

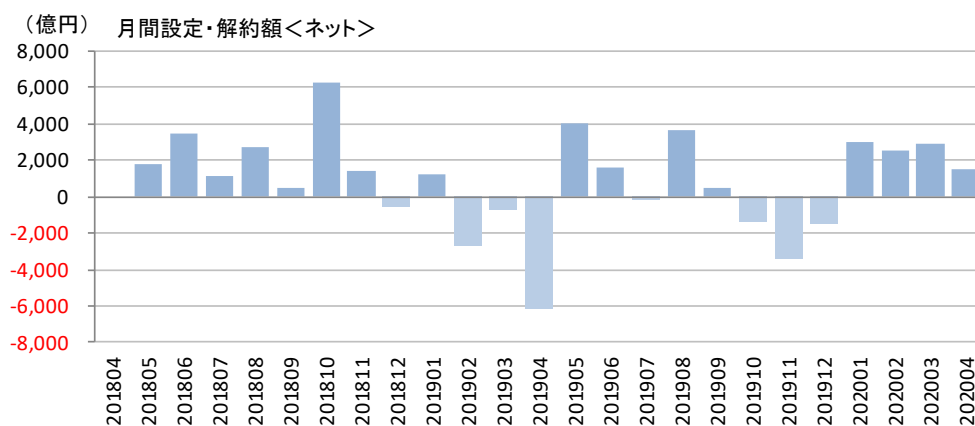
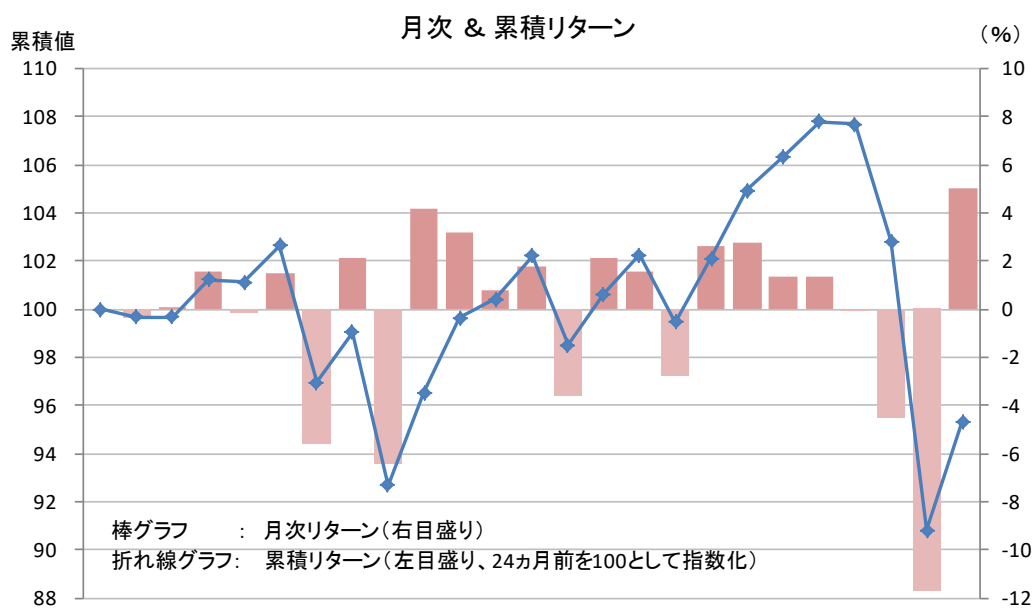
# 投信指数 MAB-FPI

## パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

### 2020年4月

**「総合」 +5.00 %**  
**(前月 -11.67 %)**



# 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」の掲載対象は原則、直近5年以上指数算出が可能なカテゴリーからの抜粋

### <1>パフォーマンス・サマリー

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

### <2>リスク・サマリー

・ ・ ・ ・ ・ P. 22

### <3>設定・解約額 [ネット金額]

・ ・ ・ ・ ・ P. 35

### <4>純資産額、ファンド本数

・ ・ ・ ・ ・ P. 38

### <5>属性、指標等

・ ・ ・ ・ ・ P. 41

## &lt;1&gt;パフォーマンス・サマリー

## (1) 当月リターン

## 「総合」およびファンド分類別①

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		12,044	11,471	573	5.00
国内株式		14,151	13,348	803	6.02
一般		13,775	13,064	710	5.44
フリー		13,010	12,297	713	5.80
バリュー		17,453	16,774	679	4.05
小型		29,885	26,816	3,068	11.44
その他		13,949	13,214	734	5.56
日経225		13,362	12,525	837	6.68
TOPIX		13,804	13,236	568	4.29
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	13,049	12,509	541	4.32
国内債券		13,277	13,236	41	0.31
一般		13,277	13,236	41	0.31
外国株式(先進国)		13,980	12,640	1,340	10.60
グローバル		15,514	14,047	1,466	10.44
除く日本		20,791	18,904	1,887	9.98
含む日本		14,319	12,950	1,369	10.57
その他		10,809	9,728	1,081	11.12
北米		10,299	9,150	1,149	12.56
米国		16,871	15,157	1,714	11.31
カナダ	10,000 (2009.02.27)	13,782	12,320	1,462	11.87
欧州		15,923	14,810	1,113	7.52
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	7,204	6,568	636	9.68
イギリス	9,683 (2014.05.30)	7,051	6,663	388	5.83
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	28,910	27,009	1,901	7.04
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	11,104	10,033	1,071	10.68
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	31,377	28,584	2,793	9.77
複合地域	10,000 (2013.04.30)	5,404	4,465	939	21.03
エマージング株式		12,039	10,997	1,042	9.48
グローバル		12,561	11,567	994	8.59
BRICS	10,000 (2005.09.30)	18,954	17,116	1,838	10.74
その他		12,222	11,131	1,091	9.80
欧州		19,838	17,684	2,154	12.18
ロシア	10,000 (2007.03.30)	8,678	7,544	1,134	15.03
アジア・オセアニア		13,581	12,545	1,036	8.26
中国		35,432	33,249	2,183	6.57
インド	10,000 (2004.09.30)	24,135	21,719	2,416	11.12
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	8,739	7,995	744	9.30
タイ		17,081	14,704	2,377	16.17
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	5,800	5,355	445	8.32
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	11,039	9,455	1,584	16.75
韓国	10,000 (1997.06.30)	19,305	16,333	2,972	18.20
香港		20,366	19,532	834	4.27
台湾	10,000 (2008.03.31)	15,132	13,693	1,439	10.51
中南米	7,427 (2006.04.28)	5,510	5,105	405	7.93
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	5,841	5,523	318	5.75
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	6,071	5,714	357	6.25
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	7,433	6,764	669	9.89
トルコ		17,038	16,092	946	5.88
複合地域	10,000 (2005.08.31)	17,665	16,275	1,390	8.54

※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		12,044	11,471	573	5.00
外国債券(先進国)		17,290	17,051	239	1.40
グローバル		17,791	17,674	116	0.66
除く日本		19,238	19,262	-24	-0.12
含む日本		16,889	16,627	262	1.57
その他		15,928	15,375	553	3.60
北米	9,052 (2013.05.31)	10,130	9,942	188	1.89
米国		14,831	14,421	410	2.85
カナダ	10,000 (2003.05.30)	13,483	13,191	292	2.22
欧州	10,000 (1998.07.31)	14,719	14,711	8	0.05
イギリス	10,069 (2014.07.31)	9,138	9,039	99	1.10
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	17,297	16,396	901	5.49
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	21,211	20,122	1,089	5.41
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	10,323	9,987	336	3.36
複合地域	10,000 (2001.11.30)	16,893	16,988	-96	-0.56
エマージング債券		14,673	14,677	-4	-0.03
グローバル		15,479	15,415	64	0.42
米ドル建て		15,795	15,774	22	0.14
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	11,229	11,066	163	1.47
その他	8,647 (2005.03.31)	11,029	11,076	-47	-0.42
ロシア	10,000 (2008.05.30)	9,983	8,994	988	10.99
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	13,541	13,251	290	2.19
インド	10,000 (2011.08.31)	14,612	14,657	-44	-0.30
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	11,836	11,190	646	5.77
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	9,866	10,189	-323	-3.17
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	9,902	9,827	75	0.77
トルコ	10,000 (2011.04.28)	5,376	5,423	-48	-0.88
複合地域	10,000 (2006.08.31)	9,534	9,395	139	1.48
ハイイールド債券		18,467	17,956	511	2.85
グローバル	10,000 (1997.06.30)	18,619	18,236	383	2.10
北米		17,935	17,504	431	2.46
その他	10,000 (2004.03.31)	18,616	17,732	884	4.98
欧州	10,000 (2006.04.28)	18,575	17,602	973	5.53
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	12,253	11,907	347	2.91
複合地域	10,000 (2004.03.31)	17,782	17,128	654	3.82
複合資産		16,298	15,898	400	2.51
安定	10,000 (1998.10.30)	14,957	14,715	242	1.64
安定成長		17,392	16,925	467	2.76
成長		18,996	18,137	859	4.74
国内バランス		12,425	12,428	-3	-0.02
安定		12,755	12,769	-15	-0.11
一般		13,322	13,056	266	2.04
その他	10,000 (2018.10.31)	11,343	10,863	481	4.42

※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&gt; 総合

## &lt;1&gt;パフォーマンス・サマリー

## (1) 当月リターン

## 「総合」およびファンド分類別③

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)	
総合		12,044	11,471	573	5.00	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	26,334	26,584	-250	-0.94	
日本	10,000 (2003.10.31)	26,334	26,584	-250	-0.94	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	21,554	20,414	1,140	5.59	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	18,331	17,306	1,025	5.92	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	19,820	18,615	1,204	6.47	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	18,398	17,396	1,002	5.76	
北米	10,000 (2003.09.30)	22,037	21,013	1,024	4.87	
その他	10,000 (2004.04.30)	21,121	19,533	1,588	8.13	
欧州	10,000 (2006.12.29)	4,465	4,281	184	4.30	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	16,239	15,130	1,109	7.33	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	9,869	8,545	1,324	15.49	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	4,672	4,256	416	9.78	
複数国	10,000 (2004.04.30)	29,578	28,216	1,362	4.83	
その他		5,587	5,522	65	1.18	
絶対収益型		7,615	7,566	49	0.65	
ロング・ショート		8,667	8,706	-39	-0.45	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,841	11,579	262	2.26	
GTAA		10,521	10,354	167	1.62	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,136	7,101	35	0.49	
CB		17,358	16,649	709	4.26	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	13,870	13,385	485	3.62	
日本		19,042	18,810	231	1.23	
グローバル		30,435	29,145	1,290	4.43	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	7,220	7,347	-127	-1.73	
全業種	10,000 (2004.12.30)	4,351	4,802	-451	-9.39	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	16,870	16,072	798	4.96	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	2,183	2,690	-506	-18.83	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	7,162	7,056	106	1.50	

※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	-11.46	-9.13	-6.73	-11.53
国内株式	-12.09	-11.05	-8.51	-14.68
一般	-12.16	-11.22	-8.80	-14.91
フリー	-11.70	-10.67	-8.33	-14.54
バリュー	-13.92	-13.27	-10.57	-16.29
小型	-11.07	-9.38	-9.18	-15.01
その他	-12.15	-11.26	-7.74	-14.03
日経225	-12.04	-10.96	-7.61	-13.77
TOPIX	-12.03	-11.04	-7.38	-13.94
JPX日経400	-12.04	-10.96	-6.88	-13.71
国内債券	-0.82	-0.92	0.22	-0.34
一般	-0.82	-0.92	0.22	-0.34
外国株式(先進国)	-10.87	-4.07	-3.94	-10.37
グローバル	-10.46	-3.23	-3.16	-9.91
除く日本	-14.19	-8.58	-7.93	-14.41
含む日本	-9.33	-1.59	-1.69	-8.53
その他	-12.18	-6.86	-6.54	-11.87
北米	-14.28	-7.92	-11.36	-13.86
米国	-8.70	-1.44	-1.45	-7.58
カナダ	-20.88	-17.57	-17.03	-21.08
欧州	-16.41	-11.92	-10.46	-17.55
ドイツ	-18.84	-18.18	-16.90	-21.47
イギリス	-21.47	-19.09	-25.15	-23.31
アジア・オセアニア	-15.83	-14.56	-14.75	-18.86
オーストラリア	-29.37	-30.53	-29.36	-31.57
ニュージーランド	-11.59	-6.05	-7.51	-14.64
複合地域	-34.31	-33.25	-42.96	-38.29
エマージング株式	-20.10	-17.98	-18.65	-21.42
グローバル	-16.26	-12.65	-12.68	-18.74
BRICS	-22.97	-20.01	-18.58	-25.73
その他	-21.46	-19.86	-20.80	-22.32
欧州	-27.47	-24.61	-18.44	-28.81
ロシア	-24.28	-17.91	-8.57	-23.95
アジア・オセアニア	-12.46	-11.48	-15.13	-16.39
中国	-1.30	5.95	6.23	-1.22
インド	-27.68	-25.95	-26.39	-26.78
インドネシア	-37.60	-38.33	-39.34	-39.14
タイ	-17.71	-25.49	-28.48	-23.93
フィリピン	-24.82	-30.85	-31.58	-29.79
ベトナム	-22.60	-26.79	-27.52	-23.34
韓国	-5.82	-2.34	-12.98	-7.23
香港	-8.52	-8.47	-17.75	-14.60
台湾	-7.96	-6.14	-5.09	-12.40
中南米	-38.24	-35.77	-33.80	-40.40
ブラジル	-43.09	-41.99	-37.97	-45.89
メキシコ	-37.90	-35.23	-37.22	-37.48
中東・アフリカ	-20.74	-17.29	-25.19	-21.71
トルコ	-28.24	-16.31	-11.97	-24.88
複合地域	-12.57	-12.45	-15.78	-17.42

※[色塗りの基準]期間別リターン&gt;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	-11.46	-9.13	-6.73	-11.53
外国債券(先進国)	-3.80	-2.98	-1.67	-3.68
グローバル	-3.17	-2.01	-0.17	-2.62
除く日本	-1.93	-0.80	1.34	-1.39
含む日本	-4.58	-3.40	-1.88	-4.03
その他	-5.53	-5.59	-5.68	-6.51
北米	-4.25	-2.85	-0.95	-3.02
米国	-8.47	-6.62	-4.69	-7.47
カナダ	-4.38	-3.47	-2.96	-4.65
欧州	-4.22	-3.81	-3.51	-3.87
イギリス	-6.44	-4.46	-5.39	-6.18
アジア・オセアニア	-4.60	-6.15	-7.41	-7.28
オーストラリア	-5.02	-6.60	-7.80	-7.61
ニュージーランド	-4.82	-3.77	-5.85	-6.97
複合地域	-0.21	1.28	2.73	0.29
エマージング債券	-15.85	-15.58	-12.80	-16.50
グローバル	-18.13	-16.90	-14.06	-18.62
米ドル建て	-19.15	-17.84	-15.22	-19.56
現地通貨建て	-14.02	-13.12	-9.29	-14.82
その他	-13.71	-14.31	-11.55	-14.51
ロシア	-15.19	-12.57	-4.69	-16.77
アジア・オセアニア	-6.96	-5.34	-3.51	-6.53
インド	-8.36	-8.16	-6.76	-8.35
インドネシア	-16.95	-12.97	-8.71	-14.11
ブラジル	-21.58	-25.77	-22.32	-24.77
メキシコ	-22.64	-19.33	-13.39	-21.52
トルコ	-16.19	-10.45	19.84	-11.40
複合地域	-16.19	-12.78	-11.55	-16.52
ハイイールド債券	-16.15	-15.27	-14.88	-17.32
グローバル	-16.58	-15.80	-15.26	-17.77
北米	-15.90	-14.88	-14.89	-17.00
その他	-16.67	-16.18	-14.54	-18.05
欧州	-17.20	-16.84	-14.73	-18.82
アジア・オセアニア	-15.38	-14.48	-14.73	-15.87
複合地域	-7.85	-7.32	-7.17	-9.10
複合資産	-8.20	-6.68	-3.85	-8.00
安定	-5.33	-4.12	-1.88	-5.09
安定成長	-8.42	-6.89	-4.02	-8.43
成長	-9.94	-7.67	-5.46	-10.57
国内バランス	-7.75	-7.77	-3.90	-7.31
安定	-7.66	-7.73	-3.86	-7.17
一般	-8.78	-7.87	-4.25	-9.18
その他	-15.39	-12.08	-0.65	-12.73

※[色塗りの基準]期間別リターン&gt;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か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	-11.46	-9.13	-6.73	-11.53
国内REIT	-27.81	-28.02	-13.91	-25.39
日本	-27.81	-28.02	-13.91	-25.39
外国REIT	-23.34	-22.95	-17.53	-21.78
グローバル	-25.16	-24.74	-20.22	-23.97
除く日本	-25.27	-24.74	-19.37	-24.18
含む日本	-25.12	-24.73	-20.42	-23.90
北米	-21.54	-21.20	-14.64	-19.42
その他	-25.29	-24.73	-21.30	-24.95
欧州	-25.41	-23.32	-21.17	-26.41
アジア・オセアニア	-22.74	-22.16	-18.59	-22.19
オーストラリア	-36.45	-36.35	-34.59	-36.96
複合地域	-36.72	-36.30	-35.53	-38.28
複数国	-22.07	-21.58	-13.16	-19.61
その他	-6.62	-5.33	-3.77	-6.93
絶対収益型	-2.53	-1.50	-1.40	-2.22
ロング・ショート	-4.15	-3.59	-2.57	-3.83
マーケットニュートラル	-0.11	0.98	-1.66	-0.37
GTAA	-3.74	-1.73	-0.76	-3.14
その他スタイル	-2.59	-1.57	-1.05	-2.19
CB	-9.10	-6.57	-6.60	-8.77
アジア・オセアニア	-11.44	-8.41	-11.21	-11.06
日本	-5.31	-5.85	-4.47	-6.03
グローバル	-9.21	-6.55	-6.56	-8.83
コモディティ	-10.15	-9.04	-5.64	-10.90
全業種	-29.92	-32.21	-36.23	-34.52
貴金属	7.40	12.58	28.12	11.81
エネルギー	-50.27	-51.20	-58.94	-56.18
その他コモディティ	-27.02	-28.37	-31.60	-31.87

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

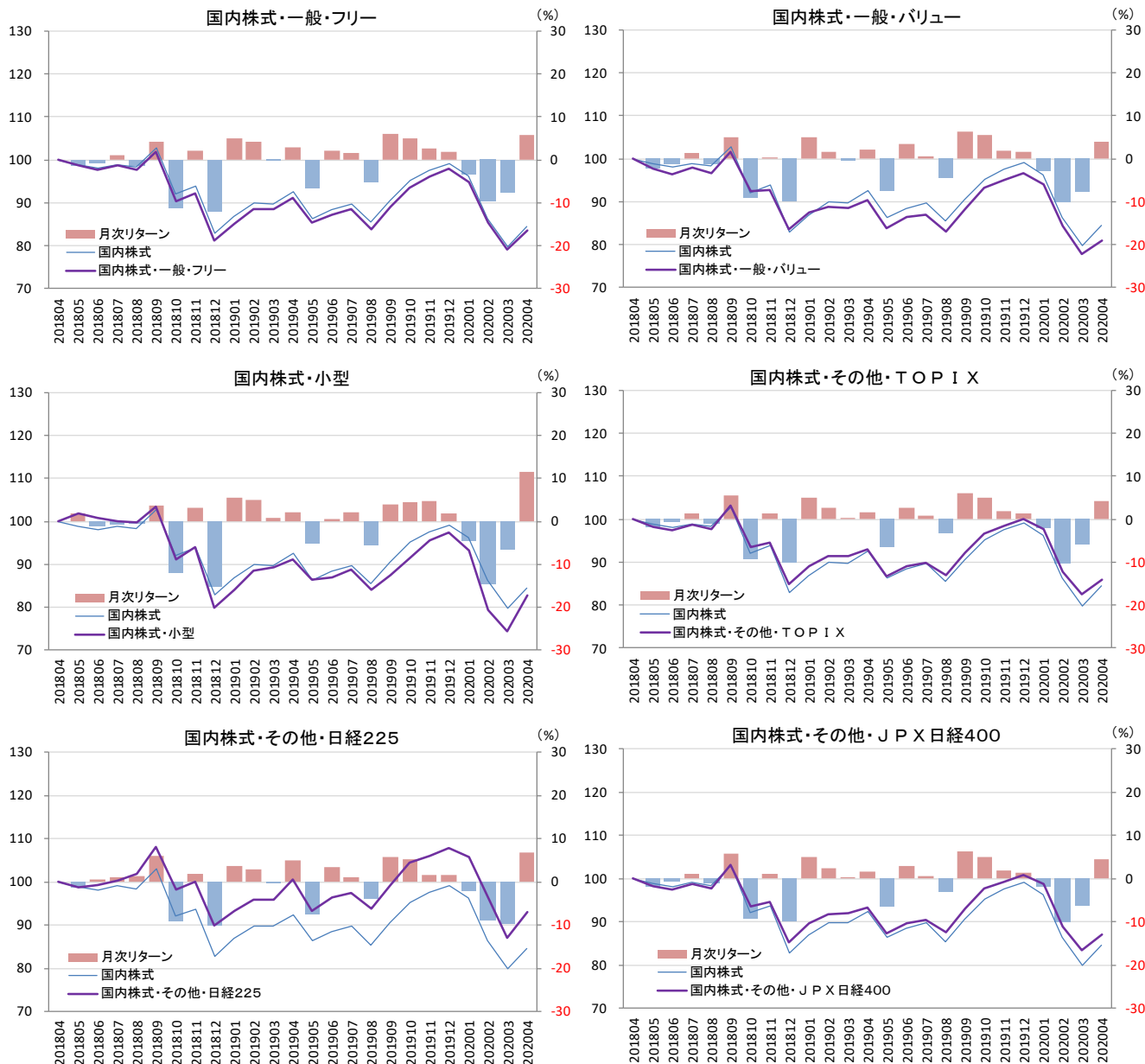


<1>パフォーマンス・サマリー

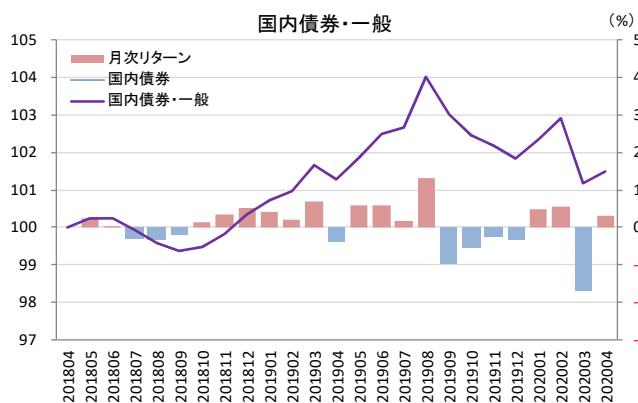
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

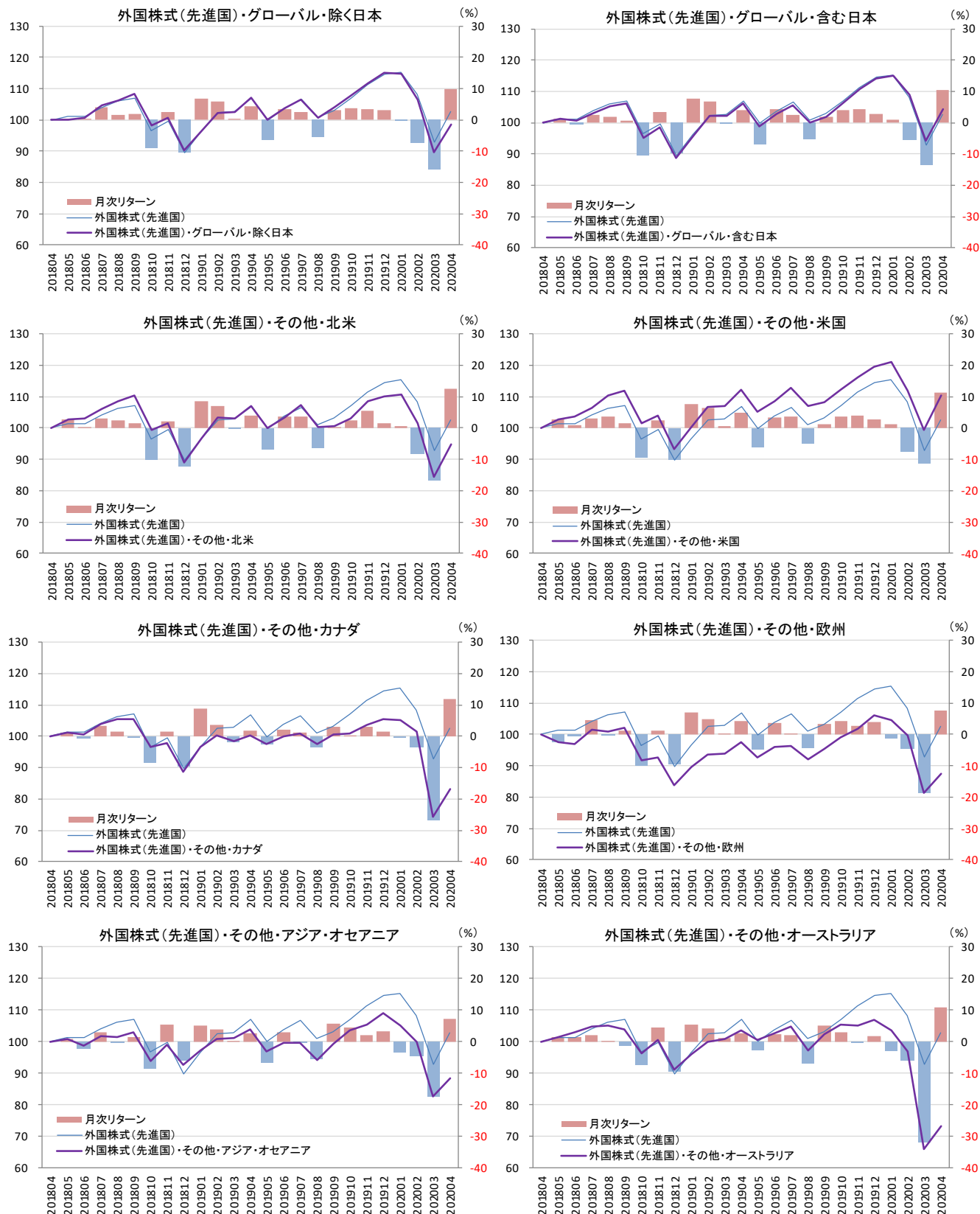


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

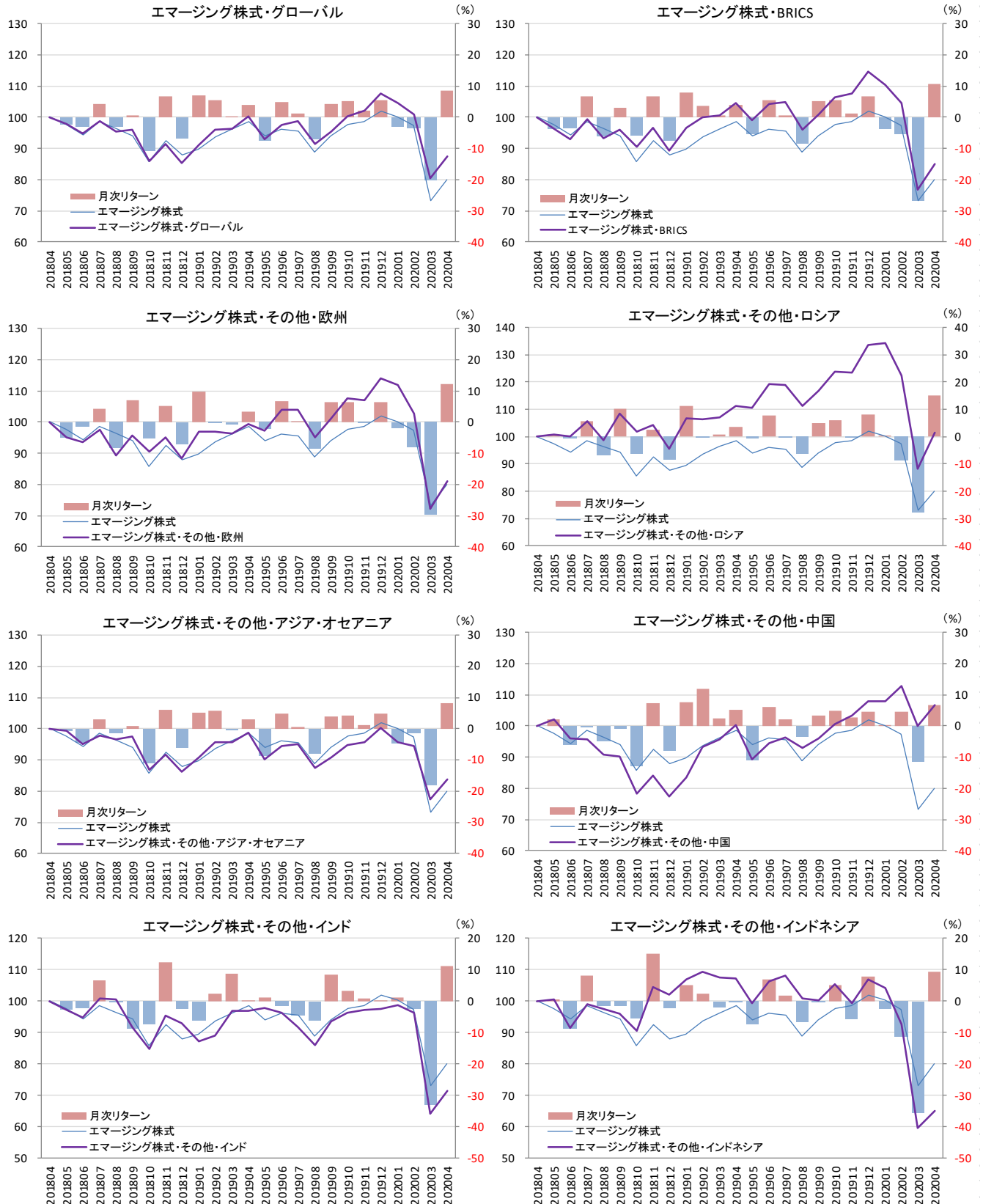


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマージング株式]



<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

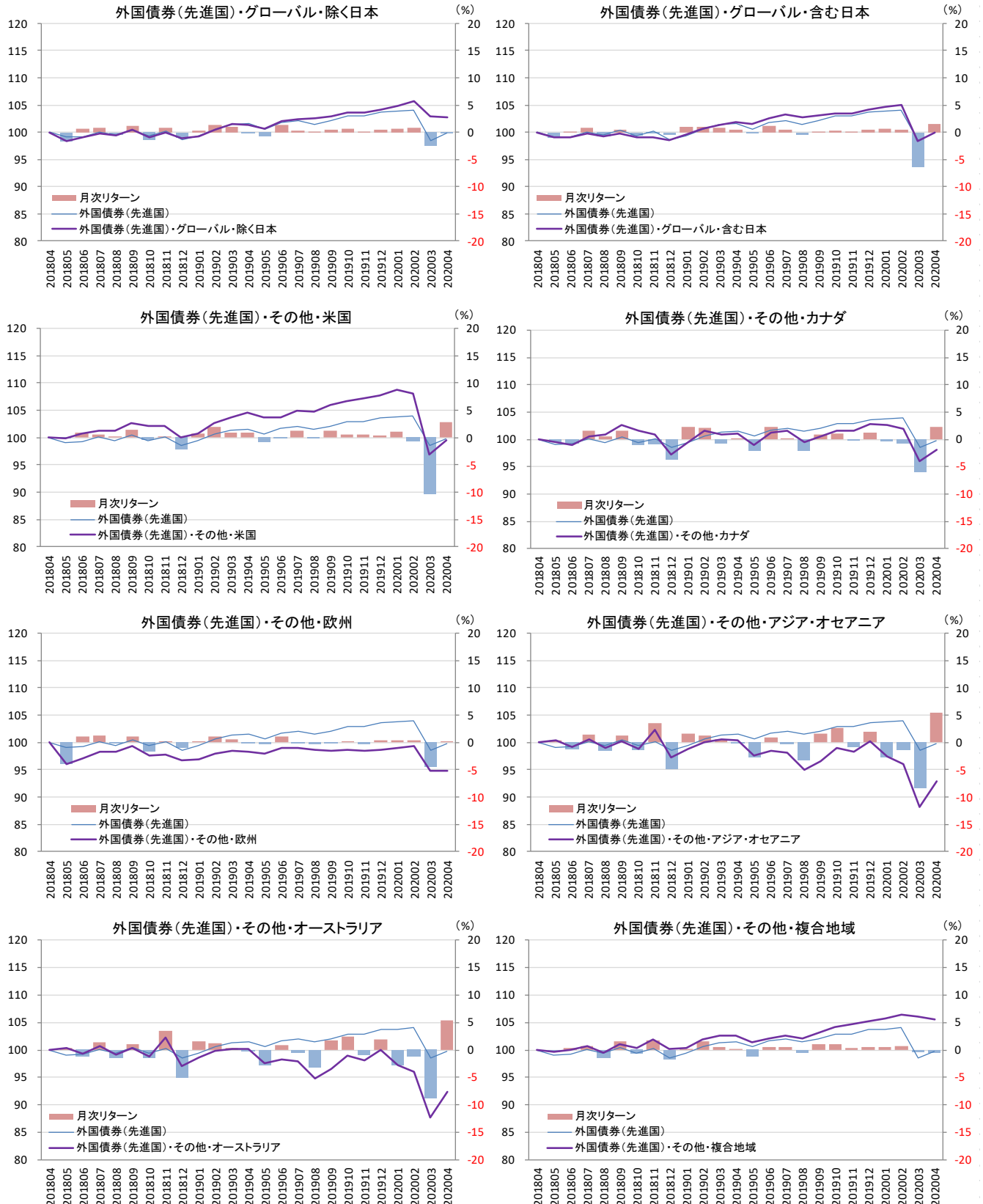


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

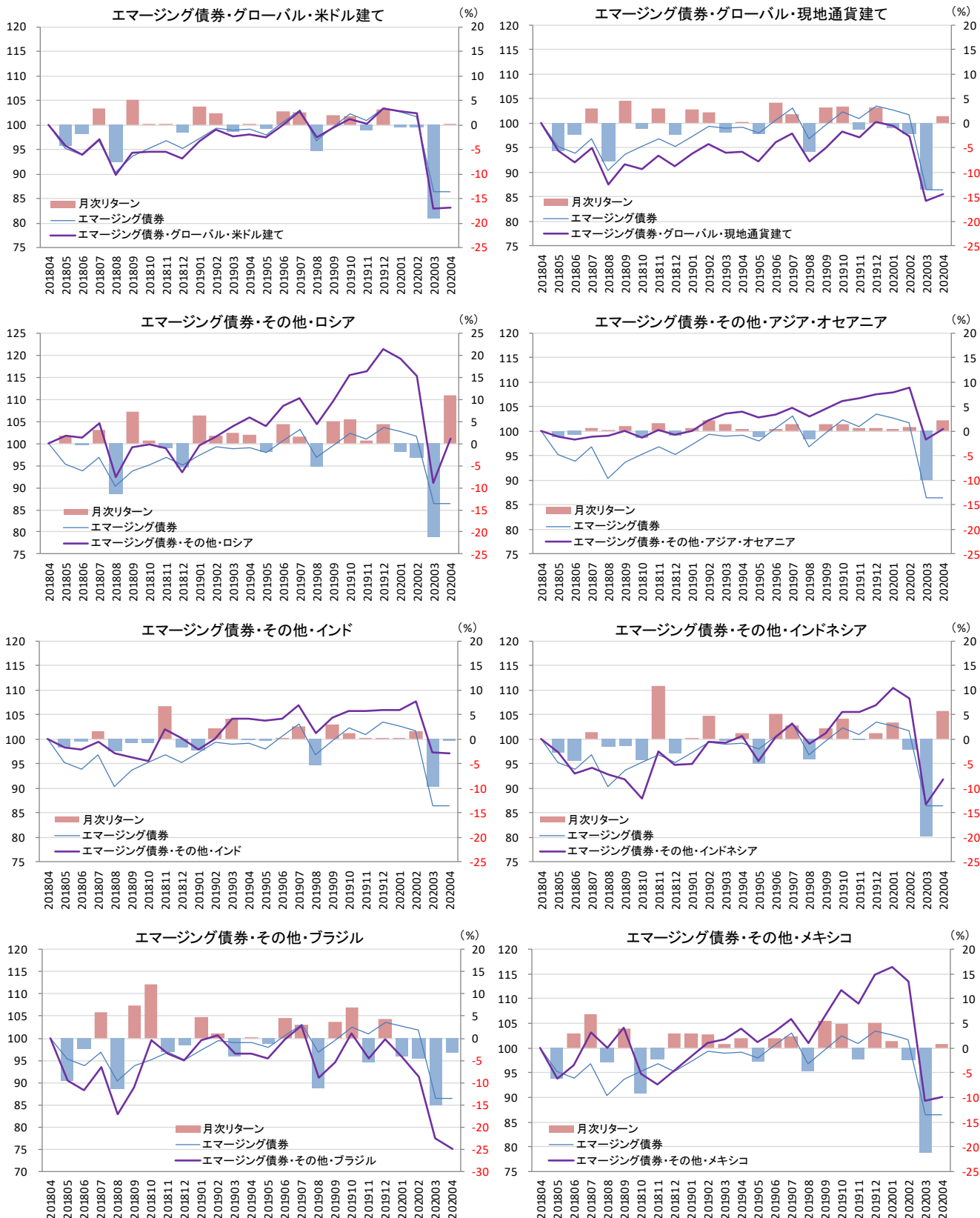


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

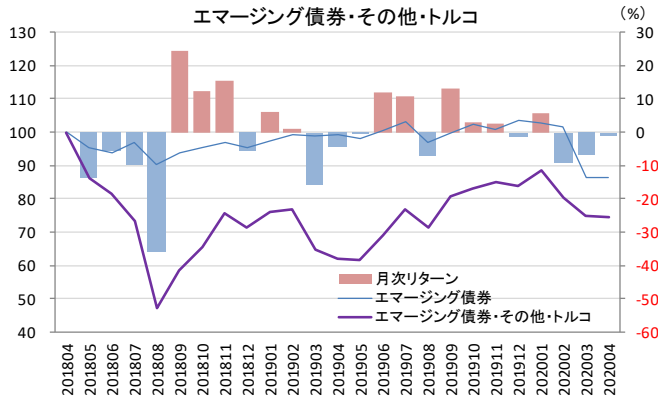


<1>パフォーマンス・サマリー

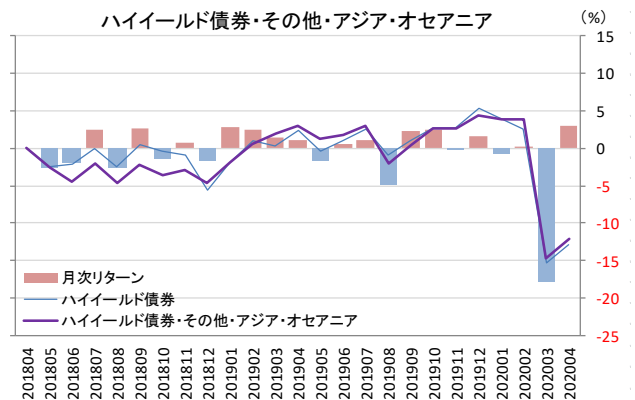
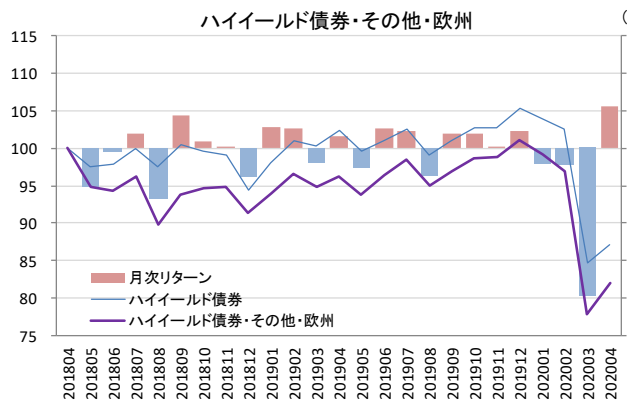
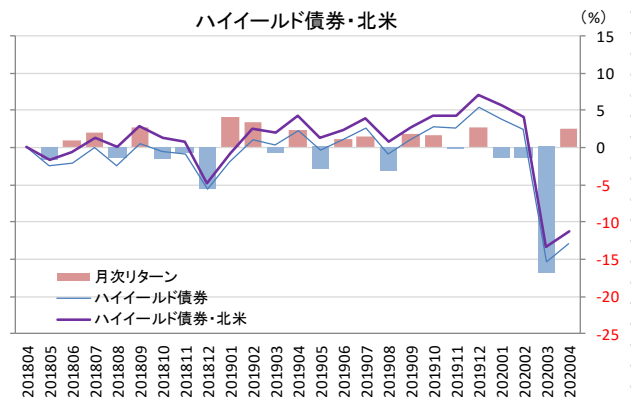
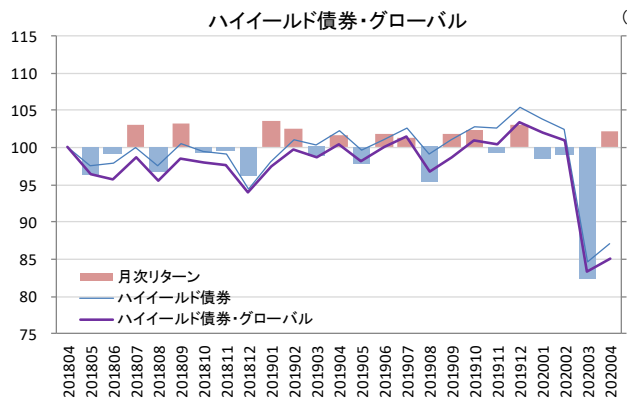
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

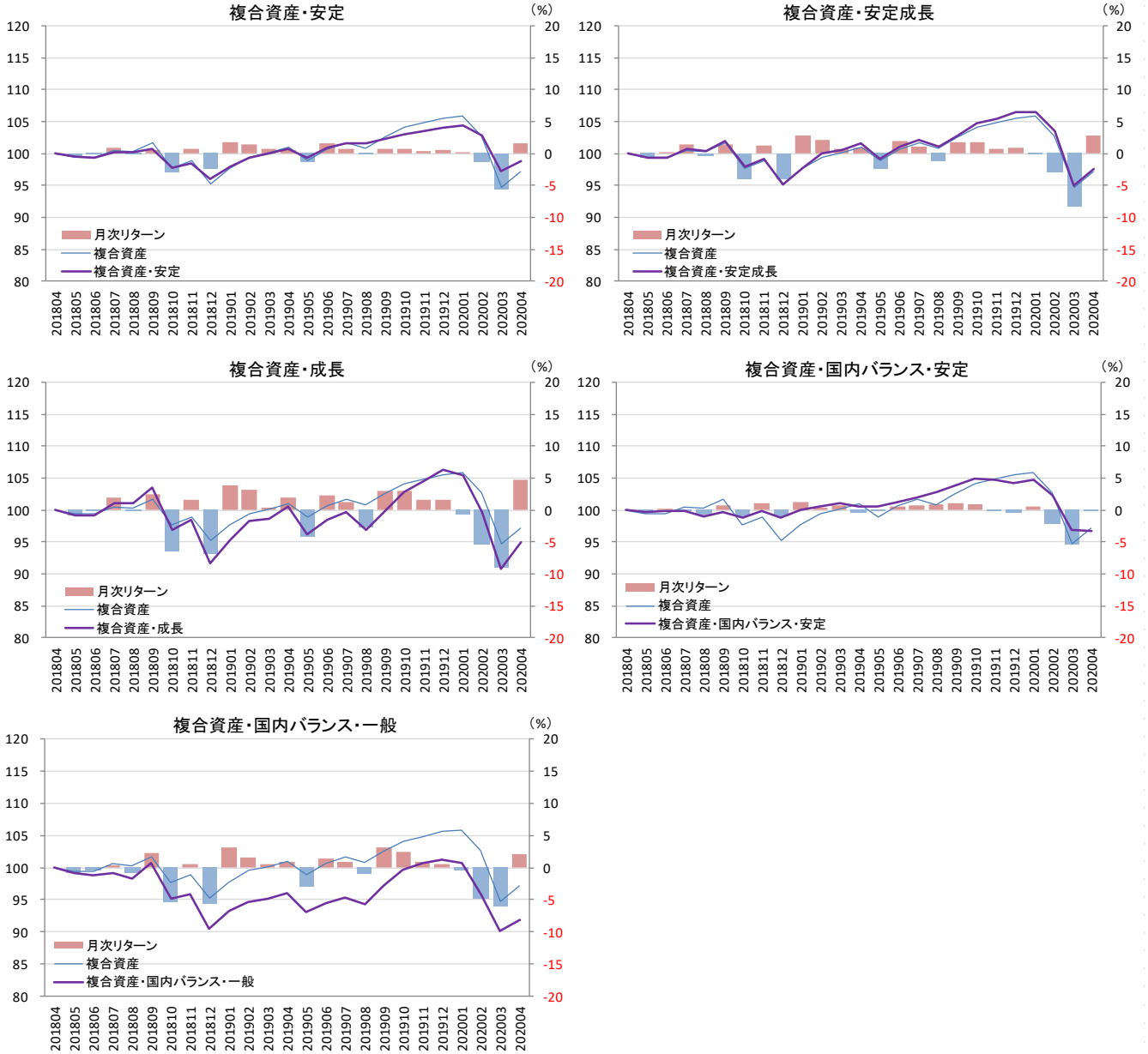


<1>パフォーマンス・サマリー

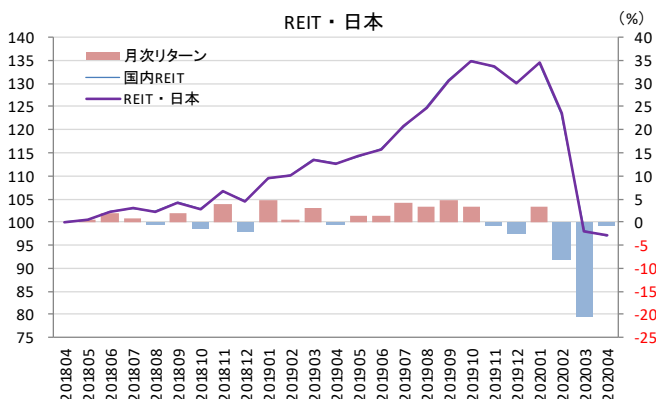
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]



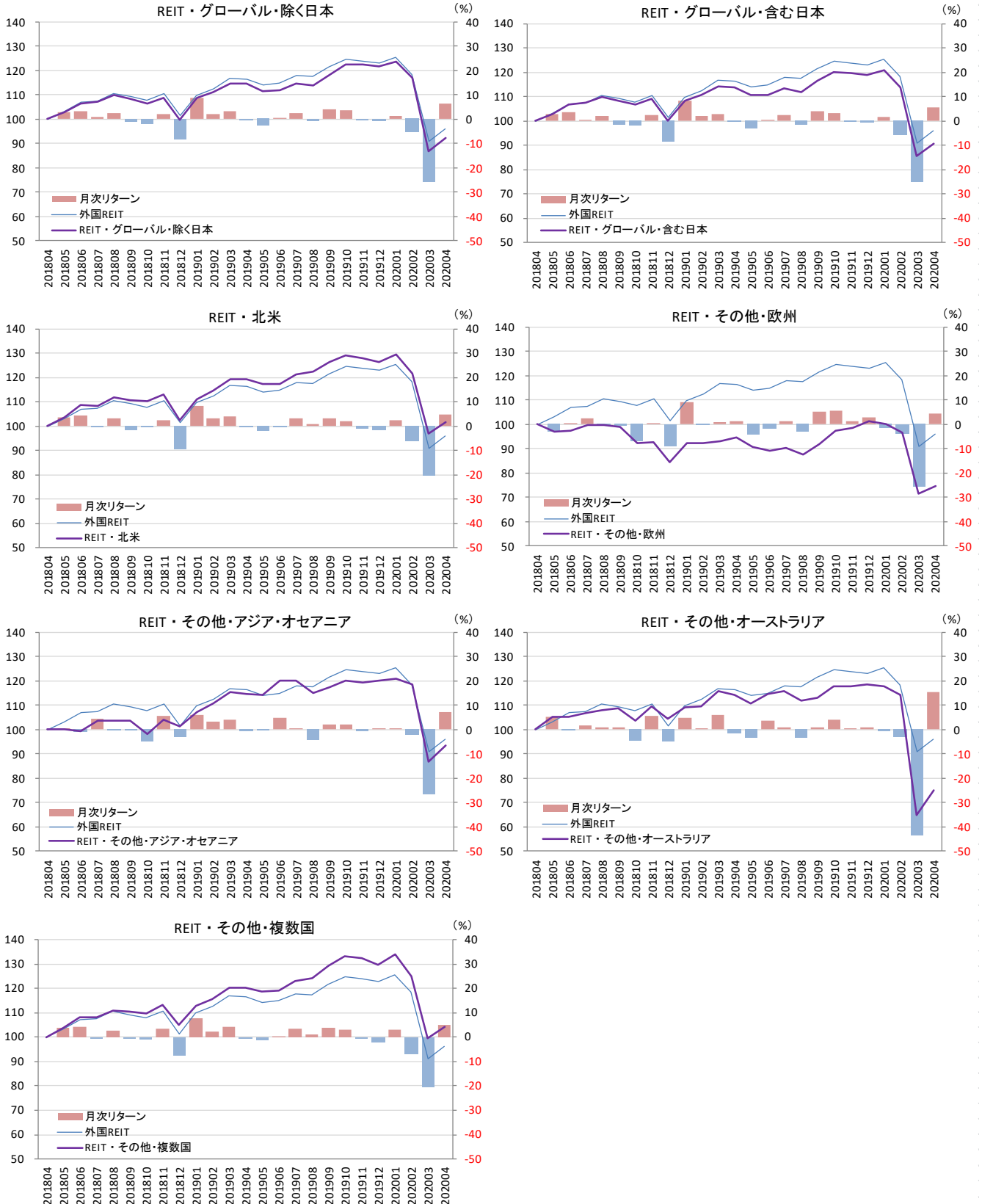


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国REIT]

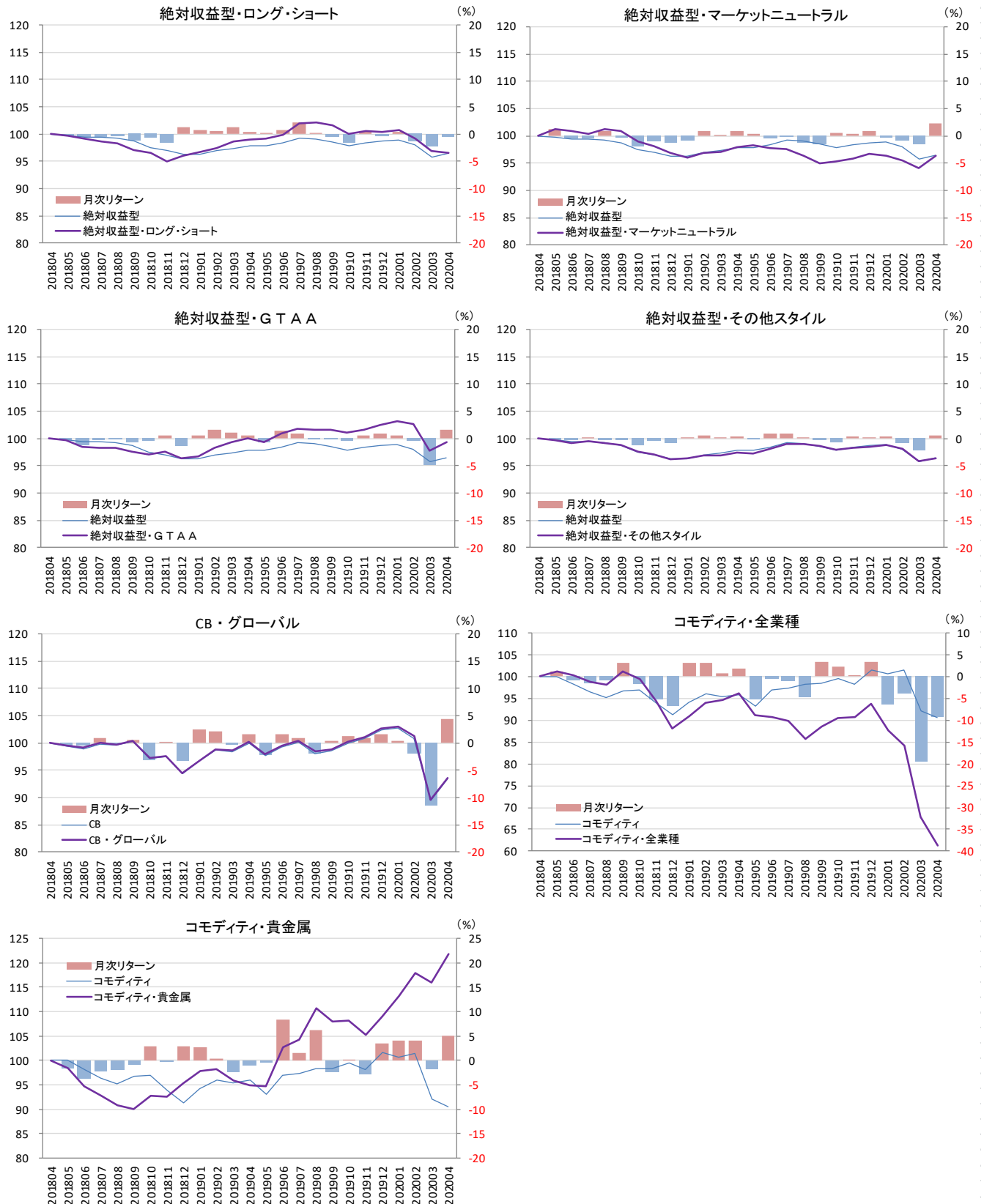


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]





## ＜1＞パフォーマンス・サマリー

## (4) 対「総合」寄与度分析

## ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)		構成比(%)		寄与度(%)
	総合	5.00				
1	外国株式(先進国)・グローバル	10.44		19.25		1.98
2	外国株式(先進国)・その他	11.12		6.16		0.67
3	国内株式・一般	5.44		8.55		0.47
4	国内株式・その他	5.56		4.81		0.28
5	エマージング株式・その他	9.80		2.68		0.25
6	複合資産・安定成長	2.76		7.67		0.22
7	REIT・北米	4.87		3.34		0.16
8	REIT・グローバル	5.92		2.52		0.15
9	国内株式・小型	11.44		1.26		0.14
10	外国債券(先進国)・その他	3.60		3.58		0.13
11	複合資産・成長	4.74		2.11		0.10
12	エマージング株式・グローバル	8.59		1.11		0.09
13	複合資産・安定	1.64		4.86		0.08
14	外国債券(先進国)・グローバル	0.66		10.35		0.07
15	複合資産・その他	4.42		1.18		0.05
16	REIT・その他	8.13		0.64		0.05
17	ハイイールド債券・北米	2.46		2.06		0.05
18	ハイイールド債券・その他	4.98		0.55		0.03
19	国内債券・一般	0.31		6.05		0.02
20	ブルベア	4.59		0.30		0.02
21	国内株式・業種特化	11.32		0.10		0.01
22	ハイイールド債券・グローバル	2.10		0.49		0.01
23	エマージング株式・BRICS	10.74		0.09		0.01
24	CB	4.26		0.21		0.01
25	絶対収益型	0.65		1.35		0.01
26	エマージング債券・グローバル	0.42		1.25		0.01
27	複合資産・国内バランス	-0.02		1.83		-0.00
28	コモディティ	-1.73		0.36		-0.01
29	エマージング債券・その他	-0.42		1.39		-0.01
30	REIT・日本	-0.94		3.90		-0.05
	合計			100.00		5.00

## ◆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	-6.73		
1	国内株式・業種特化	-7.35	0.11	-0.00
2	国内債券・一般	0.22	5.47	-0.01
3	CB	-6.60	0.24	-0.02
4	ブルベア	-12.48	0.30	-0.02
5	エマージング株式・BRICS	-18.58	0.11	-0.02
6	コモディティ	-5.64	0.31	-0.02
7	絶対収益型	-1.40	1.19	-0.03
8	外国債券(先進国)・グローバル	-0.17	9.92	-0.07
9	複合資産・成長	-5.46	2.02	-0.08
10	複合資産・国内バランス	-3.90	1.57	-0.09
11	国内株式・小型	-9.18	1.48	-0.10
12	ハイイールド債券・グローバル	-15.26	0.55	-0.10
13	ハイイールド債券・その他	-14.54	0.66	-0.11
14	複合資産・安定	-1.88	4.56	-0.11
15	複合資産・その他	-0.65	0.65	-0.13
16	国内株式・その他	-7.74	4.79	-0.15
17	エマージング株式・グローバル	-12.68	1.27	-0.17
18	エマージング債券・その他	-11.55	1.61	-0.19
19	REIT・その他	-21.30	0.78	-0.20
20	外国債券(先進国)・その他	-5.68	3.63	-0.22
21	エマージング債券・グローバル	-14.06	1.39	-0.23
22	外国株式(先進国)・その他	-6.54	5.44	-0.30
23	複合資産・安定成長	-4.02	7.04	-0.31
24	外国株式(先進国)・グローバル	-3.16	18.63	-0.33
25	ハイイールド債券・北米	-14.89	2.32	-0.40
26	国内株式・一般	-8.80	9.27	-0.58
27	REIT・北米	-14.64	3.80	-0.61
28	REIT・日本	-13.91	4.56	-0.64
29	REIT・グローバル	-20.22	2.92	-0.69
30	エマージング株式・その他	-20.80	3.43	-0.81
	合計		100.00	-6.73

## ◆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	0.41	-2.83	49.33	11.25 ↑	11.21 ↑	11.89	0.02	-0.05	0.34
国内株式	2.25	1.84	79.99	16.36 ↑	17.10	17.55	0.05	0.02	0.34
一般	0.05	-1.41	67.97	16.39 ↑	17.34	17.84	0.00	-0.01	0.30
フリー	1.14	-0.90	68.63	16.67 ↑	17.65	18.46	0.03	-0.01	0.29
バリュー	-4.01	-3.27	67.34	15.57 ↑	16.43	16.57	-0.08	-0.04	0.32
小型	11.45	27.43	161.75	19.87 ↑	18.18 ↑	18.10	0.19	0.27	0.56
その他	5.30	5.02	94.13	15.68 ↑	16.69	17.27	0.11	0.06	0.40
日経225	9.89	10.90	107.65	16.42 ↑	17.09	17.58	0.20	0.12	0.43
TOPIX	1.58	1.17	77.62	15.01 ↑	16.24	16.88	0.04	0.02	0.35
JPX日経400	0.82	-1.17	-	14.79 ↑	15.85	-	0.02	-0.01	-
国内債券	1.65	4.60	14.42	1.81	1.89	1.65	0.33	0.49	0.81
一般	1.65	4.60	14.42	1.81	1.89	1.65	0.33	0.49	0.81
外国株式(先進国)	10.72	5.93	80.84	17.38 ↑	17.07 ↑	16.87	0.20	0.07	0.36
グローバル	12.85	8.92	90.62	17.42 ↑	16.86 ↑	16.74	0.24	0.10	0.40
除く日本	8.44	8.69	110.84	18.11 ↑	18.14 ↑	18.52	0.15	0.09	0.42
含む日本	14.25	8.99	85.77	17.29 ↑	16.56 ↑	16.38	0.27	0.11	0.39
その他	5.11	-0.93	62.15	17.46 ↑	17.71 ↑	18.22	0.10	-0.01	0.27
北米	-0.03	-7.15	21.50	20.64 ↑	19.90 ↑	21.80	0.00	-0.07	0.09
米国	18.25	10.93	83.28	17.17 ↑	18.23 ↑	18.21	0.34	0.12	0.34
カナダ	-13.83	-28.30	-22.56	21.03 ↑	18.52 ↑	18.28 ↑	-0.23	-0.35	-0.14
欧州	-5.73	-6.68	59.89	17.91 ↑	17.37 ↑	19.28	-0.11	-0.08	0.25
ドイツ	-18.24	-20.55	-	21.45 ↑	21.91 ↑	-	-0.30	-0.20	-
イギリス	-23.27	-34.40	-	18.42 ↑	17.78 ↑	-	-0.46	-0.45	-
アジア・オセアニア	-1.26	-7.82	68.05	16.82 ↑	17.23 ↑	18.41	-0.02	-0.09	0.29
オーストラリア	-30.13	-29.38	5.36	23.45 ↑	21.52 ↑	21.92 ↑	-0.48	-0.31	0.02
ニュージーランド	21.69	35.66	-	18.12 ↑	18.76 ↑	-	0.38	0.34	-
複合地域	-44.65	-56.07	-	32.17 ↑	27.57 ↑	-	-0.55	-0.55	-
エマージング株式	-11.22	-18.30	10.90	20.27 ↑	19.27 ↑	19.48 ↑	-0.19	-0.20	0.05
グローバル	-1.82	-14.09	13.61	19.62 ↑	18.97 ↑	19.19	-0.03	-0.16	0.07
BRICS	-0.28	-5.80	18.80	23.19 ↑	22.35 ↑	22.33	-0.00	-0.05	0.08
その他	-14.82	-20.21	11.99	20.93 ↑	19.71 ↑	19.67 ↑	-0.25	-0.22	0.06
欧州	-11.18	-9.56	-16.14	25.32 ↑	23.77 ↑	25.44	-0.15	-0.08	-0.07
ロシア	7.33	20.49	5.38	25.81 ↑	25.12 ↑	27.72	0.09	0.15	0.02
アジア・オセアニア	-6.62	-18.50	36.46	18.64 ↑	18.13 ↑	18.03	-0.12	-0.22	0.17
中国	34.89	5.65	102.69	19.71 ↑	21.80	21.90	0.54	0.05	0.33
インド	-23.58	-15.09	10.94	26.19 ↑	24.26 ↑	25.96 ↑	-0.33	-0.13	0.04
インドネシア	-38.79	-39.36	-11.77	28.15 ↑	26.16 ↑	24.60	-0.53	-0.36	-0.05
タイ	-18.51	-19.17	93.29	22.19 ↑	19.20 ↑	19.04 ↑	-0.29	-0.22	0.36
フィリピン	-32.57	-46.67	-	21.41 ↑	19.42 ↑	-	-0.57	-0.61	-
ベトナム	-12.67	-2.40	10.39	26.69 ↑	22.43 ↑	21.48	-0.16	-0.02	0.05
韓国	-18.12	-34.76	-3.36	22.17 ↑	19.60 ↑	20.65	-0.29	-0.42	-0.02
香港	3.25	-10.78	39.49	18.91 ↑	19.40	19.30	0.06	-0.11	0.17
台湾	1.87	-3.86	84.73	21.78 ↑	19.91	19.43	0.03	-0.04	0.32
中南米	-26.38	-32.77	-39.13	30.89 ↑	28.25	25.95 ↑	-0.31	-0.27	-0.19
ブラジル	-30.63	-35.00	-57.36	35.86 ↑	35.50	31.58	-0.32	-0.23	-0.26
メキシコ	-42.58	-51.66	-	29.67 ↑	26.17 ↑	-	-0.57	-0.52	-
中東・アフリカ	-15.90	-35.45	12.33	19.53 ↑	18.58 ↑	18.12	-0.28	-0.45	0.06
トルコ	-44.36	-56.59	-52.27	36.27	31.16	31.20	-0.49	-0.49	-0.23
複合地域	-12.74	-24.74	26.68	18.06 ↑	17.18 ↑	16.98	-0.24	-0.32	0.14

※[色塗りの基準] 累積リターン&gt;総合、リスク&lt;総合、シャープ・レシオ&gt;=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	0.41	-2.83	49.33	11.25 ↑	11.21 ↑	11.89	0.02	-0.05	0.34
外国債券(先進国)	0.75	-7.36	24.47	4.56 ↑	5.41	8.06	0.07	-0.28	0.27
グローバル	2.52	-4.71	25.76	3.77 ↑	4.78	7.28	0.23	-0.20	0.32
除く日本	4.75	-4.73	29.76	3.64	4.97	7.90	0.44	-0.19	0.33
含む日本	-0.08	-4.52	21.11	4.47 ↑	4.92 ↑	6.73	0.01	-0.18	0.28
その他	-4.08	-13.26	20.25	7.32 ↑	7.66 ↑	10.02	-0.18	-0.36	0.18
北米	-0.92	-3.47	-	4.63 ↑	4.71 ↑	-	-0.06	-0.14	-
米国	-2.33	-6.41	30.71	7.23 ↑	6.99 ↑	6.97 ↑	-0.10	-0.18	0.39
カナダ	-0.51	-17.84	-0.76	7.38	8.20	9.36	-0.02	-0.47	-0.01
欧州	2.78	-6.87	24.10	4.94	6.20	9.96	0.20	-0.22	0.22
イギリス	-5.03	-19.68	-	8.21	10.52	-	-0.20	-0.40	-
アジア・オセアニア	-6.67	-16.04	21.36	9.12 ↑	9.30 ↑	11.29	-0.24	-0.37	0.17
オーストラリア	-7.35	-16.02	17.63	9.23 ↑	9.38 ↑	11.55	-0.27	-0.36	0.14
ニュージーランド	-0.61	-9.81	-	9.36 ↑	9.79	-	-0.02	-0.21	-
複合地域	7.92	-2.39	22.75	4.35 ↓	6.49 ↓	9.51	0.60	-0.07	0.22
エマージング債券	-14.28	-12.00	10.08	12.17 ↑	12.24	13.31	-0.41	-0.20	0.07
グローバル	-16.46	-15.44	9.25	13.65 ↑	12.94	13.56	-0.42	-0.25	0.06
米ドル建て	-17.52	-15.45	10.70	14.07	13.29	13.83	-0.44	-0.25	0.07
現地通貨建て	-11.82	-17.77	-1.70	12.52 ↑	12.00	12.50	-0.32	-0.32	-0.02
その他	-12.29	-8.47	7.59	11.18	12.18	13.86	-0.38	-0.14	0.05
ロシア	-4.68	5.02	6.71	19.54 ↑	19.90 ↓	22.74	-0.08	0.05	0.03
アジア・オセアニア	-0.12	-2.80	36.59	7.10 ↑	7.58 ↑	9.07	0.00	-0.07	0.35
インド	-5.78	-0.81	-	9.51	10.40	-	-0.20	-0.01	-
インドネシア	-9.66	-6.27	-	16.38 ↑	16.14 ↑	-	-0.20	-0.08	-
ブラジル	-24.85	-14.73	-3.67	19.67 ↑	19.80	18.43	-0.46	-0.16	-0.02
メキシコ	-6.04	-28.73	-	18.70	17.51 ↑	-	-0.11	-0.37	-
トルコ	-35.50	-49.79	-	36.28	29.73	-	-0.37	-0.43	-
複合地域	-3.09	-20.34	-2.51	12.94 ↑	13.02 ↑	13.90	-0.08	-0.34	-0.02
ハイイールド債券	-12.73	-10.75	37.73	12.49 ↑	12.23	12.94	-0.35	-0.18	0.25
グローバル	-13.39	-10.70	29.87	12.61 ↑	12.26	13.17	-0.37	-0.18	0.20
北米	-11.70	-9.71	45.02	12.26 ↑	12.17	12.49	-0.33	-0.16	0.30
その他	-15.18	-14.14	30.53	14.02 ↑	13.22 ↑	15.93	-0.38	-0.22	0.17
欧州	-15.74	-15.60	39.29	14.83 ↑	14.00 ↑	17.17	-0.37	-0.24	0.19
アジア・オセアニア	-13.36	-8.07	-	12.23 ↑	11.50	-	-0.38	-0.14	-
複合地域	-0.70	-3.56	51.70	9.14 ↑	9.61 ↑	11.97	-0.02	-0.07	0.35
複合資産	1.64	-1.50	48.47	7.19 ↑	7.70 ↑	9.40	0.08	-0.04	0.43
安定	1.62	-2.17	39.76	5.03 ↑	5.55	7.72	0.12	-0.07	0.44
安定成長	2.08	-1.07	50.60	7.73 ↑	8.17 ↑	9.83	0.10	-0.02	0.42
成長	3.45	2.10	66.84	11.15 ↑	11.64 ↑	12.15	0.11	0.04	0.43
国内バランス	-0.12	0.52	23.90	4.27	4.14	6.84	0.00	0.03	0.31
安定	-0.75	2.01	21.22	4.04	3.39	3.54	-0.05	0.13	0.54
一般	3.19	2.65	33.52	8.64 ↑	8.96	9.89	0.13	0.06	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	0.41	-2.83	49.33	11.25 ↑	11.21 ↑	11.89	0.02	-0.05	0.34
国内REIT	-0.12	-3.44	120.48	15.43	13.31 ↑	17.43	0.00	-0.05	0.47
日本	-0.12	-3.44	120.48	15.43	13.31 ↑	17.43	0.00	-0.05	0.47
外国REIT	-8.52	-8.28	83.30	18.01 ↑	16.84 ↑	16.79	-0.16	-0.10	0.37
グローバル	-12.65	-15.56	66.29	18.88 ↑	17.37 ↑	16.96 ↑	-0.23	-0.19	0.31
除く日本	-8.36	-9.48	81.23	19.33 ↑	17.76 ↑	17.16 ↑	-0.15	-0.11	0.36
含む日本	-13.28	-16.34	64.68	18.76 ↑	17.29 ↑	16.92 ↑	-0.24	-0.20	0.30
北米	-5.05	-2.02	95.75	17.45 ↑	16.67	17.01	-0.10	-0.02	0.41
その他	-7.26	-7.28	86.93	20.12 ↑	17.80 ↑	16.97 ↑	-0.12	-0.08	0.38
欧州	-16.07	-24.25	-4.93	19.66	19.17 ↑	21.45	-0.29	-0.28	-0.02
アジア・オセアニア	0.82	2.81	118.31	19.05 ↑	17.13 ↑	16.75 ↑	0.02	0.03	0.48
オーストラリア	-29.30	-28.16	35.91	28.94 ↑	24.56 ↑	21.89 ↑	-0.38	-0.26	0.14
複合地域	-35.40	-41.93	17.21	26.51 ↑	23.20 ↑	21.68 ↑	-0.51	-0.44	0.07
複数国	0.18	4.93	134.31	16.48 ↑	15.07 ↑	15.77	0.01	0.07	0.56
その他									
絶対収益型	-1.48	-6.29	-8.07	2.52	2.25	3.54	-0.18	-0.56	-0.24
ロング・ショート	-2.96	-8.70	-6.77	3.62	3.20	3.67	-0.26	-0.55	-0.20
マーケットニュートラル	2.37	18.25	34.50	3.93	5.30	5.28	0.21	0.65	0.57
GTAA	0.14	0.17	10.62	3.96 ↑	3.22 ↑	3.12	0.03	0.02	0.32
その他スタイル	-2.85	-7.96	-12.99	2.39	2.34	5.15	-0.38	-0.69	-0.27
CB	-5.22	-8.26	17.03	8.47 ↑	8.32 ↑	10.19	-0.20	-0.20	0.15
アジア・オセアニア	-2.65	-5.64	38.79	12.39 ↑	12.26	12.19 ↑	-0.07	-0.09	0.27
日本	-4.83	2.48	33.98	5.45 ↑	5.76	6.23	-0.29	0.09	0.47
グローバル	-5.19	-8.10	19.27	8.63 ↑	8.38 ↑	10.63	-0.20	-0.20	0.16
コモディティ	-3.63	-27.83	-30.42	8.89	11.43	14.32	-0.13	-0.55	-0.25
全業種	-33.40	-50.91	-53.62	16.46 ↑	15.92 ↑	16.33 ↑	-0.77	-0.83	-0.45
貴金属	23.99	16.26	33.83	9.41 ↑	9.89	16.50	0.80	0.31	0.18
エネルギー	-45.93	-67.49	-74.59	33.41 ↑	30.91 ↑	27.69 ↑	-0.55	-0.65	-0.46
その他コモディティ	-30.81	-41.24	-24.77	18.45	17.22	19.13	-0.62	-0.58	-0.15

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

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

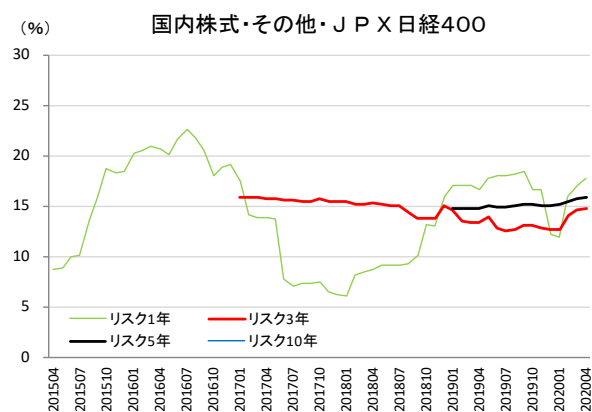
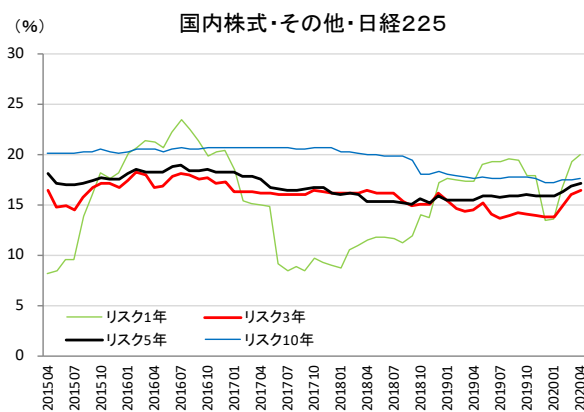
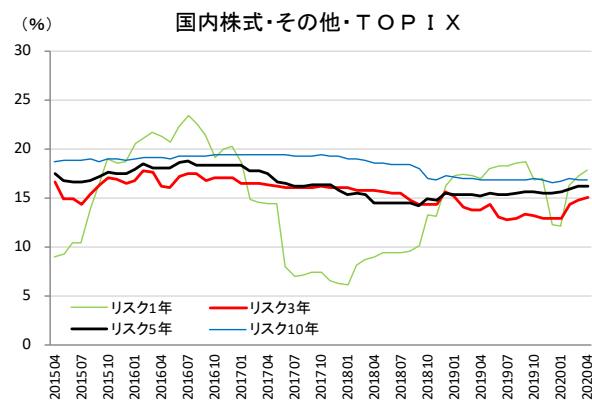
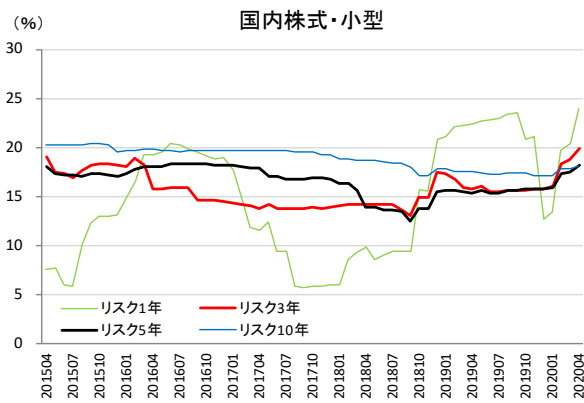
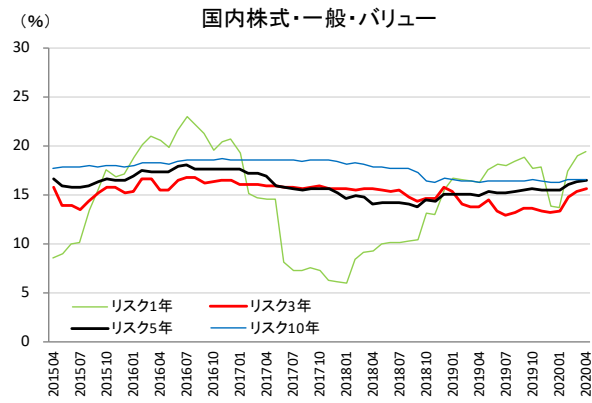
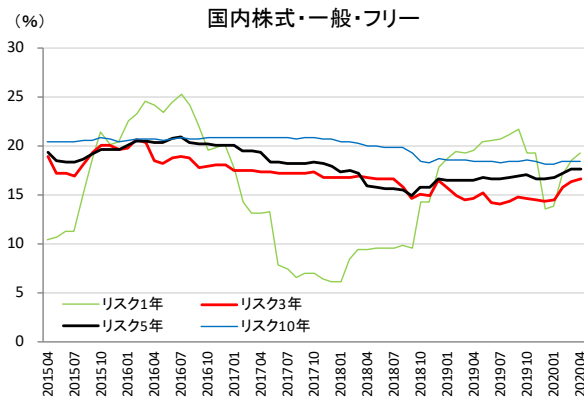


<2> リスク・サマリー

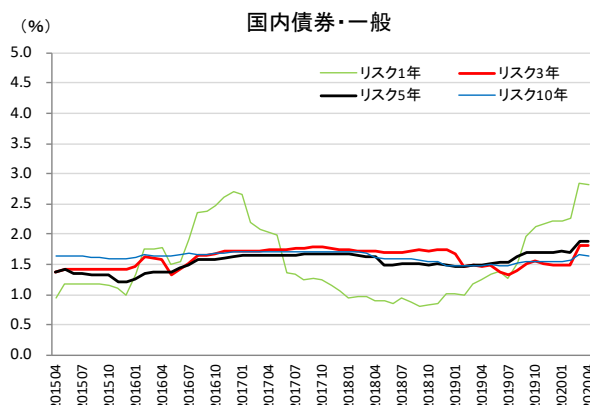
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

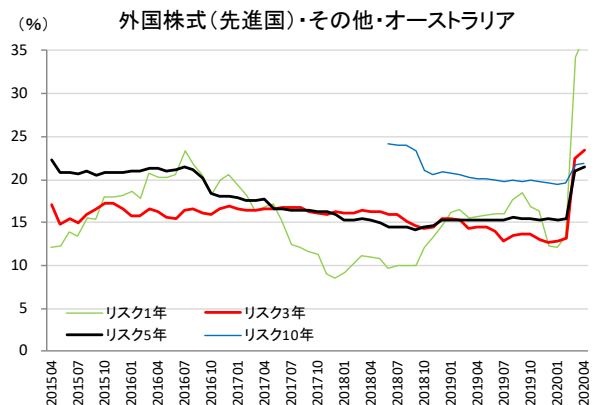
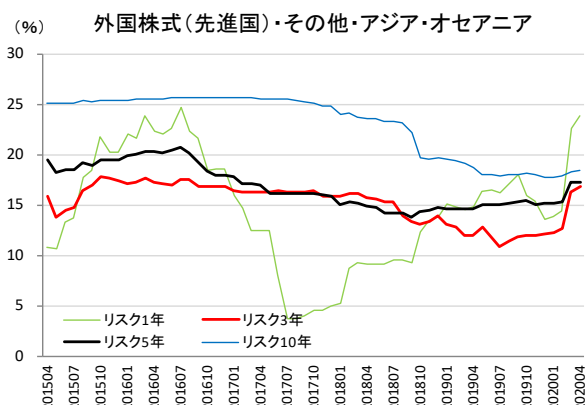
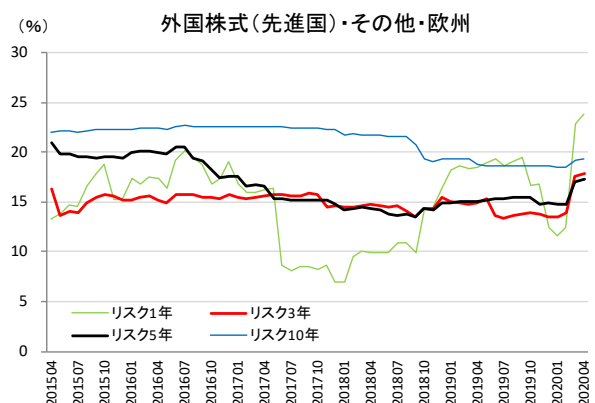
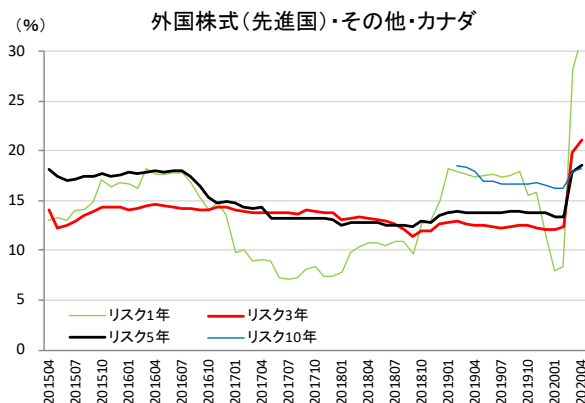
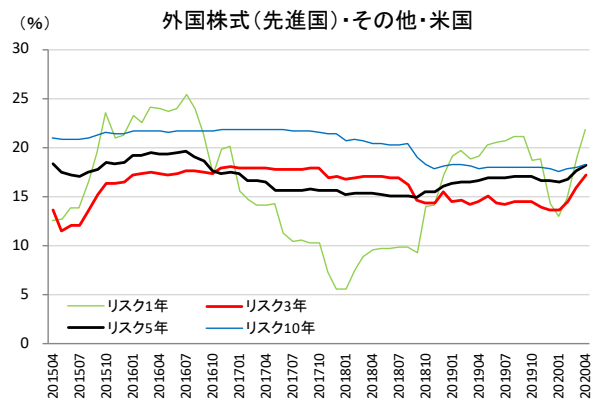
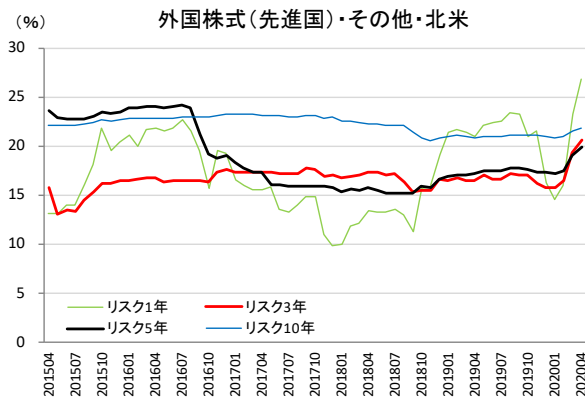
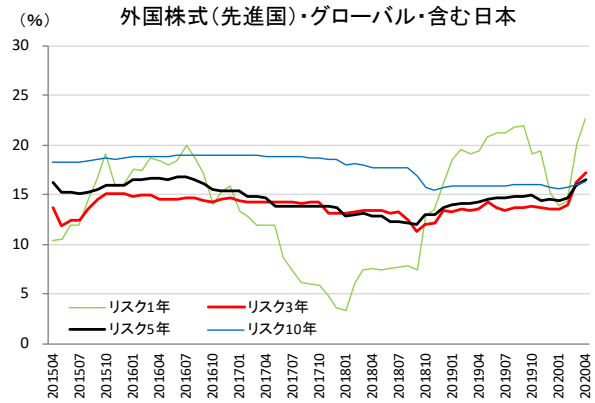
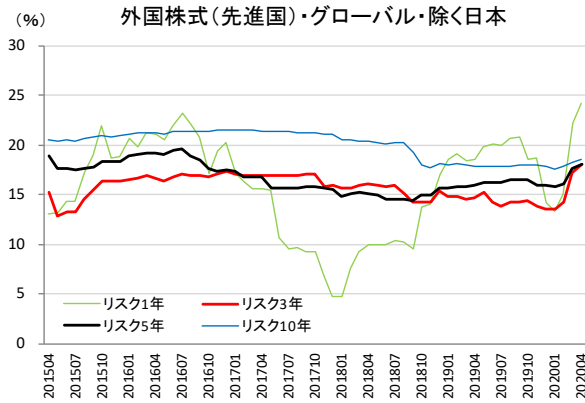


<2>リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

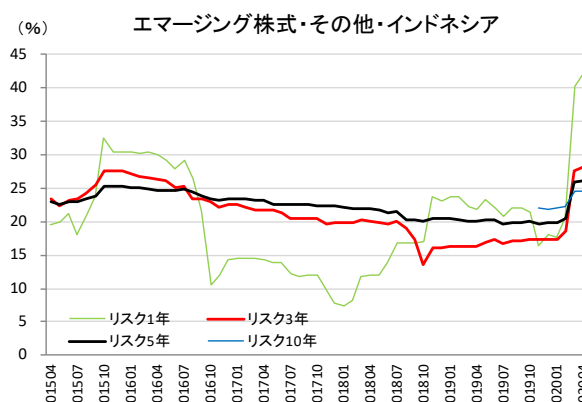
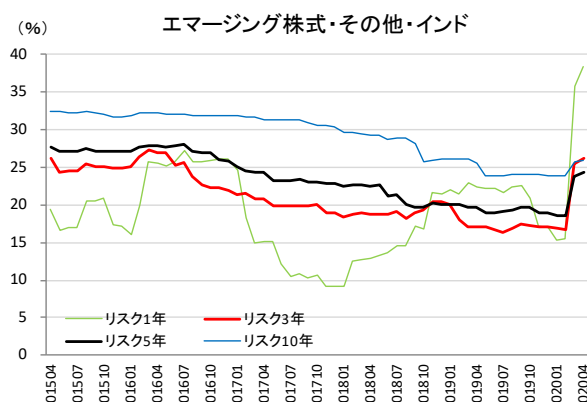
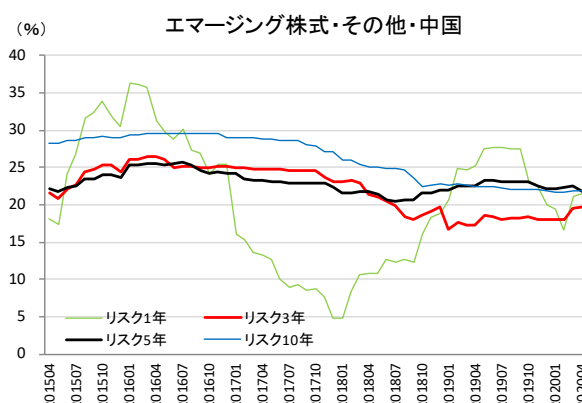
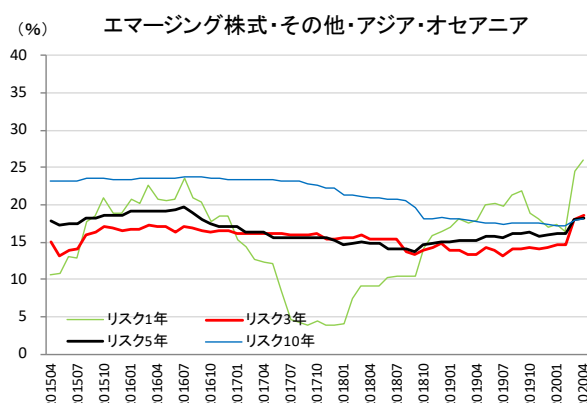
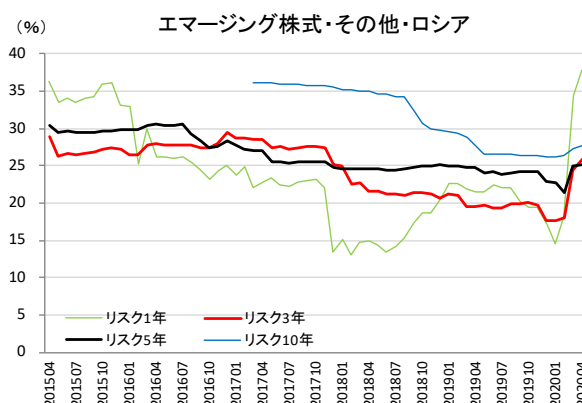
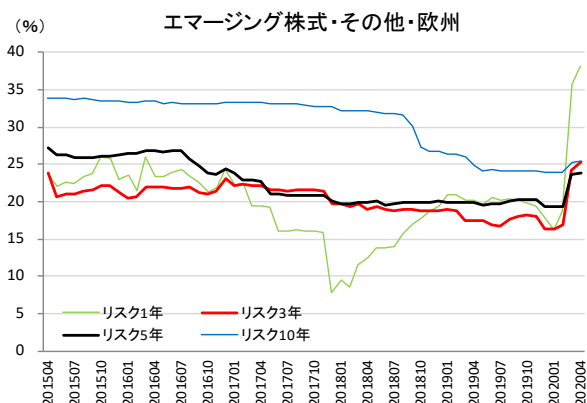
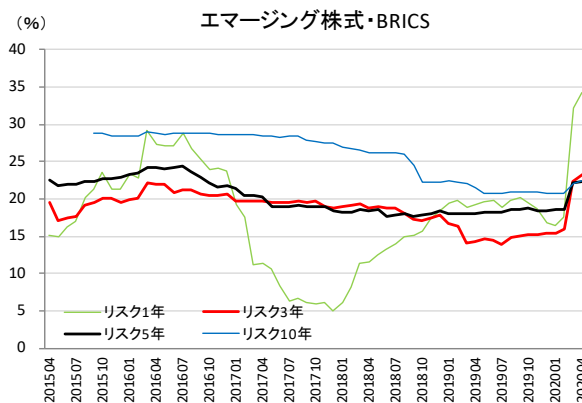
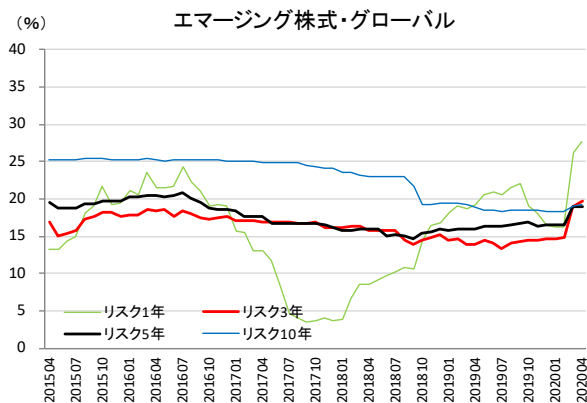


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

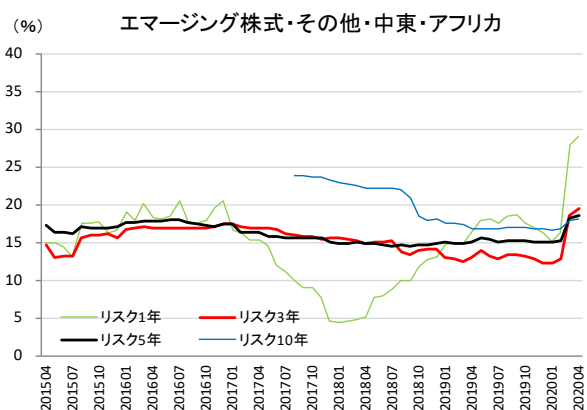
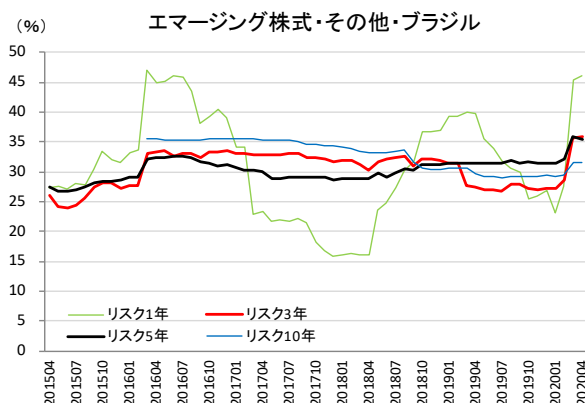
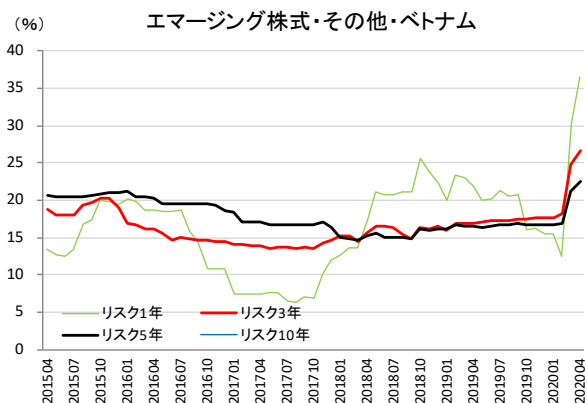
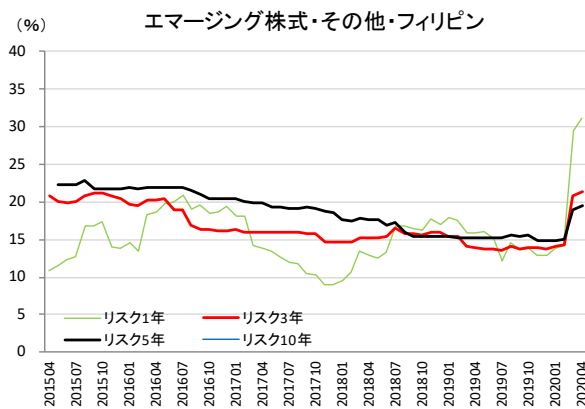
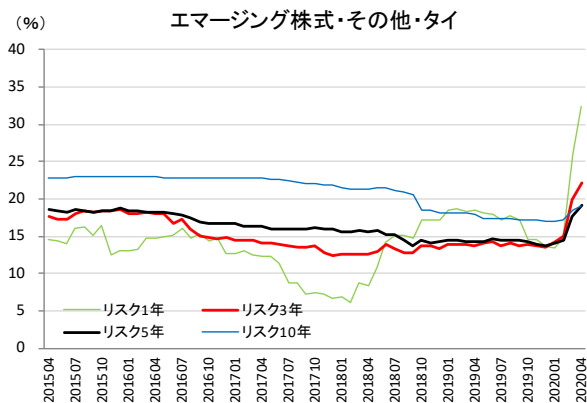


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

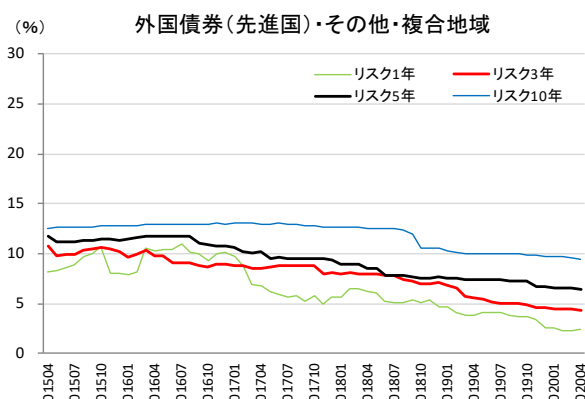
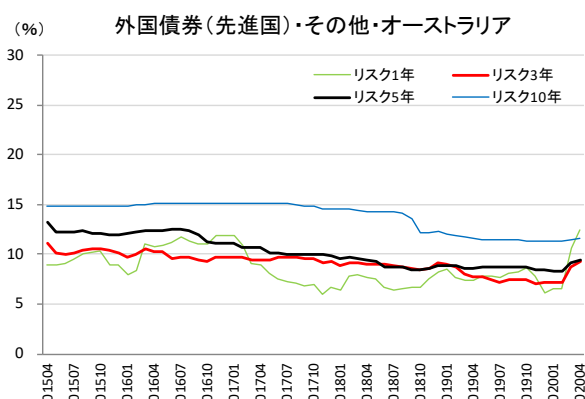
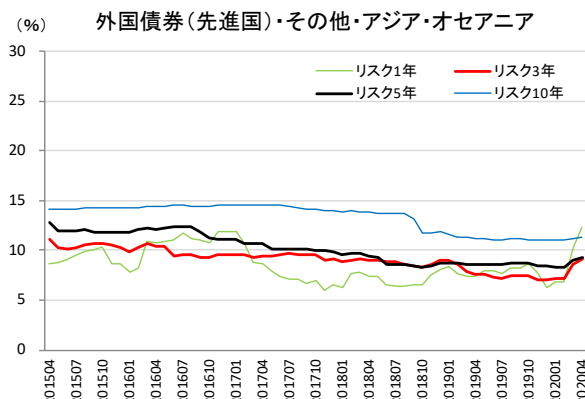
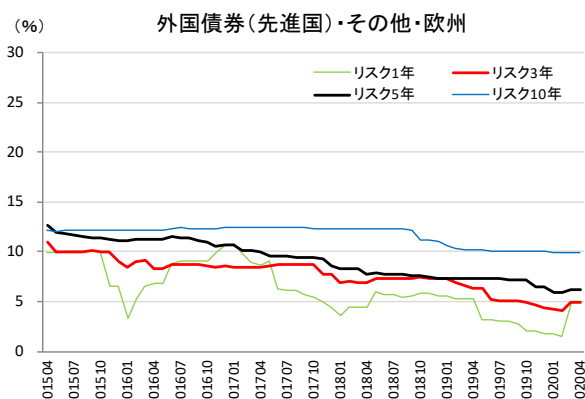
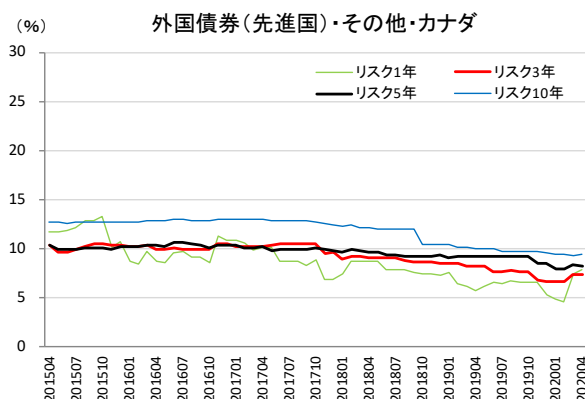
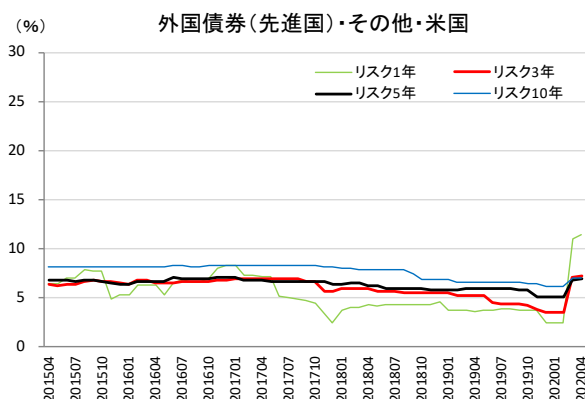
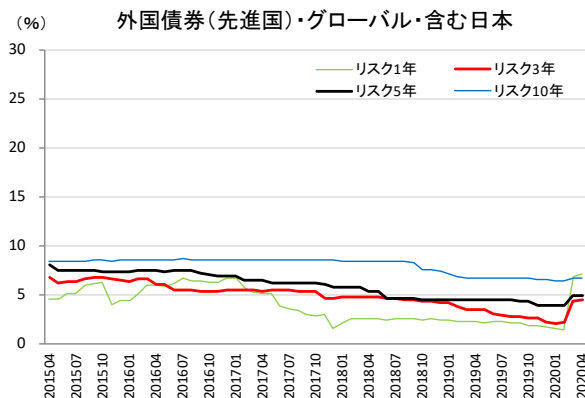
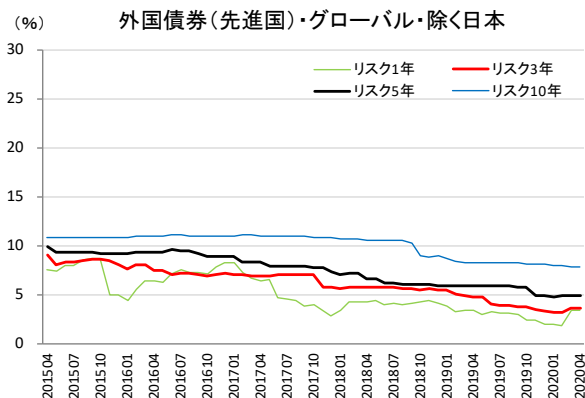


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

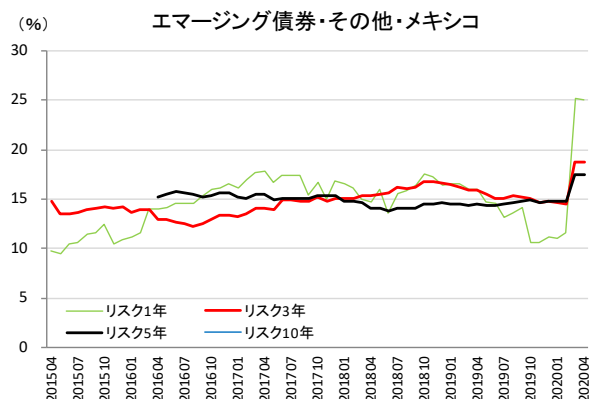
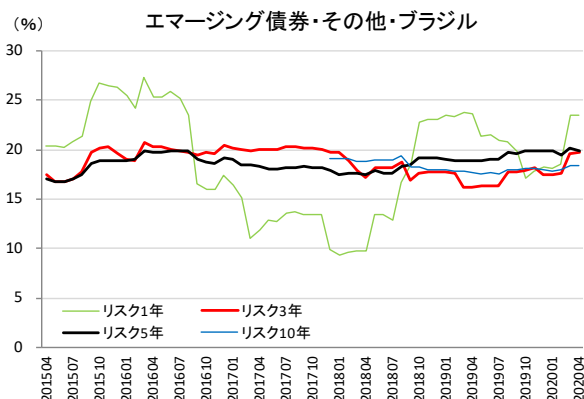
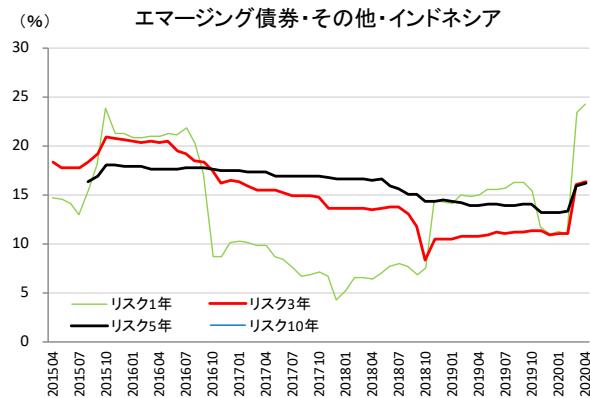
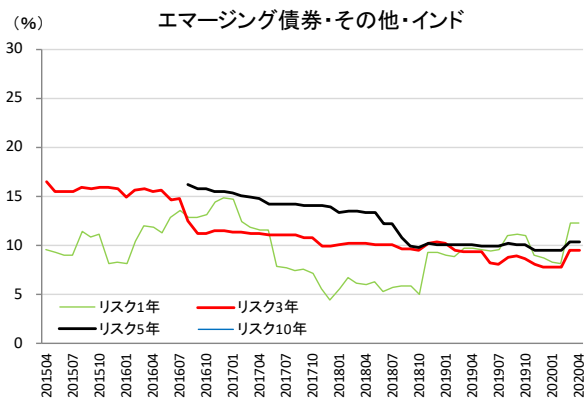
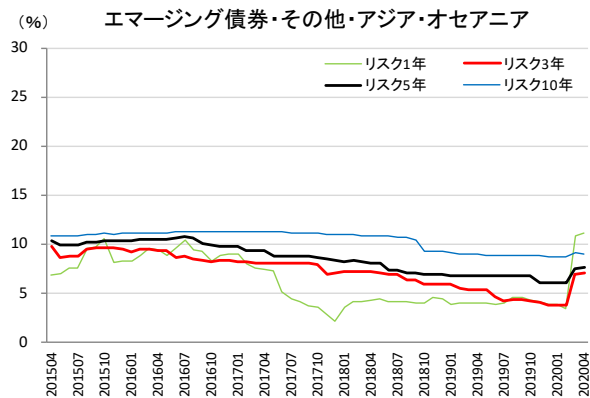
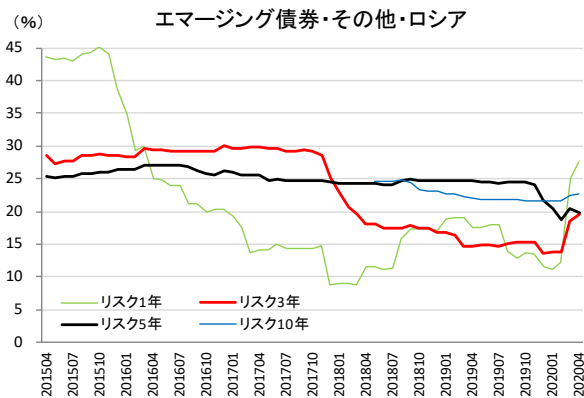
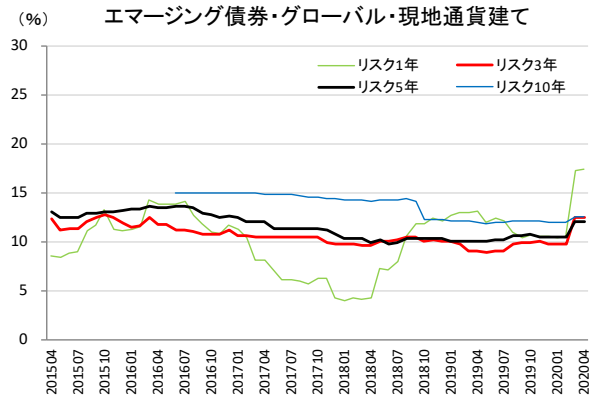
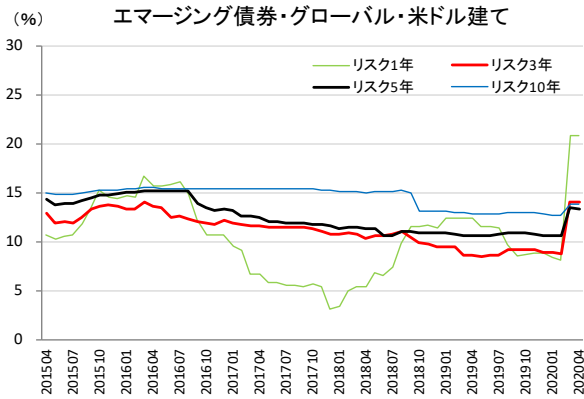


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

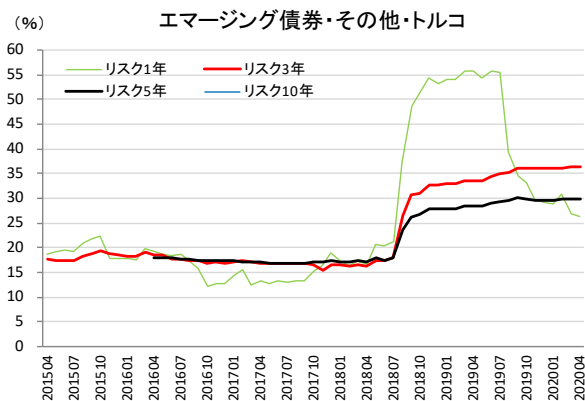


<2> リスク・サマリー

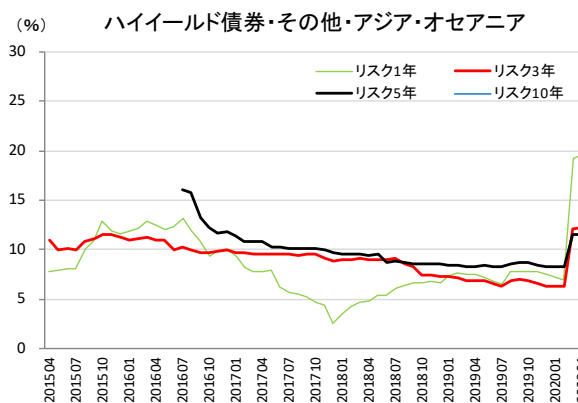
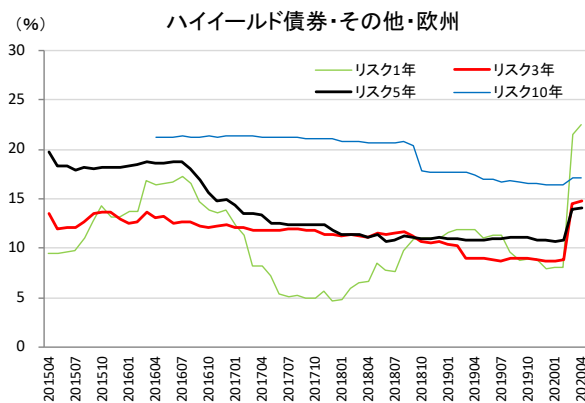
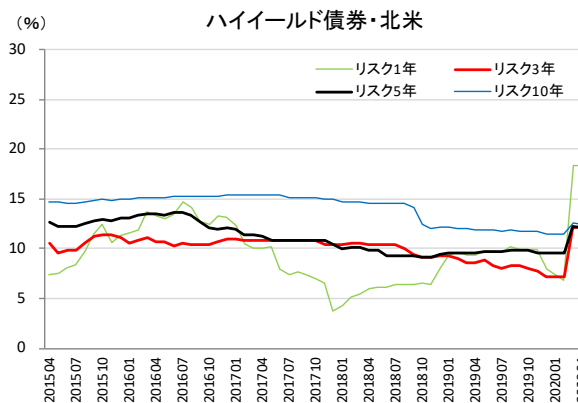
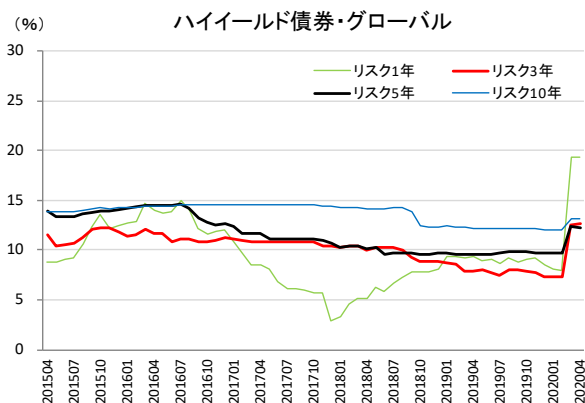
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

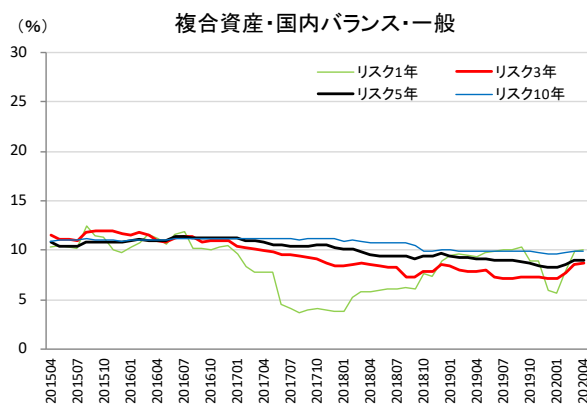
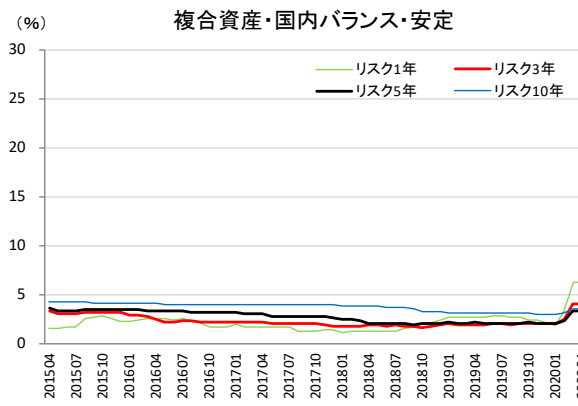
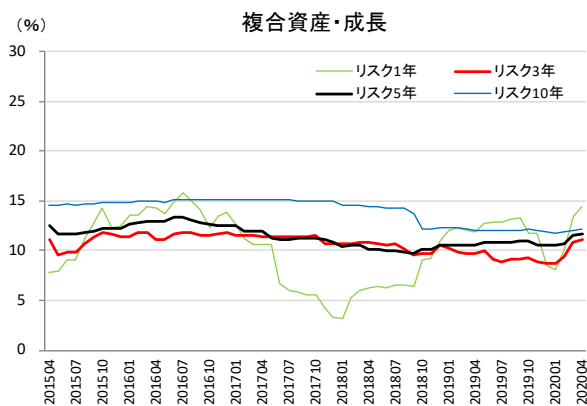
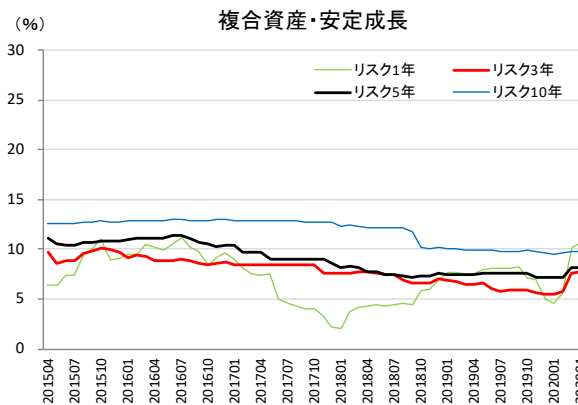
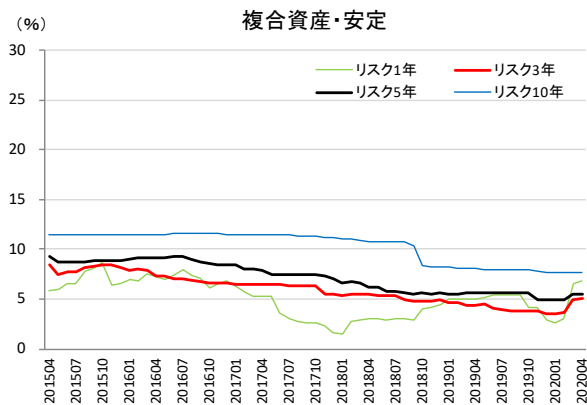


<2>リスク・サマリー

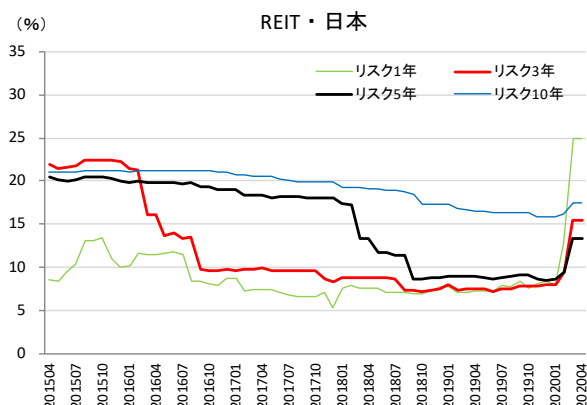
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]



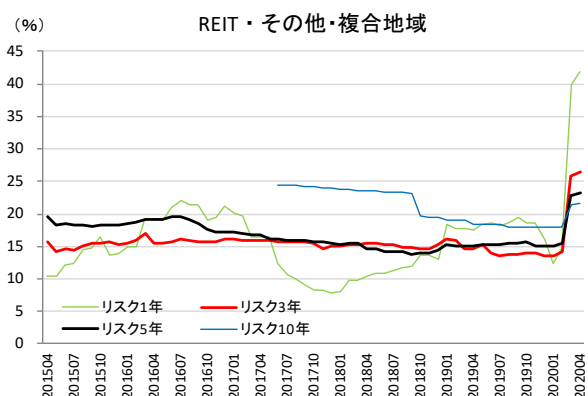
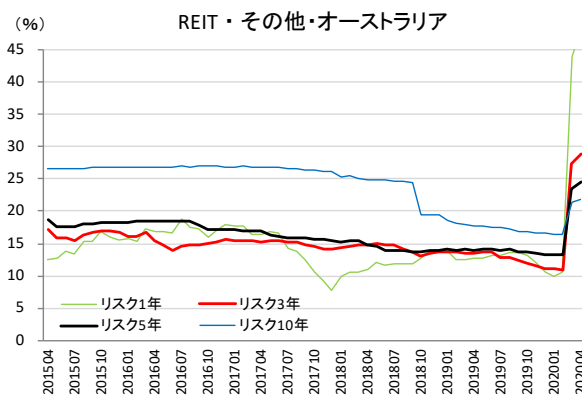
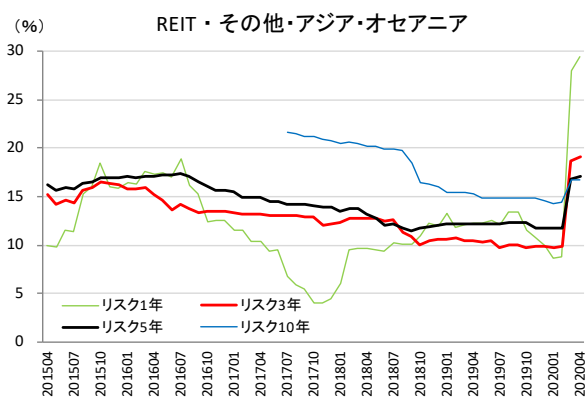
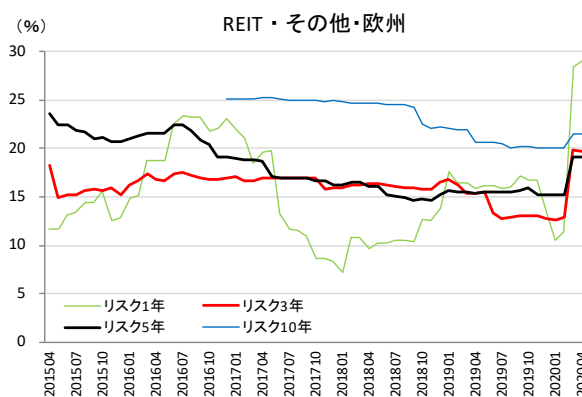
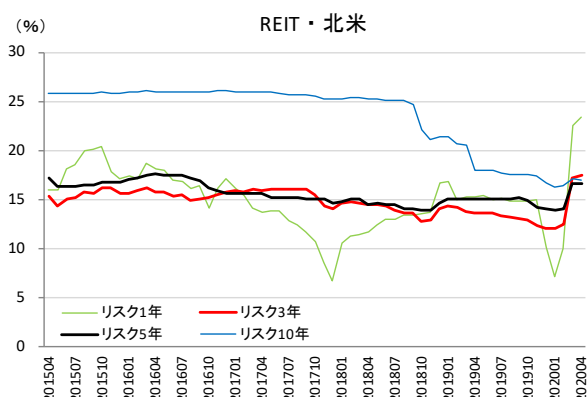
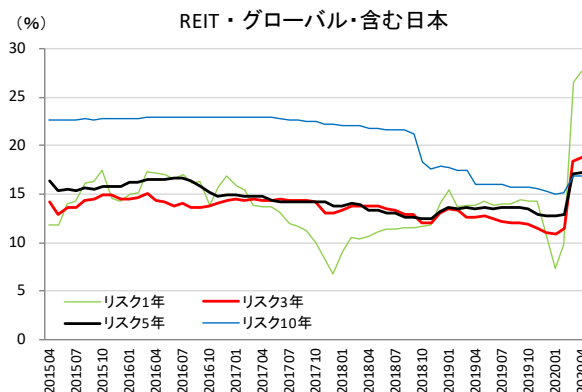
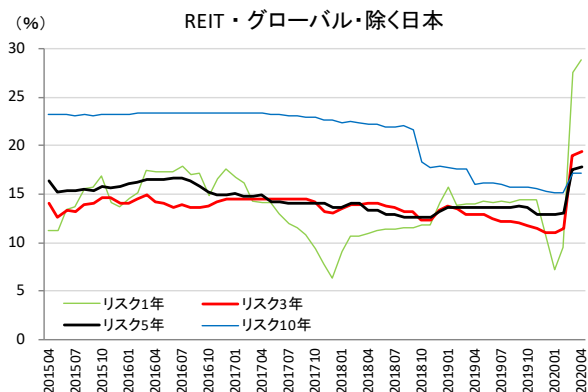


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

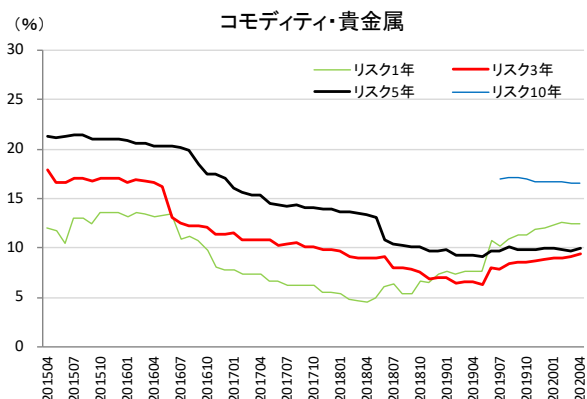
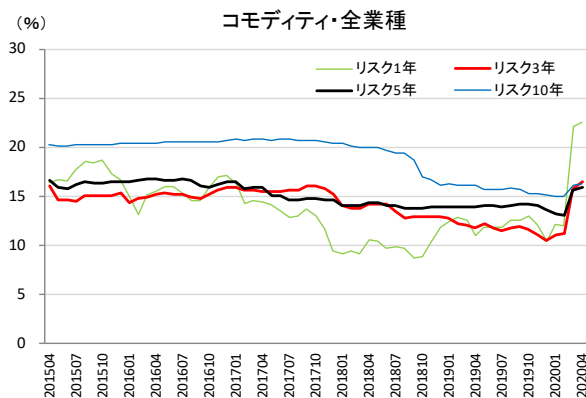
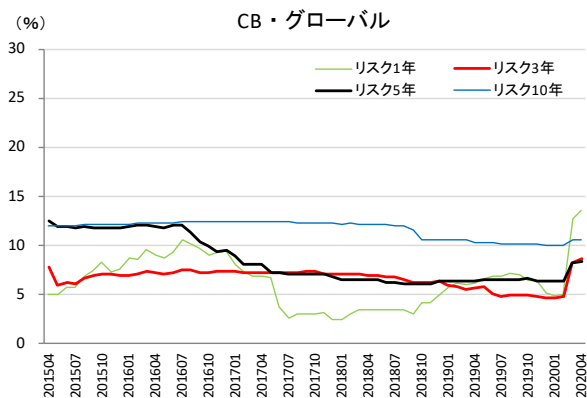
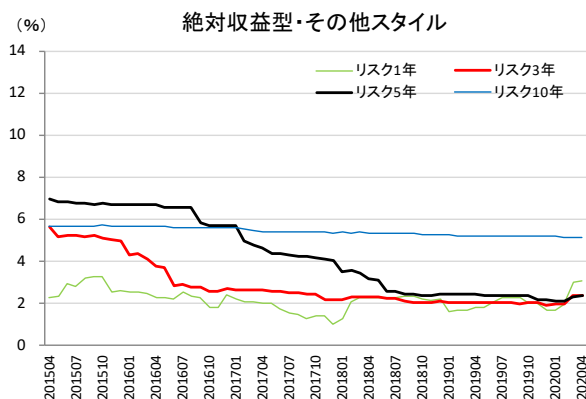
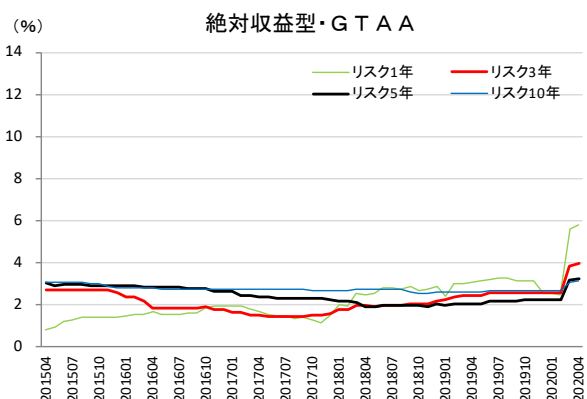
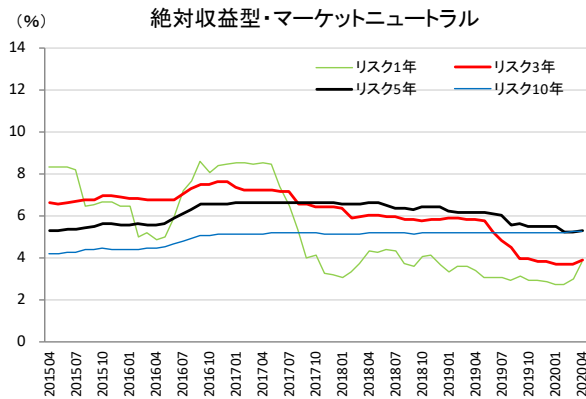
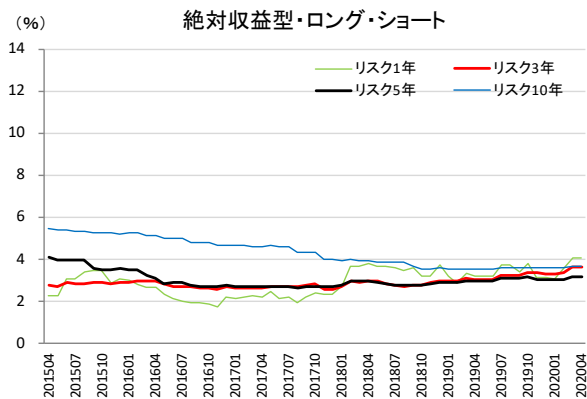


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



## &lt;3&gt; 設定・解約額 [ネット金額]

## 「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	1,536	6,956	5,040	13,326
国内株式	-268	706	-6,486	-11,472
一般	-102	-741	-5,150	-8,186
フリー	-58	-574	-4,592	-7,418
バリュー	-43	-167	-558	-767
小型	-93	-277	-1,426	-2,539
その他	-74	1,727	138	-667
日経225	-73	1,923	641	-456
TOPIX	-12	-329	-450	-36
JPX日経400	1	38	-67	-128
国内債券	-184	-135	519	913
一般	-184	-135	519	913
外国株式(先進国)	1,906	8,157	8,934	15,405
グローバル	978	3,908	1,332	6,455
除く日本	529	1,082	2,486	3,777
含む日本	449	2,827	-1,154	2,678
その他	929	4,249	7,602	8,950
北米	1	-5	-21	19
米国	896	4,218	7,653	9,058
カナダ	-1	-12	-50	-92
欧州	8	-33	-156	-336
ドイツ	0	0	-1	-3
イギリス	0	-1	-3	-7
アジア・オセアニア	-1	0	-7	-25
オーストラリア	25	82	189	338
ニュージーランド	0	-1	-1	-1
複合地域	1	0	0	-1
エマージング株式	39	-1,111	-3,455	-6,155
グローバル	103	-15	-586	-1,797
BRICS	1	-11	-52	-79
その他	-66	-1,084	-2,818	-4,279
欧州	-1	-3	-22	-38
ロシア	1	2	-5	-18
アジア・オセアニア	-8	-130	-504	-1,015
中国	-41	-273	-607	-1,008
インド	-19	-645	-1,692	-2,248
インドネシア	1	-4	-15	-31
タイ	0	-1	-7	-16
フィリピン	-1	-3	-9	-30
ベトナム	-7	-14	95	94
韓国	0	0	-1	-3
香港	0	1	1	3
台湾	0	0	0	0
中南米	0	-2	-7	-14
ブラジル	12	2	-18	38
メキシコ	0	0	-2	-3
中東・アフリカ	-1	-9	-13	28
トルコ	-1	-4	-11	-15
複合地域	0	-1	-1	-2

## &lt;3&gt; 設定・解約額 [ネット金額]

## 「総合」およびファンド分類別②

(単位: 億円)	当月	3か月	6か月	1年
総合	1,536	6,956	5,040	13,326
外国債券(先進国)	-341	-2,410	-3,527	-4,476
グローバル	-203	-1,676	-2,283	-3,474
除く日本	-66	-1,067	-1,477	-2,355
含む日本	-138	-608	-806	-1,119
その他	-138	-734	-1,244	-1,002
北米	0	-3	-4	-14
米国	-13	-149	-111	628
カナダ	-7	-41	-143	-284
欧州	-59	-158	-5	329
イギリス	0	-1	-4	-6
アジア・オセアニア	-13	-67	-189	-415
オーストラリア	-45	-251	-659	-1,036
ニュージーランド	-1	-9	-17	-28
複合地域	-15	-69	-126	-190
エマージング債券	-239	-848	-1,422	-2,032
グローバル	-118	-288	-352	-436
米ドル建て	-121	-267	-330	-420
現地通貨建て	3	-21	-22	-16
その他	-121	-560	-1,070	-1,596
ロシア	2	-5	-32	-100
アジア・オセアニア	-1	-11	-29	-38
インド	-42	-247	-501	-584
インドネシア	-2	-31	-92	-117
ブラジル	-26	-87	-138	-246
メキシコ	-2	-24	-88	-131
トルコ	-1	-8	-25	-33
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイイールド債券	-14	-433	-1,040	-1,883
グローバル	-17	-69	-101	-233
北米	36	-230	-677	-1,142
その他	-33	-134	-263	-508
欧州	-27	-106	-213	-408
アジア・オセアニア	-4	-22	-36	-69
複合地域	0	-1	-1	-4
複合資産	-444	1,269	8,176	17,450
安定	-617	-481	1,054	2,143
安定成長	57	390	1,584	4,026
成長	113	226	265	892
国内バランス	-56	32	1,182	3,077
安定	-53	46	1,243	3,196
一般	-2	-11	-46	-84
その他	59	1,102	4,091	7,311

## &lt;3&gt; 設定・解約額 [ネット金額]

## 「総合」およびファンド分類別③

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	1,536	6,956	5,040	13,326
国内REIT	488	640	593	1,753
日本	488	640	593	1,753
外国REIT	396	566	2,075	3,265
グローバル	265	293	905	1,712
除く日本	193	459	721	1,079
含む日本	71	-166	184	633
北米	123	317	1,170	1,499
その他	9	-44	-1	53
欧州	1	-5	-24	-50
アジア・オセアニア	1	-26	50	44
オーストラリア	7	-4	-4	104
複合地域	1	2	0	0
複数国	-1	-11	-22	-45
その他	198	553	672	559
絶対収益型	-22	74	411	529
ロング・ショート	-9	155	115	-80
マーケットニュートラル	-11	-144	-161	-226
GTAA	1	0	-14	-44
その他スタイル	-3	62	470	879
CB	-8	-54	-218	-366
アジア・オセアニア	0	-1	-5	-8
日本	-1	-5	-10	-16
グローバル	-7	-48	-204	-342
コモディティ	126	177	259	305
全業種	67	83	79	107
貴金属	-55	-52	32	47
エネルギー	114	144	145	146
その他コモディティ	1	1	3	4

## &lt; 4 &gt; 純資産額、ファンド本数

## 「総合」およびファンド分類別①

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	581,095	100.00	5,402	100.00
国内株式	86,471	14.88	883	16.35
一般	50,104	8.62	577	10.68
フリー	39,779	6.85	459	8.50
バリュー	10,325	1.78	118	2.18
小型	7,538	1.30	95	1.76
その他	28,214	4.86	204	3.78
日経225	14,694	2.53	69	1.28
TOPIX	11,391	1.96	75	1.39
JPX日経400	655	0.11	20	0.37
国内債券	34,109	5.87	136	2.52
一般	34,109	5.87	136	2.52
外国株式(先進国)	153,031	26.33	1,001	18.53
グローバル	115,612	19.90	652	12.07
除く日本	26,085	4.49	179	3.31
含む日本	89,527	15.41	473	8.76
その他	37,419	6.44	349	6.46
北米	346	0.06	12	0.22
米国	31,382	5.40	235	4.35
カナダ	227	0.04	3	0.06
欧州	1,290	0.22	54	1.00
ドイツ	21	0.00	1	0.02
イギリス	13	0.00	2	0.04
アジア・オセアニア	71	0.01	8	0.15
オーストラリア	4,053	0.70	32	0.59
ニュージーランド	11	0.00	1	0.02
複合地域	5	0.00	1	0.02
エマージング株式	22,784	3.92	350	6.48
グローバル	6,547	1.13	101	1.87
BRICS	516	0.09	7	0.13
その他	15,720	2.71	242	4.48
欧州	158	0.03	8	0.15
ロシア	96	0.02	4	0.07
アジア・オセアニア	4,966	0.85	106	1.96
中国	1,654	0.28	29	0.54
インド	6,902	1.19	31	0.57
インドネシア	116	0.02	7	0.13
タイ	62	0.01	4	0.07
フィリピン	53	0.01	5	0.09
ベトナム	914	0.16	10	0.19
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	46	0.01	2	0.04
ブラジル	535	0.09	16	0.30
メキシコ	13	0.00	3	0.06
中東・アフリカ	119	0.02	8	0.15
トルコ	53	0.01	4	0.07
複合地域	17	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	581,095	100.00	5,402	100.00
外国債券(先進国)	78,484	13.51	813	15.05
グローバル	58,127	10.00	520	9.63
除く日本	31,233	5.37	230	4.26
含む日本	26,894	4.63	290	5.37
その他	20,356	3.50	293	5.42
北米	87	0.01	6	0.11
米国	5,745	0.99	158	2.92
カナダ	1,154	0.20	6	0.11
欧州	1,570	0.27	37	0.68
イギリス	27	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	2,061	0.35	12	0.22
オーストラリア	8,101	1.39	40	0.74
ニュージーランド	146	0.03	14	0.26
複合地域	1,452	0.25	11	0.20
エマージング債券	14,620	2.52	290	5.37
グローバル	6,920	1.19	193	3.57
米ドル建て	5,469	0.94	152	2.81
現地通貨建て	1,451	0.25	41	0.76
その他	7,700	1.33	97	1.80
ロシア	170	0.03	5	0.09
アジア・オセアニア	418	0.07	13	0.24
インド	3,579	0.62	21	0.39
インドネシア	431	0.07	11	0.20
ブラジル	2,248	0.39	24	0.44
メキシコ	385	0.07	9	0.17
トルコ	127	0.02	5	0.09
複合地域	43	0.01	1	0.02
ハイイールド債券	17,441	3.00	306	5.66
グローバル	2,756	0.47	58	1.07
北米	11,563	1.99	157	2.91
その他	3,123	0.54	91	1.68
欧州	2,433	0.42	51	0.94
アジア・オセアニア	600	0.10	30	0.56
複合地域	41	0.01	1	0.02
複合資産	100,930	17.37	983	18.20
安定	27,478	4.73	291	5.39
安定成長	43,896	7.55	404	7.48
成長	12,340	2.12	242	4.48
国内バランス	10,272	1.77	33	0.61
安定	9,785	1.68	9	0.17
一般	398	0.07	19	0.35
その他	6,944	1.19	13	0.24

## &lt;4&gt; 純資産額、ファンド本数

## 「総合」およびファンド分類別③

	純資産額 (億円)	構成比(%)		本数	構成比(%)
総合	581,095	100.00		5,402	100.00
国内REIT	22,545	3.88		123	2.28
日本	22,545	3.88		123	2.28
外国REIT	38,146	6.56		289	5.35
グローバル	14,841	2.55		139	2.57
除く日本	3,478	0.60		51	0.94
含む日本	11,363	1.96		88	1.63
北米	19,593	3.37		82	1.52
その他	3,712	0.64		68	1.26
欧州	193	0.03		17	0.31
アジア・オセアニア	2,705	0.47		34	0.63
オーストラリア	546	0.09		13	0.24
複合地域	34	0.01		3	0.06
複数国	235	0.04		1	0.02
その他	12,534	2.16		228	4.22
絶対収益型	7,565	1.30		101	1.87
ロング・ショート	996	0.17		35	0.65
マーケットニュートラル	961	0.17		15	0.28
GTAA	401	0.07		14	0.26
その他スタイル	5,207	0.90		37	0.68
CB	1,173	0.20		41	0.76
アジア・オセアニア	31	0.01		1	0.02
日本	53	0.01		3	0.06
グローバル	1,090	0.19		37	0.68
コモディティ	1,988	0.34		27	0.50
全業種	656	0.11		14	0.26
貴金属	1,194	0.21		11	0.20
エネルギー	129	0.02		1	0.02
その他コモディティ	8	0.00		1	0.02



## &lt; 5 &gt; 属性、指標等（平均値）

## 「総合」およびファンド分類別①

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	10,481	8.4	3.39	4.37	1.266
国内株式	12,734	11.5	1.00	1.35	1.148
一般	11,633	11.2	1.25	1.81	1.423
フリー	11,390	10.7	1.37	2.04	1.468
バリュー	12,580	13.2	0.81	0.95	1.247
小型	17,841	11.9	1.26	1.43	1.741
その他	13,540	12.0	0.48	0.53	0.490
日経225	14,236	13.4	0.49	0.54	0.581
TOPIX	14,199	13.5	0.34	0.37	0.325
JPX日経400	12,227	5.7	0.04	0.04	0.547
国内債券	11,023	10.5	0.32	0.33	0.352
一般	11,023	10.5	0.32	0.33	0.352
外国株式(先進国)	11,400	6.7	3.86	4.84	1.567
グローバル	12,028	7.0	3.13	3.83	1.556
除く日本	14,368	9.2	0.68	0.89	0.732
含む日本	11,142	6.2	3.89	4.74	1.795
その他	10,227	6.2	6.27	8.18	1.602
北米	9,923	6.9	6.64	7.79	1.918
米国	11,045	5.6	5.13	5.64	1.564
カナダ	5,830	8.1	13.83	19.77	1.992
欧州	9,945	8.7	2.66	3.38	1.658
ドイツ	8,723	6.1	0.00	0.00	0.770
イギリス	4,359	5.9	14.12	23.06	1.943
アジア・オセアニア	7,650	6.0	4.67	5.99	1.697
オーストラリア	6,371	5.8	14.67	26.24	1.826
ニュージーランド	12,573	7.8	2.86	3.18	1.672
複合地域	4,950	7.0	0.00	0.00	1.705
エマージング株式	10,067	9.0	2.77	4.06	1.793
グローバル	9,242	6.9	1.73	2.36	1.432
BRICS	11,737	13.9	1.08	1.33	2.068
その他	10,363	9.8	3.26	4.85	1.934
欧州	7,398	14.1	0.20	0.26	1.984
ロシア	8,817	10.9	2.11	2.32	2.016
アジア・オセアニア	10,995	9.9	6.43	8.66	1.739
中国	18,323	10.0	1.61	1.67	1.969
インド	9,009	10.0	1.36	1.88	2.075
インドネシア	6,427	8.7	0.40	0.66	1.853
タイ	8,262	12.0	0.68	0.94	1.699
フィリピン	7,760	6.7	0.50	0.77	1.793
ベトナム	8,831	4.2	0.87	1.21	1.869
韓国	8,684	1.3	0.00	0.00	1.804
香港	13,556	10.7	1.84	2.29	0.858
台湾	9,851	7.4	0.00	0.00	1.661
中南米	5,231	13.3	0.00	0.00	2.041
ブラジル	3,704	10.1	11.12	29.52	1.934
メキシコ	5,459	6.4	0.00	0.00	1.919
中東・アフリカ	7,840	9.4	0.18	1.59	2.061
トルコ	5,014	13.8	0.00	0.00	2.036
複合地域	15,644	11.9	2.86	3.50	1.941

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目録見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

## &lt;5&gt; 属性、指標等 (平均値)

## 「総合」およびファンド分類別②

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	10,481	8.4	3.39	4.37	1.266
外国債券(先進国)	9,497	8.3	2.51	2.84	1.109
グローバル	10,118	8.6	1.83	1.98	1.047
除く日本	10,965	10.8	1.73	1.85	0.822
含む日本	9,446	6.9	1.94	2.14	1.307
その他	8,395	7.8	4.46	5.28	1.288
北米	9,706	6.0	1.83	2.06	1.811
米国	9,057	6.6	4.74	6.01	1.347
カナダ	7,534	7.8	4.01	4.31	1.369
欧州	8,009	9.9	1.24	1.38	1.042
イギリス	7,534	5.4	3.51	3.89	1.260
アジア・オセアニア	7,207	9.5	3.03	3.41	1.421
オーストラリア	7,277	10.9	5.56	6.49	1.261
ニュージーランド	8,797	5.6	2.47	2.70	1.348
複合地域	5,255	10.4	3.47	3.71	1.191
エマーシング債券	7,461	8.6	6.57	8.48	1.590
グローバル	7,567	9.3	5.82	7.90	1.556
米ドル建て	7,557	9.6	6.04	8.37	1.616
現地通貨建て	7,605	8.4	5.03	6.16	1.330
その他	7,251	7.3	7.22	9.01	1.621
ロシア	7,770	7.2	6.04	6.95	1.608
アジア・オセアニア	8,227	7.5	11.20	13.56	1.640
インド	8,494	5.4	7.20	8.49	1.699
インドネシア	6,337	7.7	7.00	8.27	1.665
ブラジル	6,749	10.3	7.47	10.58	1.591
メキシコ	5,393	7.4	5.76	7.17	1.395
トルコ	3,213	7.2	10.63	9.80	1.454
複合地域	3,563	13.7	4.73	5.61	1.210
ハイールド債券	7,300	8.9	8.47	11.28	1.693
グローバル	6,491	8.2	6.60	8.80	1.577
北米	7,967	10.2	8.32	10.97	1.700
その他	6,664	6.9	10.64	14.59	1.769
欧州	6,190	7.0	11.30	15.59	1.746
アジア・オセアニア	7,041	8.0	9.09	12.09	1.878
複合地域	4,029	16.1	5.24	5.96	1.800
複合資産	10,970	7.9	1.58	1.77	1.040
安定	10,556	7.5	0.93	1.02	1.116
安定成長	10,660	8.4	2.13	2.44	1.092
成長	12,122	8.0	0.48	0.54	0.921
国内バランス	10,381	8.2	2.14	2.31	0.941
安定	10,446	9.2	2.19	2.35	0.921
一般	10,607	9.0	0.88	0.97	1.363
その他	9,937	0.6	1.74	1.90	0.772

(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

## &lt;5&gt; 属性、指標等（平均値）

## 「総合」およびファンド分類別③

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	10,481	8.4	3.39	4.37	1.266
国内REIT	11,008	8.4	9.63	12.92	0.954
日本	11,008	8.4	9.63	12.92	0.954
外国REIT	8,666	7.2	10.48	14.79	1.557
グローバル	9,276	7.8	8.44	12.77	1.402
除く日本	10,812	6.2	6.08	10.58	1.089
含む日本	8,387	8.7	9.16	13.44	1.498
北米	8,137	7.4	12.36	16.73	1.630
その他	8,057	6.0	8.69	12.60	1.797
欧州	7,333	5.7	4.77	6.65	1.820
アジア・オセアニア	9,474	6.0	10.48	15.12	1.837
オーストラリア	6,134	5.4	4.30	7.00	1.713
複合地域	4,492	8.2	1.36	1.98	0.852
複数国	7,871	16.0	2.58	3.05	1.650
その他					
絶対収益型	9,962	5.2	0.09	0.09	1.670
ロング・ショート	10,057	4.6	0.68	0.67	1.480
マーケットニュートラル	10,342	4.8	0.08	0.08	1.236
GTAA	10,221	6.2	0.00	0.00	1.550
その他スタイル	9,619	5.7	0.01	0.01	1.796
CB	10,257	6.8	1.13	1.31	1.521
アジア・オセアニア	7,275	9.8	2.84	3.30	1.823
日本	10,399	9.0	0.21	0.22	1.019
グローバル	10,326	6.5	1.13	1.30	1.536
コモディティ	7,454	6.8	0.00	0.00	0.933
全業種	4,201	8.7	0.00	0.00	1.408
貴金属	11,847	4.3	0.00	0.00	0.659
エネルギー	4,216	11.2	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	7,911	3.6	0.00	0.00	0.506

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

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

**【照会先】**

三菱アセット・ブレインズ株式会社

コンサルティンググループ 川眞田 隆志

電話番号 : 03-6721-1013

Eメール : mab-index@mab.co.jp

〒107-0062 東京都港区南青山1丁目1番1号 新青山ビル西館8階

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

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

加入協会名 一般社団法人 日本投資顧問業協会