

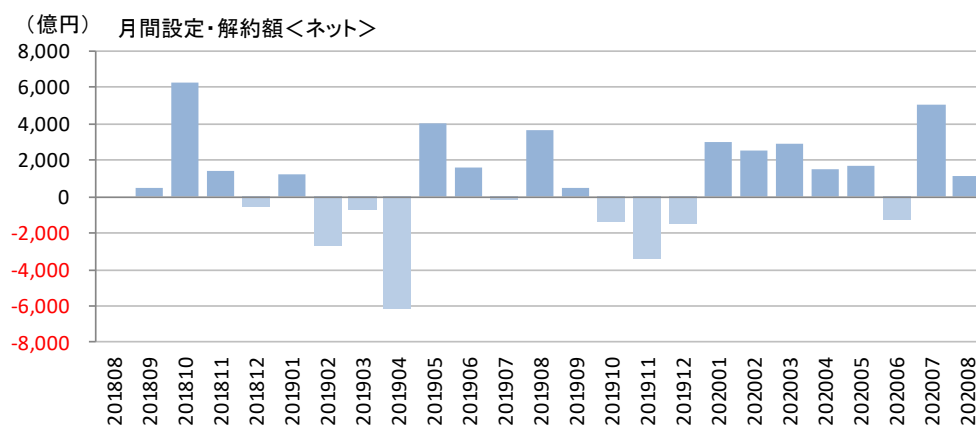
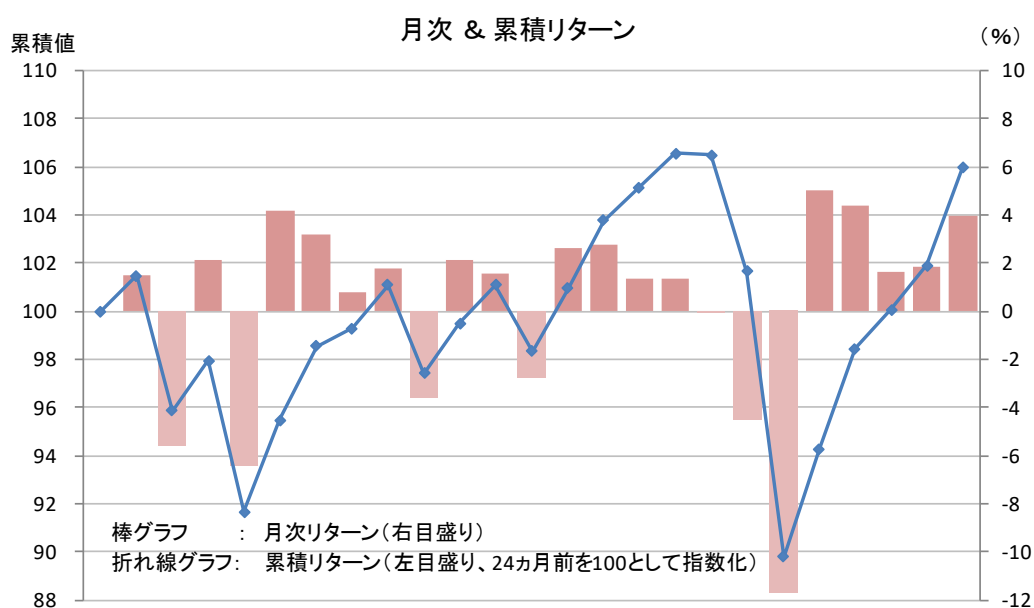
投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2020年8月

「総合」 +3.99 %

(前月 +1.83 %)



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		13,535	13,016	519	3.99	
国内株式		16,154	15,107	1,048	6.93	
一般		15,716	14,778	938	6.35	
フリー		15,003	14,159	843	5.96	
バリュー		19,100	17,707	1,394	7.87	
小型		36,106	33,160	2,945	8.88	
その他		15,703	14,602	1,101	7.54	
日経225		15,304	14,364	940	6.55	
TOPIX		15,266	14,117	1,149	8.14	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	14,520	13,420	1,100	8.19	
国内債券		13,185	13,241	-56	-0.42	
一般		13,185	13,241	-56	-0.42	
外国株式(先進国)		17,057	15,990	1,066	6.67	
グローバル		18,932	17,822	1,110	6.23	
除く日本		24,728	23,043	1,685	7.31	
含む日本		17,607	16,623	984	5.92	
その他		13,183	12,207	976	7.99	
北米		11,952	11,333	619	5.47	
米国		20,613	18,966	1,647	8.68	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	15,863	15,213	650	4.27	
欧州		18,530	17,852	677	3.79	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	9,070	8,530	540	6.33	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	7,285	7,167	118	1.65	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	33,602	31,945	1,657	5.19	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	13,592	13,072	519	3.97	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	38,102	36,333	1,769	4.87	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	5,369	5,132	237	4.62	
エマージング株式		14,555	13,766	789	5.73	
グローバル		15,440	14,687	752	5.12	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	22,749	21,887	862	3.94	
その他		14,677	13,840	837	6.05	
欧州		22,250	21,880	369	1.69	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	9,728	9,453	275	2.91	
アジア・オセアニア		15,904	15,221	683	4.48	
中国		45,329	42,777	2,552	5.97	
インド	10,000 (2004.09.30)	29,526	27,272	2,254	8.27	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	10,974	10,444	530	5.07	
タイ		18,225	17,857	368	2.06	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	6,115	6,007	108	1.80	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	12,449	11,341	1,108	9.77	
韓国	10,000 (1997.06.30)	26,924	25,088	1,836	7.32	
香港		21,138	20,369	769	3.77	
台湾	10,000 (2008.03.31)	18,314	18,180	134	0.74	
中南米	7,427 (2006.04.28)	6,514	6,797	-283	-4.17	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	6,918	7,352	-434	-5.91	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	6,823	6,582	241	3.66	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	8,339	7,975	364	4.56	
トルコ		16,920	17,972	-1,052	-5.85	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	20,440	19,683	757	3.85	

※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		13,535	13,016	519	3.99	
外国債券(先進国)		18,236	18,141	95	0.52	
グローバル		18,591	18,577	15	0.08	
除く日本		20,133	20,102	30	0.15	
含む日本		17,620	17,621	-1	-0.00	
その他		17,244	16,940	304	1.79	
北米	9,052 (2013.05.31)	10,742	10,712	29	0.28	
米国		15,430	15,334	96	0.63	
カナダ	10,000 (2003.05.30)	14,203	13,819	384	2.78	
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,464	15,405	58	0.38	
イギリス	10,069 (2014.07.31)	9,744	9,564	180	1.88	
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	19,290	18,774	516	2.75	
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	23,708	23,100	608	2.63	
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,414	11,136	279	2.50	
複合地域	10,000 (2001.11.30)	18,066	17,857	209	1.17	
エマージング債券		15,985	15,947	38	0.24	
グローバル		17,422	17,332	89	0.52	
米ドル建て		18,012	17,897	115	0.64	
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,023	12,015	8	0.07	
その他	8,647 (2005.03.31)	11,654	11,658	-4	-0.04	
ロシア	10,000 (2008.05.30)	9,999	10,003	-3	-0.03	
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	14,437	14,264	173	1.21	
インド	10,000 (2011.08.31)	15,884	15,499	385	2.48	
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	13,116	13,021	95	0.73	
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	9,908	10,379	-471	-4.54	
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	11,358	11,221	136	1.22	
トルコ	10,000 (2011.04.28)	4,891	5,221	-331	-6.33	
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,164	10,056	108	1.07	
ハイイールド債券		20,581	20,272	309	1.52	
グローバル	10,000 (1997.06.30)	20,849	20,645	205	0.99	
北米		19,966	19,650	315	1.61	
その他	10,000 (2004.03.31)	20,744	20,398	346	1.70	
欧州	10,000 (2006.04.28)	20,695	20,357	338	1.66	
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	13,673	13,424	249	1.85	
複合地域	10,000 (2004.03.31)	19,768	19,450	318	1.63	
複合資産		17,328	16,961	367	2.16	
安定	10,000 (1998.10.30)	15,599	15,429	169	1.10	
安定成長		18,598	18,160	437	2.41	
成長		20,959	20,025	935	4.67	
国内バランス		12,473	12,433	40	0.32	
安定		12,762	12,747	15	0.12	
一般		14,302	13,721	580	4.23	
その他	10,000 (2018.10.31)	12,698	12,350	348	2.82	

※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		13,535	13,016	519	3.99	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	29,603	28,219	1,384	4.90	
日本	10,000 (2003.10.31)	29,603	28,219	1,384	4.90	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	23,361	22,807	554	2.43	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	19,857	19,280	577	2.99	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	21,700	20,992	708	3.37	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	19,864	19,308	556	2.88	
北米	10,000 (2003.09.30)	23,621	23,209	412	1.78	
その他	10,000 (2004.04.30)	24,280	23,443	837	3.57	
欧州	10,000 (2006.12.29)	4,966	4,745	220	4.65	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	18,456	17,978	478	2.66	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	12,415	11,537	878	7.61	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	5,163	5,034	129	2.56	
複数国	10,000 (2004.04.30)	31,907	31,043	864	2.78	
その他		6,135	5,998	137	2.29	
絶対収益型		7,784	7,763	21	0.27	
ロング・ショート		8,761	8,749	12	0.14	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	12,380	12,423	-44	-0.35	
GTAA		10,982	10,825	156	1.44	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,265	7,243	23	0.31	
CB		19,534	19,077	458	2.40	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	16,076	15,157	919	6.07	
日本		19,732	19,389	343	1.77	
グローバル		34,337	33,549	789	2.35	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	8,778	8,556	223	2.60	
全業種	10,000 (2004.12.30)	5,540	5,233	307	5.87	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	19,203	19,129	74	0.39	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	3,432	3,205	227	7.09	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	8,800	8,246	554	6.72	

※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	7.64	4.22	7.72	-0.57
国内株式	5.31	11.74	13.03	-2.60
一般	5.33	11.14	13.09	-2.92
フリー	5.94	12.79	14.87	-1.46
バリュー	2.97	4.95	6.49	-8.39
小型	7.24	25.92	18.98	2.68
その他	4.75	9.30	11.33	-3.22
日経225	5.78	10.45	13.62	-1.23
TOPIX	3.57	8.45	9.47	-4.82
JPX日経400	3.81	8.73	10.44	-3.99
国内債券	-0.38	-2.06	-3.09	-1.03
一般	-0.38	-2.06	-3.09	-1.03
外国株式(先進国)	15.15	15.81	24.04	9.35
グローバル	15.34	15.92	25.32	9.94
除く日本	13.74	10.05	16.42	1.80
含む日本	15.83	17.70	28.11	12.48
その他	14.59	15.50	19.81	7.49
北米	10.23	8.47	9.82	-0.03
米国	15.37	20.75	26.09	12.92
カナダ	12.09	-5.58	-1.90	-9.16
欧州	10.32	1.93	10.28	-4.06
ドイツ	15.95	8.84	15.78	-1.13
イギリス	1.70	-12.61	-10.20	-20.77
アジア・オセアニア	11.30	2.77	9.33	-5.69
オーストラリア	9.95	-7.71	-8.05	-16.23
ニュージーランド	18.28	11.35	20.22	3.65
複合地域	-1.13	-25.46	-32.73	-38.69
エマージング株式	19.02	-0.51	8.92	-5.00
グローバル	18.85	6.62	17.41	-0.13
BRICS	17.15	-2.35	6.26	-10.86
その他	19.15	-3.15	5.84	-6.71
欧州	3.61	-11.52	-4.39	-20.16
ロシア	3.62	-6.92	2.44	-14.75
アジア・オセアニア	16.99	3.85	12.30	-2.09
中国	27.54	20.93	46.65	26.37
インド	23.57	-9.32	1.37	-10.42
インドネシア	14.92	-11.67	-18.85	-23.57
タイ	0.37	-4.83	-21.03	-18.84
フィリピン	6.97	-16.39	-22.78	-25.98
ベトナム	0.74	-6.44	-13.84	-13.54
韓国	25.11	37.50	48.85	29.38
香港	9.52	-6.40	1.24	-11.37
台湾	15.10	14.65	27.58	6.02
中南米	11.97	-16.90	-14.77	-29.54
ブラジル	12.97	-21.03	-22.34	-35.91
メキシコ	3.88	-23.17	-16.37	-29.73
中東・アフリカ	8.83	-5.22	-3.89	-12.17
トルコ	-5.82	-20.25	-11.45	-25.40
複合地域	15.63	3.24	8.42	-4.44

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別②

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来 (%)
総合	7.64	4.22	7.72	-0.57
外国債券(先進国)	3.41	1.22	3.75	1.59
グローバル	2.62	0.57	3.22	1.76
除く日本	2.82	1.81	4.88	3.19
含む日本	2.39	-0.84	1.33	0.12
その他	5.69	3.09	5.24	1.21
北米	3.36	0.64	2.80	2.84
米国	1.57	-4.13	-1.09	-3.73
カナダ	3.71	1.39	3.80	0.44
欧州	3.54	0.30	1.11	1.00
イギリス	6.31	0.69	9.00	0.05
アジア・オセアニア	8.67	7.86	9.09	3.40
オーストラリア	8.81	7.49	8.83	3.27
ニュージーランド	7.32	6.94	9.57	2.87
複合地域	4.63	6.02	10.53	7.26
エマージング債券	3.49	-7.45	-2.73	-9.04
グローバル	4.62	-7.12	-2.39	-8.41
米ドル建て	5.64	-7.35	-2.73	-8.27
現地通貨建て	0.82	-6.00	-0.70	-8.79
その他	2.40	-7.81	-3.14	-9.67
ロシア	-6.23	-12.21	-3.10	-16.63
アジア・オセアニア	3.15	-1.75	3.90	-0.35
インド	5.15	-2.08	4.17	-0.37
インドネシア	2.52	-5.98	2.76	-4.83
ブラジル	-0.46	-17.49	-17.39	-24.45
メキシコ	2.67	-8.98	2.36	-9.98
トルコ	-11.02	-16.04	-5.09	-19.39
複合地域	1.59	-8.86	-2.05	-11.01
ハイイールド債券	5.18	-5.27	-2.03	-7.85
グローバル	5.60	-5.63	-1.57	-7.92
北米	4.82	-5.11	-1.91	-7.60
その他	6.16	-5.49	-2.81	-8.68
欧州	6.30	-5.67	-3.65	-9.55
アジア・オセアニア	5.64	-5.62	-0.02	-6.12
複合地域	6.42	2.35	6.03	1.05
複合資産	3.79	0.49	2.39	-2.18
安定	2.52	0.10	1.40	-1.02
安定成長	4.11	0.82	3.19	-2.09
成長	6.11	5.09	8.14	-1.32
国内バランス	-0.02	-5.08	-5.36	-6.95
安定	-0.17	-5.42	-5.87	-7.12
一般	3.18	2.91	4.57	-2.51
その他	8.00	-0.53	3.15	-2.31

※[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ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	7.64	4.22	7.72	-0.57
国内REIT	4.27	-11.67	-12.58	-16.12
日本	4.27	-11.67	-12.58	-16.12
外国REIT	5.84	-12.01	-11.26	-15.23
グローバル	5.92	-14.08	-12.38	-17.64
除く日本	6.81	-13.56	-11.23	-16.99
含む日本	5.64	-14.25	-12.72	-17.84
北米	5.08	-10.41	-10.82	-13.62
その他	9.40	-11.81	-9.09	-13.73
欧州	7.78	-13.90	-5.20	-18.16
アジア・オセアニア	9.79	-10.40	-7.70	-11.57
オーストラリア	10.18	-17.44	-15.82	-20.70
複合地域	5.34	-24.11	-22.17	-31.79
複数国	4.58	-10.01	-9.47	-13.28
その他	6.02	4.56	7.28	2.20
絶対収益型	1.82	0.52	-0.52	-0.06
ロング・ショート	0.71	-1.69	-4.45	-2.78
マーケットニュートラル	3.09	5.36	4.51	4.16
GTAA	2.90	0.97	1.93	1.10
その他スタイル	1.70	0.00	-0.91	-0.42
CB	8.21	4.25	7.19	2.67
アジア・オセアニア	11.71	2.16	12.13	3.08
日本	1.08	2.70	1.21	-2.62
グローバル	8.41	4.32	7.29	2.86
コモディティ	14.53	8.47	11.97	8.33
全業種	15.11	-7.22	-8.72	-16.62
貴金属	13.29	17.41	25.20	27.28
エネルギー	18.87	-16.34	-22.21	-31.13
その他コモディティ	14.57	-3.64	-8.57	-16.29

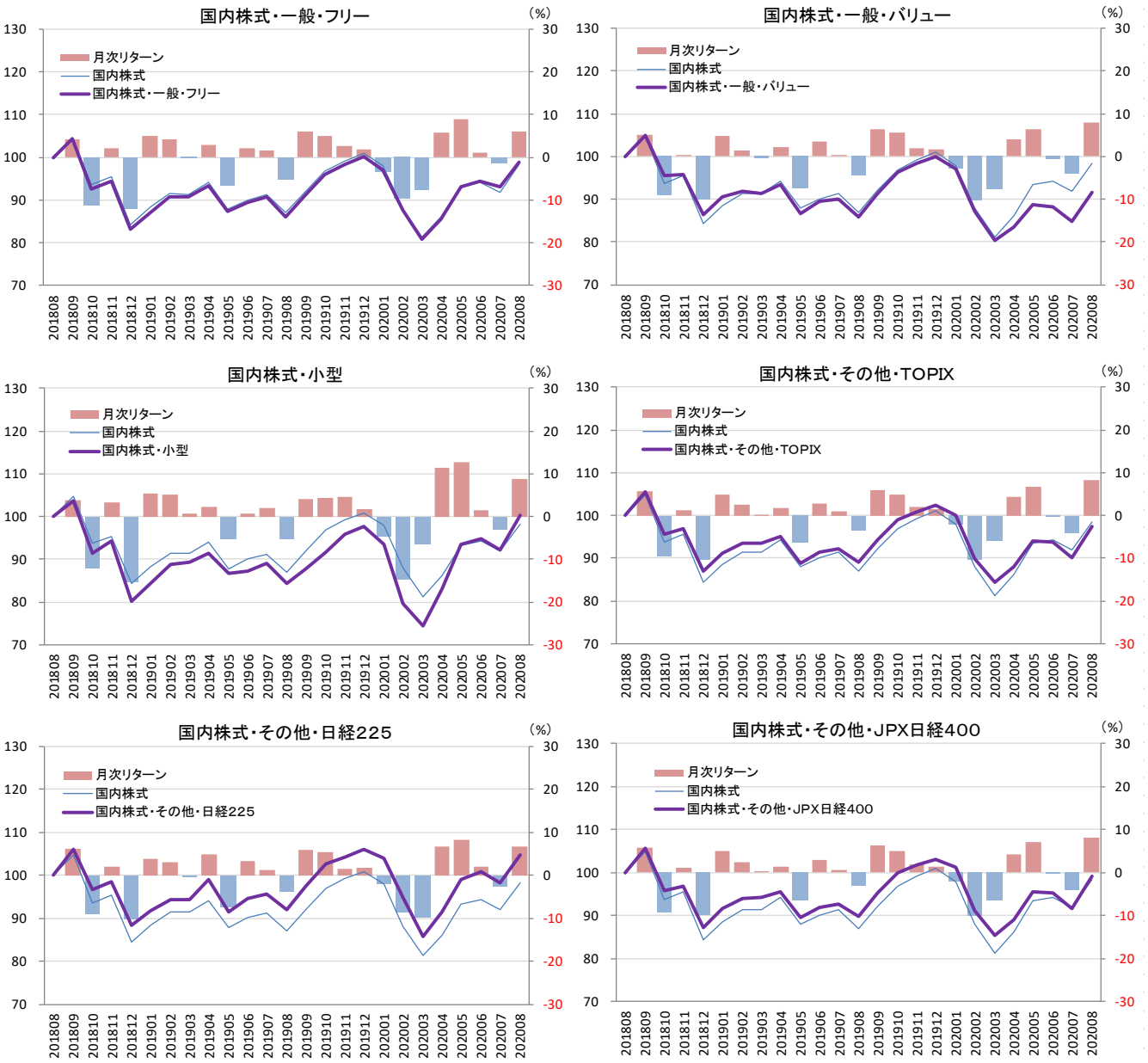
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

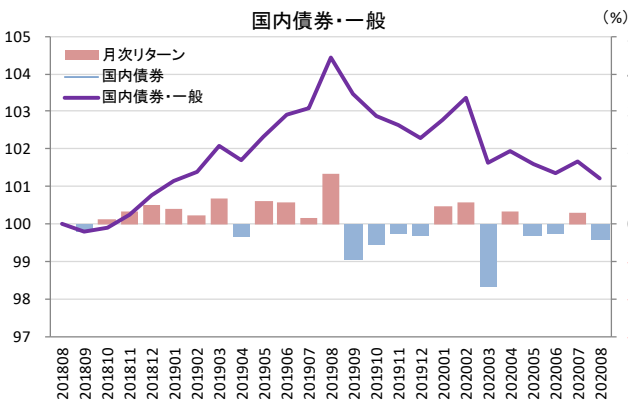
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

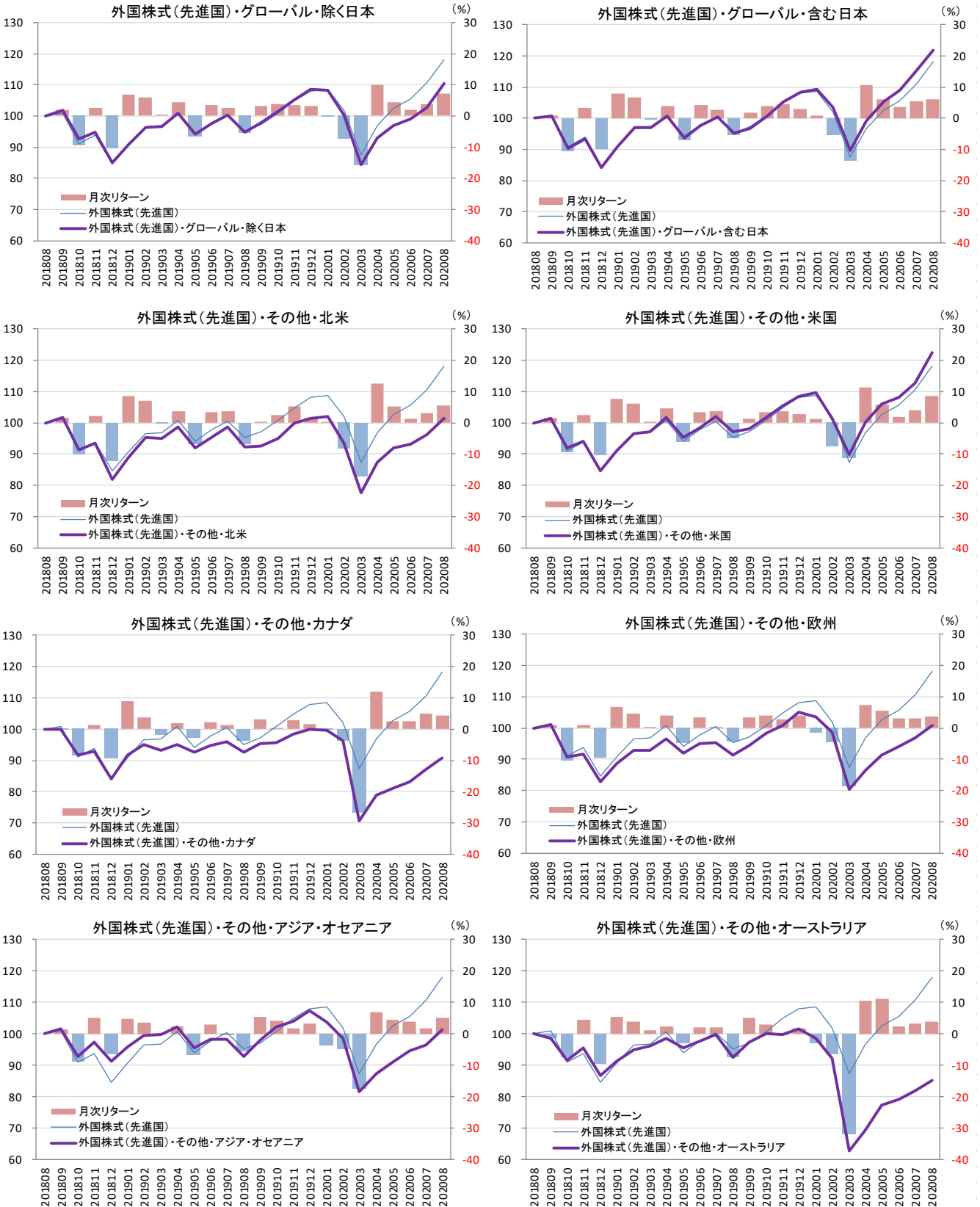


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

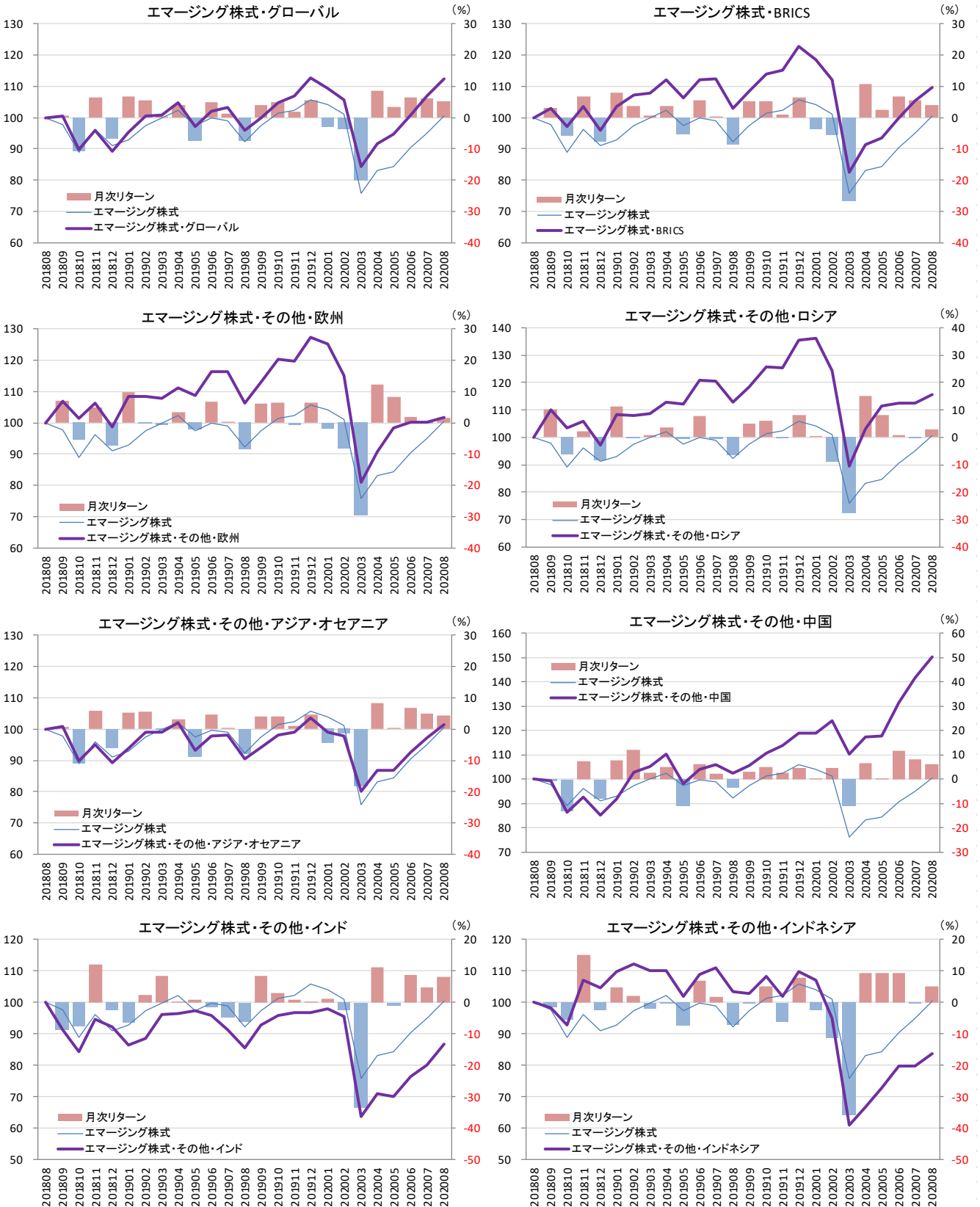


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

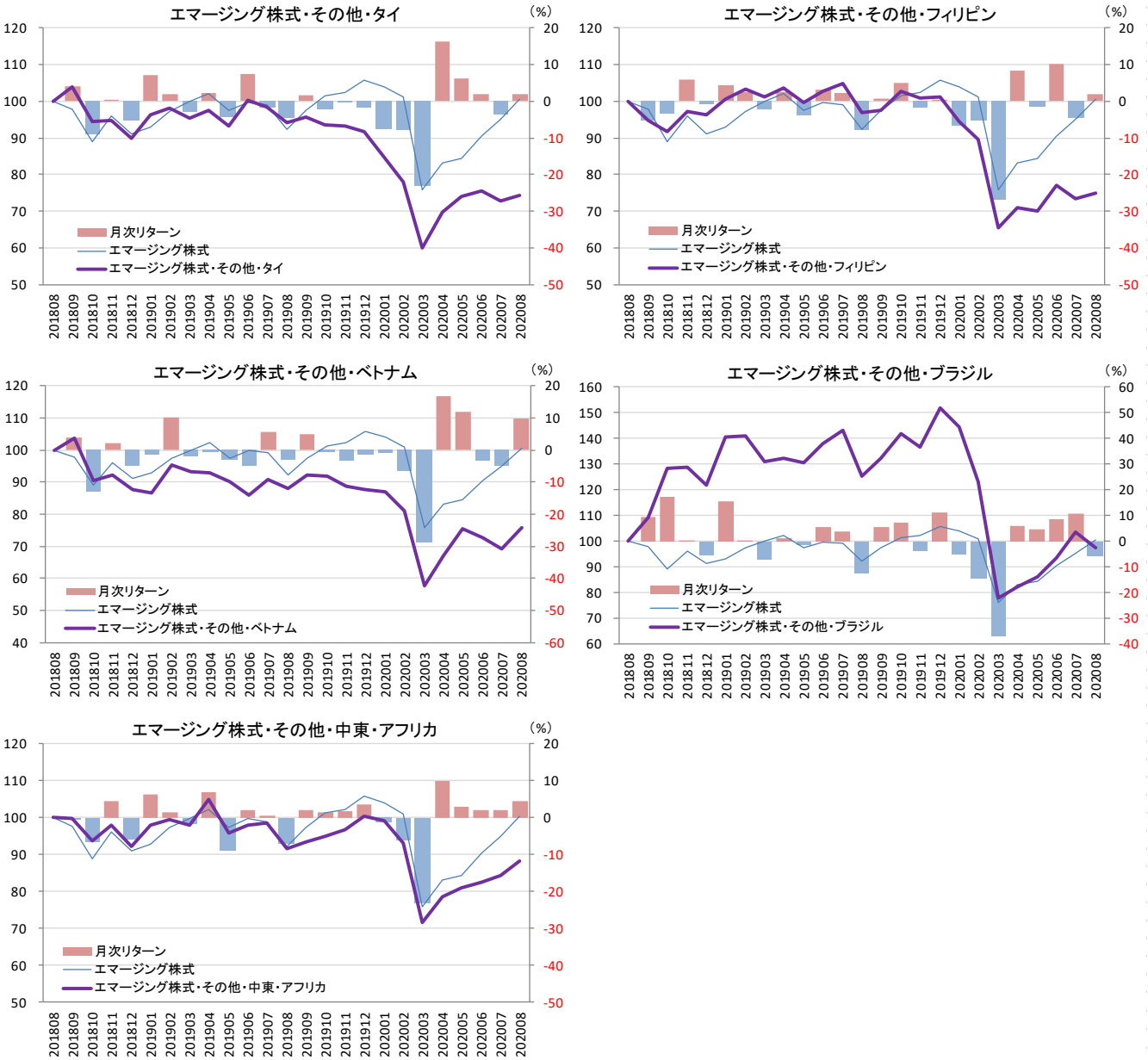


＜1＞パフォーマンス・サマリー

(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]

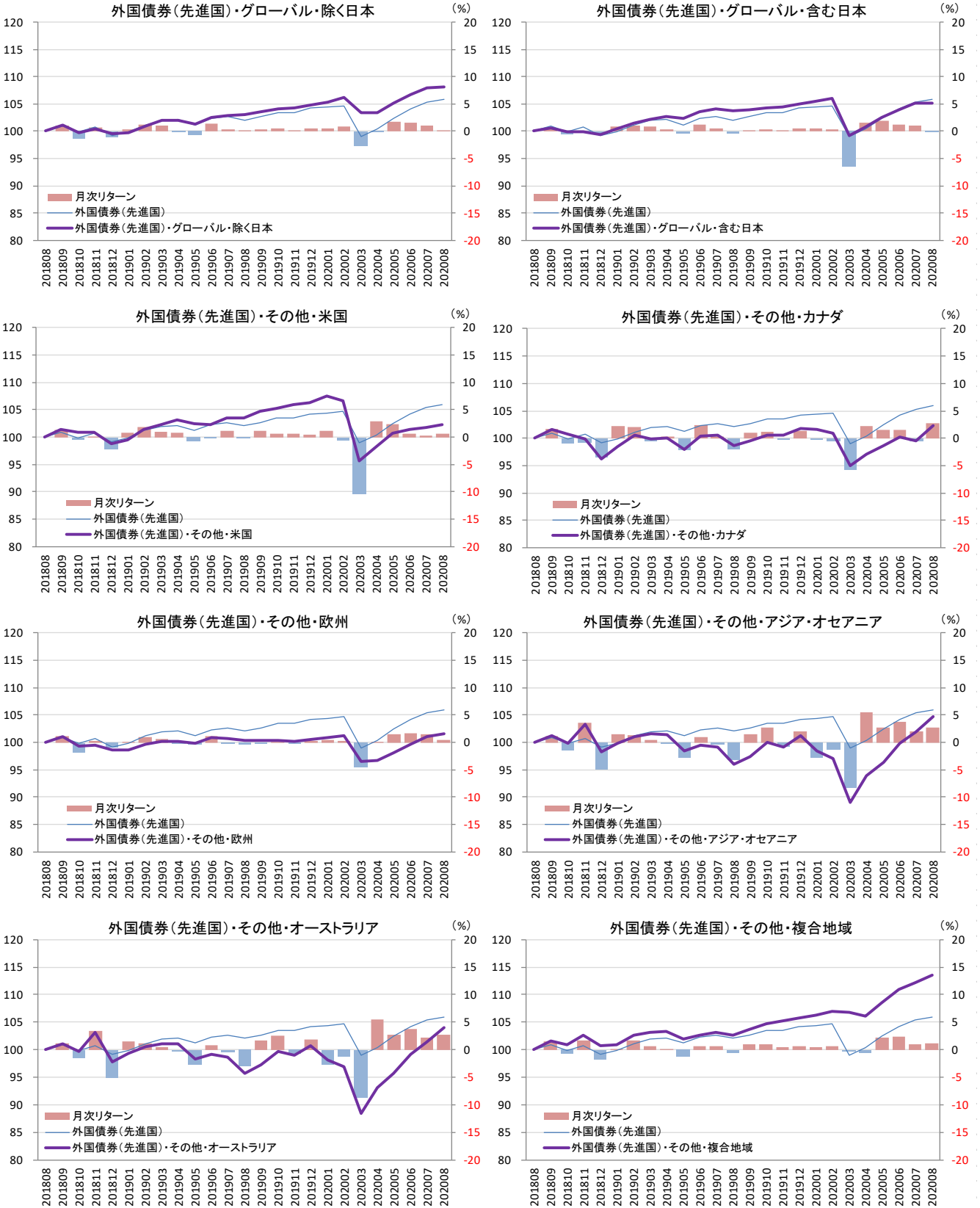


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

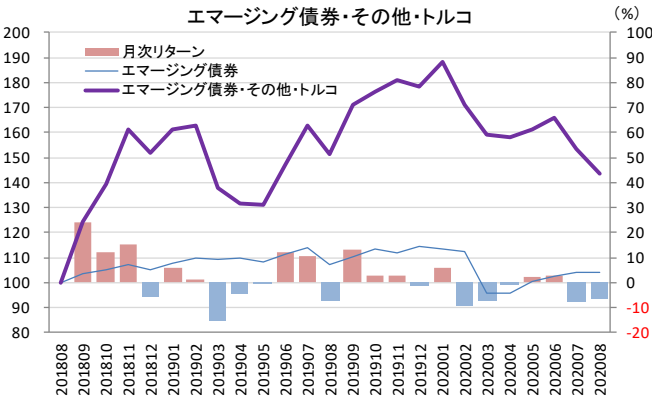


＜1＞パフォーマンス・サマリー

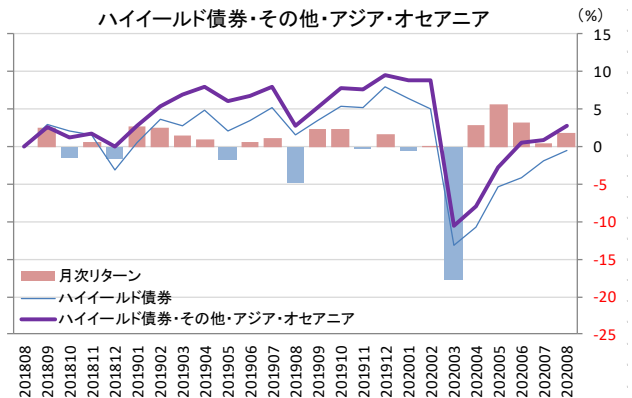
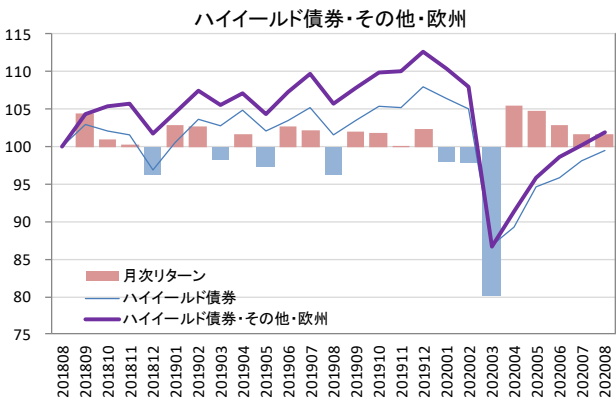
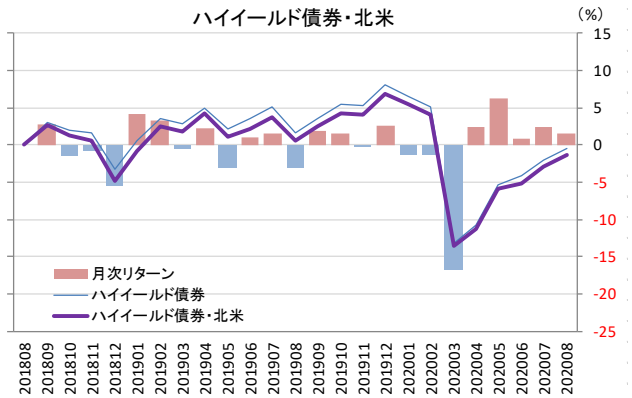
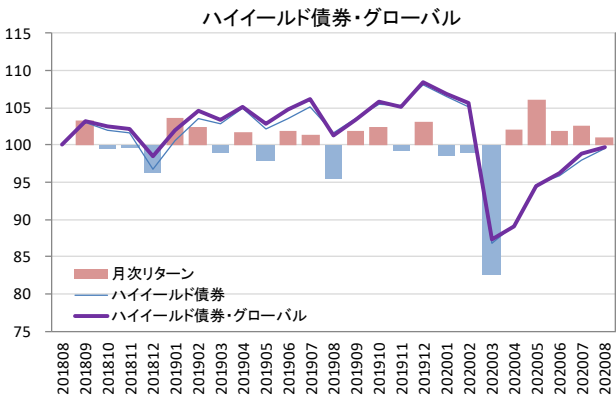
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

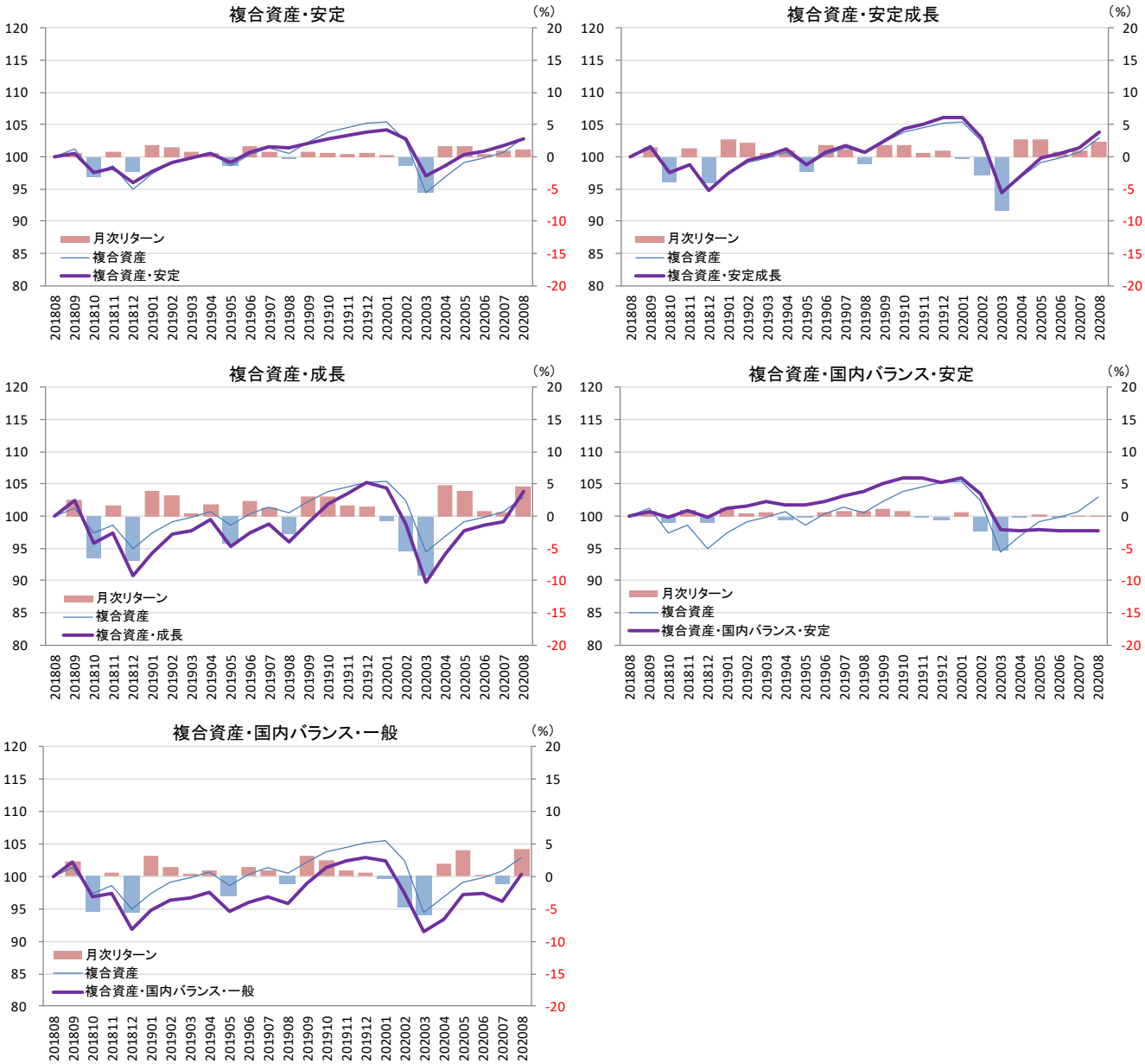


<1>パフォーマンス・サマリー

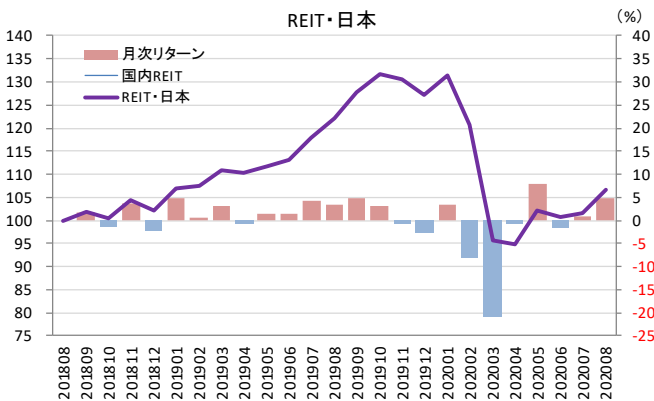
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

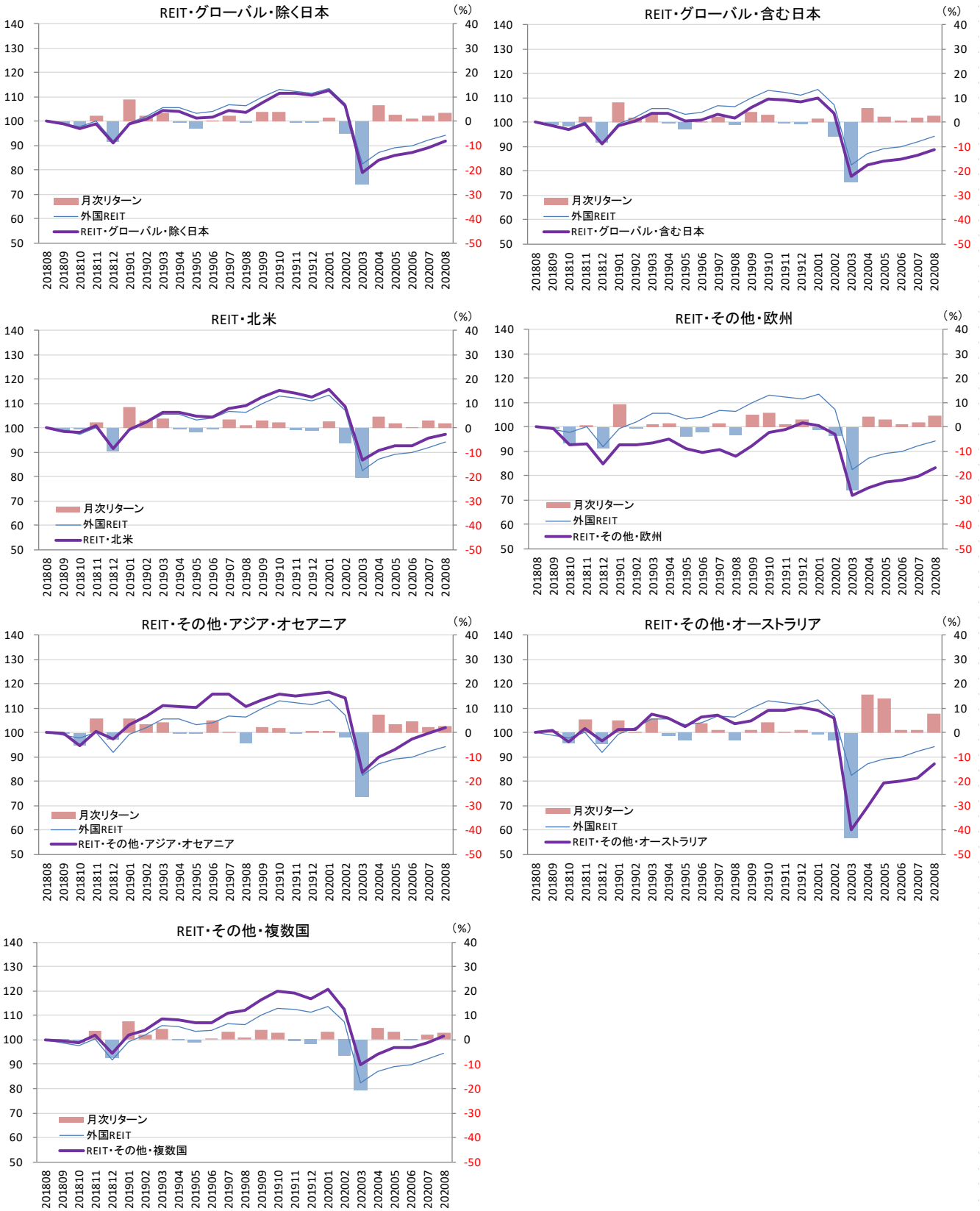


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

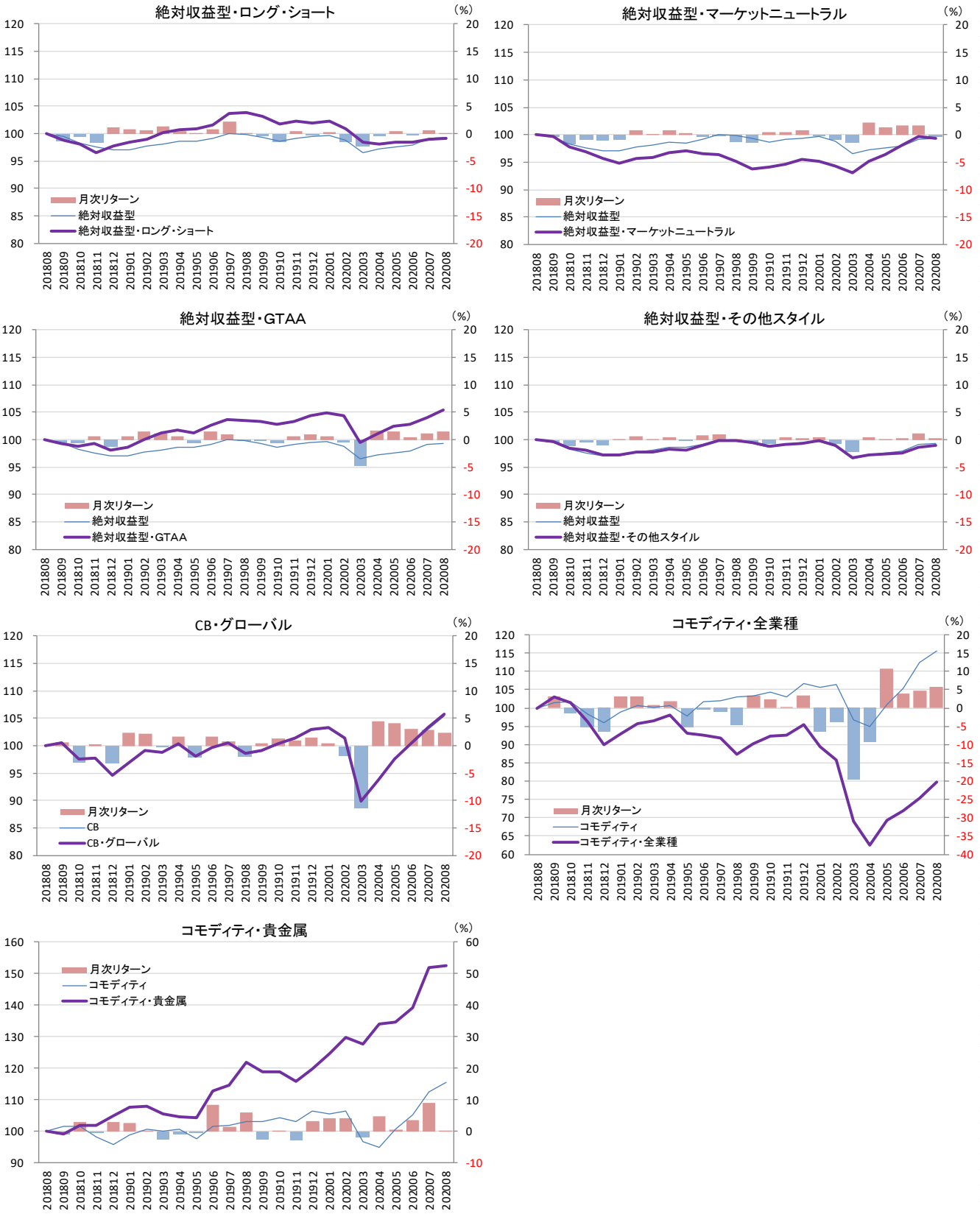


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	3.99		
1	外国株式(先進国)・グローバル	6.23	21.98	1.35
2	外国株式(先進国)・その他	7.99	7.32	0.57
3	国内株式・一般	6.35	8.31	0.52
4	国内株式・その他	7.54	4.57	0.34
5	REIT・日本	4.90	3.90	0.19
6	複合資産・安定成長	2.41	7.31	0.18
7	エマージング株式・その他	6.05	2.77	0.17
8	国内株式・小型	8.88	1.20	0.10
9	複合資産・成長	4.67	2.15	0.10
10	REIT・グローバル	2.99	2.51	0.08
11	外国債券(先進国)・その他	1.79	3.29	0.06
12	エマージング株式・グローバル	5.12	1.17	0.06
13	REIT・北米	1.78	3.21	0.06
14	複合資産・安定	1.10	4.54	0.05
15	複合資産・その他	2.82	1.18	0.03
16	ハイイールド債券・北米	1.61	1.97	0.03
17	ブルベア	10.03	0.31	0.03
18	REIT・その他	3.57	0.62	0.02
19	コモディティ	2.60	0.43	0.01
20	外国債券(先進国)・グローバル	0.08	9.32	0.01
21	ハイイールド債券・その他	1.70	0.50	0.01
22	CB	2.40	0.30	0.01
23	エマージング債券・グローバル	0.51	1.20	0.01
24	国内株式・業種特化	5.23	0.10	0.01
25	複合資産・国内バランス	0.32	1.60	0.01
26	ハイイールド債券・グローバル	0.99	0.46	0.00
27	エマージング株式・BRICS	3.94	0.09	0.00
28	絶対収益型	0.27	1.23	0.00
29	エマージング債券・その他	-0.04	1.16	-0.00
30	国内債券・一般	-0.42	5.29	-0.02
	合計		100.00	3.99

◆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	7.72		
1	外国株式(先進国)・グローバル	25.32	19.51	5.01
2	国内株式・一般	13.09	8.93	1.42
3	外国株式(先進国)・その他	19.81	6.04	1.36
4	国内株式・その他	11.33	4.75	0.76
5	国内株式・小型	18.98	1.36	0.30
6	外国債券(先進国)・グローバル	3.22	9.74	0.24
7	複合資産・安定成長	3.19	7.30	0.21
8	複合資産・成長	8.14	2.09	0.20
9	エマージング株式・グローバル	17.41	1.20	0.19
10	外国債券(先進国)・その他	5.24	3.51	0.17
11	ブルベア	28.12	0.30	0.10
12	エマージング株式・その他	5.84	3.09	0.08
13	コモディティ	11.97	0.34	0.05
14	複合資産・安定	1.40	4.58	0.03
15	国内株式・業種特化	16.17	0.11	0.02
16	CB	7.19	0.23	0.02
17	エマージング株式・BRICS	6.26	0.10	0.01
18	複合資産・その他	3.15	0.98	-0.02
19	絶対収益型	-0.52	1.22	-0.02
20	ハイイールド債券・グローバル	-1.57	0.51	-0.03
21	ハイイールド債券・その他	-2.81	0.59	-0.04
22	エマージング債券・その他	-3.14	1.44	-0.06
23	エマージング債券・グローバル	-2.39	1.31	-0.07
24	ハイイールド債券・北米	-1.91	2.16	-0.10
25	複合資産・国内バランス	-5.36	1.67	-0.11
26	REIT・その他	-9.09	0.72	-0.12
27	国内債券・一般	-3.09	5.49	-0.21
28	REIT・グローバル	-12.38	2.77	-0.48
29	REIT・北米	-10.82	3.59	-0.52
30	REIT・日本	-12.58	4.36	-0.67
	合計		100.00	7.72

◆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	9.43	16.93	87.36	11.77 ↑	11.11	11.55	0.26	0.29	0.56
国内株式	9.25	21.24	155.05	17.41 ↑	17.24	17.23	0.17	0.23	0.57
一般	6.41	17.95	137.07	17.33 ↑	17.40	17.53	0.12	0.20	0.51
フリー	8.35	20.16	141.95	17.58 ↑	17.71	18.12	0.16	0.21	0.51
バリュー	-0.81	9.85	124.78	16.68 ↑	16.62	16.32	-0.01	0.12	0.52
小型	17.04	52.24	291.67	21.34 ↑	19.08 ↑	18.10	0.25	0.46	0.81
その他	14.05	22.84	172.63	16.83 ↑	16.80	16.91	0.27	0.25	0.62
日経225	22.96	31.17	198.15	17.41 ↑	17.15	17.14	0.41	0.33	0.67
TOPIX	6.31	15.90	141.00	16.24 ↑	16.44	16.63	0.13	0.18	0.55
JPX日経400	7.34	14.70	-	16.12 ↑	16.13	-	0.15	0.17	-
国内債券	0.84	4.20	11.42	1.83	1.90	1.64	0.18	0.45	0.65
一般	0.84	4.20	11.42	1.83	1.90	1.64	0.18	0.45	0.65
外国株式(先進国)	30.77	42.04	159.42	18.20 ↑	17.05	16.37	0.52	0.43	0.61
グローバル	32.03	44.66	173.06	18.20 ↑	16.83	16.22	0.54	0.46	0.65
除く日本	25.25	38.71	205.82	18.76 ↑	18.01	17.84	0.42	0.38	0.66
含む日本	34.19	46.45	166.45	18.12 ↑	16.58	15.91	0.57	0.48	0.65
その他	26.99	35.42	140.69	18.39 ↑	17.75	17.65	0.45	0.35	0.52
北米	19.18	22.26	79.72	20.99 ↑	19.69	21.23	0.29	0.21	0.28
米国	43.86	51.66	179.33	18.06 ↑	18.17	17.73	0.72	0.48	0.61
カナダ	-4.96	-0.09	9.01	21.39 ↑	18.34	17.80	-0.08	0.00	0.05
欧州	5.95	13.17	122.20	18.37 ↑	17.16	18.40	0.11	0.15	0.45
ドイツ	-0.87	8.87	-	22.57 ↑	22.12	-	-0.01	0.08	-
イギリス	-19.99	-28.42	-	18.43 ↑	17.26	-	-0.39	-0.37	-
アジア・オセアニア	8.82	27.07	130.83	17.29 ↑	16.58	17.89	0.17	0.30	0.49
オーストラリア	-15.33	0.51	57.90	24.52 ↑	21.81	21.32	-0.22	0.01	0.22
ニュージーランド	35.65	91.22	-	18.21 ↑	18.40	-	0.59	0.75	-
複合地域	-42.15	-48.54	-	32.29 ↑	27.45	-	-0.51	-0.45	-
エマージング株式	0.17	18.05	52.02	21.07 ↑	19.04	19.29	0.01	0.18	0.22
グローバル	11.95	29.05	58.92	20.43 ↑	18.70	18.95	0.19	0.28	0.25
BRICS	7.73	40.09	65.86	23.55	21.88	22.04	0.11	0.32	0.23
その他	-4.25	13.28	52.11	21.75 ↑	19.51	19.50 ↑	-0.06	0.13	0.22
欧州	-7.04	22.46	17.26	25.57	23.51	24.65	-0.09	0.18	0.06
ロシア	19.59	60.76	47.42	25.74	24.77	27.10	0.24	0.40	0.15
アジア・オセアニア	1.50	16.24	77.53	19.30 ↑	17.67	17.89	0.03	0.18	0.33
中国	45.75	79.44	190.57	20.86 ↑	20.64	22.00	0.64	0.60	0.51
インド	-10.88	7.23	51.95	27.22 ↑	24.44	25.93 ↑	-0.14	0.06	0.16
インドネシア	-24.46	-6.14	13.28	29.42 ↑	25.99	24.66 ↑	-0.30	-0.05	0.05
タイ	-17.81	-0.33	68.78	22.58 ↑	19.03	18.73	-0.28	-0.00	0.29
フィリピン	-30.10	-36.02	79.56	22.33 ↑	19.78	21.72	-0.50	-0.43	0.28
ベトナム	-9.27	10.04	59.87	28.16 ↑	22.96	21.64	-0.11	0.09	0.22
韓国	7.38	3.59	56.24	24.73 ↑	21.27 ↑	20.95	0.10	0.04	0.22
香港	-6.49	21.71	48.48	19.19	18.50	19.37	-0.11	0.22	0.21
台湾	11.65	40.21	155.86	22.45	19.33	19.02	0.17	0.36	0.52
中南米	-21.26	-0.86	-16.02	31.50	28.33	25.76	-0.24	-0.00	-0.07
ブラジル	-23.49	5.21	-41.07	36.47 ↑	35.28	31.50	-0.23	0.03	-0.16
メキシコ	-40.44	-40.08	-	30.01	26.36	-	-0.53	-0.37	-
中東・アフリカ	-11.63	-15.55	49.83	19.79 ↑	18.05	17.64	-0.20	-0.18	0.23
トルコ	-53.08	-46.90	-47.09	36.60	31.27	30.88	-0.61	-0.38	-0.20
複合地域	-3.03	3.50	66.05	18.68 ↑	16.92	16.63	-0.05	0.04	0.31

※[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	9.43	16.93	87.36	11.77 ↑	11.11	11.55	0.26	0.29	0.56
外国債券(先進国)	2.71	2.61	43.04	4.70 ↑	5.35	7.66	0.20	0.10	0.47
グローバル	3.99	3.04	42.73	3.91	4.69	6.89	0.35	0.14	0.52
除く日本	5.46	3.25	48.44	3.70	4.88	7.49	0.50	0.14	0.54
含む日本	2.32	2.97	36.06	4.65	4.85	6.37	0.18	0.13	0.49
その他	-0.47	1.08	43.27	7.50 ↑	7.66	9.58	-0.01	0.03	0.38
北米	3.95	3.64	-	4.99	4.59	-	0.27	0.16	-
米国	0.99	-2.37	44.09	7.37 ↑	6.85	6.91	0.05	-0.06	0.54
カナダ	-1.02	-6.80	17.59	7.31	8.11	9.13	-0.04	-0.17	0.18
欧州	0.46	-0.98	44.23	4.70	6.26	9.36	0.04	-0.03	0.40
イギリス	1.49	-14.79	-	8.50 ↑	10.66	-	0.06	-0.29	-
アジア・オセアニア	-1.25	2.87	49.85	9.43 ↑	9.40	10.82	-0.04	0.06	0.38
オーストラリア	-1.86	2.86	47.11	9.55 ↑	9.49	11.03	-0.06	0.06	0.36
ニュージーランド	4.16	12.33	-	9.03	9.61	-	0.16	0.25	-
複合地域	9.89	14.64	42.23	4.27	6.18	9.13	0.76	0.45	0.39
エマージング債券	-10.29	6.20	27.39	12.57	12.10	13.17	-0.28	0.10	0.18
グローバル	-10.17	5.30	29.08	14.44	13.11	13.50	-0.24	0.08	0.19
米ドル建て	-10.24	6.81	31.85	14.95	13.53	13.80	-0.23	0.10	0.20
現地通貨建て	-9.24	-3.27	15.26	12.99	11.91	12.35	-0.24	-0.05	0.11
その他	-10.49	7.28	23.41	11.26	11.78	13.70	-0.32	0.12	0.15
ロシア	-3.85	28.01	21.02	20.24	19.32	22.70	-0.06	0.26	0.08
アジア・オセアニア	4.88	7.55	56.50	7.48 ↑	7.35	8.92	0.22	0.20	0.51
インド	-0.45	9.21	-	9.77 ↑	10.20	-	-0.01	0.18	-
インドネシア	-1.80	15.30	31.16	17.27	16.22	16.22	-0.03	0.18	0.17
ブラジル	-27.67	-0.59	4.96	19.42	19.44	18.37	-0.52	-0.00	0.03
メキシコ	-2.86	-11.84	-	19.41	18.16	-	-0.05	-0.14	-
トルコ	-44.15	-50.40	-	36.61	29.74	-	-0.48	-0.44	-
複合地域	-2.09	-5.82	13.46	13.09	12.69	13.67	-0.05	-0.09	0.09
ハイイールド債券	-5.06	6.26	66.77	13.08 ↑	12.31	12.75	-0.13	0.10	0.41
グローバル	-6.62	7.38	57.66	13.22 ↑	12.34	12.97	-0.17	0.12	0.36
北米	-3.09	6.49	74.79	12.91 ↑	12.27	12.38	-0.08	0.11	0.46
その他	-9.97	3.45	64.87	14.41 ↑	13.25	15.14	-0.24	0.05	0.34
欧州	-11.61	2.43	77.08	15.12 ↑	14.02	16.21	-0.26	0.04	0.36
アジア・オセアニア	-4.81	7.64	-	12.88 ↑	11.53	-	-0.12	0.13	-
複合地域	5.05	8.20	88.90	9.57 ↑	9.75	11.36	0.18	0.17	0.58
複合資産	5.62	9.52	75.03	7.40 ↑	7.45	8.97	0.26	0.25	0.64
安定	4.09	5.82	58.68	5.16 ↑	5.34	7.32	0.27	0.22	0.64
安定成長	6.55	11.35	78.82	7.97 ↑	7.91	9.40	0.27	0.28	0.63
成長	10.31	17.35	112.23	11.62 ↑	11.51	11.69	0.29	0.29	0.67
国内バランス	-0.84	2.97	35.41	4.26	3.67	6.54	-0.05	0.17	0.47
安定	-1.40	3.41	25.79	4.02	3.33	3.41	-0.10	0.21	0.67
一般	6.51	14.31	58.33	9.20 ↑	8.63	9.76	0.24	0.32	0.48

※[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	9.43	16.93	87.36	11.77 ↑	11.11	11.55	0.26	0.29	0.56
国内REIT	14.13	23.62	167.60	16.21 ↑	13.38	17.29	0.28	0.33	0.60
日本	14.13	23.62	167.60	16.21 ↑	13.38	17.29	0.28	0.33	0.60
外国REIT	-1.27	4.59	127.08	18.11 ↑	16.37	16.18	-0.02	0.06	0.53
グローバル	-5.28	-2.94	104.35	18.99 ↑	16.96	16.37	-0.09	-0.03	0.45
除く日本	-1.71	5.00	125.16	19.45 ↑	17.42	16.55	-0.03	0.06	0.51
含む日本	-6.07	-4.13	101.69	18.86 ↑	16.87	16.33	-0.11	-0.05	0.44
北米	1.40	8.90	145.82	17.51 ↑	16.09	16.35	0.03	0.11	0.57
その他	3.08	17.79	146.71	20.50 ↑	17.59	16.43	0.05	0.19	0.57
欧州	-11.11	-14.36	20.44	19.91 ↑	19.09	20.44	-0.19	-0.16	0.09
アジア・オセアニア	8.15	33.03	152.03	19.27 ↑	16.65	16.48	0.14	0.36	0.59
オーストラリア	-9.81	1.16	96.11	30.41 ↑	25.33	21.92 ↑	-0.11	0.01	0.32
複合地域	-29.93	-31.28	47.48	26.80 ↑	23.10	21.02	-0.42	-0.31	0.19
複数国	8.40	19.89	191.58	16.63 ↑	14.50	15.13	0.17	0.26	0.75
その他									
絶対収益型	-1.25	-2.47	-2.19	2.56	2.26	3.49	-0.14	-0.20	-0.07
ロング・ショート	-4.18	-6.28	-0.65	3.54	3.08	3.56	-0.39	-0.41	-0.02
マーケットニュートラル	1.01	17.20	44.87	3.82	5.16	5.29	0.10	0.63	0.71
GTAA	4.22	5.05	16.04	4.16 ↑	3.34 ↑	3.14	0.35	0.31	0.47
その他スタイル	-1.97	-3.84	-4.51	2.49 ↑	2.31	5.04	-0.24	-0.32	-0.10
CB	5.71	8.69	45.29	9.16 ↑	8.53	9.98	0.21	0.20	0.38
アジア・オセアニア	8.64	19.84	72.83	13.24 ↑	12.25	12.23 ↑	0.22	0.30	0.46
日本	-1.76	2.02	43.82	5.73	5.64	6.16	-0.09	0.08	0.60
グローバル	6.06	9.19	48.51	9.33 ↑	8.63	10.35	0.22	0.21	0.39
コモディティ	18.89	1.48	-3.29	10.42 ↑	11.54	14.23	0.57	0.03	-0.02
全業種	-13.23	-27.78	-31.93	18.41 ↑	16.70	16.55 ↑	-0.25	-0.38	-0.23
貴金属	37.90	44.89	56.85	10.57	9.92	16.59	1.07	0.78	0.28
エネルギー	-9.13	-35.80	-50.07	38.96 ↑	34.41 ↑	29.55 ↑	-0.08	-0.25	-0.23
その他コモディティ	-14.02	-16.43	0.30	19.14 ↑	17.62	18.54	-0.25	-0.20	0.00

※[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

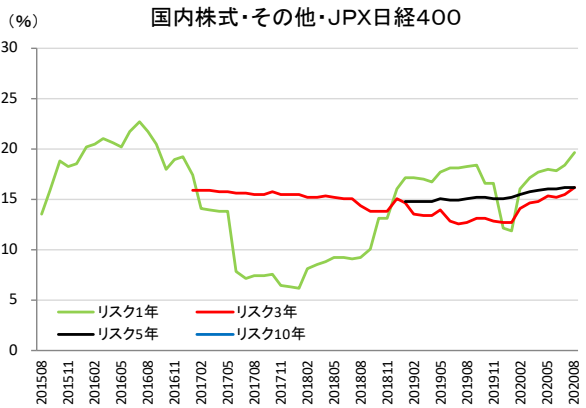
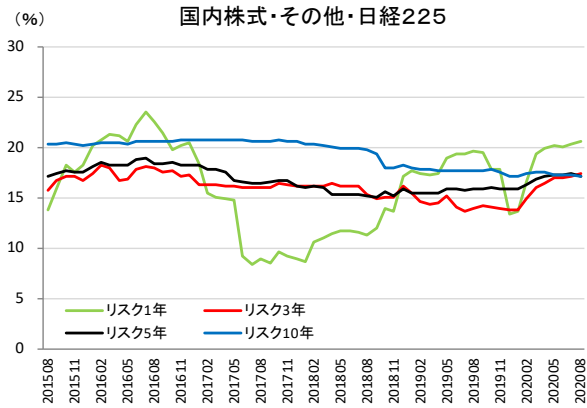
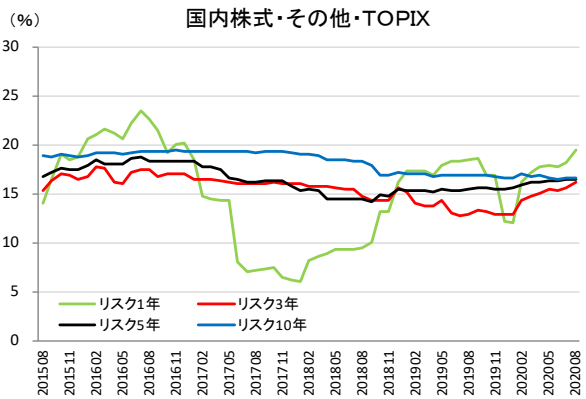
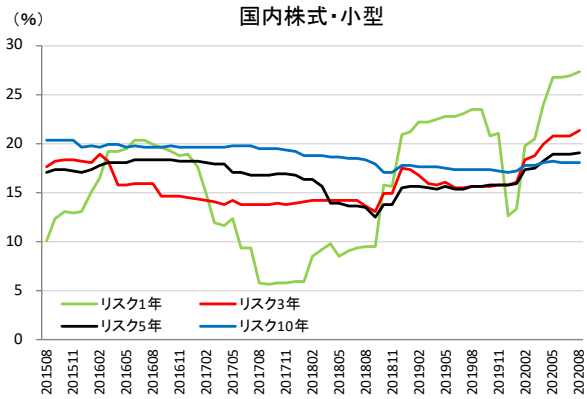
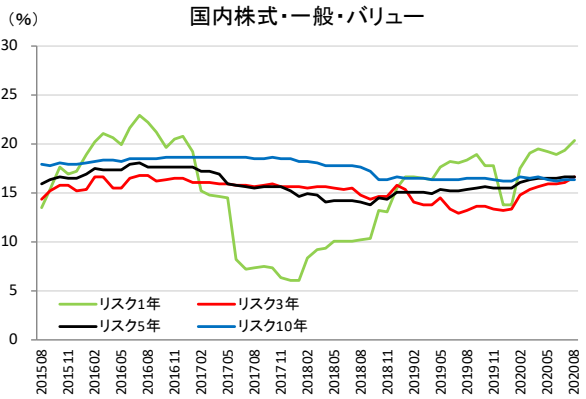
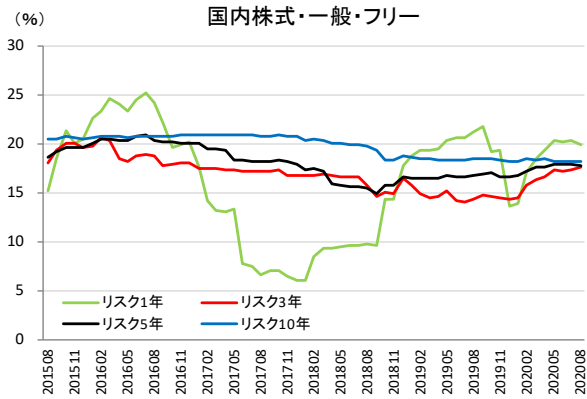
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

＜2＞リスク・サマリー

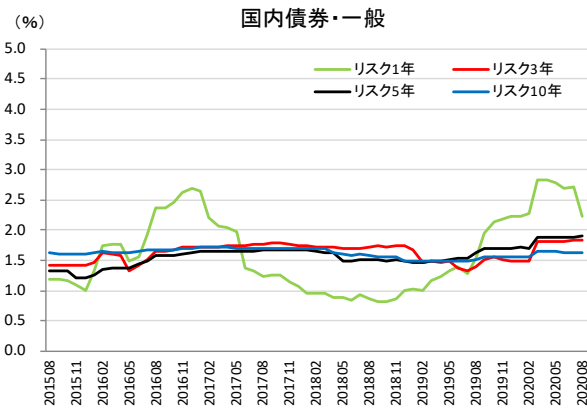
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

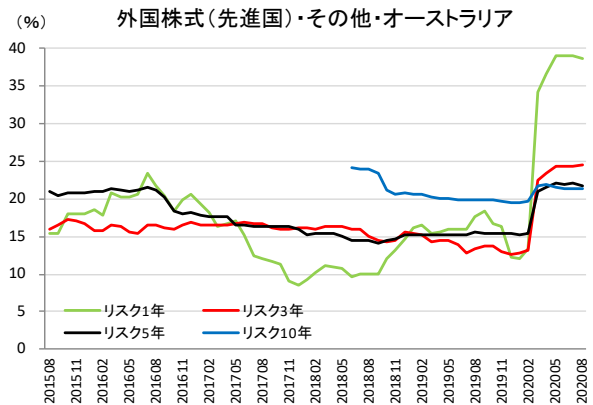
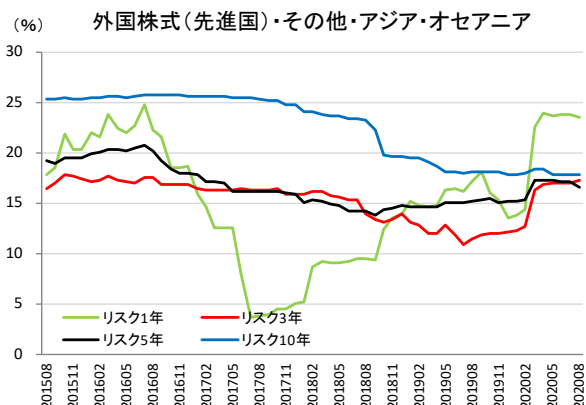
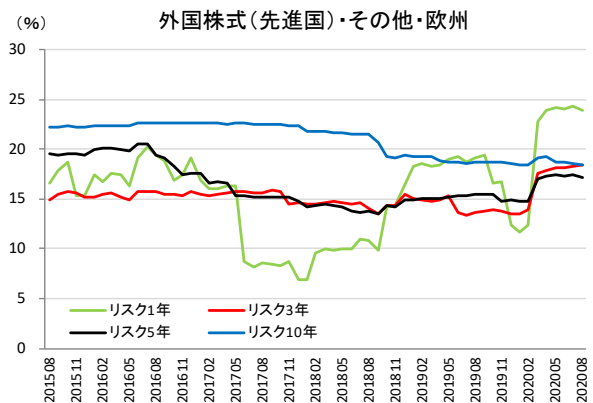
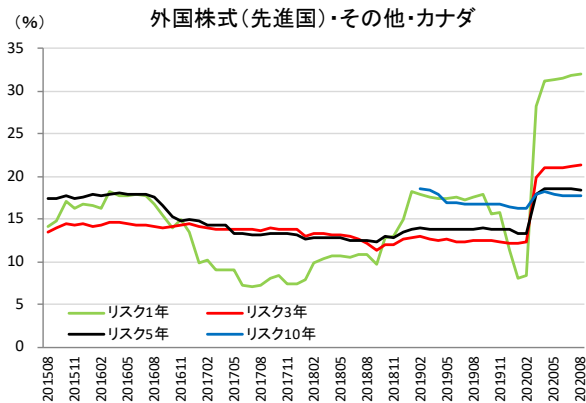
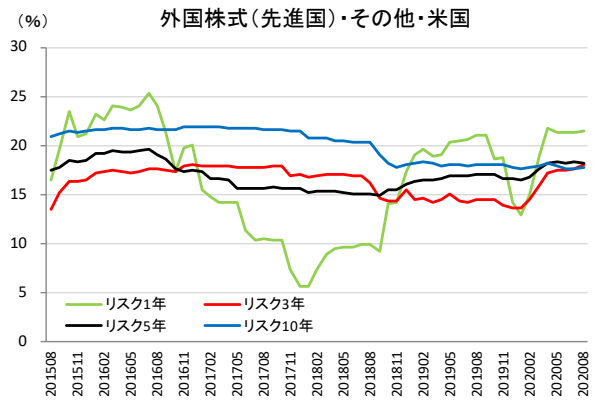
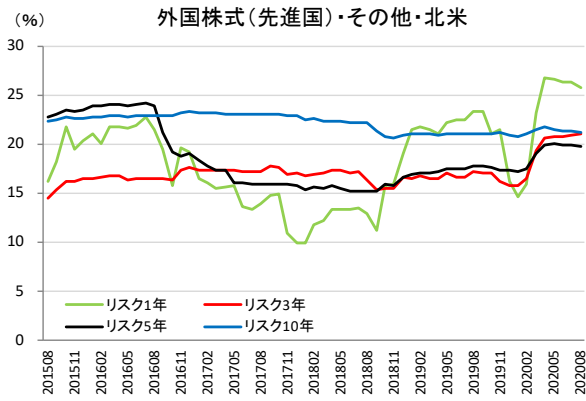
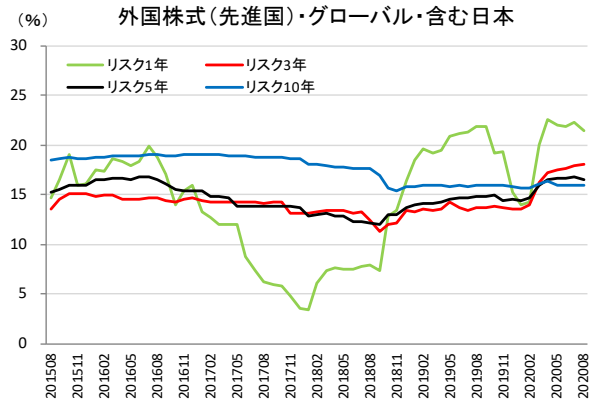
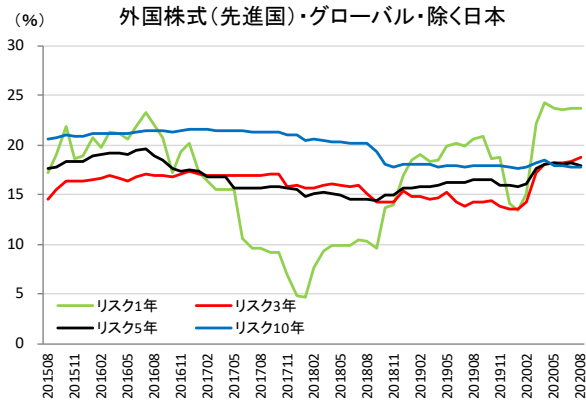


＜2＞リスク・サマリー

(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)]

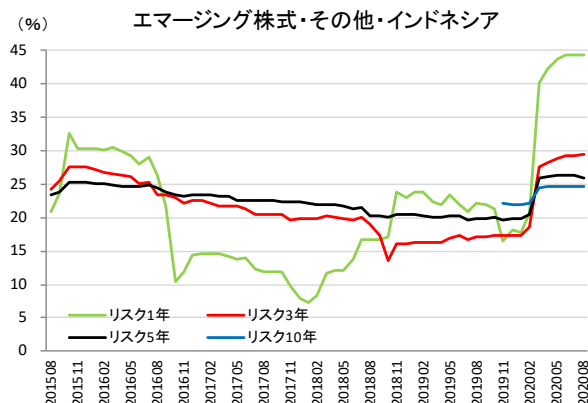
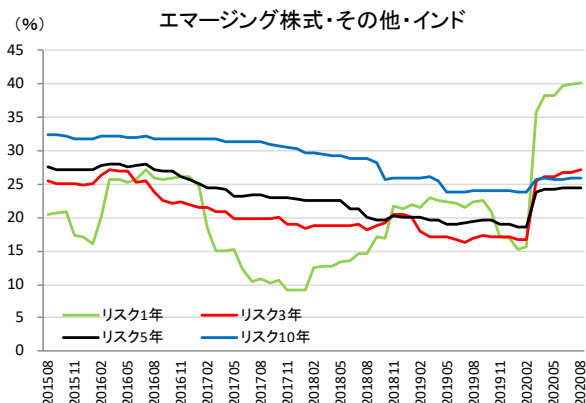
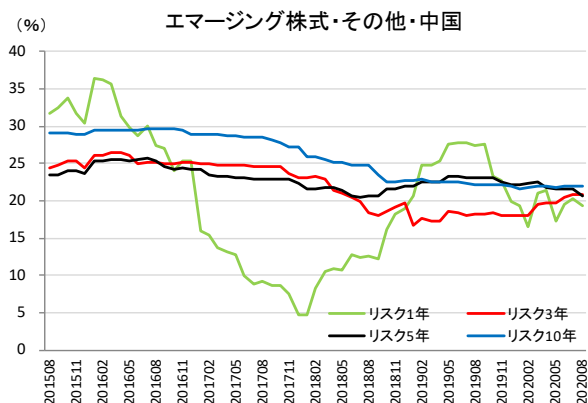
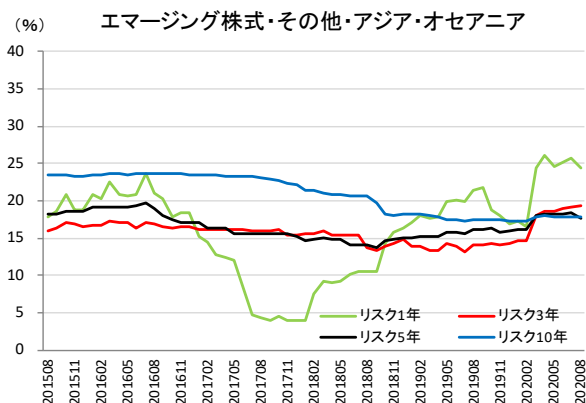
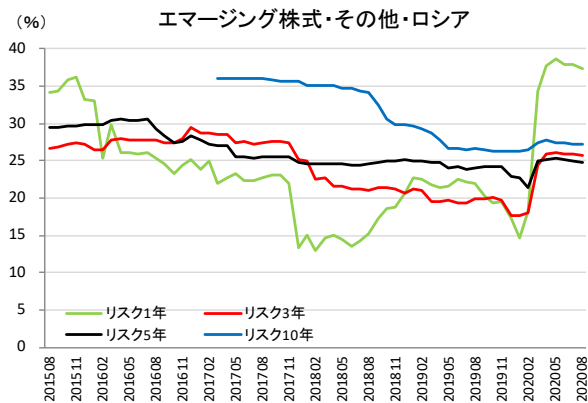
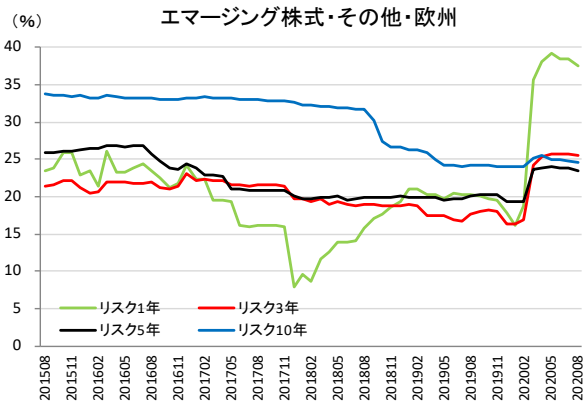
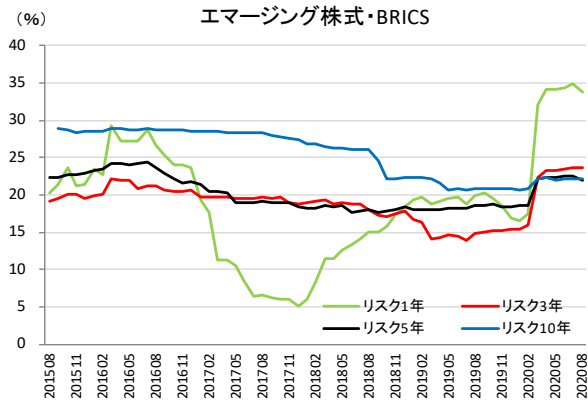
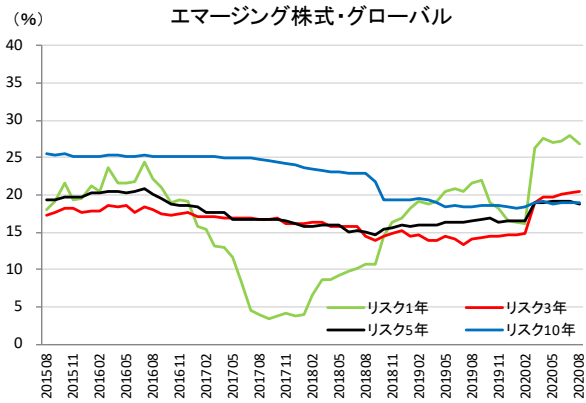


＜2＞リスク・サマリー

(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]

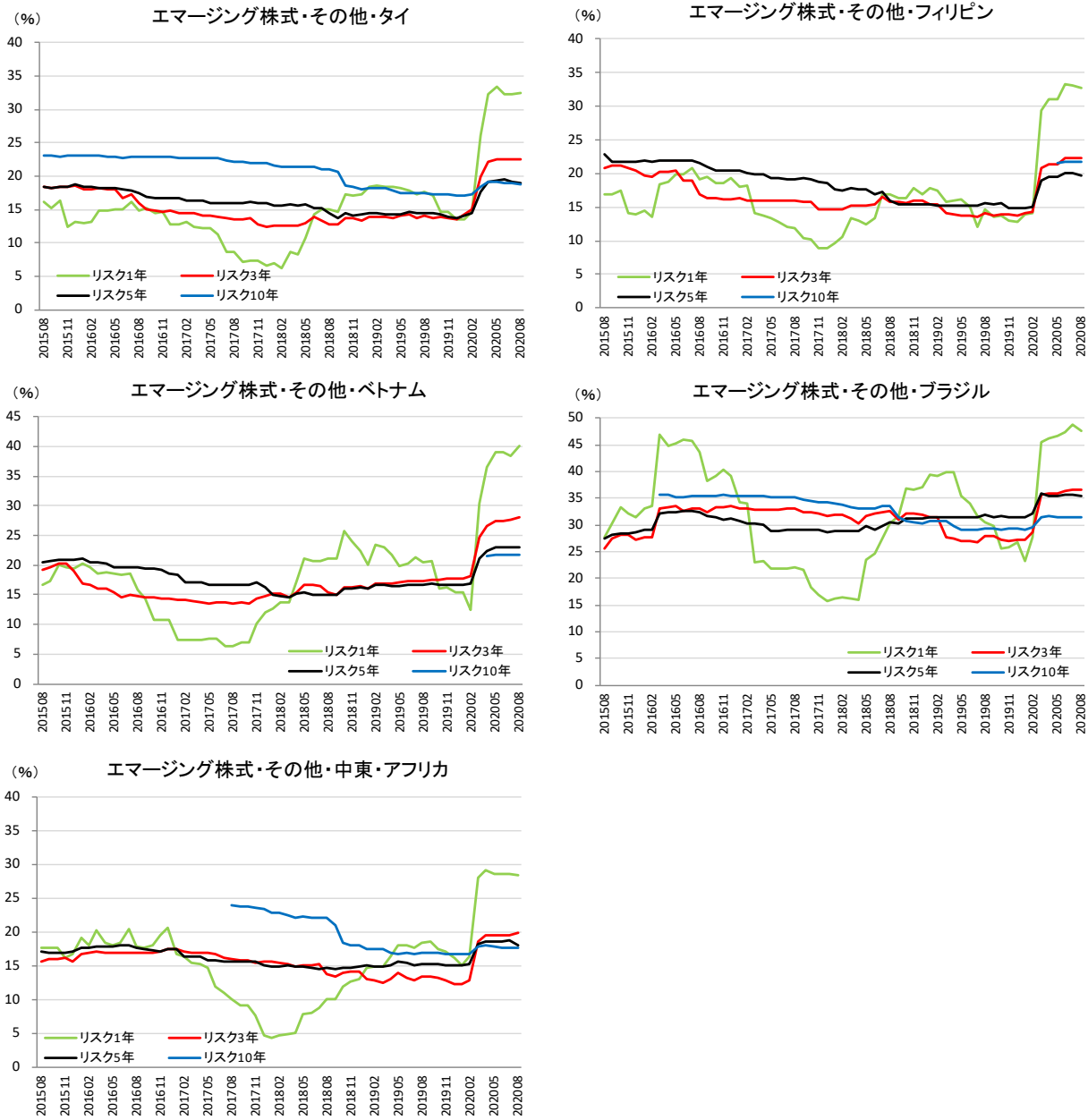


＜2＞リスク・サマリー

(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]

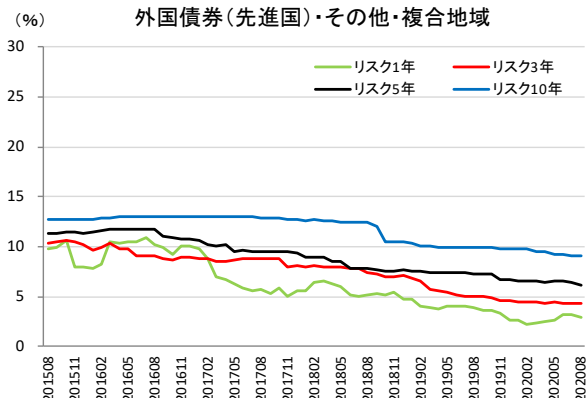
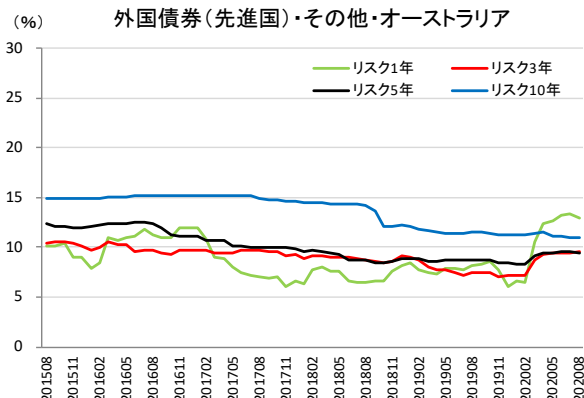
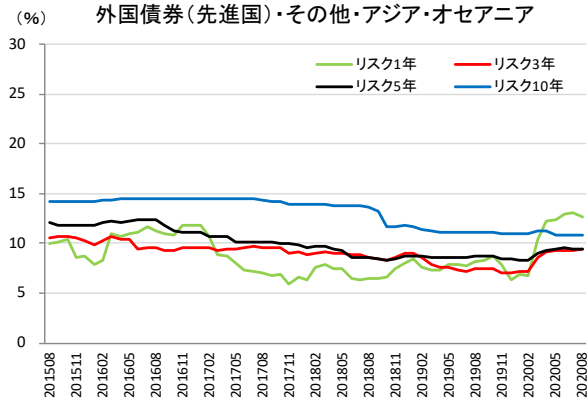
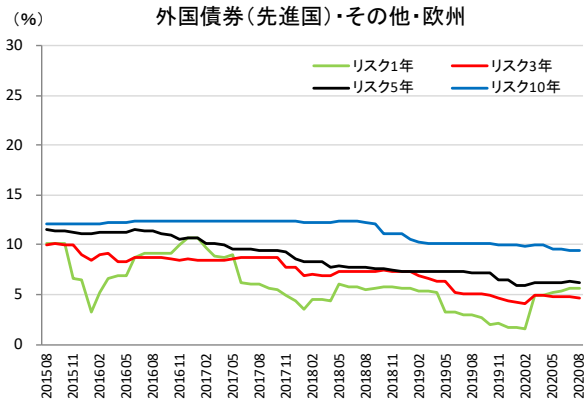
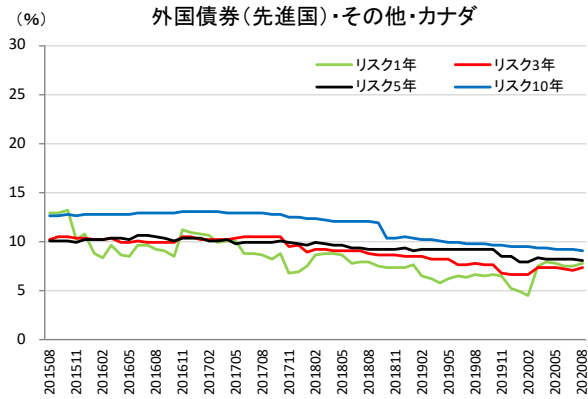
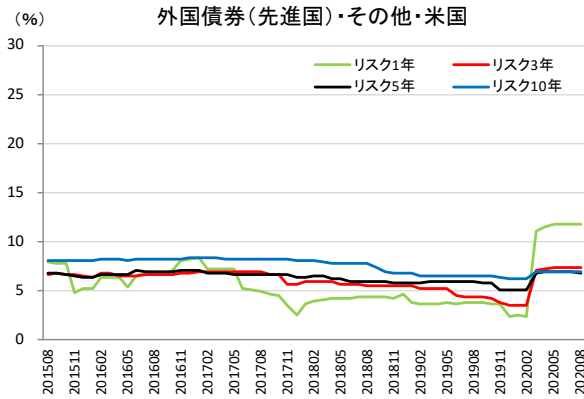
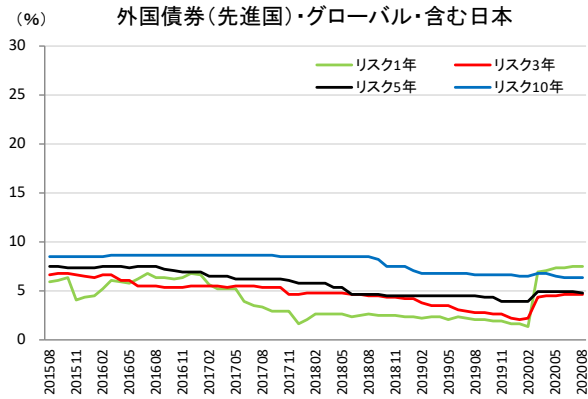
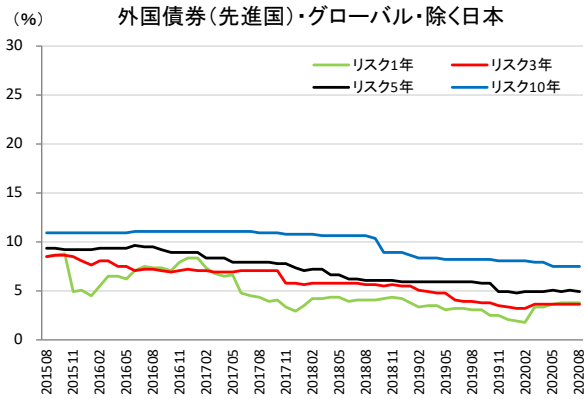


＜2＞リスク・サマリー

(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)]

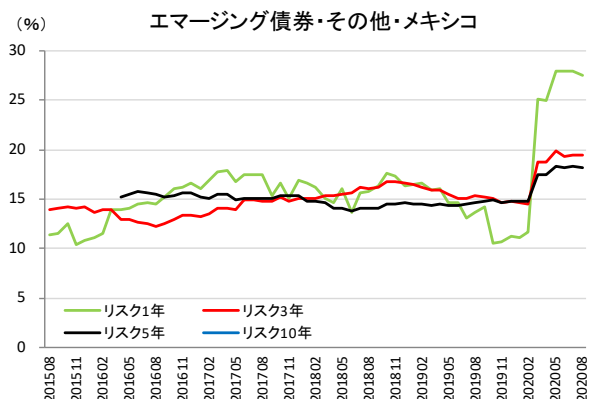
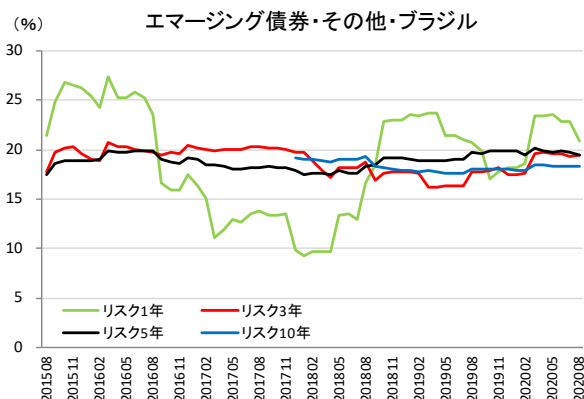
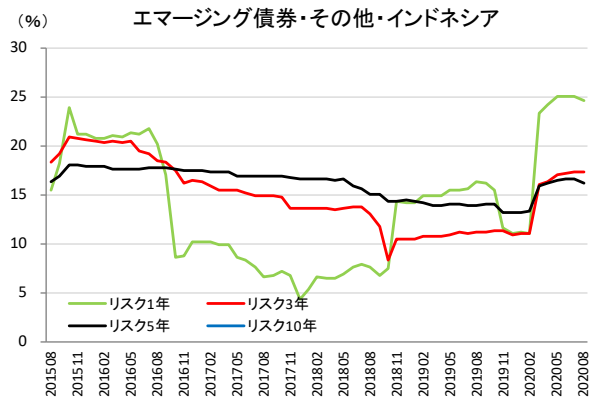
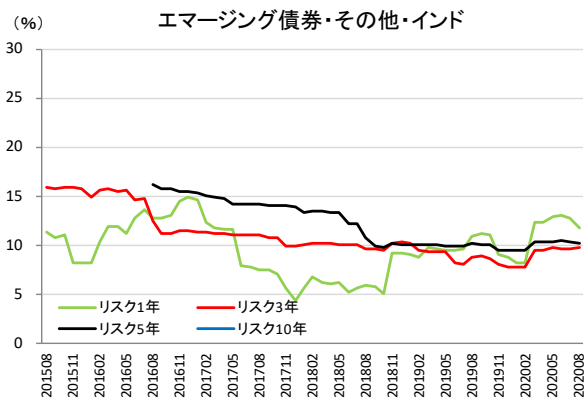
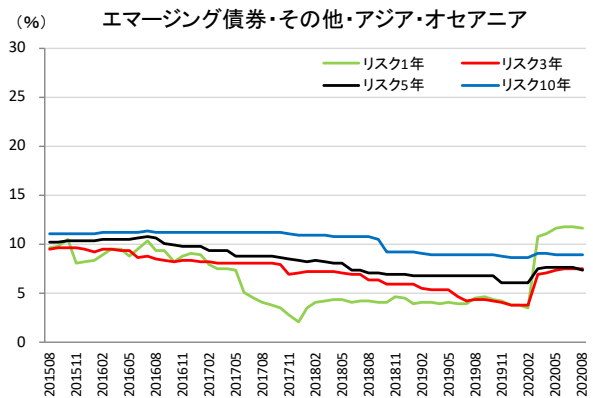
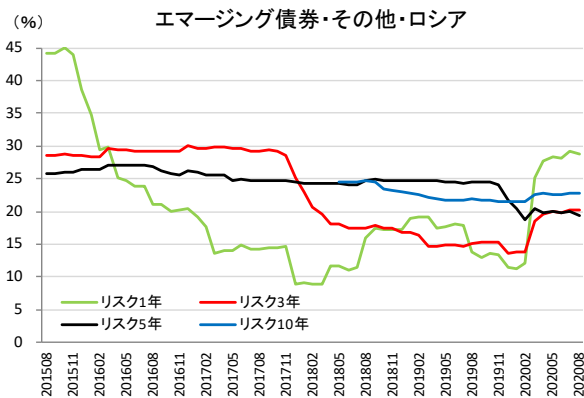
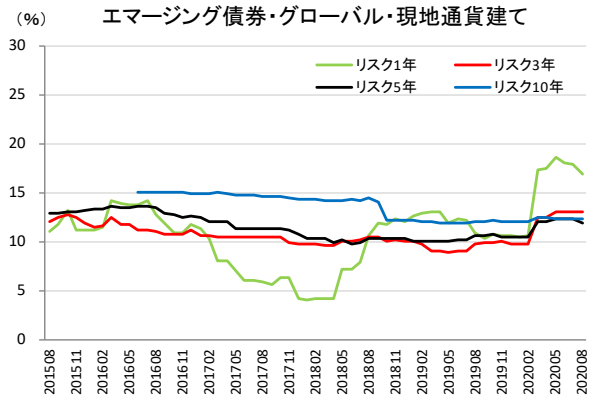
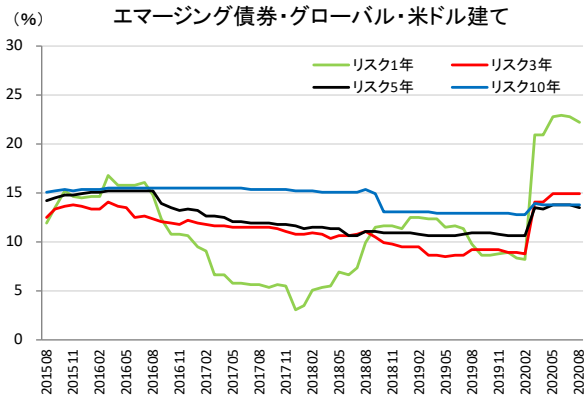


<2> リスク・サマリー

(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]

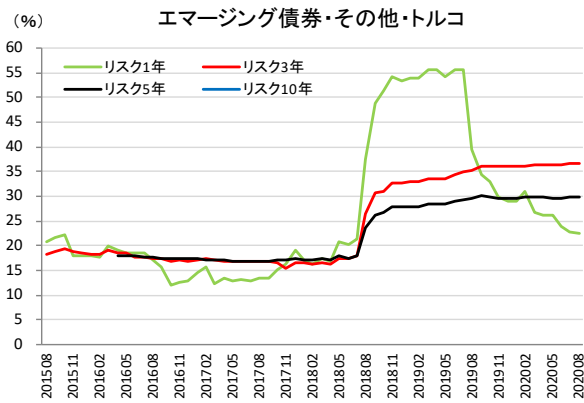


＜2＞リスク・サマリー

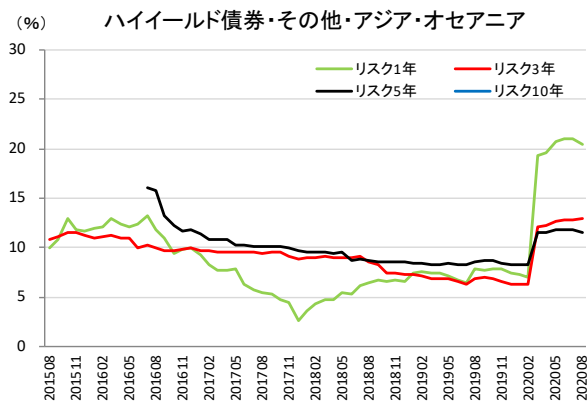
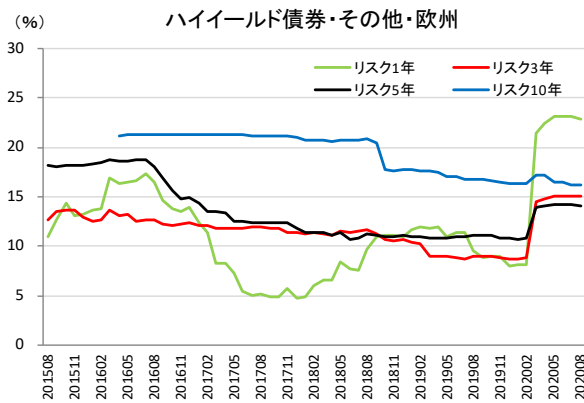
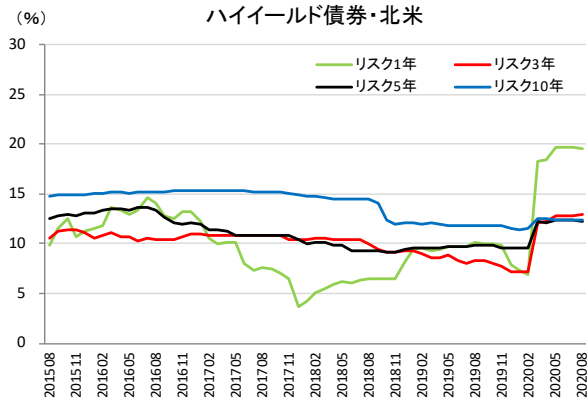
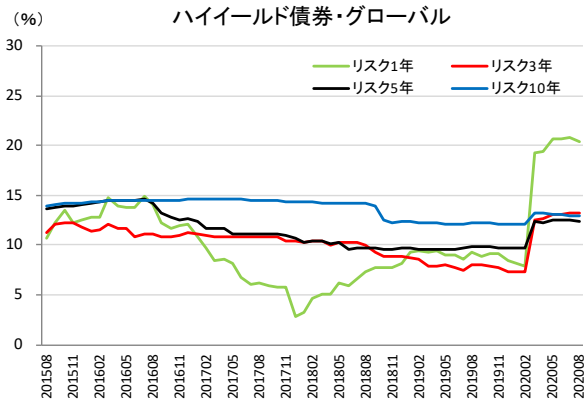
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

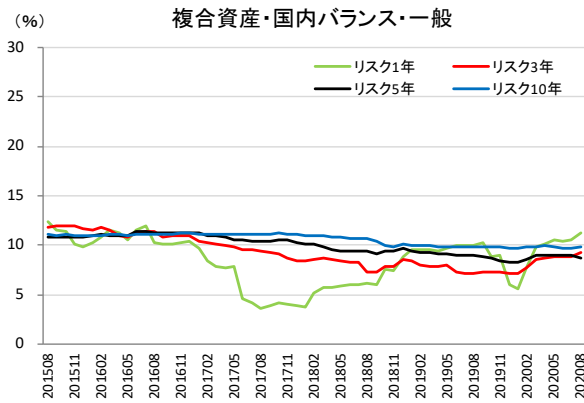
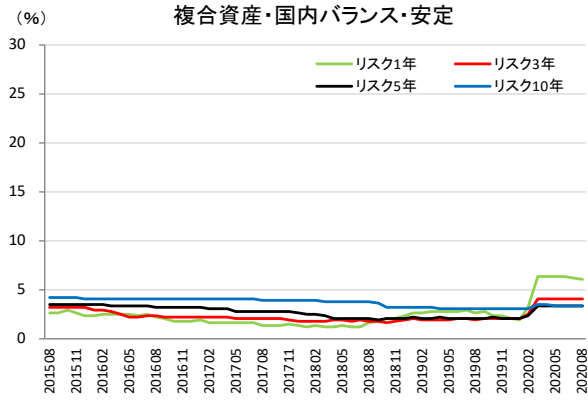
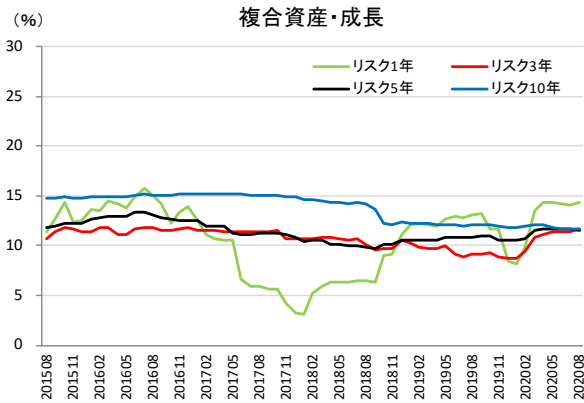
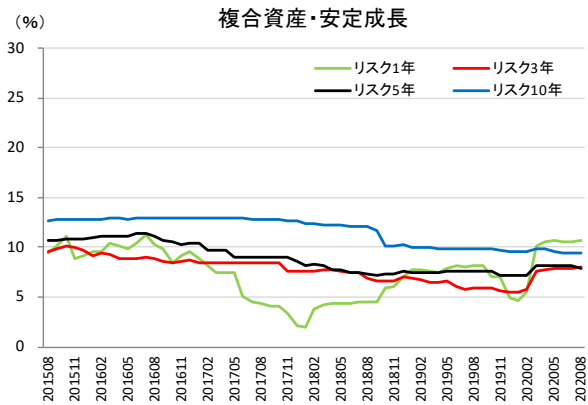
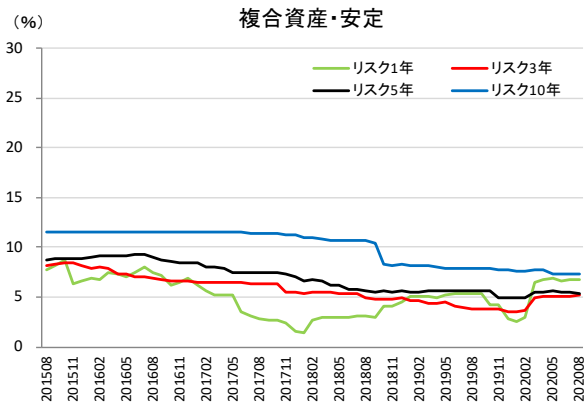


＜2＞リスク・サマリー

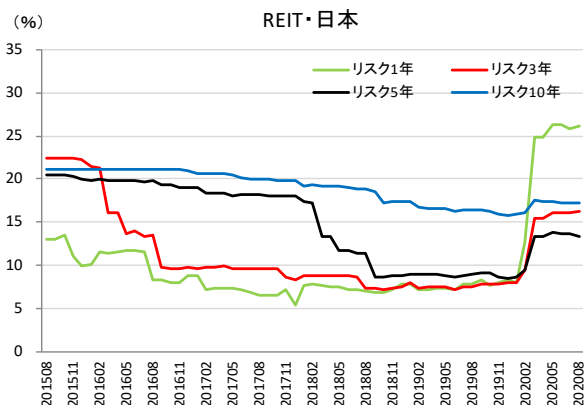
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

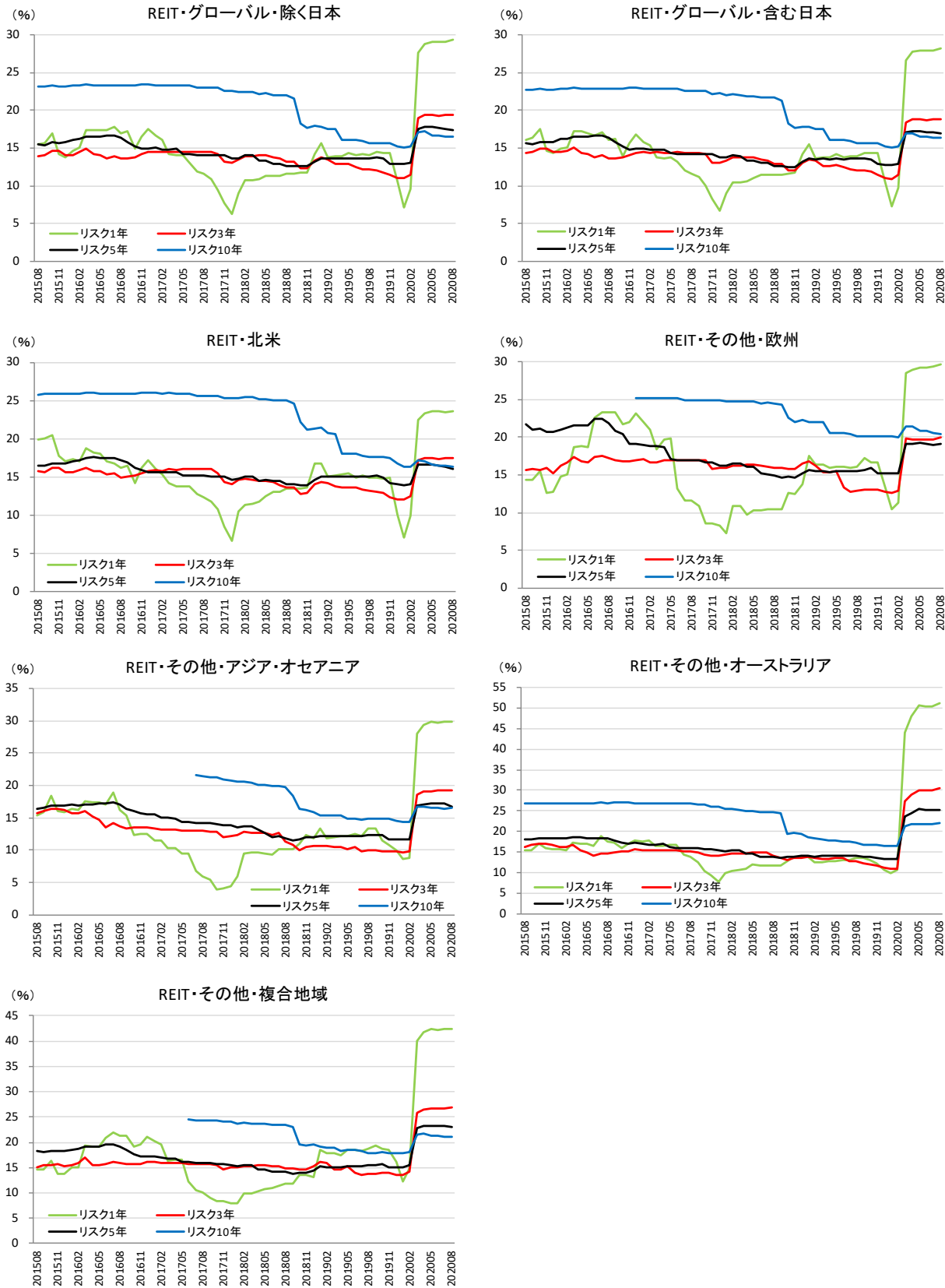


＜2＞リスク・サマリー

(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]

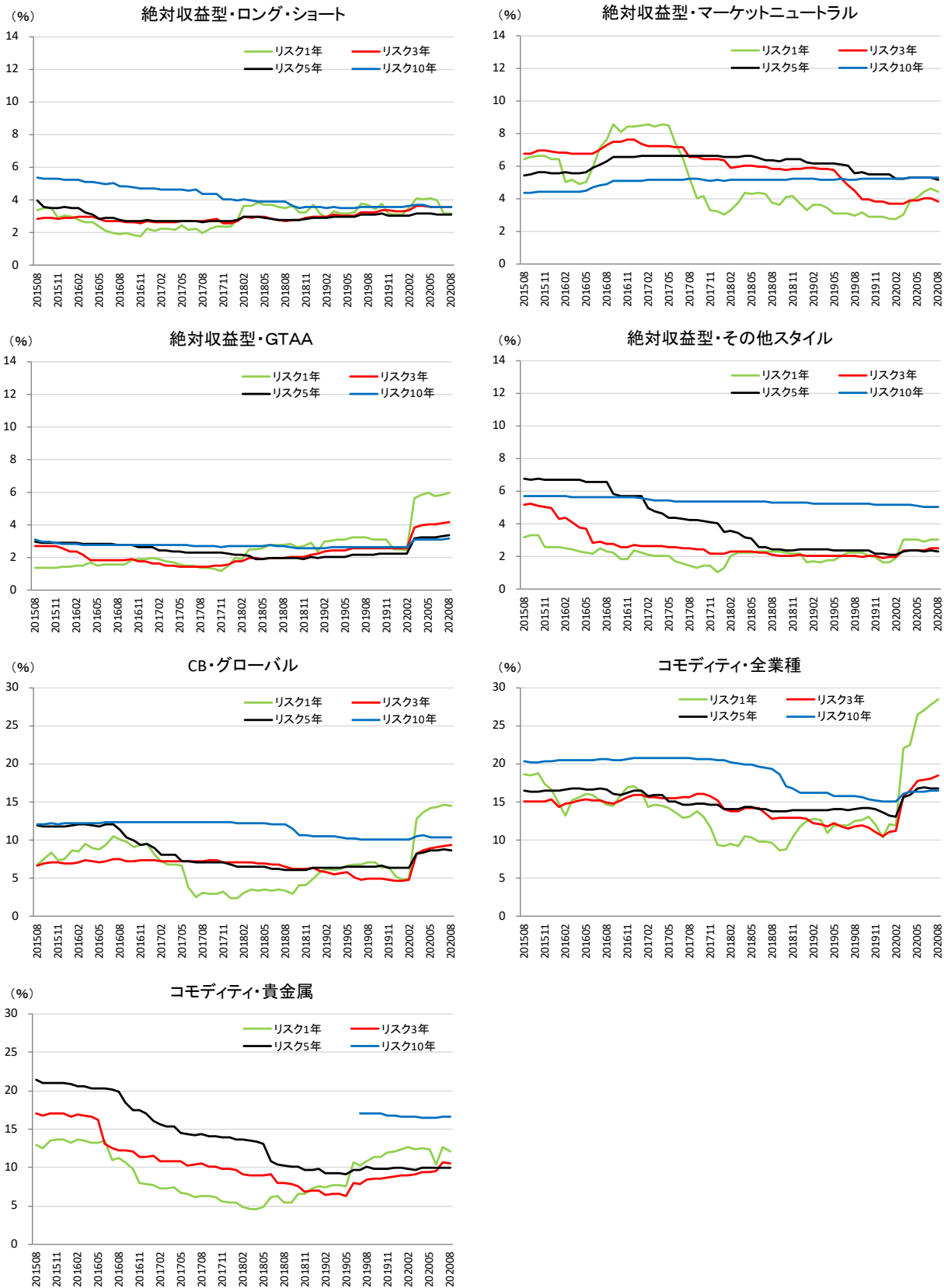


<2> リスク・サマリー

(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	1,088	4,858	10,970	10,752
国内株式	-2,039	-6,366	-6,010	-18,104
一般	-1,119	-3,301	-3,601	-10,177
フリー	-1,063	-3,154	-3,410	-9,365
バリュー	-56	-146	-191	-812
小型	-218	-1,005	-1,385	-3,127
その他	-696	-2,043	-1,006	-4,722
日経225	-552	-1,830	-703	-3,956
TOPIX	-115	-201	-395	-517
JPX日経400	-14	-36	-10	-190
国内債券	195	287	-60	794
一般	195	287	-60	794
外国株式(先進国)	3,617	9,849	16,719	21,200
グローバル	2,293	6,222	9,250	8,565
除く日本	126	771	2,195	4,380
含む日本	2,167	5,451	7,055	4,184
その他	1,324	3,627	7,469	12,636
北米	10	-24	-25	-38
米国	1,333	3,704	7,486	12,749
カナダ	-3	-10	-20	-78
欧州	10	-29	-41	-249
ドイツ	0	-1	-1	-3
イギリス	0	-2	-2	-6
アジア・オセアニア	-1	-7	-6	-21
オーストラリア	-24	-3	77	284
ニュージーランド	0	0	-1	-2
複合地域	0	0	1	0
エマージング株式	-255	-672	-1,093	-5,091
グローバル	-103	-346	-287	-1,247
BRICS	-4	-6	-12	-73
その他	-148	-320	-794	-3,771
欧州	-2	-2	-4	-27
ロシア	-1	0	3	-8
アジア・オセアニア	-27	7	-58	-675
中国	31	-79	-266	-936
インド	-129	-201	-394	-2,121
インドネシア	-4	-3	-4	-21
タイ	-1	-2	-3	-11
フィリピン	-1	-3	-5	-17
ベトナム	-23	-64	-98	33
韓国	0	0	0	-1
香港	1	0	2	2
台湾	0	0	0	0
中南米	0	-2	-2	-11
ブラジル	12	38	50	63
メキシコ	0	0	0	-3
中東・アフリカ	-3	-9	-11	-22
トルコ	0	-1	-4	-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	1,088	4,858	10,970	10,752
外国債券(先進国)	-309	-872	-3,043	-5,087
グローバル	-135	-322	-1,921	-3,241
除く日本	-33	-236	-1,143	-2,089
含む日本	-102	-86	-778	-1,152
その他	-175	-550	-1,122	-1,846
北米	0	-9	-12	-17
米国	45	31	-80	167
カナダ	-21	-50	-78	-257
欧州	-14	-26	-196	80
イギリス	0	-1	-2	-5
アジア・オセアニア	-28	-81	-126	-361
オーストラリア	-138	-366	-543	-1,249
ニュージーランド	-4	-10	-18	-34
複合地域	-12	-41	-98	-200
エマージング債券	-214	-692	-1,425	-2,625
グローバル	-85	-242	-506	-657
米ドル建て	-72	-215	-467	-615
現地通貨建て	-13	-27	-39	-42
その他	-129	-450	-919	-1,968
ロシア	-6	-16	-22	-82
アジア・オセアニア	-2	-10	-17	-44
インド	-73	-238	-408	-840
インドネシア	-5	-23	-37	-130
ブラジル	-32	-106	-196	-307
メキシコ	-7	-25	-36	-154
トルコ	-1	-4	-9	-36
複合地域	0	-1	-1	-4
ハイイールド債券	-163	-218	-430	-1,619
グローバル	-28	-63	-123	-218
北米	-90	-23	-55	-885
その他	-44	-133	-253	-515
欧州	-33	-108	-206	-414
アジア・オセアニア	-8	-19	-38	-74
複合地域	0	-1	-1	-3
複合資産	170	1,008	1,436	14,103
安定	408	1,015	484	2,892
安定成長	-22	222	593	3,230
成長	-6	102	491	760
国内バランス	-44	-29	-198	1,797
安定	-38	-12	-169	1,937
一般	-5	-14	-23	-100
その他	-167	-301	66	5,425

<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	1,088	4,858	10,970	10,752
国内REIT	17	716	1,854	1,961
日本	17	716	1,854	1,961
外国REIT	-23	778	1,685	3,818
グローバル	-48	357	817	1,728
除く日本	1	93	390	974
含む日本	-50	263	427	754
北米	75	563	1,033	2,209
その他	-50	-142	-166	-119
欧州	-2	-3	-4	-38
アジア・オセアニア	-45	-134	-168	-66
オーストラリア	-3	-5	7	17
複合地域	1	3	6	3
複数国	-1	-3	-7	-36
その他	94	1,041	1,339	1,402
絶対収益型	-3	212	75	715
ロング・ショート	4	-14	-46	52
マーケットニュートラル	-43	-61	-141	-269
GTAA	-3	-11	-10	-38
その他スタイル	38	265	239	936
CB	-1	628	601	349
アジア・オセアニア	0	-1	-2	-9
日本	-2	-4	-8	-17
グローバル	1	634	612	375
コモディティ	92	313	498	664
全業種	3	46	122	136
貴金属	108	337	257	400
エネルギー	-19	-71	118	123
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	650,819	100.00	5,373	100.00
国内株式	91,230	14.02	882	16.42
一般	53,381	8.20	575	10.70
フリー	42,237	6.49	459	8.54
バリュー	11,144	1.71	116	2.16
小型	7,722	1.19	96	1.79
その他	29,458	4.53	204	3.80
日経225	14,606	2.24	69	1.28
TOPIX	12,512	1.92	75	1.40
JPX日経400	686	0.11	20	0.37
国内債券	33,941	5.22	134	2.49
一般	33,941	5.22	134	2.49
外国株式(先進国)	195,545	30.05	1,021	19.00
グローバル	146,265	22.47	672	12.51
除く日本	32,456	4.99	181	3.37
含む日本	113,809	17.49	491	9.14
その他	49,280	7.57	349	6.50
北米	337	0.05	10	0.19
米国	42,429	6.52	239	4.45
カナダ	240	0.04	3	0.06
欧州	1,449	0.22	52	0.97
ドイツ	25	0.00	1	0.02
イギリス	11	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	4,696	0.72	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	26,396	4.06	343	6.38
グローバル	7,642	1.17	101	1.88
BRICS	610	0.09	7	0.13
その他	18,144	2.79	235	4.37
欧州	166	0.03	7	0.13
ロシア	109	0.02	4	0.07
アジア・オセアニア	5,680	0.87	103	1.92
中国	1,916	0.29	30	0.56
インド	8,126	1.25	30	0.56
インドネシア	135	0.02	5	0.09
タイ	64	0.01	4	0.07
フィリピン	52	0.01	5	0.09
ベトナム	962	0.15	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	53	0.01	2	0.04
ブラジル	655	0.10	16	0.30
メキシコ	14	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	124	0.02	8	0.15
トルコ	52	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	650,819	100.00	5,373	100.00
外国債券(先進国)	80,534	12.37	803	14.95
グローバル	59,427	9.13	518	9.64
除く日本	31,829	4.89	227	4.22
含む日本	27,599	4.24	291	5.42
その他	21,106	3.24	285	5.30
北米	82	0.01	6	0.11
米国	5,926	0.91	153	2.85
カナダ	1,147	0.18	6	0.11
欧州	1,595	0.25	36	0.67
イギリス	27	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	2,183	0.34	12	0.22
オーストラリア	8,497	1.31	40	0.74
ニュージーランド	150	0.02	14	0.26
複合地域	1,466	0.23	9	0.17
エマージング債券	14,946	2.30	287	5.34
グローバル	7,581	1.16	192	3.57
米ドル建て	5,872	0.90	150	2.79
現地通貨建て	1,709	0.26	42	0.78
その他	7,365	1.13	95	1.77
ロシア	148	0.02	5	0.09
アジア・オセアニア	398	0.06	11	0.20
インド	3,509	0.54	21	0.39
インドネシア	442	0.07	11	0.20
ブラジル	2,076	0.32	24	0.45
メキシコ	404	0.06	9	0.17
トルコ	108	0.02	5	0.09
複合地域	45	0.01	1	0.02
ハイイールド債券	18,739	2.88	305	5.68
グローバル	2,943	0.45	56	1.04
北米	12,592	1.93	161	3.00
その他	3,204	0.49	88	1.64
欧州	2,483	0.38	48	0.89
アジア・オセアニア	629	0.10	30	0.56
複合地域	44	0.01	1	0.02
複合資産	108,203	16.63	976	18.16
安定	29,389	4.52	285	5.30
安定成長	47,113	7.24	402	7.48
成長	13,957	2.14	244	4.54
国内バランス	10,214	1.57	32	0.60
安定	9,718	1.49	8	0.15
一般	408	0.06	19	0.35
その他	7,529	1.16	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	650,819	100.00		5,373	100.00
国内REIT	25,645	3.94		123	2.29
日本	25,645	3.94		123	2.29
外国REIT	40,834	6.27		285	5.30
グローバル	16,220	2.49		135	2.51
除く日本	3,875	0.60		50	0.93
含む日本	12,345	1.90		85	1.58
北米	20,630	3.17		82	1.53
その他	3,984	0.61		68	1.27
欧州	206	0.03		17	0.32
アジア・オセアニア	2,818	0.43		34	0.63
オーストラリア	672	0.10		13	0.24
複合地域	41	0.01		3	0.06
複数国	247	0.04		1	0.02
その他	14,807	2.28		214	3.98
絶対収益型	7,916	1.22		99	1.84
ロング・ショート	965	0.15		34	0.63
マーケットニュートラル	924	0.14		15	0.28
GTAA	406	0.06		12	0.22
その他スタイル	5,586	0.86		37	0.69
CB	1,942	0.30		43	0.80
アジア・オセアニア	34	0.01		1	0.02
日本	50	0.01		3	0.06
グローバル	1,859	0.29		39	0.73
コモディティ	2,836	0.44		28	0.52
全業種	892	0.14		14	0.26
貴金属	1,739	0.27		12	0.22
エネルギー	193	0.03		1	0.02
その他コモディティ	11	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	11,689	8.7	3.46	3.91	1.281
国内株式	14,492	11.7	1.08	1.10	1.144
一般	13,209	11.4	1.23	1.36	1.422
フリー	13,067	10.9	1.35	1.51	1.467
バリュー	13,771	13.5	0.77	0.75	1.251
小型	20,974	11.9	2.16	1.77	1.728
その他	15,133	12.3	0.53	0.49	0.475
日経225	16,148	13.6	0.56	0.50	0.566
TOPIX	15,680	13.9	0.35	0.33	0.317
JPX日経400	13,592	6.0	0.18	0.17	0.543
国内債券	10,961	10.8	0.31	0.32	0.357
一般	10,961	10.8	0.31	0.32	0.357
外国株式(先進国)	13,313	6.8	4.25	4.30	1.561
グローバル	13,956	7.0	3.26	3.38	1.553
除く日本	16,664	9.3	0.66	0.67	0.719
含む日本	12,957	6.2	4.07	4.22	1.791
その他	12,075	6.5	7.36	7.17	1.583
北米	12,129	7.2	6.71	6.19	1.904
米国	13,091	5.8	6.48	5.53	1.549
カナダ	6,681	8.5	10.97	12.76	1.992
欧州	11,488	9.1	3.03	3.18	1.658
ドイツ	10,983	6.4	0.00	0.00	0.770
イギリス	4,344	6.3	15.60	21.25	1.947
アジア・オセアニア	8,292	6.4	4.92	4.86	1.694
オーストラリア	7,519	6.1	15.53	21.18	1.826
ニュージーランド	15,056	8.1	3.11	2.66	1.672
複合地域	4,918	7.3	0.00	0.00	1.705
エマージング株式	12,186	9.3	2.89	3.27	1.777
グローバル	11,091	7.2	1.46	1.56	1.381
BRICS	13,984	14.3	1.19	1.11	2.069
その他	12,602	10.1	3.57	4.08	1.933
欧州	8,233	14.3	0.14	0.15	1.971
ロシア	9,716	11.3	2.14	2.16	2.009
アジア・オセアニア	13,426	10.3	7.28	7.50	1.741
中国	22,522	9.7	2.17	1.64	1.946
インド	11,102	10.3	1.46	1.50	2.072
インドネシア	8,273	10.2	0.33	0.41	1.857
タイ	8,804	12.3	0.71	0.90	1.698
フィリピン	8,155	7.0	0.52	0.71	1.790
ベトナム	9,990	4.5	0.50	0.60	1.875
韓国	12,111	1.7	0.00	0.00	1.804
香港	13,811	11.0	1.87	1.88	0.858
台湾	11,922	7.8	0.00	0.00	1.661
中南米	6,077	13.6	0.00	0.00	2.042
ブラジル	4,341	10.4	11.09	23.67	1.933
メキシコ	5,942	7.5	0.00	0.00	1.929
中東・アフリカ	8,624	9.7	0.82	0.75	2.057
トルコ	4,989	14.1	0.00	0.00	2.033
複合地域	17,949	12.3	3.21	3.06	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	11,689	8.7	3.46	3.91	1.281
外国債券(先進国)	9,945	8.6	2.46	2.55	1.102
グローバル	10,563	8.8	1.76	1.81	1.035
除く日本	11,453	11.1	1.67	1.67	0.810
含む日本	9,868	7.1	1.88	1.98	1.295
その他	8,822	8.1	4.39	4.61	1.289
北米	10,296	6.3	2.15	2.28	1.798
米国	9,350	6.9	4.88	5.84	1.349
カナダ	7,612	8.1	3.61	3.61	1.376
欧州	8,584	10.1	1.25	1.28	1.050
イギリス	7,871	5.7	3.48	3.29	1.261
アジア・オセアニア	7,962	9.8	3.20	3.08	1.420
オーストラリア	7,970	11.3	5.32	5.25	1.260
ニュージーランド	9,582	5.9	2.12	1.98	1.345
複合地域	5,027	10.8	3.13	3.07	1.192
エマージング債券	8,242	9.0	6.27	7.19	1.589
グローバル	8,591	9.7	5.37	6.23	1.555
米ドル建て	8,724	10.0	5.43	6.38	1.614
現地通貨建て	8,119	8.6	5.18	5.73	1.353
その他	7,535	7.6	7.19	8.17	1.624
ロシア	7,665	7.5	6.23	7.08	1.606
アジア・オセアニア	9,403	7.4	10.70	11.91	1.634
インド	8,854	5.7	7.27	7.62	1.701
インドネシア	6,811	8.0	7.28	7.66	1.665
ブラジル	6,710	10.7	7.18	9.53	1.588
メキシコ	6,054	7.7	6.14	6.48	1.398
トルコ	2,866	7.5	9.55	11.11	1.453
複合地域	3,758	14.0	4.01	4.26	1.210
ハイイールド債券	8,132	9.1	8.21	9.43	1.692
グローバル	7,245	8.5	6.48	7.31	1.578
北米	8,932	10.3	8.14	9.24	1.698
その他	7,234	7.3	10.06	12.09	1.770
欧州	6,662	7.4	10.47	12.79	1.746
アジア・オセアニア	7,695	8.3	9.38	10.55	1.879
複合地域	4,395	16.4	5.48	5.46	1.800
複合資産	11,822	8.2	1.54	1.63	1.037
安定	11,111	7.9	1.01	1.02	1.123
安定成長	11,519	8.7	2.05	2.18	1.080
成長	13,310	8.3	0.48	0.56	0.892
国内バランス	10,958	8.7	2.12	2.32	0.940
安定	10,622	10.2	2.15	2.37	0.920
一般	11,373	9.3	1.15	1.17	1.352
その他	10,968	0.9	1.57	1.62	0.833

(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	11,689	8.7	3.46	3.91	1.281
国内REIT	12,335	8.7	8.50	11.35	0.952
日本	12,335	8.7	8.50	11.35	0.952
外国REIT	9,482	7.5	9.99	13.24	1.551
グローバル	10,166	8.1	7.44	10.22	1.395
除く日本	11,628	6.6	6.21	9.71	1.074
含む日本	9,306	9.0	7.83	10.38	1.496
北米	8,731	7.6	12.36	16.18	1.629
その他	9,029	6.4	8.10	10.25	1.784
欧州	7,955	6.0	5.81	6.95	1.807
アジア・オセアニア	10,476	6.3	9.70	12.30	1.824
オーストラリア	7,660	5.7	4.59	5.89	1.712
複合地域	4,863	8.6	1.37	1.62	0.837
複数国	8,408	16.3	2.51	2.85	1.650
その他					
絶対収益型	10,206	5.5	0.09	0.09	1.683
ロング・ショート	10,415	4.9	0.54	0.57	1.480
マーケットニュートラル	10,563	5.1	0.08	0.09	1.235
GTAA	10,874	6.8	0.11	0.11	1.546
その他スタイル	9,646	6.0	0.01	0.01	1.805
CB	11,255	6.8	3.35	3.02	1.329
アジア・オセアニア	8,347	10.2	3.13	2.88	1.823
日本	10,818	9.3	0.22	0.22	1.006
グローバル	11,363	6.5	3.49	3.15	1.329
コモディティ	8,817	6.9	0.00	0.00	0.948
全業種	5,119	9.0	0.00	0.00	1.438
貴金属	13,238	4.2	0.00	0.00	0.686
エネルギー	6,627	11.5	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	9,720	3.9	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