

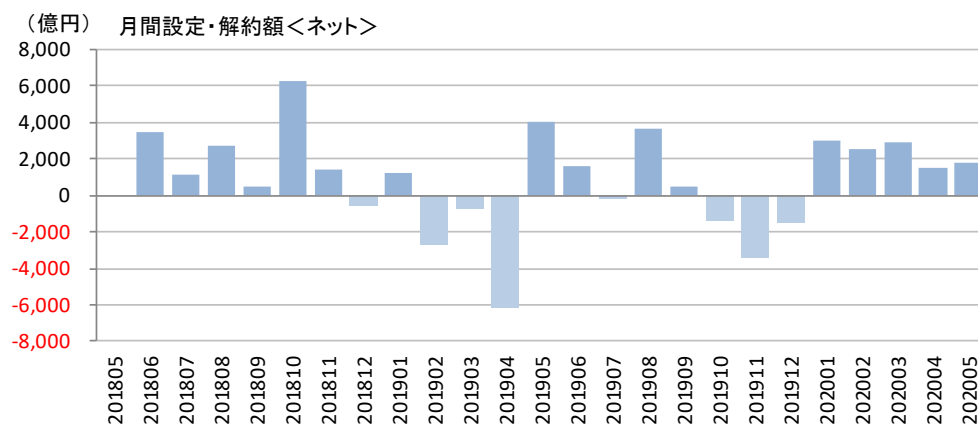
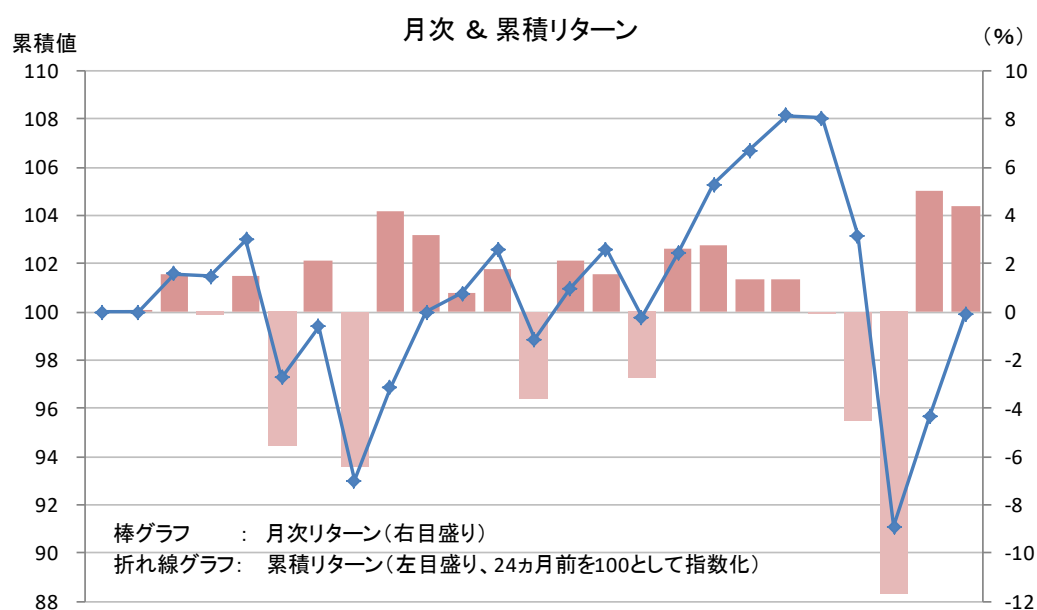
投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2020年5月

「総合」 +4.41 %

(前月 +5.00 %)



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

<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		12,575	12,044	531	4.41	
国内株式		15,340	14,151	1,189	8.40	
一般		14,921	13,775	1,146	8.32	
フリー		14,162	13,010	1,152	8.85	
バリュー		18,549	17,453	1,095	6.28	
小型		33,667	29,885	3,782	12.66	
その他		14,991	13,949	1,042	7.47	
日経225		14,468	13,362	1,106	8.28	
TOPIX		14,740	13,804	936	6.78	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	13,987	13,049	938	7.19	
国内債券		13,235	13,277	-42	-0.32	
一般		13,235	13,277	-42	-0.32	
外国株式(先進国)		14,813	13,980	833	5.96	
グローバル		16,415	15,514	901	5.81	
除く日本		21,741	20,791	950	4.57	
含む日本		15,201	14,319	883	6.16	
その他		11,504	10,809	696	6.44	
北米		10,843	10,299	545	5.29	
米国		17,867	16,871	996	5.91	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	14,152	13,782	370	2.68	
欧州		16,796	15,923	873	5.48	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	7,822	7,204	619	8.59	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	7,163	7,051	112	1.59	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	30,191	28,910	1,280	4.43	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	12,361	11,104	1,257	11.32	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	32,213	31,377	836	2.66	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	5,430	5,404	26	0.48	
エマージング株式		12,229	12,039	190	1.58	
グローバル		12,991	12,561	429	3.42	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	19,419	18,954	465	2.45	
その他		12,318	12,222	96	0.79	
欧州		21,474	19,838	1,636	8.25	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	9,389	8,678	710	8.18	
アジア・オセアニア		13,594	13,581	13	0.10	
中国		35,541	35,432	109	0.31	
インド	10,000 (2004.09.30)	23,894	24,135	-241	-1.00	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	9,549	8,739	810	9.27	
タイ		18,159	17,081	1,078	6.31	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	5,716	5,800	-84	-1.44	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	12,358	11,039	1,319	11.95	
韓国	10,000 (1997.06.30)	21,519	19,305	2,214	11.47	
香港		19,301	20,366	-1,065	-5.23	
台湾	10,000 (2008.03.31)	15,911	15,132	779	5.15	
中南米	7,427 (2006.04.28)	5,817	5,510	307	5.58	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	6,124	5,841	282	4.83	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	6,568	6,071	498	8.20	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	7,662	7,433	229	3.09	
トルコ		17,966	17,038	928	5.45	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	17,677	17,665	12	0.07	

※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		12,575	12,044	531	4.41
外国債券(先進国)		17,634	17,290	344	1.99
グローバル		18,117	17,791	326	1.83
除く日本		19,581	19,238	343	1.78
含む日本		17,209	16,889	320	1.89
その他		16,315	15,928	387	2.43
北米	9,052 (2013.05.31)	10,393	10,130	263	2.59
米国		15,191	14,831	360	2.43
カナダ	10,000 (2003.05.30)	13,695	13,483	211	1.57
欧州	10,000 (1998.07.31)	14,935	14,719	216	1.47
イギリス	10,069 (2014.07.31)	9,166	9,138	28	0.31
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	17,751	17,297	454	2.63
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	21,787	21,211	577	2.72
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	10,636	10,323	313	3.03
複合地域	10,000 (2001.11.30)	17,267	16,893	375	2.22
エマージング債券		15,446	14,673	773	5.27
グローバル		16,652	15,479	1,173	7.58
米ドル建て		17,050	15,795	1,255	7.94
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	11,925	11,229	697	6.20
その他	8,647 (2005.03.31)	11,381	11,029	352	3.19
ロシア	10,000 (2008.05.30)	10,664	9,983	681	6.82
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	13,996	13,541	456	3.37
インド	10,000 (2011.08.31)	15,106	14,612	494	3.38
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	12,793	11,836	957	8.08
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	9,954	9,866	88	0.89
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	11,063	9,902	1,161	11.72
トルコ	10,000 (2011.04.28)	5,496	5,376	120	2.24
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,005	9,534	471	4.94
ハイイールド債券		19,568	18,467	1,101	5.96
グローバル	10,000 (1997.06.30)	19,744	18,619	1,125	6.04
北米		19,048	17,935	1,114	6.21
その他	10,000 (2004.03.31)	19,540	18,616	924	4.96
欧州	10,000 (2006.04.28)	19,469	18,575	894	4.81
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	12,943	12,253	690	5.63
複合地域	10,000 (2004.03.31)	18,575	17,782	793	4.46
複合資産		16,694	16,298	397	2.44
安定	10,000 (1998.10.30)	15,215	14,957	258	1.73
安定成長		17,864	17,392	472	2.72
成長		19,751	18,996	756	3.98
国内バランス		12,476	12,425	50	0.40
安定		12,784	12,755	29	0.23
一般		13,861	13,322	538	4.04
その他	10,000 (2018.10.31)	11,757	11,343	414	3.65

※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		12,575	12,044	531	4.41	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	28,391	26,334	2,058	7.81	
日本	10,000 (2003.10.31)	28,391	26,334	2,058	7.81	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	22,073	21,554	519	2.41	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	18,748	18,331	416	2.27	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	20,317	19,820	497	2.51	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	18,803	18,398	405	2.20	
北米	10,000 (2003.09.30)	22,478	22,037	442	2.00	
その他	10,000 (2004.04.30)	22,194	21,121	1,073	5.08	
欧州	10,000 (2006.12.29)	4,607	4,465	142	3.19	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	16,811	16,239	572	3.52	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	11,268	9,869	1,399	14.18	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	4,902	4,672	230	4.91	
複数国	10,000 (2004.04.30)	30,510	29,578	932	3.15	
その他		5,787	5,587	200	3.58	
絶対収益型		7,644	7,615	29	0.38	
ロング・ショート		8,700	8,667	33	0.38	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	12,008	11,841	167	1.41	
GTAA		10,672	10,521	151	1.44	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,144	7,136	8	0.11	
CB		18,052	17,358	694	4.00	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	14,390	13,870	520	3.75	
日本		19,522	19,042	480	2.52	
グローバル		31,675	30,435	1,240	4.07	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	7,664	7,220	444	6.15	
全業種	10,000 (2004.12.30)	4,813	4,351	462	10.62	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	16,951	16,870	81	0.48	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	2,887	2,183	704	32.23	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	7,681	7,162	519	7.24	

※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	-3.17	-6.40	1.04	-7.63
国内株式	6.11	-5.91	6.23	-7.51
一般	5.52	-6.17	5.80	-7.83
フリー	6.47	-5.26	6.65	-6.98
バリュー	1.92	-9.62	2.64	-11.03
小型	17.42	-2.50	7.90	-4.25
その他	4.34	-6.21	6.79	-7.61
日経225	4.41	-5.07	8.05	-6.63
TOPIX	4.71	-6.80	5.80	-8.10
JPX日経400	4.75	-6.22	6.72	-7.51
国内債券	-1.69	-0.99	-0.69	-0.65
一般	-1.69	-0.99	-0.69	-0.65
外国株式(先進国)	0.57	-2.24	8.92	-5.03
グローバル	0.50	-1.79	10.01	-4.68
除く日本	-3.25	-7.67	2.90	-10.50
含む日本	1.62	0.02	12.19	-2.89
その他	0.79	-3.74	5.20	-6.20
北米	-1.60	-7.94	-0.05	-9.30
米国	4.66	0.60	11.25	-2.12
カナダ	-15.77	-17.71	-12.60	-18.96
欧州	-7.60	-9.56	-0.70	-13.03
ドイツ	-6.13	-12.82	-4.25	-14.73
イギリス	-14.07	-19.55	-16.43	-22.09
アジア・オセアニア	-7.66	-12.44	-4.60	-15.26
オーストラリア	-16.06	-22.52	-18.99	-23.82
ニュージーランド	-5.86	-6.65	-0.38	-12.37
複合地域	-24.61	-33.70	-36.47	-38.00
エマージング株式	-16.41	-17.50	-13.33	-20.18
グローバル	-10.29	-11.43	-2.62	-15.97
BRICS	-16.65	-18.90	-11.99	-23.91
その他	-18.72	-19.74	-17.15	-21.71
欧州	-14.60	-18.04	-9.78	-22.94
ロシア	-10.18	-10.99	-0.61	-17.73
アジア・オセアニア	-11.23	-12.38	-6.99	-16.31
中国	-5.18	3.57	19.87	-0.92
インド	-26.62	-27.37	-27.83	-27.51
インドネシア	-23.14	-28.36	-28.50	-33.50
タイ	-5.18	-20.60	-20.61	-19.13
フィリピン	-21.84	-30.60	-29.87	-30.80
ベトナム	-7.12	-15.19	-16.42	-14.18
韓国	9.90	10.74	6.97	3.41
香港	-14.54	-14.67	-13.81	-19.07
台湾	-0.39	-3.48	17.12	-7.89
中南米	-25.78	-30.64	-27.62	-37.07
ブラジル	-30.09	-37.00	-34.08	-43.27
メキシコ	-26.04	-28.48	-26.31	-32.35
中東・アフリカ	-12.91	-16.25	-15.51	-19.29
トルコ	-15.32	-18.45	-1.88	-20.79
複合地域	-10.71	-14.33	-8.94	-17.36

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別②

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	-3.17	-6.40	1.04	-7.63
外国債券(先進国)	-2.12	-1.05	1.21	-1.76
グローバル	-1.99	-0.31	2.20	-0.84
除く日本	-0.98	0.90	3.92	0.37
含む日本	-3.16	-1.68	0.26	-2.22
その他	-2.47	-3.07	-1.45	-4.24
北米	-2.63	-0.66	0.97	-0.51
米国	-5.61	-4.88	-1.62	-5.22
カナダ	-2.24	-1.92	0.69	-3.15
欧州	-3.12	-2.15	-1.74	-2.45
イギリス	-5.29	-4.75	-1.38	-5.89
アジア・オセアニア	-0.75	-2.94	-2.25	-4.85
オーストラリア	-1.21	-3.30	-2.66	-5.10
ニュージーランド	-0.35	-1.27	0.10	-4.15
複合地域	1.33	3.09	6.36	2.51
エマージング債券	-10.57	-9.85	-7.15	-12.11
グローバル	-11.22	-9.62	-6.68	-12.45
米ドル建て	-12.29	-10.38	-7.88	-13.17
現地通貨建て	-6.76	-6.54	-1.60	-9.53
その他	-9.97	-10.05	-7.52	-11.79
ロシア	-6.37	-7.24	3.78	-11.09
アジア・オセアニア	-4.75	-2.75	0.91	-3.39
インド	-6.87	-5.10	-3.31	-5.25
インドネシア	-8.29	-5.91	3.87	-7.17
ブラジル	-17.11	-20.74	-20.64	-24.10
メキシコ	-11.35	-7.77	-0.68	-12.32
トルコ	-5.65	-10.78	23.02	-9.41
複合地域	-10.29	-8.75	-4.41	-12.40
ハイイールド債券	-9.93	-10.07	-7.29	-12.39
グローバル	-10.63	-10.13	-8.14	-12.80
北米	-9.47	-9.49	-6.88	-11.84
その他	-10.97	-12.07	-8.09	-13.98
欧州	-11.26	-12.89	-8.25	-14.91
アジア・オセアニア	-10.65	-9.65	-8.31	-11.14
複合地域	-3.82	-3.25	-0.39	-5.04
複合資産	-3.18	-5.07	0.59	-5.76
安定	-2.36	-2.87	1.15	-3.45
安定成長	-3.16	-5.02	0.94	-5.95
成長	-0.97	-5.56	2.62	-7.01
国内バランス	-5.06	-7.37	-3.27	-6.93
安定	-5.25	-7.44	-3.61	-6.95
一般	-0.27	-5.02	2.66	-5.51
その他	-7.90	-10.11	4.87	-9.55

※[色塗りの基準]期間別リターン> 総合

<1>パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別③

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	-3.17	-6.40	1.04	-7.63
国内REIT	-15.28	-21.69	-8.41	-19.56
日本	-15.28	-21.69	-8.41	-19.56
外国REIT	-16.86	-20.62	-13.78	-19.90
グローバル	-18.88	-22.77	-16.04	-22.24
除く日本	-19.07	-22.79	-15.02	-22.28
含む日本	-18.82	-22.77	-16.29	-22.23
北米	-14.75	-18.93	-11.46	-17.80
その他	-19.38	-20.61	-16.40	-21.14
欧州	-20.12	-21.80	-15.22	-24.07
アジア・オセアニア	-18.39	-18.93	-15.51	-19.45
オーストラリア	-25.07	-27.34	-22.68	-28.02
複合地域	-27.96	-34.13	-27.78	-35.25
複数国	-13.95	-18.72	-9.34	-17.08
その他	-1.37	-2.40	3.03	-3.60
絶対収益型	-1.28	-1.54	-0.98	-1.85
ロング・ショート	-2.39	-3.69	-2.33	-3.47
マーケットニュートラル	2.20	1.94	-0.62	1.04
GTAA	-1.87	-0.86	1.31	-1.75
その他スタイル	-1.67	-1.84	-0.82	-2.08
CB	-3.67	-3.72	-0.62	-5.12
アジア・オセアニア	-8.56	-5.94	-2.89	-7.73
日本	1.60	-3.36	-1.06	-3.66
グローバル	-3.77	-3.67	-0.53	-5.12
コモディティ	-5.29	-2.20	3.13	-5.42
全業種	-19.40	-25.15	-25.57	-27.56
貴金属	3.64	16.20	29.17	12.35
エネルギー	-29.62	-39.14	-39.60	-42.06
その他コモディティ	-15.89	-23.93	-21.17	-26.93

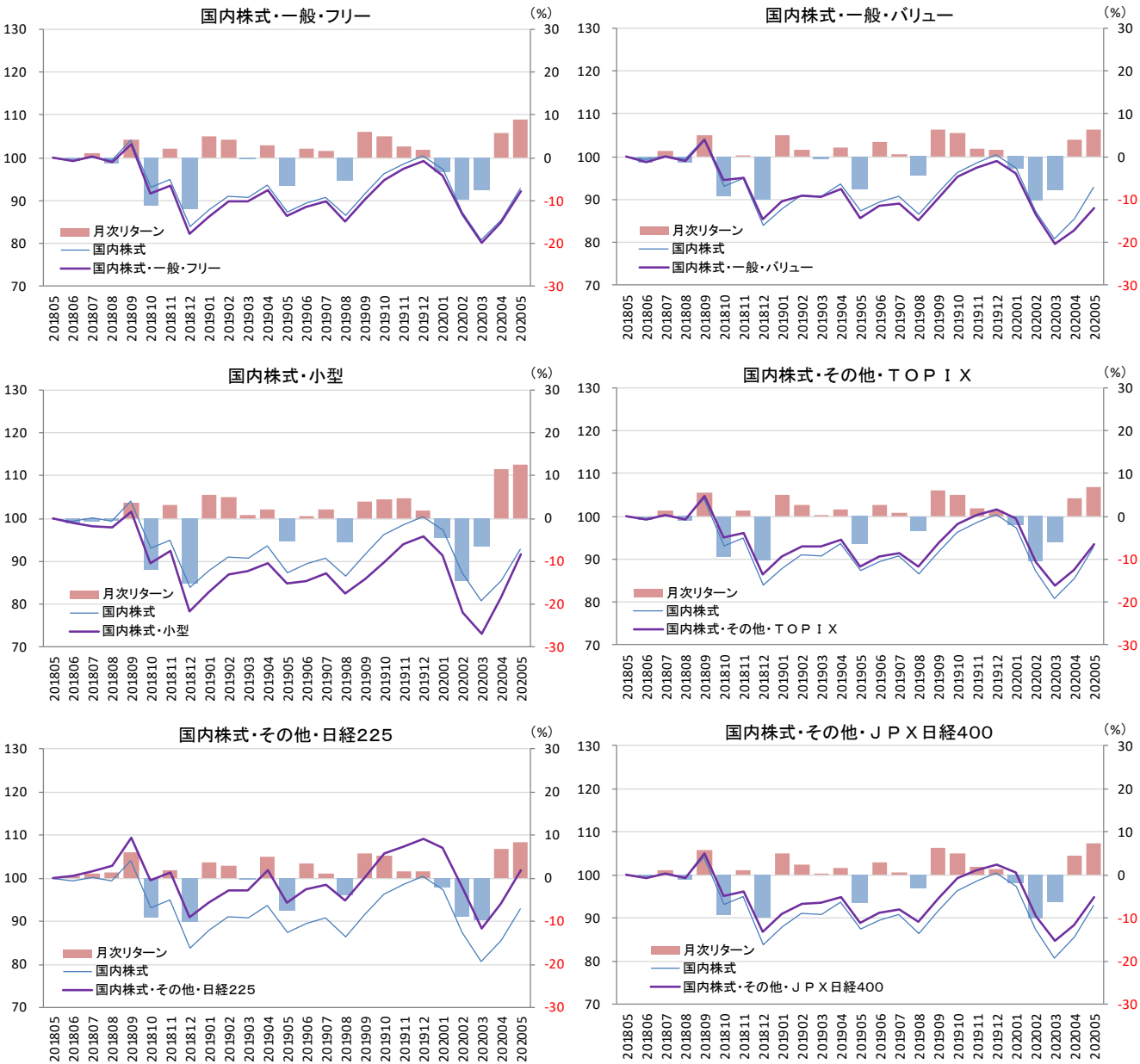
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

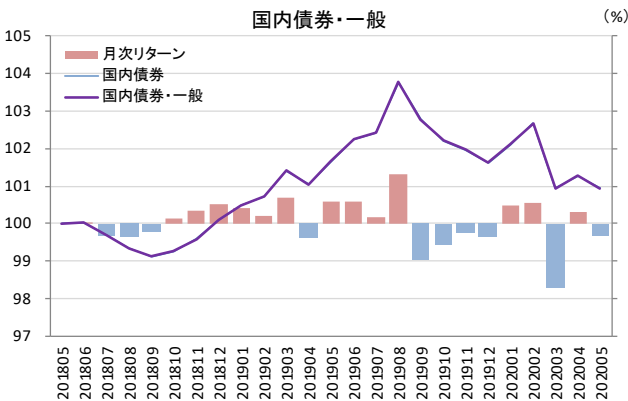
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

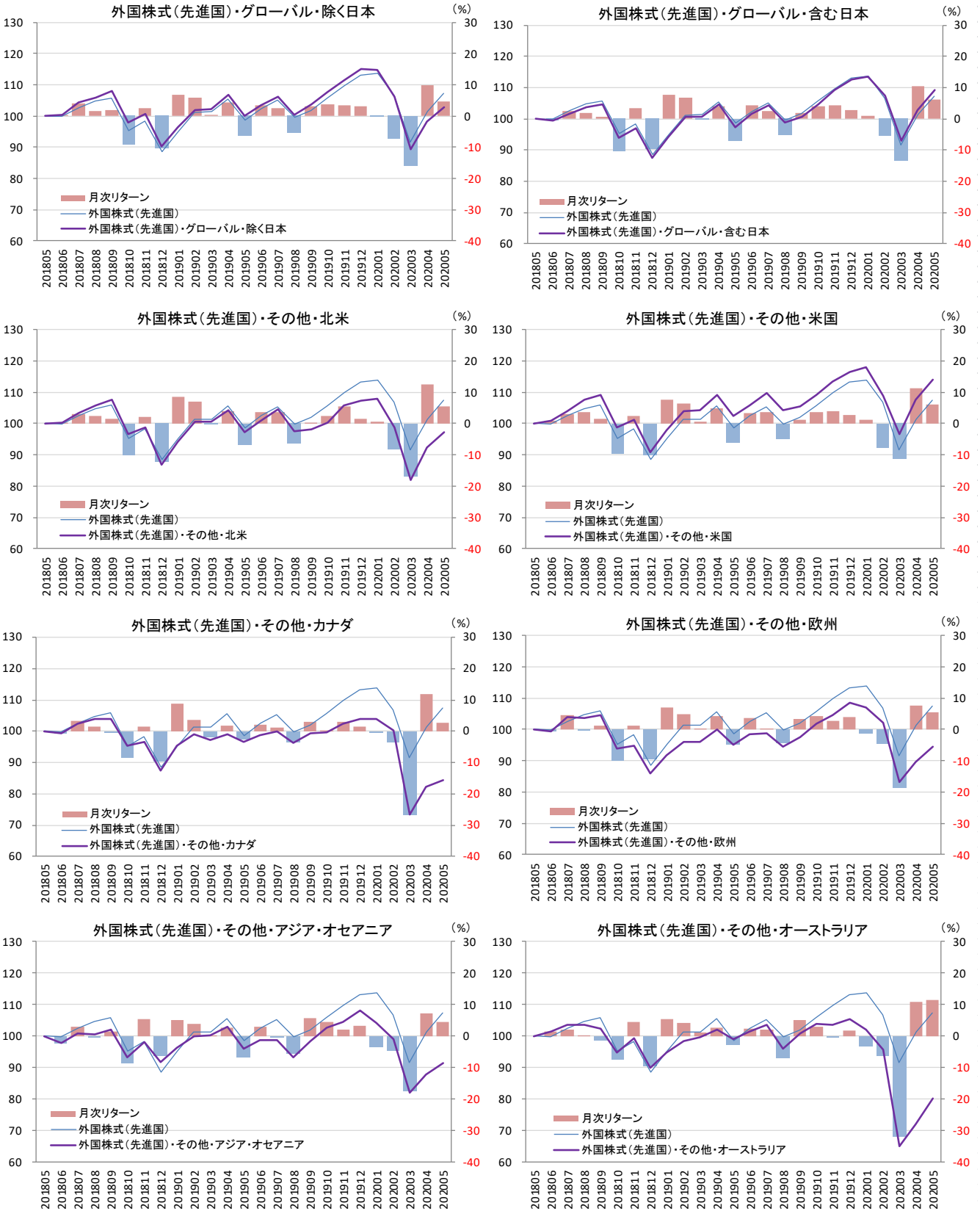


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

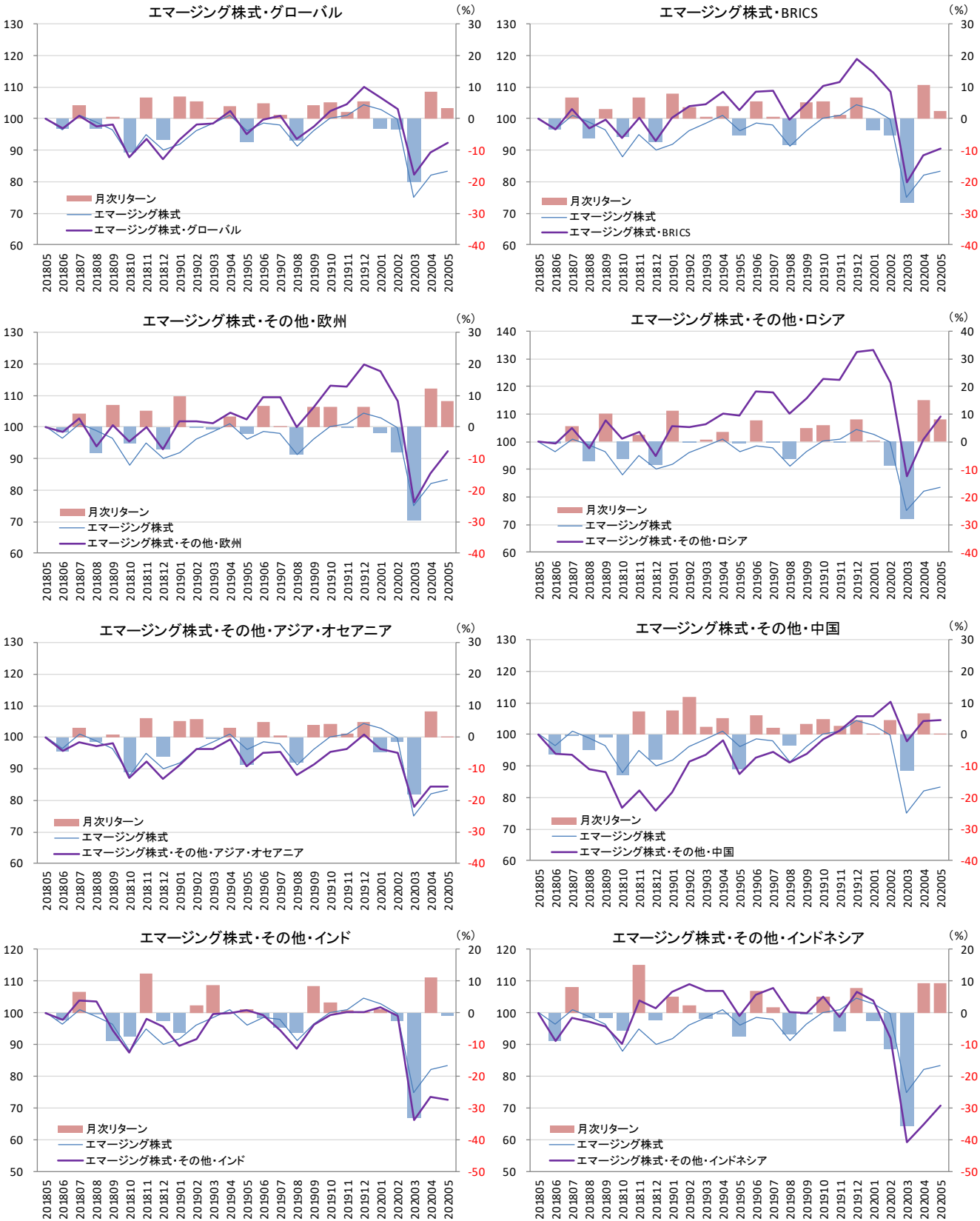


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24 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]

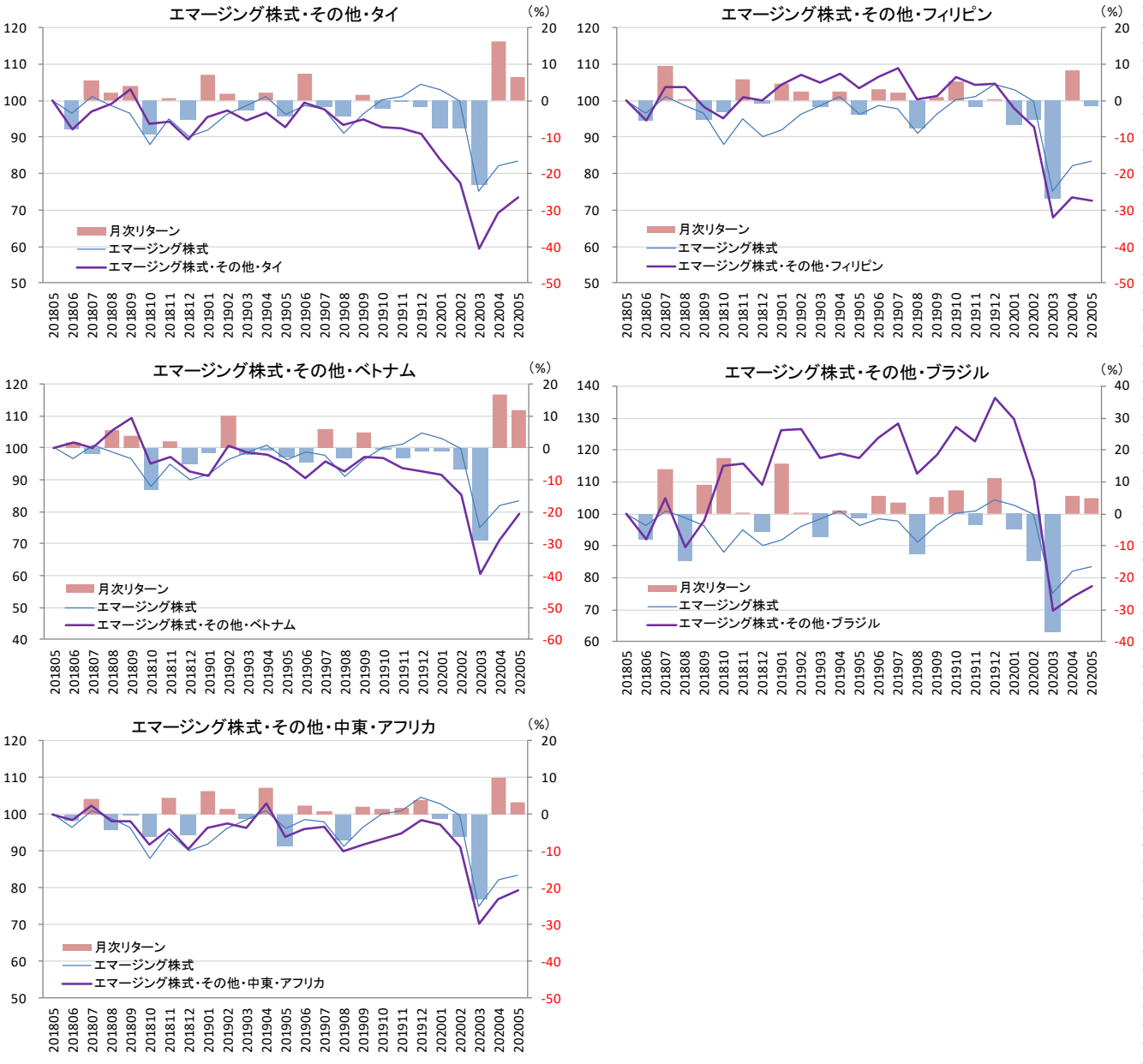


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24 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④

[エマージング株式]

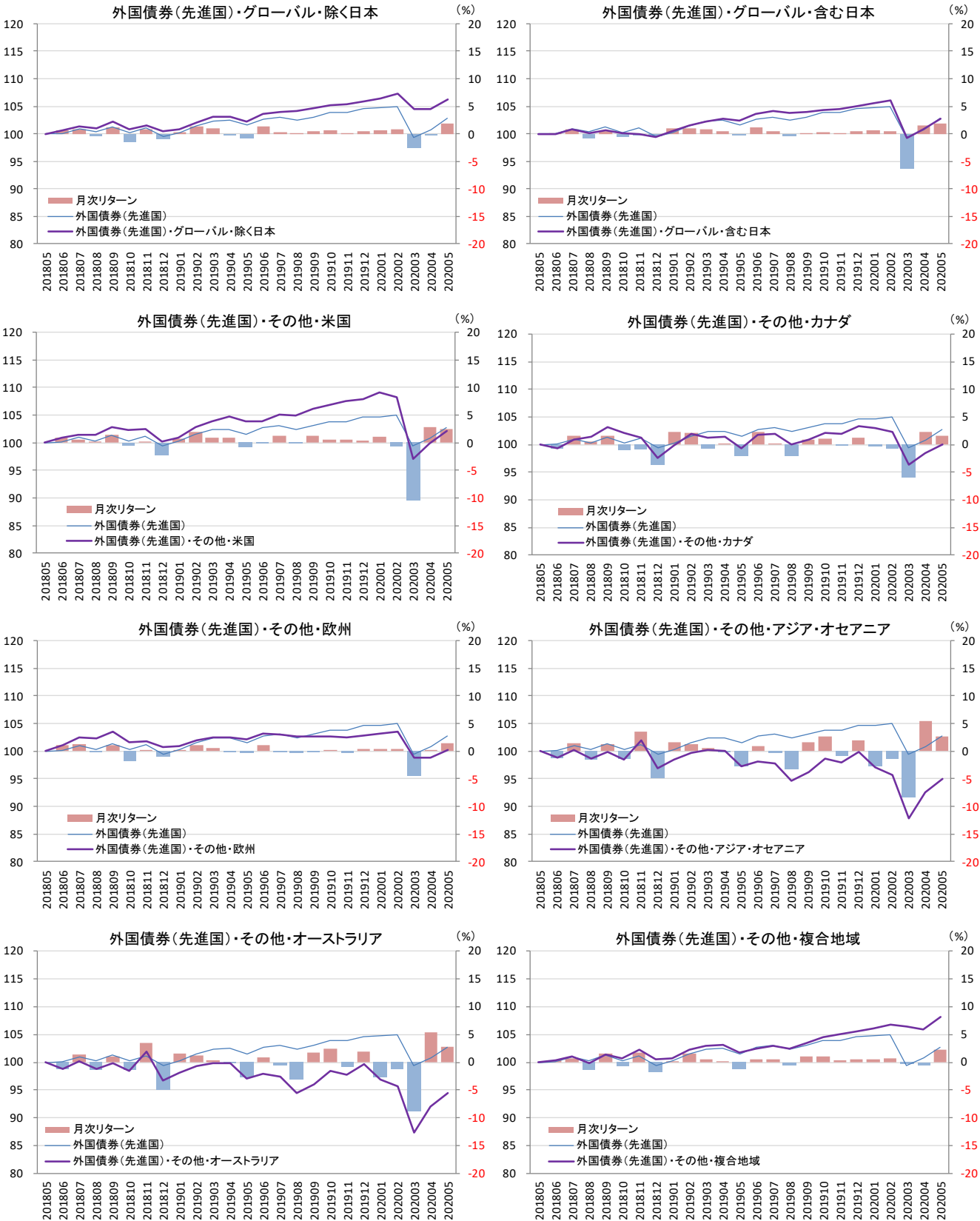


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

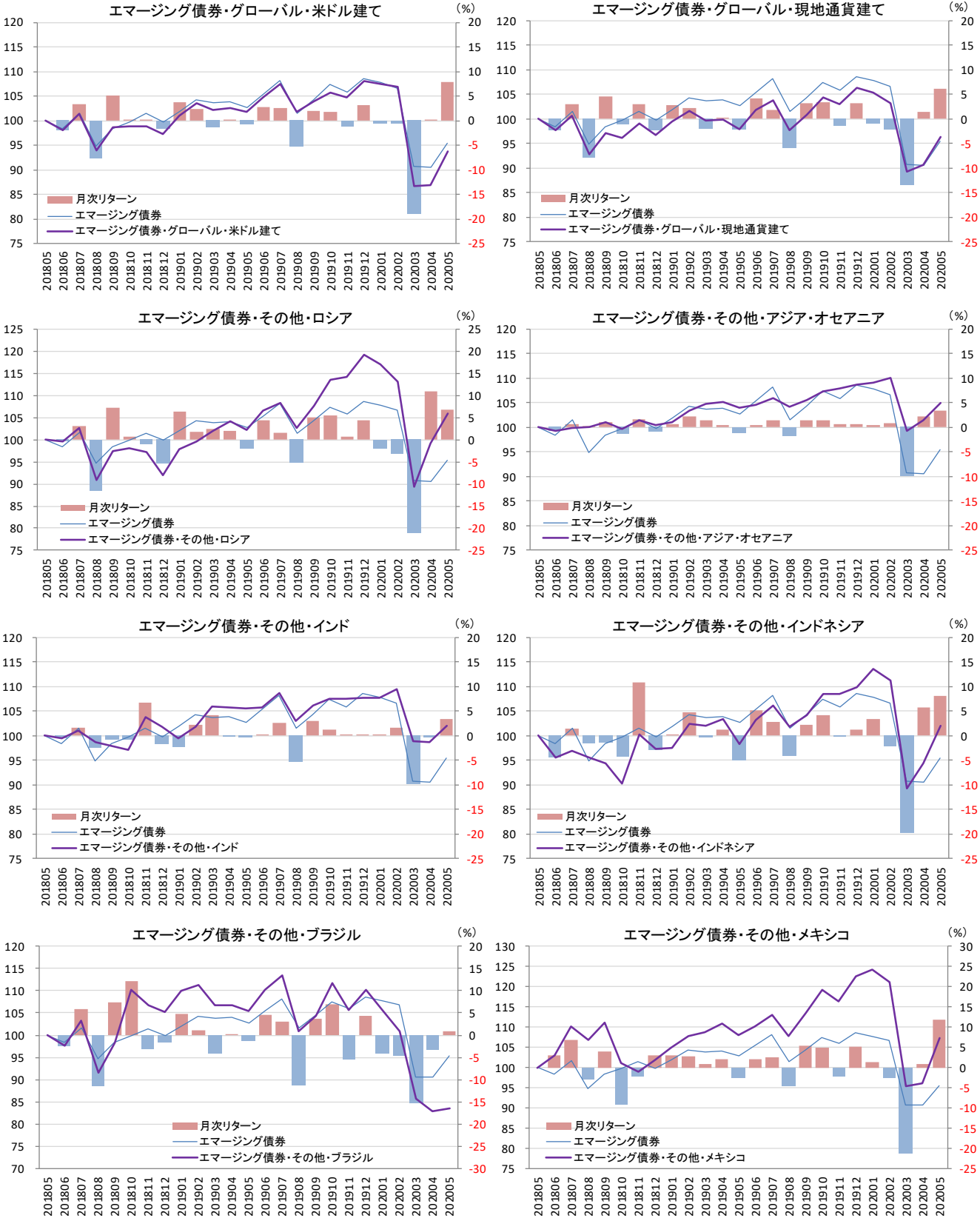


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

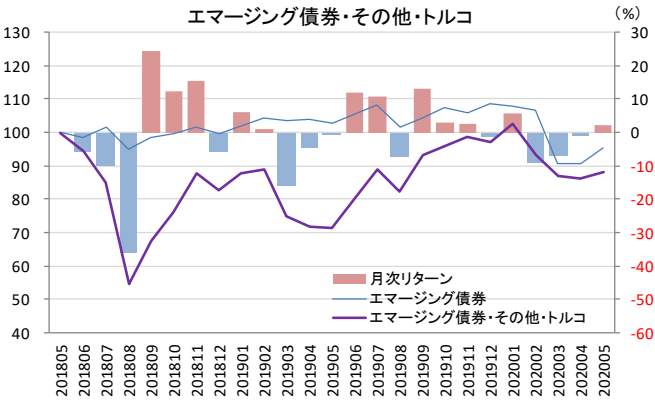


<1>パフォーマンス・サマリー

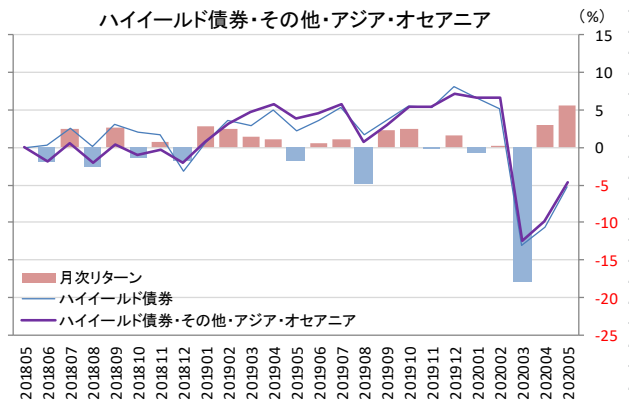
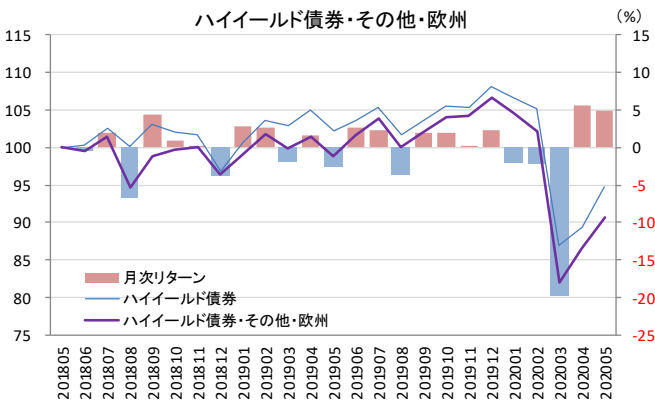
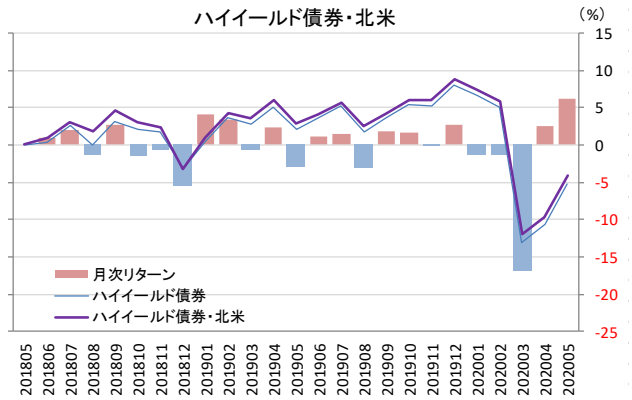
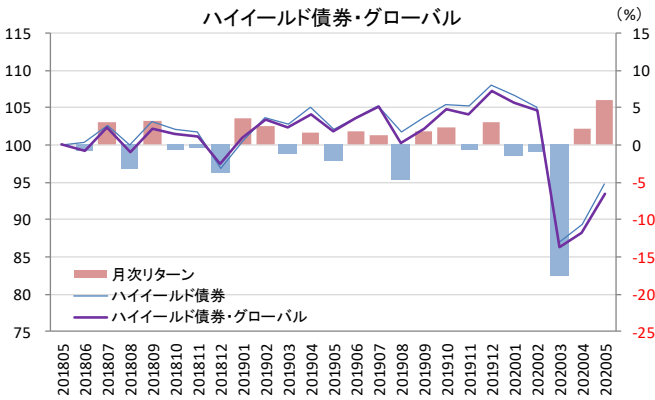
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

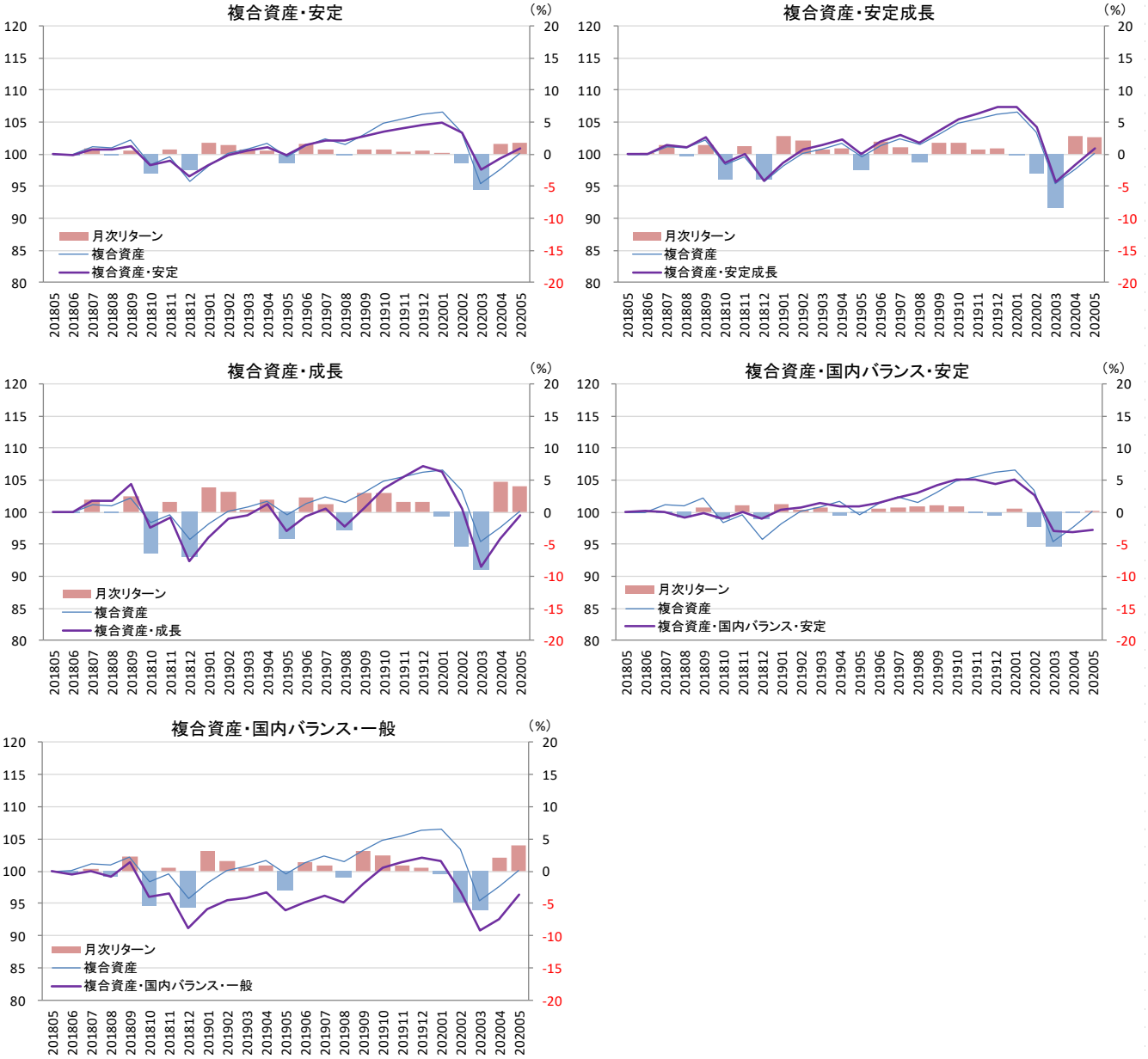


<1>パフォーマンス・サマリー

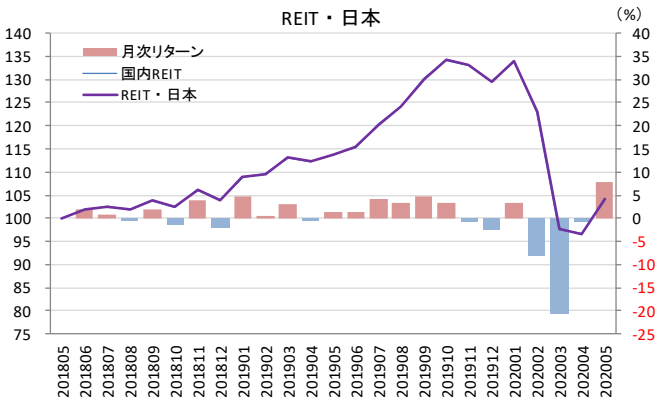
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

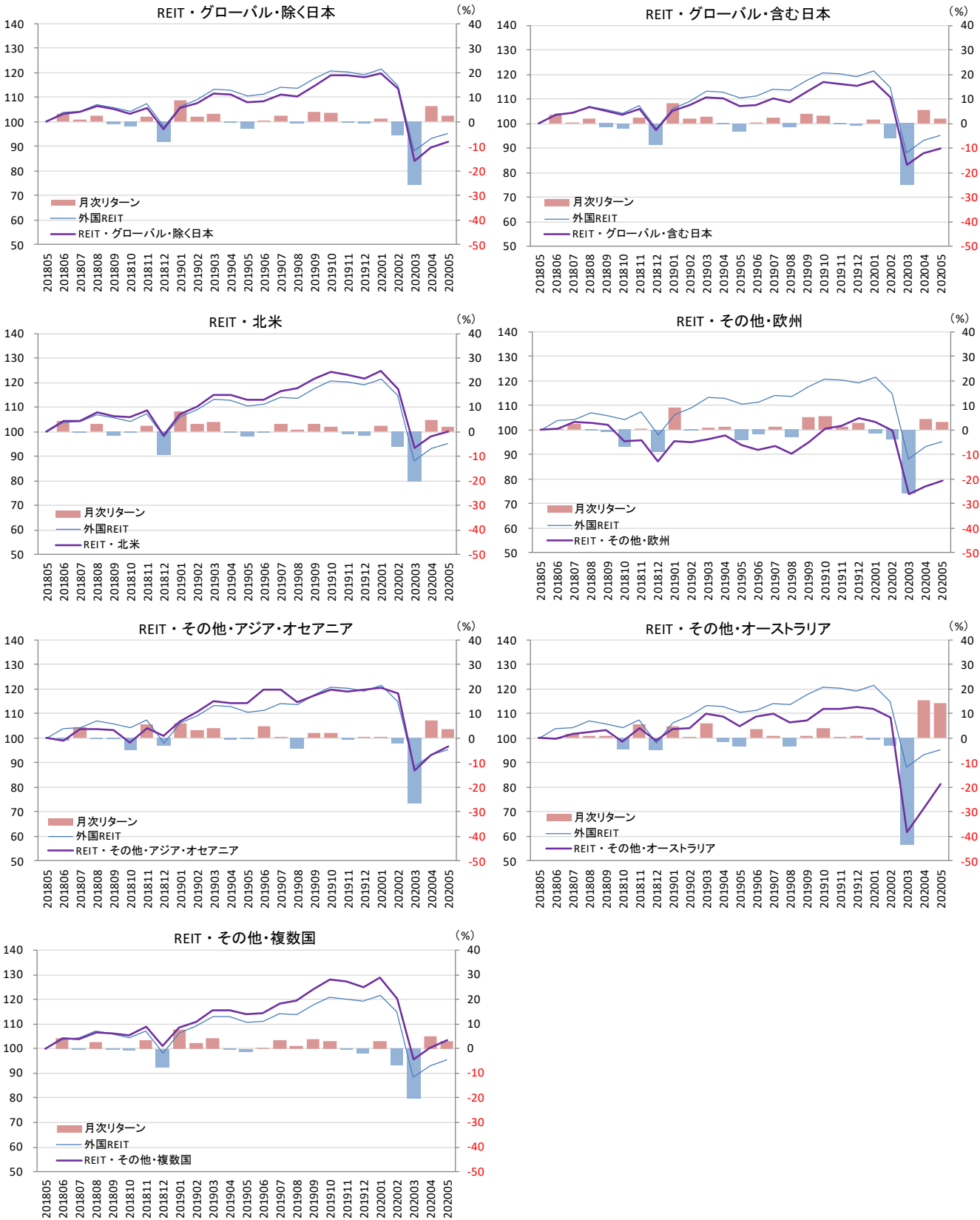


＜1＞パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24 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]

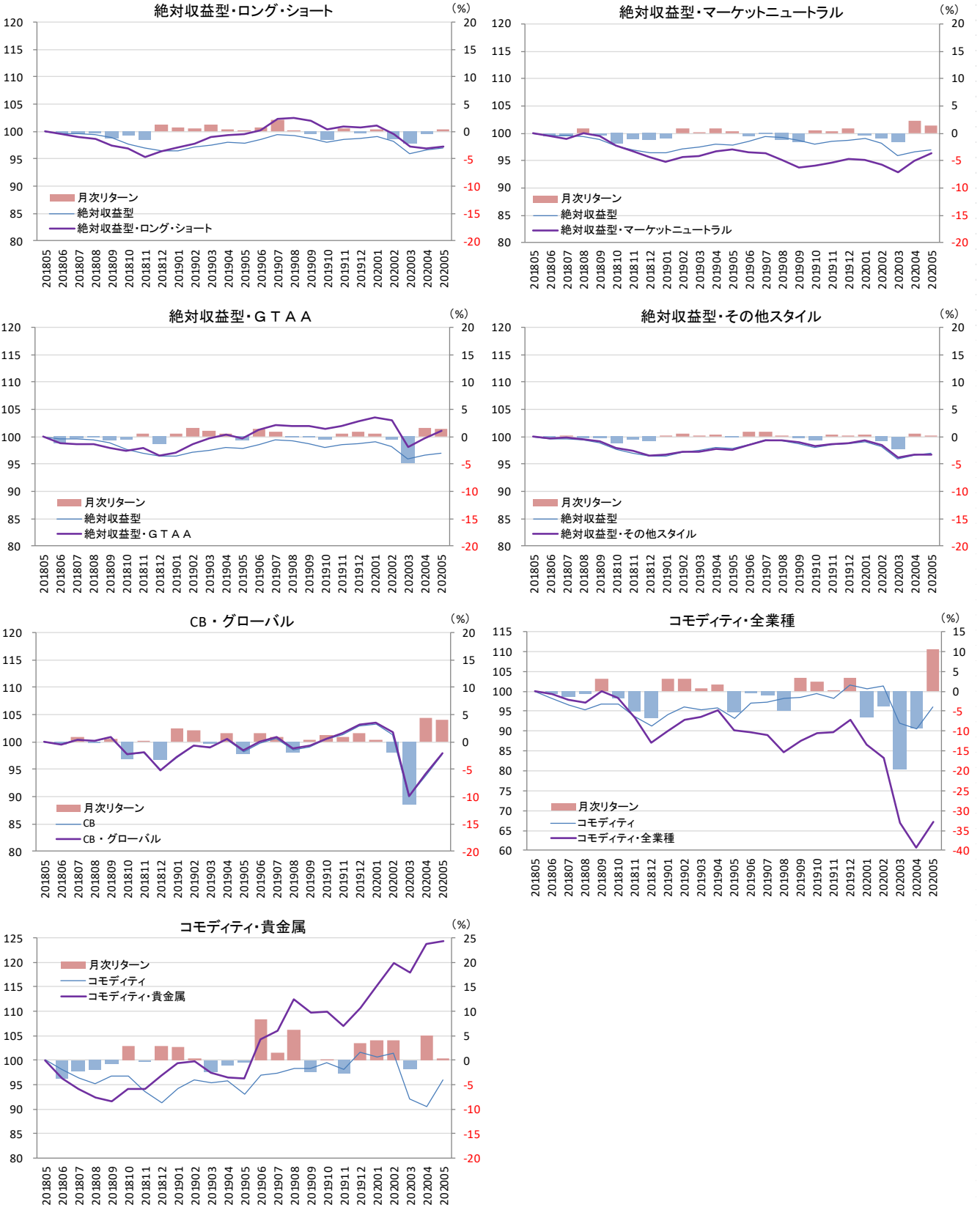


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	4.41				
1	外国株式(先進国)・グローバル	5.81		20.06		1.17
2	国内株式・一般	8.32		8.77		0.72
3	外国株式(先進国)・その他	6.44		6.56		0.42
4	国内株式・その他	7.47		4.88		0.37
5	REIT・日本	7.81		3.96		0.30
6	複合資産・安定成長	2.72		7.53		0.21
7	外国債券(先進国)・グローバル	1.83		9.93		0.18
8	国内株式・小型	12.66		1.35		0.16
9	ハイイールド債券・北米	6.21		2.01		0.12
10	エマージング債券・グローバル	7.58		1.21		0.09
11	複合資産・成長	3.98		2.13		0.09
12	外国債券(先進国)・その他	2.43		3.48		0.09
13	複合資産・安定	1.73		4.66		0.08
14	REIT・北米	2.00		3.18		0.06
15	REIT・グローバル	2.27		2.45		0.05
16	複合資産・その他	3.65		1.19		0.04
17	ブルベア	13.72		0.32		0.04
18	エマージング債券・その他	3.19		1.31		0.04
19	エマージング株式・グローバル	3.42		1.12		0.04
20	REIT・その他	5.08		0.64		0.03
21	ハイイールド債券・グローバル	6.04		0.48		0.03
22	ハイイールド債券・その他	4.96		0.53		0.03
23	コモディティ	6.15		0.36		0.02
24	エマージング株式・その他	0.79		2.65		0.02
25	CB	4.00		0.20		0.01
26	複合資産・国内バランス	0.40		1.76		0.01
27	国内株式・業種特化	5.84		0.11		0.01
28	絶対収益型	0.38		1.29		0.00
29	エマージング株式・BRICS	2.45		0.09		0.00
30	国内債券・一般	-0.32		5.79		-0.02
	合計			100.00		4.41

◆計算定義

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

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

<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	1.04		
1	外国株式(先進国)・グローバル	10.01	18.79	2.03
2	国内株式・一般	5.80	9.19	0.84
3	国内株式・その他	6.79	4.79	0.56
4	外国株式(先進国)・その他	5.20	5.54	0.39
5	国内株式・小型	7.90	1.46	0.16
6	外国債券(先進国)・グローバル	2.20	9.91	0.15
7	複合資産・成長	2.62	2.03	0.08
8	ブルベア	16.98	0.30	0.07
9	複合資産・安定成長	0.94	7.12	0.04
10	複合資産・安定	1.15	4.57	0.02
11	国内株式・業種特化	6.22	0.11	0.01
12	コモディティ	3.13	0.31	0.01
13	CB	-0.62	0.23	-0.00
14	エマージング株式・BRICS	-11.99	0.10	-0.01
15	絶対収益型	-0.98	1.20	-0.02
16	エマージング株式・グローバル	-2.62	1.24	-0.03
17	ハイイールド債券・グローバル	-8.14	0.54	-0.06
18	ハイイールド債券・その他	-8.09	0.64	-0.07
19	国内債券・一般	-0.69	5.50	-0.07
20	外国債券(先進国)・その他	-1.45	3.61	-0.07
21	複合資産・国内バランス	-3.27	1.61	-0.08
22	複合資産・その他	4.87	0.73	-0.09
23	エマージング債券・グローバル	-6.68	1.38	-0.13
24	エマージング債券・その他	-7.52	1.57	-0.13
25	REIT・その他	-16.40	0.77	-0.17
26	ハイイールド債券・北米	-6.88	2.28	-0.22
27	REIT・日本	-8.41	4.52	-0.41
28	REIT・北米	-11.46	3.74	-0.50
29	REIT・グローバル	-16.04	2.88	-0.58
30	エマージング株式・その他	-17.15	3.34	-0.68
	合計		100.00	1.04

◆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	3.93	-0.45	70.73	11.52 ↑	11.36 ↑	11.60	0.12	-0.01	0.47
国内株式	7.56	5.20	119.29	16.96 ↑	17.37	17.33	0.15	0.06	0.47
一般	5.16	1.76	104.13	16.99 ↑	17.59	17.63	0.10	0.02	0.42
フリー	6.41	2.92	106.64	17.31 ↑	17.96	18.26	0.12	0.03	0.41
バリュー	0.45	-2.44	98.64	15.97 ↑	16.50	16.29	0.01	-0.03	0.43
小型	17.40	38.13	228.50	20.76 ↑	18.92 ↑	18.12	0.27	0.35	0.70
その他	10.75	7.32	135.53	16.20 ↑	16.86	16.97	0.22	0.09	0.53
日経225	16.28	14.12	154.58	17.01 ↑	17.32	17.29	0.31	0.16	0.57
TOPIX	5.91	2.78	112.72	15.44 ↑	16.36	16.59	0.13	0.04	0.47
JPX日経400	5.91	1.29	-	15.31 ↑	16.04	-	0.13	0.02	-
国内債券	1.46	4.80	13.88	1.82	1.88	1.66	0.30	0.52	0.78
一般	1.46	4.80	13.88	1.82	1.88	1.66	0.30	0.52	0.78
外国株式(先進国)	15.88	9.34	117.06	17.67 ↑	17.23 ↑	16.48	0.29	0.11	0.49
グローバル	16.96	11.85	128.28	17.67 ↑	17.00 ↑	16.35	0.31	0.14	0.53
除く日本	11.95	9.54	154.10	18.26 ↑	18.18 ↑	18.01	0.21	0.10	0.54
含む日本	18.54	12.52	122.56	17.57 ↑	16.74 ↑	16.02	0.33	0.14	0.52
その他	12.70	3.48	98.91	17.81 ↑	17.92 ↑	17.78	0.23	0.04	0.40
北米	7.06	-3.98	46.56	20.82 ↑	20.02 ↑	21.45	0.11	-0.04	0.18
米国	25.64	14.75	118.85	17.43 ↑	18.38 ↑	17.89	0.46	0.15	0.45
カナダ	-12.58	-23.86	-10.18	21.08 ↑	18.52 ↑	17.94	-0.21	-0.28	-0.06
欧州	-3.51	-6.29	97.55	18.11 ↑	17.40 ↑	18.72	-0.06	-0.07	0.38
ドイツ	-14.06	-17.18	-	21.97 ↑	22.18 ↑	-	-0.22	-0.17	-
イギリス	-23.58	-36.33	-	18.40	17.65	-	-0.46	-0.49	-
アジア・オセアニア	2.61	-6.21	102.90	17.01 ↑	17.30 ↑	17.89	0.05	-0.07	0.41
オーストラリア	-20.27	-20.75	40.99	24.43 ↑	22.14 ↑	21.52	-0.30	-0.20	0.16
ニュージーランド	21.22	39.58	-	18.10	18.78 ↑	-	0.37	0.37	-
複合地域	-42.39	-55.81	-	32.16	27.57 ↑	-	-0.52	-0.55	-
エマージング株式	-10.84	-17.92	26.89	20.28 ↑	19.28 ↑	19.14	-0.18	-0.20	0.12
グローバル	-0.22	-11.27	32.67	19.69 ↑	19.04 ↑	18.85	-0.00	-0.12	0.15
BRICS	0.42	-3.51	37.88	23.21 ↑	22.37 ↑	22.01	0.01	-0.03	0.15
その他	-14.95	-20.83	27.04	20.93	19.70	19.34	-0.25	-0.23	0.12
欧州	-3.87	-1.83	8.20	25.76 ↑	24.05 ↑	25.03	-0.05	-0.01	0.03
ロシア	19.93	29.09	34.64	26.09 ↑	25.35 ↑	27.38	0.24	0.21	0.11
アジア・オセアニア	-8.30	-18.97	50.78	18.60	18.13	17.75	-0.15	-0.23	0.23
中国	30.81	0.03	121.15	19.65	21.64	21.72	0.48	0.00	0.38
インド	-24.48	-19.22	24.83	26.19	24.19	25.66	-0.34	-0.17	0.09
インドネシア	-32.88	-37.01	6.42	28.76 ↑	26.41 ↑	24.58	-0.43	-0.33	0.02
タイ	-13.95	-13.38	110.74	22.52 ↑	19.41 ↑	19.09 ↑	-0.21	-0.14	0.40
フィリピン	-35.60	-46.83	77.93	21.28	19.43 ↑	21.48	-0.64	-0.61	0.28
ベトナム	-5.42	5.34	33.15	27.52 ↑	22.99 ↑	21.66	-0.07	0.05	0.13
韓国	-13.90	-28.40	25.77	22.92 ↑	20.31 ↑	20.43	-0.21	-0.32	0.11
香港	-6.00	-13.56	39.26	19.03 ↑	19.51	19.30	-0.10	-0.15	0.17
台湾	4.91	-3.74	124.32	21.94 ↑	19.92 ↑	18.95	0.08	-0.04	0.44
中南米	-21.28	-27.15	-25.75	31.08 ↑	28.35 ↑	25.66	-0.25	-0.22	-0.12
ブラジル	-24.75	-28.54	-47.79	35.95 ↑	35.51 ↑	31.30	-0.25	-0.18	-0.20
メキシコ	-38.51	-48.74	-	30.13 ↑	26.46 ↑	-	-0.50	-0.47	-
中東・アフリカ	-15.45	-33.90	30.60	19.56 ↑	18.64 ↑	17.76	-0.28	-0.42	0.15
トルコ	-43.04	-55.04	-42.21	36.39 ↑	31.26	30.98	-0.47	-0.47	-0.17
複合地域	-13.78	-25.04	42.39	18.04	17.18	16.59	-0.26	-0.32	0.22

※[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	3.93	-0.45	70.73	11.52 ↑	11.36 ↑	11.60	0.12	-0.01	0.47
外国債券(先進国)	1.77	-5.96	36.69	4.67 ↑	5.49 ↑	7.74	0.14	-0.22	0.41
グローバル	3.28	-3.74	37.10	3.86 ↑	4.84	6.97	0.29	-0.15	0.46
除く日本	5.23	-3.92	41.98	3.71	5.02	7.57	0.48	-0.15	0.47
含む日本	1.02	-3.35	31.40	4.58 ↑	4.99 ↑	6.45	0.09	-0.13	0.43
その他	-2.46	-11.10	34.86	7.45 ↑	7.75 ↑	9.63	-0.10	-0.30	0.31
北米	1.02	-3.37	-	4.86 ↑	4.72 ↑	-	0.08	-0.14	-
米国	-0.31	-6.71	37.18	7.37 ↑	6.96	6.95	-0.01	-0.19	0.46
カナダ	-0.41	-16.98	7.23	7.39 ↑	8.24	9.17	-0.01	-0.44	0.07
欧州	1.94	-6.01	37.58	4.83	6.23	9.58	0.14	-0.19	0.34
イギリス	-4.27	-20.82	-	8.21 ↑	10.48	-	-0.17	-0.43	-
アジア・オセアニア	-4.96	-12.95	38.55	9.24 ↑	9.38 ↑	10.83	-0.18	-0.29	0.30
オーストラリア	-5.31	-13.12	35.12	9.37 ↑	9.47 ↑	11.05	-0.19	-0.29	0.27
ニュージーランド	-1.54	-4.90	-	9.23	9.84	-	-0.05	-0.10	-
複合地域	8.49	0.38	36.13	4.42	6.56	9.18	0.63	0.02	0.34
エマージング債券	-9.43	-7.75	25.26	12.60 ↑	12.47 ↑	13.19	-0.25	-0.13	0.17
グローバル	-10.41	-9.33	27.50	14.41 ↑	13.40 ↑	13.52	-0.25	-0.14	0.18
米ドル建て	-11.19	-8.87	29.66	14.88 ↑	13.78 ↑	13.81	-0.26	-0.13	0.19
現地通貨建て	-7.08	-13.85	13.04	13.05 ↑	12.32 ↑	12.41	-0.18	-0.24	0.10
その他	-8.52	-6.09	19.17	11.35 ↑	12.26	13.71	-0.25	-0.10	0.13
ロシア	0.27	8.60	25.21	19.92 ↑	20.07	22.64	0.01	0.08	0.10
アジア・オセアニア	2.96	-2.15	49.82	7.35 ↑	7.64 ↑	8.92	0.14	-0.05	0.46
インド	-2.43	-0.67	-	9.72 ↑	10.41 ↑	-	-0.08	-0.01	-
インドネシア	-2.25	0.61	-	17.06 ↑	16.54 ↑	-	-0.04	0.01	-
ブラジル	-21.86	-12.92	4.27	19.64	19.79	18.30	-0.40	-0.14	0.02
メキシコ	3.21	-22.62	-	19.88 ↑	18.28 ↑	-	0.06	-0.27	-
トルコ	-34.40	-51.29	-	36.31	29.63	-	-0.36	-0.45	-
複合地域	-0.34	-17.97	10.84	13.21 ↑	13.20 ↑	13.76	-0.00	-0.29	0.07
ハイイールド債券	-7.64	-7.07	58.38	13.00 ↑	12.50 ↑	12.79	-0.20	-0.11	0.37
グローバル	-8.62	-6.81	49.89	13.13 ↑	12.55 ↑	13.02	-0.22	-0.11	0.32
北米	-6.17	-6.26	65.54	12.82 ↑	12.45 ↑	12.41	-0.16	-0.10	0.41
その他	-11.36	-10.69	58.97	14.35 ↑	13.41 ↑	15.35	-0.27	-0.16	0.31
欧州	-12.35	-12.04	72.89	15.12 ↑	14.17 ↑	16.45	-0.28	-0.18	0.34
アジア・オセアニア	-8.02	-5.23	-	12.70 ↑	11.73 ↑	-	-0.21	-0.09	-
複合地域	1.70	-2.17	76.72	9.43 ↑	9.72 ↑	11.54	0.07	-0.04	0.51
複合資産	3.10	-1.03	64.64	7.30 ↑	7.73 ↑	9.07	0.15	-0.02	0.56
安定	2.55	-1.82	52.64	5.11 ↑	5.57 ↑	7.39	0.18	-0.06	0.58
安定成長	3.80	-0.27	67.63	7.86 ↑	8.22 ↑	9.51	0.17	-0.00	0.56
成長	6.04	2.93	91.26	11.35 ↑	11.69 ↑	11.79	0.18	0.05	0.57
国内バランス	-0.25	-0.96	31.26	4.27	4.06	6.62	-0.01	-0.04	0.41
安定	-0.86	2.10	24.58	4.04	3.39 ↑	3.44	-0.06	0.13	0.64
一般	5.34	3.13	47.78	8.87 ↑	9.00	9.75	0.20	0.07	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	3.93	-0.45	70.73	11.52 ↑	11.36 ↑	11.60	0.12	-0.01	0.47
国内REIT	6.87	4.07	158.15	16.05 ↑	13.76 ↑	17.35	0.14	0.06	0.57
日本	6.87	4.07	158.15	16.05 ↑	13.76 ↑	17.35	0.14	0.06	0.57
外国REIT	-5.03	-8.23	111.35	18.05 ↑	16.85 ↑	16.37	-0.09	-0.10	0.47
グローバル	-9.34	-15.37	91.89	18.92 ↑	17.38 ↑	16.53	-0.17	-0.19	0.41
除く日本	-5.45	-8.78	110.60	19.38 ↑	17.78 ↑	16.70	-0.09	-0.10	0.46
含む日本	-9.99	-16.22	89.71	18.79 ↑	17.29 ↑	16.50	-0.18	-0.20	0.40
北米	-1.67	-2.71	123.55	17.46 ↑	16.65	16.62	-0.03	-0.03	0.50
その他	-2.96	-3.87	120.06	20.34 ↑	17.94 ↑	16.63	-0.05	-0.04	0.49
欧州	-15.88	-23.34	16.54	19.67 ↑	19.21 ↑	20.86	-0.28	-0.27	0.07
アジア・オセアニア	2.51	4.94	146.29	19.12 ↑	17.19 ↑	16.53	0.05	0.06	0.57
オーストラリア	-16.92	-17.59	79.34	30.11 ↑	25.39 ↑	21.86	-0.20	-0.15	0.27
複合地域	-32.55	-39.82	44.09	26.71 ↑	23.32 ↑	21.19	-0.46	-0.41	0.17
複数国	4.47	5.88	168.61	16.55 ↑	15.10 ↑	15.40	0.09	0.08	0.67
その他									
絶対収益型	-1.82	-6.08	-5.95	2.49	2.26	3.49	-0.22	-0.54	-0.18
ロング・ショート	-3.66	-8.95	-4.22	3.56	3.19	3.60	-0.33	-0.57	-0.13
マーケットニュートラル	2.21	19.67	37.38	3.91	5.33	5.29	0.20	0.69	0.61
GTAA	1.52	0.83	14.09	4.04 ↑	3.26 ↑	3.10	0.14	0.06	0.42
その他スタイル	-3.15	-7.74	-10.75	2.38	2.34	5.10	-0.42	-0.67	-0.23
CB	-1.94	-5.65	31.29	8.79 ↑	8.50 ↑	9.98	-0.07	-0.13	0.27
アジア・オセアニア	1.50	-4.33	53.02	12.57 ↑	12.33 ↑	12.07	0.04	-0.07	0.36
日本	-3.21	1.51	42.09	5.64 ↑	5.66	6.17	-0.18	0.06	0.58
グローバル	-1.84	-5.25	34.78	8.96 ↑	8.58 ↑	10.39	-0.06	-0.12	0.29
コモディティ	2.88	-24.22	-17.32	9.58 ↑	11.79	14.07	0.10	-0.46	-0.14
全業種	-25.86	-46.46	-42.59	17.78 ↑	16.73 ↑	16.39	-0.53	-0.70	-0.33
貴金属	25.18	15.66	36.88	9.39	9.89	16.48	0.83	0.30	0.19
エネルギー	-28.45	-56.68	-60.90	38.58 ↑	34.39 ↑	29.28 ↑	-0.27	-0.45	-0.31
その他コモディティ	-24.75	-35.84	-6.50	19.03 ↑	17.58 ↑	18.76	-0.47	-0.48	-0.04

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

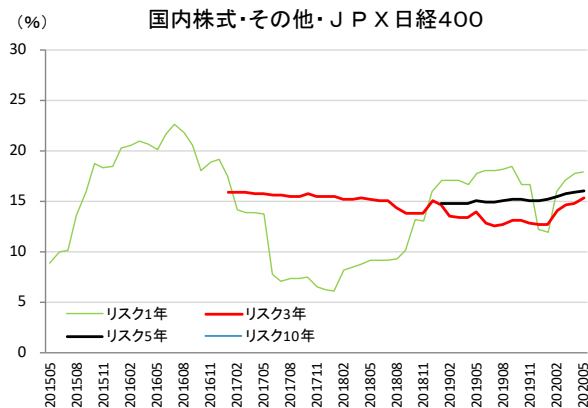
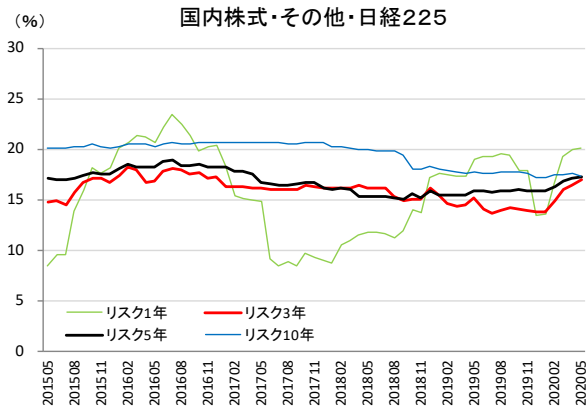
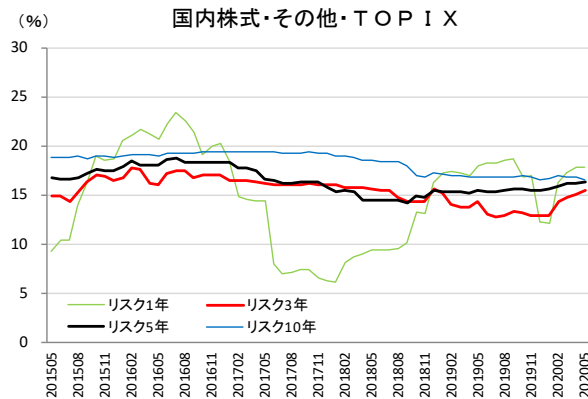
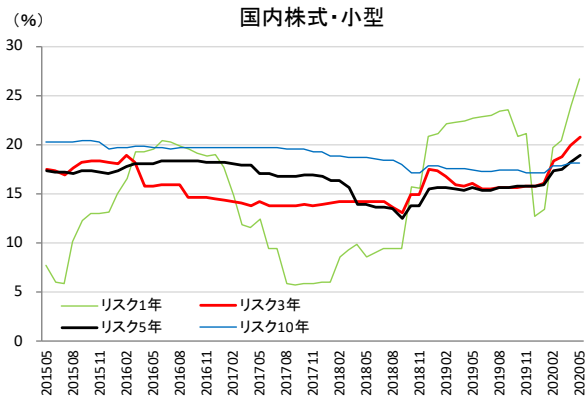
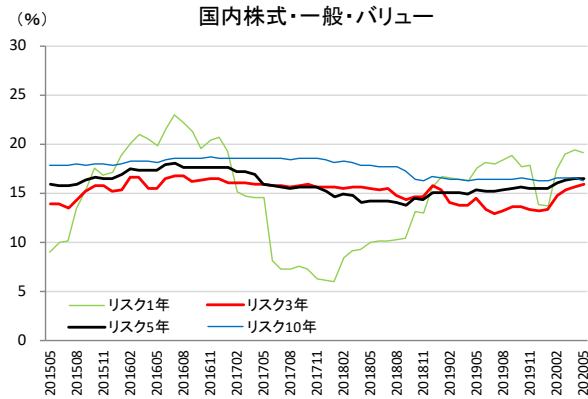
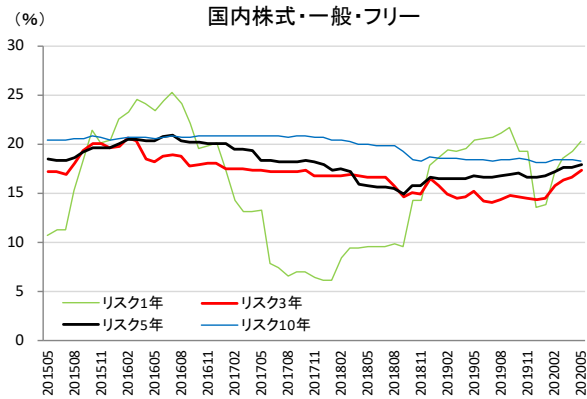
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

＜2＞リスク・サマリー

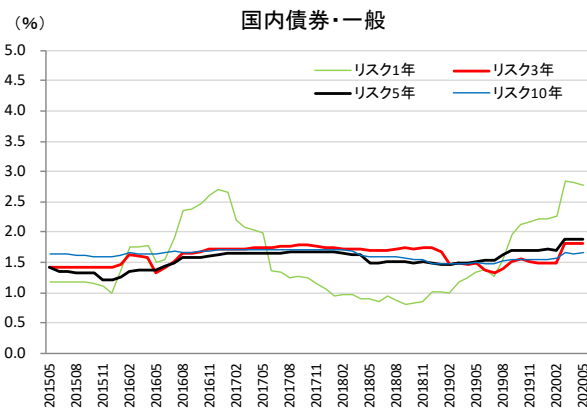
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

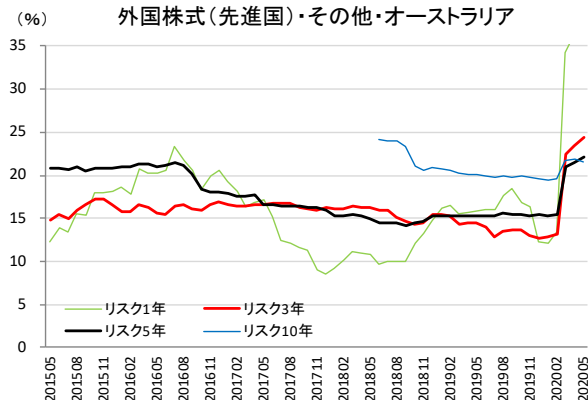
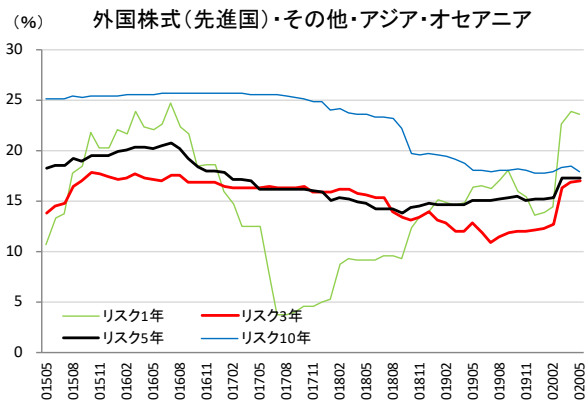
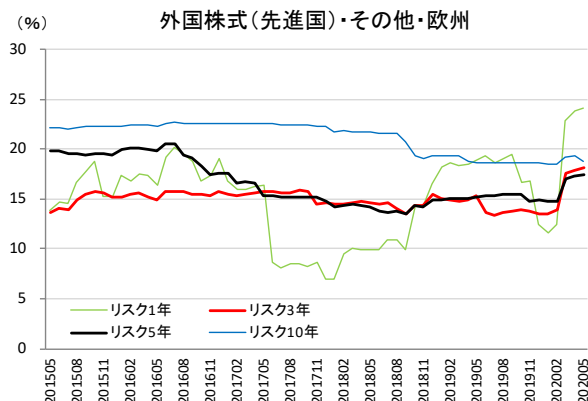
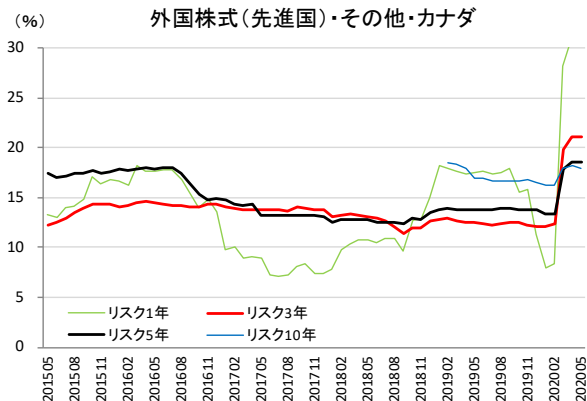
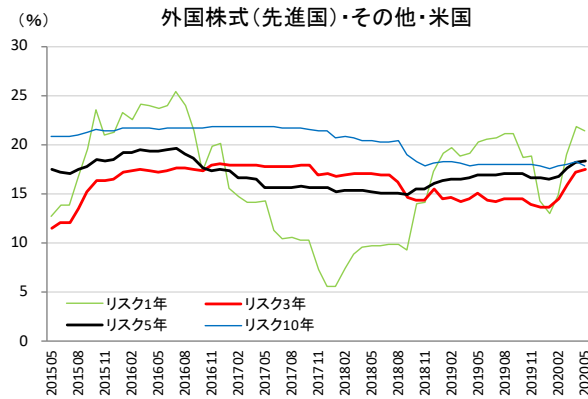
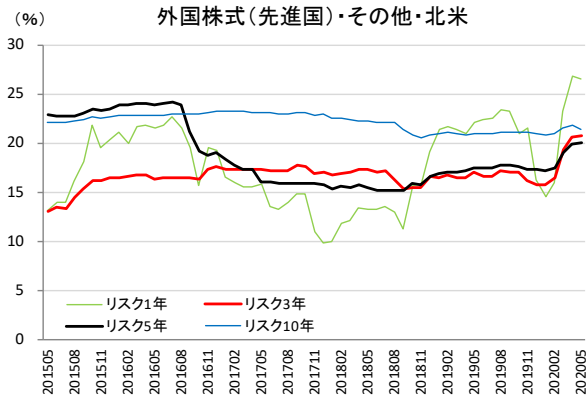
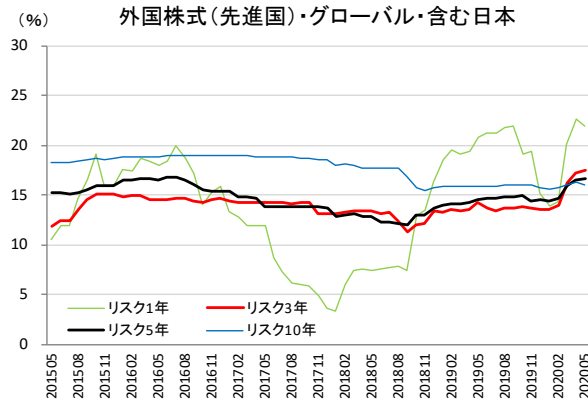
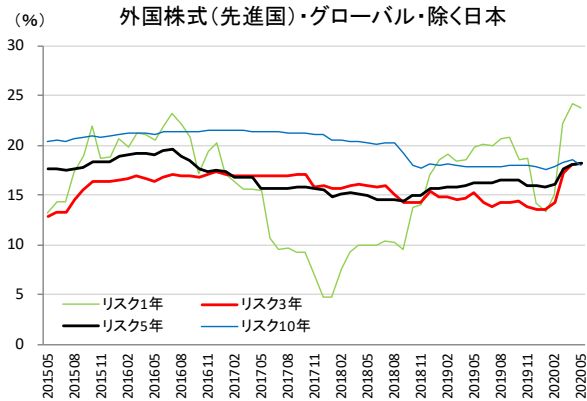


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

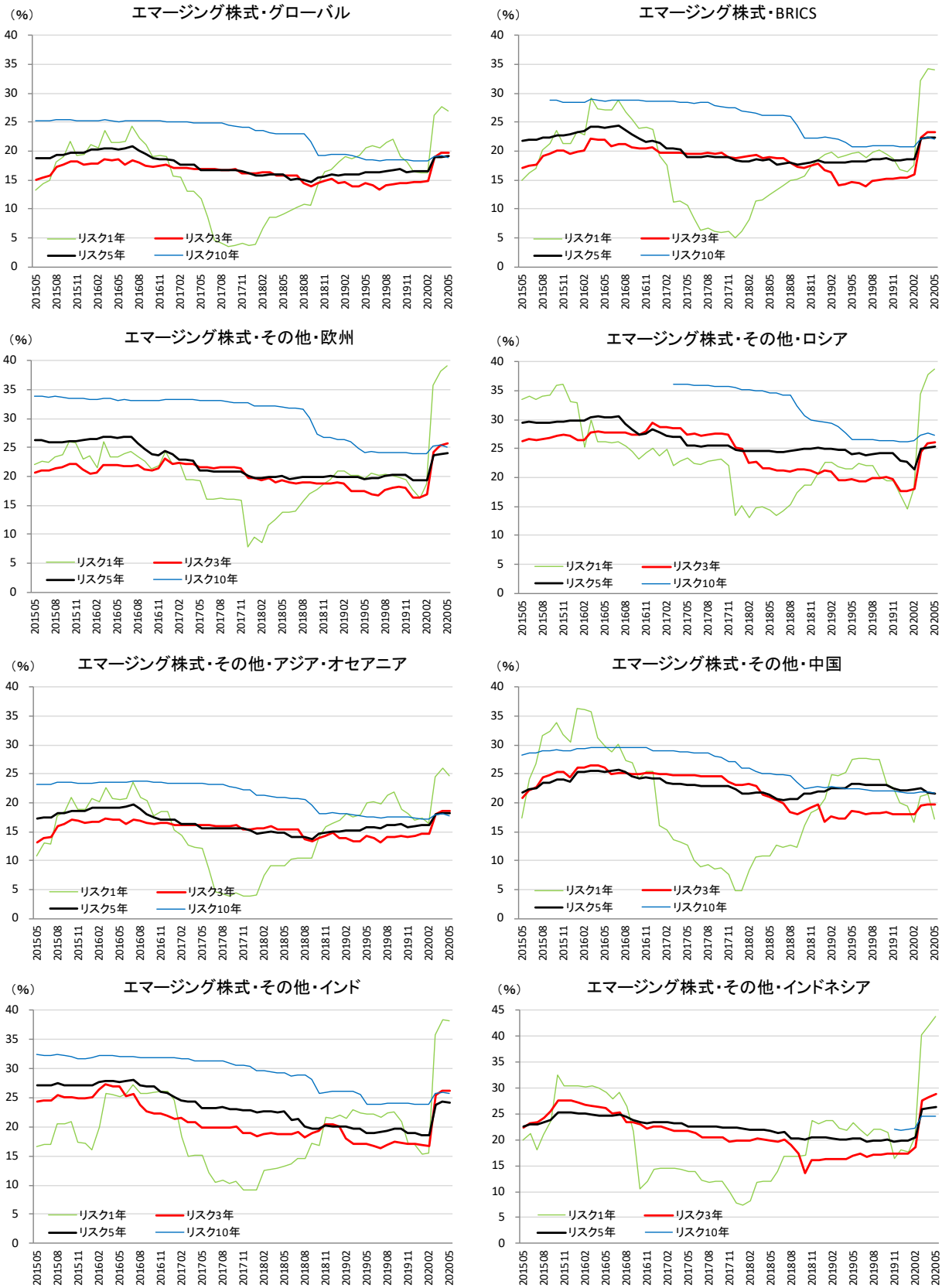


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

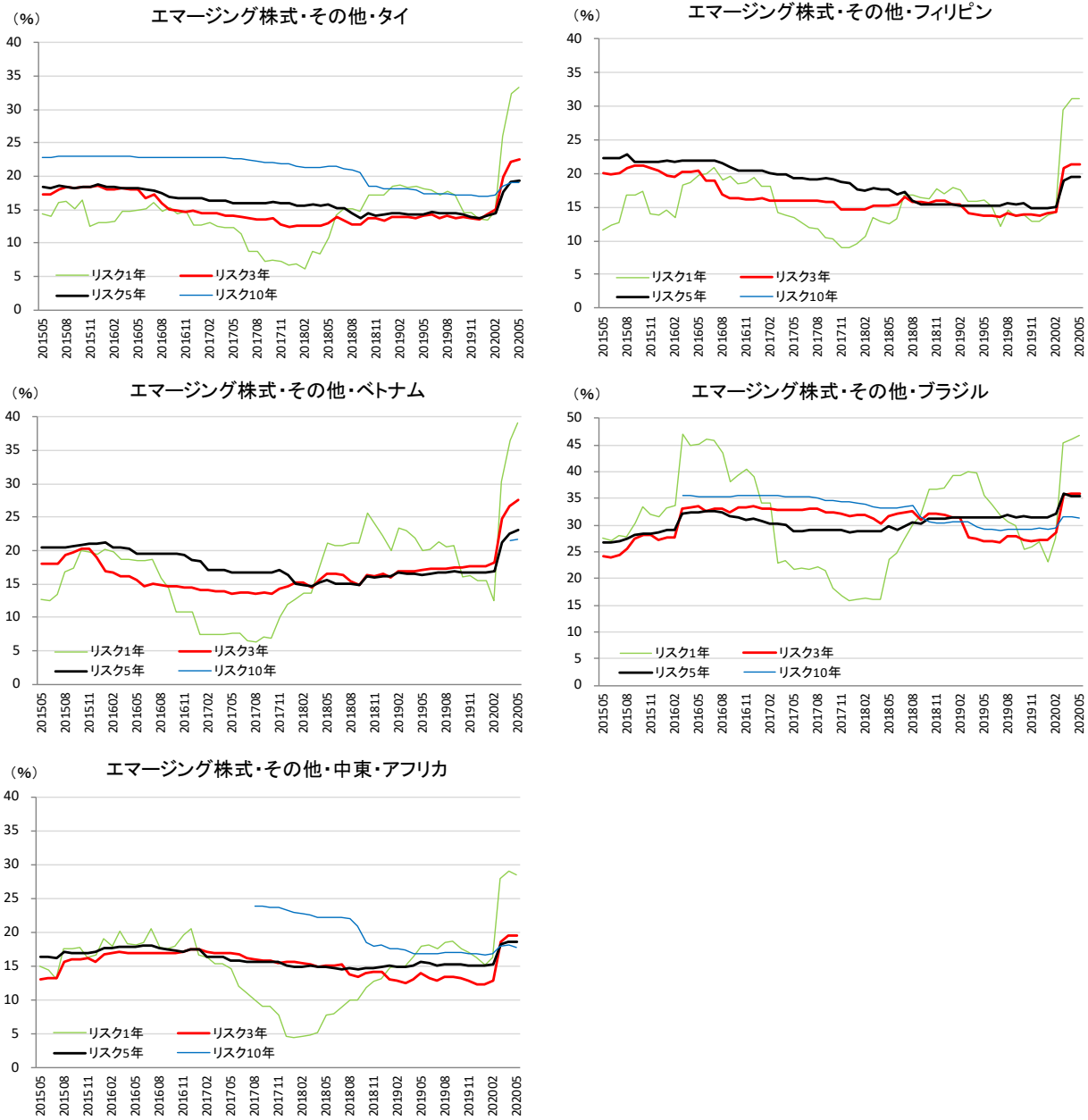


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

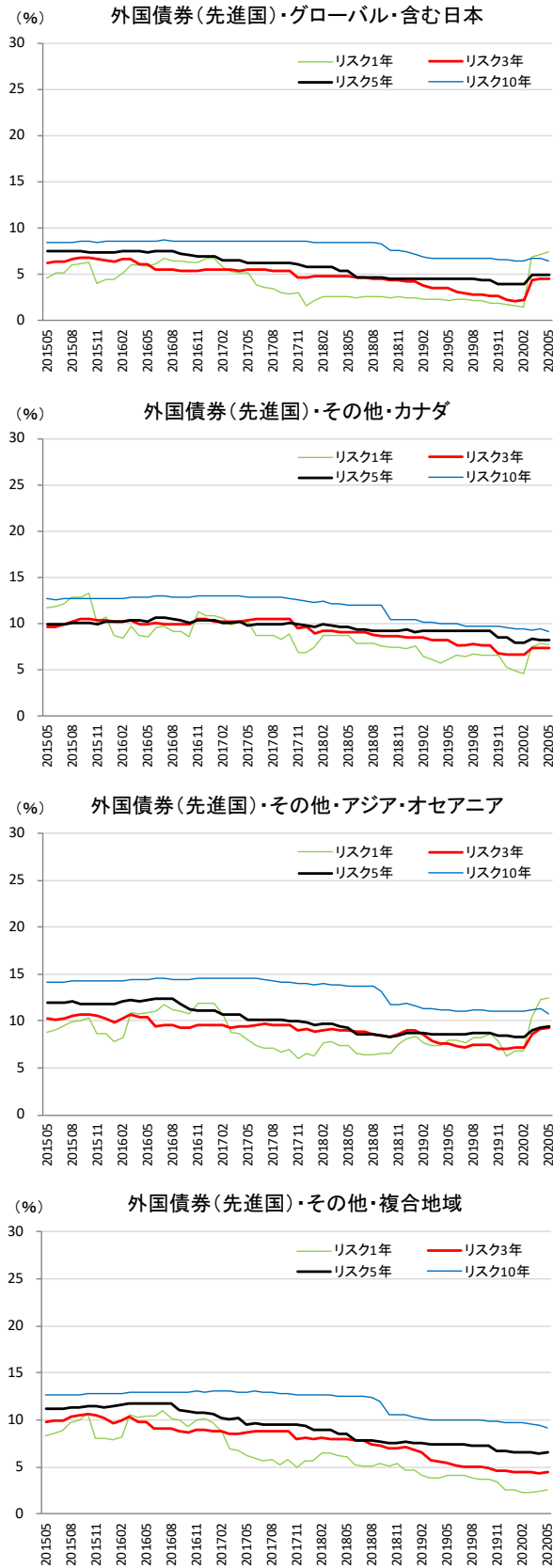
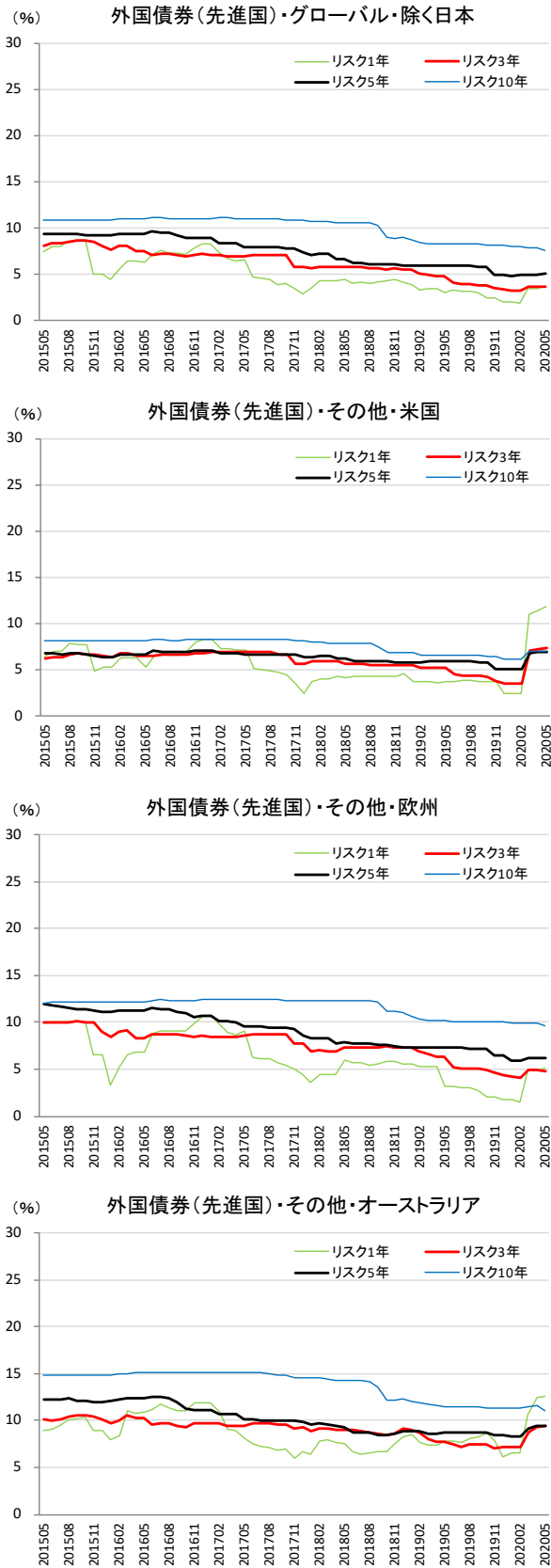


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

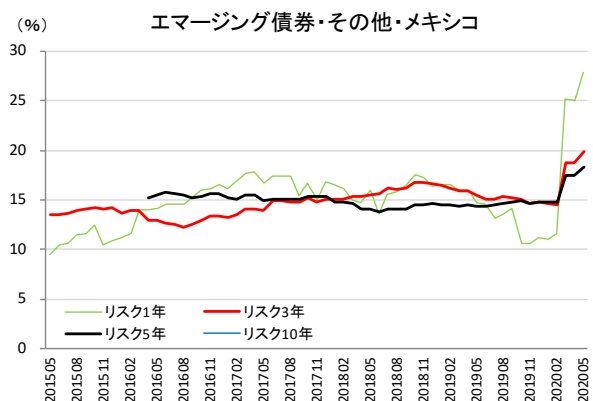
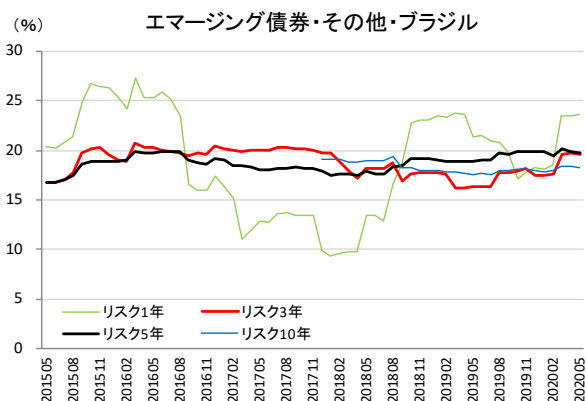
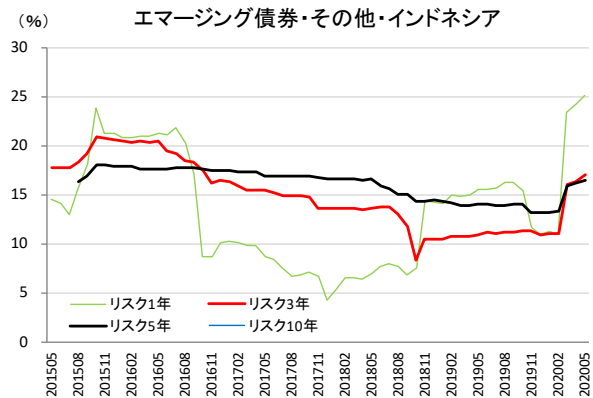
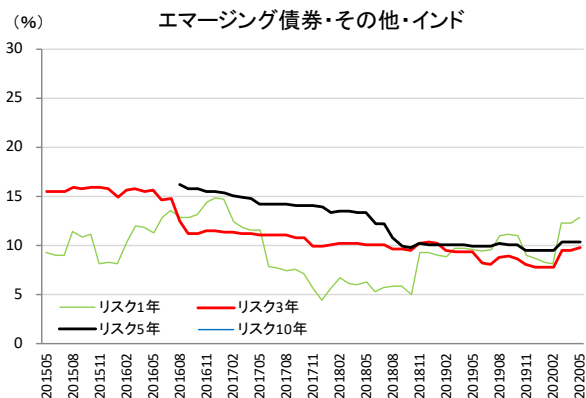
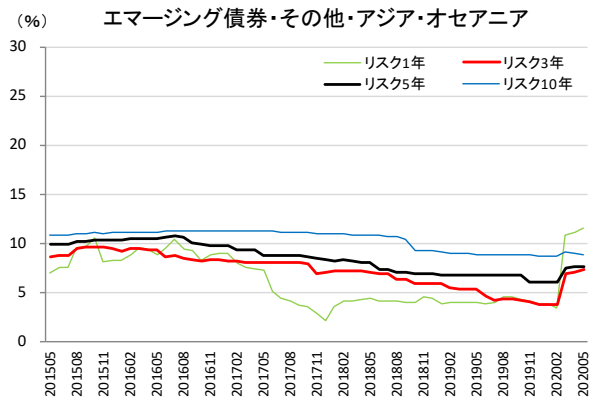
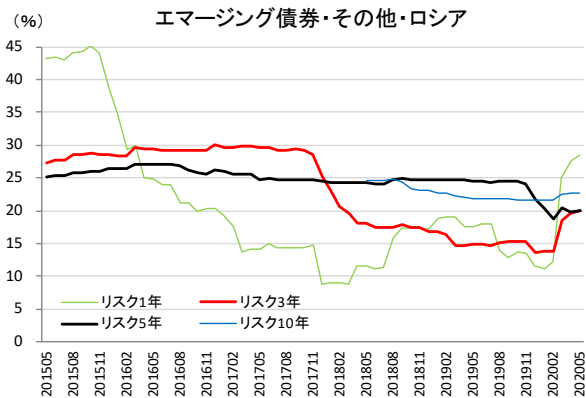
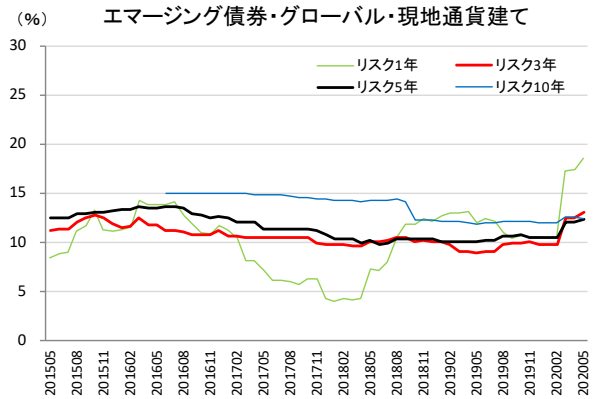
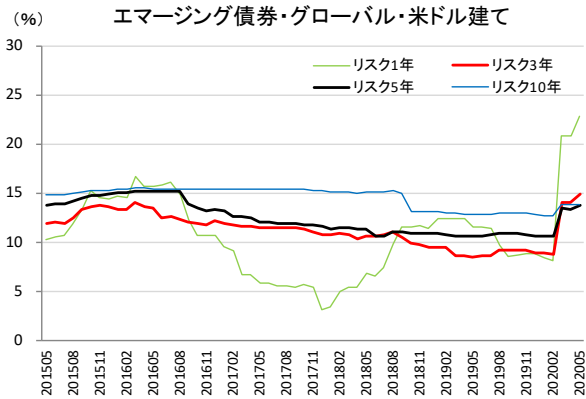


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

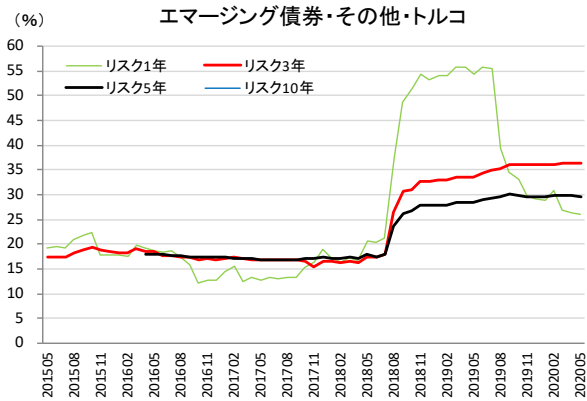


<2> リスク・サマリー

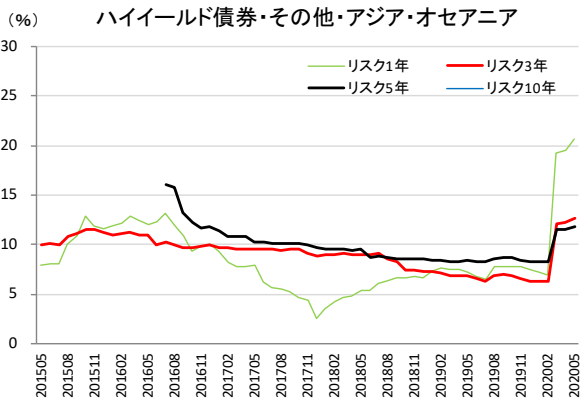
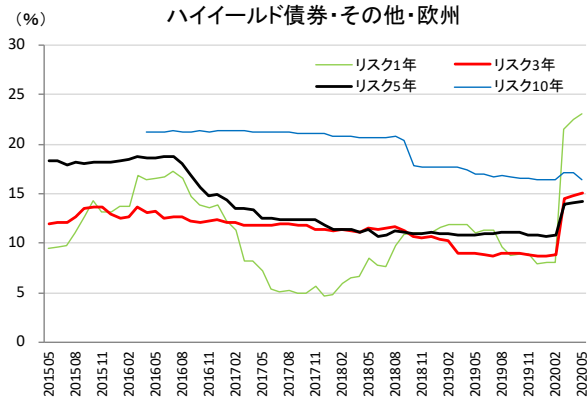
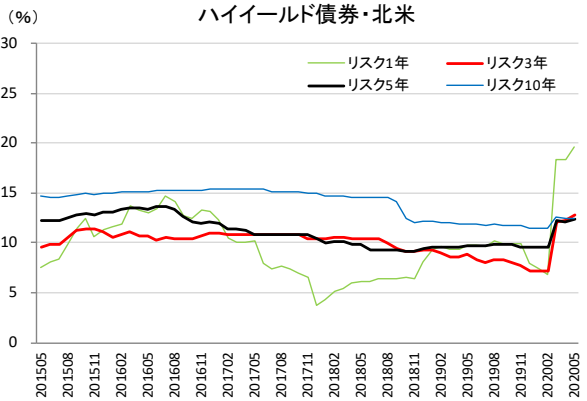
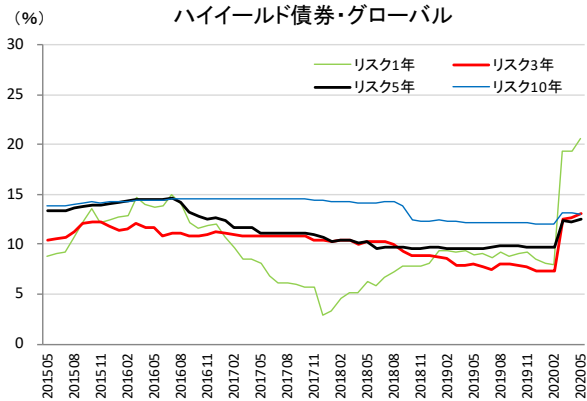
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

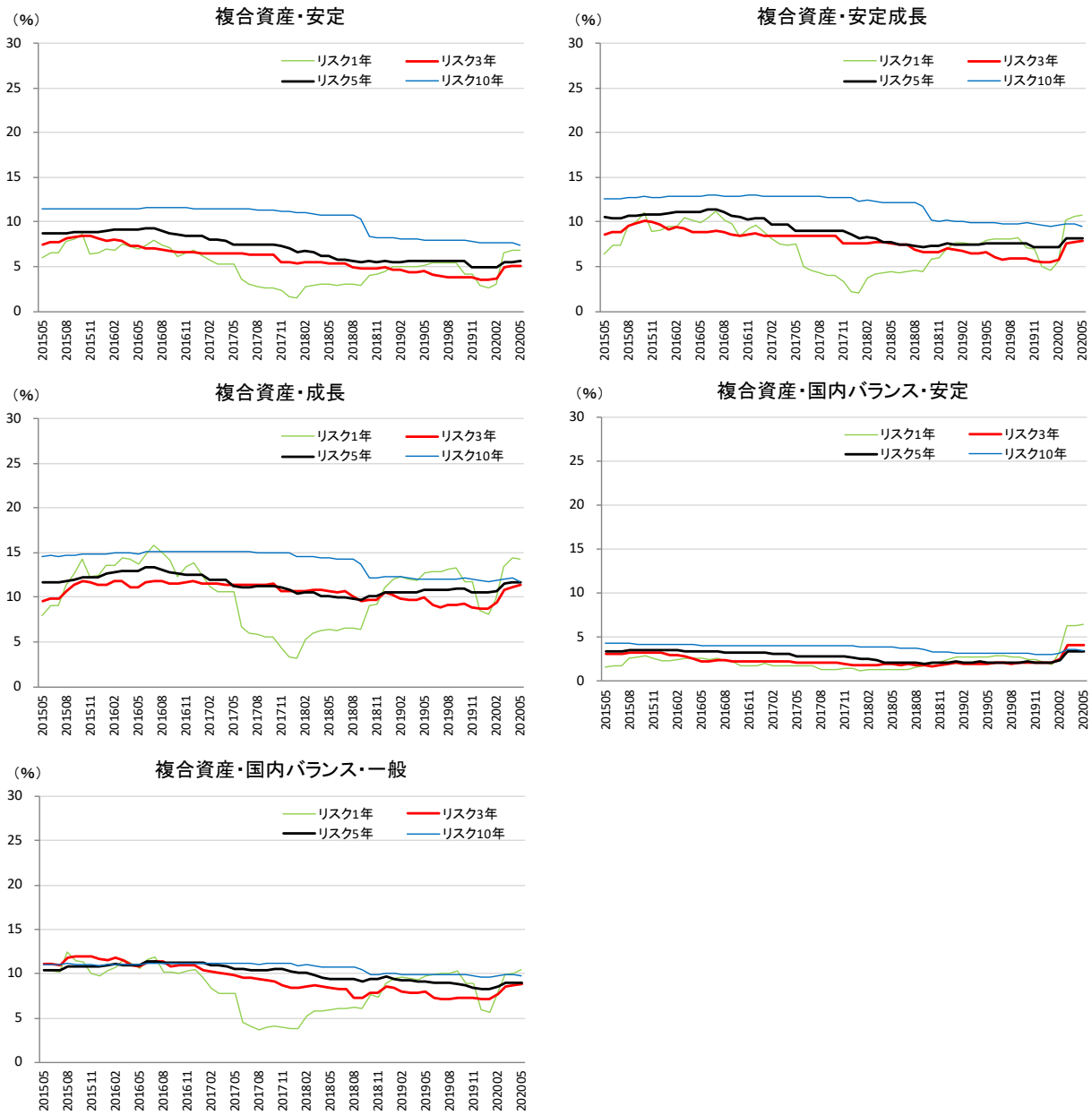


＜2＞リスク・サマリー

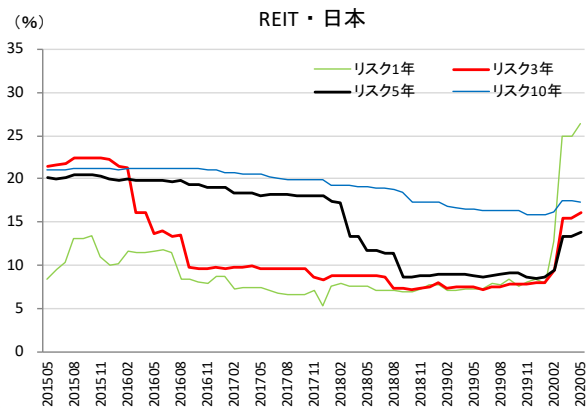
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

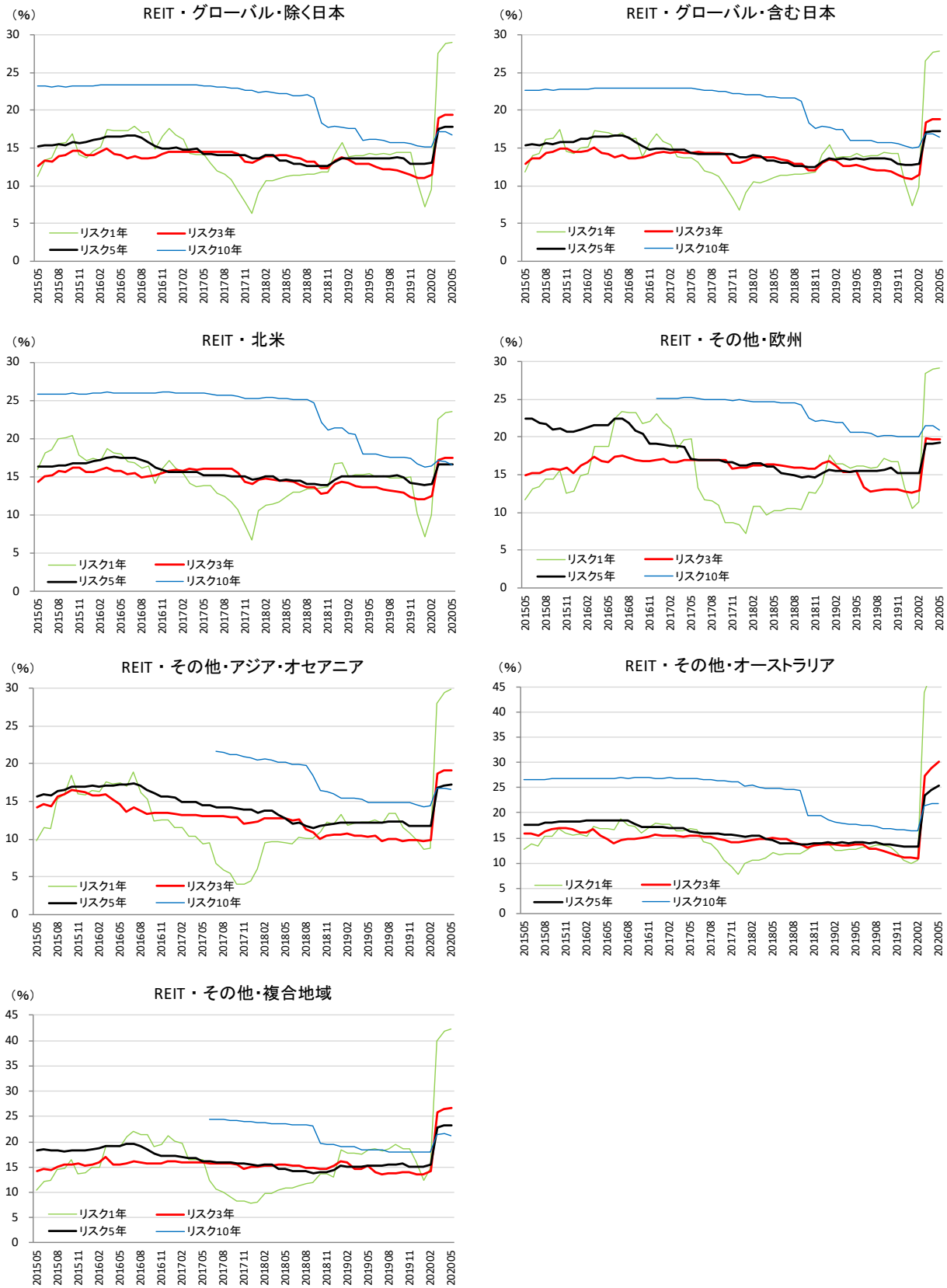


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

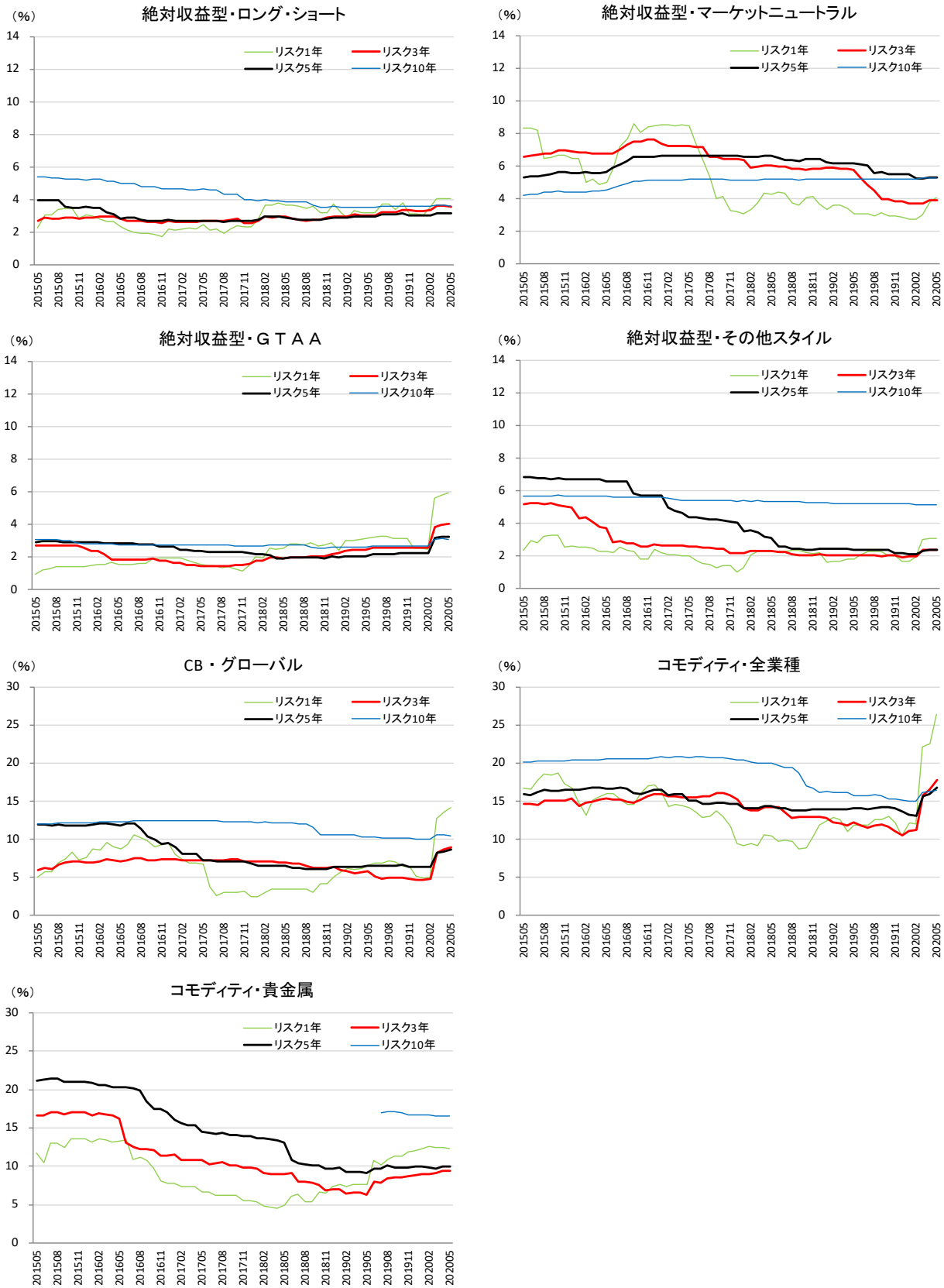


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	1,745	6,123	10,162	11,029
国内株式	-475	357	-3,771	-12,625
一般	-71	-301	-3,529	-8,088
フリー	-83	-257	-3,119	-7,338
バリュー	11	-44	-410	-749
小型	-216	-382	-1,269	-2,651
その他	-189	1,040	1,061	-1,809
日経225	-327	1,129	1,172	-1,508
TOPIX	134	-193	-151	-77
JPX日経400	-6	26	-23	-149
国内債券	-163	-346	112	565
一般	-163	-346	112	565
外国株式(先進国)	1,360	6,875	11,399	14,981
グローバル	469	3,030	3,333	5,399
除く日本	599	1,424	2,979	4,187
含む日本	-130	1,605	353	1,212
その他	891	3,845	8,066	9,582
北米	-9	-1	-34	8
米国	869	3,785	8,092	9,634
カナダ	-3	-9	-36	-87
欧州	-2	-11	-116	-314
ドイツ	0	0	0	-3
イギリス	0	0	-2	-6
アジア・オセアニア	0	0	-6	-22
オーストラリア	36	81	169	374
ニュージーランド	0	-1	-1	-1
複合地域	0	0	0	-1
エマージング株式	-55	-422	-2,767	-5,856
グローバル	-5	59	-417	-1,653
BRICS	-1	-6	-41	-78
その他	-49	-475	-2,309	-4,125
欧州	0	-2	-18	-36
ロシア	1	2	-1	-14
アジア・オセアニア	7	-65	-383	-954
中国	-48	-187	-504	-1,035
インド	-18	-193	-1,395	-2,147
インドネシア	-2	-1	-15	-27
タイ	0	-1	-5	-14
フィリピン	0	-2	-6	-27
ベトナム	-3	-34	61	92
韓国	0	0	0	-2
香港	0	1	2	3
台湾	0	0	0	0
中南米	0	-1	-6	-13
ブラジル	14	12	-14	42
メキシコ	0	0	-1	-3
中東・アフリカ	0	-2	-12	29
トルコ	0	-2	-10	-15
複合地域	0	0	-1	-2

<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別②

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	1,745	6,123	10,162	11,029
外国債券(先進国)	-404	-2,172	-3,394	-4,869
グローバル	-380	-1,599	-2,214	-3,742
除く日本	-199	-908	-1,399	-2,514
含む日本	-181	-692	-815	-1,228
その他	-25	-573	-1,180	-1,128
北米	0	-3	-4	-10
米国	30	-110	-121	552
カナダ	-4	-27	-111	-271
欧州	-15	-170	-113	249
イギリス	0	-1	-3	-6
アジア・オセアニア	-7	-45	-154	-392
オーストラリア	-34	-178	-570	-1,059
ニュージーランド	0	-8	-15	-28
複合地域	-8	-58	-117	-190
エマージング債券	-123	-733	-1,397	-2,162
グローバル	-21	-263	-387	-456
米ドル建て	-29	-252	-375	-435
現地通貨建て	8	-12	-12	-21
その他	-102	-469	-1,010	-1,706
ロシア	-5	-6	-28	-96
アジア・オセアニア	-1	-7	-26	-38
インド	-41	-171	-468	-625
インドネシア	-2	-15	-71	-117
ブラジル	-24	-90	-157	-258
メキシコ	-3	-11	-61	-138
トルコ	0	-5	-19	-35
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイイールド債券	53	-213	-824	-1,756
グローバル	-6	-60	-99	-228
北米	81	-33	-481	-1,037
その他	-22	-120	-245	-491
欧州	-21	-98	-204	-394
アジア・オセアニア	0	-19	-29	-67
複合地域	0	-1	-1	-3
複合資産	778	433	7,074	16,743
安定	181	-530	948	2,106
安定成長	263	372	1,758	3,826
成長	225	390	558	986
国内バランス	15	-168	827	2,760
安定	18	-157	874	2,892
一般	-3	-9	-37	-92
その他	93	368	2,983	7,064

<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別③

(単位:億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	1,745	6,123	10,162	11,029
国内REIT	397	1,138	1,346	1,991
日本	397	1,138	1,346	1,991
外国REIT	352	907	1,730	3,585
グローバル	194	459	847	1,793
除く日本	60	296	697	1,061
含む日本	134	163	150	732
北米	167	472	926	1,710
その他	-8	-24	-42	82
欧州	0	0	-18	-47
アジア・オセアニア	-13	-34	-6	82
オーストラリア	4	12	-2	88
複合地域	1	3	2	1
複数国	0	-4	-18	-42
その他	26	300	655	433
絶対収益型	-26	-137	287	485
ロング・ショート	-24	-32	108	-66
マーケットニュートラル	-19	-80	-172	-247
GTAA	-1	0	-10	-42
その他スタイル	17	-26	361	840
CB	-4	-27	-168	-353
アジア・オセアニア	0	0	-4	-8
日本	-1	-5	-9	-17
グローバル	-2	-22	-154	-328
コモディティ	73	186	305	346
全業種	6	76	86	108
貴金属	18	-80	22	38
エネルギー	48	190	194	196
その他コモディティ	0	1	2	4

< 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	606,303	100.00	5,383	100.00
国内株式	93,170	15.37	880	16.35
一般	54,125	8.93	576	10.70
フリー	43,143	7.12	459	8.53
バリュー	10,982	1.81	117	2.17
小型	8,264	1.36	94	1.75
その他	30,129	4.97	203	3.77
日経225	15,578	2.57	68	1.26
TOPIX	12,295	2.03	75	1.39
JPX日経400	697	0.11	20	0.37
国内債券	33,830	5.58	136	2.53
一般	33,830	5.58	136	2.53
外国株式(先進国)	163,117	26.90	997	18.52
グローバル	122,540	20.21	650	12.08
除く日本	27,878	4.60	178	3.31
含む日本	94,661	15.61	472	8.77
その他	40,577	6.69	347	6.45
北米	355	0.06	12	0.22
米国	34,038	5.61	235	4.37
カナダ	228	0.04	3	0.06
欧州	1,355	0.22	52	0.97
ドイツ	23	0.00	1	0.02
イギリス	13	0.00	2	0.04
アジア・オセアニア	73	0.01	8	0.15
オーストラリア	4,475	0.74	32	0.59
ニュージーランド	12	0.00	1	0.02
複合地域	5	0.00	1	0.02
エマージング株式	23,022	3.80	349	6.48
グローバル	6,752	1.11	101	1.88
BRICS	528	0.09	7	0.13
その他	15,742	2.60	241	4.48
欧州	171	0.03	8	0.15
ロシア	105	0.02	4	0.07
アジア・オセアニア	4,944	0.82	106	1.97
中国	1,604	0.26	30	0.56
インド	6,815	1.12	31	0.58
インドネシア	125	0.02	6	0.11
タイ	65	0.01	4	0.07
フィリピン	52	0.01	5	0.09
ベトナム	1,019	0.17	10	0.19
韓国	4	0.00	1	0.02
香港	10	0.00	1	0.02
台湾	2	0.00	1	0.02
中南米	49	0.01	2	0.04
ブラジル	568	0.09	16	0.30
メキシコ	13	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	123	0.02	8	0.15
トルコ	56	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	606,303	100.00	5,383	100.00
外国債券(先進国)	79,446	13.10	810	15.05
グローバル	58,717	9.68	520	9.66
除く日本	31,539	5.20	230	4.27
含む日本	27,178	4.48	290	5.39
その他	20,729	3.42	290	5.39
北米	89	0.01	6	0.11
米国	5,888	0.97	156	2.90
カナダ	1,164	0.19	6	0.11
欧州	1,576	0.26	37	0.69
イギリス	27	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	2,101	0.35	12	0.22
オーストラリア	8,251	1.36	40	0.74
ニュージーランド	150	0.02	14	0.26
複合地域	1,453	0.24	10	0.19
エマージング債券	15,165	2.50	289	5.37
グローバル	7,375	1.22	192	3.57
米ドル建て	5,843	0.96	152	2.82
現地通貨建て	1,532	0.25	40	0.74
その他	7,791	1.29	97	1.80
ロシア	176	0.03	5	0.09
アジア・オセアニア	427	0.07	13	0.24
インド	3,635	0.60	21	0.39
インドネシア	461	0.08	11	0.20
ブラジル	2,227	0.37	24	0.45
メキシコ	425	0.07	9	0.17
トルコ	128	0.02	5	0.09
複合地域	45	0.01	1	0.02
ハイイールド債券	18,384	3.03	303	5.63
グローバル	2,897	0.48	58	1.08
北米	12,262	2.02	157	2.92
その他	3,225	0.53	88	1.63
欧州	2,503	0.41	48	0.89
アジア・オセアニア	628	0.10	30	0.56
複合地域	43	0.01	1	0.02
複合資産	103,645	17.09	980	18.21
安定	27,747	4.58	288	5.35
安定成長	45,262	7.47	404	7.51
成長	13,055	2.15	243	4.51
国内バランス	10,307	1.70	32	0.59
安定	9,804	1.62	8	0.15
一般	411	0.07	19	0.35
その他	7,274	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	606,303	100.00		5,383	100.00	
国内REIT	24,515	4.04		123	2.28	
日本	24,515	4.04		123	2.28	
外国REIT	39,001	6.43		288	5.35	
グローバル	15,275	2.52		139	2.58	
除く日本	3,605	0.59		51	0.95	
含む日本	11,670	1.92		88	1.63	
北米	19,866	3.28		81	1.50	
その他	3,861	0.64		68	1.26	
欧州	198	0.03		17	0.32	
アジア・オセアニア	2,760	0.46		34	0.63	
オーストラリア	625	0.10		13	0.24	
複合地域	36	0.01		3	0.06	
複数国	241	0.04		1	0.02	
その他	13,008	2.15		228	4.24	
絶対収益型	7,567	1.25		101	1.88	
ロング・ショート	975	0.16		35	0.65	
マーケットニュートラル	956	0.16		15	0.28	
GTAA	406	0.07		14	0.26	
その他スタイル	5,230	0.86		37	0.69	
CB	1,216	0.20		41	0.76	
アジア・オセアニア	32	0.01		1	0.02	
日本	53	0.01		3	0.06	
グローバル	1,131	0.19		37	0.69	
コモディティ	2,184	0.36		27	0.50	
全業種	733	0.12		14	0.26	
貴金属	1,217	0.20		11	0.20	
エネルギー	225	0.04		1	0.02	
その他コモディティ	9	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	10,957	8.5	3.45	4.13	1.269
国内株式	13,837	11.5	1.06	1.22	1.149
一般	12,607	11.2	1.31	1.60	1.422
フリー	12,405	10.7	1.42	1.78	1.467
バリュー	13,401	13.3	0.87	0.89	1.247
小型	20,066	12.0	1.33	1.27	1.739
その他	14,527	12.1	0.53	0.51	0.486
日経225	15,389	13.6	0.53	0.50	0.576
TOPIX	15,153	13.6	0.38	0.37	0.323
JPX日経400	13,107	5.8	0.04	0.04	0.546
国内債券	10,985	10.6	0.32	0.33	0.354
一般	10,985	10.6	0.32	0.33	0.354
外国株式(先進国)	11,961	6.8	3.94	4.42	1.564
グローバル	12,589	7.1	3.13	3.51	1.552
除く日本	14,920	9.2	0.70	0.82	0.730
含む日本	11,710	6.3	3.86	4.32	1.794
その他	10,785	6.3	6.59	7.42	1.600
北米	10,179	7.0	6.98	7.14	1.919
米国	11,615	5.7	5.42	5.15	1.562
カナダ	5,957	8.2	13.41	18.06	1.992
欧州	10,572	8.9	2.81	3.26	1.655
ドイツ	9,472	6.2	0.00	0.00	0.770
イギリス	4,357	6.0	15.40	22.85	1.943
アジア・オセアニア	7,840	6.1	4.95	5.68	1.696
オーストラリア	7,013	5.9	15.20	23.51	1.826
ニュージーランド	12,908	7.8	3.00	3.10	1.672
複合地域	4,974	7.1	0.00	0.00	1.705
エマージング株式	10,270	9.1	2.94	4.00	1.787
グローバル	9,420	6.9	1.87	2.28	1.426
BRICS	11,975	14.0	1.16	1.30	2.068
その他	10,577	9.9	3.46	4.83	1.933
欧州	7,946	14.1	0.21	0.25	1.982
ロシア	9,492	11.0	2.11	2.17	2.016
アジア・オセアニア	11,138	10.0	7.00	8.69	1.740
中国	18,008	9.8	1.93	1.78	1.968
インド	8,957	10.0	1.34	1.90	2.074
インドネシア	7,296	9.9	0.42	0.59	1.853
タイ	8,826	12.1	0.72	0.89	1.699
フィリピン	7,640	6.8	0.51	0.76	1.792
ベトナム	9,862	4.3	0.70	0.83	1.870
韓国	9,680	1.4	0.00	0.00	1.804
香港	12,847	10.8	2.03	2.41	0.858
台湾	10,358	7.5	0.00	0.00	1.661
中南米	5,535	13.4	0.00	0.00	2.041
ブラジル	3,835	10.1	11.30	27.83	1.932
メキシコ	5,729	7.2	0.00	0.00	1.926
中東・アフリカ	8,006	9.5	0.16	1.53	2.061
トルコ	5,288	13.8	0.00	0.00	2.035
複合地域	15,627	12.0	3.10	3.52	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	10,957	8.5	3.45	4.13	1.269
外国債券(先進国)	9,685	8.4	2.54	2.75	1.112
グローバル	10,302	8.7	1.85	1.93	1.049
除く日本	11,138	10.9	1.75	1.80	0.824
含む日本	9,639	6.9	1.96	2.08	1.310
その他	8,579	7.9	4.51	5.07	1.290
北米	10,031	6.1	1.90	2.04	1.809
米国	9,233	6.7	4.90	5.89	1.352
カナダ	7,598	7.9	3.98	4.12	1.370
欧州	8,157	10.0	1.24	1.35	1.045
イギリス	7,555	5.5	3.58	3.78	1.260
アジア・オセアニア	7,385	9.6	3.12	3.33	1.421
オーストラリア	7,449	11.0	5.54	6.13	1.261
ニュージーランド	9,021	5.6	2.44	2.50	1.348
複合地域	5,597	10.5	3.41	3.48	1.191
エマージング債券	7,946	8.7	6.55	7.93	1.590
グローバル	8,187	9.4	5.79	7.17	1.555
米ドル建て	8,192	9.7	5.97	7.54	1.617
現地通貨建て	8,170	8.3	5.12	5.78	1.320
その他	7,469	7.4	7.25	8.64	1.623
ロシア	8,290	7.3	6.23	6.60	1.608
アジア・オセアニア	8,517	7.6	11.11	12.85	1.639
インド	8,655	5.4	7.20	8.16	1.700
インドネシア	6,773	7.8	7.41	7.71	1.665
ブラジル	6,822	10.4	7.38	10.22	1.591
メキシコ	5,992	7.5	5.94	6.45	1.396
トルコ	3,242	7.3	10.78	9.67	1.453
複合地域	3,729	13.8	4.65	5.10	1.210
ハイイールド債券	7,709	9.0	8.66	10.56	1.693
グローバル	6,834	8.3	6.74	8.24	1.579
北米	8,494	10.3	8.55	10.29	1.699
その他	6,884	7.1	10.75	13.64	1.770
欧州	6,276	7.2	11.40	14.57	1.746
アジア・オセアニア	7,375	8.1	9.26	11.44	1.878
複合地域	4,188	16.2	5.40	5.73	1.800
複合資産	11,315	8.0	1.60	1.72	1.040
安定	10,839	7.6	0.97	1.01	1.122
安定成長	10,985	8.4	2.16	2.34	1.088
成長	12,563	8.0	0.49	0.61	0.917
国内バランス	10,753	8.4	2.15	2.30	0.941
安定	10,604	10.0	2.19	2.35	0.921
一般	11,087	9.1	0.90	0.93	1.361
その他	10,143	0.7	1.75	1.80	0.783

(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	10,957	8.5	3.45	4.13	1.269
国内REIT	11,897	8.5	9.45	11.95	0.953
日本	11,897	8.5	9.45	11.95	0.953
外国REIT	8,891	7.3	10.57	14.32	1.556
グローバル	9,489	7.9	8.43	12.11	1.400
除く日本	10,940	6.3	6.31	10.28	1.086
含む日本	8,648	8.8	9.09	12.68	1.497
北米	8,267	7.4	12.60	16.50	1.630
その他	8,413	6.1	8.45	11.76	1.792
欧州	7,451	5.8	5.16	6.72	1.818
アジア・オセアニア	9,780	6.0	10.19	14.28	1.834
オーストラリア	6,979	5.5	4.48	6.21	1.711
複合地域	4,693	8.3	1.42	1.84	0.848
複数国	8,097	16.1	2.61	2.96	1.650
その他					
絶対収益型	10,043	5.3	0.09	0.09	1.671
ロング・ショート	10,213	4.7	0.70	0.69	1.480
マーケットニュートラル	10,418	4.8	0.08	0.08	1.235
GTAA	10,400	6.3	0.00	0.00	1.551
その他スタイル	9,596	5.7	0.01	0.01	1.796
CB	10,602	6.9	1.19	1.25	1.526
アジア・オセアニア	7,528	9.9	3.00	3.19	1.823
日本	10,705	9.1	0.22	0.22	1.014
グローバル	10,676	6.6	1.19	1.24	1.541
コモディティ	7,710	6.9	0.00	0.00	0.958
全業種	4,515	8.8	0.00	0.00	1.418
貴金属	11,900	4.4	0.00	0.00	0.663
エネルギー	5,575	11.3	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	8,484	3.7	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