

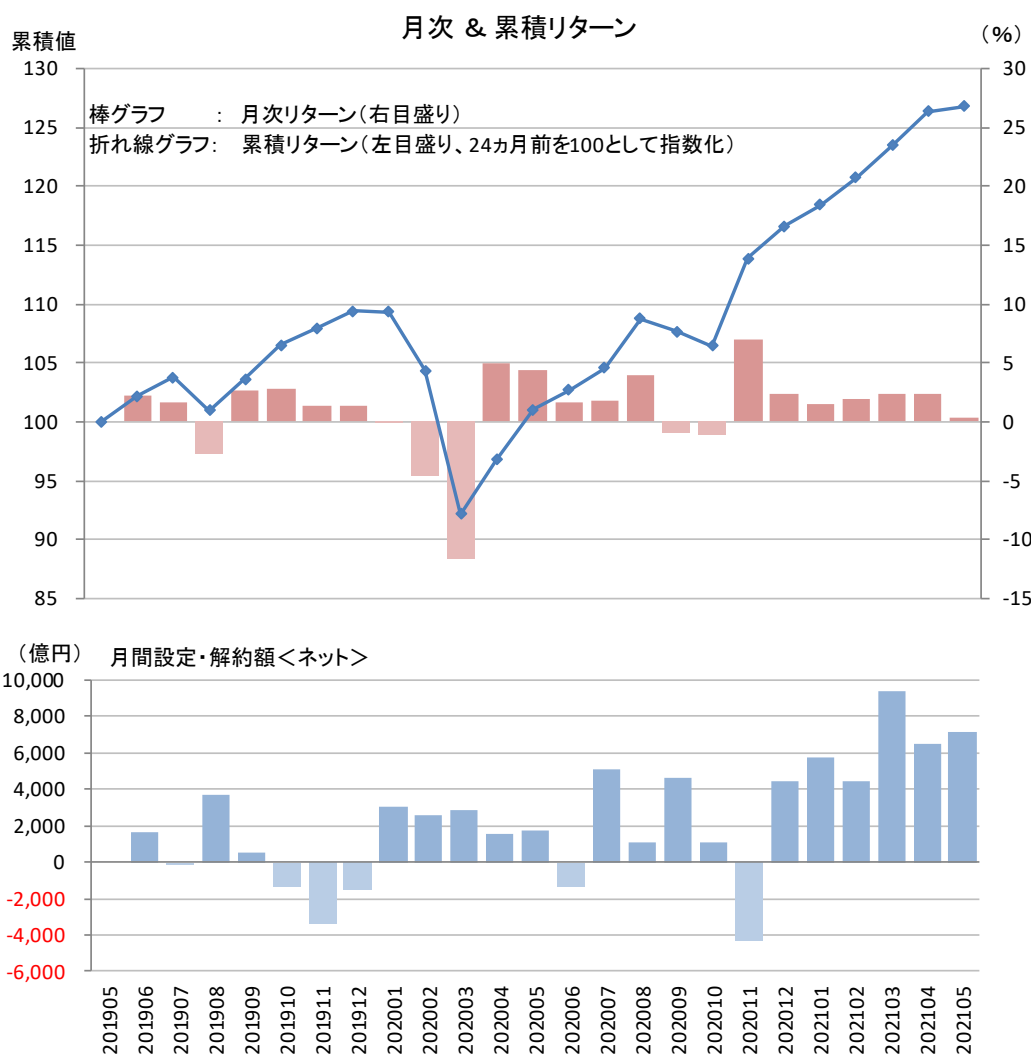
投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2021年5月

「総合」 +0.31 %

(前月 +2.34 %)



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		15,776	15,727	48	0.31	
国内株式		19,705	19,577	129	0.66	
一般		19,059	18,938	122	0.64	
フリー		18,094	18,017	77	0.43	
バリュー		23,610	23,279	331	1.42	
小型		42,724	43,022	-298	-0.69	
その他		19,452	19,263	189	0.98	
日経225		19,289	19,259	30	0.16	
TOPIX		18,475	18,227	248	1.36	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	17,545	17,258	287	1.66	
国内債券		13,212	13,201	11	0.09	
一般		13,212	13,201	11	0.09	
外国株式(先進国)		20,957	21,140	-183	-0.86	
グローバル		23,411	23,654	-243	-1.03	
除く日本		31,497	31,080	416	1.34	
含む日本		21,610	21,973	-364	-1.66	
その他		15,921	15,976	-55	-0.34	
北米		16,753	16,381	371	2.27	
米国		24,670	24,815	-145	-0.58	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	20,103	19,469	634	3.26	
欧州		23,242	22,435	808	3.60	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	11,355	10,985	370	3.37	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	9,376	8,959	417	4.65	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	40,583	40,553	30	0.08	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	17,622	17,411	211	1.21	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	44,043	44,750	-707	-1.58	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	7,945	7,584	361	4.76	
エマージング株式		18,776	18,328	447	2.44	
グローバル		19,605	19,429	176	0.91	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	29,141	28,226	914	3.24	
その他		19,063	18,492	571	3.09	
欧州		27,395	25,500	1,895	7.43	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	12,712	11,924	788	6.61	
アジア・オセアニア		19,766	19,994	-228	-1.14	
中国		53,435	52,174	1,261	2.42	
インド	10,000 (2004.09.30)	40,313	38,023	2,290	6.02	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	12,101	12,255	-154	-1.26	
タイ		20,638	21,121	-483	-2.29	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,302	6,987	315	4.50	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	20,396	18,564	1,832	9.87	
韓国	10,000 (1997.06.30)	36,688	36,599	89	0.24	
香港		25,351	25,189	162	0.64	
台湾	10,000 (2008.03.31)	24,743	25,520	-777	-3.04	
中南米	7,427 (2006.04.28)	8,750	8,356	394	4.71	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	8,708	8,173	535	6.55	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	9,851	9,601	250	2.60	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	11,293	11,064	230	2.08	
トルコ		19,732	19,913	-182	-0.91	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	25,673	25,964	-290	-1.12	

※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		15,776	15,727	48	0.31	
外国債券(先進国)		18,940	18,801	139	0.74	
グローバル		19,109	18,958	151	0.80	
除く日本		20,673	20,474	199	0.97	
含む日本		18,140	18,028	112	0.62	
その他		18,481	18,377	104	0.57	
北米	9,052 (2013.05.31)	11,049	10,961	89	0.81	
米国		16,649	16,403	246	1.50	
カナダ	10,000 (2003.05.30)	15,662	15,270	392	2.57	
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,577	15,589	-12	-0.08	
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,691	10,446	245	2.34	
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	20,801	20,820	-19	-0.09	
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	25,553	25,550	3	0.01	
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,931	12,019	-88	-0.73	
複合地域	10,000 (2001.11.30)	18,945	18,927	17	0.09	
グローバル	10,000 (2015.10.30)	10,131	9,881	250	2.53	
エマージング債券		17,256	16,819	437	2.60	
グローバル		18,743	18,351	392	2.13	
米ドル建て		19,380	18,973	407	2.14	
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,937	12,670	266	2.10	
その他	8,647 (2005.03.31)	12,631	12,248	383	3.13	
ロシア	10,000 (2008.05.30)	10,535	10,225	310	3.03	
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	15,046	14,886	160	1.08	
インド	10,000 (2011.08.31)	17,488	16,837	650	3.86	
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	14,665	14,330	335	2.34	
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	10,439	10,128	312	3.08	
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	12,859	12,591	268	2.13	
トルコ	10,000 (2011.04.28)	4,228	4,336	-108	-2.50	
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,686	10,589	97	0.92	
ハイイールド債券		23,244	22,933	310	1.35	
グローバル	10,000 (1997.06.30)	23,449	22,970	479	2.09	
北米		22,632	22,348	284	1.27	
その他	10,000 (2004.03.31)	23,168	22,947	221	0.96	
欧州	10,000 (2006.04.28)	23,149	22,990	159	0.69	
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	15,165	14,876	288	1.94	
複合地域	10,000 (2004.03.31)	21,813	21,550	262	1.22	
複合資産		18,985	18,822	163	0.86	
安定	10,000 (1998.10.30)	16,385	16,283	101	0.62	
安定成長		20,641	20,419	222	1.09	
成長		24,437	24,178	259	1.07	
国内バランス		12,912	12,918	-7	-0.05	
安定		13,148	13,160	-11	-0.09	
一般		16,182	16,091	91	0.56	
その他	10,000 (2018.10.31)	14,697	14,496	201	1.39	

※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		15,776	15,727	48	0.31	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	35,892	35,649	243	0.68	
日本	10,000 (2003.10.31)	35,892	35,649	243	0.68	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	29,483	28,979	504	1.74	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	25,246	24,780	466	1.88	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	27,996	27,454	542	1.97	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	25,130	24,674	455	1.84	
北米	10,000 (2003.09.30)	29,983	29,442	541	1.84	
その他	10,000 (2004.04.30)	28,696	28,555	142	0.50	
欧州	10,000 (2006.12.29)	6,034	5,779	255	4.41	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	21,179	21,162	17	0.08	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	15,833	15,717	116	0.74	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	6,702	6,610	92	1.39	
複数国	10,000 (2004.04.30)	40,324	39,780	543	1.37	
その他		6,599	6,527	73	1.11	
絶対収益型		7,916	7,911	5	0.06	
ロング・ショート		8,655	8,609	47	0.54	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	12,013	12,227	-214	-1.75	
GTAA		11,729	11,699	31	0.26	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,440	7,424	16	0.21	
CB		21,924	21,940	-16	-0.07	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	20,401	19,918	483	2.43	
日本		20,039	20,145	-106	-0.53	
グローバル		38,538	38,584	-46	-0.12	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	9,576	9,009	567	6.29	
全業種	10,000 (2004.12.30)	7,374	7,120	255	3.58	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	18,624	17,262	1,362	7.89	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	5,011	4,874	137	2.82	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	11,152	10,650	502	4.72	

※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	5.02	11.31	25.45	8.69
国内株式	3.02	8.75	28.45	5.80
一般	3.38	8.30	27.74	5.70
フリー	2.75	6.94	27.76	4.59
バリュー	5.67	13.40	27.29	9.81
小型	3.16	4.03	26.90	2.66
その他	2.35	10.72	29.76	6.76
日経225	0.10	9.76	33.32	5.63
TOPIX	4.06	10.69	25.34	7.53
JPX日経400	3.83	9.85	25.44	7.16
国内債券	0.88	-0.13	-0.18	-0.20
一般	0.88	-0.13	-0.18	-0.20
外国株式(先進国)	6.17	15.18	41.48	11.49
グローバル	4.91	14.55	42.62	10.56
除く日本	12.00	21.96	44.88	18.67
含む日本	3.09	12.65	42.16	8.49
その他	10.25	17.28	38.40	14.53
北米	15.55	28.53	54.50	25.94
米国	10.46	17.04	38.07	14.32
カナダ	11.65	20.65	42.05	18.14
欧州	12.58	21.33	38.38	16.33
ドイツ	14.93	23.73	45.16	17.61
イギリス	10.38	22.77	30.88	18.58
アジア・オセアニア	2.81	12.99	34.42	10.69
オーストラリア	7.06	18.24	42.56	15.70
ニュージーランド	3.64	7.16	36.73	1.35
複合地域	14.92	40.12	46.32	43.15
エマージング株式	3.56	20.04	53.53	14.89
グローバル	3.22	17.81	50.92	14.29
BRICS	5.90	18.39	50.06	13.99
その他	3.64	21.04	54.75	15.19
欧州	11.00	22.56	27.57	14.49
ロシア	14.32	27.45	35.40	19.10
アジア・オセアニア	-1.05	14.07	45.40	11.76
中国	0.40	16.05	50.34	12.23
インド	5.80	28.14	68.71	19.64
インドネシア	-5.08	-0.14	26.72	-2.83
タイ	2.38	6.62	13.65	6.87
フィリピン	4.55	4.76	27.73	0.10
ベトナム	19.70	40.08	65.05	29.93
韓国	7.76	25.46	70.49	12.70
香港	0.64	14.78	31.35	16.79
台湾	0.93	26.74	55.51	19.64
中南米	14.91	19.62	50.41	9.55
ブラジル	18.80	17.53	42.20	7.72
メキシコ	17.87	22.74	49.98	15.84
中東・アフリカ	13.08	25.57	47.39	22.08
トルコ	-11.84	4.10	9.83	-8.53
複合地域	1.11	18.68	45.24	16.48

※[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	5.02	11.31	25.45	8.69
外国債券(先進国)	2.39	3.20	7.40	2.27
グローバル	2.14	2.00	5.48	1.26
除く日本	2.57	2.35	5.57	1.57
含む日本	1.70	1.64	5.41	0.94
その他	3.14	6.87	13.27	5.37
北米	1.85	1.49	6.32	0.96
米国	5.54	7.66	9.60	7.52
カナダ	7.89	11.00	14.37	9.80
欧州	0.40	-0.17	4.30	-1.14
イギリス	4.63	10.45	16.59	9.21
アジア・オセアニア	1.80	7.66	17.18	5.39
オーストラリア	1.87	7.46	17.28	5.07
ニュージーランド	1.93	2.84	12.18	2.01
複合地域	2.25	4.32	9.72	2.74
グローバル	5.97	9.18	11.48	6.71
エマージング債券	4.62	6.57	11.72	3.92
グローバル	3.77	5.71	12.56	2.93
米ドル建て	4.05	5.92	13.66	3.13
現地通貨建て	2.88	5.02	8.48	2.28
その他	5.57	7.54	10.99	5.03
ロシア	4.82	7.35	-1.21	4.17
アジア・オセアニア	1.37	3.56	7.50	2.78
インド	5.31	9.64	15.77	8.25
インドネシア	3.25	5.10	14.64	3.48
ブラジル	8.51	6.73	4.88	1.93
メキシコ	5.94	3.77	16.24	1.26
トルコ	-18.21	-10.71	-23.08	-14.88
複合地域	2.14	1.87	6.81	0.38
ハイイールド債券	4.53	10.47	18.79	8.19
グローバル	4.80	9.55	18.77	7.06
北米	4.98	11.00	18.81	8.98
その他	2.39	9.14	18.57	6.05
欧州	2.00	9.09	18.90	5.82
アジア・オセアニア	3.71	9.30	17.16	6.82
複合地域	4.06	8.43	17.43	6.54
複合資産	4.08	6.96	13.72	5.44
安定	2.47	3.51	7.68	2.63
安定成長	4.73	8.33	15.54	6.66
成長	5.81	11.44	23.72	9.15
国内バランス	1.88	3.15	3.50	1.97
安定	1.79	2.83	2.85	1.74
一般	3.48	8.75	16.74	5.76
その他	7.23	10.03	25.00	7.44

※[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③

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	5.02	11.31	25.45	8.69
国内REIT	7.94	24.74	26.42	17.84
日本	7.94	24.74	26.42	17.84
外国REIT	13.90	23.43	33.57	22.19
グローバル	13.00	22.32	34.66	20.68
除く日本	13.29	22.99	37.79	21.39
含む日本	12.90	22.08	33.65	20.42
北米	15.87	26.41	33.38	25.97
その他	7.23	12.70	29.30	9.44
欧州	12.37	17.62	30.96	13.40
アジア・オセアニア	5.43	10.98	25.99	7.87
オーストラリア	10.28	13.09	40.51	9.23
複合地域	12.85	20.21	36.73	14.11
複数国	13.38	25.72	32.17	23.96
その他	2.56	6.23	14.03	4.12
絶対収益型	0.72	1.35	3.56	0.88
ロング・ショート	1.07	-0.36	-0.51	-0.40
マーケットニュートラル	-1.77	-4.16	0.03	-3.57
GTAA	2.29	5.23	9.90	3.68
その他スタイル	0.90	2.10	4.14	1.48
CB	0.88	7.33	21.45	5.03
アジア・オセアニア	6.49	23.32	41.77	19.54
日本	-2.18	-0.84	2.65	-0.77
グローバル	0.83	7.24	21.67	4.89
コモディティ	8.66	16.71	24.94	11.48
全業種	9.13	31.56	53.22	27.62
貴金属	8.24	8.23	9.87	2.48
エネルギー	10.27	47.68	73.56	42.36
その他コモディティ	11.36	27.75	45.20	24.47

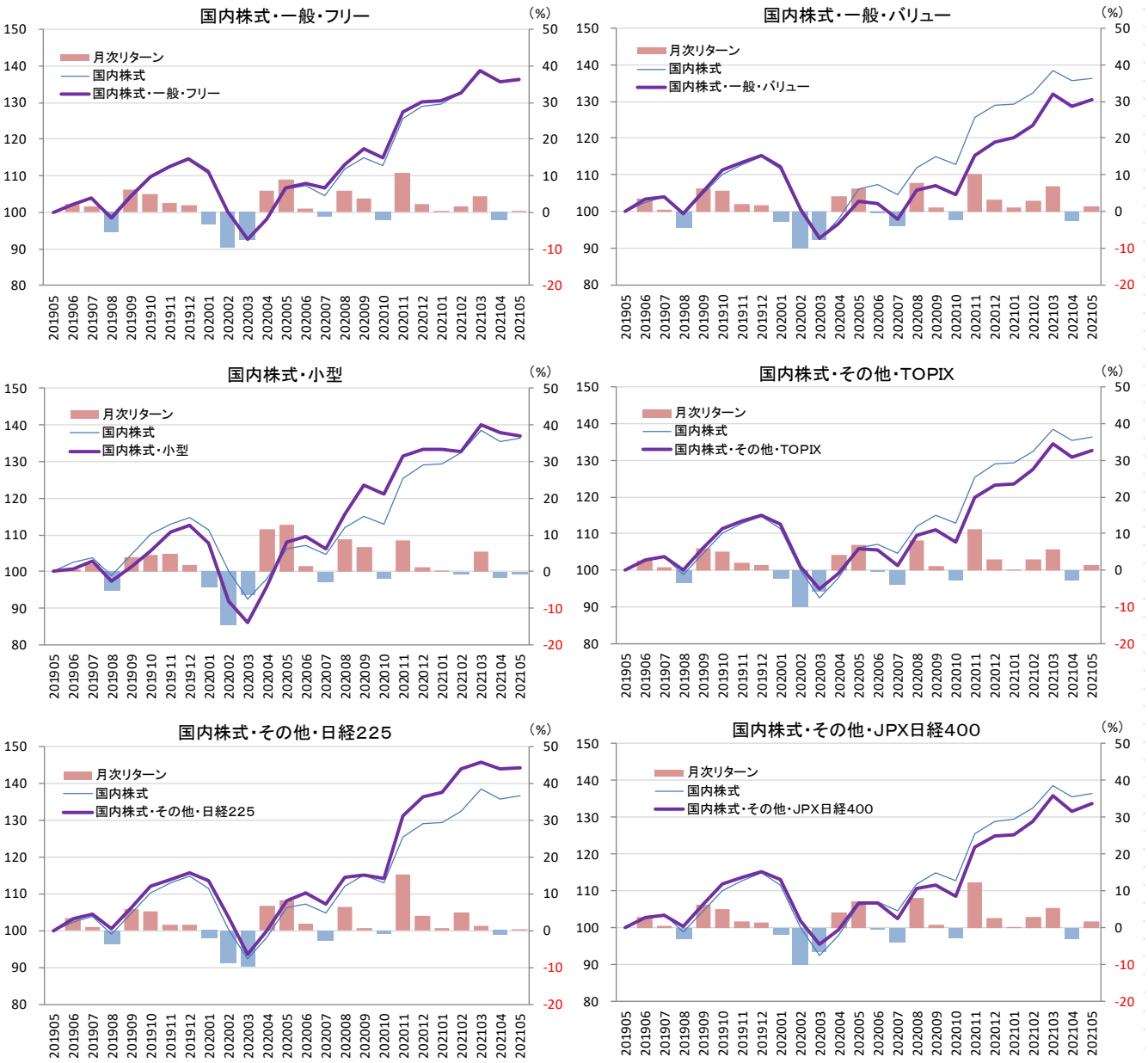
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

＜1＞パフォーマンス・サマリー

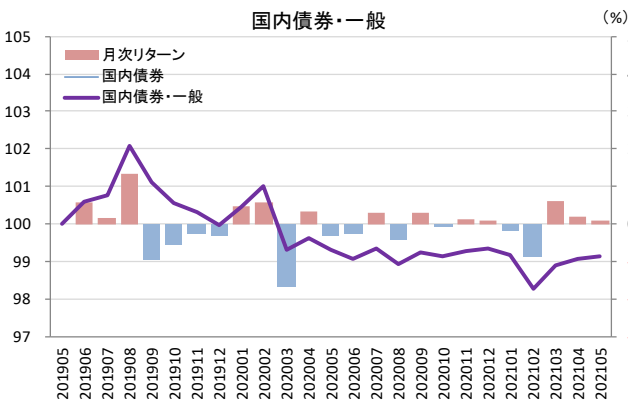
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

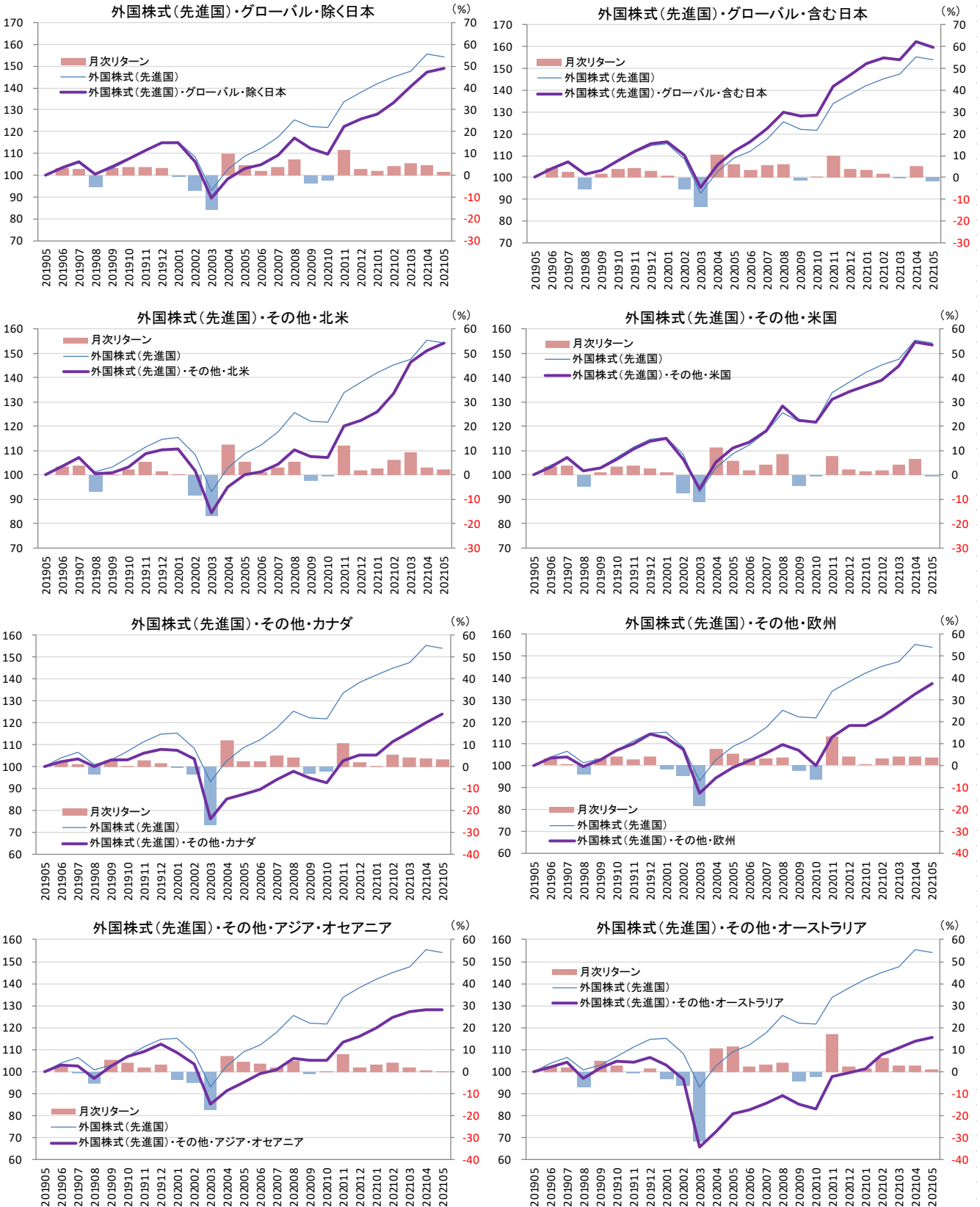


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

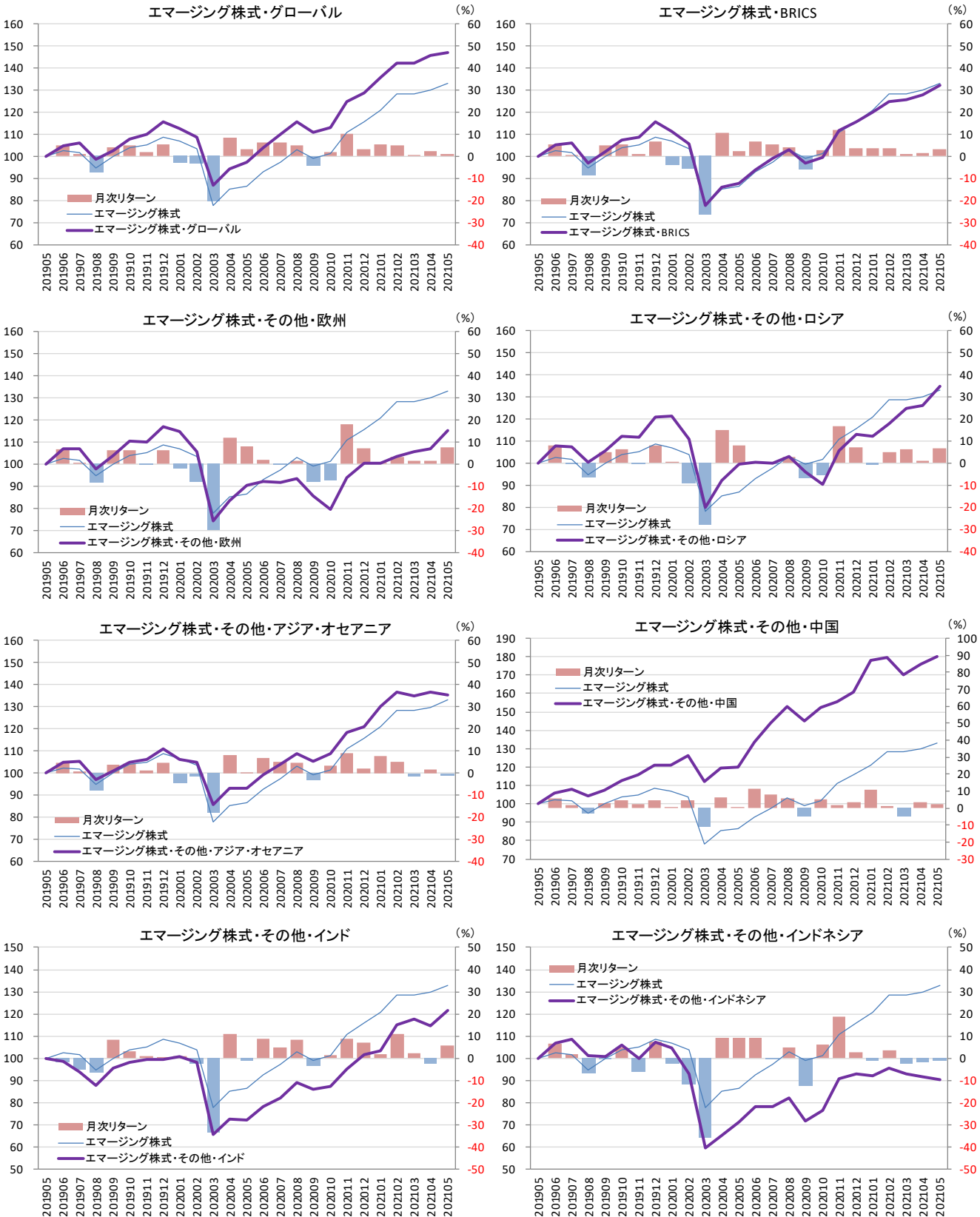


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

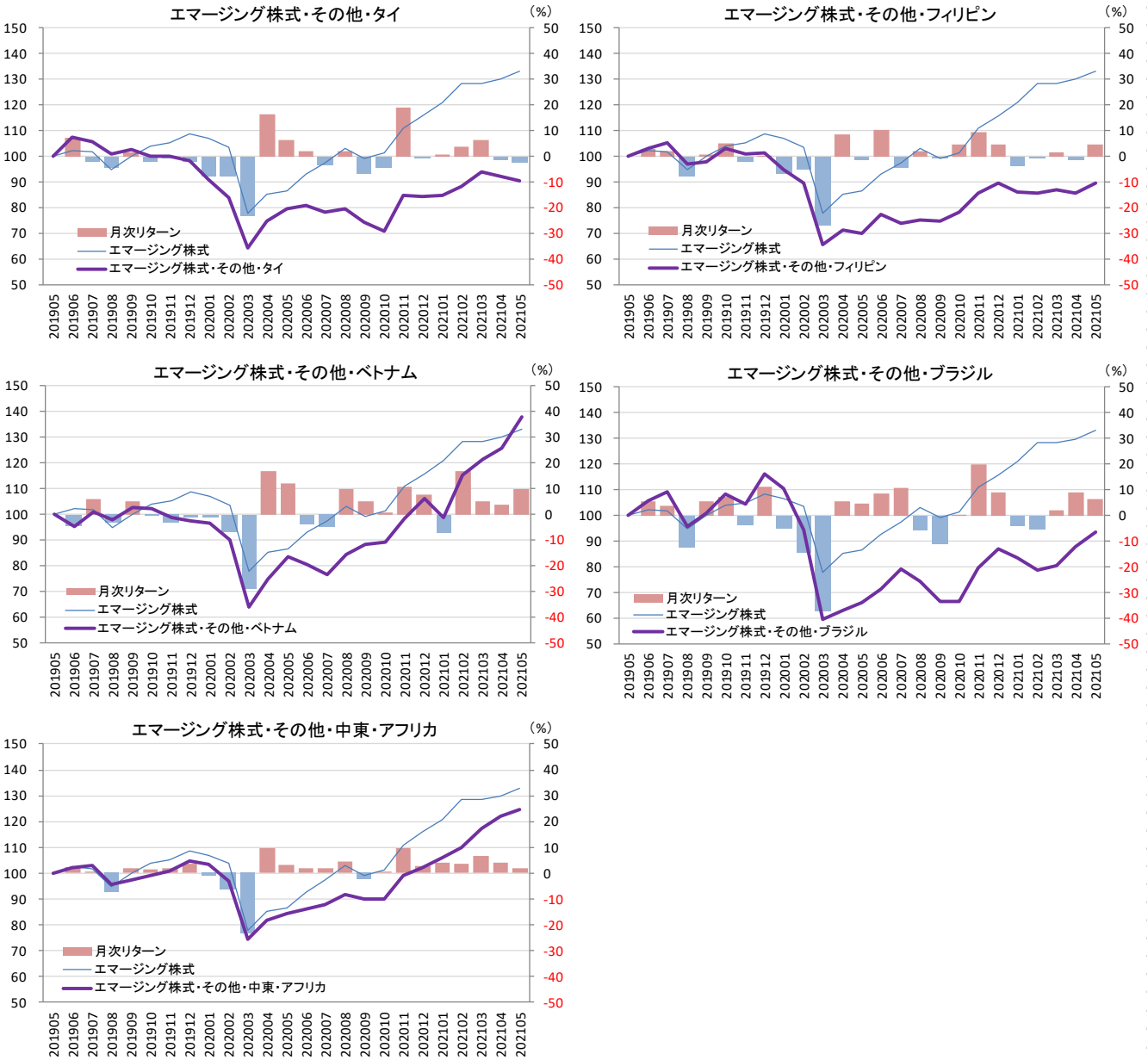


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

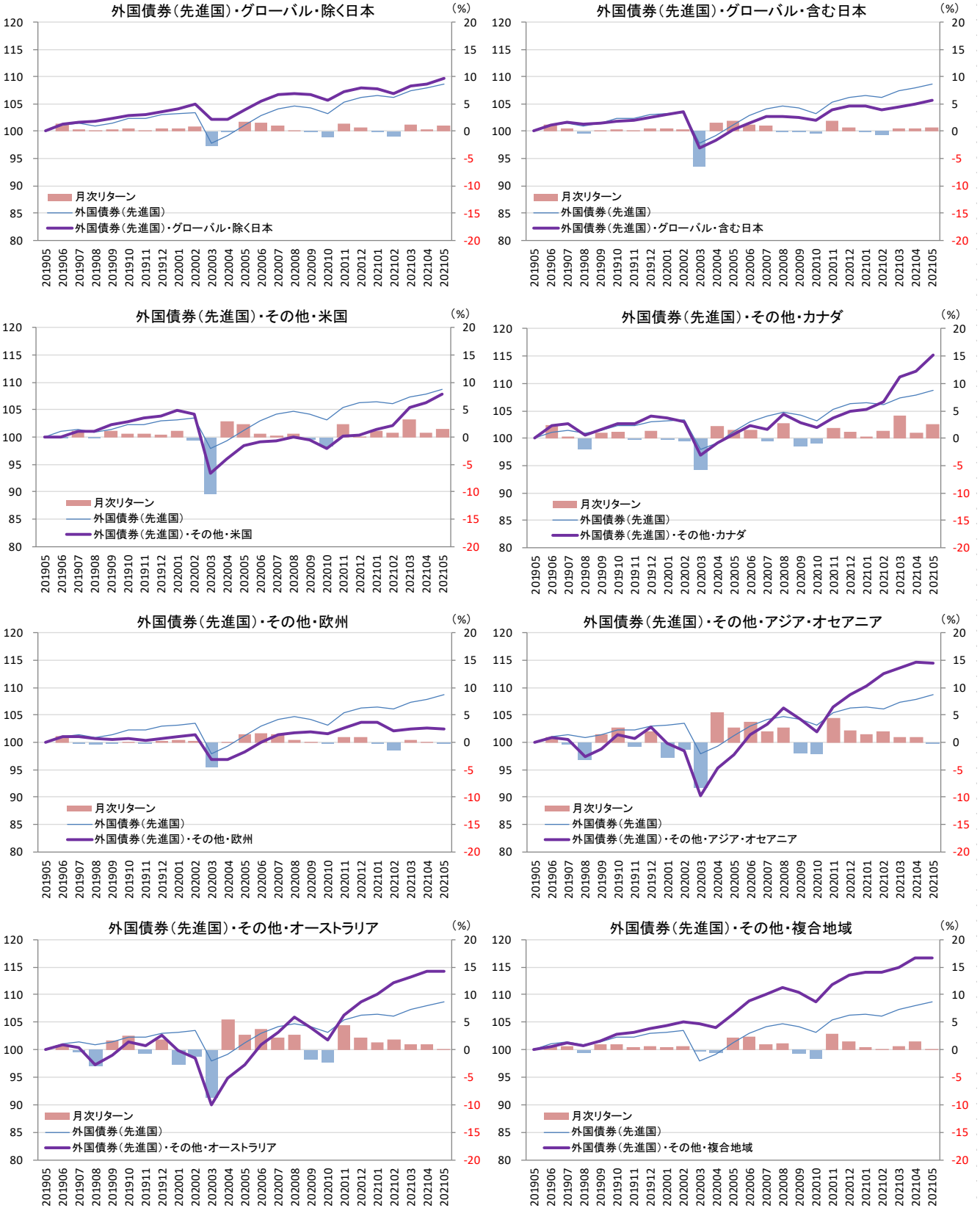


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

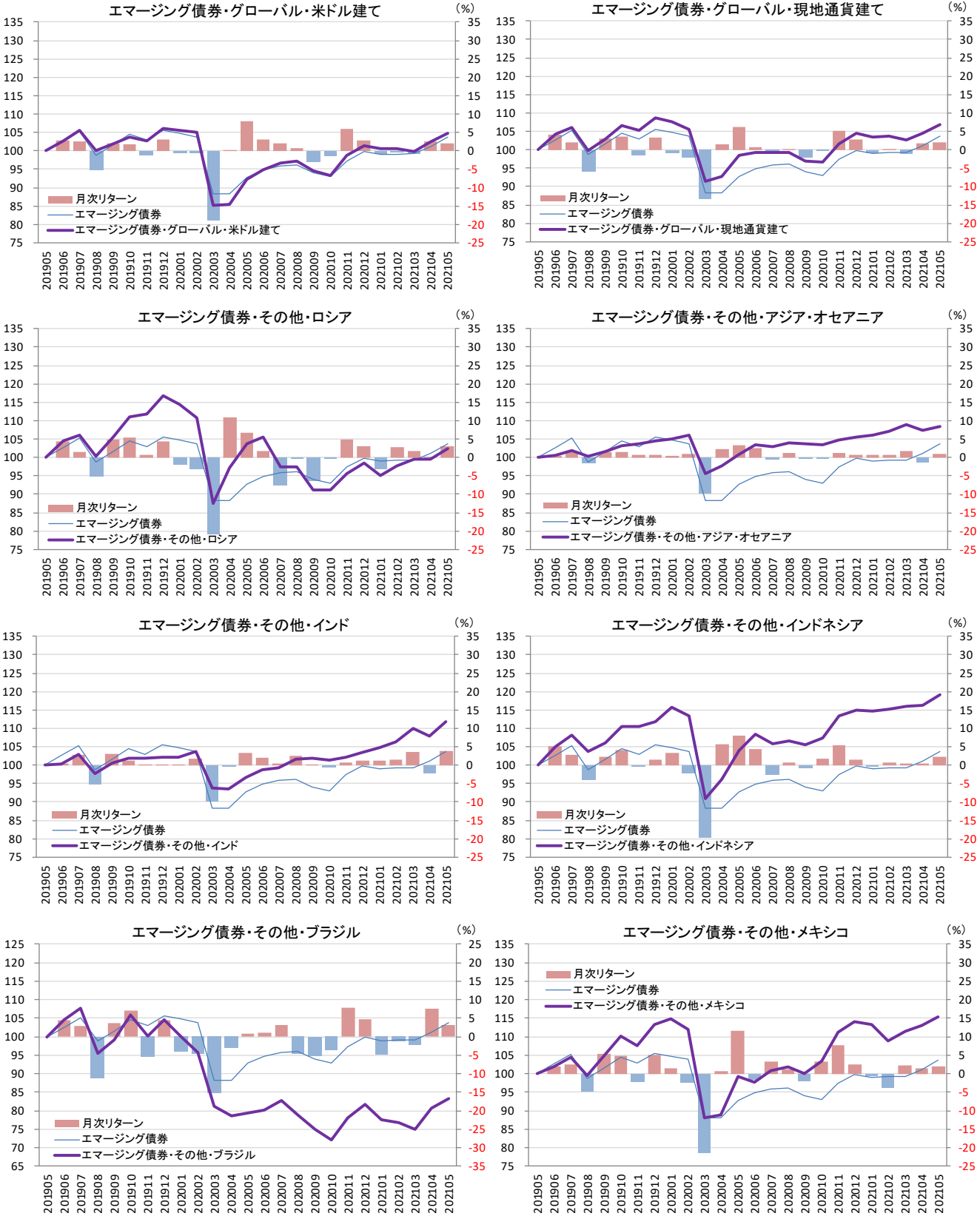


＜1＞パフォーマンス・サマリー

(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]

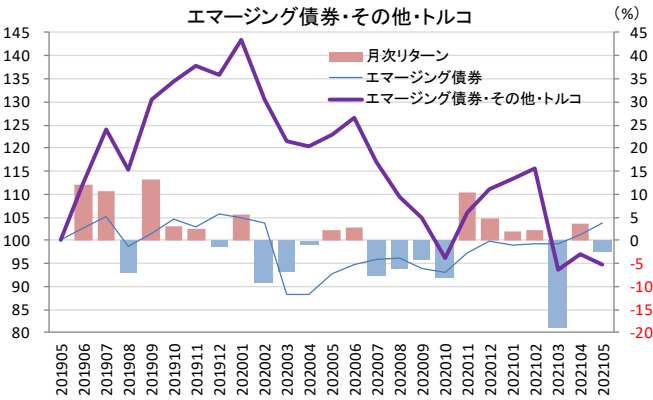


<1>パフォーマンス・サマリー

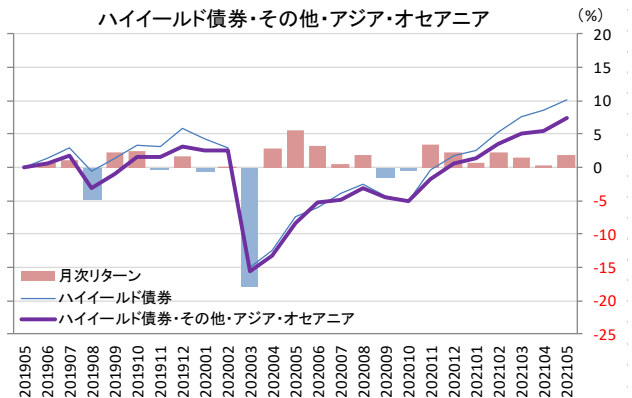
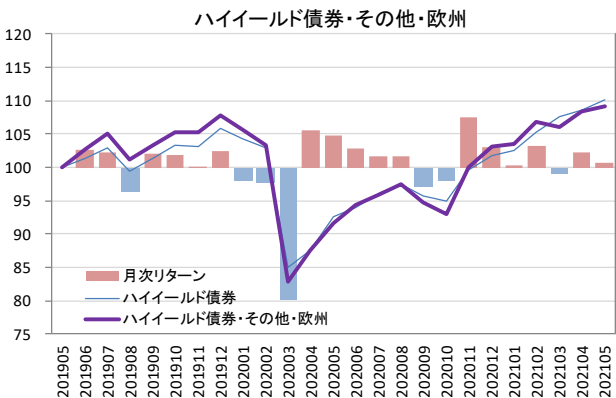
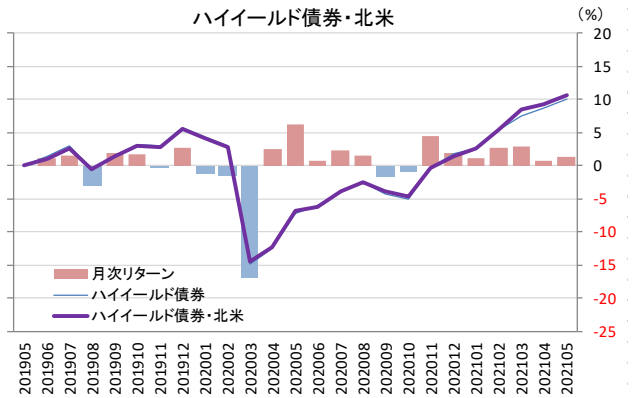
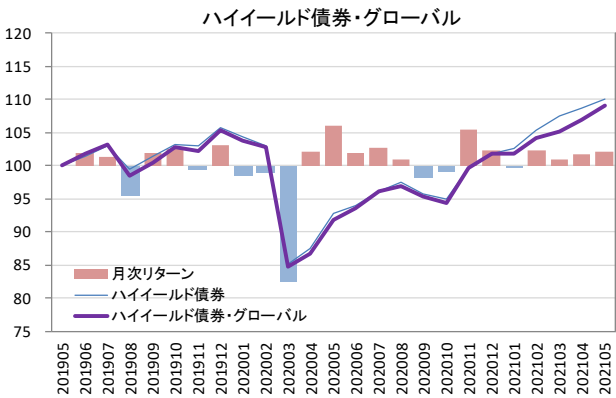
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

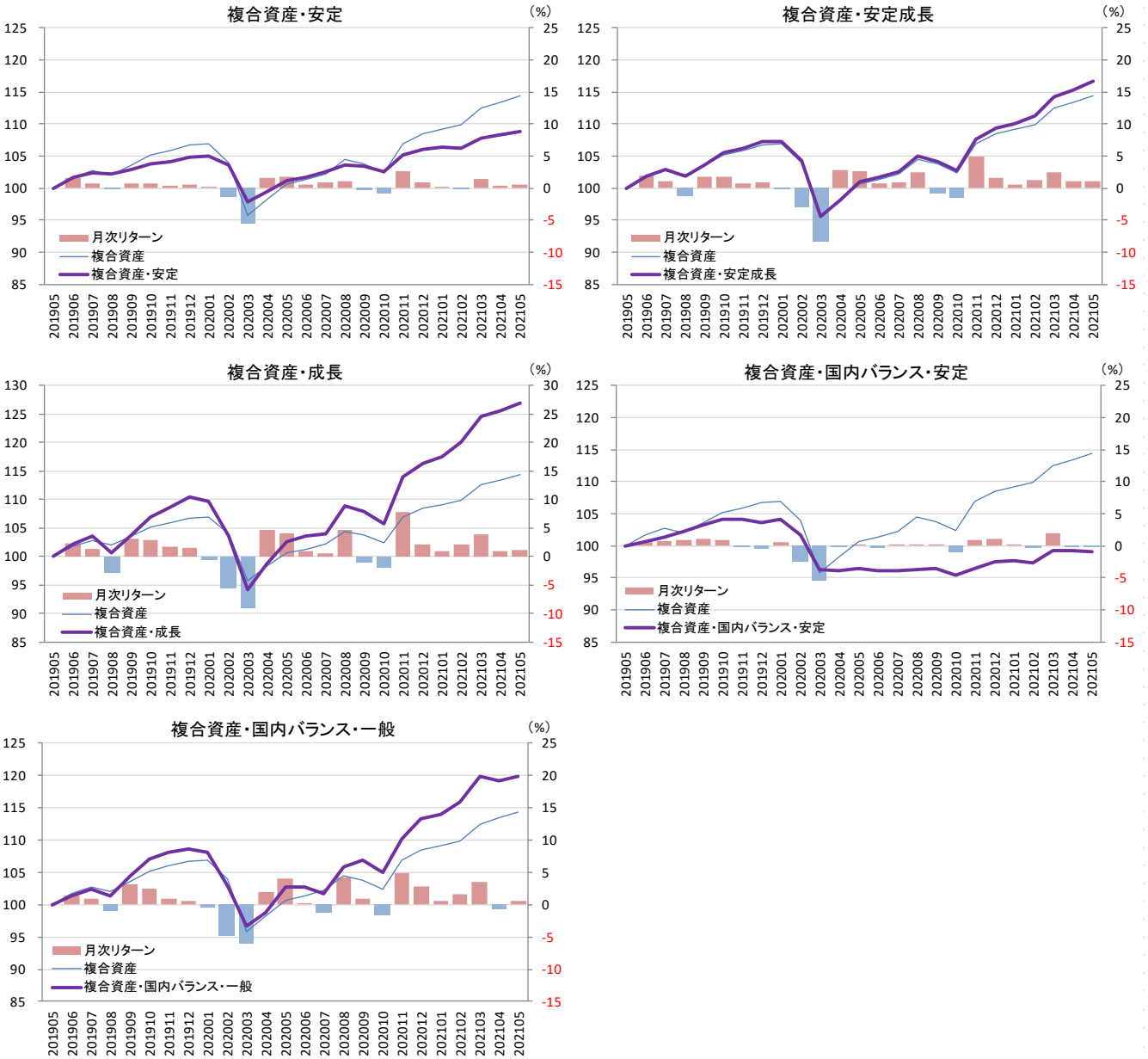


<1>パフォーマンス・サマリー

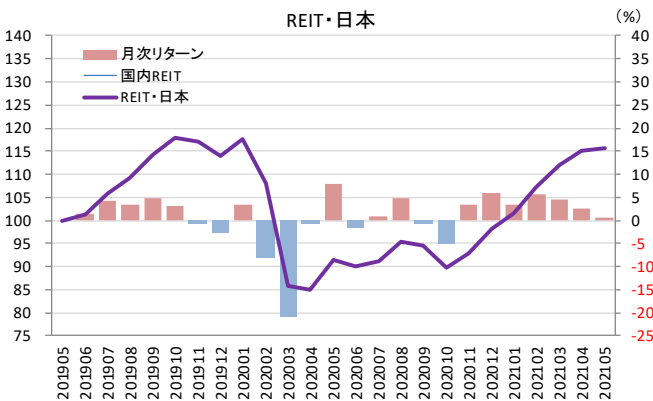
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

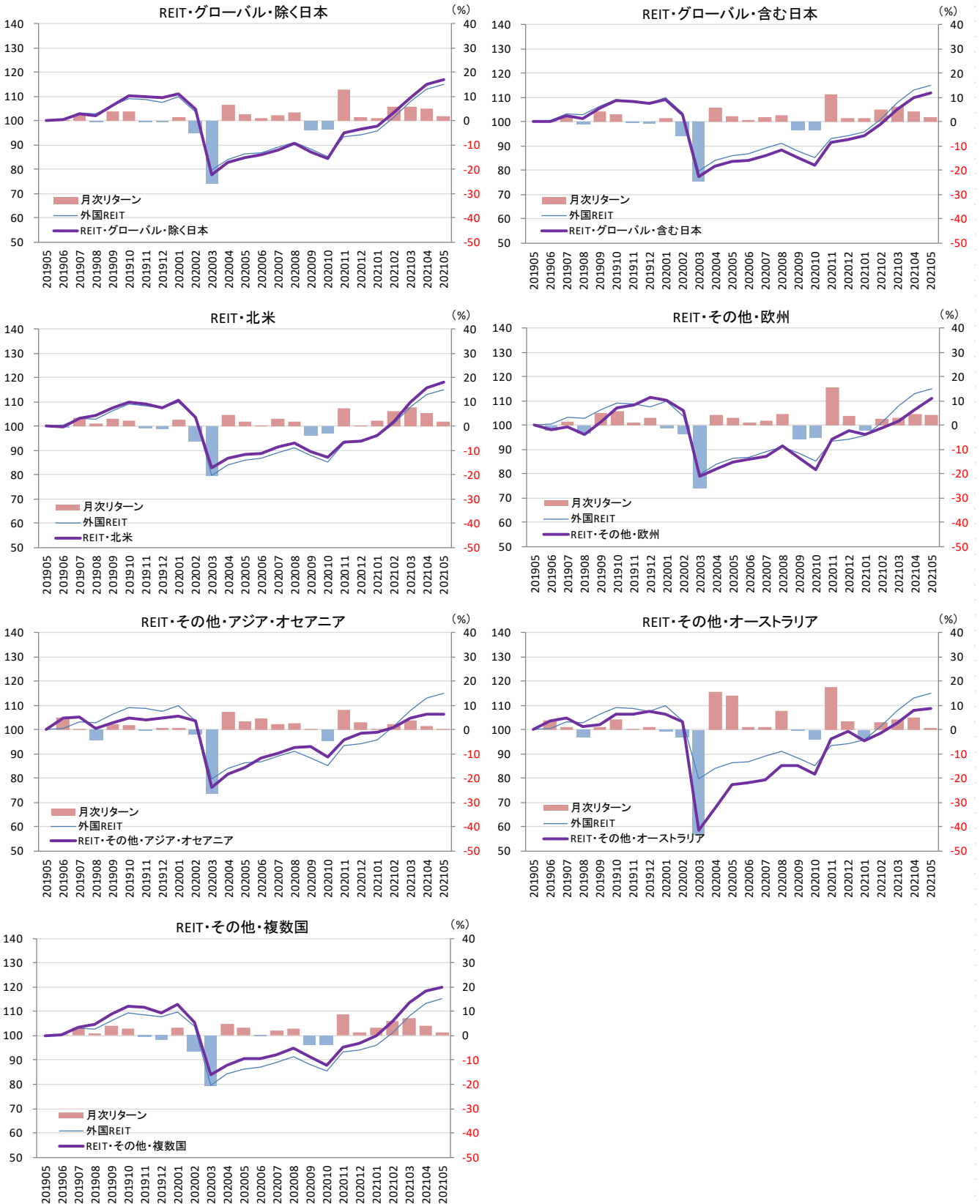


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

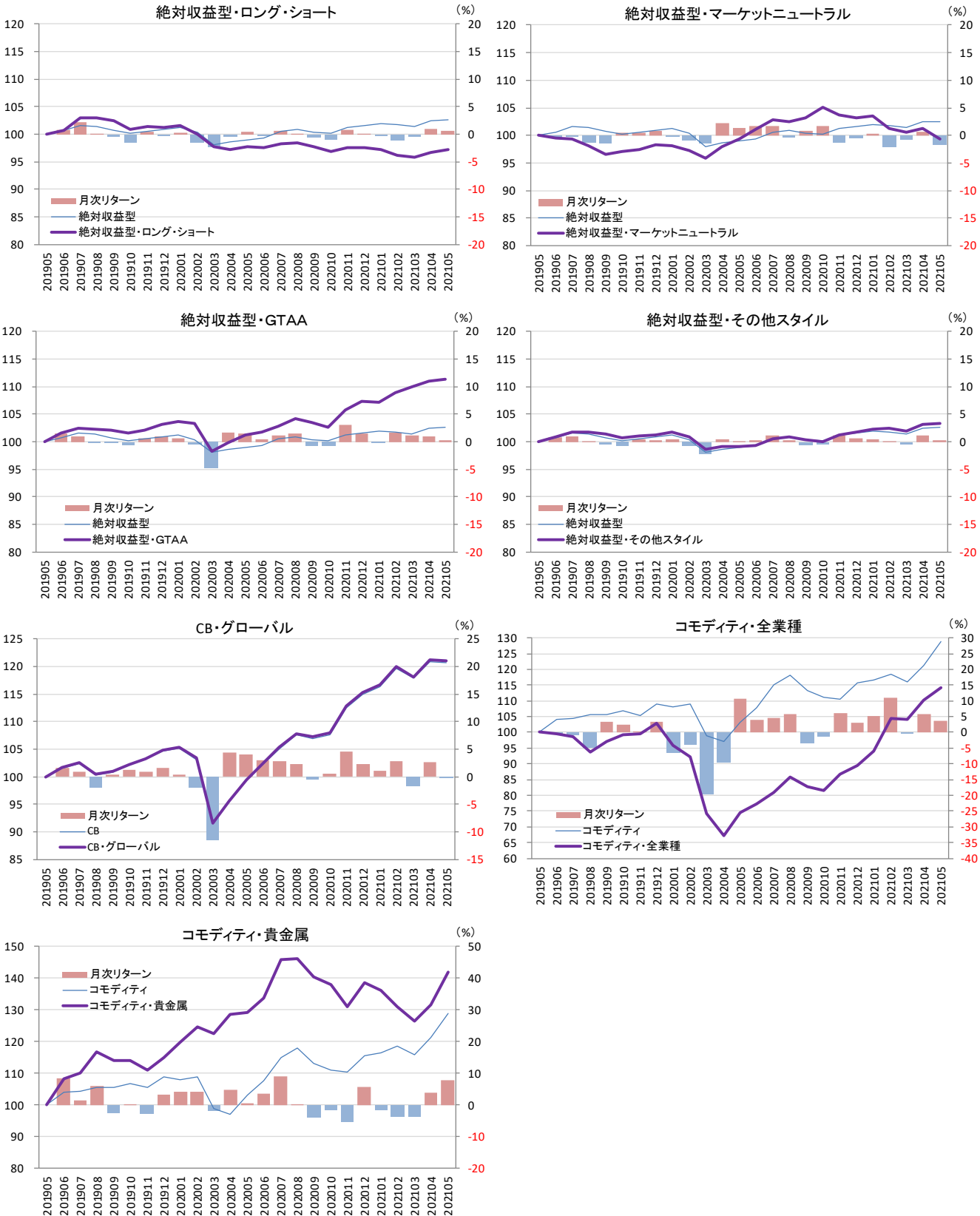


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	0.31		
1	エマージング株式・その他	3.09	2.75	0.08
2	複合資産・安定成長	1.09	6.68	0.07
3	外国債券(先進国)・グローバル	0.80	7.80	0.06
4	REIT・北米	1.84	2.96	0.05
5	国内株式・その他	0.98	4.47	0.05
6	国内株式・一般	0.64	7.22	0.05
7	REIT・グローバル	1.88	2.39	0.04
8	複合資産・安定	0.62	4.54	0.03
9	コモディティ	6.29	0.46	0.03
10	REIT・日本	0.68	3.90	0.02
11	エマージング債券・その他	3.13	0.82	0.02
12	複合資産・成長	1.07	2.18	0.02
13	ハイレッド債券・北米	1.27	1.59	0.02
14	エマージング債券・グローバル	2.13	0.92	0.02
15	外国債券(先進国)・その他	0.57	2.52	0.01
16	エマージング株式・グローバル	0.91	1.19	0.01
17	複合資産・その他	1.39	0.65	0.01
18	ハイレッド債券・グローバル	2.09	0.38	0.01
19	国内債券・一般	0.09	4.74	0.00
20	ハイレッド債券・その他	0.96	0.37	0.00
21	エマージング株式・BRICS	3.24	0.09	0.00
22	REIT・その他	0.50	0.51	0.00
23	国内株式・業種特化	0.52	0.09	0.00
24	絶対収益型	0.06	1.18	0.00
25	CB	-0.07	0.23	-0.00
26	複合資産・国内バランス	-0.05	1.26	-0.00
27	ブルベア	-1.37	0.38	-0.00
28	国内株式・小型	-0.69	0.98	-0.01
29	外国株式(先進国)・その他	-0.34	8.89	-0.03
30	外国株式(先進国)・グローバル	-1.03	27.87	-0.29
	合計		100.00	0.31

◆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	25.45				
1	外国株式(先進国)・グローバル	42.62		24.29		9.66
2	外国株式(先進国)・その他	38.40		7.92		2.87
3	国内株式・一般	27.74		8.09		2.27
4	国内株式・その他	29.76		4.59		1.35
5	エマージング株式・その他	54.75		2.79		1.32
6	複合資産・安定成長	15.54		7.04		1.11
7	REIT・日本	26.42		3.85		0.94
8	REIT・北米	33.38		3.03		0.92
9	REIT・グローバル	34.66		2.42		0.77
10	外国債券(先進国)・グローバル	5.48		8.70		0.53
11	エマージング株式・グローバル	50.92		1.18		0.52
12	複合資産・成長	23.72		2.16		0.51
13	外国債券(先進国)・その他	13.27		2.98		0.41
14	複合資産・安定	7.68		4.56		0.37
15	ハイイールド債券・北米	18.81		1.81		0.33
16	国内株式・小型	26.90		1.15		0.33
17	複合資産・その他	25.00		0.96		0.25
18	REIT・その他	29.30		0.58		0.16
19	エマージング債券・グローバル	12.56		1.08		0.14
20	ブルベア	36.67		0.34		0.12
21	エマージング債券・その他	10.99		1.03		0.11
22	コモディティ	24.94		0.43		0.10
23	ハイイールド債券・その他	18.57		0.45		0.08
24	ハイイールド債券・グローバル	18.77		0.43		0.08
25	CB	21.45		0.26		0.06
26	複合資産・国内バランス	3.50		1.47		0.05
27	絶対収益型	3.56		1.21		0.05
28	国内株式・業種特化	41.42		0.10		0.04
29	エマージング株式・BRICS	50.06		0.09		0.04
30	国内債券・一般	-0.18		5.04		-0.01
	合計			100.00		25.45

◆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	25.31	41.08	97.76	12.26	10.43	11.65	0.64	0.69	0.61
国内株式	19.25	61.30	182.53	18.13	15.71 ↓	17.23	0.34	0.64	0.63
一般	16.71	57.32	162.49	17.97	15.63 ↓	17.54	0.30	0.61	0.58
フリー	17.89	59.82	164.49	18.22	15.77	18.13	0.31	0.63	0.56
バリュー	12.01	47.72	156.27	17.47	15.52	16.38	0.22	0.53	0.60
小型	16.34	75.87	301.45	21.80	18.13 ↓	18.04	0.24	0.66	0.83
その他	26.25	65.63	206.23	17.77	15.78 ↓	16.94	0.46	0.68	0.70
日経225	35.86	78.69	237.60	18.51	16.43 ↓	17.28	0.58	0.75	0.75
TOPIX	17.10	53.70	175.23	17.26	15.26	16.65	0.32	0.59	0.64
JPX日経400	18.85	51.13	-	17.36	15.19	-	0.34	0.57	-
国内債券	0.77	-0.50	12.35	1.91	1.76	1.62	0.16	-0.03	0.72
一般	0.77	-0.50	12.35	1.91	1.76	1.62	0.16	-0.03	0.72
外国株式(先進国)	51.94	88.04	168.95	18.80	15.95	16.50	0.80	0.85	0.63
グローバル	53.66	91.81	185.32	18.85	15.91	16.37	0.82	0.88	0.67
除く日本	49.07	88.25	217.11	19.68	17.14	18.06	0.73	0.79	0.68
含む日本	55.36	93.11	178.16	18.80	15.74	16.07	0.84	0.90	0.67
その他	46.88	77.92	137.48	18.94	16.34	17.68	0.72	0.75	0.51
北米	50.26	86.02	107.83	21.76	19.00	21.56	0.67	0.70	0.35
米国	57.38	102.14	166.70	18.44	16.06	17.72	0.89	0.94	0.58
カナダ	19.77	33.02	15.77	22.14	18.10	17.96	0.28	0.33	0.08
欧州	30.65	53.98	125.87	19.98	17.51	18.66	0.47	0.52	0.45
ドイツ	22.44	50.53	-	25.15	22.25	-	0.28	0.39	-
イギリス	1.66	3.75	-	20.63	17.96	-	0.03	0.04	-
アジア・オセアニア	23.01	54.24	135.46	17.43	15.00 ↓	17.68	0.41	0.61	0.51
オーストラリア	14.41	27.07	69.27	26.45	22.20	21.50	0.18	0.22	0.25
ニュージーランド	46.67	78.45	-	19.07	16.72	-	0.72	0.74	-
複合地域	-27.46	-17.11	-	36.42	29.88	-	-0.28	-0.12	-
エマージング株式	28.05	67.49	82.43	21.73	17.98 ↓	19.26	0.40	0.61	0.32
グローバル	39.53	82.65	82.34	21.16	17.55 ↓	18.98	0.56	0.73	0.33
BRICS	35.71	93.85	94.39	24.19	19.99 ↓	22.09	0.44	0.71	0.31
その他	23.76	61.17	84.59	22.37	18.51	19.47	0.33	0.54	0.32
欧州	17.77	52.42	20.13	28.15	24.05	25.31	0.20	0.37	0.07
ロシア	47.52	101.27	55.32	27.82	24.50	27.56	0.50	0.61	0.16
アジア・オセアニア	22.73	58.04	98.18	20.23	16.93	17.96	0.35	0.57	0.39
中国	57.35	141.96	228.66	21.81	18.28 ↓	22.09	0.75	1.06	0.57
インド	22.71	63.14	118.62	28.05	23.40	25.52	0.25	0.44	0.32
インドネシア	-10.29	-0.55	5.64	32.02	25.98	25.27	-0.11	-0.00	0.02
タイ	-16.51	12.31	58.09	25.28	20.88	19.47	-0.23	0.11	0.24
フィリピン	-7.46	-18.82	77.61	22.71	19.24	20.74	-0.11	-0.21	0.28
ベトナム	30.95	86.35	221.34	29.45	24.66 ↑	22.17	0.32	0.54	0.56
韓国	36.58	62.40	67.28	25.70	20.93	20.38	0.43	0.49	0.26
香港	5.39	57.65	56.43	20.58	17.49	19.74	0.09	0.55	0.23
台湾	40.41	100.92	179.39	23.54	19.40	18.95	0.51	0.77	0.57
中南米	17.56	47.79	2.61	33.61	28.32	26.80	0.17	0.29	0.01
ブラジル	10.01	42.40	-30.50	38.08	32.56	32.45	0.09	0.23	-0.11
メキシコ	8.58	-5.92	-	31.98	27.35	-	0.09	-0.04	-
中東・アフリカ	16.98	40.18	85.76	20.94	17.66	17.65	0.26	0.40	0.36
トルコ	-25.94	-35.75	-35.31	38.20	32.56	31.21	-0.25	-0.26	-0.14
複合地域	21.59	42.53	81.57	20.00	16.89	16.85	0.34	0.44	0.36

※[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	25.31	41.08	97.76	12.26	10.43	11.65	0.64	0.69	0.61
外国債券(先進国)	10.37	11.99	38.34	4.45 ↓	4.69 ↓	7.39	0.76	0.50	0.44
グローバル	10.30	10.84	40.15	3.64 ↓	4.12	6.62	0.92	0.52	0.52
除く日本	12.19	11.91	43.63	3.18 ↓	4.26	7.24	1.24	0.55	0.51
含む日本	8.24	9.73	36.32	4.58	4.36	6.08	0.59	0.44	0.52
その他	11.04	14.75	35.62	7.38	7.04 ↓	9.30	0.49	0.40	0.33
北米	8.98	10.84	-	5.03	4.30	-	0.59	0.49	-
米国	12.02	11.67	56.77	7.43	6.80	6.75	0.53	0.34	0.68
カナダ	14.42	10.61	24.43	6.67	7.76	9.06	0.70	0.27	0.24
欧州	4.58	6.46	38.91	3.86 ↓	5.56	8.83	0.40	0.23	0.38
イギリス	11.33	2.95	-	7.88	10.13	-	0.47	0.06	-
アジア・オセアニア	11.37	17.46	37.68	9.45	8.68 ↓	10.55	0.39	0.38	0.31
オーストラリア	10.87	17.15	34.12	9.54	8.78 ↓	10.69	0.37	0.37	0.28
ニュージーランド	12.04	18.81	-	8.37	8.58 ↓	-	0.47	0.41	-
複合地域	18.74	26.03	40.42	3.78 ↓	4.79 ↓	8.93	1.57	1.00	0.39
グローバル	3.89	10.92	-	13.47	11.40	-	0.10	0.19	-
エマージング債券	6.62	16.86	25.52	12.70	10.73	13.14	0.17	0.30	0.17
グローバル	6.24	15.81	27.59	14.70	12.09	13.53	0.14	0.25	0.18
米ドル建て	6.68	16.72	29.95	15.24	12.50	13.84	0.15	0.25	0.19
現地通貨建て	4.44	10.89	17.31	13.05	11.04	12.30	0.12	0.19	0.13
その他	6.95	18.12	20.84	11.28	9.99	13.62	0.20	0.34	0.14
ロシア	4.71	29.30	14.41	20.23	17.76	22.78	0.08	0.30	0.06
アジア・オセアニア	12.82	15.08	55.84	7.24	6.73	8.78	0.57	0.43	0.52
インド	18.12	26.31	-	9.77	9.56	-	0.59	0.51	-
インドネシア	16.98	24.55	35.98	17.17	14.15	15.93	0.32	0.32	0.20
ブラジル	-12.26	2.65	-0.53	20.46	17.97	18.81	-0.21	0.03	-0.00
メキシコ	24.78	17.25	29.36	18.68	17.59	16.51	0.41	0.19	0.16
トルコ	-32.31	-55.55	-54.92	37.52	30.85	25.15	-0.32	-0.48	-0.31
複合地域	2.35	16.21	10.94	12.72	10.98 ↓	13.50	0.06	0.28	0.08
ハイイールド債券	12.49	26.18	64.73	13.22	11.34	12.73	0.31	0.42	0.40
グローバル	11.04	27.28	55.49	13.45	11.40	12.96	0.27	0.44	0.35
北米	13.91	28.59	74.24	13.00	11.35	12.37	0.34	0.46	0.46
その他	8.83	18.50	49.26	14.75	12.32	14.97	0.20	0.28	0.27
欧州	7.84	17.84	55.49	15.59	13.01 ↓	16.01	0.17	0.26	0.28
アジア・オセアニア	11.64	20.72	-	12.89	10.83	-	0.29	0.36	-
複合地域	19.28	29.19	86.97	9.39	9.22 ↓	11.14	0.65	0.58	0.58
複合資産	13.88	23.83	78.16	7.70	6.89	8.98	0.58	0.64	0.66
安定	8.73	14.48	58.79	5.21	4.79	7.26	0.55	0.58	0.65
安定成長	16.59	27.18	82.88	8.31	7.42	9.42	0.64	0.67	0.66
成長	23.21	44.38	126.42	12.22	10.83	11.85	0.59	0.71	0.72
国内バランス	0.34	4.16	34.15	4.45	3.63	6.35	0.04	0.24	0.47
安定	-0.04	2.14	27.88	4.24	3.41	3.41	0.01	0.14	0.73
一般	12.53	31.12	69.74	9.42	8.41	9.76	0.43	0.67	0.56

※[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	25.31	41.08	97.76	12.26	10.43	11.65	0.64	0.69	0.61
国内REIT	31.71	29.37	167.53	16.99	13.98	17.14	0.57	0.38	0.60
日本	31.71	29.37	167.53	16.99	13.98	17.14	0.57	0.38	0.60
外国REIT	27.47	28.88	140.05	18.85	16.45	16.60	0.45	0.32	0.55
グローバル	21.55	22.05	117.55	20.17	17.34	16.88	0.34	0.24	0.48
除く日本	26.56	31.85	145.45	20.84	17.87	17.13	0.39	0.32	0.55
含む日本	20.13	20.11	113.35	19.97	17.19	16.82	0.32	0.22	0.47
北米	33.48	33.69	161.63	17.98	16.08	16.78	0.56	0.37	0.60
その他	19.67	35.57	143.49	21.19	17.51	16.76	0.29	0.36	0.55
欧州	4.20	10.09	26.00	22.11	19.57	20.51	0.06	0.10	0.11
アジア・オセアニア	21.52	48.35	161.17	19.61	16.19	16.63	0.34	0.51	0.61
オーストラリア	14.12	20.03	114.76	31.83	26.11	22.53	0.14	0.14	0.35
複合地域	-8.82	-7.33	54.88	29.44	24.22	21.77	-0.10	-0.06	0.20
複数国	36.75	38.53	208.31	17.76	15.20	15.64	0.62	0.45	0.76
その他									
絶対収益型	0.42	1.92	-1.91	2.40	2.28	3.29	0.08	0.19	-0.06
ロング・ショート	-3.31	-3.46	-5.79	3.19	3.12	2.99 ↓	-0.34	-0.21	-0.20
マーケットニュートラル	-3.57	8.27	39.64	3.93	5.20	5.41	-0.30	0.32	0.63
GTAA	11.06	12.54	21.45	4.52	3.74	3.31	0.80	0.65	0.59
その他スタイル	0.81	1.76	-3.60	2.44	2.29	4.88	0.13	0.17	-0.08
CB	18.57	29.01	43.78	9.63	8.14	9.90	0.61	0.65	0.37
アジア・オセアニア	36.42	59.20	103.59	14.07	12.01	12.49	0.78	0.82	0.59
日本	-3.18	1.67	42.17	5.79	5.23	6.22	-0.18	0.07	0.57
グローバル	19.07	29.76	43.24	9.83	8.27	10.17	0.61	0.65	0.36
コモディティ	20.00	25.97	-15.66	11.47 ↑	10.93	14.06	0.55	0.44	-0.12
全業種	2.93	10.72	-25.80	19.92 ↑	17.16	16.88	0.05	0.12	-0.17
貴金属	36.56	42.52	14.44	13.06 ↑	10.75 ↑	16.22	0.84	0.69	0.08
エネルギー	-4.37	13.32	-42.17	42.17	35.58	30.84	-0.03	0.07	-0.17
その他コモディティ	2.32	3.75	-8.62	20.22	17.54	18.21	0.04	0.04	-0.05

※[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

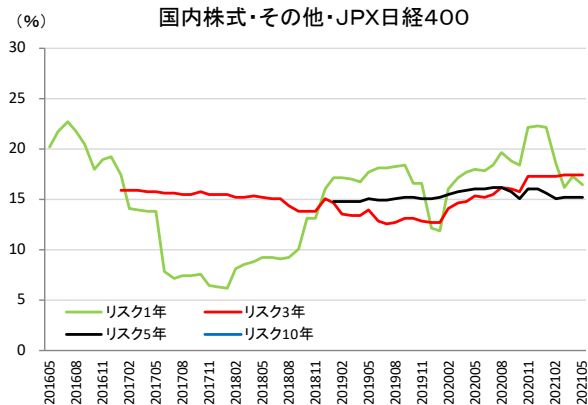
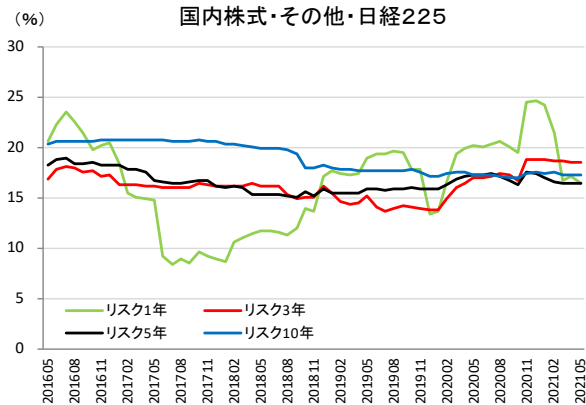
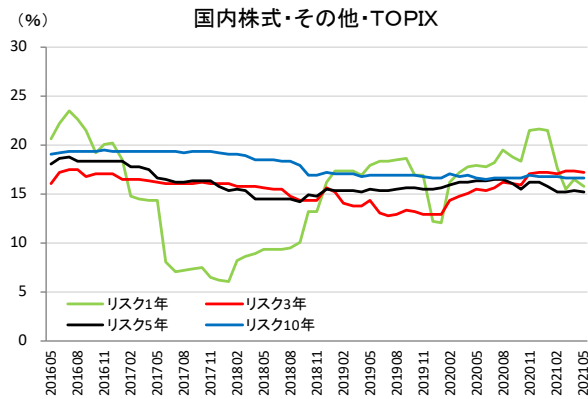
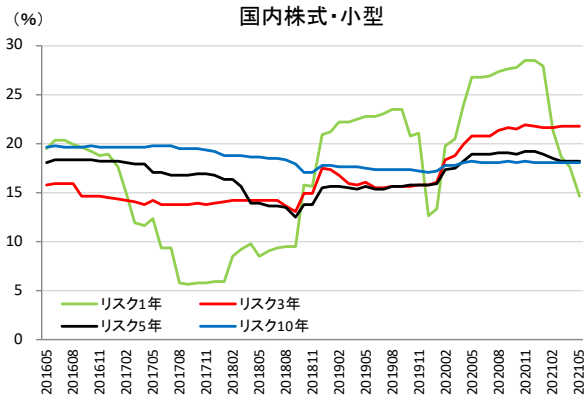
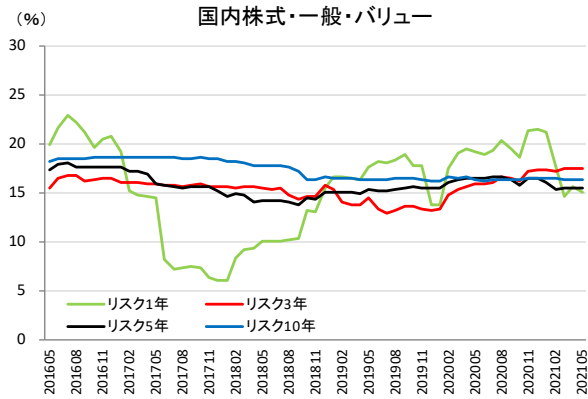
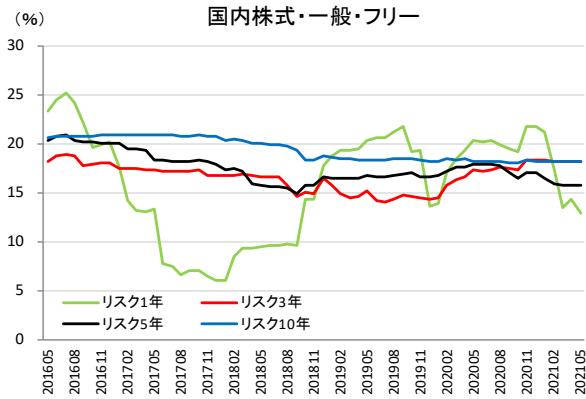
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

＜2＞リスク・サマリー

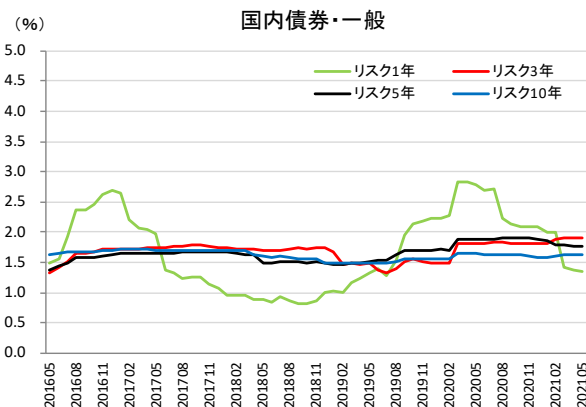
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

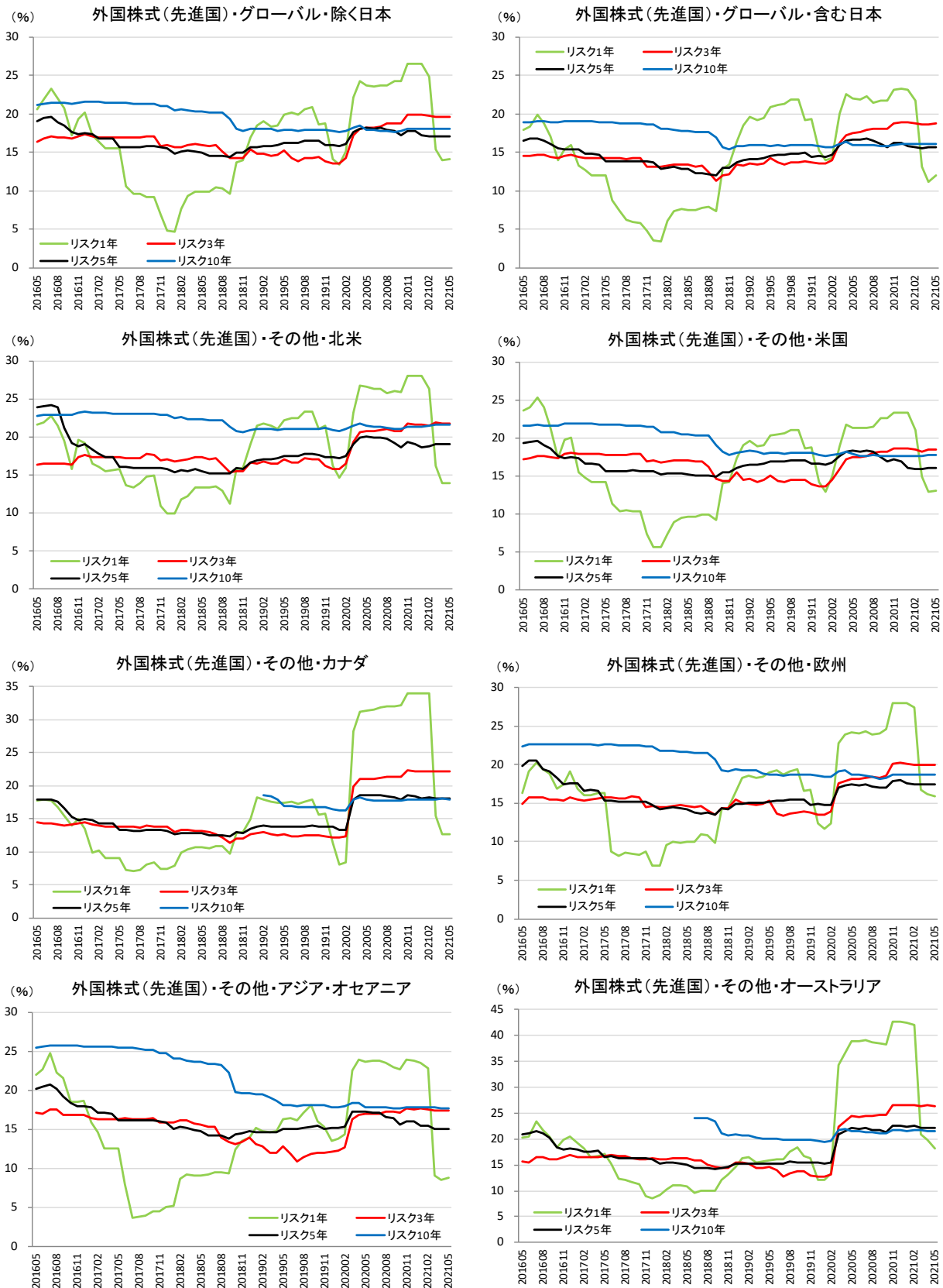


＜2＞リスク・サマリー

(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)]

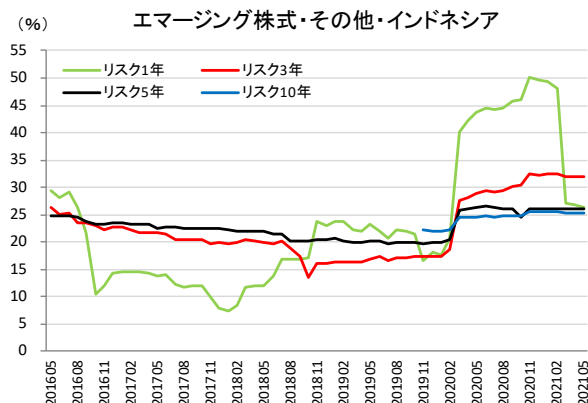
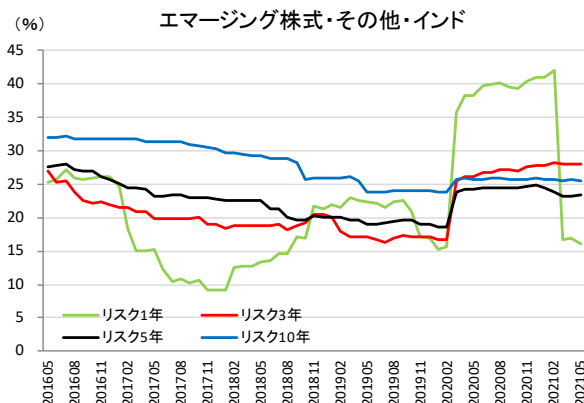
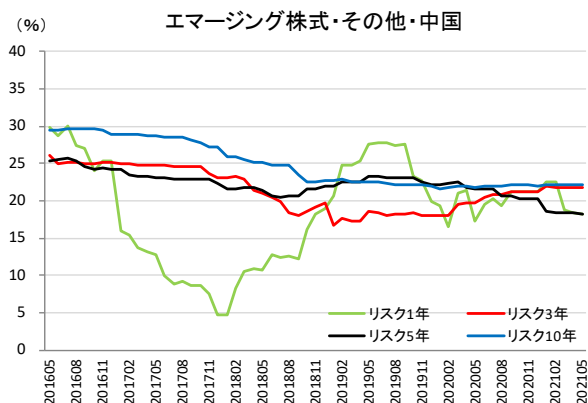
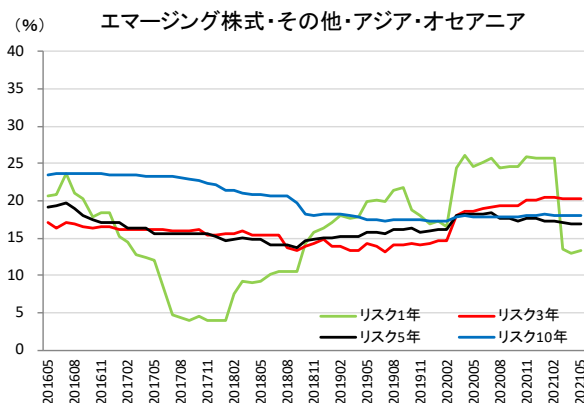
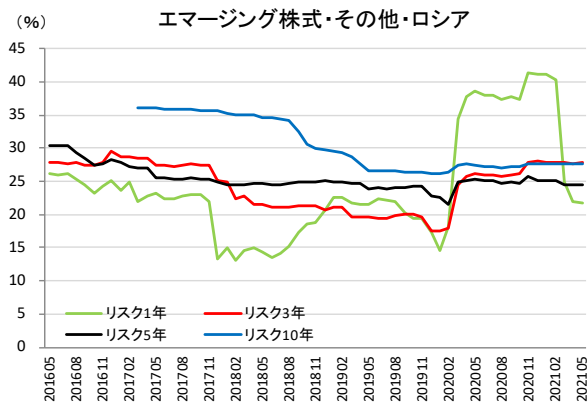
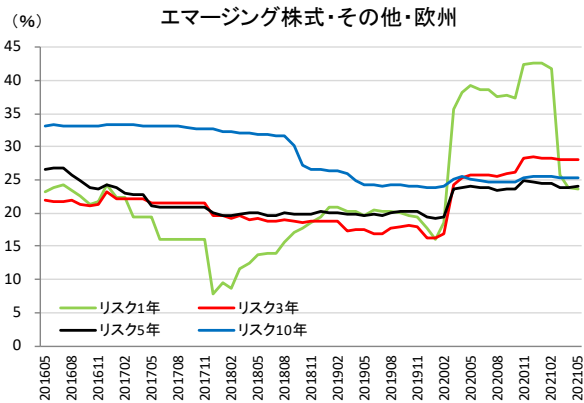
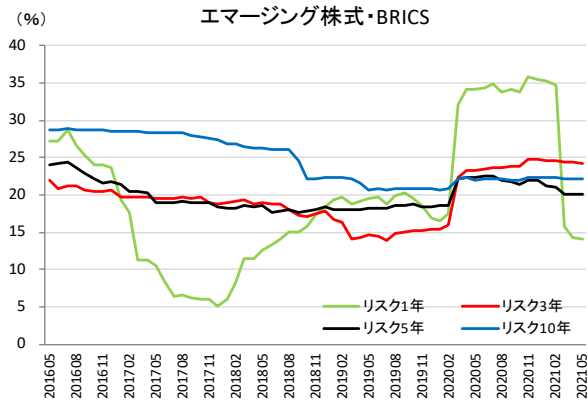
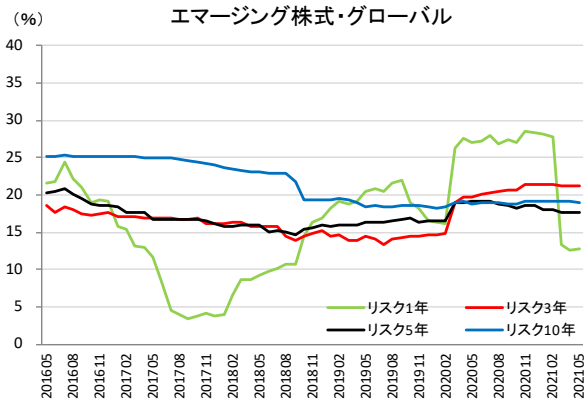


<2> リスク・サマリー

(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]

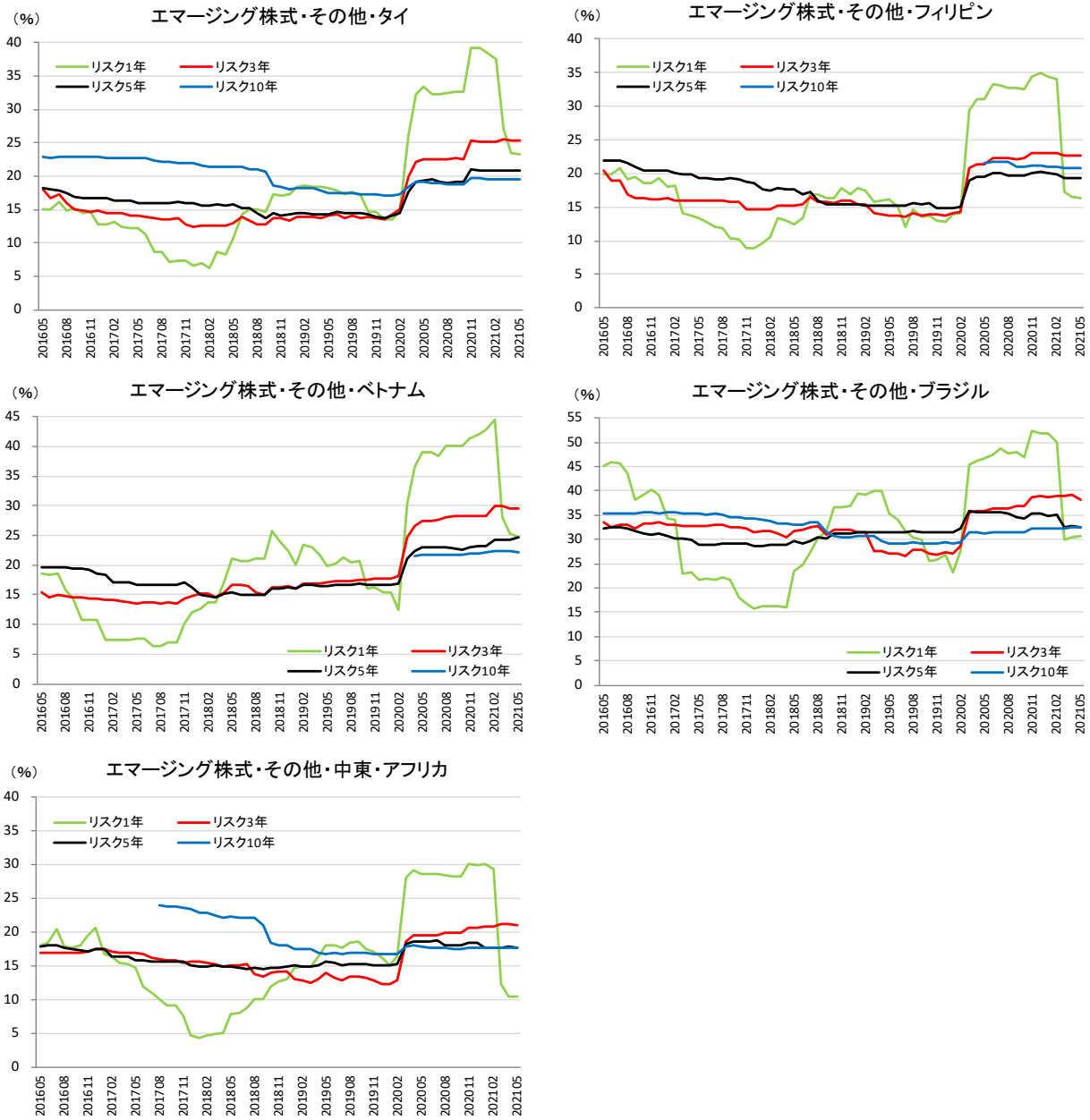


＜2＞リスク・サマリー

(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]

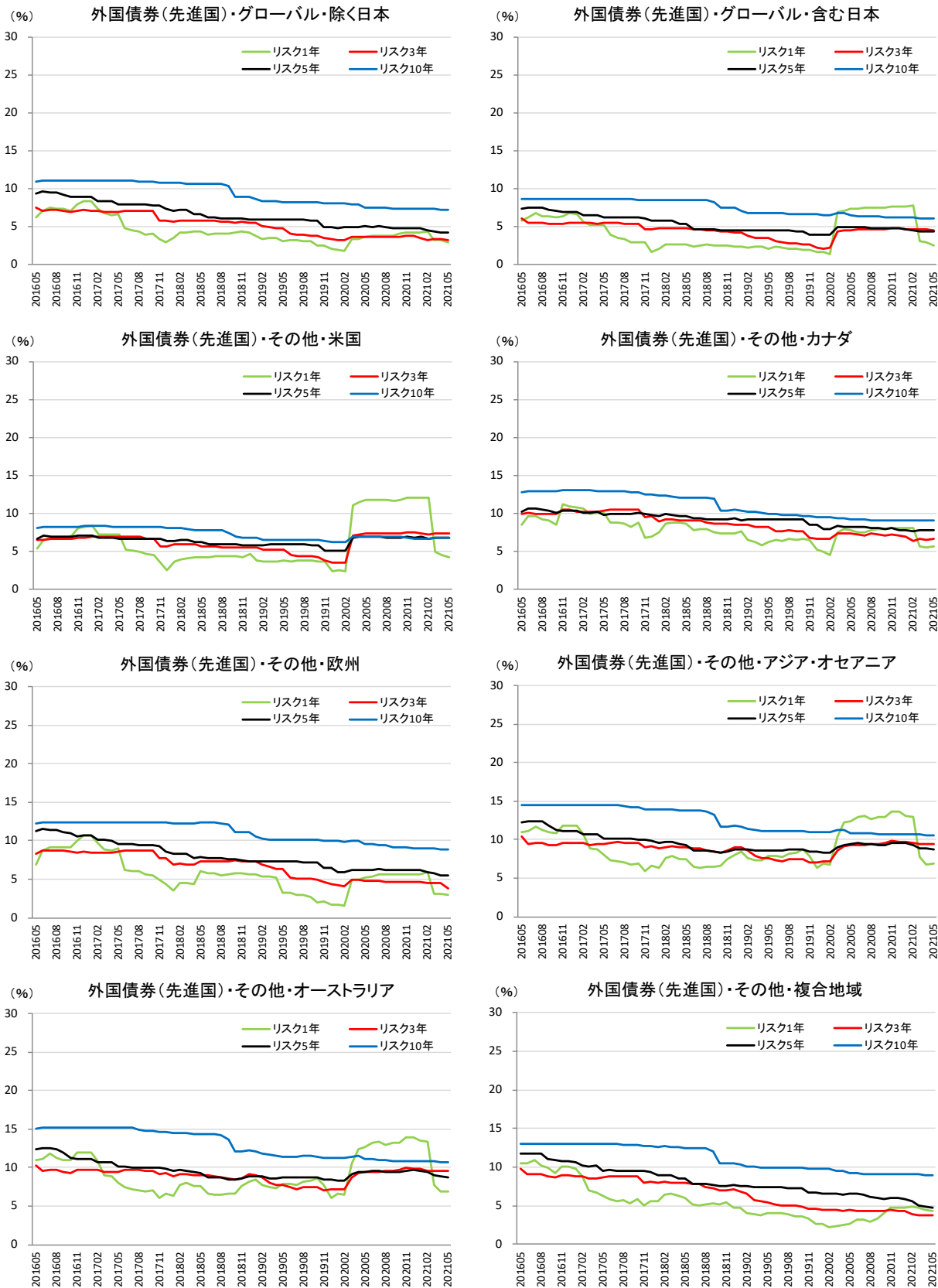


<2> リスク・サマリー

(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)]

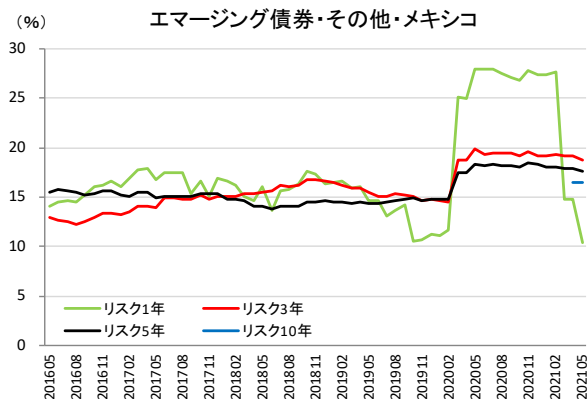
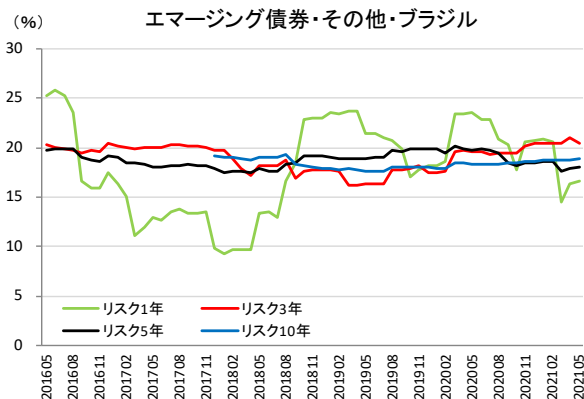
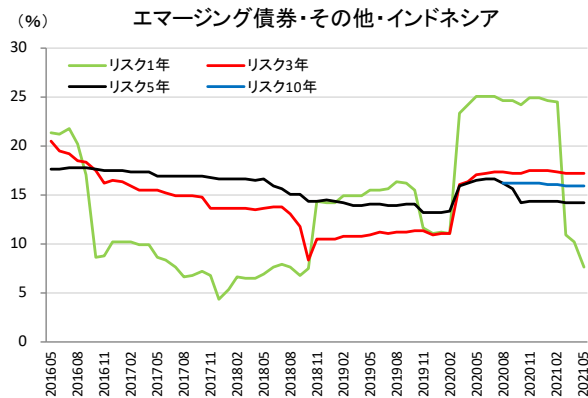
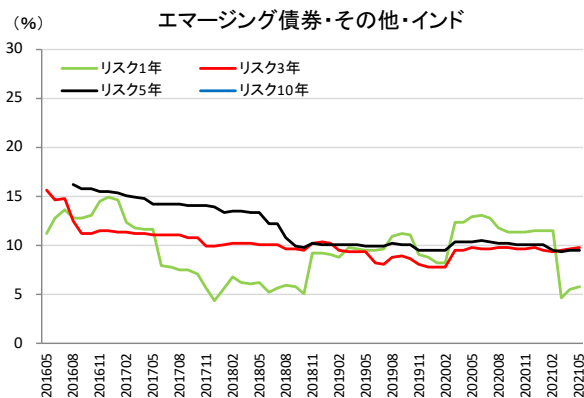
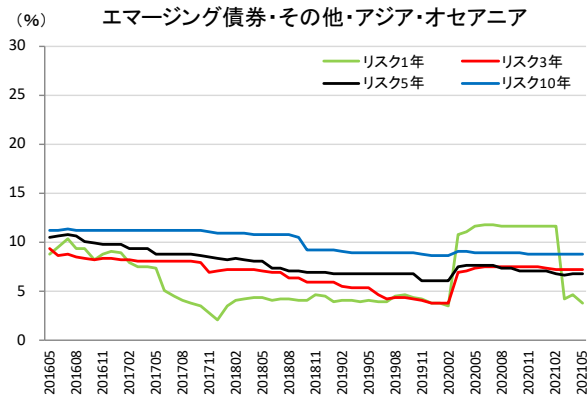
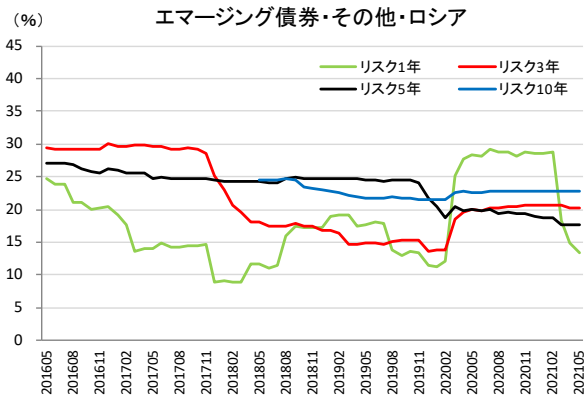
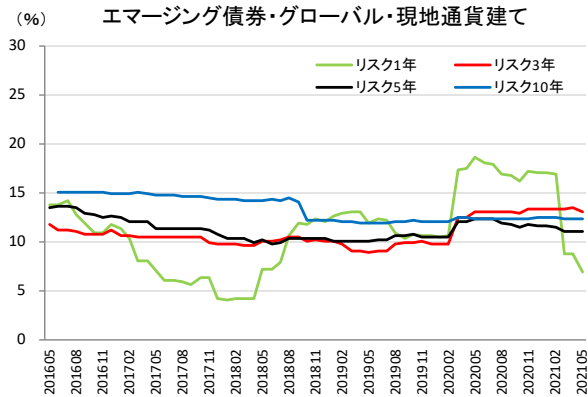
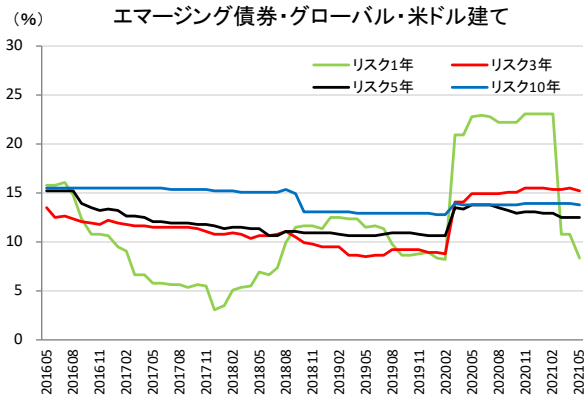


＜2＞リスク・サマリー

(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]

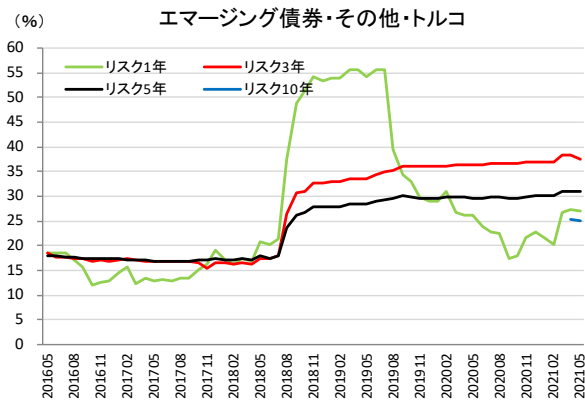


＜2＞リスク・サマリー

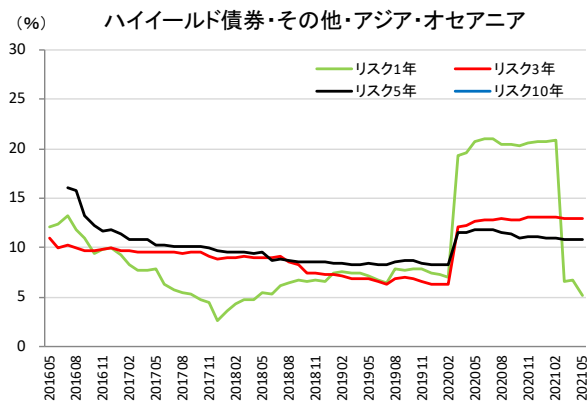
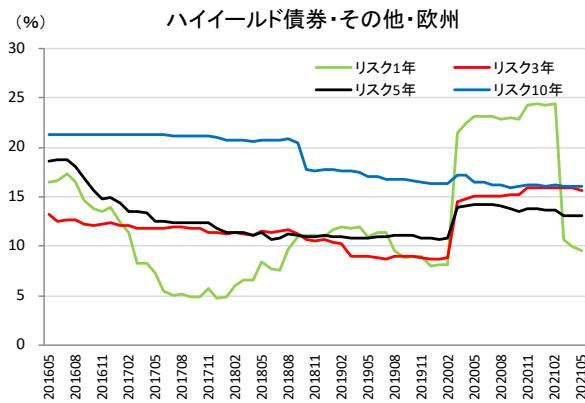
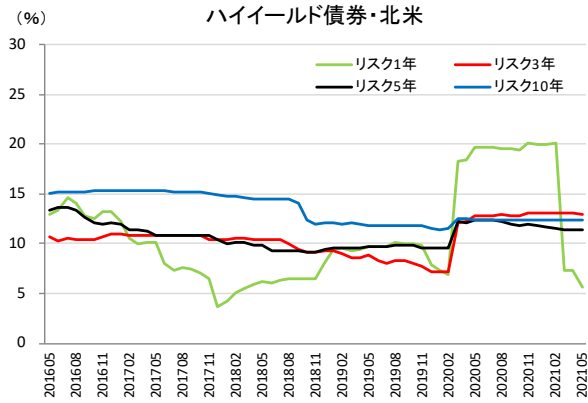
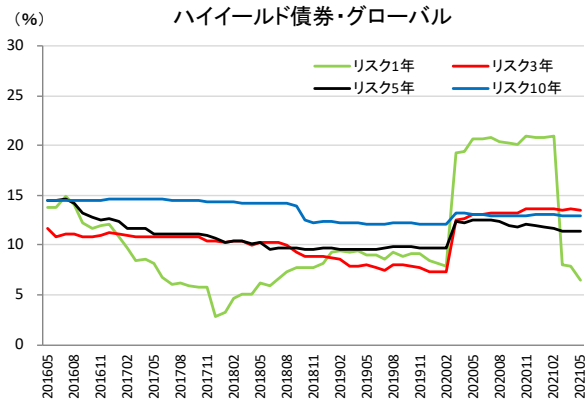
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

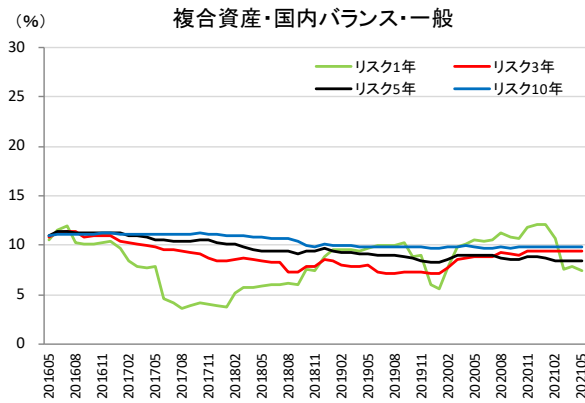
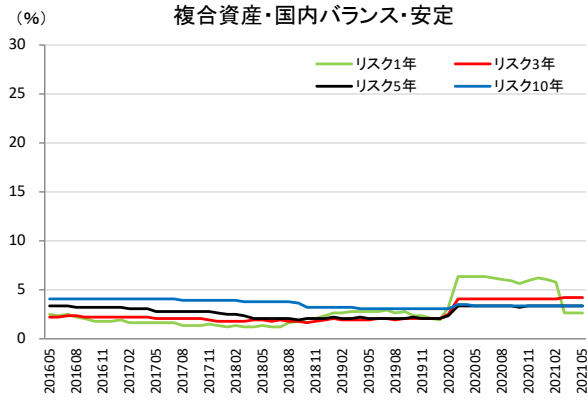
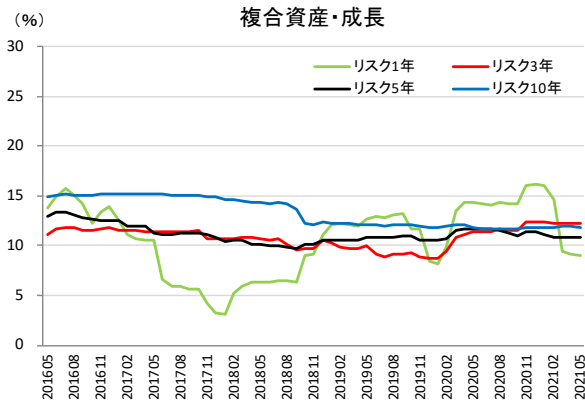
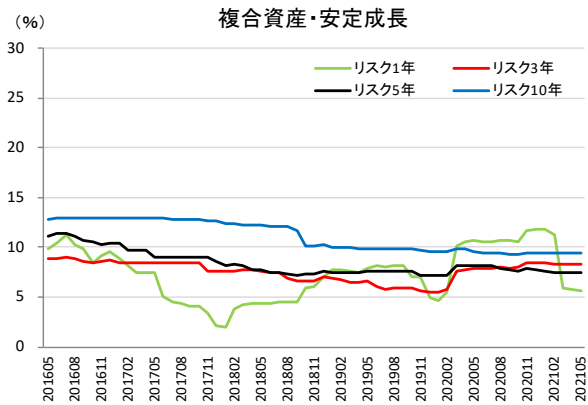
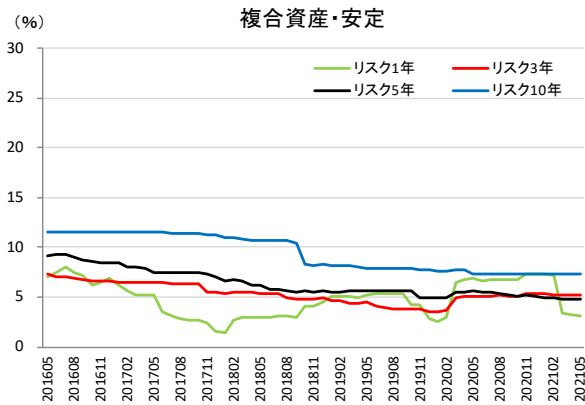


<2> リスク・サマリー

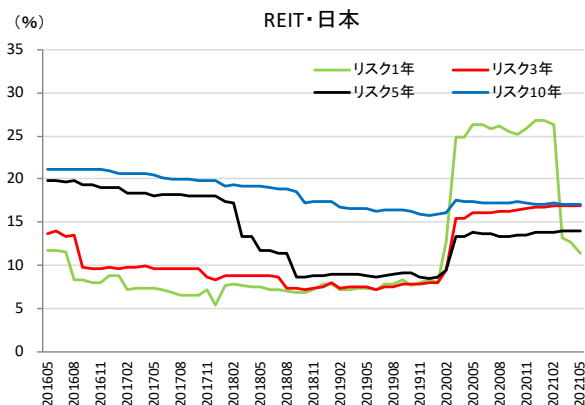
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

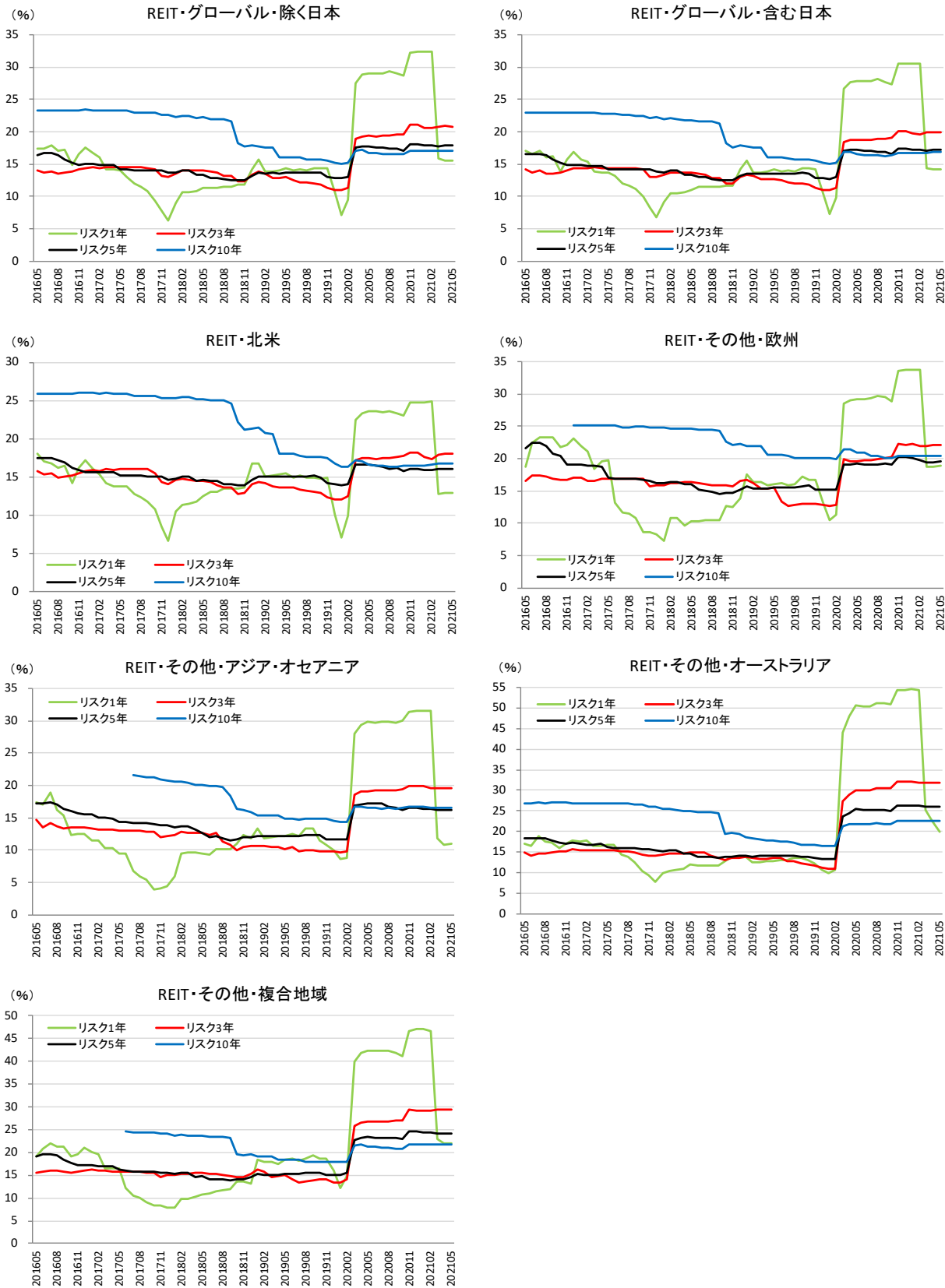


＜2＞リスク・サマリー

(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]

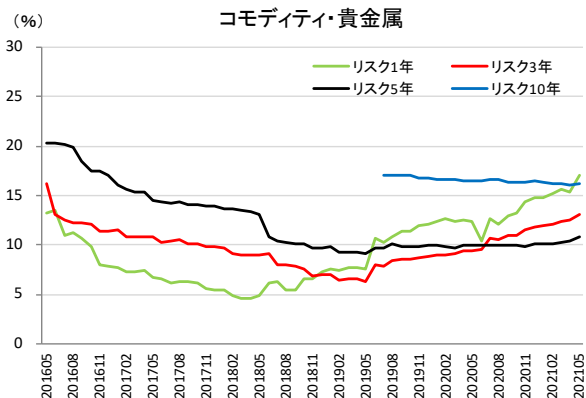
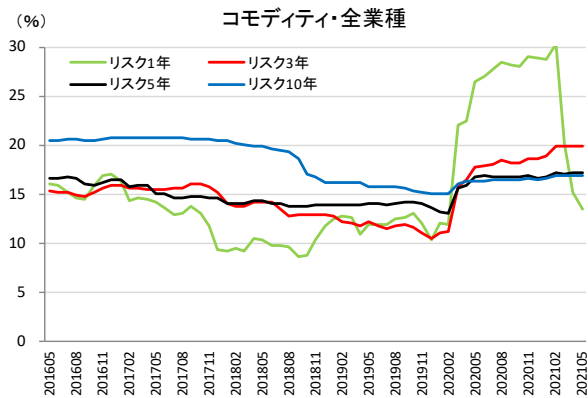
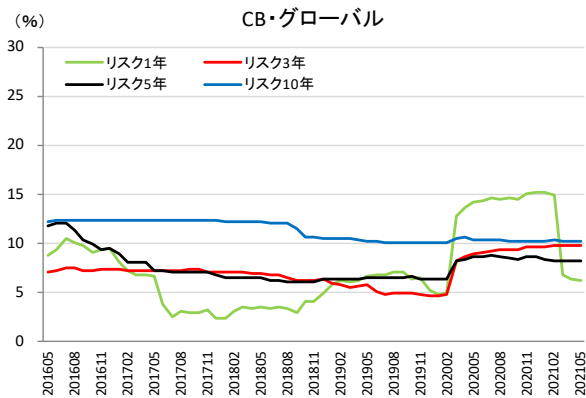
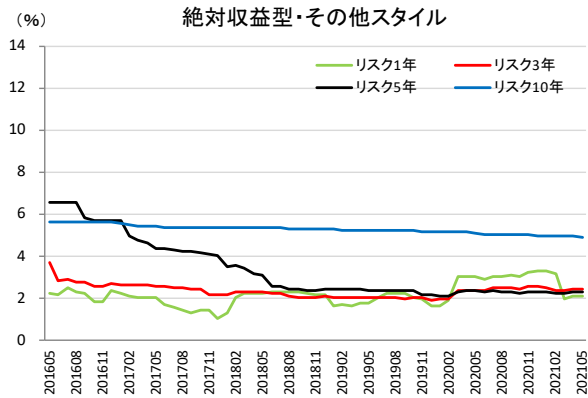
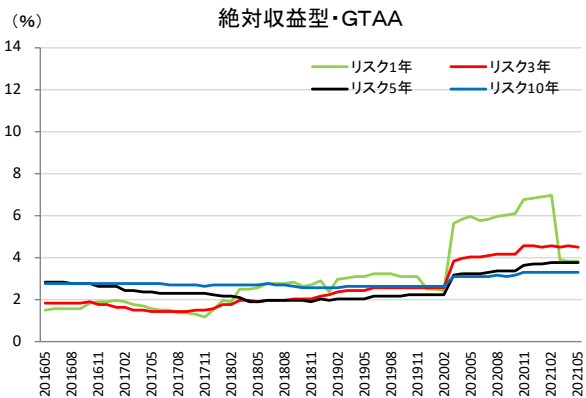
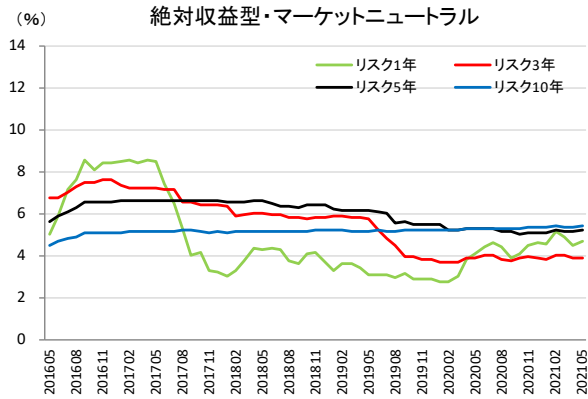
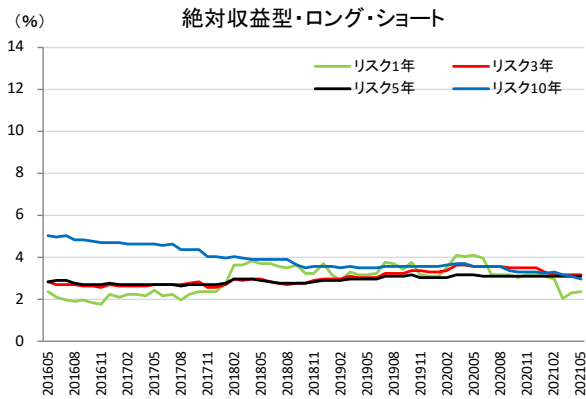


<2> リスク・サマリー

(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	7,099	22,913	37,479	43,729
国内株式	-266	-67	-3,823	-16,971
一般	-412	-1,050	-4,035	-10,815
フリー	-387	-705	-3,122	-9,394
バリュー	-25	-345	-913	-1,421
小型	12	-131	-613	-2,469
その他	128	1,105	894	-3,536
日経225	382	1,145	846	-2,832
TOPIX	-260	-67	73	-729
JPX日経400	4	7	-44	-187
国内債券	764	2,233	2,157	2,549
一般	764	2,233	2,157	2,549
外国株式(先進国)	6,843	21,625	42,073	63,742
グローバル	5,116	17,687	34,541	47,900
除く日本	1,648	3,068	5,378	7,262
含む日本	3,468	14,619	29,163	40,638
その他	1,727	3,938	7,532	15,843
北米	-2	-15	-36	-89
米国	1,852	4,382	8,387	16,996
カナダ	-6	-17	-35	-58
欧州	15	-27	-130	-195
ドイツ	-1	-5	-11	-12
イギリス	0	-1	-1	-4
アジア・オセアニア	-1	-2	-7	-17
オーストラリア	-130	-379	-634	-777
ニュージーランド	0	2	1	0
複合地域	-1	-1	-1	-1
エマージング株式	-263	-589	-428	-1,970
グローバル	35	118	171	-454
BRICS	-7	-21	-56	-82
その他	-291	-686	-544	-1,433
欧州	-3	-8	-18	-24
ロシア	-2	-4	-11	-12
アジア・オセアニア	-31	-12	385	228
中国	22	304	1,286	1,506
インド	-234	-775	-1,763	-2,524
インドネシア	2	-1	-11	-19
タイ	-1	-3	-7	-11
フィリピン	-1	-3	-7	-16
ベトナム	-38	-171	-342	-504
韓国	0	0	0	0
香港	0	0	-2	0
台湾	1	3	4	4
中南米	0	-2	-5	-9
ブラジル	-3	-7	-22	9
メキシコ	0	-2	-2	-2
中東・アフリカ	-1	-4	-15	-39
トルコ	0	-1	-13	-17
複合地域	0	-1	-2	-3

<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	7,099	22,913	37,479	43,729
外国債券(先進国)	-91	-534	-1,063	-3,501
グローバル	153	399	831	-196
除く日本	-1,239	-986	-1,699	-2,327
含む日本	1,392	1,385	2,531	2,131
その他	-244	-934	-1,894	-3,305
北米	0	1	0	-10
米国	-58	-218	-373	-504
カナダ	-20	-74	-145	-256
欧州	-13	-71	-123	-217
イギリス	0	-1	-4	-7
アジア・オセアニア	-31	-94	-200	-371
オーストラリア	-115	-433	-953	-1,719
ニュージーランド	-2	-6	-14	-42
複合地域	-6	-29	-71	-158
グローバル	0	0	0	0
エマージング債券	-221	-692	-1,419	-2,844
グローバル	-73	-263	-551	-1,065
米ドル建て	-58	-226	-477	-927
現地通貨建て	-14	-37	-74	-138
その他	-149	-429	-868	-1,779
ロシア	-5	-13	-23	-51
アジア・オセアニア	-3	-13	-26	-51
インド	-87	-251	-499	-1,003
インドネシア	-8	-24	-54	-102
ブラジル	-24	-74	-166	-363
メキシコ	-9	-26	-51	-111
トルコ	2	4	-2	-10
複合地域	-1	-2	-4	-6
ハイイールド債券	-130	-647	-1,466	-2,342
グローバル	-22	-94	-198	-356
北米	-75	-436	-974	-1,405
その他	-34	-118	-293	-581
欧州	-30	-110	-271	-502
アジア・オセアニア	-4	-7	-18	-65
複合地域	0	-1	-2	-4
複合資産	572	1,721	962	1,816
安定	314	1,498	2,895	5,249
安定成長	289	735	301	330
成長	256	579	622	837
国内バランス	-60	-255	-569	-837
安定	-56	-231	-506	-726
一般	-4	-21	-57	-96
その他	-226	-836	-2,287	-3,763

<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	7,099	22,913	37,479	43,729
国内REIT	-128	-205	379	1,517
日本	-128	-205	379	1,517
外国REIT	-142	-888	-1,363	-975
グローバル	-104	-467	-637	-574
除く日本	16	39	211	343
含む日本	-120	-505	-848	-917
北米	-26	-352	-504	136
その他	-12	-70	-222	-537
欧州	-2	-5	-13	-24
アジア・オセアニア	3	-13	-120	-388
オーストラリア	-10	-38	-69	-101
複合地域	1	1	3	7
複数国	-5	-16	-23	-30
その他	161	959	1,468	2,706
絶対収益型	27	441	638	1,179
ロング・ショート	9	-12	-35	-67
マーケットニュートラル	-52	-66	-57	-133
GTAA	-6	-16	-27	-53
その他スタイル	63	523	744	1,384
CB	-25	-87	-148	414
アジア・オセアニア	0	-1	-2	-4
日本	-1	-2	-5	-12
グローバル	-24	-84	-141	430
コモディティ	61	163	372	824
全業種	33	19	33	63
貴金属	39	182	429	965
エネルギー	-11	-39	-91	-205
その他コモディティ	0	0	1	1

< 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	776,000	100.00	5,372	100.00
国内株式	98,248	12.66	871	16.21
一般	55,539	7.16	563	10.48
フリー	43,340	5.59	452	8.41
バリュー	12,199	1.57	111	2.07
小型	7,528	0.97	98	1.82
その他	34,477	4.44	203	3.78
日経225	17,078	2.20	66	1.23
TOPIX	14,459	1.86	77	1.43
JPX日経400	649	0.08	19	0.35
国内債券	36,384	4.69	135	2.51
一般	36,384	4.69	135	2.51
外国株式(先進国)	289,379	37.29	1,061	19.75
グローバル	220,104	28.36	704	13.10
除く日本	48,285	6.22	168	3.13
含む日本	171,818	22.14	536	9.98
その他	69,275	8.93	357	6.65
北米	181	0.02	10	0.19
米国	62,579	8.06	251	4.67
カナダ	233	0.03	3	0.06
欧州	1,541	0.20	48	0.89
ドイツ	20	0.00	1	0.02
イギリス	10	0.00	3	0.06
アジア・オセアニア	69	0.01	7	0.13
オーストラリア	4,621	0.60	32	0.60
ニュージーランド	16	0.00	1	0.02
複合地域	6	0.00	1	0.02
エマージング株式	31,465	4.05	330	6.14
グローバル	9,339	1.20	96	1.79
BRICS	691	0.09	7	0.13
その他	21,435	2.76	227	4.23
欧州	166	0.02	6	0.11
ロシア	127	0.02	4	0.07
アジア・オセアニア	6,905	0.89	103	1.92
中国	3,776	0.49	29	0.54
インド	8,242	1.06	30	0.56
インドネシア	122	0.02	4	0.07
タイ	62	0.01	4	0.07
フィリピン	48	0.01	5	0.09
ベトナム	993	0.13	10	0.19
韓国	6	0.00	1	0.02
香港	13	0.00	1	0.02
台湾	6	0.00	1	0.02
中南米	63	0.01	2	0.04
ブラジル	721	0.09	16	0.30
メキシコ	18	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	104	0.01	5	0.09
トルコ	40	0.01	2	0.04
複合地域	21	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	776,000	100.00	5,372	100.00
外国債券(先進国)	79,046	10.19	780	14.52
グローバル	59,967	7.73	502	9.34
除く日本	30,112	3.88	220	4.10
含む日本	29,855	3.85	282	5.25
その他	19,079	2.46	278	5.17
北米	82	0.01	6	0.11
米国	5,564	0.72	151	2.81
カナダ	1,026	0.13	4	0.07
欧州	1,402	0.18	36	0.67
イギリス	23	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	2,001	0.26	12	0.22
オーストラリア	7,475	0.96	40	0.74
ニュージーランド	119	0.02	13	0.24
複合地域	1,377	0.18	7	0.13
グローバル	0	0.00	1	0.02
エマージング債券	13,249	1.71	278	5.17
グローバル	7,030	0.91	186	3.46
米ドル建て	5,367	0.69	143	2.66
現地通貨建て	1,663	0.21	43	0.80
その他	6,219	0.80	92	1.71
ロシア	111	0.01	5	0.09
アジア・オセアニア	354	0.05	11	0.20
インド	2,867	0.37	19	0.35
インドネシア	387	0.05	11	0.20
ブラジル	1,820	0.23	24	0.45
メキシコ	347	0.04	8	0.15
トルコ	81	0.01	5	0.09
複合地域	40	0.01	1	0.02
ハイイールド債券	17,788	2.29	286	5.32
グローバル	2,866	0.37	52	0.97
北米	12,114	1.56	154	2.87
その他	2,808	0.36	80	1.49
欧州	2,161	0.28	45	0.84
アジア・オセアニア	603	0.08	30	0.56
複合地域	44	0.01	1	0.02
複合資産	117,855	15.19	996	18.54
安定	34,952	4.50	284	5.29
安定成長	51,504	6.64	407	7.58
成長	16,946	2.18	256	4.77
国内バランス	9,578	1.23	33	0.61
安定	9,118	1.18	9	0.17
一般	369	0.05	19	0.35
その他	4,876	0.63	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	776,000	100.00		5,372	100.00	
国内REIT	29,824	3.84		127	2.36	
日本	29,824	3.84		127	2.36	
外国REIT	45,423	5.85		285	5.31	
グローバル	18,493	2.38		140	2.61	
除く日本	5,162	0.67		52	0.97	
含む日本	13,331	1.72		88	1.64	
北米	22,967	2.96		84	1.56	
その他	3,963	0.51		61	1.14	
欧州	179	0.02		10	0.19	
アジア・オセアニア	2,731	0.35		34	0.63	
オーストラリア	720	0.09		13	0.24	
複合地域	57	0.01		3	0.06	
複数国	276	0.04		1	0.02	
その他	17,340	2.23		223	4.15	
絶対収益型	8,982	1.16		107	1.99	
ロング・ショート	867	0.11		35	0.65	
マーケットニュートラル	816	0.11		16	0.30	
GTAA	387	0.05		12	0.22	
その他スタイル	6,856	0.88		43	0.80	
CB	1,749	0.23		38	0.71	
アジア・オセアニア	39	0.01		1	0.02	
日本	42	0.01		3	0.06	
グローバル	1,668	0.21		34	0.63	
コモディティ	3,647	0.47		28	0.52	
全業種	1,192	0.15		13	0.24	
貴金属	2,339	0.30		13	0.24	
エネルギー	102	0.01		1	0.02	
その他コモディティ	15	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	13,502	9.1	4.23	3.77	1.275
国内株式	17,461	12.3	1.45	1.23	1.105
一般	15,977	12.0	1.81	1.57	1.416
フリー	15,725	11.5	2.08	1.82	1.465
バリュー	17,002	14.4	0.82	0.68	1.243
小型	24,328	12.5	2.78	2.31	1.710
その他	18,328	12.8	0.46	0.35	0.460
日経225	20,555	14.7	0.56	0.43	0.548
TOPIX	18,710	14.2	0.16	0.13	0.282
JPX日経400	16,386	6.8	0.53	0.43	0.525
国内債券	10,954	11.1	0.25	0.25	0.360
一般	10,954	11.1	0.25	0.25	0.360
外国株式(先進国)	16,147	6.9	5.68	4.99	1.508
グローバル	16,984	7.0	4.50	3.93	1.526
除く日本	21,964	9.8	1.15	0.86	0.675
含む日本	15,423	6.1	5.62	4.93	1.765
その他	14,497	6.8	9.02	8.04	1.454
北米	15,242	7.1	9.35	7.25	1.772
米国	15,606	6.2	8.52	7.67	1.418
カナダ	8,345	9.2	8.93	6.80	1.992
欧州	13,786	9.9	4.60	3.74	1.651
ドイツ	13,750	7.2	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,115	4.8	13.74	11.94	1.924
アジア・オセアニア	9,882	6.6	5.89	4.52	1.683
オーストラリア	9,076	6.9	17.08	14.50	1.825
ニュージーランド	17,202	8.8	3.10	2.33	1.672
複合地域	7,278	8.1	0.00	0.00	1.705
エマージング株式	14,940	9.7	3.77	2.93	1.726
グローバル	14,118	7.5	0.89	0.61	1.244
BRICS	17,862	15.0	1.15	0.81	2.069
その他	15,197	10.4	5.15	4.03	1.924
欧州	10,949	14.9	0.35	0.25	1.968
ロシア	12,485	12.0	0.85	0.67	1.999
アジア・オセアニア	16,281	10.8	7.20	5.58	1.745
中国	21,959	8.4	5.97	5.54	1.949
インド	15,012	11.0	3.26	2.01	2.068
インドネシア	10,062	11.1	0.00	0.00	1.860
タイ	9,956	13.1	1.92	1.71	1.694
フィリピン	9,807	7.8	0.28	0.22	1.783
ベトナム	15,674	5.3	2.78	1.87	1.890
韓国	16,503	2.4	0.00	0.00	1.804
香港	16,564	11.8	2.02	1.57	0.858
台湾	12,427	8.5	31.86	26.56	1.661
中南米	8,053	14.4	0.00	0.00	2.041
ブラジル	5,557	10.4	11.73	12.09	1.925
メキシコ	8,601	8.2	0.00	0.00	1.921
中東・アフリカ	11,671	9.8	2.33	1.66	2.066
トルコ	6,737	19.8	0.00	0.00	2.038
複合地域	22,302	13.0	3.12	2.20	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	13,502	9.1	4.23	3.77	1.275
外国債券(先進国)	10,236	9.3	2.20	2.09	1.058
グローバル	10,839	9.6	1.54	1.52	0.983
除く日本	11,782	11.9	1.42	1.38	0.772
含む日本	10,103	7.8	1.68	1.68	1.196
その他	9,147	8.8	4.21	3.84	1.294
北米	10,534	7.1	2.43	2.38	1.788
米国	9,634	7.6	5.56	5.06	1.356
カナダ	7,272	10.3	2.41	2.16	1.378
欧州	8,731	10.7	1.44	1.31	1.084
イギリス	8,285	6.3	3.26	2.84	1.350
アジア・オセアニア	8,401	10.6	3.29	2.93	1.420
オーストラリア	8,530	12.0	4.61	4.21	1.257
ニュージーランド	9,844	6.9	2.03	1.86	1.363
複合地域	4,887	11.9	2.57	2.42	1.188
グローバル	9,228	5.6	1.19	1.08	1.474
エマージング債券	8,827	9.8	5.71	5.52	1.560
グローバル	9,293	10.4	4.71	4.49	1.506
米ドル建て	9,477	10.8	4.80	4.51	1.587
現地通貨建て	8,681	9.2	4.41	4.41	1.245
その他	7,884	8.4	6.83	6.69	1.621
ロシア	7,813	8.3	6.36	7.18	1.603
アジア・オセアニア	9,726	8.2	7.46	7.62	1.632
インド	9,170	6.8	7.41	6.95	1.700
インドネシア	7,243	8.8	7.46	7.01	1.664
ブラジル	6,934	11.4	6.29	6.48	1.587
メキシコ	6,740	8.3	6.70	6.23	1.404
トルコ	2,347	8.3	8.71	12.74	1.454
複合地域	3,859	14.8	3.22	3.11	1.210
ハイイールド債券	9,159	9.9	7.24	6.68	1.688
グローバル	8,171	9.1	5.21	4.66	1.571
北米	10,205	11.0	7.03	6.43	1.696
その他	7,790	8.3	10.19	9.81	1.776
欧州	7,480	8.3	10.41	10.10	1.746
アジア・オセアニア	8,031	9.1	9.72	9.11	1.882
複合地域	4,659	17.2	5.73	5.15	1.800
複合資産	13,046	8.5	1.52	1.40	1.026
安定	11,761	8.2	0.95	0.88	1.140
安定成長	12,763	9.1	2.04	1.86	1.046
成長	15,125	8.4	0.60	0.50	0.817
国内バランス	12,056	8.9	2.31	2.31	0.939
安定	10,914	9.8	2.34	2.36	0.919
一般	12,771	9.6	1.77	1.57	1.334
その他	11,793	1.5	1.80	1.47	0.888

(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	13,502	9.1	4.23	3.77	1.275
国内REIT	14,815	9.0	9.92	9.35	0.942
日本	14,815	9.0	9.92	9.35	0.942
外国REIT	11,697	8.1	11.70	10.18	1.528
グローバル	12,732	8.4	7.75	6.58	1.353
除く日本	14,600	7.0	7.38	6.97	1.070
含む日本	11,629	9.2	7.90	6.42	1.462
北米	10,934	8.2	15.30	13.44	1.628
その他	10,371	7.2	9.10	8.00	1.770
欧州	8,035	7.3	6.17	5.27	1.823
アジア・オセアニア	11,724	7.0	10.88	9.80	1.813
オーストラリア	9,568	6.5	6.01	4.60	1.712
複合地域	6,280	9.3	1.45	1.06	0.808
複数国	10,411	17.1	2.96	2.31	1.650
その他					
絶対収益型	10,666	5.5	0.20	0.19	1.719
ロング・ショート	10,900	4.6	0.40	0.38	1.495
マーケットニュートラル	10,345	5.5	1.21	1.21	1.307
GTAA	11,433	7.6	0.92	0.88	1.548
その他スタイル	10,347	5.7	0.01	0.00	1.809
CB	12,696	7.9	8.96	8.15	1.363
アジア・オセアニア	10,386	10.9	3.19	2.31	1.823
日本	11,147	10.1	0.24	0.24	0.975
グローバル	12,901	7.6	9.54	8.70	1.362
コモディティ	9,987	7.2	0.15	0.10	0.941
全業種	7,062	9.5	0.46	0.31	1.369
貴金属	12,756	4.6	0.00	0.00	0.719
エネルギー	9,676	12.3	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	12,319	4.7	0.00	0.00	0.506

(注 1) 平均値

基準価額（円）と設定来年数（年）は単純平均値

実績分配金利回り（%）、予想分配金利回り（%）、運用管理費用（%）は純資産額加重平均値

(注 2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注 3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注 4) 分配金利回り（%）

実績分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数÷実績決算回数))÷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