

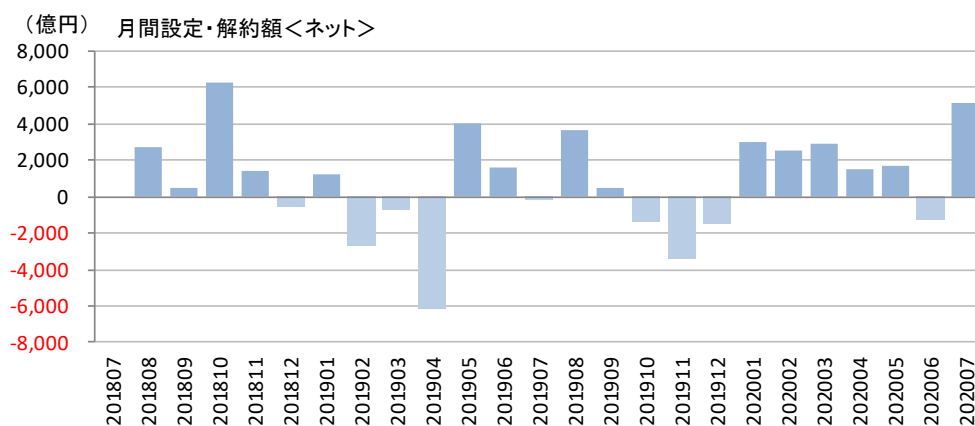
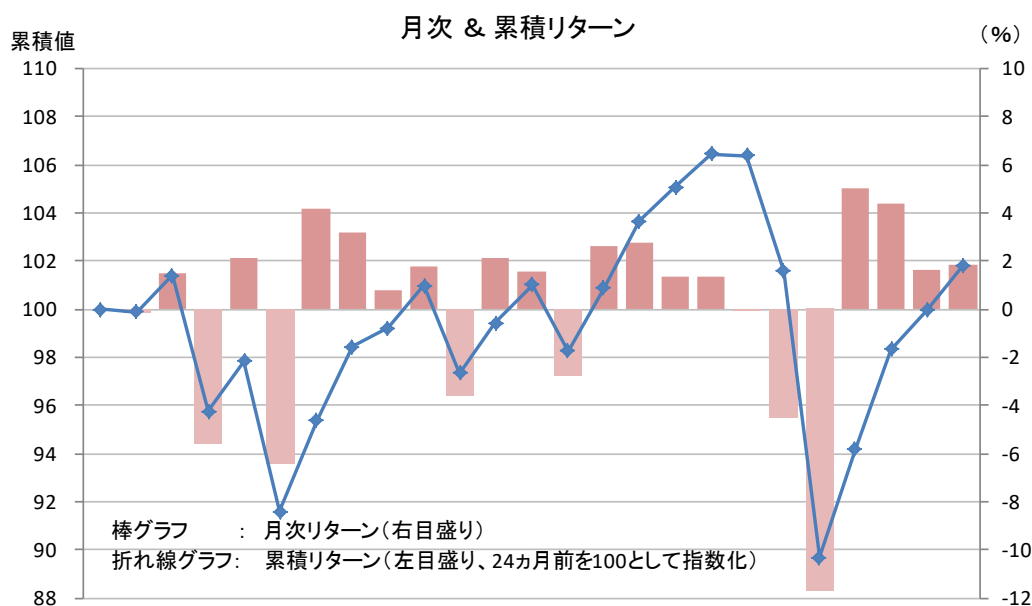
投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2020年7月

「総合」 +1.83 %

(前月 +1.65 %)



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		13,016	12,782	234	1.83	
国内株式		15,107	15,479	-372	-2.40	
一般		14,778	15,041	-263	-1.75	
フリー		14,159	14,327	-168	-1.17	
バリュー		17,707	18,439	-732	-3.97	
小型		33,160	34,150	-990	-2.90	
その他		14,602	15,126	-524	-3.46	
日経225		14,364	14,753	-389	-2.64	
TOPIX		14,117	14,711	-595	-4.04	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	13,420	13,975	-555	-3.97	
国内債券		13,241	13,202	39	0.30	
一般		13,241	13,202	39	0.30	
外国株式(先進国)		15,990	15,255	736	4.82	
グローバル		17,822	16,953	869	5.12	
除く日本		23,043	22,183	860	3.88	
含む日本		16,623	15,757	866	5.49	
その他		12,207	11,745	463	3.94	
北米		11,333	10,978	355	3.24	
米国		18,966	18,228	738	4.05	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	15,213	14,505	708	4.88	
欧州		17,852	17,310	542	3.13	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	8,530	8,231	299	3.63	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	7,167	7,192	-25	-0.34	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	31,945	31,344	601	1.92	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	13,072	12,647	425	3.36	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	36,333	34,606	1,727	4.99	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	5,132	5,238	-106	-2.02	
エマージング株式		13,766	13,101	666	5.08	
グローバル		14,687	13,834	853	6.17	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	21,887	20,721	1,166	5.63	
その他		13,840	13,230	610	4.61	
欧州		21,880	21,895	-15	-0.07	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	9,453	9,462	-9	-0.09	
アジア・オセアニア		15,221	14,515	706	4.87	
中国		42,777	39,647	3,130	7.90	
インド	10,000 (2004.09.30)	27,272	25,999	1,273	4.90	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	10,444	10,456	-12	-0.12	
タイ		17,857	18,492	-634	-3.43	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	6,007	6,297	-291	-4.61	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	11,341	11,919	-578	-4.85	
韓国	10,000 (1997.06.30)	25,088	21,953	3,135	14.28	
香港		20,369	20,481	-111	-0.54	
台湾	10,000 (2008.03.31)	18,180	16,876	1,304	7.73	
中南米	7,427 (2006.04.28)	6,797	6,239	558	8.94	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	7,352	6,641	711	10.70	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	6,582	6,587	-5	-0.08	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	7,975	7,814	160	2.05	
トルコ		17,972	19,421	-1,449	-7.46	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	19,683	18,818	864	4.59	

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

[色塗りの基準]月次リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別②

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)	
総合		13,016	12,782	234	1.83	
外国債券(先進国)		18,141	17,932	209	1.17	
グローバル		18,577	18,373	203	1.11	
除く日本		20,102	19,878	224	1.13	
含む日本		17,621	17,432	189	1.08	
その他		16,940	16,717	223	1.33	
北米	9,052 (2013.05.31)	10,712	10,575	137	1.30	
米国		15,334	15,296	38	0.25	
カナダ	10,000 (2003.05.30)	13,819	13,904	-85	-0.61	
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,405	15,189	217	1.43	
イギリス	10,069 (2014.07.31)	9,564	9,219	345	3.74	
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	18,774	18,406	369	2.00	
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	23,100	22,599	501	2.22	
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,136	10,966	169	1.54	
複合地域	10,000 (2001.11.30)	17,857	17,672	185	1.05	
エマージング債券		15,947	15,767	180	1.14	
グローバル		17,332	17,072	260	1.53	
米ドル建て		17,897	17,556	341	1.94	
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,015	12,024	-9	-0.07	
その他	8,647 (2005.03.31)	11,658	11,569	90	0.77	
ロシア	10,000 (2008.05.30)	10,003	10,836	-833	-7.69	
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	14,264	14,343	-79	-0.55	
インド	10,000 (2011.08.31)	15,499	15,415	84	0.55	
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	13,021	13,365	-344	-2.57	
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	10,379	10,058	321	3.19	
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	11,221	10,873	348	3.20	
トルコ	10,000 (2011.04.28)	5,221	5,655	-433	-7.67	
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,056	10,086	-30	-0.29	
ハイイールド債券		20,272	19,827	445	2.25	
グローバル	10,000 (1997.06.30)	20,645	20,118	526	2.62	
北米		19,650	19,195	455	2.37	
その他	10,000 (2004.03.31)	20,398	20,111	286	1.42	
欧州	10,000 (2006.04.28)	20,357	20,035	323	1.61	
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	13,424	13,364	60	0.45	
複合地域	10,000 (2004.03.31)	19,450	18,931	519	2.74	
複合資産		16,961	16,809	151	0.90	
安定	10,000 (1998.10.30)	15,429	15,288	141	0.92	
安定成長		18,160	17,990	170	0.95	
成長		20,025	19,918	106	0.53	
国内バランス		12,433	12,439	-7	-0.06	
安定		12,747	12,745	2	0.01	
一般		13,721	13,881	-160	-1.15	
その他	10,000 (2018.10.31)	12,350	12,048	301	2.50	

※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

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別③

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)	
総合		13,016	12,782	234	1.83	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	28,219	27,942	277	0.99	
日本	10,000 (2003.10.31)	28,219	27,942	277	0.99	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	22,807	22,233	573	2.58	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	19,280	18,889	390	2.07	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	20,992	20,525	467	2.27	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	19,308	18,929	379	2.00	
北米	10,000 (2003.09.30)	23,209	22,514	695	3.09	
その他	10,000 (2004.04.30)	23,443	22,982	461	2.00	
欧州	10,000 (2006.12.29)	4,745	4,664	81	1.73	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	17,978	17,584	394	2.24	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	11,537	11,404	133	1.17	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	5,034	5,021	14	0.27	
複数国	10,000 (2004.04.30)	31,043	30,447	596	1.96	
その他		5,998	5,887	111	1.89	
絶対収益型		7,763	7,673	90	1.18	
ロング・ショート		8,749	8,694	55	0.64	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	12,423	12,220	203	1.66	
GTAA		10,825	10,712	113	1.06	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,243	7,158	84	1.18	
CB		19,077	18,582	495	2.66	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	15,157	15,100	57	0.38	
日本		19,389	19,527	-138	-0.71	
グローバル		33,549	32,630	919	2.82	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	8,556	8,007	549	6.86	
全業種	10,000 (2004.12.30)	5,233	5,001	232	4.65	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	19,129	17,541	1,588	9.05	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	3,205	3,223	-18	-0.56	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	8,246	7,813	433	5.54	

※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

(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	8.07	-4.31	0.78	-4.39
国内株式	6.75	-6.15	0.74	-8.92
一般	7.28	-5.77	0.88	-8.71
フリー	8.83	-3.90	2.66	-7.00
バリュー	1.45	-12.67	-5.66	-15.07
小型	10.96	-1.33	3.44	-5.69
その他	4.69	-8.04	-0.17	-10.01
日経225	7.50	-5.45	2.64	-7.30
TOPIX	2.27	-10.04	-2.21	-11.99
JPX日経400	2.84	-9.55	-1.08	-11.26
国内債券	-0.27	-1.09	-1.39	-0.61
一般	-0.27	-1.09	-1.39	-0.61
外国株式(先進国)	14.38	1.95	10.16	2.52
グローバル	14.88	2.86	11.79	3.49
除く日本	10.84	-4.89	2.61	-5.14
含む日本	16.09	5.26	14.66	6.19
その他	12.94	-0.82	4.98	-0.47
北米	10.04	-5.67	-2.71	-5.21
米国	12.42	2.64	10.25	3.90
カナダ	10.38	-12.66	-9.17	-12.88
欧州	12.11	-6.29	1.68	-7.57
ドイツ	18.41	-3.90	2.93	-7.01
イギリス	1.64	-20.19	-16.62	-22.05
アジア・オセアニア	10.50	-6.99	-1.81	-10.34
オーストラリア	17.73	-16.84	-17.94	-19.43
ニュージーランド	15.80	2.38	4.21	-1.16
複合地域	-5.03	-37.61	-39.68	-41.40
エマージング株式	14.35	-8.64	-4.02	-10.15
グローバル	16.92	-2.09	3.64	-4.99
BRICS	15.48	-11.05	-6.38	-14.24
その他	13.24	-11.07	-6.82	-12.03
欧州	10.29	-20.01	-14.03	-21.48
ロシア	8.93	-17.52	-6.80	-17.16
アジア・オセアニア	12.08	-1.88	-1.04	-6.29
中国	20.73	19.16	33.51	19.26
インド	13.00	-18.27	-12.17	-17.26
インドネシア	19.52	-25.43	-28.11	-27.26
タイ	4.55	-13.97	-26.03	-20.47
フィリピン	3.56	-22.14	-30.00	-27.29
ベトナム	2.74	-20.48	-23.89	-21.24
韓国	29.95	22.38	31.89	20.55
香港	0.01	-8.51	-12.80	-14.59
台湾	20.14	10.58	22.74	5.25
中南米	23.35	-23.82	-21.54	-26.48
ブラジル	25.86	-28.37	-27.66	-31.89
メキシコ	8.42	-32.67	-23.99	-32.21
中東・アフリカ	7.29	-14.97	-14.57	-16.00
トルコ	5.48	-24.31	-17.74	-20.76
複合地域	11.42	-2.58	-4.12	-7.98

※[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	8.07	-4.31	0.78	-4.39
外国債券(先進国)	4.92	0.93	2.62	1.06
グローバル	4.42	1.11	3.06	1.68
除く日本	4.49	2.47	4.90	3.04
含む日本	4.33	-0.45	0.98	0.12
その他	6.35	0.47	1.44	-0.58
北米	5.75	1.26	3.57	2.55
米国	3.39	-5.37	-1.80	-4.33
カナダ	2.49	-2.00	-1.02	-2.27
欧州	4.67	0.25	0.34	0.62
イギリス	4.67	-2.07	5.71	-1.80
アジア・オセアニア	8.54	3.54	2.76	0.64
オーストラリア	8.91	3.44	2.79	0.62
ニュージーランド	7.87	2.67	2.29	0.35
複合地域	5.71	5.49	8.66	6.02
エマージング債券	8.68	-8.55	-8.90	-9.25
グローバル	11.97	-8.33	-8.02	-8.88
米ドル建て	13.30	-8.39	-8.33	-8.86
現地通貨建て	7.00	-8.00	-6.60	-8.85
その他	5.71	-8.79	-9.72	-9.64
ロシア	0.20	-15.02	-8.19	-16.61
アジア・オセアニア	5.34	-1.99	0.94	-1.54
インド	6.07	-2.80	-3.67	-2.79
インドネシア	10.01	-8.63	-2.13	-5.51
ブラジル	5.20	-17.50	-23.14	-20.86
メキシコ	13.33	-12.33	-3.54	-11.06
トルコ	-2.87	-18.60	-5.87	-13.94
複合地域	5.47	-11.60	-7.31	-11.95
ハイイールド債券	9.77	-7.96	-6.78	-9.24
グローバル	10.88	-7.50	-6.97	-8.82
北米	9.57	-7.86	-6.38	-9.06
その他	9.57	-8.69	-8.03	-10.20
欧州	9.60	-9.25	-8.66	-11.02
アジア・オセアニア	9.56	-7.29	-6.53	-7.83
複合地域	9.38	0.80	2.20	-0.57
複合資産	4.07	-4.46	-0.59	-4.26
安定	3.16	-2.34	0.19	-2.09
安定成長	4.42	-4.38	-0.37	-4.39
成長	5.42	-5.07	0.44	-5.72
国内バランス	0.06	-7.70	-5.00	-7.25
安定	-0.06	-7.72	-5.20	-7.22
一般	2.99	-6.04	-0.73	-6.46
その他	8.87	-7.88	1.83	-4.99

※[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	8.07	-4.31	0.78	-4.39
国内REIT	7.16	-22.64	-13.87	-20.05
日本	7.16	-22.64	-13.87	-20.05
外国REIT	5.81	-18.89	-13.68	-17.24
グローバル	5.17	-21.29	-15.91	-20.03
除く日本	5.91	-20.86	-14.69	-19.70
含む日本	4.94	-21.42	-16.24	-20.14
北米	5.32	-17.37	-11.52	-15.13
その他	10.99	-17.08	-15.52	-16.70
欧州	6.28	-20.73	-12.20	-21.80
アジア・オセアニア	10.71	-14.47	-13.96	-13.86
オーストラリア	16.90	-25.70	-24.37	-26.30
複合地域	7.76	-31.81	-27.81	-33.49
複数国	4.95	-18.21	-10.97	-15.63
その他	7.36	0.25	3.35	-0.09
絶対収益型	1.94	-0.64	-0.95	-0.33
ロング・ショート	0.95	-3.24	-4.53	-2.92
マーケットニュートラル	4.92	4.81	3.55	4.53
GTAA	2.89	-0.96	0.35	-0.34
その他スタイル	1.49	-1.14	-1.17	-0.73
CB	9.90	-0.11	2.54	0.26
アジア・オセアニア	9.28	-3.23	-1.11	-2.81
日本	1.82	-3.58	-1.76	-4.31
グローバル	10.23	0.07	2.78	0.49
コモディティ	18.49	6.46	10.23	5.58
全業種	20.27	-15.72	-17.87	-21.24
貴金属	13.39	21.78	32.39	26.79
エネルギー	46.77	-27.00	-31.40	-35.69
その他コモディティ	15.13	-15.98	-18.23	-21.56

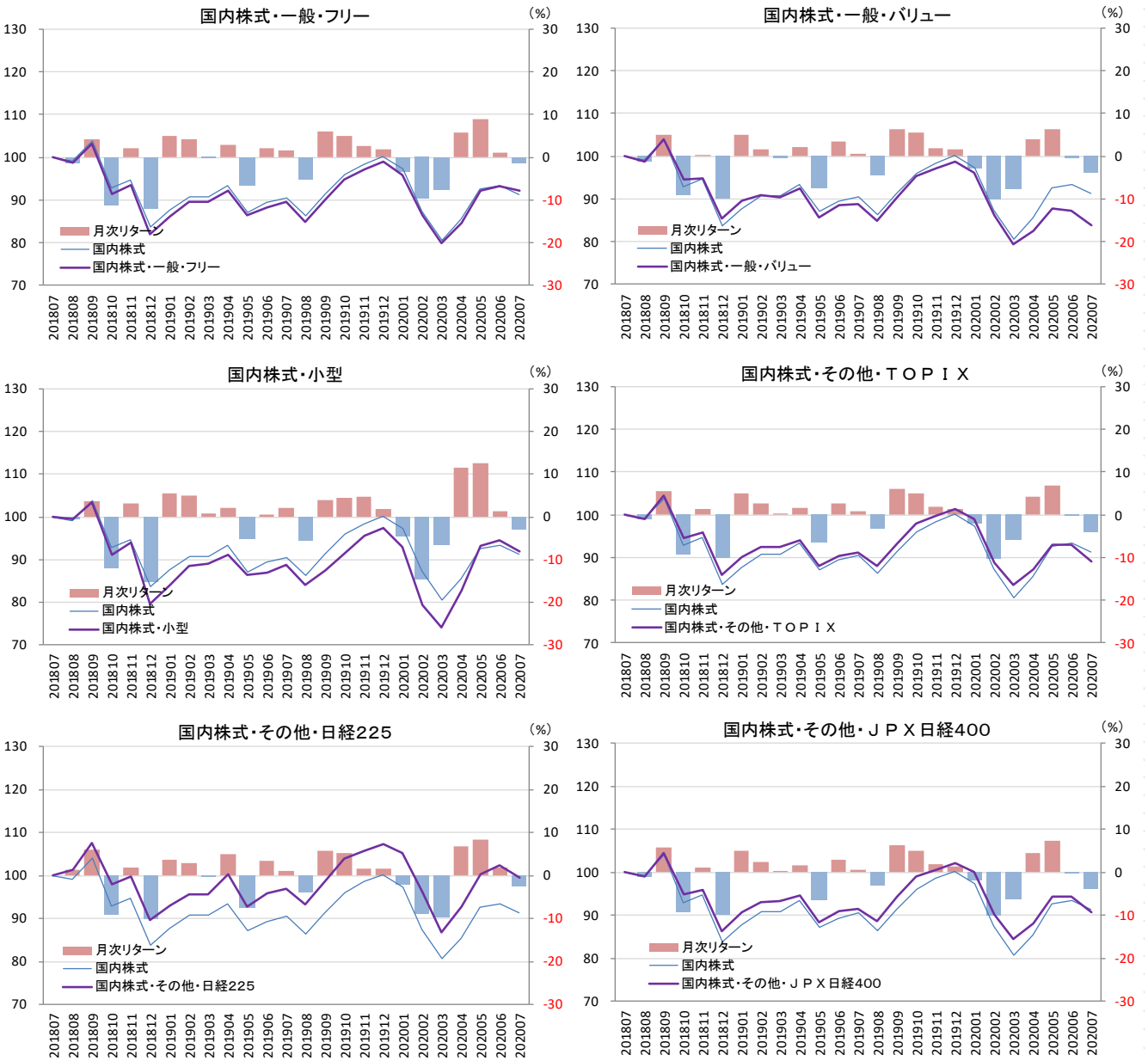
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

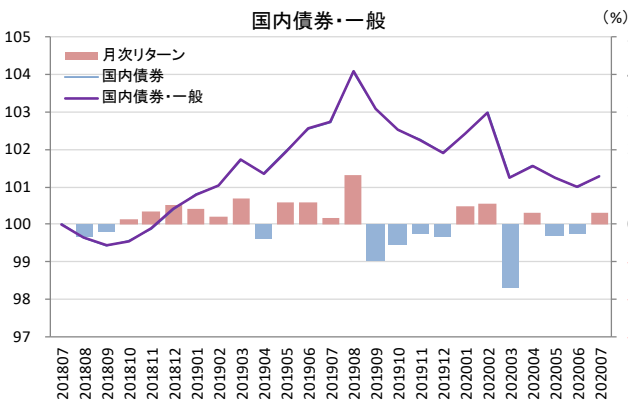
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

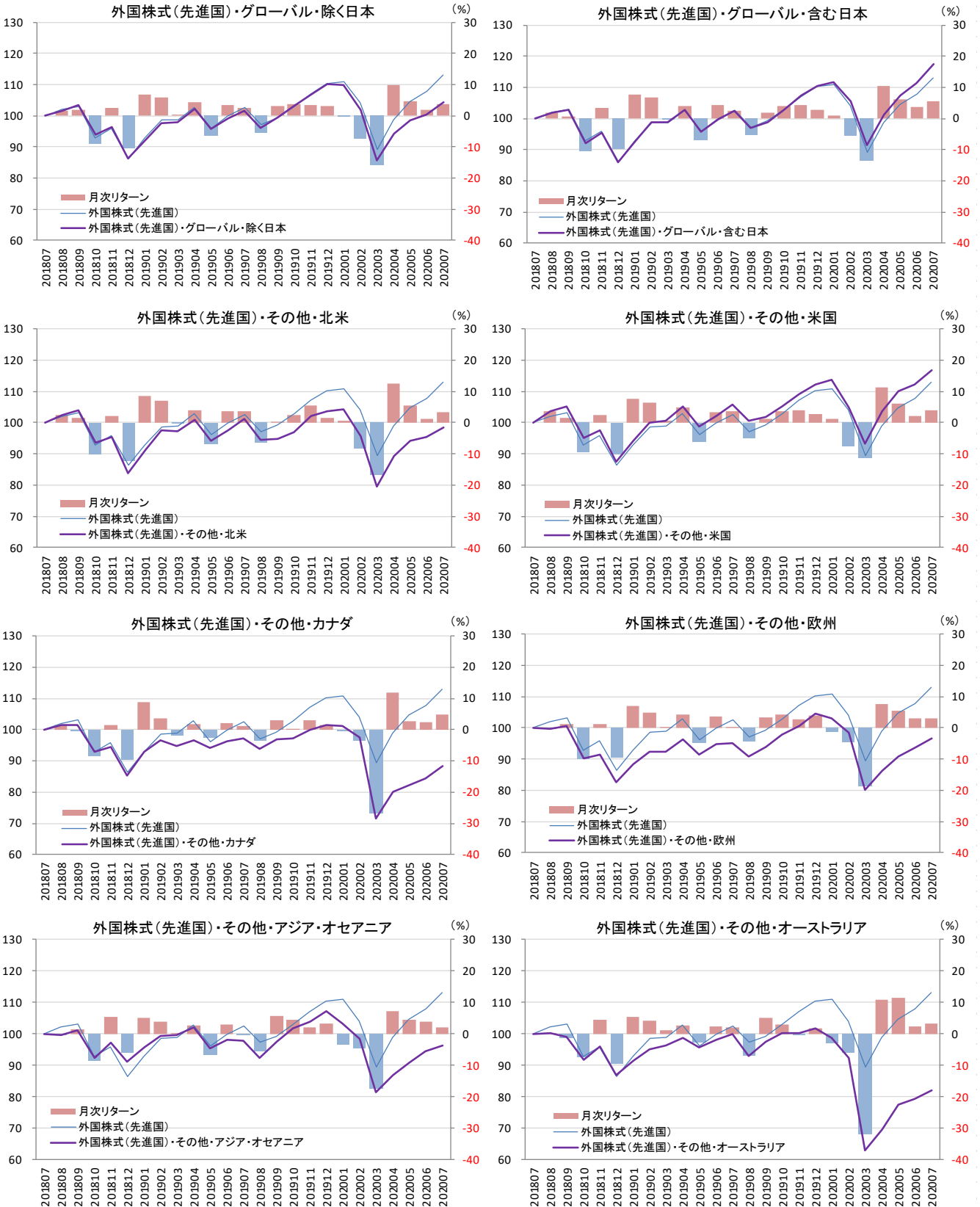


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

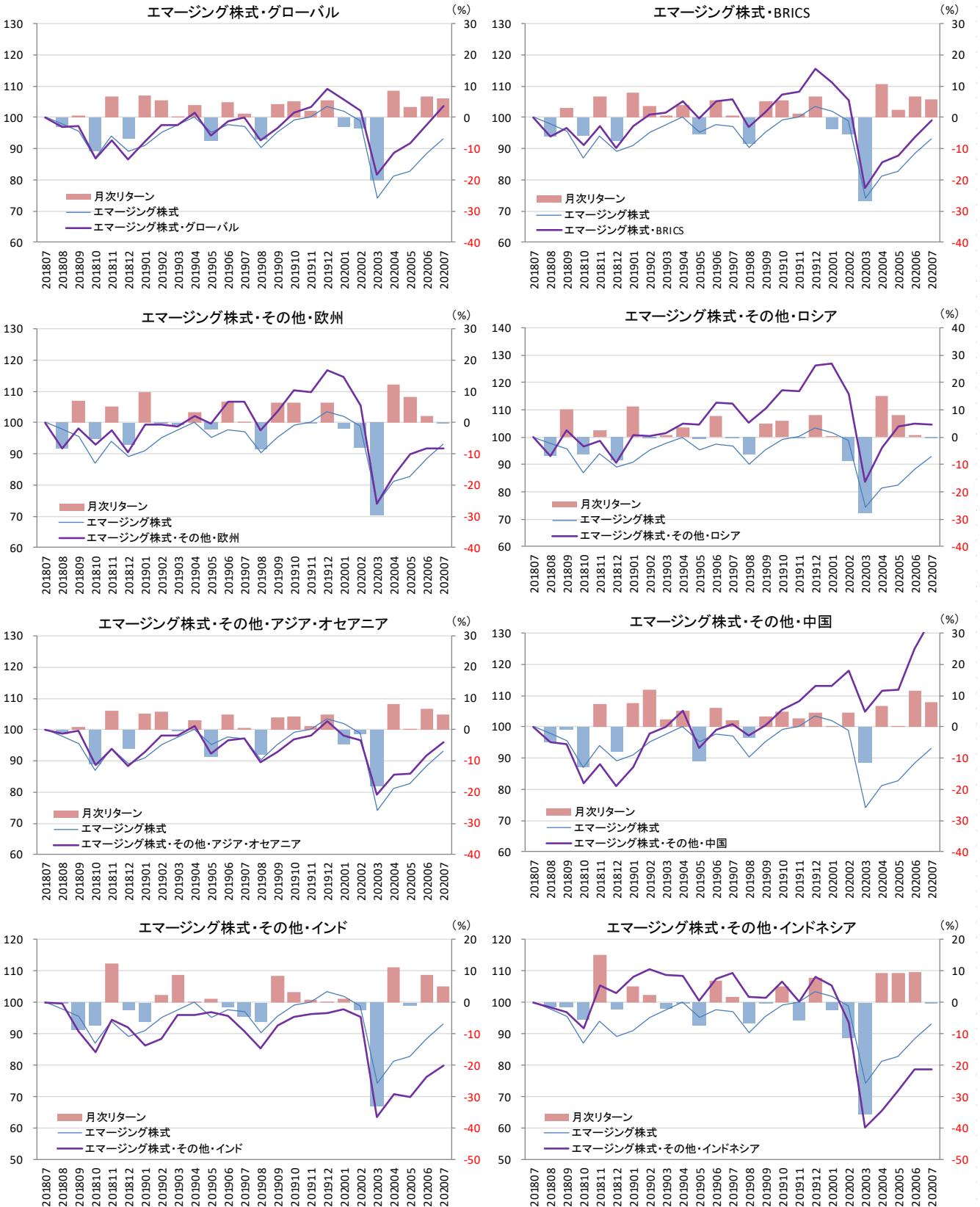


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

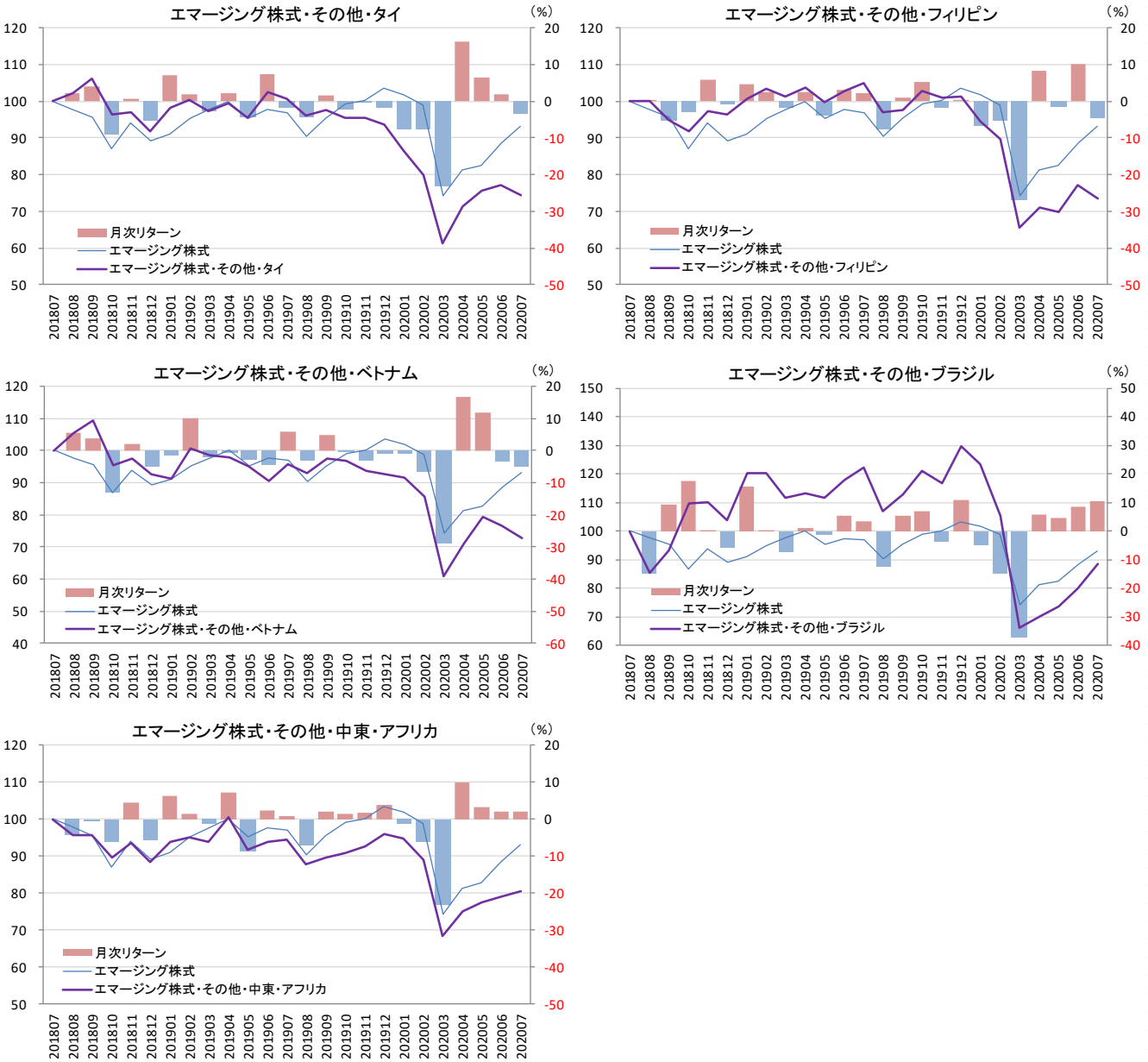


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

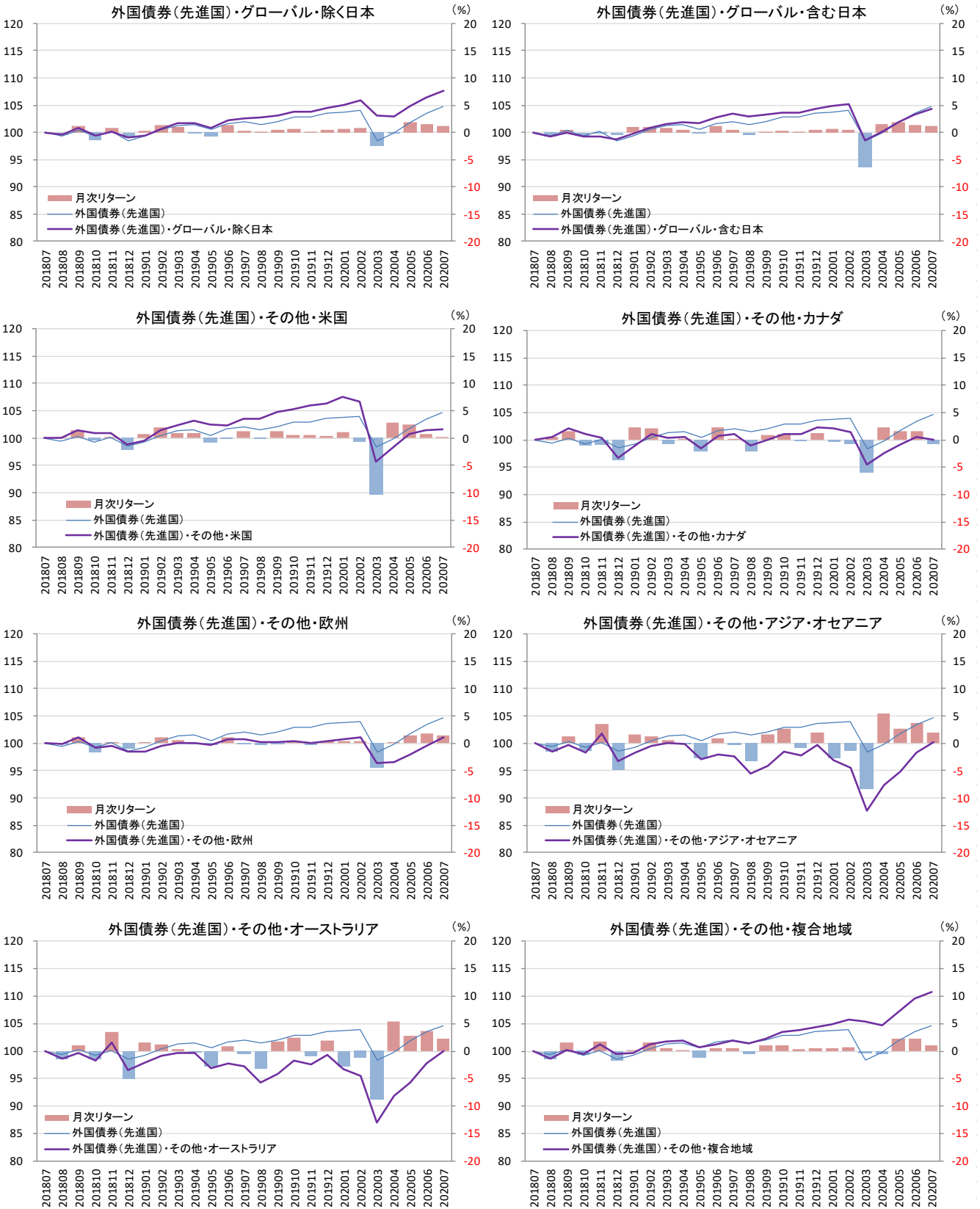


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

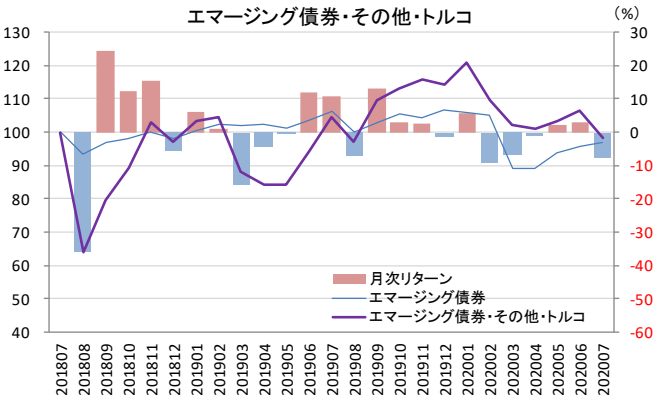


＜1＞パフォーマンス・サマリー

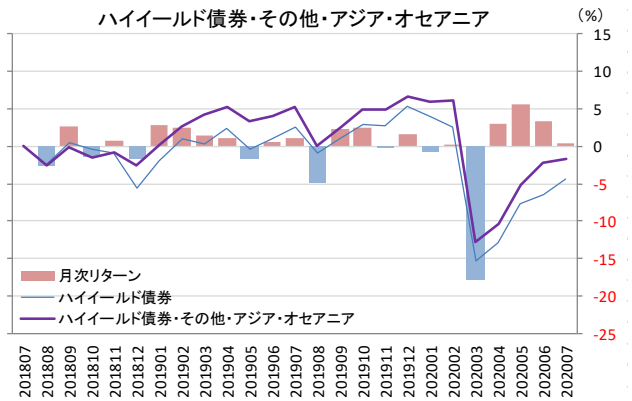
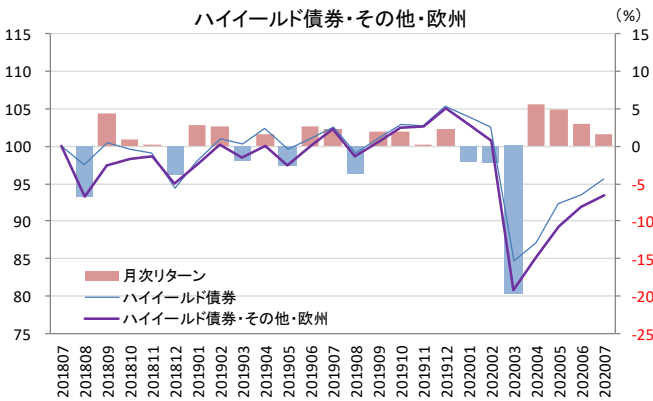
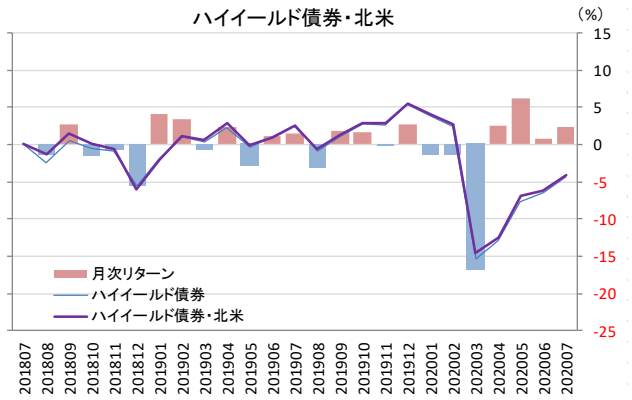
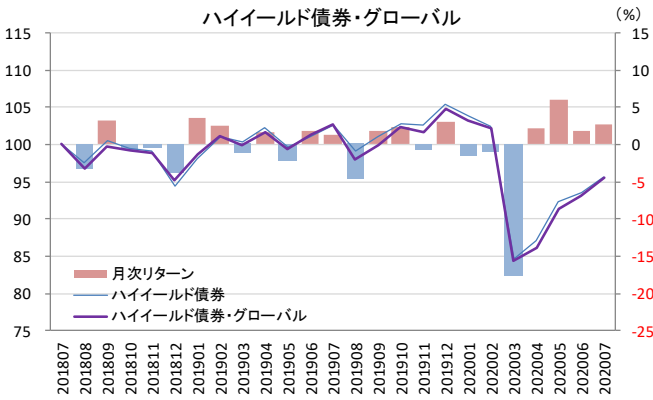
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

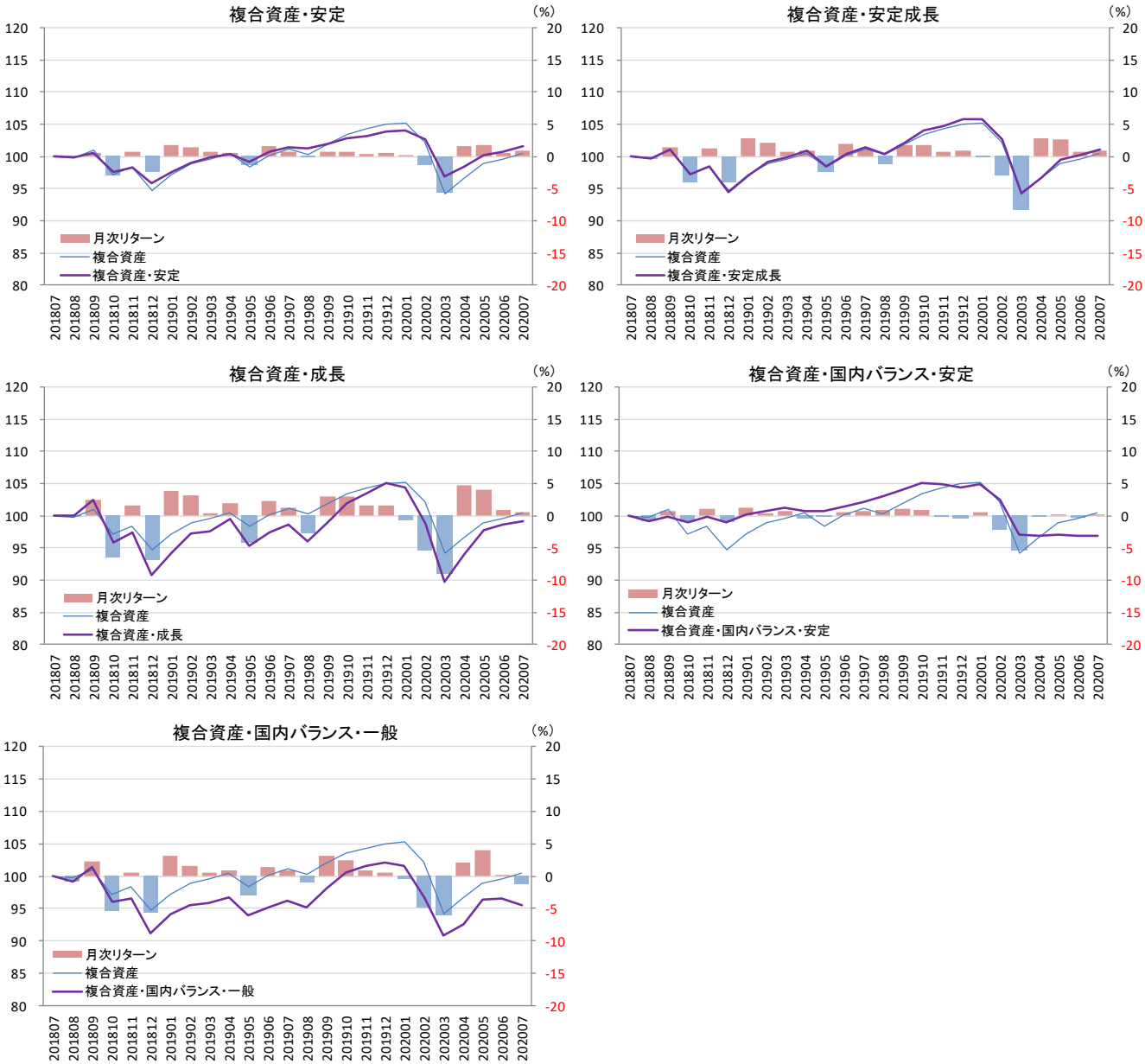


<1>パフォーマンス・サマリー

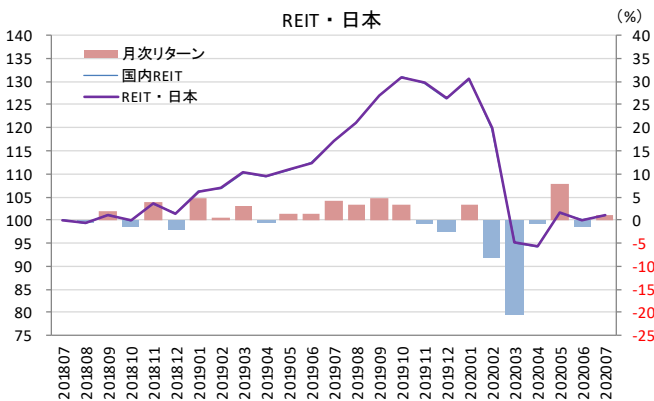
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

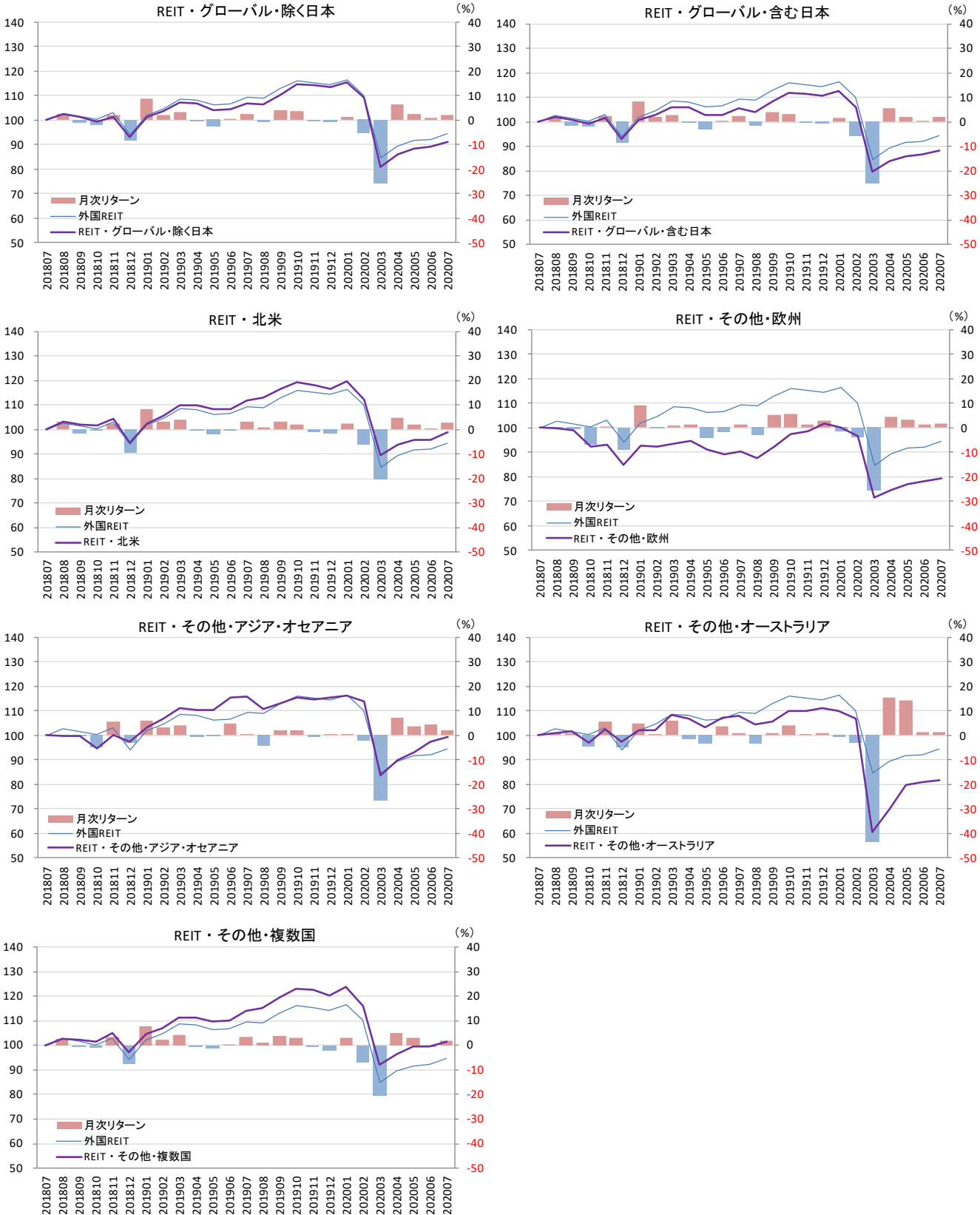


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

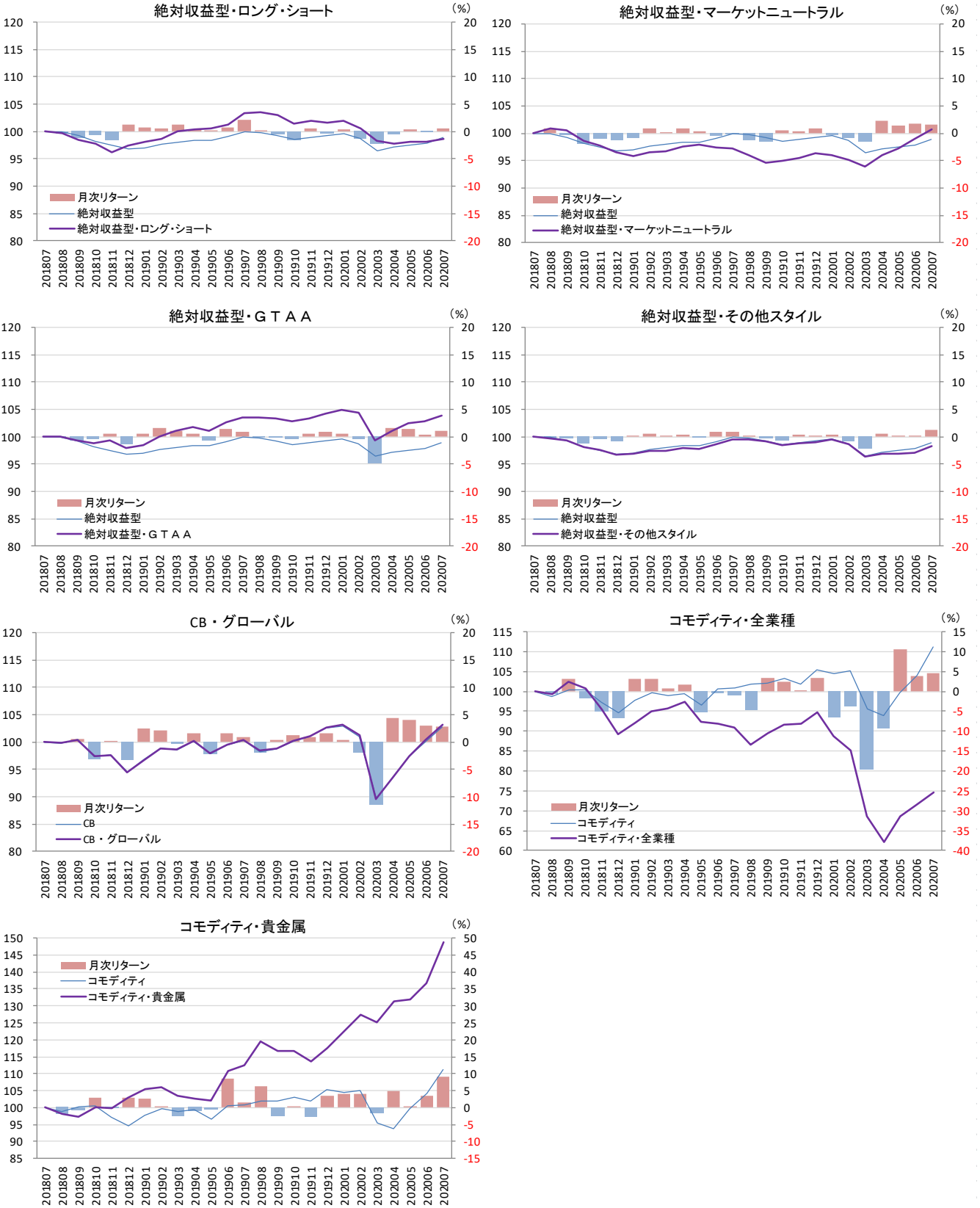


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	1.83		
1	外国株式(先進国)・グローバル	5.12	20.91	1.04
2	外国株式(先進国)・その他	3.94	7.07	0.27
3	エマージング株式・その他	4.61	2.79	0.13
4	外国債券(先進国)・グローバル	1.11	9.49	0.10
5	REIT・北米	3.09	3.23	0.10
6	複合資産・安定成長	0.95	7.41	0.07
7	エマージング株式・グローバル	6.17	1.18	0.07
8	REIT・グローバル	2.07	2.52	0.05
9	ハイイールド債券・北米	2.37	2.01	0.05
10	外国債券(先進国)・その他	1.33	3.38	0.05
11	複合資産・安定	0.92	4.57	0.04
12	REIT・日本	0.99	3.96	0.04
13	複合資産・その他	2.50	1.21	0.03
14	コモディティ	6.86	0.40	0.03
15	エマージング債券・グローバル	1.53	1.20	0.02
16	国内債券・一般	0.30	5.44	0.02
17	絶対収益型	1.18	1.25	0.01
18	REIT・その他	2.00	0.64	0.01
19	ハイイールド債券・グローバル	2.62	0.47	0.01
20	複合資産・成長	0.53	2.16	0.01
21	エマージング債券・その他	0.77	1.24	0.01
22	ハイイールド債券・その他	1.42	0.52	0.01
23	CB	2.66	0.28	0.01
24	エマージング株式・BRICS	5.63	0.09	0.01
25	複合資産・国内バランス	-0.06	1.65	-0.00
26	国内株式・業種特化	-1.75	0.11	-0.00
27	ブルベア	-2.32	0.32	-0.01
28	国内株式・小型	-2.90	1.24	-0.04
29	国内株式・一般	-1.75	8.55	-0.14
30	国内株式・その他	-3.46	4.72	-0.16
	合計		100.00	1.83

◆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	0.78		
1	外国株式(先進国)・グローバル	11.79	19.20	2.59
2	外国株式(先進国)・その他	4.98	5.85	0.49
3	国内株式・一般	0.88	9.02	0.39
4	国内株式・その他	-0.17	4.77	0.26
5	外国債券(先進国)・グローバル	3.06	9.81	0.22
6	国内株式・小型	3.44	1.39	0.10
7	ブルベア	6.91	0.30	0.05
8	複合資産・成長	0.44	2.07	0.04
9	コモディティ	10.23	0.33	0.04
10	外国債券(先進国)・その他	1.44	3.55	0.04
11	エマージング株式・グローバル	3.64	1.21	0.03
12	国内株式・業種特化	3.35	0.11	0.01
13	CB	2.54	0.23	0.00
14	エマージング株式・BRICS	-6.38	0.10	-0.01
15	複合資産・安定	0.19	4.59	-0.02
16	絶対収益型	-0.95	1.21	-0.02
17	複合資産・安定成長	-0.37	7.25	-0.04
18	複合資産・その他	1.83	0.91	-0.04
19	ハイイールド債券・グローバル	-6.97	0.52	-0.06
20	ハイイールド債券・その他	-8.03	0.61	-0.08
21	国内債券・一般	-1.39	5.51	-0.11
22	複合資産・国内バランス	-5.00	1.66	-0.11
23	エマージング債券・グローバル	-8.02	1.33	-0.17
24	REIT・その他	-15.52	0.74	-0.18
25	エマージング債券・その他	-9.72	1.48	-0.20
26	ハイイールド債券・北米	-6.38	2.20	-0.22
27	エマージング株式・その他	-6.82	3.15	-0.36
28	REIT・北米	-11.52	3.64	-0.54
29	REIT・グローバル	-15.91	2.81	-0.60
30	REIT・日本	-13.87	4.44	-0.71
	合計		100.00	0.78

◆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	5.20	5.82	75.45	11.57 ↑	11.33 ↑	11.55	0.15	0.10	0.50
国内株式	2.35	4.42	123.30	16.97 ↑	17.38	17.28	0.05	0.05	0.48
一般	0.35	2.02	109.53	16.95 ↑	17.59	17.57	0.01	0.02	0.44
フリー	2.57	4.02	113.87	17.27 ↑	17.95	18.19	0.05	0.05	0.43
バリュー	-7.82	-5.28	96.82	16.03 ↑	16.56	16.28	-0.16	-0.06	0.43
小型	10.42	31.34	235.31	20.81 ↑	18.97 ↑	18.11	0.16	0.30	0.71
その他	5.28	5.15	136.14	16.31 ↑	16.90	16.95	0.11	0.06	0.53
日経225	13.85	13.20	158.93	17.09 ↑	17.35	17.26	0.26	0.15	0.58
TOPIX	-1.77	-0.74	111.10	15.56 ↑	16.41	16.58	-0.03	-0.01	0.47
JPX日経400	-1.25	-1.83	-	15.43 ↑	16.09	-	-0.02	-0.02	-
国内債券	1.77	4.73	12.53	1.83	1.89	1.64	0.35	0.51	0.71
一般	1.77	4.73	12.53	1.83	1.89	1.64	0.35	0.51	0.71
外国株式(先進国)	22.13	22.63	130.35	17.89 ↑	17.26 ↑	16.38	0.39	0.24	0.53
グローバル	24.19	25.72	143.52	17.93 ↑	17.05 ↑	16.25	0.42	0.28	0.57
除く日本	15.69	18.87	168.34	18.38 ↑	18.17 ↑	17.86	0.27	0.20	0.58
含む日本	26.88	27.79	138.56	17.88 ↑	16.82 ↑	15.95	0.46	0.30	0.57
その他	16.28	14.91	109.98	17.91 ↑	17.88 ↑	17.63	0.29	0.16	0.44
北米	9.93	6.16	58.84	20.88 ↑	19.96 ↑	21.31	0.16	0.06	0.22
米国	30.58	27.17	142.47	17.55 ↑	18.32 ↑	17.69	0.53	0.27	0.52
カナダ	-9.77	-10.39	0.68	21.25 ↑	18.48	17.79	-0.16	-0.12	0.00
欧州	1.04	1.57	99.71	18.27 ↑	17.38 ↑	18.53	0.02	0.02	0.39
ドイツ	-6.90	-6.19	-	22.27 ↑	22.29 ↑	-	-0.10	-0.06	-
イギリス	-22.91	-35.05	-	18.41	17.54	-	-0.45	-0.47	-
アジア・オセアニア	3.71	8.17	113.75	17.05 ↑	17.16	17.86	0.07	0.09	0.44
オーストラリア	-19.13	-11.33	45.79	24.40 ↑	22.07 ↑	21.34	-0.28	-0.11	0.18
ニュージーランド	26.02	65.80	-	18.17 ↑	18.89 ↑	-	0.44	0.57	-
複合地域	-46.65	-54.77	-	32.14	27.53	-	-0.59	-0.53	-
エマージング株式	-4.15	-0.37	38.80	20.82 ↑	19.53 ↑	19.26	-0.06	-0.00	0.17
グローバル	7.83	9.89	44.58	20.25 ↑	19.22 ↑	18.96	0.13	0.10	0.20
BRICS	8.02	20.01	51.86	23.57 ↑	22.44 ↑	22.08	0.11	0.17	0.19
その他	-8.77	-4.79	38.75	21.47 ↑	19.97 ↑	19.46	-0.14	-0.05	0.17
欧州	-4.35	11.22	6.50	25.69	23.79	24.77	-0.06	0.09	0.02
ロシア	24.00	45.04	33.09	25.94 ↑	25.02	27.20	0.29	0.31	0.11
アジア・オセアニア	-1.58	-1.30	65.37	19.14 ↑	18.32 ↑	17.88	-0.02	-0.01	0.29
中国	44.16	46.51	166.96	20.78 ↑	21.53	21.98	0.63	0.37	0.47
インド	-17.96	-10.28	37.87	26.78 ↑	24.56 ↑	25.83	-0.24	-0.09	0.13
インドネシア	-27.82	-20.70	4.53	29.25	26.39	24.64	-0.35	-0.17	0.02
タイ	-17.87	-7.96	79.47	22.58 ↑	19.19	18.89	-0.28	-0.08	0.32
フィリピン	-32.88	-42.91	84.38	22.29 ↑	20.11 ↑	21.75	-0.56	-0.53	0.29
ベトナム	-16.84	-9.67	31.18	27.57 ↑	23.01	21.69	-0.21	-0.09	0.13
韓国	-1.51	-9.70	40.72	24.41 ↑	21.23 ↑	20.87	-0.02	-0.09	0.17
香港	-6.06	2.09	39.89	19.23	19.39	19.36	-0.10	0.02	0.18
台湾	12.79	25.07	148.18	22.46 ↑	19.93	19.05	0.18	0.23	0.50
中南米	-13.45	-7.09	-17.12	31.57 ↑	28.65 ↑	25.79	-0.15	-0.05	-0.07
ブラジル	-13.99	-2.21	-40.65	36.46 ↑	35.65	31.49	-0.13	-0.01	-0.16
メキシコ	-42.58	-46.21	-	29.89	26.44	-	-0.56	-0.44	-
中東・アフリカ	-14.45	-28.93	37.02	19.60 ↑	18.68 ↑	17.66	-0.26	-0.35	0.18
トルコ	-48.33	-49.86	-46.88	36.63 ↑	31.53	30.87	-0.54	-0.41	-0.20
複合地域	-7.04	-9.87	54.64	18.55 ↑	17.39 ↑	16.64	-0.13	-0.12	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	5.20	5.82	75.45	11.57 ↑	11.33 ↑	11.55	0.15	0.10	0.50
外国債券(先進国)	2.34	-0.95	40.06	4.69 ↑	5.51 ↑	7.69	0.18	-0.03	0.44
グローバル	4.34	0.34	40.46	3.91 ↑	4.83	6.91	0.38	0.02	0.50
除く日本	5.86	0.44	45.49	3.70	5.02	7.52	0.53	0.02	0.51
含む日本	2.61	0.39	34.60	4.65 ↑	4.99 ↑	6.39	0.20	0.02	0.47
その他	-2.58	-4.37	38.32	7.43 ↑	7.79	9.59	-0.11	-0.11	0.34
北米	4.18	1.04	-	5.00 ↑	4.70	-	0.29	0.05	-
米国	0.52	-5.31	41.76	7.36	6.92	6.92	0.03	-0.15	0.51
カナダ	-4.20	-13.12	10.88	7.12	8.21	9.15	-0.19	-0.33	0.11
欧州	1.81	-2.47	40.31	4.80	6.28	9.40	0.14	-0.07	0.36
イギリス	-1.40	-17.84	-	8.45 ↑	10.64	-	-0.05	-0.36	-
アジア・オセアニア	-4.55	-3.80	43.43	9.29 ↑	9.48	10.81	-0.16	-0.08	0.34
オーストラリア	-4.87	-3.80	40.34	9.42 ↑	9.59	11.03	-0.17	-0.08	0.31
ニュージーランド	-1.89	5.37	-	9.15	9.73	-	-0.06	0.11	-
複合地域	7.68	8.35	39.30	4.29	6.50	9.14	0.59	0.25	0.37
エマージング債券	-9.80	-0.89	26.63	12.58	12.45	13.17	-0.26	-0.01	0.18
グローバル	-9.72	-1.56	28.31	14.45	13.40	13.50	-0.23	-0.02	0.19
米ドル建て	-9.90	-0.16	31.19	14.96 ↑	13.80	13.80	-0.22	0.00	0.20
現地通貨建て	-8.33	-9.81	12.93	13.01	12.28	12.37	-0.22	-0.16	0.10
その他	-9.95	-0.37	22.39	11.27	12.23	13.70	-0.30	-0.00	0.15
ロシア	-0.86	13.40	16.98	20.31 ↑	20.05	22.73	-0.01	0.13	0.07
アジア・オセアニア	4.05	1.11	53.42	7.45 ↑	7.67 ↑	8.93	0.19	0.03	0.49
インド	-2.24	1.09	-	9.67 ↑	10.42	-	-0.07	0.02	-
インドネシア	-1.21	5.40	-	17.28 ↑	16.64 ↑	-	-0.02	0.07	-
ブラジル	-24.32	-4.43	9.05	19.29	19.69	18.31	-0.46	-0.04	0.05
メキシコ	-3.30	-17.02	-	19.41 ↑	18.27 ↑	-	-0.05	-0.20	-
トルコ	-38.52	-51.36	-	36.55	29.82	-	-0.41	-0.45	-
複合地域	-2.32	-14.15	10.38	13.09	13.15	13.68	-0.06	-0.23	0.07
ハイイールド債券	-6.89	-0.67	60.59	13.05 ↑	12.51 ↑	12.77	-0.18	-0.01	0.38
グローバル	-7.43	0.52	52.52	13.21 ↑	12.59 ↑	13.00	-0.19	0.01	0.33
北米	-5.31	-0.22	68.34	12.87 ↑	12.45 ↑	12.41	-0.14	-0.00	0.43
その他	-11.34	-3.85	57.62	14.36	13.46 ↑	15.17	-0.27	-0.06	0.31
欧州	-12.97	-4.71	69.79	15.08	14.22 ↑	16.23	-0.30	-0.07	0.33
アジア・オセアニア	-6.02	-0.47	-	12.84 ↑	11.81 ↑	-	-0.16	-0.01	-
複合地域	3.81	3.57	79.72	9.53 ↑	9.81 ↑	11.42	0.14	0.08	0.53
複合資産	3.49	2.37	67.08	7.31 ↑	7.68	9.00	0.16	0.07	0.58
安定	3.05	1.16	54.22	5.12 ↑	5.54	7.35	0.21	0.05	0.60
安定成長	4.13	3.50	70.17	7.86 ↑	8.16	9.43	0.18	0.09	0.58
成長	5.47	5.92	94.91	11.33 ↑	11.63	11.71	0.16	0.10	0.59
国内バランス	-0.76	-1.04	32.20	4.27	4.01	6.58	-0.05	-0.04	0.43
安定	-1.05	1.87	24.46	4.03	3.39	3.43	-0.07	0.12	0.64
一般	2.50	2.55	48.25	8.88 ↑	8.95	9.73	0.10	0.06	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	5.20	5.82	75.45	11.57 ↑	11.33 ↑	11.55	0.15	0.10	0.50
国内REIT	7.66	9.22	153.39	16.02	13.66	17.25	0.16	0.13	0.56
日本	7.66	9.22	153.39	16.02	13.66	17.25	0.16	0.13	0.56
外国REIT	-4.15	-3.91	114.93	18.06 ↑	16.56	16.21	-0.07	-0.05	0.49
グローバル	-8.83	-11.51	92.69	18.91 ↑	17.13	16.39	-0.16	-0.14	0.41
除く日本	-5.26	-4.31	111.45	19.36 ↑	17.57	16.57	-0.09	-0.05	0.47
含む日本	-9.54	-12.52	90.41	18.78 ↑	17.04	16.35	-0.17	-0.15	0.41
北米	-0.74	1.17	132.93	17.49 ↑	16.28	16.41	-0.01	0.02	0.54
その他	-0.99	5.04	130.11	20.41 ↑	17.89 ↑	16.46	-0.01	0.06	0.53
欧州	-14.56	-21.01	7.97	19.71 ↑	19.02	20.50	-0.26	-0.24	0.04
アジア・オセアニア	4.48	17.59	145.05	19.24 ↑	17.19 ↑	16.47	0.08	0.19	0.57
オーストラリア	-16.25	-12.79	81.91	30.09 ↑	25.33 ↑	21.81	-0.19	-0.11	0.28
複合地域	-32.02	-37.22	39.20	26.74 ↑	23.22	21.05	-0.45	-0.38	0.16
複数国	4.59	9.55	174.35	16.58 ↑	14.74	15.18	0.09	0.13	0.70
その他									
絶対収益型	-1.05	-3.71	-3.24	2.57 ↑	2.30	3.50	-0.12	-0.31	-0.10
ロング・ショート	-3.93	-7.48	-1.83	3.55	3.12	3.58	-0.36	-0.48	-0.06
マーケットニュートラル	3.83	21.23	44.11	4.05	5.30	5.30	0.32	0.75	0.70
GTAA	2.97	3.11	14.55	4.08 ↑	3.28 ↑	3.11	0.25	0.20	0.43
その他スタイル	-2.15	-5.39	-6.39	2.48 ↑	2.37	5.06	-0.27	-0.45	-0.13
CB	2.48	2.31	37.85	9.08 ↑	8.63 ↑	10.01	0.10	0.06	0.32
アジア・オセアニア	3.01	4.80	57.94	12.80	12.43	12.15	0.08	0.08	0.38
日本	-3.95	-1.25	40.05	5.63 ↑	5.63	6.16	-0.23	-0.04	0.55
グローバル	2.82	3.01	40.92	9.26 ↑	8.72 ↑	10.38	0.11	0.07	0.33
コモディティ	14.93	-7.94	-7.52	10.38 ↑	11.89	14.22	0.46	-0.14	-0.06
全業種	-19.30	-36.88	-36.95	18.06 ↑	16.74	16.44 ↑	-0.38	-0.52	-0.28
貴金属	41.13	44.84	61.45	10.62 ↑	9.92	16.62	1.15	0.78	0.29
エネルギー	-19.30	-44.58	-55.85	38.86	34.40	29.50	-0.18	-0.32	-0.27
その他コモディティ	-24.76	-27.49	-7.28	19.02	17.63 ↑	18.43	-0.47	-0.35	-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

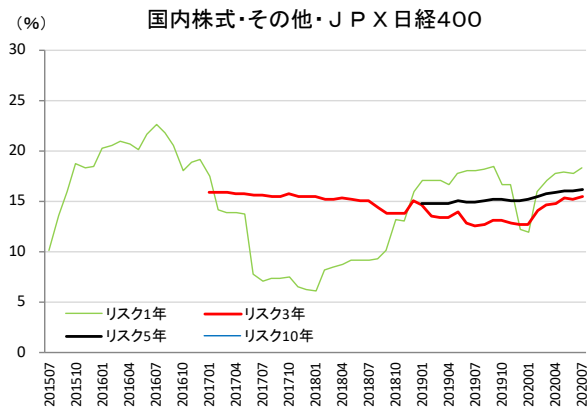
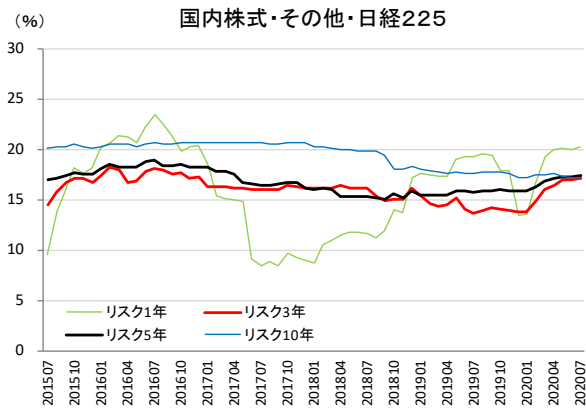
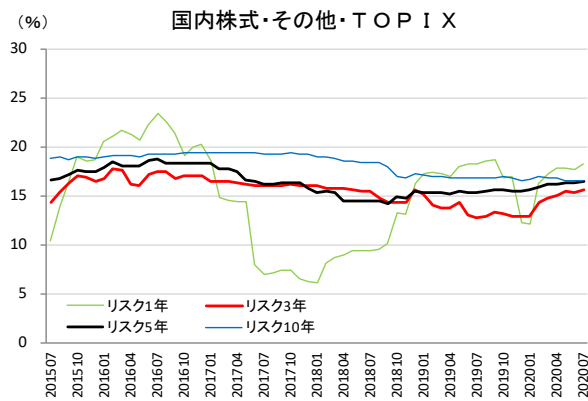
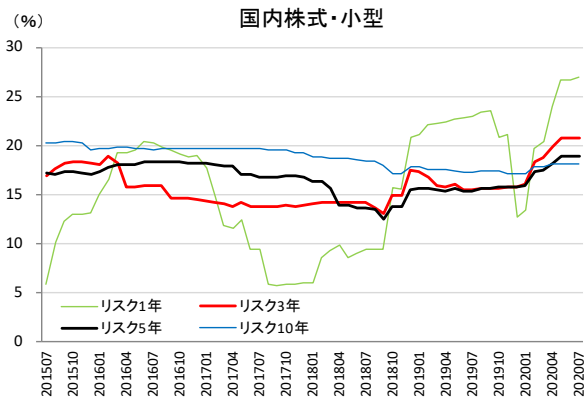
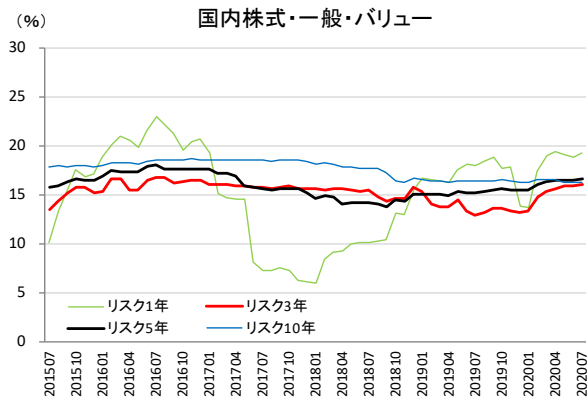
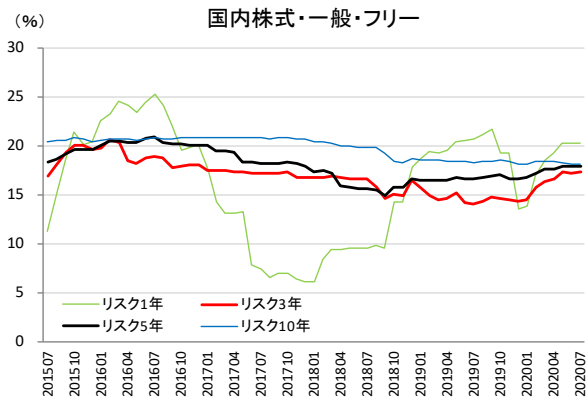
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑: 上昇傾向、↓: 低下傾向

＜2＞リスク・サマリー

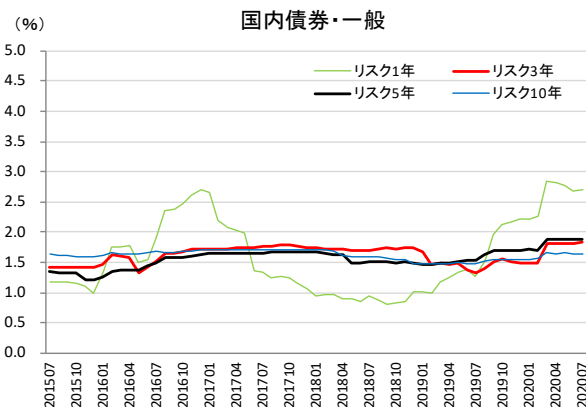
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

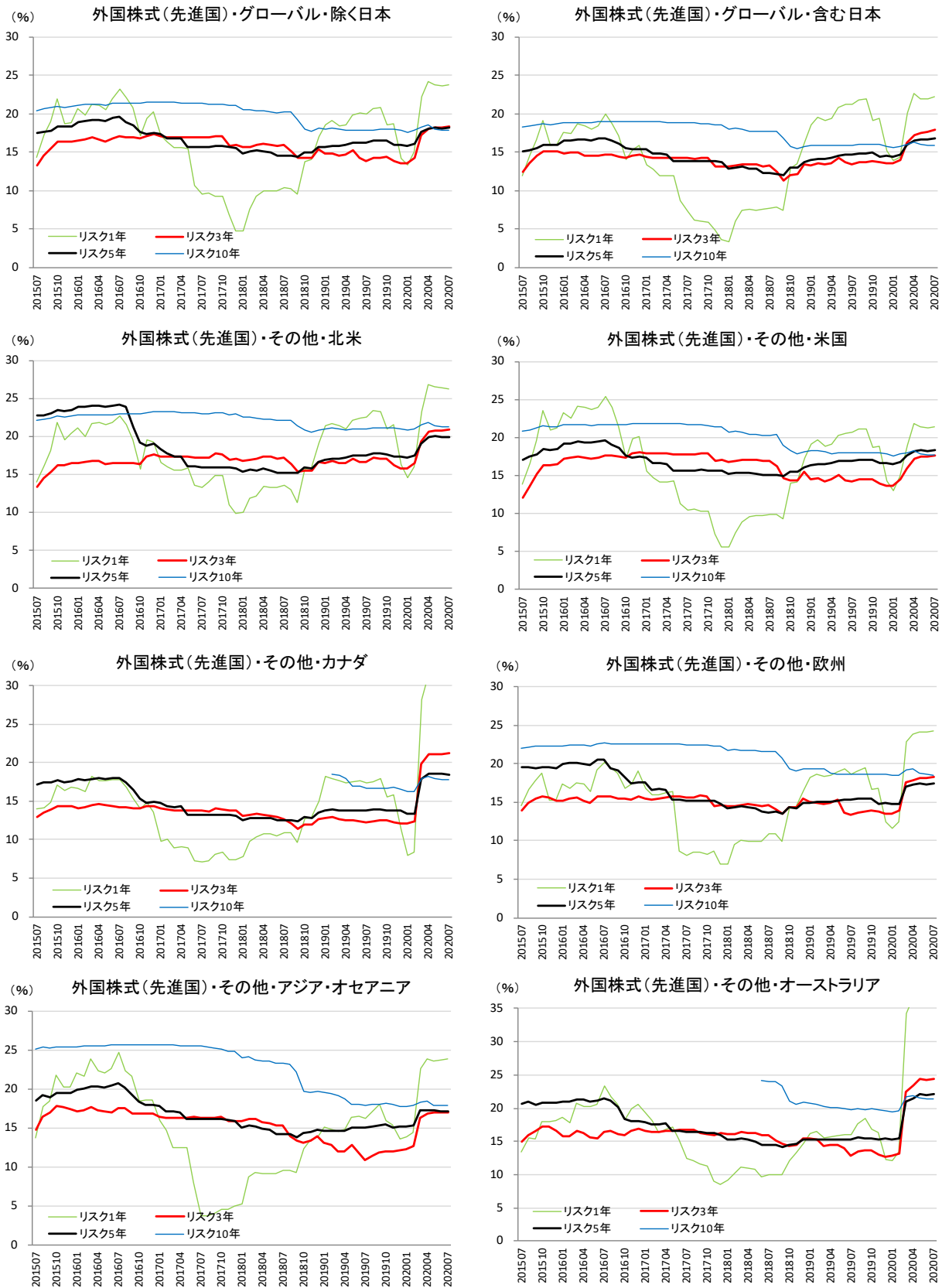


＜2＞リスク・サマリー

(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)]

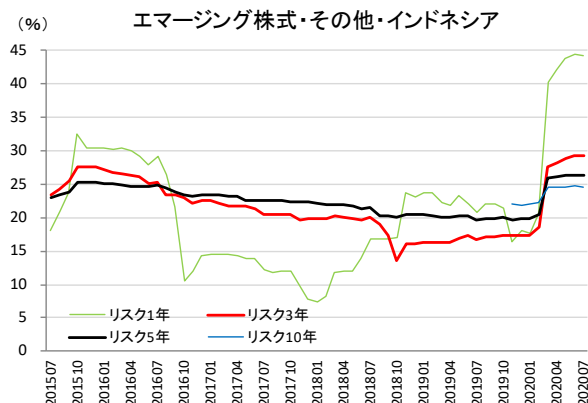
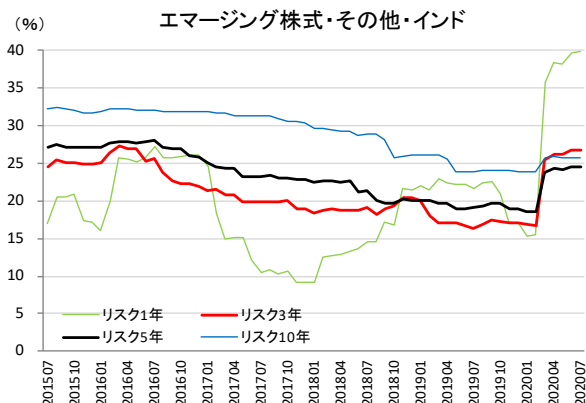
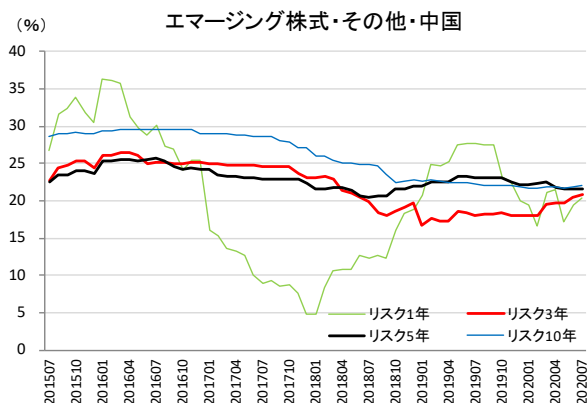
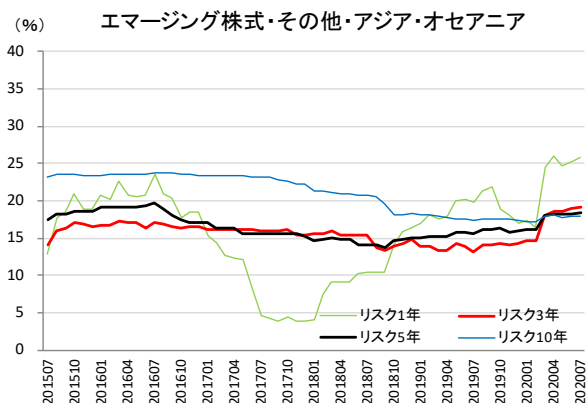
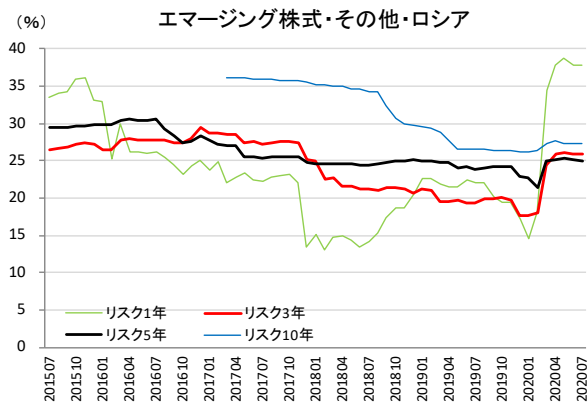
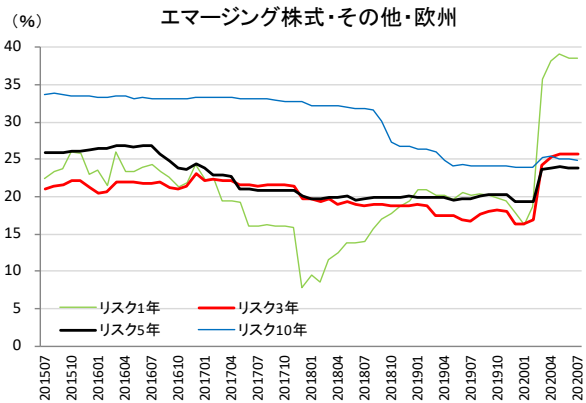
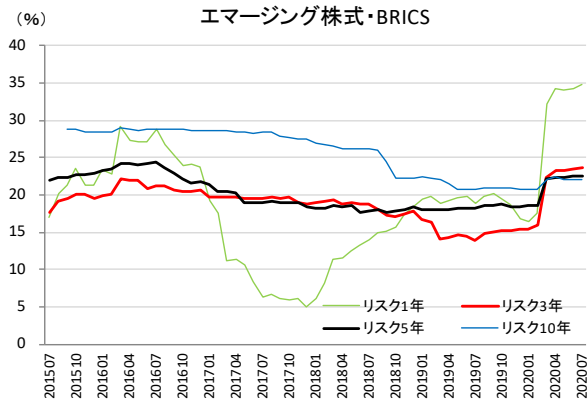
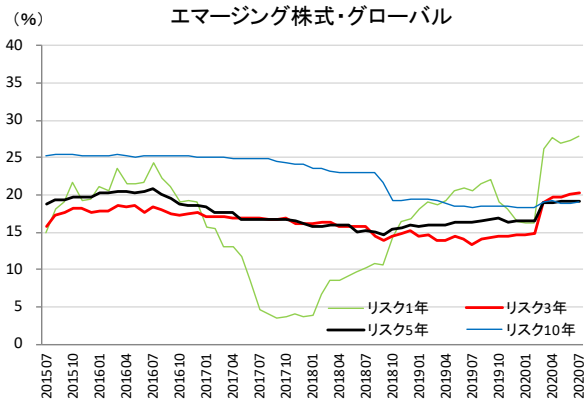


＜2＞リスク・サマリー

(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]

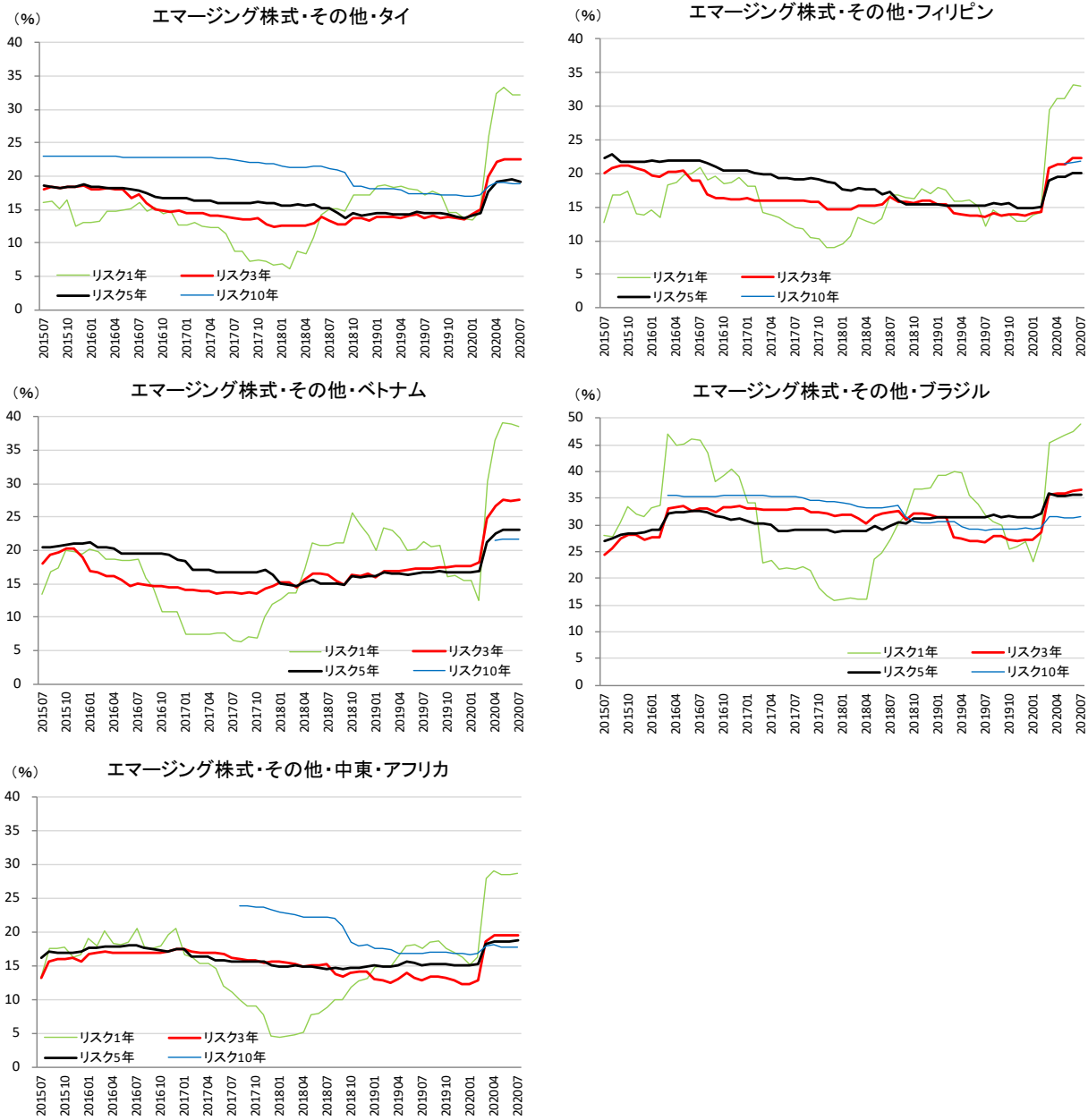


＜2＞リスク・サマリー

(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]

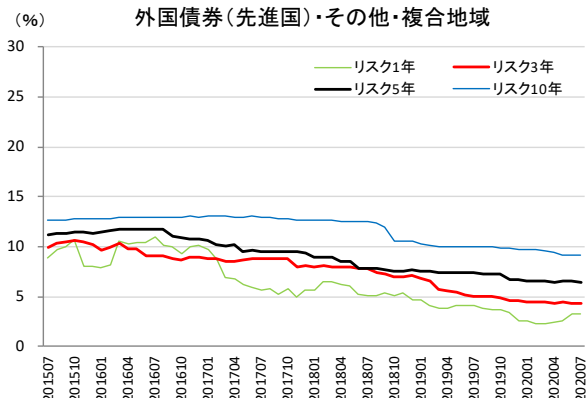
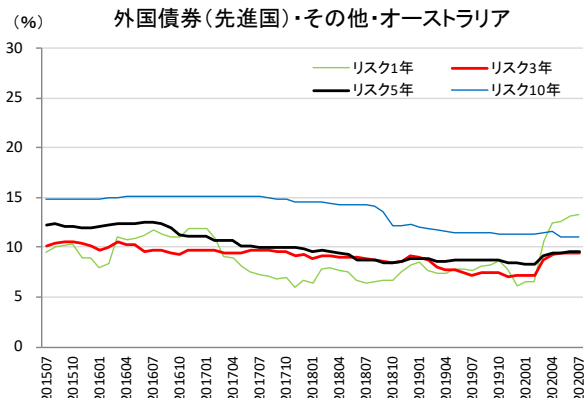
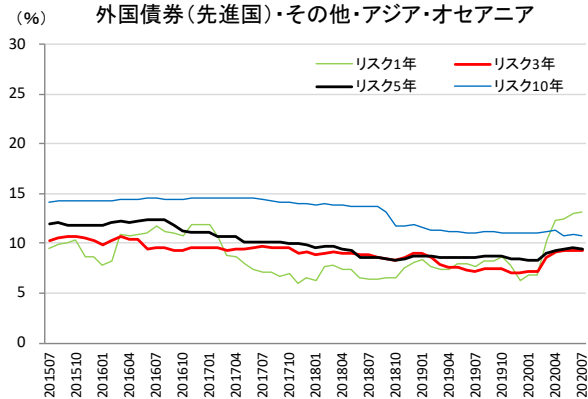
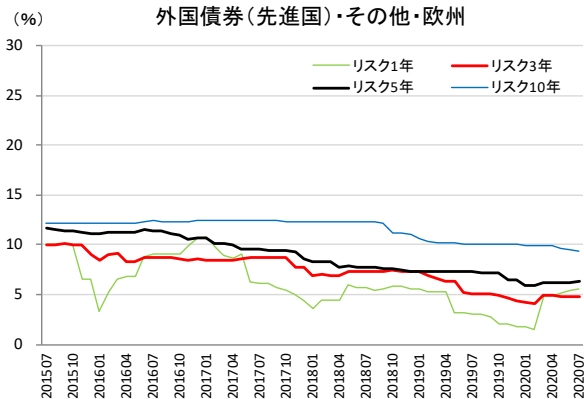
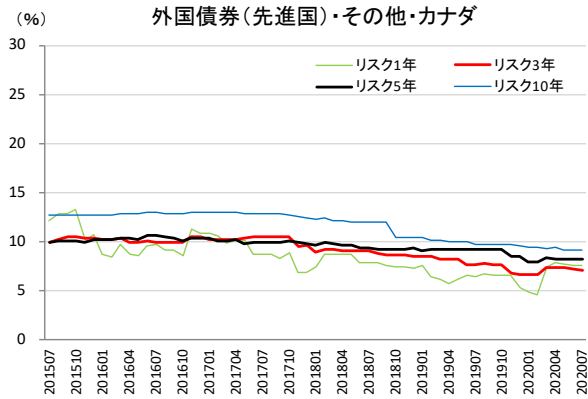
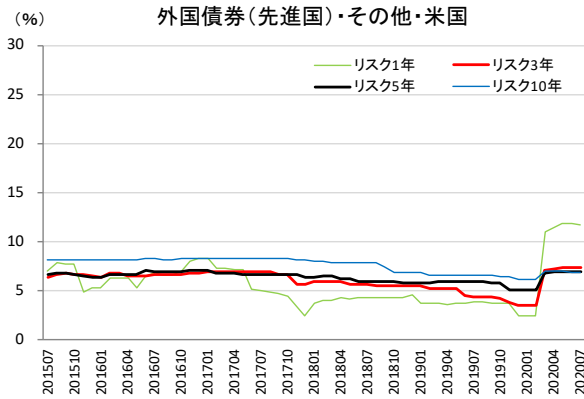
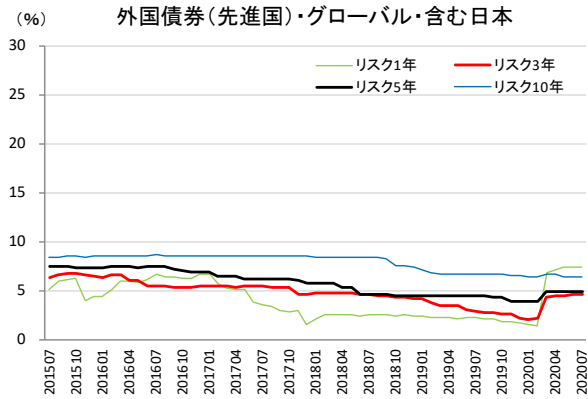
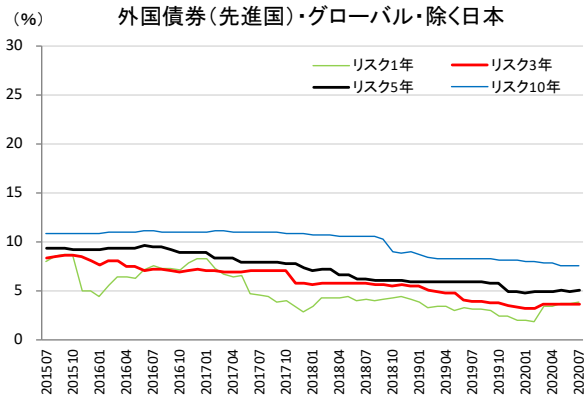


<2> リスク・サマリー

(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)]

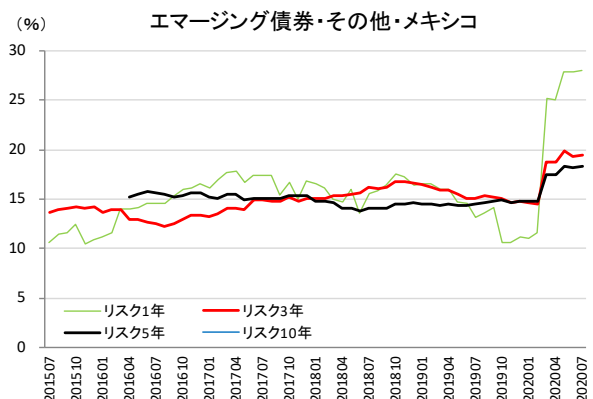
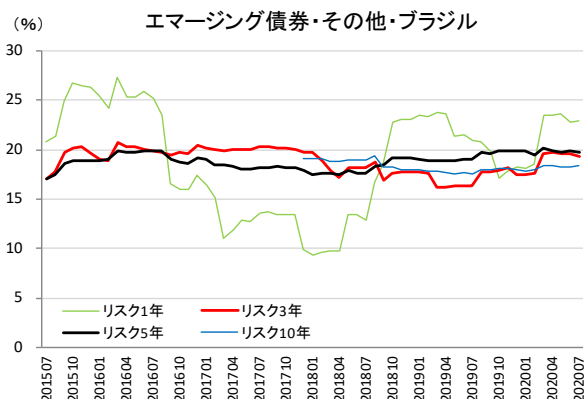
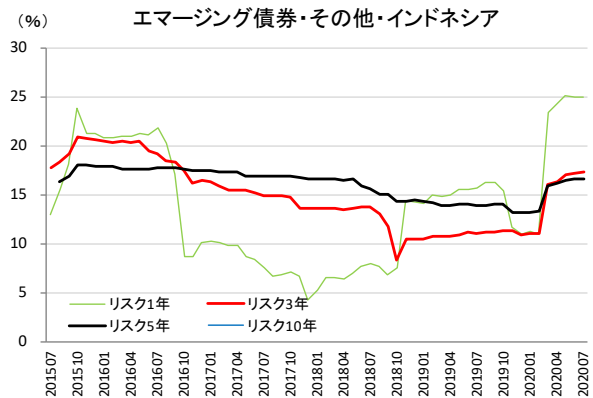
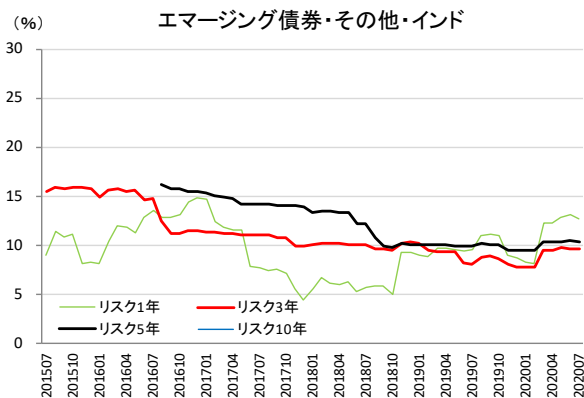
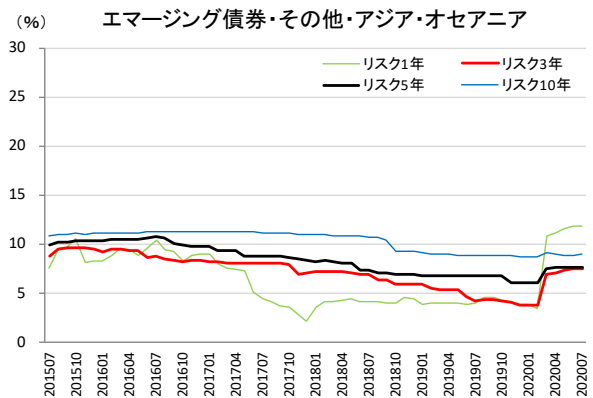
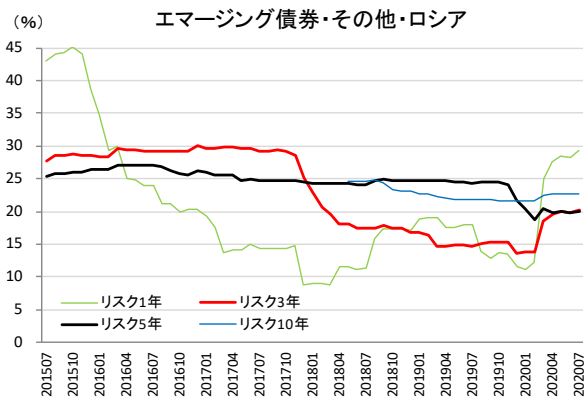
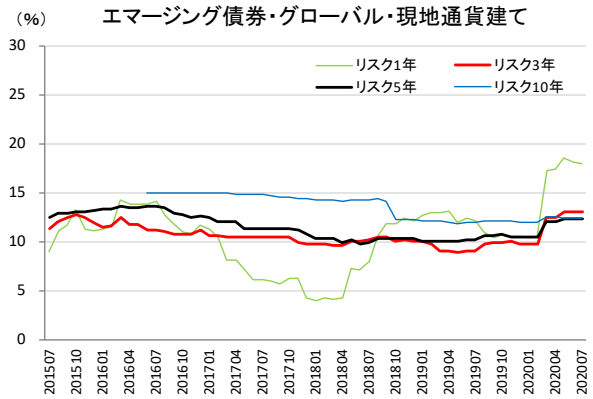
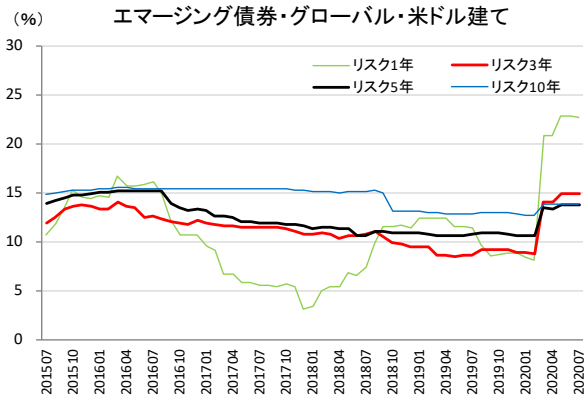


<2> リスク・サマリー

(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]

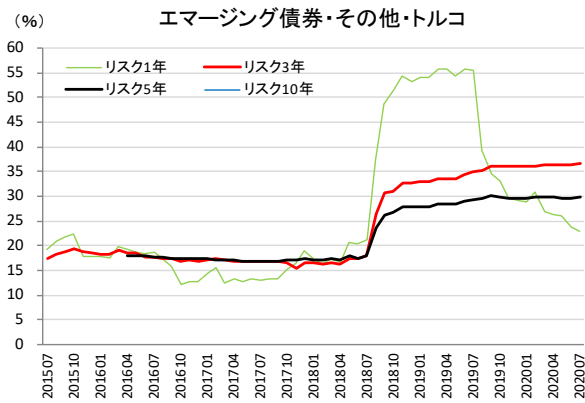


＜2＞リスク・サマリー

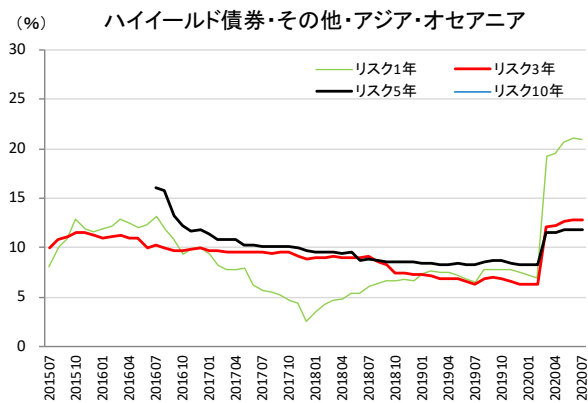
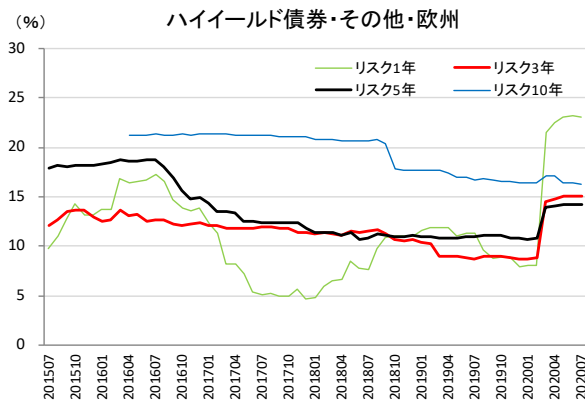
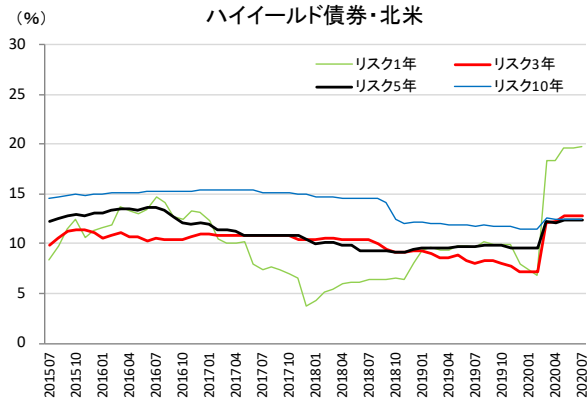
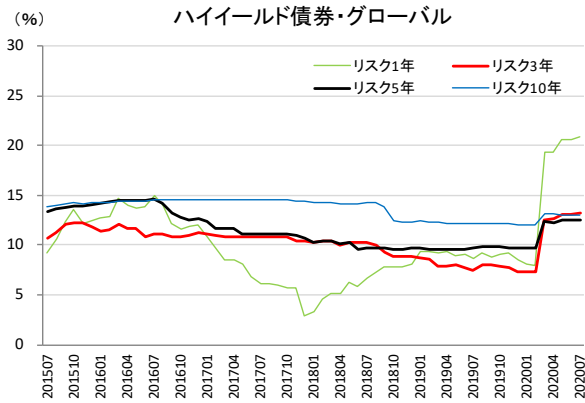
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

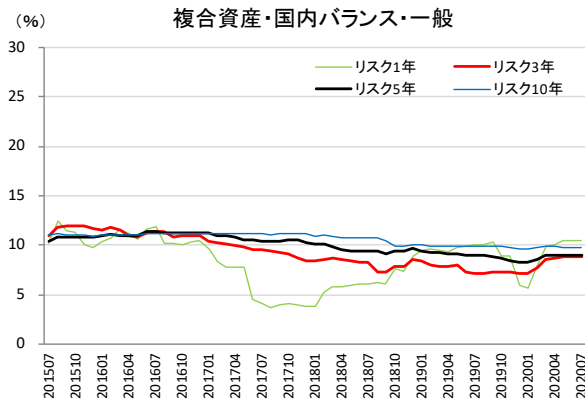
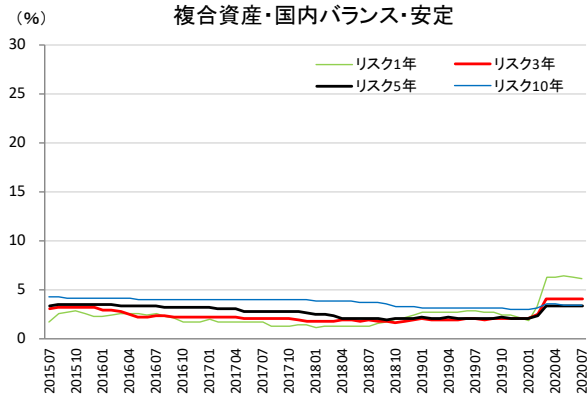
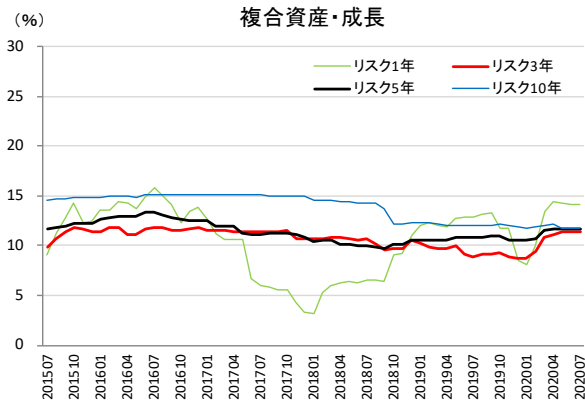
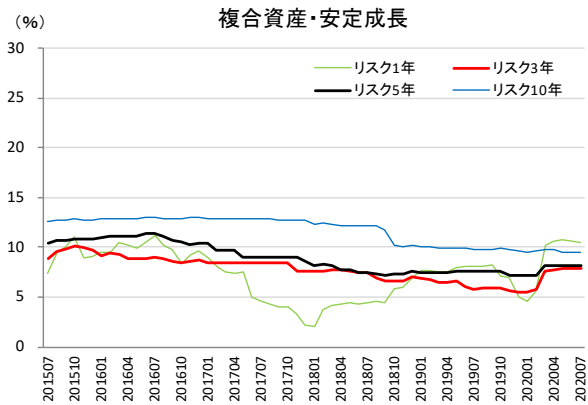
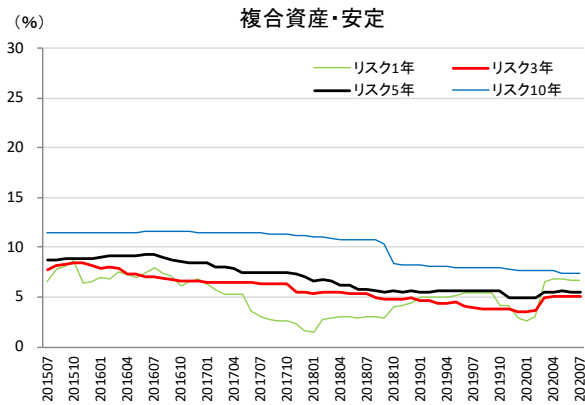


＜2＞リスク・サマリー

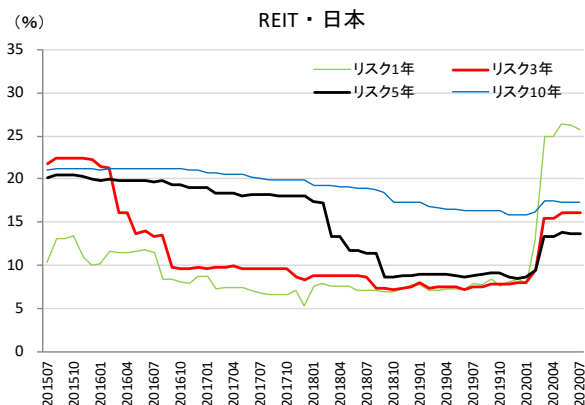
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

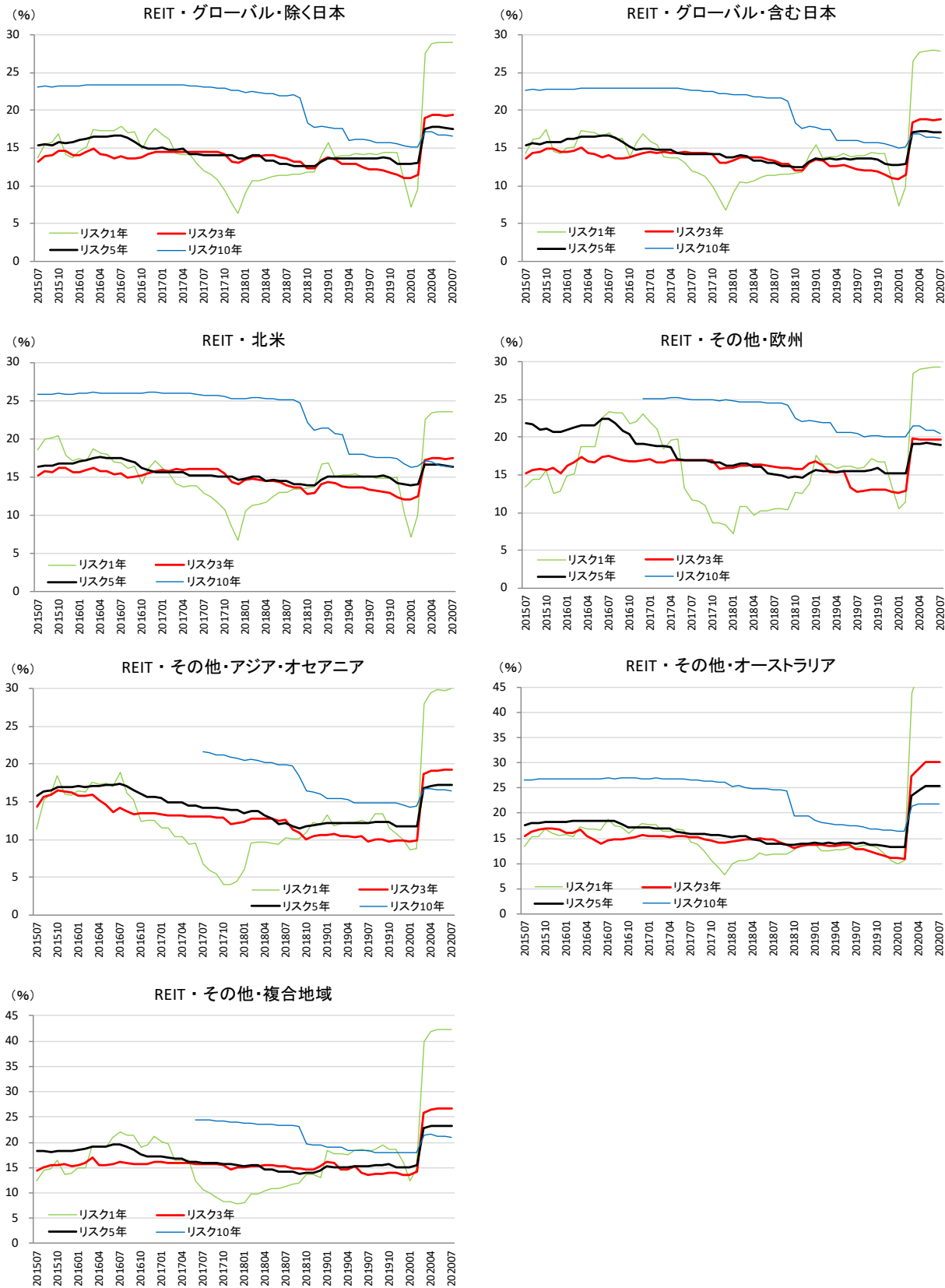


＜2＞リスク・サマリー

(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]

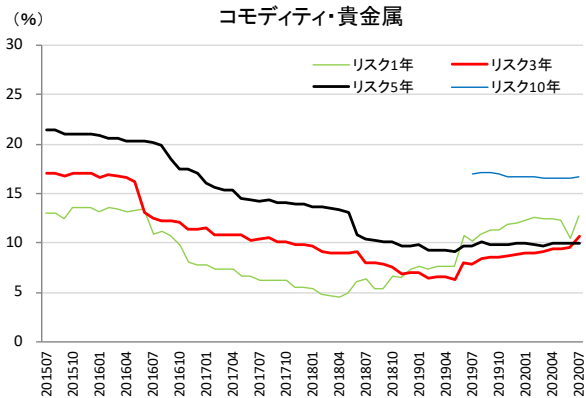
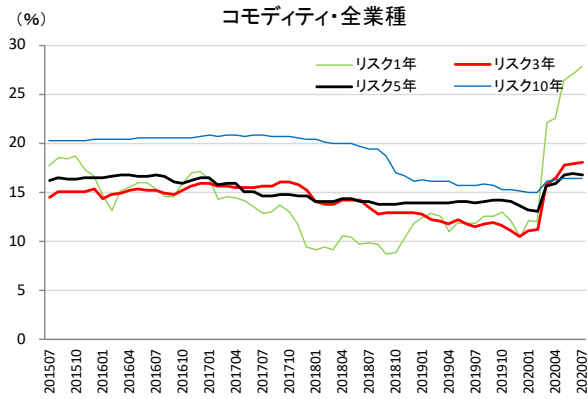
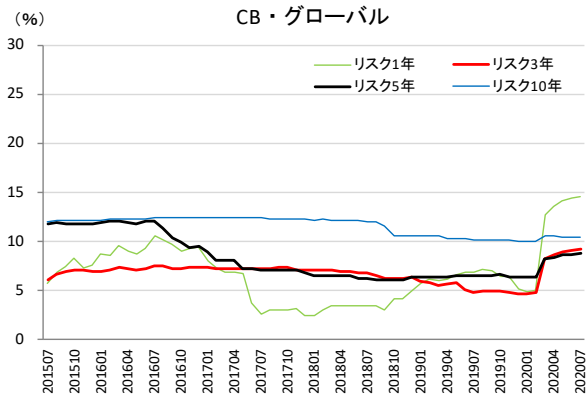
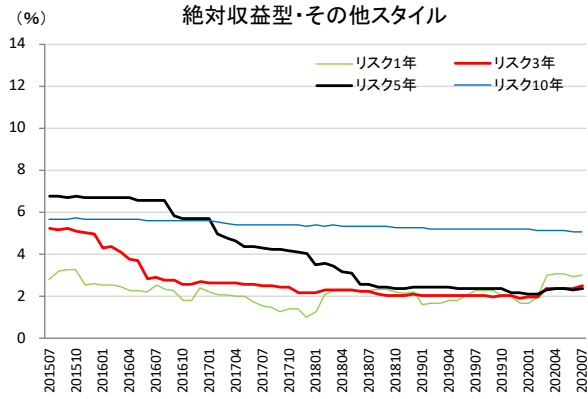
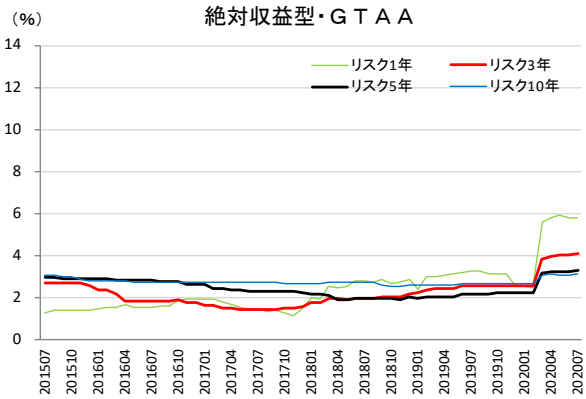
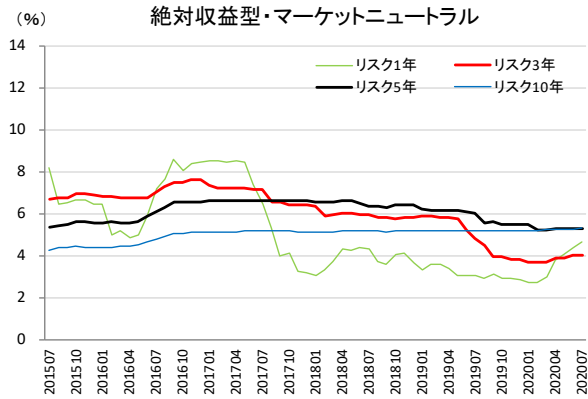
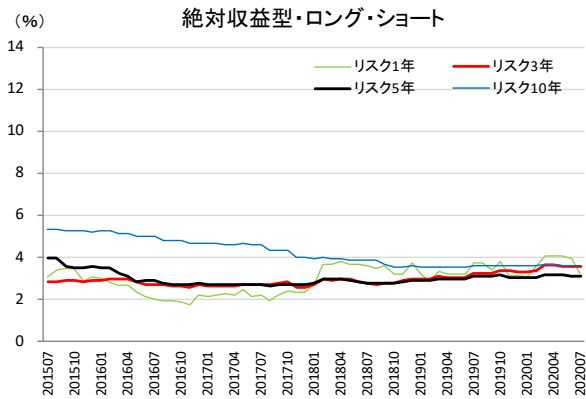


<2> リスク・サマリー

(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	5,098	5,531	12,453	13,349
国内株式	-1,533	-4,796	-4,097	-15,419
一般	-923	-2,250	-2,995	-9,246
フリー	-881	-2,171	-2,749	-8,481
バリュー	-43	-79	-247	-765
小型	-275	-1,002	-1,278	-3,058
その他	-335	-1,534	191	-3,039
日経225	-331	-1,603	319	-2,603
TOPIX	-29	49	-281	-251
JPX日経400	-4	-28	10	-160
国内債券	-141	-72	-207	605
一般	-141	-72	-207	605
外国株式(先進国)	6,388	7,594	15,739	19,401
グローバル	5,070	4,400	8,304	7,439
除く日本	515	1,243	2,323	4,505
含む日本	4,554	3,157	5,980	2,935
その他	1,319	3,194	7,435	11,961
北米	-9	-43	-48	-26
米国	1,360	3,239	7,450	12,000
カナダ	-3	-10	-22	-79
欧州	-10	-41	-74	-277
ドイツ	0	-1	0	-3
イギリス	0	-1	-3	-6
アジア・オセアニア	-4	-6	-6	-22
オーストラリア	-15	57	139	376
ニュージーランド	0	0	-1	-2
複合地域	0	0	0	-1
エマージング株式	-286	-472	-1,583	-5,107
グローバル	-136	-248	-264	-1,241
BRICS	-2	-3	-15	-69
その他	-147	-221	-1,305	-3,797
欧州	0	-1	-4	-28
ロシア	1	2	3	-7
アジア・オセアニア	-28	41	-89	-730
中国	-26	-159	-432	-1,038
インド	-71	-89	-733	-2,030
インドネシア	0	0	-4	-20
タイ	0	-1	-3	-11
フィリピン	-1	-2	-5	-18
ベトナム	-25	-44	-58	51
韓国	0	0	0	-1
香港	0	0	2	3
台湾	0	0	0	0
中南米	-1	-1	-3	-11
ブラジル	7	41	43	75
メキシコ	0	0	0	-3
中東・アフリカ	-1	-6	-15	-12
トルコ	-1	-2	-6	-14
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	5,098	5,531	12,453	13,349
外国債券(先進国)	-28	-965	-3,375	-5,095
グローバル	176	-566	-2,242	-3,481
除く日本	-162	-401	-1,467	-2,325
含む日本	338	-166	-774	-1,156
その他	-204	-399	-1,133	-1,614
北米	-4	-9	-12	-17
米国	-19	16	-133	203
カナダ	-15	-33	-74	-253
欧州	-11	-27	-185	178
イギリス	0	-1	-2	-6
アジア・オセアニア	-23	-60	-127	-369
オーストラリア	-115	-261	-512	-1,157
ニュージーランド	-3	-6	-15	-30
複合地域	-14	-36	-105	-196
エマージング債券	-246	-601	-1,449	-2,449
グローバル	-75	-179	-466	-555
米ドル建て	-65	-172	-438	-533
現地通貨建て	-10	-6	-27	-22
その他	-171	-423	-983	-1,893
ロシア	-3	-15	-20	-82
アジア・オセアニア	-5	-9	-20	-43
インド	-99	-206	-453	-771
インドネシア	-7	-19	-51	-125
ブラジル	-39	-98	-185	-273
メキシコ	-9	-21	-45	-151
トルコ	-2	-3	-12	-38
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイイールド債券	-119	-1	-433	-1,537
グローバル	-25	-40	-110	-206
北米	-51	149	-81	-841
その他	-43	-109	-243	-490
欧州	-35	-95	-201	-393
アジア・オセアニア	-6	-11	-33	-70
複合地域	0	0	-1	-3
複合資産	343	1,613	2,880	15,217
安定	335	788	307	2,664
安定成長	132	506	896	3,572
成長	47	332	557	871
国内バランス	-25	28	61	2,107
安定	-20	44	90	2,244
一般	-3	-12	-23	-95
その他	-147	-42	1,060	6,003

<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	5,098	5,531	12,453	13,349
国内REIT	157	1,095	1,735	2,078
日本	157	1,095	1,735	2,078
外国REIT	186	1,158	1,720	4,155
グローバル	105	602	893	1,917
除く日本	73	152	610	1,024
含む日本	32	450	283	892
北米	146	655	971	2,236
その他	-65	-99	-143	2
欧州	0	-1	-6	-39
アジア・オセアニア	-60	-101	-127	24
オーストラリア	-3	2	-2	49
複合地域	0	3	5	4
複数国	-1	-2	-13	-36
その他	376	979	1,522	1,500
絶対収益型	110	189	263	758
ロング・ショート	-10	-42	113	3
マーケットニュートラル	-16	-38	-181	-242
GTAA	-4	-8	-8	-36
その他スタイル	139	244	307	1,001
CB	178	625	571	330
アジア・オセアニア	-1	-1	-2	-8
日本	-1	-4	-9	-17
グローバル	180	630	582	355
コモディティ	99	293	470	572
全業種	29	49	131	138
貴金属	109	248	196	288
エネルギー	-39	-5	141	142
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	626,770	100.00	5,375	100.00
国内株式	87,351	13.94	881	16.39
一般	51,313	8.19	574	10.68
フリー	40,926	6.53	457	8.50
バリュー	10,387	1.66	117	2.18
小型	7,357	1.17	96	1.79
その他	28,039	4.47	204	3.80
日経225	14,222	2.27	69	1.28
TOPIX	11,681	1.86	75	1.40
JPX日経400	647	0.10	20	0.37
国内債券	33,906	5.41	135	2.51
一般	33,906	5.41	135	2.51
外国株式(先進国)	180,499	28.80	1,013	18.85
グローバル	135,829	21.67	667	12.41
除く日本	30,138	4.81	181	3.37
含む日本	105,691	16.86	486	9.04
その他	44,670	7.13	346	6.44
北米	310	0.05	10	0.19
米国	38,002	6.06	236	4.39
カナダ	235	0.04	3	0.06
欧州	1,388	0.22	52	0.97
ドイツ	24	0.00	1	0.02
イギリス	11	0.00	2	0.04
アジア・オセアニア	72	0.01	8	0.15
オーストラリア	4,611	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	25,295	4.04	346	6.44
グローバル	7,374	1.18	101	1.88
BRICS	591	0.09	7	0.13
その他	17,330	2.76	238	4.43
欧州	165	0.03	7	0.13
ロシア	106	0.02	4	0.07
アジア・オセアニア	5,499	0.88	105	1.95
中国	1,810	0.29	31	0.58
インド	7,632	1.22	30	0.56
インドネシア	132	0.02	5	0.09
タイ	64	0.01	4	0.07
フィリピン	53	0.01	5	0.09
ベトナム	898	0.14	10	0.19
韓国	4	0.00	1	0.02
香港	11	0.00	1	0.02
台湾	2	0.00	1	0.02
中南米	56	0.01	2	0.04
ブラジル	691	0.11	16	0.30
メキシコ	13	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	122	0.02	8	0.15
トルコ	55	0.01	4	0.07
複合地域	19	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	626,770	100.00	5,375	100.00
外国債券(先進国)	80,595	12.86	804	14.96
グローバル	59,606	9.51	518	9.64
除く日本	31,860	5.08	227	4.22
含む日本	27,745	4.43	291	5.41
その他	20,989	3.35	286	5.32
北米	82	0.01	6	0.11
米国	5,875	0.94	153	2.85
カナダ	1,140	0.18	6	0.11
欧州	1,611	0.26	37	0.69
イギリス	27	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	2,158	0.34	12	0.22
オーストラリア	8,447	1.35	40	0.74
ニュージーランド	151	0.02	14	0.26
複合地域	1,464	0.23	9	0.17
エマージング債券	15,230	2.43	291	5.41
グローバル	7,664	1.22	194	3.61
米ドル建て	5,936	0.95	152	2.83
現地通貨建て	1,728	0.28	42	0.78
その他	7,566	1.21	97	1.80
ロシア	154	0.02	5	0.09
アジア・オセアニア	419	0.07	13	0.24
インド	3,518	0.56	21	0.39
インドネシア	447	0.07	11	0.20
ブラジル	2,220	0.35	24	0.45
メキシコ	409	0.07	9	0.17
トルコ	117	0.02	5	0.09
複合地域	44	0.01	1	0.02
ハイイールド債券	18,738	2.99	307	5.71
グローバル	2,963	0.47	58	1.08
北米	12,552	2.00	161	3.00
その他	3,222	0.51	88	1.64
欧州	2,498	0.40	48	0.89
アジア・オセアニア	631	0.10	30	0.56
複合地域	44	0.01	1	0.02
複合資産	105,860	16.89	978	18.20
安定	28,689	4.58	286	5.32
安定成長	46,099	7.36	403	7.50
成長	13,343	2.13	244	4.54
国内バランス	10,245	1.63	32	0.60
安定	9,763	1.56	8	0.15
一般	396	0.06	19	0.35
その他	7,485	1.19	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	626,770	100.00		5,375	100.00
国内REIT	24,627	3.93		123	2.29
日本	24,627	3.93		123	2.29
外国REIT	40,283	6.43		284	5.28
グローバル	15,895	2.54		135	2.51
除く日本	3,771	0.60		50	0.93
含む日本	12,124	1.93		85	1.58
北米	20,464	3.26		81	1.51
その他	3,924	0.63		68	1.27
欧州	199	0.03		17	0.32
アジア・オセアニア	2,813	0.45		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	242	0.04		1	0.02
その他	14,385	2.30		213	3.96
絶対収益型	7,900	1.26		101	1.88
ロング・ショート	961	0.15		34	0.63
マーケットニュートラル	971	0.15		15	0.28
GTAA	404	0.06		14	0.26
その他スタイル	5,531	0.88		37	0.69
CB	1,898	0.30		43	0.80
アジア・オセアニア	32	0.01		1	0.02
日本	50	0.01		3	0.06
グローバル	1,815	0.29		39	0.73
コモディティ	2,674	0.43		28	0.52
全業種	840	0.13		14	0.26
貴金属	1,625	0.26		12	0.22
エネルギー	199	0.03		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	11,251	8.6	3.37	4.04	1.278
国内株式	13,570	11.6	0.99	1.17	1.148
一般	12,417	11.3	1.18	1.49	1.423
フリー	12,335	10.8	1.29	1.65	1.467
バリュー	12,734	13.4	0.76	0.84	1.250
小型	19,568	11.9	1.50	1.41	1.733
その他	14,060	12.2	0.51	0.53	0.479
日経225	15,193	13.5	0.53	0.53	0.570
TOPIX	14,501	13.8	0.35	0.37	0.319
JPX日経400	12,562	6.0	0.18	0.18	0.544
国内債券	10,990	10.8	0.31	0.32	0.356
一般	10,990	10.8	0.31	0.32	0.356
外国株式(先進国)	12,607	6.8	3.96	4.41	1.565
グローバル	13,271	7.0	3.14	3.50	1.557
除く日本	15,601	9.2	0.65	0.74	0.726
含む日本	12,404	6.2	3.89	4.33	1.793
その他	11,326	6.4	6.65	7.37	1.592
北米	11,478	7.1	6.04	6.33	1.896
米国	12,183	5.9	5.71	5.47	1.556
カナダ	6,350	8.4	11.41	14.49	1.992
欧州	11,046	9.0	2.90	3.27	1.657
ドイツ	10,329	6.3	0.00	0.00	0.770
イギリス	4,287	6.2	15.18	22.38	1.948
アジア・オセアニア	8,036	6.3	4.68	5.20	1.694
オーストラリア	7,282	6.0	14.43	22.07	1.826
ニュージーランド	14,357	8.0	2.82	2.79	1.672
複合地域	4,701	7.3	0.00	0.00	1.705
エマージング株式	11,580	9.2	2.74	3.50	1.778
グローバル	10,684	7.1	1.46	1.75	1.390
BRICS	13,556	14.2	1.08	1.15	2.068
その他	11,902	10.0	3.35	4.33	1.933
欧州	8,008	14.2	0.12	0.15	1.971
ロシア	9,476	11.2	2.06	2.30	2.011
アジア・オセアニア	12,544	10.1	6.69	7.86	1.741
中国	21,081	9.6	1.78	1.47	1.951
インド	10,191	10.2	1.39	1.63	2.074
インドネシア	7,934	10.1	0.31	0.42	1.856
タイ	8,627	12.2	0.68	0.91	1.698
フィリピン	8,032	7.0	0.48	0.72	1.791
ベトナム	9,108	4.5	0.71	0.96	1.874
韓国	11,285	1.6	0.00	0.00	1.804
香港	13,558	10.9	1.95	2.29	0.858
台湾	11,835	7.7	0.00	0.00	1.661
中南米	6,381	13.5	0.00	0.00	2.041
ブラジル	4,644	10.3	10.05	23.01	1.934
メキシコ	5,740	7.4	0.00	0.00	1.927
中東・アフリカ	8,230	9.6	0.80	0.83	2.059
トルコ	5,302	14.0	0.00	0.00	2.034
複合地域	17,303	12.2	2.95	3.18	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	11,251	8.6	3.37	4.04	1.278
外国債券(先進国)	9,920	8.5	2.44	2.60	1.104
グローバル	10,562	8.8	1.76	1.83	1.038
除く日本	11,464	11.0	1.66	1.69	0.812
含む日本	9,859	7.0	1.88	1.99	1.299
その他	8,758	8.0	4.36	4.77	1.290
北米	10,260	6.3	2.11	2.26	1.800
米国	9,335	6.9	4.89	5.94	1.357
カナダ	7,666	8.1	3.64	3.82	1.370
欧州	8,475	10.2	1.24	1.29	1.050
イギリス	7,794	5.6	3.51	3.44	1.260
アジア・オセアニア	7,770	9.8	3.10	3.16	1.420
オーストラリア	7,812	11.2	5.27	5.51	1.261
ニュージーランド	9,385	5.8	2.15	2.16	1.346
複合地域	5,028	10.7	3.17	3.20	1.191
エマージング債券	8,180	8.9	5.99	7.36	1.591
グローバル	8,506	9.6	5.19	6.45	1.558
米ドル建て	8,614	9.8	5.26	6.64	1.616
現地通貨建て	8,117	8.6	4.93	5.81	1.360
その他	7,528	7.5	6.79	8.27	1.623
ロシア	7,710	7.4	5.95	7.12	1.607
アジア・オセアニア	8,701	7.8	10.59	12.11	1.639
インド	8,739	5.6	6.91	7.86	1.701
インドネシア	6,791	8.0	6.94	7.67	1.665
ブラジル	7,056	10.6	6.55	9.36	1.589
メキシコ	6,009	7.6	5.83	6.52	1.397
トルコ	3,050	7.4	8.81	10.32	1.453
複合地域	3,728	13.9	4.05	4.56	1.210
ハイイールド債券	7,988	9.0	8.13	9.81	1.692
グローバル	7,071	8.5	6.34	7.61	1.581
北米	8,798	10.2	8.10	9.63	1.698
その他	7,111	7.2	9.84	12.54	1.769
欧州	6,548	7.3	10.30	13.31	1.746
アジア・オセアニア	7,580	8.3	8.96	10.81	1.878
複合地域	4,344	16.3	5.34	5.52	1.800
複合資産	11,501	8.2	1.54	1.68	1.040
安定	10,986	7.8	0.98	1.02	1.123
安定成長	11,206	8.6	2.06	2.26	1.086
成長	12,754	8.2	0.47	0.59	0.903
国内バランス	10,579	8.6	2.13	2.33	0.940
安定	10,555	10.1	2.17	2.37	0.920
一般	10,894	9.2	1.13	1.21	1.354
その他	10,764	0.8	1.60	1.69	0.819

(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	11,251	8.6	3.37	4.04	1.278
国内REIT	11,741	8.6	8.85	11.95	0.953
日本	11,741	8.6	8.85	11.95	0.953
外国REIT	9,251	7.5	10.09	13.67	1.553
グローバル	9,922	8.0	7.64	10.98	1.398
除く日本	11,292	6.5	6.09	9.99	1.075
含む日本	9,116	8.9	8.13	11.30	1.499
北米	8,559	7.6	12.38	16.29	1.629
その他	8,745	6.3	7.89	10.77	1.786
欧州	7,638	5.9	5.59	7.18	1.807
アジア・オセアニア	10,278	6.2	9.39	12.83	1.826
オーストラリア	7,129	5.6	4.41	6.28	1.712
複合地域	4,831	8.5	1.31	1.69	0.835
複数国	8,200	16.3	2.54	2.93	1.650
その他					
絶対収益型	10,170	5.4	0.09	0.09	1.674
ロング・ショート	10,342	4.8	0.56	0.58	1.482
マーケットニュートラル	10,613	5.0	0.08	0.08	1.234
GTAA	10,699	6.4	0.11	0.11	1.545
その他スタイル	9,624	5.9	0.01	0.01	1.796
CB	10,985	6.7	3.18	3.10	1.334
アジア・オセアニア	7,889	10.1	2.92	3.04	1.823
日本	10,609	9.2	0.22	0.23	1.007
グローバル	11,094	6.4	3.31	3.23	1.334
コモディティ	8,599	6.8	0.00	0.00	0.944
全業種	4,821	8.9	0.00	0.00	1.438
貴金属	13,164	4.2	0.00	0.00	0.676
エネルギー	6,188	11.4	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	9,108	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