

投信指数 MAB-FPI

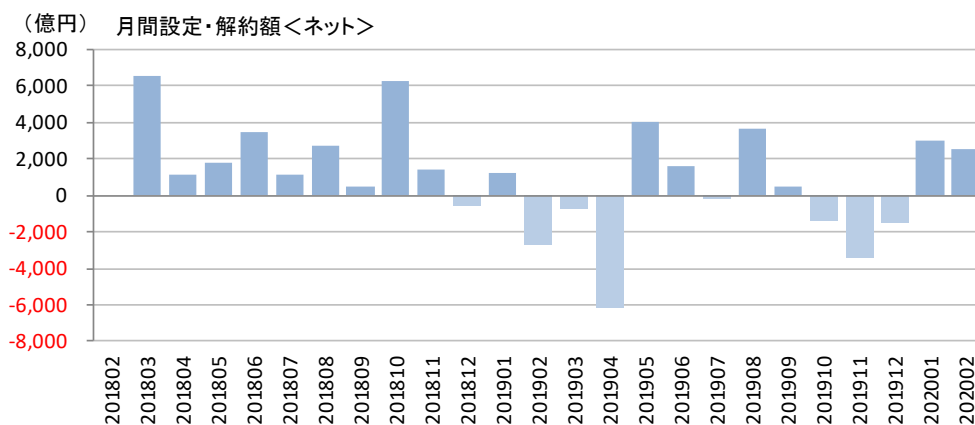
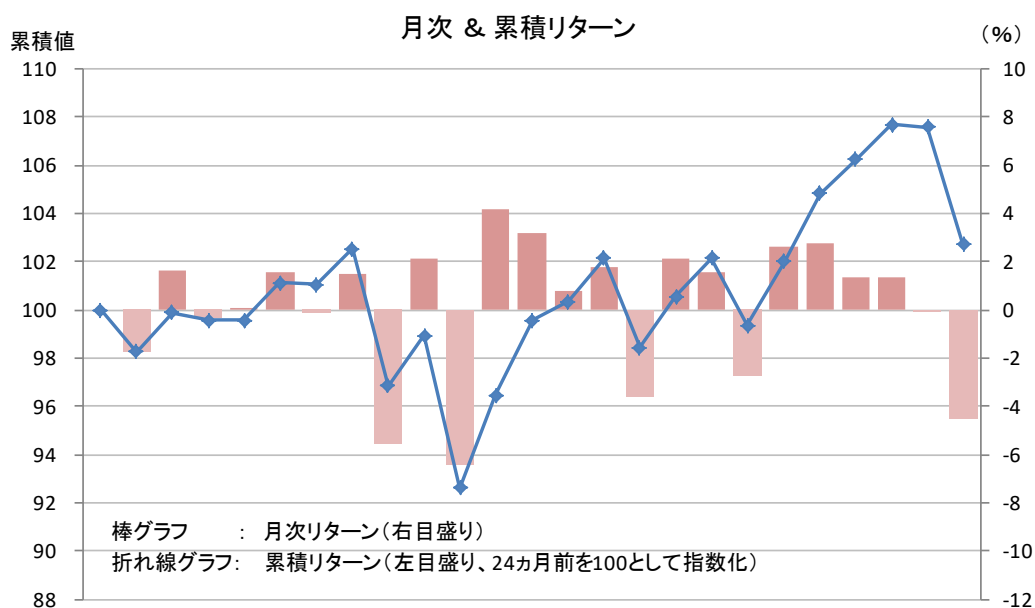
パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2020年2月

「総合」 **-4.52 %**

(前月 **-0.08 %**)



MAB-FPI について

MAB-FPI とは日本の公募追加型株式投資信託全体の動向を表す指数で、弊社が独自に開発したものです。

(FPI は Fund Performance Index の略)

■主な特徴

- ・国内籍の公募追加型株式投資信託をユニバースとします（但し、ETF は除く）。
- ・月末に翌月の採用ファンドを選定します（月次リバランス）。
- ・総合および各カテゴリー別の日次収益率は、個々の投資信託の日次収益率を前日の純資産額によって加重した平均値として計算します。
- ・指数は算出開始時点（原則、1997年3月31日）を10,000（単位：ポイント）とし、各カテゴリーの日次収益率を乗じて算出します。
- ・カテゴリーは全体を表す「総合」のほかファンド分類別（大分類、中分類、小分類）、各種区分別（ヘッジ種別、アクティブ/パッシブ別、他）など、様々なサブ・カテゴリー指数を算出します。

詳細については『MAB 投信指数「MAB-FPI」算出要領』をご参照下さい。

■本レポートの内容

掲載対象カテゴリー：「総合」

|--- ファンド分類別「大分類」
|--- " " 「中分類」
|--- " " 「小分類」

なお、「中分類」と「小分類」の掲載対象は直近5年以上指数算出が可能なカテゴリーからの抜粋

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン	・ ・ ・ ・ ・	P. 3
(2) 期間別リターン	・ ・ ・ ・ ・	P. 6
(3) リターン推移	・ ・ ・ ・ ・	P. 9
(4) 対「総合」寄与度分析	・ ・ ・ ・ ・	P. 20

<2>リスク・サマリー

・ ・ ・ ・ ・ P. 22

<3>設定・解約額 [ネット金額]

・ ・ ・ ・ ・ P. 35

<4>純資産額、ファンド本数

・ ・ ・ ・ ・ P. 38

<5>属性、指標等

・ ・ ・ ・ ・ P. 41

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別①

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		12,987	13,602	-615	-4.52
国内株式		14,457	16,097	-1,641	-10.19
一般		14,140	15,682	-1,542	-9.83
フリー		13,301	14,734	-1,433	-9.72
バリュー		18,200	20,275	-2,076	-10.24
小型		28,673	33,606	-4,933	-14.68
その他		14,367	15,879	-1,511	-9.52
日経225		13,856	15,192	-1,336	-8.79
TOPIX		14,077	15,692	-1,615	-10.29
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	13,354	14,836	-1,483	-9.99
国内債券		13,462	13,386	76	0.57
一般		13,462	13,386	76	0.57
外国株式(先進国)		14,728	15,685	-956	-6.10
グローバル		16,332	17,327	-994	-5.74
除く日本		22,470	24,229	-1,759	-7.26
含む日本		14,960	15,792	-832	-5.27
その他		11,414	12,308	-894	-7.27
北米		11,019	12,014	-994	-8.28
米国		17,071	18,478	-1,407	-7.61
カナダ	10,000 (2009.02.27)	16,801	17,418	-617	-3.54
欧州		18,179	19,050	-871	-4.57
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	8,333	8,876	-543	-6.11
イギリス	9,683 (2014.05.30)	8,336	8,980	-644	-7.17
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	32,695	34,347	-1,651	-4.81
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	14,727	15,720	-993	-6.32
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	34,219	35,489	-1,270	-3.58
複合地域	10,000 (2013.04.30)	7,203	8,226	-1,023	-12.44
エマージング株式		14,630	15,068	-439	-2.91
グローバル		14,481	15,001	-520	-3.47
BRICS	10,000 (2005.09.30)	23,297	24,606	-1,309	-5.32
その他		15,154	15,562	-407	-2.62
欧州		25,146	27,353	-2,207	-8.07
ロシア	10,000 (2007.03.30)	10,452	11,461	-1,009	-8.80
アジア・オセアニア		15,313	15,513	-200	-1.29
中国		37,483	35,899	1,584	4.41
インド	10,000 (2004.09.30)	32,561	33,370	-810	-2.43
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	12,423	14,005	-1,582	-11.30
タイ		19,150	20,758	-1,608	-7.74
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,313	7,714	-401	-5.20
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	13,306	14,262	-956	-6.71
韓国	10,000 (1997.06.30)	19,581	20,499	-918	-4.48
香港		22,584	22,264	320	1.44
台湾	10,000 (2008.03.31)	15,974	16,441	-467	-2.84
中南米	7,427 (2006.04.28)	7,838	8,922	-1,084	-12.14
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	8,760	10,264	-1,505	-14.66
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	8,881	9,775	-895	-9.15
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	8,798	9,378	-580	-6.19
トルコ		21,217	23,744	-2,527	-10.64
複合地域	10,000 (2005.08.31)	19,798	20,203	-405	-2.01

※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		12,987	13,602	-615	-4.52
外国債券(先進国)		18,016	17,974	43	0.24
グローバル		18,485	18,373	112	0.61
除く日本		19,776	19,618	158	0.81
含む日本		17,769	17,700	70	0.39
その他		16,728	16,861	-134	-0.79
北米	9,052 (2013.05.31)	10,674	10,579	95	0.89
米国		16,094	16,204	-110	-0.68
カナダ	10,000 (2003.05.30)	14,008	14,101	-92	-0.65
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,417	15,367	50	0.33
イギリス	10,069 (2014.07.31)	9,677	9,767	-89	-0.92
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	17,885	18,132	-247	-1.36
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	22,055	22,331	-276	-1.23
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	10,674	10,846	-172	-1.59
複合地域	10,000 (2001.11.30)	17,041	16,928	113	0.67
エマージング債券		17,272	17,438	-166	-0.95
グローバル		18,757	18,908	-150	-0.79
米ドル建て		19,440	19,536	-95	-0.49
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,791	13,059	-269	-2.06
その他	8,647 (2005.03.31)	12,641	12,781	-140	-1.09
ロシア	10,000 (2008.05.30)	11,390	11,771	-381	-3.24
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	14,694	14,554	141	0.97
インド	10,000 (2011.08.31)	16,221	15,946	275	1.72
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	13,950	14,251	-302	-2.12
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	12,008	12,581	-573	-4.55
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	12,479	12,799	-320	-2.50
南アフリカ	10,000 (2010.03.31)	10,660	10,912	-252	-2.31
トルコ	10,000 (2011.04.28)	5,825	6,414	-589	-9.18
複合地域	10,000 (2006.08.31)	11,152	11,376	-224	-1.97
ハイイールド債券		21,725	22,024	-299	-1.36
グローバル	10,000 (1997.06.30)	22,093	22,319	-227	-1.02
北米		21,041	21,325	-284	-1.33
その他	10,000 (2004.03.31)	21,948	22,339	-390	-1.75
欧州	10,000 (2006.04.28)	21,939	22,433	-494	-2.20
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,487	14,481	6	0.04
複合地域	10,000 (2004.03.31)	19,313	19,297	17	0.09
複合資産		17,243	17,753	-510	-2.87
安定	10,000 (1998.10.30)	15,583	15,799	-217	-1.37
安定成長		18,447	18,992	-544	-2.87
成長		19,945	21,093	-1,148	-5.44
国内バランス		13,140	13,470	-330	-2.45
安定		13,493	13,813	-320	-2.32
一般		13,898	14,604	-706	-4.84
その他	10,000 (2018.10.31)	12,766	13,406	-640	-4.77

※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		12,987	13,602	-615	-4.52	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	33,514	36,477	-2,964	-8.12	
日本	10,000 (2003.10.31)	33,514	36,477	-2,964	-8.12	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	26,549	28,118	-1,570	-5.58	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	23,111	24,494	-1,383	-5.65	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	25,105	26,524	-1,419	-5.35	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	23,163	24,572	-1,408	-5.73	
北米	10,000 (2003.09.30)	26,367	28,088	-1,721	-6.13	
その他	10,000 (2004.04.30)	27,530	28,271	-741	-2.62	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,767	5,986	-218	-3.65	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	20,598	21,019	-421	-2.00	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	15,038	15,528	-490	-3.16	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	6,804	7,383	-579	-7.84	
複数国	10,000 (2004.04.30)	35,456	37,955	-2,498	-6.58	
その他		5,868	5,983	-115	-1.93	
絶対収益型		7,743	7,813	-70	-0.89	
ロング・ショート		8,912	9,042	-129	-1.43	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,750	11,854	-104	-0.88	
GTAA		10,876	10,930	-54	-0.49	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,265	7,326	-61	-0.83	
CB		18,739	19,097	-358	-1.87	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	15,737	15,662	75	0.48	
日本		19,214	20,109	-895	-4.45	
グローバル		32,914	33,524	-610	-1.82	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	8,092	8,036	56	0.70	
全業種	10,000 (2004.12.30)	5,971	6,209	-238	-3.83	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	16,356	15,708	648	4.13	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	4,102	4,390	-288	-6.56	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	9,132	9,814	-682	-6.95	

※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	-3.33	3.36	3.17	-4.60
国内株式	-11.33	1.15	-3.80	-12.84
一般	-11.08	1.75	-3.88	-12.65
フリー	-11.01	1.84	-3.56	-12.63
バリュー	-11.32	1.46	-5.14	-12.71
小型	-16.97	-5.51	-10.26	-18.45
その他	-10.11	1.86	-1.72	-11.45
日経225	-9.08	2.87	0.44	-10.58
TOPIX	-10.99	0.95	-3.95	-12.23
JPX日経400	-10.47	1.57	-2.98	-11.70
国内債券	0.71	-1.05	1.95	1.05
一般	0.71	-1.05	1.95	1.05
外国株式(先進国)	-2.79	7.11	5.50	-5.57
グローバル	-2.28	8.12	6.14	-5.15
除く日本	-4.58	5.79	4.19	-7.50
含む日本	-1.57	8.85	6.76	-4.44
その他	-4.50	3.73	3.38	-6.94
北米	-6.45	1.24	-1.81	-7.83
米国	-3.88	4.43	4.91	-6.48
カナダ	-2.30	3.91	1.20	-3.79
欧州	-2.12	8.19	6.43	-5.88
ドイツ	-7.12	6.38	1.23	-9.16
イギリス	-6.38	2.75	-10.17	-9.34
アジア・オセアニア	-5.18	6.38	-0.87	-8.23
オーストラリア	-7.69	-0.37	-2.87	-9.24
ニュージーランド	-0.84	7.97	6.55	-6.91
複合地域	-12.05	-9.75	-19.91	-17.75
エマージング株式	-1.31	9.47	3.77	-4.51
グローバル	-1.26	10.12	4.90	-6.33
BRICS	-2.71	8.82	4.51	-8.71
その他	-1.26	9.29	3.41	-3.68
欧州	-4.03	8.05	6.22	-9.76
ロシア	-0.91	10.07	15.15	-8.41
アジア・オセアニア	-1.29	8.13	-1.34	-5.72
中国	9.23	21.27	20.85	4.50
インド	-1.03	11.78	8.01	-1.22
インドネシア	-6.79	-8.14	-15.42	-13.48
タイ	-16.26	-17.02	-20.33	-14.72
フィリピン	-11.21	-7.64	-13.32	-11.47
ベトナム	-8.69	-7.91	-15.01	-7.59
韓国	0.77	8.26	-14.22	-5.91
香港	-0.15	8.17	-5.44	-5.30
台湾	-3.10	11.28	5.51	-7.52
中南米	-6.54	2.57	-9.59	-15.21
ブラジル	-9.88	-1.66	-12.59	-18.85
メキシコ	-3.30	8.85	-4.09	-8.53
中東・アフリカ	-3.84	1.40	-6.49	-7.33
トルコ	-3.70	11.03	-7.61	-6.45
複合地域	-4.05	5.01	-3.29	-7.44

※[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か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	-3.33	3.36	3.17	-4.60
外国債券(先進国)	1.09	2.50	3.44	0.37
グローバル	1.72	2.63	4.83	1.18
除く日本	1.90	3.02	5.15	1.37
含む日本	1.52	2.19	4.48	0.97
その他	-0.62	2.09	-0.27	-1.82
北米	2.03	2.15	5.40	2.19
米国	0.78	3.17	5.27	0.41
カナダ	0.33	2.38	0.38	-0.93
欧州	1.01	0.81	1.54	0.69
イギリス	0.56	8.26	-1.12	-0.64
アジア・オセアニア	-2.21	1.14	-3.99	-4.13
オーストラリア	-2.11	1.25	-3.72	-3.93
ニュージーランド	-0.92	2.46	-3.51	-3.81
複合地域	1.74	4.26	4.37	1.17
エマージング債券	0.80	5.10	2.39	-1.72
グローバル	1.81	5.10	2.97	-1.39
米ドル建て	2.19	4.98	3.30	-1.00
現地通貨建て	0.24	5.64	1.60	-2.97
その他	-0.09	5.07	1.87	-2.01
ロシア	-0.92	10.38	13.61	-5.04
アジア・オセアニア	2.10	5.75	6.58	1.43
インド	1.90	6.38	7.67	1.74
インドネシア	2.60	9.30	8.72	1.23
ブラジル	-4.39	0.12	-9.21	-8.43
メキシコ	4.04	12.47	12.46	-1.09
南アフリカ	-0.13	6.23	-3.54	-7.38
トルコ	-5.43	13.05	4.97	-3.99
複合地域	1.71	7.48	4.01	-2.35
ハイイールド債券	-0.16	3.42	1.41	-2.73
グローバル	0.56	4.30	1.14	-2.43
北米	-0.02	3.38	1.56	-2.62
その他	-1.23	2.83	1.08	-3.38
欧州	-1.84	2.14	0.49	-4.11
アジア・オセアニア	1.12	5.93	3.35	-0.54
複合地域	0.60	3.60	2.47	-1.27
複合資産	-1.95	1.89	3.28	-2.66
安定	-0.53	1.30	3.64	-1.12
安定成長	-1.92	2.36	3.47	-2.88
成長	-4.64	2.90	1.52	-6.10
国内バランス	-2.44	-0.29	1.83	-1.98
安定	-2.31	-0.48	1.82	-1.79
一般	-4.77	1.62	1.22	-5.26
その他	-2.39	3.70	17.36	-1.79

※[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	-3.33	3.36	3.17	-4.60
国内REIT	-7.57	-1.03	12.19	-5.04
日本	-7.57	-1.03	12.19	-5.04
外国REIT	-4.52	0.85	5.17	-3.66
グローバル	-4.80	1.98	3.46	-4.14
除く日本	-4.59	2.71	5.30	-3.96
含む日本	-4.86	1.78	3.01	-4.19
北米	-4.91	-0.45	6.25	-3.58
その他	-1.52	3.08	6.26	-2.18
欧州	-2.11	10.11	4.58	-4.95
アジア・オセアニア	-0.67	3.01	6.79	-1.31
オーストラリア	-3.03	1.97	4.30	-3.94
複合地域	-8.56	2.55	-3.69	-10.11
複数国	-5.54	0.60	8.35	-3.64
その他	-1.04	2.59	3.33	-2.26
絶対収益型	-0.26	-1.04	1.09	-0.58
ロング・ショート	-1.33	-2.80	1.86	-1.10
マーケットニュートラル	-0.26	-0.81	-1.40	-1.14
GTAA	1.03	0.95	4.42	0.12
その他スタイル	-0.18	-0.92	1.19	-0.42
CB	-0.05	2.82	2.08	-1.51
アジア・オセアニア	2.86	9.76	2.33	0.91
日本	-4.89	-1.45	-4.60	-5.18
グローバル	0.10	2.84	2.40	-1.41
コモディティ	3.26	3.22	5.60	-0.14
全業種	-7.13	-1.62	-10.26	-10.13
貴金属	12.12	6.64	20.20	8.41
エネルギー	-13.54	-7.02	-15.14	-17.68
その他コモディティ	-9.56	-5.12	-12.42	-13.13

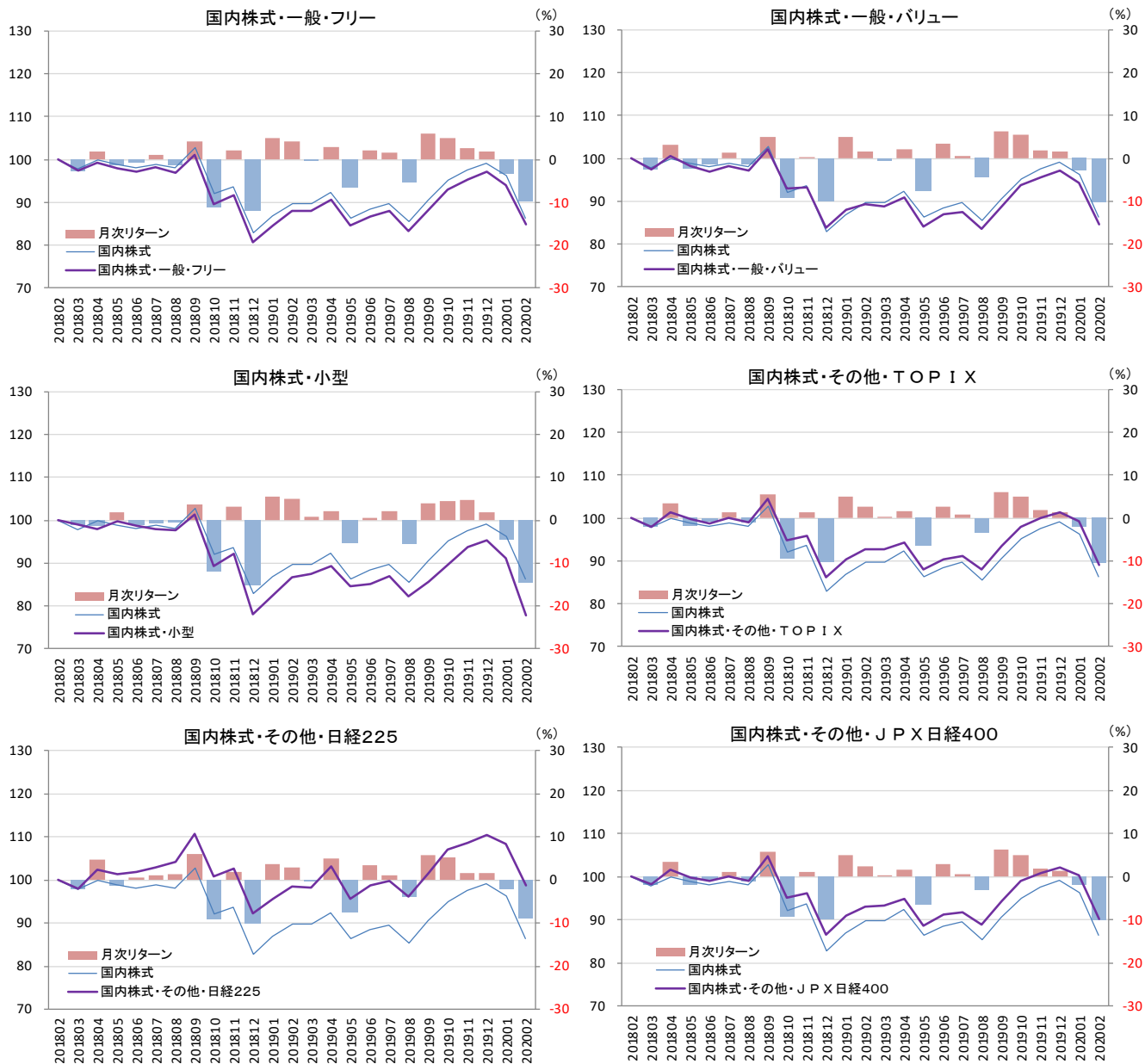
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

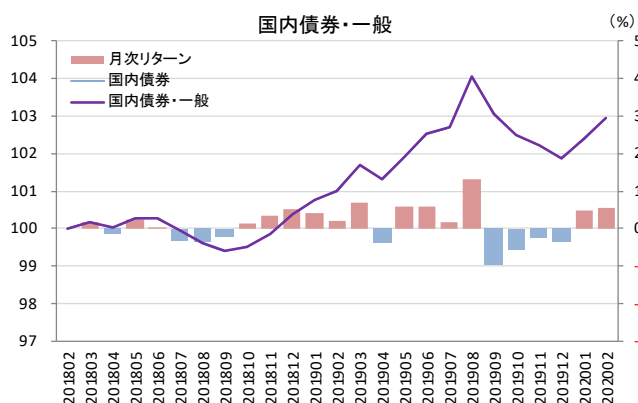
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

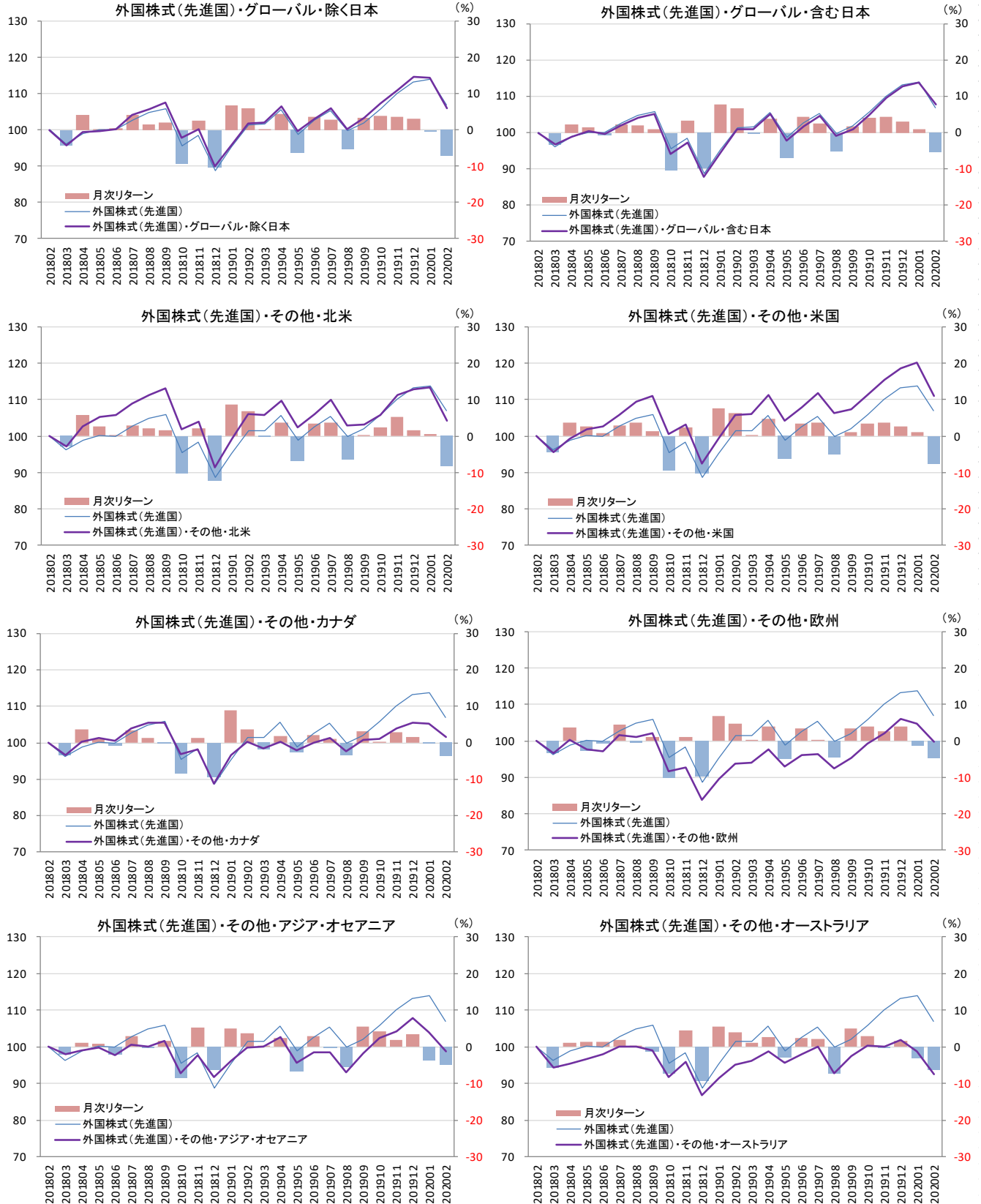


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

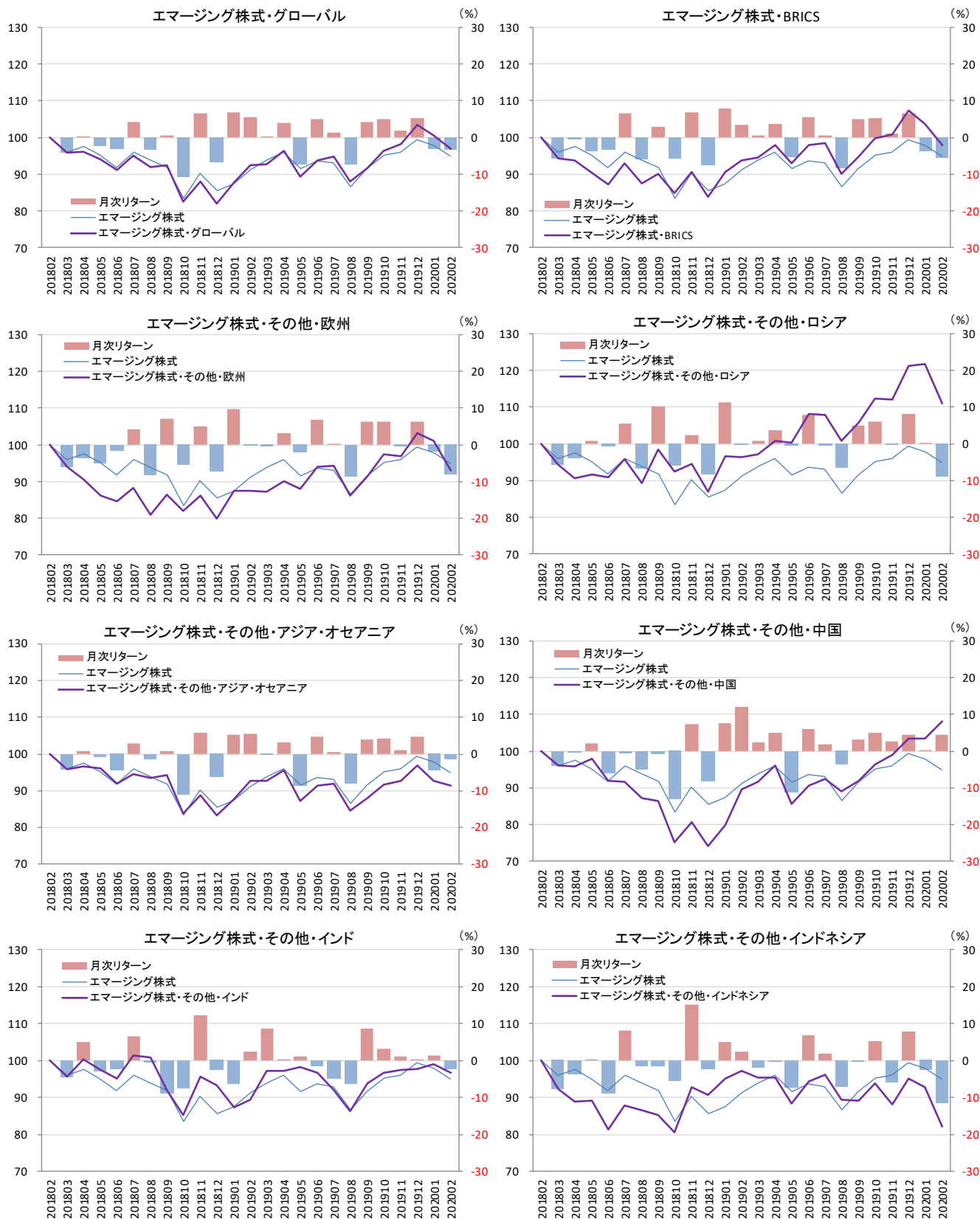


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

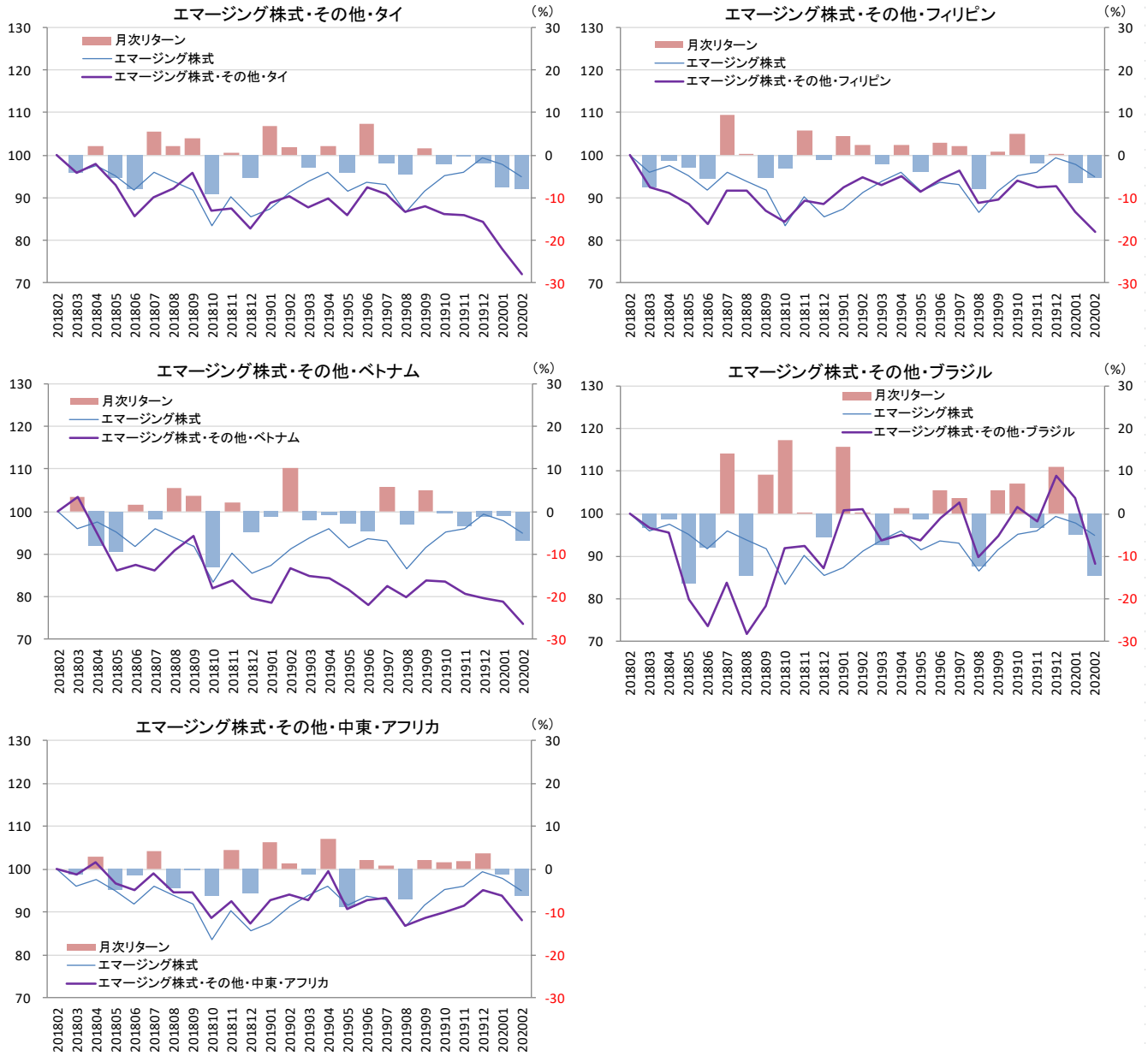


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

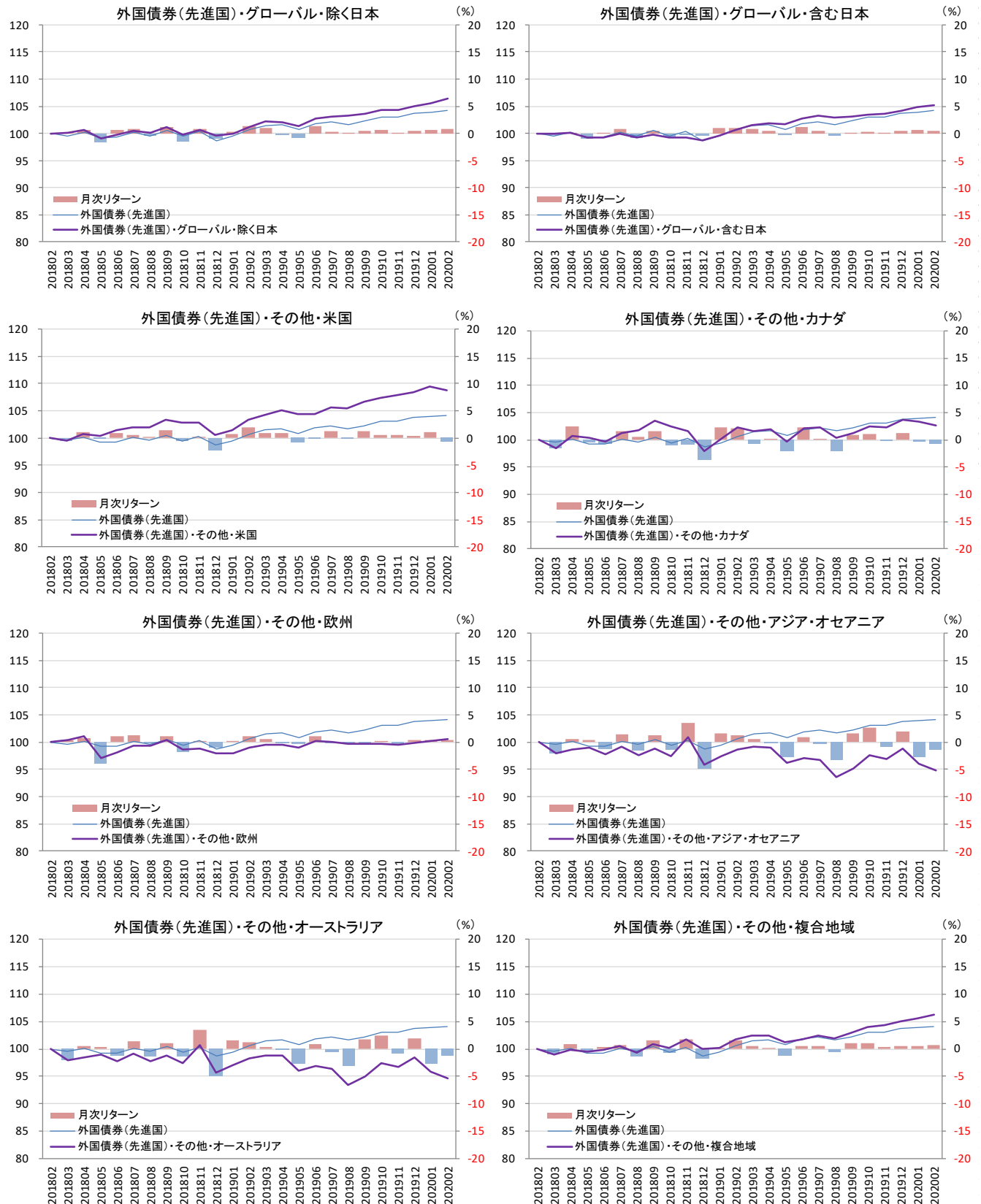


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

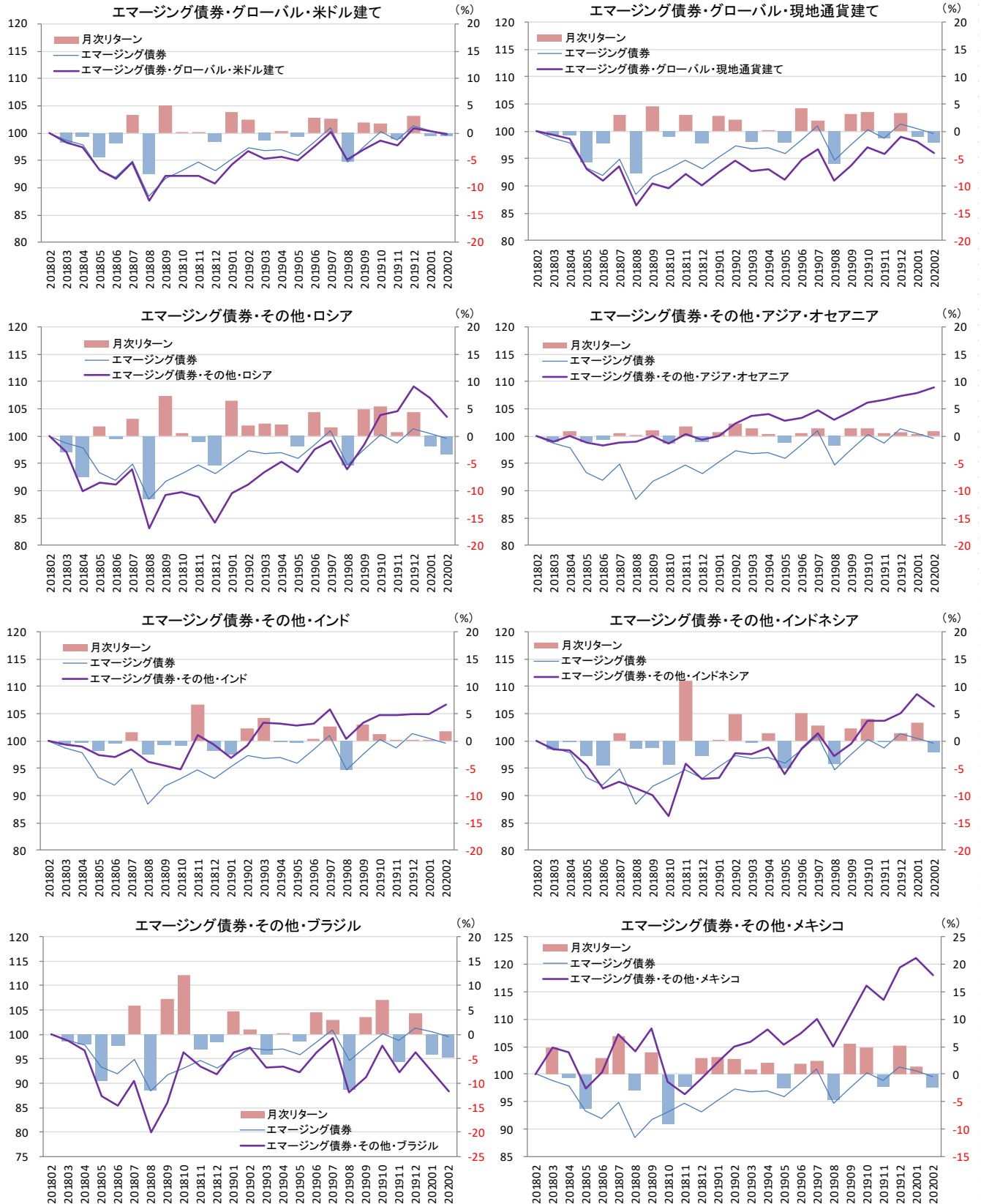


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

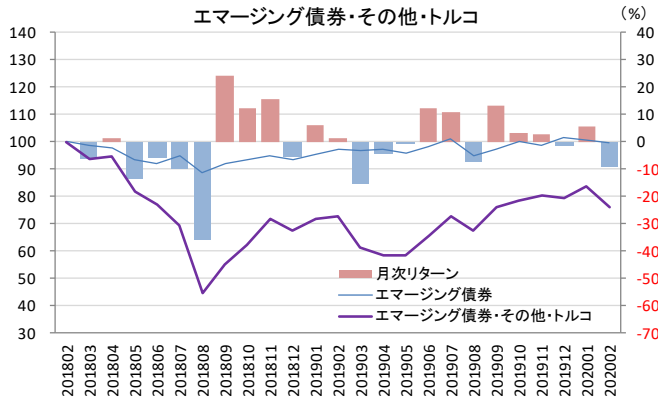


<1>パフォーマンス・サマリー

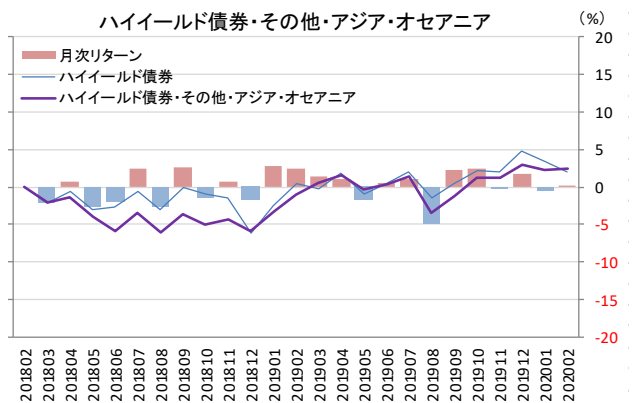
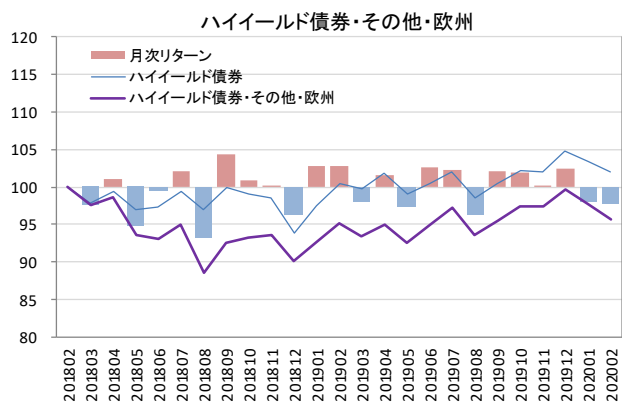
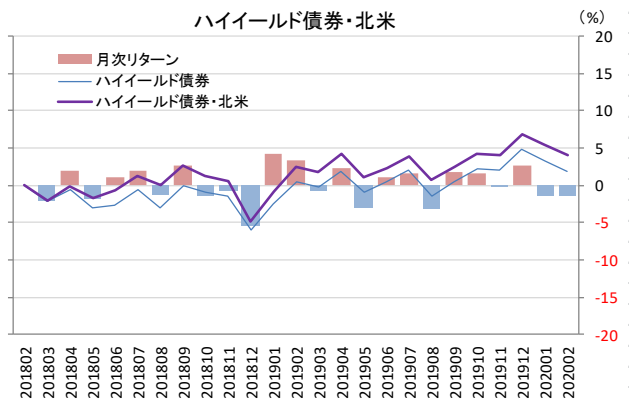
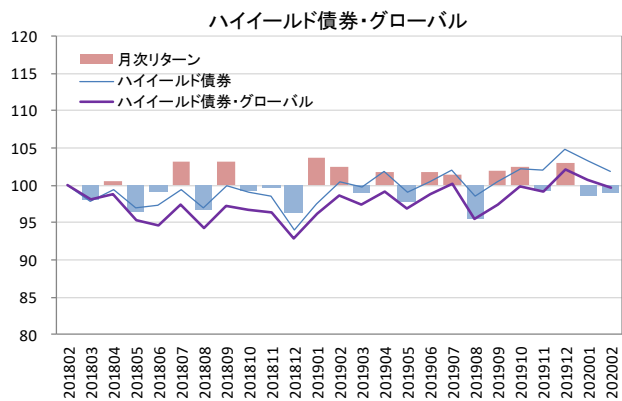
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

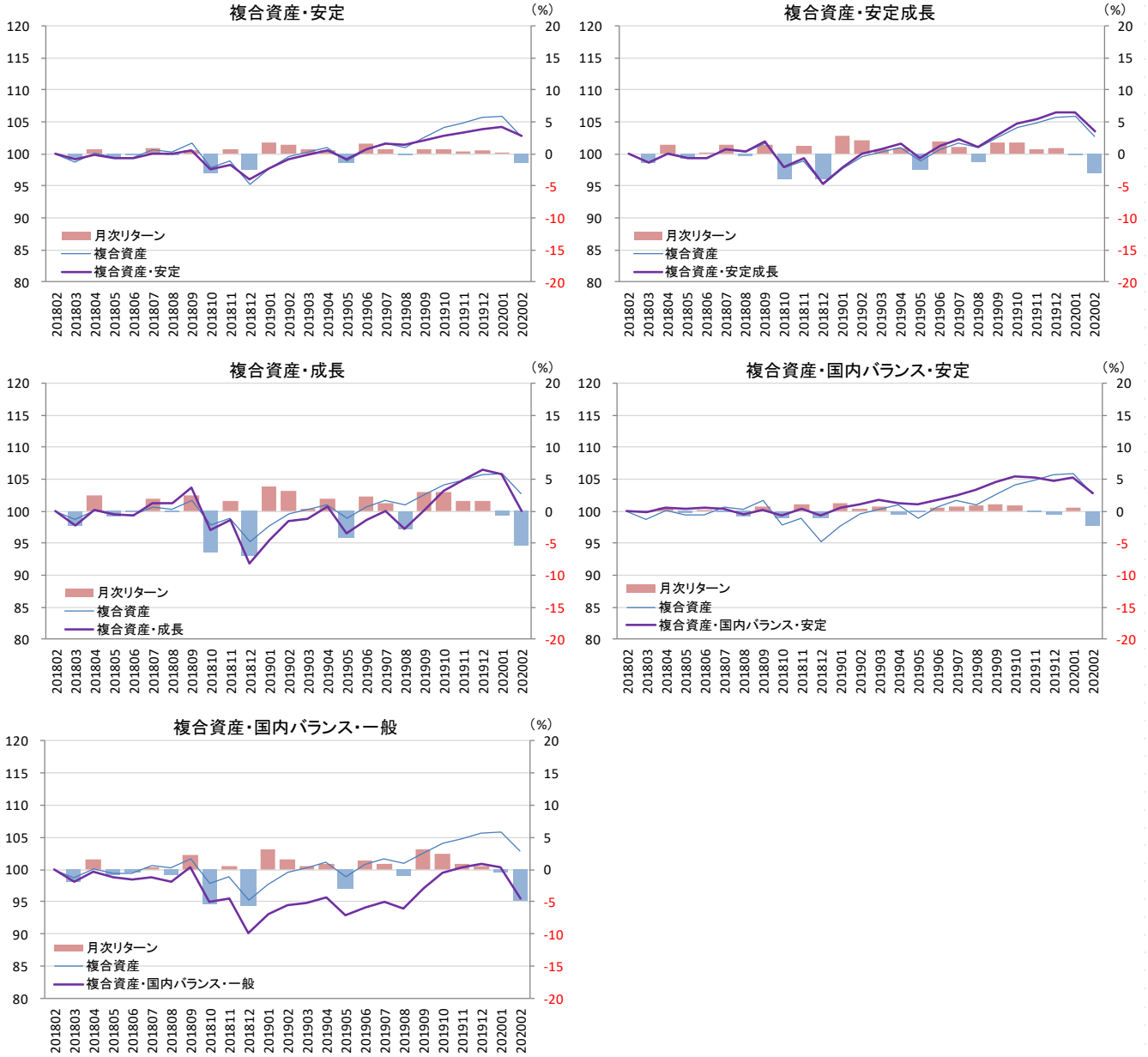


<1>パフォーマンス・サマリー

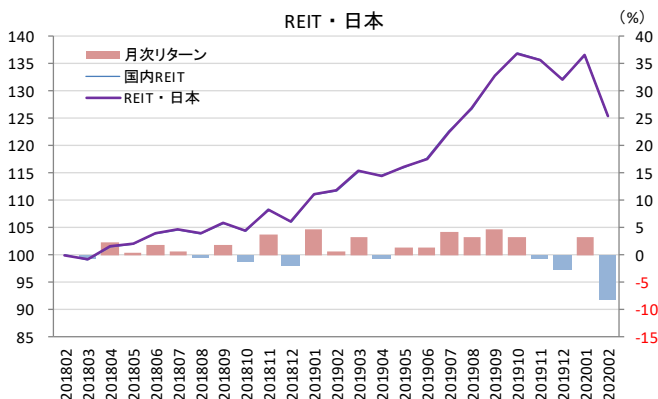
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

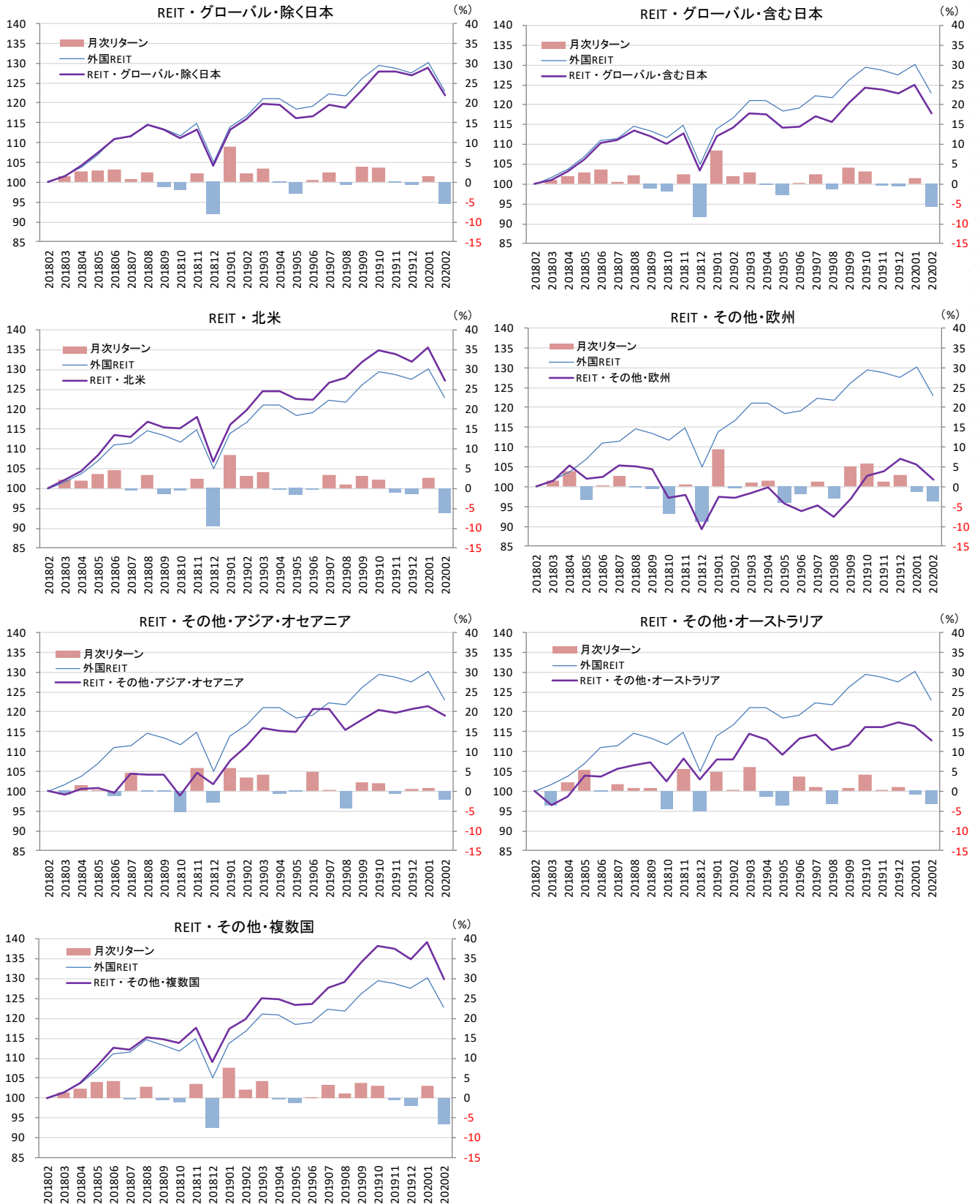


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

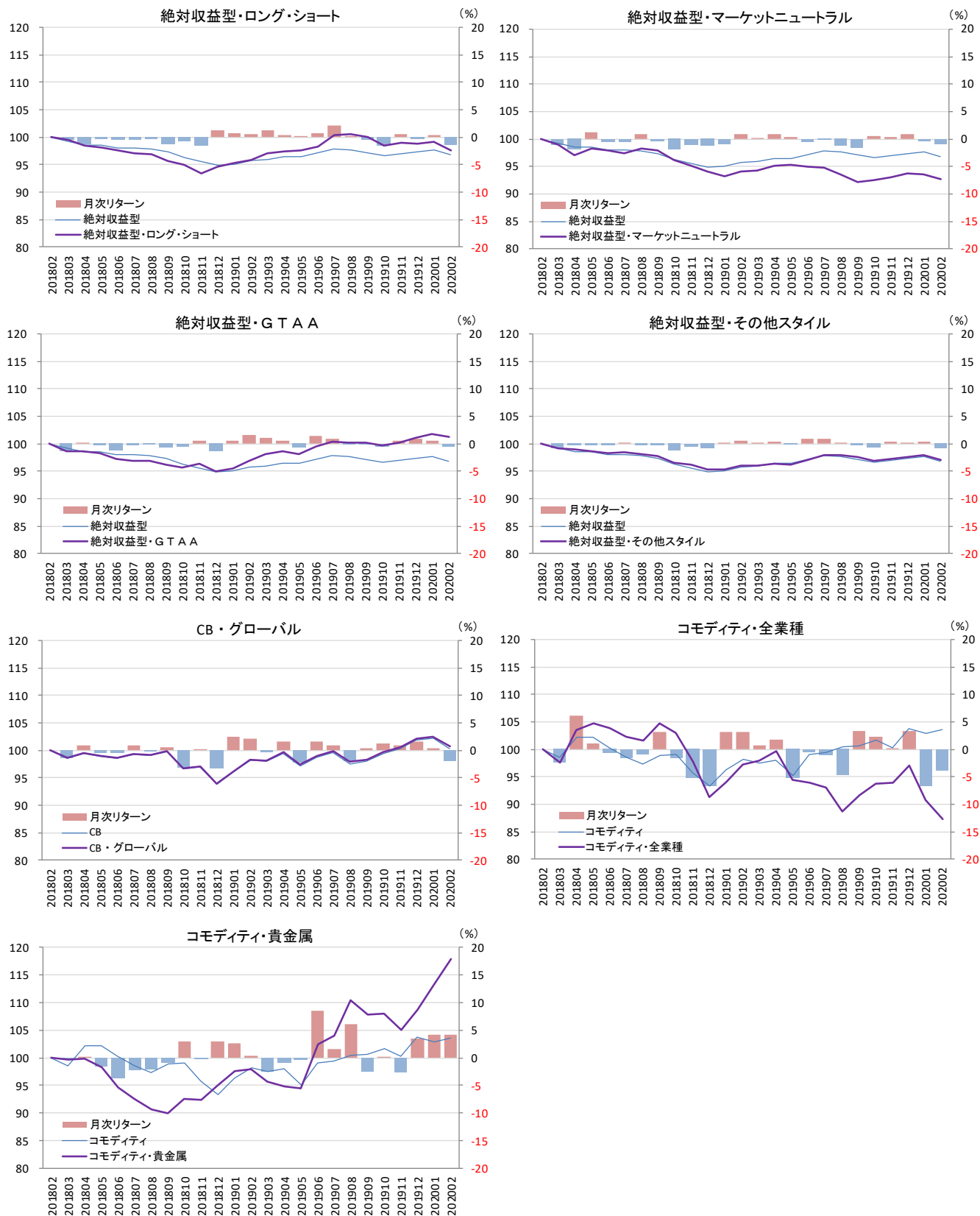


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	-4.52		
1	外国債券(先進国)・グローバル	0.61	9.40	0.05
2	国内債券・一般	0.57	5.23	0.03
3	コモディティ	0.70	0.31	0.00
4	CB	-1.87	0.21	-0.00
5	エマージング株式・BRICS	-5.32	0.10	-0.01
6	ハイイールド債券・グローバル	-1.02	0.52	-0.01
7	ハイイールド債券・その他	-1.75	0.61	-0.01
8	絶対収益型	-0.89	1.17	-0.01
9	エマージング債券・グローバル	-0.79	1.36	-0.01
10	国内株式・業種特化	-12.53	0.11	-0.01
11	エマージング債券・その他	-1.09	1.47	-0.02
12	REIT・その他	-2.62	0.79	-0.02
13	ブルベア	-9.47	0.27	-0.03
14	外国債券(先進国)・その他	-0.79	3.43	-0.03
15	ハイイールド債券・北米	-1.33	2.19	-0.03
16	エマージング株式・グローバル	-3.47	1.21	-0.04
17	複合資産・国内バランス	-2.45	1.71	-0.04
18	複合資産・その他	-4.77	1.14	-0.06
19	複合資産・安定	-1.37	4.52	-0.06
20	エマージング株式・その他	-2.62	3.23	-0.08
21	複合資産・成長	-5.44	2.06	-0.11
22	REIT・グローバル	-5.65	3.06	-0.17
23	国内株式・小型	-14.68	1.31	-0.19
24	複合資産・安定成長	-2.87	7.30	-0.21
25	REIT・北米	-6.13	3.94	-0.24
26	REIT・日本	-8.12	4.70	-0.39
27	外国株式(先進国)・その他	-7.27	5.95	-0.43
28	国内株式・その他	-9.52	4.54	-0.44
29	国内株式・一般	-9.83	8.75	-0.86
30	外国株式(先進国)・グローバル	-5.74	19.41	-1.10
	合計		100.00	-4.52

◆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	3.17		
1	外国株式(先進国)・グローバル	6.14	18.50	1.09
2	REIT・日本	12.19	4.59	0.50
3	外国債券(先進国)・グローバル	4.83	9.85	0.44
4	REIT・北米	6.25	3.89	0.23
5	複合資産・安定成長	3.47	6.84	0.23
6	複合資産・安定	3.64	4.46	0.15
7	外国株式(先進国)・その他	3.38	5.31	0.15
8	エマージング株式・その他	3.41	3.64	0.13
9	REIT・グローバル	3.46	2.98	0.10
10	国内債券・一般	1.95	5.32	0.10
11	エマージング株式・グローバル	4.90	1.34	0.06
12	REIT・その他	6.26	0.81	0.05
13	エマージング債券・グローバル	2.97	1.42	0.04
14	複合資産・成長	1.52	1.99	0.04
15	ハイイールド債券・北米	1.56	2.40	0.04
16	エマージング債券・その他	1.87	1.66	0.03
17	ブルベア	7.20	0.31	0.03
18	複合資産・国内バランス	1.83	1.46	0.02
19	複合資産・その他	17.36	0.45	0.02
20	国内株式・その他	-1.72	4.83	0.02
21	コモディティ	5.60	0.30	0.02
22	絶対収益型	1.09	1.15	0.01
23	ハイイールド債券・その他	1.08	0.69	0.01
24	エマージング株式・BRICS	4.51	0.11	0.01
25	ハイイールド債券・グローバル	1.14	0.56	0.01
26	CB	2.08	0.25	0.00
27	国内株式・業種特化	-3.91	0.11	-0.00
28	外国債券(先進国)・その他	-0.27	3.66	-0.01
29	国内株式・小型	-10.26	1.57	-0.11
30	国内株式・一般	-3.88	9.56	-0.23
	合計		100.00	3.17

◆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	8.24	5.98	77.20	8.41	9.66	11.40	0.32	0.12	0.51
国内株式	5.36	9.17	105.39	15.33 ↑	16.59	17.53	0.12	0.11	0.42
一般	3.58	6.25	93.20	15.45 ↑	16.89	17.85	0.08	0.07	0.38
フリー	4.47	6.31	93.13	15.70 ↑	17.20	18.47	0.10	0.07	0.37
バリュー	0.28	6.06	95.57	14.70 ↑	16.02	16.59	0.01	0.08	0.42
小型	9.03	28.19	184.98	18.37 ↑	17.28 ↑	17.83	0.16	0.30	0.62
その他	9.24	13.33	121.25	14.61 ↑	16.14	17.26	0.21	0.16	0.48
日経225	15.10	19.94	136.52	14.91	16.28	17.43	0.33	0.23	0.51
TOPIX	4.24	8.65	101.60	14.39 ↑	15.97	16.99	0.10	0.11	0.43
JPX日経400	3.56	5.89	-	14.10 ↑	15.53	-	0.09	0.08	-
国内債券	3.37	6.41	16.79	1.50	1.71	1.57	0.78	0.74	0.98
一般	3.37	6.41	16.79	1.50	1.71	1.57	0.78	0.74	0.98
外国株式(先進国)	18.42	12.87	112.51	13.91	15.12	16.18	0.42	0.16	0.48
グローバル	21.06	15.94	123.60	14.06	14.92	16.07	0.47	0.20	0.52
除く日本	19.02	18.57	158.29	14.33	16.05	17.81	0.42	0.22	0.56
含む日本	21.74	15.18	115.63	14.06	14.68	15.74	0.49	0.20	0.51
その他	11.74	5.85	94.89	13.68	15.67	17.58	0.28	0.07	0.39
北米	5.37	1.06	47.74	16.53	17.49	20.98	0.11	0.01	0.19
米国	19.91	12.83	114.43	14.43	16.81	17.82	0.44	0.15	0.44
カナダ	1.98	-9.56	9.77	12.35	13.32	16.25	0.06	-0.15	0.06
欧州	16.67	8.68	103.29	13.86	14.84	18.47	0.38	0.11	0.40
ドイツ	0.91	-8.51	-	16.84	19.41	-	0.02	-0.09	-
イギリス	-4.44	-21.55	-	14.10	15.26	-	-0.10	-0.31	-
アジア・オセアニア	12.09	11.43	124.33	12.69 ↑	15.29	17.91	0.31	0.14	0.47
オーストラリア	-6.89	-4.25	58.23	13.21	15.40	19.62	-0.17	-0.05	0.24
ニュージーランド	29.39	45.19	-	14.20	16.62	-	0.64	0.47	-
複合地域	-28.08	-39.78	-	19.96 ↑	19.60	-	-0.52	-0.49	-
エマージング株式	12.28	3.34	52.17	13.04	15.31	17.90	0.31	0.04	0.24
グローバル	16.05	4.07	49.43	14.80	16.58	18.29	0.35	0.05	0.22
BRICS	24.78	23.03	67.19	15.87	18.63	20.76	0.49	0.23	0.25
その他	10.53	2.48	56.44	12.92	15.17	17.83	0.27	0.03	0.26
欧州	13.88	24.94	29.27	16.90	19.36	23.98	0.27	0.24	0.11
ロシア	27.43	62.36	52.28	17.95	21.42 ↓	26.36	0.47	0.48	0.16
アジア・オセアニア	7.55	-2.37	71.16	14.58	16.06	17.18	0.17	-0.03	0.32
中国	47.49	39.77	125.59	18.05	22.23	21.68	0.77	0.31	0.39
インド	14.23	6.83	76.93	16.80	18.52	23.84	0.27	0.07	0.25
インドネシア	-8.86	-20.79	54.09	18.51	20.50	22.24	-0.16	-0.22	0.20
タイ	-6.93	-12.25	133.75	14.92 ↑	14.44	17.19	-0.16	-0.18	0.51
フィリピン	-11.16	-32.29	-	14.22	14.97	-	-0.27	-0.50	-
ベトナム	6.19	9.89	-	18.18	16.89	-	0.11	0.11	-
韓国	-13.27	-26.61	17.98	17.02	16.69	19.67	-0.27	-0.36	0.08
香港	16.51	14.05	61.36	16.93	19.75	18.87	0.31	0.14	0.26
台湾	8.16	8.81	125.45	19.13	18.52	18.90	0.14	0.09	0.45
中南米	4.05	-2.71	-1.64	22.77	23.74	23.66	0.06	-0.02	-0.01
ブラジル	-2.06	-1.55	-28.24	28.54	32.15	29.46	-0.02	-0.01	-0.11
メキシコ	-8.95	-28.83	-	22.02	20.67	-	-0.14	-0.32	-
中東・アフリカ	-0.40	-21.02	55.44	12.91	15.24	16.81	-0.01	-0.30	0.27
トルコ	-24.30	-48.75	-22.33	33.81	29.32	31.03	-0.26	-0.43	-0.08
複合地域	2.47	-9.68	60.21	14.04	15.10	16.05	0.06	-0.13	0.30

※[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	8.24	5.98	77.20	8.41	9.66	11.40	0.32	0.12	0.51
外国債券(先進国)	4.18	-2.75	38.64	3.19 ↓	4.86 ↓	8.01	0.45	-0.11	0.41
グローバル	6.49	-0.82	38.89	2.68	4.36	7.27	0.81	-0.03	0.46
除く日本	7.40	-1.90	42.90	3.27	4.87	8.01	0.75	-0.07	0.45
含む日本	5.41	0.64	34.04	2.17	3.93	6.49	0.84	0.04	0.45
その他	-1.47	-7.41	37.32	5.29	6.65	9.80	-0.08	-0.23	0.33
北米	5.17	1.82	-	2.05	3.45	-	0.85	0.11	-
米国	5.68	2.23	50.94	3.50	5.04 ↓	6.19	0.55	0.09	0.67
カナダ	-0.43	-12.41	12.70	6.61 ↓	7.91 ↓	9.44	-0.01	-0.33	0.12
欧州	9.33	-3.29	34.50	4.15 ↓	5.92 ↓	9.91	0.74	-0.11	0.30
イギリス	3.34	-14.18	-	7.36	10.18	-	0.16	-0.29	-
アジア・オセアニア	-6.22	-11.61	37.67	7.16	8.24	11.04	-0.29	-0.29	0.29
オーストラリア	-6.46	-10.92	34.97	7.15	8.29	11.31	-0.30	-0.27	0.27
ニュージーランド	-1.44	-5.73	-	8.52	9.24 ↓	-	-0.05	-0.12	-
複合地域	6.46	-1.01	35.58	4.49	6.56 ↓	9.75	0.48	-0.03	0.31
エマージング債券	1.57	3.92	46.00	8.52	10.59	12.71	0.07	0.08	0.30
グローバル	1.92	3.64	49.71	8.92	10.48	12.62	0.08	0.07	0.32
米ドル建て	2.12	5.52	54.36	8.85	10.60	12.76	0.09	0.10	0.35
現地通貨建て	1.60	-6.64	24.97	9.77	10.47	12.04	0.06	-0.13	0.19
その他	1.21	3.55	37.70	8.62	11.35	13.50	0.05	0.06	0.24
ロシア	12.16	55.69	34.61	13.90	18.80 ↓	21.61	0.28	0.49	0.14
アジア・オセアニア	8.65	5.97	61.72	3.87	6.07	8.68	0.74	0.20	0.56
インド	8.40	8.35	-	7.79	9.45	-	0.36	0.17	-
インドネシア	9.28	4.90	-	11.11	13.29	-	0.28	0.07	-
ブラジル	-10.67	3.44	31.05	17.62	19.47	17.91	-0.21	0.04	0.15
メキシコ	23.67	-12.24	-	14.55	14.74	-	0.51	-0.17	-
南アフリカ	1.31	-9.01	-	20.70	19.55	-	0.02	-0.09	-
トルコ	-28.55	-51.09	-	36.19	29.74	-	-0.29	-0.45	-
複合地域	14.45	-8.94	26.63	9.00	11.08	13.21	0.52	-0.17	0.18
ハイイールド債券	2.28	5.70	80.40	7.16	9.50	11.87	0.11	0.12	0.51
グローバル	2.95	7.11	68.23	7.37	9.66	12.05	0.14	0.15	0.44
北米	2.93	6.73	89.81	7.24	9.59	11.47	0.14	0.14	0.57
その他	0.03	1.52	77.21	7.95	9.97	15.04	0.01	0.03	0.39
欧州	-0.56	-0.13	93.51	8.79	10.75	16.39	-0.02	-0.00	0.41
アジア・オセアニア	2.73	9.92	-	6.26	8.27	-	0.15	0.23	-
複合地域	9.13	4.30	81.65	5.86 ↓	7.99 ↓	11.58	0.51	0.11	0.53
複合資産	7.92	5.78	69.99	5.31	6.78	9.22	0.49	0.17	0.59
安定	6.24	3.06	55.64	3.68	4.92	7.66	0.57	0.13	0.59
安定成長	8.61	6.53	73.36	5.76	7.19	9.61	0.49	0.18	0.59
成長	9.36	9.30	93.15	9.38	10.70	11.94	0.33	0.17	0.57
国内バランス	5.65	8.34	38.93	2.82 ↑	3.38	6.75	0.67	0.49	0.49
安定	5.08	8.43	31.98	2.51 ↑	2.34	3.13	0.68	0.71	0.89
一般	7.58	10.20	48.94	7.76	8.52	9.80	0.32	0.23	0.41

※[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	8.24	5.98	77.20	8.41	9.66	11.40	0.32	0.12	0.51
国内REIT	21.47	21.47	210.07	9.52 ↑	9.46 ↑	16.12	0.71	0.42	0.74
日本	21.47	21.47	210.07	9.52 ↑	9.46 ↑	16.12	0.71	0.42	0.74
外国REIT	10.46	10.99	167.10	11.50	13.11	15.40	0.30	0.16	0.67
グローバル	8.52	4.89	144.22	11.40	12.97	15.17	0.25	0.08	0.61
除く日本	15.84	13.94	165.46	11.40	13.10	15.20	0.45	0.20	0.67
含む日本	7.46	3.73	141.93	11.41	12.96	15.18	0.22	0.06	0.61
北米	10.52	14.63	192.53	12.56	13.99	16.39	0.27	0.20	0.69
その他	23.63	20.38	189.43	9.43	11.43	14.40	0.78	0.33	0.78
欧州	15.50	-4.02	26.93	12.85	15.17	20.01	0.39	-0.05	0.12
アジア・オセアニア	32.39	30.34	209.59	9.85	11.75	14.34	1.00	0.47	0.83
オーストラリア	7.87	10.64	135.69	10.97 ↓	13.32	16.52	0.24	0.16	0.54
複合地域	-2.75	-15.94	86.61	14.15	15.44	18.02	-0.06	-0.22	0.36
複数国	16.53	23.77	240.15	11.01	11.82	14.78	0.48	0.37	0.88
その他									
絶対収益型	0.34	-4.28	-4.96	2.10	2.01	3.48	0.08	-0.42	-0.15
ロング・ショート	-1.02	-5.66	-2.35	3.37	3.05	3.62	-0.09	-0.37	-0.07
マーケットニュートラル	1.95	15.55	35.47	3.68 ↓	5.21	5.22	0.19	0.57	0.59
GTAA	4.05	4.53	14.93	2.60	2.27	2.67	0.53	0.40	0.52
その他スタイル	-1.26	-5.72	-8.64	1.99	2.13	5.16	-0.19	-0.54	-0.18
CB	3.68	1.36	33.94	4.83	6.47	9.58	0.26	0.05	0.31
アジア・オセアニア	12.84	17.68	65.55	8.46	10.72	11.17	0.49	0.31	0.46
日本	-3.95	4.90	41.09	5.27 ↑	5.68	6.24	-0.24	0.17	0.56
グローバル	3.95	1.46	37.05	4.82	6.42	10.03	0.28	0.05	0.32
コモディティ	2.49	-18.63	-15.24	7.32	10.89 ↓	14.18	0.12	-0.37	-0.12
全業種	-13.95	-32.43	-31.01	11.23	13.07 ↓	15.03	-0.43	-0.58	-0.24
貴金属	19.98	11.72	47.69	9.02	9.76	16.66	0.70	0.23	0.24
エネルギー	-8.82	-35.14	-45.79	25.02	26.27	25.11	-0.12	-0.31	-0.24
その他コモディティ	-19.08	-25.00	1.74	13.45 ↑	14.13	17.76	-0.50	-0.39	0.01

※[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

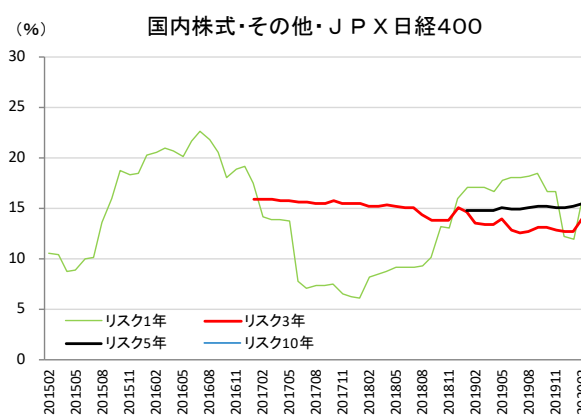
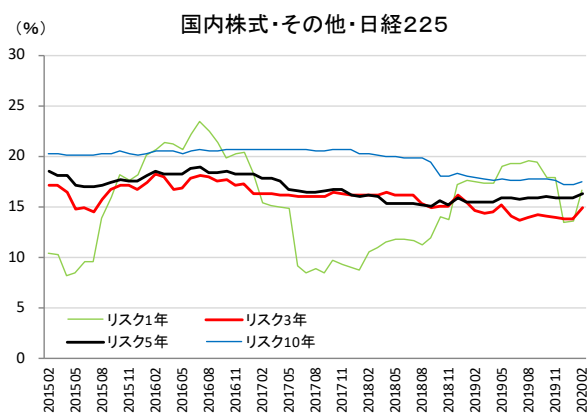
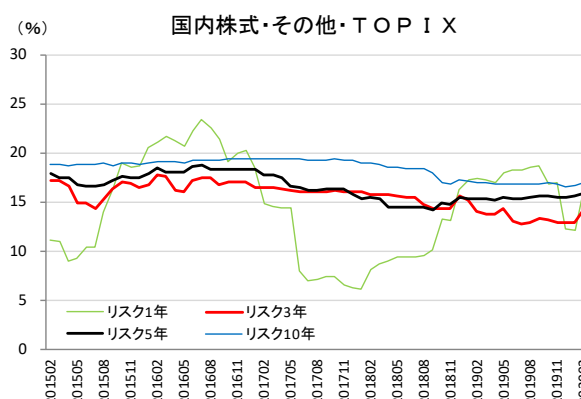
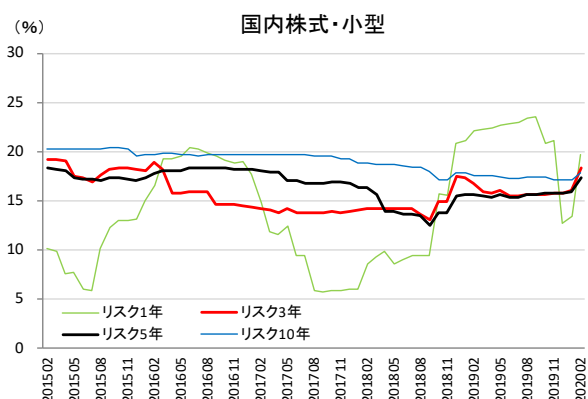
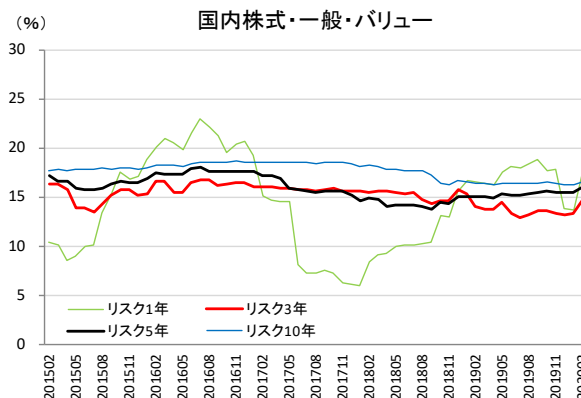
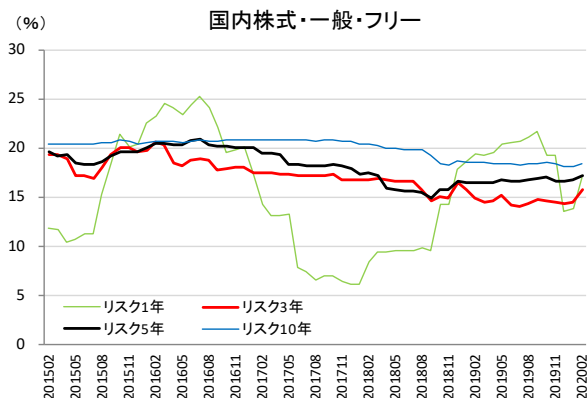
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

＜2＞リスク・サマリー

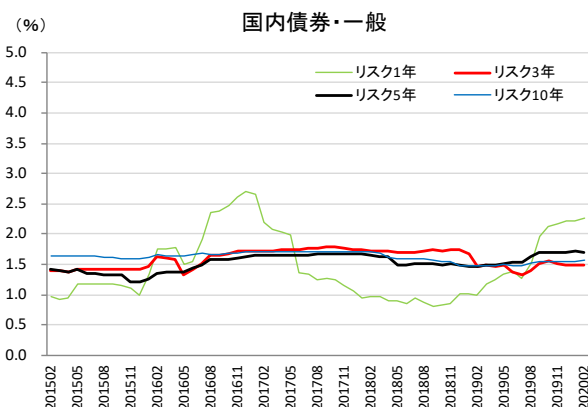
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

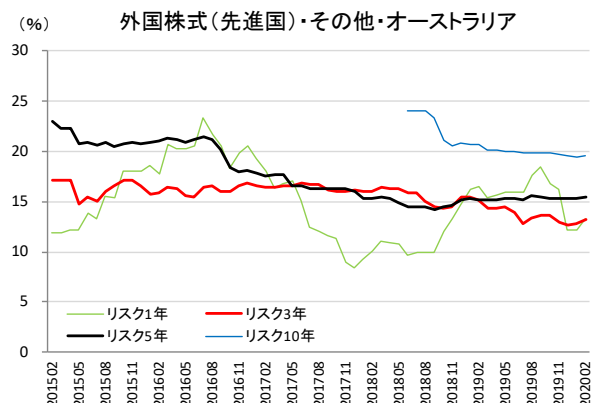
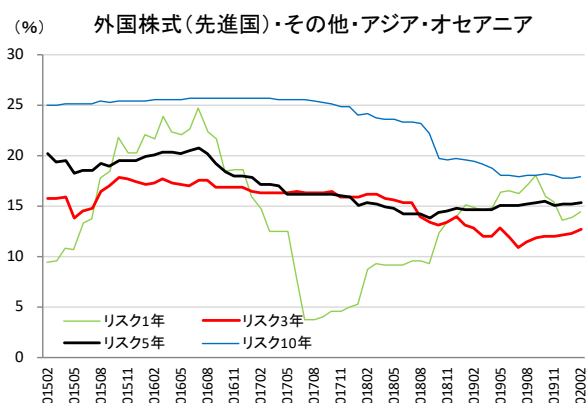
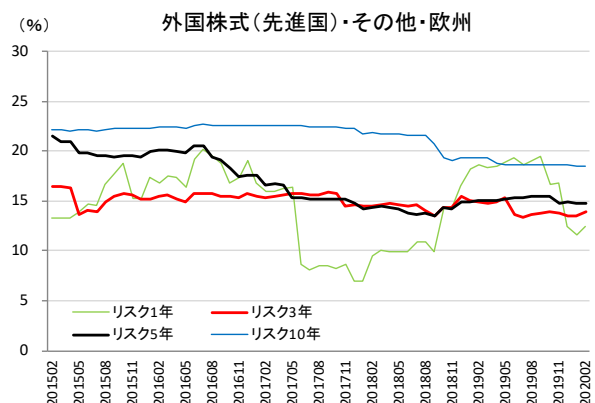
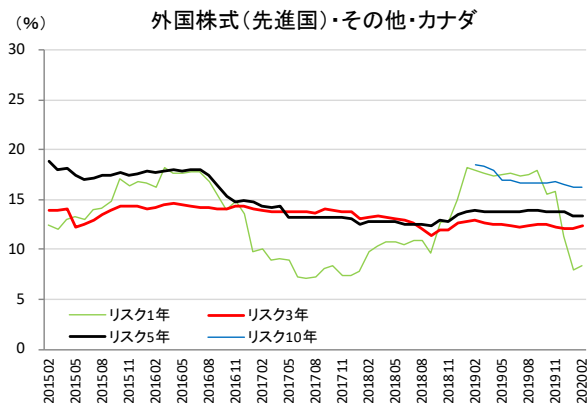
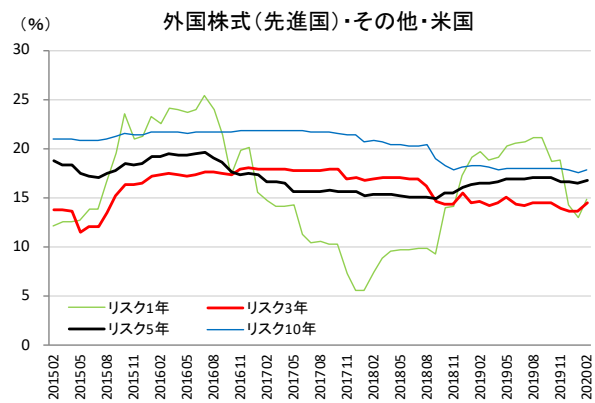
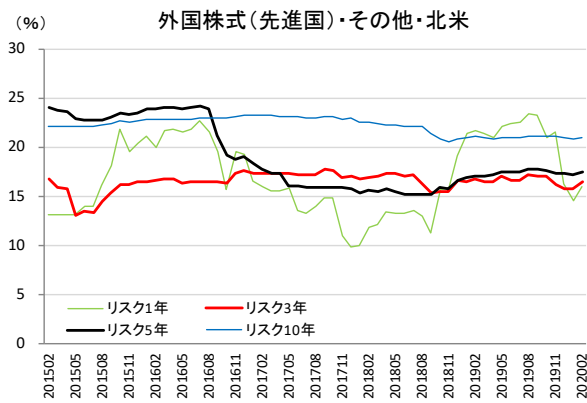
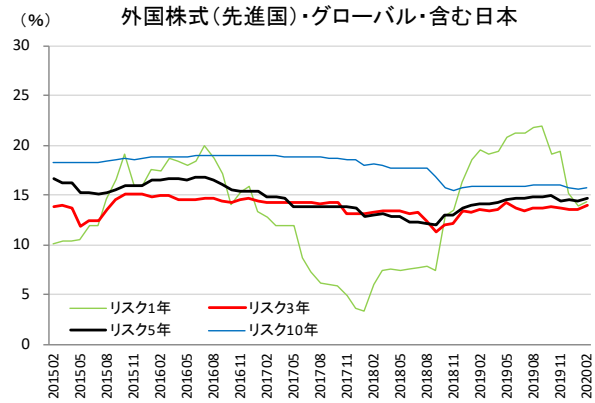
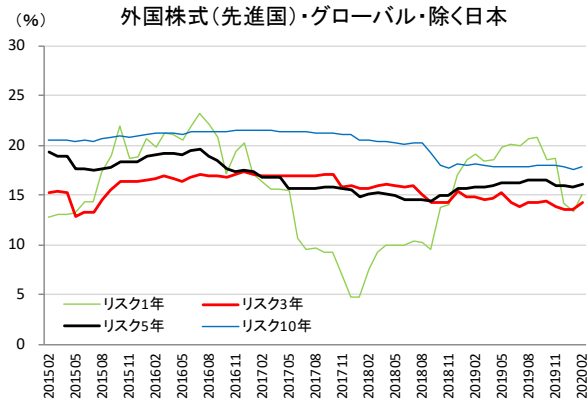


<2> リスク・サマリー

(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)]

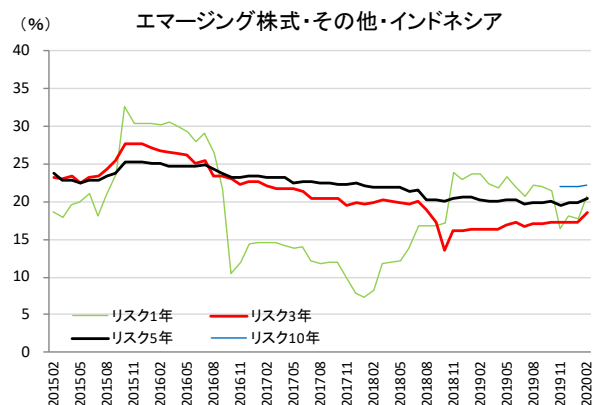
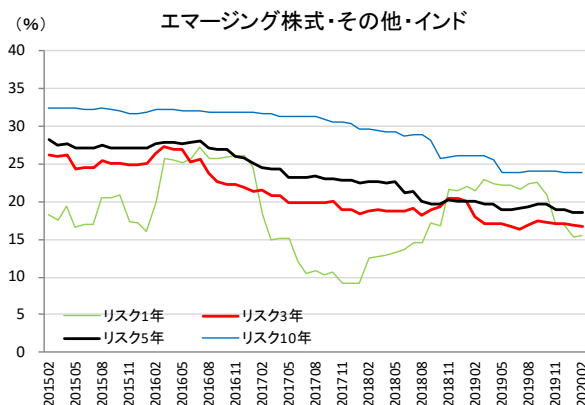
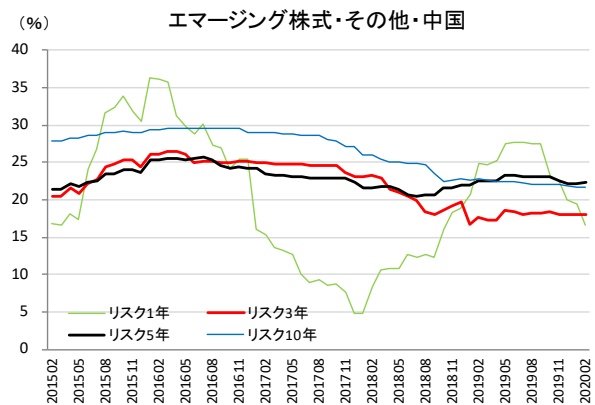
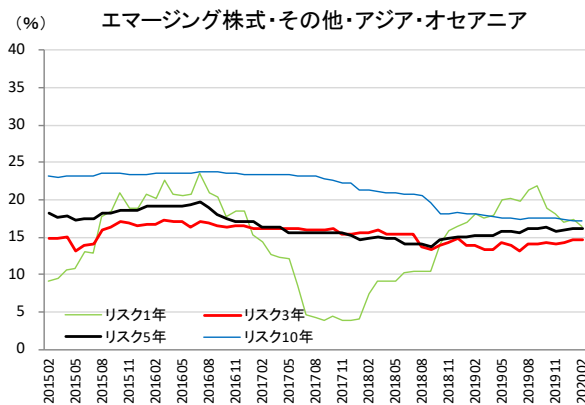
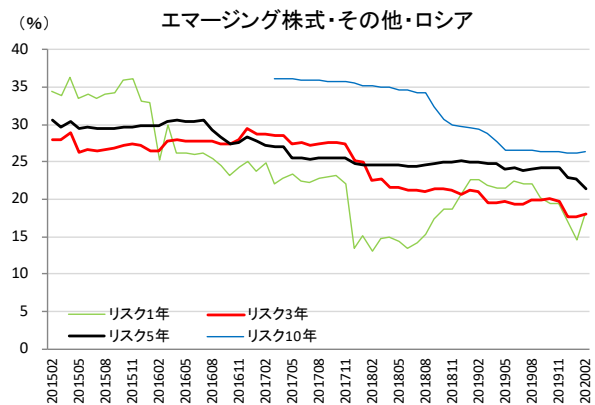
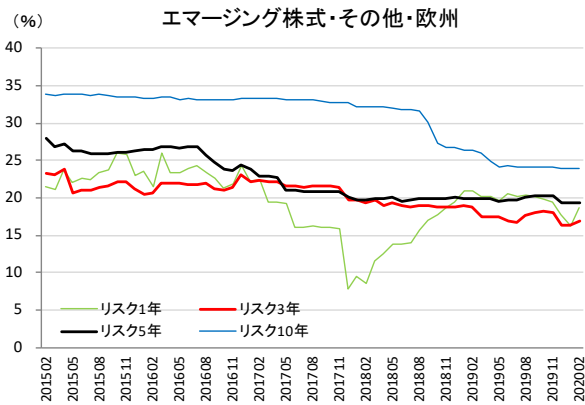
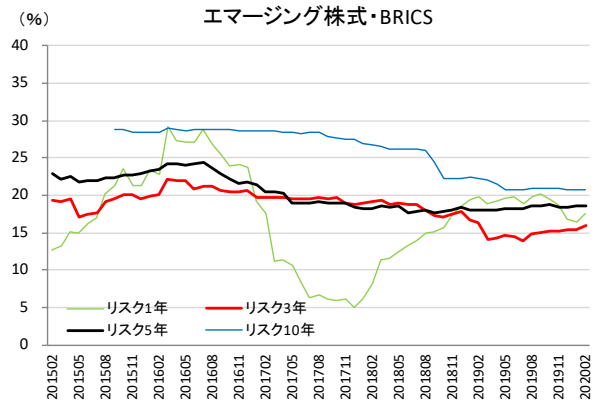
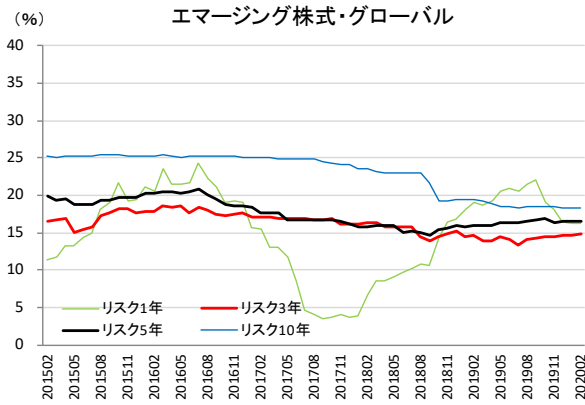


<2> リスク・サマリー

(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]

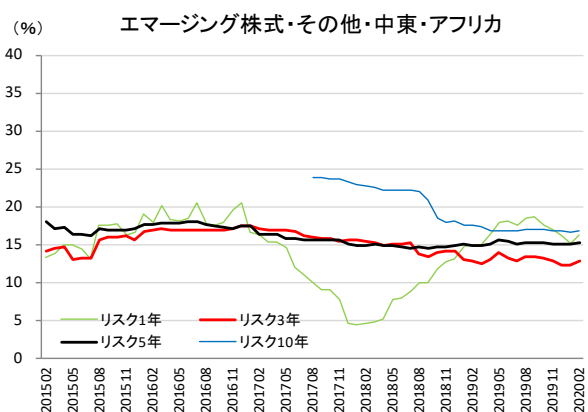
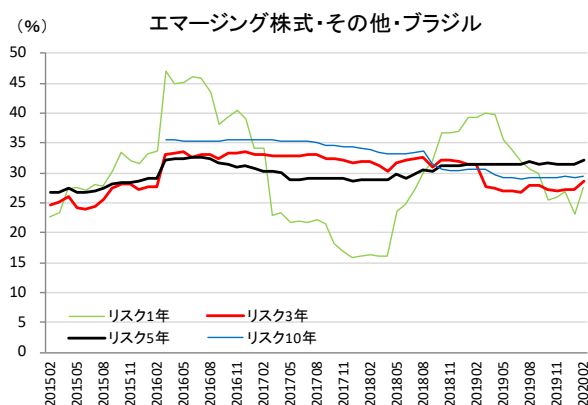
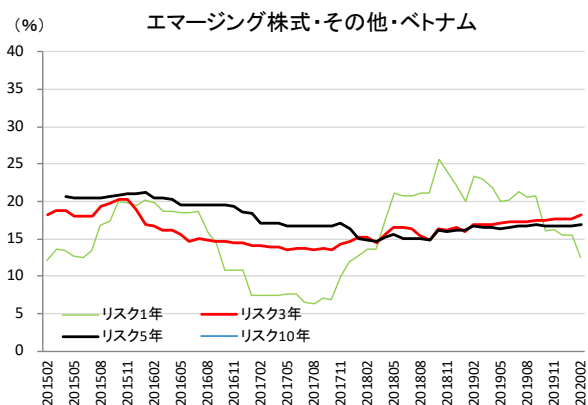
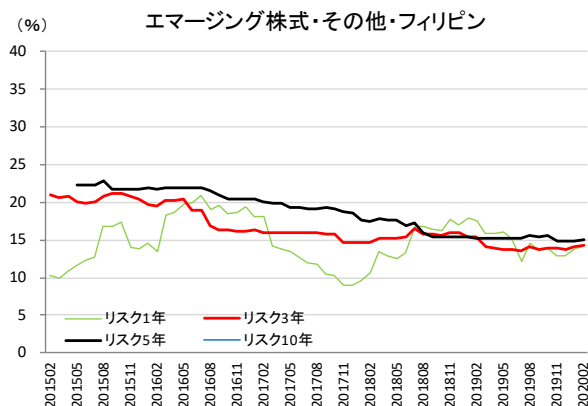
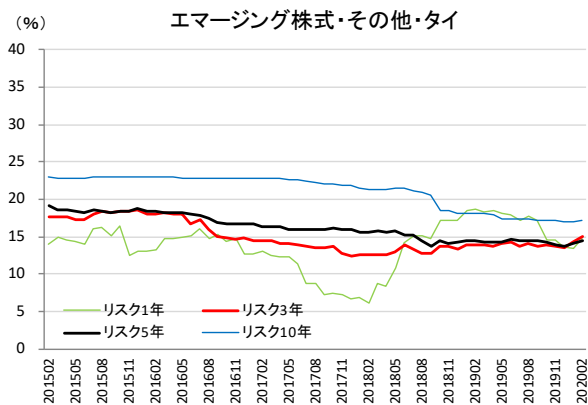


<2> リスク・サマリー

(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]

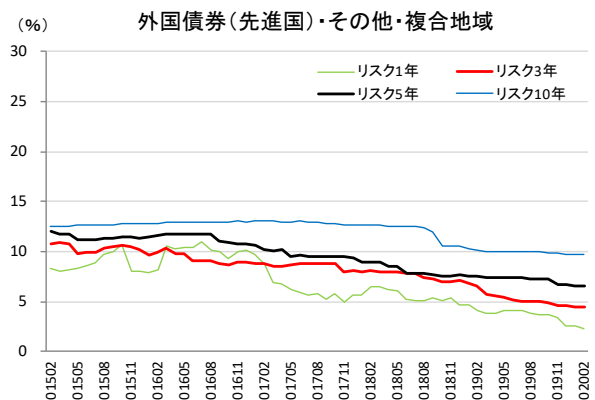
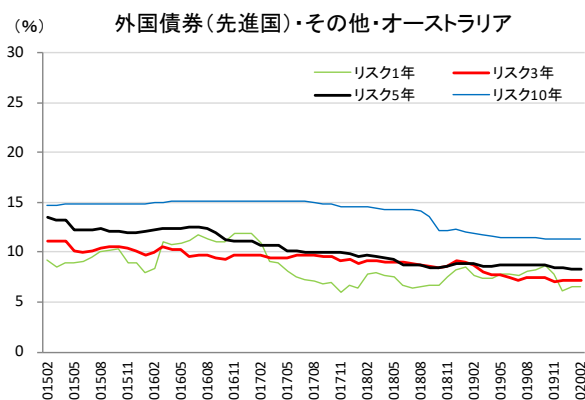
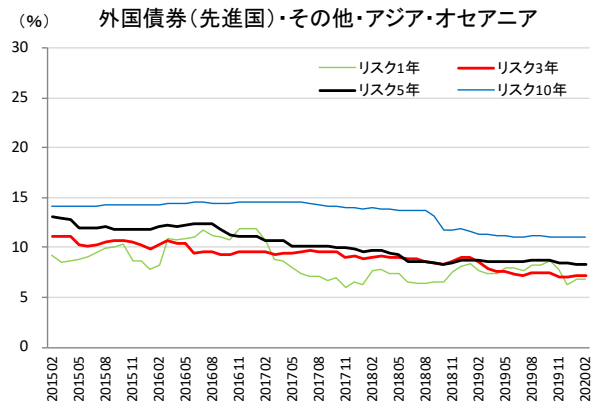
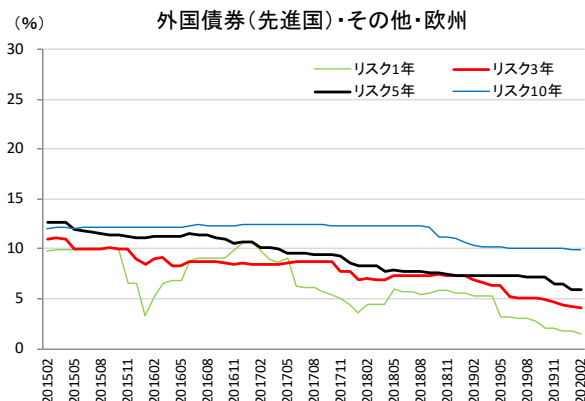
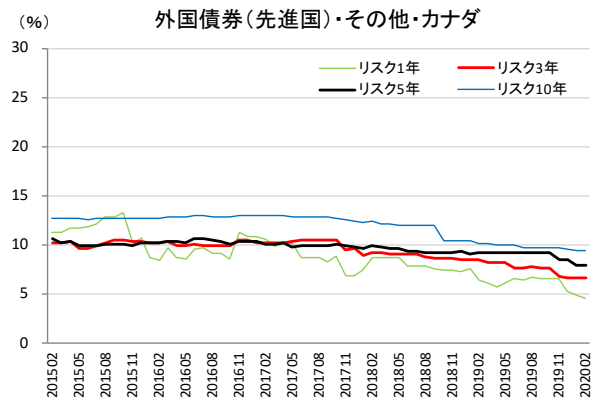
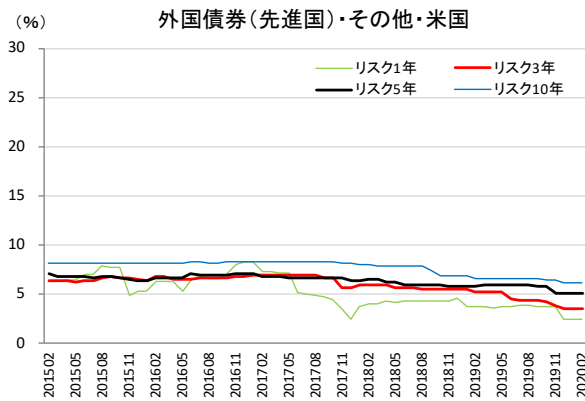
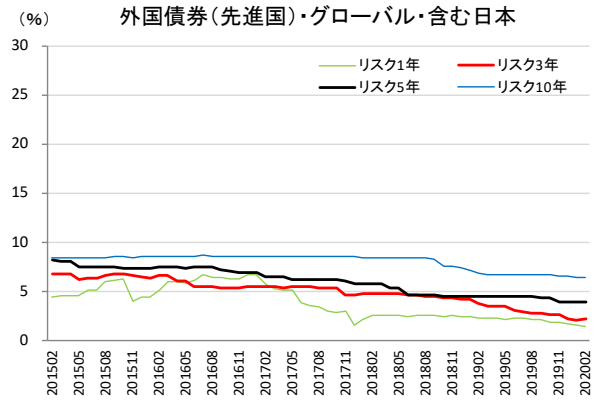
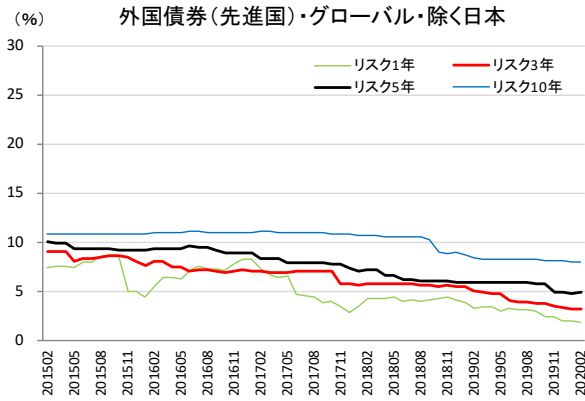


<2> リスク・サマリー

(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)]

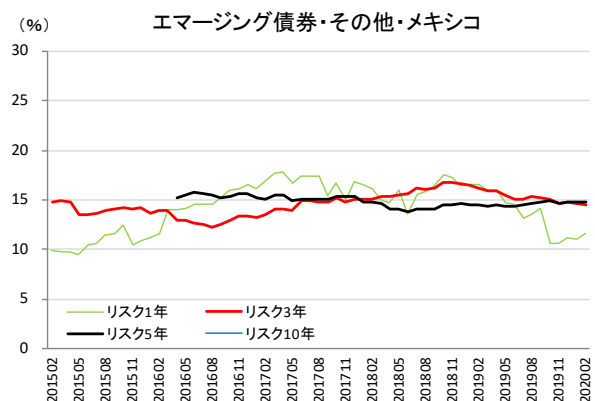
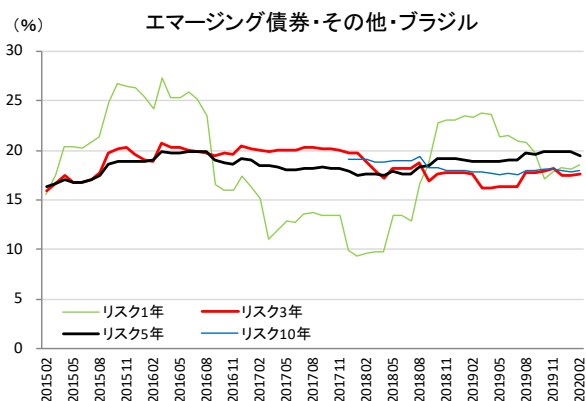
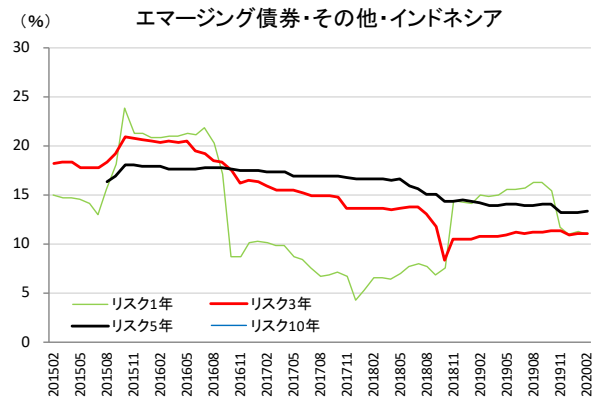
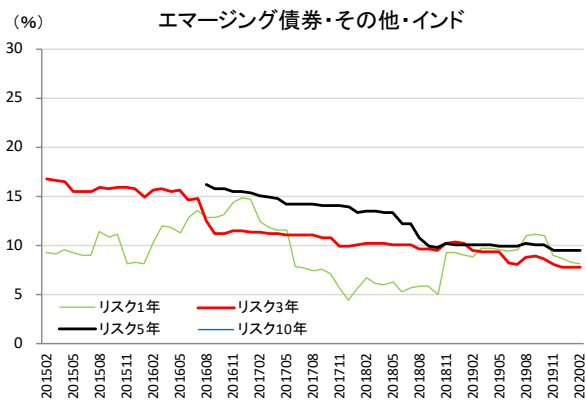
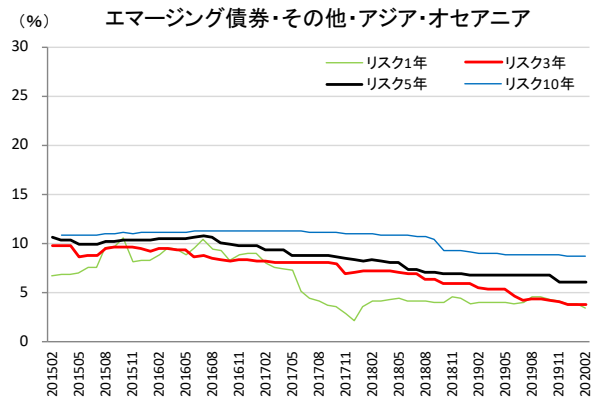
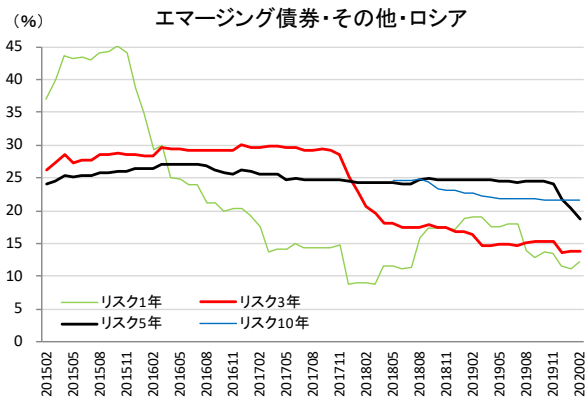
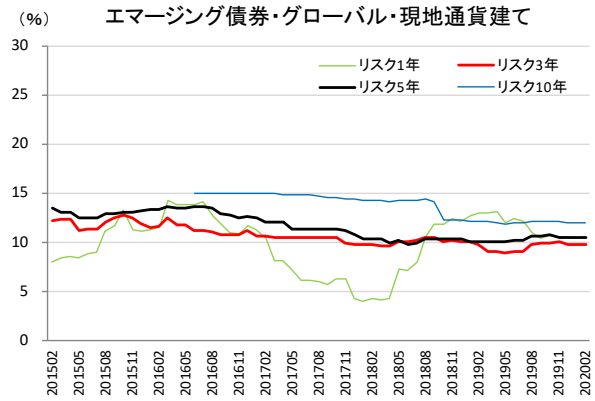
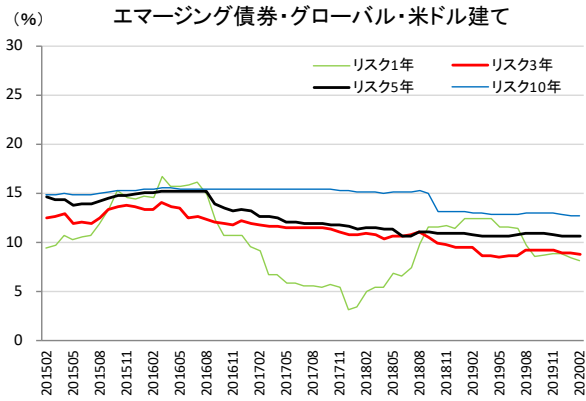


<2> リスク・サマリー

(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]

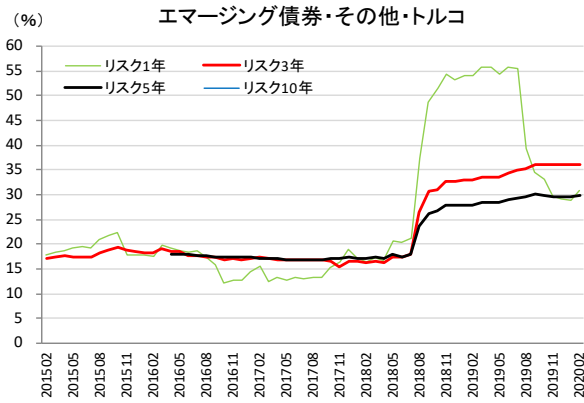


<2> リスク・サマリー

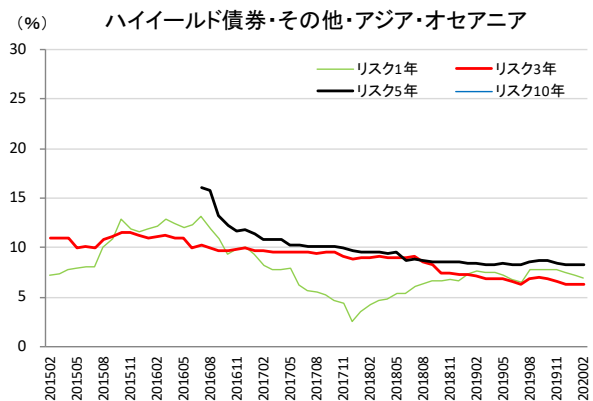
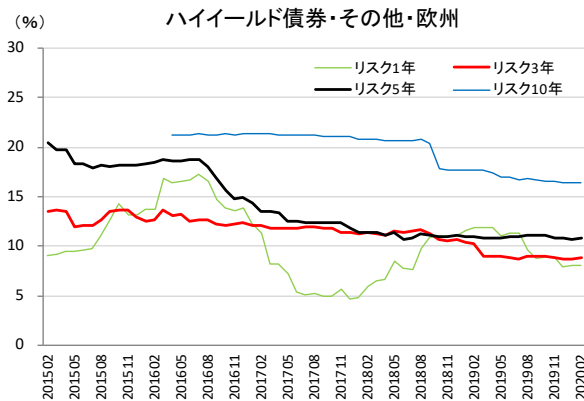
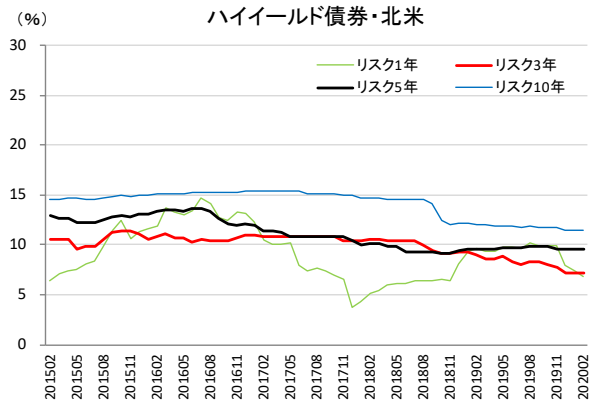
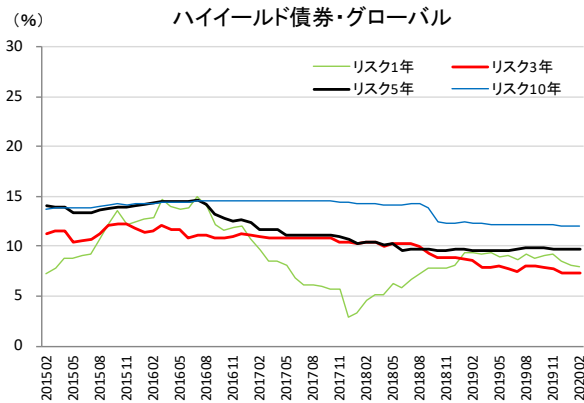
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

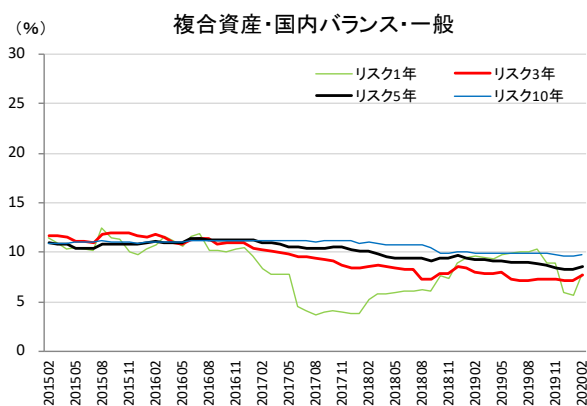
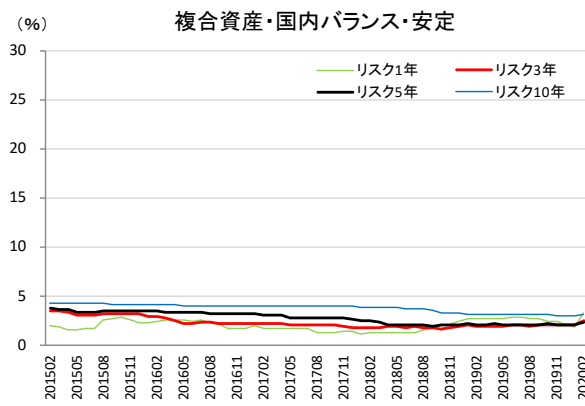
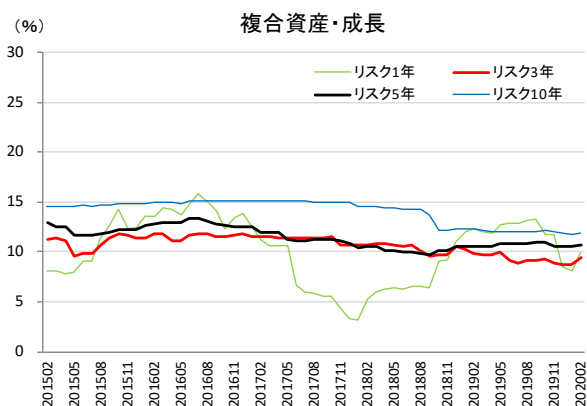
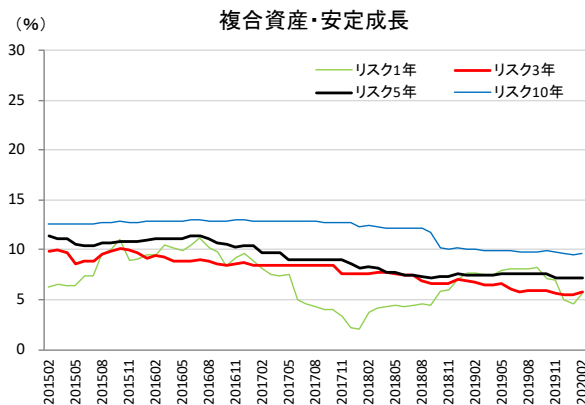
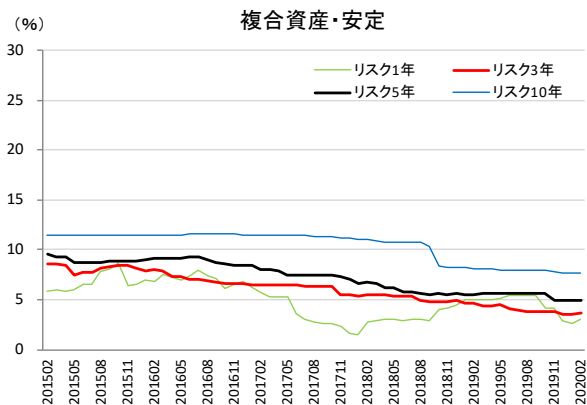


<2>リスク・サマリー

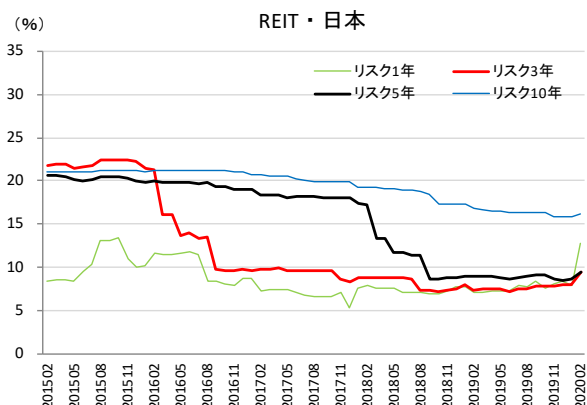
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

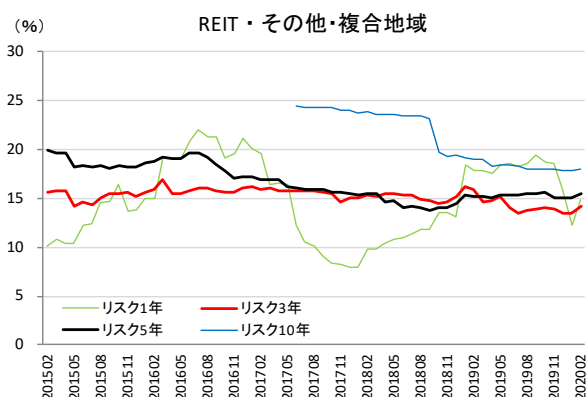
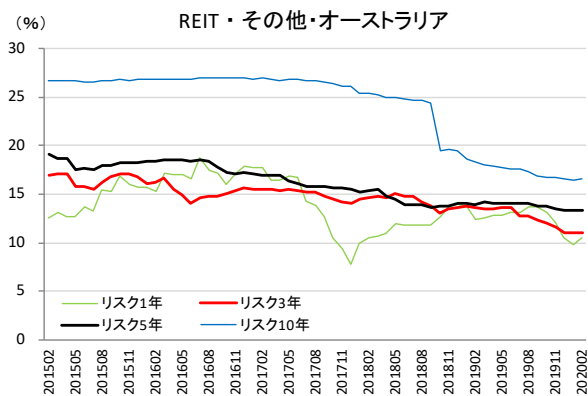
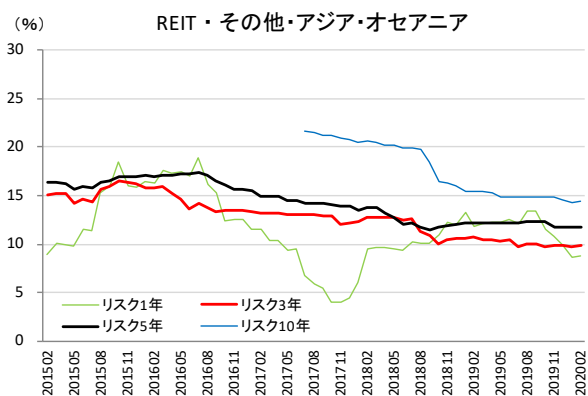
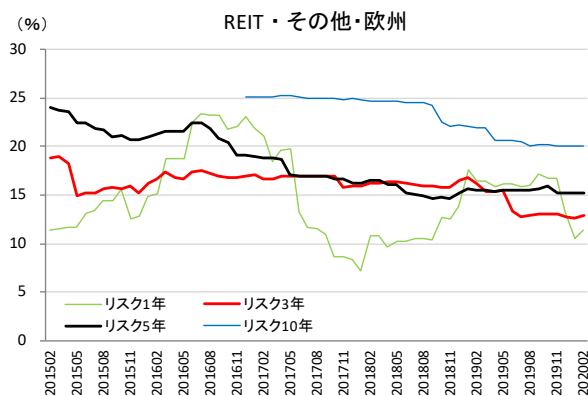
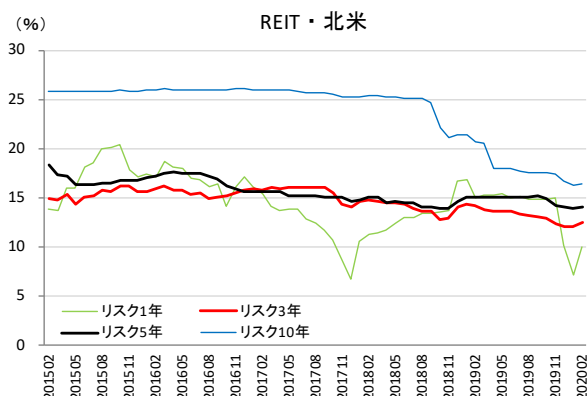
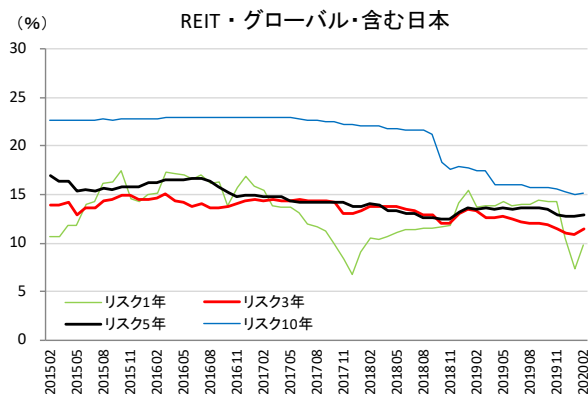
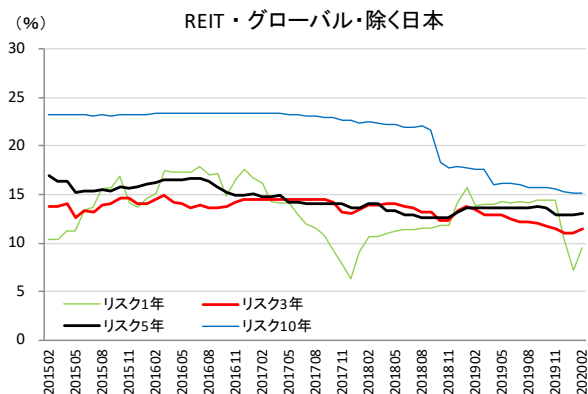


<2> リスク・サマリー

(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]

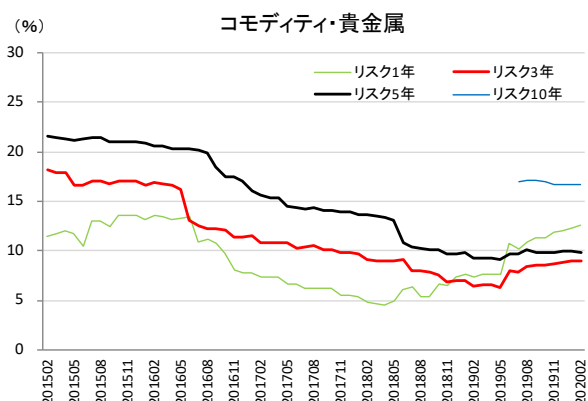
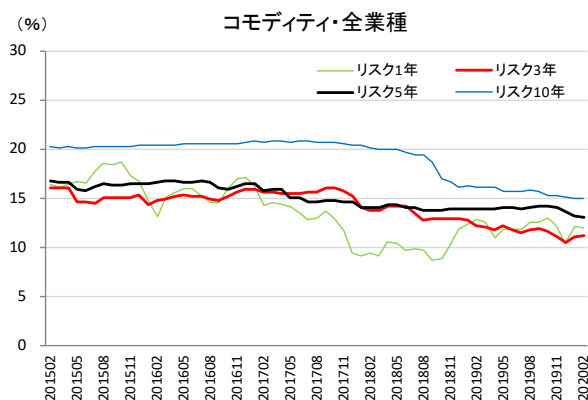
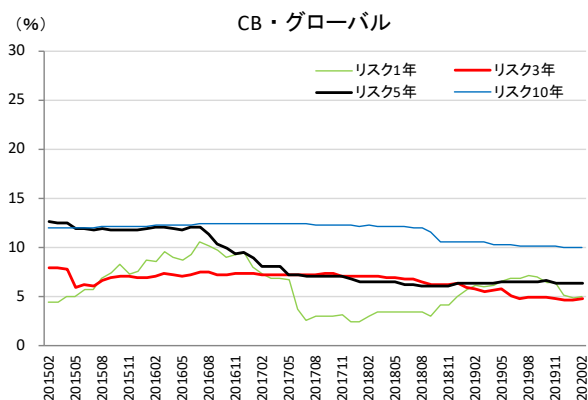
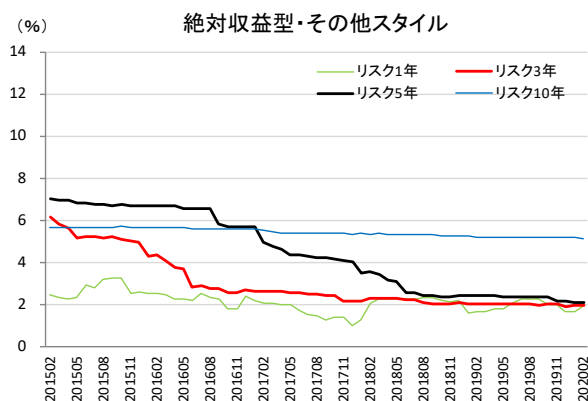
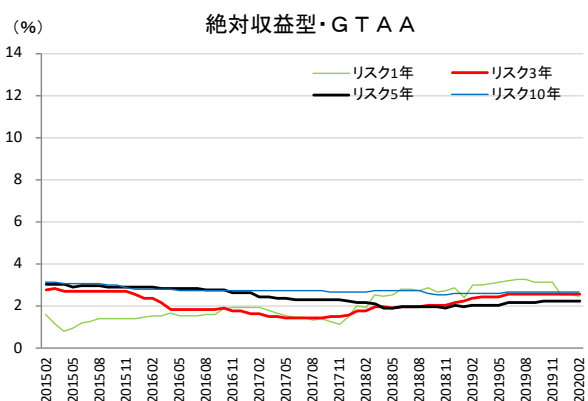
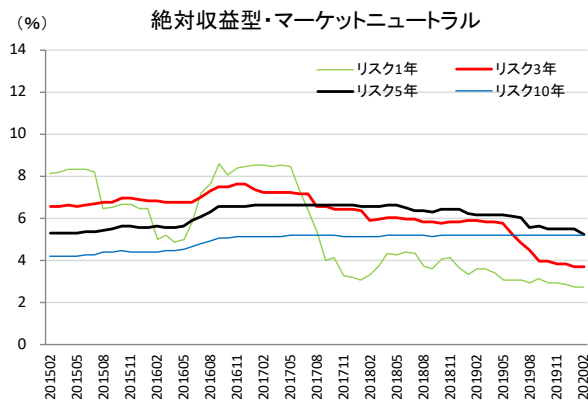
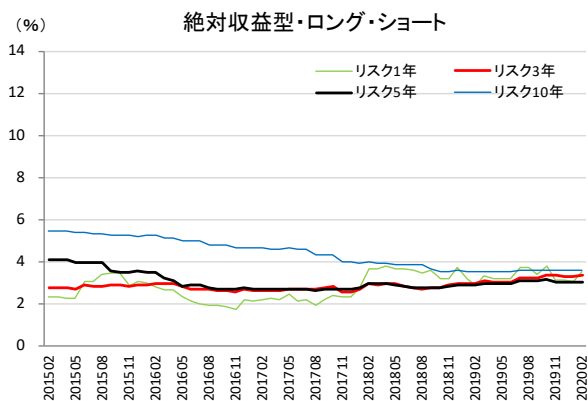


<2> リスク・サマリー

(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	2,497	3,993	-264	1,971
国内株式	-138	-4,133	-12,098	-14,992
一般	-512	-3,225	-6,573	-9,230
フリー	-400	-2,859	-5,952	-8,342
バリュー	-112	-365	-621	-888
小型	-110	-887	-1,741	-2,603
その他	487	13	-3,724	-3,062
日経225	457	34	-3,263	-3,144
TOPIX	-2	43	-121	427
JPX日経400	6	-49	-180	-185
国内債券	48	459	854	1,203
一般	48	459	854	1,203
外国株式(先進国)	2,618	4,512	4,470	7,354
グローバル	1,347	307	-681	2,377
除く日本	273	1,573	2,204	3,128
含む日本	1,074	-1,266	-2,885	-751
その他	1,271	4,205	5,150	4,977
北米	-13	-33	-13	27
米国	1,278	4,291	5,247	5,233
カナダ	-6	-26	-59	-111
欧州	-23	-105	-208	-409
ドイツ	0	-1	-2	-3
イギリス	-1	-1	-4	-7
アジア・オセアニア	-1	-6	-15	-36
オーストラリア	37	87	206	285
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	-747	-2,349	-4,001	-6,923
グローバル	-80	-477	-961	-2,391
BRICS	-7	-35	-60	-95
その他	-660	-1,838	-2,980	-4,437
欧州	-2	-16	-23	-48
ロシア	0	-3	-10	-26
アジア・オセアニア	-57	-318	-618	-1,168
中国	-135	-318	-670	-955
インド	-470	-1,203	-1,729	-2,443
インドネシア	-5	-14	-18	-37
タイ	0	-4	-8	-20
フィリピン	-2	-5	-12	-34
ベトナム	16	94	130	237
韓国	0	0	-1	-3
香港	1	0	1	1
台湾	0	0	0	0
中南米	-1	-5	-9	-15
ブラジル	4	-27	12	68
メキシコ	0	-1	-3	-3
中東・アフリカ	-7	-10	-10	27
トルコ	-2	-8	-10	-15
複合地域	0	-1	-1	-3

<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	2,497	3,993	-264	1,971
外国債券(先進国)	-642	-1,222	-2,044	-3,575
グローバル	-456	-615	-1,320	-2,943
除く日本	-358	-491	-946	-1,842
含む日本	-98	-124	-374	-1,101
その他	-186	-607	-724	-632
北米	0	-1	-5	-12
米国	-9	-11	246	730
カナダ	-18	-84	-180	-331
欧州	-3	57	275	685
イギリス	0	-2	-3	-7
アジア・オセアニア	-29	-109	-235	-489
オーストラリア	-107	-391	-705	-1,000
ニュージーランド	-1	-7	-16	-33
複合地域	-19	-59	-101	-176
エマージング債券	-237	-664	-1,200	-1,331
グローバル	-45	-123	-151	-245
米ドル建て	-43	-123	-148	-275
現地通貨建て	-2	-1	-3	29
その他	-193	-541	-1,048	-1,085
ロシア	-4	-22	-60	-120
アジア・オセアニア	-5	-19	-28	-45
インド	-118	-298	-431	-551
インドネシア	-19	-56	-93	-111
ブラジル	-21	-67	-111	-214
メキシコ	-16	-50	-118	-123
南アフリカ	0	0	0	0
トルコ	-3	-14	-27	-27
複合地域	-1	-1	-2	-5
ハイイールド債券	-168	-613	-1,190	-2,320
グローバル	-15	-38	-95	-287
北米	-118	-450	-833	-1,437
その他	-35	-124	-263	-595
欧州	-29	-106	-208	-475
アジア・オセアニア	-3	-10	-36	-84
複合地域	0	-1	-2	-4
複合資産	1,605	6,634	12,660	18,603
安定	230	1,477	2,408	2,683
安定成長	277	1,383	2,634	3,966
成長	59	167	269	675
国内バランス	215	995	1,995	3,824
安定	221	1,031	2,107	3,932
一般	-5	-28	-77	-76
その他	823	2,612	5,355	7,456

< 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	2,497	3,993	-264	1,971
国内REIT	-98	211	110	1,591
日本	-98	211	110	1,591
外国REIT	6	822	2,131	2,143
グローバル	25	387	911	1,393
除く日本	221	400	584	1,050
含む日本	-196	-13	327	344
北米	9	453	1,174	617
その他	-28	-18	47	133
欧州	-5	-18	-34	-66
アジア・オセアニア	-4	28	102	224
オーストラリア	-12	-14	10	30
複合地域	0	-1	-2	-2
複数国	-7	-14	-28	-53
その他	251	337	45	218
絶対収益型	186	425	640	675
ロング・ショート	163	140	98	-121
マーケットニュートラル	-82	-92	-127	-117
GTAA	-1	-10	-27	-58
その他スタイル	105	387	697	971
CB	-31	-141	-252	-388
アジア・オセアニア	0	-4	-7	-6
日本	-2	-5	-9	-15
グローバル	-29	-132	-237	-366
コモディティ	63	118	165	370
全業種	12	9	14	36
貴金属	47	103	144	326
エネルギー	4	5	5	5
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	625,994	100.00	5,438	100.00
国内株式	87,562	13.99	886	16.29
一般	51,852	8.28	581	10.68
フリー	40,994	6.55	462	8.50
バリュー	10,858	1.73	119	2.19
小型	7,417	1.18	93	1.71
その他	27,680	4.42	205	3.77
日経225	13,627	2.18	70	1.29
TOPIX	11,947	1.91	76	1.40
JPX日経400	635	0.10	20	0.37
国内債券	34,796	5.56	136	2.50
一般	34,796	5.56	136	2.50
外国株式(先進国)	155,741	24.88	1,002	18.43
グローバル	119,277	19.05	646	11.88
除く日本	27,214	4.35	177	3.25
含む日本	92,062	14.71	469	8.62
その他	36,464	5.82	356	6.55
北米	362	0.06	12	0.22
米国	28,627	4.57	238	4.38
カナダ	292	0.05	3	0.06
欧州	1,498	0.24	58	1.07
ドイツ	24	0.00	1	0.02
イギリス	16	0.00	2	0.04
アジア・オセアニア	80	0.01	8	0.15
オーストラリア	5,546	0.89	32	0.59
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	6	0.00	1	0.02
エマージング株式	28,256	4.51	352	6.47
グローバル	7,498	1.20	101	1.86
BRICS	642	0.10	7	0.13
その他	20,116	3.21	244	4.49
欧州	202	0.03	8	0.15
ロシア	114	0.02	4	0.07
アジア・オセアニア	5,769	0.92	108	1.99
中国	1,908	0.30	29	0.53
インド	9,526	1.52	30	0.55
インドネシア	165	0.03	8	0.15
タイ	71	0.01	4	0.07
フィリピン	68	0.01	5	0.09
ベトナム	1,137	0.18	10	0.18
韓国	3	0.00	1	0.02
香港	10	0.00	1	0.02
台湾	1	0.00	1	0.02
中南米	66	0.01	2	0.04
ブラジル	824	0.13	16	0.29
メキシコ	19	0.00	3	0.06
中東・アフリカ	143	0.02	8	0.15
トルコ	69	0.01	4	0.07
複合地域	20	0.00	2	0.04

＜4＞純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別②

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	625,994	100.00	5,438	100.00
外国債券(先進国)	84,149	13.44	840	15.45
グローバル	61,988	9.90	542	9.97
除く日本	32,976	5.27	239	4.39
含む日本	29,013	4.63	303	5.57
その他	22,161	3.54	298	5.48
北米	95	0.02	6	0.11
米国	6,467	1.03	162	2.98
カナダ	1,233	0.20	7	0.13
欧州	1,808	0.29	37	0.68
イギリス	30	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	2,184	0.35	12	0.22
オーストラリア	8,662	1.38	41	0.75
ニュージーランド	160	0.03	14	0.26
複合地域	1,522	0.24	11	0.20
エマージング債券	18,144	2.90	298	5.48
グローバル	8,766	1.40	193	3.55
米ドル建て	7,075	1.13	152	2.80
現地通貨建て	1,691	0.27	41	0.75
その他	9,378	1.50	105	1.93
ロシア	199	0.03	5	0.09
アジア・オセアニア	478	0.08	17	0.31
インド	4,169	0.67	22	0.40
インドネシア	529	0.08	11	0.20
ブラジル	2,857	0.46	25	0.46
メキシコ	501	0.08	9	0.17
南アフリカ	3	0.00	1	0.02
トルコ	149	0.02	6	0.11
複合地域	51	0.01	1	0.02
ハイイールド債券	21,194	3.39	307	5.65
グローバル	3,375	0.54	58	1.07
北米	13,941	2.23	158	2.91
その他	3,878	0.62	91	1.67
欧州	3,031	0.48	51	0.94
アジア・オセアニア	744	0.12	30	0.55
複合地域	46	0.01	1	0.02
複合資産	107,544	17.18	994	18.28
安定	29,433	4.70	292	5.37
安定成長	46,657	7.45	410	7.54
成長	12,815	2.05	245	4.51
国内バランス	11,099	1.77	34	0.63
安定	10,578	1.69	9	0.17
一般	423	0.07	19	0.35
その他	7,541	1.20	13	0.24

< 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	625,994	100.00		5,438	100.00
国内REIT	28,272	4.52		122	2.24
日本	28,272	4.52		122	2.24
外国REIT	47,400	7.57		291	5.35
グローバル	18,674	2.98		140	2.57
除く日本	4,176	0.67		50	0.92
含む日本	14,498	2.32		90	1.66
北米	23,767	3.80		82	1.51
その他	4,959	0.79		69	1.27
欧州	254	0.04		17	0.31
アジア・オセアニア	3,539	0.57		34	0.63
オーストラリア	829	0.13		13	0.24
複合地域	47	0.01		3	0.06
複数国	291	0.05		2	0.04
その他	12,935	2.07		210	3.86
絶対収益型	7,808	1.25		99	1.82
ロング・ショート	1,032	0.16		33	0.61
マーケットニュートラル	1,016	0.16		15	0.28
GTAA	413	0.07		14	0.26
その他スタイル	5,346	0.85		37	0.68
CB	1,330	0.21		45	0.83
アジア・オセアニア	36	0.01		1	0.02
日本	57	0.01		3	0.06
グローバル	1,238	0.20		41	0.75
コモディティ	2,104	0.34		27	0.50
全業種	815	0.13		14	0.26
貴金属	1,256	0.20		11	0.20
エネルギー	23	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	11,340	8.3	3.84	4.16	1.283
国内株式	13,039	11.4	1.20	1.46	1.156
一般	12,086	11.0	1.57	1.97	1.427
フリー	11,807	10.5	1.77	2.25	1.474
バリュー	13,170	13.1	0.83	0.91	1.247
小型	17,392	12.0	1.27	1.47	1.741
その他	13,861	12.0	0.50	0.52	0.483
日経225	14,637	13.4	0.52	0.53	0.583
TOPIX	14,444	13.4	0.33	0.35	0.320
JPX日経400	12,511	5.5	0.04	0.04	0.549
国内債券	11,218	10.5	0.33	0.33	0.358
一般	11,218	10.5	0.33	0.33	0.358
外国株式(先進国)	12,241	6.6	4.45	4.84	1.580
グローバル	12,857	7.0	3.54	3.76	1.558
除く日本	15,540	9.2	0.79	0.88	0.749
含む日本	11,844	6.1	4.38	4.65	1.797
その他	11,123	6.1	7.58	8.52	1.650
北米	10,880	6.7	6.76	7.40	1.910
米国	11,645	5.5	6.12	6.41	1.608
カナダ	6,767	8.0	14.90	17.47	1.992
欧州	11,222	8.4	2.88	3.07	1.665
ドイツ	10,091	5.9	0.00	0.00	0.770
イギリス	5,216	5.8	14.11	18.81	1.944
アジア・オセアニア	9,110	5.9	4.95	5.51	1.699
オーストラリア	8,523	5.6	15.30	19.34	1.827
ニュージーランド	13,712	7.6	3.02	2.92	1.672
複合地域	6,598	6.8	0.00	0.00	1.705
エマージング株式	11,703	8.9	2.90	3.41	1.819
グローバル	10,764	6.7	1.94	2.11	1.463
BRICS	14,371	13.8	1.11	1.09	2.068
その他	12,014	9.7	3.31	3.97	1.944
欧州	9,354	13.9	0.22	0.21	1.984
ロシア	10,558	10.8	2.18	1.99	2.016
アジア・オセアニア	12,331	9.7	6.59	7.59	1.743
中国	19,202	10.0	1.67	1.57	1.961
インド	12,063	10.1	1.47	1.40	2.074
インドネシア	9,260	8.7	0.40	0.47	1.853
タイ	9,415	11.8	0.66	0.83	1.705
フィリピン	9,859	6.5	0.53	0.62	1.795
ベトナム	10,526	4.0	0.84	0.98	1.869
韓国	8,808	1.2	0.00	0.00	1.804
香港	15,032	10.5	1.91	2.06	0.858
台湾	10,399	7.3	0.00	0.00	1.661
中南米	7,574	13.1	0.00	0.00	2.040
ブラジル	5,599	9.9	11.89	21.90	1.931
メキシコ	8,021	6.2	0.00	0.00	1.920
中東・アフリカ	9,346	9.2	0.19	1.34	2.068
トルコ	6,235	13.6	0.00	0.00	2.041
複合地域	17,454	11.8	2.91	3.10	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	11,340	8.3	3.84	4.16	1.283
外国債券(先進国)	9,977	8.1	2.64	2.77	1.124
グローバル	10,559	8.4	1.90	1.93	1.062
除く日本	11,223	10.6	1.78	1.81	0.838
含む日本	10,035	6.7	2.02	2.06	1.317
その他	8,918	7.6	4.74	5.12	1.296
北米	10,544	5.8	1.87	1.85	1.811
米国	9,663	6.4	5.12	5.33	1.376
カナダ	8,091	7.7	4.21	4.39	1.368
欧州	8,519	9.8	1.31	1.33	1.038
イギリス	7,914	5.2	3.62	3.82	1.271
アジア・オセアニア	7,480	9.3	3.05	3.29	1.423
オーストラリア	7,643	10.7	5.89	6.60	1.262
ニュージーランド	9,062	5.4	2.59	2.77	1.335
複合地域	5,675	10.2	3.73	3.84	1.190
エマージング債券	8,847	8.4	6.70	7.26	1.595
グローバル	9,187	9.2	6.05	6.64	1.572
米ドル建て	9,315	9.4	6.32	6.94	1.627
現地通貨建て	8,711	8.2	4.96	5.39	1.343
その他	8,224	7.1	7.30	7.84	1.616
ロシア	8,763	7.0	6.26	6.02	1.609
アジア・オセアニア	9,043	6.8	11.65	12.74	1.641
インド	9,310	5.3	7.66	7.77	1.700
インドネシア	7,466	7.5	7.01	6.95	1.664
ブラジル	8,203	10.1	7.25	8.74	1.592
メキシコ	6,727	7.2	5.89	5.61	1.396
南アフリカ	6,725	7.8	7.17	8.03	1.430
トルコ	3,559	7.1	8.46	8.87	1.452
複合地域	4,192	13.5	5.18	5.25	1.210
ハイイールド債券	8,676	8.7	8.68	9.61	1.696
グローバル	7,652	8.1	6.92	7.56	1.594
北米	9,532	10.0	8.48	9.28	1.701
その他	7,843	6.7	10.89	12.50	1.769
欧州	7,347	6.8	11.52	13.39	1.746
アジア・オセアニア	8,274	7.8	9.34	10.15	1.876
複合地域	4,419	15.9	5.27	5.43	1.800
複合資産	11,564	7.9	1.68	1.71	1.051
安定	11,048	7.6	0.95	0.95	1.138
安定成長	11,305	8.3	2.27	2.35	1.106
成長	12,755	7.9	0.52	0.54	0.936
国内バランス	10,919	7.9	2.15	2.18	0.940
安定	10,829	9.0	2.20	2.23	0.921
一般	11,143	8.8	0.91	0.91	1.353
その他	10,603	0.4	2.28	2.07	0.727

(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	11,340	8.3	3.84	4.16	1.283
国内REIT	14,324	8.3	9.97	10.18	0.957
日本	14,324	8.3	9.97	10.18	0.957
外国REIT	10,943	7.1	10.97	12.06	1.565
グローバル	11,675	7.6	9.16	10.49	1.419
除く日本	13,551	6.2	6.44	8.20	1.113
含む日本	10,632	8.4	9.95	11.15	1.507
北米	9,951	7.3	12.78	13.78	1.629
その他	10,638	5.9	9.01	9.71	1.803
欧州	9,474	5.5	4.65	4.84	1.861
アジア・オセアニア	11,957	5.8	11.02	11.96	1.843
オーストラリア	9,445	5.2	4.42	4.54	1.717
複合地域	6,706	8.1	1.45	1.43	0.856
複数国	11,775	12.9	2.66	2.52	1.656
その他					
絶対収益型	10,198	5.2	0.09	0.09	1.672
ロング・ショート	10,252	4.7	0.68	0.66	1.488
マーケットニュートラル	10,278	4.6	0.04	0.05	1.242
GTAA	10,656	6.0	0.00	0.00	1.579
その他スタイル	9,943	5.5	0.02	0.02	1.796
CB	11,141	6.4	1.16	1.18	1.517
アジア・オセアニア	8,300	9.7	2.87	2.89	1.823
日本	10,549	8.8	0.20	0.21	1.037
グローバル	11,253	6.1	1.15	1.18	1.530
コモディティ	8,161	6.6	0.00	0.00	0.886
全業種	5,423	8.5	0.00	0.00	1.247
貴金属	11,491	4.1	0.00	0.00	0.651
エネルギー	7,921	11.0	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	10,087	3.4	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