

投信指数 MAB-FPI

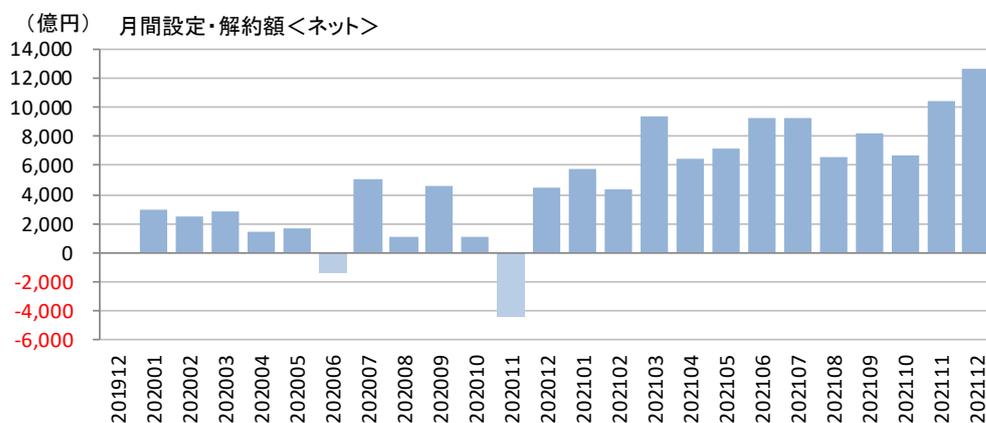
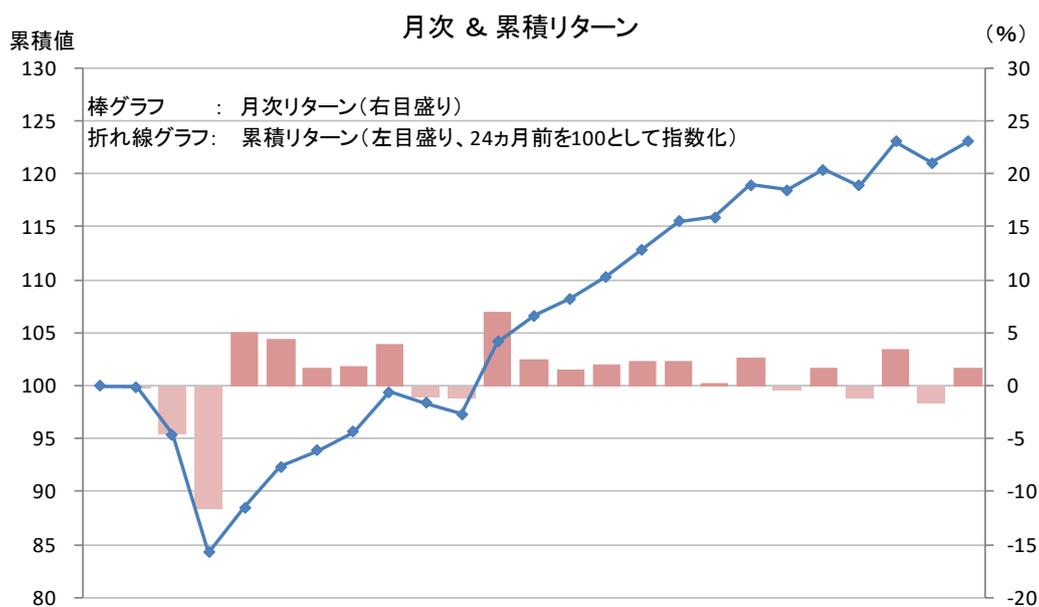
パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2021年12月

「総合」 +1.69 %

(前月 -1.64 %)



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		16,754	16,475	279	1.69	
国内株式		20,532	20,012	520	2.60	
一般		20,037	19,574	463	2.36	
フリー		19,058	18,700	358	1.92	
バリュー		24,655	23,700	956	4.03	
小型		44,369	44,641	-272	-0.61	
その他		19,961	19,263	698	3.62	
日経225		19,351	18,675	676	3.62	
TOPIX		19,326	18,678	648	3.47	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	18,329	17,710	620	3.50	
国内債券		13,236	13,254	-18	-0.13	
一般		13,236	13,254	-18	-0.13	
外国株式(先進国)		23,017	22,782	235	1.03	
グローバル		25,209	25,096	113	0.45	
除く日本		35,565	34,327	1,238	3.61	
含む日本		22,941	23,053	-112	-0.49	
その他		18,485	18,021	464	2.58	
北米		18,762	17,940	822	4.58	
米国		28,901	28,231	670	2.37	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	20,954	20,789	164	0.79	
欧州		24,809	23,581	1,229	5.21	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	11,252	10,675	576	5.40	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	9,752	9,149	604	6.60	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	40,073	39,359	714	1.81	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	18,428	17,340	1,087	6.27	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	45,865	44,021	1,844	4.19	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	9,329	9,128	201	2.20	
エマージング株式		19,048	18,841	206	1.10	
グローバル		19,017	18,724	294	1.57	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	27,167	27,310	-144	-0.53	
その他		19,784	19,602	182	0.93	
欧州		28,610	28,139	471	1.67	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	13,341	13,431	-89	-0.67	
アジア・オセアニア		19,300	19,105	196	1.02	
中国		47,194	48,799	-1,605	-3.29	
インド	10,000 (2004.09.30)	46,969	45,808	1,161	2.53	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	14,003	13,939	64	0.46	
タイ		20,780	19,814	965	4.87	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,001	7,882	119	1.51	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	23,948	24,119	-171	-0.71	
韓国	10,000 (1997.06.30)	35,578	34,296	1,283	3.74	
香港		21,171	21,627	-457	-2.11	
台湾	10,000 (2008.03.31)	30,172	27,915	2,257	8.08	
中南米	7,427 (2006.04.28)	7,575	7,309	266	3.64	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	6,778	6,815	-37	-0.55	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	10,754	9,491	1,263	13.31	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	12,636	12,192	444	3.64	
トルコ		19,285	18,059	1,225	6.79	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	26,510	25,964	546	2.10	

※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		16,754	16,475	279	1.69
外国債券(先進国)		19,044	18,847	197	1.04
グローバル		19,228	19,099	128	0.67
除く日本		20,757	20,612	145	0.70
含む日本		18,293	18,176	117	0.64
その他		18,569	18,118	451	2.49
北米	9,052 (2013.05.31)	11,262	11,185	77	0.69
米国		17,741	17,391	350	2.01
カナダ	10,000 (2003.05.30)	15,400	15,204	196	1.29
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,455	15,390	65	0.42
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,573	10,364	209	2.01
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	20,221	19,610	611	3.12
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	24,989	24,200	789	3.26
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,417	11,164	253	2.26
複合地域	10,000 (2001.11.30)	18,626	18,109	517	2.86
エマージング債券		17,106	16,735	371	2.22
グローバル		18,408	17,971	437	2.43
米ドル建て		19,075	18,643	432	2.32
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,614	12,270	344	2.80
その他	8,647 (2005.03.31)	12,667	12,423	243	1.96
ロシア	10,000 (2008.05.30)	10,997	10,559	438	4.15
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	14,851	14,631	220	1.50
インド	10,000 (2011.08.31)	18,135	17,830	304	1.71
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	15,918	15,719	199	1.27
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	9,847	9,688	159	1.64
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	12,834	11,950	884	7.40
トルコ	10,000 (2011.04.28)	3,003	3,077	-74	-2.41
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,813	10,532	282	2.67
ハイイールド債券		24,132	23,510	622	2.64
グローバル	10,000 (1997.06.30)	23,489	22,958	531	2.31
北米		24,069	23,429	640	2.73
その他	10,000 (2004.03.31)	22,365	21,799	566	2.60
欧州	10,000 (2006.04.28)	22,600	21,955	645	2.94
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	13,981	13,803	178	1.29
複合地域	10,000 (2004.03.31)	22,212	21,652	559	2.58
複合資産		19,622	19,300	322	1.67
安定	10,000 (1998.10.30)	16,701	16,558	143	0.86
安定成長		21,391	20,988	403	1.92
成長		25,824	25,189	635	2.52
国内バランス		12,955	12,847	108	0.84
安定		13,186	13,081	105	0.80
一般		16,459	16,220	239	1.47
その他	10,000 (2018.10.31)	15,875	15,383	493	3.20

※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		16,754	16,475	279	1.69	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	36,171	35,041	1,130	3.23	
日本	10,000 (2003.10.31)	36,171	35,041	1,130	3.23	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	35,340	33,216	2,124	6.39	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	29,571	27,925	1,646	5.89	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	33,297	31,316	1,981	6.33	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	29,249	27,670	1,580	5.71	
北米	10,000 (2003.09.30)	37,196	34,737	2,459	7.08	
その他	10,000 (2004.04.30)	31,095	29,765	1,330	4.47	
欧州	10,000 (2006.12.29)	6,036	5,882	154	2.62	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	22,457	21,748	709	3.26	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	18,379	16,879	1,500	8.89	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,144	6,697	447	6.68	
複数国	10,000 (2004.04.30)	47,548	44,939	2,609	5.81	
その他		6,900	6,788	112	1.65	
絶対収益型		8,097	8,065	32	0.39	
ロング・ショート		8,714	8,642	72	0.84	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	12,273	12,592	-318	-2.53	
GTAA		12,081	11,900	181	1.52	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,625	7,585	40	0.53	
CB		21,935	22,067	-132	-0.60	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	20,212	19,840	373	1.88	
日本		20,252	20,056	196	0.98	
グローバル		38,546	38,826	-280	-0.72	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	9,865	9,670	195	2.02	
全業種	10,000 (2004.12.30)	8,516	8,264	252	3.05	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	17,836	17,630	206	1.17	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	6,341	5,801	540	9.31	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	12,032	11,726	306	2.61	

※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	3.50	3.48	15.43	15.43
国内株式	-1.99	2.49	10.24	10.24
一般	-1.90	3.13	11.12	11.12
フリー	-2.16	3.12	10.17	10.17
バリュー	-0.94	3.21	14.67	14.67
小型	-4.57	-0.78	6.61	6.61
その他	-1.70	2.04	9.55	9.55
日経225	-2.20	0.55	5.97	5.97
TOPIX	-1.75	3.41	12.48	12.48
JPX日経400	-1.49	3.67	11.95	11.95
国内債券	-0.03	0.04	-0.02	-0.02
一般	-0.03	0.04	-0.02	-0.02
外国株式(先進国)	6.25	4.86	22.45	22.45
グローバル	4.84	2.68	19.06	19.06
除く日本	9.52	10.32	34.00	34.00
含む日本	3.47	0.55	15.17	15.17
その他	10.15	11.28	32.97	32.97
北米	10.60	12.59	41.04	41.04
米国	10.43	11.78	33.93	33.93
カナダ	4.33	3.67	23.14	23.14
欧州	7.74	5.71	24.18	24.18
ドイツ	3.49	-0.29	16.54	16.54
イギリス	7.38	5.64	23.34	23.34
アジア・オセアニア	1.47	-2.10	9.30	9.30
オーストラリア	6.03	5.32	20.99	20.99
ニュージーランド	1.37	3.97	5.54	5.54
複合地域	8.51	13.89	68.10	68.10
エマーGING株式	1.91	-0.54	16.56	16.56
グローバル	1.51	-4.80	10.86	10.86
BRICS	-5.51	-9.45	6.27	6.27
その他	2.33	1.73	19.54	19.54
欧州	-4.27	1.63	19.57	19.57
ロシア	-5.39	1.33	24.99	24.99
アジア・オセアニア	3.96	-3.73	9.12	9.12
中国	1.43	-12.32	-0.88	-0.88
インド	1.38	14.13	39.39	39.39
インドネシア	10.49	17.91	12.44	12.44
タイ	2.60	1.79	7.60	7.60
フィリピン	8.52	5.66	9.69	9.69
ベトナム	10.32	9.55	52.56	52.56
韓国	0.02	-6.15	9.29	9.29
香港	-3.96	-16.99	-2.47	-2.47
台湾	16.62	15.42	45.89	45.89
中南米	-3.93	-18.26	-5.15	-5.15
ブラジル	-10.33	-27.22	-16.15	-16.15
メキシコ	6.73	7.24	26.46	26.46
中東・アフリカ	6.71	11.22	36.59	36.59
トルコ	-1.64	0.48	-10.60	-10.60
複合地域	5.41	2.30	20.28	20.28

※[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	3.50	3.48	15.43	15.43
外国債券(先進国)	1.01	0.56	2.83	2.83
グローバル	0.61	0.47	1.88	1.88
除く日本	0.98	0.60	1.98	1.98
含む日本	0.26	0.36	1.79	1.79
その他	2.50	0.98	5.88	5.88
北米	0.45	0.83	2.90	2.90
米国	3.58	4.86	14.57	14.57
カナダ	1.98	0.11	7.97	7.97
欧州	0.49	-0.49	-1.91	-1.91
イギリス	2.48	0.21	8.01	8.01
アジア・オセアニア	2.05	-1.00	2.45	2.45
オーストラリア	2.43	-0.76	2.75	2.75
ニュージーランド	-0.05	-2.23	-2.39	-2.39
複合地域	1.61	-0.54	1.01	1.01
エマージング債券	-0.26	-1.99	3.01	3.01
グローバル	-1.27	-2.79	1.09	1.09
米ドル建て	-1.56	-2.86	1.51	1.51
現地通貨建て	-0.32	-2.60	-0.27	-0.27
その他	0.99	-0.96	5.33	5.33
ロシア	0.58	2.17	8.75	8.75
アジア・オセアニア	-0.14	-1.07	1.45	1.45
インド	2.99	5.19	12.25	12.25
インドネシア	3.26	8.68	12.32	12.32
ブラジル	-1.53	-11.27	-3.85	-3.85
メキシコ	2.50	-0.96	1.06	1.06
トルコ	-31.26	-30.28	-39.54	-39.54
複合地域	1.96	0.93	1.57	1.57
ハイイールド債券	1.47	1.90	12.33	12.33
グローバル	0.30	-1.08	7.25	7.25
北米	2.57	3.90	15.90	15.90
その他	-2.42	-3.94	2.37	2.37
欧州	-1.96	-2.92	3.31	3.31
アジア・オセアニア	-4.41	-8.00	-1.51	-1.51
複合地域	1.08	1.70	8.49	8.49
複合資産	1.98	2.49	8.98	8.98
安定	1.08	1.37	4.61	4.61
安定成長	2.49	2.93	10.54	10.54
成長	2.92	4.40	15.34	15.34
国内バランス	-0.58	-0.52	2.31	2.31
安定	-0.56	-0.57	2.03	2.03
一般	-0.64	0.76	7.57	7.57
その他	4.66	4.45	16.06	16.06

※[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	3.50	3.48	15.43	15.43
国内REIT	0.02	-3.19	18.76	18.76
日本	0.02	-3.19	18.76	18.76
外国REIT	13.84	15.93	46.47	46.47
グローバル	12.43	13.79	41.35	41.35
除く日本	13.45	15.55	44.38	44.38
含む日本	12.01	13.08	40.17	40.17
北米	15.93	19.29	56.28	56.28
その他	7.70	6.18	18.59	18.59
欧州	3.05	1.37	13.44	13.44
アジア・オセアニア	6.42	4.03	14.37	14.37
オーストラリア	12.59	13.23	26.79	26.79
複合地域	7.11	6.63	21.63	21.63
複数国	10.69	12.57	46.17	46.17
その他	3.08	4.17	8.87	8.87
絶対収益型	1.11	1.42	3.19	3.19
ロング・ショート	0.99	0.35	0.28	0.28
マーケットニュートラル	0.16	1.45	-1.48	-1.48
GTAA	2.54	2.62	6.79	6.79
その他スタイル	1.13	1.51	4.00	4.00
CB	-0.62	-1.59	5.08	5.08
アジア・オセアニア	3.29	-1.44	18.44	18.44
日本	-1.22	0.15	0.29	0.29
グローバル	-0.72	-1.66	4.92	4.92
コモディティ	4.93	7.08	14.85	14.85
全業種	4.99	13.07	47.37	47.37
貴金属	4.82	3.41	-1.85	-1.85
エネルギー	7.76	15.57	80.14	80.14
その他コモディティ	4.39	9.32	34.28	34.28

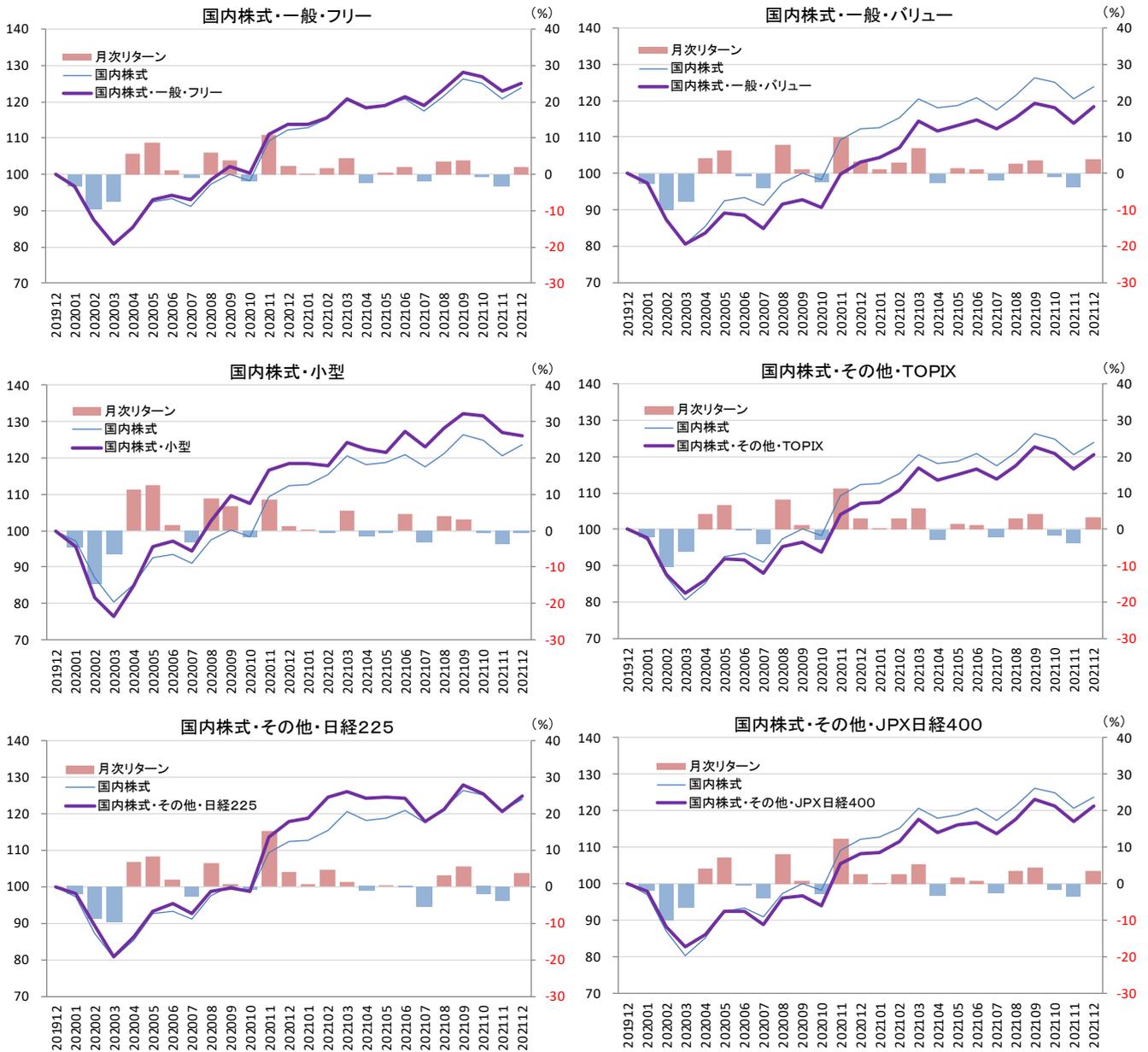
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

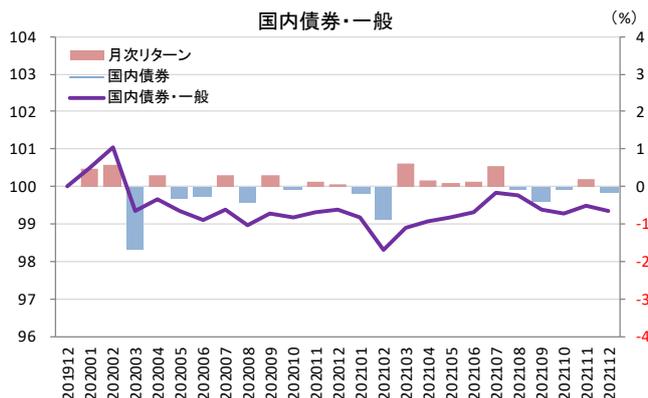
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

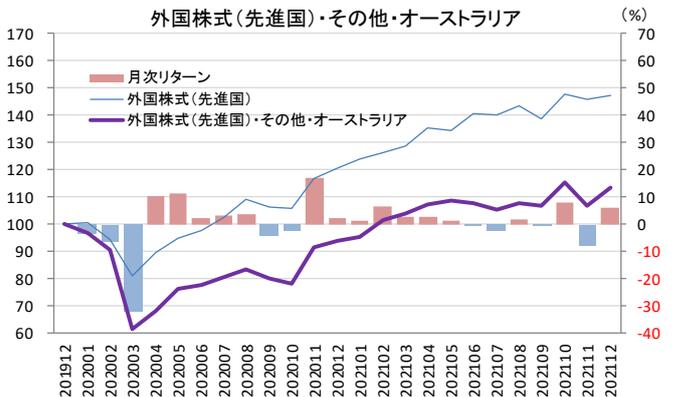
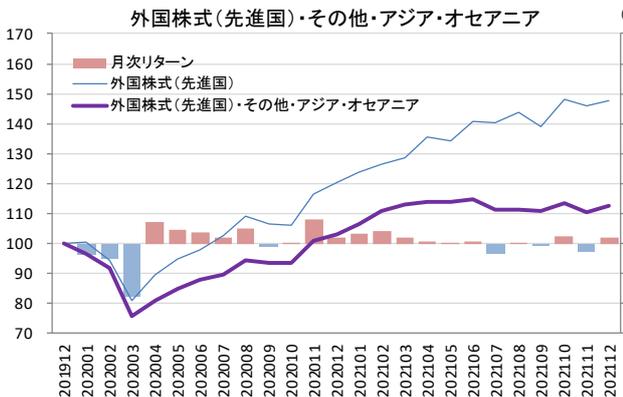
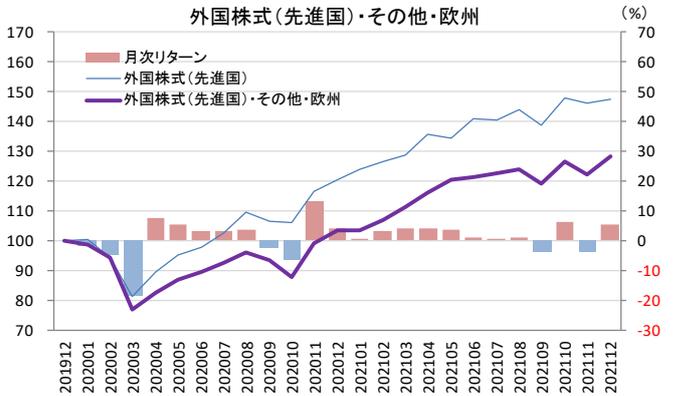
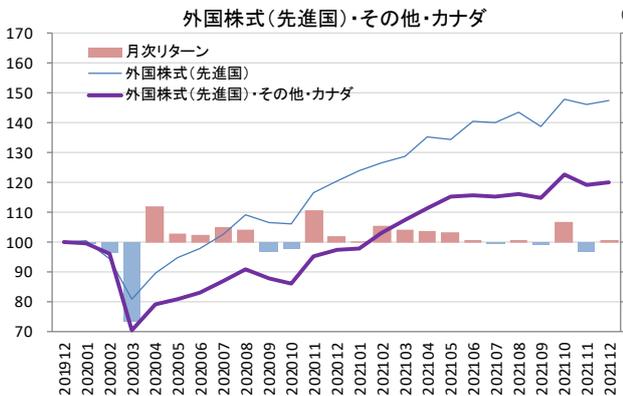
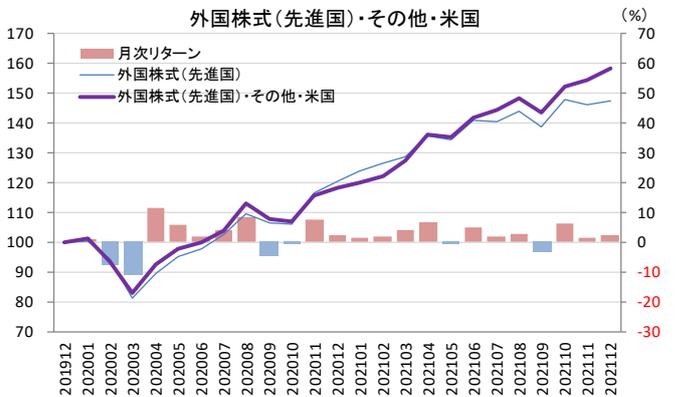
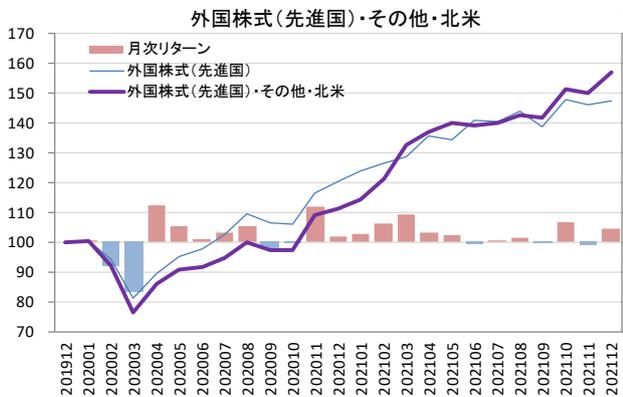
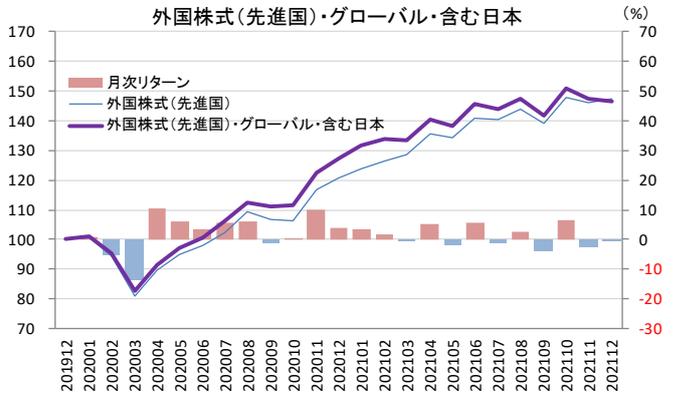
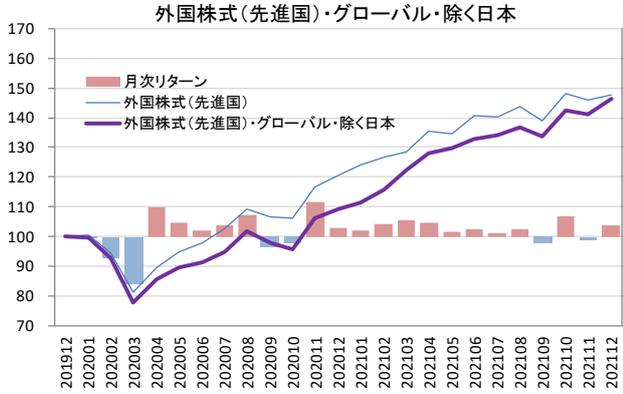


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

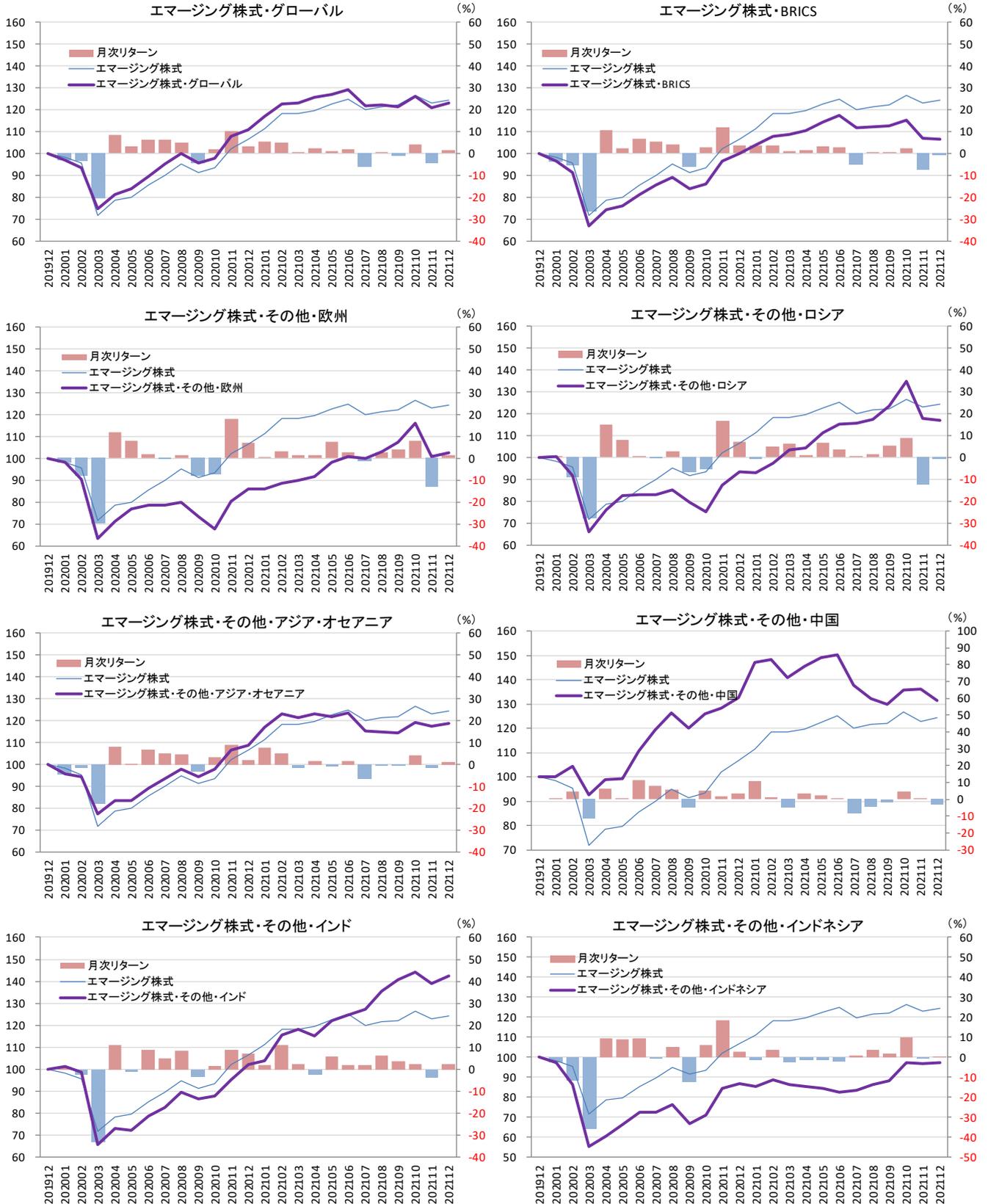


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

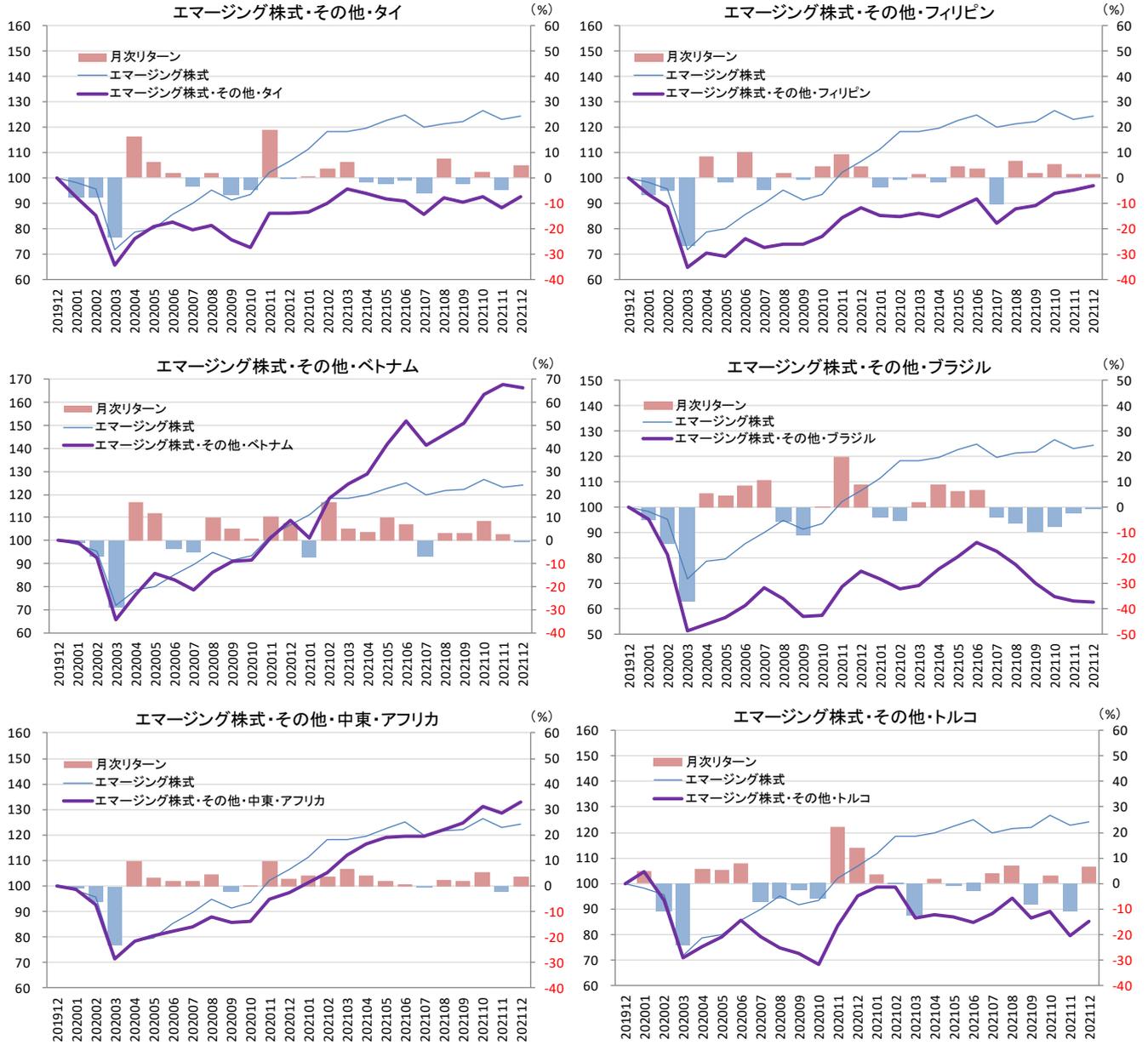


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

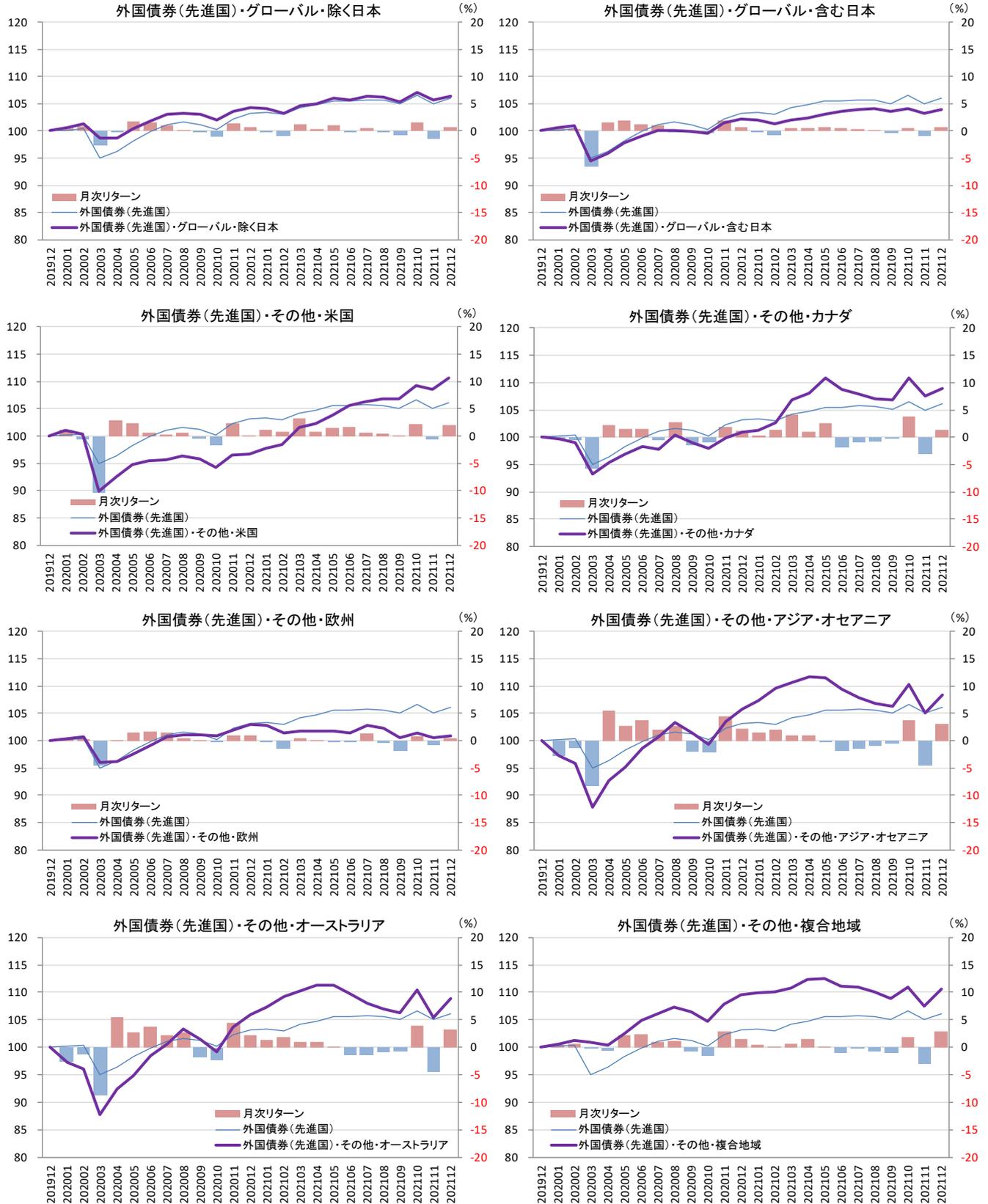


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

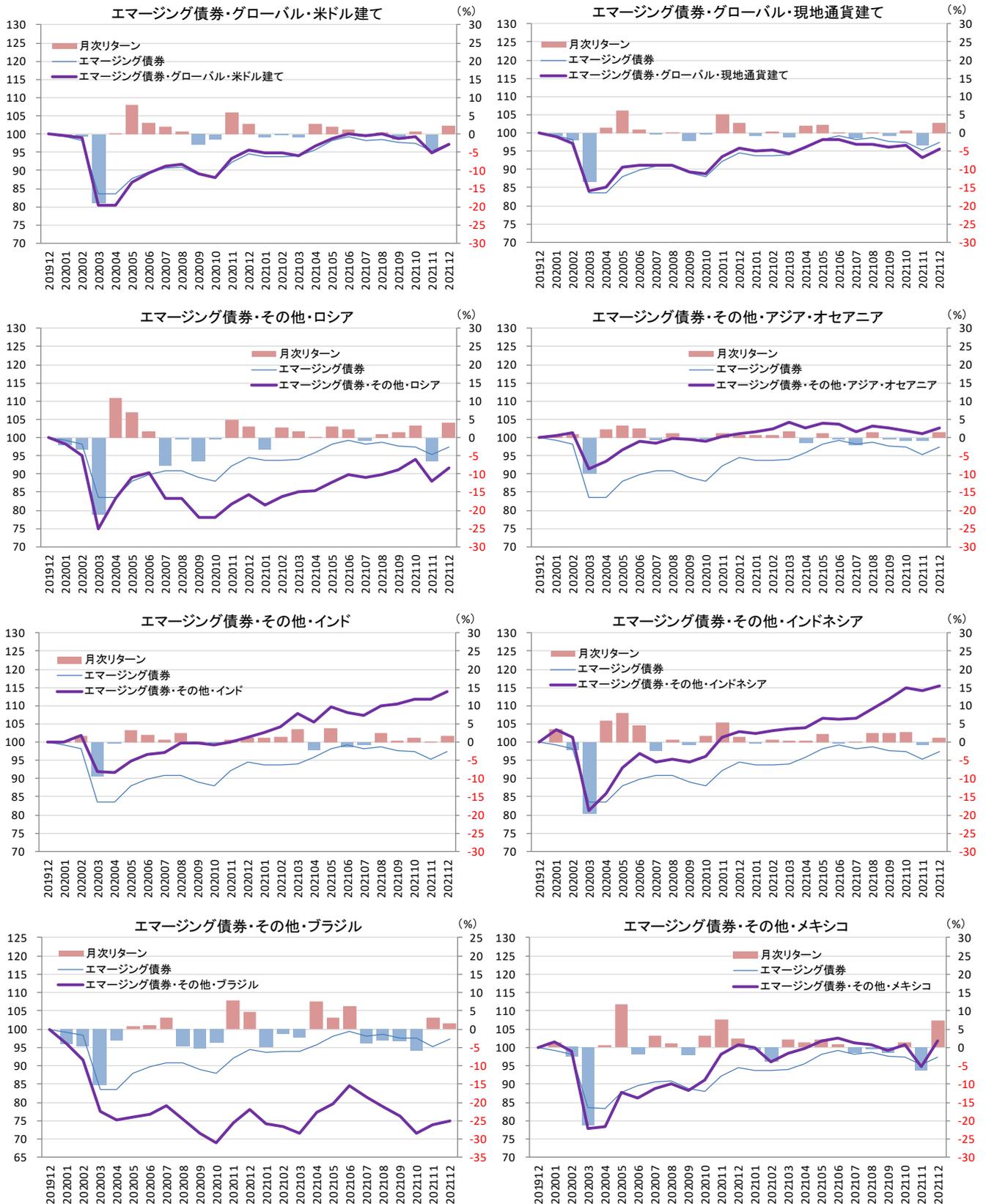


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

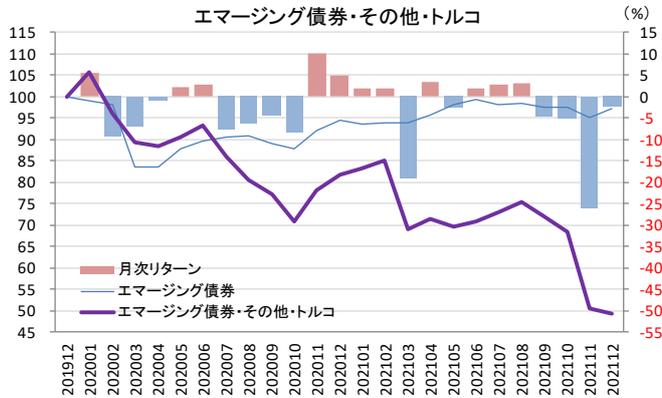


<1>パフォーマンス・サマリー

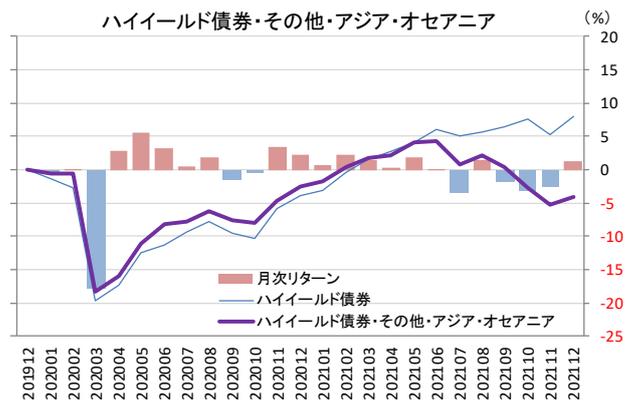
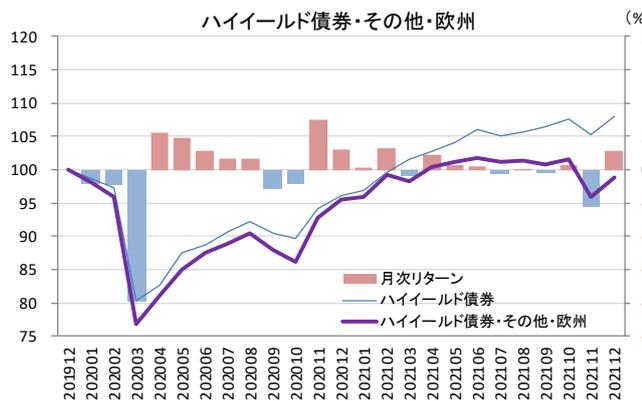
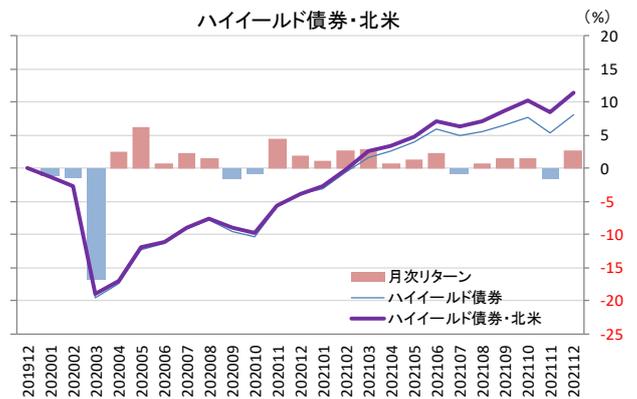
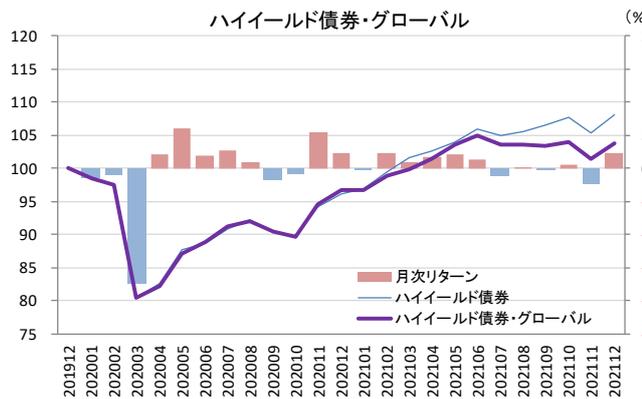
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

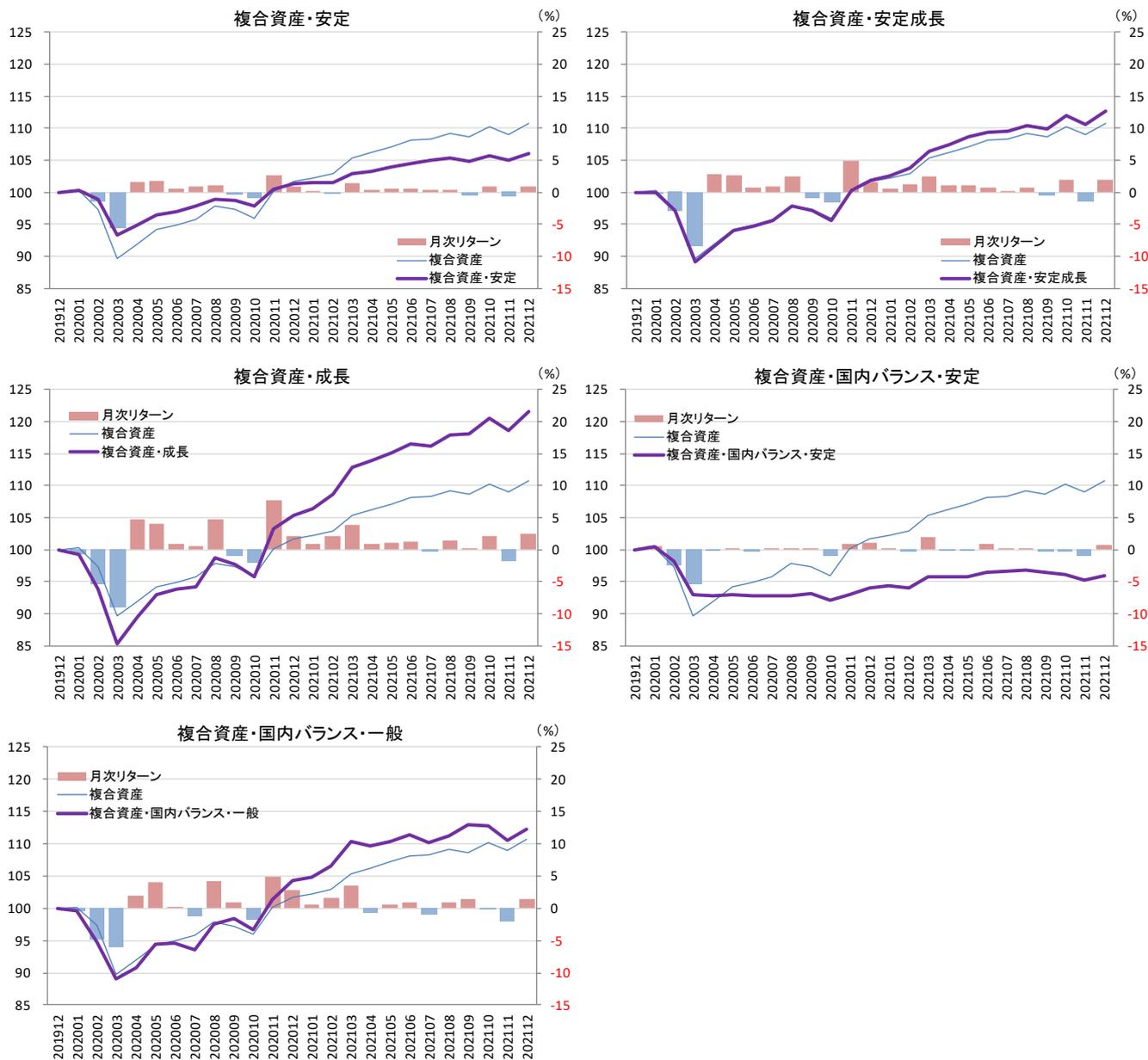


<1>パフォーマンス・サマリー

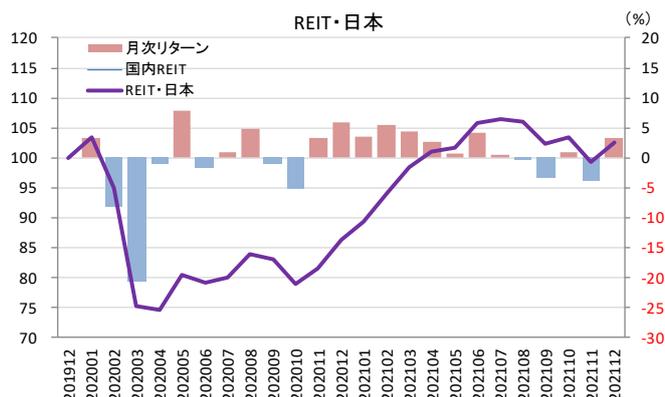
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

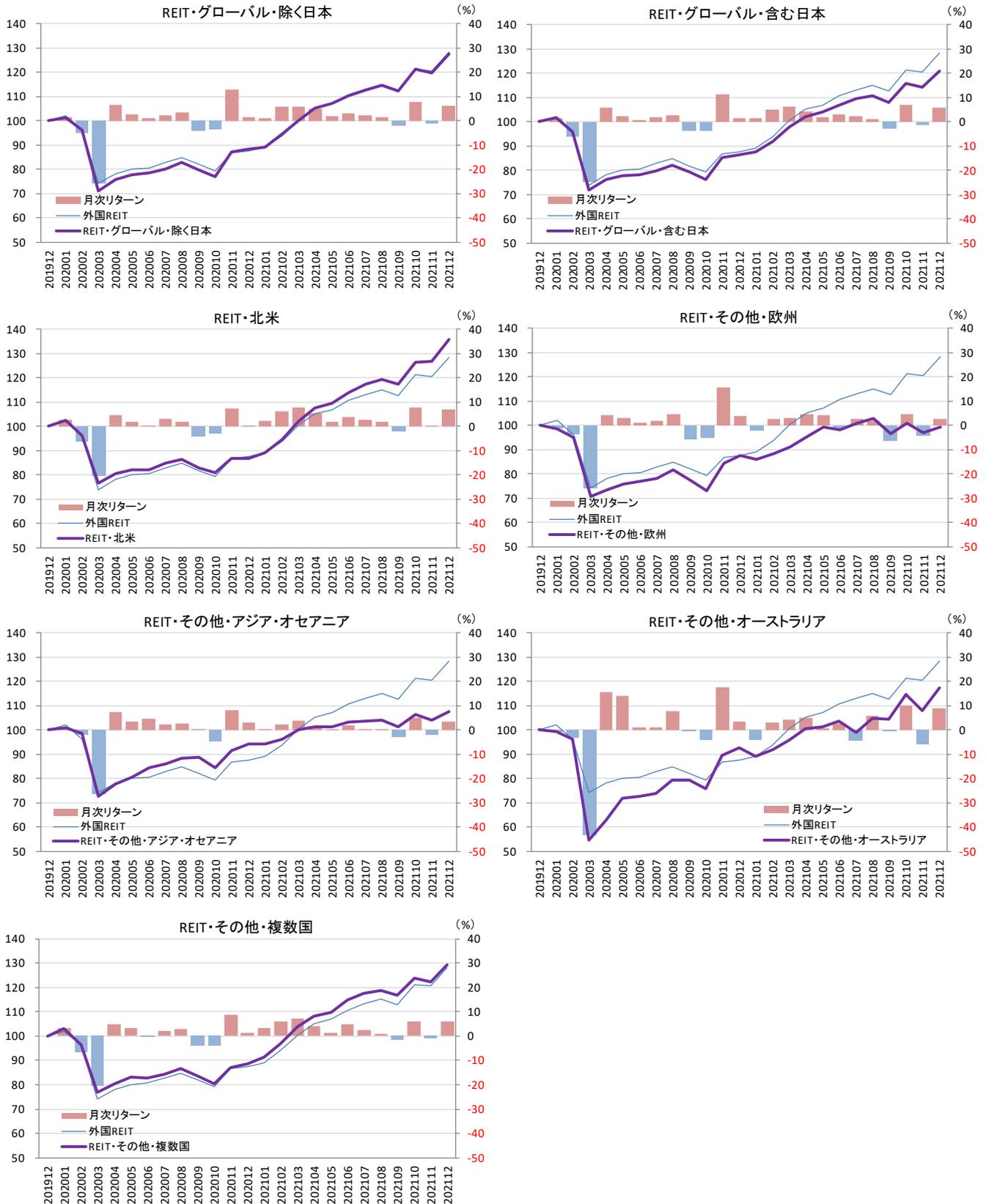


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

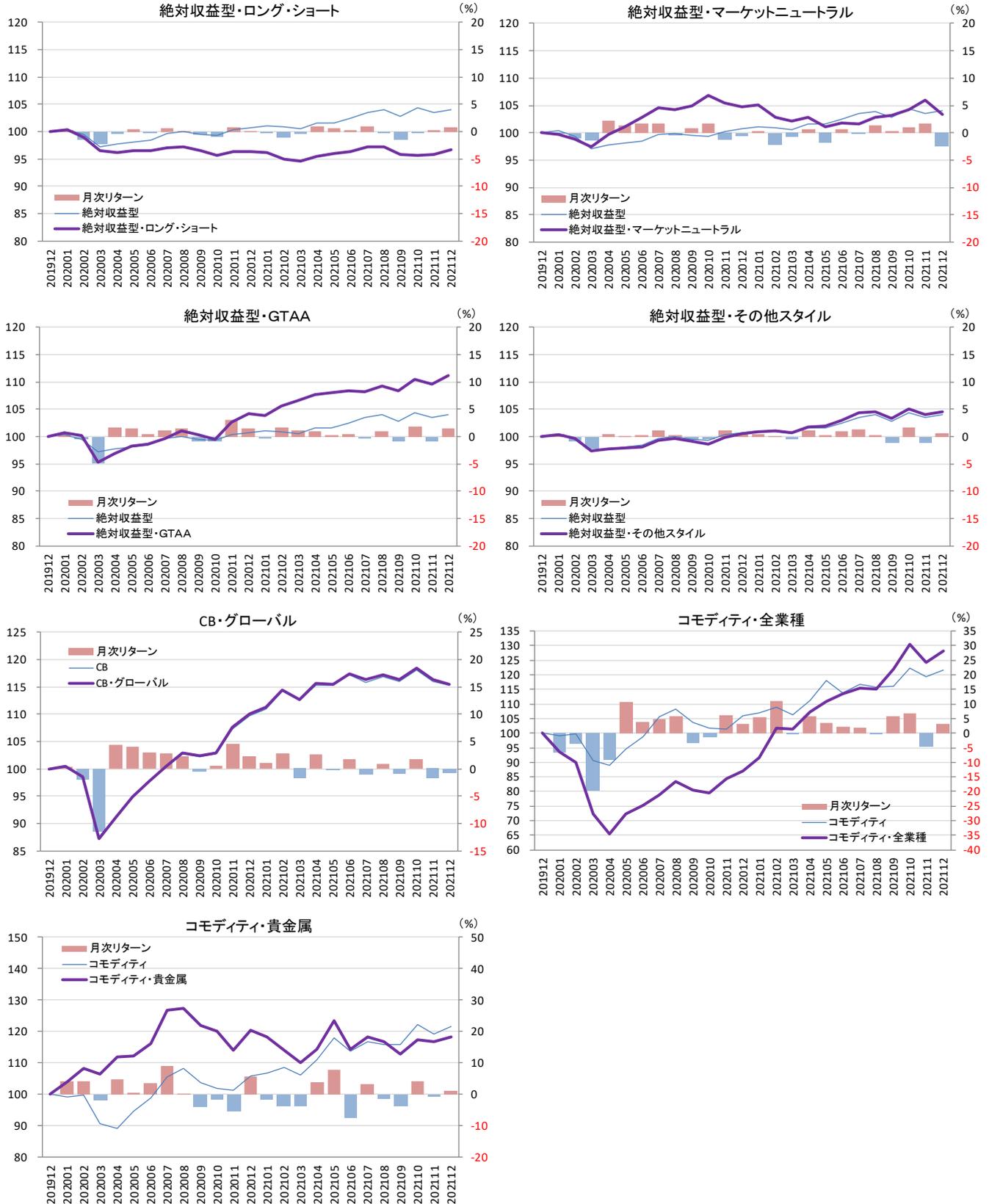


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	1.69		
1	外国株式(先進国)・その他	2.58	11.17	0.30
2	REIT・北米	7.08	2.90	0.20
3	国内株式・一般	2.36	6.79	0.16
4	国内株式・その他	3.62	4.40	0.16
5	REIT・グローバル	5.89	2.29	0.13
6	複合資産・安定成長	1.92	6.45	0.12
7	外国株式(先進国)・グローバル	0.45	29.40	0.12
8	REIT・日本	3.23	3.24	0.10
9	複合資産・成長	2.52	2.31	0.06
10	外国債券(先進国)・グローバル	0.67	7.65	0.05
11	外国債券(先進国)・その他	2.49	1.98	0.05
12	複合資産・安定	0.86	4.38	0.04
13	ハイイールド債券・北米	2.73	1.35	0.04
14	ブルベア	4.77	0.54	0.03
15	エマージング株式・その他	0.93	2.31	0.02
16	REIT・その他	4.47	0.43	0.02
17	エマージング債券・グローバル	2.43	0.74	0.02
18	エマージング株式・グローバル	1.57	1.08	0.02
19	複合資産・その他	3.20	0.52	0.02
20	エマージング債券・その他	1.96	0.61	0.01
21	コモディティ	2.02	0.45	0.01
22	複合資産・国内バランス	0.84	1.05	0.01
23	ハイイールド債券・グローバル	2.31	0.32	0.01
24	ハイイールド債券・その他	2.60	0.27	0.01
25	絶対収益型	0.39	1.25	0.00
26	国内株式・業種特化	2.40	0.09	0.00
27	エマージング株式・BRICS	-0.53	0.07	-0.00
28	CB	-0.60	0.15	-0.00
29	国内株式・小型	-0.61	0.86	-0.00
30	国内債券・一般	-0.13	4.94	-0.01
	合計		100.00	1.69

◆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

<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	15.43		
1	外国株式(先進国)・グローバル	19.06	28.34	5.24
2	外国株式(先進国)・その他	32.97	9.44	2.83
3	REIT・北米	56.28	2.91	1.36
4	国内株式・一般	11.12	7.26	0.87
5	REIT・グローバル	41.35	2.33	0.85
6	複合資産・安定成長	10.54	6.60	0.71
7	REIT・日本	18.76	3.67	0.70
8	エマージング株式・その他	19.54	2.65	0.52
9	国内株式・その他	9.55	4.46	0.48
10	複合資産・成長	15.34	2.21	0.33
11	ハイイールド債券・北米	15.90	1.53	0.24
12	複合資産・安定	4.61	4.46	0.22
13	外国債券(先進国)・その他	5.88	2.37	0.16
14	外国債券(先進国)・グローバル	1.88	7.79	0.16
15	エマージング株式・グローバル	10.86	1.17	0.13
16	複合資産・その他	16.06	0.64	0.10
17	ブルベア	18.92	0.41	0.09
18	REIT・その他	18.59	0.49	0.09
19	国内株式・小型	6.61	0.98	0.08
20	コモディティ	14.85	0.45	0.06
21	エマージング債券・その他	5.33	0.76	0.04
22	絶対収益型	3.19	1.18	0.03
23	複合資産・国内バランス	2.31	1.21	0.03
24	ハイイールド債券・グローバル	7.25	0.36	0.03
25	国内株式・業種特化	16.73	0.09	0.02
26	エマージング債券・グローバル	1.09	0.88	0.02
27	CB	5.08	0.21	0.01
28	ハイイールド債券・その他	2.37	0.34	0.01
29	エマージング株式・BRICS	6.27	0.08	0.01
30	国内債券・一般	-0.02	4.75	-0.00
	合計		100.00	15.43

◆計算定義

日次寄与度(%) = 日次リターン(%) × 前日の純資産額構成比

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

＜2＞リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別①

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	43.06	41.12	136.70	11.16 ↓	10.01	10.95	1.14	0.72	0.82
国内株式	48.16	51.84	241.29	15.53 ↓	14.99	16.94	0.90	0.58	0.77
一般	48.03	49.24	223.67	15.19 ↓	14.85	17.20	0.92	0.56	0.72
フリー	50.93	52.19	232.85	15.23 ↓	15.03	17.70	0.97	0.59	0.72
バリュー	36.83	38.24	204.25	15.56 ↓	14.56	16.16	0.71	0.46	0.73
小型	54.03	75.39	362.43	18.57 ↓	17.92	17.99	0.84	0.67	0.92
その他	46.19	52.39	259.99	15.93 ↓	14.97	16.70	0.85	0.59	0.82
日経225	49.77	60.76	285.59	17.04 ↓	15.85	17.08	0.85	0.63	0.85
TOPIX	41.87	44.69	228.05	15.17 ↓	14.38	16.44	0.82	0.54	0.77
JPX日経400	43.20	43.46	-	15.41 ↓	14.44	-	0.83	0.52	-
国内債券	0.85	1.40	11.23	1.89	1.59	1.62	0.17	0.20	0.66
一般	0.85	1.40	11.23	1.89	1.59	1.62	0.17	0.20	0.66
外国株式(先進国)	88.52	89.31	247.82	16.89 ↓	15.43	15.64	1.40	0.89	0.85
グローバル	87.89	91.20	260.56	16.98 ↓	15.51	15.58	1.38	0.90	0.88
除く日本	86.57	91.56	326.15	17.74 ↓	16.13	16.76	1.30	0.86	0.93
含む日本	88.44	91.42	245.60	17.04 ↓	15.54	15.42	1.38	0.90	0.86
その他	89.43	84.97	237.78	17.10 ↓	15.62	16.24	1.39	0.84	0.80
北米	94.09	77.62	219.69	19.43 ↓	18.17	18.51	1.28	0.67	0.67
米国	102.91	108.31	273.72	16.31 ↓	15.31	16.38 ↓	1.63	1.04	0.86
カナダ	42.59	27.85	52.90	20.96	18.06	16.47 ↓	0.60	0.28	0.26
欧州	62.50	59.99	213.21	18.41 ↓	16.74	17.11	0.96	0.59	0.71
ドイツ	49.99	36.57	-	23.40	20.89	-	0.62	0.31	-
イギリス	17.55	11.84	-	20.09	17.22	-	0.28	0.13	-
アジア・オセアニア	32.25	41.31	195.73	16.01 ↓	14.26	16.19 ↓	0.61	0.51	0.71
オーストラリア	33.22	19.23	118.11	26.28	21.86	20.03	0.38	0.17	0.40
ニュージーランド	54.07	78.77	-	18.62	16.60	-	0.83	0.75	-
複合地域	15.33	-10.80	-	35.96	30.27	-	0.14	-0.07	-
エマージング株式	44.27	54.50	144.53	20.17	17.63	18.02 ↓	0.65	0.52	0.52
グローバル	55.22	59.19	125.04	19.56 ↓	17.34	17.88 ↓	0.81	0.56	0.47
BRICS	36.33	52.21	142.23	23.16	20.01	20.78	0.47	0.44	0.44
その他	41.02	53.15	154.27	20.78	18.11	18.23 ↓	0.59	0.49	0.54
欧州	32.54	27.43	84.78	28.16	23.73	23.95	0.35	0.21	0.26
ロシア	63.21	54.47	135.89	27.56	23.93	26.08	0.64	0.38	0.34
アジア・オセアニア	38.18	41.67	144.05	18.67 ↓	16.59	16.81 ↓	0.61	0.44	0.55
中国	83.52	96.20	281.65	19.54 ↓	18.44	21.42	1.15	0.78	0.67
インド	49.47	80.52	283.57	26.22	22.97	24.32	0.55	0.55	0.59
インドネシア	2.29	1.83	36.33	30.40	25.76	24.50	0.03	0.02	0.13
タイ	-5.76	1.79	63.82	24.81	20.96	18.93	-0.08	0.02	0.27
フィリピン	1.56	-2.02	107.75	22.76	19.69	20.10	0.02	-0.02	0.38
ベトナム	66.18	93.40	328.98	28.77	25.18	22.03	0.64	0.56	0.71
韓国	60.99	63.89	119.51	23.41 ↓	20.94	18.56 ↓	0.74	0.50	0.44
香港	-0.13	16.05	69.01	20.01	18.11	19.06	-0.00	0.17	0.28
台湾	111.98	119.06	358.06	19.80 ↓	19.23	17.91	1.44	0.89	0.92
中南米	-0.81	9.41	13.70	32.48	28.21	25.91	-0.01	0.07	0.05
ブラジル	-21.58	-15.60	-26.25	35.28	32.31	31.56	-0.22	-0.10	-0.10
メキシコ	24.59	11.54	-	30.14	27.32	-	0.25	0.08	-
中東・アフリカ	44.69	42.96	149.27	20.01	16.80	17.04	0.66	0.44	0.56
トルコ	-5.14	-27.71	-9.67	32.68	33.04	30.99	-0.05	-0.19	-0.03
複合地域	42.31	43.85	128.76	18.47 ↓	16.43	16.20	0.68	0.46	0.53

※[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	43.06	41.12	136.70	11.16 ↓	10.01	10.95	1.14	0.72	0.82
外国債券(先進国)	11.55	9.97	47.42	4.40	4.08	6.80	0.85	0.48	0.58
グローバル	10.96	9.74	49.60	3.62	3.40 ↓	6.14	0.98	0.57	0.67
除く日本	12.07	11.34	53.43	3.19	3.43 ↓	6.75	1.23	0.65	0.65
含む日本	9.70	7.92	45.32	4.56	3.82 ↓	5.63	0.70	0.41	0.68
その他	13.73	10.95	44.37	7.35	6.75	8.64	0.60	0.32	0.43
北米	12.00	11.20	-	5.01	4.10	-	0.78	0.53	-
米国	19.15	14.82	70.20	7.41	6.26	6.71	0.82	0.46	0.81
カナダ	15.21	8.30	27.51	6.88	7.04	8.85	0.71	0.23	0.28
欧州	2.94	6.40	53.99	3.80	4.41 ↓	8.18 ↓	0.27	0.29	0.54
イギリス	13.65	11.32	-	8.14	7.66 ↓	-	0.54	0.29	-
アジア・オセアニア	11.69	9.25	40.34	9.57	8.78	9.99	0.40	0.21	0.34
オーストラリア	12.12	9.27	38.46	9.66	8.88	10.06	0.41	0.21	0.33
ニュージーランド	6.40	6.27	-	8.29	8.49	-	0.26	0.15	-
複合地域	16.07	18.63	53.41	4.41 ↑	4.77	8.31	1.16	0.74	0.53
エマージング債券	5.87	3.00	38.74	11.79	10.42	12.16	0.17	0.06	0.27
グローバル	7.25	2.53	39.48	13.82	12.00	12.59	0.17	0.05	0.27
米ドル建て	7.81	2.93	42.07	14.42	12.42	12.89	0.18	0.05	0.28
現地通貨建て	5.28	1.42	30.00	11.86	10.84	11.77	0.15	0.03	0.23
その他	5.11	3.72	35.65	10.31	9.38 ↓	12.67 ↓	0.17	0.08	0.24
ロシア	18.93	10.47	42.32	18.81	17.00	22.00	0.32	0.12	0.16
アジア・オセアニア	10.85	9.57	67.58	7.32	6.11	8.21	0.48	0.31	0.65
インド	20.17	19.26	107.41	8.92 ↓	8.32 ↓	12.48	0.71	0.44	0.61
インドネシア	30.35	24.57	42.25	15.47 ↓	13.77	15.68	0.60	0.33	0.23
ブラジル	-21.27	-22.39	5.18	18.07	17.70	18.40	-0.42	-0.28	0.03
メキシコ	22.38	30.16	53.76	17.99	17.20	16.33	0.39	0.32	0.27
トルコ	-41.93	-64.41	-61.23	28.58	32.94	26.35	-0.58	-0.57	-0.34
複合地域	5.80	12.30	28.41	11.76	10.72	12.82	0.16	0.22	0.20
ハイイールド債券	20.54	15.16	96.05	12.81	10.74	11.57	0.50	0.27	0.60
グローバル	14.20	11.15	82.25	13.02	10.88	11.80 ↓	0.35	0.20	0.52
北米	25.07	19.15	106.97	12.53	10.58	11.36	0.62	0.34	0.66
その他	8.71	3.73	78.33	14.38	12.15	12.95 ↓	0.20	0.06	0.46
欧州	9.29	4.45	88.19	15.10	12.92	13.95 ↓	0.20	0.07	0.47
アジア・オセアニア	5.02	0.40	71.31	13.03	10.61	11.27	0.13	0.01	0.49
複合地域	22.22	23.30	120.07	9.16	8.06	10.14	0.76	0.54	0.81
複合資産	22.82	23.01	105.78	6.95 ↓	6.31	8.38	1.02	0.68	0.89
安定	14.74	13.84	76.95	4.62 ↓	4.30	6.73 ↓	1.02	0.62	0.87
安定成長	25.98	26.11	113.81	7.53 ↓	6.83	8.79	1.07	0.70	0.90
成長	40.91	42.62	168.48	10.64 ↓	9.96	11.30	1.14	0.74	0.92
国内バランス	2.42	4.07	42.81	4.30	3.62	6.21	0.19	0.23	0.58
安定	1.27	2.43	31.31	4.17	3.43	3.35	0.11	0.15	0.82
一般	25.55	28.38	85.78	8.10 ↓	7.89	9.65	0.98	0.65	0.66

※[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	43.06	41.12	136.70	11.16 ↓	10.01	10.95	1.14	0.72	0.82
国内REIT	27.63	29.59	239.89	17.31	14.08	16.83	0.49	0.38	0.77
日本	27.63	29.59	239.89	17.31	14.08	16.83	0.49	0.38	0.77
外国REIT	55.60	48.48	223.23	18.62	16.20	15.61	0.85	0.51	0.80
グローバル	46.42	39.43	194.19	19.98	17.02	15.97	0.68	0.41	0.71
除く日本	55.27	54.66	236.37	20.71	17.53	16.25	0.76	0.52	0.79
含む日本	43.72	36.23	186.75	19.76	16.86	15.89	0.65	0.38	0.70
北米	67.88	57.68	251.81	17.56	15.91	15.73 ↓	1.08	0.60	0.85
その他	30.53	43.43	202.96	21.06	17.23	15.88	0.44	0.44	0.74
欧州	19.29	19.51	96.93	21.71	18.47	18.73 ↓	0.28	0.20	0.37
アジア・オセアニア	27.55	50.69	221.48	19.21	16.02	15.79	0.44	0.54	0.78
オーストラリア	33.70	34.77	191.76	32.70	26.25	22.14	0.31	0.24	0.51
複合地域	11.88	2.40	117.54	29.22	23.74	20.75	0.13	0.02	0.39
複数国	59.81	57.19	308.05	17.47	15.06	14.71	0.97	0.63	1.03
その他									
絶対収益型	6.53	5.04	8.42	2.55	2.42	2.97	0.85	0.43	0.27
ロング・ショート	0.93	-2.27	-2.93	3.06	3.15	2.94	0.11	-0.13	-0.10
マーケットニュートラル	2.99	9.77	42.06	4.16	4.17	5.51	0.25	0.46	0.65
GTAA	18.38	15.79	27.07	4.47	3.87	3.30	1.30	0.78	0.73
その他スタイル	6.94	3.89	10.37	2.72	2.49	4.39 ↓	0.85	0.33	0.22
CB	24.98	22.95	77.41	9.34	7.77	8.57	0.83	0.55	0.69
アジア・オセアニア	40.60	45.59	149.78	13.76	11.52	11.94	0.88	0.68	0.80
日本	1.67	0.37	47.86	5.25 ↓	5.15	6.27	0.11	0.02	0.64
グローバル	25.56	23.52	77.17	9.55	7.92	8.69	0.83	0.55	0.68
コモディティ	35.35	22.26	3.76	11.69	10.31	13.36	0.91	0.40	0.03
全業種	36.33	18.59	3.08	19.91	16.89	16.64	0.55	0.21	0.02
貴金属	35.11	38.99	17.37	13.83	11.50	14.55 ↓	0.77	0.60	0.11
エネルギー	61.72	31.13	-12.45	40.67	35.07	30.76	0.43	0.16	-0.04
その他コモディティ	23.27	10.44	15.94	19.96	17.53	17.27	0.36	0.12	0.09

※[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

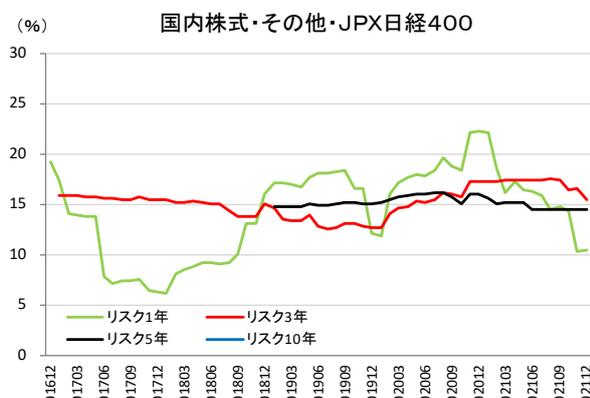
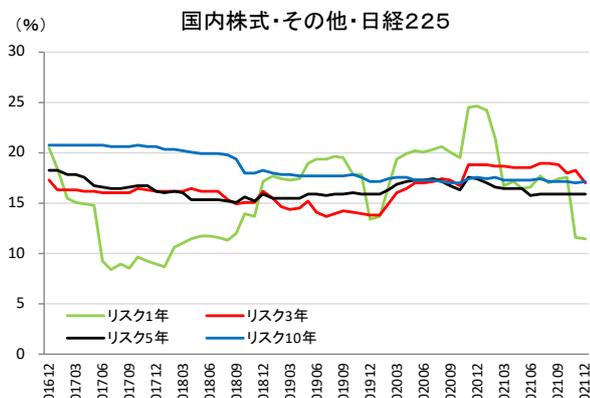
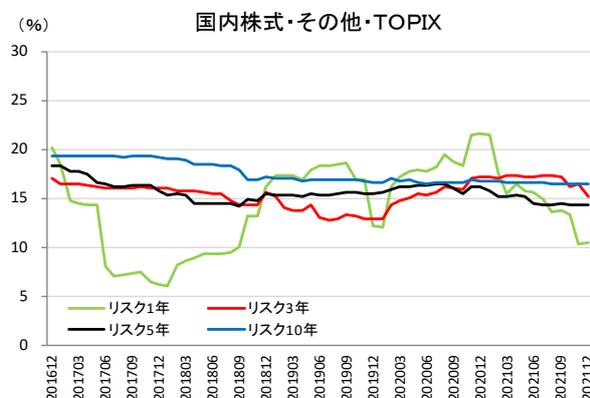
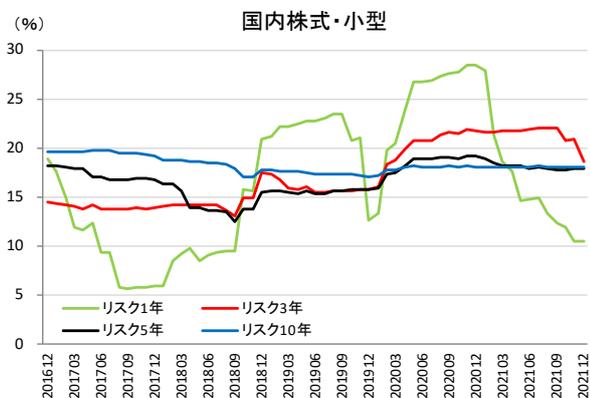
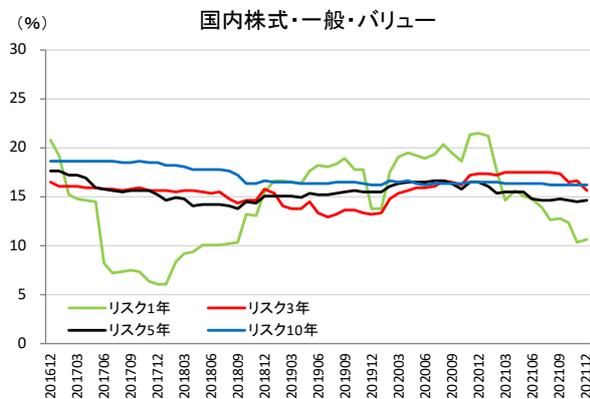
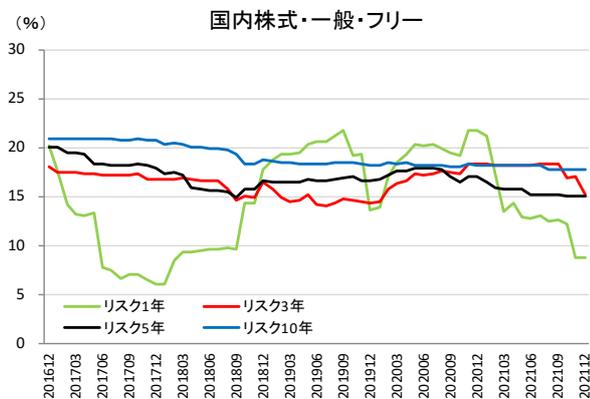
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2>リスク・サマリー

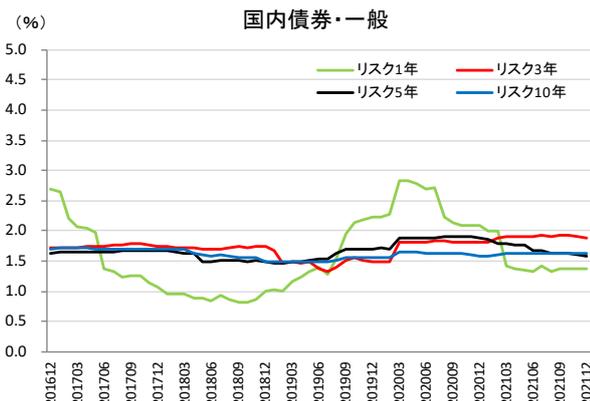
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

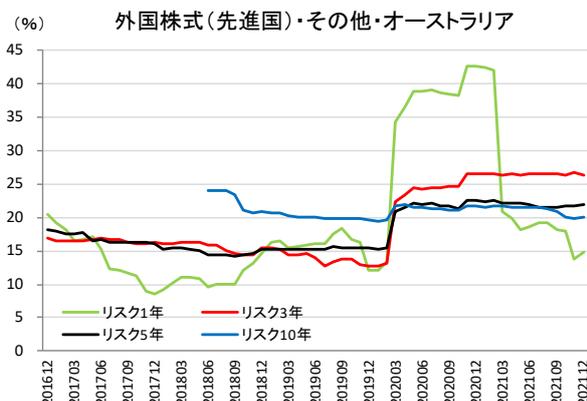
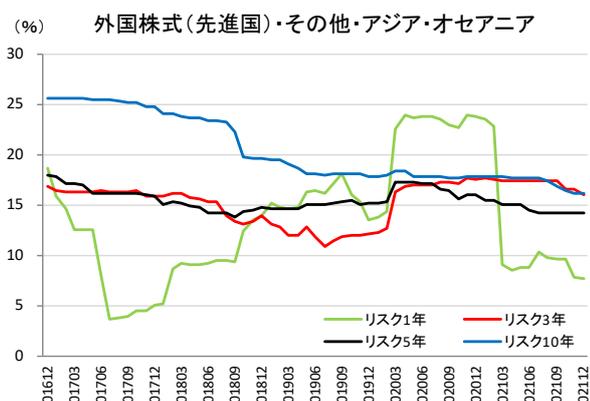
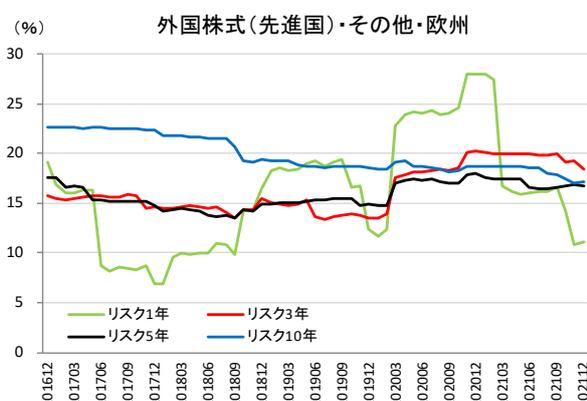
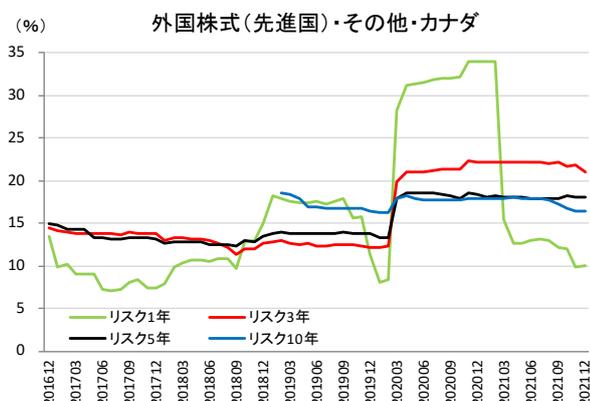
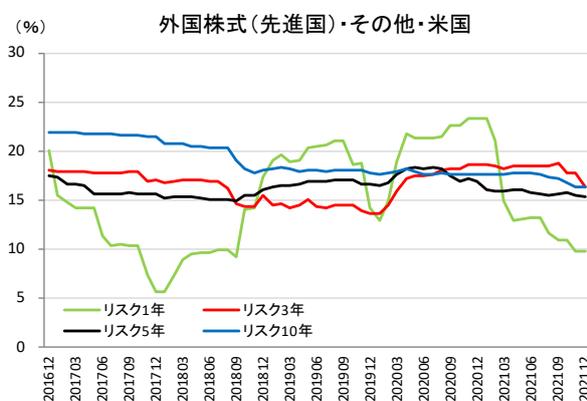
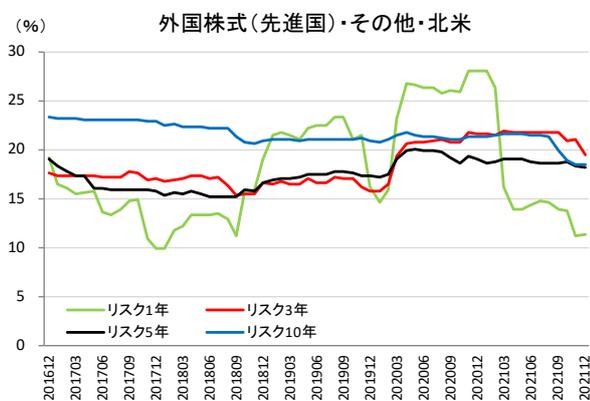
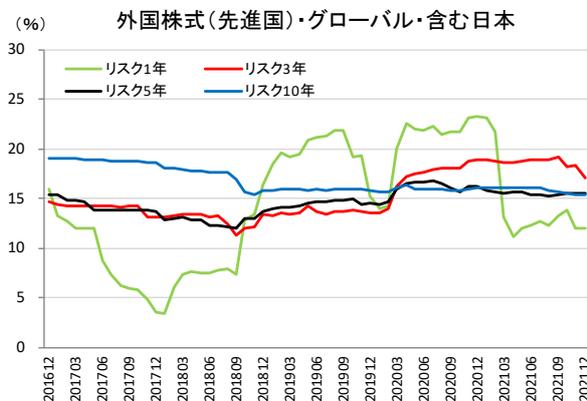
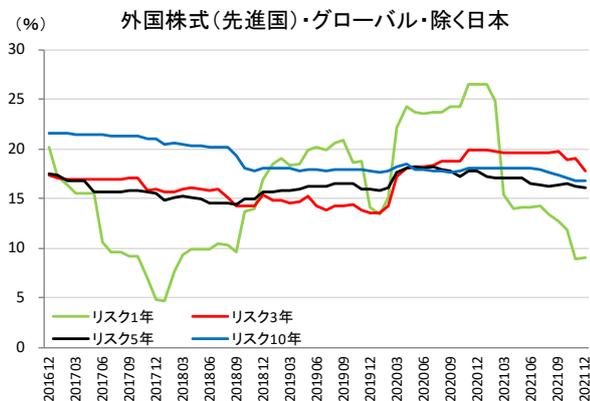


<2> リスク・サマリー

(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)]

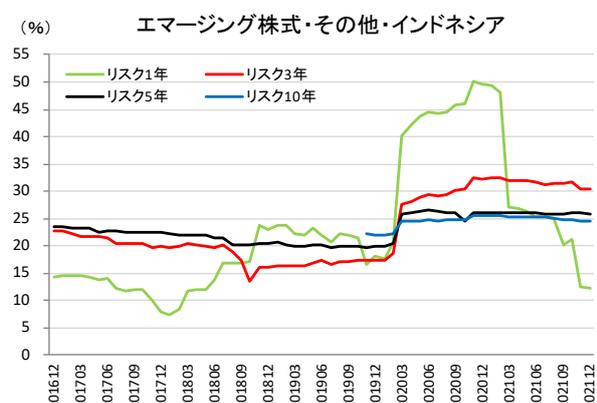
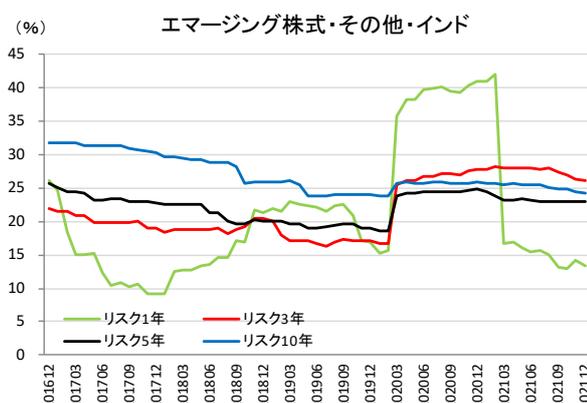
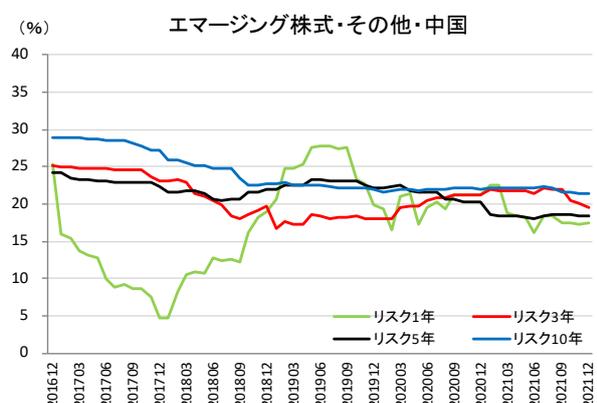
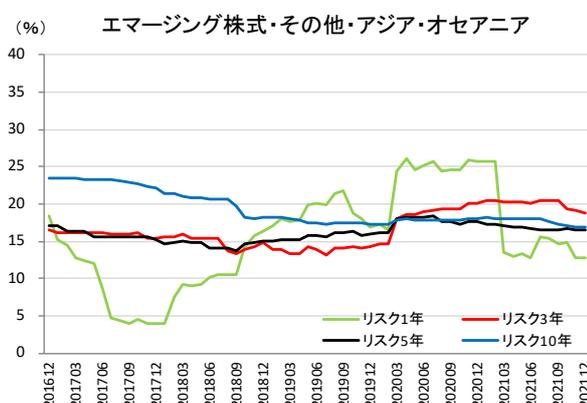
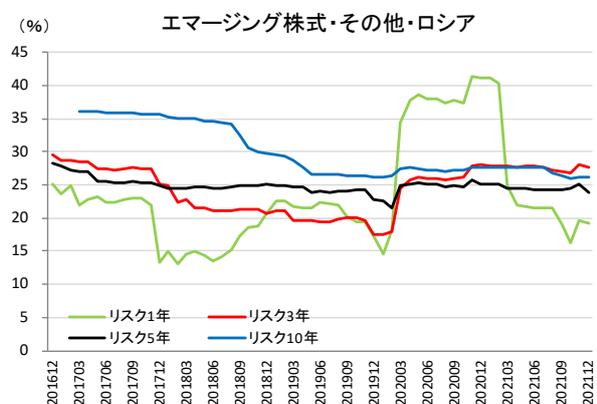
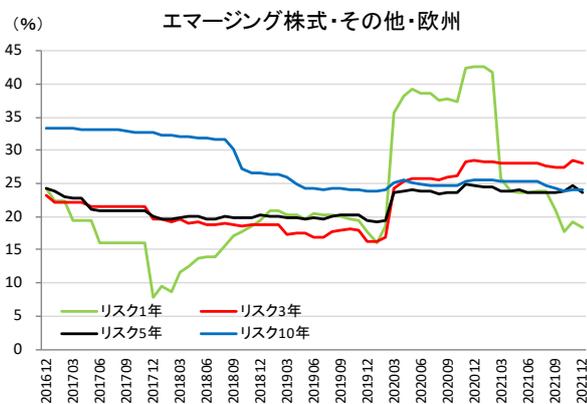
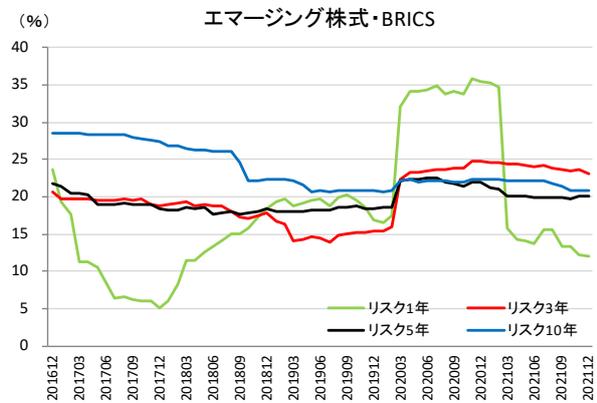
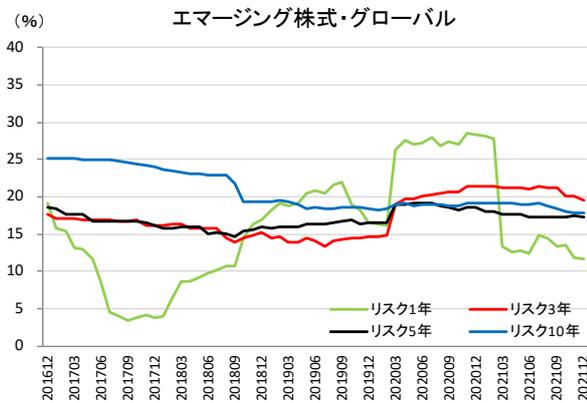


<2> リスク・サマリー

(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]

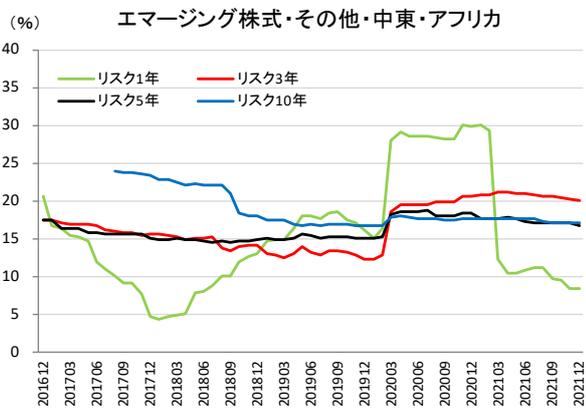
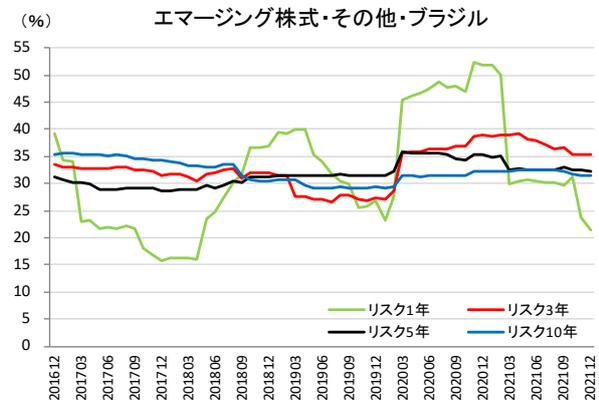
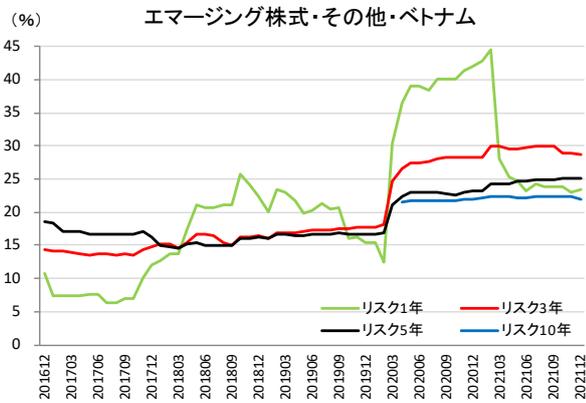
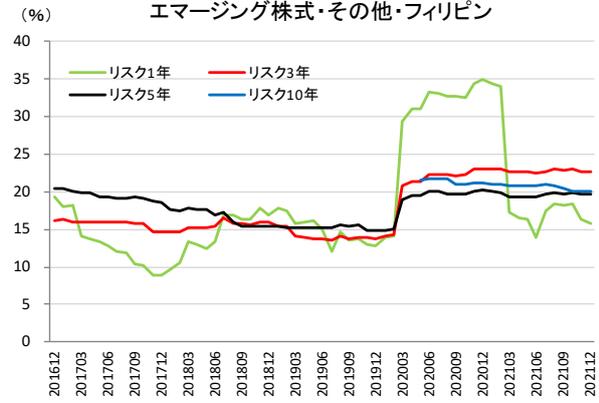
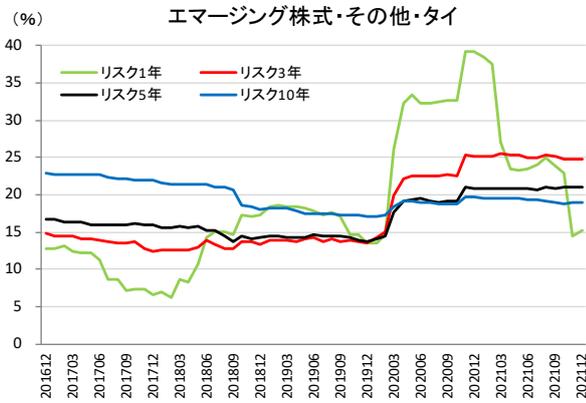


<2> リスク・サマリー

(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]

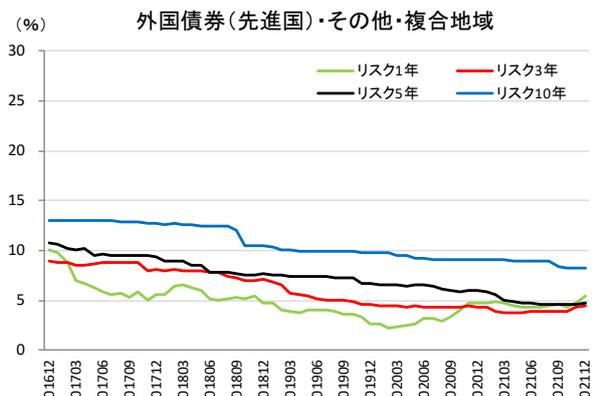
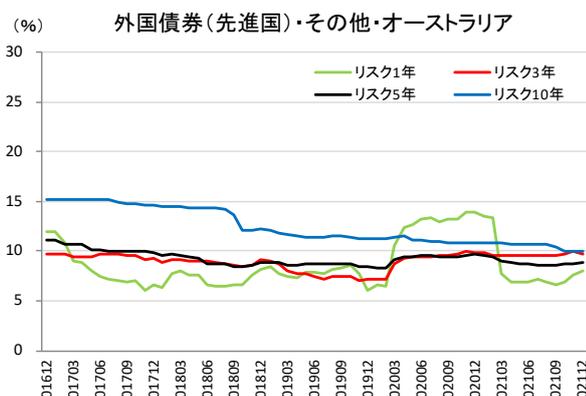
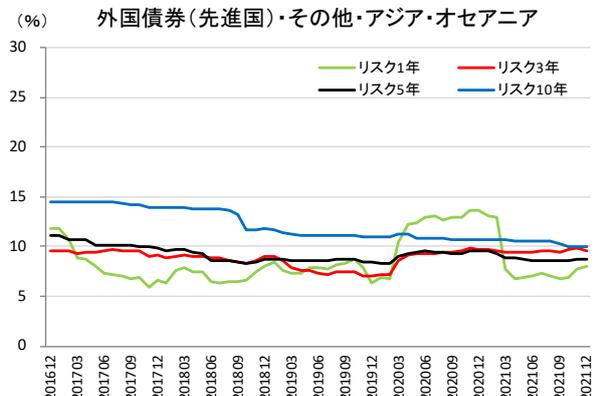
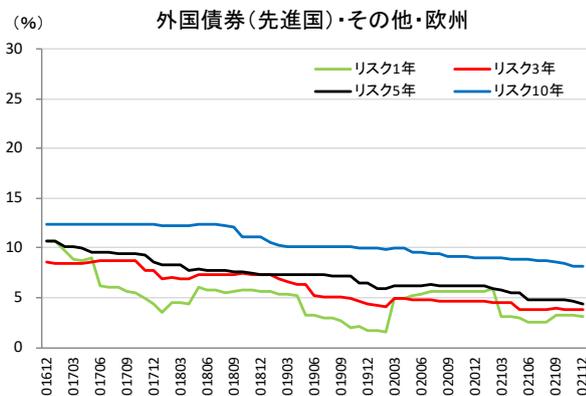
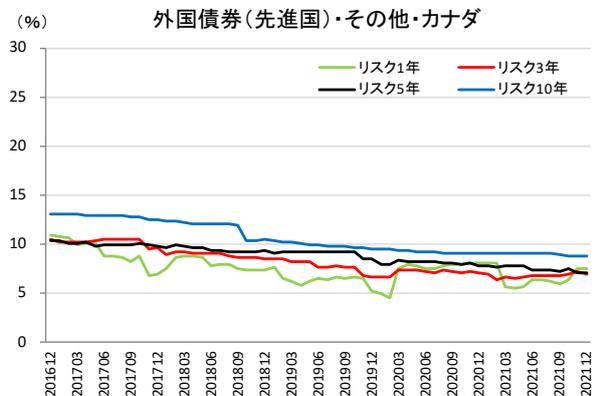
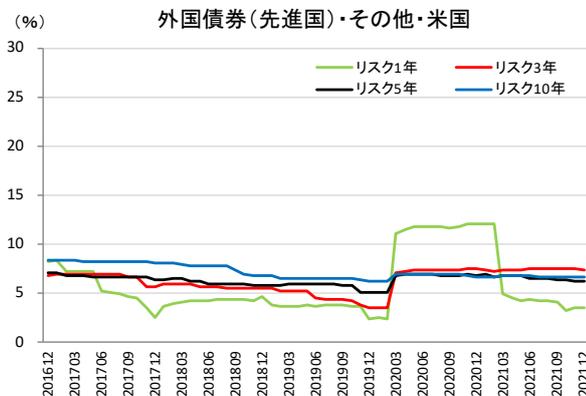
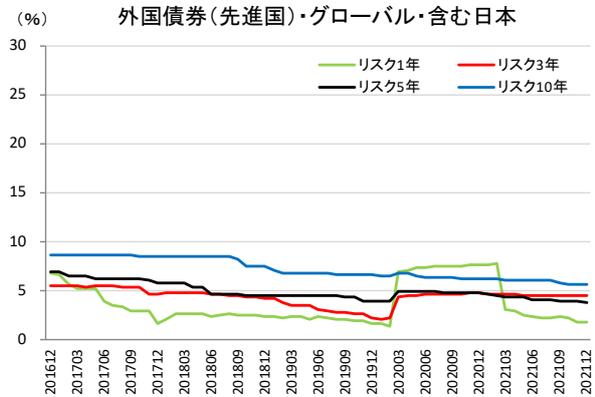
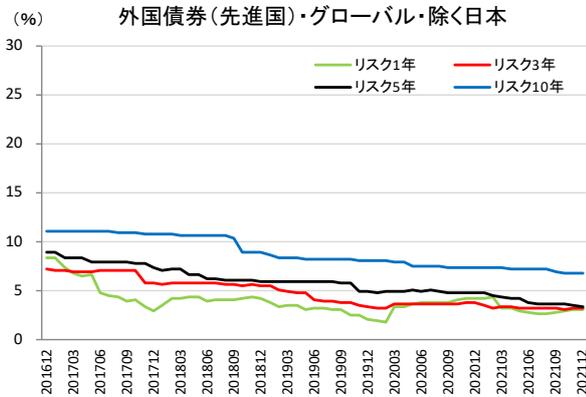


<2> リスク・サマリー

(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)]

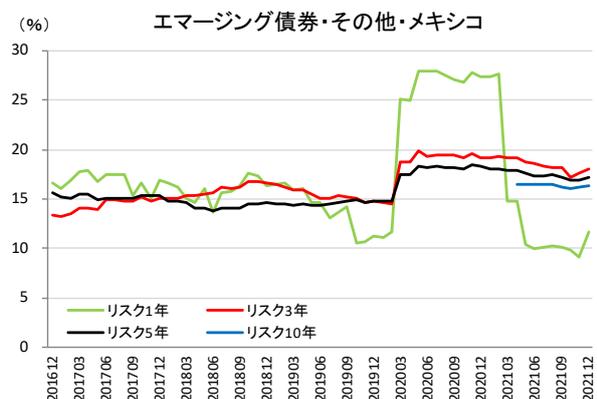
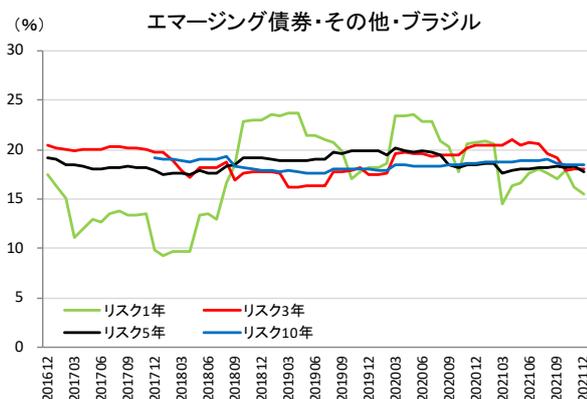
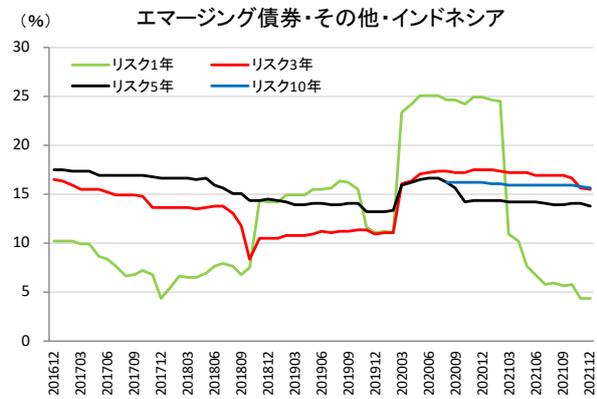
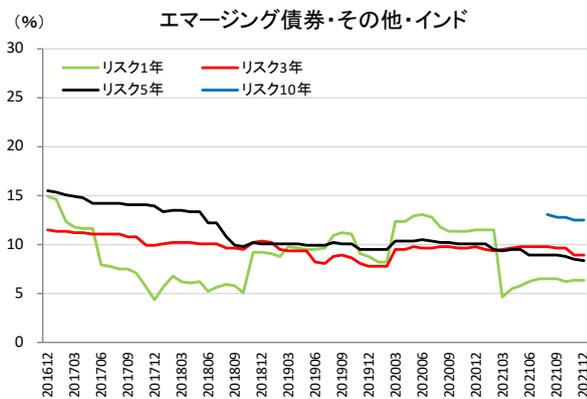
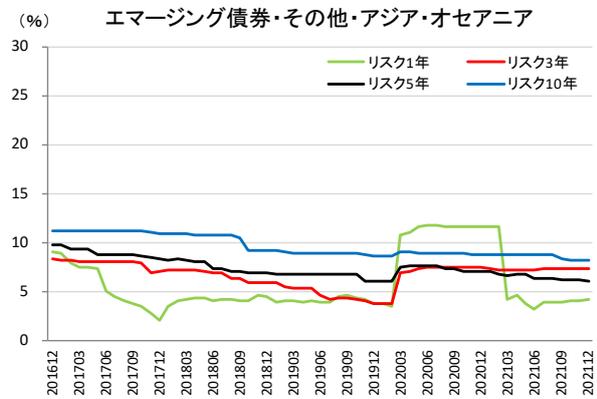
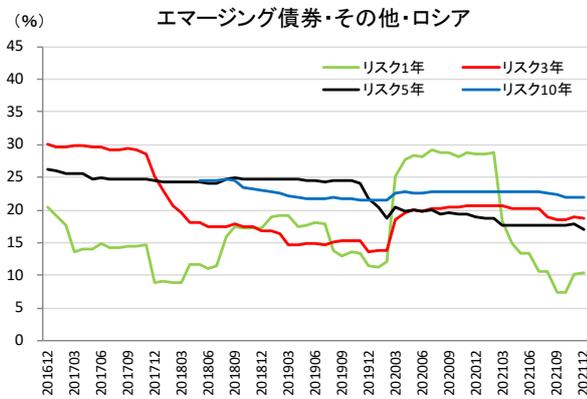
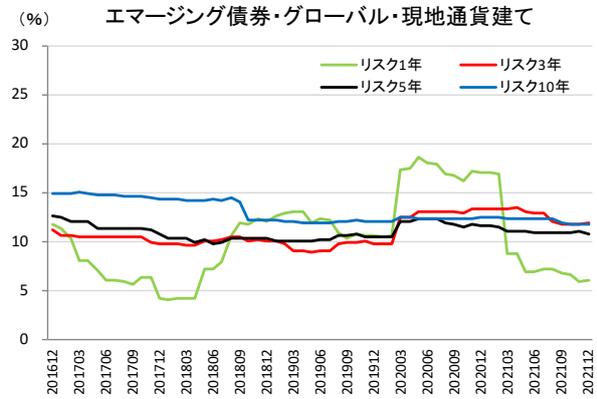
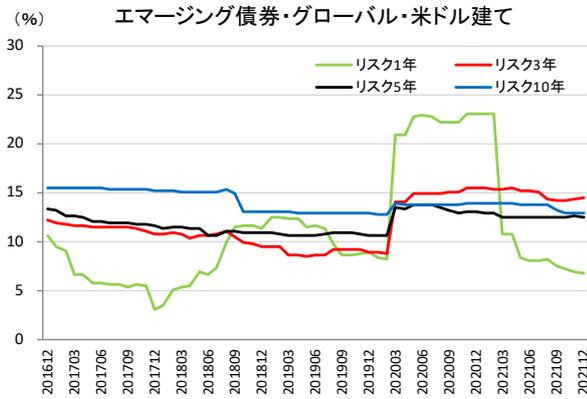


<2>リスク・サマリー

(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]

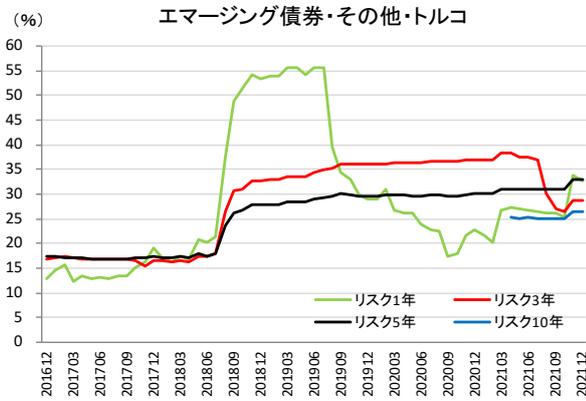


<2> リスク・サマリー

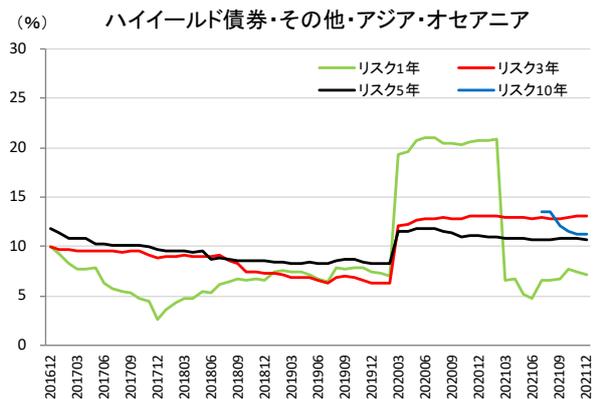
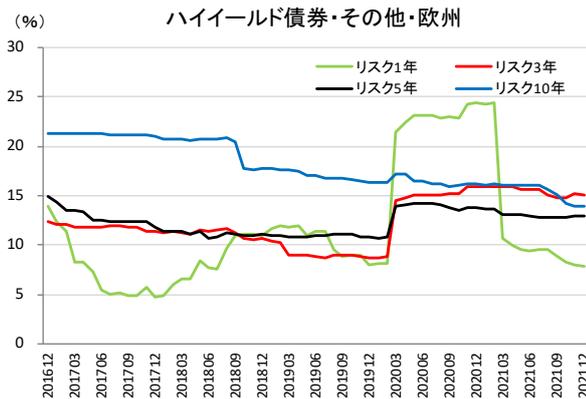
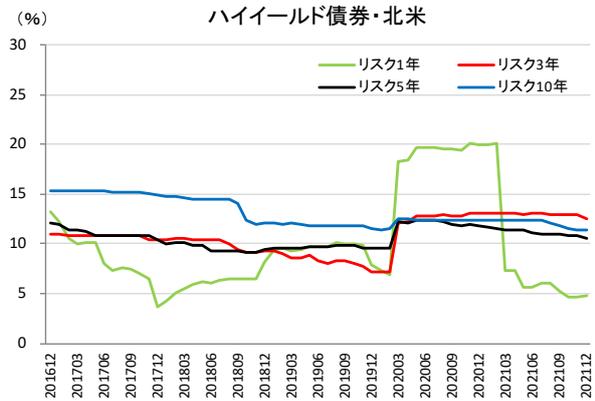
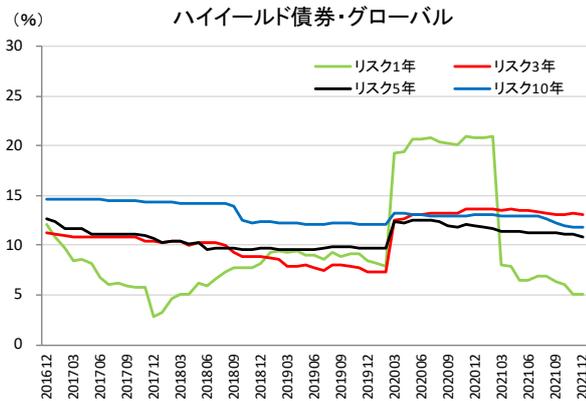
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

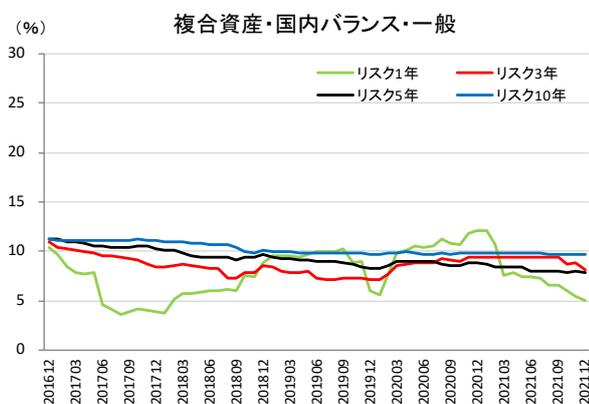
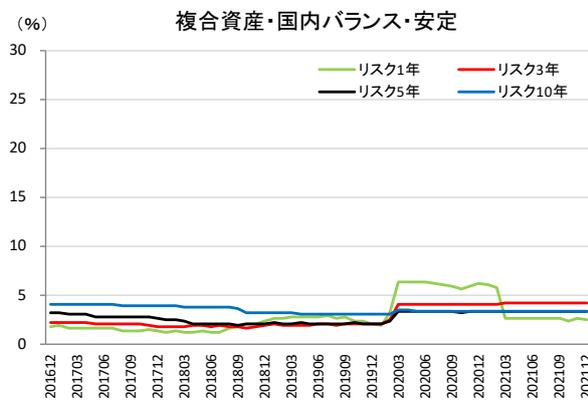
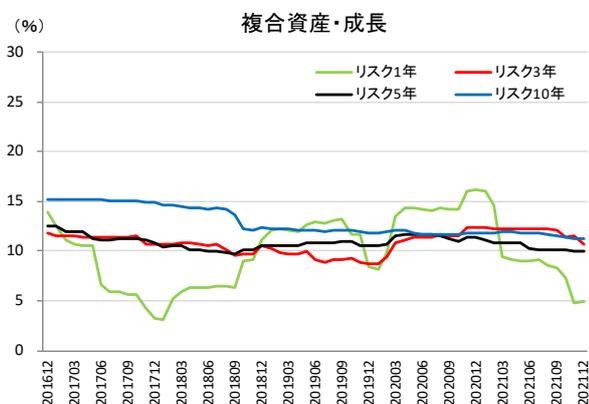
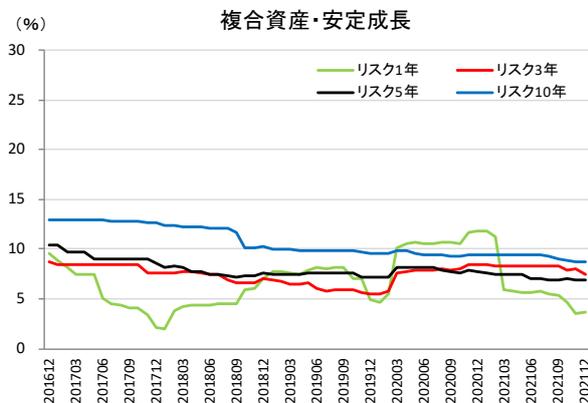
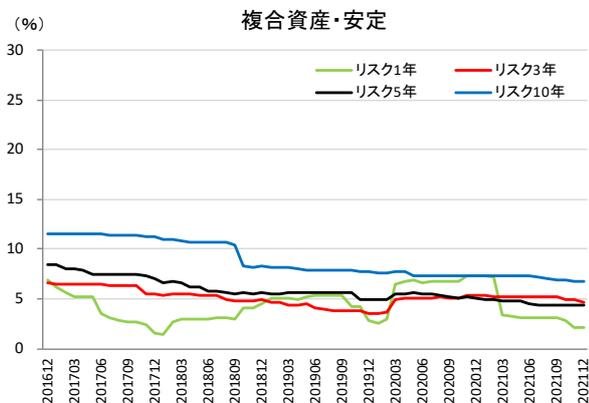


<2> リスク・サマリー

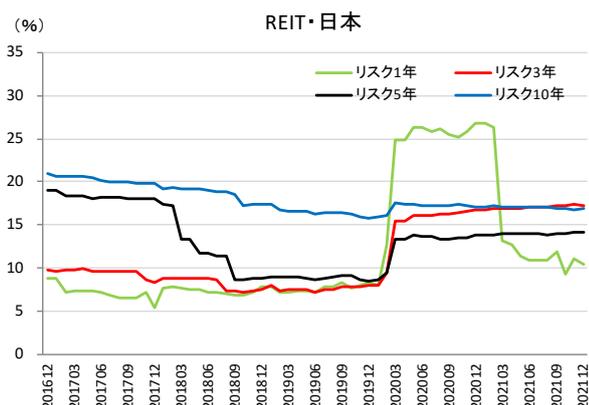
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

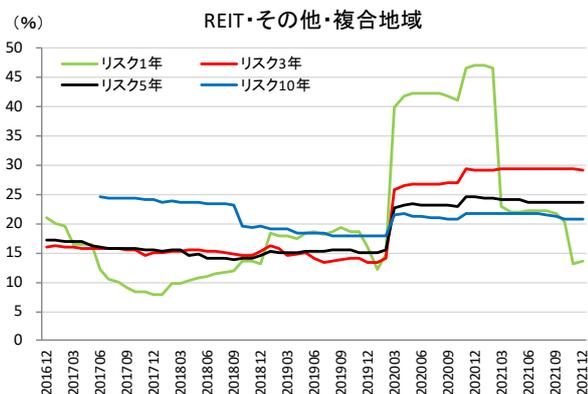
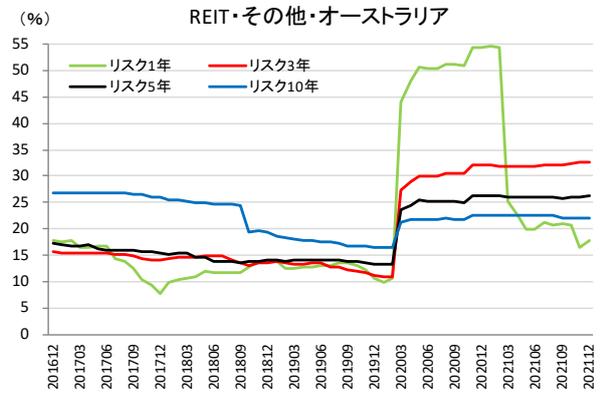
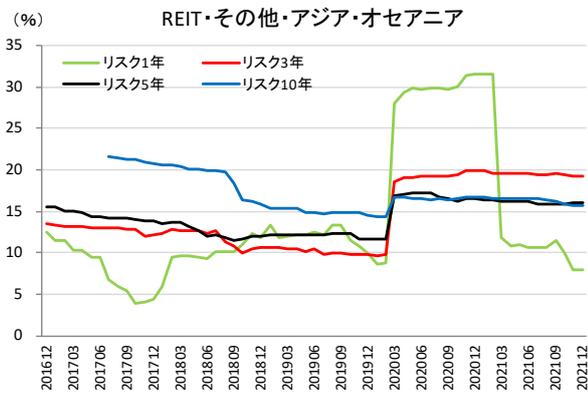
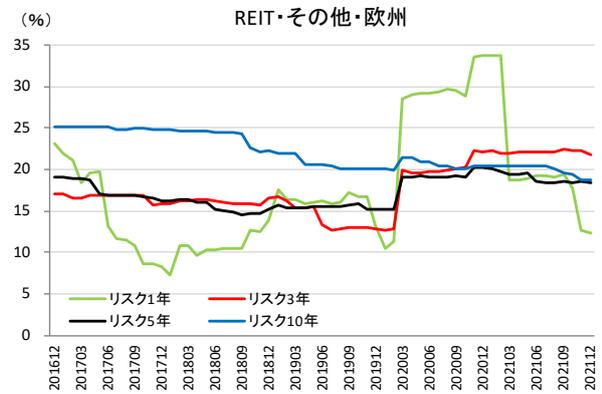
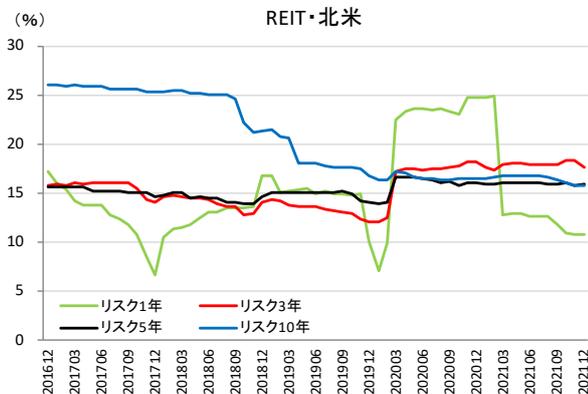
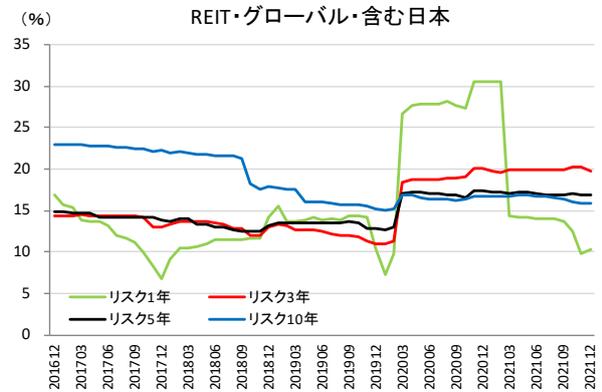
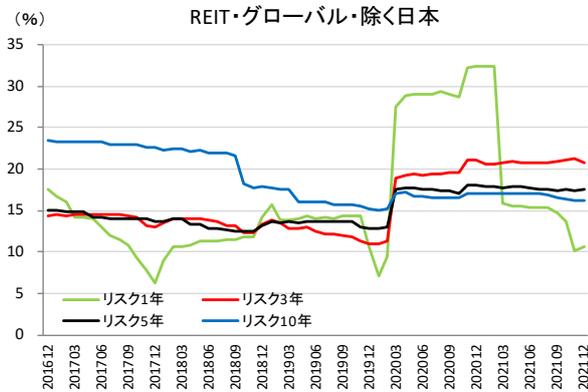


<2> リスク・サマリー

(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]

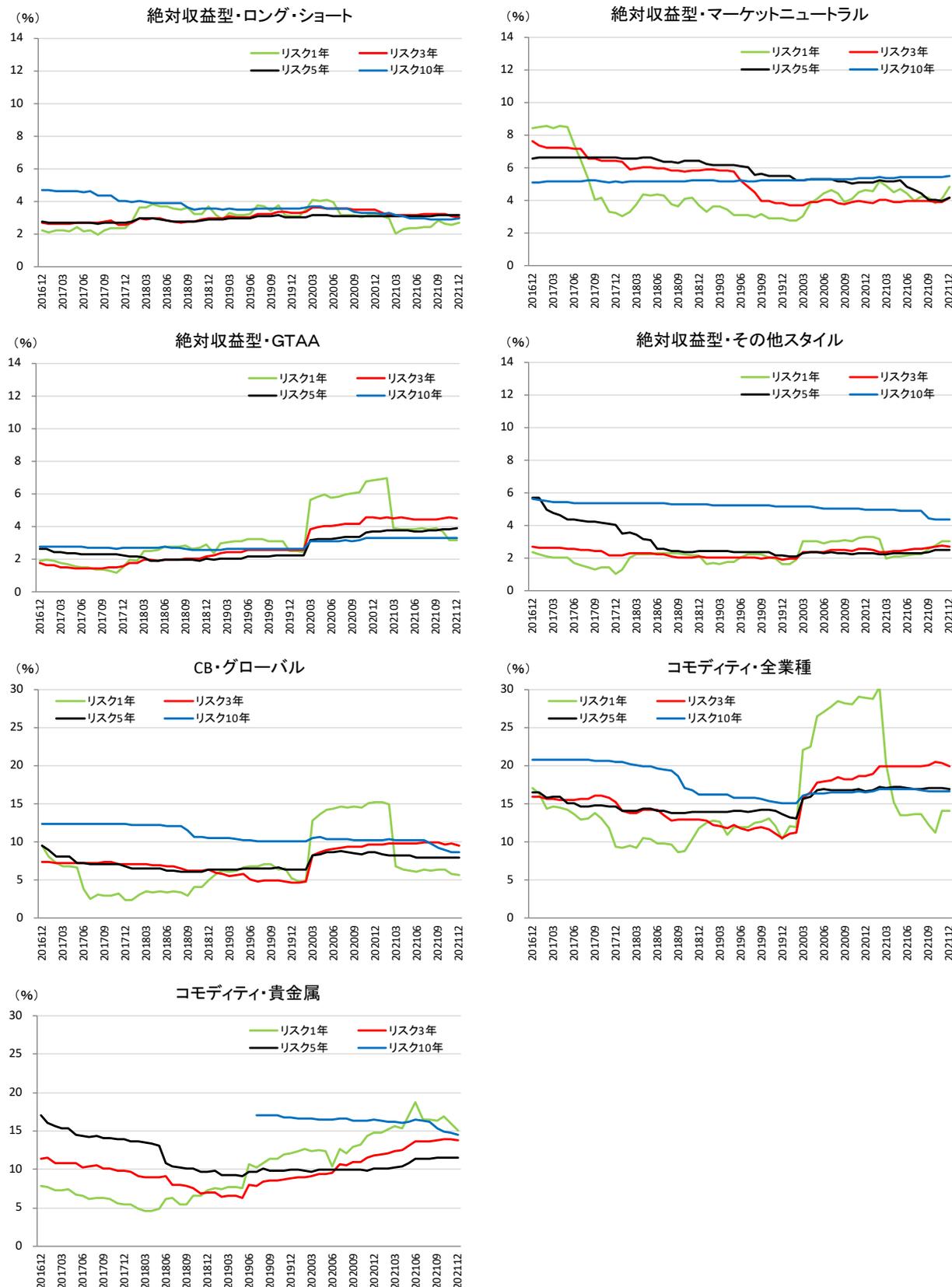


<2>リスク・サマリー

(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	12,655	29,800	53,799	96,128
国内株式	480	1,984	2,033	167
一般	330	746	548	-2,467
フリー	320	742	642	-1,619
バリュー	9	3	-94	-848
小型	-8	-93	-325	-852
その他	157	1,328	1,802	3,517
日経225	108	1,064	1,233	2,601
TOPIX	46	211	484	848
JPX日経400	8	29	32	11
国内債券	1,109	2,334	5,580	7,927
一般	1,109	2,334	5,580	7,927
外国株式(先進国)	10,160	22,790	41,594	84,255
グローバル	5,459	11,425	21,513	55,440
除く日本	1,143	2,802	4,916	10,942
含む日本	4,316	8,622	16,597	44,498
その他	4,700	11,365	20,080	28,815
北米	-2	0	1	-32
米国	4,751	11,738	20,596	30,039
カナダ	-4	-15	-28	-60
欧州	19	19	164	187
ドイツ	0	-1	-1	-12
イギリス	0	-1	-1	-2
アジア・オセアニア	1	-1	-3	-10
オーストラリア	-64	-374	-646	-1,293
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	0	0	-1	-2
エマージング株式	-291	-777	-1,462	-1,785
グローバル	15	23	191	596
BRICS	-4	-17	-32	-86
その他	-302	-784	-1,621	-2,295
欧州	-2	-11	-20	-36
ロシア	-13	-18	-25	-42
アジア・オセアニア	-95	-281	-485	-195
中国	-129	-325	-621	475
インド	-48	-128	-443	-2,106
インドネシア	-2	-4	-5	-13
タイ	0	-12	-13	-9
フィリピン	-3	-6	-8	-15
ベトナム	3	21	52	-251
韓国	0	0	0	0
香港	1	1	3	1
台湾	0	1	4	9
中南米	-1	-2	-4	-8
ブラジル	-12	-16	-46	-70
メキシコ	-1	-2	-4	-7
中東・アフリカ	1	1	-4	-14
トルコ	0	-1	-2	-12
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	12,655	29,800	53,799	96,128
外国債券(先進国)	182	1,449	2,374	2,209
グローバル	364	2,317	3,862	5,507
除く日本	207	541	991	-485
含む日本	157	1,776	2,871	5,992
その他	-182	-868	-1,487	-3,298
北米	-1	-3	-3	-3
米国	-38	-171	-328	-705
カナダ	-13	-60	-105	-242
欧州	-22	-114	-150	-262
イギリス	0	-1	-2	-6
アジア・オセアニア	-19	-79	-143	-333
オーストラリア	-77	-386	-656	-1,558
ニュージーランド	-1	-4	-8	-21
複合地域	-11	-47	-86	-150
エマージング債券	-189	-556	-1,051	-2,365
グローバル	-62	-178	-354	-830
米ドル建て	-49	-143	-297	-708
現地通貨建て	-13	-34	-57	-122
その他	-127	-378	-697	-1,535
ロシア	-3	-8	-16	-36
アジア・オセアニア	-8	-21	-31	-56
インド	-57	-189	-359	-852
インドネシア	-7	-25	-54	-106
ブラジル	-38	-86	-144	-289
メキシコ	-8	-25	-42	-92
トルコ	-1	-2	-3	-1
複合地域	0	-1	-2	-6
ハイイールド債券	-152	-514	-935	-2,230
グローバル	-13	-40	-51	-231
北米	-95	-354	-691	-1,571
その他	-44	-120	-192	-428
欧州	-38	-93	-150	-370
アジア・オセアニア	-6	-26	-40	-54
複合地域	0	-1	-2	-4
複合資産	955	2,543	5,206	7,345
安定	332	1,015	2,149	4,853
安定成長	430	1,079	2,283	3,233
成長	362	893	1,780	2,770
国内バランス	-94	-260	-544	-1,063
安定	-92	-251	-523	-995
一般	-3	-12	-24	-72
その他	-76	-184	-462	-2,448

<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	12,655	29,800	53,799	96,128
国内REIT	-74	-220	-702	-697
日本	-74	-220	-702	-697
外国REIT	-166	-995	-1,680	-3,002
グローバル	-38	-288	-622	-1,322
除く日本	37	79	103	292
含む日本	-75	-367	-724	-1,613
北米	-83	-507	-725	-1,193
その他	-45	-199	-333	-488
欧州	-2	-6	-13	-23
アジア・オセアニア	-31	-127	-196	-246
オーストラリア	-10	-54	-102	-176
複合地域	-1	-2	-3	1
複数国	-2	-9	-19	-43
その他	643	1,762	2,843	4,304
絶対収益型	351	863	1,545	2,158
ロング・ショート	24	38	45	18
マーケットニュートラル	-10	-55	-140	-221
GTAA	-2	7	12	-13
その他スタイル	336	869	1,616	2,347
CB	-26	-102	-206	-363
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-3
日本	-1	-3	-4	-9
グローバル	-25	-99	-200	-351
コモディティ	29	-2	126	389
全業種	4	-2	53	92
貴金属	26	14	106	407
エネルギー	0	-14	-33	-110
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	869,162	100.00	5,424	100.00
国内株式	104,365	12.01	853	15.73
一般	58,675	6.75	545	10.05
フリー	46,119	5.31	437	8.06
バリュー	12,556	1.44	108	1.99
小型	7,320	0.84	93	1.71
その他	37,628	4.33	209	3.85
日経225	18,724	2.15	67	1.24
TOPIX	15,744	1.81	81	1.49
JPX日経400	695	0.08	17	0.31
国内債券	42,522	4.89	140	2.58
一般	42,522	4.89	140	2.58
外国株式(先進国)	357,513	41.13	1,124	20.72
グローバル	257,726	29.65	766	14.12
除く日本	60,741	6.99	186	3.43
含む日本	196,985	22.66	580	10.69
その他	99,788	11.48	358	6.60
北米	187	0.02	9	0.17
米国	93,679	10.78	258	4.76
カナダ	199	0.02	2	0.04
欧州	1,864	0.21	48	0.88
ドイツ	17	0.00	1	0.02
イギリス	9	0.00	3	0.06
アジア・オセアニア	52	0.01	3	0.06
オーストラリア	3,759	0.43	32	0.59
ニュージーランド	15	0.00	1	0.02
複合地域	6	0.00	1	0.02
エマージング株式	29,554	3.40	335	6.18
グローバル	9,311	1.07	102	1.88
BRICS	603	0.07	7	0.13
その他	19,640	2.26	226	4.17
欧州	151	0.02	6	0.11
ロシア	97	0.01	4	0.07
アジア・オセアニア	5,942	0.68	100	1.84
中国	2,773	0.32	34	0.63
インド	8,532	0.98	28	0.52
インドネシア	134	0.02	4	0.07
タイ	31	0.00	3	0.06
フィリピン	43	0.00	5	0.09
ベトナム	1,192	0.14	11	0.20
韓国	6	0.00	1	0.02
香港	13	0.00	1	0.02
台湾	11	0.00	1	0.02
中南米	51	0.01	2	0.04
ブラジル	489	0.06	15	0.28
メキシコ	15	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	102	0.01	5	0.09
トルコ	38	0.00	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	869,162	100.00	5,424	100.00
外国債券(先進国)	82,252	9.46	798	14.71
グローバル	65,242	7.51	520	9.59
除く日本	31,112	3.58	226	4.17
含む日本	34,130	3.93	294	5.42
その他	17,011	1.96	278	5.13
北米	80	0.01	6	0.11
米国	5,368	0.62	156	2.88
カナダ	871	0.10	4	0.07
欧州	1,220	0.14	36	0.66
イギリス	21	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	1,734	0.20	11	0.20
オーストラリア	6,374	0.73	39	0.72
ニュージーランド	101	0.01	10	0.18
複合地域	1,242	0.14	8	0.15
エマージング債券	11,451	1.32	269	4.96
グローバル	6,319	0.73	188	3.47
米ドル建て	4,810	0.55	146	2.69
現地通貨建て	1,510	0.17	42	0.77
その他	5,132	0.59	81	1.49
ロシア	93	0.01	5	0.09
アジア・オセアニア	294	0.03	8	0.15
インド	2,398	0.28	17	0.31
インドネシア	337	0.04	9	0.17
ブラジル	1,477	0.17	22	0.41
メキシコ	283	0.03	7	0.13
トルコ	52	0.01	4	0.07
複合地域	37	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	16,614	1.91	256	4.72
グローバル	2,710	0.31	43	0.79
北米	11,603	1.33	149	2.75
その他	2,301	0.26	64	1.18
欧州	1,796	0.21	40	0.74
アジア・オセアニア	464	0.05	23	0.42
複合地域	41	0.00	1	0.02
複合資産	126,562	14.56	995	18.34
安定	37,518	4.32	280	5.16
安定成長	55,642	6.40	412	7.60
成長	20,083	2.31	254	4.68
国内バランス	8,869	1.02	32	0.59
安定	8,433	0.97	9	0.17
一般	339	0.04	18	0.33
その他	4,452	0.51	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	869,162	100.00	5,424	100.00
国内REIT	27,728	3.19	134	2.47
日本	27,728	3.19	134	2.47
外国REIT	49,852	5.74	291	5.37
グローバル	20,303	2.34	149	2.75
除く日本	6,116	0.70	61	1.12
含む日本	14,187	1.63	88	1.62
北米	25,803	2.97	83	1.53
その他	3,746	0.43	59	1.09
欧州	161	0.02	10	0.18
アジア・オセアニア	2,544	0.29	33	0.61
オーストラリア	685	0.08	12	0.22
複合地域	59	0.01	3	0.06
複数国	297	0.03	1	0.02
その他	20,749	2.39	229	4.22
絶対収益型	10,764	1.24	107	1.97
ロング・ショート	904	0.10	36	0.66
マーケットニュートラル	694	0.08	17	0.31
GTAA	405	0.05	12	0.22
その他スタイル	8,691	1.00	41	0.76
CB	1,247	0.14	31	0.57
アジア・オセアニア	36	0.00	1	0.02
日本	37	0.00	3	0.06
グローバル	1,173	0.13	27	0.50
コモディティ	3,879	0.45	34	0.63
全業種	1,443	0.17	14	0.26
貴金属	2,341	0.27	18	0.33
エネルギー	78	0.01	1	0.02
その他コモディティ	16	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	13,895	9.3	4.10	3.89	1.245
国内株式	17,968	12.7	1.34	1.32	1.077
一般	16,550	12.4	1.85	1.83	1.405
フリー	16,338	11.8	2.01	2.01	1.450
バリュー	17,407	15.1	1.27	1.21	1.240
小型	25,227	13.0	1.26	1.24	1.706
その他	18,414	12.9	0.43	0.40	0.433
日経225	20,145	14.9	0.46	0.44	0.500
TOPIX	19,090	14.1	0.14	0.13	0.277
JPX日経400	16,924	7.3	0.47	0.43	0.509
国内債券	10,915	11.2	0.21	0.21	0.397
一般	10,915	11.2	0.21	0.21	0.397
外国株式(先進国)	16,923	6.9	5.58	5.48	1.441
グローバル	17,597	6.8	3.95	4.10	1.477
除く日本	23,401	9.4	0.89	0.77	0.646
含む日本	15,736	6.0	4.96	5.19	1.733
その他	15,482	7.1	9.63	8.93	1.351
北米	16,336	7.8	14.10	12.78	1.747
米国	16,683	6.4	9.55	8.85	1.323
カナダ	6,624	10.8	8.84	7.84	1.991
欧州	14,207	10.5	6.78	6.18	1.659
ドイツ	13,625	7.8	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,317	5.4	13.34	12.32	1.896
アジア・オセアニア	9,187	11.1	9.00	9.02	1.670
オーストラリア	9,593	7.5	12.70	12.24	1.825
ニュージーランド	17,706	9.4	2.33	2.26	1.672
複合地域	8,546	8.7	0.00	0.00	1.705
エマージング株式	14,307	9.8	3.98	3.75	1.698
グローバル	13,359	7.5	0.68	0.63	1.178
BRICS	16,624	15.6	0.94	0.95	2.069
その他	14,664	10.6	5.62	5.30	1.934
欧州	11,241	15.5	0.51	0.42	1.963
ロシア	12,836	12.6	3.46	3.23	2.021
アジア・オセアニア	15,450	11.3	5.57	6.01	1.745
中国	17,765	7.7	3.37	3.89	1.942
インド	16,192	11.9	6.82	5.59	2.065
インドネシア	11,349	11.7	1.31	1.14	1.859
タイ	11,221	9.4	2.84	2.75	1.820
フィリピン	10,694	8.4	0.46	0.42	1.774
ベトナム	17,881	5.4	3.56	2.78	1.917
韓国	16,004	3.0	0.00	0.00	1.804
香港	13,630	12.3	1.55	1.61	0.858
台湾	12,567	9.1	38.22	38.20	1.661
中南米	6,983	15.0	0.00	0.00	2.040
ブラジル	4,499	11.2	6.53	9.00	1.931
メキシコ	9,364	8.8	0.00	0.00	1.907
中東・アフリカ	12,507	10.4	8.49	7.19	2.060
トルコ	6,500	20.4	0.00	0.00	2.035
複合地域	22,863	13.6	2.05	1.73	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	13,895	9.3	4.10	3.89	1.245
外国債券(先進国)	10,202	9.6	1.79	1.79	1.015
グローバル	10,821	9.6	1.29	1.32	0.943
除く日本	11,788	11.8	1.15	1.17	0.738
含む日本	10,077	7.9	1.44	1.48	1.131
その他	9,044	9.8	3.63	3.48	1.288
北米	10,674	7.7	2.21	2.18	1.782
米国	9,566	8.9	5.00	4.32	1.322
カナダ	7,072	10.9	1.76	1.66	1.378
欧州	8,544	11.3	1.48	1.47	1.126
イギリス	8,076	6.9	3.04	2.91	1.346
アジア・オセアニア	8,427	11.2	3.00	3.05	1.417
オーストラリア	8,342	12.7	3.66	3.82	1.254
ニュージーランド	9,566	7.5	1.64	1.72	1.366
複合地域	5,200	11.7	2.34	2.37	1.190
エマージング債券	8,760	10.2	5.08	5.31	1.532
グローバル	9,138	10.7	3.98	4.25	1.458
米ドル建て	9,321	11.0	4.05	4.31	1.554
現地通貨建て	8,501	9.6	3.74	4.07	1.150
その他	7,884	9.0	6.42	6.61	1.623
ロシア	7,923	8.9	6.87	7.06	1.601
アジア・オセアニア	9,510	9.9	6.31	6.75	1.635
インド	9,279	7.1	7.03	6.79	1.701
インドネシア	7,984	9.2	6.54	6.22	1.665
ブラジル	6,501	12.2	6.02	6.77	1.585
メキシコ	6,613	8.8	5.86	6.23	1.403
トルコ	1,787	8.8	7.88	14.60	1.457
複合地域	3,834	15.3	3.08	3.13	1.210
ハイイールド債券	9,288	10.8	6.50	6.32	1.674
グローバル	8,524	9.7	4.31	4.26	1.521
北米	10,394	11.8	6.43	5.94	1.692
その他	7,224	9.2	9.39	10.64	1.767
欧州	7,299	8.7	9.43	10.72	1.742
アジア・オセアニア	7,208	9.7	9.61	10.81	1.863
複合地域	4,602	17.8	5.37	5.22	1.800
複合資産	13,431	8.9	1.47	1.44	1.011
安定	11,937	8.6	1.11	1.08	1.147
安定成長	13,074	9.4	1.88	1.84	1.024
成長	15,895	8.9	0.57	0.53	0.799
国内バランス	12,058	9.6	2.36	2.38	0.938
安定	10,918	10.4	2.36	2.40	0.919
一般	12,836	10.5	1.98	1.91	1.332
その他	12,424	2.0	1.74	1.62	0.807

(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	13,895	9.3	4.10	3.89	1.245
国内REIT	14,600	9.1	9.62	9.44	0.931
日本	14,600	9.1	9.62	9.44	0.931
外国REIT	13,282	8.3	10.76	8.14	1.506
グローバル	14,597	8.3	6.01	4.74	1.308
除く日本	16,400	6.1	5.53	4.88	1.007
含む日本	13,347	9.8	6.22	4.68	1.438
北米	12,686	8.6	14.84	10.84	1.624
その他	10,803	7.8	8.18	7.85	1.764
欧州	8,239	7.9	4.28	4.03	1.824
アジア・オセアニア	11,989	7.5	10.15	10.00	1.811
オーストラリア	10,620	7.2	4.67	3.89	1.710
複合地域	6,595	9.9	1.19	0.96	0.807
複数国	12,123	17.7	2.83	1.98	1.650
その他					
絶対収益型	10,795	5.7	0.13	0.14	1.766
ロング・ショート	11,029	4.7	0.29	0.31	1.453
マーケットニュートラル	10,424	5.7	0.93	0.95	1.322
GTAA	11,755	8.1	1.18	1.20	1.512
その他スタイル	10,430	6.0	0.00	0.00	1.849
CB	13,223	9.0	6.66	7.92	1.399
アジア・オセアニア	10,148	11.5	2.73	2.36	1.823
日本	11,519	10.6	0.29	0.29	0.952
グローバル	13,526	8.7	6.99	8.33	1.400
コモディティ	10,298	6.4	0.27	0.21	0.987
全業種	8,235	9.3	0.73	0.56	1.421
貴金属	11,629	3.9	0.00	0.00	0.720
エネルギー	12,244	12.8	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	13,290	5.3	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