

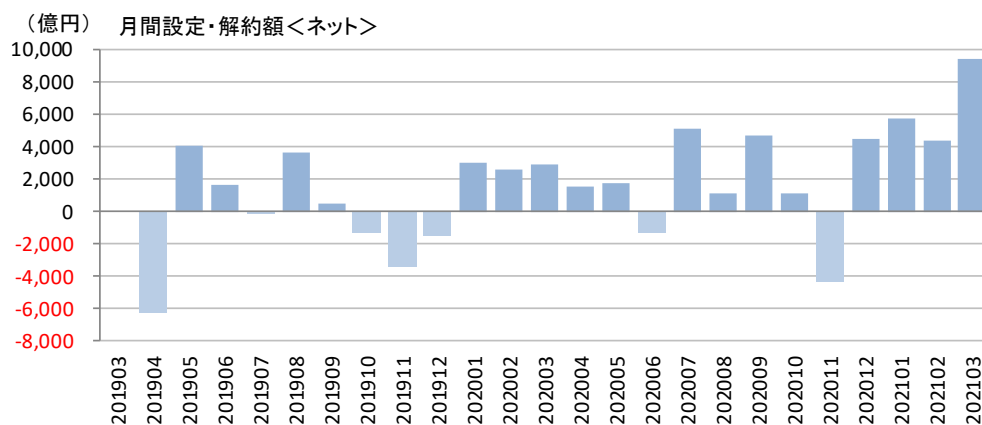
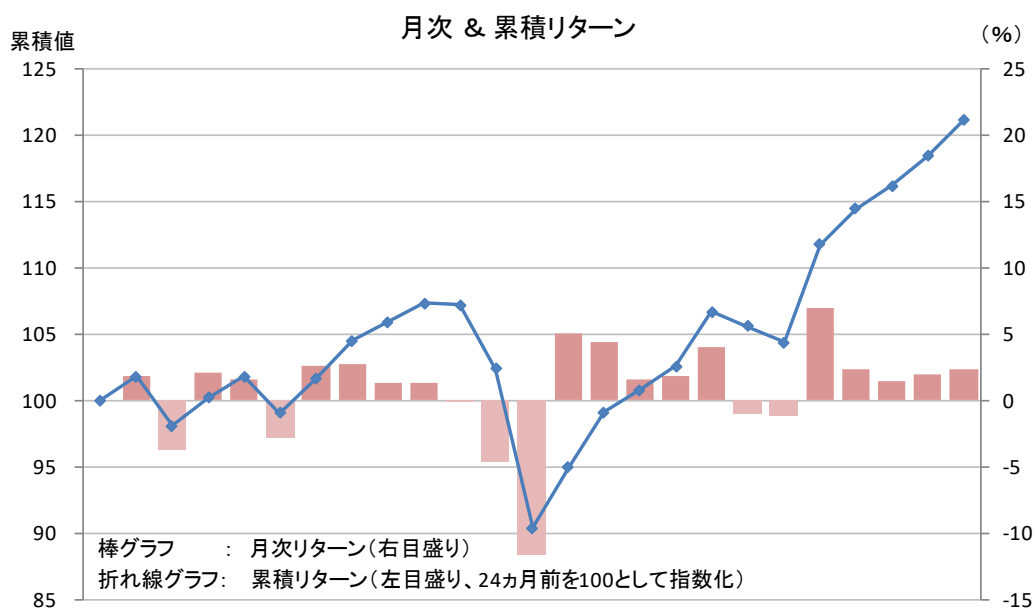
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2021年3月

「総合」 +2.30 %
(前月 +1.95 %)



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		15,367	15,022	345	2.30
国内株式		20,004	19,128	877	4.58
一般		19,364	18,436	928	5.03
フリー		18,408	17,610	798	4.53
バリュー		23,871	22,342	1,529	6.84
小型		43,729	41,414	2,314	5.59
その他		19,692	19,005	686	3.61
日経225		19,508	19,270	238	1.24
TOPIX		18,761	17,754	1,007	5.67
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	17,787	16,898	889	5.26
国内債券		13,177	13,097	80	0.61
一般		13,177	13,097	80	0.61
外国株式(先進国)		20,061	19,739	322	1.63
グローバル		22,505	22,315	190	0.85
除く日本		29,695	28,122	1,573	5.59
含む日本		20,882	20,963	-80	-0.38
その他		15,037	14,441	597	4.13
北米		15,875	14,498	1,377	9.50
米国		23,281	22,334	947	4.24
カナダ	10,000 (2009.02.27)	18,728	18,005	723	4.02
欧州		21,529	20,645	884	4.28
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	10,722	9,880	842	8.53
イギリス	9,683 (2014.05.30)	8,820	8,494	327	3.85
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	40,317	39,476	841	2.13
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	16,900	16,460	440	2.68
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	42,909	42,497	412	0.97
複合地域	10,000 (2013.04.30)	7,410	6,913	497	7.18
エマージング株式		18,135	18,130	5	0.03
グローバル		18,997	18,994	3	0.02
BRICS	10,000 (2005.09.30)	27,766	27,517	248	0.90
その他		18,394	18,393	1	0.01
欧州		25,102	24,679	423	1.71
ロシア	10,000 (2007.03.30)	11,789	11,119	670	6.02
アジア・オセアニア		19,700	19,976	-275	-1.38
中国		50,526	53,222	-2,696	-5.07
インド	10,000 (2004.09.30)	38,999	38,104	895	2.35
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	12,441	12,749	-308	-2.42
タイ		21,464	20,159	1,304	6.47
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,095	6,984	111	1.58
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	17,927	17,039	889	5.21
韓国	10,000 (1997.06.30)	35,472	34,044	1,427	4.19
香港		24,932	25,189	-257	-1.02
台湾	10,000 (2008.03.31)	24,216	24,516	-301	-1.23
中南米	7,427 (2006.04.28)	7,891	7,615	276	3.62
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	7,482	7,330	152	2.07
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	9,298	8,358	940	11.25
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	10,642	9,987	655	6.56
トルコ		19,589	22,381	-2,792	-12.47
複合地域	10,000 (2005.08.31)	25,047	25,390	-343	-1.35

※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		15,367	15,022	345	2.30
外国債券(先進国)		18,704	18,498	206	1.11
グローバル		18,882	18,708	174	0.93
除く日本		20,410	20,155	255	1.27
含む日本		17,938	17,837	101	0.57
その他		18,217	17,918	299	1.67
北米	9,052 (2013.05.31)	10,913	10,849	64	0.59
米国		16,272	15,775	497	3.15
カナダ	10,000 (2003.05.30)	15,118	14,516	601	4.14
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,575	15,515	60	0.39
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,443	10,218	225	2.20
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	20,635	20,434	201	0.98
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	25,317	25,084	234	0.93
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,715	11,706	9	0.08
複合地域	10,000 (2001.11.30)	18,643	18,529	115	0.62
グローバル	10,000 (2015.10.30)	9,725	9,560	165	1.72
エマージング債券		16,511	16,495	17	0.10
グローバル		17,906	18,062	-155	-0.86
米ドル建て		18,477	18,626	-148	-0.80
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,440	12,574	-134	-1.06
その他	8,647 (2005.03.31)	12,105	11,965	140	1.17
ロシア	10,000 (2008.05.30)	10,215	10,050	164	1.64
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	15,101	14,843	258	1.74
インド	10,000 (2011.08.31)	17,196	16,605	590	3.55
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	14,279	14,204	76	0.53
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	9,407	9,621	-214	-2.23
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	12,417	12,138	278	2.29
トルコ	10,000 (2011.04.28)	4,189	5,169	-980	-18.96
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,550	10,462	88	0.84
ハイイールド債券		22,699	22,236	463	2.08
グローバル	10,000 (1997.06.30)	22,592	22,374	218	0.97
北米		22,191	21,558	632	2.93
その他	10,000 (2004.03.31)	22,544	22,627	-83	-0.37
欧州	10,000 (2006.04.28)	22,493	22,694	-200	-0.88
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,828	14,622	206	1.41
複合地域	10,000 (2004.03.31)	21,346	20,962	384	1.83
複合資産		18,676	18,241	435	2.38
安定	10,000 (1998.10.30)	16,218	15,990	228	1.42
安定成長		20,213	19,708	505	2.56
成長		23,971	23,096	875	3.79
国内バランス		12,922	12,673	249	1.97
安定		13,160	12,917	243	1.88
一般		16,189	15,638	551	3.52
その他	10,000 (2018.10.31)	14,168	13,706	462	3.37

※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		15,367	15,022	345	2.30	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	34,728	33,252	1,476	4.44	
日本	10,000 (2003.10.31)	34,728	33,252	1,476	4.44	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	27,673	25,885	1,787	6.91	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	23,714	22,341	1,373	6.15	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	26,191	24,712	1,479	5.99	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	23,640	22,259	1,381	6.20	
北米	10,000 (2003.09.30)	27,951	25,875	2,076	8.02	
その他	10,000 (2004.04.30)	27,901	26,762	1,139	4.26	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,530	5,369	161	3.00	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	20,889	20,089	800	3.98	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	14,983	14,357	626	4.36	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	6,285	5,939	346	5.83	
複数国	10,000 (2004.04.30)	38,173	35,564	2,608	7.33	
その他		6,377	6,434	-58	-0.90	
絶対収益型		7,830	7,860	-29	-0.37	
ロング・ショート		8,530	8,564	-34	-0.40	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	12,146	12,229	-83	-0.68	
GTAA		11,591	11,466	125	1.09	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,344	7,374	-30	-0.40	
CB		21,412	21,733	-321	-1.48	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	19,674	19,158	516	2.69	
日本		20,620	20,484	136	0.66	
グローバル		37,599	38,219	-620	-1.62	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	8,614	8,812	-199	-2.26	
全業種	10,000 (2004.12.30)	6,731	6,758	-27	-0.40	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	16,601	17,206	-605	-3.52	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	4,615	4,544	70	1.55	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	10,158	10,014	144	1.44	

※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	5.87	14.71	33.96	5.87
国内株式	7.41	20.46	49.87	7.41
一般	7.39	19.39	48.22	7.39
フリー	6.41	18.29	49.69	6.41
バリュー	11.02	23.45	42.31	11.02
小型	5.07	13.46	63.07	5.07
その他	8.08	24.15	49.02	8.08
日経225	6.84	26.52	55.75	6.84
TOPIX	9.19	21.37	41.75	9.19
JPX日経400	8.63	21.50	42.20	8.63
国内債券	-0.47	-0.37	-0.44	-0.47
一般	-0.47	-0.37	-0.44	-0.47
外国株式(先進国)	6.72	20.69	58.72	6.72
グローバル	6.29	21.20	60.21	6.29
除く日本	11.88	24.97	57.08	11.88
含む日本	4.84	20.22	61.26	4.84
その他	8.17	19.34	54.59	8.17
北米	19.34	36.24	73.50	19.34
米国	7.88	18.29	53.60	7.88
カナダ	10.06	21.98	52.02	10.06
欧州	7.75	19.16	45.36	7.75
ドイツ	11.06	21.44	63.26	11.06
イギリス	11.56	25.50	32.38	11.56
アジア・オセアニア	9.96	21.20	49.27	9.96
オーストラリア	10.96	30.02	68.45	10.96
ニュージーランド	-1.26	18.98	50.11	-1.26
複合地域	33.52	54.34	65.97	33.52
エマージング株式	10.97	29.45	64.91	10.97
グローバル	10.74	28.43	64.23	10.74
BRICS	8.61	29.54	62.22	8.61
その他	11.15	29.87	65.26	11.15
欧州	4.91	22.88	41.95	4.91
ロシア	10.45	29.99	56.26	10.45
アジア・オセアニア	11.39	28.21	57.04	11.39
中国	6.12	17.48	51.96	6.12
インド	15.74	36.58	79.56	15.74
インドネシア	-0.11	29.54	55.61	-0.11
タイ	11.15	26.15	45.97	11.15
フィリピン	-2.74	16.58	32.50	-2.74
ベトナム	14.21	37.08	89.61	14.21
韓国	8.97	29.14	117.18	8.97
香港	14.86	28.02	27.64	14.86
台湾	17.09	33.85	76.85	17.09
中南米	-1.20	32.92	54.56	-1.20
ブラジル	-7.45	21.36	35.45	-7.45
メキシコ	9.33	42.79	62.73	9.33
中東・アフリカ	15.05	30.50	57.34	15.05
トルコ	-9.19	18.67	21.73	-9.19
複合地域	13.64	27.02	53.90	13.64

※[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	5.87	14.71	33.96	5.87
外国債券(先進国)	1.00	2.96	9.69	1.00
グローバル	0.05	1.67	6.83	0.05
除く日本	0.28	1.44	5.96	0.28
含む日本	-0.18	1.97	7.88	-0.18
その他	3.87	6.91	18.48	3.87
北米	-0.29	1.51	9.76	-0.29
米国	5.09	5.94	12.84	5.09
カナダ	5.99	8.04	14.60	5.99
欧州	-1.16	0.60	5.87	-1.16
イギリス	6.68	10.18	15.50	6.68
アジア・オセアニア	4.55	9.07	25.85	4.55
オーストラリア	4.10	8.74	25.82	4.10
ニュージーランド	0.16	3.42	17.30	0.16
複合地域	1.10	4.01	9.74	1.10
グローバル	2.43	9.92	12.08	2.43
エマージング債券	-0.57	5.64	12.50	-0.57
グローバル	-1.66	5.65	16.16	-1.66
米ドル建て	-1.67	5.60	17.14	-1.67
現地通貨建て	-1.65	5.83	12.42	-1.65
その他	0.66	5.68	9.29	0.66
ロシア	1.01	9.04	13.57	1.01
アジア・オセアニア	3.15	4.89	13.96	3.15
インド	6.44	8.10	17.32	6.44
インドネシア	0.76	9.77	27.61	0.76
ブラジル	-8.15	0.07	-7.68	-8.15
メキシコ	-2.22	11.38	26.36	-2.22
トルコ	-15.66	-10.53	-22.76	-15.66
複合地域	-0.90	4.61	12.30	-0.90
ハイイールド債券	5.66	12.26	26.42	5.66
グローバル	3.15	10.35	23.89	3.15
北米	6.86	12.90	26.78	6.86
その他	3.19	11.44	27.13	3.19
欧州	2.83	11.80	27.79	2.83
アジア・オセアニア	4.45	10.04	24.53	4.45
複合地域	4.26	9.54	24.62	4.26
複合資産	3.72	8.39	17.47	3.72
安定	1.59	4.26	10.21	1.59
安定成長	4.45	9.59	19.43	4.45
成長	7.07	15.45	32.17	7.07
国内バランス	2.05	3.32	3.98	2.05
安定	1.83	2.86	3.06	1.83
一般	5.81	12.19	23.99	5.81
その他	3.57	12.06	30.42	3.57

※[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	5.87	14.71	33.96	5.87
国内REIT	14.02	18.38	30.64	14.02
日本	14.02	18.38	30.64	14.02
外国REIT	14.69	22.59	35.56	14.69
グローバル	13.36	23.88	37.03	13.36
除く日本	13.57	25.48	40.70	13.57
含む日本	13.28	23.36	35.89	13.28
北米	17.44	22.99	33.02	17.44
その他	6.41	15.21	42.84	6.41
欧州	3.94	17.99	29.20	3.94
アジア・オセアニア	6.39	12.66	38.07	6.39
オーストラリア	3.37	20.71	75.35	3.37
複合地域	7.01	28.21	47.69	7.01
複数国	17.35	24.37	35.29	17.35
その他	0.61	5.28	15.48	0.61
絶対収益型	-0.21	1.01	3.49	-0.21
ロング・ショート	-1.84	-2.02	-2.02	-1.84
マーケットニュートラル	-2.50	-2.63	4.89	-2.50
GTAA	2.45	6.31	11.94	2.45
その他スタイル	0.17	1.62	3.42	0.17
CB	2.58	10.18	28.61	2.58
アジア・オセアニア	15.28	25.50	46.99	15.28
日本	2.11	3.99	9.62	2.11
グローバル	2.34	10.06	29.01	2.34
コモディティ	0.28	2.38	17.24	0.28
全業種	16.47	25.74	40.17	16.47
貴金属	-8.65	-9.89	3.29	-8.65
エネルギー	31.10	46.83	71.56	31.10
その他コモディティ	13.38	22.54	43.97	13.38

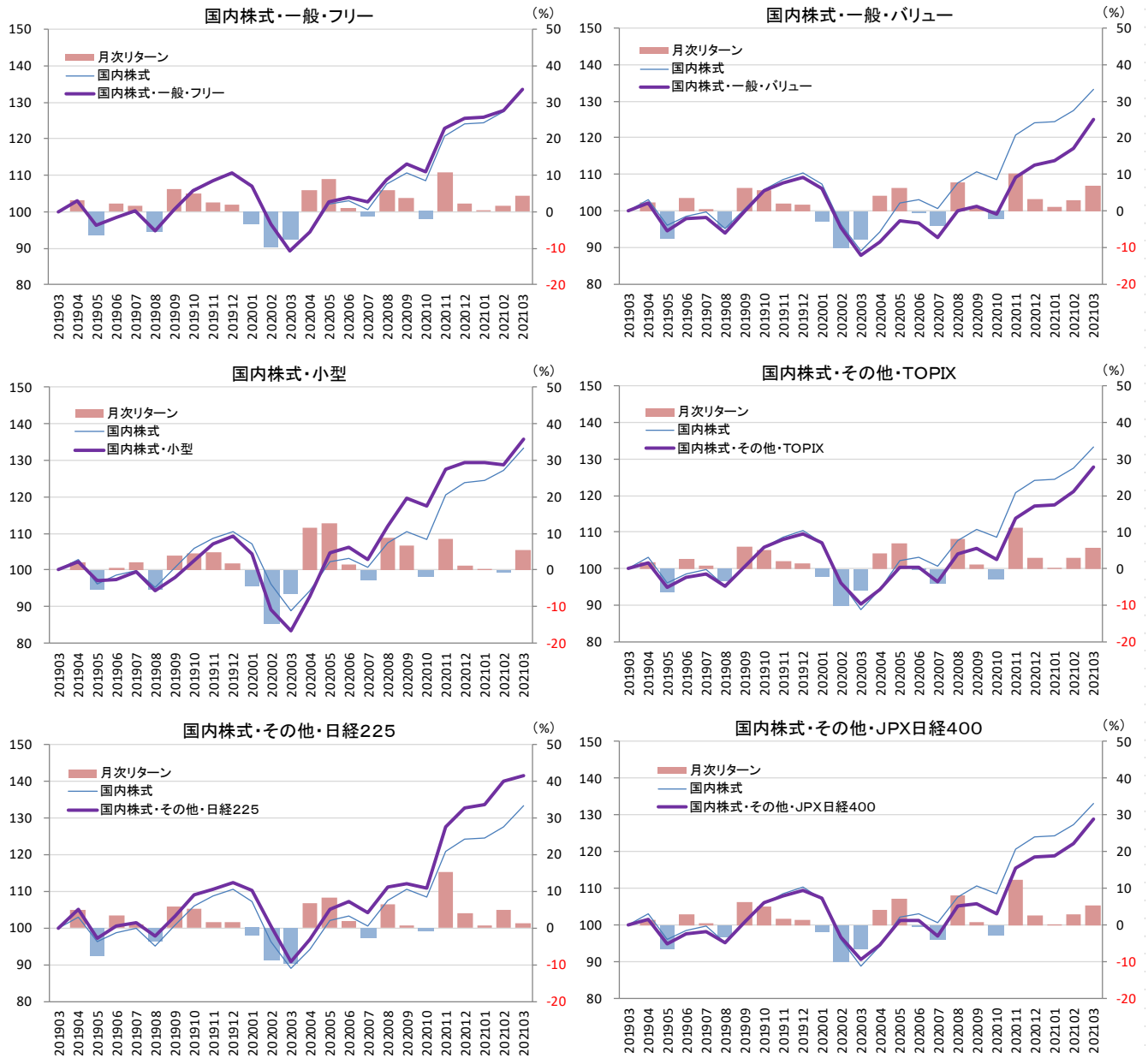
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

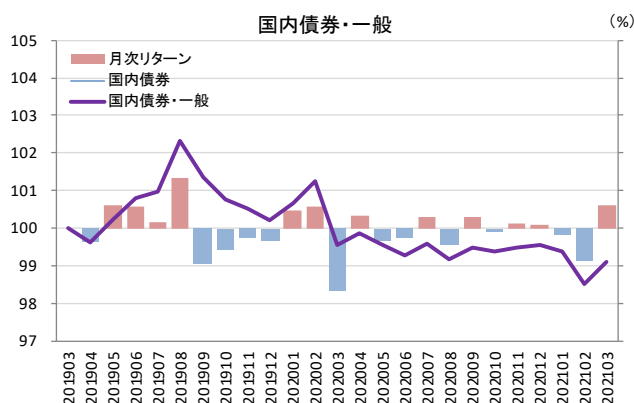
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

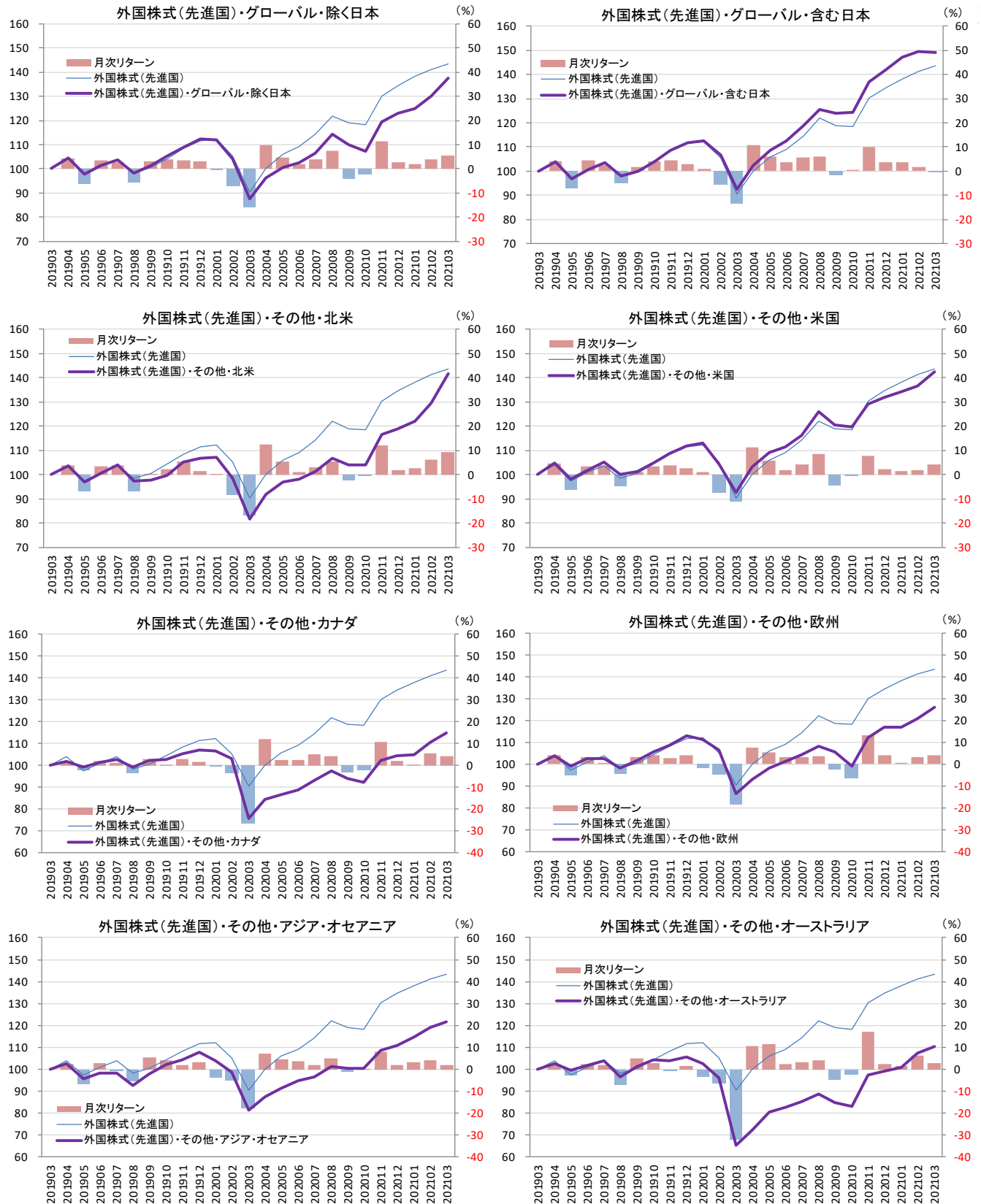


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24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)]

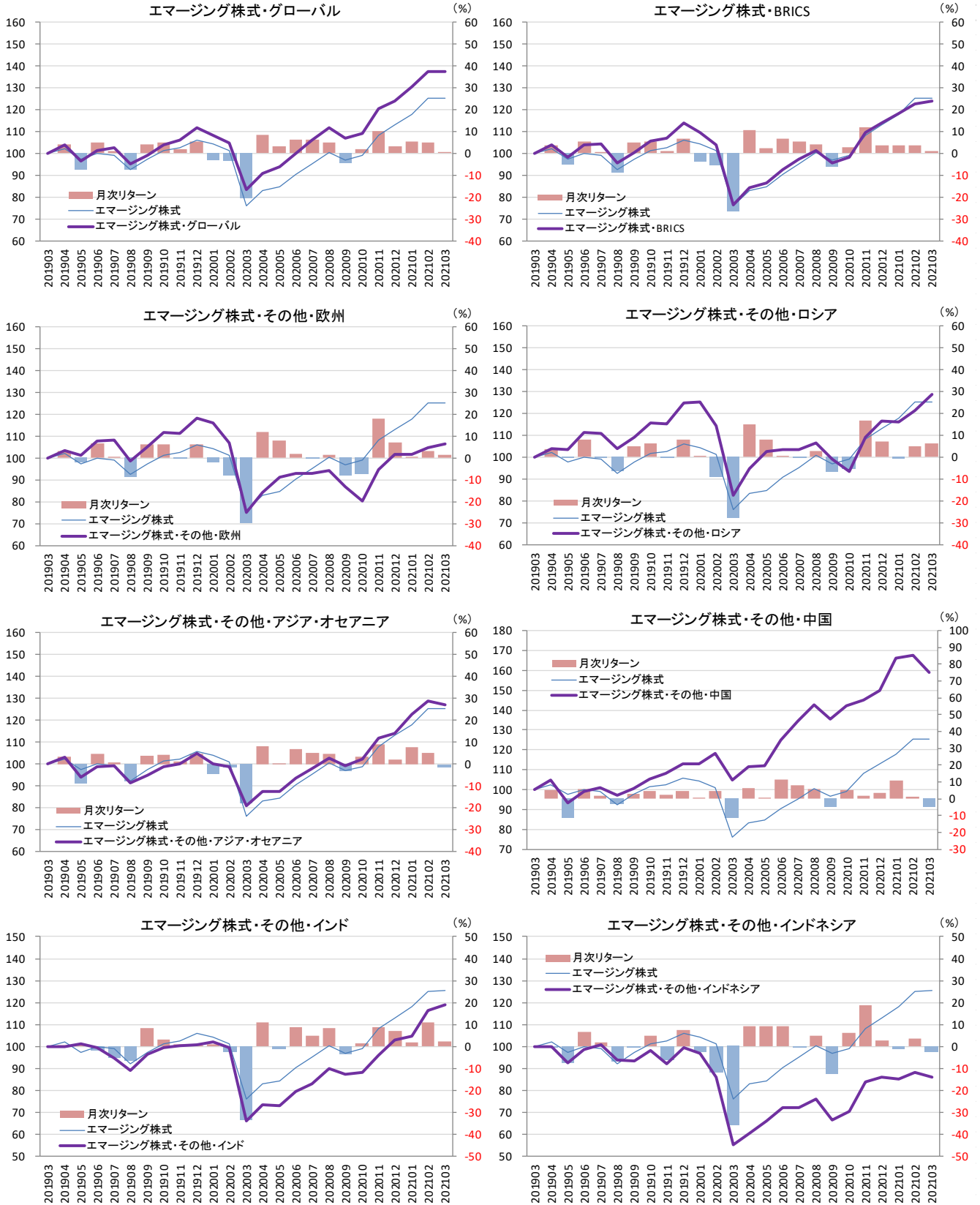


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

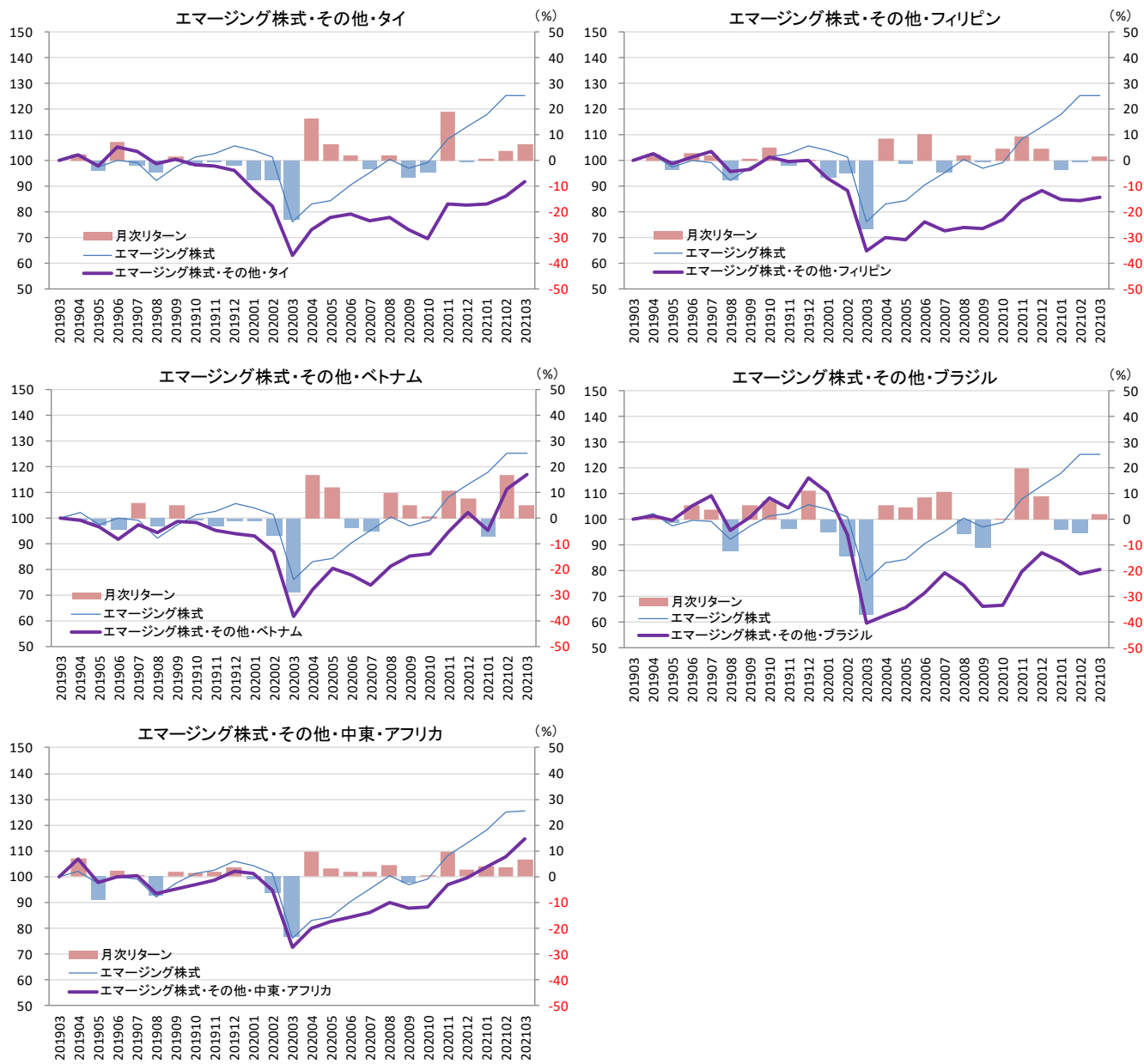


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

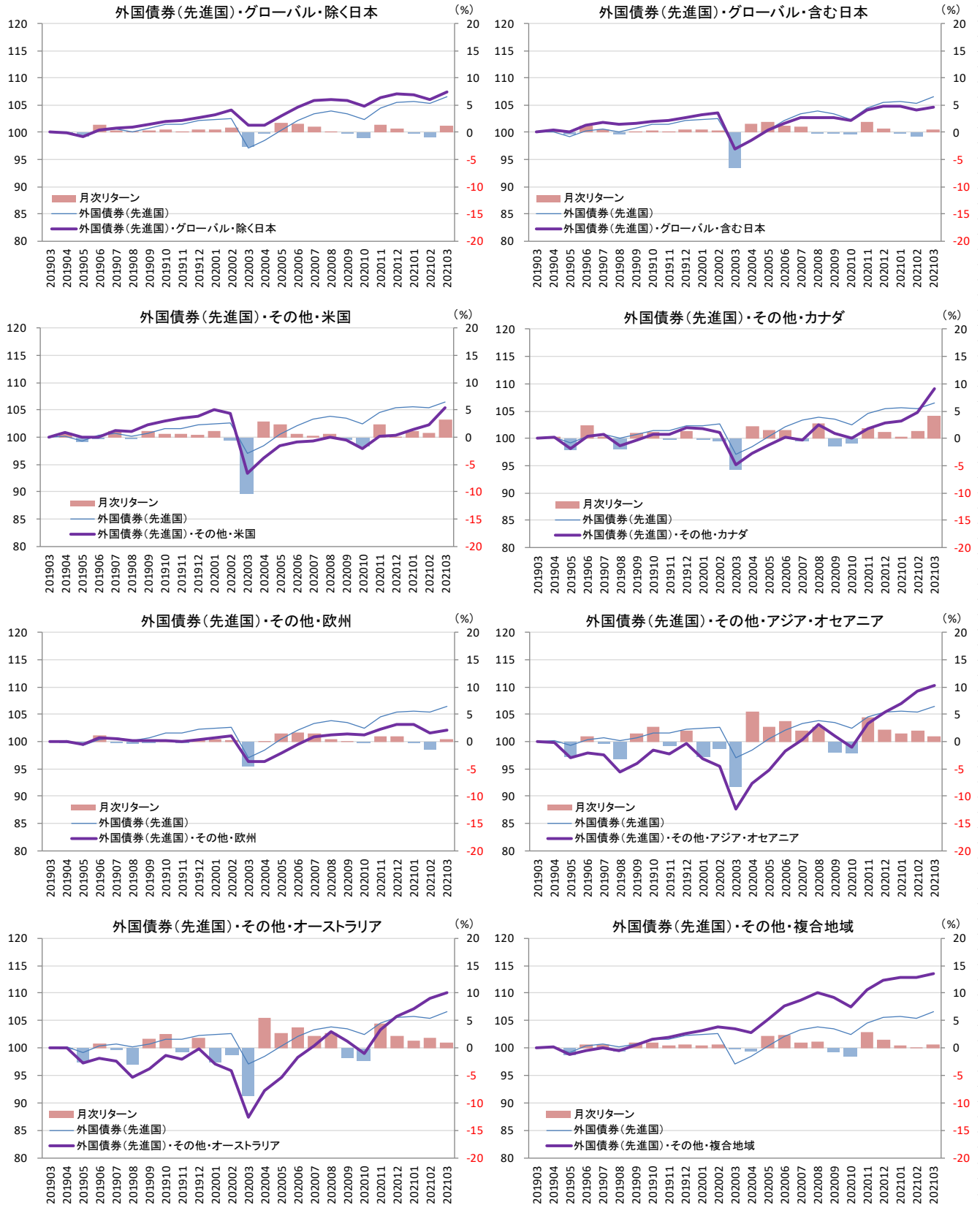


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

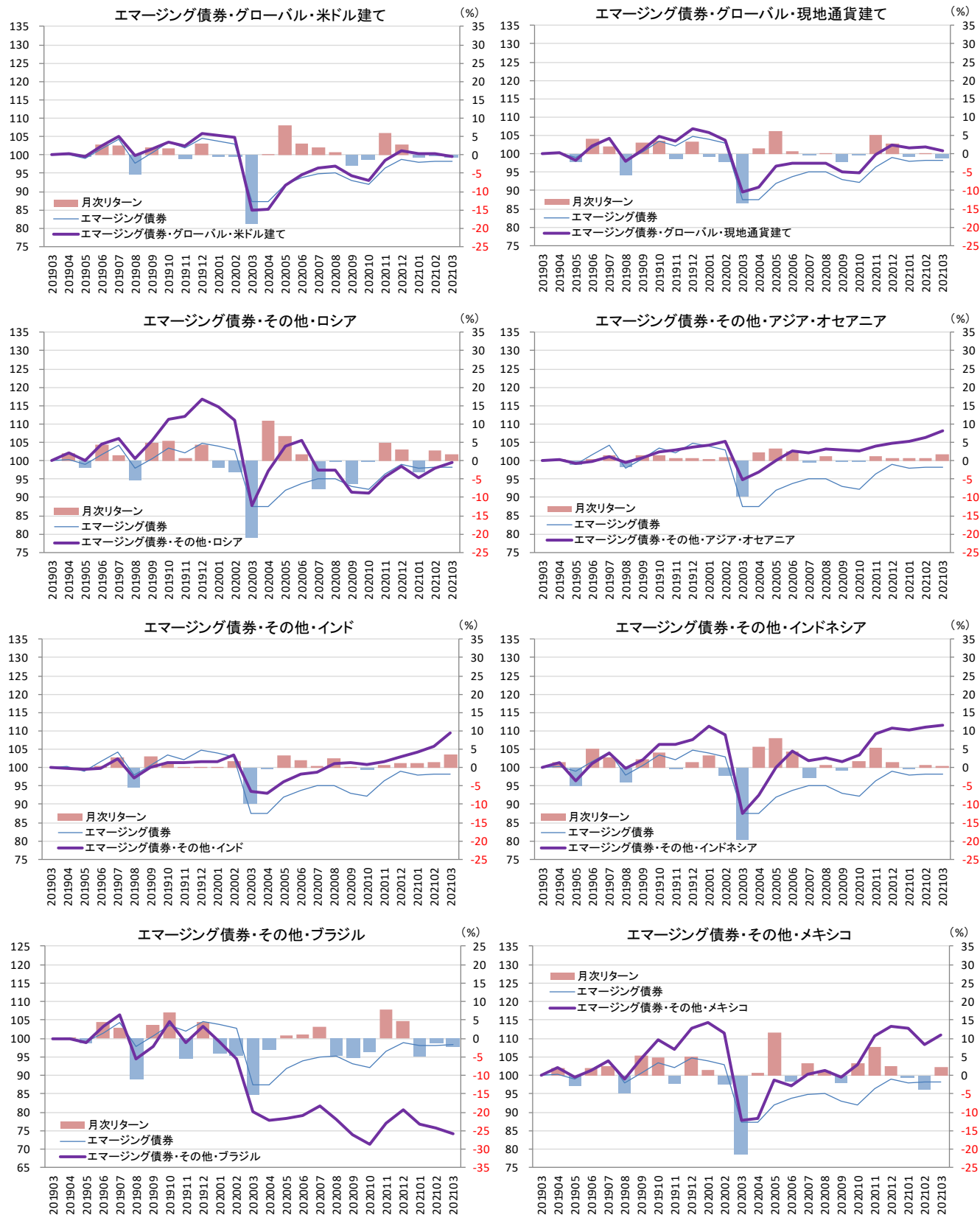


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

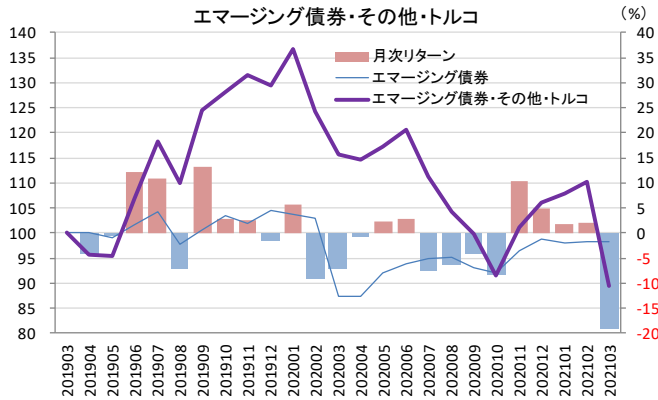


<1>パフォーマンス・サマリー

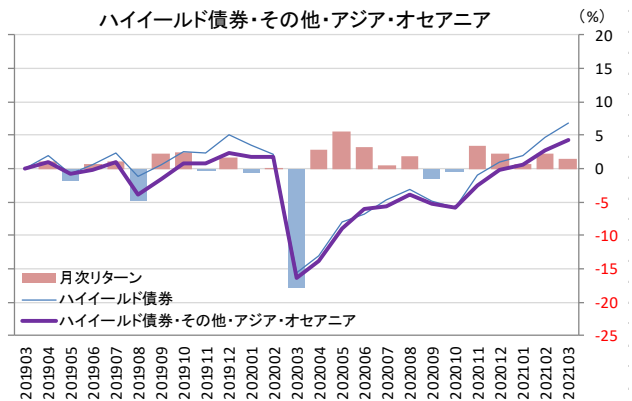
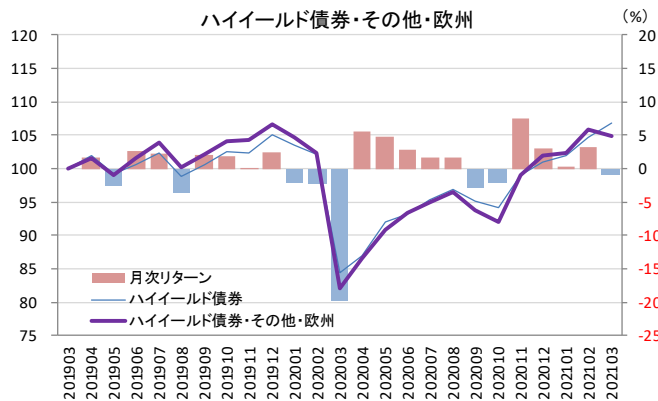
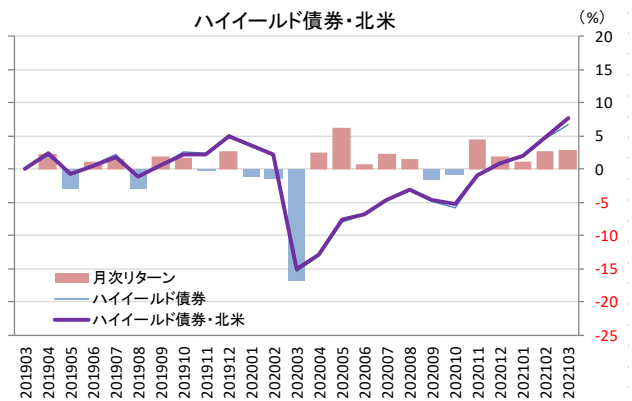
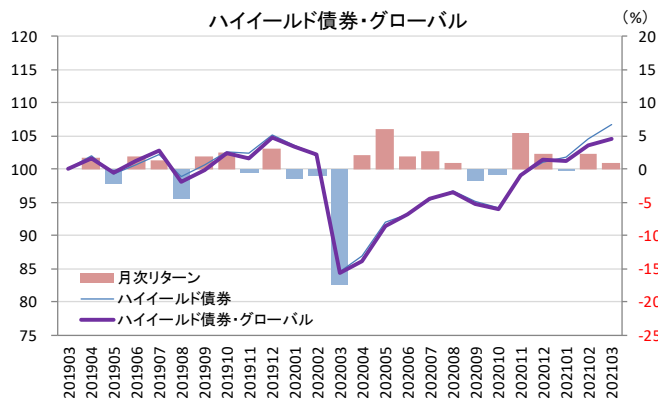
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

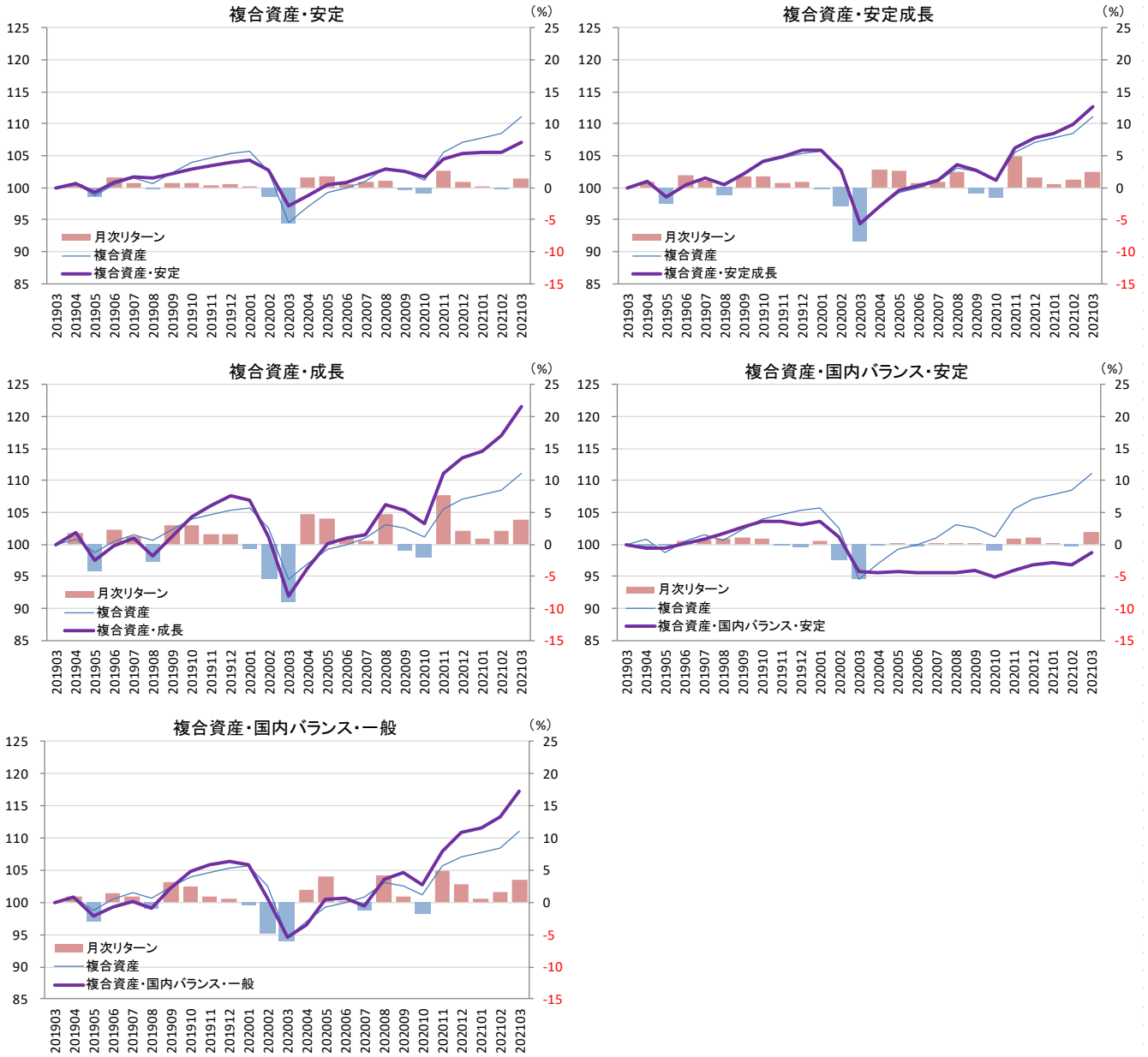


<1>パフォーマンス・サマリー

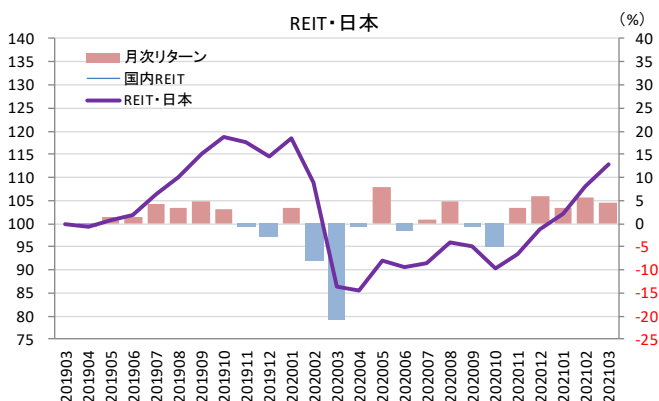
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

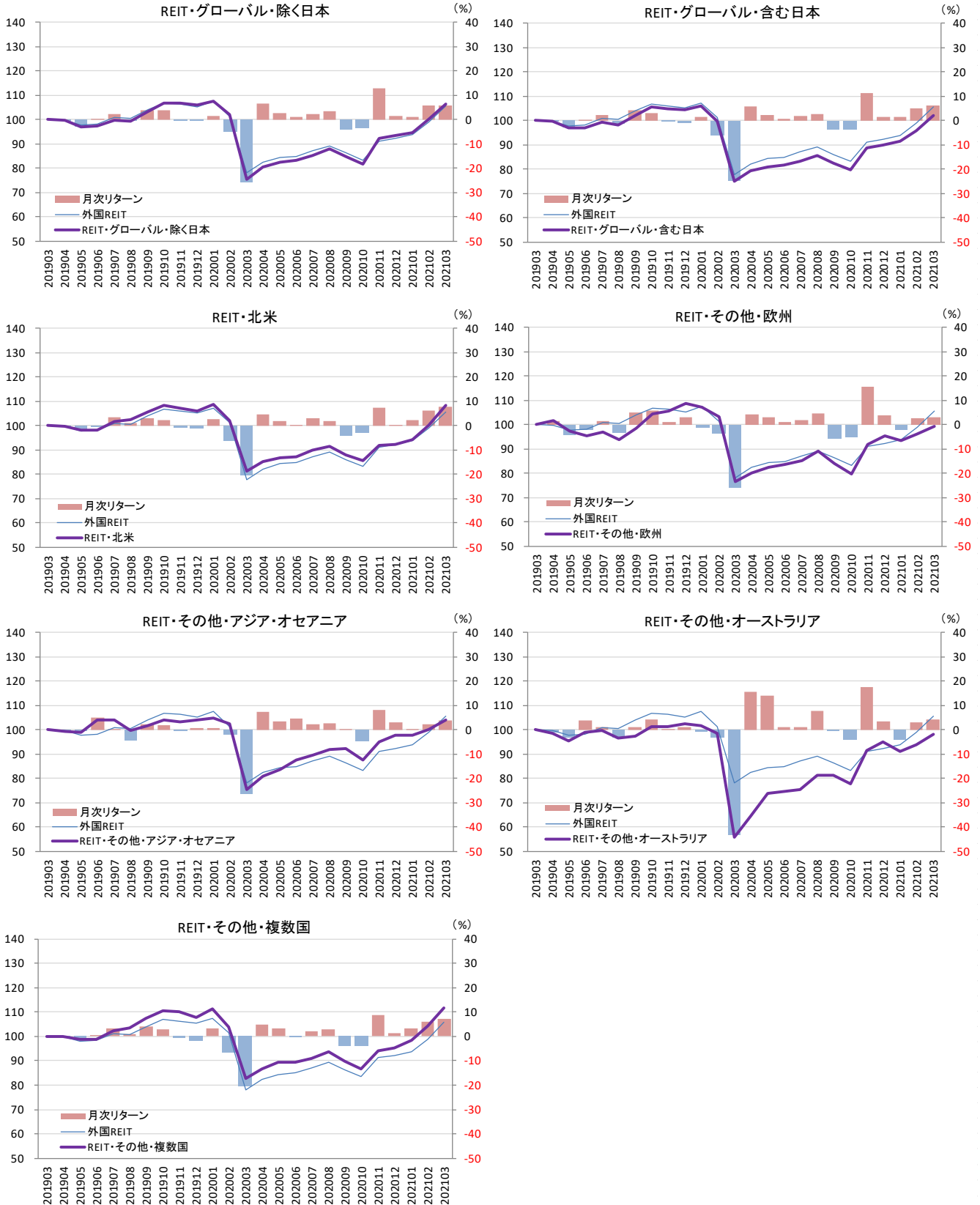


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

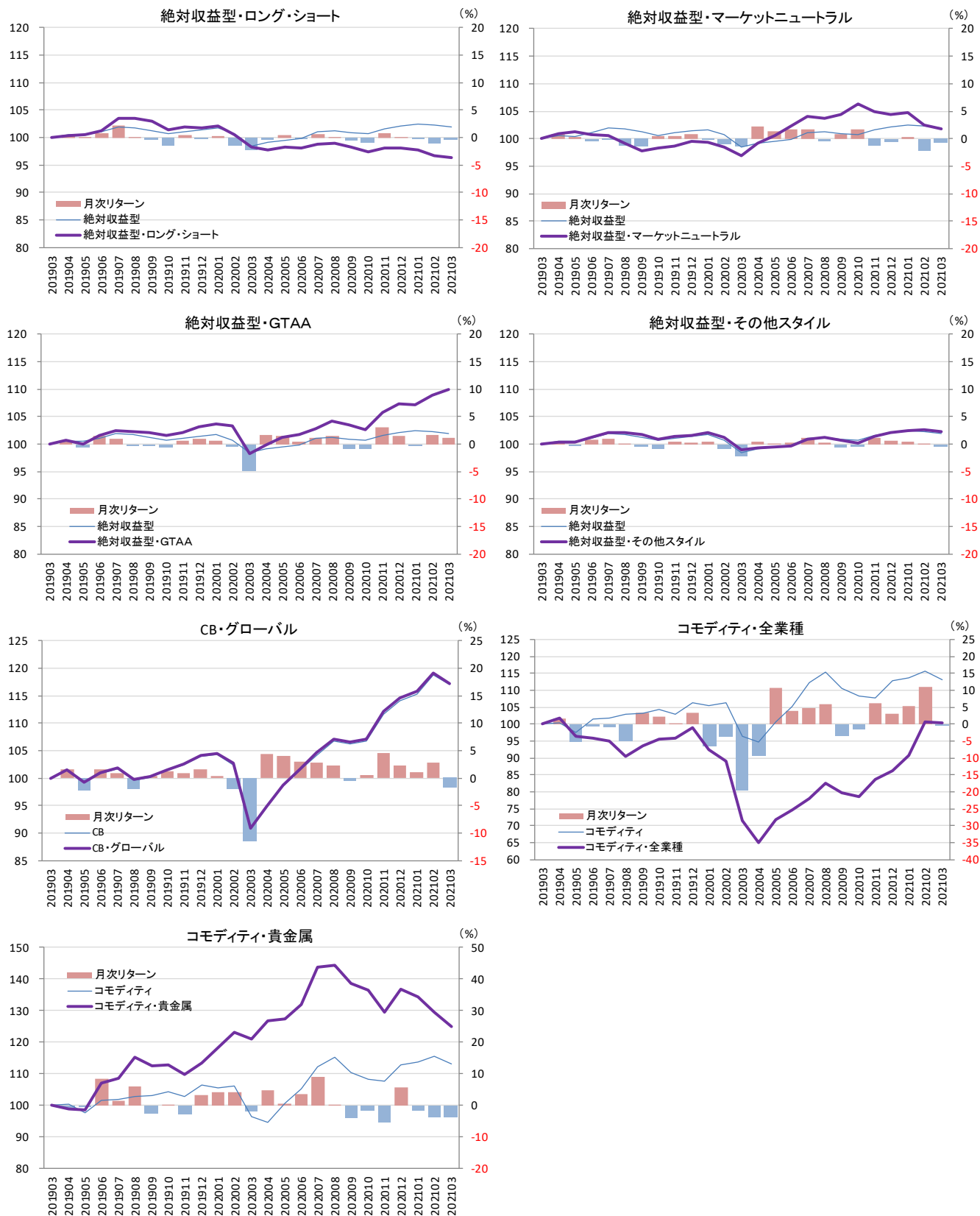


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	2.30				
1	国内株式・一般	5.03		7.69		0.38
2	外国株式(先進国)・その他	4.13		8.50		0.35
3	外国株式(先進国)・グローバル	0.85		26.84		0.24
4	REIT・北米	8.02		2.89		0.23
5	複合資産・安定成長	2.56		6.73		0.17
6	REIT・日本	4.44		3.90		0.17
7	国内株式・その他	3.61		4.62		0.17
8	REIT・グローバル	6.15		2.37		0.14
9	複合資産・成長	3.79		2.16		0.08
10	外国債券(先進国)・グローバル	0.93		8.02		0.08
11	複合資産・安定	1.42		4.54		0.06
12	国内株式・小型	5.59		1.04		0.06
13	ハイイールド債券・北米	2.93		1.66		0.05
14	外国債券(先進国)・その他	1.67		2.66		0.05
15	国内債券・一般	0.61		4.68		0.03
16	複合資産・国内バランス	1.97		1.33		0.03
17	複合資産・その他	3.37		0.73		0.02
18	REIT・その他	4.26		0.53		0.02
19	エマージング債券・その他	1.17		0.87		0.01
20	国内株式・業種特化	4.84		0.10		0.00
21	ハイイールド債券・グローバル	0.97		0.39		0.00
22	エマージング株式・BRICS	0.90		0.09		0.00
23	エマージング株式・グローバル	0.02		1.23		-0.00
24	ブルベア	-0.58		0.36		-0.00
25	ハイイールド債券・その他	-0.37		0.39		-0.00
26	エマージング株式・その他	0.01		2.91		-0.00
27	CB	-1.48		0.25		-0.00
28	絶対収益型	-0.37		1.16		-0.00
29	エマージング債券・グローバル	-0.86		0.96		-0.01
30	コモディティ	-2.26		0.43		-0.01
	合計			100.00		2.30

◆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	33.96		
1	外国株式(先進国)・グローバル	60.21	23.00	12.40
2	国内株式・一般	48.22	8.29	3.79
3	外国株式(先進国)・その他	54.59	7.52	3.64
4	国内株式・その他	49.02	4.64	2.15
5	エマージング株式・その他	65.26	2.78	1.54
6	複合資産・安定成長	19.43	7.19	1.46
7	REIT・日本	30.64	3.86	1.10
8	REIT・北米	33.02	3.08	0.97
9	REIT・グローバル	37.03	2.43	0.85
10	外国債券(先進国)・グローバル	6.83	9.07	0.73
11	国内株式・小型	63.07	1.19	0.70
12	複合資産・成長	32.17	2.15	0.68
13	エマージング株式・グローバル	64.23	1.17	0.64
14	外国債券(先進国)・その他	18.48	3.14	0.63
15	複合資産・安定	10.21	4.60	0.51
16	ハイイールド債券・北米	26.78	1.88	0.50
17	複合資産・その他	30.42	1.05	0.34
18	REIT・その他	42.84	0.60	0.24
19	エマージング債券・グローバル	16.16	1.13	0.21
20	ブルベア	58.77	0.33	0.18
21	ハイイールド債券・その他	27.13	0.47	0.13
22	エマージング債券・その他	9.29	1.11	0.11
23	ハイイールド債券・グローバル	23.89	0.44	0.11
24	コモディティ	17.24	0.41	0.07
25	CB	28.61	0.26	0.07
26	国内株式・業種特化	67.25	0.10	0.06
27	複合資産・国内バランス	3.98	1.56	0.06
28	エマージング株式・BRICS	62.22	0.09	0.05
29	絶対収益型	3.49	1.23	0.05
30	国内債券・一般	-0.44	5.24	-0.02
	合計		100.00	33.96

◆計算定義

日次寄与度(%) = 日次リターン(%) × 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	23.67	36.96	93.23	12.25	10.41	11.68	0.60	0.63	0.58
国内株式	22.34	66.49	180.11	18.12	15.67	17.23	0.39	0.69	0.63
一般	19.20	61.79	159.00	17.96	15.58	17.54	0.34	0.65	0.57
フリー	20.50	64.34	161.83	18.20	15.71	18.13	0.36	0.67	0.56
バリュー	14.12	52.09	150.92	17.52	15.50	16.38	0.26	0.57	0.59
小型	19.79	86.58	306.80	21.78	18.19	18.02	0.29	0.73	0.84
その他	30.96	71.74	204.96	17.84	15.77	16.93	0.53	0.73	0.70
日経225	42.03	85.65	239.06	18.62	16.44	17.28	0.67	0.80	0.75
TOPIX	21.08	59.81	169.56	17.27	15.21	16.65	0.38	0.65	0.63
JPX日経400	22.50	56.65	-	17.35	15.12	-	0.41	0.62	-
国内債券	0.58	0.10	12.80	1.91	1.78	1.62	0.13	0.04	0.74
一般	0.58	0.10	12.80	1.91	1.78	1.62	0.13	0.04	0.74
外国株式(先進国)	51.38	81.15	154.98	18.63	15.82	16.51	0.80	0.80	0.59
グローバル	53.38	84.94	171.68	18.68	15.79	16.39	0.82	0.83	0.64
除く日本	46.40	78.85	194.57	19.66	17.07	18.10	0.69	0.72	0.63
含む日本	55.75	86.91	166.52	18.59	15.60	16.08	0.86	0.86	0.64
その他	45.57	70.48	121.87	18.72	16.17	17.67	0.71	0.70	0.47
北米	54.48	80.28	90.55	21.88	18.99	21.58	0.72	0.66	0.31
米国	58.17	94.54	147.40	18.22	15.86 ↓	17.69	0.91	0.90	0.54
カナダ	17.13	27.86	3.36	22.08	18.05	17.95	0.25	0.28	0.02
欧州	22.37	43.55	110.32	19.97	17.41	18.72	0.35	0.43	0.41
ドイツ	17.65	40.52	-	25.27	22.22	-	0.22	0.32	-
イギリス	-1.54	-3.73	-	20.74	17.84	-	-0.02	-0.04	-
アジア・オセアニア	24.61	52.49	130.66	17.42	15.01	17.77	0.44	0.59	0.49
オーストラリア	12.46	20.54	58.69	26.42	22.19	21.67	0.15	0.17	0.22
ニュージーランド	43.38	72.13	-	18.95	16.70 ↓	-	0.68	0.69	-
複合地域	-23.76	-21.52	-	36.75 ↑	29.83	-	-0.23	-0.16	-
エマージング株式	22.62	58.19	69.64	21.80	18.02	19.36	0.32	0.54	0.28
グローバル	32.57	69.60	71.93	21.24	17.70	19.08	0.47	0.63	0.29
BRICS	24.02	83.06	74.20	24.31	20.01	22.19	0.31	0.64	0.26
その他	19.03	53.09	71.61	22.43	18.51	19.56	0.27	0.48	0.28
欧州	-1.17	39.28	1.27	28.15	23.89	25.35	-0.01	0.29	0.00
ロシア	32.67	92.50	29.55	27.80	24.40	27.63	0.36	0.58	0.09
アジア・オセアニア	22.64	52.58	95.19	20.21	16.98	18.03	0.35	0.52	0.38
中国	51.52	118.35	195.14	21.80	18.42	22.19	0.68	0.92	0.51
インド	20.86	62.70	95.86	28.01	23.24	25.60	0.23	0.44	0.27
インドネシア	-10.70	-2.27	13.55	32.07	26.01	25.30	-0.11	-0.02	0.05
タイ	-15.88	16.30	69.75	25.44 ↑	20.85 ↑	19.52	-0.22	0.15	0.28
フィリピン	-13.83	-21.77	80.85	22.61	19.36	20.84	-0.21	-0.25	0.29
ベトナム	-4.08	65.68	163.60	29.94	24.37	22.37	-0.04	0.44	0.45
韓国	32.15	47.96	62.65	25.81	21.05	20.65	0.38	0.39	0.24
香港	6.52	52.71	52.02	20.63	17.57	19.78	0.11	0.51	0.22
台湾	41.21	84.74	186.21	23.59	19.48	19.02	0.52	0.67	0.58
中南米	-8.54	24.08	-11.06	34.55	28.38	26.76	-0.08	0.16	-0.04
ブラジル	-21.96	18.73	-43.33	38.85	32.51	32.31	-0.20	0.11	-0.17
メキシコ	-5.92	-17.66	-	32.76	27.40	-	-0.06	-0.14	-
中東・アフリカ	7.75	30.15	71.81	21.12	17.71	17.70	0.12	0.31	0.31
トルコ	-38.79	-41.83	-40.33	38.87	32.86	31.59	-0.39	-0.31	-0.16
複合地域	18.79	35.05	77.26	19.92	16.88	16.87	0.30	0.37	0.35

※[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	23.67	36.96	93.23	12.25	10.41	11.68	0.60	0.63	0.58
外国債券(先進国)	8.59	7.74	38.43	4.50	4.78	7.47	0.63	0.32	0.44
グローバル	8.06	7.77	39.82	3.73	4.17	6.68	0.71	0.37	0.51
除く日本	9.72	7.93	43.47	3.35	4.36	7.31	0.95	0.36	0.50
含む日本	6.22	7.78	35.70	4.62	4.37	6.14	0.45	0.36	0.50
その他	10.39	8.11	36.28	7.38	7.20	9.40	0.46	0.23	0.33
北米	7.95	10.08	-	5.02	4.31	-	0.52	0.46	-
米国	10.53	8.76	52.69	7.41	6.78	6.74	0.46	0.26	0.64
カナダ	12.65	4.51	18.02	6.66	7.74	9.09	0.62	0.12	0.18
欧州	1.18	3.75	39.88	4.56	5.71	8.95	0.10	0.14	0.38
イギリス	5.95	1.15	-	8.31	10.15	-	0.24	0.03	-
アジア・オセアニア	11.54	9.58	40.83	9.44	8.92	10.64	0.40	0.21	0.33
オーストラリア	10.93	8.85	36.01	9.54	9.04	10.79	0.37	0.19	0.29
ニュージーランド	9.22	13.19	-	8.27	8.59 ↓	-	0.37	0.30	-
複合地域	17.45	18.01	39.31	3.76 ↓	5.09 ↓	9.03	1.48	0.67	0.37
グローバル	-4.57	1.29	-	13.51	11.48	-	-0.11	0.03	-
エマージング債券	-3.63	10.58	22.34	12.89	10.69	13.18	-0.09	0.19	0.15
グローバル	-3.84	8.95	24.28	14.85	12.07	13.57	-0.08	0.15	0.16
米ドル建て	-3.40	9.89	26.50	15.35	12.48	13.88	-0.07	0.16	0.17
現地通貨建て	-5.93	3.17	13.43	13.39	11.07	12.36	-0.15	0.06	0.10
その他	-3.44	12.59	17.81	11.50	9.91 ↓	13.64	-0.10	0.25	0.12
ロシア	-4.25	30.36	11.94	20.67	17.75 ↓	22.79	-0.07	0.31	0.05
アジア・オセアニア	13.04	13.37	57.30	7.21	6.72	8.78	0.58	0.39	0.53
インド	13.80	22.74	-	9.54	9.38	-	0.47	0.45	-
インドネシア	10.55	17.57	38.13	17.25	14.26	15.94	0.20	0.23	0.21
ブラジル	-29.85	-5.73	-8.76	20.49	17.60	18.68	-0.54	-0.06	-0.05
メキシコ	12.08	3.69	-	19.10	17.87	-	0.21	0.04	-
トルコ	-41.47	-57.79	-	38.20	30.85	-	-0.43	-0.51	-
複合地域	-3.46	7.39	11.53	12.90	11.31 ↓	13.58	-0.09	0.13	0.08
ハイイールド債券	8.80	23.92	62.19	13.33	11.35	12.78	0.22	0.39	0.39
グローバル	3.88	22.83	50.82	13.56	11.40	12.99	0.10	0.37	0.32
北米	12.09	28.45	72.20	13.08	11.36	12.42	0.30	0.46	0.45
その他	2.12	13.41	47.91	14.99	12.35	15.06	0.05	0.21	0.26
欧州	0.50	12.06	54.43	15.86	13.06	16.10	0.01	0.18	0.28
アジア・オセアニア	6.98	18.20	-	12.97	10.81	-	0.18	0.32	-
複合地域	16.13	25.52	82.27	9.67	9.22	11.19	0.53	0.51	0.55
複合資産	12.79	21.75	75.07	7.74	6.89	9.01	0.54	0.59	0.64
安定	7.87	13.06	57.12	5.23	4.79	7.29	0.50	0.53	0.63
安定成長	15.02	24.39	79.13	8.35	7.42	9.46	0.58	0.61	0.63
成長	22.88	42.18	120.16	12.29	10.84	11.89	0.58	0.68	0.69
国内バランス	0.86	4.97	33.05	4.48	3.64	6.36	0.07	0.28	0.45
安定	0.44	2.89	27.63	4.26	3.41	3.41	0.05	0.18	0.72
一般	13.36	32.84	67.95	9.45	8.43	9.77	0.46	0.70	0.54

※[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カ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	23.67	36.96	93.23	12.25	10.41	11.68	0.60	0.63	0.58
国内REIT	31.08	25.27	163.28	16.99	13.98	17.15	0.56	0.33	0.59
日本	31.08	25.27	163.28	16.99	13.98	17.15	0.56	0.33	0.59
外国REIT	26.09	19.21	131.19	18.78	16.38	16.59	0.43	0.22	0.53
グローバル	20.15	12.77	109.82	20.10	17.26	16.88	0.32	0.14	0.46
除く日本	25.36	22.83	134.62	20.77	17.80	17.11	0.38	0.24	0.52
含む日本	18.81	11.03	106.20	19.90	17.12	16.82	0.30	0.13	0.45
北米	31.86	23.03	149.96	17.88	16.01	16.76	0.54	0.27	0.57
その他	19.77	29.40	142.74	21.18	17.53	16.78	0.29	0.30	0.55
欧州	-3.95	1.19	13.23	22.02	19.41	20.45	-0.06	0.01	0.06
アジア・オセアニア	21.89	42.09	162.91	19.61	16.29	16.63	0.35	0.45	0.61
オーストラリア	16.25	12.32	104.75	31.86	26.05	22.55	0.16	0.09	0.33
複合地域	-13.80	-14.47	48.96	29.40	24.11	21.76	-0.16	-0.13	0.19
複数国	37.82	30.18	200.05	17.76	15.14	15.63	0.64	0.36	0.74
その他									
絶対収益型	-1.40	0.34	-4.95	2.34	2.24	3.38	-0.18	0.05	-0.15
ロング・ショート	-6.14	-5.74	-8.10	3.16	3.08	3.15	-0.65	-0.37	-0.27
マーケットニュートラル	-3.09	12.41	40.58	4.01	5.19	5.38	-0.25	0.47	0.64
GTAA	9.42	11.39	20.58	4.52	3.74	3.30	0.68	0.60	0.57
その他スタイル	-1.10	-0.30	-8.48	2.37	2.26	4.98	-0.14	-0.01	-0.18
CB	16.26	25.73	39.40	9.58	8.10	9.96	0.54	0.58	0.34
アジア・オセアニア	30.98	48.15	95.31	14.10	12.13	12.50	0.67	0.68	0.55
日本	0.52	6.68	46.33	5.78	5.19	6.16	0.04	0.26	0.63
グローバル	16.65	26.43	38.63	9.76	8.22	10.25	0.54	0.59	0.32
コモディティ	12.00	20.66	-26.18	10.86	10.59 ↓	13.99	0.36	0.37	-0.21
全業種	0.75	8.12	-35.00	19.86	17.03	16.88	0.01	0.10	-0.25
貴金属	20.00	22.60	8.76	12.30 ↑	10.23	16.20	0.51	0.41	0.05
エネルギー	-3.50	20.78	-49.23	42.28	35.81	30.92	-0.03	0.11	-0.21
その他コモディティ	-0.18	-6.25	-16.39	20.18	17.32	18.19	-0.00	-0.07	-0.10

※[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

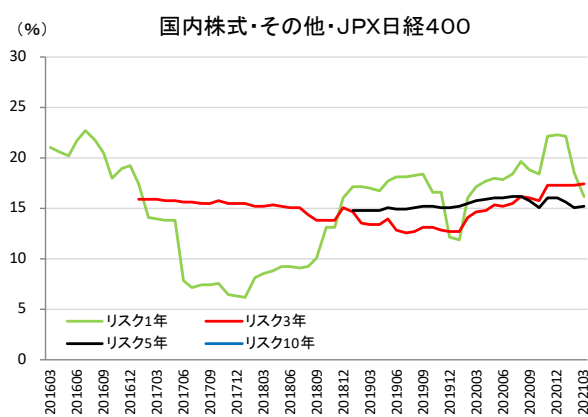
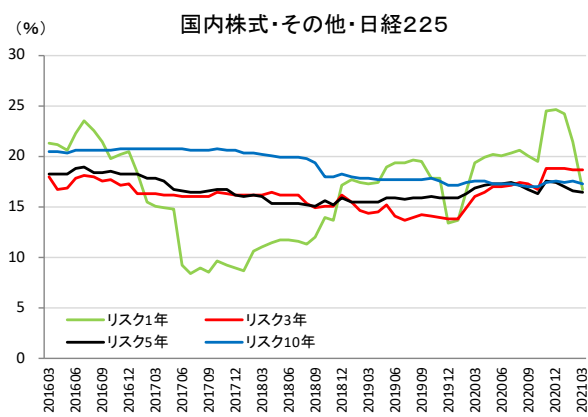
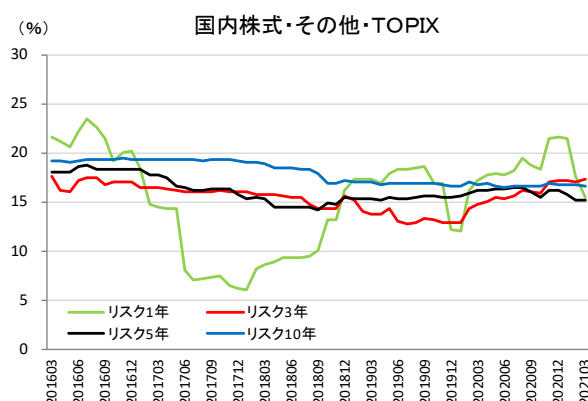
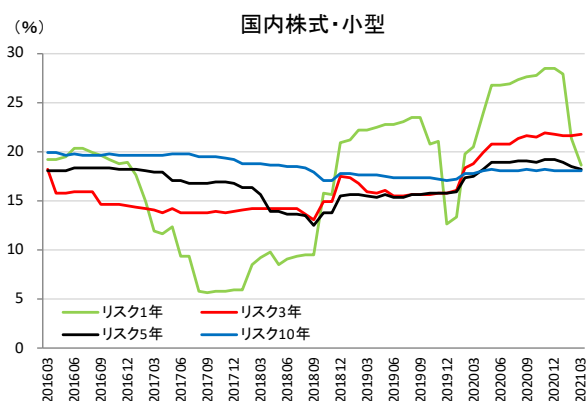
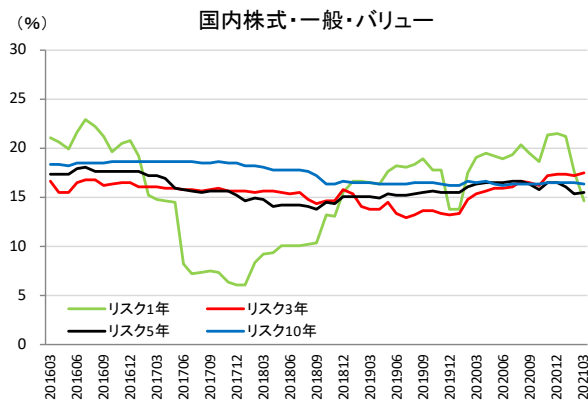
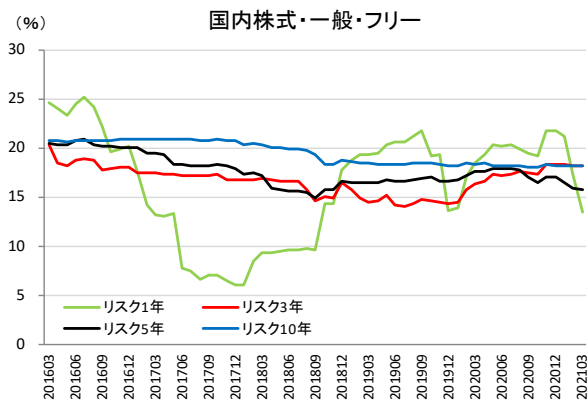
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

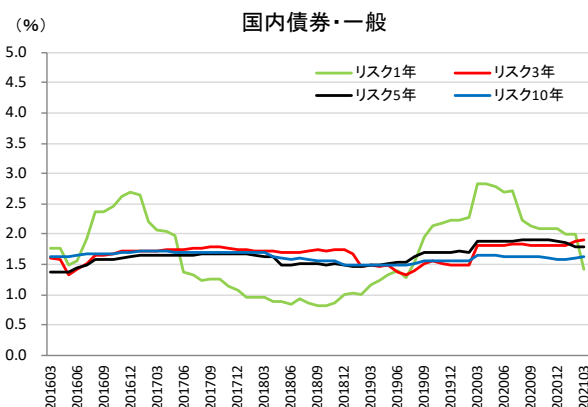
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

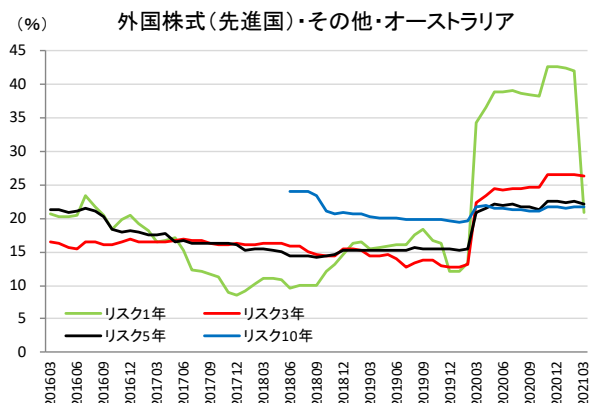
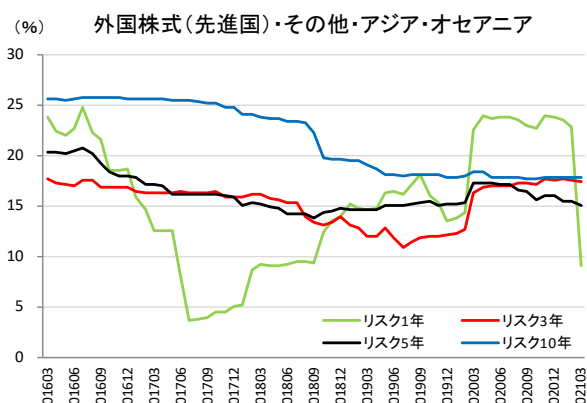
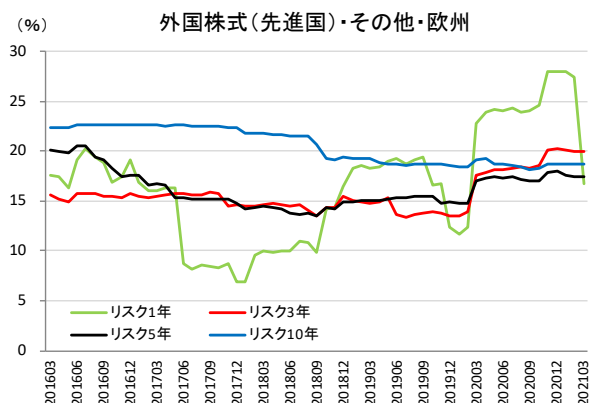
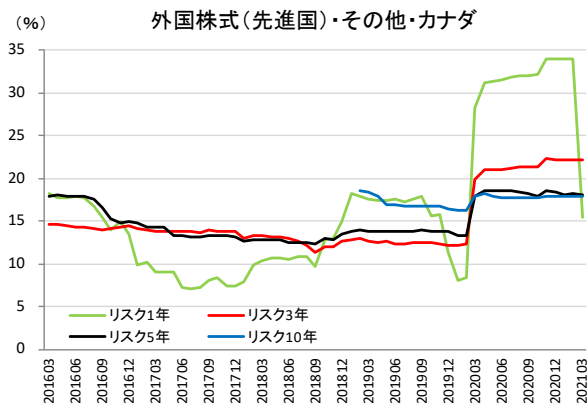
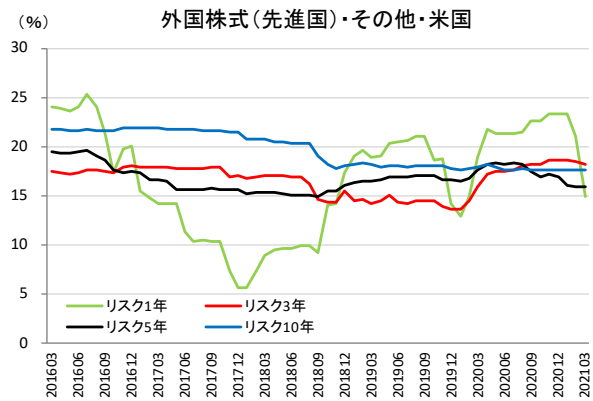
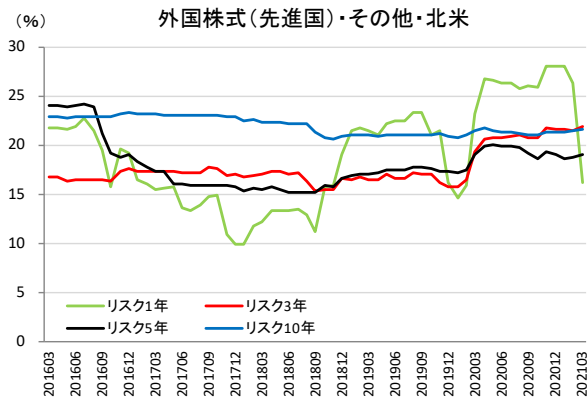
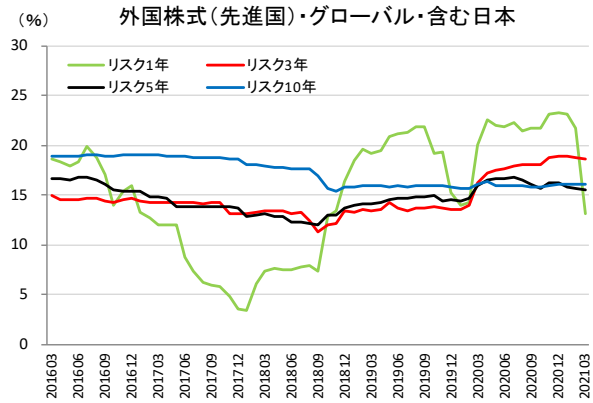
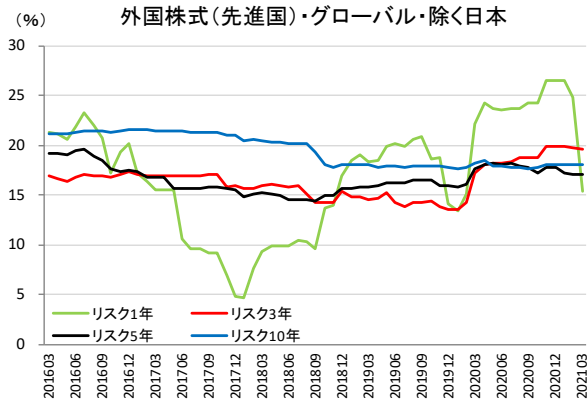


<2> リスク・サマリー

(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)]

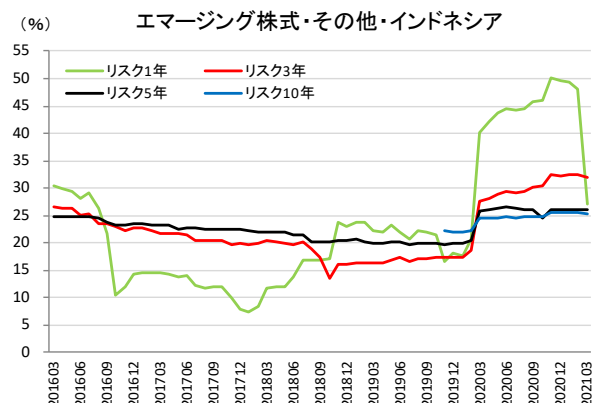
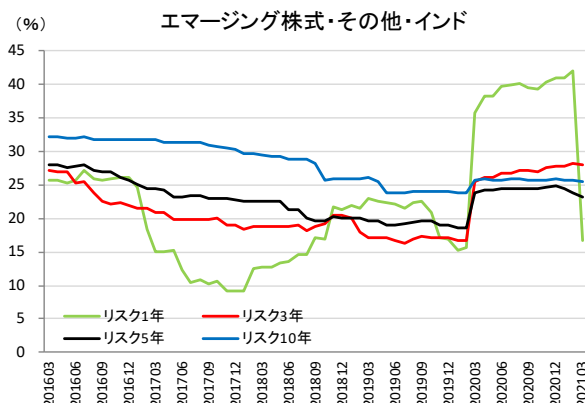
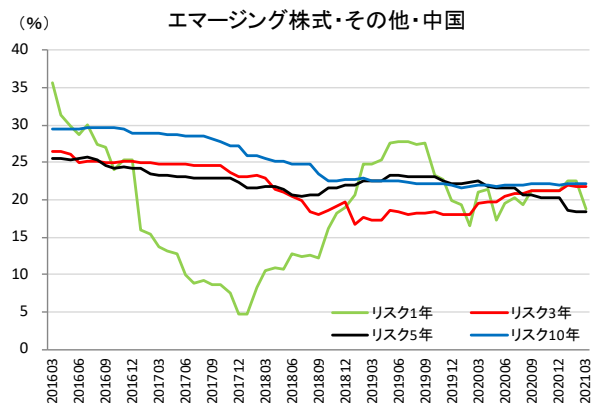
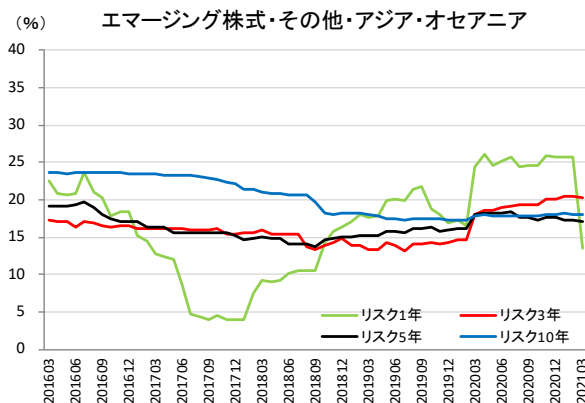
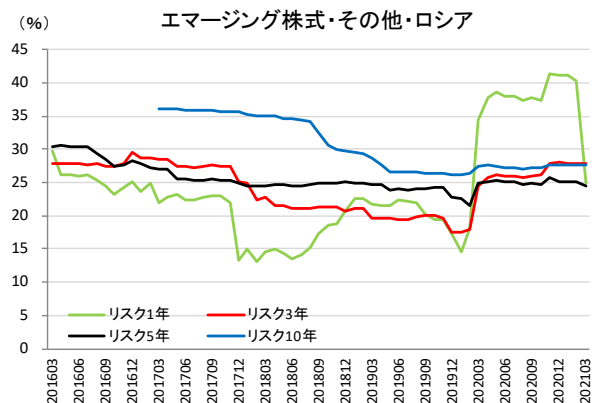
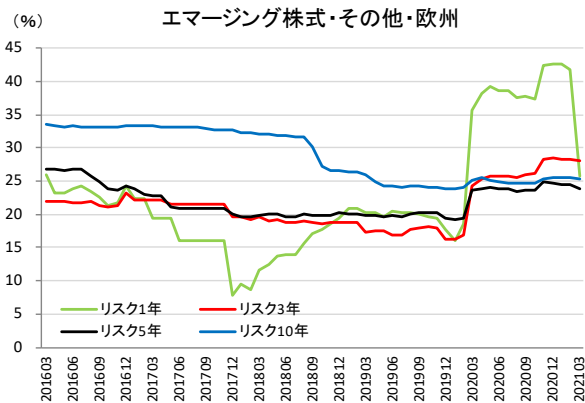
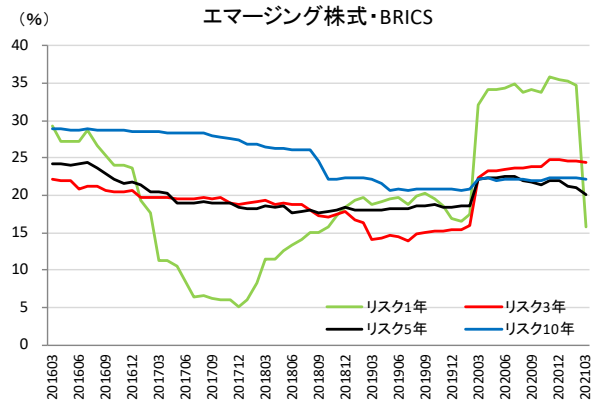
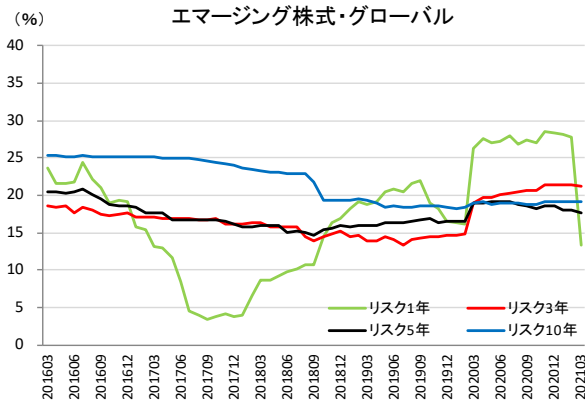


<2> リスク・サマリー

(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]

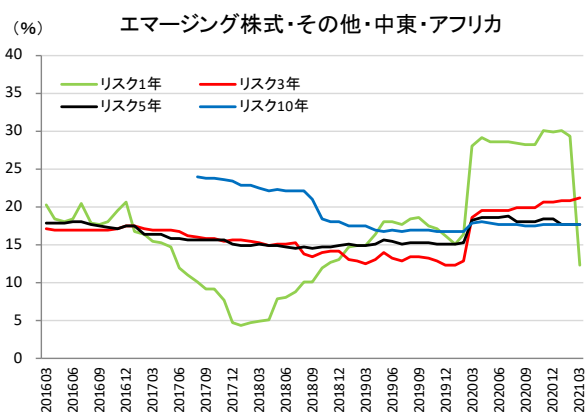
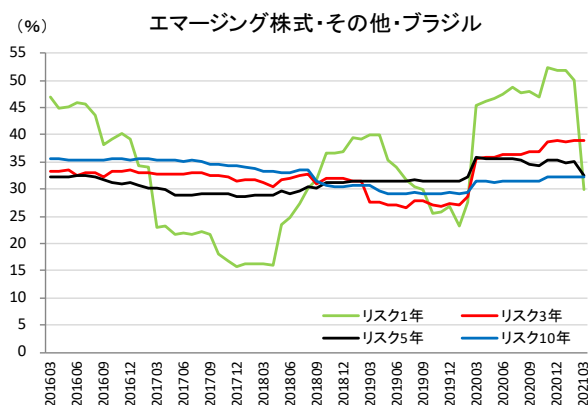
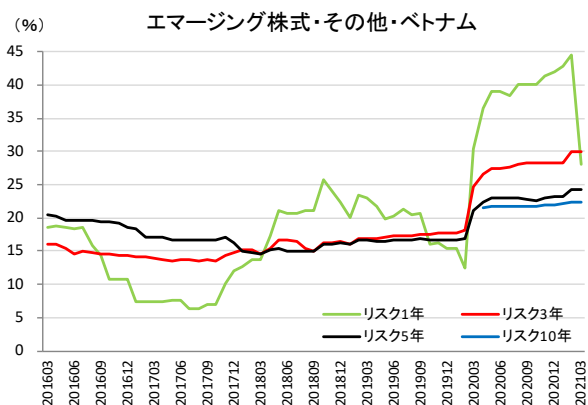
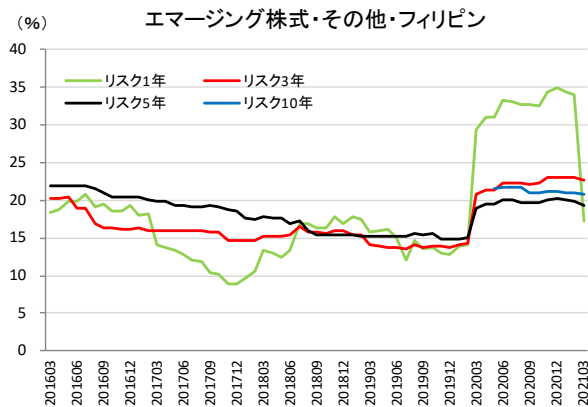
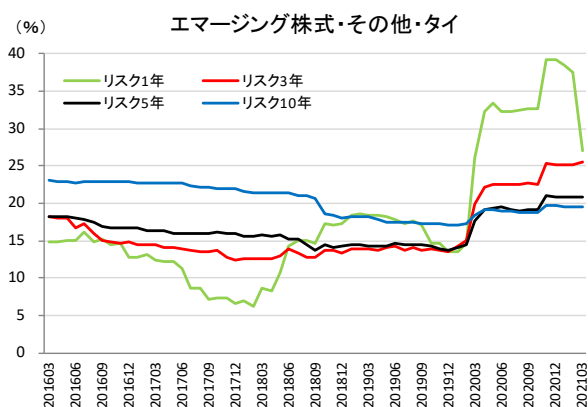


<2> リスク・サマリー

(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]

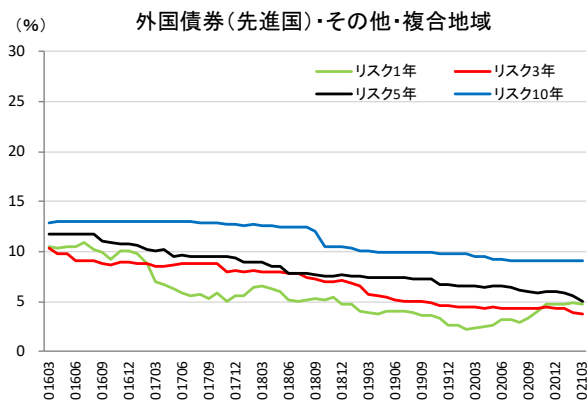
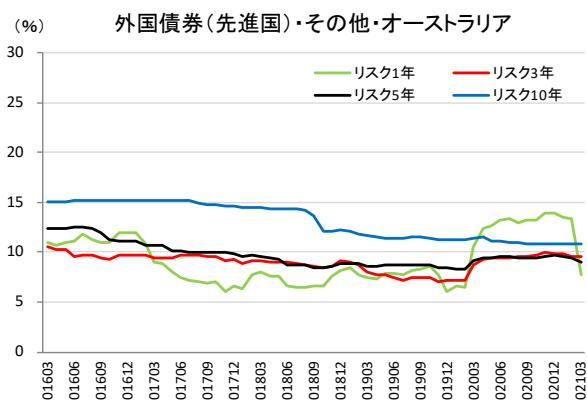
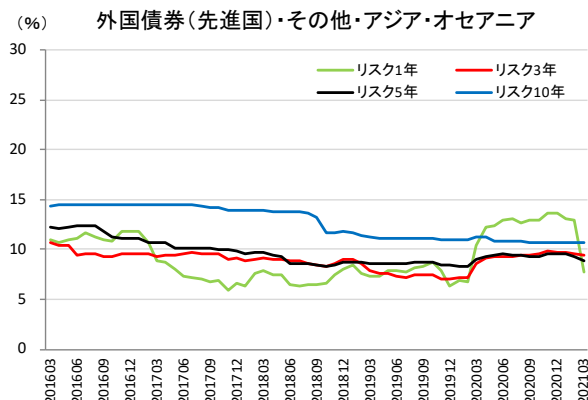
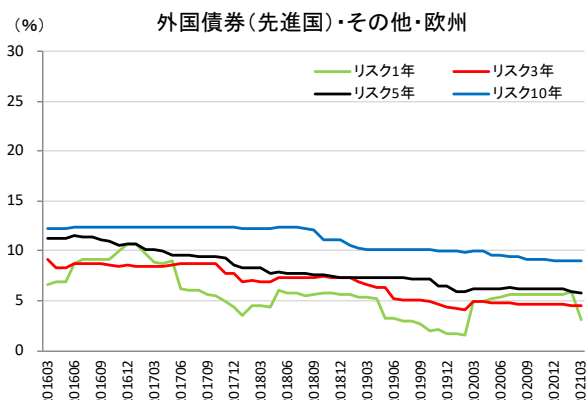
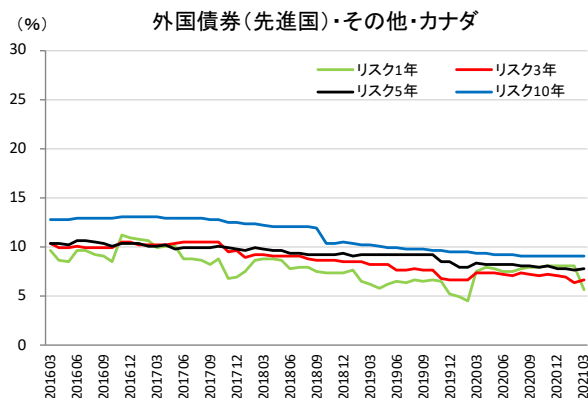
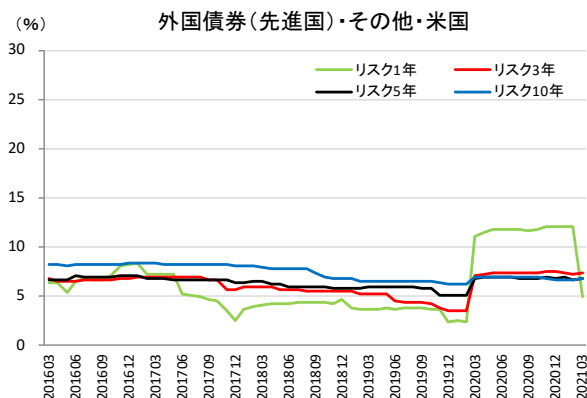
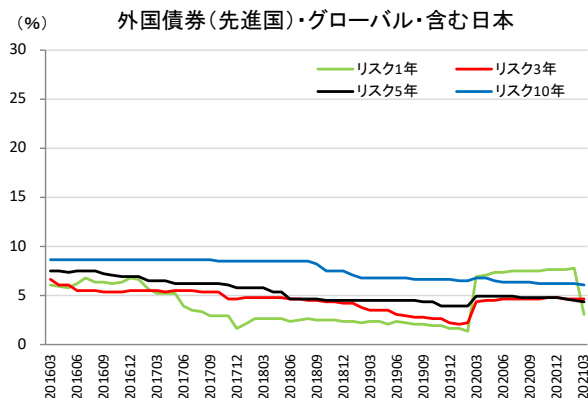
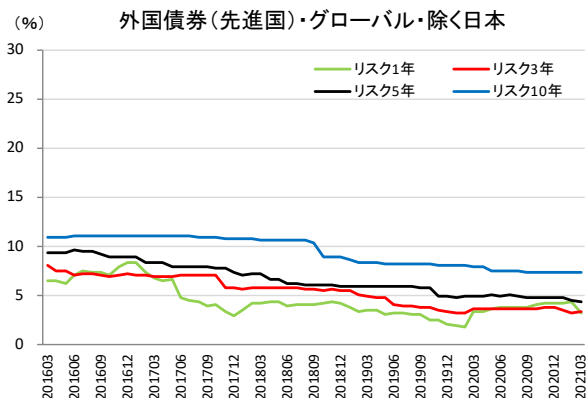


<2> リスク・サマリー

(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)]

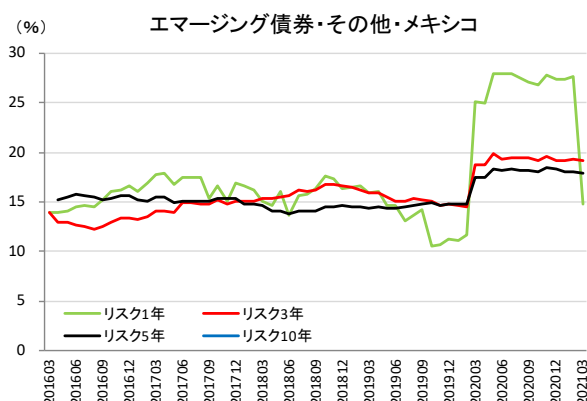
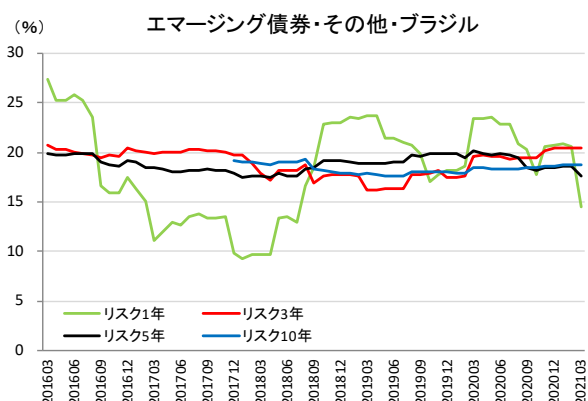
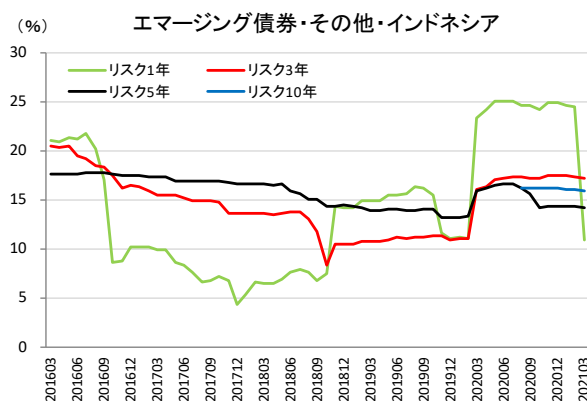
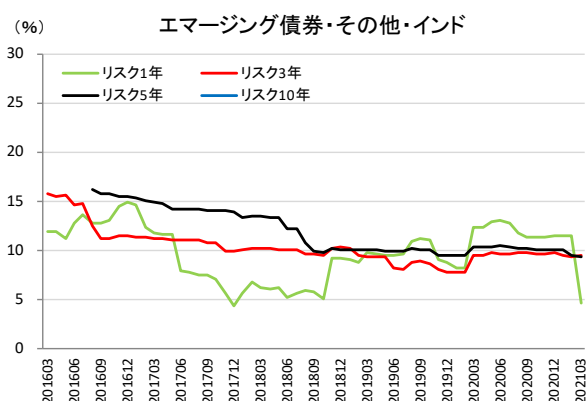
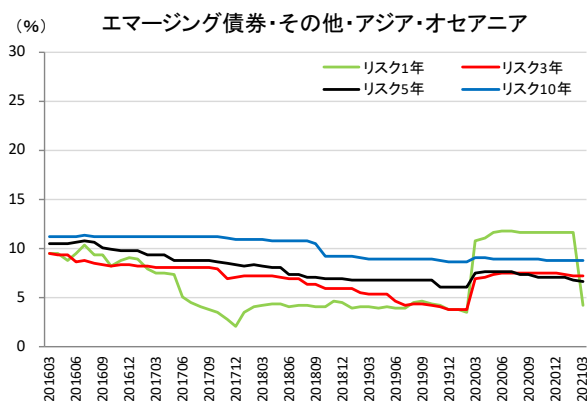
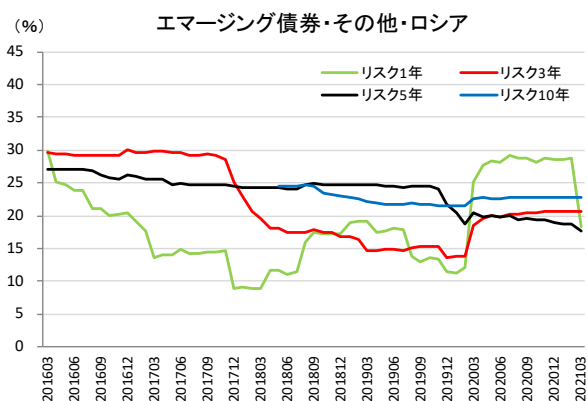
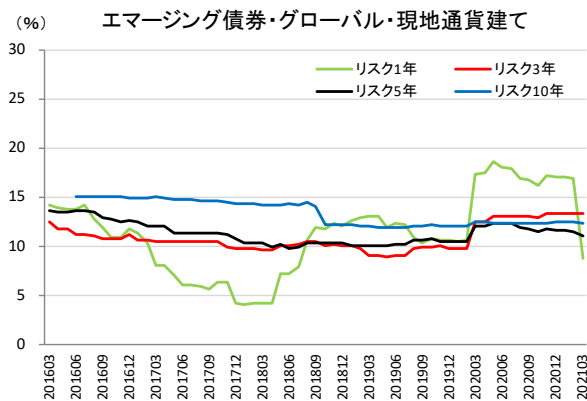
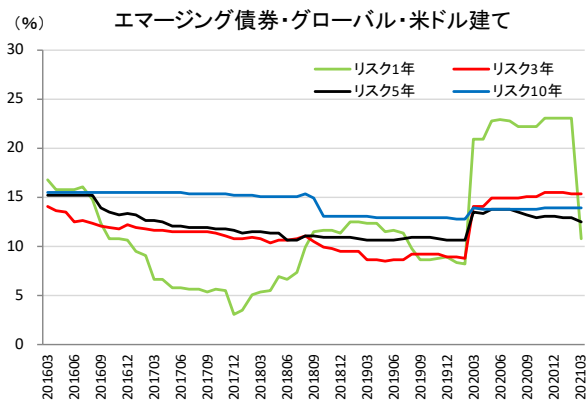


<2> リスク・サマリー

(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]

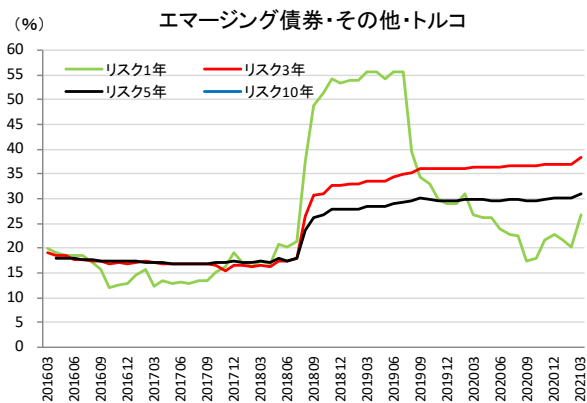


<2> リスク・サマリー

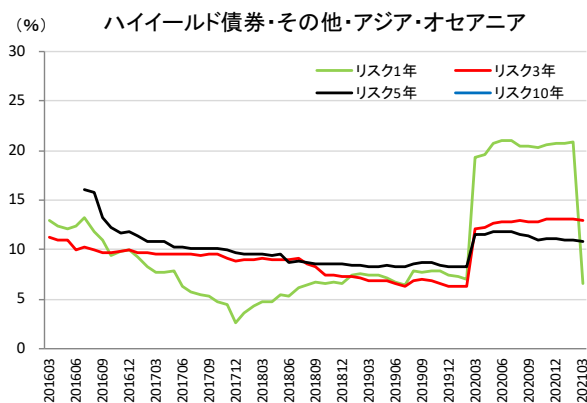
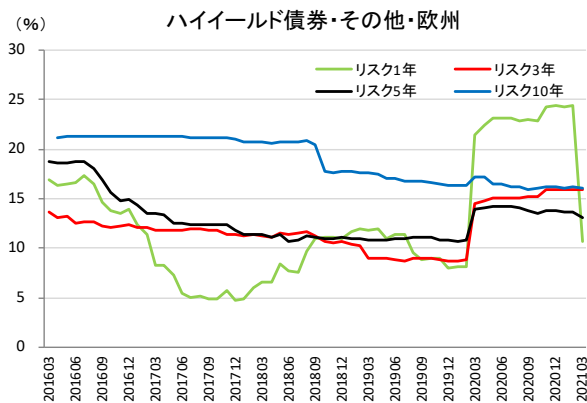
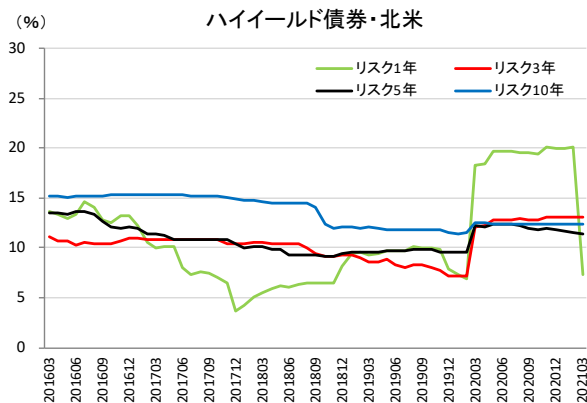
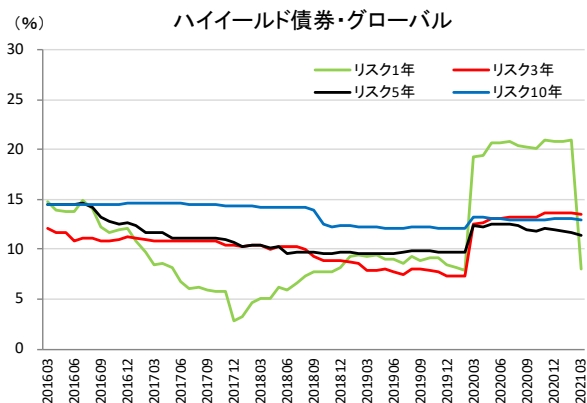
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

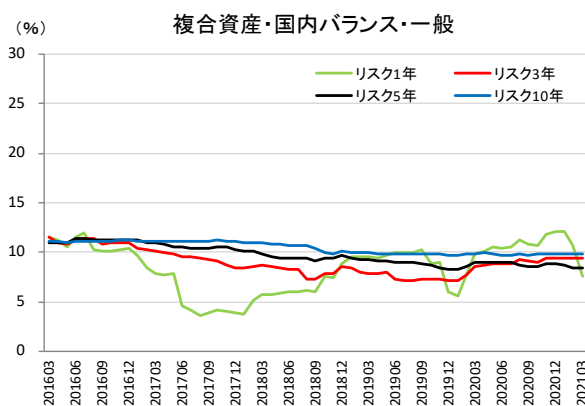
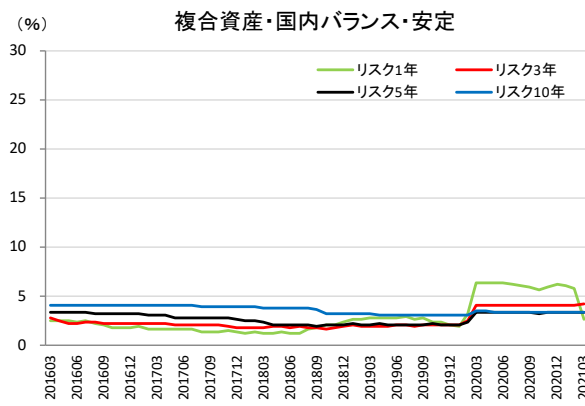
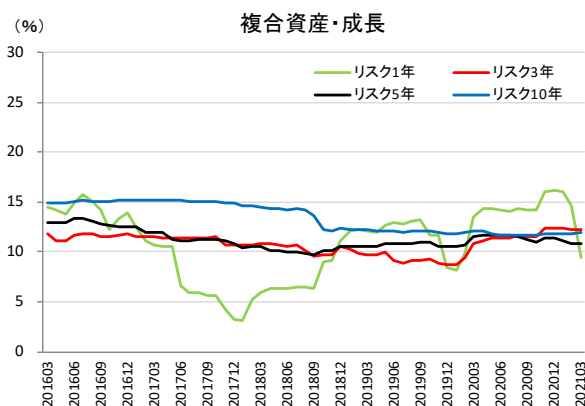
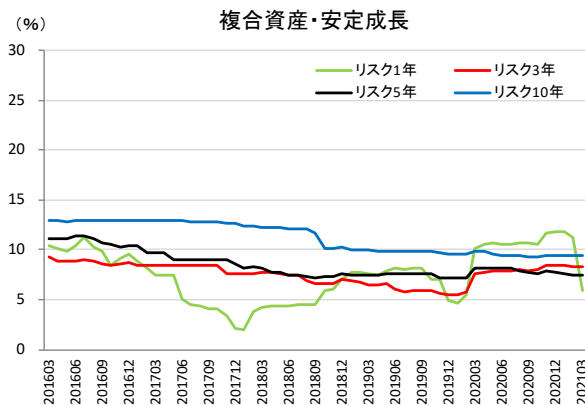
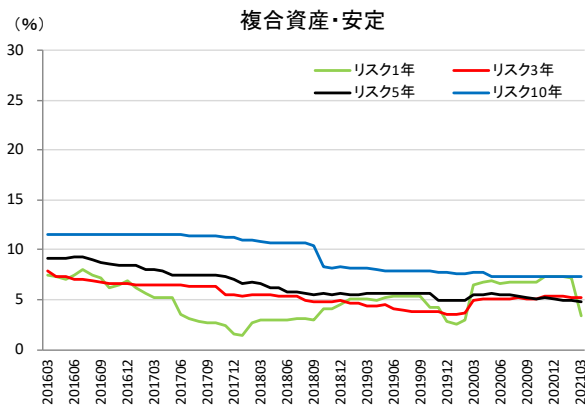


<2>リスク・サマリー

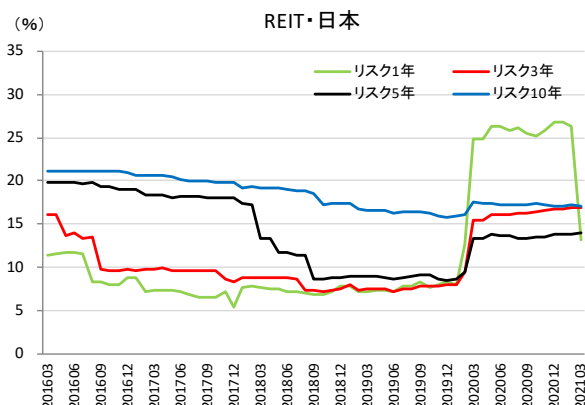
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

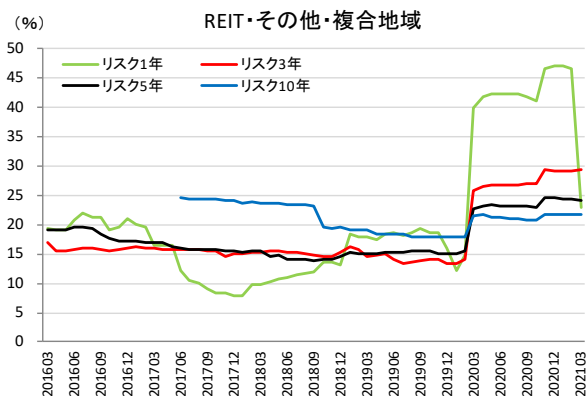
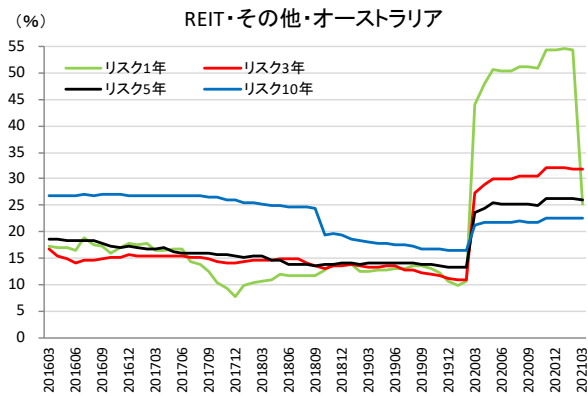
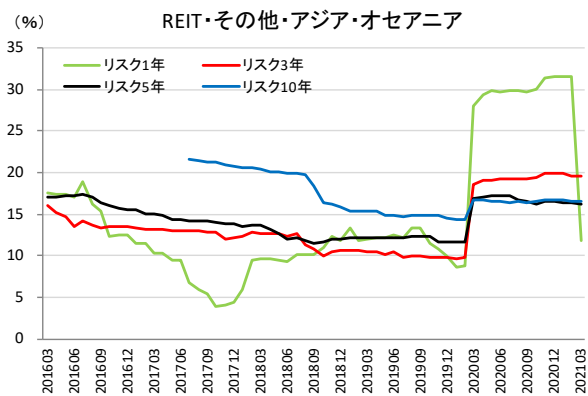
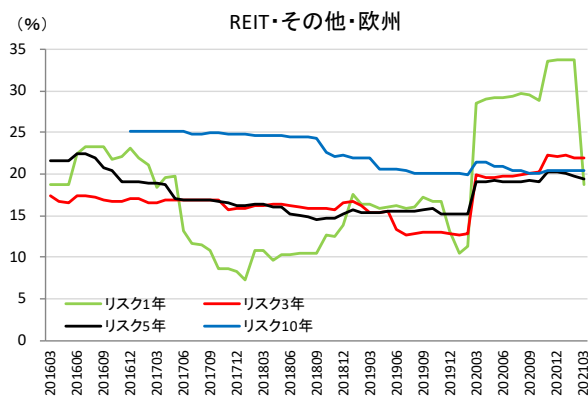
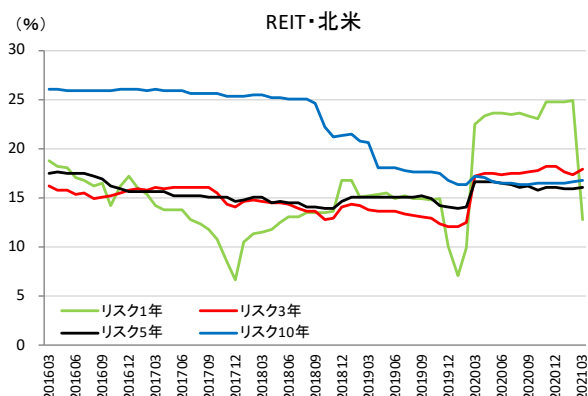
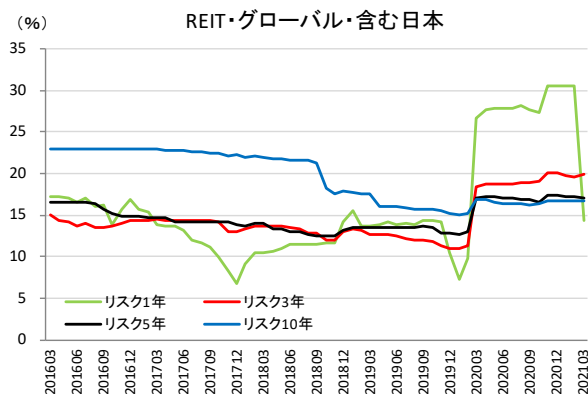
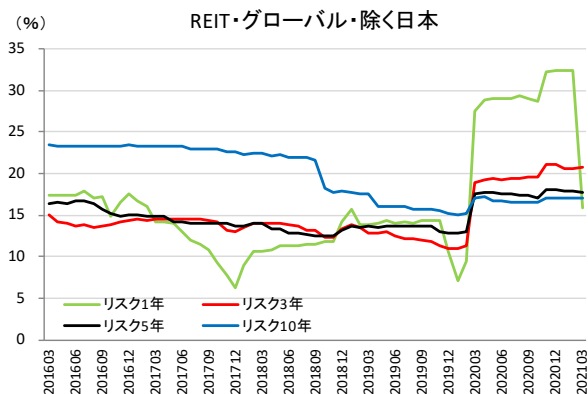


<2> リスク・サマリー

(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]

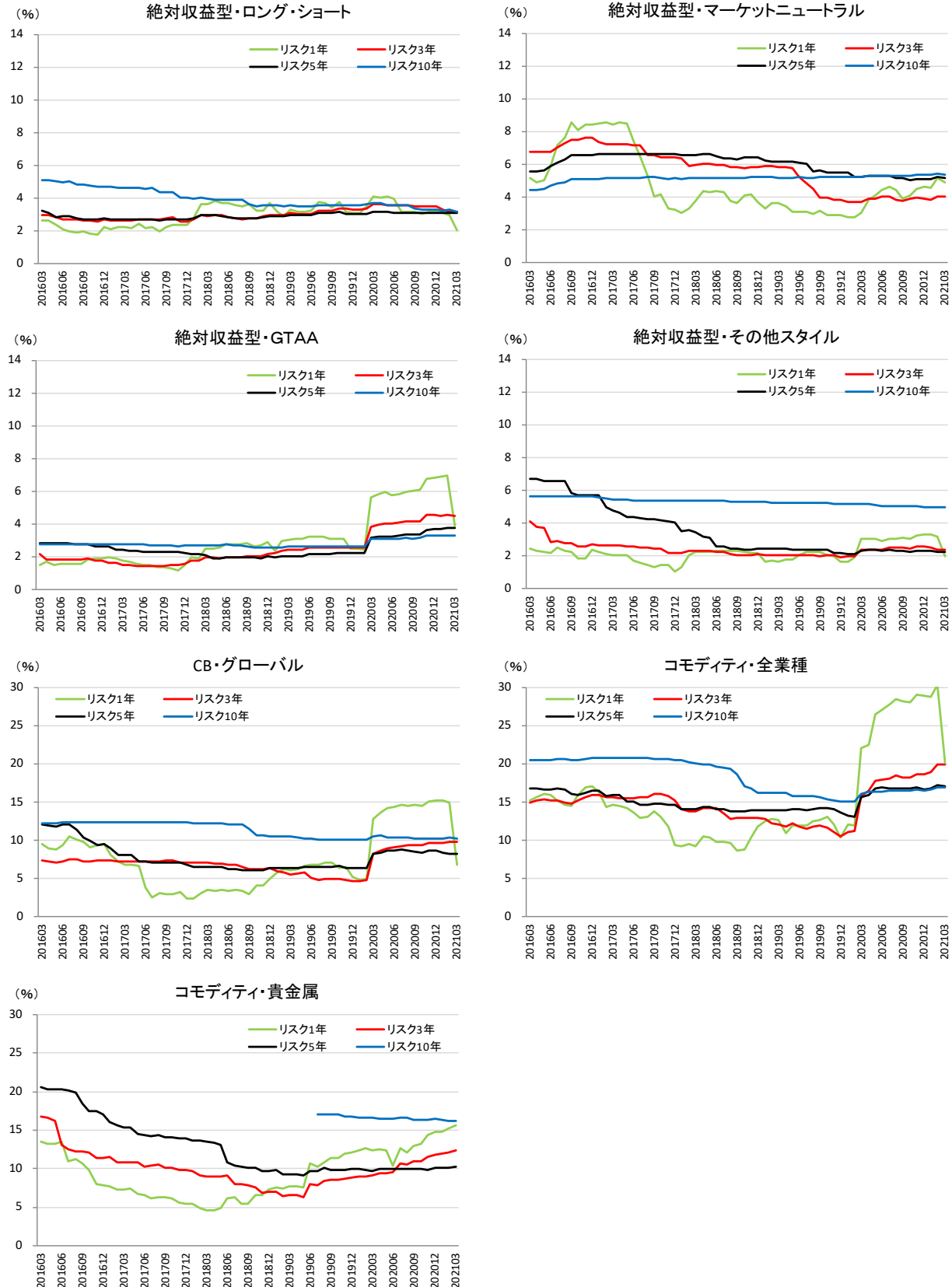


<2> リスク・サマリー

(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	9,346	19,442	20,668	33,398
国内株式	490	-1,773	-8,838	-17,164
一般	-256	-2,325	-5,894	-10,198
フリー	-143	-1,824	-4,906	-8,975
バリュー	-113	-501	-988	-1,222
小型	-64	-399	-1,116	-2,709
その他	800	982	-1,704	-4,109
日経225	581	517	-1,436	-3,798
TOPIX	217	503	-280	-327
JPX日経400	0	-29	-150	-199
国内債券	884	447	866	853
一般	884	447	866	853
外国株式(先進国)	7,346	21,719	33,840	52,713
グローバル	5,766	17,769	25,996	37,419
除く日本	659	2,538	3,589	5,980
含む日本	5,106	15,231	22,407	31,439
その他	1,581	3,950	7,845	15,294
北米	-9	-23	-64	-90
米国	1,731	4,352	8,612	16,099
カナダ	-6	-16	-33	-51
欧州	-8	-77	-148	-171
ドイツ	-2	-6	-8	-9
イギリス	0	-1	-1	-3
アジア・オセアニア	-1	-6	-8	-16
オーストラリア	-127	-273	-506	-465
ニュージーランド	2	1	1	0
複合地域	0	0	0	1
エマージング株式	10	370	-421	-1,387
グローバル	111	294	-23	-364
BRICS	-8	-34	-60	-70
その他	-93	109	-338	-953
欧州	-3	-8	-16	-20
ロシア	-1	-5	-8	-6
アジア・オセアニア	71	456	346	310
中国	247	954	1,509	1,360
インド	-312	-1,040	-1,740	-2,098
インドネシア	-1	-7	-15	-20
タイ	-1	-3	-7	-10
フィリピン	-2	-4	-10	-16
ベトナム	-90	-211	-328	-433
韓国	0	-1	0	0
香港	0	-1	-1	0
台湾	1	3	2	3
中南米	0	-2	-6	-7
ブラジル	-1	-5	-25	41
メキシコ	0	-1	1	0
中東・アフリカ	-1	-5	-24	-37
トルコ	-1	-9	-14	-18
複合地域	0	-1	-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	9,346	19,442	20,668	33,398
外国債券(先進国)	-241	-1,183	-1,917	-3,953
グローバル	69	-251	-68	-1,108
除く日本	121	-502	-1,040	-1,483
含む日本	-52	251	973	375
その他	-310	-932	-1,849	-2,844
北米	1	0	0	-10
米国	-35	-140	-310	-304
カナダ	-30	-68	-148	-222
欧州	-23	-51	-130	-243
イギリス	0	-3	-5	-6
アジア・オセアニア	-33	-103	-196	-330
オーストラリア	-180	-522	-943	-1,544
ニュージーランド	-2	-7	-16	-39
複合地域	-9	-37	-87	-162
グローバル	0	0	0	0
エマージング債券	-228	-640	-1,486	-2,741
グローバル	-79	-234	-583	-1,020
米ドル建て	-71	-205	-506	-921
現地通貨建て	-8	-29	-77	-99
その他	-149	-406	-903	-1,722
ロシア	-3	-8	-21	-44
アジア・オセアニア	-5	-12	-29	-45
インド	-96	-253	-519	-931
インドネシア	-8	-24	-57	-89
ブラジル	-22	-67	-178	-360
メキシコ	-7	-23	-56	-97
トルコ	0	-3	-10	-15
複合地域	-1	-2	-4	-5
ハイイールド債券	-257	-730	-1,563	-1,911
グローバル	-35	-95	-212	-320
北米	-181	-509	-1,018	-1,033
その他	-42	-127	-333	-558
欧州	-37	-116	-291	-478
アジア・オセアニア	-4	-8	-37	-67
複合地域	-1	-1	-2	-3
複合資産	999	508	-537	1,420
安定	907	1,745	2,967	4,221
安定成長	317	19	-448	230
成長	110	129	173	703
国内バランス	-83	-275	-598	-707
安定	-74	-244	-524	-605
一般	-7	-29	-66	-88
その他	-252	-1,110	-2,632	-3,027

< 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	9,346	19,442	20,668	33,398
国内REIT	92	481	898	2,698
日本	92	481	898	2,698
外国REIT	-246	-605	-1,168	413
グローバル	-82	-240	-520	268
除く日本	70	163	265	626
含む日本	-152	-403	-785	-358
北米	-148	-271	-355	627
その他	-16	-94	-293	-482
欧州	-2	-7	-14	-19
アジア・オセアニア	-1	-51	-205	-388
オーストラリア	-9	-27	-62	-62
複合地域	0	1	2	7
複数国	-4	-9	-15	-20
その他	497	849	995	2,456
絶対収益型	197	239	623	888
ロング・ショート	-23	-36	-55	-111
マーケットニュートラル	-3	-21	0	-100
GTAA	-3	-11	-25	-39
その他スタイル	225	306	701	1,101
CB	-34	-70	-145	455
アジア・オセアニア	0	-1	-2	-4
日本	-1	-3	-6	-14
グローバル	-33	-67	-137	472
コモディティ	53	163	356	913
全業種	3	12	16	119
貴金属	64	192	439	810
エネルギー	-15	-41	-100	-19
その他コモディティ	0	1	1	2

＜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	747,197	100.00	5,361	100.00
国内株式	100,424	13.44	868	16.19
一般	57,390	7.68	562	10.48
フリー	44,749	5.99	449	8.38
バリュー	12,641	1.69	113	2.11
小型	7,779	1.04	98	1.83
その他	34,543	4.62	201	3.75
日経225	16,655	2.23	66	1.23
TOPIX	14,966	2.00	76	1.42
JPX日経400	650	0.09	19	0.35
国内債券	34,957	4.68	132	2.46
一般	34,957	4.68	132	2.46
外国株式(先進国)	265,210	35.49	1,054	19.66
グローバル	201,025	26.90	694	12.95
除く日本	43,255	5.79	172	3.21
含む日本	157,770	21.11	522	9.74
その他	64,185	8.59	360	6.72
北米	183	0.02	10	0.19
米国	57,429	7.69	254	4.74
カナダ	232	0.03	3	0.06
欧州	1,455	0.19	48	0.90
ドイツ	22	0.00	1	0.02
イギリス	11	0.00	3	0.06
アジア・オセアニア	70	0.01	7	0.13
オーストラリア	4,762	0.64	32	0.60
ニュージーランド	15	0.00	1	0.02
複合地域	7	0.00	1	0.02
エマージング株式	31,336	4.19	332	6.19
グローバル	9,165	1.23	99	1.85
BRICS	673	0.09	7	0.13
その他	21,498	2.88	226	4.22
欧州	157	0.02	6	0.11
ロシア	122	0.02	4	0.07
アジア・オセアニア	7,043	0.94	102	1.90
中国	3,574	0.48	29	0.54
インド	8,498	1.14	30	0.56
インドネシア	125	0.02	4	0.07
タイ	66	0.01	4	0.07
フィリピン	49	0.01	5	0.09
ベトナム	964	0.13	10	0.19
韓国	6	0.00	1	0.02
香港	13	0.00	1	0.02
台湾	4	0.00	1	0.02
中南米	58	0.01	2	0.04
ブラジル	638	0.09	16	0.30
メキシコ	19	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	101	0.01	5	0.09
トルコ	41	0.01	2	0.04
複合地域	22	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	747,197	100.00		5,361	100.00
外国債券(先進国)	78,652	10.53		786	14.66
グローバル	59,109	7.91		505	9.42
除く日本	30,894	4.13		219	4.09
含む日本	28,215	3.78		286	5.33
その他	19,543	2.62		281	5.24
北米	82	0.01		6	0.11
米国	5,667	0.76		153	2.85
カナダ	1,038	0.14		6	0.11
欧州	1,452	0.19		35	0.65
イギリス	23	0.00		7	0.13
アジア・オセアニア	2,056	0.28		12	0.22
オーストラリア	7,706	1.03		40	0.75
ニュージーランド	122	0.02		13	0.24
複合地域	1,379	0.18		7	0.13
グローバル	0	0.00		1	0.02
エマージング債券	13,250	1.77		277	5.17
グローバル	6,946	0.93		185	3.45
米ドル建て	5,306	0.71		143	2.67
現地通貨建て	1,639	0.22		42	0.78
その他	6,304	0.84		92	1.72
ロシア	119	0.02		5	0.09
アジア・オセアニア	368	0.05		11	0.21
インド	3,010	0.40		19	0.35
インドネシア	398	0.05		11	0.21
ブラジル	1,707	0.23		24	0.45
メキシコ	358	0.05		8	0.15
トルコ	78	0.01		5	0.09
複合地域	41	0.01		1	0.02
ハイイールド債券	17,988	2.41		290	5.41
グローバル	2,854	0.38		55	1.03
北米	12,281	1.64		155	2.89
その他	2,853	0.38		80	1.49
欧州	2,207	0.30		45	0.84
アジア・オセアニア	602	0.08		30	0.56
複合地域	44	0.01		1	0.02
複合資産	115,510	15.46		993	18.52
安定	34,064	4.56		285	5.32
安定成長	50,191	6.72		406	7.57
成長	16,173	2.16		253	4.72
国内バランス	9,793	1.31		33	0.62
安定	9,318	1.25		9	0.17
一般	383	0.05		19	0.35
その他	5,289	0.71		16	0.30

<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	747,197	100.00	5,361	100.00
国内REIT	29,573	3.96	126	2.35
日本	29,573	3.96	126	2.35
外国REIT	43,978	5.89	283	5.28
グローバル	17,926	2.40	137	2.56
除く日本	4,774	0.64	50	0.93
含む日本	13,152	1.76	87	1.62
北米	22,080	2.96	84	1.57
その他	3,972	0.53	62	1.16
欧州	182	0.02	11	0.21
アジア・オセアニア	2,750	0.37	34	0.63
オーストラリア	714	0.10	13	0.24
複合地域	52	0.01	3	0.06
複数国	274	0.04	1	0.02
その他	16,319	2.18	220	4.10
絶対収益型	8,645	1.16	105	1.96
ロング・ショート	844	0.11	33	0.62
マーケットニュートラル	891	0.12	16	0.30
GTAA	396	0.05	12	0.22
その他スタイル	6,472	0.87	43	0.80
CB	1,775	0.24	39	0.73
アジア・オセアニア	38	0.01	1	0.02
日本	44	0.01	3	0.06
グローバル	1,692	0.23	35	0.65
コモディティ	3,186	0.43	29	0.54
全業種	1,082	0.14	14	0.26
貴金属	1,974	0.26	13	0.24
エネルギー	117	0.02	1	0.02
その他コモディティ	14	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	13,262	9.0	4.49	3.70	1.279
国内株式	17,823	12.2	1.61	1.14	1.110
一般	16,284	12.0	1.92	1.43	1.415
フリー	16,054	11.4	2.20	1.64	1.465
バリュー	17,198	14.3	0.91	0.67	1.237
小型	25,029	12.3	3.52	2.15	1.711
その他	18,687	12.8	0.52	0.35	0.458
日経225	20,783	14.5	0.65	0.43	0.549
TOPIX	19,130	14.3	0.23	0.16	0.284
JPX日経400	16,611	6.6	0.59	0.42	0.526
国内債券	10,945	11.2	0.27	0.27	0.354
一般	10,945	11.2	0.27	0.27	0.354
外国株式(先進国)	15,464	7.0	6.10	4.70	1.527
グローバル	16,268	7.1	4.90	3.78	1.539
除く日本	20,419	9.7	1.21	0.82	0.688
含む日本	14,900	6.3	6.09	4.72	1.772
その他	13,913	6.7	9.47	7.32	1.489
北米	14,685	6.9	6.19	4.25	1.770
米国	15,015	6.0	8.60	6.72	1.454
カナダ	7,958	9.1	9.20	6.56	1.992
欧州	12,919	9.8	4.91	3.89	1.651
ドイツ	12,984	7.0	0.00	0.00	0.770
イギリス	6,968	4.6	14.22	12.53	1.924
アジア・オセアニア	9,852	6.5	6.68	4.69	1.684
オーストラリア	8,673	6.7	21.39	15.63	1.825
ニュージーランド	16,759	8.7	3.49	2.39	1.672
複合地域	6,788	7.9	0.00	0.00	1.705
エマージング株式	14,584	9.7	3.55	2.55	1.739
グローバル	13,665	7.6	1.06	0.69	1.274
BRICS	17,043	14.9	1.30	0.85	2.069
その他	14,910	10.4	4.72	3.43	1.926
欧州	9,928	14.8	0.42	0.28	1.968
ロシア	11,620	11.9	1.00	0.70	2.003
アジア・オセアニア	16,278	10.7	7.27	5.31	1.744
中国	21,832	8.9	5.63	3.96	1.955
インド	14,464	10.9	2.47	1.45	2.070
インドネシア	10,224	11.0	0.00	0.00	1.861
タイ	10,352	12.9	2.37	1.65	1.695
フィリピン	9,513	7.6	0.30	0.23	1.786
ベトナム	14,267	5.1	0.96	0.52	1.889
韓国	15,956	2.3	0.00	0.00	1.804
香港	16,290	11.6	2.00	1.60	0.858
台湾	12,162	8.3	37.02	27.13	1.661
中南米	7,314	14.2	0.00	0.00	2.041
ブラジル	4,760	10.3	12.84	14.58	1.928
メキシコ	8,133	8.0	0.00	0.00	1.938
中東・アフリカ	11,014	9.7	2.72	1.72	2.068
トルコ	6,729	19.7	0.00	0.00	2.042
複合地域	21,791	12.8	3.58	2.39	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+実績決算回数))÷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+実績決算回数))÷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	13,262	9.0	4.49	3.70	1.279
外国債券(先進国)	10,124	9.1	2.45	2.24	1.073
グローバル	10,718	9.4	1.70	1.64	1.000
除く日本	11,663	11.8	1.54	1.48	0.781
含む日本	9,993	7.6	1.88	1.82	1.238
その他	9,058	8.6	4.64	4.00	1.294
北米	10,428	6.9	2.65	2.47	1.789
米国	9,534	7.4	6.15	5.31	1.359
カナダ	7,809	8.7	2.79	2.50	1.378
欧州	8,639	10.9	1.45	1.28	1.074
イギリス	8,157	6.1	3.31	2.87	1.350
アジア・オセアニア	8,346	10.4	3.53	2.93	1.420
オーストラリア	8,463	11.9	5.13	4.37	1.257
ニュージーランド	9,724	6.7	2.22	1.93	1.364
複合地域	4,804	11.7	2.65	2.50	1.188
グローバル	8,858	5.4	1.25	1.13	1.474
エマージング債券	8,480	9.6	6.18	5.95	1.567
グローバル	8,904	10.3	5.25	4.89	1.516
米ドル建て	9,072	10.7	5.33	4.91	1.590
現地通貨建て	8,329	9.2	4.99	4.82	1.275
その他	7,627	8.2	7.20	7.11	1.623
ロシア	7,630	8.1	7.51	7.37	1.604
アジア・オセアニア	9,686	8.0	8.49	8.24	1.633
インド	9,099	6.6	7.63	7.04	1.700
インドネシア	7,161	8.6	8.49	7.20	1.664
ブラジル	6,277	11.3	6.50	7.63	1.588
メキシコ	6,575	8.1	7.35	6.30	1.403
トルコ	2,363	8.1	9.26	13.42	1.454
複合地域	3,830	14.6	3.41	3.13	1.210
ハイイールド債券	8,908	9.7	8.20	7.13	1.688
グローバル	7,806	9.0	5.99	5.18	1.569
北米	9,948	10.8	8.03	6.91	1.696
その他	7,649	8.2	11.11	10.00	1.776
欧州	7,297	8.1	11.37	10.28	1.747
アジア・オセアニア	7,945	8.9	10.53	9.36	1.883
複合地域	4,599	17.0	6.15	5.22	1.800
複合資産	12,884	8.5	1.60	1.42	1.026
安定	11,651	8.1	0.97	0.87	1.134
安定成長	12,568	9.1	2.17	1.92	1.048
成長	15,000	8.5	0.64	0.50	0.822
国内バランス	12,055	8.7	2.30	2.30	0.939
安定	10,917	9.7	2.33	2.34	0.920
一般	12,783	9.5	1.91	1.57	1.338
その他	11,104	1.3	1.89	1.46	0.907

(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÷実績決算回数))÷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÷実績決算回数))÷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	13,262	9.0	4.49	3.70	1.279
国内REIT	14,397	8.9	10.44	9.60	0.945
日本	14,397	8.9	10.44	9.60	0.945
外国REIT	11,036	8.0	12.46	10.83	1.533
グローバル	11,965	8.4	8.38	7.02	1.363
除く日本	13,781	6.9	8.39	7.67	1.059
含む日本	10,922	9.3	8.37	6.78	1.473
北米	10,249	8.0	16.18	14.39	1.629
その他	10,048	7.1	10.24	8.23	1.770
欧州	7,299	7.1	7.44	6.50	1.818
アジア・オセアニア	11,677	6.9	11.90	9.92	1.813
オーストラリア	9,075	6.3	7.88	4.92	1.710
複合地域	5,929	9.1	1.75	1.18	0.812
複数国	9,895	16.9	3.19	2.43	1.650
その他					
絶対収益型	10,508	5.4	0.19	0.18	1.697
ロング・ショート	10,852	4.7	0.42	0.40	1.448
マーケットニュートラル	10,393	5.3	0.91	0.87	1.299
GTAA	11,264	7.4	0.95	0.90	1.533
その他スタイル	10,049	5.5	0.01	0.01	1.797
CB	12,397	7.7	9.79	8.10	1.350
アジア・オセアニア	10,056	10.8	3.41	2.39	1.823
日本	11,637	9.9	0.24	0.23	0.986
グローバル	12,529	7.4	10.45	8.66	1.349
コモディティ	8,761	7.2	0.00	0.00	0.948
全業種	6,166	9.6	0.00	0.00	1.343
貴金属	11,354	4.5	0.00	0.00	0.727
エネルギー	8,911	12.1	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	11,221	4.5	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÷実績決算回数))÷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÷実績決算回数))÷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

システムグループ 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