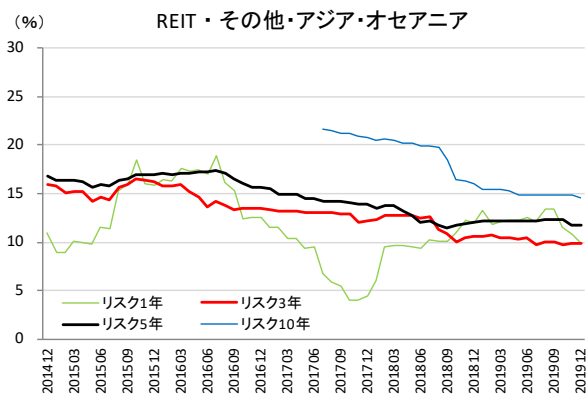
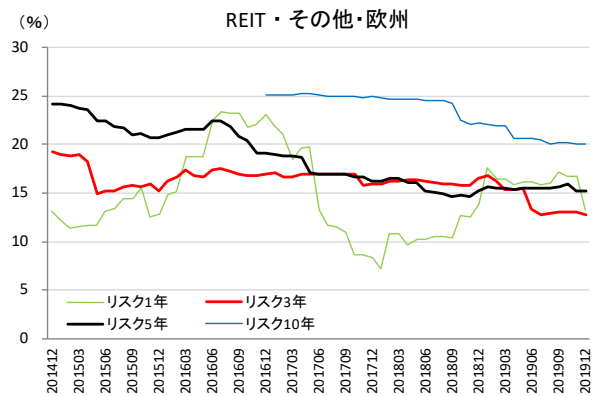
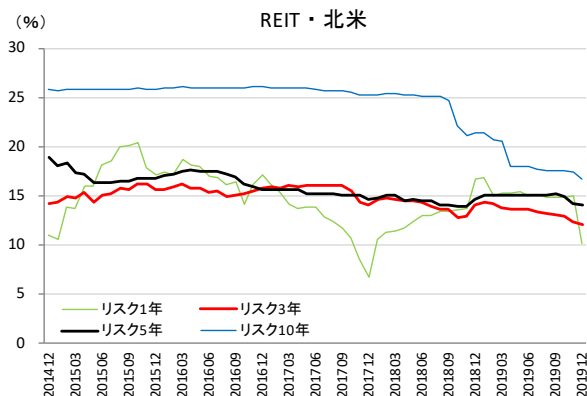
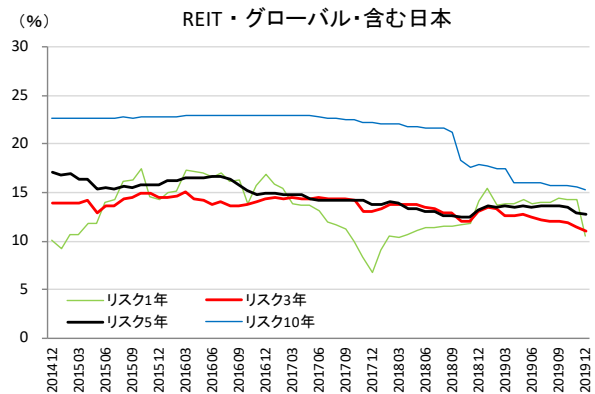
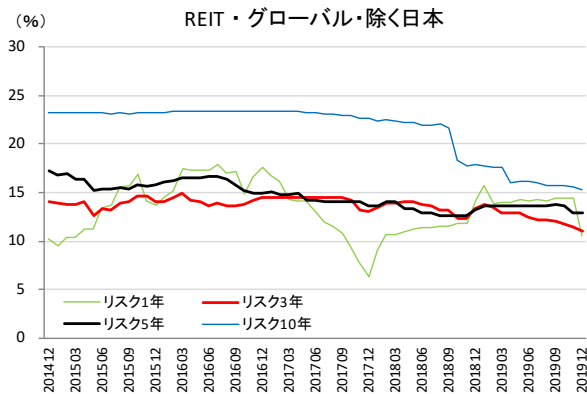


<2> リスク・サマリー

(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]

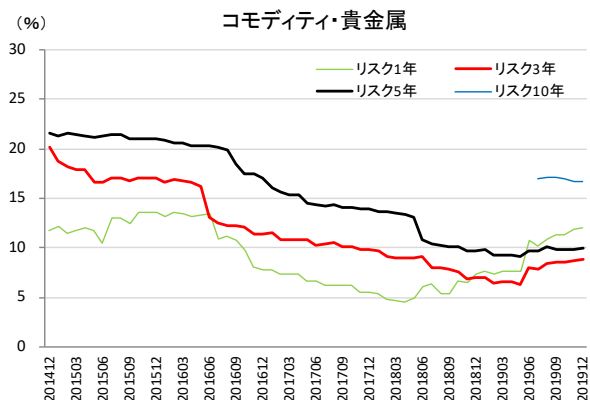
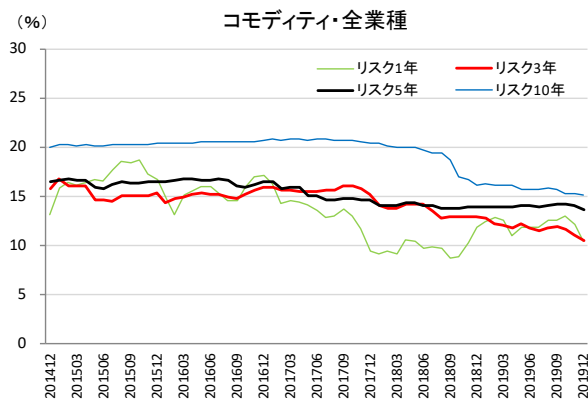
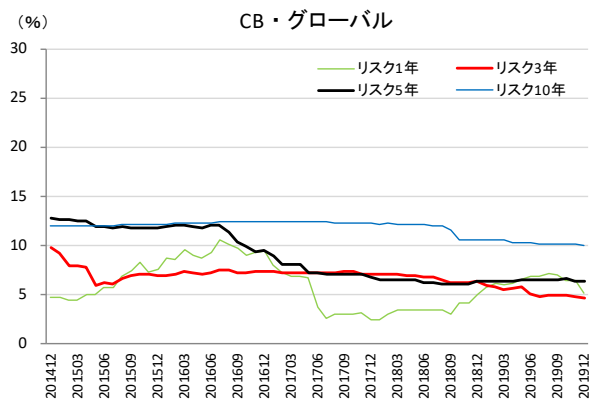
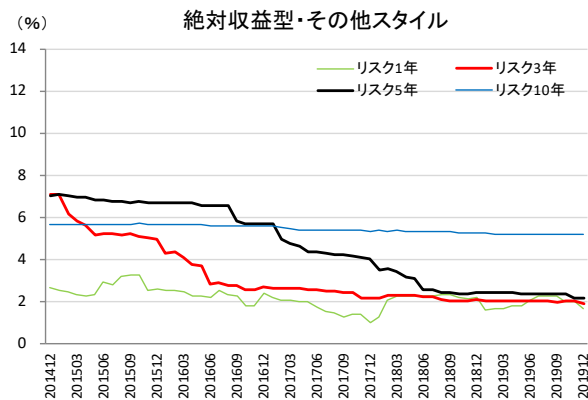
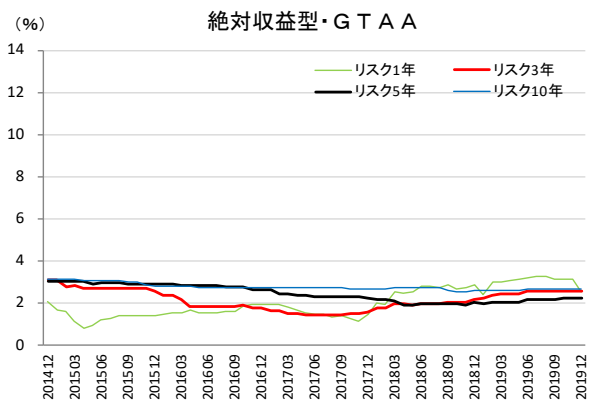
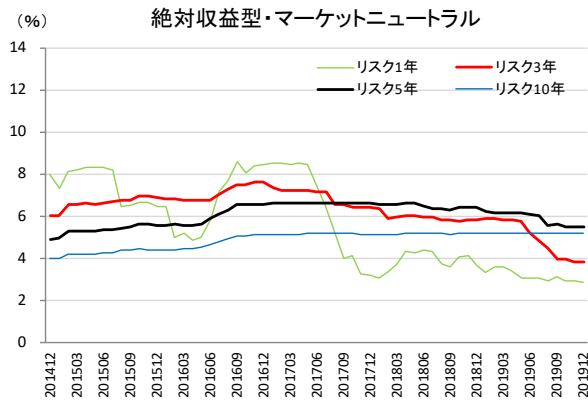
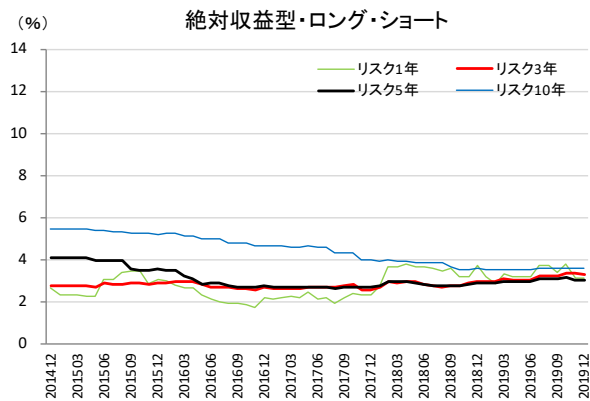


<2>リスク・サマリー

(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	-1,509	-6,266	-2,275	-5,083
国内株式	-3,048	-8,874	-11,211	-13,548
一般	-1,780	-4,666	-5,914	-7,618
フリー	-1,631	-4,276	-5,442	-6,907
バリュー	-149	-391	-472	-712
小型	-505	-1,147	-1,704	-2,107
その他	-740	-3,014	-3,533	-3,734
日経225	-826	-2,985	-3,607	-4,064
TOPIX	182	252	450	714
JPX日経400	-52	-148	-184	-195
国内債券	325	584	793	997
一般	325	584	793	997
外国株式(先進国)	389	-255	2,343	3,436
グローバル	-1,500	-2,846	-1,032	1,065
除く日本	777	1,096	1,854	2,749
含む日本	-2,278	-3,942	-2,886	-1,684
その他	1,889	2,591	3,375	2,371
北米	-6	1	34	60
米国	1,931	2,649	3,386	2,706
カナダ	-14	-40	-57	-118
欧州	-42	-118	-206	-420
ドイツ	0	-1	-2	-2
イギリス	0	-2	-4	-7
アジア・オセアニア	0	-6	-13	-42
オーストラリア	23	108	239	196
ニュージーランド	0	0	-1	0
複合地域	0	-1	-1	-2
エマーGING株式	-825	-2,072	-3,313	-5,953
グローバル	-246	-574	-1,167	-2,425
BRICS	-14	-36	-46	-87
その他	-565	-1,463	-2,099	-3,441
欧州	-7	-12	-22	-56
ロシア	-3	-8	-12	-32
アジア・オセアニア	-141	-355	-624	-1,067
中国	-90	-329	-582	-765
インド	-331	-806	-953	-1,726
インドネシア	-4	-8	-11	-35
タイ	-2	-5	-8	-21
フィリピン	-1	-7	-16	-48
ベトナム	43	80	76	250
韓国	0	-1	0	-3
香港	0	0	1	0
台湾	0	0	0	0
中南米	-2	-5	-9	-18
ブラジル	-21	2	30	64
メキシコ	-1	-2	-2	-4
中東・アフリカ	-2	-3	41	34
トルコ	-3	-5	-8	-12
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	-1,509	-6,266	-2,275	-5,083
外国債券(先進国)	-399	-1,330	-1,801	-4,109
グローバル	-181	-944	-1,543	-3,537
除く日本	-188	-727	-1,145	-1,845
含む日本	8	-218	-398	-1,693
その他	-218	-386	-258	-572
北米	-1	-2	-5	-20
米国	-17	149	454	672
カナダ	-37	-112	-176	-347
欧州	44	155	396	701
イギリス	-1	-2	-3	-7
アジア・オセアニア	-43	-130	-242	-516
オーストラリア	-144	-385	-586	-855
ニュージーランド	-3	-9	-15	-35
複合地域	-17	-50	-80	-165
エマージング債券	-221	-615	-925	-923
グローバル	-52	-74	-93	-276
米ドル建て	-41	-66	-72	-310
現地通貨建て	-11	-9	-21	34
その他	-169	-541	-832	-648
ロシア	-7	-32	-65	-127
アジア・オセアニア	-8	-14	-17	-46
インド	-88	-209	-248	-389
インドネシア	-11	-41	-56	-74
ブラジル	-25	-56	-104	-238
メキシコ	-18	-76	-93	-113
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	-6	-18	-22	-18
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイイールド債券	-272	-674	-1,088	-2,520
グローバル	-19	-59	-121	-360
北米	-196	-469	-699	-1,504
その他	-57	-146	-269	-656
欧州	-48	-111	-209	-504
アジア・オセアニア	-5	-25	-40	-118
複合地域	0	-1	-2	-4
複合資産	1,998	5,689	10,514	14,976
安定	345	804	1,495	1,592
安定成長	164	748	1,960	3,045
成長	-16	-109	284	662
国内バランス	483	1,164	2,058	3,804
安定	502	1,229	2,165	3,892
一般	-14	-45	-70	-62
その他	1,023	3,082	4,717	5,873

< 3 > 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別③

(単位:億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	-1,509	-6,266	-2,275	-5,083
国内REIT	79	-186	316	1,504
日本	79	-186	316	1,504
外国REIT	608	1,671	2,489	1,553
グローバル	228	665	1,052	1,095
除く日本	81	260	383	824
含む日本	147	405	668	272
北米	334	930	1,238	-35
その他	46	76	200	493
欧州	-8	-20	-34	-69
アジア・オセアニア	52	104	184	598
オーストラリア	5	7	76	18
複合地域	0	-1	-1	-1
複数国	-3	-14	-24	-53
その他	-144	-203	-392	-495
絶対収益型	79	251	297	161
ロング・ショート	-20	-52	-148	-324
マーケットニュートラル	-17	-36	-89	-2
GTAA	-6	-16	-34	-58
その他スタイル	121	356	568	545
CB	-67	-149	-224	-357
アジア・オセアニア	-1	-2	-4	-3
日本	-1	-4	-7	-12
グローバル	-65	-143	-213	-340
コモディティ	25	65	59	291
全業種	-3	-6	13	34
貴金属	28	70	43	254
エネルギー	-1	-1	1	0
その他コモディティ	0	1	2	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	655,647	100.00	5,454	100.00
国内株式	101,762	15.52	884	16.21
一般	61,012	9.31	581	10.65
フリー	48,329	7.37	462	8.47
バリュー	12,683	1.93	119	2.18
小型	9,539	1.45	93	1.71
その他	30,471	4.65	203	3.72
日経225	14,331	2.19	69	1.27
TOPIX	13,772	2.10	76	1.39
JPX日経400	715	0.11	20	0.37
国内債券	34,318	5.23	136	2.49
一般	34,318	5.23	136	2.49
外国株式(先進国)	162,561	24.79	988	18.12
グローバル	125,178	19.09	629	11.53
除く日本	28,746	4.38	176	3.23
含む日本	96,433	14.71	453	8.31
その他	37,383	5.70	359	6.58
北米	423	0.06	12	0.22
米国	28,587	4.36	241	4.42
カナダ	322	0.05	3	0.06
欧州	1,663	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	93	0.01	8	0.15
オーストラリア	6,225	0.95	32	0.59
ニュージーランド	15	0.00	1	0.02
複合地域	7	0.00	1	0.02
エマージング株式	31,346	4.78	356	6.53
グローバル	8,279	1.26	101	1.85
BRICS	726	0.11	8	0.15
その他	22,341	3.41	247	4.53
欧州	233	0.04	8	0.15
ロシア	127	0.02	4	0.07
アジア・オセアニア	6,383	0.97	108	1.98
中国	2,051	0.31	29	0.53
インド	10,517	1.60	30	0.55
インドネシア	201	0.03	8	0.15
タイ	85	0.01	4	0.07
フィリピン	81	0.01	5	0.09
ベトナム	1,183	0.18	9	0.17
韓国	4	0.00	1	0.02
香港	11	0.00	1	0.02
台湾	1	0.00	1	0.02
中南米	81	0.01	2	0.04
ブラジル	1,100	0.17	20	0.37
メキシコ	21	0.00	3	0.06
中東・アフリカ	163	0.02	8	0.15
トルコ	78	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	655,647	100.00	5,454	100.00
外国債券(先進国)	85,056	12.97	852	15.62
グローバル	61,924	9.44	552	10.12
除く日本	32,929	5.02	239	4.38
含む日本	28,995	4.42	313	5.74
その他	23,132	3.53	300	5.50
北米	93	0.01	6	0.11
米国	6,495	0.99	163	2.99
カナダ	1,298	0.20	7	0.13
欧州	1,786	0.27	37	0.68
イギリス	31	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	2,357	0.36	12	0.22
オーストラリア	9,346	1.43	42	0.77
ニュージーランド	171	0.03	14	0.26
複合地域	1,555	0.24	11	0.20
エマージング債券	19,108	2.91	299	5.48
グローバル	9,047	1.38	193	3.54
米ドル建て	7,300	1.11	152	2.79
現地通貨建て	1,748	0.27	41	0.75
その他	10,061	1.53	106	1.94
ロシア	226	0.03	5	0.09
アジア・オセアニア	490	0.07	17	0.31
インド	4,354	0.66	22	0.40
インドネシア	573	0.09	11	0.20
ブラジル	3,205	0.49	25	0.46
メキシコ	543	0.08	9	0.17
南アフリカ	3	0.00	1	0.02
トルコ	164	0.03	6	0.11
複合地域	54	0.01	1	0.02
ハイールド債券	22,484	3.43	317	5.81
グローバル	3,525	0.54	62	1.14
北米	14,787	2.26	162	2.97
その他	4,172	0.64	93	1.71
欧州	3,286	0.50	51	0.94
アジア・オセアニア	778	0.12	32	0.59
複合地域	47	0.01	1	0.02
複合資産	106,260	16.21	1,000	18.34
安定	28,753	4.39	296	5.43
安定成長	47,000	7.17	418	7.66
成長	13,501	2.06	241	4.42
国内バランス	10,851	1.66	33	0.61
安定	10,282	1.57	9	0.17
一般	461	0.07	18	0.33
その他	6,156	0.94	12	0.22

<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	655,647	100.00		5,454	100.00
国内REIT	30,127	4.60		123	2.26
日本	30,127	4.60		123	2.26
外国REIT	49,870	7.61		290	5.32
グローバル	19,613	2.99		137	2.51
除く日本	4,090	0.62		50	0.92
含む日本	15,522	2.37		87	1.60
北米	25,046	3.82		83	1.52
その他	5,211	0.79		70	1.28
欧州	279	0.04		18	0.33
アジア・オセアニア	3,678	0.56		34	0.62
オーストラリア	888	0.14		13	0.24
複合地域	53	0.01		3	0.06
複数国	314	0.05		2	0.04
その他	12,755	1.95		209	3.83
絶対収益型	7,509	1.15		96	1.76
ロング・ショート	884	0.13		30	0.55
マーケットニュートラル	1,104	0.17		15	0.28
GTAA	417	0.06		14	0.26
その他スタイル	5,104	0.78		37	0.68
CB	1,430	0.22		45	0.83
アジア・オセアニア	38	0.01		1	0.02
日本	63	0.01		3	0.06
グローバル	1,328	0.20		41	0.75
コモディティ	2,014	0.31		27	0.50
全業種	894	0.14		14	0.26
貴金属	1,087	0.17		11	0.20
エネルギー	22	0.00		1	0.02
その他コモディティ	10	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	12,039	8.3	3.99	3.83	1.298
国内株式	15,100	11.3	1.28	1.26	1.177
一般	13,895	10.9	1.69	1.72	1.432
フリー	13,551	10.3	1.93	1.99	1.479
バリュー	15,233	13.0	0.79	0.70	1.252
小型	21,365	11.9	1.22	1.05	1.743
その他	15,776	12.0	0.51	0.43	0.480
日経225	16,467	13.8	0.53	0.45	0.580
TOPIX	16,466	13.3	0.33	0.28	0.328
JPX日経400	14,168	5.4	0.04	0.04	0.553
国内債券	11,106	10.3	0.34	0.34	0.356
一般	11,106	10.3	0.34	0.34	0.356
外国株式(先進国)	13,275	6.7	4.22	3.94	1.589
グローバル	13,975	7.1	3.16	2.97	1.563
除く日本	16,929	9.1	0.90	0.80	0.763
含む日本	12,827	6.3	3.86	3.63	1.802
その他	12,049	6.0	7.84	7.28	1.675
北米	12,244	6.5	6.93	5.89	1.921
米国	12,626	5.4	6.00	5.12	1.635
カナダ	7,121	7.8	18.04	18.43	1.992
欧州	11,994	8.6	3.32	2.95	1.676
ドイツ	11,108	5.8	0.00	0.00	0.770
イギリス	5,856	5.6	16.34	17.87	1.944
アジア・オセアニア	9,821	5.7	5.71	5.36	1.701
オーストラリア	9,194	5.5	16.50	17.13	1.827
ニュージーランド	14,932	7.4	3.21	2.68	1.672
複合地域	8,022	6.7	0.00	0.00	1.705
エマージング株式	12,462	8.8	3.17	3.18	1.827
グローバル	11,697	6.6	2.25	2.00	1.488
BRICS	15,136	12.0	1.24	1.00	2.068
その他	12,688	9.6	3.58	3.69	1.945
欧州	10,342	13.7	0.26	0.20	1.991
ロシア	11,871	10.6	0.70	0.50	2.016
アジア・オセアニア	13,123	9.6	7.64	7.50	1.742
中国	19,062	9.9	1.57	1.25	1.965
インド	12,298	10.0	1.26	1.22	2.075
インドネシア	10,703	8.5	0.46	0.44	1.853
タイ	11,178	11.7	0.71	0.71	1.707
フィリピン	11,139	6.4	0.61	0.58	1.796
ベトナム	11,540	4.3	0.81	0.81	1.869
韓国	9,361	1.0	0.00	0.00	1.804
香港	15,874	10.3	2.15	1.95	0.858
台湾	11,245	7.1	0.00	0.00	1.661
中南米	8,950	13.0	0.00	0.00	2.040
ブラジル	7,453	9.6	11.94	16.03	1.939
メキシコ	8,807	6.1	0.00	0.00	1.916
中東・アフリカ	10,089	9.1	0.20	1.24	2.073
トルコ	6,676	13.4	0.00	0.00	2.041
複合地域	18,792	11.6	3.18	2.85	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

< 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	12,039	8.3	3.99	3.83	1.298
外国債券(先進国)	9,920	7.9	2.84	2.85	1.136
グローバル	10,437	8.2	1.98	1.98	1.075
除く日本	11,079	10.4	1.90	1.89	0.852
含む日本	9,948	6.5	2.08	2.07	1.328
その他	8,969	7.4	5.14	5.19	1.298
北米	10,375	5.7	1.89	1.84	1.813
米国	9,621	6.2	5.47	5.17	1.382
カナダ	8,055	7.5	4.64	4.60	1.367
欧州	8,509	9.6	1.38	1.38	1.041
イギリス	7,942	5.1	3.91	3.89	1.278
アジア・オセアニア	7,794	9.2	3.24	3.28	1.422
オーストラリア	7,956	10.5	6.42	6.75	1.261
ニュージーランド	9,454	5.2	2.89	2.90	1.335
複合地域	5,781	10.0	3.96	3.99	1.192
エマージング債券	8,988	8.2	7.14	7.29	1.600
グローバル	9,295	9.0	6.67	6.74	1.583
米ドル建て	9,377	9.3	6.99	7.08	1.635
現地通貨建て	8,990	8.0	5.37	5.37	1.366
その他	8,431	6.8	7.55	7.76	1.616
ロシア	9,298	6.9	6.88	5.81	1.609
アジア・オセアニア	9,007	6.7	12.33	13.44	1.642
インド	9,185	5.1	7.72	8.04	1.700
インドネシア	7,505	7.4	7.27	6.95	1.663
ブラジル	8,978	9.9	7.75	8.09	1.592
メキシコ	6,852	7.1	6.13	5.47	1.395
南アフリカ	7,356	7.7	7.59	7.34	1.430
トルコ	3,689	7.0	8.91	8.37	1.453
複合地域	4,313	13.3	5.87	5.56	1.210
ハイイールド債券	8,833	8.5	9.32	9.34	1.700
グローバル	7,591	8.0	7.52	7.48	1.608
北米	9,759	9.7	9.08	8.97	1.702
その他	8,048	6.6	11.68	12.18	1.768
欧州	7,638	6.6	12.33	12.91	1.747
アジア・オセアニア	8,327	7.7	10.09	10.34	1.875
複合地域	4,516	15.8	5.42	5.31	1.800
複合資産	12,022	7.9	1.69	1.61	1.058
安定	11,236	7.5	0.91	0.86	1.154
安定成長	11,704	8.3	2.40	2.31	1.112
成長	13,671	8.0	0.33	0.29	0.946
国内バランス	11,554	8.0	2.21	2.15	0.943
安定	11,006	8.8	2.26	2.20	0.921
一般	11,987	9.1	0.95	0.86	1.362
その他	10,628	0.3	2.09	1.65	0.645

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

< 5 > 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別③

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	12,039	8.3	3.99	3.83	1.298
国内REIT	15,067	8.1	10.20	9.40	0.958
日本	15,067	8.1	10.20	9.40	0.958
外国REIT	11,380	7.0	12.24	11.64	1.570
グローバル	12,157	7.7	10.42	10.24	1.430
除く日本	14,102	6.0	6.86	7.32	1.122
含む日本	11,039	8.7	11.35	11.01	1.512
北米	10,422	7.1	14.17	13.17	1.629
その他	10,997	5.8	9.85	9.58	1.807
欧州	9,787	5.4	5.10	4.65	1.857
アジア・オセアニア	12,298	5.6	12.19	11.95	1.850
オーストラリア	9,833	5.1	4.59	4.32	1.718
複合地域	7,669	7.9	1.56	1.31	0.854
複数国	12,335	12.7	2.91	2.42	1.657
その他					
絶対収益型	10,289	5.2	0.09	0.09	1.673
ロング・ショート	10,453	5.0	0.49	0.47	1.597
マーケットニュートラル	10,370	4.4	0.11	0.11	1.237
GTAA	10,725	5.8	0.00	0.00	1.589
その他スタイル	9,959	5.3	0.02	0.02	1.787
CB	11,273	6.2	0.97	0.91	1.517
アジア・オセアニア	8,264	9.5	3.06	2.90	1.823
日本	11,137	8.6	0.19	0.19	1.053
グローバル	11,356	6.0	0.95	0.88	1.530
コモディティ	8,274	6.5	0.00	0.00	0.909
全業種	6,092	8.3	0.00	0.00	1.245
貴金属	10,625	3.9	0.00	0.00	0.632
エネルギー	9,622	10.8	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	11,611	3.3	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