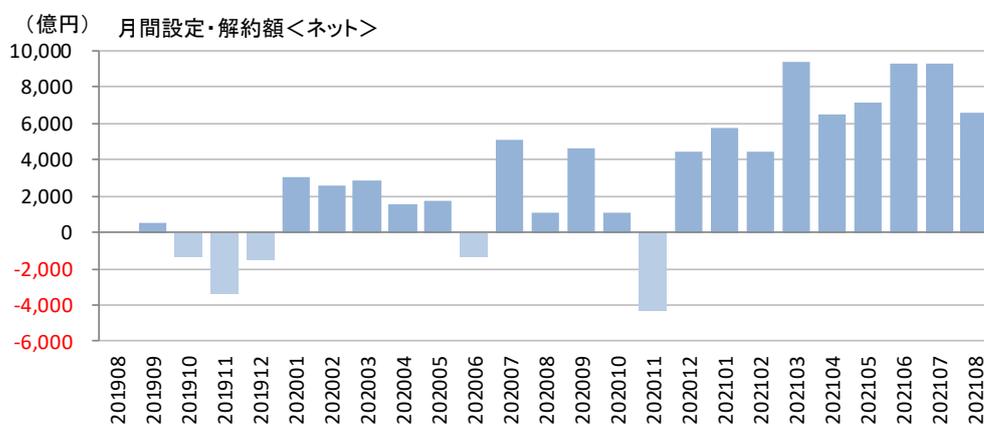
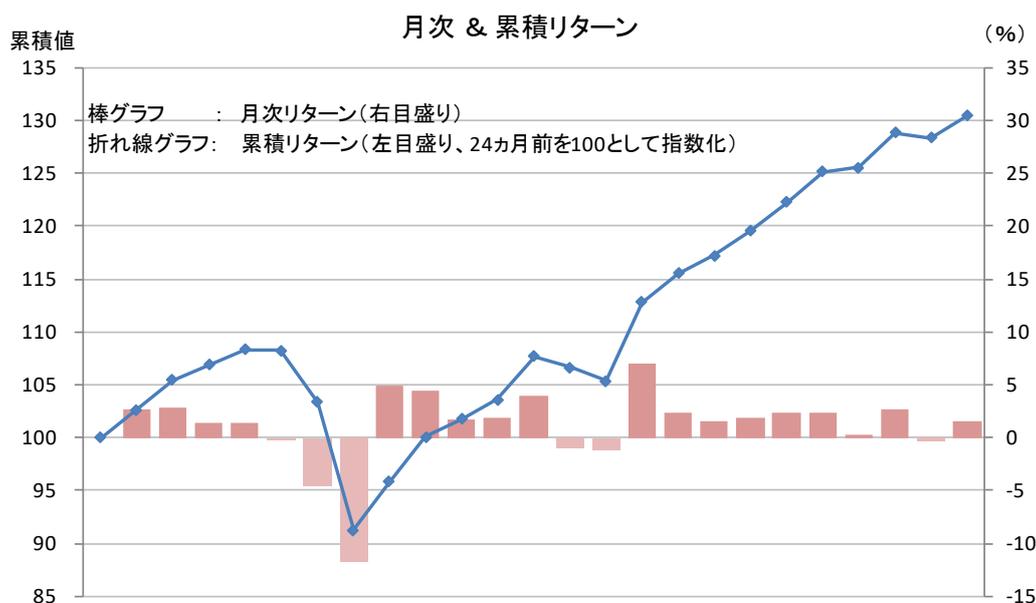


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2021年8月

「総合」 +1.62 %
(前月 -0.39 %)



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		16,389	16,128	262	1.62	
国内株式		20,119	19,490	628	3.22	
一般		19,673	19,034	639	3.36	
フリー		18,747	18,101	647	3.57	
バリュー		24,038	23,432	606	2.59	
小型		45,052	43,321	1,731	4.00	
その他		19,378	18,833	545	2.89	
日経225		18,765	18,227	538	2.95	
TOPIX		18,852	18,279	573	3.14	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	17,818	17,218	600	3.49	
国内債券		13,292	13,301	-9	-0.06	
一般		13,292	13,301	-9	-0.06	
外国株式(先進国)		22,428	21,891	537	2.45	
グローバル		24,910	24,335	575	2.36	
除く日本		33,265	32,535	730	2.24	
含む日本		23,042	22,502	540	2.40	
その他		17,341	16,883	458	2.71	
北米		17,034	16,754	280	1.67	
米国		27,089	26,352	737	2.80	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	20,280	20,147	133	0.66	
欧州		23,953	23,657	295	1.25	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	11,241	11,111	130	1.17	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	9,235	9,198	37	0.40	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	39,650	39,606	44	0.11	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	17,460	17,108	352	2.05	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	45,378	44,150	1,228	2.78	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	7,716	7,692	24	0.31	
エマージング株式		18,620	18,369	251	1.36	
グローバル		18,925	18,843	82	0.43	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	28,588	28,550	37	0.13	
その他		19,139	18,797	342	1.82	
欧州		28,729	27,888	840	3.01	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	13,371	13,186	185	1.40	
アジア・オセアニア		18,661	18,739	-77	-0.41	
中国		47,352	49,435	-2,083	-4.21	
インド	10,000 (2004.09.30)	44,680	41,959	2,721	6.49	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	12,428	11,975	453	3.79	
タイ		20,715	19,219	1,496	7.78	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,244	6,794	449	6.61	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	21,021	20,334	686	3.37	
韓国	10,000 (1997.06.30)	36,385	37,935	-1,549	-4.08	
香港		22,368	22,968	-600	-2.61	
台湾	10,000 (2008.03.31)	26,318	26,121	197	0.75	
中南米	7,427 (2006.04.28)	8,643	8,942	-299	-3.34	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	8,366	8,939	-573	-6.41	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	10,281	10,215	67	0.65	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	11,590	11,338	251	2.22	
トルコ		21,379	19,995	1,384	6.92	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	24,895	24,513	381	1.56	

※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		16,389	16,128	262	1.62
外国債券(先進国)		18,960	18,986	-26	-0.14
グローバル		19,220	19,228	-8	-0.04
除く日本		20,719	20,744	-25	-0.12
含む日本		18,311	18,304	7	0.04
その他		18,212	18,298	-87	-0.47
北米	9,052 (2013.05.31)	11,240	11,210	30	0.27
米国		17,113	17,034	79	0.46
カナダ	10,000 (2003.05.30)	15,125	15,244	-119	-0.78
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,655	15,725	-70	-0.45
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,447	10,553	-105	-1.00
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	19,924	20,112	-188	-0.94
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	24,563	24,810	-247	-0.99
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,578	11,674	-97	-0.83
複合地域	10,000 (2001.11.30)	18,536	18,683	-147	-0.78
グローバル	10,000 (2015.10.30)	10,103	10,032	72	0.72
エマージング債券		17,325	17,249	77	0.44
グローバル		18,879	18,798	81	0.43
米ドル建て		19,645	19,534	110	0.56
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,765	12,765	0	0.00
その他	8,647 (2005.03.31)	12,635	12,577	58	0.46
ロシア	10,000 (2008.05.30)	10,770	10,670	100	0.94
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	14,935	14,728	207	1.40
インド	10,000 (2011.08.31)	17,520	17,104	416	2.43
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	15,042	14,667	375	2.55
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	10,351	10,679	-328	-3.07
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	12,720	12,783	-63	-0.49
トルコ	10,000 (2011.04.28)	4,580	4,434	146	3.30
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,695	10,541	154	1.46
ハイイールド債券		23,581	23,457	124	0.53
グローバル	10,000 (1997.06.30)	23,460	23,442	18	0.08
北米		23,127	22,976	151	0.66
その他	10,000 (2004.03.31)	23,099	23,002	97	0.42
欧州	10,000 (2006.04.28)	23,176	23,146	30	0.13
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,894	14,671	223	1.52
複合地域	10,000 (2004.03.31)	21,756	21,695	62	0.28
複合資産		19,342	19,193	150	0.78
安定	10,000 (1998.10.30)	16,615	16,539	77	0.46
安定成長		20,966	20,799	167	0.80
成長		25,044	24,672	373	1.51
国内バランス		13,066	13,040	26	0.20
安定		13,308	13,285	23	0.17
一般		16,329	16,171	158	0.98
その他	10,000 (2018.10.31)	15,883	15,679	204	1.30

※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		16,389	16,128	262	1.62	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	37,418	37,586	-168	-0.45	
日本	10,000 (2003.10.31)	37,418	37,586	-168	-0.45	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	31,728	31,198	529	1.70	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	26,962	26,586	376	1.41	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	29,958	29,497	460	1.56	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	26,816	26,457	358	1.35	
北米	10,000 (2003.09.30)	32,698	32,072	626	1.95	
その他	10,000 (2004.04.30)	29,584	29,139	444	1.52	
欧州	10,000 (2006.12.29)	6,244	6,124	121	1.97	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	21,691	21,593	98	0.45	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	16,400	15,493	907	5.85	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	6,904	6,654	251	3.77	
複数国	10,000 (2004.04.30)	43,665	43,292	374	0.86	
その他		6,724	6,647	76	1.15	
絶対収益型		8,094	8,067	27	0.34	
ロング・ショート		8,758	8,765	-7	-0.08	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	12,226	12,070	156	1.29	
GTAA		11,876	11,757	118	1.01	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,628	7,609	19	0.25	
CB		22,234	22,050	184	0.83	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	19,459	19,582	-122	-0.62	
日本		20,044	19,946	98	0.49	
グローバル		39,157	38,815	342	0.88	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	9,387	9,467	-80	-0.84	
全業種	10,000 (2004.12.30)	7,658	7,662	-4	-0.06	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	17,635	17,841	-205	-1.15	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	5,344	5,533	-189	-3.41	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	11,193	11,245	-52	-0.46	

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

[色塗りの基準]月次リターン> 総合

＜1＞パフォーマンス・サマリー

(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	3.89	9.10	21.09	12.92
国内株式	2.10	5.18	24.54	8.02
一般	3.22	6.71	25.18	9.10
フリー	3.61	6.46	24.96	8.37
バリュー	1.82	7.59	25.85	11.80
小型	5.45	8.78	24.78	8.25
その他	-0.38	1.96	23.40	6.35
日経225	-2.72	-2.62	22.62	2.77
TOPIX	2.04	6.18	23.49	9.72
JPX日経400	1.56	5.44	22.72	8.83
国内債券	0.60	1.49	0.81	0.40
一般	0.60	1.49	0.81	0.40
外国株式(先進国)	7.02	13.62	31.49	19.31
グローバル	6.40	11.63	31.58	17.64
除く日本	5.61	18.29	34.52	25.33
含む日本	6.63	9.92	30.86	15.68
その他	8.92	20.09	31.54	24.74
北米	1.68	17.49	42.51	28.05
米国	9.80	21.29	31.42	25.53
カナダ	0.89	12.64	27.85	19.19
欧州	3.06	16.02	29.27	19.89
ドイツ	-1.00	13.77	23.94	16.43
イギリス	-1.50	8.73	26.77	16.80
アジア・オセアニア	-2.30	0.44	18.00	8.14
オーストラリア	-0.92	6.08	28.46	14.63
ニュージーランド	3.03	6.78	19.10	4.42
複合地域	-2.89	11.61	43.72	39.02
エマージング株式	-0.83	2.70	27.92	13.94
グローバル	-3.47	-0.37	22.57	10.32
BRICS	-1.90	3.89	25.67	11.83
その他	0.40	4.06	30.40	15.65
欧州	4.87	16.41	29.12	20.07
ロシア	5.18	20.25	37.44	25.27
アジア・オセアニア	-5.59	-6.58	17.34	5.51
中国	-11.38	-11.03	4.46	-0.55
インド	10.83	17.26	51.32	32.60
インドネシア	2.70	-2.51	13.25	-0.21
タイ	0.37	2.75	13.66	7.27
フィリピン	-0.80	3.72	18.46	-0.69
ベトナム	3.06	23.37	68.85	33.91
韓国	-0.82	6.88	35.14	11.77
香港	-11.77	-11.20	5.82	3.05
台湾	6.37	7.35	43.71	27.26
中南米	-1.22	13.51	32.70	8.22
ブラジル	-3.92	14.14	20.94	3.50
メキシコ	4.36	23.01	50.69	20.90
中東・アフリカ	2.62	16.04	38.99	25.29
トルコ	8.35	-4.48	26.35	-0.89
複合地域	-3.03	-1.95	21.80	12.95

※[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か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	3.89	9.10	21.09	12.92
外国債券(先進国)	0.11	2.50	3.97	2.38
グローバル	0.58	2.74	3.38	1.85
除く日本	0.23	2.80	2.91	1.80
含む日本	0.94	2.66	3.92	1.89
その他	-1.46	1.64	5.61	3.84
北米	1.73	3.61	4.64	2.70
米国	2.79	8.48	10.91	10.51
カナダ	-3.43	4.19	6.49	6.04
欧州	0.50	0.90	1.24	-0.65
イギリス	-2.28	2.24	7.18	6.72
アジア・オセアニア	-4.22	-2.50	3.29	0.94
オーストラリア	-3.87	-2.08	3.61	1.00
ニュージーランド	-2.96	-1.09	1.43	-1.01
複合地域	-2.16	0.04	2.60	0.52
グローバル	-0.27	5.68	11.41	6.42
エマージング債券	0.40	5.04	8.38	4.33
グローバル	0.73	4.53	8.37	3.68
米ドル建て	1.37	5.47	9.06	4.54
現地通貨建て	-1.32	1.52	6.17	0.93
その他	0.03	5.60	8.42	5.06
ロシア	2.24	7.16	7.71	6.50
アジア・オセアニア	-0.74	0.62	3.45	2.02
インド	0.18	5.51	10.30	8.44
インドネシア	2.57	5.90	14.69	6.14
ブラジル	-0.84	7.59	4.48	1.07
メキシコ	-1.08	4.79	11.99	0.17
トルコ	8.33	-11.40	-6.35	-7.79
複合地域	0.08	2.23	5.22	0.46
ハイイールド債券	1.45	6.05	14.58	9.77
グローバル	0.05	4.85	12.52	7.11
北米	2.19	7.28	15.83	11.37
その他	-0.30	2.09	11.36	5.73
欧州	0.12	2.13	11.99	5.95
アジア・オセアニア	-1.78	1.86	8.93	4.92
複合地域	-0.26	3.79	10.06	6.27
複合資産	1.88	6.04	11.63	7.42
安定	1.41	3.91	6.52	4.08
安定成長	1.57	6.38	12.73	8.34
成長	2.49	8.44	19.49	11.86
国内バランス	1.20	3.11	4.76	3.19
安定	1.21	3.03	4.28	2.97
一般	0.91	4.42	14.18	6.73
その他	8.07	15.89	25.09	16.11

※[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	3.89	9.10	21.09	12.92
国内REIT	4.25	12.53	26.40	22.85
日本	4.25	12.53	26.40	22.85
外国REIT	7.62	22.57	35.82	31.50
グローバル	6.80	20.68	35.78	28.88
除く日本	7.01	21.23	38.06	29.90
含む日本	6.71	20.47	35.00	28.51
北米	9.06	26.37	38.43	37.38
その他	3.09	10.54	21.84	12.82
欧州	3.50	16.30	25.76	17.36
アジア・オセアニア	2.41	7.97	17.53	10.47
オーストラリア	3.58	14.23	32.10	13.14
複合地域	3.02	16.25	33.72	17.55
複数国	8.29	22.78	36.85	34.23
その他	1.89	4.49	9.59	6.09
絶対収益型	2.25	2.99	3.99	3.15
ロング・ショート	1.19	2.27	-0.04	0.79
マーケットニュートラル	1.77	-0.03	-1.25	-1.86
GTAA	1.25	3.57	8.14	4.97
その他スタイル	2.53	3.45	4.99	4.04
CB	1.41	2.30	13.82	6.51
アジア・オセアニア	-4.61	1.57	21.05	14.03
日本	0.03	-2.15	1.58	-0.75
グローバル	1.61	2.45	14.04	6.58
コモディティ	-1.97	6.52	6.94	9.29
全業種	3.84	13.32	38.22	32.52
貴金属	-5.31	2.50	-8.16	-2.96
エネルギー	6.66	17.61	55.73	51.83
その他コモディティ	0.37	11.77	27.20	24.93

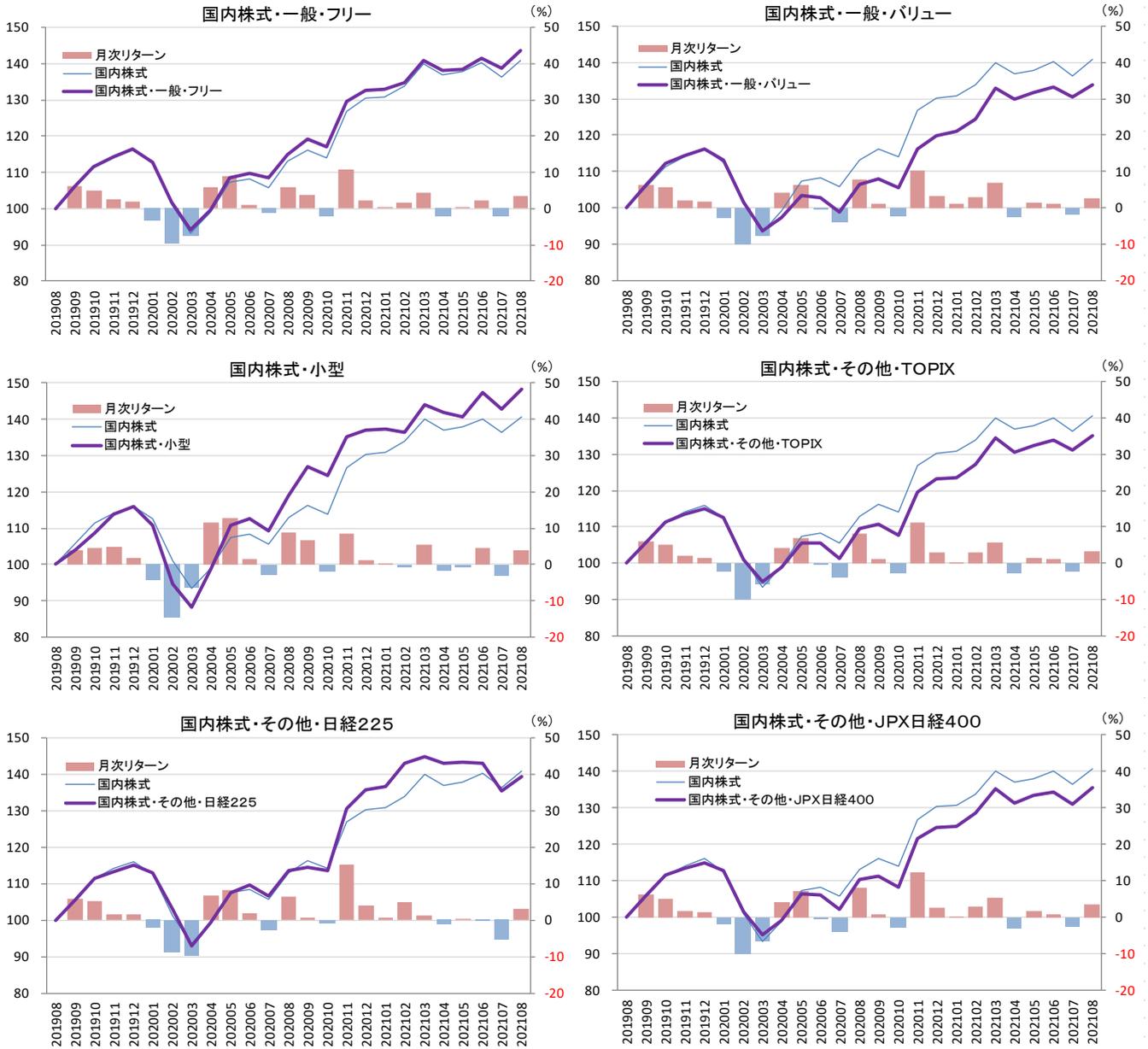
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

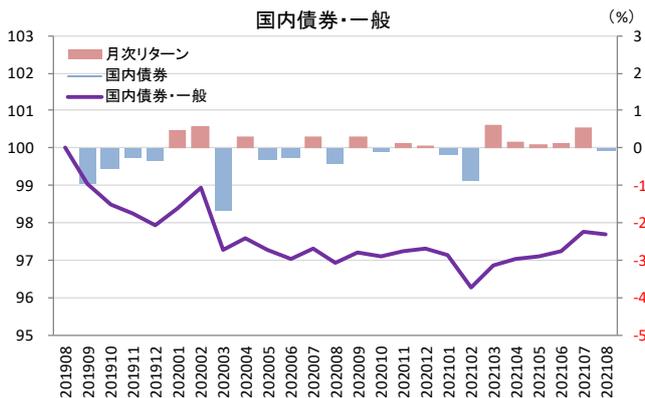
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

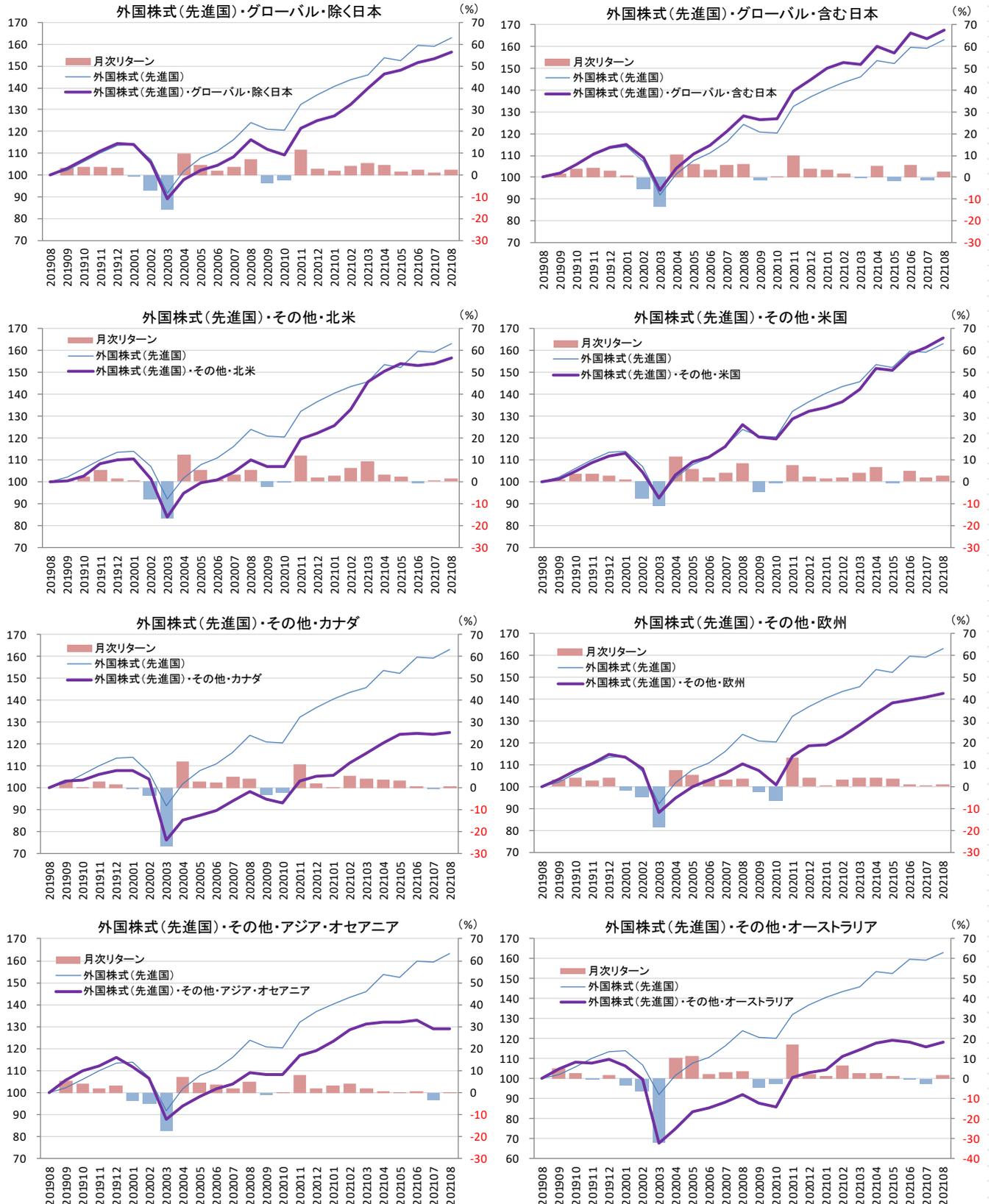


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

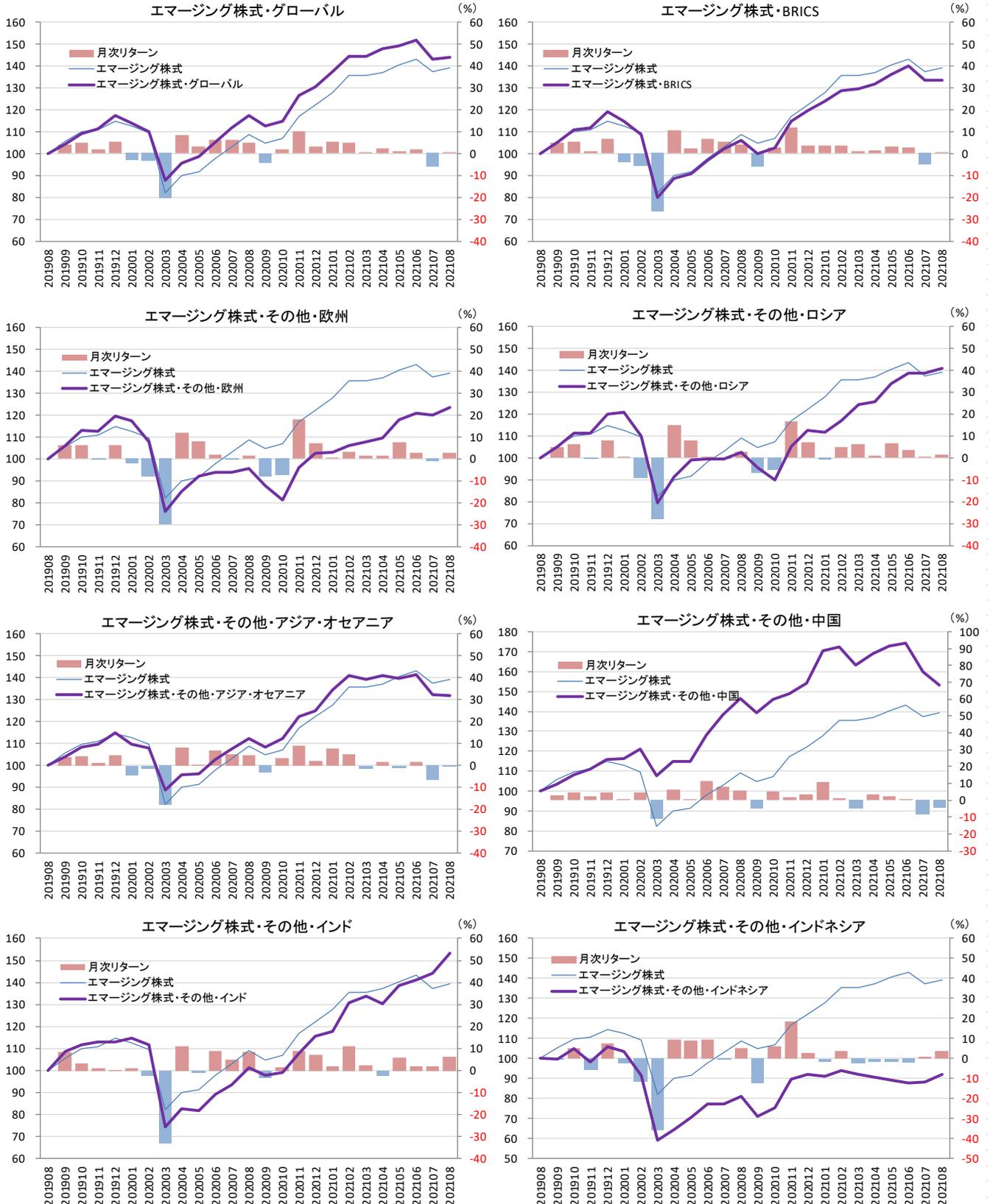


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

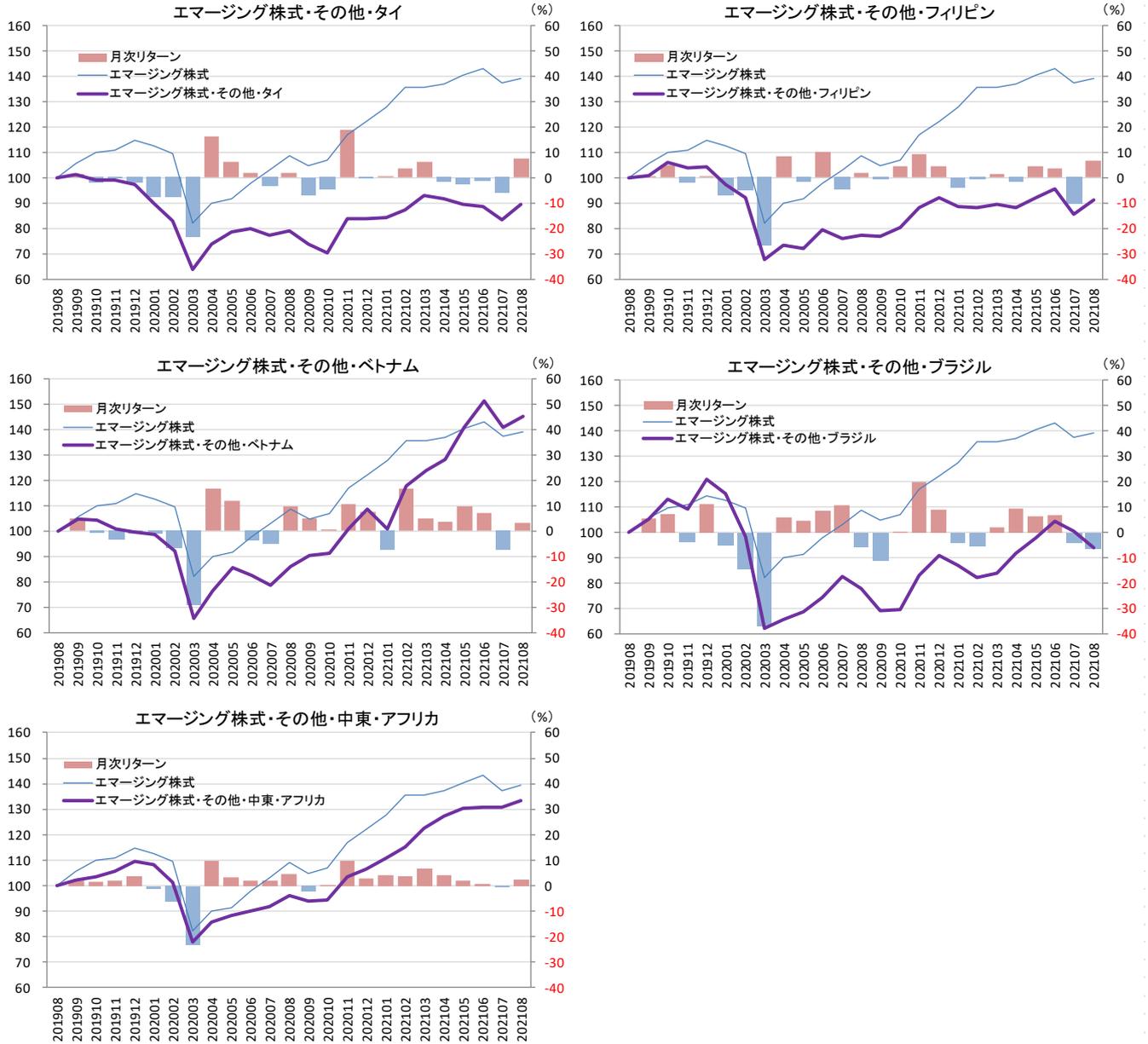


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

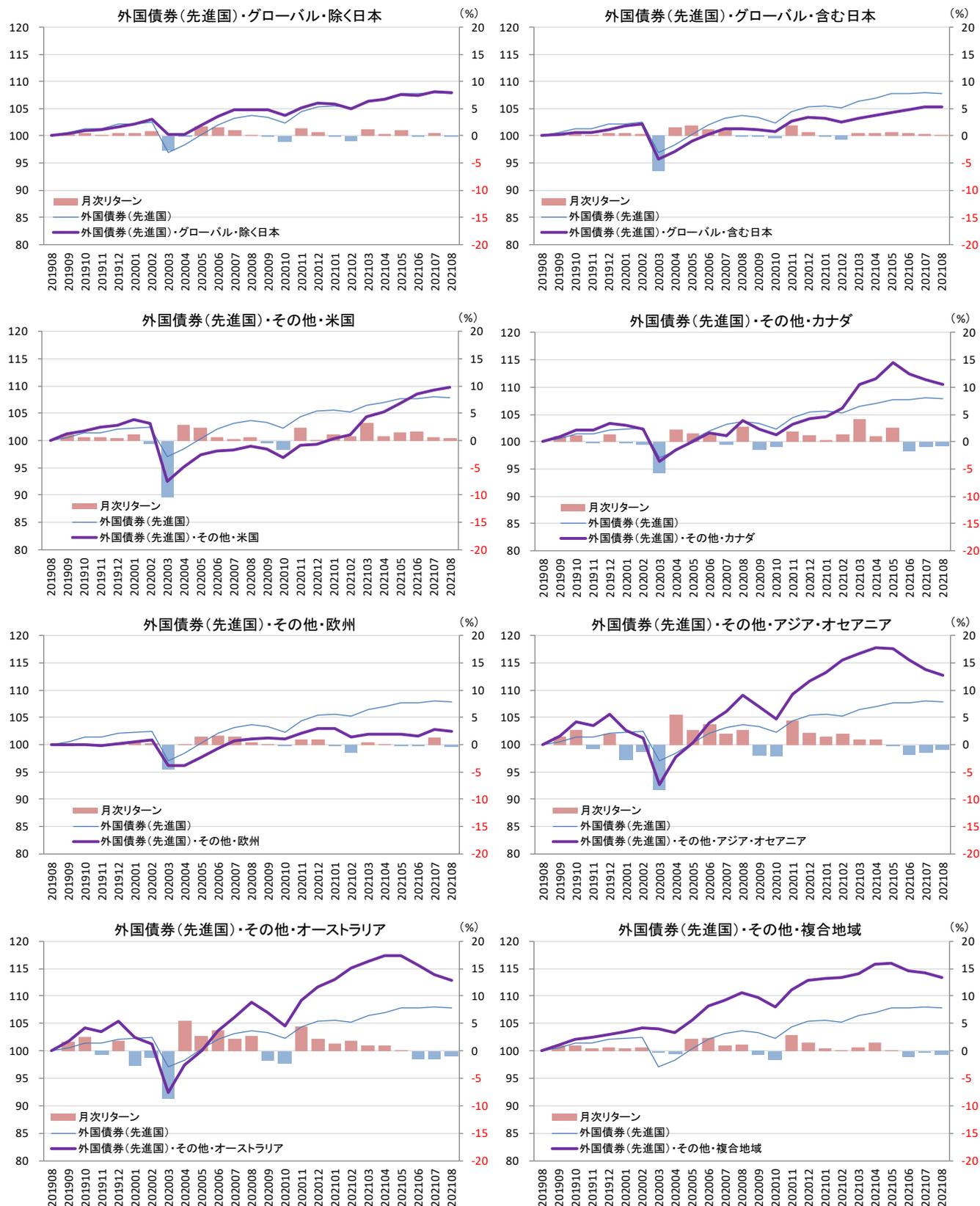


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

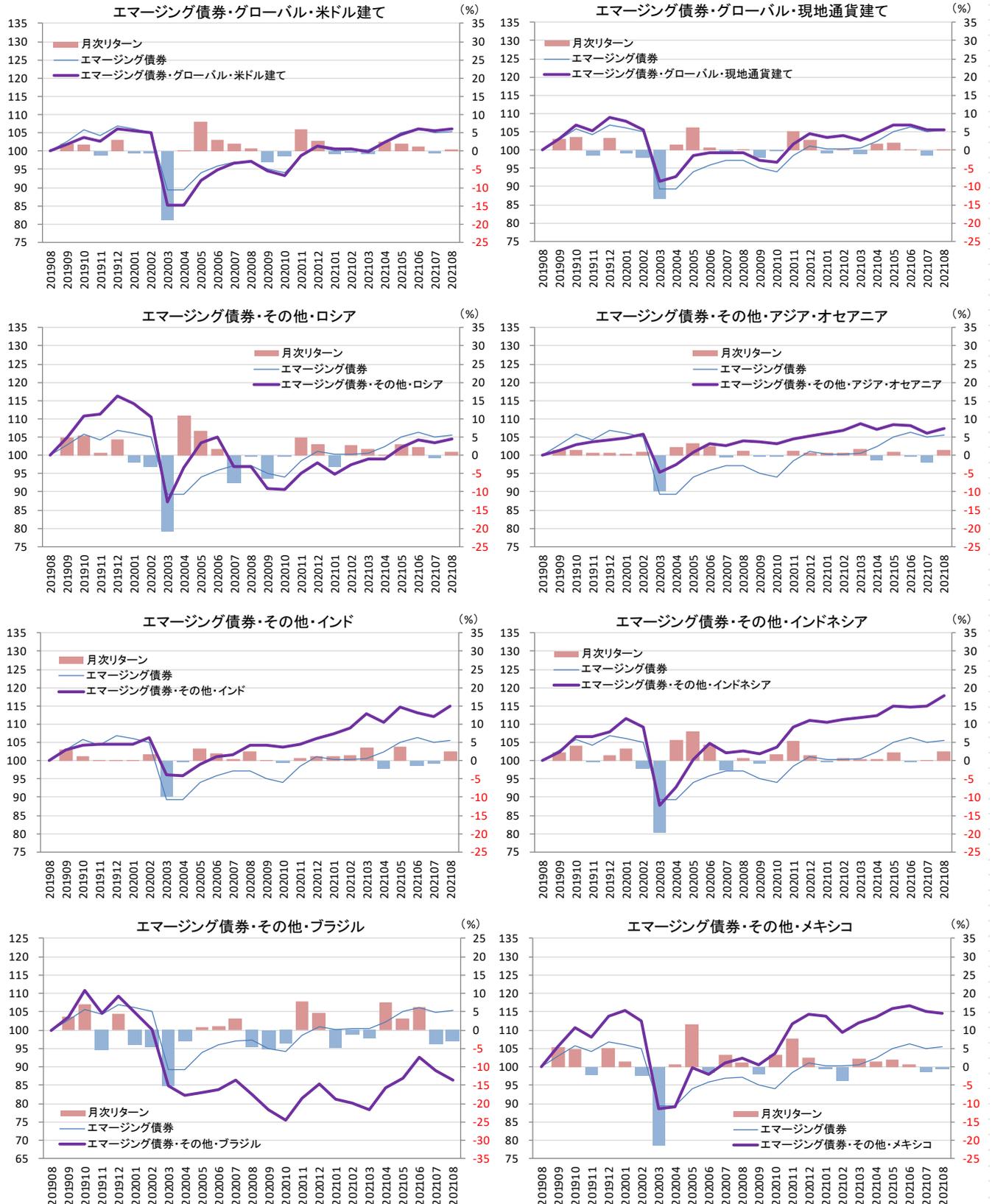


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24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⑥

[エマージング債券]

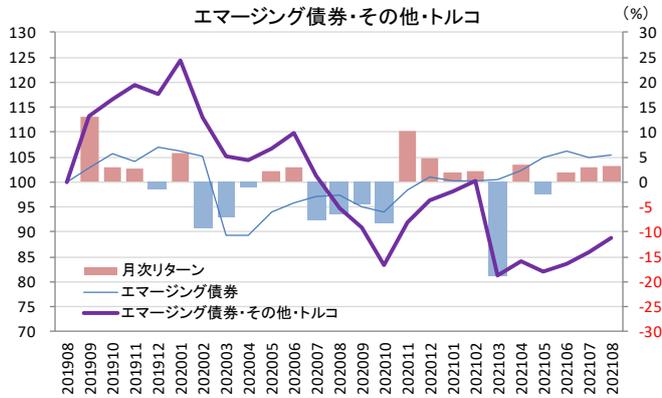


<1>パフォーマンス・サマリー

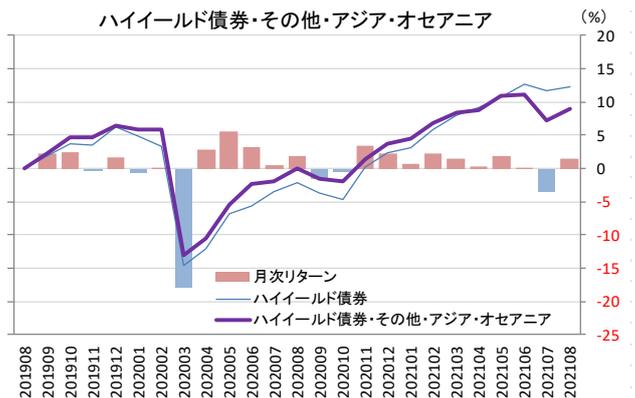
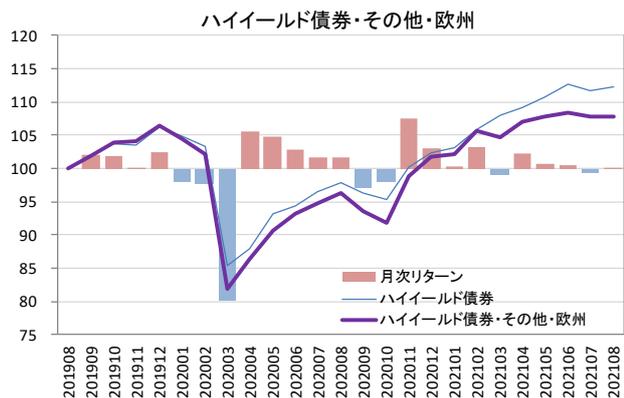
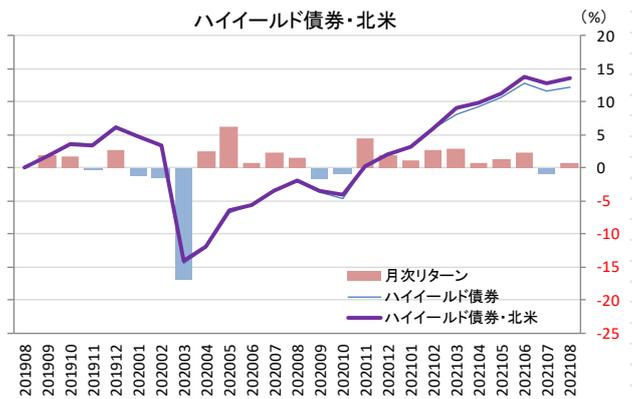
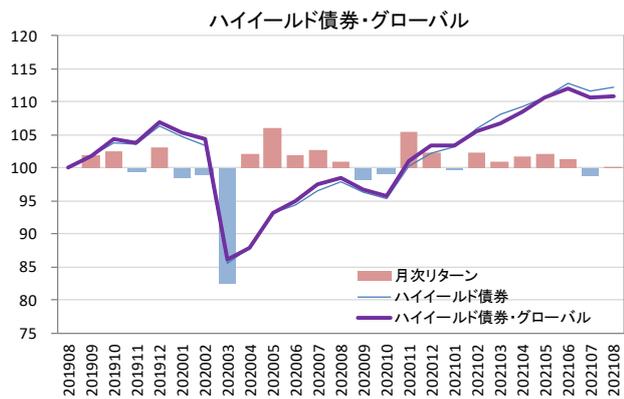
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

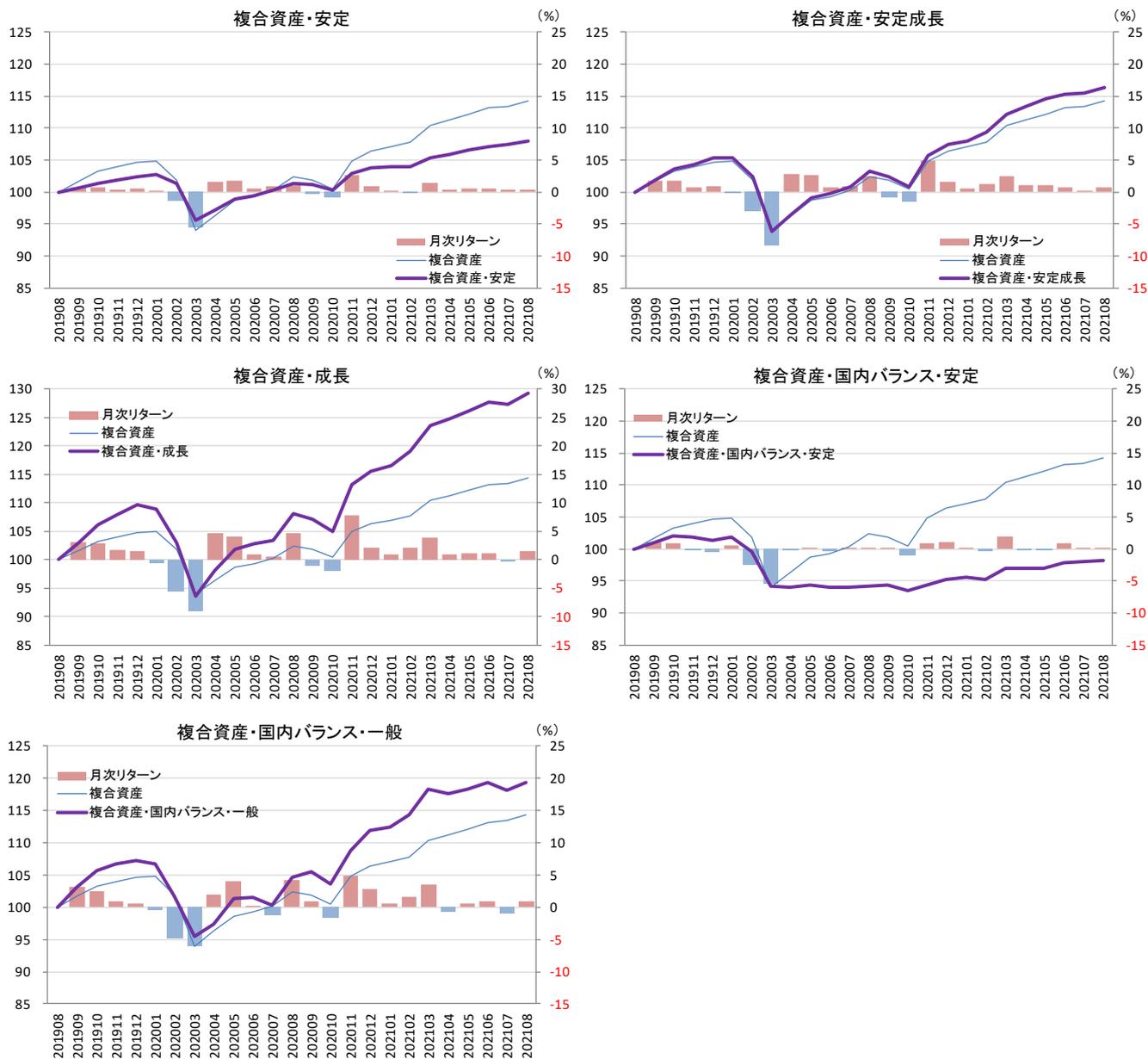


<1>パフォーマンス・サマリー

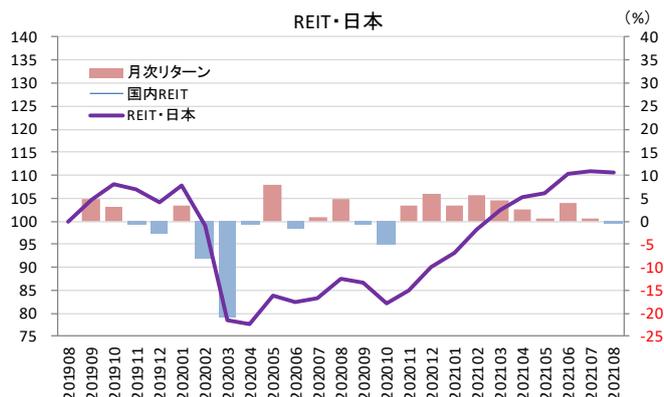
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

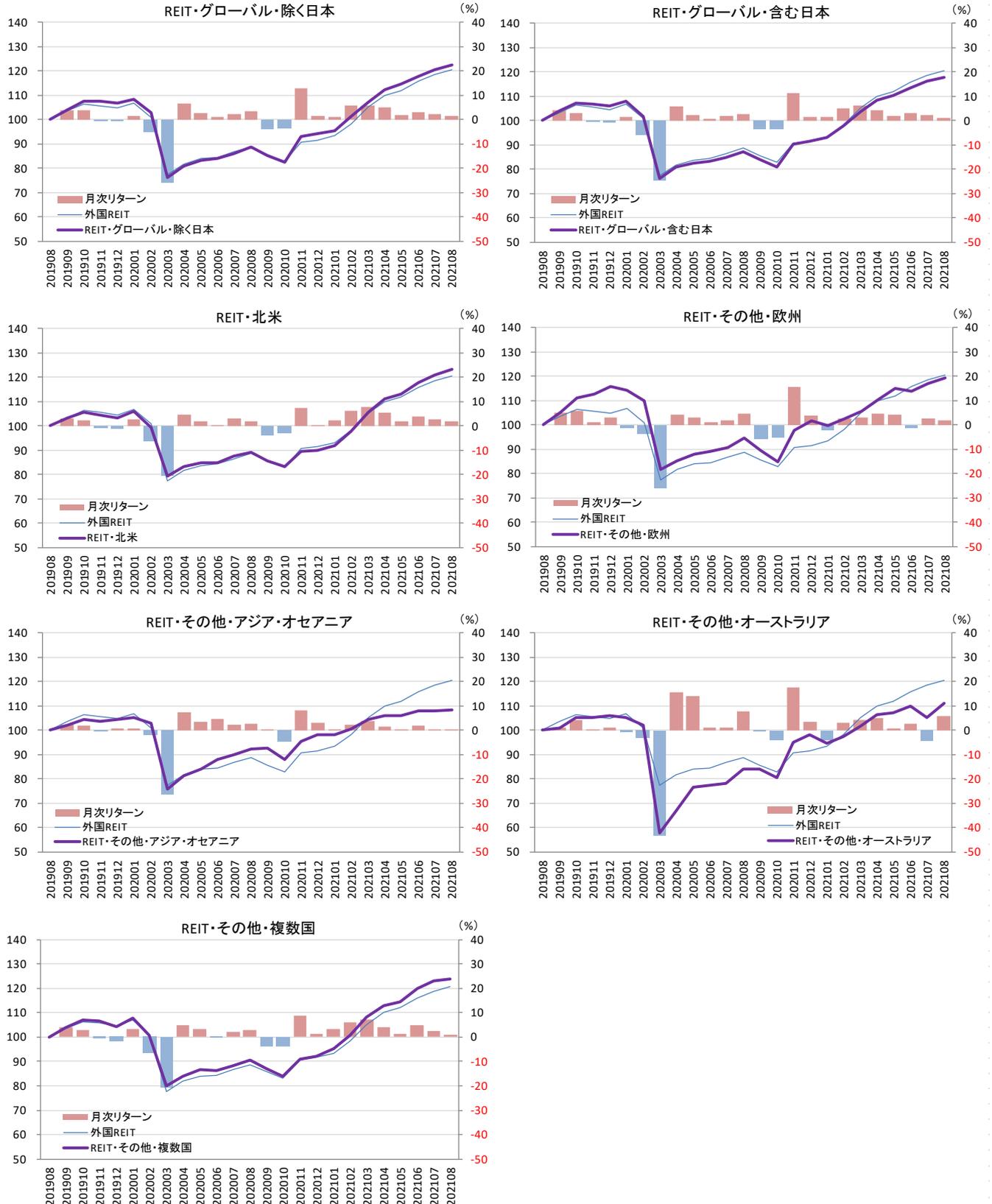


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

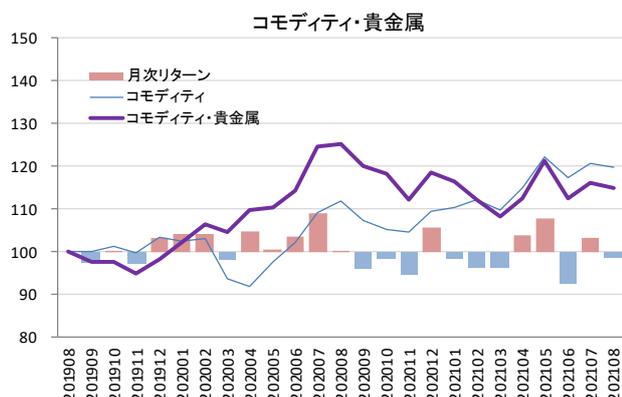
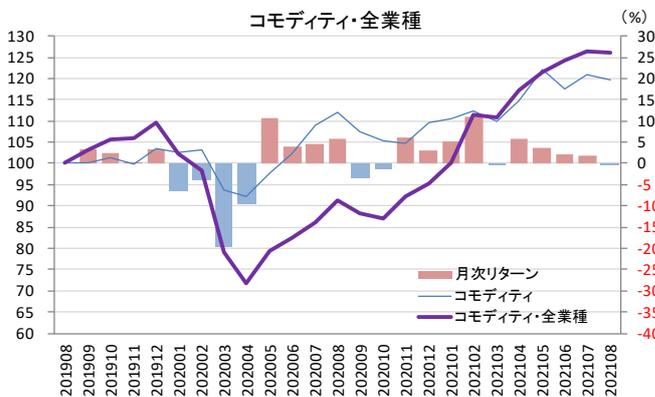
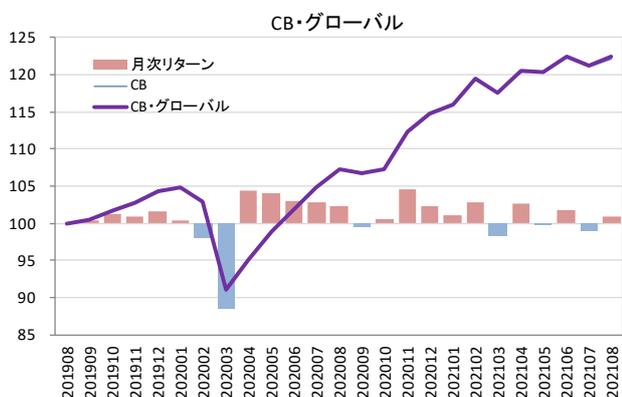
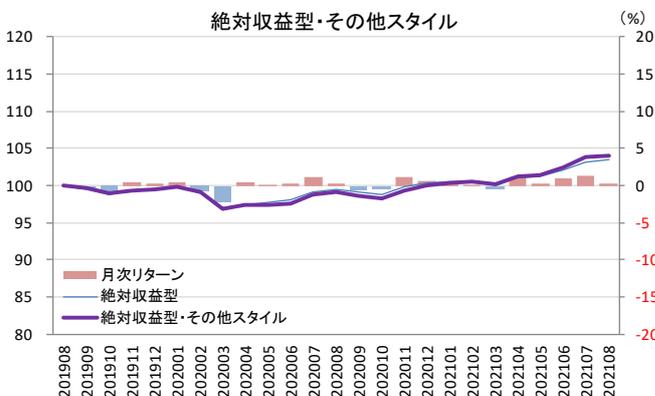
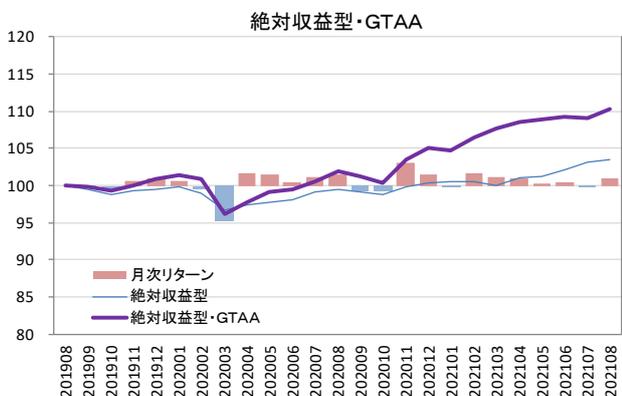
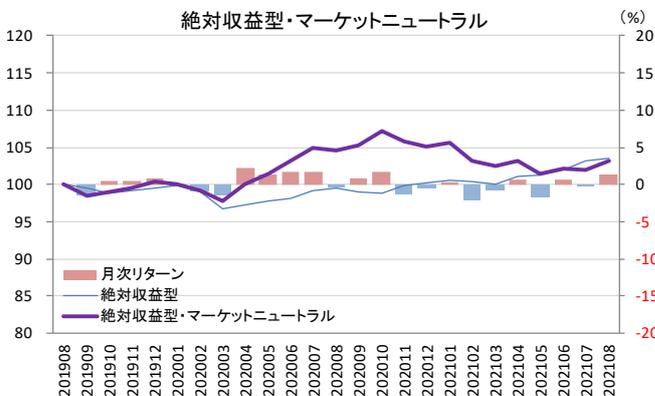
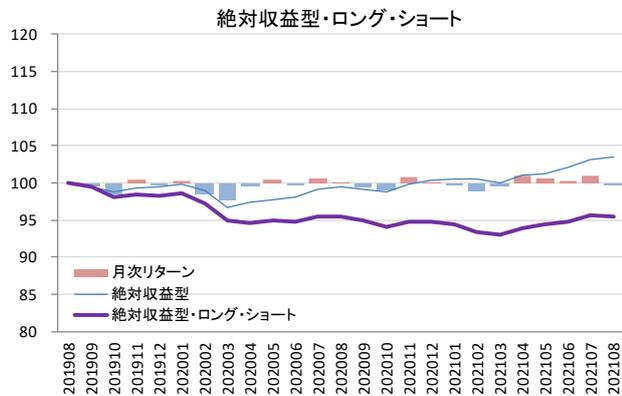


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	1.62		
1	外国株式(先進国)・グローバル	2.36	29.24	0.69
2	外国株式(先進国)・その他	2.71	9.75	0.27
3	国内株式・一般	3.36	6.89	0.23
4	国内株式・その他	2.89	4.36	0.13
5	REIT・北米	1.95	2.95	0.06
6	複合資産・安定成長	0.80	6.54	0.05
7	エマージング株式・その他	1.82	2.52	0.04
8	国内株式・小型	4.00	0.92	0.04
9	複合資産・成長	1.51	2.23	0.03
10	REIT・グローバル	1.41	2.35	0.03
11	ブルベア	5.82	0.41	0.02
12	複合資産・安定	0.46	4.45	0.02
13	ハイイールド債券・北米	0.66	1.47	0.01
14	複合資産・その他	1.30	0.58	0.01
15	REIT・その他	1.52	0.48	0.01
16	エマージング株式・グローバル	0.43	1.12	0.00
17	絶対収益型	0.34	1.17	0.00
18	エマージング債券・グローバル	0.43	0.84	0.00
19	エマージング債券・その他	0.46	0.71	0.00
20	複合資産・国内バランス	0.20	1.17	0.00
21	CB	0.83	0.18	0.00
22	ハイイールド債券・その他	0.42	0.33	0.00
23	国内株式・業種特化	1.28	0.08	0.00
24	ハイイールド債券・グローバル	0.08	0.35	0.00
25	エマージング株式・BRICS	0.13	0.08	0.00
26	国内債券・一般	-0.06	4.77	-0.00
27	外国債券(先進国)・グローバル	-0.04	7.72	-0.00
28	コモディティ	-0.84	0.45	-0.00
29	外国債券(先進国)・その他	-0.47	2.23	-0.01
30	REIT・日本	-0.45	3.68	-0.02
	合計		100.00	1.62

◆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	21.09		
1	外国株式(先進国)・グローバル	31.58	26.31	8.03
2	外国株式(先進国)・その他	31.54	8.52	2.60
3	国内株式・一般	25.18	7.69	2.00
4	国内株式・その他	23.40	4.50	1.09
5	REIT・北米	38.43	2.96	1.01
6	REIT・日本	26.40	3.81	0.94
7	複合資産・安定成長	12.73	6.83	0.89
8	エマージング株式・その他	30.40	2.76	0.81
9	REIT・グローバル	35.78	2.37	0.77
10	複合資産・成長	19.49	2.17	0.42
11	複合資産・安定	6.52	4.54	0.31
12	外国債券(先進国)・グローバル	3.38	8.24	0.29
13	国内株式・小型	24.78	1.07	0.28
14	エマージング株式・グローバル	22.57	1.18	0.26
15	ハイイールド債券・北米	15.83	1.69	0.26
16	複合資産・その他	25.09	0.81	0.19
17	外国債券(先進国)・その他	5.61	2.71	0.17
18	REIT・その他	21.84	0.54	0.11
19	ブルベア	30.32	0.36	0.11
20	エマージング債券・グローバル	8.37	0.99	0.08
21	エマージング債券・その他	8.42	0.90	0.07
22	複合資産・国内バランス	4.76	1.36	0.07
23	ハイイールド債券・グローバル	12.52	0.40	0.05
24	ハイイールド債券・その他	11.36	0.40	0.05
25	絶対収益型	3.99	1.19	0.05
26	国内債券・一般	0.81	4.86	0.04
27	国内株式・業種特化	37.33	0.10	0.04
28	CB	13.82	0.25	0.04
29	コモディティ	6.94	0.44	0.03
30	エマージング株式・BRICS	25.67	0.09	0.02
	合計		100.00	21.09

◆計算定義

$$\text{日次寄与度(％)} = \text{日次リターン(％)} \times \text{前日の純資産額構成比}$$

当月および直近1年間の寄与度は日次寄与度について累積計算したものの
また、上表の「構成比(％)」は期間中の平均値

<2>リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別①

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	28.29	49.38	120.47	12.31	10.06	11.51	0.71	0.84	0.71
国内株式	22.44	72.83	215.17	18.28	15.07	16.98	0.38	0.77	0.72
一般	21.70	71.61	198.15	18.07	14.97	17.25	0.38	0.76	0.67
フリー	23.41	75.82	203.01	18.33	15.15	17.82	0.40	0.79	0.66
バリュー	15.15	56.19	184.81	17.51	14.67	16.13	0.28	0.64	0.68
小型	25.21	103.53	337.96	22.07	17.87	18.03	0.35	0.86	0.88
その他	24.39	69.06	232.32	17.99	15.01	16.71	0.42	0.74	0.76
日経225	28.31	77.24	255.55	18.91	15.86	17.11	0.46	0.77	0.79
TOPIX	20.23	62.61	205.49	17.35	14.41	16.41	0.37	0.71	0.72
JPX日経400	21.57	59.46	-	17.50	14.48	-	0.39	0.68	-
国内債券	2.04	0.52	12.09	1.90	1.62	1.62	0.38	0.09	0.70
一般	2.04	0.52	12.09	1.90	1.62	1.62	0.38	0.09	0.70
外国株式(先進国)	55.29	106.99	229.46	18.90	15.39	16.21	0.84	1.02	0.78
グローバル	56.78	110.88	246.59	18.96	15.36	16.10	0.85	1.05	0.82
除く日本	48.52	106.22	292.52	19.63	16.32	17.64	0.72	0.96	0.83
含む日本	59.51	112.55	236.74	18.98	15.28	15.85	0.89	1.07	0.81
その他	50.78	97.23	205.25	19.01	15.79	17.27	0.77	0.92	0.68
北米	44.50	91.40	133.97	21.75	18.66	21.39	0.60	0.75	0.41
米国	60.79	125.24	243.35	18.50	15.55	17.34	0.93	1.14	0.76
カナダ	16.13	36.88	35.28	22.07	17.92	17.67	0.23	0.36	0.17
欧州	30.13	68.96	190.45	19.82	16.47 ↓	17.95	0.47	0.67	0.63
ドイツ	21.64	55.38	-	24.73	21.02	-	0.27	0.44	-
イギリス	0.31	13.43	-	20.57	17.06	-	0.01	0.15	-
アジア・オセアニア	19.70	50.35	164.17	17.44	14.18	17.37	0.36	0.60	0.59
オーストラリア	9.43	25.28	93.28	26.51	21.55	21.29	0.12	0.22	0.32
ニュージーランド	44.77	78.37	-	19.08	16.41	-	0.69	0.75	-
複合地域	-27.88	-16.51	-	36.60	29.86	-	-0.28	-0.12	-
エマージング株式	28.59	61.32	111.75	21.60	17.57	18.89	0.41	0.57	0.41
グローバル	37.94	72.35	105.27	21.18	17.18	18.68	0.54	0.67	0.40
BRICS	37.61	80.16	127.35	23.74	19.80	21.72	0.47	0.63	0.39
その他	25.20	56.97	116.68	22.21	18.08	19.10	0.35	0.52	0.42
欧州	31.41	63.73	57.52	27.58	23.65	24.65	0.35	0.44	0.19
ロシア	58.89	110.57	99.50	27.29	24.20	26.86	0.61	0.67	0.27
アジア・オセアニア	19.18	46.11	116.24	20.40	16.56	17.67	0.30	0.48	0.45
中国	56.76	107.52	231.94	22.00	18.50	22.05	0.74	0.85	0.58
インド	31.38	76.22	189.77	27.98	23.04	25.07	0.34	0.52	0.45
インドネシア	-5.04	-4.39	15.01	31.32	25.76	25.01	-0.05	-0.03	0.06
タイ	-15.48	6.50	62.45	25.28	20.97	19.22	-0.21	0.06	0.26
フィリピン	-11.40	-17.55	85.39	23.05	19.86	20.90	-0.17	-0.19	0.30
ベトナム	28.12	78.41	227.76	29.91	24.95	22.32	0.29	0.49	0.56
韓国	43.68	61.54	101.91	25.56	20.85	19.63	0.50	0.49	0.37
香港	-4.12	27.13	61.45	21.34	17.75	19.61	-0.06	0.28	0.25
台湾	53.27	105.37	253.66	23.35	18.91	18.36	0.66	0.82	0.73
中南米	18.81	34.47	18.77	32.32	28.44	26.68	0.18	0.22	0.06
ブラジル	17.75	15.38	-19.16	36.35	32.61	32.38	0.16	0.09	-0.07
メキシコ	-2.01	4.68	-	30.81	27.00	-	-0.02	0.04	-
中東・アフリカ	22.55	49.65	120.20	20.61	17.12	17.35	0.34	0.49	0.47
トルコ	27.66	-22.28	-10.77	34.18 ↓	32.58	30.80	0.25	-0.15	-0.04
複合地域	17.91	40.17	100.97	20.18	16.20	16.62	0.28	0.43	0.43

※[色塗りの基準] 累積リターン>総合、リスク<総合、シャープ・レシオ>=0.5

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

＜2＞リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別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	28.29	49.38	120.47	12.31	10.06	11.51	0.71	0.84	0.71
外国債券(先進国)	10.11	14.84	42.24	4.42	4.25 ↓	7.36	0.75	0.67	0.49
グローバル	10.33	14.31	44.19	3.61	3.62 ↓	6.57	0.93	0.76	0.57
除く日本	11.31	15.96	47.15	3.17	3.66 ↓	7.21	1.16	0.83	0.55
含む日本	9.19	12.36	40.89	4.54	4.03 ↓	6.01	0.66	0.60	0.58
その他	9.62	15.63	38.15	7.36	6.74 ↓	9.26	0.43	0.44	0.35
北米	10.34	12.67	-	5.05	4.11	-	0.67	0.60	-
米国	13.47	18.76	67.35	7.46	6.44	6.67	0.58	0.55	0.79
カナダ	8.95	14.36	23.70	6.78	7.36	9.04	0.43	0.38	0.24
欧州	2.76	12.17	43.24	3.83	4.74	8.73	0.25	0.50	0.42
イギリス	9.02	14.57	-	7.95	8.48	-	0.37	0.33	-
アジア・オセアニア	8.09	13.86	35.04	9.50	8.54	10.56	0.28	0.31	0.29
オーストラリア	7.85	14.02	33.70	9.58	8.62 ↓	10.66	0.27	0.31	0.28
ニュージーランド	10.04	13.03	-	8.34	8.59	-	0.39	0.29	-
複合地域	16.42	23.68	42.25	3.85	4.62	8.89	1.36	0.95	0.40
グローバル	11.48	13.39	-	12.32 ↓	11.28	-	0.30	0.23	-
エマージング債券	12.92	13.91	27.62	11.89 ↓	10.72	13.12	0.35	0.25	0.19
グローバル	14.14	11.76	30.78	13.80 ↓	12.05	13.49	0.33	0.19	0.20
米ドル建て	15.13	12.36	33.79	14.38 ↓	12.45	13.81	0.34	0.19	0.21
現地通貨建て	10.95	10.97	20.03	12.03 ↓	10.97	12.28	0.30	0.20	0.15
その他	11.79	16.77	21.53	10.57 ↓	9.99	13.60	0.36	0.32	0.14
ロシア	17.85	34.74	26.59	18.94 ↓	17.65 ↓	22.69	0.30	0.35	0.10
アジア・オセアニア	11.88	16.96	59.80	7.37	6.30	8.76	0.52	0.51	0.55
インド	19.89	31.33	75.20	9.74	8.91	13.03	0.64	0.63	0.44
インドネシア	25.63	26.64	37.83	16.91	13.95	15.94	0.47	0.35	0.20
ブラジル	-4.96	-4.20	-1.12	19.55	18.21	18.95	-0.08	-0.04	-0.01
メキシコ	15.56	23.17	38.47	18.20 ↓	17.39	16.42	0.27	0.25	0.20
トルコ	34.60	-49.39	-46.46	30.22 ↓	30.94	25.13	0.35	-0.41	-0.24
複合地域	4.32	18.01	14.73	12.17 ↓	10.87 ↓	13.48	0.12	0.31	0.10
ハイイールド債券	14.04	26.78	83.01	13.13	11.06	12.49	0.34	0.44	0.50
グローバル	12.26	24.96	70.55	13.21	11.19	12.70	0.30	0.41	0.43
北米	14.35	30.33	93.32	12.99	11.01	12.16	0.36	0.50	0.56
その他	13.64	17.43	71.29	14.29	12.12	14.57	0.31	0.27	0.38
欧州	14.06	16.99	80.61	14.99	12.81 ↓	15.57	0.30	0.25	0.39
アジア・オセアニア	11.99	18.68	57.33	12.86	10.73	13.44	0.30	0.33	0.34
複合地域	15.24	33.98	111.10	9.38	8.43 ↓	10.78	0.52	0.72	0.72
複合資産	14.94	28.95	94.16	7.68	6.43 ↓	8.81	0.62	0.82	0.78
安定	9.55	18.20	70.87	5.19	4.41 ↓	7.10	0.60	0.78	0.77
安定成長	17.07	31.97	98.92	8.28	6.96 ↓	9.26	0.66	0.83	0.77
成長	24.01	52.51	151.90	12.21	10.17	11.64	0.61	0.87	0.83
国内バランス	2.35	7.30	40.78	4.44	3.59	6.24	0.18	0.41	0.56
安定	2.01	4.63	31.42	4.23	3.38	3.34	0.17	0.28	0.83
一般	14.52	37.47	79.07	9.43	7.94	9.66	0.49	0.83	0.62

※[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	28.29	49.38	120.47	12.31	10.06	11.51	0.71	0.84	0.71
国内REIT	34.80	39.42	199.81	17.08	13.90	17.07	0.62	0.50	0.68
日本	34.80	39.42	199.81	17.08	13.90	17.07	0.62	0.50	0.68
外国REIT	28.15	39.50	190.81	18.83	16.22	16.37	0.46	0.43	0.69
グローバル	21.66	32.48	161.72	20.14	17.06	16.66	0.34	0.34	0.61
除く日本	27.03	44.55	194.26	20.83	17.53	16.91	0.40	0.44	0.67
含む日本	20.12	30.19	156.60	19.94	16.91	16.59	0.32	0.32	0.60
北米	34.88	45.96	220.99	17.91	15.92	16.56	0.59	0.50	0.75
その他	19.27	37.71	182.78	21.15	17.13	16.54	0.29	0.39	0.66
欧州	4.81	22.88	58.29	22.15	18.36	20.12	0.07	0.23	0.23
アジア・オセアニア	20.19	45.30	188.97	19.46	15.84	16.45	0.33	0.49	0.68
オーストラリア	15.40	21.70	153.17	32.13	25.98	22.47	0.15	0.16	0.43
複合地域	-3.79	1.87	87.66	29.37	23.61	21.51	-0.04	0.02	0.30
複数国	38.71	52.06	274.33	17.77	15.07	15.43	0.65	0.58	0.91
その他									
絶対収益型	3.33	5.33	1.17	2.50	2.29	3.29	0.46	0.47	0.03
ロング・ショート	-0.89	-0.88	-2.80	3.23	3.09	2.92 ↓	-0.08	-0.04	-0.10
マーケットニュートラル	-1.82	12.72	41.81	3.98	4.40 ↓	5.42	-0.14	0.56	0.65
GTAA	14.05	14.18	25.32	4.45	3.74	3.27	1.02	0.73	0.69
その他スタイル	3.91	4.77	-0.65	2.57	2.32	4.88	0.52	0.42	-0.02
CB	20.08	31.71	64.25	9.67	7.75	9.48 ↓	0.65	0.74	0.54
アジア・オセアニア	34.00	55.81	117.54	14.26	11.65	12.32	0.72	0.80	0.66
日本	-4.05	4.12	43.98	5.83	5.14	6.22	-0.23	0.17	0.60
グローバル	20.68	32.54	64.41	9.86	7.90	9.73	0.66	0.74	0.52
コモディティ	23.50	33.73	-11.50	11.64	10.72	14.06	0.63	0.56	-0.09
全業種	10.16	25.28	-15.85	19.92	16.87	16.80	0.17	0.28	-0.10
貴金属	40.08	32.28	-4.24	13.57	11.32	16.15	0.88	0.51	-0.03
エネルギー	-5.04	36.87	-28.30	42.45	35.09	30.80	-0.04	0.19	-0.11
その他コモディティ	5.09	14.19	-6.50	20.24	17.31	18.22	0.08	0.16	-0.04

※[色塗りの基準] 累積リターン>総合、リスク<総合、シャープ・レシオ>=0.5

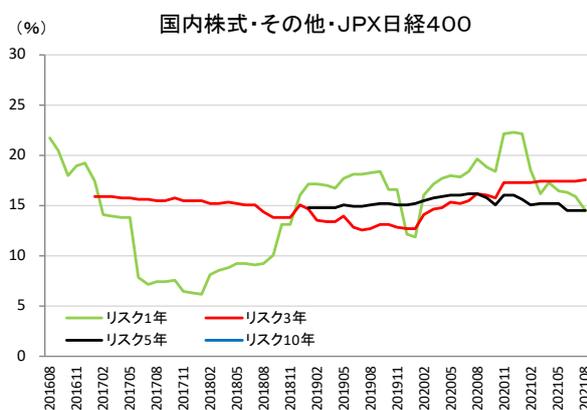
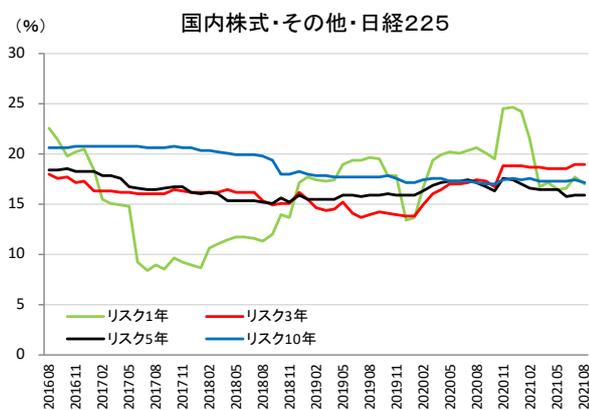
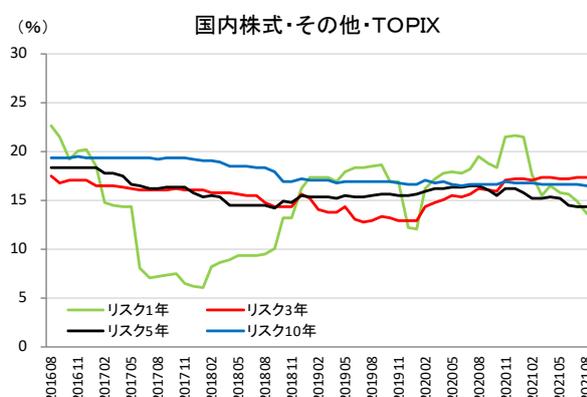
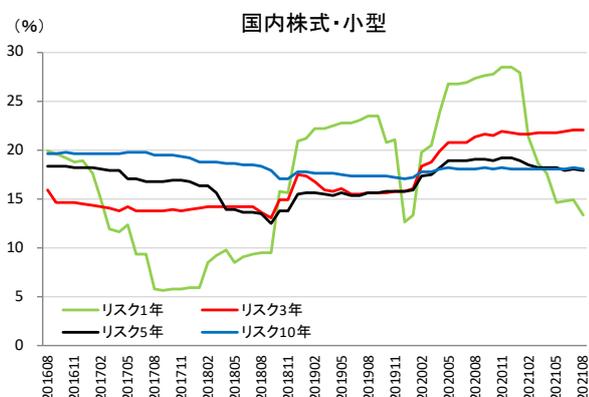
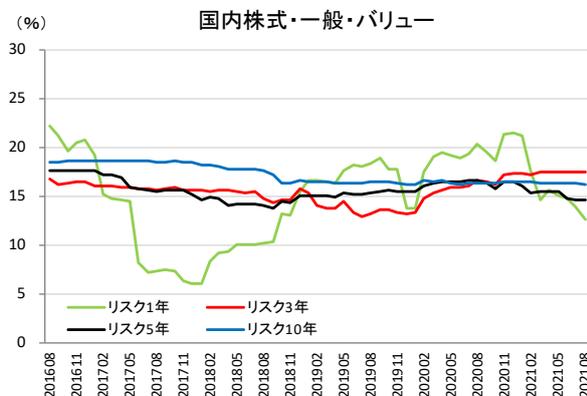
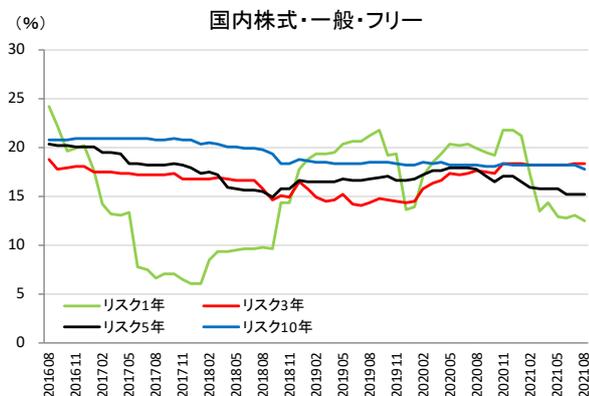
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

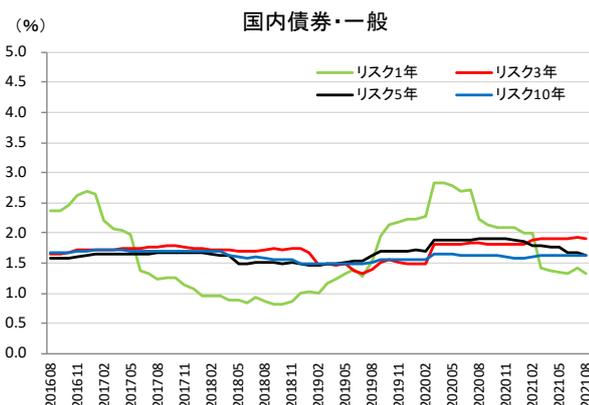
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

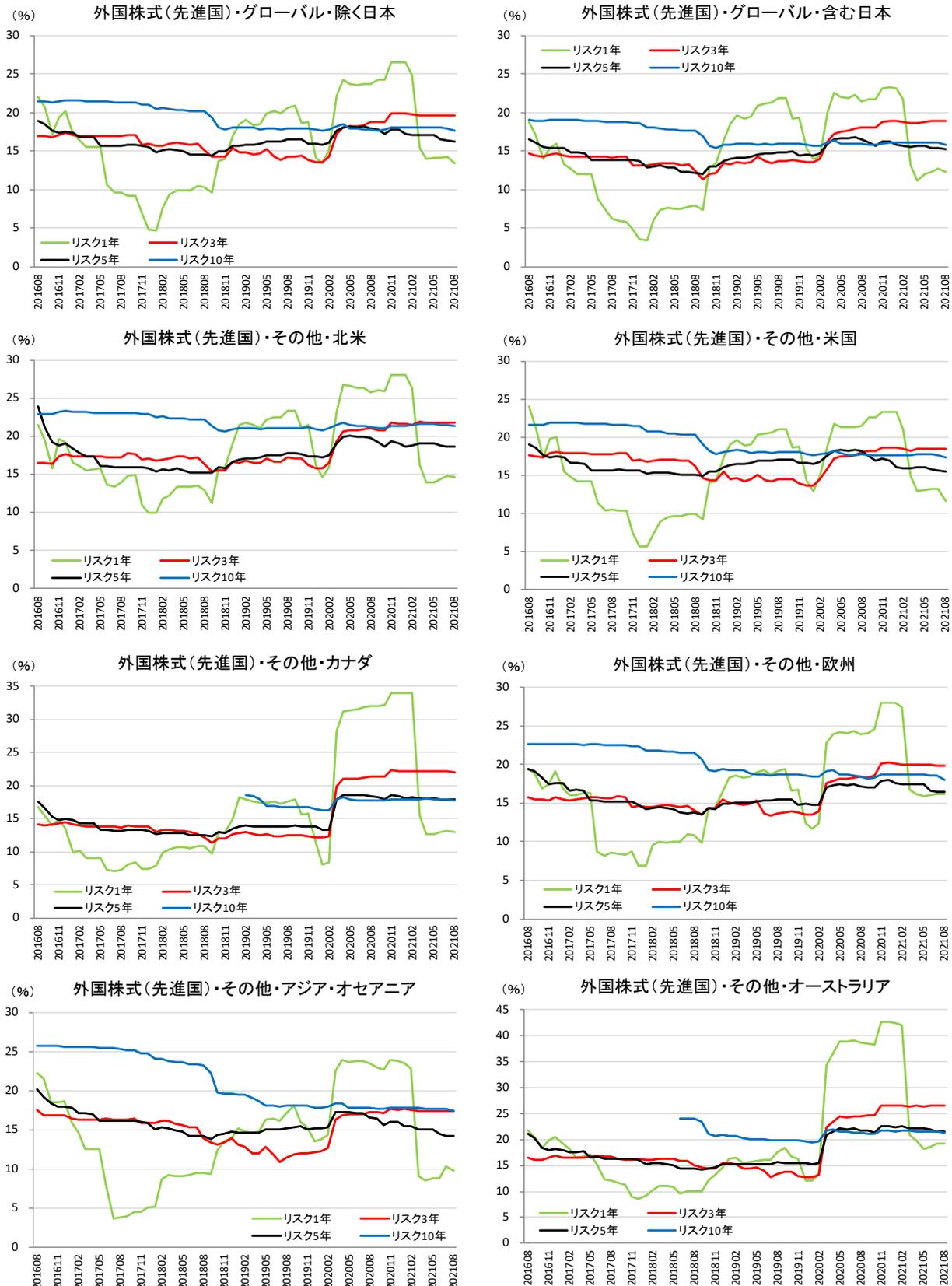


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

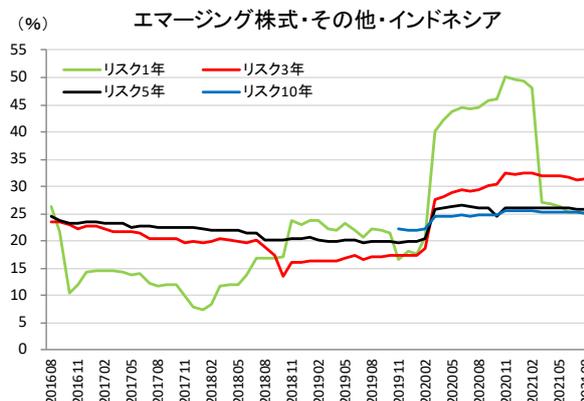
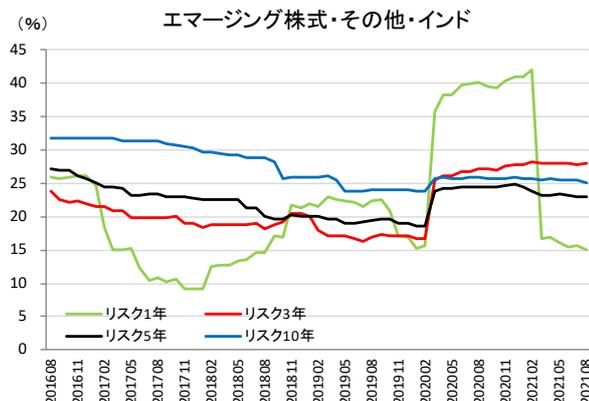
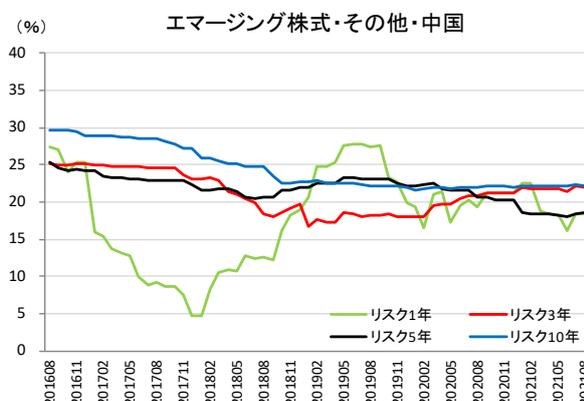
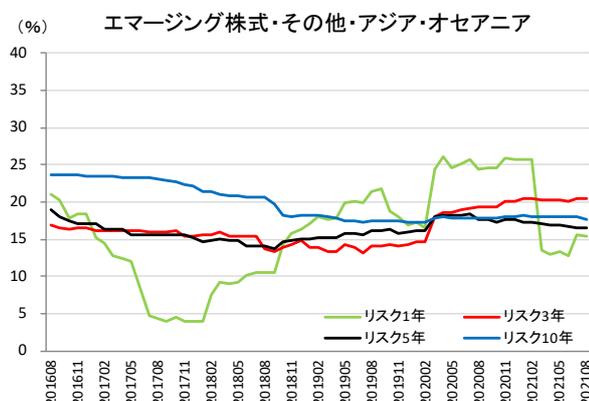
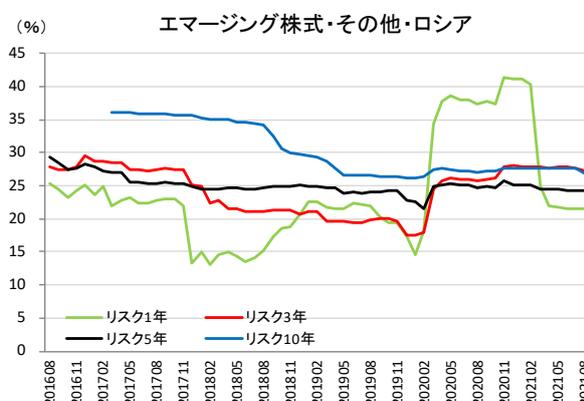
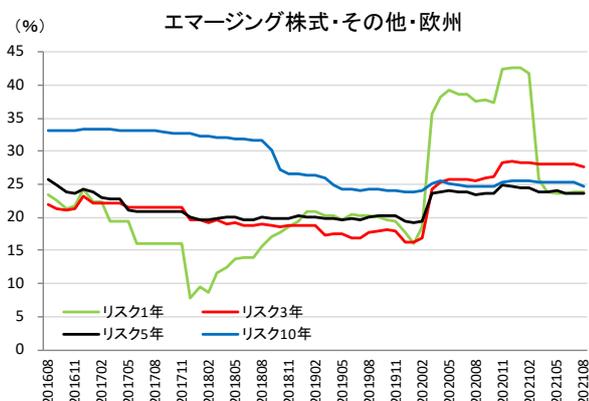
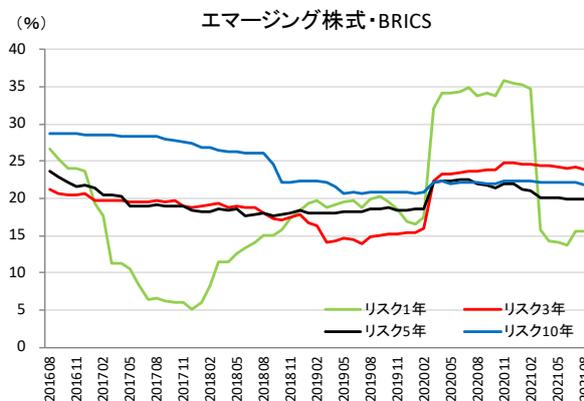
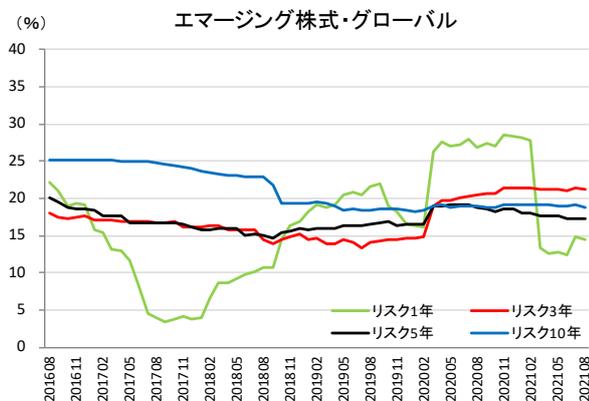


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

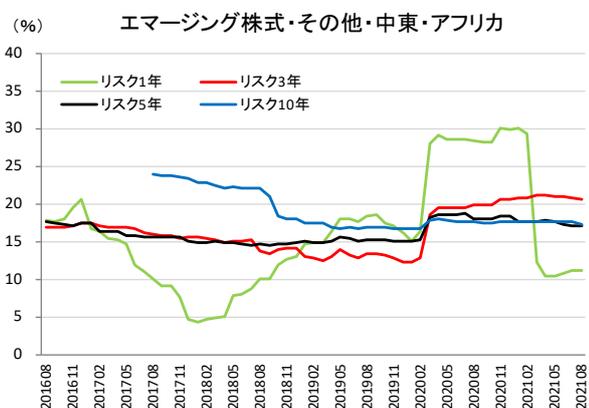
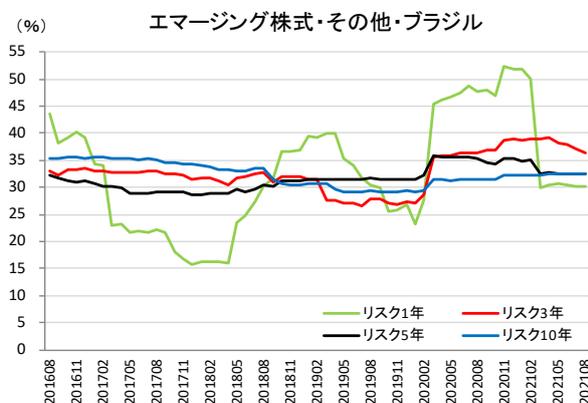
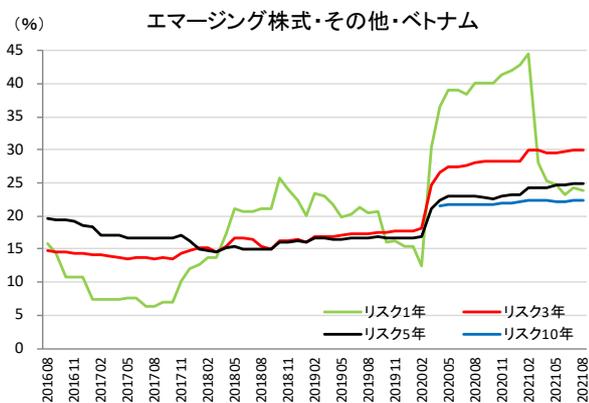
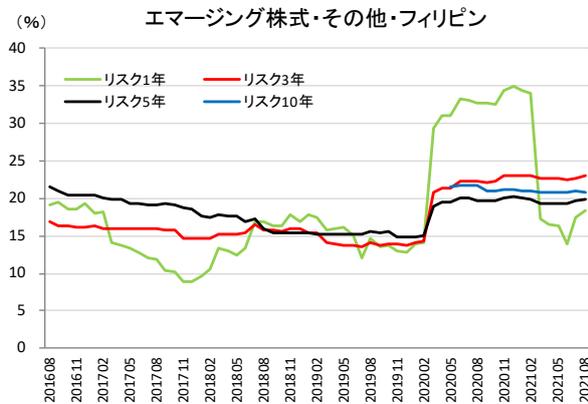
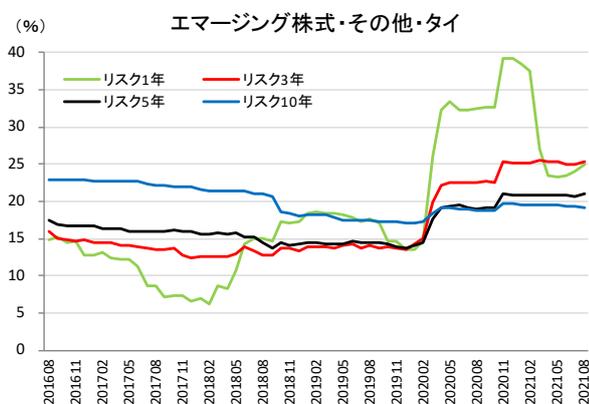


<2>リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

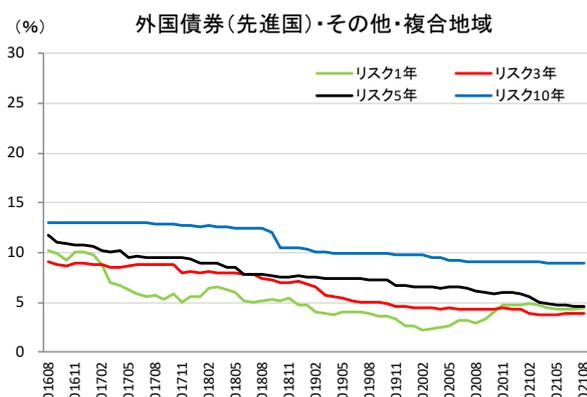
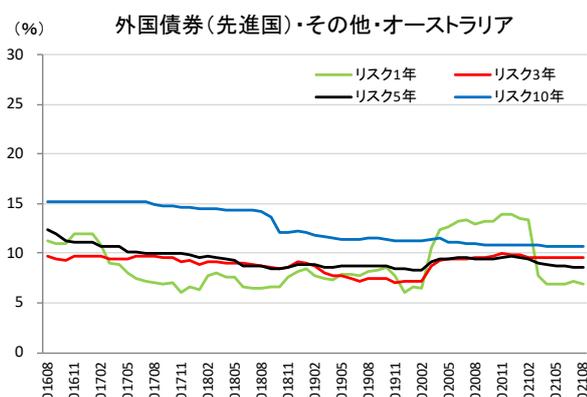
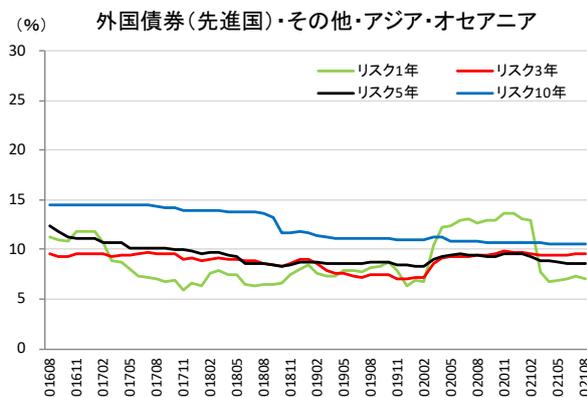
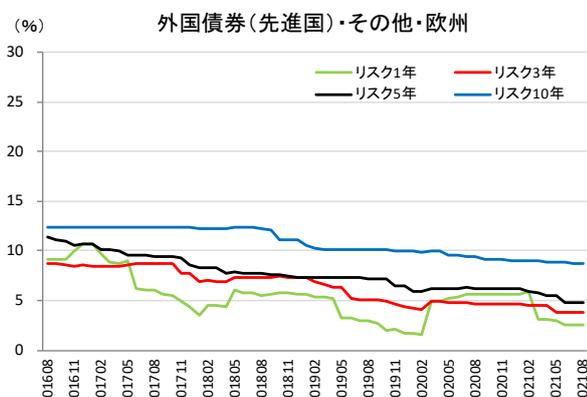
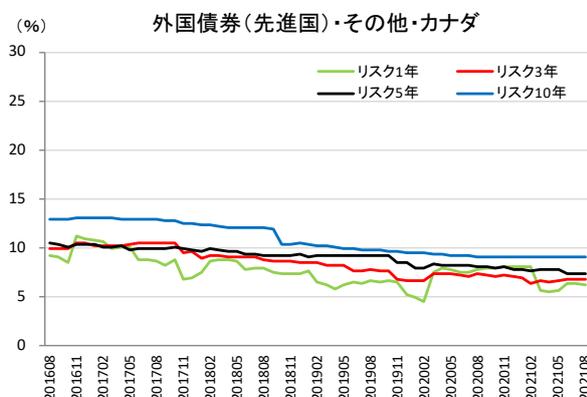
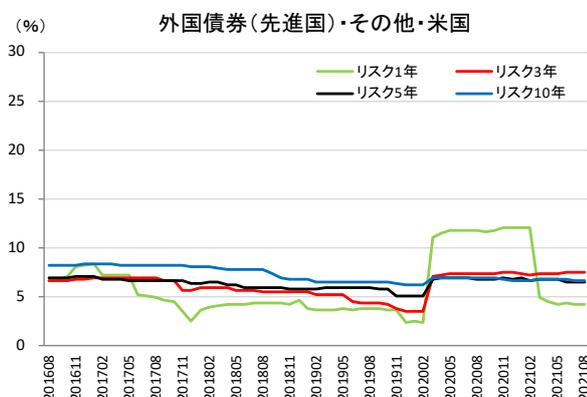
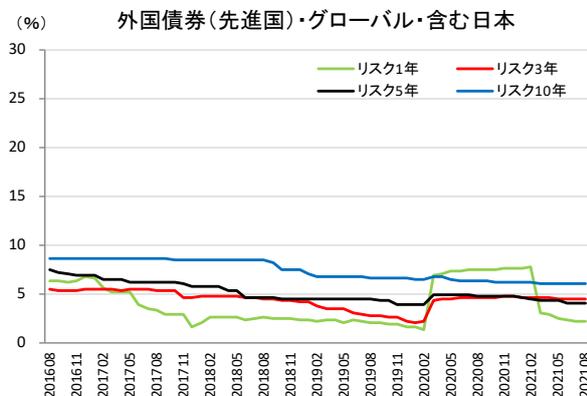
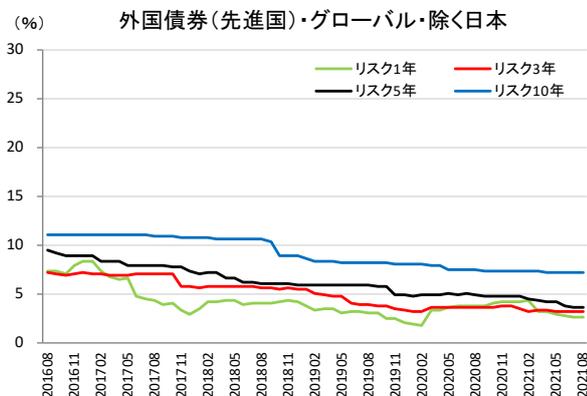


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

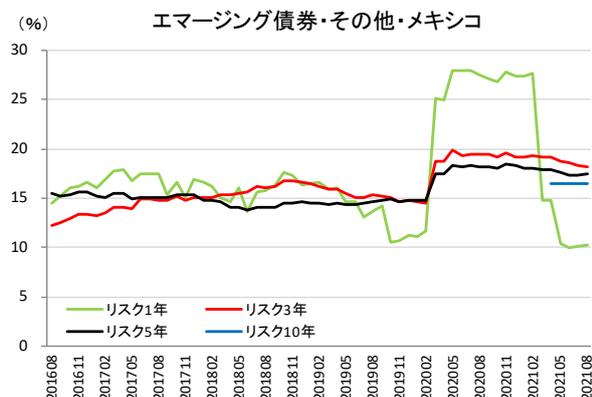
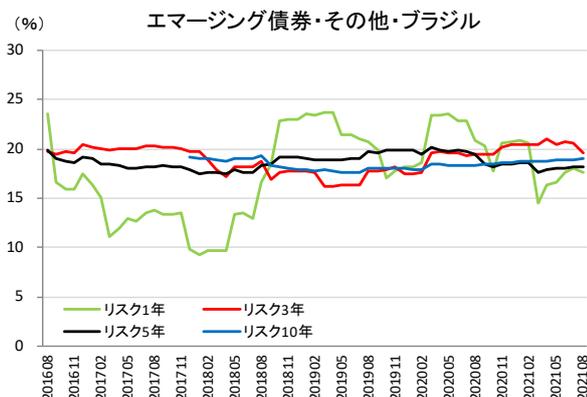
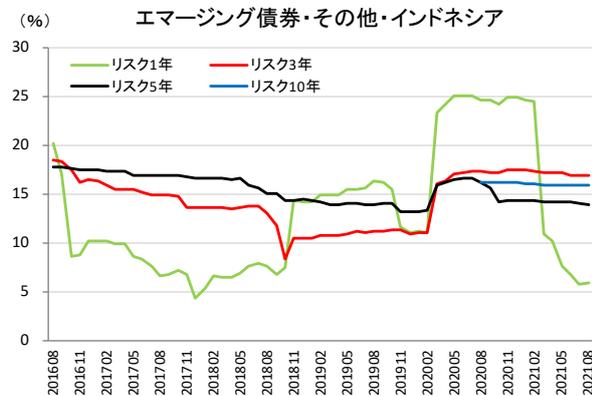
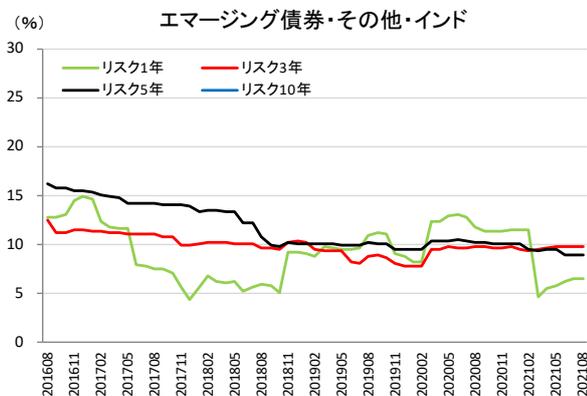
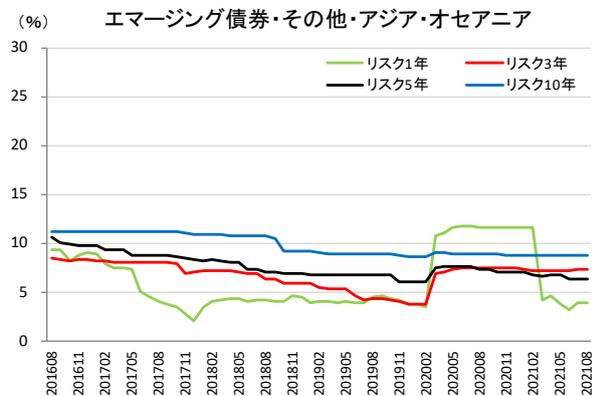
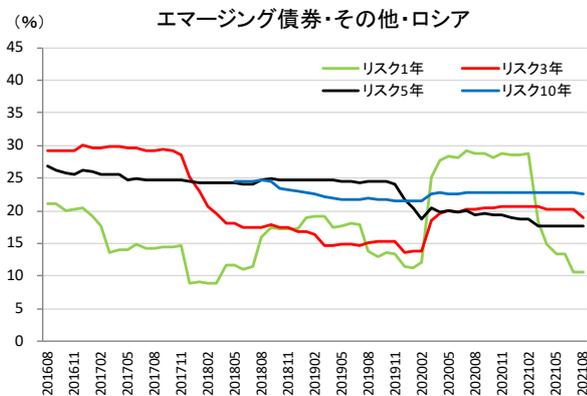
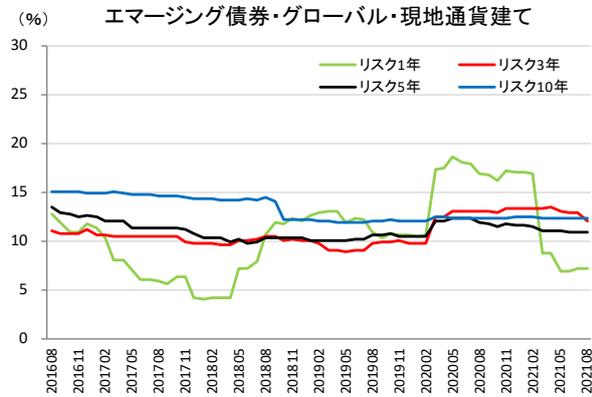
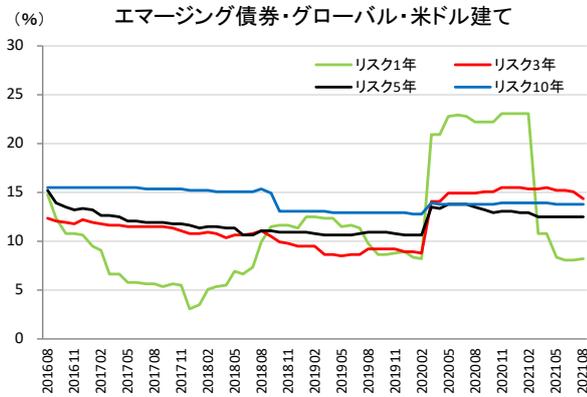


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

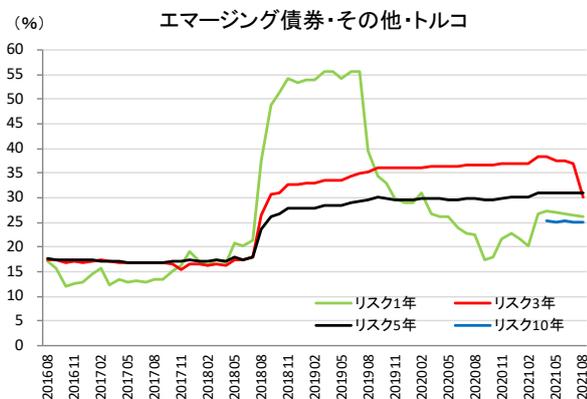


<2> リスク・サマリー

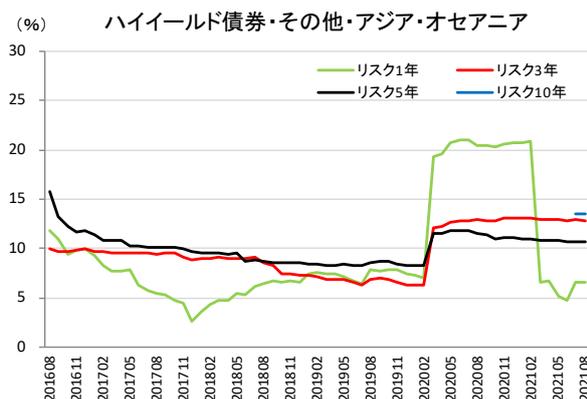
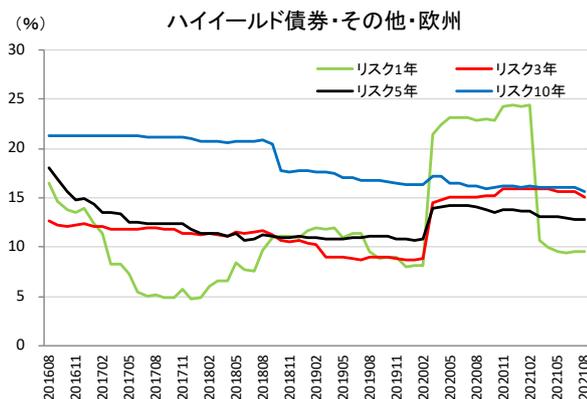
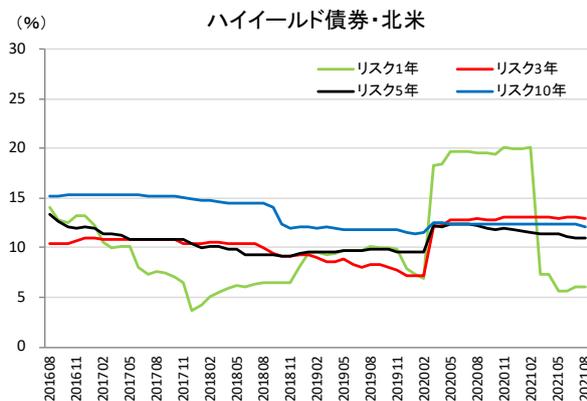
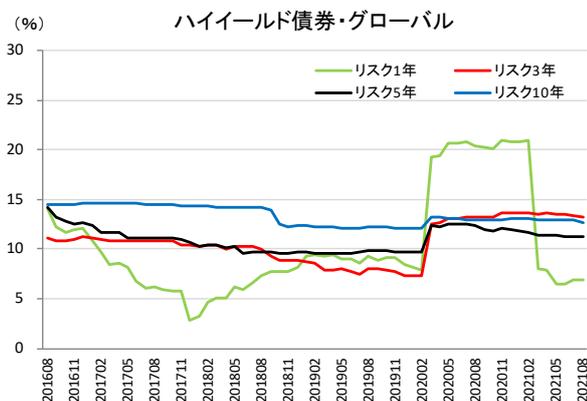
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

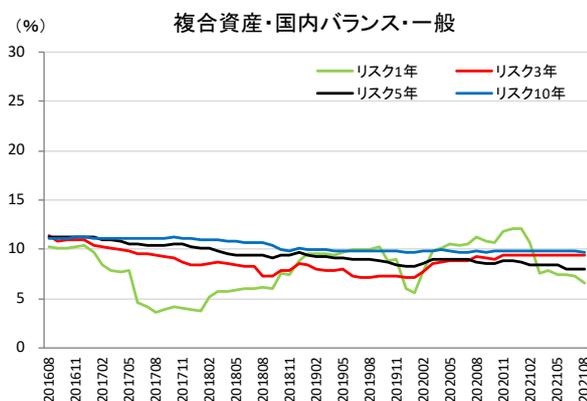
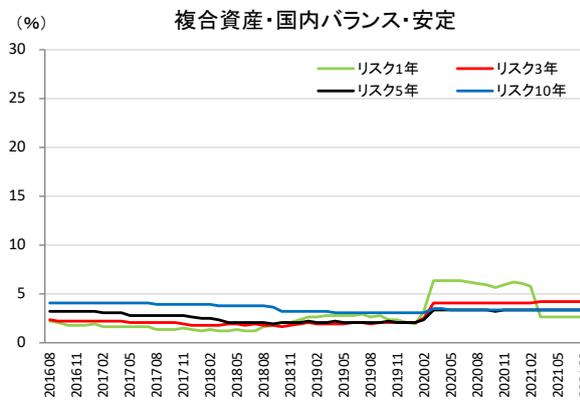
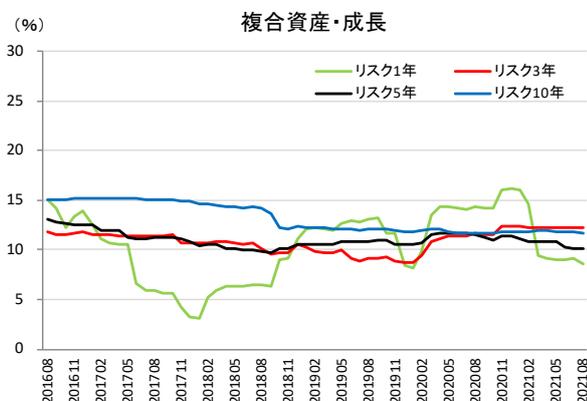
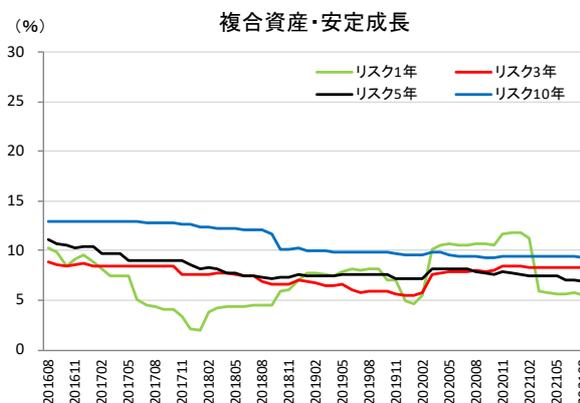
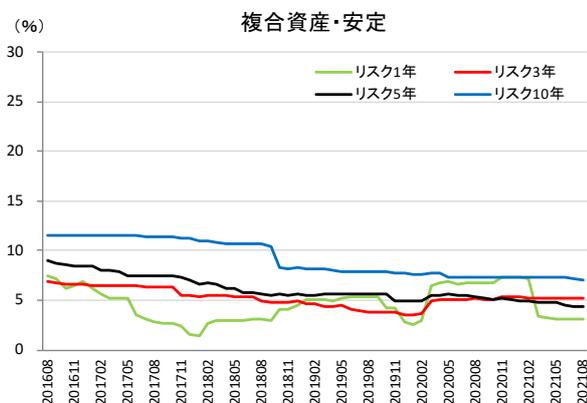


<2>リスク・サマリー

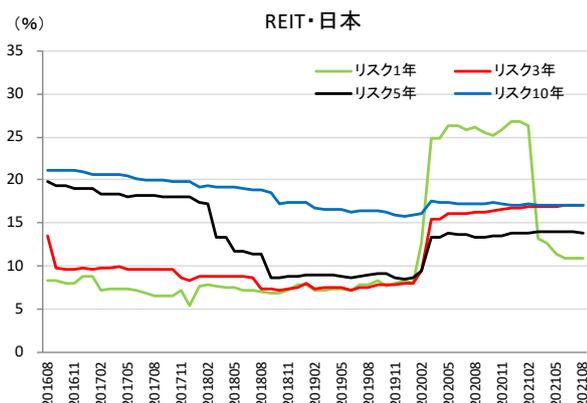
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

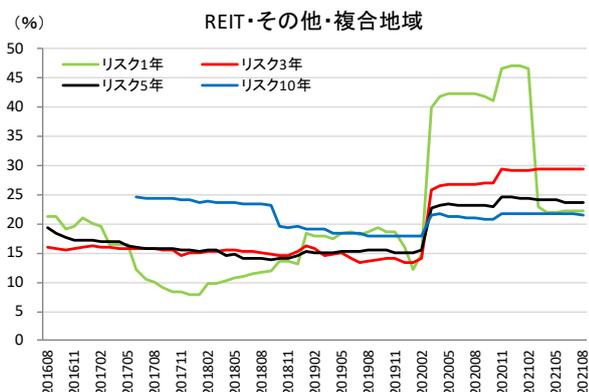
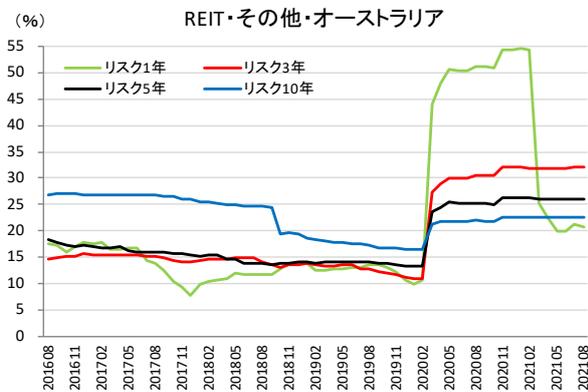
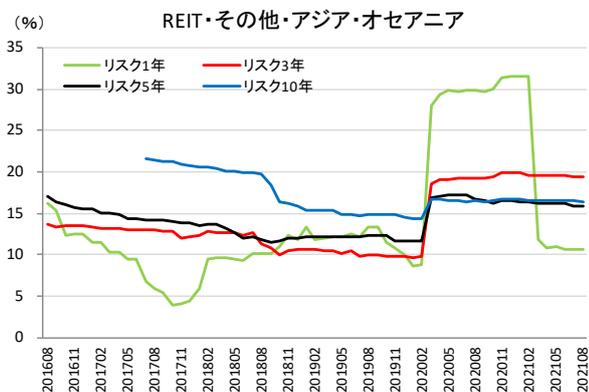
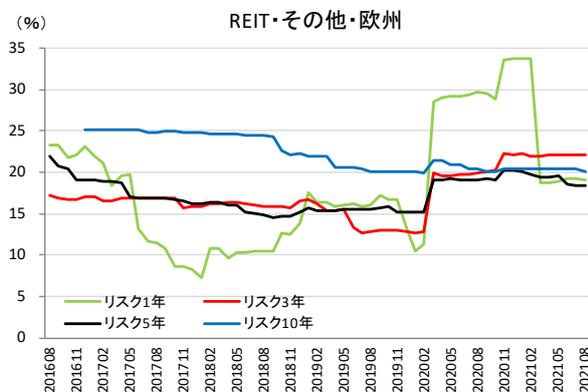
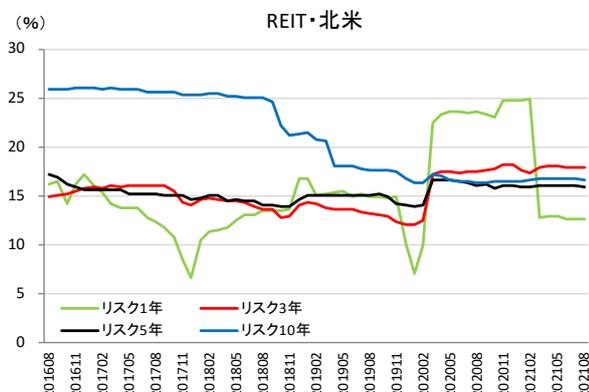
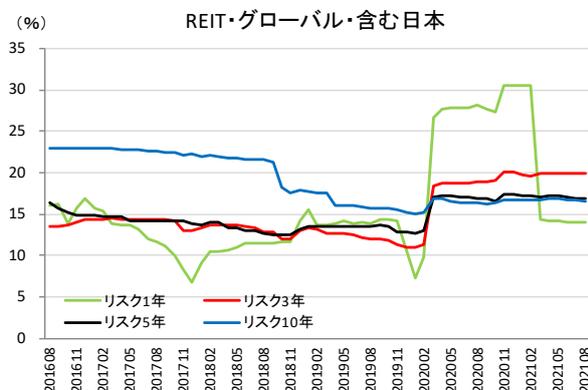
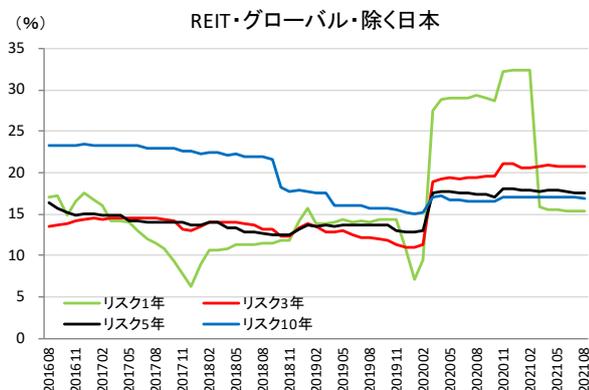


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

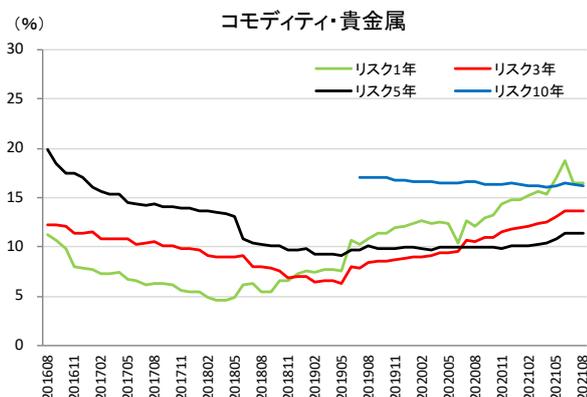
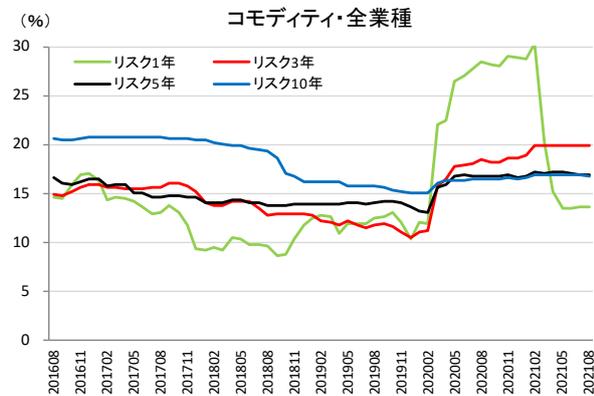
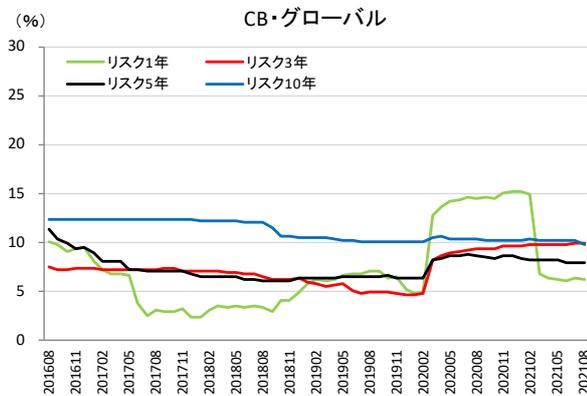
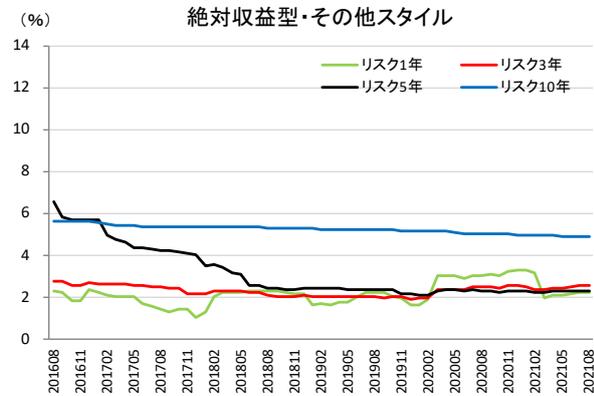
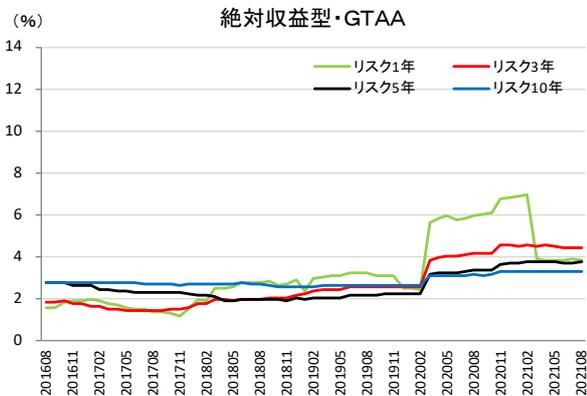
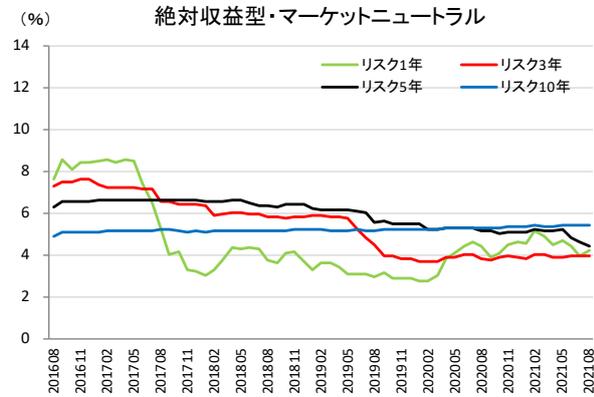
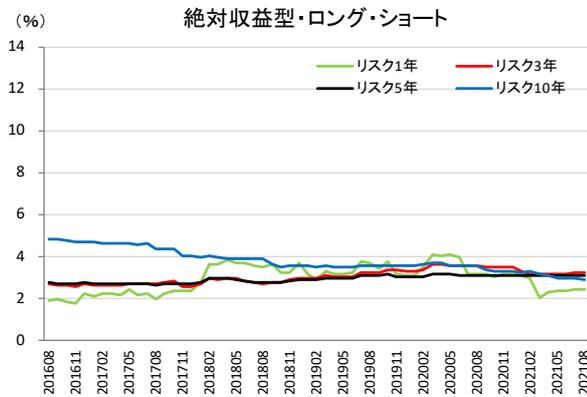


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	6,539	25,117	48,063	64,033
国内株式	163	1,663	1,602	-8,938
一般	-141	144	-902	-7,369
フリー	-136	141	-559	-6,097
バリュー	-5	3	-343	-1,272
小型	-21	-114	-245	-1,579
その他	317	1,636	2,742	145
日経225	181	1,392	2,535	391
TOPIX	109	158	96	-368
JPX日経400	0	21	27	-131
国内債券	528	2,152	4,384	4,415
一般	528	2,152	4,384	4,415
外国株式(先進国)	5,273	18,429	40,071	72,355
グローバル	2,871	10,937	28,639	52,640
除く日本	702	2,579	5,653	9,078
含む日本	2,169	8,358	22,986	43,562
その他	2,403	7,493	11,432	19,715
北米	2	-3	-18	-68
米国	2,429	7,540	11,923	20,837
カナダ	-5	-15	-32	-63
欧州	59	254	227	88
ドイツ	0	-2	-7	-13
イギリス	0	0	-1	-2
アジア・オセアニア	-1	0	-2	-10
オーストラリア	-80	-278	-656	-1,051
ニュージーランド	0	-1	1	0
複合地域	0	-1	-2	-2
エマージング株式	-235	-579	-1,167	-1,876
グローバル	43	208	326	99
BRICS	-4	-16	-36	-92
その他	-274	-771	-1,456	-1,884
欧州	-3	-7	-16	-30
ロシア	0	-10	-14	-22
アジア・オセアニア	-70	-222	-234	-2
中国	-110	-151	153	1,434
インド	-98	-378	-1,151	-2,701
インドネシア	-1	-2	-3	-19
タイ	0	9	6	0
フィリピン	0	-2	-6	-16
ベトナム	15	36	-135	-404
韓国	0	0	0	0
香港	2	2	1	1
台湾	0	1	4	5
中南米	-1	-2	-3	-8
ブラジル	-5	-37	-44	-66
メキシコ	-1	-1	-4	-3
中東・アフリカ	-2	-5	-9	-35
トルコ	0	0	-1	-15
複合地域	0	0	-1	-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	6,539	25,117	48,063	64,033
外国債券(先進国)	233	1,928	1,400	-693
グローバル	425	2,602	3,008	2,736
除く日本	131	435	-546	-1,652
含む日本	295	2,168	3,555	4,388
その他	-192	-675	-1,609	-3,429
北米	0	-1	1	-1
米国	-45	-174	-393	-709
カナダ	-14	-53	-127	-259
欧州	-12	-32	-103	-223
イギリス	0	0	-1	-6
アジア・オセアニア	-16	-67	-161	-357
オーストラリア	-89	-305	-739	-1,659
ニュージーランド	-1	-5	-11	-37
複合地域	-15	-33	-62	-151
グローバル	0	0	0	0
エマージング債券	-130	-515	-1,208	-2,667
グローバル	-37	-168	-432	-991
米ドル建て	-32	-149	-376	-862
現地通貨建て	-5	-19	-56	-129
その他	-93	-347	-776	-1,675
ロシア	-2	-8	-20	-43
アジア・オセアニア	-3	-12	-25	-53
インド	-49	-186	-437	-951
インドネシア	-8	-29	-53	-108
ブラジル	-16	-60	-135	-316
メキシコ	-5	-20	-46	-105
トルコ	-1	1	4	-6
複合地域	0	-1	-3	-7
ハイイールド債券	-113	-413	-1,061	-2,538
グローバル	3	-31	-125	-324
北米	-95	-311	-747	-1,695
その他	-20	-71	-189	-519
欧州	-18	-60	-170	-454
アジア・オセアニア	-2	-10	-17	-57
複合地域	0	-1	-2	-4
複合資産	867	2,673	4,391	3,480
安定	397	1,072	2,569	5,306
安定成長	374	1,353	2,087	1,461
成長	258	996	1,575	1,730
国内バランス	-67	-223	-478	-1,029
安定	-64	-218	-449	-932
一般	-4	-11	-31	-93
その他	-95	-526	-1,362	-3,988

<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	6,539	25,117	48,063	64,033
国内REIT	-184	-611	-816	191
日本	-184	-611	-816	191
外国REIT	-157	-499	-1,385	-2,253
グローバル	-101	-295	-761	-1,227
除く日本	-5	74	113	324
含む日本	-95	-369	-874	-1,551
北米	-23	-133	-484	-561
その他	-34	-71	-140	-465
欧州	-2	-4	-9	-25
アジア・オセアニア	-19	-19	-32	-273
オーストラリア	-10	-40	-78	-137
複合地域	0	2	3	6
複数国	-3	-9	-25	-36
その他	292	888	1,851	2,558
絶対収益型	244	529	969	1,496
ロング・ショート	-3	-8	-20	-61
マーケットニュートラル	-34	-51	-117	-123
GTAA	7	5	-11	-37
その他スタイル	272	576	1,098	1,695
CB	-28	-100	-186	-314
アジア・オセアニア	0	-1	-2	-3
日本	0	-2	-4	-10
グローバル	-27	-98	-181	-301
コモディティ	71	104	266	614
全業種	55	66	86	83
貴金属	20	59	241	687
エネルギー	-4	-22	-61	-156
その他コモディティ	0	0	0	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	822,852	100.00	5,408	100.00
国内株式	101,516	12.34	865	15.99
一般	57,105	6.94	555	10.26
フリー	44,742	5.44	446	8.25
バリュー	12,363	1.50	109	2.02
小型	7,726	0.94	95	1.76
その他	35,989	4.37	209	3.86
日経225	18,007	2.19	68	1.26
TOPIX	14,914	1.81	79	1.46
JPX日経400	680	0.08	19	0.35
国内債券	38,739	4.71	137	2.53
一般	38,739	4.71	137	2.53
外国株式(先進国)	324,155	39.39	1,095	20.25
グローバル	242,590	29.48	733	13.55
除く日本	53,531	6.51	178	3.29
含む日本	189,059	22.98	555	10.26
その他	81,565	9.91	362	6.69
北米	175	0.02	10	0.18
米国	75,068	9.12	257	4.75
カナダ	215	0.03	3	0.06
欧州	1,819	0.22	48	0.89
ドイツ	17	0.00	1	0.02
イギリス	10	0.00	3	0.06
アジア・オセアニア	61	0.01	6	0.11
オーストラリア	4,180	0.51	32	0.59
ニュージーランド	15	0.00	1	0.02
複合地域	5	0.00	1	0.02
エマージング株式	30,283	3.68	333	6.16
グローバル	9,193	1.12	99	1.83
BRICS	661	0.08	7	0.13
その他	20,429	2.48	227	4.20
欧州	166	0.02	6	0.11
ロシア	120	0.01	4	0.07
アジア・オセアニア	6,209	0.75	102	1.89
中国	3,195	0.39	30	0.55
インド	8,528	1.04	29	0.54
インドネシア	123	0.01	4	0.07
タイ	71	0.01	4	0.07
フィリピン	46	0.01	5	0.09
ベトナム	1,056	0.13	11	0.20
韓国	6	0.00	1	0.02
香港	13	0.00	1	0.02
台湾	8	0.00	1	0.02
中南米	61	0.01	2	0.04
ブラジル	648	0.08	16	0.30
メキシコ	17	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	98	0.01	5	0.09
トルコ	44	0.01	2	0.04
複合地域	20	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	822,852	100.00	5,408	100.00
外国債券(先進国)	80,670	9.80	797	14.74
グローバル	62,712	7.62	511	9.45
除く日本	30,514	3.71	223	4.12
含む日本	32,198	3.91	288	5.33
その他	17,958	2.18	286	5.29
北米	83	0.01	6	0.11
米国	5,478	0.67	162	3.00
カナダ	935	0.11	4	0.07
欧州	1,373	0.17	36	0.67
イギリス	22	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	1,827	0.22	11	0.20
オーストラリア	6,820	0.83	40	0.74
ニュージーランド	109	0.01	11	0.20
複合地域	1,307	0.16	7	0.13
グローバル	0	0.00	1	0.02
エマージング債券	12,602	1.53	277	5.12
グローバル	6,830	0.83	189	3.49
米ドル建て	5,226	0.64	146	2.70
現地通貨建て	1,605	0.20	43	0.80
その他	5,772	0.70	88	1.63
ロシア	104	0.01	5	0.09
アジア・オセアニア	331	0.04	9	0.17
インド	2,636	0.32	19	0.35
インドネシア	362	0.04	11	0.20
ブラジル	1,719	0.21	24	0.44
メキシコ	317	0.04	7	0.13
トルコ	86	0.01	4	0.07
複合地域	39	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	17,299	2.10	275	5.09
グローバル	2,805	0.34	52	0.96
北米	11,870	1.44	153	2.83
その他	2,624	0.32	70	1.29
欧州	2,032	0.25	40	0.74
アジア・オセアニア	550	0.07	25	0.46
複合地域	42	0.01	1	0.02
複合資産	122,251	14.86	992	18.34
安定	36,348	4.42	279	5.16
安定成長	53,435	6.49	408	7.54
成長	18,346	2.23	255	4.72
国内バランス	9,411	1.14	33	0.61
安定	8,957	1.09	9	0.17
一般	358	0.04	19	0.35
その他	4,711	0.57	17	0.31

<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	822,852	100.00		5,408	100.00
国内REIT	29,833	3.63		131	2.42
日本	29,833	3.63		131	2.42
外国REIT	47,282	5.75		287	5.31
グローバル	19,180	2.33		143	2.64
除く日本	5,504	0.67		55	1.02
含む日本	13,677	1.66		88	1.63
北米	24,171	2.94		84	1.55
その他	3,931	0.48		60	1.11
欧州	179	0.02		10	0.18
アジア・オセアニア	2,706	0.33		33	0.61
オーストラリア	698	0.08		13	0.24
複合地域	60	0.01		3	0.06
複数国	288	0.04		1	0.02
その他	18,221	2.21		219	4.05
絶対収益型	9,624	1.17		104	1.92
ロング・ショート	861	0.10		34	0.63
マーケットニュートラル	779	0.09		16	0.30
GTAA	394	0.05		12	0.22
その他スタイル	7,527	0.91		41	0.76
CB	1,453	0.18		34	0.63
アジア・オセアニア	36	0.00		1	0.02
日本	40	0.00		3	0.06
グローバル	1,376	0.17		30	0.55
コモディティ	3,681	0.45		33	0.61
全業種	1,305	0.16		13	0.24
貴金属	2,275	0.28		18	0.33
エネルギー	86	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	13,702	9.2	4.13	3.84	1.269
国内株式	17,708	12.4	1.47	1.29	1.099
一般	16,174	12.2	1.98	1.76	1.412
フリー	15,955	11.6	2.21	1.98	1.459
バリュー	17,067	14.5	1.15	0.98	1.241
小型	25,647	12.6	1.69	1.45	1.707
その他	18,167	12.7	0.45	0.37	0.461
日経225	19,707	14.5	0.53	0.44	0.549
TOPIX	18,854	14.1	0.17	0.14	0.281
JPX日経400	16,627	7.0	0.50	0.42	0.521
国内債券	10,983	11.2	0.23	0.23	0.386
一般	10,983	11.2	0.23	0.23	0.386
外国株式(先進国)	16,618	6.9	5.50	5.18	1.490
グローバル	17,399	6.9	4.28	4.10	1.515
除く日本	22,459	9.5	1.04	0.85	0.671
含む日本	15,776	6.1	5.27	5.06	1.753
その他	15,038	6.9	8.97	8.33	1.419
北米	15,413	7.3	11.89	10.41	1.759
米国	16,277	6.2	8.72	8.11	1.388
カナダ	8,116	9.5	8.87	7.58	1.992
欧州	14,014	10.2	5.42	4.61	1.662
ドイツ	13,612	7.4	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,178	5.1	13.03	11.67	1.895
アジア・オセアニア	9,464	7.2	9.36	8.58	1.680
オーストラリア	9,158	7.1	14.83	13.75	1.825
ニュージーランド	17,518	9.1	2.66	2.28	1.672
複合地域	7,068	8.3	0.00	0.00	1.705
エマージング株式	14,334	9.7	3.72	3.45	1.720
グローバル	13,540	7.4	0.83	0.68	1.225
BRICS	17,436	15.3	0.97	0.83	2.069
その他	14,585	10.6	5.13	4.77	1.932
欧州	11,253	15.2	0.47	0.36	1.964
ロシア	12,792	12.3	4.75	4.02	2.003
アジア・オセアニア	15,453	11.1	6.31	6.15	1.746
中国	18,795	8.3	3.93	5.86	1.940
インド	16,217	11.6	4.87	3.56	2.069
インドネシア	10,347	11.4	0.44	0.34	1.860
タイ	9,888	13.3	2.29	2.08	1.710
フィリピン	9,757	8.0	0.28	0.23	1.780
ベトナム	15,734	5.1	3.23	2.13	1.901
韓国	16,367	2.7	0.00	0.00	1.804
香港	14,401	12.0	1.59	1.53	0.858
台湾	13,218	8.8	27.68	24.97	1.661
中南米	7,926	14.6	0.00	0.00	2.040
ブラジル	5,302	10.7	9.00	9.69	1.930
メキシコ	8,969	8.5	0.00	0.00	1.919
中東・アフリカ	11,702	10.1	6.69	5.41	2.064
トルコ	7,275	20.1	0.00	0.00	2.038
複合地域	21,632	13.3	2.54	2.13	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	13,702	9.2	4.13	3.84	1.269
外国債券(先進国)	10,207	9.5	1.95	1.94	1.037
グローバル	10,865	9.6	1.40	1.42	0.965
除く日本	11,813	11.8	1.25	1.27	0.754
含む日本	10,132	7.8	1.55	1.57	1.166
その他	9,030	9.5	3.80	3.72	1.289
北米	10,677	7.3	2.25	2.22	1.786
米国	9,502	8.6	5.07	4.64	1.335
カナダ	6,996	10.6	1.91	1.83	1.378
欧州	8,694	11.0	1.39	1.35	1.094
イギリス	8,096	6.5	3.04	2.91	1.349
アジア・オセアニア	8,362	10.9	3.05	3.07	1.418
オーストラリア	8,254	12.3	4.08	4.21	1.257
ニュージーランド	9,655	7.1	1.78	1.80	1.364
複合地域	4,796	12.1	2.42	2.42	1.188
グローバル	9,152	5.8	1.20	1.09	1.474
エマージング債券	8,832	9.9	5.40	5.36	1.552
グローバル	9,280	10.5	4.42	4.35	1.492
米ドル建て	9,492	10.8	4.50	4.37	1.580
現地通貨建て	8,560	9.4	4.18	4.28	1.207
その他	7,868	8.7	6.56	6.56	1.622
ロシア	7,911	8.5	6.84	7.10	1.602
アジア・オセアニア	9,576	9.3	6.38	6.66	1.638
インド	9,048	7.0	7.05	6.93	1.700
インドネシア	7,322	9.0	7.18	6.73	1.664
ブラジル	6,833	11.7	6.12	6.32	1.588
メキシコ	6,668	8.5	6.56	6.31	1.404
トルコ	2,704	8.5	8.85	10.61	1.456
複合地域	3,832	15.0	3.19	3.13	1.210
ハイイールド債券	9,215	10.2	6.78	6.45	1.683
グローバル	8,157	9.4	4.69	4.40	1.551
北米	10,257	11.3	6.57	6.13	1.694
その他	7,726	8.5	9.95	10.09	1.775
欧州	7,417	8.4	10.13	10.30	1.744
アジア・オセアニア	8,024	9.4	9.62	9.70	1.886
複合地域	4,587	17.4	5.46	5.23	1.800
複合資産	13,264	8.7	1.50	1.42	1.019
安定	11,907	8.4	0.92	0.88	1.144
安定成長	12,944	9.2	2.02	1.91	1.037
成長	15,463	8.6	0.62	0.55	0.810
国内バランス	12,067	9.1	2.37	2.34	0.938
安定	10,972	10.1	2.37	2.35	0.919
一般	12,770	9.9	2.08	1.89	1.330
その他	12,571	1.6	1.76	1.45	0.832

(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	13,702	9.2	4.13	3.84	1.269
国内REIT	15,230	9.0	9.75	9.10	0.938
日本	15,230	9.0	9.75	9.10	0.938
外国REIT	12,340	8.2	11.11	9.36	1.520
グローバル	13,482	8.3	7.09	5.87	1.336
除く日本	15,299	6.4	6.82	6.27	1.041
含む日本	12,347	9.5	7.20	5.70	1.455
北米	11,664	8.4	14.69	12.33	1.626
その他	10,565	7.4	8.51	7.94	1.768
欧州	8,483	7.6	4.80	4.19	1.822
アジア・オセアニア	11,820	7.2	10.33	9.89	1.813
オーストラリア	9,888	6.7	5.37	4.33	1.711
複合地域	6,429	9.6	1.31	0.98	0.803
複数国	11,212	17.3	2.85	2.14	1.650
その他					
絶対収益型	10,824	5.7	0.19	0.19	1.730
ロング・ショート	11,115	4.8	0.35	0.34	1.473
マーケットニュートラル	10,470	5.7	1.09	1.11	1.310
GTAA	11,596	7.8	1.44	1.39	1.535
その他スタイル	10,466	6.0	0.01	0.00	1.816
CB	12,887	8.6	6.88	7.09	1.380
アジア・オセアニア	9,848	11.2	2.88	2.44	1.823
日本	11,200	10.3	0.28	0.28	0.970
グローバル	13,157	8.3	7.18	7.41	1.380
コモディティ	9,846	6.3	0.13	0.10	0.953
全業種	7,317	9.7	0.37	0.28	1.351
貴金属	11,506	3.5	0.00	0.00	0.723
エネルギー	10,320	12.5	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	12,364	4.9	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 川真田 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