

投信指数 MAB-FPI

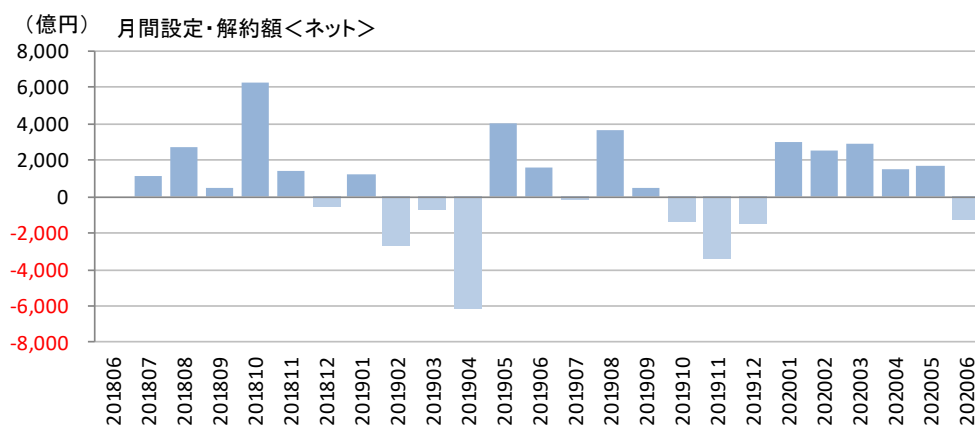
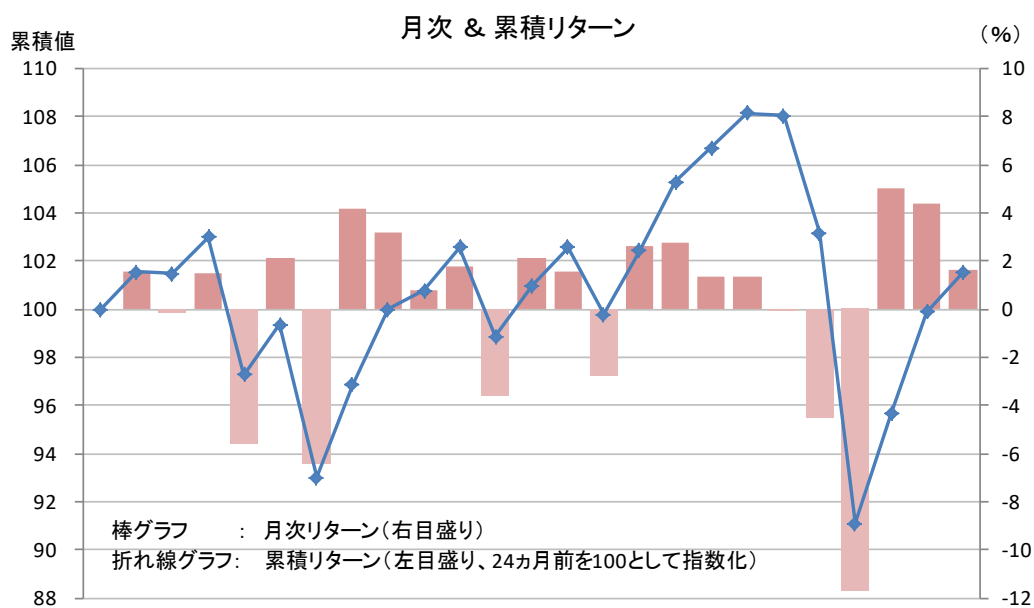
パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2020年6月

「総合」 +1.65 %

(前月 +4.41 %)



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		12,782	12,575	207	1.65
国内株式		15,479	15,340	139	0.90
一般		15,041	14,921	120	0.81
フリー		14,327	14,162	165	1.17
バリュー		18,439	18,549	-110	-0.59
小型		34,150	33,667	483	1.44
その他		15,126	14,991	135	0.90
日経225		14,753	14,468	285	1.97
TOPIX		14,711	14,740	-28	-0.19
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	13,975	13,987	-12	-0.09
国内債券		13,202	13,235	-34	-0.25
一般		13,202	13,235	-34	-0.25
外国株式(先進国)		15,255	14,813	442	2.98
グローバル		16,953	16,415	539	3.28
除く日本		22,183	21,741	443	2.04
含む日本		15,757	15,201	556	3.66
その他		11,745	11,504	240	2.09
北米		10,978	10,843	134	1.24
米国		18,228	17,867	361	2.02
カナダ	10,000 (2009.02.27)	14,505	14,152	354	2.50
欧州		17,310	16,796	514	3.06
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	8,231	7,822	409	5.23
イギリス	9,683 (2014.05.30)	7,192	7,163	28	0.40
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	31,344	30,191	1,153	3.82
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	12,647	12,361	286	2.32
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	34,606	32,213	2,393	7.43
複合地域	10,000 (2013.04.30)	5,238	5,430	-192	-3.54
エマージング株式		13,101	12,229	871	7.12
グローバル		13,834	12,991	844	6.50
BRICS	10,000 (2005.09.30)	20,721	19,419	1,302	6.71
その他		13,230	12,318	912	7.40
欧州		21,895	21,474	421	1.96
ロシア	10,000 (2007.03.30)	9,462	9,389	73	0.78
アジア・オセアニア		14,515	13,594	921	6.78
中国		39,647	35,541	4,105	11.55
インド	10,000 (2004.09.30)	25,999	23,894	2,105	8.81
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	10,456	9,549	907	9.50
タイ		18,492	18,159	332	1.83
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	6,297	5,716	581	10.16
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	11,919	12,358	-439	-3.55
韓国	10,000 (1997.06.30)	21,953	21,519	434	2.01
香港		20,481	19,301	1,179	6.11
台湾	10,000 (2008.03.31)	16,876	15,911	965	6.06
中南米	7,427 (2006.04.28)	6,239	5,817	422	7.25
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	6,641	6,124	518	8.46
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	6,587	6,568	19	0.28
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	7,814	7,662	152	1.99
トルコ		19,421	17,966	1,455	8.10
複合地域	10,000 (2005.08.31)	18,818	17,677	1,142	6.46

※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		12,782	12,575	207	1.65
外国債券(先進国)		17,932	17,634	298	1.69
グローバル		18,373	18,117	257	1.42
除く日本		19,878	19,581	297	1.52
含む日本		17,432	17,209	223	1.30
その他		16,717	16,315	402	2.46
北米	9,052 (2013.05.31)	10,575	10,393	182	1.75
米国		15,296	15,191	105	0.69
カナダ	10,000 (2003.05.30)	13,904	13,695	210	1.53
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,189	14,935	254	1.70
イギリス	10,069 (2014.07.31)	9,219	9,166	53	0.58
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	18,406	17,751	654	3.69
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	22,599	21,787	811	3.72
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	10,966	10,636	330	3.10
複合地域	10,000 (2001.11.30)	17,672	17,267	405	2.35
エマージング債券		15,767	15,446	321	2.08
グローバル		17,072	16,652	420	2.52
米ドル建て		17,556	17,050	506	2.97
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,024	11,925	98	0.82
その他	8,647 (2005.03.31)	11,569	11,381	188	1.65
ロシア	10,000 (2008.05.30)	10,836	10,664	172	1.61
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	14,343	13,996	347	2.48
インド	10,000 (2011.08.31)	15,415	15,106	309	2.05
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	13,365	12,793	572	4.47
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	10,058	9,954	104	1.04
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	10,873	11,063	-190	-1.72
トルコ	10,000 (2011.04.28)	5,655	5,496	159	2.89
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,086	10,005	81	0.81
ハイイールド債券		19,827	19,568	259	1.32
グローバル	10,000 (1997.06.30)	20,118	19,744	374	1.90
北米		19,195	19,048	147	0.77
その他	10,000 (2004.03.31)	20,111	19,540	572	2.93
欧州	10,000 (2006.04.28)	20,035	19,469	566	2.91
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	13,364	12,943	421	3.25
複合地域	10,000 (2004.03.31)	18,931	18,575	355	1.91
複合資産		16,809	16,694	115	0.69
安定	10,000 (1998.10.30)	15,288	15,215	73	0.48
安定成長		17,990	17,864	126	0.71
成長		19,918	19,751	167	0.85
国内バランス		12,439	12,476	-36	-0.29
安定		12,745	12,784	-39	-0.30
一般		13,881	13,861	21	0.15
その他	10,000 (2018.10.31)	12,048	11,757	291	2.48

※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		12,782	12,575	207	1.65
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	27,942	28,391	-450	-1.58
日本	10,000 (2003.10.31)	27,942	28,391	-450	-1.58
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	22,233	22,073	161	0.73
グローバル	10,000 (2004.01.30)	18,889	18,748	142	0.76
除く日本	10,000 (2004.04.30)	20,525	20,317	208	1.03
含む日本	10,000 (2004.01.30)	18,929	18,803	126	0.67
北米	10,000 (2003.09.30)	22,514	22,478	35	0.16
その他	10,000 (2004.04.30)	22,982	22,194	788	3.55
欧州	10,000 (2006.12.29)	4,664	4,607	57	1.24
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	17,584	16,811	773	4.60
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	11,404	11,268	136	1.20
複合地域	10,000 (2007.06.29)	5,021	4,902	119	2.43
複数国	10,000 (2004.04.30)	30,447	30,510	-63	-0.21
その他		5,887	5,787	100	1.73
絶対収益型		7,673	7,644	28	0.37
ロング・ショート		8,694	8,700	-6	-0.07
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	12,220	12,008	212	1.76
GTAA		10,712	10,672	40	0.37
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,158	7,144	14	0.20
CB		18,582	18,052	530	2.94
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	15,100	14,390	709	4.93
日本		19,527	19,522	5	0.03
グローバル		32,630	31,675	955	3.02
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	8,007	7,664	342	4.46
全業種	10,000 (2004.12.30)	5,001	4,813	187	3.90
貴金属	10,000 (2009.07.31)	17,541	16,951	590	3.48
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	3,223	2,887	336	11.62
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	7,813	7,681	132	1.72

※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	11.43	-6.11	0.54	-6.11
国内株式	15.97	-6.67	4.61	-6.67
一般	15.13	-7.08	4.09	-7.08
フリー	16.51	-5.89	5.53	-5.89
バリュー	9.92	-11.56	-1.31	-11.56
小型	27.35	-2.88	8.80	-2.88
その他	14.47	-6.78	4.46	-6.78
日経225	17.79	-4.79	6.58	-4.79
TOPIX	11.15	-8.28	2.81	-8.28
JPX日経400	11.73	-7.59	3.69	-7.59
国内債券	-0.26	-0.91	-1.52	-0.91
一般	-0.26	-0.91	-1.52	-0.91
外国株式(先進国)	20.69	-2.20	7.98	-2.20
グローバル	20.69	-1.55	9.16	-1.55
除く日本	17.35	-8.68	1.44	-8.68
含む日本	21.68	0.66	11.56	0.66
その他	20.74	-4.24	4.17	-4.24
北米	19.97	-8.18	-2.25	-8.18
米国	20.26	-0.15	9.85	-0.15
カナダ	17.74	-16.93	-12.35	-16.93
欧州	16.88	-10.37	-1.10	-10.37
ドイツ	25.32	-10.27	-2.81	-10.27
イギリス	7.94	-21.78	-16.89	-21.78
アジア・オセアニア	16.05	-12.03	-3.78	-12.03
オーストラリア	26.06	-22.05	-18.94	-22.05
ニュージーランド	21.07	-5.86	2.05	-5.86
複合地域	17.31	-40.19	-39.65	-40.19
エマージング株式	19.13	-14.49	-9.33	-14.49
グローバル	19.60	-10.51	-1.17	-10.51
BRICS	21.06	-18.81	-10.92	-18.81
その他	18.86	-15.91	-12.24	-15.91
欧州	23.81	-21.43	-13.85	-21.43
ロシア	25.42	-17.08	-7.09	-17.08
アジア・オセアニア	15.70	-10.64	-5.15	-10.64
中国	19.24	10.53	26.22	10.53
インド	19.71	-21.12	-20.28	-21.12
インドネシア	30.79	-27.18	-26.70	-27.18
タイ	25.76	-17.65	-24.73	-17.65
フィリピン	17.60	-23.77	-25.03	-23.77
ベトナム	26.06	-17.22	-15.41	-17.22
韓国	34.41	5.49	5.69	5.49
香港	4.85	-14.12	-12.92	-14.12
台湾	23.24	-2.30	17.26	-2.30
中南米	22.21	-32.51	-26.24	-32.51
ブラジル	20.24	-38.47	-32.29	-38.47
メキシコ	15.29	-32.16	-26.45	-32.16
中東・アフリカ	15.53	-17.69	-15.68	-17.69
トルコ	20.69	-14.37	-0.83	-14.37
複合地域	15.63	-12.02	-7.19	-12.02

※[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	11.43	-6.11	0.54	-6.11
外国債券(先進国)	5.17	-0.10	1.80	-0.10
グローバル	3.96	0.57	2.38	0.57
除く日本	3.20	1.89	4.11	1.89
含む日本	4.84	-0.95	0.42	-0.95
その他	8.73	-1.88	0.24	-1.88
北米	6.37	1.24	2.34	1.24
米国	6.07	-4.57	-0.89	-4.57
カナダ	5.41	-1.67	-0.15	-1.67
欧州	3.25	-0.80	-1.15	-0.80
イギリス	2.00	-5.34	-0.54	-5.34
アジア・オセアニア	12.25	-1.34	0.39	-1.34
オーストラリア	12.31	-1.56	0.12	-1.56
ニュージーランド	9.80	-1.17	0.84	-1.17
複合地域	4.03	4.92	8.19	4.92
エマージング債券	7.42	-10.28	-7.59	-10.28
グローバル	10.75	-10.25	-7.13	-10.25
米ドル建て	11.30	-10.60	-7.70	-10.60
現地通貨建て	8.66	-8.79	-4.73	-8.79
その他	4.45	-10.33	-8.02	-10.33
ロシア	20.47	-9.66	0.97	-9.66
アジア・オセアニア	8.24	-1.00	2.91	-1.00
インド	5.18	-3.31	-1.65	-3.31
インドネシア	19.43	-3.02	3.23	-3.02
ブラジル	-1.29	-23.31	-23.29	-23.31
メキシコ	10.65	-13.82	-4.26	-13.82
トルコ	4.27	-6.80	12.93	-6.80
複合地域	7.35	-11.69	-5.79	-11.69
ハイイールド債券	10.42	-11.23	-7.38	-11.23
グローバル	10.32	-11.15	-8.08	-11.15
北米	9.66	-11.16	-7.16	-11.16
その他	13.42	-11.47	-7.50	-11.47
欧州	13.82	-12.43	-8.07	-12.43
アジア・オセアニア	12.24	-8.24	-5.91	-8.24
複合地域	10.52	-3.23	0.03	-3.23
複合資産	5.73	-5.11	-0.48	-5.11
安定	3.89	-2.99	0.02	-2.99
安定成長	6.30	-5.28	-0.25	-5.28
成長	9.82	-6.22	1.19	-6.22
国内バランス	0.09	-7.20	-4.21	-7.20
安定	-0.19	-7.24	-4.51	-7.24
一般	6.32	-5.37	1.38	-5.37
その他	10.91	-7.31	2.56	-7.31

※[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か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	11.43	-6.11	0.54	-6.11
国内REIT	5.11	-20.83	-11.05	-20.83
日本	5.11	-20.83	-11.05	-20.83
外国REIT	8.91	-19.32	-13.58	-19.32
グローバル	9.15	-21.65	-15.60	-21.65
除く日本	10.26	-21.48	-14.54	-21.48
含む日本	8.81	-21.71	-15.88	-21.71
北米	7.14	-17.67	-11.29	-17.67
その他	17.66	-18.34	-16.75	-18.34
欧州	8.96	-23.13	-12.50	-23.13
アジア・オセアニア	16.22	-15.75	-15.74	-15.75
オーストラリア	33.45	-27.15	-24.52	-27.15
複合地域	17.98	-33.67	-27.87	-33.67
複数国	7.91	-17.25	-9.74	-17.25
その他	6.62	-1.94	2.49	-1.94
絶対収益型	1.41	-1.49	-1.25	-1.49
ロング・ショート	-0.14	-3.53	-3.12	-3.53
マーケットニュートラル	5.53	2.82	1.62	2.82
GTAA	3.46	-1.39	0.19	-1.39
その他スタイル	0.80	-1.89	-1.45	-1.89
CB	11.61	-2.34	0.71	-2.34
アジア・オセアニア	12.81	-3.18	-0.13	-3.18
日本	3.81	-3.63	-1.39	-3.63
グローバル	11.96	-2.26	0.83	-2.26
コモディティ	8.97	-1.20	3.53	-1.20
全業種	4.14	-24.74	-22.28	-24.74
貴金属	9.14	16.26	23.28	16.26
エネルギー	19.81	-35.33	-31.76	-35.33
その他コモディティ	10.73	-25.67	-22.08	-25.67

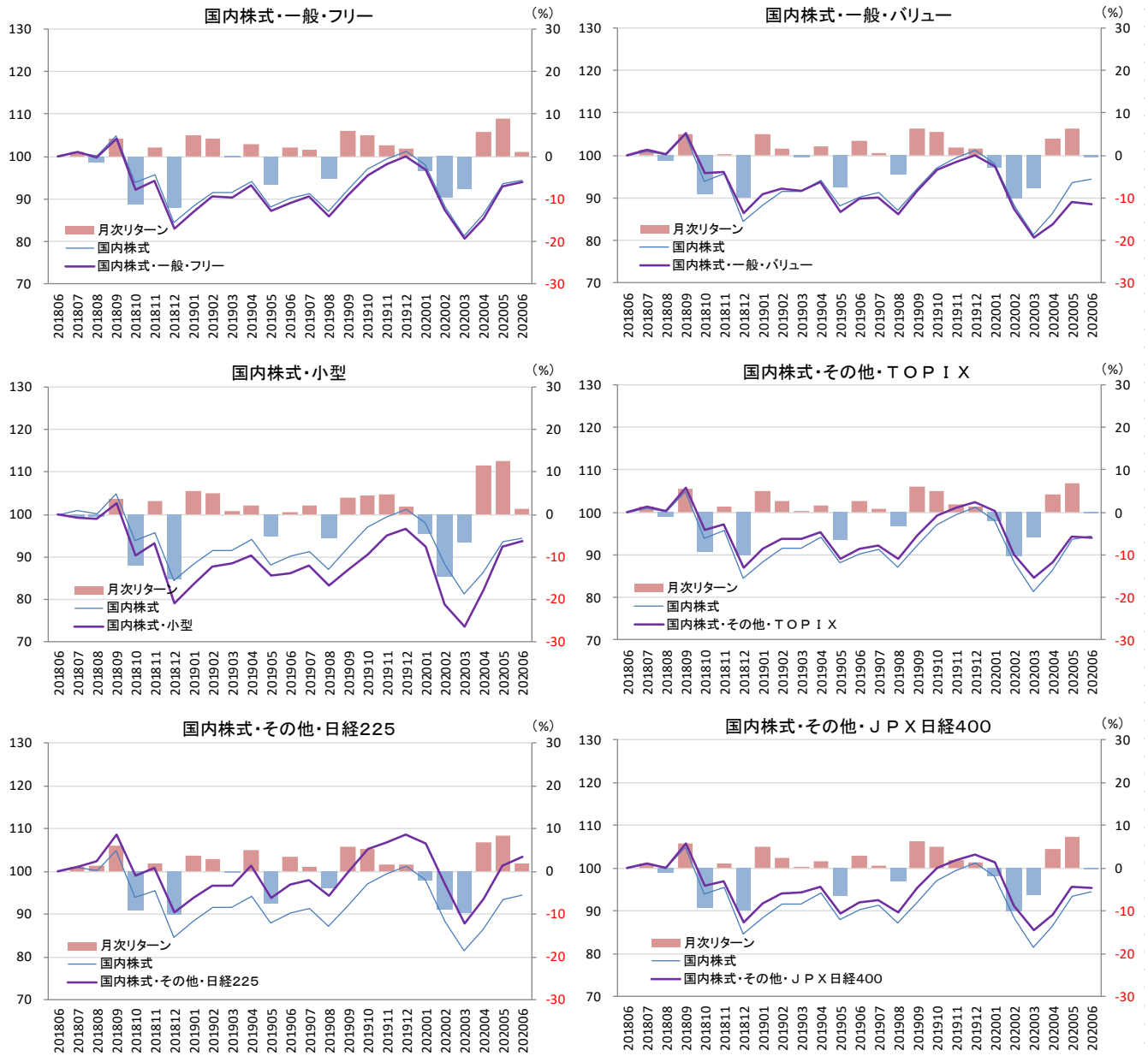
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

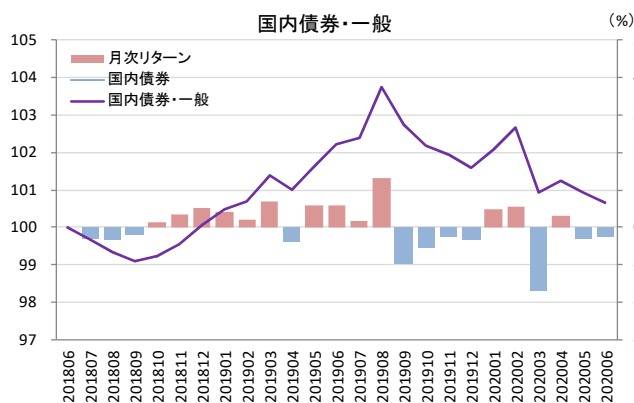
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

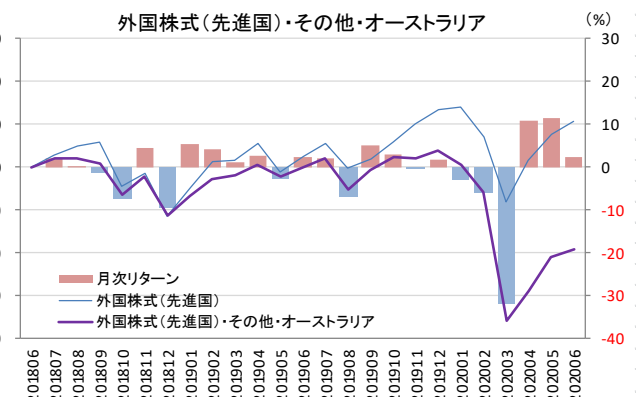
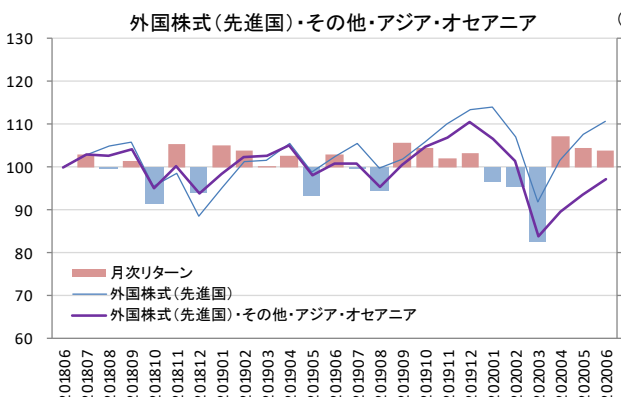
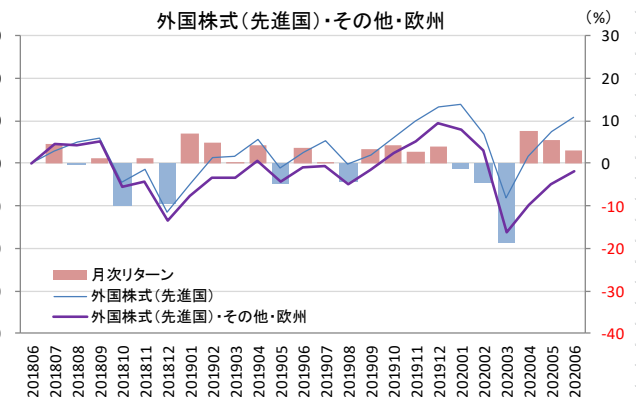
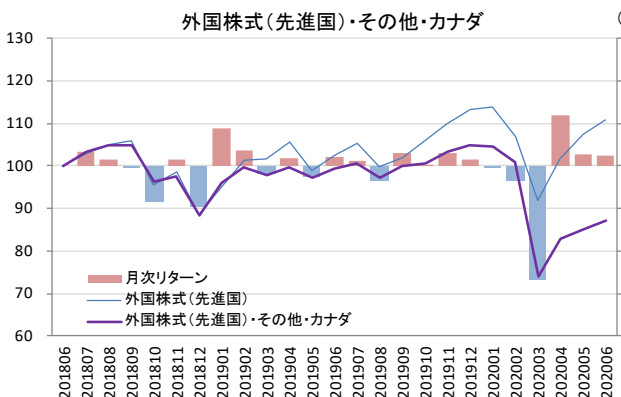
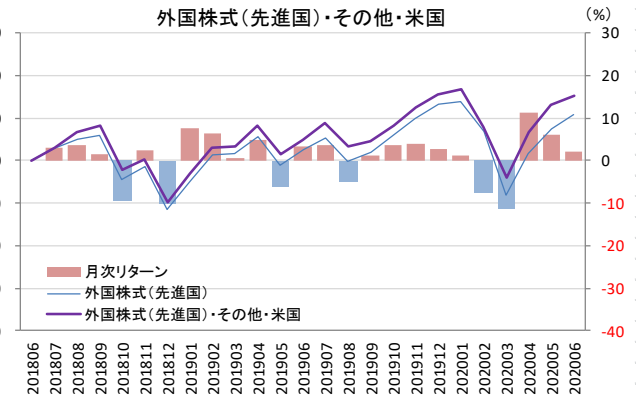
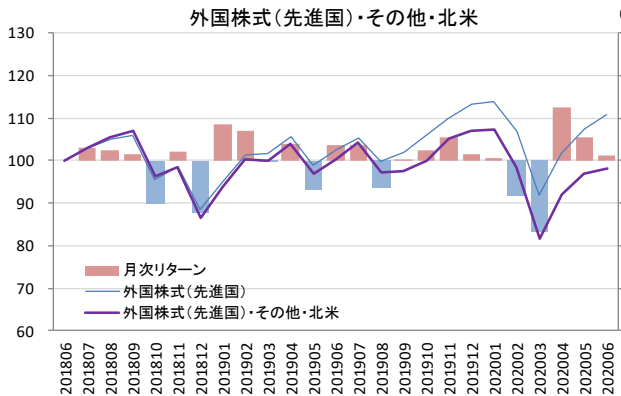
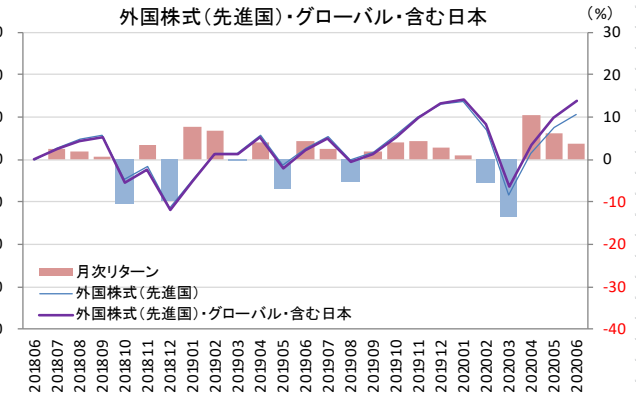
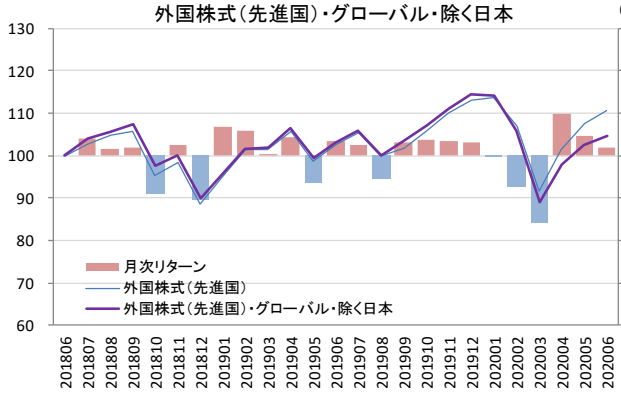


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

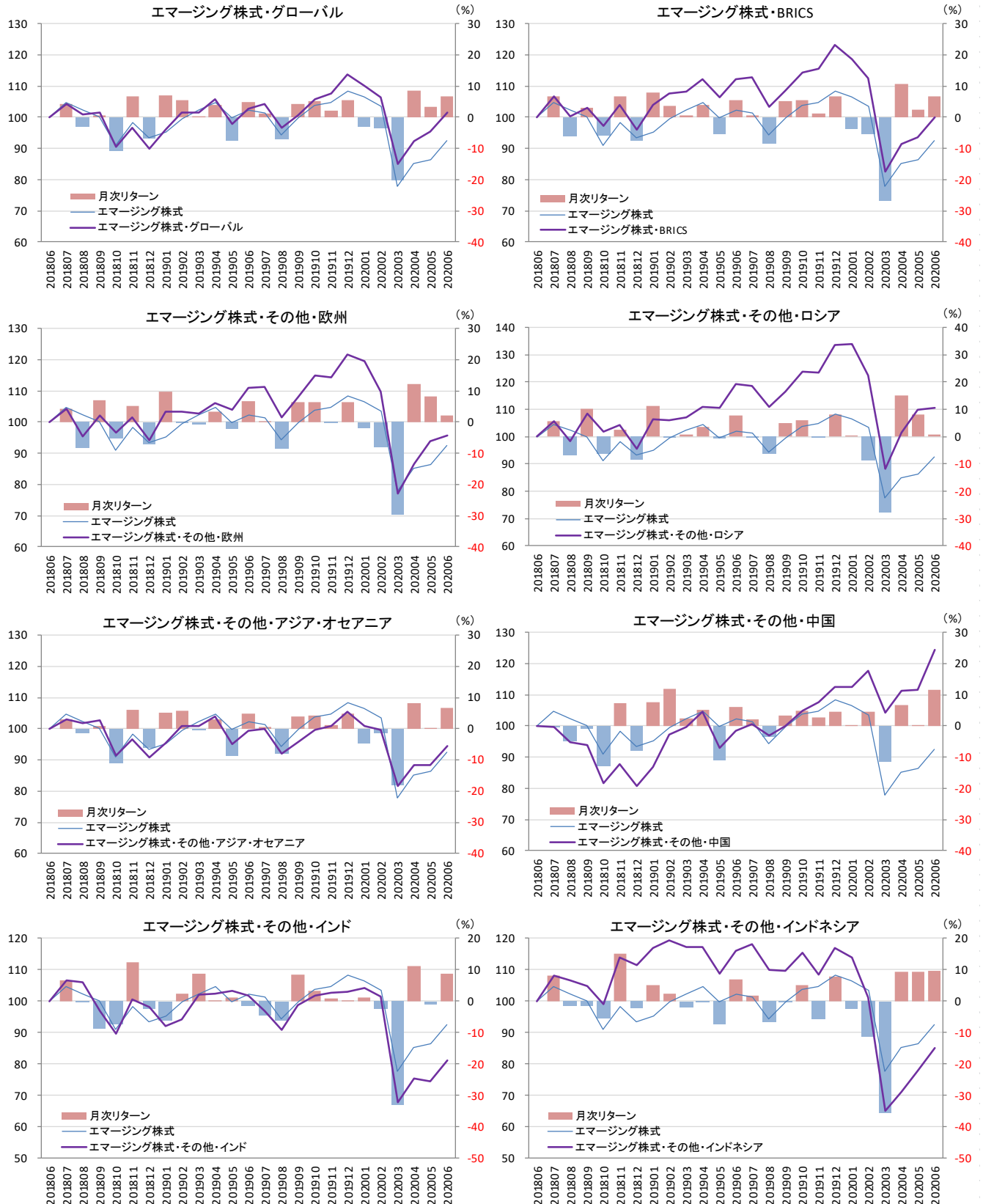


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

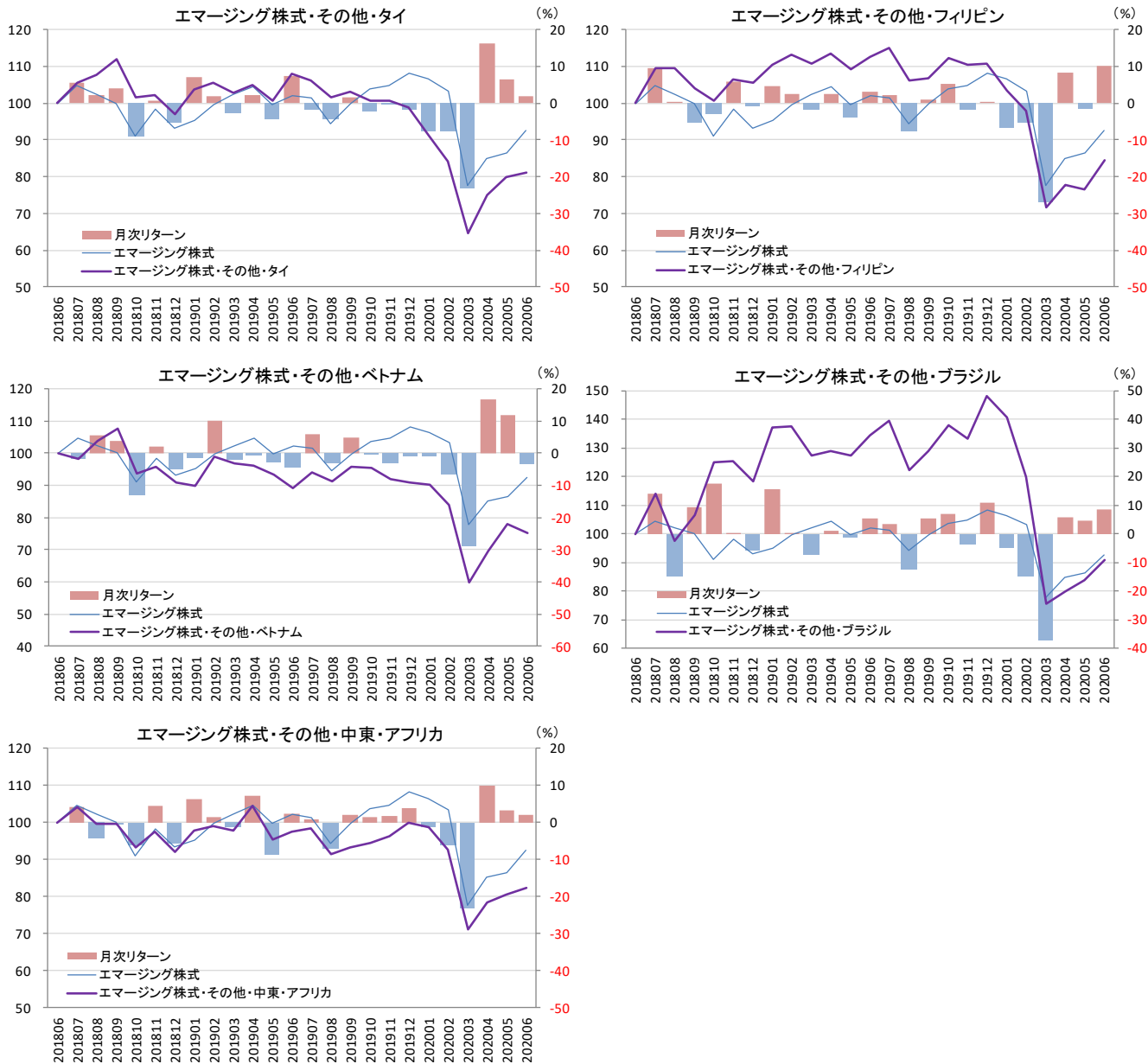


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

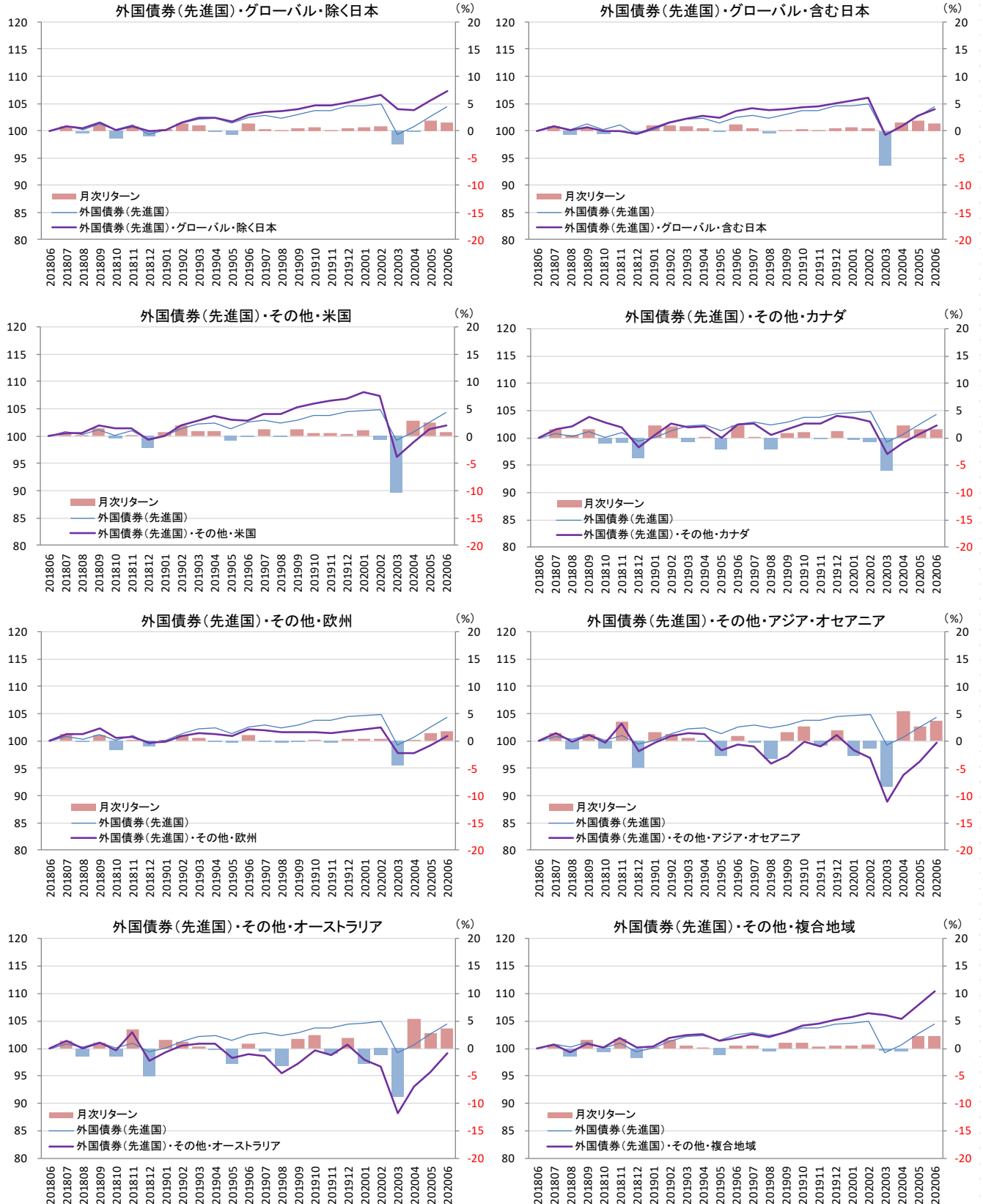


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

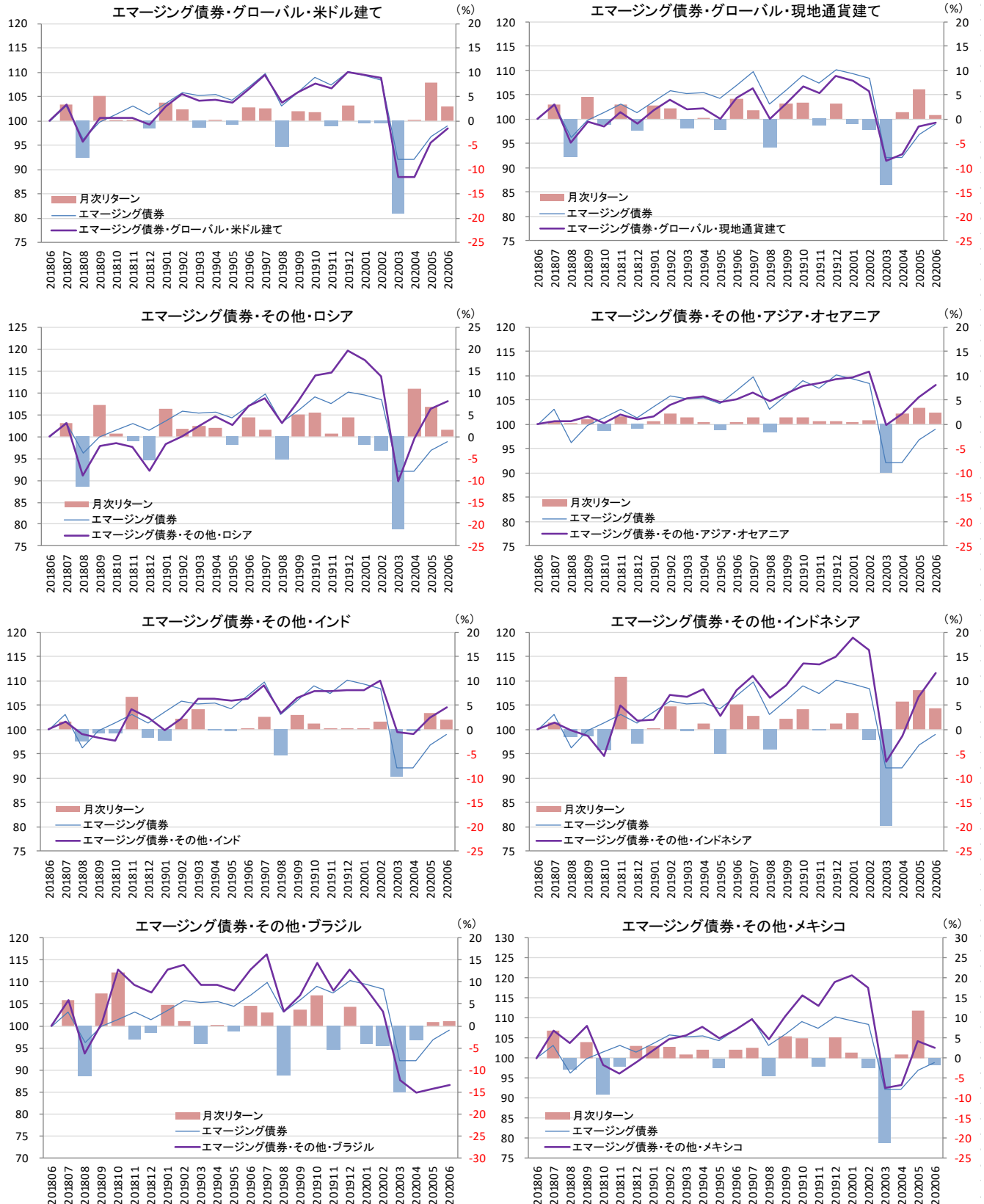


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

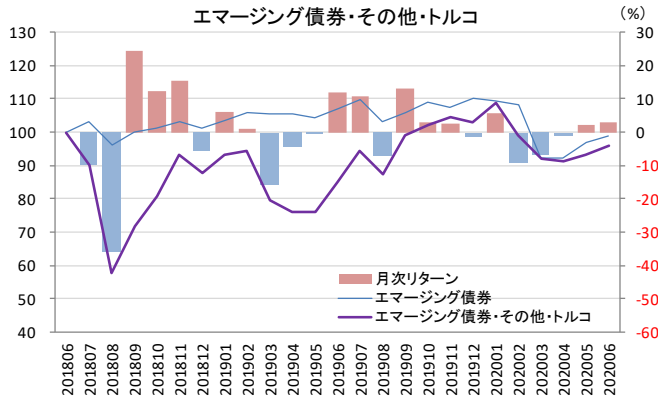


<1>パフォーマンス・サマリー

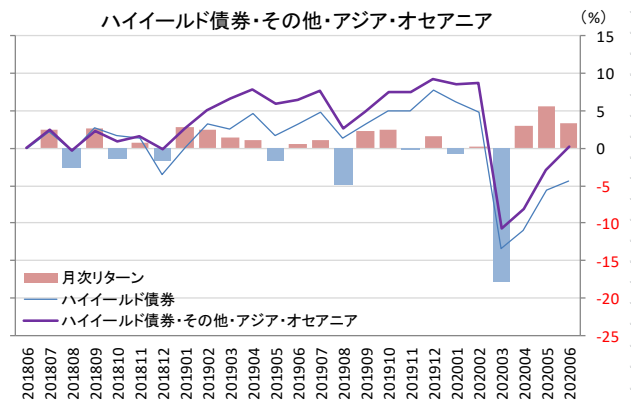
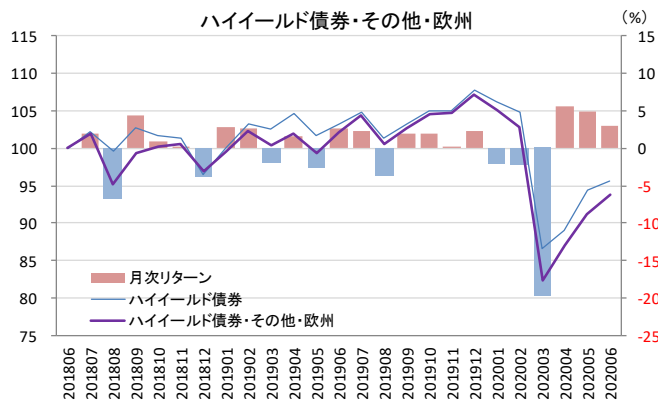
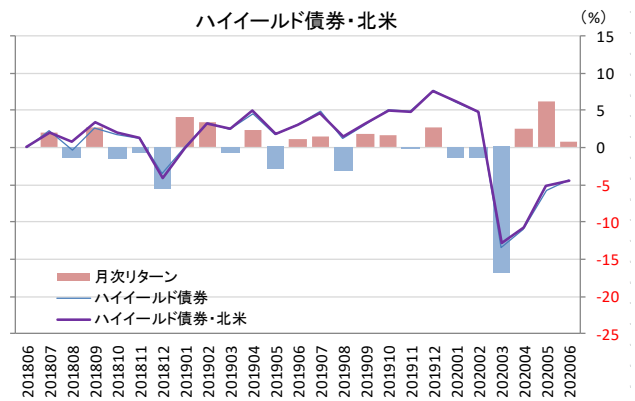
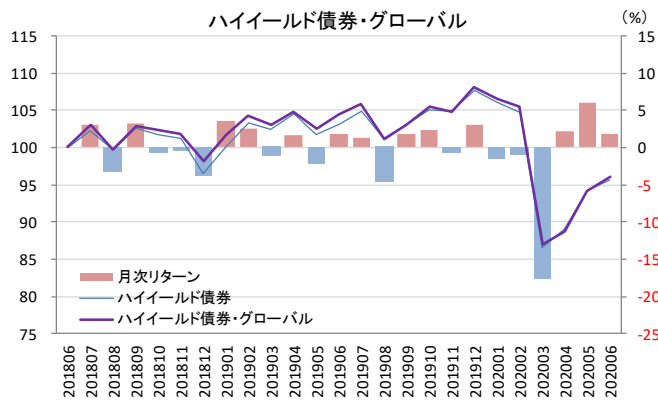
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

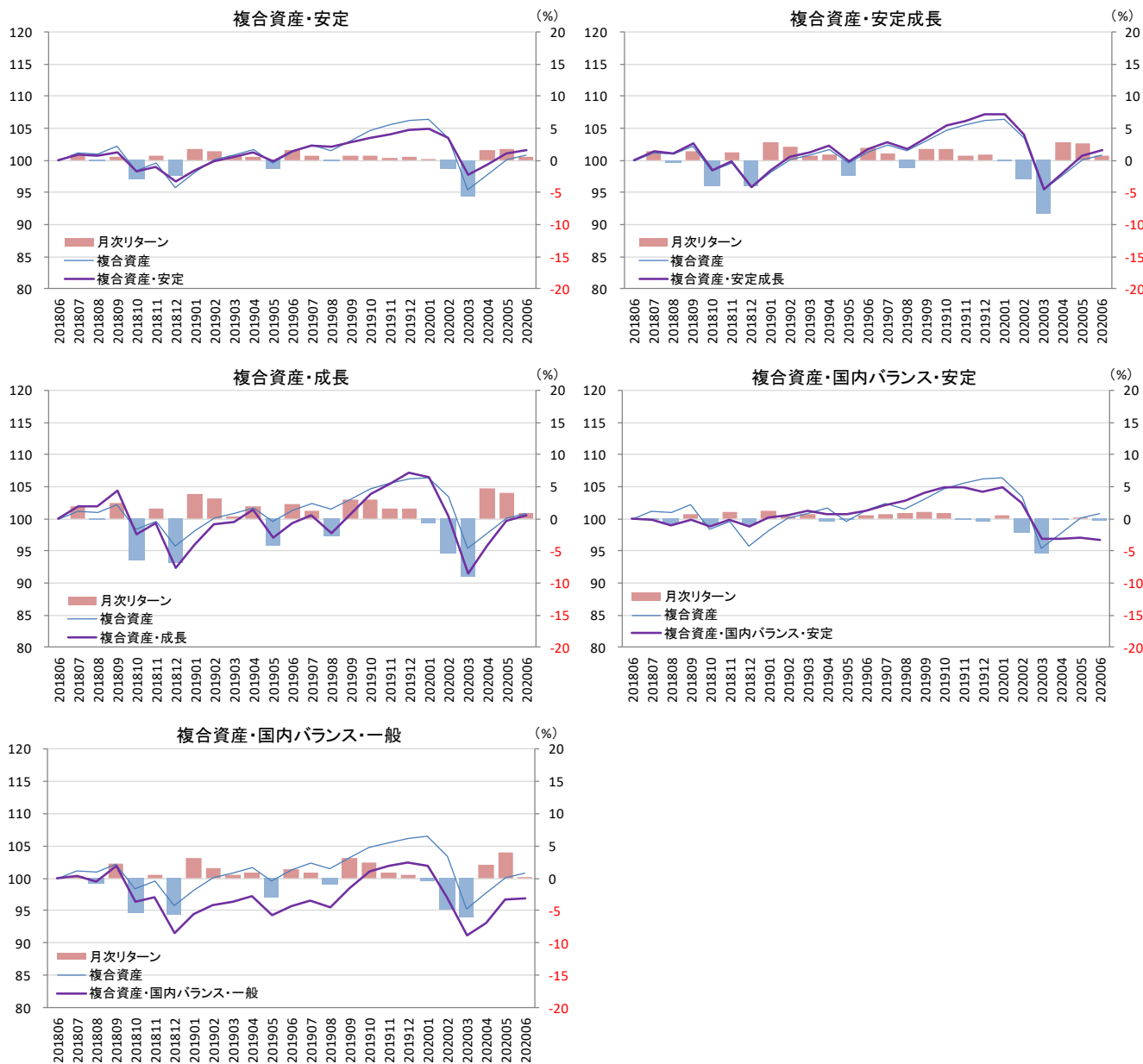


<1>パフォーマンス・サマリー

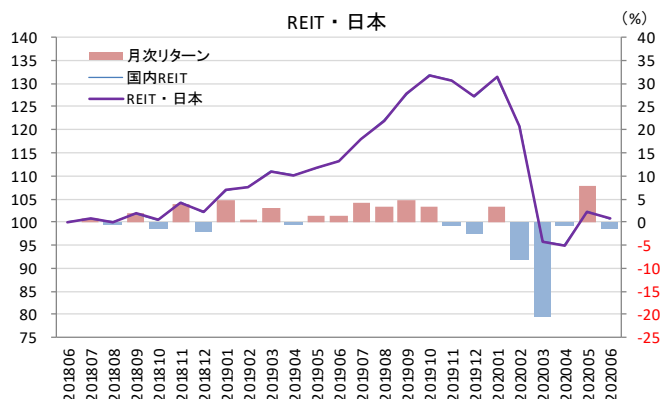
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

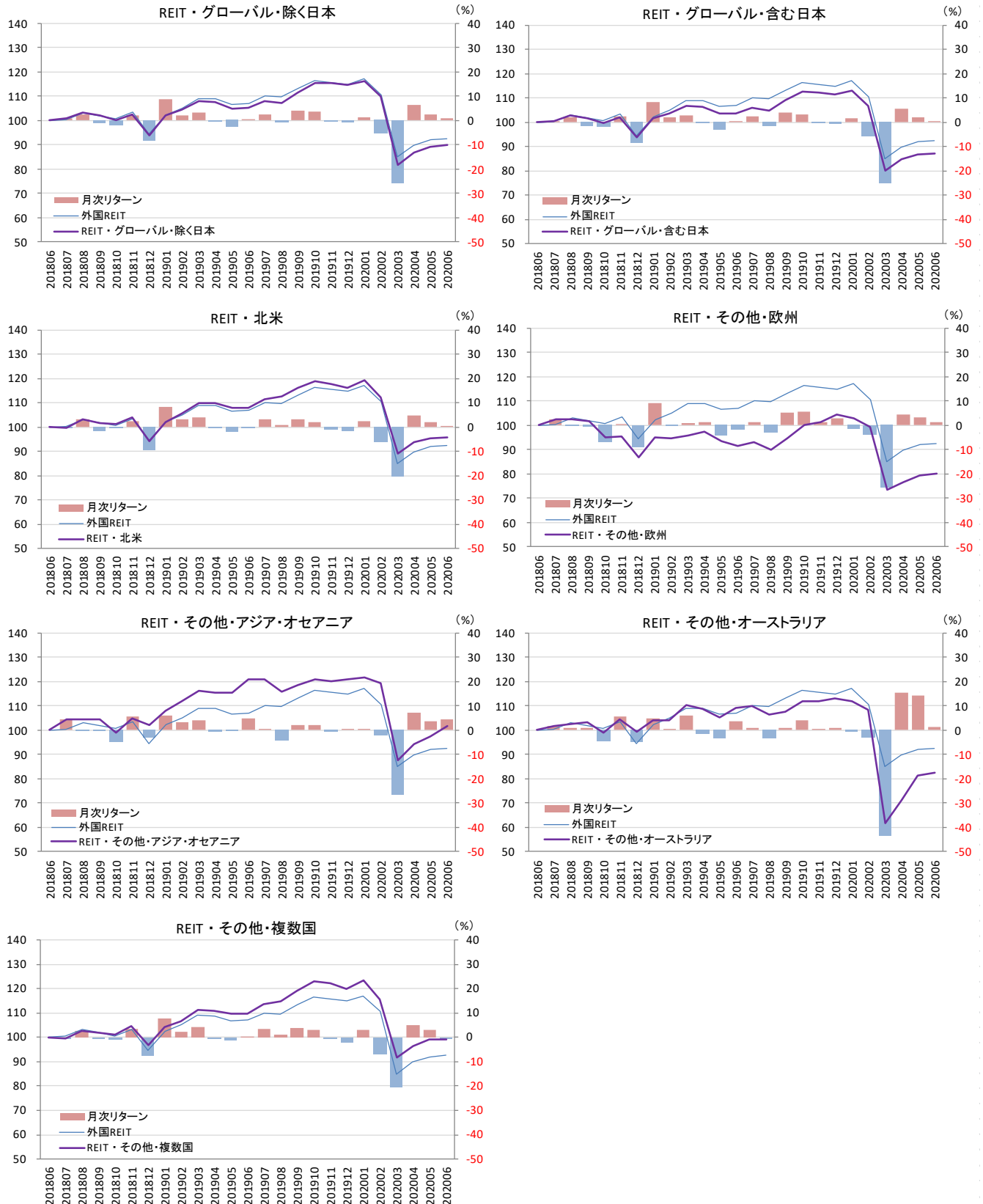


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

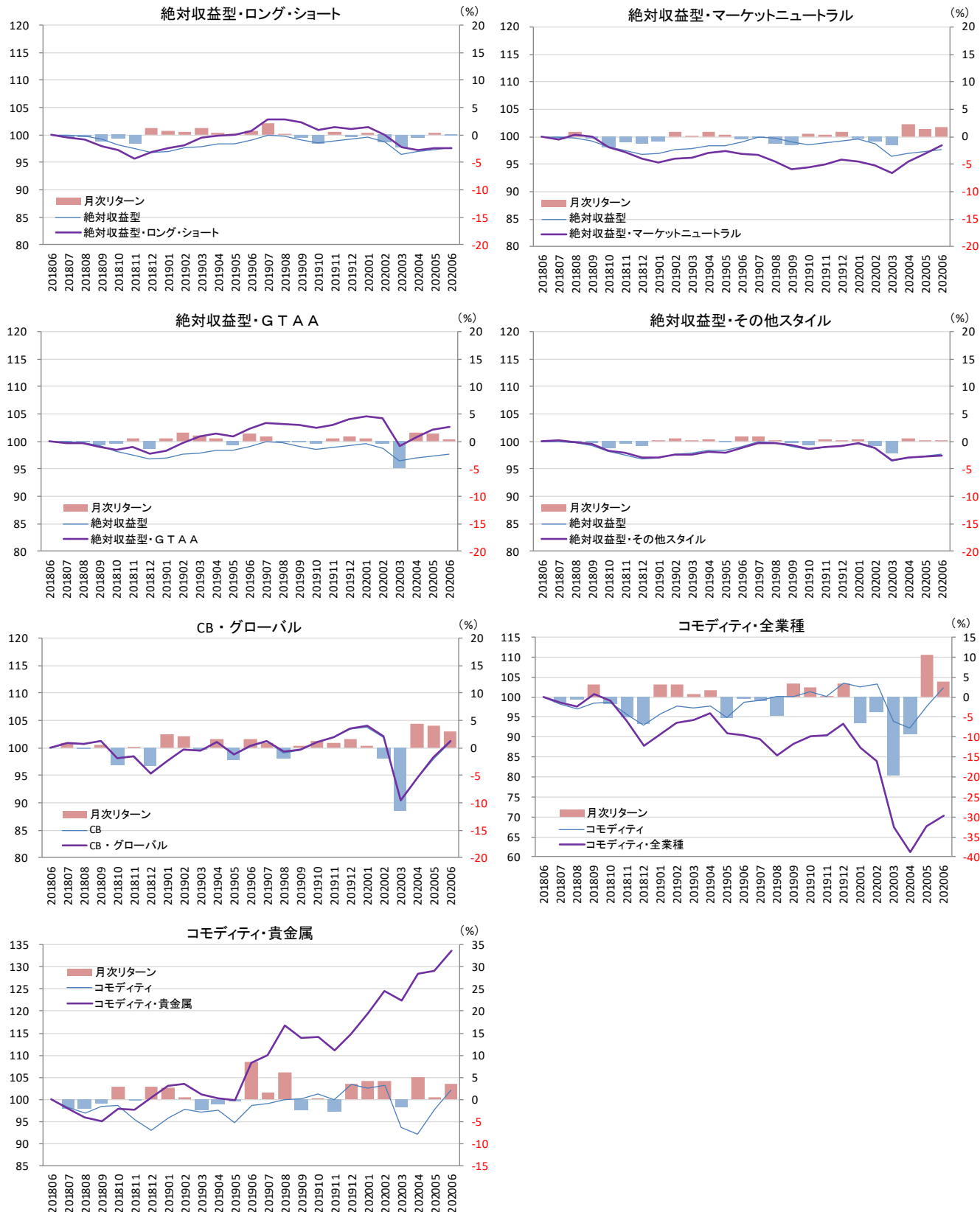


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	1.65		
1	外国株式(先進国)・グローバル	3.28	20.39	0.67
2	エマージング株式・その他	7.40	2.70	0.18
3	外国株式(先進国)・その他	2.09	6.80	0.14
4	外国債券(先進国)・グローバル	1.42	9.59	0.13
5	外国債券(先進国)・その他	2.46	3.43	0.08
6	国内株式・一般	0.81	8.80	0.08
7	エマージング株式・グローバル	6.50	1.15	0.07
8	複合資産・安定成長	0.71	7.43	0.05
9	国内株式・その他	0.90	4.85	0.05
10	複合資産・その他	2.48	1.21	0.03
11	エマージング債券・グローバル	2.52	1.22	0.03
12	複合資産・安定	0.48	4.54	0.02
13	REIT・グローバル	0.76	2.59	0.02
14	国内株式・小型	1.44	1.32	0.02
15	REIT・その他	3.55	0.66	0.02
16	エマージング債券・その他	1.65	1.28	0.02
17	複合資産・成長	0.85	2.16	0.02
18	コモディティ	4.46	0.37	0.02
19	ハイイールド債券・その他	2.93	0.54	0.01
20	ハイイールド債券・北米	0.77	2.04	0.01
21	REIT・北米	0.16	3.33	0.01
22	ブルベア	2.75	0.33	0.01
23	ハイイールド債券・グローバル	1.90	0.48	0.01
24	CB	2.94	0.20	0.01
25	エマージング株式・BRICS	6.71	0.09	0.01
26	絶対収益型	0.37	1.23	0.00
27	国内株式・業種特化	2.00	0.11	0.00
28	複合資産・国内バランス	-0.29	1.67	-0.00
29	国内債券・一般	-0.25	5.48	-0.01
30	REIT・日本	-1.58	4.02	-0.07
	合計		100.00	1.65

◆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	0.54		
1	外国株式(先進国)・グローバル	9.16	18.99	1.99
2	国内株式・一般	4.09	9.11	0.68
3	国内株式・その他	4.46	4.79	0.47
4	外国株式(先進国)・その他	4.17	5.69	0.39
5	国内株式・小型	8.80	1.43	0.17
6	外国債券(先進国)・グローバル	2.38	9.86	0.16
7	ブルベア	12.04	0.30	0.06
8	複合資産・成長	1.19	2.05	0.06
9	コモディティ	3.53	0.32	0.01
10	国内株式・業種特化	7.09	0.11	0.01
11	CB	0.71	0.23	-0.00
12	外国債券(先進国)・その他	0.24	3.58	-0.01
13	エマージング株式・BRICS	-10.92	0.10	-0.01
14	絶対収益型	-1.25	1.20	-0.03
15	エマージング株式・グローバル	-1.17	1.22	-0.03
16	複合資産・安定	0.02	4.58	-0.03
17	複合資産・安定成長	-0.25	7.18	-0.04
18	ハイイールド債券・グローバル	-8.08	0.53	-0.06
19	複合資産・その他	2.56	0.82	-0.07
20	ハイイールド債券・その他	-7.50	0.63	-0.07
21	複合資産・国内バランス	-4.21	1.63	-0.10
22	国内債券・一般	-1.52	5.50	-0.11
23	エマージング債券・グローバル	-7.13	1.36	-0.15
24	エマージング債券・その他	-8.02	1.53	-0.15
25	REIT・その他	-16.75	0.76	-0.19
26	ハイイールド債券・北米	-7.16	2.24	-0.23
27	REIT・北米	-11.29	3.69	-0.51
28	REIT・日本	-11.05	4.49	-0.55
29	エマージング株式・その他	-12.24	3.24	-0.55
30	REIT・グローバル	-15.60	2.84	-0.57
	合計		100.00	0.54

◆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	4.07	4.18	77.77	11.53	↑ 11.30	11.57	0.12	0.08	0.51
国内株式	5.63	8.11	131.36	16.91	17.35	17.25	0.11	0.09	0.51
一般	2.99	4.66	115.72	16.92	17.57	17.55	0.06	0.05	0.45
フリー	4.63	6.14	119.28	17.25	17.94	18.18	0.09	0.07	0.45
バリュー	-3.11	-0.76	106.82	15.88	16.47	16.22	-0.06	-0.01	0.46
小型	16.05	37.93	244.31	20.74	18.91	18.07	0.25	0.35	0.73
その他	9.18	10.63	147.74	16.16	16.83	16.90	0.19	0.12	0.56
日経225	16.26	18.17	170.24	17.01	17.31	17.22	0.31	0.20	0.61
TOPIX	2.77	5.25	122.00	15.37	16.32	16.51	0.06	0.07	0.50
JPX日経400	3.05	3.82	-	15.24	16.00	-	0.07	0.05	-
国内債券	1.44	4.66	12.49	1.82	1.88	1.64	0.29	0.50	0.71
一般	1.44	4.66	12.49	1.82	1.88	1.64	0.29	0.50	0.71
外国株式(先進国)	17.67	17.64	133.47	17.72	↑ 17.15	16.42	0.32	0.19	0.54
グローバル	19.55	20.55	146.13	17.74	↑ 16.92	16.29	0.35	0.23	0.58
除く日本	12.65	16.05	173.58	18.28	↑ 18.10	17.91	0.22	0.17	0.59
含む日本	21.73	21.88	140.40	17.66	↑ 16.67	15.97	0.39	0.24	0.57
その他	12.46	10.63	114.40	17.80	17.81	17.68	0.23	0.12	0.45
北米	7.30	1.85	59.77	20.82	↑ 19.92	21.32	0.12	0.02	0.22
米国	26.78	22.64	141.96	17.45	↑ 18.25	17.68	0.47	0.23	0.52
カナダ	-12.77	-19.50	-0.01	21.07	18.52	17.77	-0.21	-0.23	-0.00
欧州	-1.58	0.62	110.85	18.18	↑ 17.35	18.69	-0.03	0.01	0.41
ドイツ	-10.90	-9.17	-	22.17	↑ 22.23	↑ -	-0.17	-0.08	-
イギリス	-23.11	-33.39	-	18.41	↑ 17.59	-	-0.45	-0.44	-
アジア・オセアニア	2.99	3.15	116.83	17.03	↑ 17.19	17.88	0.06	0.04	0.45
オーストラリア	-22.10	-13.87	52.21	24.30	22.02	21.45	-0.33	-0.13	0.20
ニュージーランド	20.38	58.48	-	18.00	18.81	↑ -	0.36	0.51	-
複合地域	-44.83	-55.13	-	32.17	↑ 27.54	-	-0.56	-0.54	-
エマージング株式	-6.07	-7.97	38.09	20.68	↑ 19.45	↑ 19.25	-0.10	-0.08	0.17
グローバル	4.43	-1.21	43.53	20.01	↑ 19.16	↑ 18.94	0.08	-0.01	0.19
BRICS	7.10	8.23	51.21	23.51	↑ 22.44	↑ 22.07	0.10	0.07	0.19
その他	-10.21	-10.98	38.48	21.37	↑ 19.89	↑ 19.45	-0.16	-0.11	0.17
欧州	-0.76	7.06	17.17	25.77	↑ 23.86	24.96	-0.01	0.06	0.06
ロシア	25.92	40.04	44.01	25.94	25.10	27.30	0.31	0.28	0.14
アジア・オセアニア	-4.56	-8.71	63.53	18.96	↑ 18.25	↑ 17.85	-0.08	-0.10	0.28
中国	38.77	25.38	159.16	20.46	↑ 21.62	21.90	0.57	0.22	0.46
インド	-18.82	-11.27	32.60	26.71	↑ 24.52	↑ 25.79	-0.25	-0.10	0.11
インドネシア	-29.12	-23.81	11.12	29.26	↑ 26.45	↑ 24.71	↑ -0.37	↑ -0.20	0.04
タイ	-14.05	-12.00	96.83	22.52	19.43	↑ 18.92	-0.22	-0.13	0.37
フィリピン	-28.34	-40.33	95.28	22.23	↑ 20.04	↑ 21.69	-0.47	-0.49	0.32
ベトナム	-13.28	0.64	32.34	27.43	23.05	↑ 21.67	-0.17	0.01	0.13
韓国	-13.43	-23.99	28.35	22.94	↑ 20.27	20.44	-0.20	-0.26	0.12
香港	-2.85	-3.31	45.65	19.29	↑ 19.57	19.38	-0.05	-0.03	0.20
台湾	6.67	8.47	143.95	22.07	↑ 19.90	18.99	0.10	0.08	0.49
中南米	-15.30	-20.15	-18.04	31.37	↑ 28.53	↑ 25.75	-0.17	-0.15	-0.08
ブラジル	-15.84	-21.34	-42.11	36.25	↑ 35.71	31.41	-0.15	-0.13	-0.17
メキシコ	-41.08	-47.17	-	29.96	26.45	-	-0.54	-0.45	-
中東・アフリカ	-15.07	-30.49	39.89	19.58	↑ 18.64	17.69	-0.27	-0.37	0.19
トルコ	-41.37	-48.82	-35.07	36.61	↑ 31.46	↑ 31.06	-0.44	-0.40	-0.14
複合地域	-11.15	-15.42	56.12	18.34	↑ 17.28	↑ 16.67	-0.21	-0.19	0.27

※[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	4.07	4.18	77.77	11.53	↑ 11.30	11.57	0.12	0.08	0.51
外国債券(先進国)	1.65	-2.69	41.93	4.65	5.49	7.71	0.13	-0.09	0.46
グローバル	3.32	-0.54	42.02	3.87	↑ 4.81	6.93	0.30	-0.02	0.51
除く日本	4.89	-0.54	47.09	3.66	5.00	7.54	0.45	-0.01	0.52
含む日本	1.51	-0.37	36.11	4.61	↑ 4.97	6.41	0.12	-0.01	0.49
その他	-2.68	-7.49	40.97	7.42	7.81	↑ 9.63	-0.11	-0.19	0.36
北米	2.44	0.54	-	4.96	↑ 4.68	-	0.17	0.03	-
米国	-0.28	-4.61	40.27	7.37	↑ 6.94	6.93	-0.01	-0.13	0.49
カナダ	-2.20	-14.67	11.50	7.17	8.27	9.15	-0.10	-0.37	0.12
欧州	1.47	-3.10	45.23	4.77	6.26	9.50	0.11	-0.10	0.40
イギリス	-5.29	-20.42	-	8.15	10.49	-	-0.21	-0.42	-
アジア・オセアニア	-4.67	-8.22	46.11	9.28	↑ 9.51	↑ 10.86	-0.16	-0.18	0.35
オーストラリア	-5.06	-8.59	42.96	9.40	↑ 9.62	↑ 11.08	-0.18	-0.18	0.33
ニュージーランド	-2.26	2.77	-	9.13	9.72	-	-0.08	0.06	-
複合地域	7.81	5.18	41.95	4.30	6.55	9.17	0.60	0.16	0.39
エマージング債券	-9.02	-4.15	28.96	12.62	↑ 12.48	↑ 13.19	-0.24	-0.07	0.19
グローバル	-9.58	-4.89	31.19	14.46	↑ 13.41	↑ 13.54	-0.22	-0.07	0.20
米ドル建て	-9.94	-3.99	33.75	14.96	↑ 13.81	↑ 13.83	-0.23	-0.06	0.21
現地通貨建て	-7.97	-11.14	16.05	13.02	12.29	12.40	-0.21	-0.19	0.12
その他	-8.53	-3.74	23.34	11.35	12.28	13.71	-0.25	-0.06	0.15
ロシア	5.82	18.94	31.62	19.80	19.79	↓ 22.62	0.10	0.18	0.12
アジア・オセアニア	4.14	2.26	55.69	7.45	↑ 7.67	↑ 8.92	0.19	0.06	0.50
インド	-3.06	2.27	-	9.66	10.44	↑ -	-0.10	0.05	-
インドネシア	0.33	8.21	-	17.22	↑ 16.59	↑ -	0.01	0.10	-
ブラジル	-21.69	-12.51	7.21	19.64	↑ 19.80	18.29	-0.40	-0.13	0.04
メキシコ	-6.35	-20.88	-	19.32	18.22	-	-0.11	-0.25	-
トルコ	-34.19	-48.32	-	36.32	29.66	-	-0.36	-0.42	-
複合地域	-2.58	-15.12	15.00	13.09	13.16	13.73	-0.06	-0.24	0.10
ハイイールド債券	-7.87	-3.97	61.86	12.99	12.48	12.79	-0.20	-0.06	0.38
グローバル	-8.48	-3.55	54.15	13.14	↑ 12.56	↑ 13.02	-0.22	-0.05	0.34
北米	-6.64	-3.50	67.94	12.81	12.42	12.40	-0.17	-0.05	0.43
その他	-10.97	-6.36	67.45	14.38	↑ 13.46	↑ 15.34	-0.26	-0.09	0.34
欧州	-12.33	-7.62	81.94	15.12	↑ 14.21	↑ 16.44	-0.28	-0.11	0.37
アジア・オセアニア	-6.10	-1.11	-	12.83	↑ 11.81	↑ -	-0.16	-0.02	-
複合地域	1.33	1.17	84.55	9.40	9.74	↑ 11.51	0.05	0.03	0.55
複合資産	2.87	1.85	69.92	7.29	7.67	9.03	0.14	0.05	0.60
安定	2.40	0.30	55.97	5.10	5.53	7.36	0.17	0.02	0.61
安定成長	3.45	2.87	73.43	7.85	8.15	9.46	0.15	0.07	0.60
成長	5.30	6.46	99.32	11.33	11.64	11.73	0.16	0.11	0.61
国内バランス	-0.41	-0.17	33.48	4.27	4.03	6.59	-0.02	0.00	0.44
安定	-0.81	2.19	25.02	4.04	3.39	3.43	-0.05	0.14	0.65
一般	4.38	5.20	51.56	8.86	8.95	9.72	0.17	0.12	0.43

※[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	4.07	4.18	77.77	11.53	↑ 11.30	11.57	0.12	0.08	0.51
国内REIT	7.73	5.48	163.63	16.02	13.71	17.30	0.16	0.08	0.59
日本	7.73	5.48	163.63	16.02	13.71	17.30	0.16	0.08	0.59
外国REIT	-6.69	-1.94	122.44	18.00	16.65	16.29	-0.12	-0.02	0.51
グローバル	-10.77	-9.75	100.59	18.87	17.21	16.48	-0.19	-0.12	0.44
除く日本	-7.22	-2.73	119.74	19.31	17.63	16.66	-0.13	-0.03	0.49
含む日本	-11.44	-10.71	98.33	18.74	17.12	16.44	-0.21	-0.13	0.43
北米	-4.03	3.74	139.01	17.40	16.42	16.47	-0.08	0.05	0.55
その他	-1.87	4.19	140.13	20.39	↑ 17.88	16.55	-0.03	0.05	0.55
欧州	-15.17	-18.79	19.38	19.69	19.13	20.86	-0.27	-0.21	0.08
アジア・オセアニア	4.28	14.66	155.58	19.23	↑ 17.17	16.57	0.08	0.16	0.59
オーストラリア	-18.01	-13.08	86.40	30.09	25.33	21.83	-0.21	-0.11	0.29
複合地域	-32.06	-35.30	50.28	26.74	↑ 23.28	21.19	-0.45	-0.36	0.20
複数国	3.11	12.24	184.75	16.55	14.84	15.26	0.07	0.16	0.72
その他									
絶対収益型	-1.73	-4.74	-4.69	2.49	2.23	3.48	-0.21	-0.42	-0.14
ロング・ショート	-3.80	-7.48	-2.84	3.56	3.12	3.57	-0.35	-0.48	-0.09
マーケットニュートラル	3.59	18.84	41.19	4.02	5.28	5.29	0.31	0.67	0.66
GTAA	1.79	1.71	13.99	4.05	↑ 3.26	3.10	0.16	0.11	0.42
その他スタイル	-3.13	-6.47	-8.74	2.38	2.30	5.06	-0.42	-0.56	-0.18
CB	0.20	-0.81	37.40	8.95	↑ 8.56	↑ 10.00	0.01	-0.02	0.32
アジア・オセアニア	4.22	3.71	59.30	12.82	↑ 12.44	12.15	0.11	0.06	0.39
日本	-3.78	0.67	43.09	5.62	5.65	6.16	-0.22	0.03	0.59
グローバル	0.41	-0.33	41.59	9.12	↑ 8.64	↑ 10.40	0.02	-0.00	0.34
コモディティ	10.42	-20.75	-10.40	9.75	↑ 11.99	14.10	0.35	-0.38	-0.08
全業種	-20.65	-44.35	-37.91	17.92	↑ 16.86	↑ 16.40	-0.41	-0.65	-0.29
貴金属	30.70	22.04	39.54	9.48	9.94	16.51	0.99	0.41	0.20
エネルギー	-14.40	-51.41	-54.82	38.99	↑ 34.84	↑ 29.51	-0.13	-0.38	-0.26
その他コモディティ	-24.64	-35.43	-1.53	19.04	↑ 17.60	↑ 18.74	-0.47	-0.47	-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

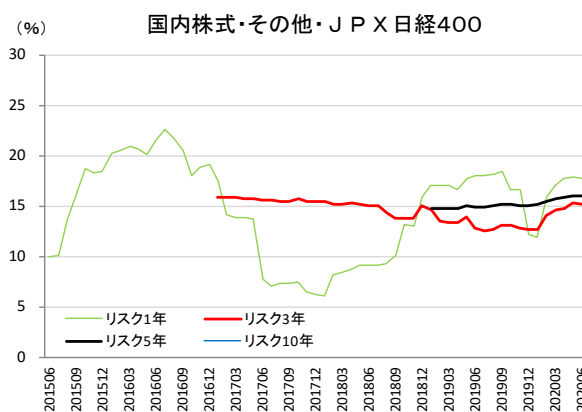
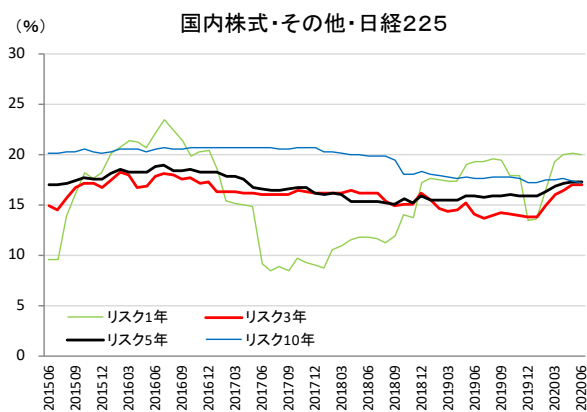
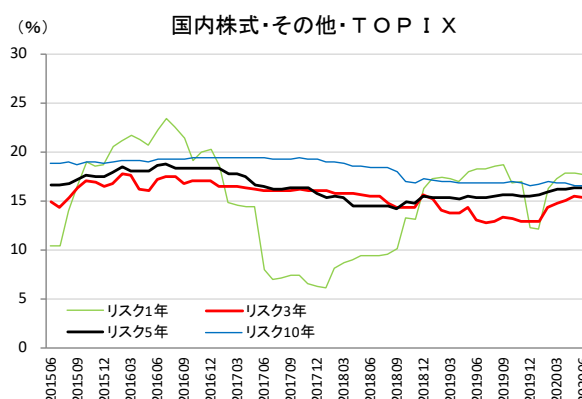
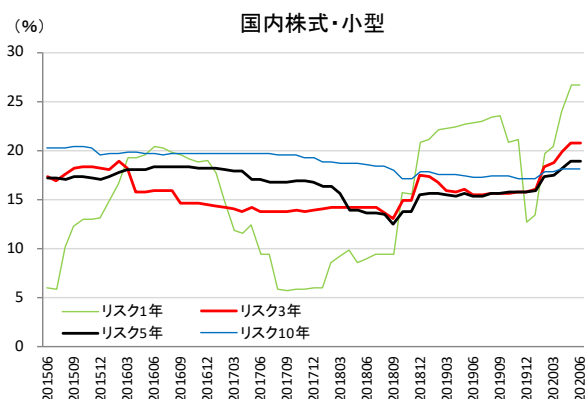
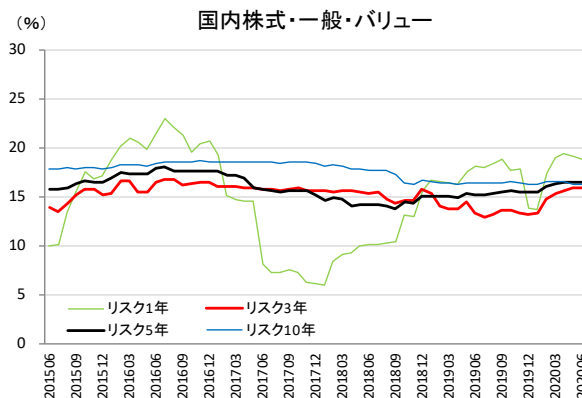
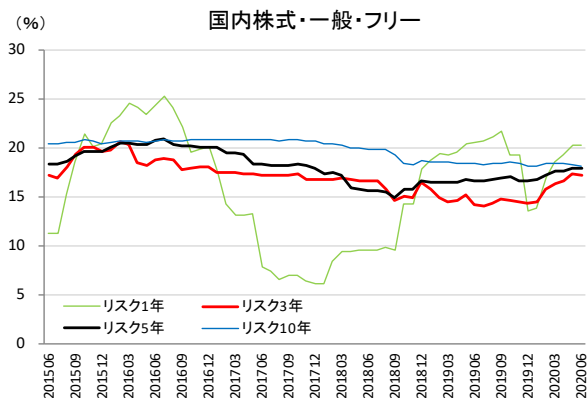
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

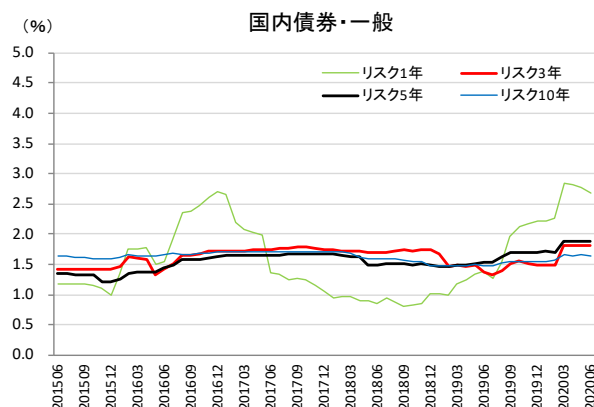
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

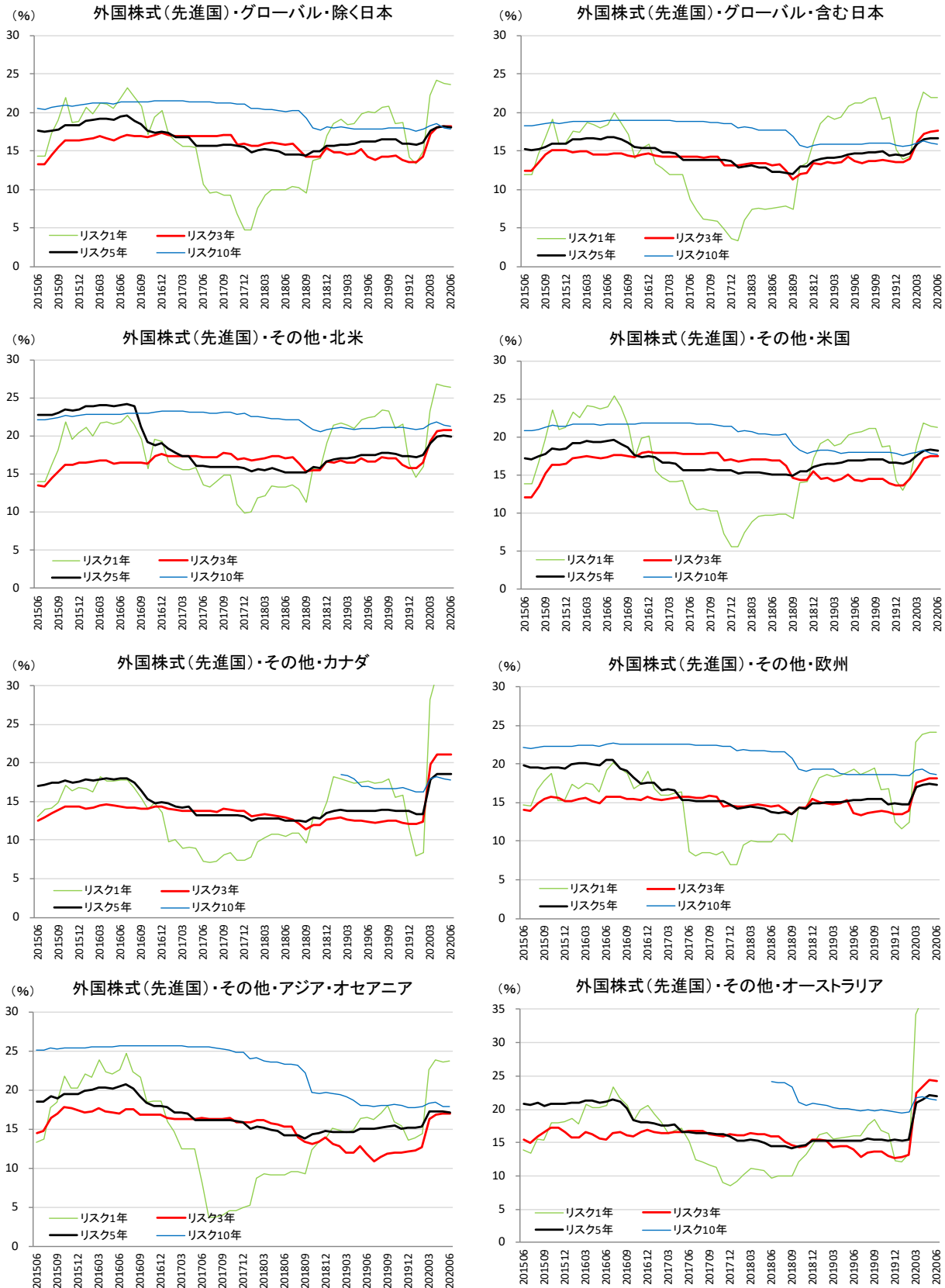


<2> リスク・サマリー

(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)]

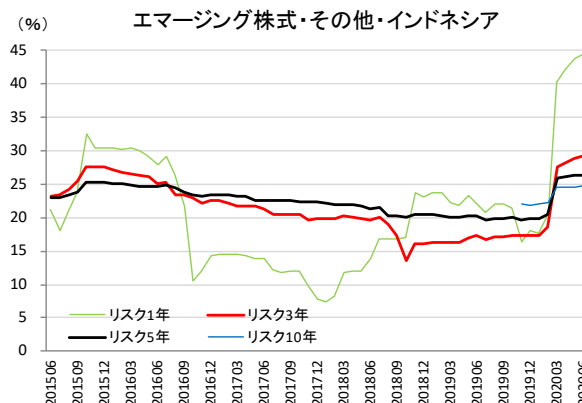
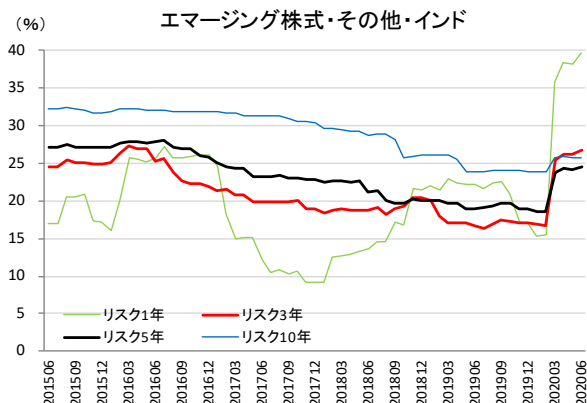
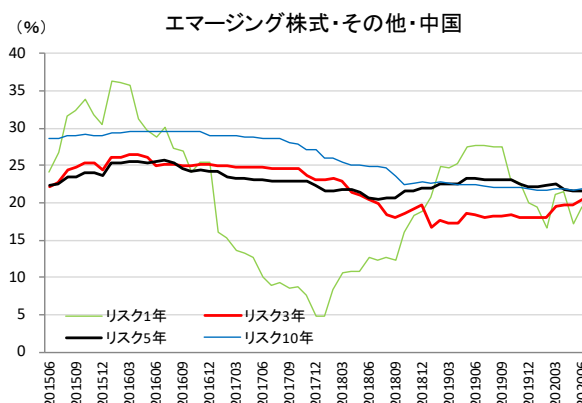
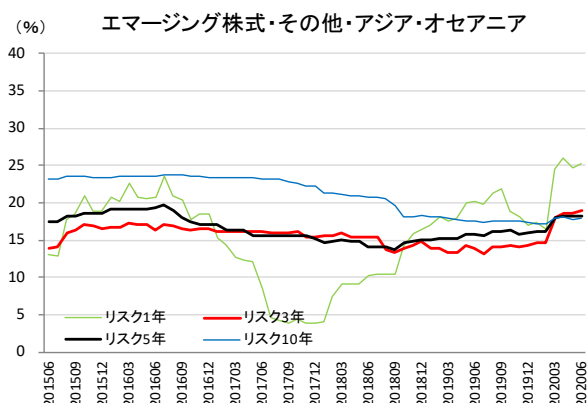
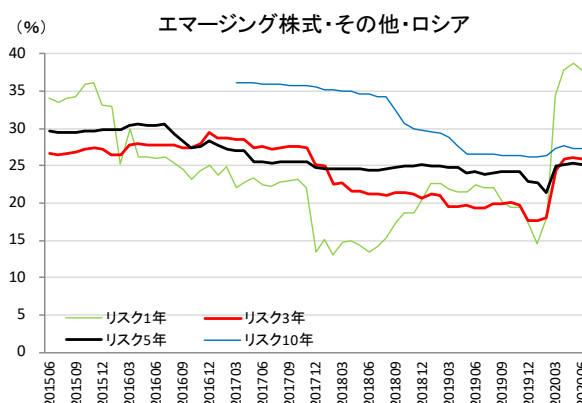
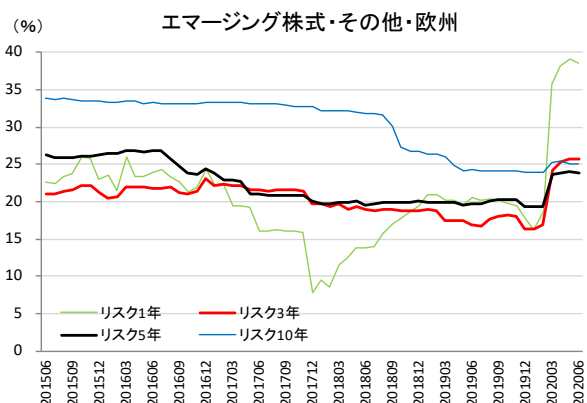
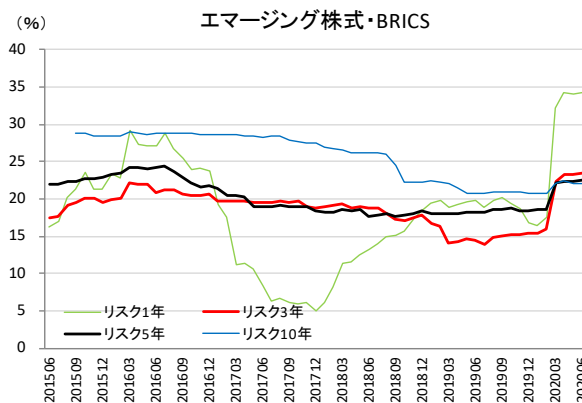
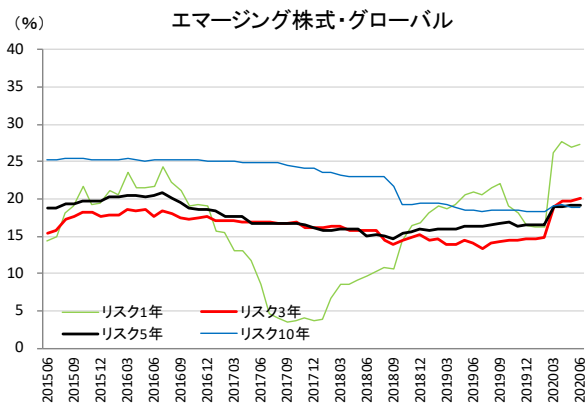


<2> リスク・サマリー

(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]

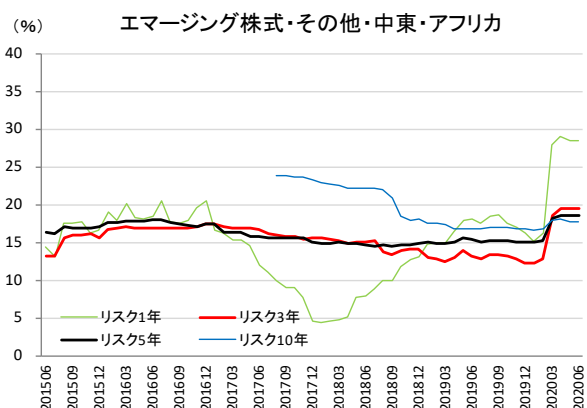
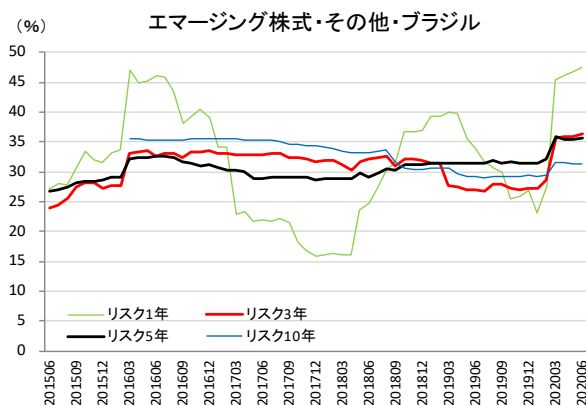
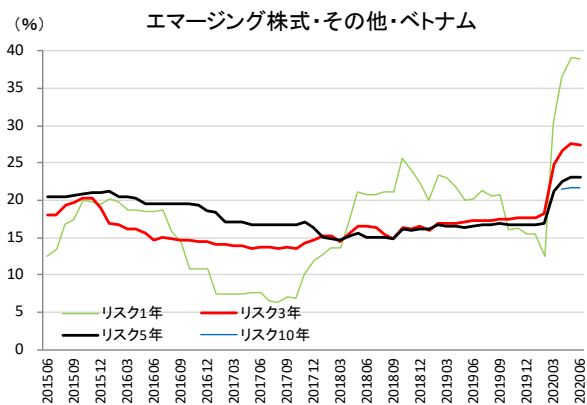
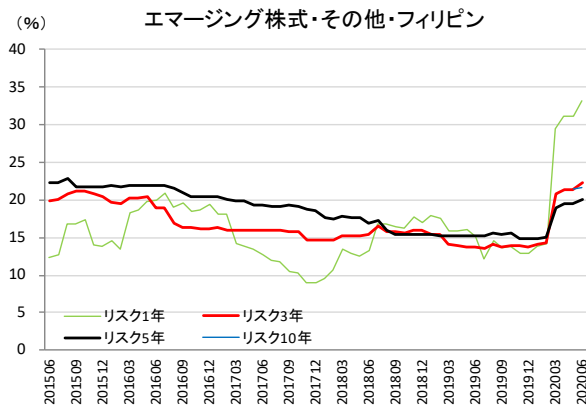
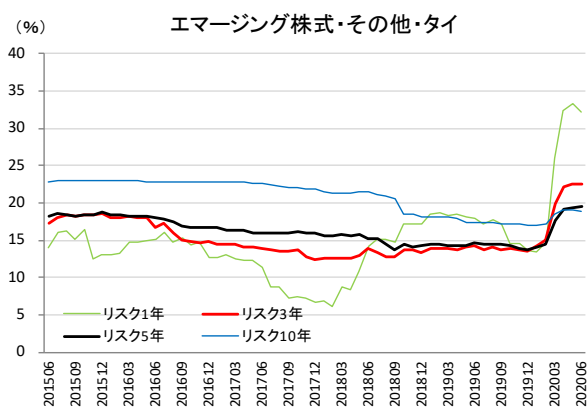


<2> リスク・サマリー

(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]

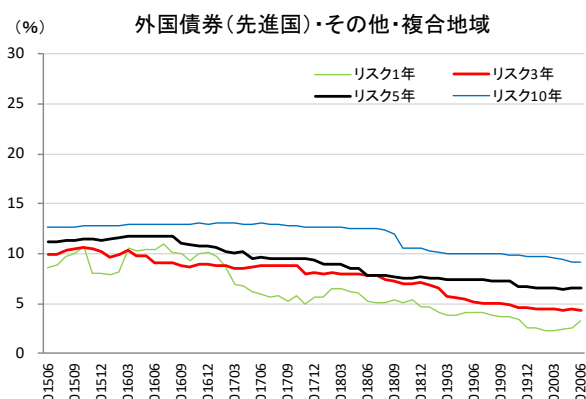
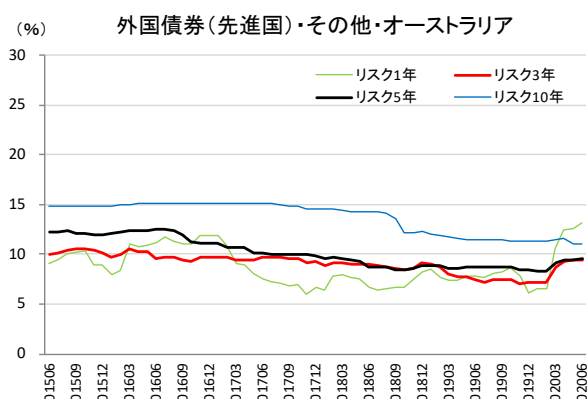
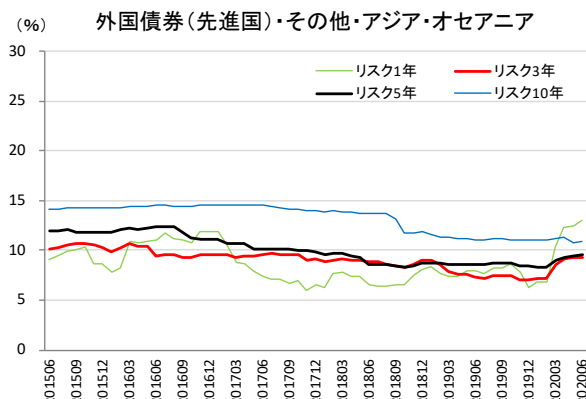
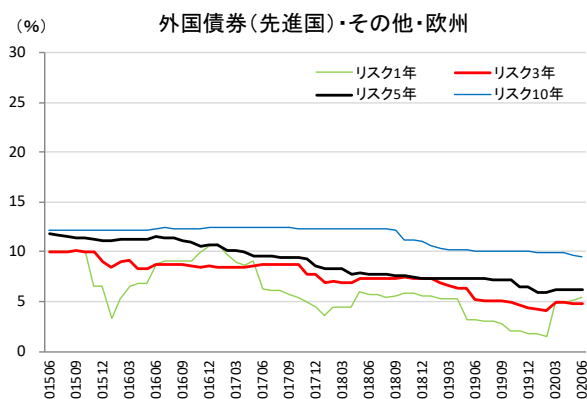
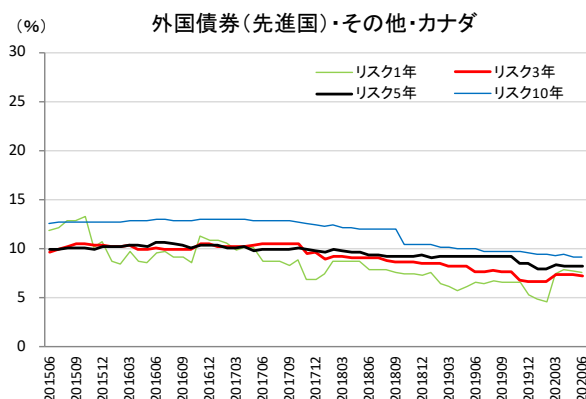
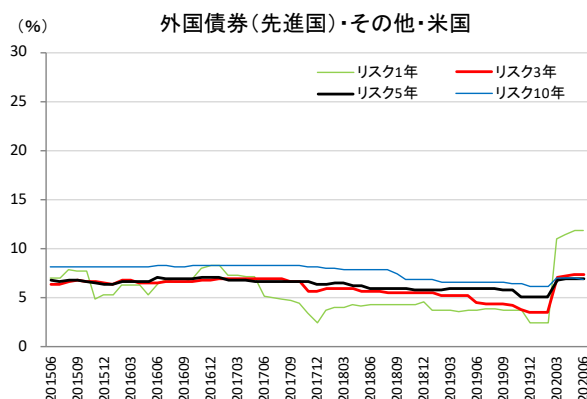
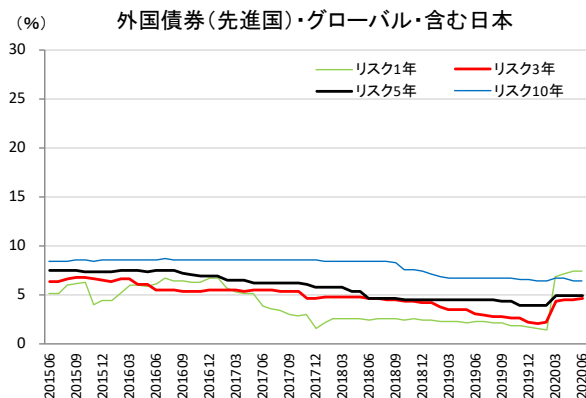
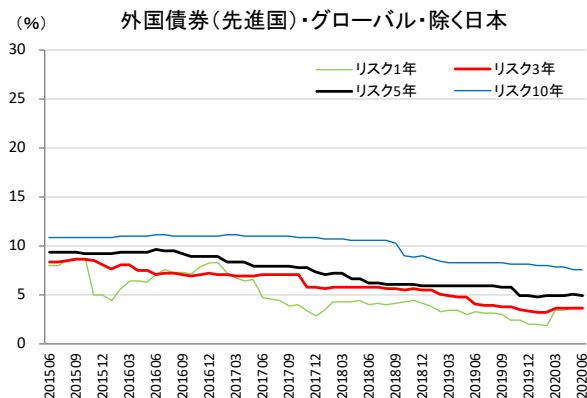


<2> リスク・サマリー

(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)]

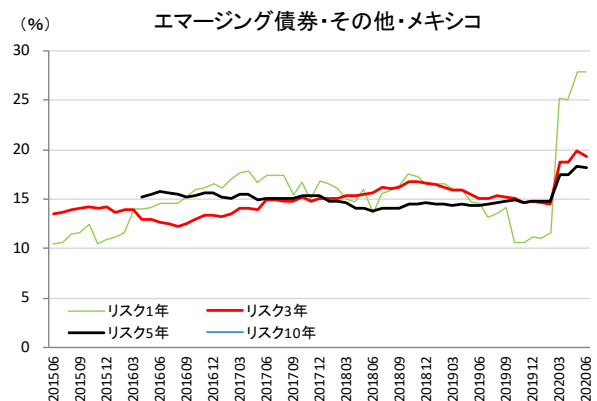
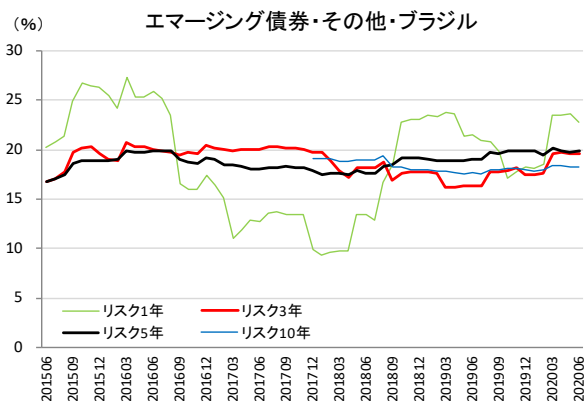
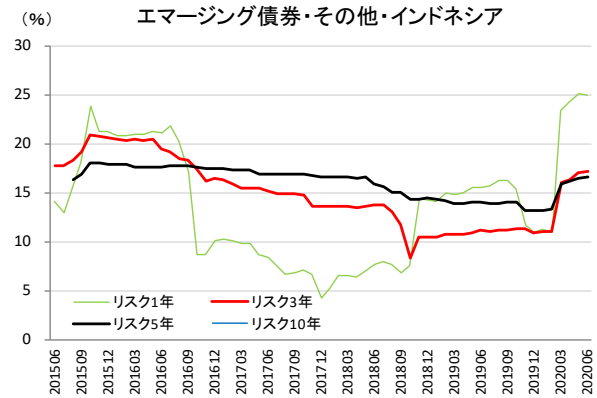
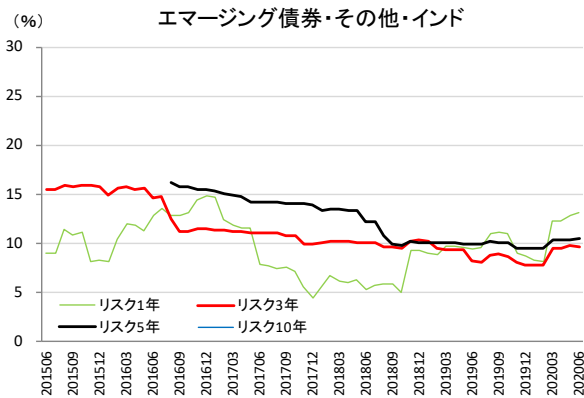
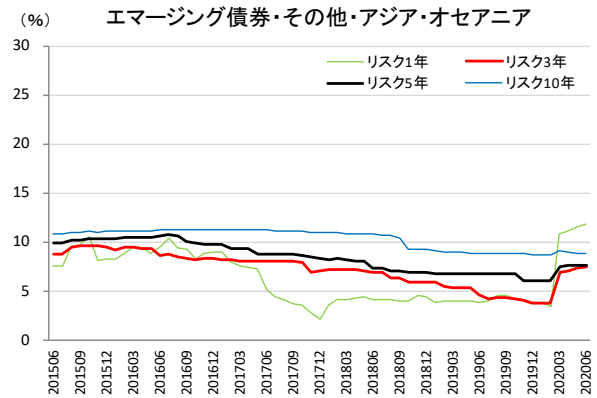
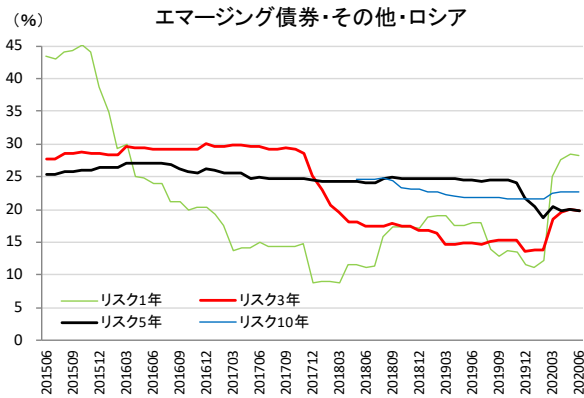
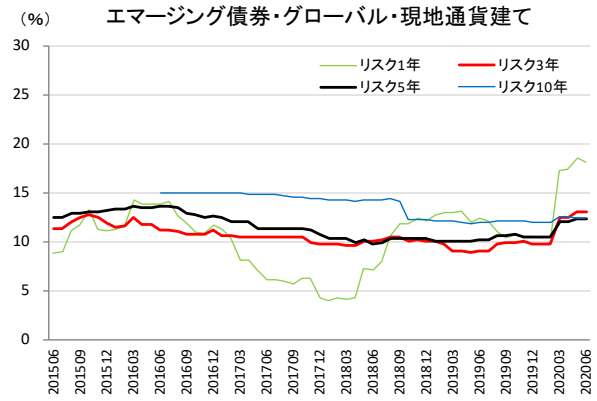
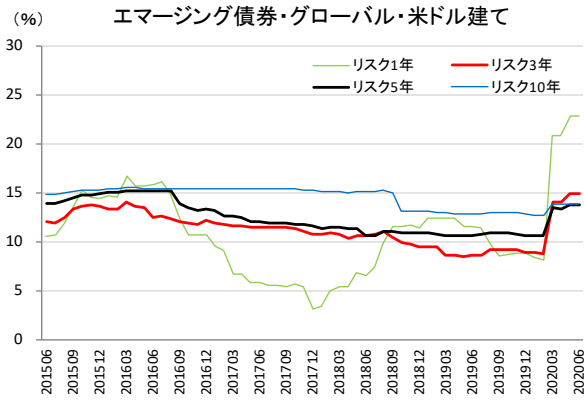


<2> リスク・サマリー

(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]

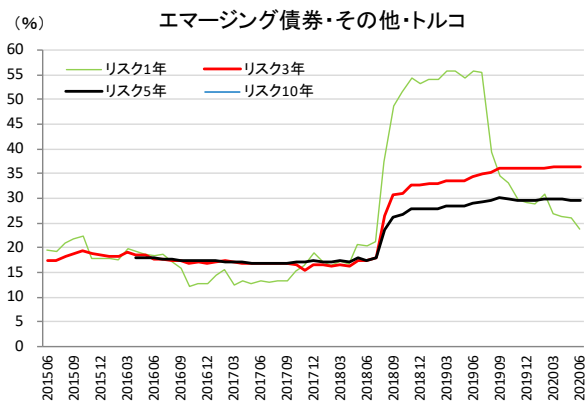


<2> リスク・サマリー

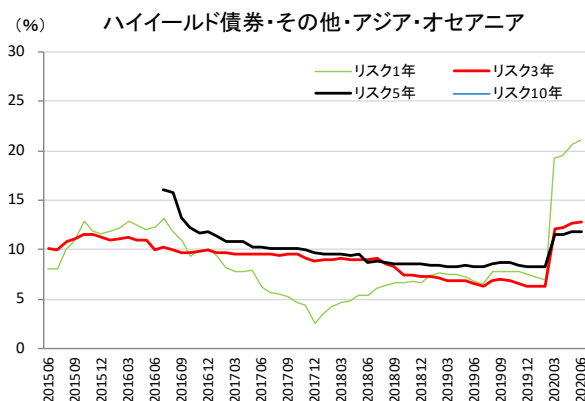
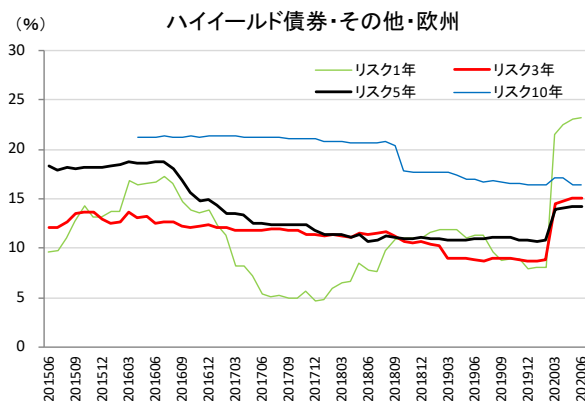
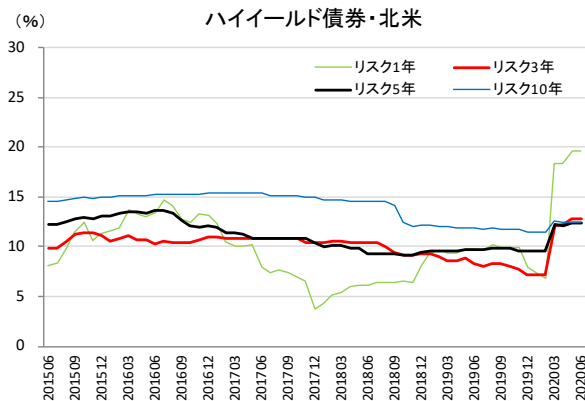
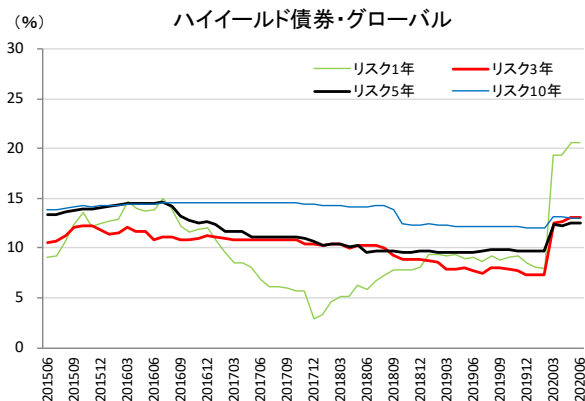
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

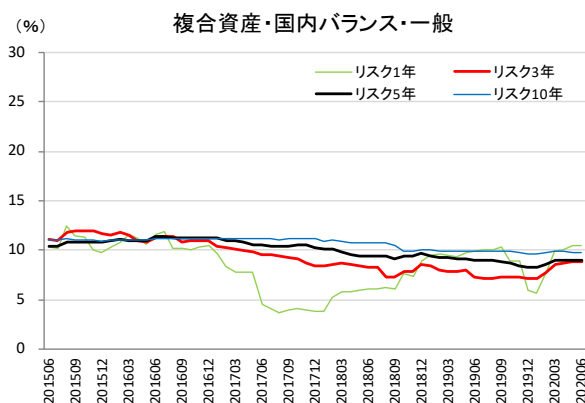
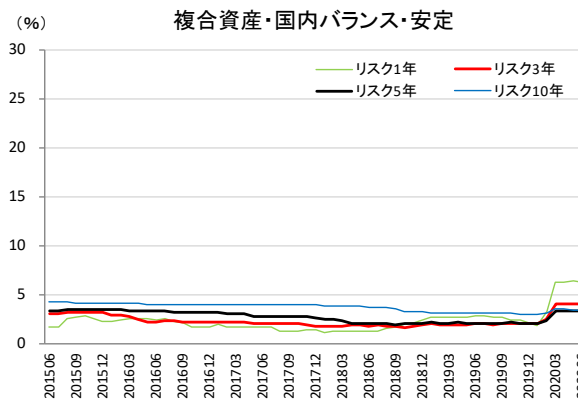
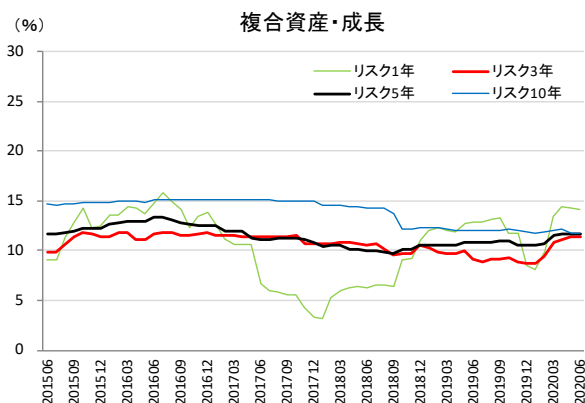
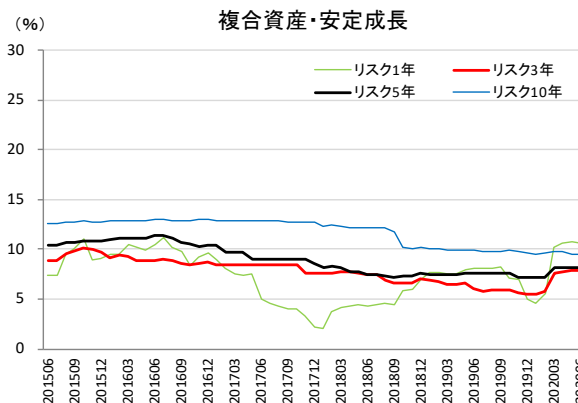
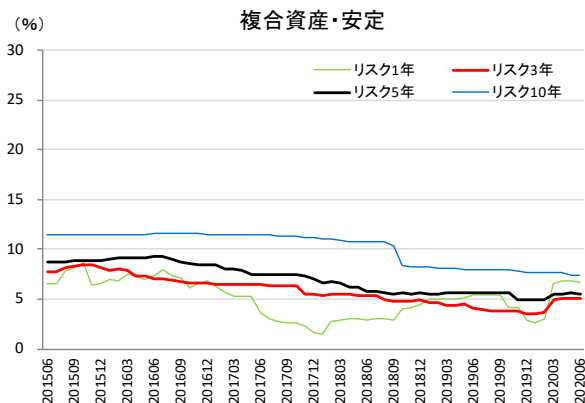


<2>リスク・サマリー

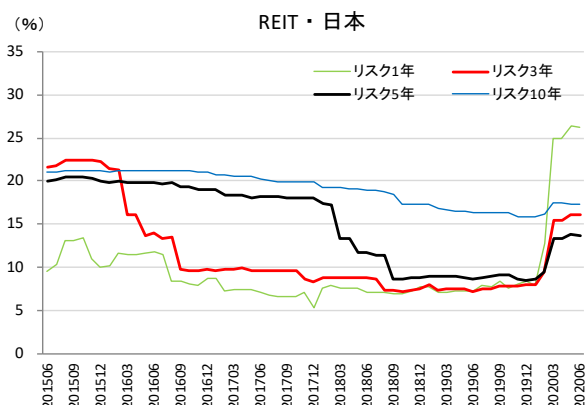
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

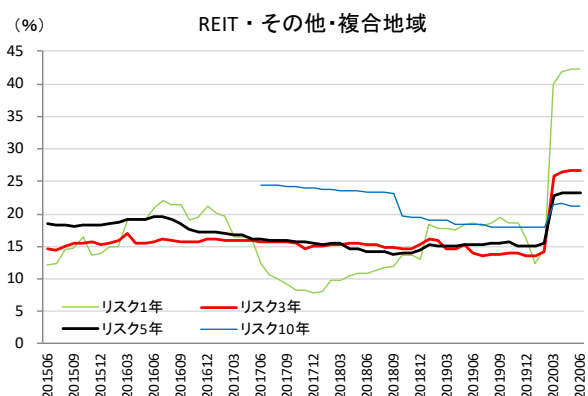
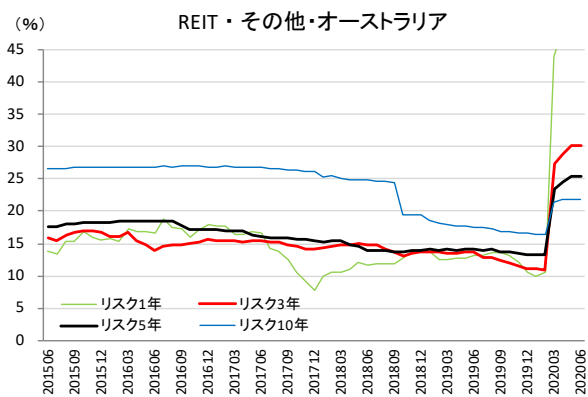
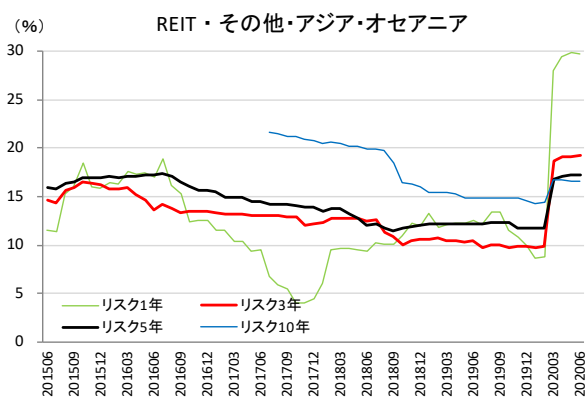
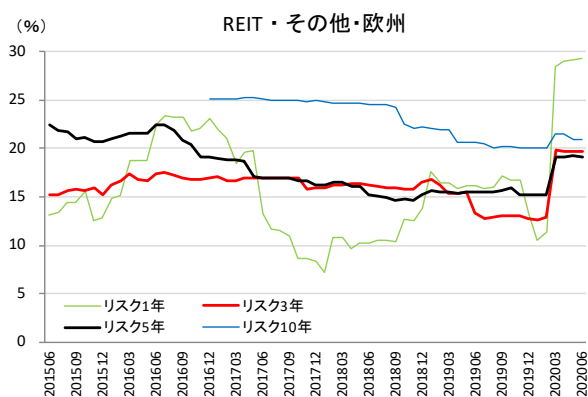
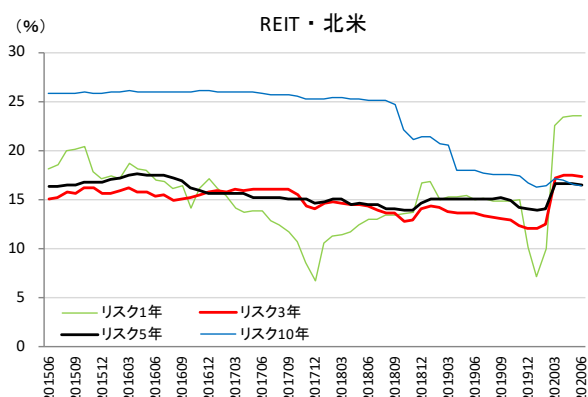
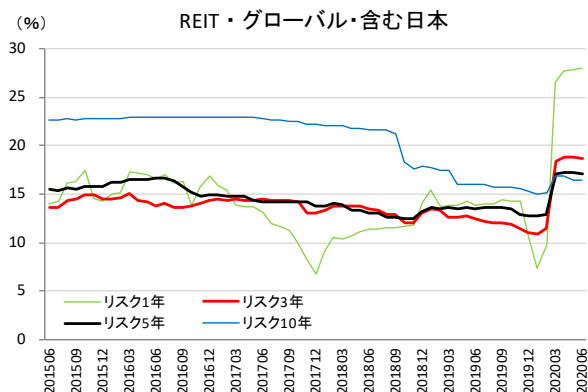
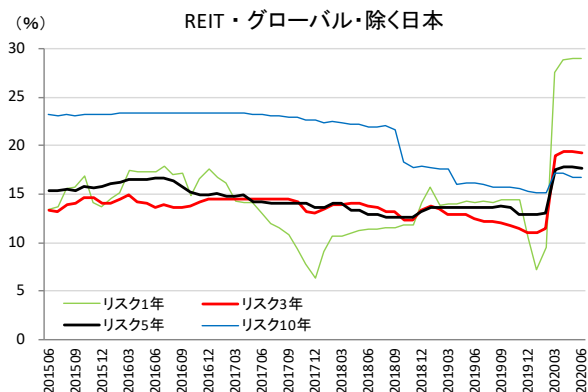


<2> リスク・サマリー

(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]

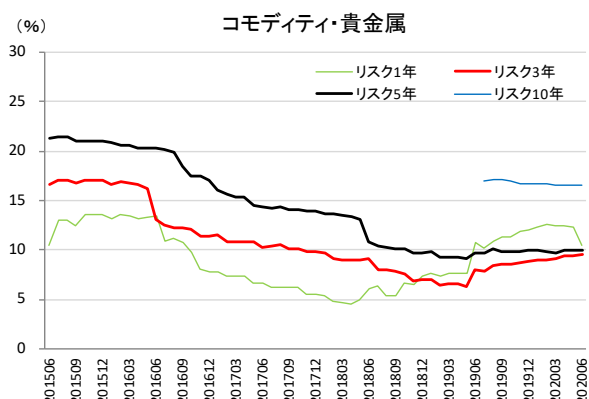
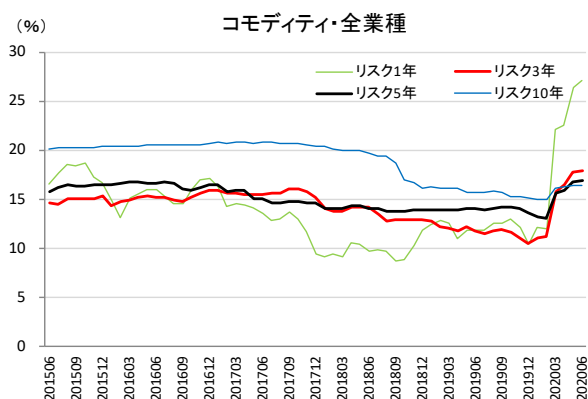
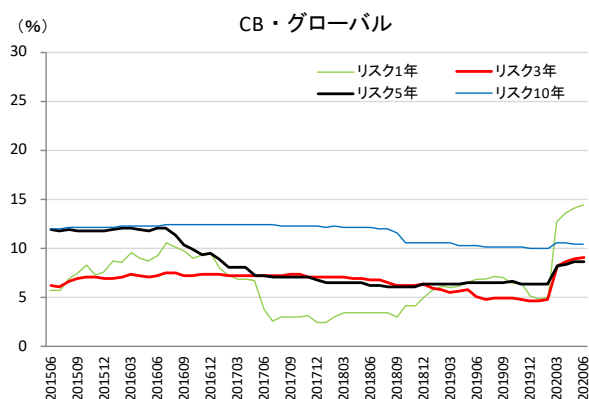
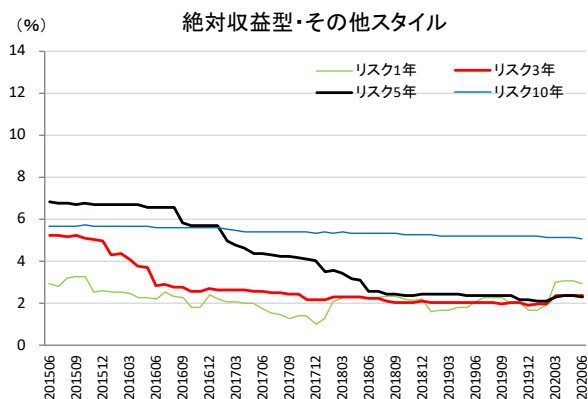
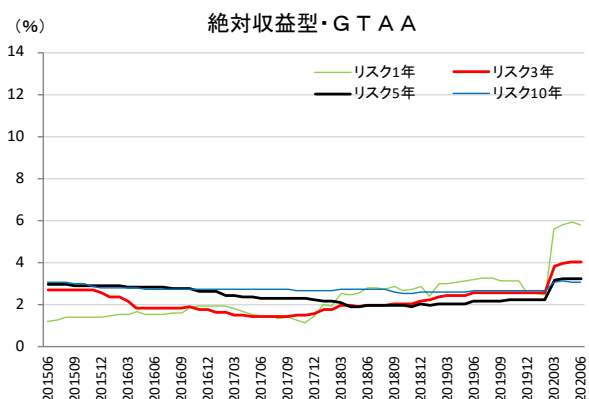
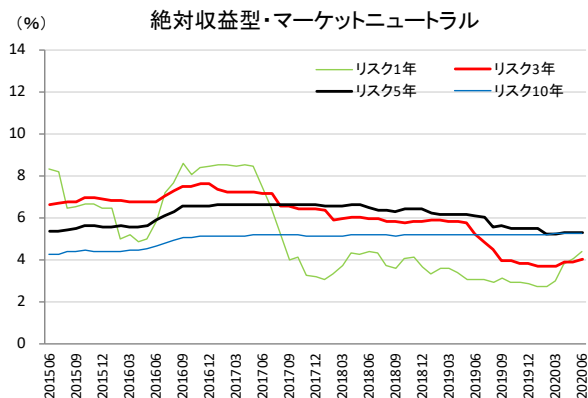
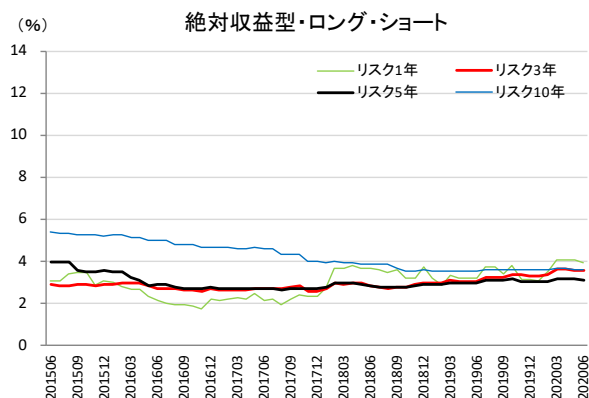


<2> リスク・サマリー

(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	-1,301	1,935	10,348	8,085
国内株式	-2,791	-3,542	-3,517	-14,726
一般	-1,257	-1,434	-3,007	-8,919
フリー	-1,209	-1,353	-2,698	-8,138
バリュー	-48	-81	-309	-780
小型	-513	-820	-1,278	-2,979
その他	-1,009	-1,277	791	-2,744
日経225	-946	-1,348	1,052	-2,555
TOPIX	-55	64	-389	60
JPX日経400	-18	-22	12	-173
国内債券	232	-115	21	813
一般	232	-115	21	813
外国株式(先進国)	-148	3,101	10,856	13,201
グローバル	-1,134	306	3,696	2,666
除く日本	131	1,257	2,333	4,187
含む日本	-1,265	-951	1,363	-1,522
その他	986	2,795	7,160	10,535
北米	-25	-33	-53	-19
米国	1,013	2,768	7,171	10,558
カナダ	-5	-8	-26	-83
欧州	-29	-24	-103	-309
ドイツ	0	0	-1	-3
イギリス	-1	-1	-3	-7
アジア・オセアニア	-2	-3	-7	-20
オーストラリア	36	96	181	420
ニュージーランド	0	0	-1	-2
複合地域	0	1	0	-1
エマージング株式	-133	-149	-2,079	-5,387
グローバル	-107	-10	-280	-1,446
BRICS	0	0	-27	-73
その他	-25	-139	-1,772	-3,868
欧州	0	-1	-11	-32
ロシア	0	2	2	-10
アジア・オセアニア	62	61	-181	-804
中国	-85	-174	-499	-1,081
インド	-1	-37	-1,066	-2,018
インドネシア	1	1	-10	-21
タイ	-1	-1	-4	-12
フィリピン	-1	-2	-6	-22
ベトナム	-16	-26	2	78
韓国	0	0	0	-1
香港	0	0	1	3
台湾	0	0	0	0
中南米	-1	-1	-4	-13
ブラジル	20	46	26	57
メキシコ	0	0	-1	-2
中東・アフリカ	-4	-5	-15	26
トルコ	0	-2	-7	-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か月	6か月	1年
総合	-1,301	1,935	10,348	8,085
外国債券(先進国)	-532	-1,276	-3,526	-5,327
グローバル	-362	-944	-2,395	-3,938
除く日本	-40	-303	-1,250	-2,395
含む日本	-322	-641	-1,145	-1,543
その他	-169	-332	-1,131	-1,389
北米	-5	-5	-8	-13
米国	5	23	-99	355
カナダ	-14	-25	-88	-264
欧州	-1	-74	-158	239
イギリス	0	-1	-3	-6
アジア・オセアニア	-30	-50	-141	-383
オーストラリア	-113	-191	-538	-1,124
ニュージーランド	-4	-5	-15	-30
複合地域	-15	-38	-115	-195
エマージング債券	-232	-594	-1,409	-2,334
グローバル	-82	-221	-418	-510
米ドル建て	-78	-228	-412	-484
現地通貨建て	-4	6	-5	-26
その他	-150	-373	-992	-1,824
ロシア	-7	-10	-28	-92
アジア・オセアニア	-3	-5	-21	-38
インド	-67	-150	-447	-695
インドネシア	-11	-14	-71	-127
ブラジル	-35	-85	-167	-270
メキシコ	-9	-14	-52	-145
トルコ	-1	-2	-14	-37
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイイールド債券	65	106	-487	-1,575
グローバル	-9	-32	-89	-210
北米	119	237	-167	-864
その他	-45	-99	-232	-501
欧州	-39	-87	-194	-403
アジア・オセアニア	-5	-9	-29	-69
複合地域	0	0	-1	-3
複合資産	502	828	5,571	16,087
安定	273	-164	875	2,370
安定成長	115	433	1,707	3,667
成長	62	398	636	919
国内バランス	39	-3	382	2,440
安定	45	10	416	2,581
一般	-6	-11	-28	-99
その他	13	164	1,971	6,690

<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	-1,301	1,935	10,348	8,085
国内REIT	541	1,424	1,806	2,123
日本	541	1,424	1,806	2,123
外国REIT	619	1,364	1,741	4,231
グローバル	303	760	923	1,974
除く日本	20	272	636	1,019
含む日本	282	488	287	955
北米	343	631	933	2,172
その他	-27	-26	-115	85
欧州	-1	0	-11	-45
アジア・オセアニア	-28	-40	-87	97
オーストラリア	1	12	-6	70
複合地域	2	4	4	3
複数国	-1	-2	-16	-40
その他	575	786	1,372	979
絶対収益型	105	57	313	610
ロング・ショート	-8	-41	119	-28
マーケットニュートラル	-2	-32	-158	-247
GTAA	-4	-3	-7	-41
その他スタイル	88	103	328	895
CB	450	438	350	126
アジア・オセアニア	0	0	-4	-8
日本	-1	-4	-10	-17
グローバル	452	443	363	151
コモディティ	122	320	401	460
全業種	14	87	103	116
貴金属	120	83	115	158
エネルギー	-13	149	181	182
その他コモディティ	0	1	3	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	612,719	100.00	5,371	100.00
国内株式	91,116	14.87	879	16.37
一般	53,207	8.68	574	10.69
フリー	42,340	6.91	457	8.51
バリュー	10,867	1.77	117	2.18
小型	7,861	1.28	95	1.77
その他	29,394	4.80	203	3.78
日経225	14,934	2.44	68	1.27
TOPIX	12,219	1.99	75	1.40
JPX日経400	678	0.11	20	0.37
国内債券	33,969	5.54	136	2.53
一般	33,969	5.54	136	2.53
外国株式(先進国)	166,879	27.24	998	18.58
グローバル	124,924	20.39	654	12.18
除く日本	28,570	4.66	178	3.31
含む日本	96,353	15.73	476	8.86
その他	41,955	6.85	344	6.40
北米	318	0.05	10	0.19
米国	35,380	5.77	234	4.36
カナダ	228	0.04	3	0.06
欧州	1,358	0.22	52	0.97
ドイツ	24	0.00	1	0.02
イギリス	12	0.00	2	0.04
アジア・オセアニア	74	0.01	8	0.15
オーストラリア	4,544	0.74	32	0.60
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	5	0.00	1	0.02
エマージング株式	24,462	3.99	347	6.46
グローバル	7,079	1.16	101	1.88
BRICS	562	0.09	7	0.13
その他	16,820	2.75	239	4.45
欧州	166	0.03	7	0.13
ロシア	106	0.02	4	0.07
アジア・オセアニア	5,307	0.87	106	1.97
中国	1,701	0.28	30	0.56
インド	7,405	1.21	30	0.56
インドネシア	139	0.02	6	0.11
タイ	66	0.01	4	0.07
フィリピン	57	0.01	5	0.09
ベトナム	968	0.16	10	0.19
韓国	3	0.00	1	0.02
香港	11	0.00	1	0.02
台湾	2	0.00	1	0.02
中南米	52	0.01	2	0.04
ブラジル	626	0.10	16	0.30
メキシコ	13	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	121	0.02	8	0.15
トルコ	60	0.01	4	0.07
複合地域	18	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	612,719	100.00	5,371	100.00
外国債券(先進国)	80,081	13.07	809	15.06
グローバル	59,086	9.64	519	9.66
除く日本	31,920	5.21	229	4.26
含む日本	27,166	4.43	290	5.40
その他	20,995	3.43	290	5.40
北米	85	0.01	6	0.11
米国	5,909	0.96	156	2.90
カナダ	1,165	0.19	6	0.11
欧州	1,601	0.26	37	0.69
イギリス	26	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	2,144	0.35	12	0.22
オーストラリア	8,411	1.37	40	0.74
ニュージーランド	151	0.02	14	0.26
複合地域	1,470	0.24	10	0.19
エマージング債券	15,169	2.48	289	5.38
グローバル	7,446	1.22	192	3.57
米ドル建て	5,913	0.97	152	2.83
現地通貨建て	1,533	0.25	40	0.74
その他	7,723	1.26	97	1.81
ロシア	172	0.03	5	0.09
アジア・オセアニア	430	0.07	13	0.24
インド	3,618	0.59	21	0.39
インドネシア	468	0.08	11	0.20
ブラジル	2,203	0.36	24	0.45
メキシコ	407	0.07	9	0.17
トルコ	130	0.02	5	0.09
複合地域	45	0.01	1	0.02
ハイイールド債券	18,555	3.03	303	5.64
グローバル	2,926	0.48	58	1.08
北米	12,383	2.02	157	2.92
その他	3,247	0.53	88	1.64
欧州	2,515	0.41	48	0.89
アジア・オセアニア	638	0.10	30	0.56
複合地域	43	0.01	1	0.02
複合資産	104,755	17.10	981	18.26
安定	28,144	4.59	288	5.36
安定成長	45,621	7.45	405	7.54
成長	13,227	2.16	243	4.52
国内バランス	10,296	1.68	32	0.60
安定	9,801	1.60	8	0.15
一般	405	0.07	19	0.35
その他	7,467	1.22	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	612,719	100.00		5,371	100.00
国内REIT	24,452	3.99		123	2.29
日本	24,452	3.99		123	2.29
外国REIT	39,485	6.44		284	5.29
グローバル	15,571	2.54		135	2.51
除く日本	3,638	0.59		51	0.95
含む日本	11,933	1.95		84	1.56
北米	19,974	3.26		81	1.51
その他	3,940	0.64		68	1.27
欧州	197	0.03		17	0.32
アジア・オセアニア	2,835	0.46		34	0.63
オーストラリア	630	0.10		13	0.24
複合地域	39	0.01		3	0.06
複数国	239	0.04		1	0.02
その他	13,797	2.25		222	4.13
絶対収益型	7,699	1.26		101	1.88
ロング・ショート	965	0.16		34	0.63
マーケットニュートラル	971	0.16		15	0.28
GTAA	403	0.07		14	0.26
その他スタイル	5,329	0.87		37	0.69
CB	1,699	0.28		42	0.78
アジア・オセアニア	33	0.01		1	0.02
日本	52	0.01		3	0.06
グローバル	1,615	0.26		38	0.71
コモディティ	2,406	0.39		28	0.52
全業種	775	0.13		14	0.26
貴金属	1,384	0.23		12	0.22
エネルギー	238	0.04		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	11,126	8.6	3.41	4.11	1.270
国内株式	13,948	11.6	1.01	1.17	1.147
一般	12,701	11.3	1.23	1.53	1.422
フリー	12,542	10.7	1.33	1.69	1.466
バリュー	13,324	13.3	0.84	0.89	1.250
小型	20,235	11.9	1.42	1.29	1.736
その他	14,605	12.2	0.52	0.51	0.482
日経225	15,680	13.7	0.54	0.51	0.572
TOPIX	15,118	13.7	0.36	0.36	0.322
JPX日経400	13,082	5.9	0.18	0.18	0.545
国内債券	10,951	10.7	0.31	0.33	0.355
一般	10,951	10.7	0.31	0.33	0.355
外国株式(先進国)	12,184	6.9	3.96	4.50	1.561
グローバル	12,820	7.1	3.15	3.59	1.549
除く日本	15,176	9.3	0.66	0.78	0.729
含む日本	11,939	6.3	3.89	4.43	1.792
その他	10,976	6.4	6.62	7.49	1.599
北米	11,183	7.1	6.64	6.84	1.907
米国	11,773	5.8	5.56	5.38	1.562
カナダ	6,065	8.3	12.34	16.41	1.992
欧州	10,810	9.0	2.91	3.37	1.664
ドイツ	9,967	6.3	0.00	0.00	0.770
イギリス	4,346	6.1	15.55	23.14	1.948
アジア・オセアニア	8,040	6.2	4.79	5.46	1.696
オーストラリア	7,099	6.0	14.79	22.87	1.826
ニュージーランド	13,867	7.9	2.86	2.88	1.672
複合地域	4,798	7.2	0.00	0.00	1.705
エマージング株式	11,045	9.2	2.76	3.70	1.783
グローバル	10,105	7.0	1.59	1.99	1.404
BRICS	12,731	14.1	1.09	1.22	2.069
その他	11,393	9.9	3.31	4.51	1.934
欧州	7,998	14.1	0.21	0.26	1.975
ロシア	9,537	11.1	2.01	2.23	2.012
アジア・オセアニア	11,997	10.1	6.67	8.23	1.741
中国	19,848	9.8	1.79	1.59	1.959
インド	9,764	10.1	1.32	1.69	2.074
インドネシア	8,024	10.0	0.39	0.52	1.854
タイ	9,059	12.2	0.67	0.88	1.701
フィリピン	8,434	6.9	0.50	0.69	1.791
ベトナム	9,561	4.4	0.74	0.89	1.872
韓国	9,875	1.5	0.00	0.00	1.804
香港	13,632	10.8	1.94	2.27	0.858
台湾	10,986	7.6	0.00	0.00	1.661
中南米	5,853	13.5	0.00	0.00	2.042
ブラジル	4,183	10.2	10.61	25.62	1.934
メキシコ	5,737	7.3	0.00	0.00	1.928
中東・アフリカ	8,247	9.6	0.17	0.85	2.059
トルコ	5,715	13.9	0.00	0.00	2.035
複合地域	16,557	12.1	2.97	3.30	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	11,126	8.6	3.41	4.11	1.270
外国債券(先進国)	9,814	8.5	2.49	2.68	1.109
グローバル	10,434	8.8	1.81	1.89	1.045
除く日本	11,307	10.9	1.71	1.76	0.820
含む日本	9,744	7.0	1.92	2.04	1.309
その他	8,704	7.9	4.42	4.90	1.290
北米	10,184	6.2	2.02	2.15	1.804
米国	9,315	6.8	4.94	5.94	1.355
カナダ	7,690	8.0	3.77	3.93	1.370
欧州	8,310	10.1	1.24	1.32	1.049
イギリス	7,586	5.6	3.50	3.66	1.258
アジア・オセアニア	7,636	9.7	3.09	3.21	1.420
オーストラリア	7,675	11.1	5.37	5.77	1.261
ニュージーランド	9,286	5.7	2.27	2.31	1.347
複合地域	5,613	10.6	3.29	3.32	1.191
エマージング債券	8,125	8.8	6.28	7.61	1.590
グローバル	8,411	9.5	5.47	6.78	1.555
米ドル建て	8,456	9.8	5.63	7.05	1.618
現地通貨建て	8,238	8.4	4.90	5.74	1.312
その他	7,560	7.4	7.04	8.41	1.624
ロシア	8,384	7.4	6.02	6.56	1.607
アジア・オセアニア	8,741	7.7	10.91	12.28	1.639
インド	8,771	5.5	7.13	7.92	1.700
インドネシア	7,023	7.9	7.08	7.41	1.665
ブラジル	6,851	10.5	6.90	9.90	1.589
メキシコ	5,860	7.6	5.91	6.66	1.397
トルコ	3,311	7.3	9.69	9.45	1.453
複合地域	3,749	13.8	4.33	4.80	1.210
ハイールド債券	7,783	9.1	8.45	10.27	1.692
グローバル	6,946	8.4	6.59	8.02	1.580
北米	8,519	10.4	8.40	10.10	1.699
その他	7,020	7.1	10.27	12.95	1.770
欧州	6,410	7.3	10.80	13.79	1.746
アジア・オセアニア	7,552	8.2	9.15	10.97	1.878
複合地域	4,248	16.3	5.35	5.65	1.800
複合資産	11,400	8.1	1.57	1.70	1.037
安定	10,883	7.7	0.95	1.00	1.120
安定成長	11,087	8.5	2.12	2.31	1.085
成長	12,679	8.1	0.48	0.60	0.906
国内バランス	10,731	8.5	2.13	2.31	0.941
安定	10,571	10.1	2.18	2.36	0.921
一般	11,085	9.2	0.90	0.96	1.359
その他	10,372	0.8	1.67	1.75	0.800

(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	11,126	8.6	3.41	4.11	1.270
国内REIT	11,702	8.5	9.31	12.16	0.953
日本	11,702	8.5	9.31	12.16	0.953
外国REIT	9,033	7.4	10.46	14.11	1.556
グローバル	9,680	7.9	8.16	11.61	1.402
除く日本	11,039	6.4	6.44	10.33	1.088
含む日本	8,855	8.9	8.69	12.01	1.498
北米	8,288	7.5	12.69	16.61	1.629
その他	8,638	6.2	8.07	11.18	1.790
欧州	7,482	5.9	5.59	7.12	1.813
アジア・オセアニア	10,176	6.1	9.62	13.38	1.830
オーストラリア	7,039	5.6	4.35	6.24	1.713
複合地域	4,867	8.4	1.31	1.71	0.835
複数国	8,062	16.2	2.62	2.98	1.650
その他					
絶対収益型	10,080	5.3	0.09	0.09	1.666
ロング・ショート	10,307	4.7	0.70	0.70	1.480
マーケットニュートラル	10,495	4.9	0.08	0.08	1.232
GTAA	10,485	6.3	0.11	0.11	1.544
その他スタイル	9,553	5.8	0.01	0.01	1.789
CB	10,825	6.8	1.17	1.20	1.374
アジア・オセアニア	7,879	10.0	2.95	3.05	1.823
日本	10,725	9.1	0.22	0.22	1.011
グローバル	10,910	6.5	1.16	1.19	1.376
コモディティ	8,061	6.7	0.00	0.00	0.952
全業種	4,665	8.8	0.00	0.00	1.426
貴金属	12,130	4.1	0.00	0.00	0.669
エネルギー	6,223	11.3	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	8,630	3.8	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