

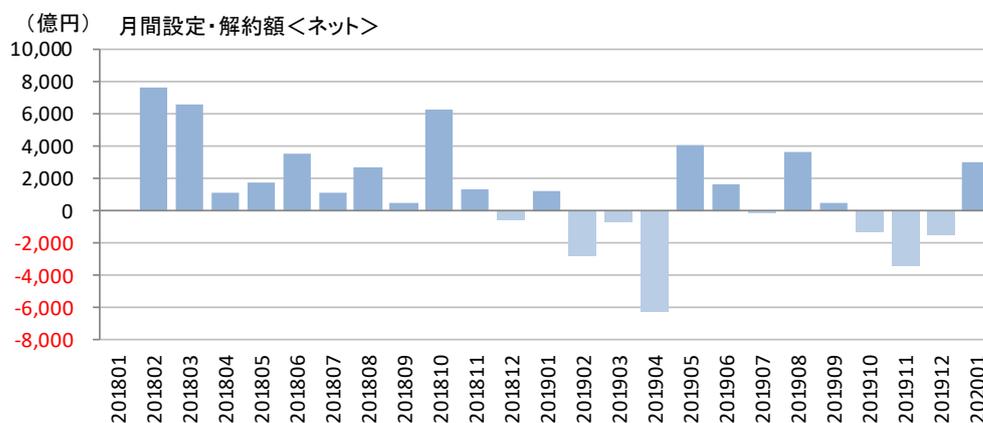
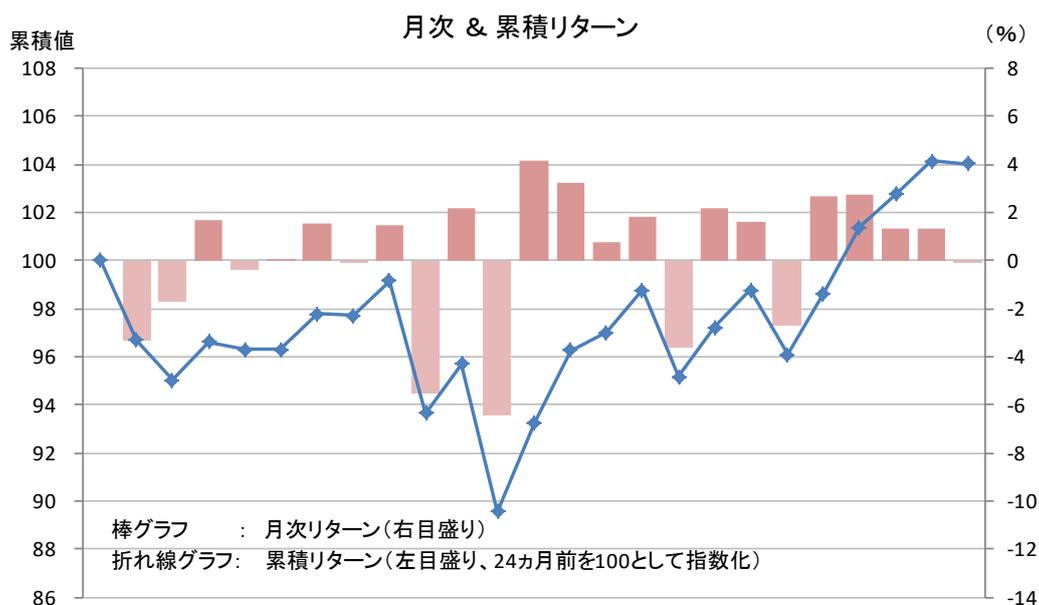
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

— Vol.2 ファンド分類 詳細編 —

2020年1月

「総合」 -0.08 %
(前月 +1.33 %)



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		13,602	13,613	-11	-0.08
国内株式		16,097	16,586	-488	-2.95
一般		15,682	16,188	-505	-3.12
フリー		14,734	15,224	-490	-3.22
バリュー		20,275	20,849	-574	-2.75
小型		33,606	35,162	-1,556	-4.42
その他		15,879	16,226	-347	-2.14
日経225		15,192	15,495	-304	-1.96
TOPIX		15,692	16,039	-347	-2.16
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	14,836	15,123	-287	-1.90
国内債券		13,386	13,322	64	0.48
一般		13,386	13,322	64	0.48
外国株式(先進国)		15,685	15,598	87	0.56
グローバル		17,327	17,220	107	0.62
除く日本		24,229	24,291	-62	-0.26
含む日本		15,792	15,654	138	0.88
その他		12,308	12,265	44	0.36
北米		12,014	11,956	58	0.48
米国		18,478	18,255	223	1.22
カナダ	10,000 (2009.02.27)	17,418	17,462	-45	-0.26
欧州		19,050	19,314	-264	-1.37
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	8,876	9,173	-297	-3.24
イギリス	9,683 (2014.05.30)	8,980	9,195	-215	-2.34
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	34,347	35,629	-1,282	-3.60
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	15,720	16,226	-506	-3.12
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	35,489	36,760	-1,271	-3.46
複合地域	10,000 (2013.04.30)	8,226	8,757	-532	-6.07
エマージング株式		15,068	15,321	-252	-1.65
グローバル		15,001	15,459	-458	-2.96
BRICS	10,000 (2005.09.30)	24,606	25,521	-915	-3.58
その他		15,562	15,733	-171	-1.09
欧州		27,353	27,866	-513	-1.84
ロシア	10,000 (2007.03.30)	11,461	11,411	50	0.44
アジア・オセアニア		15,513	16,242	-729	-4.49
中国		35,899	35,870	29	0.08
インド	10,000 (2004.09.30)	33,370	32,962	409	1.24
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	14,005	14,359	-354	-2.46
タイ		20,758	22,455	-1,697	-7.56
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,714	8,261	-546	-6.61
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	14,262	14,399	-137	-0.95
韓国	10,000 (1997.06.30)	20,499	20,810	-311	-1.50
香港		22,264	23,849	-1,585	-6.65
台湾	10,000 (2008.03.31)	16,441	17,274	-833	-4.82
中南米	7,427 (2006.04.28)	8,922	9,244	-322	-3.49
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	10,264	10,794	-530	-4.91
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	9,775	9,709	66	0.68
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	9,378	9,494	-115	-1.22
トルコ		23,744	22,681	1,063	4.69
複合地域	10,000 (2005.08.31)	20,203	21,390	-1,186	-5.55

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000
[色塗りの基準]月次リターン> 総合

<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		13,602	13,613	-11	-0.08
外国債券(先進国)		17,974	17,950	23	0.13
グローバル		18,373	18,270	103	0.56
除く日本		19,618	19,509	108	0.56
含む日本		17,700	17,599	101	0.57
その他		16,861	17,038	-177	-1.04
北米	9,052 (2013.05.31)	10,579	10,446	134	1.28
米国		16,204	16,028	176	1.10
カナダ	10,000 (2003.05.30)	14,101	14,140	-40	-0.28
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,367	15,310	56	0.37
イギリス	10,069 (2014.07.31)	9,767	9,739	28	0.28
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	18,132	18,656	-524	-2.81
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	22,331	22,957	-626	-2.73
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	10,846	11,096	-251	-2.26
複合地域	10,000 (2001.11.30)	16,928	16,844	85	0.50
エマージング債券		17,438	17,574	-136	-0.77
グローバル		18,908	19,021	-113	-0.60
米ドル建て		19,536	19,637	-101	-0.52
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	13,059	13,182	-122	-0.93
その他	8,647 (2005.03.31)	12,781	12,901	-120	-0.93
ロシア	10,000 (2008.05.30)	11,771	11,994	-224	-1.86
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	14,554	14,487	66	0.46
インド	10,000 (2011.08.31)	15,946	15,944	2	0.02
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	14,251	13,781	471	3.42
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	12,581	13,114	-533	-4.07
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	12,799	12,617	183	1.45
南アフリカ	10,000 (2010.03.31)	10,912	11,510	-598	-5.19
トルコ	10,000 (2011.04.28)	6,414	6,067	347	5.72
複合地域	10,000 (2006.08.31)	11,376	11,421	-45	-0.40
ハイイールド債券		22,024	22,335	-310	-1.39
グローバル	10,000 (1997.06.30)	22,319	22,643	-323	-1.43
北米		21,325	21,607	-282	-1.30
その他	10,000 (2004.03.31)	22,339	22,716	-377	-1.66
欧州	10,000 (2006.04.28)	22,433	22,880	-446	-1.95
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,481	14,565	-84	-0.58
複合地域	10,000 (2004.03.31)	19,297	19,562	-266	-1.36
複合資産		17,753	17,715	38	0.21
安定	10,000 (1998.10.30)	15,799	15,759	40	0.25
安定成長		18,992	18,994	-2	-0.01
成長		21,093	21,240	-147	-0.69
国内バランス		13,470	13,405	65	0.48
安定		13,813	13,740	74	0.54
一般		14,604	14,669	-65	-0.45
その他	10,000 (2018.10.31)	13,406	12,999	407	3.13

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000
[色塗りの基準]月次リターン> 総合

<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		13,602	13,613	-11	-0.08	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	36,477	35,294	1,183	3.35	
日本	10,000 (2003.10.31)	36,477	35,294	1,183	3.35	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	28,118	27,557	562	2.04	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	24,494	24,109	385	1.60	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	26,524	26,141	383	1.47	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	24,572	24,177	394	1.63	
北米	10,000 (2003.09.30)	28,088	27,346	742	2.71	
その他	10,000 (2004.04.30)	28,271	28,143	128	0.45	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,986	6,068	-82	-1.35	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	21,019	20,871	148	0.71	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	15,528	15,655	-126	-0.81	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,383	7,569	-187	-2.47	
複数国	10,000 (2004.04.30)	37,955	36,795	1,160	3.15	
その他		5,983	6,003	-20	-0.34	
絶対収益型		7,813	7,788	24	0.31	
ロング・ショート		9,042	9,012	30	0.33	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,854	11,885	-31	-0.26	
GTAA		10,930	10,863	67	0.62	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,326	7,296	30	0.41	
CB		19,097	19,026	70	0.37	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	15,662	15,595	67	0.43	
日本		20,109	20,263	-154	-0.76	
グローバル		33,524	33,384	140	0.42	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	8,036	8,104	-68	-0.83	
全業種	10,000 (2004.12.30)	6,209	6,644	-436	-6.55	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	15,708	15,088	620	4.11	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	4,390	4,983	-593	-11.90	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	9,814	10,512	-698	-6.64	

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

[色塗りの基準]月次リターン>総合

＜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	2.62	5.32	11.53	-0.08
国内株式	1.18	7.35	10.84	-2.95
一般	1.08	7.06	10.45	-3.12
フリー	1.16	6.82	11.23	-3.22
バリュー	0.75	8.03	7.28	-2.75
小型	1.90	4.83	10.58	-4.42
その他	1.01	8.56	11.53	-2.14
日経225	1.24	8.56	13.38	-1.96
TOPIX	1.13	8.71	9.82	-2.16
JPX日経400	1.24	9.36	10.36	-1.90
国内債券	-0.10	-0.31	1.59	0.48
一般	-0.10	-0.31	1.59	0.48
外国株式(先進国)	7.63	8.05	19.50	0.56
グローバル	8.08	8.68	20.00	0.62
除く日本	6.54	7.89	19.01	-0.26
含む日本	8.53	8.93	20.30	0.88
その他	6.06	5.85	17.78	0.36
北米	7.41	3.14	14.46	0.48
米国	7.95	7.41	20.62	1.22
カナダ	4.18	3.99	8.84	-0.26
欧州	5.37	8.50	16.81	-1.37
ドイツ	0.82	7.11	11.45	-3.24
イギリス	3.04	4.47	-1.14	-2.34
アジア・オセアニア	1.51	5.58	8.02	-3.60
オーストラリア	-1.65	-1.31	7.82	-3.12
ニュージーランド	6.26	1.79	16.32	-3.46
複合地域	1.60	-3.32	-6.43	-6.07
エマージング株式	2.66	5.06	11.90	-1.65
グローバル	4.32	5.86	14.62	-2.96
BRICS	3.85	5.25	14.31	-3.58
その他	2.04	4.77	10.87	-1.09
欧州	3.95	7.47	15.51	-1.84
ロシア	8.41	13.00	25.89	0.44
アジア・オセアニア	1.12	0.86	5.59	-4.49
中国	7.34	12.04	29.61	0.08
インド	2.39	7.47	13.25	1.24
インドネシア	-1.17	-3.59	-2.50	-2.46
タイ	-9.45	-14.01	-12.00	-7.56
フィリピン	-8.02	-10.10	-6.30	-6.61
ベトナム	-5.42	-4.29	0.36	-0.95
韓国	3.70	7.77	-7.02	-1.50
香港	0.05	-4.69	-1.17	-6.65
台湾	1.98	11.00	15.18	-4.82
中南米	4.01	3.00	4.11	-3.49
ブラジル	1.94	0.99	2.70	-4.91
メキシコ	4.30	12.89	6.92	0.68
中東・アフリカ	4.36	0.46	1.07	-1.22
トルコ	16.62	8.68	4.10	4.69
複合地域	0.14	-1.59	3.42	-5.55

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

＜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	2.62	5.32	11.53	-0.08
外国債券(先進国)	0.86	1.68	4.48	0.13
グローバル	1.19	1.93	5.41	0.56
除く日本	1.16	2.38	5.63	0.56
含む日本	1.24	1.43	5.17	0.57
その他	-0.06	0.97	2.01	-1.04
北米	1.46	2.28	5.20	1.28
米国	2.03	3.78	7.97	1.10
カナダ	0.95	1.00	3.15	-0.28
欧州	0.42	0.09	2.25	0.37
イギリス	2.12	7.95	2.93	0.28
アジア・オセアニア	-1.62	-0.76	-1.39	-2.81
オーストラリア	-1.67	-0.63	-1.33	-2.73
ニュージーランド	1.10	-0.38	-0.45	-2.26
複合地域	1.49	3.01	5.37	0.50
エマージング債券	0.32	-0.39	5.59	-0.77
グローバル	1.50	0.34	6.27	-0.60
米ドル建て	1.61	0.07	6.33	-0.52
現地通貨建て	1.05	1.52	6.00	-0.93
その他	-0.70	-1.02	5.00	-0.93
ロシア	3.09	8.04	19.62	-1.86
アジア・オセアニア	1.74	2.99	7.92	0.46
インド	0.22	-0.90	8.19	0.02
インドネシア	4.80	7.12	16.49	3.42
ブラジル	-5.35	-6.83	-3.91	-4.07
メキシコ	4.28	10.02	18.45	1.45
南アフリカ	4.27	-0.10	-2.67	-5.19
トルコ	6.86	15.63	16.85	5.72
複合地域	4.08	4.86	7.64	-0.40
ハイイールド債券	1.06	1.28	5.96	-1.39
グローバル	0.93	0.58	4.68	-1.43
北米	1.22	1.60	6.38	-1.30
その他	0.58	0.72	5.62	-1.66
欧州	0.44	0.66	5.54	-1.95
アジア・オセアニア	1.07	0.82	5.84	-0.58
複合地域	0.58	1.39	4.99	-1.36
複合資産	1.66	4.05	8.38	0.21
安定	1.28	2.59	6.59	0.25
安定成長	1.67	4.19	8.83	-0.01
成長	2.53	5.80	10.77	-0.69
国内バランス	-0.02	2.93	4.91	0.48
安定	-0.07	2.73	4.69	0.54
一般	0.99	5.65	7.96	-0.45
その他	3.91	10.54	27.43	3.13

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

＜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	2.62	5.32	11.53	-0.08
国内REIT	-0.29	11.34	22.88	3.35
日本	-0.29	11.34	22.88	3.35
外国REIT	0.52	6.43	14.33	2.04
グローバル	0.56	6.83	11.82	1.60
除く日本	0.72	7.79	13.64	1.47
含む日本	0.52	6.59	11.40	1.63
北米	0.43	7.08	16.77	2.71
その他	0.75	1.88	11.82	0.45
欧州	2.80	10.76	8.22	-1.35
アジア・オセアニア	0.75	0.60	12.73	0.71
オーストラリア	0.16	1.80	7.76	-0.81
複合地域	0.66	5.87	3.80	-2.47
複数国	0.62	8.85	18.48	3.15
その他	1.38	3.09	7.49	-0.34
絶対収益型	1.05	-0.32	2.70	0.31
ロング・ショート	0.59	-1.33	3.97	0.33
マーケットニュートラル	1.08	-1.20	0.32	-0.26
GTAA	2.09	1.32	6.53	0.62
その他スタイル	1.04	-0.03	2.63	0.41
CB	2.79	2.65	6.31	0.37
アジア・オセアニア	3.42	2.18	6.54	0.43
日本	-0.58	1.89	0.48	-0.76
グローバル	2.93	2.70	6.60	0.42
コモディティ	1.24	3.54	6.96	-0.83
全業種	-3.26	-2.56	-3.69	-6.55
貴金属	4.82	8.72	15.92	4.11
エネルギー	-1.89	-6.02	-2.61	-11.90
その他コモディティ	-1.86	-2.68	-3.14	-6.64

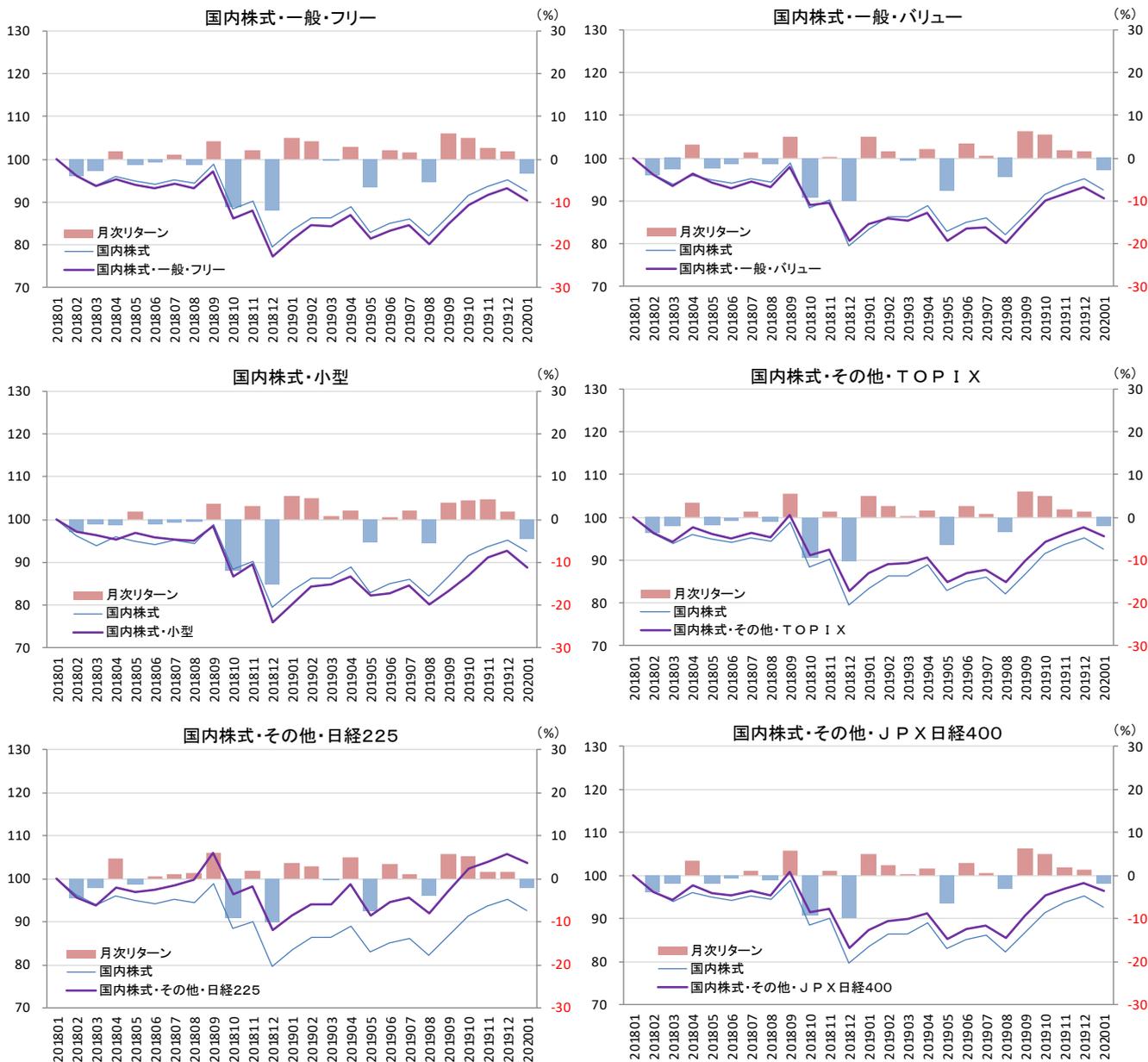
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

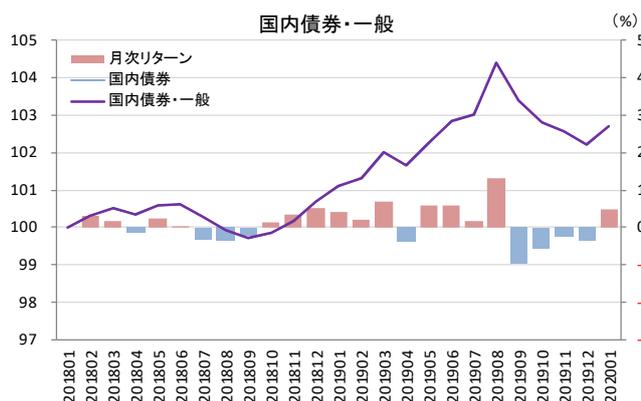
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

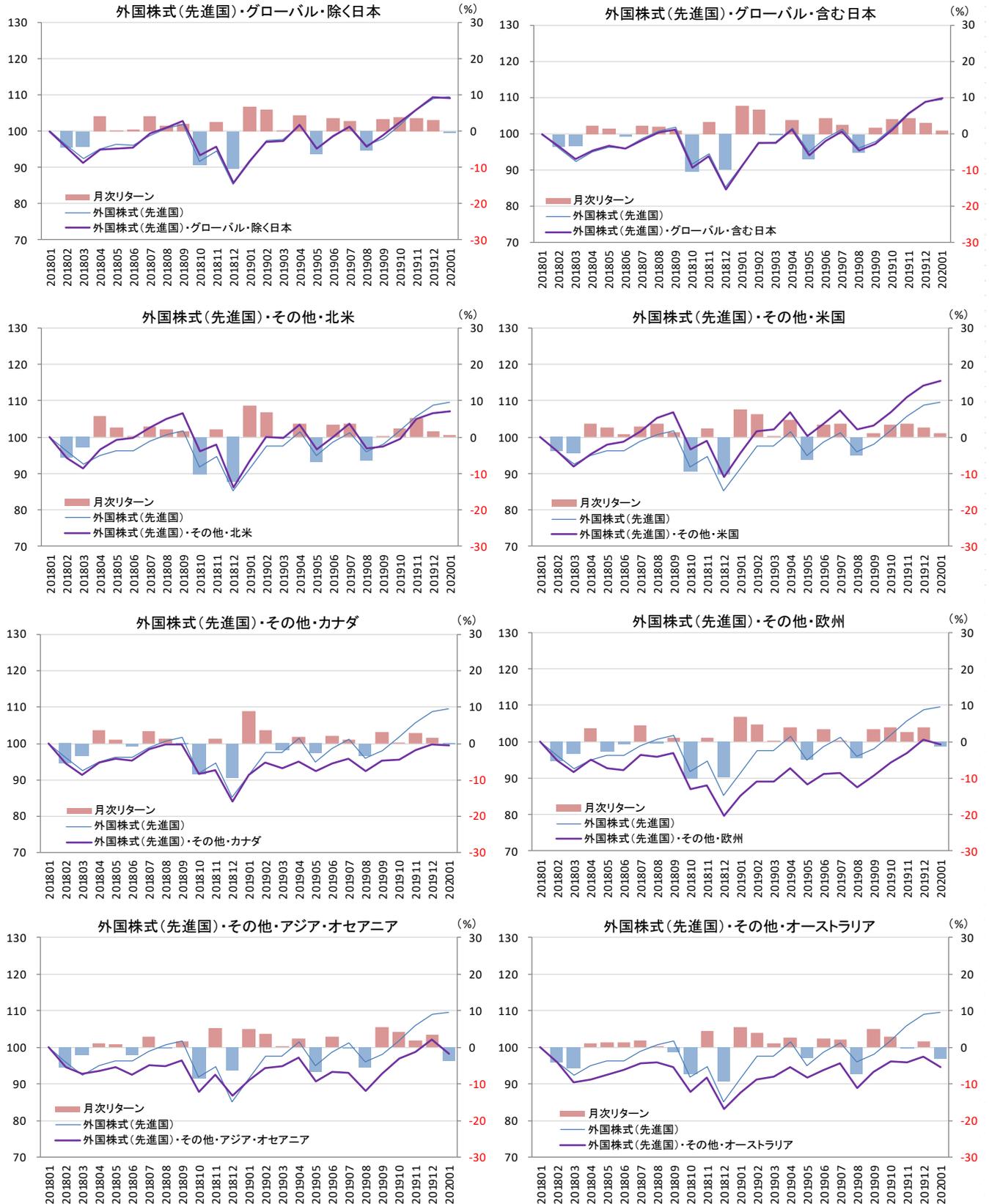


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

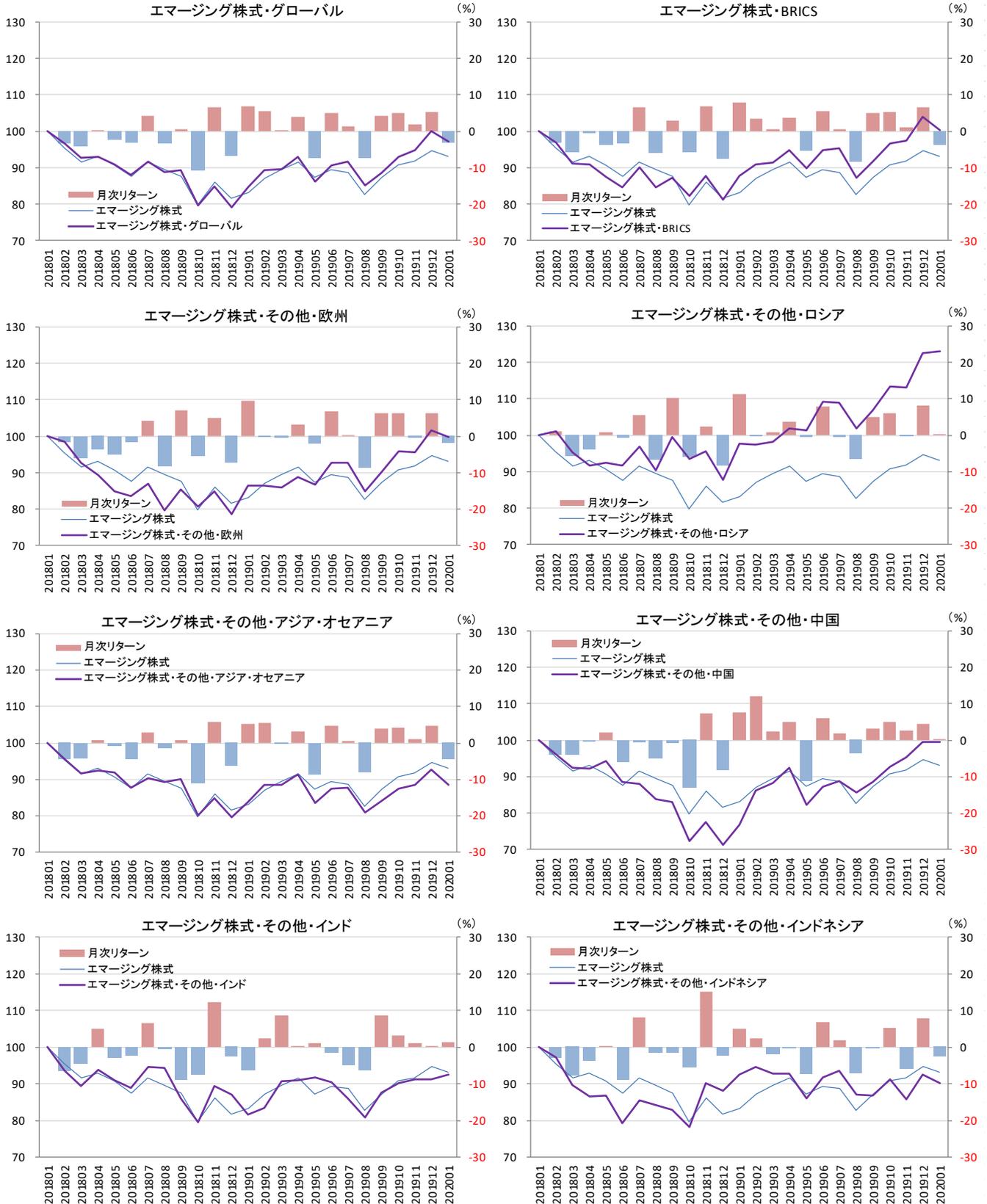


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマージング株式]

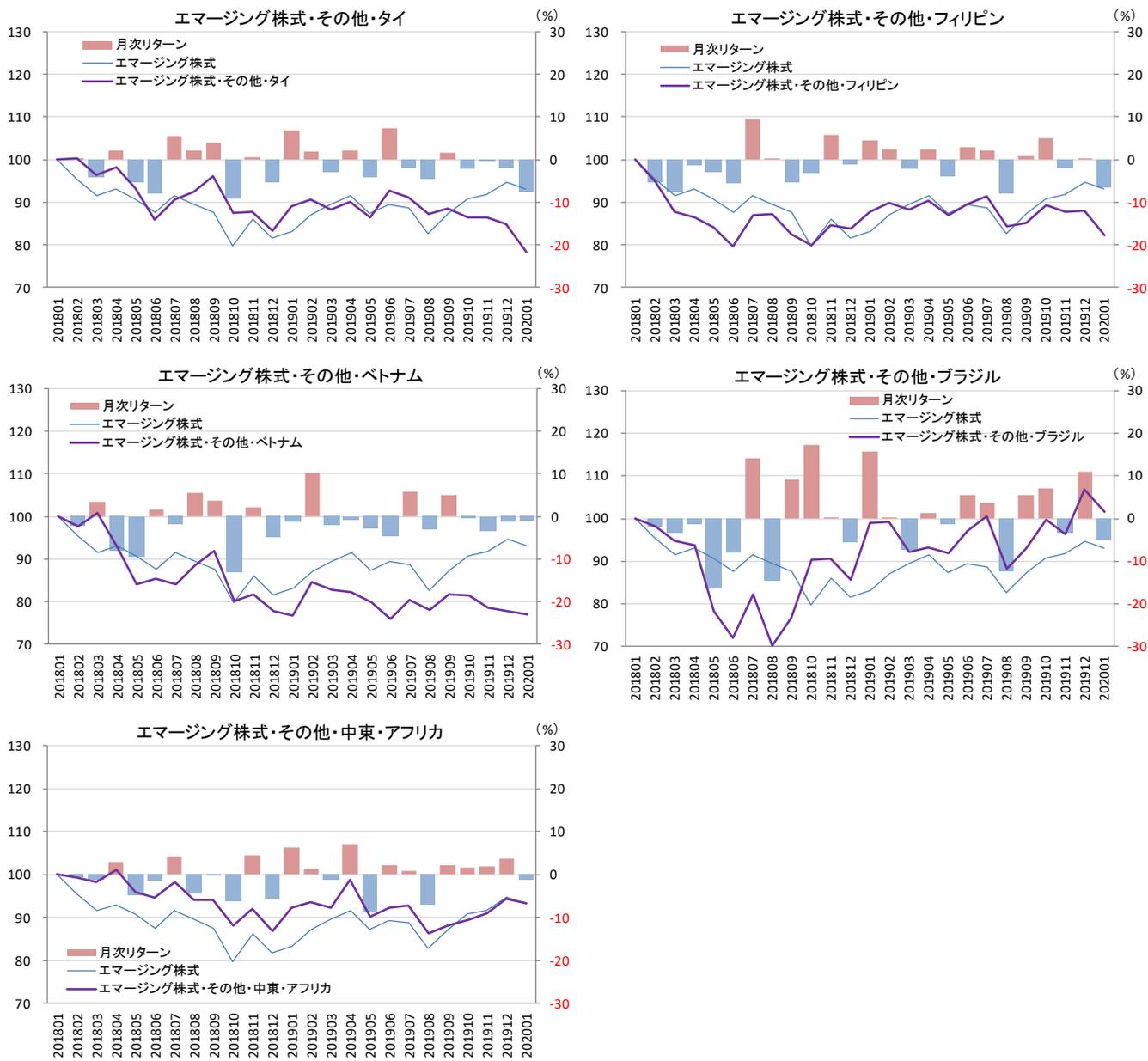


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

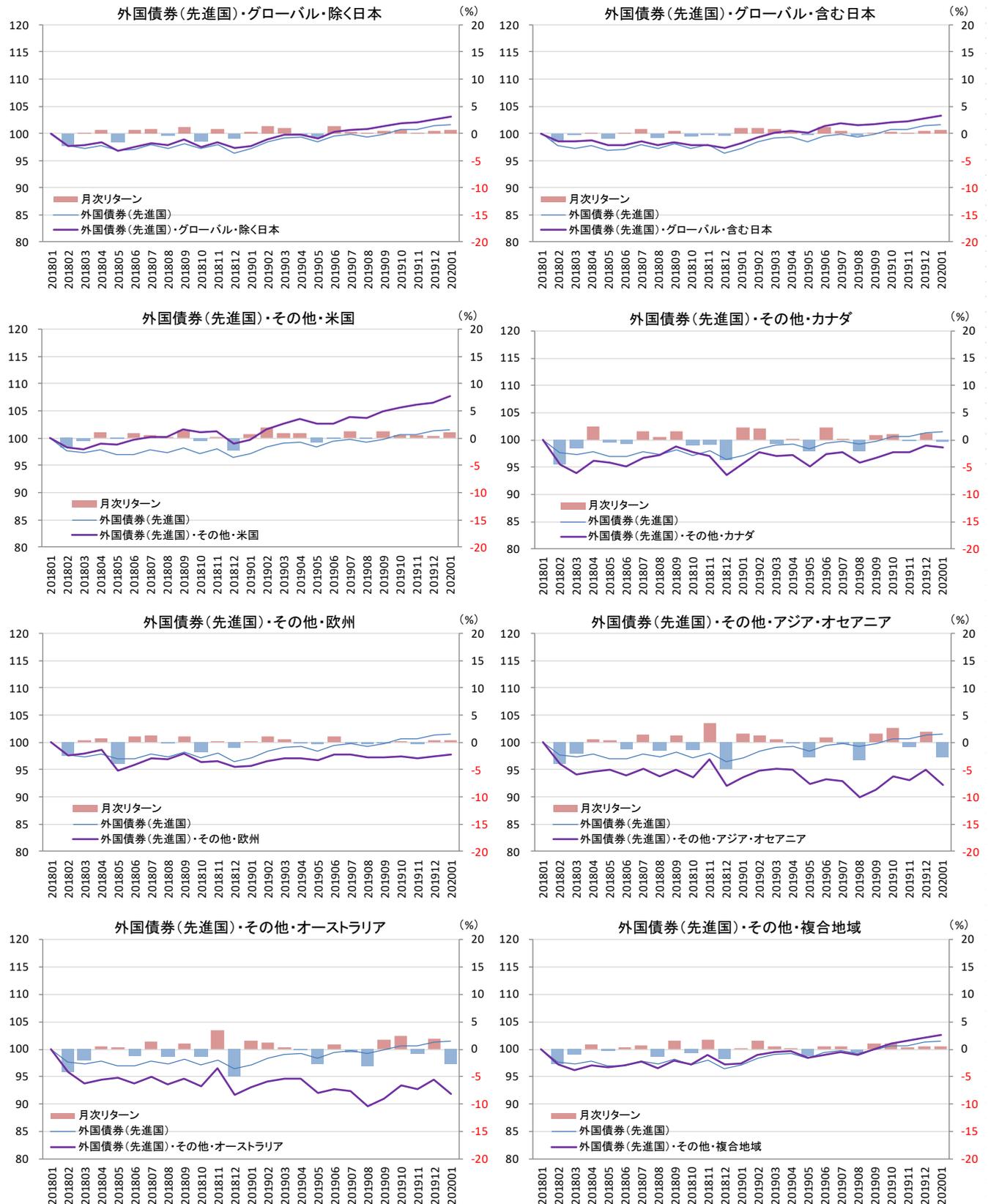


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

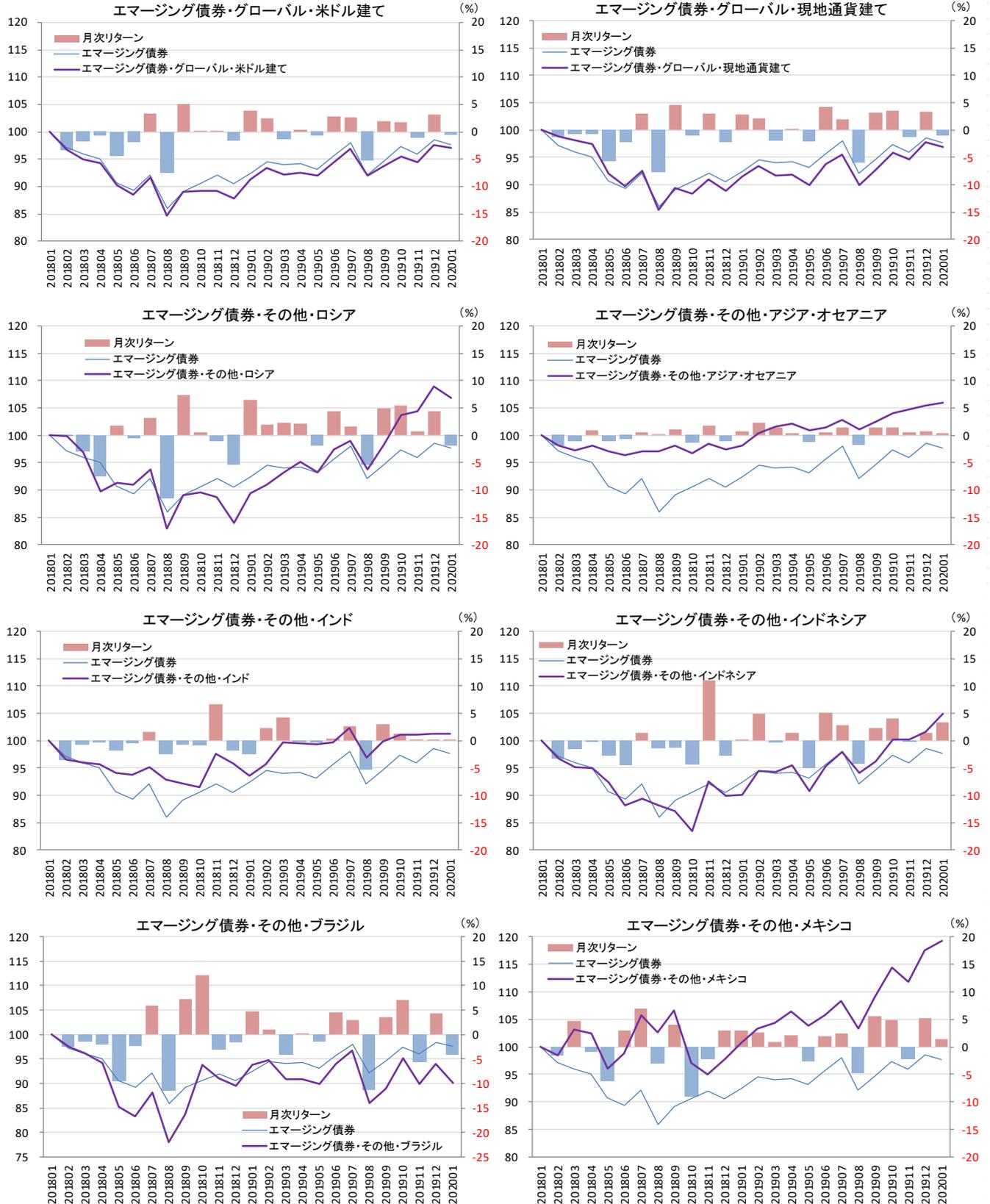


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24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]

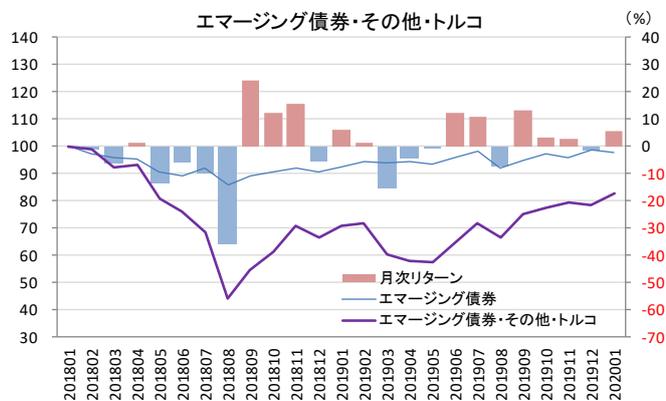


<1>パフォーマンス・サマリー

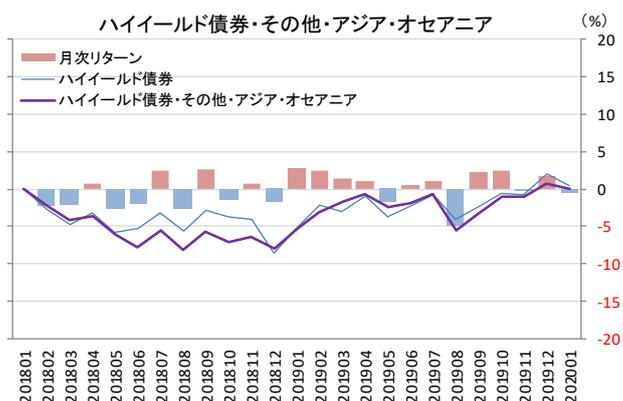
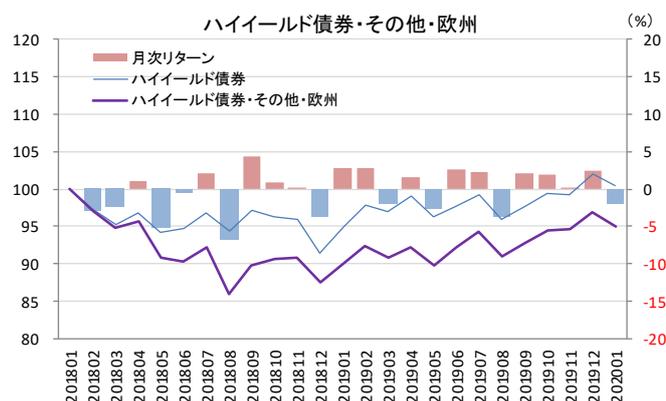
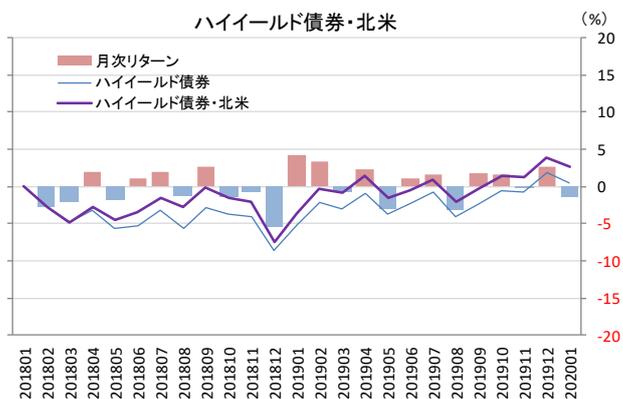
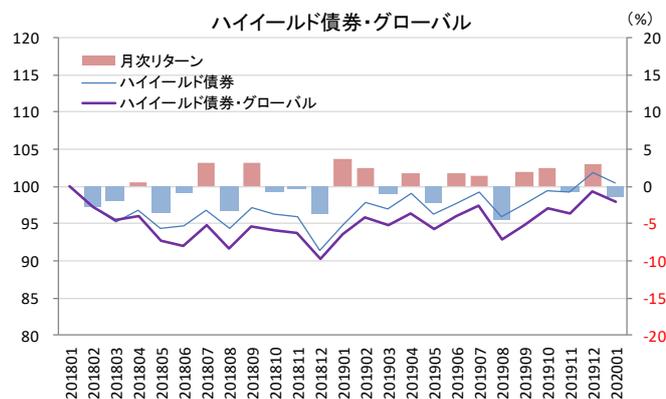
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

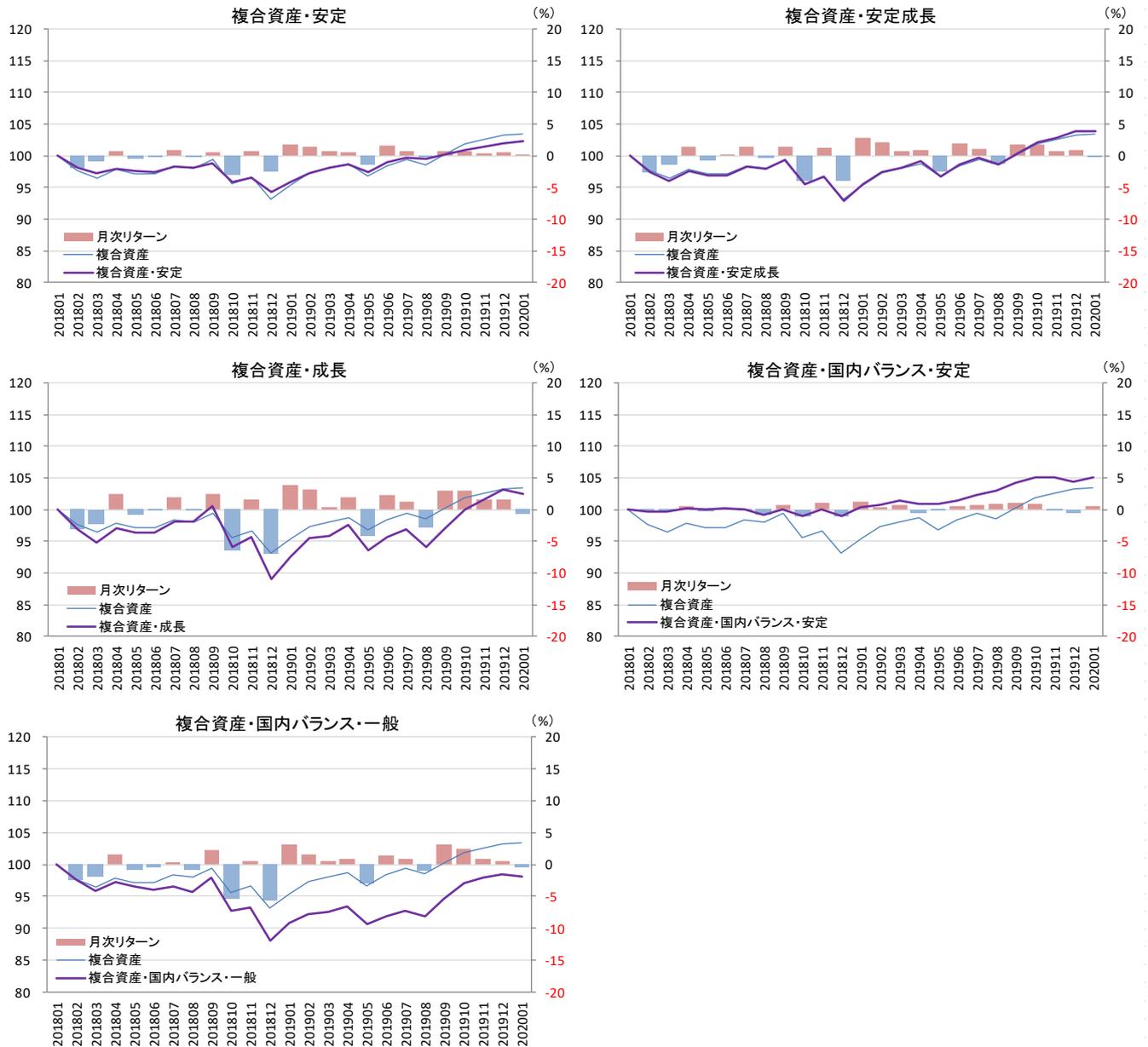


<1>パフォーマンス・サマリー

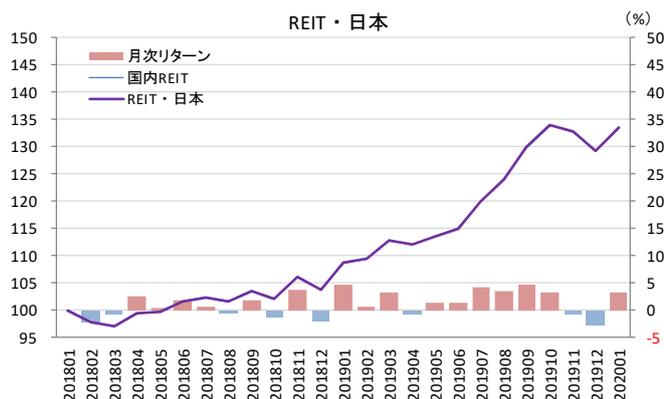
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

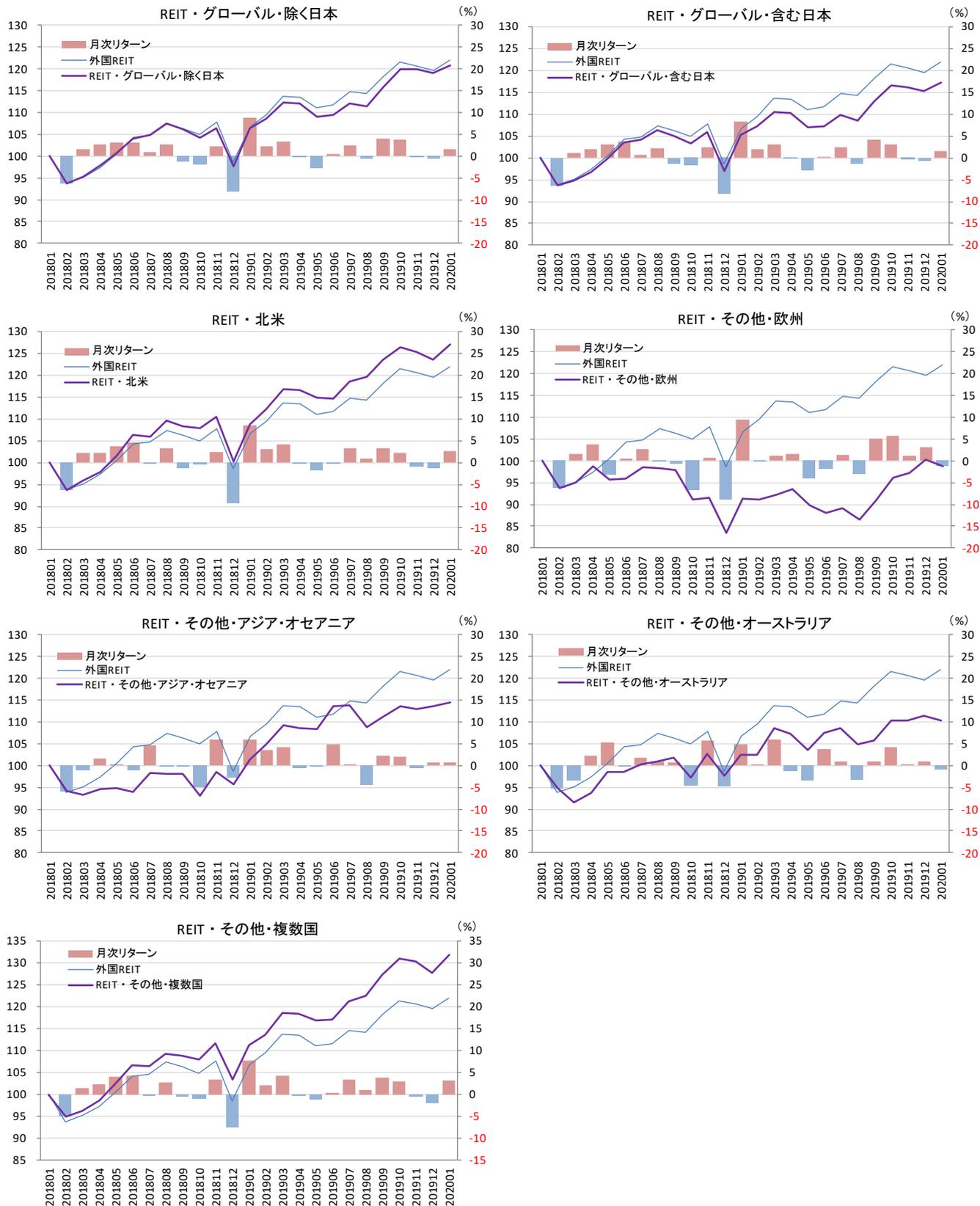


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

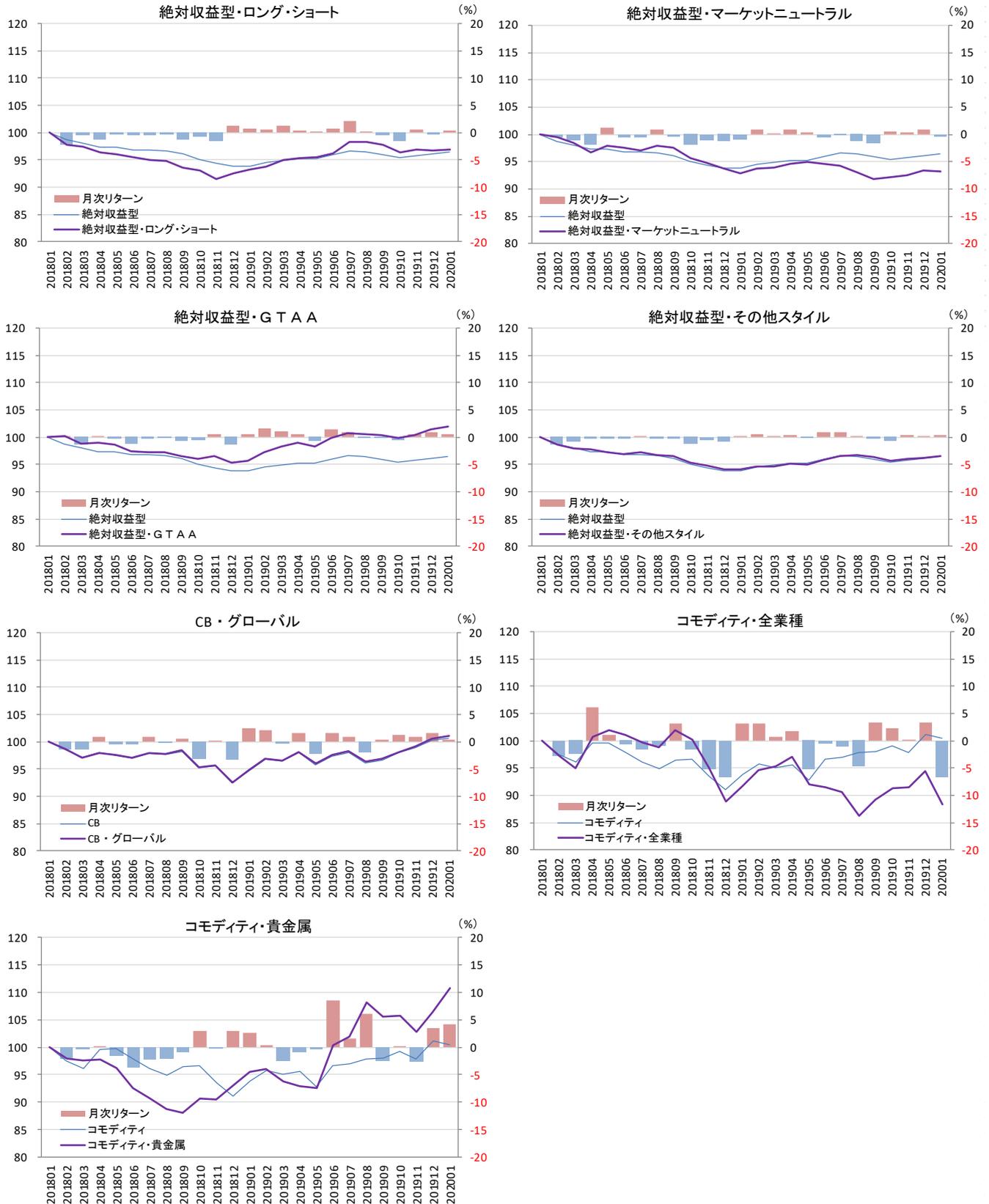


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



＜1＞パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	-0.08		
1	REIT・日本	3.35	4.59	0.15
2	外国株式(先進国)・グローバル	0.62	19.20	0.12
3	REIT・北米	2.71	3.84	0.10
4	外国債券(先進国)・グローバル	0.56	9.41	0.05
5	REIT・グローバル	1.60	3.00	0.05
6	複合資産・その他	3.13	1.00	0.03
7	国内債券・一般	0.48	5.21	0.02
8	外国株式(先進国)・その他	0.36	5.77	0.02
9	複合資産・安定	0.25	4.47	0.01
10	複合資産・国内バランス	0.48	1.67	0.01
11	絶対収益型	0.31	1.15	0.00
12	REIT・その他	0.45	0.80	0.00
13	CB	0.37	0.22	0.00
14	複合資産・安定成長	-0.01	7.25	-0.00
15	コモディティ	-0.83	0.31	-0.00
16	国内株式・業種特化	-3.32	0.11	-0.00
17	エマージング株式・BRICS	-3.58	0.11	-0.00
18	ハイイールド債券・グローバル	-1.43	0.53	-0.01
19	エマージング債券・グローバル	-0.60	1.37	-0.01
20	ブルベア	-3.12	0.27	-0.01
21	ハイイールド債券・その他	-1.66	0.63	-0.01
22	エマージング債券・その他	-0.93	1.51	-0.01
23	複合資産・成長	-0.69	2.06	-0.01
24	ハイイールド債券・北米	-1.30	2.22	-0.03
25	エマージング株式・その他	-1.09	3.38	-0.03
26	エマージング株式・グローバル	-2.96	1.26	-0.04
27	外国債券(先進国)・その他	-1.04	3.47	-0.04
28	国内株式・小型	-4.42	1.42	-0.06
29	国内株式・その他	-2.14	4.62	-0.10
30	国内株式・一般	-3.12	9.16	-0.28
	合計		100.00	-0.08

◆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	11.53		
1	外国株式(先進国)・グローバル	20.00	18.38	3.54
2	国内株式・一般	10.45	9.66	1.05
3	REIT・日本	22.88	4.55	0.97
4	外国株式(先進国)・その他	17.78	5.26	0.91
5	REIT・北米	16.77	3.90	0.65
6	国内株式・その他	11.53	4.86	0.61
7	複合資産・安定成長	8.83	6.78	0.60
8	外国債券(先進国)・グローバル	5.41	9.91	0.54
9	エマージング株式・その他	10.87	3.69	0.40
10	REIT・グローバル	11.82	2.97	0.36
11	複合資産・安定	6.59	4.46	0.30
12	複合資産・成長	10.77	1.98	0.22
13	エマージング株式・グローバル	14.62	1.36	0.20
14	国内株式・小型	10.58	1.60	0.18
15	ハイイールド債券・北米	6.38	2.43	0.16
16	REIT・その他	11.82	0.81	0.09
17	エマージング債券・グローバル	6.27	1.43	0.09
18	エマージング債券・その他	5.00	1.69	0.09
19	ブルベア	26.30	0.31	0.09
20	国内債券・一般	1.59	5.32	0.09
21	外国債券(先進国)・その他	2.01	3.69	0.08
22	複合資産・その他	27.43	0.36	0.08
23	複合資産・国内バランス	4.91	1.42	0.07
24	ハイイールド債券・その他	5.62	0.71	0.04
25	絶対収益型	2.70	1.15	0.03
26	ハイイールド債券・グローバル	4.68	0.57	0.03
27	コモディティ	6.96	0.29	0.02
28	エマージング株式・BRICS	14.31	0.11	0.02
29	CB	6.31	0.25	0.02
30	国内株式・業種特化	12.45	0.11	0.01
	合計		100.00	11.53

◆計算定義

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

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

<2>リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別①

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	14.54	12.03	84.66	7.93	9.43	11.29	0.59	0.25	0.56
国内株式	17.97	28.37	126.53	14.02	16.06	17.19	0.41	0.32	0.49
一般	15.31	24.01	112.50	14.25	16.41	17.54	0.35	0.27	0.44
フリー	15.95	23.47	111.41	14.55	16.72	18.18	0.35	0.26	0.43
バリュー	12.94	25.82	117.10	13.36	15.54	16.23	0.31	0.30	0.50
小型	30.55	56.70	228.24	16.06	15.91	17.14	0.58	0.59	0.73
その他	21.52	33.68	142.10	13.38	15.76	16.96	0.51	0.38	0.54
日経225	26.76	39.64	157.52	13.85	15.93	17.16	0.60	0.44	0.58
TOPIX	17.27	30.45	123.04	12.98	15.58	16.63	0.42	0.35	0.50
JPX日経400	15.95	26.26	-	12.75	15.15	-	0.40	0.32	-
国内債券	3.08	5.40	16.22	1.48	1.72	1.56	0.72	0.63	0.95
一般	3.08	5.40	16.22	1.48	1.72	1.56	0.72	0.63	0.95
外国株式(先進国)	28.61	23.24	121.70	13.35	14.86	16.06	0.66	0.29	0.51
グローバル	30.99	25.34	132.28	13.56	14.68	15.96	0.70	0.32	0.55
除く日本	29.94	34.58	176.74	13.56	15.81	17.63	0.68	0.39	0.61
含む日本	31.39	22.86	122.38	13.64	14.46	15.65	0.70	0.29	0.53
その他	22.82	18.52	107.81	12.92	15.38	17.41	0.55	0.23	0.43
北米	15.39	15.31	63.72	15.73	17.18	20.79	0.31	0.17	0.24
米国	32.67	26.19	135.80	13.60	16.47	17.62	0.73	0.29	0.51
カナダ	5.13	-3.12	17.26	12.16	13.31	16.23	0.14	-0.05	0.10
欧州	21.49	19.80	105.40	13.55	14.84	18.44	0.50	0.25	0.40
ドイツ	6.52	2.48	-	16.44	19.34	-	0.13	0.03	-
イギリス	4.81	-11.58	-	13.48	15.09	-	0.12	-0.16	-
アジア・オセアニア	18.72	22.30	135.62	12.31	15.22	17.82	0.48	0.27	0.50
オーストラリア	1.92	7.68	66.98	12.77	15.31	19.50	0.05	0.10	0.27
ニュージーランド	32.66	58.84	-	14.01	16.64	-	0.71	0.58	-
複合地域	-19.78	-27.35	-	18.75	19.06	-	-0.38	-0.32	-
エマージング株式	17.83	8.54	55.96	12.92	15.27	17.87	0.44	0.11	0.25
グローバル	21.54	10.92	52.00	14.62	16.54	18.26	0.46	0.13	0.23
BRICS	33.33	34.29	74.26	15.46	18.48	20.68	0.65	0.33	0.27
その他	15.97	6.81	60.23	12.84	15.13	17.81	0.40	0.09	0.27
欧州	19.81	47.03	31.35	16.29	19.25	23.93	0.38	0.42	0.11
ロシア	30.92	113.91	58.59	17.55	22.61	26.25	0.54	0.73	0.18
アジア・オセアニア	10.78	1.80	72.57	14.57	16.09	17.17	0.24	0.02	0.33
中国	43.89	37.60	117.25	17.95	22.19	21.65	0.72	0.30	0.37
インド	21.34	7.75	79.54	16.81	18.50	23.83	0.40	0.08	0.25
インドネシア	3.88	-8.60	67.55	17.28	19.90	21.96	0.08	-0.09	0.24
タイ	-0.43	-4.36	163.62	14.23	14.02	17.00	-0.01	-0.06	0.60
フィリピン	-9.23	-26.31	-	14.02	14.91	-	-0.22	-0.40	-
ベトナム	14.68	21.69	-	17.70	16.64	-	0.27	0.24	-
韓国	-9.17	-22.45	19.44	16.84	16.59	19.64	-0.18	-0.30	0.09
香港	16.61	12.08	58.64	16.93	19.75	18.87	0.31	0.12	0.25
台湾	16.29	16.88	121.80	19.17	18.55	18.94	0.27	0.17	0.44
中南米	21.60	11.54	13.21	21.56	23.07	23.33	0.31	0.10	0.05
ブラジル	18.32	11.76	-14.05	27.17	31.46	29.09	0.21	0.07	-0.05
メキシコ	2.09	-18.56	-	21.37	20.37	-	0.03	-0.20	-
中東・アフリカ	6.72	-12.86	65.80	12.37	15.09	16.67	0.18	-0.18	0.31
トルコ	-11.14	-45.76	-25.50	33.37	29.05	31.18	-0.11	-0.40	-0.09
複合地域	4.79	-5.21	59.14	13.98	15.13	16.07	0.12	-0.07	0.29

※[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	14.54	12.03	84.66	7.93	9.43	11.29	0.59	0.25	0.56
外国債券(先進国)	3.91	-2.16	37.38	3.19 ↓	4.87 ↓	8.02	0.42	-0.08	0.40
グローバル	5.76	-1.03	36.96	2.67 ↓	4.36 ↓	7.28	0.73	-0.04	0.44
除く日本	6.17	-2.07	40.68	3.27 ↓	4.86 ↓	8.02	0.63	-0.08	0.43
含む日本	5.26	0.33	32.43	2.16 ↓	3.93	6.50	0.82	0.02	0.43
その他	-0.56	-5.21	37.99	5.27	6.69	9.80	-0.03	-0.16	0.33
北米	4.54	1.52	-	2.01	3.44	-	0.77	0.10	-
米国	6.17	4.01	52.30	3.47 ↓	5.04	6.18	0.60	0.16	0.69
カナダ	-1.11	-10.16	13.77	6.64 ↓	7.96 ↓	9.44	-0.05	-0.26	0.13
欧州	7.88	-2.63	31.06	4.21 ↓	5.93 ↓	9.94	0.62	-0.09	0.27
イギリス	3.46	-12.88	-	7.35 ↓	10.18	-	0.16	-0.26	-
アジア・オセアニア	-4.42	-8.56	39.64	7.13	8.28	11.03	-0.20	-0.21	0.31
オーストラリア	-4.80	-8.31	36.35	7.13	8.31	11.30	-0.22	-0.20	0.28
ニュージーランド	-1.31	-0.11	-	8.51	9.41 ↓	-	-0.05	0.00	-
複合地域	6.09	-1.01	34.49	4.48	6.56 ↓	9.75	0.46	-0.03	0.31
エマージング債券	3.97	1.50	48.87	8.54	10.68	12.70	0.16	0.03	0.32
グローバル	4.49	2.67	51.34	8.95	10.51	12.61	0.17	0.05	0.33
米ドル建て	4.36	4.14	55.71	8.89	10.63	12.76	0.17	0.08	0.35
現地通貨建て	5.63	-5.97	27.16	9.73	10.45	12.02	0.19	-0.11	0.20
その他	3.40	-1.92	42.89	8.61	11.70	13.51	0.14	-0.03	0.27
ロシア	18.62	92.08	41.57	13.77	20.44 ↓	21.59	0.43	0.68	0.16
アジア・オセアニア	7.37	6.30	60.33	3.85	6.08	8.68	0.64	0.21	0.55
インド	5.99	7.57	-	7.75 ↓	9.43	-	0.26	0.16	-
インドネシア	11.83	6.60	-	11.02	13.26	-	0.35	0.10	-
ブラジル	-4.72	-2.29	41.21	17.46	19.87	17.86	-0.09	-0.02	0.20
メキシコ	33.18	-12.12	-	14.63	14.74	-	0.69	-0.17	-
南アフリカ	7.83	-7.75	-	20.75	19.52	-	0.13	-0.08	-
トルコ	-17.25	-49.62	-	35.93	29.61	-	-0.17	-0.43	-
複合地域	19.50	-10.67	30.61	8.95	11.17	13.20	0.69	-0.20	0.20
ハイイールド債券	4.48	7.81	81.56	7.12	9.48	11.86	0.21	0.16	0.52
グローバル	4.48	7.99	67.05	7.35	9.64	12.06	0.21	0.16	0.43
北米	5.05	9.22	92.03	7.20	9.57	11.46	0.24	0.19	0.59
その他	3.05	3.69	76.30	7.91	9.94	15.05	0.13	0.08	0.39
欧州	3.05	2.49	93.13	8.73	10.70	16.39	0.12	0.05	0.41
アジア・オセアニア	3.55	10.02	-	6.28	8.27	-	0.20	0.24	-
複合地域	7.99	6.18	77.93	5.90	8.03	11.60	0.45	0.15	0.51
複合資産	11.73	11.20	73.74	4.98	6.70	9.16	0.77	0.32	0.62
安定	8.10	6.16	56.18	3.56	4.93	7.65	0.75	0.25	0.59
安定成長	12.46	11.78	77.31	5.46	7.11	9.56	0.74	0.32	0.61
成長	16.72	19.94	103.49	8.74	10.50	11.79	0.61	0.35	0.62
国内バランス	8.70	12.44	42.15	2.37	3.21 ↓	6.70	1.21	0.75	0.53
安定	7.94	11.35	34.77	2.05	2.06	3.03	1.29	1.07	0.99
一般	13.68	17.90	56.24	7.16	8.24	9.66	0.62	0.41	0.47

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

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

<2> リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別③

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	14.54	12.03	84.66	7.93	9.43	11.29	0.59	0.25	0.56
国内REIT	30.96	33.44	240.01	8.06	8.64	15.86	1.17	0.69	0.82
日本	30.96	33.44	240.01	8.06	8.64	15.86	1.17	0.69	0.82
外国REIT	20.57	13.00	187.60	11.05 ↓	12.98 ↓	15.26	0.59	0.19	0.73
グローバル	18.27	8.50	161.02	10.93 ↓	12.75	15.03	0.53	0.13	0.67
除く日本	25.99	18.80	182.72	10.95 ↓	12.87	15.07	0.74	0.27	0.73
含む日本	17.20	7.30	158.82	10.93 ↓	12.74	15.04	0.50	0.11	0.66
北米	21.59	15.51	226.70	12.06 ↓	13.93	16.28	0.56	0.21	0.77
その他	29.89	25.01	203.54	9.28	11.35	14.36	0.99	0.40	0.82
欧州	22.18	3.23	24.47	12.64	15.16	20.06	0.55	0.04	0.11
アジア・オセアニア	36.76	35.49	221.65	9.71	11.71	14.31	1.14	0.54	0.86
オーストラリア	16.00	17.90	138.41	11.00 ↓	13.29	16.50	0.47	0.25	0.55
複合地域	8.70	-6.29	95.77	13.45	15.10	17.86	0.21	-0.08	0.39
複数国	27.67	28.03	276.37	10.23	11.51 ↓	14.59	0.83	0.44	0.97
その他									
絶対収益型	1.23	-3.28	-4.60	2.04	1.97	3.47	0.23	-0.33	-0.14
ロング・ショート	1.33	-3.41	-1.20	3.31	3.02	3.59	0.15	-0.22	-0.04
マーケットニュートラル	3.97	12.18	36.80	3.69 ↓	5.49	5.21	0.37	0.43	0.61
GTAA	4.25	5.21	15.50	2.59	2.26	2.66	0.56	0.46	0.54
その他スタイル	-0.18	-4.50	-9.68	1.94	2.12	5.19	-0.00	-0.42	-0.20
CB	6.42	4.83	35.05	4.70	6.45	9.57	0.46	0.15	0.32
アジア・オセアニア	12.19	18.43	65.53	8.46	10.73	11.17	0.47	0.32	0.46
日本	0.23	11.38	46.92	4.60	5.32	6.06	0.03	0.41	0.64
グローバル	6.74	4.91	37.88	4.70	6.39	10.02	0.48	0.15	0.32
コモディティ	1.22	-16.01	-14.67	7.32 ↓	11.05 ↓	14.18	0.06	-0.31	-0.11
全業種	-11.74	-26.16	-27.03	11.06	13.22 ↓	14.99	-0.36	-0.44	-0.21
貴金属	19.54	1.30	43.52	8.97 ↑	9.94	16.62	0.69	0.03	0.22
エネルギー	-3.57	-24.22	-41.24	24.72	26.47	25.04	-0.05	-0.20	-0.21
その他コモディティ	-13.58	-17.06	8.06	12.90	13.89	17.62	-0.36	-0.26	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

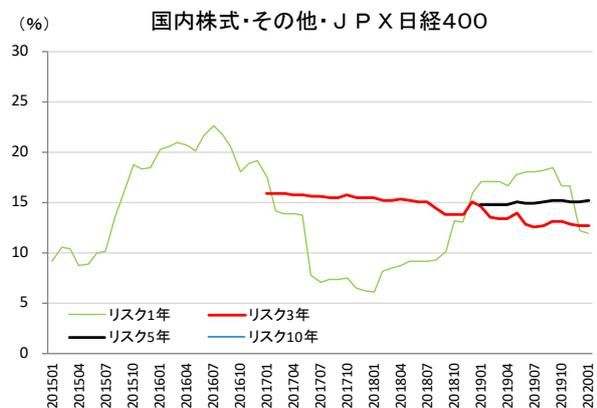
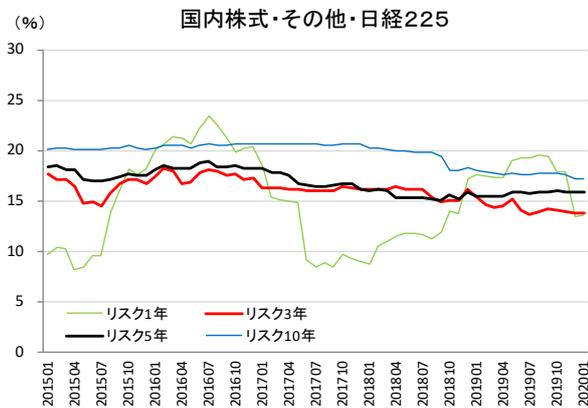
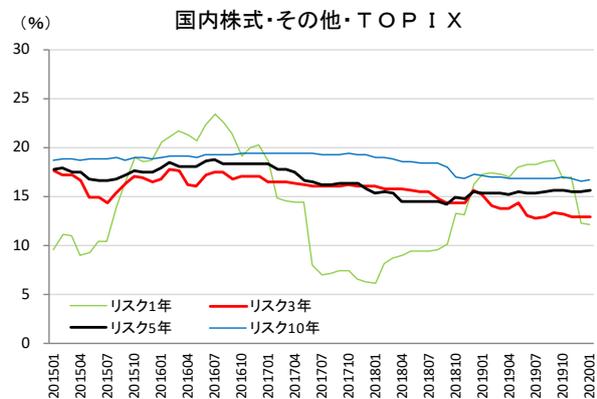
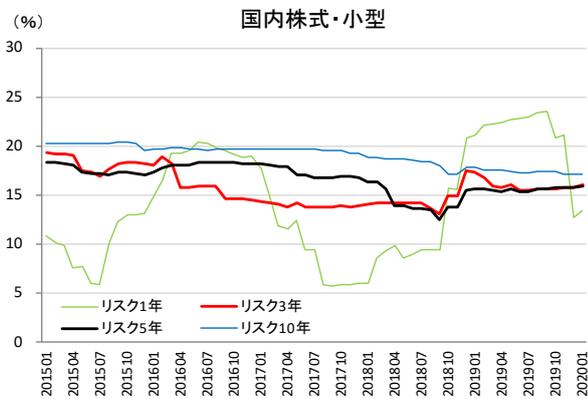
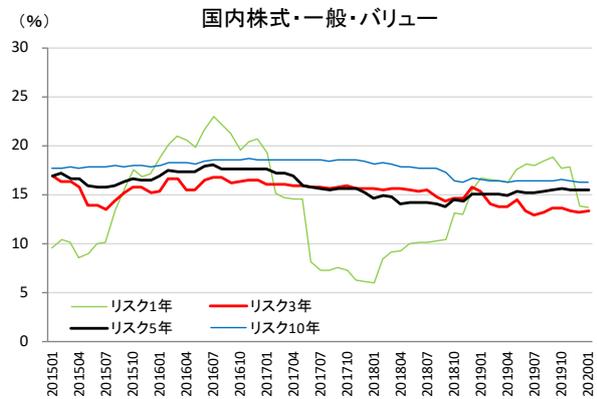
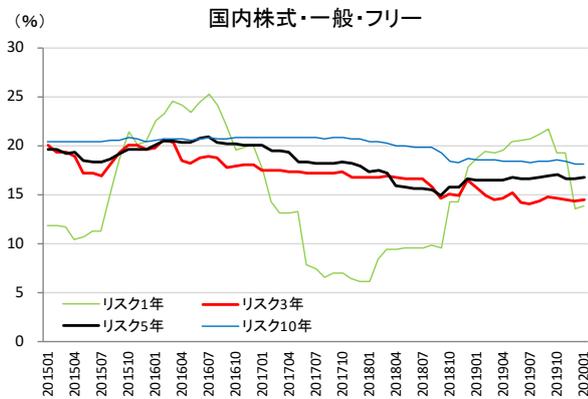
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

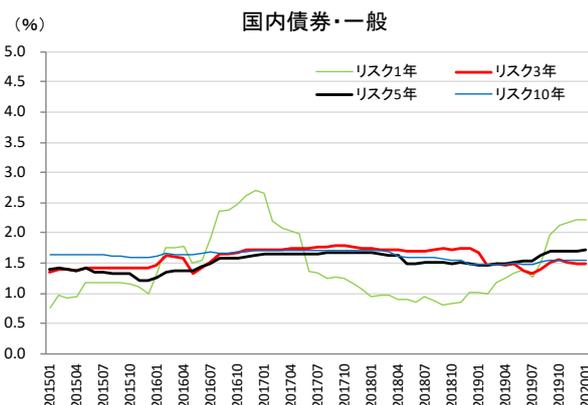
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

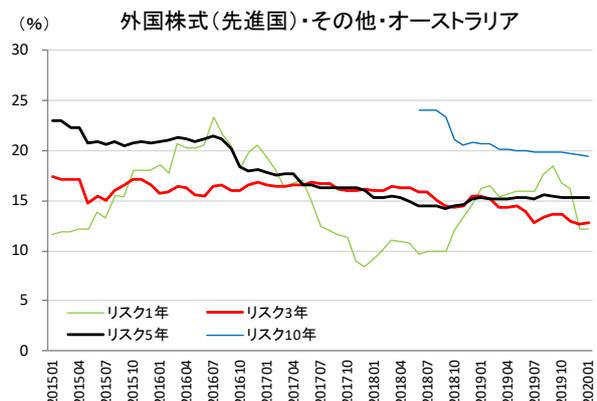
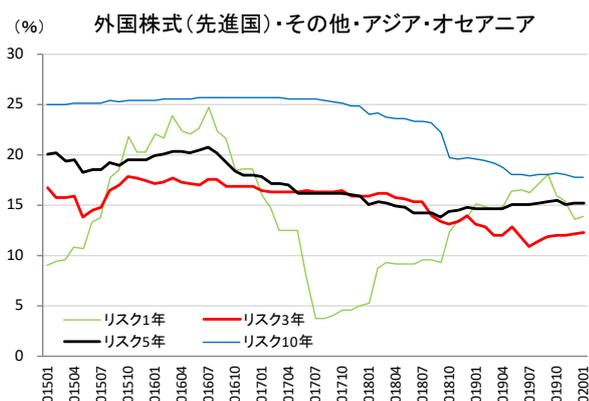
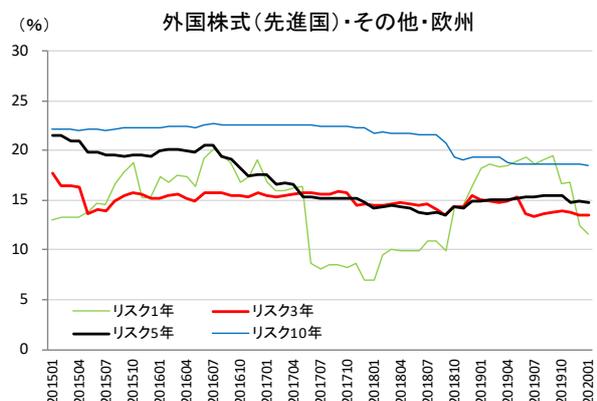
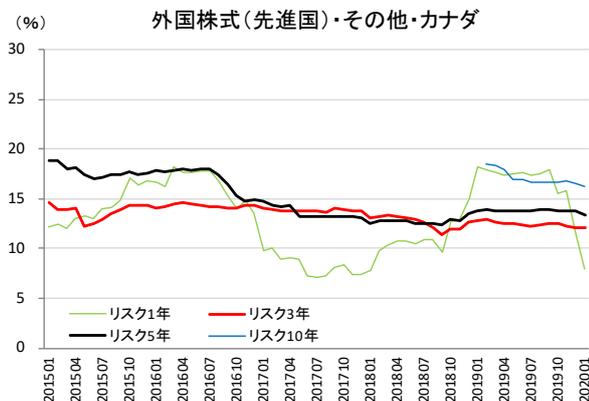
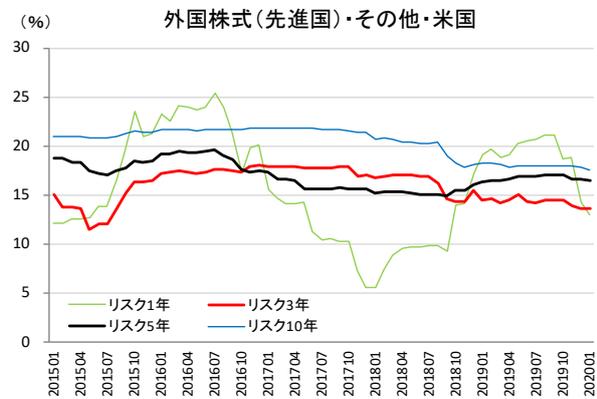
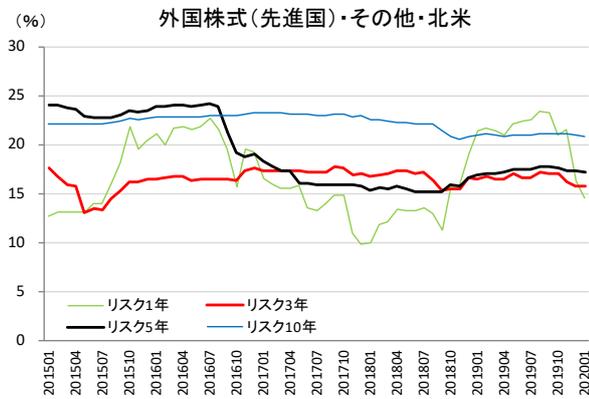
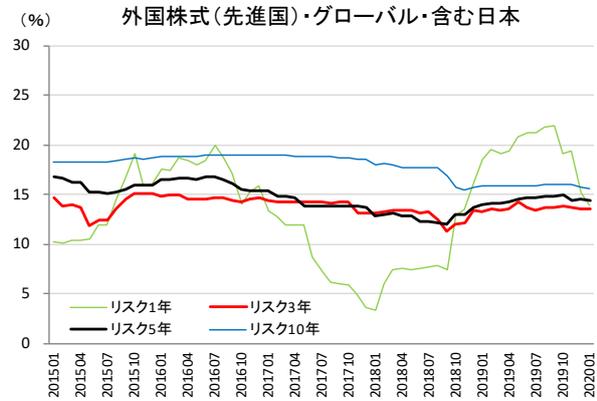
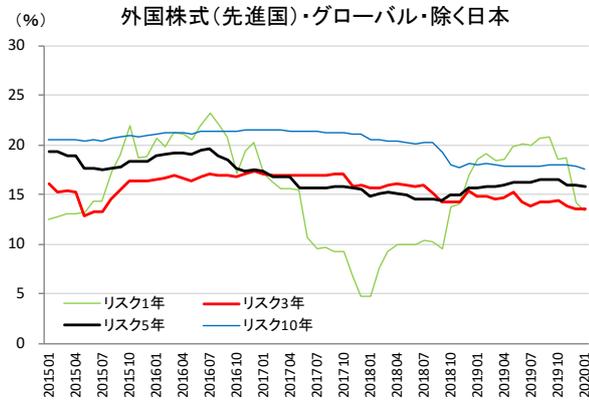


<2> リスク・サマリー

(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)]

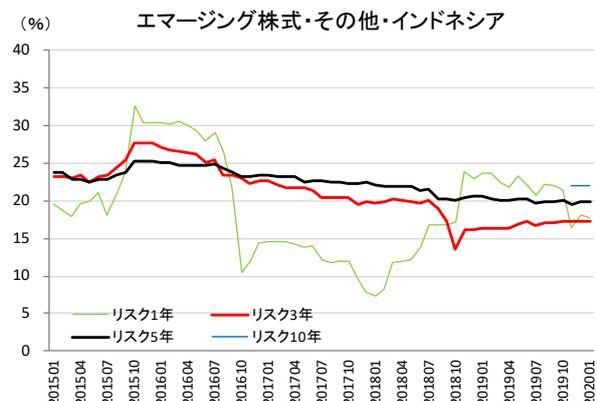
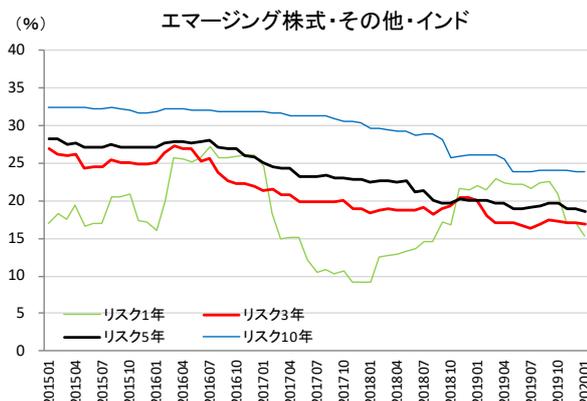
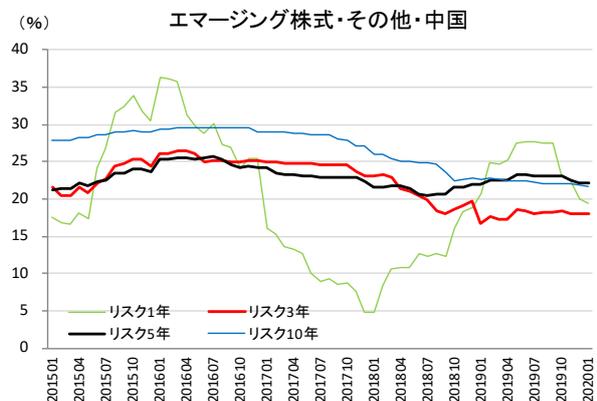
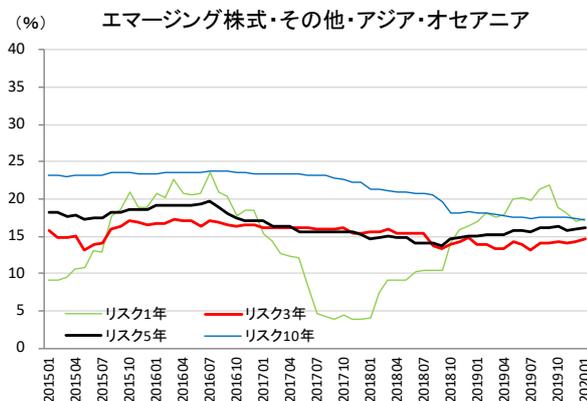
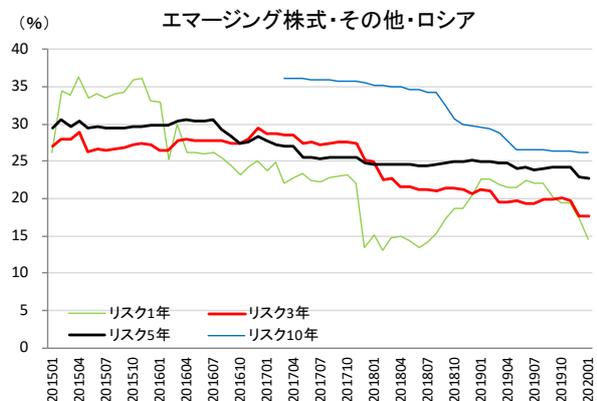
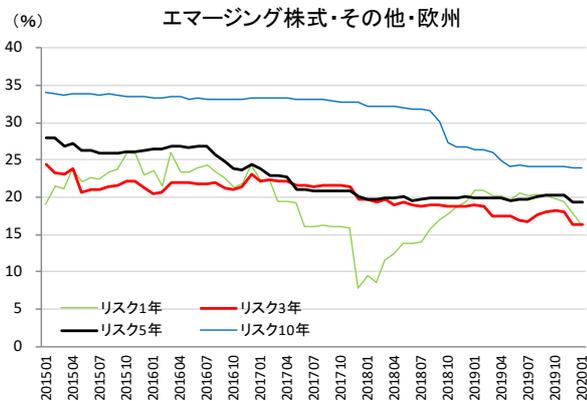
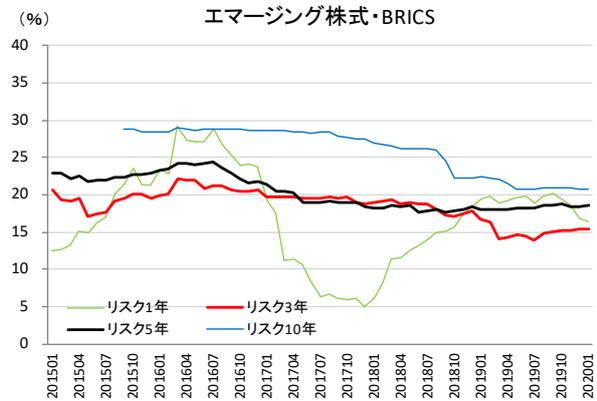
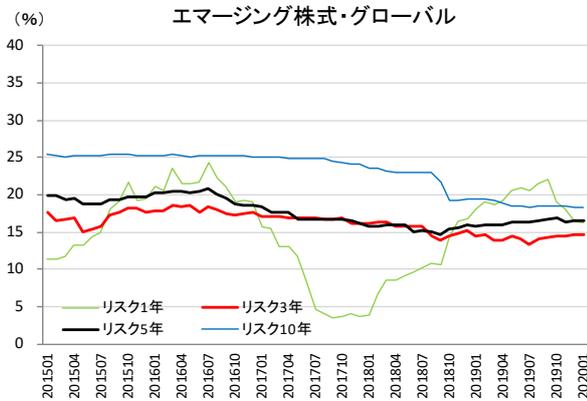


<2> リスク・サマリー

(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]

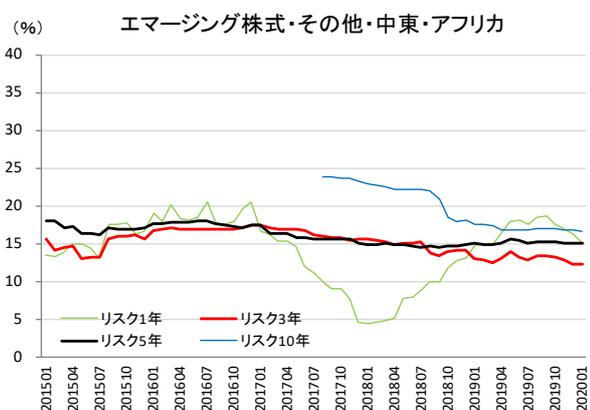
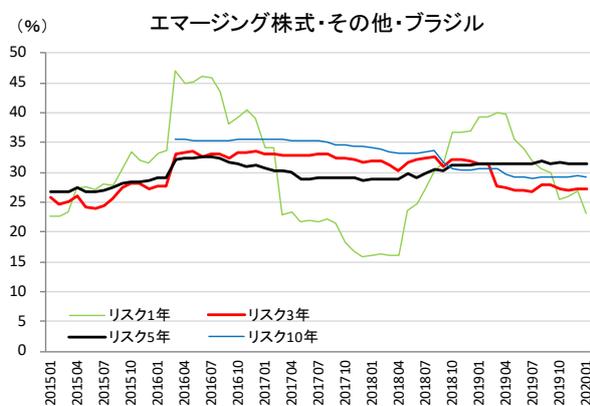
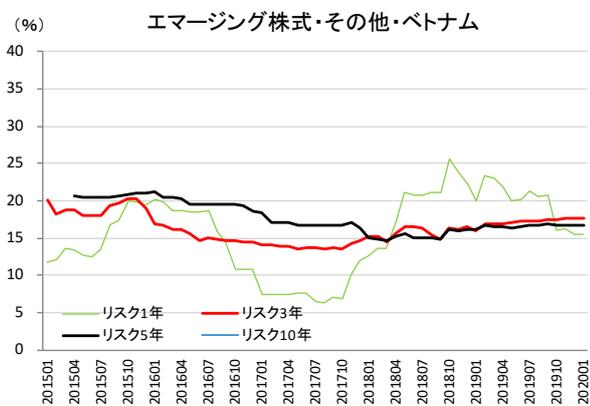
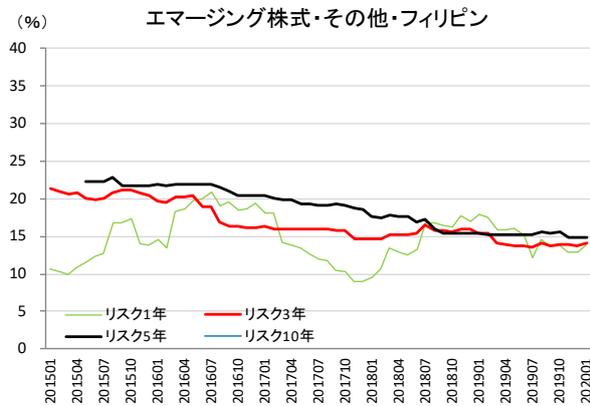
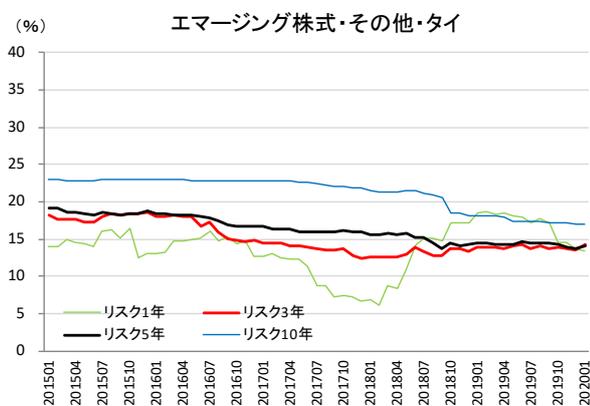


<2>リスク・サマリー

(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]

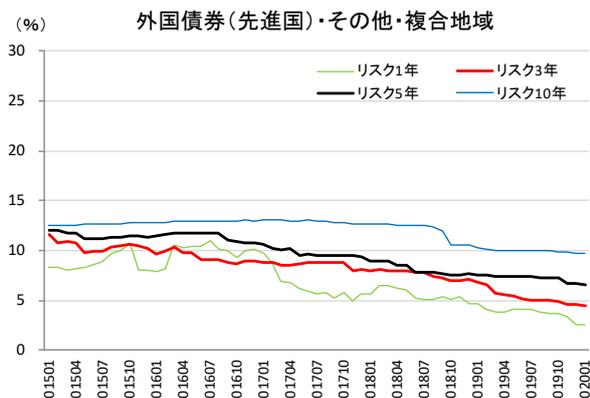
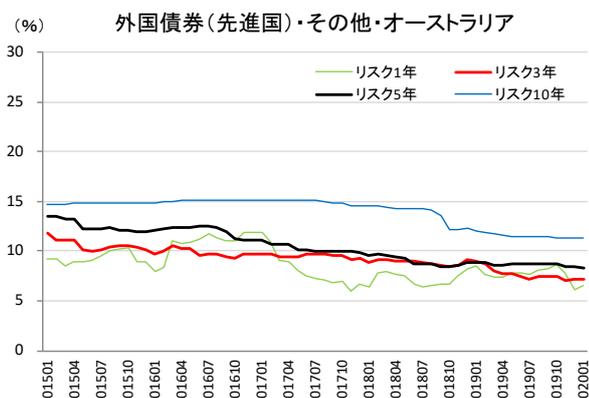
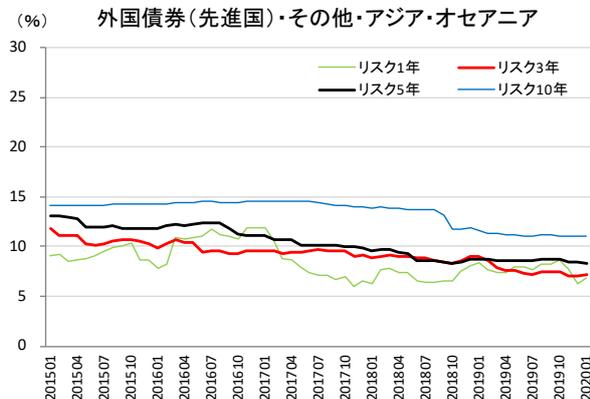
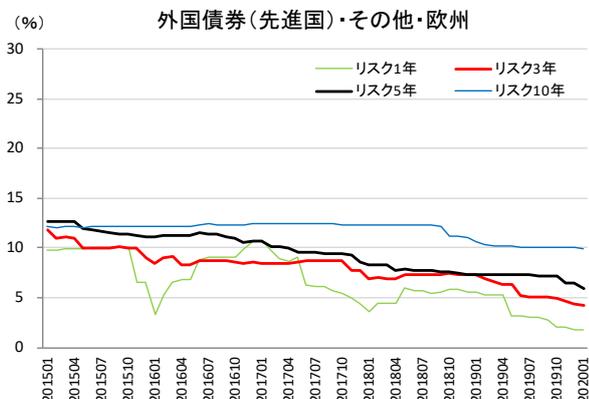
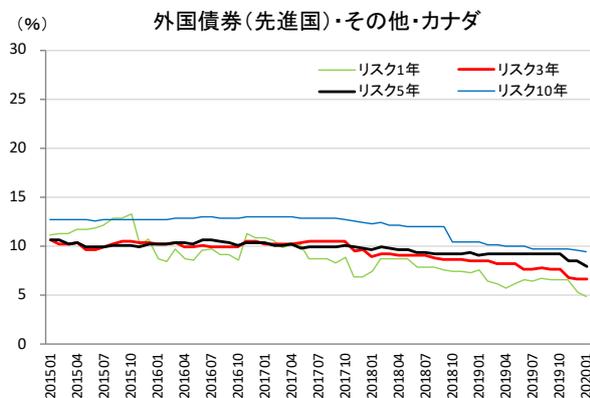
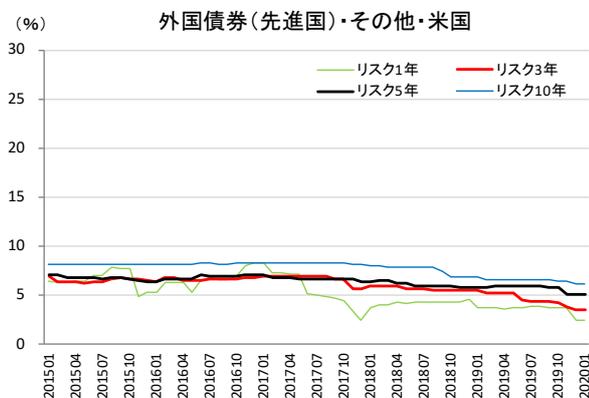
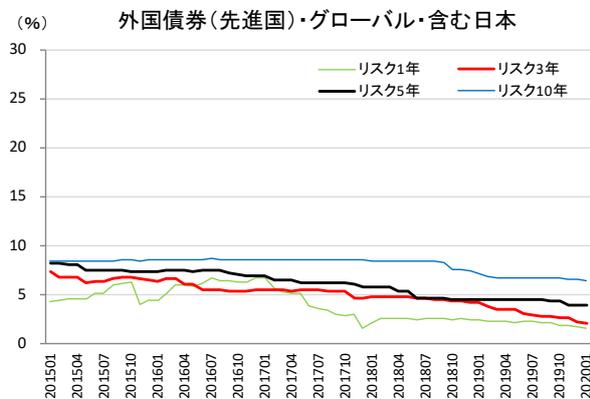
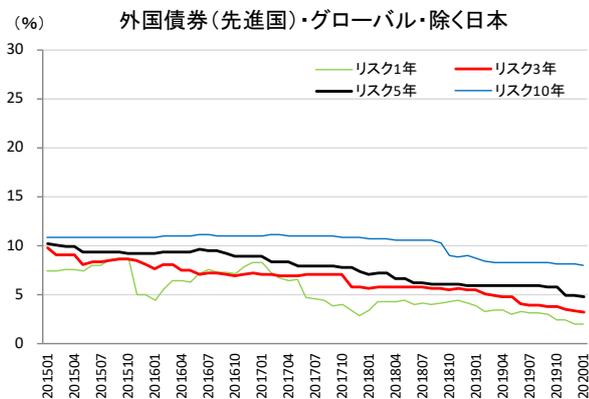


<2> リスク・サマリー

(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)]

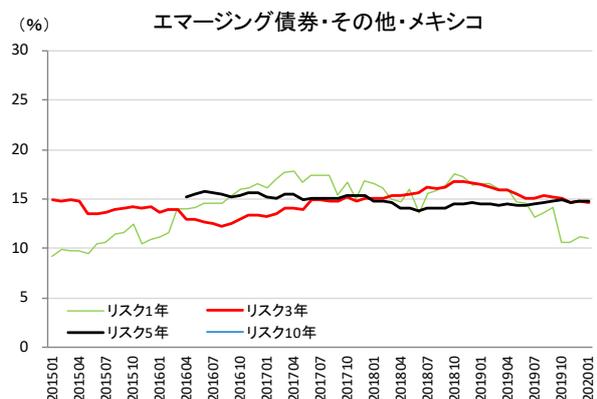
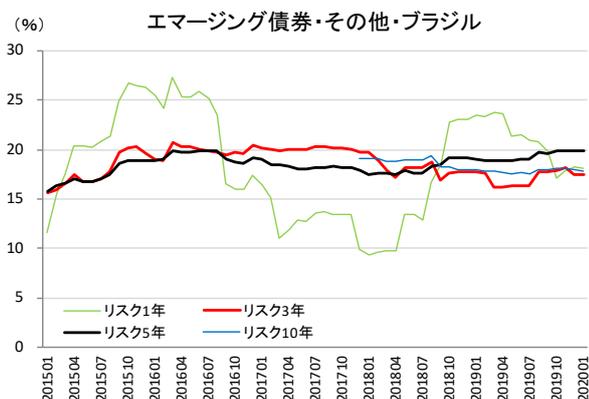
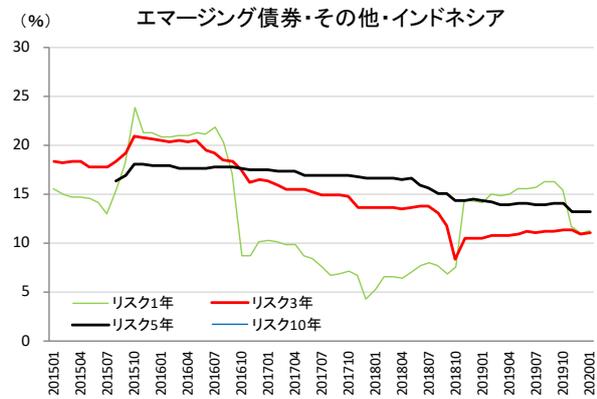
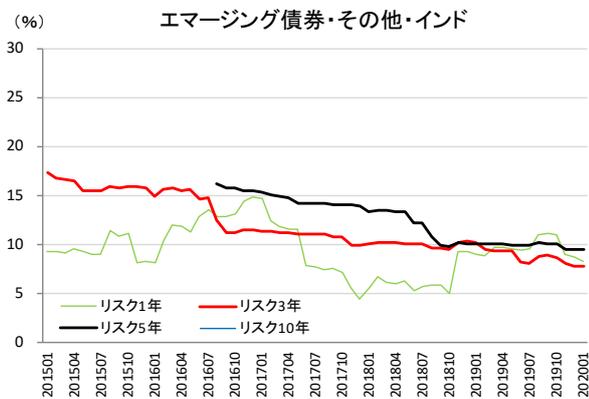
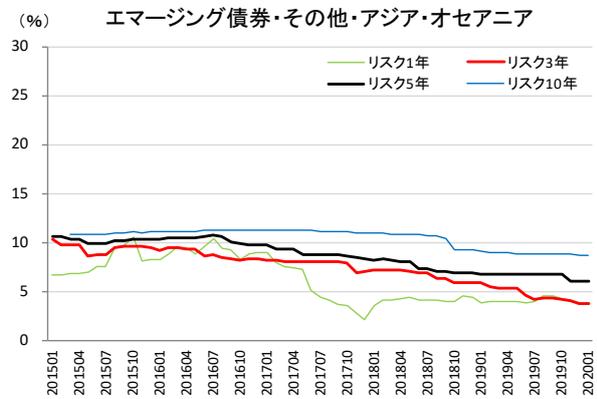
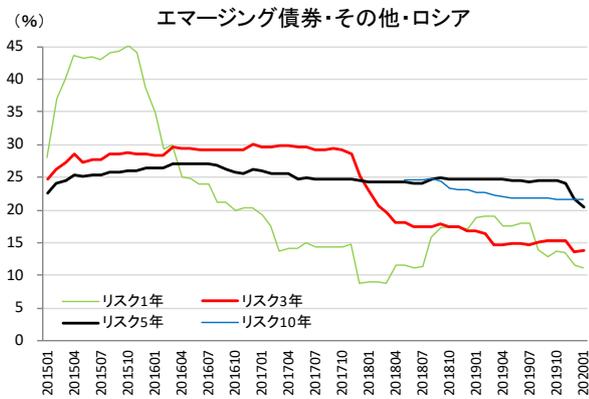
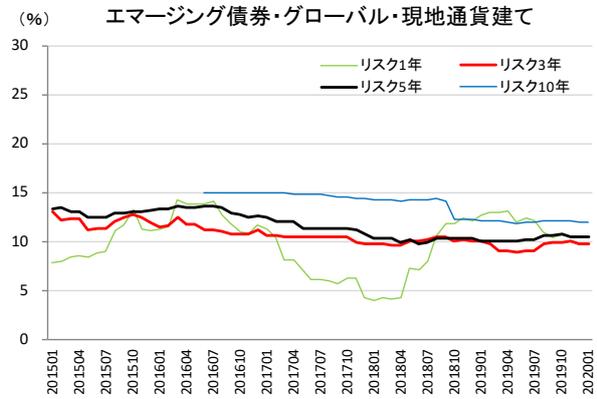
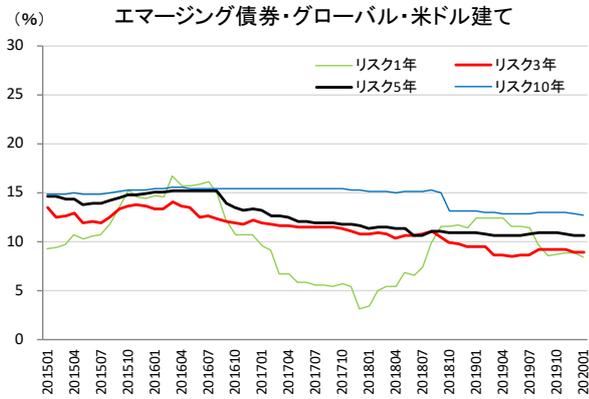


<2> リスク・サマリー

(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]

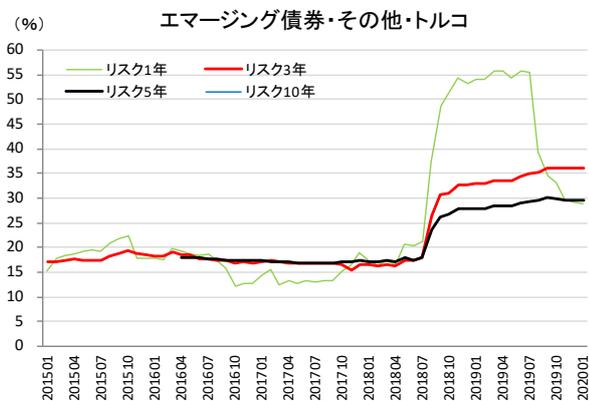


<2> リスク・サマリー

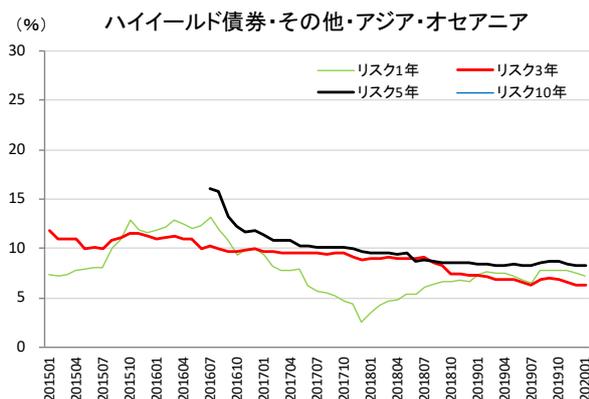
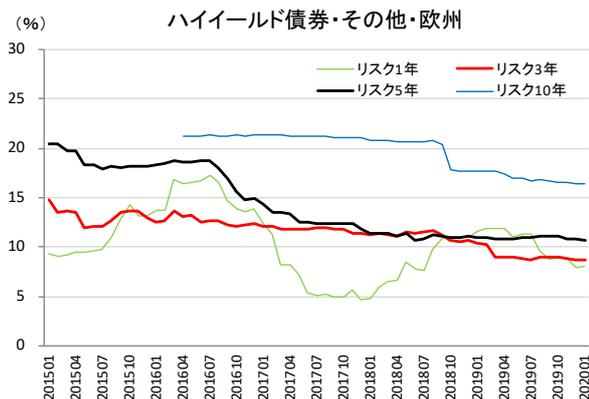
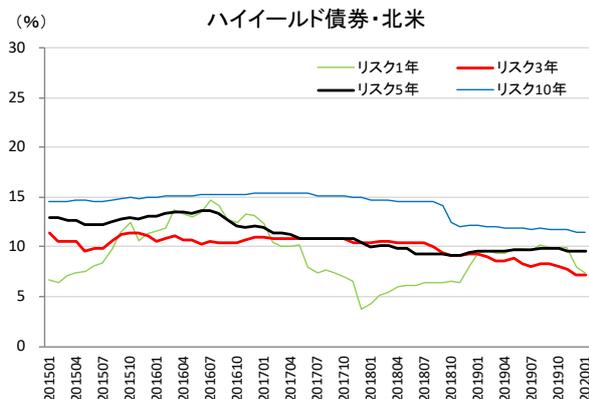
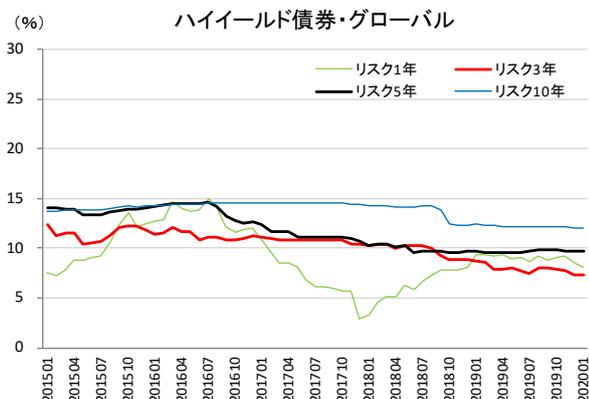
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

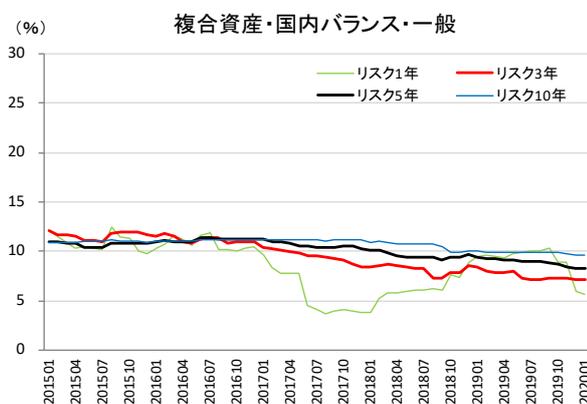
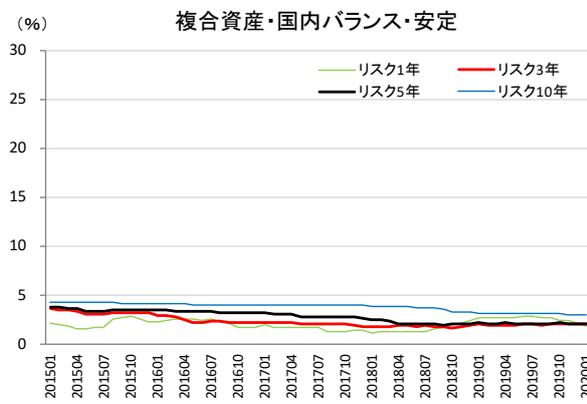
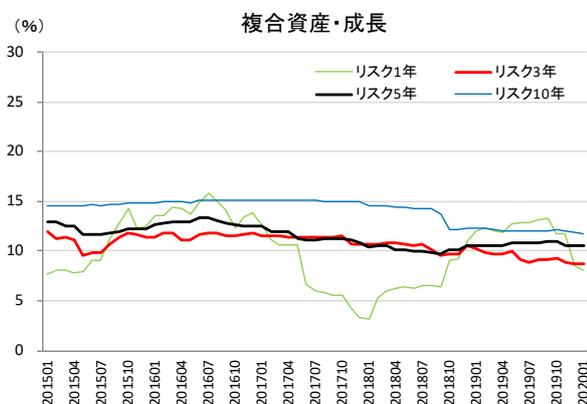
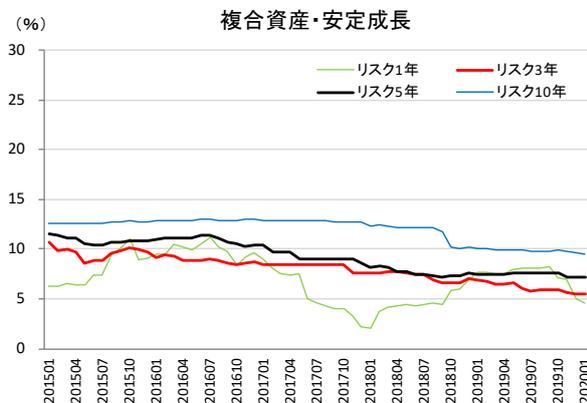
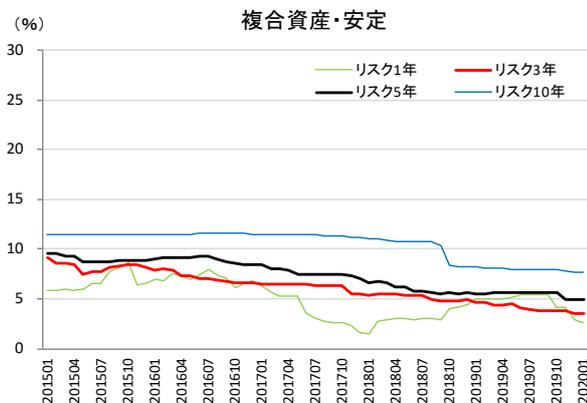


<2>リスク・サマリー

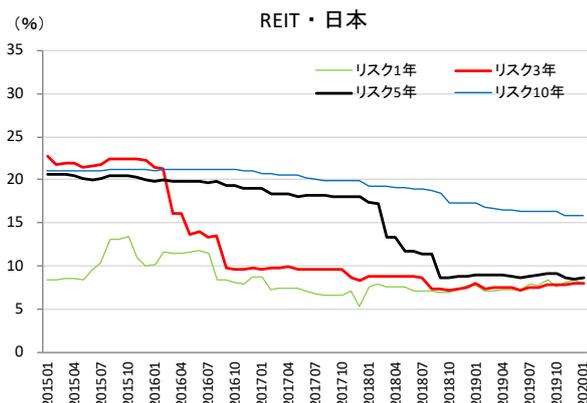
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

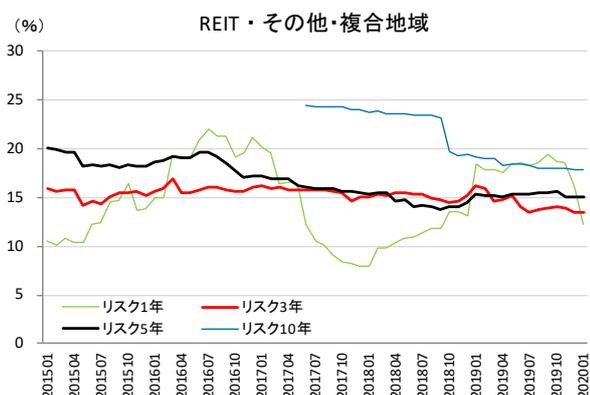
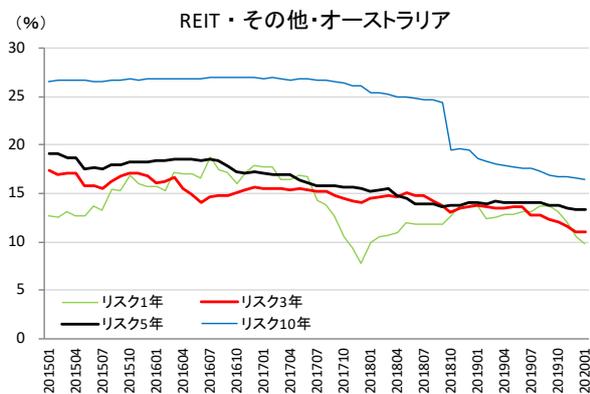
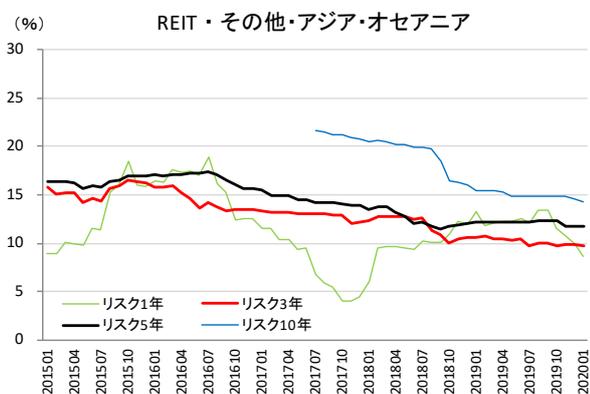
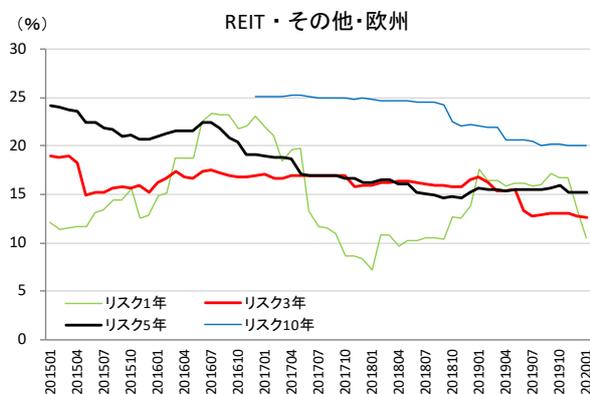
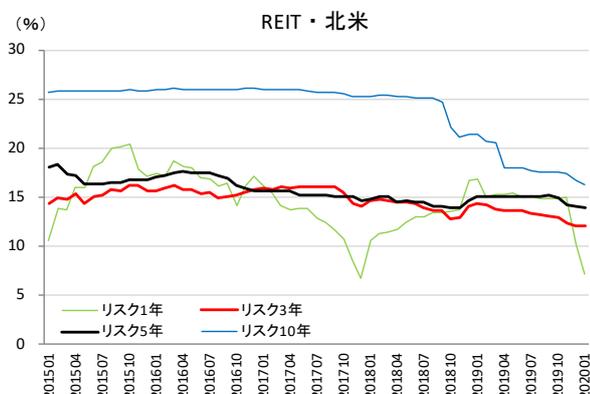
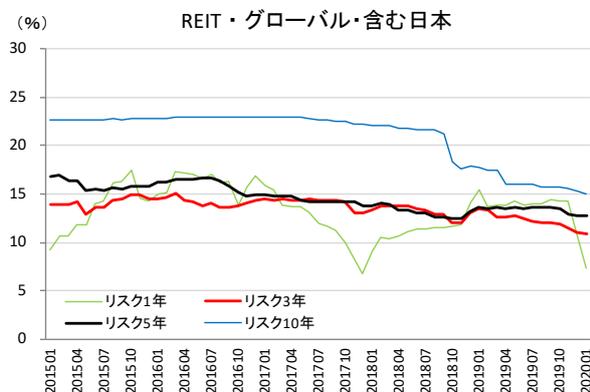
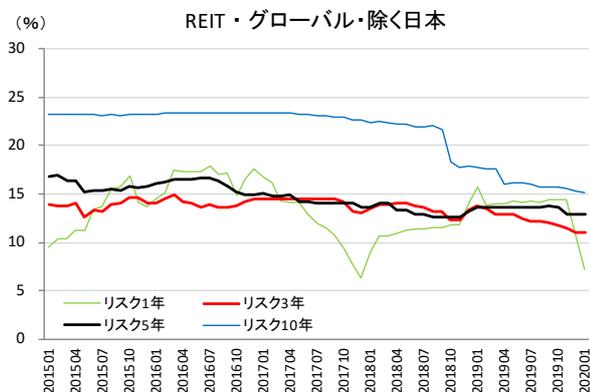


<2> リスク・サマリー

(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]

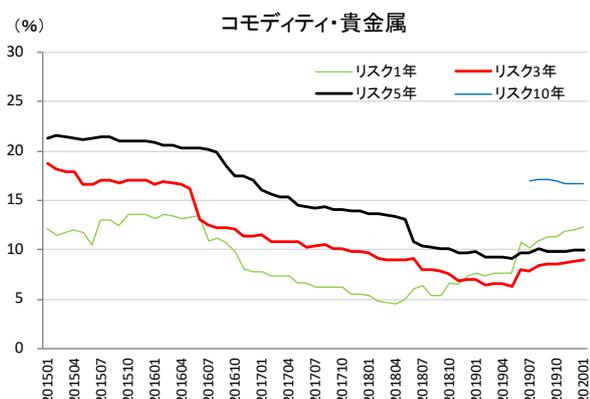
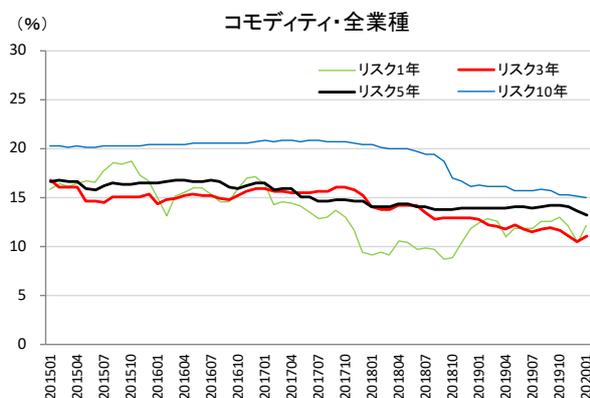
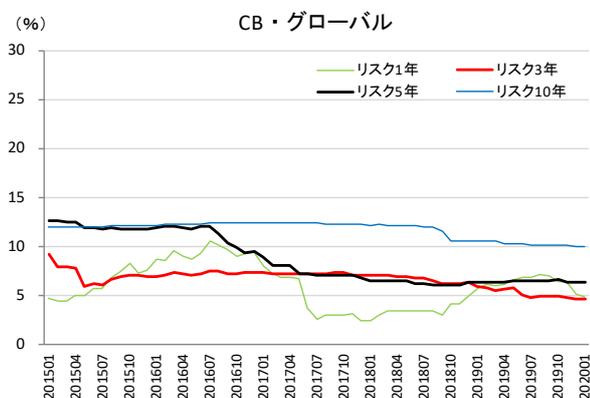
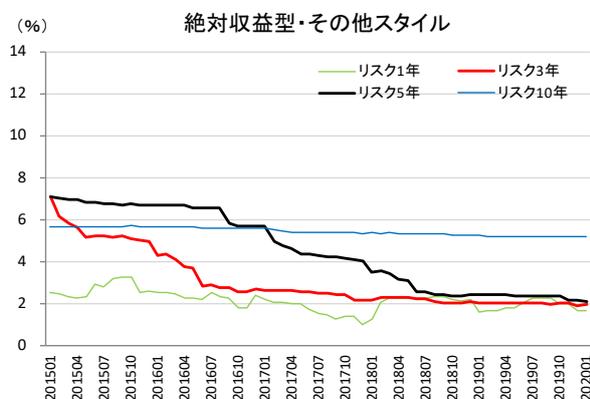
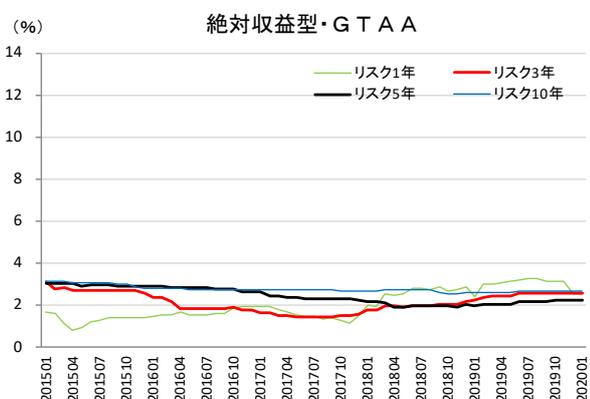
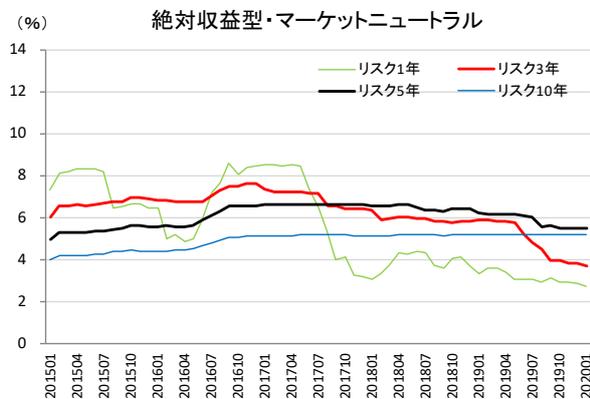
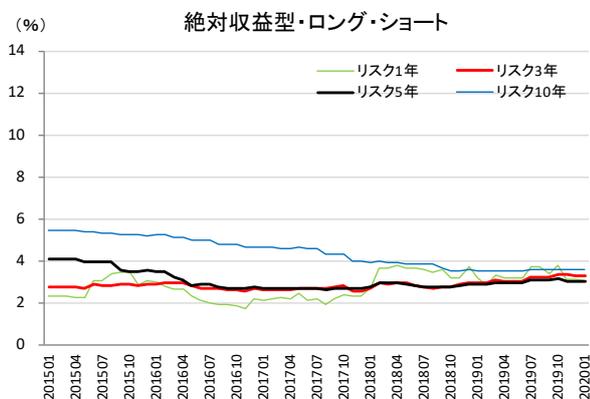


<2> リスク・サマリー

(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	2,987	-1,923	890	-3,268
国内株式	-946	-7,189	-11,319	-15,102
一般	-934	-4,409	-6,250	-8,856
フリー	-830	-4,017	-5,732	-8,044
バリュー	-104	-392	-518	-812
小型	-275	-1,150	-1,782	-2,436
その他	271	-1,585	-3,226	-3,714
日経225	407	-1,278	-2,918	-3,799
TOPIX	-136	-121	30	471
JPX日経400	-3	-106	-170	-199
国内債券	87	654	812	1,166
一般	87	654	812	1,166
外国株式(先進国)	1,495	768	3,653	3,959
グローバル	455	-2,581	-869	587
除く日本	520	1,400	2,177	2,923
含む日本	-64	-3,981	-3,046	-2,335
その他	1,040	3,349	4,522	3,372
北米	-14	-15	22	44
米国	1,077	3,431	4,546	3,704
カナダ	-6	-38	-57	-119
欧州	-38	-123	-203	-425
ドイツ	-1	-2	-2	-3
イギリス	0	-1	-4	-7
アジア・オセアニア	-4	-7	-16	-43
オーストラリア	27	106	236	222
ニュージーランド	0	-1	-1	0
複合地域	0	-1	-1	-2
エマージング株式	-783	-2,345	-3,526	-6,491
グローバル	-151	-570	-976	-2,472
BRICS	-15	-41	-55	-97
その他	-617	-1,735	-2,494	-3,922
欧州	-7	-19	-25	-54
ロシア	-1	-7	-11	-30
アジア・オセアニア	-120	-374	-641	-1,151
中国	-93	-335	-606	-839
インド	-405	-1,049	-1,299	-2,066
インドネシア	-5	-10	-16	-35
タイ	-1	-6	-8	-22
フィリピン	-2	-6	-13	-41
ベトナム	35	109	109	265
韓国	0	-1	-1	-3
香港	0	0	1	0
台湾	0	0	0	0
中南米	-2	-6	-8	-18
ブラジル	-10	-20	32	58
メキシコ	0	-2	-2	-3
中東・アフリカ	-1	-4	3	34
トルコ	-3	-7	-9	-14
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	2,987	-1,923	890	-3,268
外国債券(先進国)	-181	-1,116	-1,719	-3,727
グローバル	21	-608	-1,240	-3,091
除く日本	54	-410	-859	-1,715
含む日本	-33	-198	-381	-1,376
その他	-202	-509	-480	-635
北米	0	-1	-5	-15
米国	15	38	336	710
カナダ	-29	-102	-179	-346
欧州	16	153	363	713
イギリス	-1	-2	-3	-7
アジア・オセアニア	-37	-122	-242	-509
オーストラリア	-141	-407	-644	-972
ニュージーランド	-2	-9	-15	-36
複合地域	-23	-57	-90	-174
エマージング債券	-206	-574	-1,000	-1,063
グローバル	-27	-64	-90	-250
米ドル建て	-39	-63	-95	-286
現地通貨建て	12	-1	5	37
その他	-180	-510	-910	-813
ロシア	-11	-27	-62	-129
アジア・オセアニア	-6	-18	-23	-46
インド	-92	-254	-318	-455
インドネシア	-27	-61	-75	-97
ブラジル	-20	-51	-87	-245
メキシコ	-17	-64	-107	-121
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	-4	-17	-26	-22
複合地域	0	-1	-2	-5
ハイイールド債券	-173	-606	-1,102	-2,466
グローバル	-5	-32	-97	-321
北米	-136	-445	-758	-1,517
その他	-32	-129	-247	-628
欧州	-29	-107	-192	-491
アジア・オセアニア	-2	-14	-37	-102
複合地域	0	-1	-2	-5
複合資産	3,022	6,900	12,330	17,333
安定	898	1,530	2,352	2,419
安定成長	939	1,191	2,674	3,742
成長	125	39	315	674
国内バランス	297	1,150	2,046	3,861
安定	307	1,197	2,154	3,961
一般	-9	-35	-72	-72
その他	764	2,990	4,943	6,637

<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	2,987	-1,923	890	-3,268
国内REIT	230	-47	343	1,714
日本	230	-47	343	1,714
外国REIT	207	1,508	2,434	1,676
グローバル	134	611	1,023	1,185
除く日本	97	262	414	867
含む日本	36	350	609	318
北米	109	854	1,266	147
その他	-37	43	145	343
欧州	-5	-20	-33	-70
アジア・オセアニア	-20	75	151	455
オーストラリア	-7	0	51	16
複合地域	-1	-1	-1	-2
複数国	-4	-12	-24	-55
その他	236	124	-17	-267
絶対収益型	160	337	495	308
ロング・ショート	-4	-40	-110	-312
マーケットニュートラル	7	-18	-62	-14
GTAA	-4	-14	-28	-63
その他スタイル	161	409	695	696
CB	-43	-164	-242	-379
アジア・オセアニア	-3	-4	-6	-6
日本	-2	-5	-9	-14
グローバル	-38	-156	-227	-358
コモディティ	30	82	101	329
全業種	0	-5	7	28
貴金属	28	84	92	297
エネルギー	2	1	1	1
その他コモディティ	1	1	2	3

< 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	655,302	100.00	5,444	100.00
国内株式	97,699	14.91	882	16.20
一般	58,079	8.86	580	10.65
フリー	45,867	7.00	461	8.47
バリュー	12,212	1.86	119	2.19
小型	8,847	1.35	93	1.71
その他	30,065	4.59	202	3.71
日経225	14,445	2.20	68	1.25
TOPIX	13,325	2.03	76	1.40
JPX日経400	699	0.11	20	0.37
国内債券	34,561	5.27	136	2.50
一般	34,561	5.27	136	2.50
外国株式(先進国)	163,837	25.00	1,001	18.39
グローバル	125,541	19.16	642	11.79
除く日本	29,130	4.45	176	3.23
含む日本	96,411	14.71	466	8.56
その他	38,296	5.84	359	6.59
北米	407	0.06	12	0.22
米国	29,858	4.56	241	4.43
カナダ	311	0.05	3	0.06
欧州	1,596	0.24	58	1.07
ドイツ	26	0.00	1	0.02
イギリス	19	0.00	2	0.04
アジア・オセアニア	85	0.01	8	0.15
オーストラリア	5,974	0.91	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	29,955	4.57	351	6.45
グローバル	7,858	1.20	100	1.84
BRICS	684	0.10	8	0.15
その他	21,412	3.27	243	4.46
欧州	222	0.03	8	0.15
ロシア	127	0.02	4	0.07
アジア・オセアニア	5,937	0.91	107	1.97
中国	1,960	0.30	29	0.53
インド	10,245	1.56	30	0.55
インドネシア	191	0.03	8	0.15
タイ	77	0.01	4	0.07
フィリピン	73	0.01	5	0.09
ベトナム	1,206	0.18	9	0.17
韓国	4	0.00	1	0.02
香港	10	0.00	1	0.02
台湾	1	0.00	1	0.02
中南米	77	0.01	2	0.04
ブラジル	1,003	0.15	17	0.31
メキシコ	21	0.00	3	0.06
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	21	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	655,302	100.00	5,444	100.00
外国債券(先進国)	84,794	12.94	845	15.52
グローバル	62,189	9.49	547	10.05
除く日本	33,120	5.05	239	4.39
含む日本	29,069	4.44	308	5.66
その他	22,605	3.45	298	5.47
北米	94	0.01	6	0.11
米国	6,549	1.00	162	2.98
カナダ	1,262	0.19	7	0.13
欧州	1,807	0.28	37	0.68
イギリス	30	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	2,249	0.34	12	0.22
オーストラリア	8,915	1.36	41	0.75
ニュージーランド	164	0.03	14	0.26
複合地域	1,535	0.23	11	0.20
エマージング債券	18,655	2.85	299	5.49
グローバル	8,924	1.36	193	3.55
米ドル建て	7,188	1.10	152	2.79
現地通貨建て	1,736	0.26	41	0.75
その他	9,732	1.49	106	1.95
ロシア	210	0.03	5	0.09
アジア・オセアニア	482	0.07	17	0.31
インド	4,238	0.65	22	0.40
インドネシア	563	0.09	11	0.20
ブラジル	3,035	0.46	25	0.46
メキシコ	532	0.08	9	0.17
南アフリカ	3	0.00	1	0.02
トルコ	168	0.03	6	0.11
複合地域	53	0.01	1	0.02
ハイイールド債券	21,831	3.33	312	5.73
グローバル	3,444	0.53	58	1.07
北米	14,354	2.19	161	2.96
その他	4,033	0.62	93	1.71
欧州	3,161	0.48	51	0.94
アジア・オセアニア	765	0.12	32	0.59
複合地域	46	0.01	1	0.02
複合資産	109,306	16.68	1,000	18.37
安定	29,645	4.52	293	5.38
安定成長	47,876	7.31	419	7.70
成長	13,502	2.06	243	4.46
国内バランス	11,182	1.71	33	0.61
安定	10,627	1.62	9	0.17
一般	450	0.07	18	0.33
その他	7,100	1.08	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	655,302	100.00		5,444	100.00
国内REIT	31,111	4.75		122	2.24
日本	31,111	4.75		122	2.24
外国REIT	50,617	7.72		287	5.27
グローバル	19,890	3.04		136	2.50
除く日本	4,222	0.64		50	0.92
含む日本	15,668	2.39		86	1.58
北米	25,566	3.90		82	1.51
その他	5,160	0.79		69	1.27
欧州	269	0.04		17	0.31
アジア・オセアニア	3,651	0.56		34	0.62
オーストラリア	871	0.13		13	0.24
複合地域	51	0.01		3	0.06
複数国	319	0.05		2	0.04
その他	12,936	1.97		209	3.84
絶対収益型	7,693	1.17		98	1.80
ロング・ショート	884	0.13		32	0.59
マーケットニュートラル	1,108	0.17		15	0.28
GTAA	416	0.06		14	0.26
その他スタイル	5,286	0.81		37	0.68
CB	1,387	0.21		45	0.83
アジア・オセアニア	36	0.01		1	0.02
日本	61	0.01		3	0.06
グローバル	1,290	0.20		41	0.75
コモディティ	2,026	0.31		27	0.50
全業種	835	0.13		14	0.26
貴金属	1,160	0.18		11	0.20
エネルギー	21	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	11,936	8.3	3.94	3.95	1.289
国内株式	14,620	11.4	1.23	1.32	1.167
一般	13,453	11.0	1.62	1.80	1.430
フリー	13,118	10.4	1.83	2.07	1.478
バリュー	14,749	13.1	0.82	0.80	1.250
小型	20,367	11.9	1.18	1.11	1.743
その他	15,419	12.1	0.51	0.47	0.481
日経225	16,161	13.7	0.54	0.48	0.581
TOPIX	16,106	13.4	0.33	0.31	0.324
JPX日経400	13,899	5.5	0.04	0.04	0.551
国内債券	11,146	10.4	0.33	0.34	0.358
一般	11,146	10.4	0.33	0.34	0.358
外国株式(先進国)	13,184	6.6	4.50	4.42	1.580
グローバル	13,832	7.0	3.56	3.48	1.556
除く日本	16,873	9.2	0.84	0.82	0.750
含む日本	12,683	6.1	4.40	4.29	1.799
その他	12,026	6.0	7.70	7.65	1.661
北米	12,076	6.6	7.40	6.92	1.915
米国	12,682	5.4	6.11	5.56	1.621
カナダ	7,096	7.9	15.66	17.19	1.992
欧州	11,846	8.3	3.11	3.00	1.672
ドイツ	10,748	5.8	0.00	0.00	0.770
イギリス	5,669	5.7	14.78	18.02	1.945
アジア・オセアニア	9,521	5.8	5.26	5.38	1.700
オーストラリア	8,996	5.5	15.77	17.90	1.827
ニュージーランド	14,221	7.5	3.18	2.81	1.672
複合地域	7,535	6.8	0.00	0.00	1.705
エマージング株式	12,096	8.9	2.96	3.25	1.825
グローバル	11,280	6.7	2.02	2.04	1.472
BRICS	14,575	12.1	1.14	1.03	2.068
その他	12,351	9.7	3.37	3.76	1.947
欧州	10,157	13.8	0.22	0.19	1.987
ロシア	11,849	10.7	0.64	0.51	2.014
アジア・オセアニア	12,573	9.7	7.14	7.72	1.742
中国	18,722	9.9	1.47	1.30	1.962
インド	12,411	10.0	1.34	1.20	2.075
インドネシア	10,393	8.6	0.44	0.45	1.853
タイ	10,231	11.7	0.67	0.77	1.705
フィリピン	10,382	6.5	0.55	0.60	1.795
ベトナム	11,384	4.4	0.86	0.86	1.867
韓国	9,221	1.1	0.00	0.00	1.804
香港	14,819	10.4	2.02	2.09	0.858
台湾	10,703	7.2	0.00	0.00	1.661
中南米	8,596	13.0	0.00	0.00	2.041
ブラジル	6,579	9.8	11.60	18.12	1.935
メキシコ	8,847	6.1	0.00	0.00	1.918
中東・アフリカ	9,970	9.1	0.20	1.29	2.068
トルコ	6,976	13.5	0.00	0.00	2.042
複合地域	17,787	11.7	3.05	3.04	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	11,936	8.3	3.94	3.95	1.289
外国債券(先進国)	9,959	8.0	2.73	2.80	1.128
グローバル	10,512	8.3	1.94	1.95	1.067
除く日本	11,144	10.5	1.84	1.85	0.842
含む日本	10,021	6.5	2.05	2.06	1.323
その他	8,945	7.5	4.92	5.14	1.299
北米	10,469	5.8	1.88	1.83	1.813
米国	9,669	6.3	5.28	5.20	1.383
カナダ	8,094	7.6	4.42	4.49	1.368
欧州	8,508	9.7	1.34	1.35	1.039
イギリス	7,969	5.1	3.83	3.87	1.274
アジア・オセアニア	7,586	9.3	3.14	3.31	1.423
オーストラリア	7,720	10.6	6.12	6.70	1.261
ニュージーランド	9,208	5.3	2.74	2.84	1.335
複合地域	5,750	10.1	3.87	3.92	1.191
エマージング債券	8,948	8.3	6.90	7.25	1.596
グローバル	9,265	9.1	6.31	6.67	1.576
米ドル建て	9,366	9.3	6.60	7.01	1.631
現地通貨建て	8,890	8.1	5.11	5.31	1.349
その他	8,372	6.9	7.44	7.78	1.615
ロシア	9,110	6.9	6.37	5.83	1.609
アジア・オセアニア	9,027	6.8	12.10	13.17	1.641
インド	9,154	5.2	7.87	7.98	1.700
インドネシア	7,693	7.5	7.29	6.76	1.664
ブラジル	8,602	10.0	7.34	8.37	1.591
メキシコ	6,907	7.1	5.99	5.42	1.395
南アフリカ	6,930	7.8	7.03	7.79	1.430
トルコ	3,883	7.1	8.46	7.97	1.452
複合地域	4,286	13.4	5.47	5.37	1.210
ハイイールド債券	8,781	8.6	8.97	9.47	1.698
グローバル	7,743	8.0	7.15	7.52	1.600
北米	9,630	9.8	8.74	9.12	1.701
その他	7,959	6.7	11.28	12.32	1.768
欧州	7,494	6.7	11.95	13.13	1.746
アジア・オセアニア	8,299	7.7	9.61	10.20	1.876
複合地域	4,435	15.8	5.38	5.41	1.800
複合資産	11,963	7.9	1.68	1.63	1.048
安定	11,244	7.6	0.88	0.85	1.137
安定成長	11,631	8.2	2.31	2.28	1.105
成長	13,508	7.9	0.51	0.48	0.936
国内バランス	11,499	8.0	2.17	2.13	0.942
安定	11,029	8.9	2.21	2.18	0.921
一般	11,902	9.2	0.93	0.87	1.355
その他	11,068	0.4	2.36	1.96	0.674

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

< 5 > 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別③

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	11,936	8.3	3.94	3.95	1.289
国内REIT	15,533	8.2	9.85	9.19	0.956
日本	15,533	8.2	9.85	9.19	0.956
外国REIT	11,538	7.1	11.33	11.44	1.568
グローバル	12,380	7.8	9.56	10.08	1.427
除く日本	14,358	6.1	6.50	7.63	1.120
含む日本	11,230	8.7	10.39	10.75	1.510
北米	10,548	7.2	13.12	12.88	1.629
その他	11,056	5.8	9.30	9.50	1.804
欧州	9,872	5.4	4.68	4.71	1.860
アジア・オセアニア	12,402	5.7	11.50	11.82	1.846
オーストラリア	9,755	5.1	4.39	4.36	1.718
複合地域	7,443	8.0	1.42	1.33	0.854
複数国	12,133	12.8	2.71	2.35	1.656
その他					
絶対収益型	10,292	5.1	0.08	0.08	1.679
ロング・ショート	10,426	4.8	0.48	0.47	1.597
マーケットニュートラル	10,329	4.5	0.08	0.07	1.238
GTAA	10,765	5.9	0.00	0.00	1.584
その他スタイル	9,981	5.4	0.02	0.02	1.792
CB	11,304	6.3	1.19	1.15	1.517
アジア・オセアニア	8,280	9.6	3.00	2.90	1.823
日本	11,038	8.7	0.20	0.19	1.045
グローバル	11,397	6.1	1.19	1.15	1.531
コモディティ	8,134	6.5	0.00	0.00	0.896
全業種	5,630	8.4	0.00	0.00	1.249
貴金属	11,045	4.0	0.00	0.00	0.641
エネルギー	8,477	10.9	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	10,840	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(%)=(予想分配金×(決算回数÷実績計算回数))÷当月末の基準価額×100

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

【照会先】

三菱アセット・ブレインズ株式会社

コンサルティンググループ 川真田 隆志

電話番号 : 03-6721-1013

Eメール : mab-index@mab.co.jp

〒107-0062 東京都港区南青山1丁目1番1号 新青山ビル西館8階

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

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

加入協会名 一般社団法人 日本投資顧問業協会