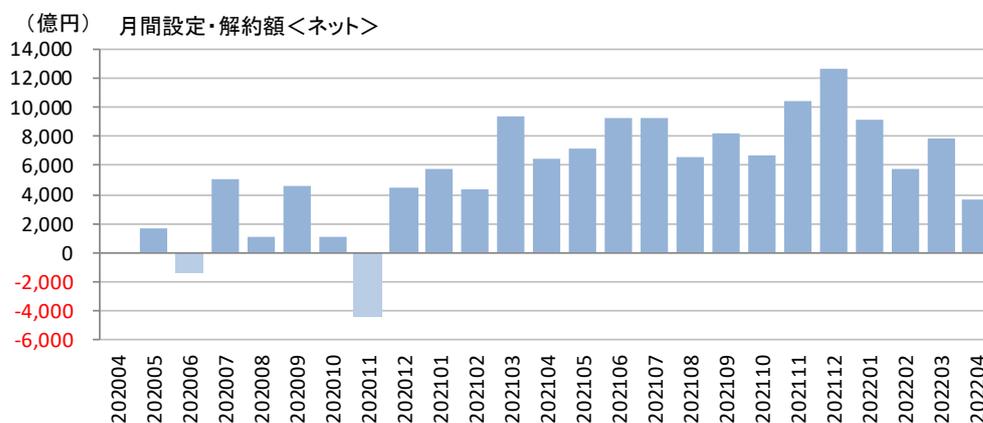
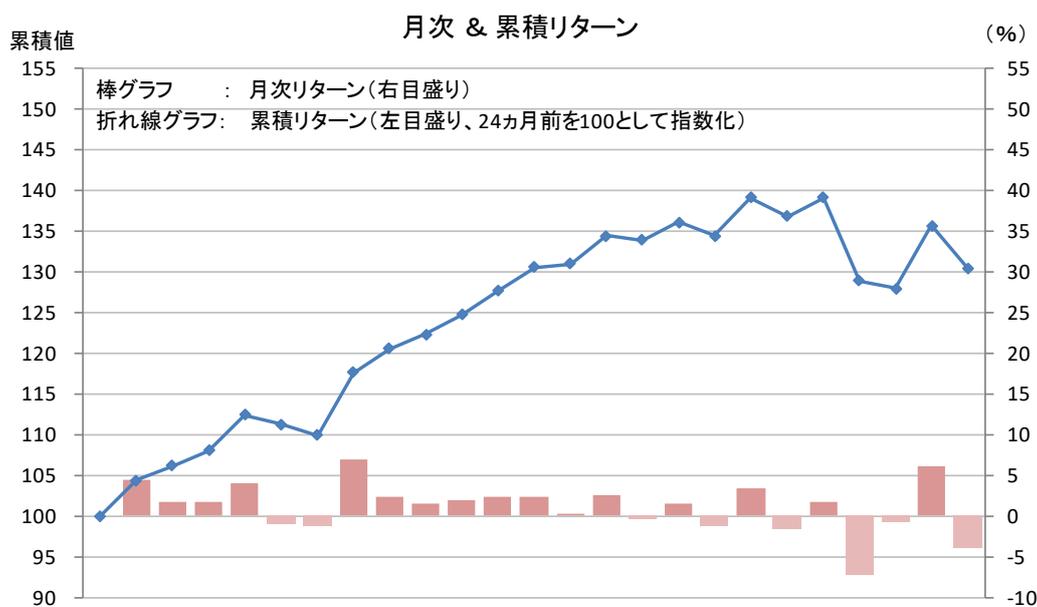


# 投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

## 2022年4月

「総合」 **-3.86 %**  
(前月 **+6.05 %**)



# MAB-FPI について

MAB-FPI とは日本の公募追加型株式投資信託全体の動向を表す指数で、弊社が独自に開発したものです。

(FPI は Fund Performance Index の略)

## ■主な特徴

- ・国内籍の公募追加型株式投資信託をユニバースとします（但し、ETF は除く）。
- ・月末に翌月の採用ファンドを選定します（月次リバランス）。
- ・総合および各カテゴリー別の日次収益率は、個々の投資信託の日次収益率を前日の純資産額によって加重した平均値として計算します。
- ・指数は算出開始時点（原則、1997年3月31日）を10,000（単位：ポイント）とし、各カテゴリーの日次収益率を乗じて算出します。
- ・カテゴリーは全体を表す「総合」のほかファンド分類別（大分類、中分類、小分類）、各種区分別（ヘッジ種別、アクティブ/パッシブ別、他）など、様々なサブ・カテゴリー指数を算出します。

詳細については『MAB 投信指数「MAB-FPI」算出要領』をご参照下さい。

## ■本レポートの内容

掲載対象カテゴリー：「総合」

|--- ファンド分類別「大分類」  
|--- " " 「中分類」  
|--- " " 「小分類」

なお、「中分類」と「小分類」の掲載対象は原則、直近5年以上指数算出が可能なカテゴリーからの抜粋

### <1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン	・ ・ ・ ・ ・	P. 3
(2) 期間別リターン	・ ・ ・ ・ ・	P. 6
(3) リターン推移	・ ・ ・ ・ ・	P. 9
(4) 対「総合」寄与度分析	・ ・ ・ ・ ・	P. 20

### <2>リスク・サマリー

・ ・ ・ ・ ・ P. 22

### <3>設定・解約額 [ネット金額]

・ ・ ・ ・ ・ P. 35

### <4>純資産額、ファンド本数

・ ・ ・ ・ ・ P. 38

### <5>属性、指標等

・ ・ ・ ・ ・ P. 41

## ＜1＞パフォーマンス・サマリー

## (1) 当月リターン

## 「総合」およびファンド分類別①

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		15,704	16,335	-631	-3.86
国内株式		19,046	19,737	-691	-3.50
一般		18,483	19,191	-708	-3.69
フリー		17,304	18,041	-737	-4.08
バリュー		24,062	24,629	-567	-2.30
小型		38,048	39,955	-1,907	-4.77
その他		18,971	19,552	-581	-2.97
日経225		18,176	18,840	-664	-3.53
TOPIX		18,627	19,088	-460	-2.41
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	17,615	18,068	-453	-2.51
国内債券		12,951	12,985	-34	-0.26
一般		12,951	12,985	-34	-0.26
外国株式(先進国)		20,414	22,039	-1,625	-7.37
グローバル		22,192	24,037	-1,845	-7.68
除く日本		34,253	35,971	-1,717	-4.77
含む日本		19,607	21,466	-1,859	-8.66
その他		16,692	17,883	-1,191	-6.66
北米		20,065	20,331	-266	-1.31
米国		25,842	27,761	-1,919	-6.91
カナダ	10,000 (2009.02.27)	21,917	22,729	-812	-3.57
欧州		22,797	23,762	-965	-4.06
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	10,154	10,826	-671	-6.20
イギリス	9,683 (2014.05.30)	10,368	10,535	-167	-1.59
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	38,414	39,773	-1,360	-3.42
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	20,612	21,030	-418	-1.99
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	46,116	47,667	-1,551	-3.25
複合地域	10,000 (2013.04.30)	13,096	12,935	161	1.25
エマージング株式		18,420	19,011	-592	-3.11
グローバル		17,952	18,797	-845	-4.50
BRICS	10,000 (2005.09.30)	23,000	24,732	-1,732	-7.00
その他		19,430	19,893	-463	-2.33
欧州		10,946	12,028	-1,081	-8.99
ロシア	10,000 (2007.03.30)	3,252	2,911	341	11.70
アジア・オセアニア		17,922	18,868	-946	-5.01
中国		39,029	42,472	-3,444	-8.11
インド	10,000 (2004.09.30)	49,183	48,591	593	1.22
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	17,108	15,777	1,332	8.44
タイ		22,909	22,809	100	0.44
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,264	8,215	49	0.60
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	25,211	26,284	-1,074	-4.08
韓国	10,000 (1997.06.30)	31,997	33,617	-1,621	-4.82
香港		20,372	21,649	-1,277	-5.90
台湾	10,000 (2008.03.31)	24,921	27,349	-2,427	-8.88
中南米	7,427 (2006.04.28)	9,693	10,340	-647	-6.25
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,123	9,685	-562	-5.80
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	12,118	12,599	-481	-3.82
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	14,670	14,656	15	0.10
トルコ		23,953	20,985	2,968	14.14
複合地域	10,000 (2005.08.31)	24,037	25,642	-1,605	-6.26

※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

## &lt;1&gt;パフォーマンス・サマリー

## (1) 当月リターン

## 「総合」およびファンド分類別②

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		15,704	16,335	-631	-3.86
外国債券(先進国)		18,606	18,757	-151	-0.81
グローバル		18,614	18,780	-165	-0.88
除く日本		20,296	20,447	-152	-0.74
含む日本		17,548	17,726	-179	-1.01
その他		18,796	18,896	-99	-0.53
北米	9,052 (2013.05.31)	10,755	10,851	-96	-0.89
米国		17,742	17,525	217	1.24
カナダ	10,000 (2003.05.30)	16,262	16,023	240	1.50
欧州	10,000 (1998.07.31)	14,487	14,795	-308	-2.08
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,557	10,631	-73	-0.69
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	20,803	21,134	-331	-1.57
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	25,706	26,101	-395	-1.51
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,330	11,676	-345	-2.96
複合地域	10,000 (2001.11.30)	18,752	18,963	-211	-1.11
エマージング債券		17,847	17,729	118	0.66
グローバル		18,012	18,232	-220	-1.21
米ドル建て		18,579	18,853	-275	-1.46
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,524	12,577	-54	-0.43
その他	8,647 (2005.03.31)	14,258	13,860	398	2.87
ロシア	10,000 (2008.05.30)	7,824	6,360	1,464	23.02
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	14,987	14,704	282	1.92
インド	10,000 (2011.08.31)	19,339	18,810	529	2.81
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	17,248	16,667	581	3.49
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	12,805	12,474	331	2.65
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	13,857	13,797	60	0.43
トルコ	10,000 (2011.04.28)	3,293	2,947	346	11.74
複合地域	10,000 (2006.08.31)	9,520	9,529	-9	-0.09
ハイイールド債券		24,892	24,772	120	0.49
グローバル	10,000 (1997.06.30)	23,682	23,873	-190	-0.80
北米		25,043	24,782	261	1.05
その他	10,000 (2004.03.31)	22,662	22,879	-217	-0.95
欧州	10,000 (2006.04.28)	22,958	23,366	-408	-1.75
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,053	13,743	311	2.26
複合地域	10,000 (2004.03.31)	22,049	22,206	-157	-0.71
複合資産		18,960	19,261	-301	-1.56
安定	10,000 (1998.10.30)	16,086	16,265	-179	-1.10
安定成長		20,801	21,132	-331	-1.56
成長		25,146	25,721	-575	-2.24
国内バランス		12,661	12,708	-47	-0.37
安定		12,887	12,928	-41	-0.32
一般		15,875	16,126	-251	-1.56
その他	10,000 (2018.10.31)	13,566	14,291	-725	-5.07

※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&gt; 総合

## &lt;1&gt;パフォーマンス・サマリー

## (1) 当月リターン

## 「総合」およびファンド分類別③

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		15,704	16,335	-631	-3.86
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	35,153	35,555	-402	-1.13
日本	10,000 (2003.10.31)	35,153	35,555	-402	-1.13
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	37,464	36,615	849	2.32
グローバル	10,000 (2004.01.30)	31,119	30,793	326	1.06
除く日本	10,000 (2004.04.30)	35,077	34,755	322	0.93
含む日本	10,000 (2004.01.30)	30,764	30,423	341	1.12
北米	10,000 (2003.09.30)	39,660	38,311	1,349	3.52
その他	10,000 (2004.04.30)	32,872	32,645	227	0.70
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,852	6,033	-182	-3.01
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	24,049	23,723	326	1.38
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	18,867	19,185	-318	-1.66
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,712	7,785	-72	-0.93
複数国	10,000 (2004.04.30)	50,046	48,791	1,255	2.57
その他		6,525	6,811	-285	-4.19
絶対収益型		7,755	7,862	-107	-1.37
ロング・ショート		8,365	8,303	62	0.74
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,291	11,532	-241	-2.09
GTAA		11,695	11,667	28	0.24
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,313	7,433	-120	-1.61
CB		20,514	21,264	-751	-3.53
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	20,767	20,405	362	1.77
日本		19,680	19,943	-262	-1.32
グローバル		35,891	37,300	-1,409	-3.78
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	12,161	11,768	393	3.34
全業種	10,000 (2004.12.30)	12,269	11,384	886	7.78
貴金属	10,000 (2009.07.31)	19,597	19,565	32	0.16
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	9,415	9,064	351	3.87
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	16,181	15,531	650	4.19

※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	1.14	-6.24	-0.14	-6.26
国内株式	0.27	-8.10	-2.71	-7.24
一般	0.15	-8.75	-2.40	-7.76
フリー	-0.15	-10.48	-3.96	-9.21
バリュー	1.18	-2.28	3.37	-2.41
小型	-0.08	-17.75	-11.56	-14.25
その他	0.54	-5.08	-1.52	-4.96
日経225	0.22	-6.32	-5.62	-6.07
TOPIX	1.29	-3.91	2.19	-3.61
JPX日経400	1.22	-3.90	2.07	-3.90
国内債券	-1.48	-2.09	-1.89	-2.15
一般	-1.48	-2.09	-1.89	-2.15
外国株式(先進国)	0.45	-11.60	-3.43	-11.31
グローバル	0.11	-13.48	-6.18	-11.97
除く日本	3.79	-1.08	10.21	-3.69
含む日本	-1.13	-17.10	-10.77	-14.53
その他	1.25	-6.52	4.48	-9.70
北米	9.11	10.72	22.49	6.95
米国	0.51	-7.14	4.14	-10.58
カナダ	6.29	2.19	12.58	4.60
欧州	-0.25	-6.73	1.61	-8.11
ドイツ	-5.23	-10.51	-7.56	-9.75
イギリス	5.83	9.51	15.73	6.31
アジア・オセアニア	0.06	-5.12	-5.27	-4.14
オーストラリア	21.30	9.83	18.38	11.85
ニュージーランド	11.86	-3.08	3.05	0.55
複合地域	26.67	38.07	72.69	40.38
エマーシング株式	-0.23	-5.03	0.50	-3.30
グローバル	-1.81	-8.07	-7.60	-5.60
BRICS	-14.85	-21.91	-18.52	-15.34
その他	1.02	-2.99	5.07	-1.79
欧州	-58.67	-66.13	-57.07	-61.74
ロシア	-72.46	-78.82	-72.73	-75.63
アジア・オセアニア	-2.10	-7.48	-10.36	-7.14
中国	-11.20	-19.87	-25.19	-17.30
インド	5.91	3.46	29.35	4.71
インドネシア	23.68	22.48	39.60	22.18
タイ	10.56	10.29	8.46	10.25
フィリピン	4.76	6.46	18.27	3.28
ベトナム	5.00	7.21	35.81	5.27
韓国	6.50	-10.38	-12.57	-10.07
香港	-5.90	-12.29	-19.12	-3.77
台湾	-10.26	-8.00	-2.35	-17.40
中南米	17.77	25.75	16.00	27.96
ブラジル	17.94	30.62	11.62	34.59
メキシコ	18.59	16.80	26.21	12.68
中東・アフリカ	15.94	17.59	32.60	16.10
トルコ	26.46	18.40	20.28	24.21
複合地域	-4.22	-10.22	-7.42	-9.33

※[色塗りの基準]期間別リターン&gt;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	1.14	-6.24	-0.14	-6.26
外国債券(先進国)	-0.25	-2.73	-1.03	-2.30
グローバル	-1.55	-3.59	-1.81	-3.19
除く日本	-0.32	-2.84	-0.87	-2.22
含む日本	-2.66	-4.27	-2.66	-4.07
その他	4.96	0.76	2.28	1.22
北米	-2.62	-4.35	-1.88	-4.50
米国	3.11	1.39	8.16	0.00
カナダ	6.52	3.77	6.50	5.60
欧州	-4.93	-6.61	-7.07	-6.26
イギリス	1.24	-1.44	1.06	-0.15
アジア・オセアニア	7.83	1.16	-0.08	2.88
オーストラリア	7.73	1.36	0.61	2.87
ニュージーランド	4.71	-2.88	-5.73	-0.75
複合地域	4.45	0.39	-0.93	0.67
エマージング債券	4.95	4.18	6.11	4.33
グローバル	-0.53	-3.97	-1.85	-2.15
米ドル建て	-0.59	-4.71	-2.08	-2.60
現地通貨建て	-0.35	-1.58	-1.16	-0.71
その他	11.77	14.78	16.41	12.56
ロシア	-20.11	-30.64	-23.49	-28.86
アジア・オセアニア	2.66	1.59	0.67	0.91
インド	7.50	8.62	14.86	6.64
インドネシア	9.23	8.87	20.37	8.35
ブラジル	23.70	36.24	26.44	30.04
メキシコ	9.02	8.98	10.05	7.97
トルコ	10.50	-20.69	-24.05	9.67
複合地域	-8.50	-11.91	-10.09	-11.96
ハイイールド債券	5.31	3.51	8.54	3.15
グローバル	2.63	0.61	3.10	0.82
北米	6.27	5.15	12.06	4.05
その他	3.53	-1.09	-1.24	1.33
欧州	3.70	-1.17	-0.14	1.58
アジア・オセアニア	2.99	-0.81	-5.53	0.52
複合地域	2.14	-0.66	2.31	-0.73
複合資産	0.03	-2.89	0.73	-3.38
安定	-1.21	-3.50	-1.21	-3.68
安定成長	0.77	-2.18	1.87	-2.76
成長	1.91	-1.84	4.00	-2.63
国内バランス	-0.28	-2.52	-1.99	-2.27
安定	-0.33	-2.49	-2.07	-2.27
一般	0.27	-4.07	-1.34	-3.55
その他	-6.93	-12.60	-6.41	-14.55

※[色塗りの基準]期間別リターン&gt;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	1.14	-6.24	-0.14	-6.26
国内REIT	2.83	-3.61	-1.39	-2.82
日本	2.83	-3.61	-1.39	-2.82
外国REIT	14.01	12.19	29.28	6.01
グローバル	12.64	10.15	25.58	5.23
除く日本	13.12	10.79	27.77	5.35
含む日本	12.42	9.88	24.68	5.18
北米	15.00	14.53	34.71	6.62
その他	14.37	7.33	15.12	5.71
欧州	0.69	-4.49	1.26	-3.05
アジア・オセアニア	14.51	8.37	13.64	7.09
オーストラリア	18.42	5.00	20.05	2.66
複合地域	12.86	9.89	16.68	7.96
複数国	12.51	9.99	25.81	5.25
その他	0.64	-5.10	-0.02	-5.43
絶対収益型	-0.98	-4.59	-1.98	-4.23
ロング・ショート	-1.57	-2.98	-2.83	-4.01
マーケットニュートラル	-4.22	-8.80	-7.65	-8.00
GTAA	0.81	-2.50	-0.03	-3.19
その他スタイル	-0.84	-4.62	-1.49	-4.09
CB	-1.38	-8.68	-6.50	-6.48
アジア・オセアニア	4.82	3.33	4.26	2.74
日本	-0.40	-3.35	-2.31	-2.83
グローバル	-1.61	-9.21	-6.98	-6.89
コモディティ	19.94	22.84	34.98	23.27
全業種	33.61	41.59	72.33	44.07
貴金属	10.49	10.51	13.52	9.87
エネルギー	34.27	47.00	93.18	48.48
その他コモディティ	29.46	31.59	51.93	34.48

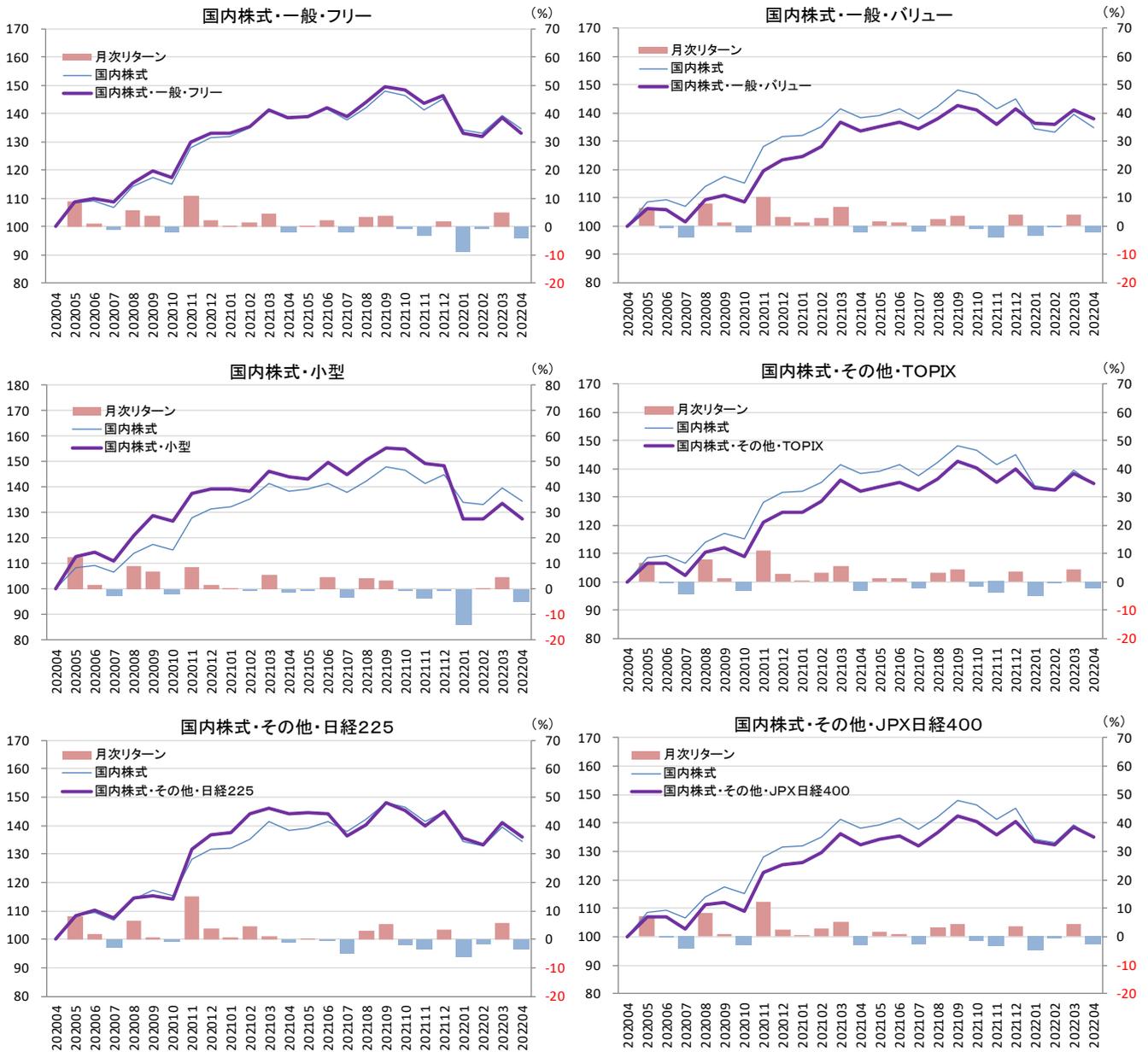
※[色塗りの基準]期間別リターン&gt;総合

<1>パフォーマンス・サマリー

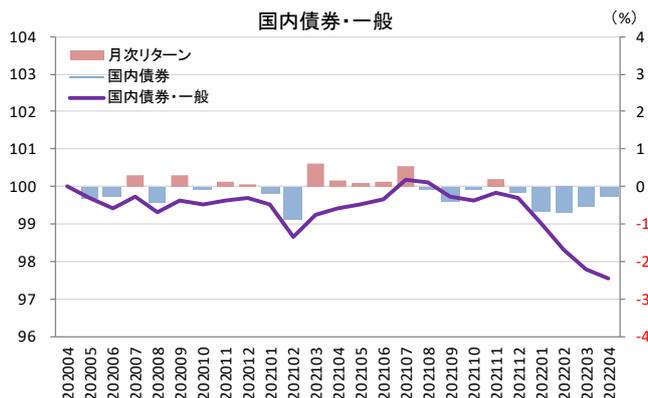
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

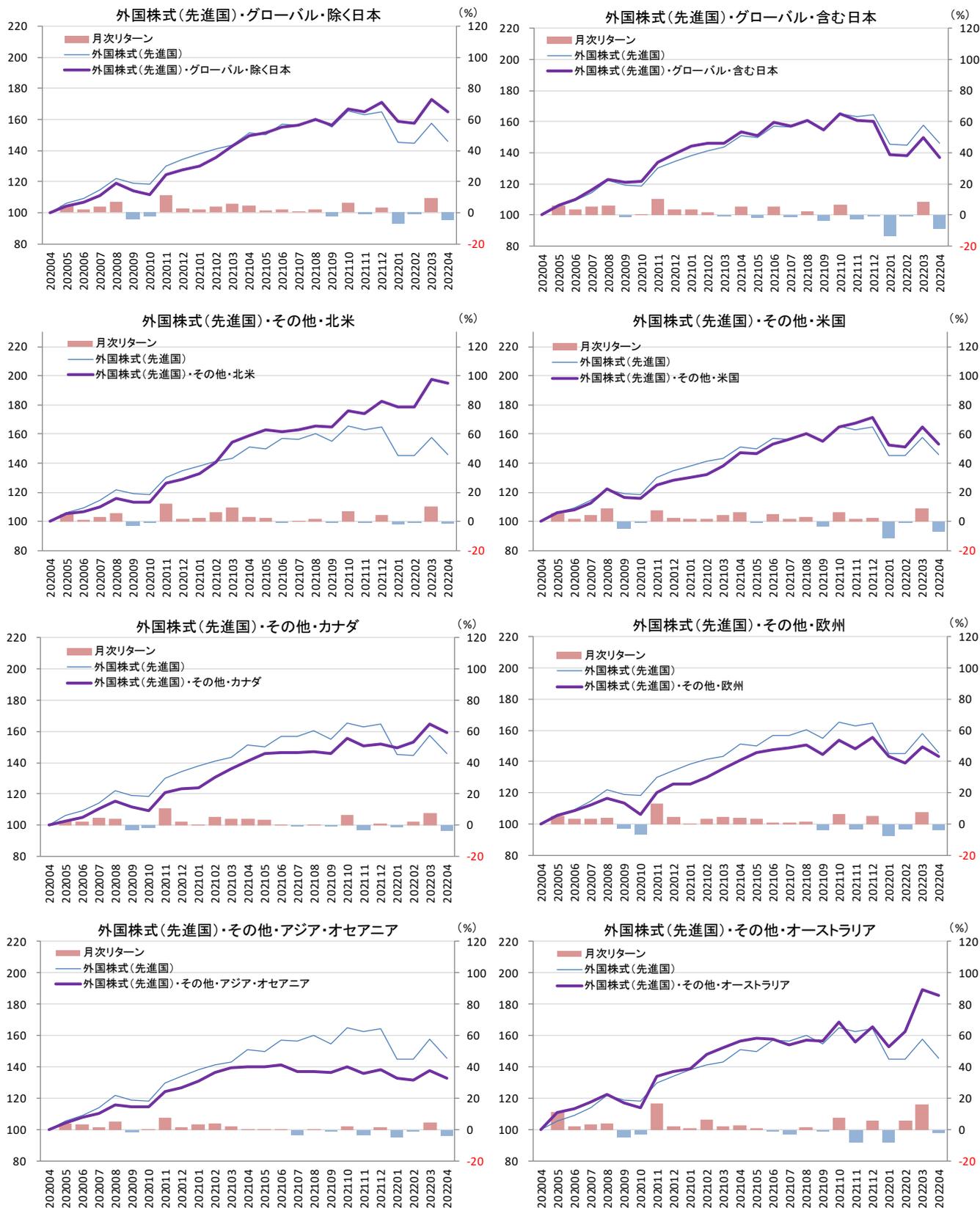


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

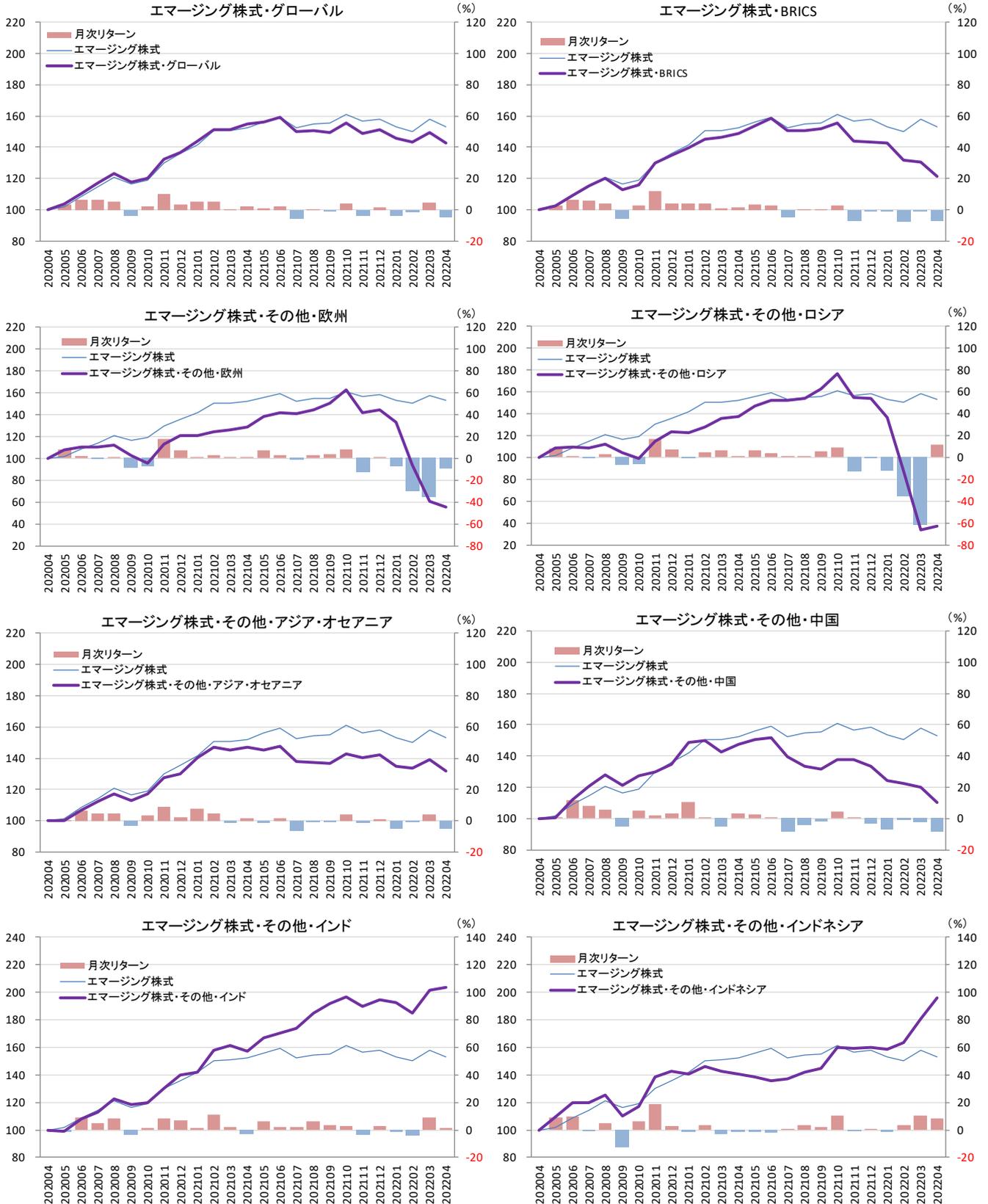


<1>パフォーマンス・サマリー

(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

[エマーシング株式]

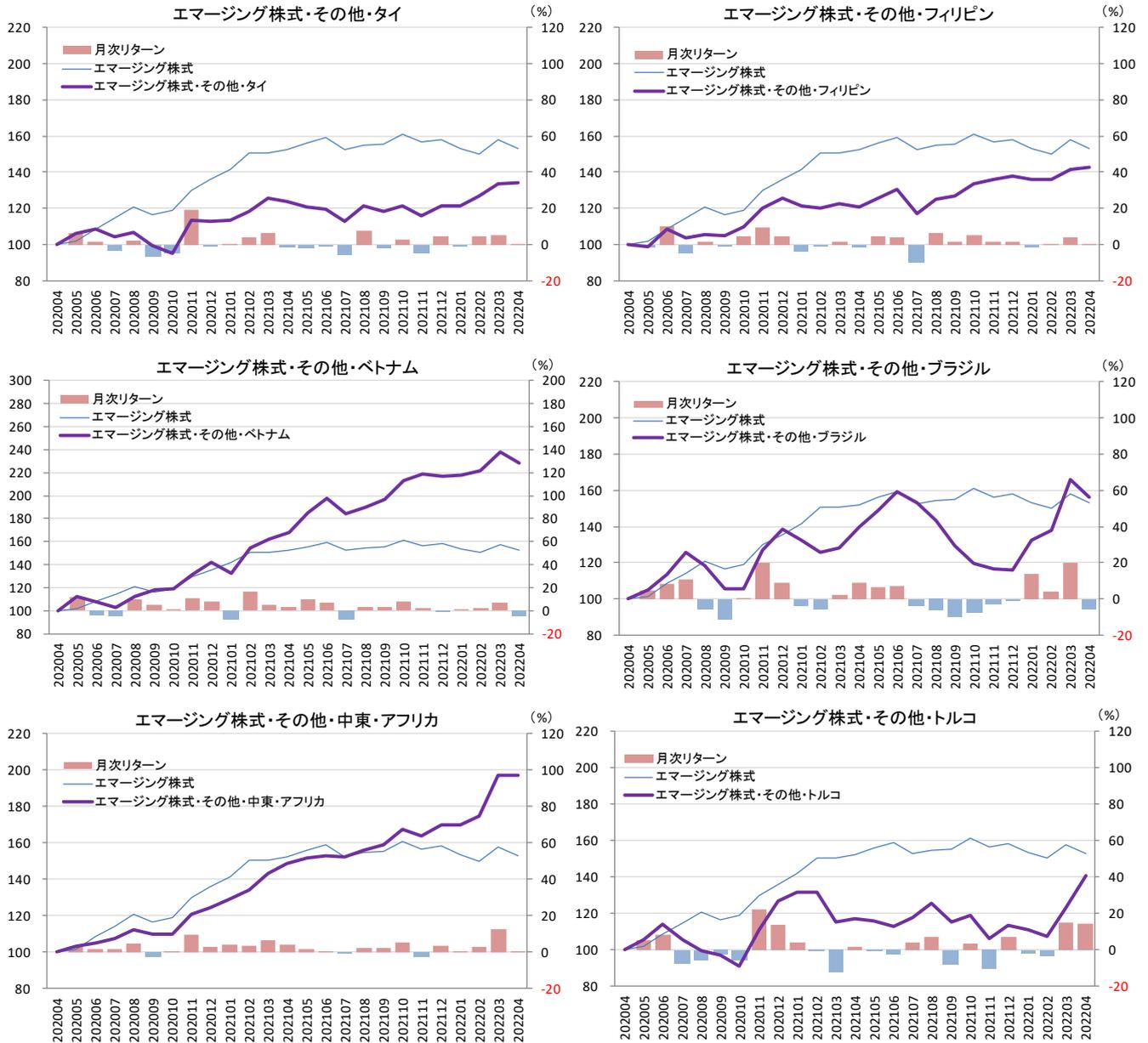


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

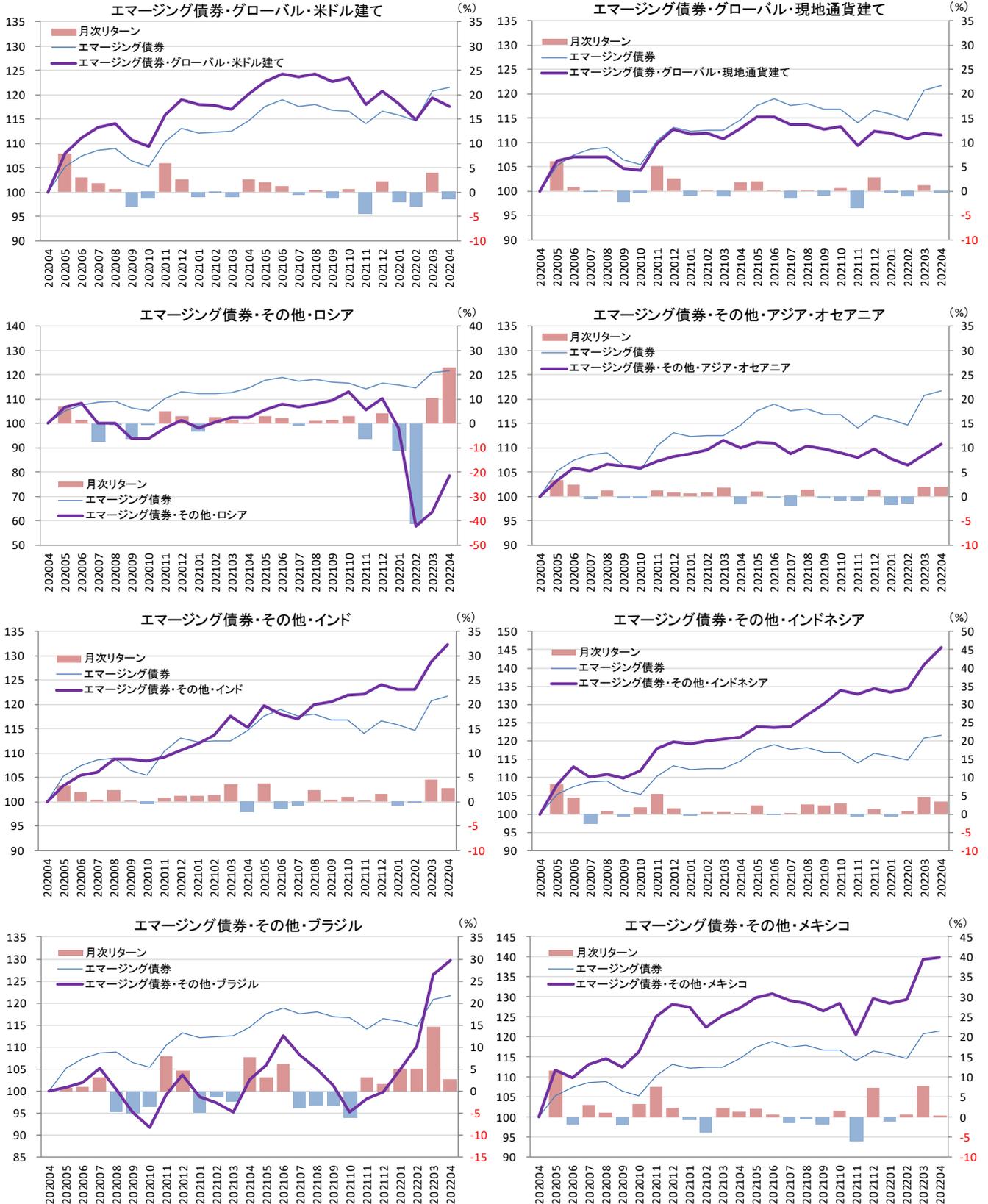


<1>パフォーマンス・サマリー

(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

[エマーシング債券]

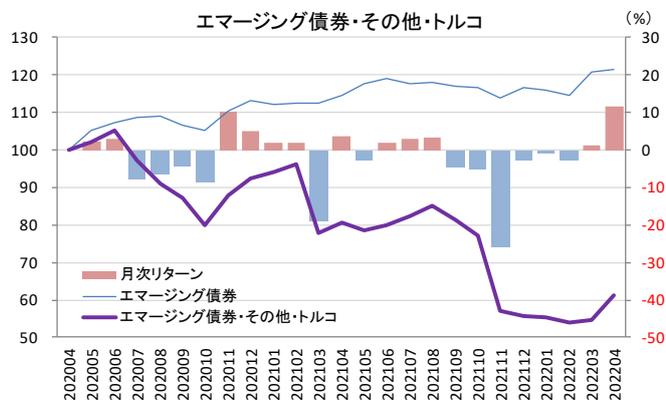


<1>パフォーマンス・サマリー

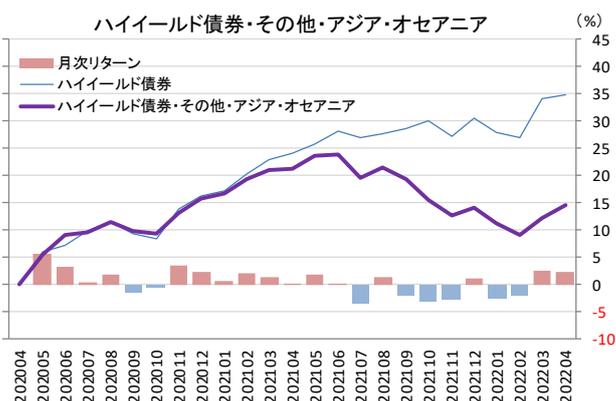
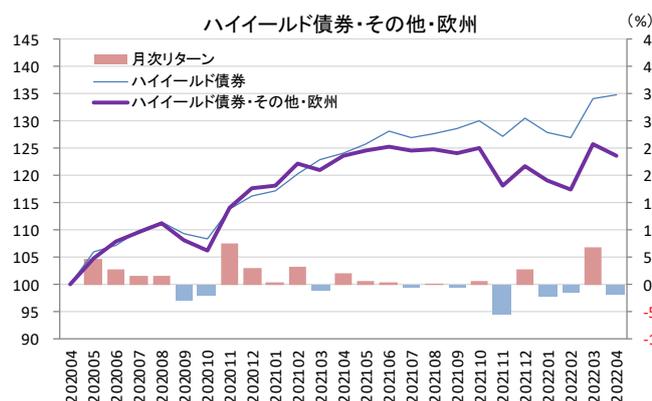
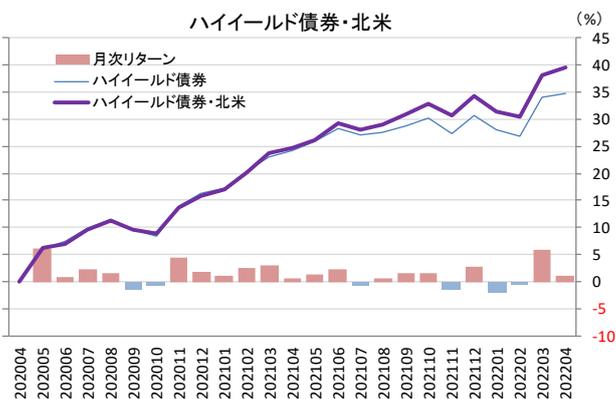
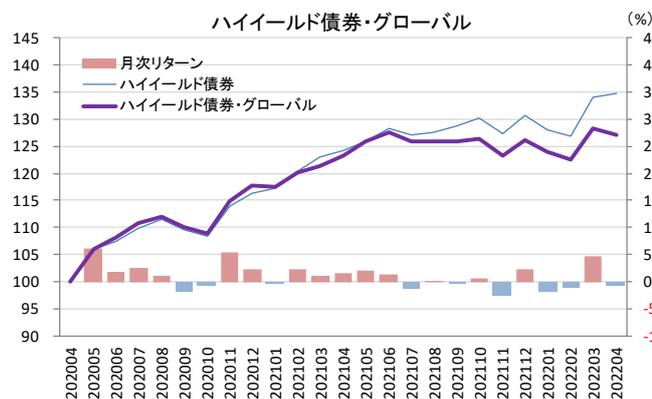
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

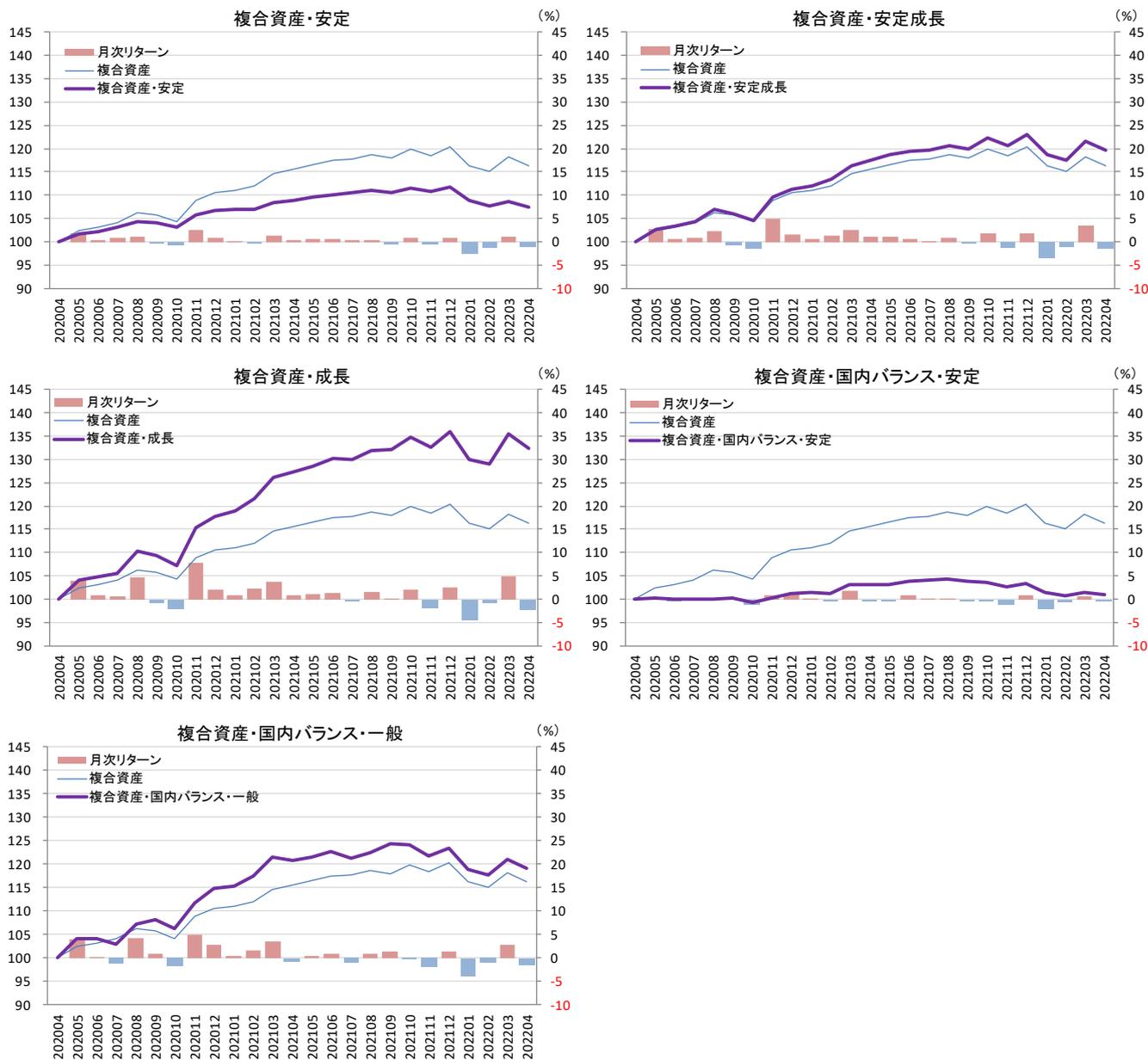


<1>パフォーマンス・サマリー

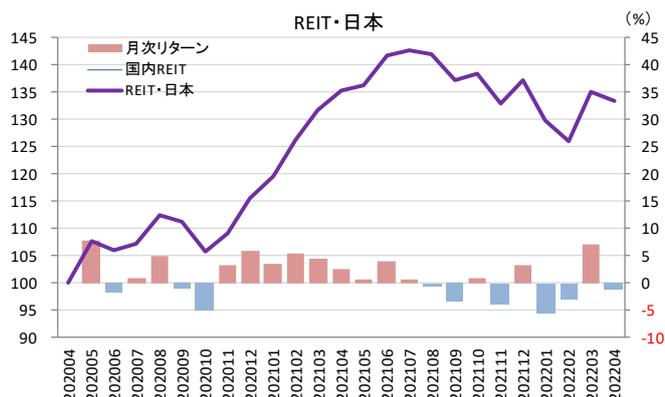
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

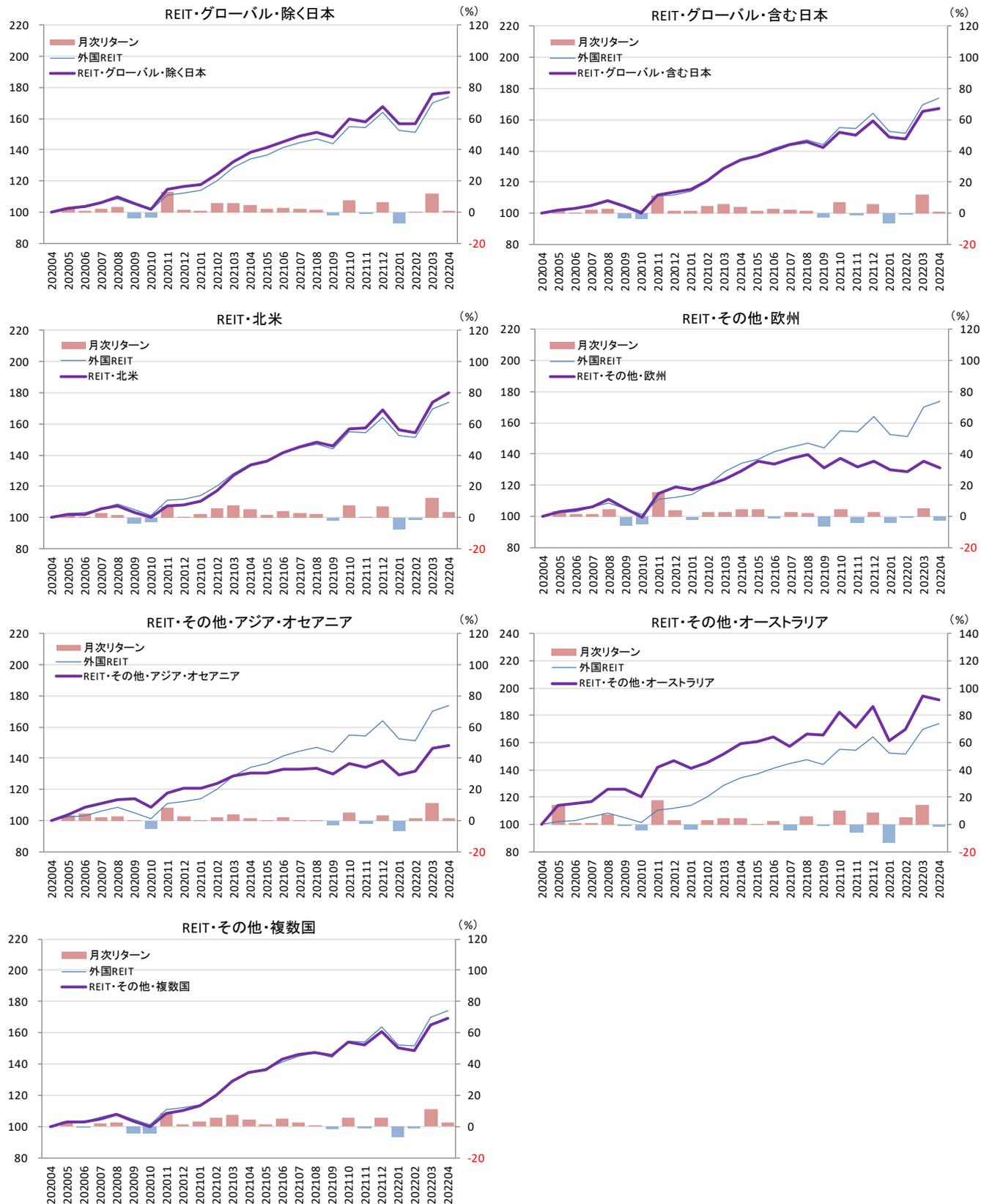


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24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]

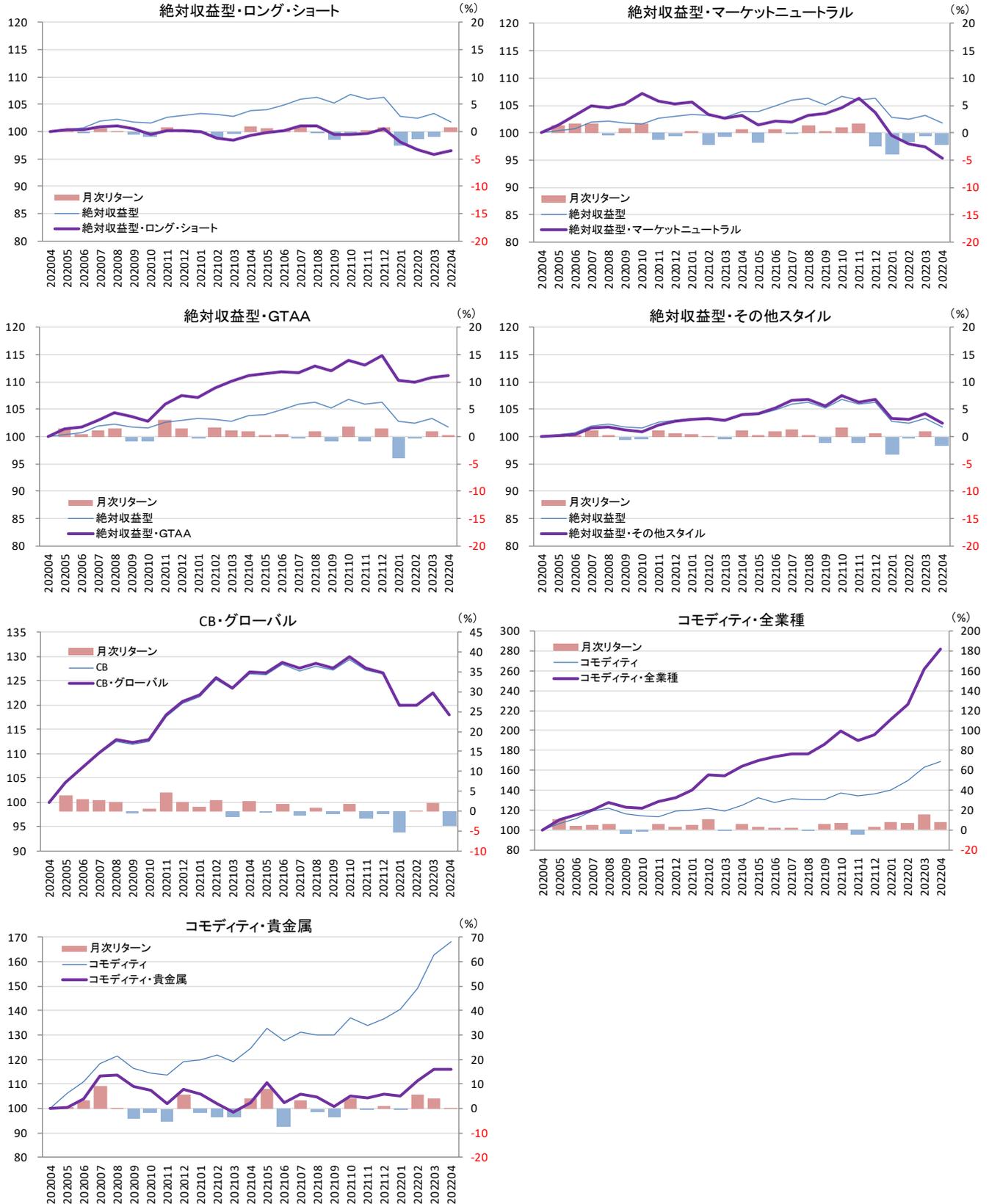


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	-3.86		
1	REIT・北米	3.52	3.13	0.10
2	REIT・グローバル	1.06	2.38	0.02
3	エマーヅング債券・その他	2.87	0.62	0.02
4	コモディティ	3.34	0.55	0.02
5	ハイイールド債券・北米	1.05	1.37	0.01
6	REIT・その他	0.70	0.43	0.00
7	ハイイールド債券・その他	-0.95	0.26	-0.00
8	ハイイールド債券・グローバル	-0.80	0.31	-0.00
9	複合資産・国内バランス	-0.37	0.98	-0.00
10	国内株式・業種特化	-5.34	0.08	-0.00
11	エマーヅング株式・BRICS	-7.00	0.06	-0.00
12	CB	-3.53	0.13	-0.00
13	エマーヅング債券・グローバル	-1.21	0.72	-0.01
14	外国債券(先進国)・その他	-0.53	1.94	-0.01
15	国内債券・一般	-0.26	4.93	-0.01
16	絶対収益型	-1.37	1.30	-0.02
17	複合資産・その他	-5.07	0.44	-0.02
18	国内株式・小型	-4.77	0.76	-0.04
19	REIT・日本	-1.13	3.16	-0.04
20	エマーヅング株式・グローバル	-4.50	1.08	-0.05
21	複合資産・安定	-1.10	4.55	-0.05
22	エマーヅング株式・その他	-2.33	2.22	-0.05
23	複合資産・成長	-2.24	2.50	-0.06
24	外国債券(先進国)・グローバル	-0.88	7.52	-0.06
25	複合資産・安定成長	-1.56	6.50	-0.10
26	ブルベア	-17.86	0.52	-0.10
27	国内株式・その他	-2.97	4.42	-0.13
28	国内株式・一般	-3.69	6.46	-0.24
29	外国株式(先進国)・その他	-6.66	12.13	-0.82
30	外国株式(先進国)・グローバル	-7.68	28.55	-2.21
	合計		100.00	-3.86

## ◆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	-0.14		
1	REIT・北米	34.71	2.94	0.83
2	REIT・グローバル	25.58	2.32	0.50
3	外国株式(先進国)・その他	4.48	10.49	0.35
4	ハイイールド債券・北米	12.06	1.43	0.15
5	コモディティ	34.98	0.48	0.14
6	複合資産・安定成長	1.87	6.54	0.12
7	エマージング株式・その他	5.07	2.45	0.11
8	エマージング債券・その他	16.41	0.67	0.10
9	複合資産・成長	4.00	2.31	0.09
10	REIT・その他	15.12	0.46	0.06
11	外国債券(先進国)・その他	2.28	2.14	0.05
12	ハイイールド債券・グローバル	3.10	0.33	0.01
13	国内株式・業種特化	-3.64	0.09	-0.00
14	ハイイールド債券・その他	-1.24	0.30	-0.01
15	CB	-6.50	0.17	-0.01
16	国内株式・その他	-1.52	4.43	-0.01
17	エマージング債券・グローバル	-1.85	0.80	-0.01
18	エマージング株式・BRICS	-18.52	0.08	-0.01
19	複合資産・国内バランス	-1.99	1.11	-0.02
20	複合資産・その他	-6.41	0.54	-0.02
21	REIT・日本	-1.39	3.45	-0.03
22	絶対収益型	-1.98	1.23	-0.03
23	複合資産・安定	-1.21	4.49	-0.07
24	国内株式・小型	-11.56	0.88	-0.09
25	エマージング株式・グローバル	-7.60	1.12	-0.10
26	国内債券・一般	-1.89	4.86	-0.11
27	ブルベア	-21.12	0.47	-0.12
28	国内株式・一般	-2.40	6.89	-0.13
29	外国債券(先進国)・グローバル	-1.81	7.66	-0.15
30	外国株式(先進国)・グローバル	-6.18	28.89	-1.73
	合計		100.00	-0.14

#### ◆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	21.62	30.92	99.63	12.62	11.09	↑	11.14	0.54	0.50	0.64		
国内株式	23.13	37.62	181.25	16.42	15.68		16.84	0.44	0.42	0.65		
一般	22.37	34.24	165.85	16.17	15.59		17.10	0.43	0.39	0.60		
フリー	21.93	34.52	166.74	16.48	15.95		17.66	0.42	0.39	0.58		
バリュー	23.29	32.34	168.14	15.77	14.81		15.86	0.46	0.39	0.65		
小型	15.63	41.89	258.45	20.65	19.41	↑	18.65	0.24	0.38	0.73		
その他	25.48	43.22	201.72	16.51	15.44		16.45	0.48	0.49	0.71		
日経225	25.68	49.48	218.71	17.78	16.45		16.94	0.45	0.51	0.73		
TOPIX	24.99	37.07	183.81	15.58	14.74		16.15	0.50	0.44	0.68		
JPX日経400	25.70	36.09	-	15.88	14.83		-	0.50	0.43	-		
国内債券	-2.24	-0.84	8.02	1.93	1.64		1.66	-0.37	-0.08	0.46		
一般	-2.24	-0.84	8.02	1.93	1.64		1.66	-0.37	-0.08	0.46		
外国株式(先進国)	40.28	61.68	175.46	19.18	↑	17.26	↑	16.23	0.62	0.59	0.66	
グローバル	38.53	61.43	184.64	19.33	↑	17.40	↑	16.23	0.60	0.58	0.68	
除く日本	51.68	78.65	259.18	18.99		17.24		16.95	0.79	0.72	0.80	
含む日本	34.62	56.44	166.42	19.83	↑	17.74	↑	16.25	0.53	0.53	0.63	
その他	44.34	62.32	157.57	19.21		17.24	↑	16.55	0.68	0.59	0.60	
北米	72.70	94.77	205.75	19.65		18.67		17.93	↓	1.02	0.77	0.66
米国	50.96	81.14	180.67	18.54		17.02	↑	16.72	0.80	0.74	0.65	
カナダ	31.94	37.04	47.69	20.92		18.40		16.42	0.46	0.36	0.24	
欧州	28.19	34.97	145.78	19.44		17.53		17.05	0.45	0.35	0.55	
ドイツ	17.14	15.25	-	23.85		21.42		-	0.23	0.14	-	
イギリス	10.05	12.81	-	19.62		17.32		-	0.17	0.14	-	
アジア・オセアニア	13.28	31.19	138.26	16.29		14.64		15.85	0.26	0.38	0.57	
オーストラリア	31.13	29.70	110.10	28.31		23.40		20.66	0.34	0.23	0.37	
ニュージーランド	35.94	78.85	-	20.62	↑	17.95	↑	-	0.52	0.69	-	
複合地域	38.24	34.14	-	37.79		31.83		-	0.30	0.19	-	
エマージング株式	24.46	35.84	102.39	20.51		17.87		17.60	0.37	0.36	0.41	
グローバル	24.78	40.30	82.37	19.65		17.68		17.55	0.39	0.40	0.35	
BRICS	-1.20	21.01	75.85	23.59		20.64		20.39	-0.02	0.19	0.28	
その他	25.90	35.42	113.64	21.08		18.31		17.82	0.38	0.34	0.44	
欧州	-54.99	-50.99	-41.75	39.05	↑	31.96	↑	27.72	↑	-0.60	-0.41	-0.19
ロシア	-65.74	-59.78	-51.31	50.53	↑	40.71	↑	34.45	↑	-0.59	-0.41	-0.20
アジア・オセアニア	11.99	23.23	94.79	18.95		17.00		16.65	0.20	0.25	0.41	
中国	17.02	48.58	173.24	19.51		19.27		21.33	0.28	0.43	0.50	
インド	50.00	55.73	232.37	26.05		23.07		23.63	0.56	0.40	0.54	
インドネシア	18.76	19.83	49.42	31.16		26.38		24.74	0.19	0.14	0.17	
タイ	-4.08	9.30	50.85	24.69		21.11		18.77	-0.05	0.09	0.22	
フィリピン	-2.51	-3.93	65.03	22.65		19.58		19.68	-0.04	-0.04	0.26	
ベトナム	65.54	99.44	248.19	28.57		25.40		21.56	0.64	0.58	0.62	
韓国	44.23	35.71	74.30	25.95	↑	22.62	↑	19.28	0.50	0.28	0.30	
香港	-17.72	3.28	41.92	19.76		18.36		18.72	-0.32	0.04	0.19	
台湾	56.31	67.76	228.98	21.35		20.17	↑	17.95	0.75	0.54	0.70	
中南米	16.46	29.52	25.79	33.98		29.73		26.31	0.15	0.18	0.09	
ブラジル	-3.12	8.35	-12.33	36.93		33.95		31.92	-0.03	0.05	-0.04	
メキシコ	25.32	14.62	-	31.56		28.15		-	0.25	0.10	-	
中東・アフリカ	47.65	65.99	147.29	20.60		17.62		16.96	0.68	0.61	0.56	
トルコ	23.76	-21.79	-13.95	33.01		34.05		31.07	0.22	-0.14	-0.05	
複合地域	14.60	18.75	82.39	19.04		16.87		16.12	0.25	0.21	0.38	

※[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	21.62	30.92	99.63	12.62	11.09 ↑	11.14	0.54	0.50	0.64
外国債券(先進国)	5.81	8.42	33.53	4.78 ↑	4.33	6.52	0.40	0.39	0.45
グローバル	4.46	7.27	34.93	3.95 ↑	3.60	5.86	0.38	0.40	0.52
除く日本	6.91	10.51	38.51	3.76 ↑	3.75	6.46	0.61	0.55	0.51
含む日本	1.95	3.81	31.31	4.75	3.97	5.40	0.14	0.20	0.51
その他	11.30	13.19	34.59	8.26 ↑	7.30	8.55	0.44	0.35	0.35
北米	5.15	5.19	-	5.36 ↑	4.32	-	0.32	0.25	-
米国	14.02	16.83	60.34	7.96	6.63	6.70	0.57	0.48	0.72
カナダ	17.04	19.99	25.89	7.45 ↑	7.33	8.84	0.73	0.51	0.26
欧州	-5.03	1.17	33.22	4.41 ↑	4.64	7.84	-0.38	0.06	0.37
イギリス	9.28	9.69	-	8.22	7.78	-	0.37	0.25	-
アジア・オセアニア	11.36	12.25	32.69	10.97 ↑	9.60	10.14	0.34	0.25	0.28
オーストラリア	11.74	12.28	31.18	10.99 ↑	9.64	10.16	0.35	0.25	0.27
ニュージーランド	3.34	9.08	-	9.77 ↑	9.28 ↑	-	0.12	0.19	-
複合地域	14.04	19.80	40.26	5.79 ↑	5.48	8.13	0.78	0.68	0.42
エマージング債券	6.07	4.26	31.25	12.09	10.67	11.76	0.17	0.08	0.23
グローバル	0.01	-2.79	23.25	13.84	12.14	12.23	0.00	-0.04	0.17
米ドル建て	-0.28	-2.99	25.10	14.54	12.64	12.56	-0.00	-0.04	0.18
現地通貨建て	1.17	-1.65	15.12	11.68	10.81	11.40	0.04	-0.03	0.12
その他	14.34	13.39	39.55	11.27 ↑	10.04 ↑	12.35	0.41	0.26	0.27
ロシア	-25.31	-25.30	-16.28	34.37 ↑	28.01 ↑	26.73 ↑	-0.27	-0.20	-0.07
アジア・オセアニア	6.80	10.54	55.41	7.47	6.30	7.97	0.30	0.33	0.57
インド	23.40	24.69	102.91	8.90	8.53	12.08	0.82	0.53	0.61
インドネシア	33.03	31.65	43.76	15.54	13.96	15.66	0.64	0.41	0.24
ブラジル	0.83	-2.46	25.07	20.27 ↑	19.12 ↑	18.69	0.02	-0.02	0.12
メキシコ	21.21	31.48	45.62	18.37	16.98	16.17	0.36	0.33	0.24
トルコ	-26.59	-60.49	-64.11	27.88	33.12	26.33	-0.35	-0.51	-0.37
複合地域	-11.67	-3.23	0.77	13.66	12.06	13.05	-0.29	-0.05	0.01
ハイイールド債券	14.74	17.63	79.42	12.99	11.06	11.23	0.36	0.30	0.54
グローバル	7.78	10.17	61.24	13.11	11.11	11.38	0.20	0.18	0.43
北米	18.84	23.30	93.25	12.70	10.92	11.08	0.47	0.40	0.61
その他	4.03	3.26	55.65	14.71	12.50	12.39 ↓	0.09	0.05	0.36
欧州	5.40	4.15	63.28	15.53	13.35	13.34 ↓	0.12	0.06	0.38
アジア・オセアニア	-2.20	-0.63	51.25	13.12	10.81	10.80	-0.05	-0.01	0.39
複合地域	15.11	23.13	94.28	9.74 ↑	8.46	9.88	0.50	0.51	0.70
複合資産	11.86	18.25	80.12	7.43	6.69	8.15	0.52	0.52	0.74
安定	5.53	9.29	56.06	4.92	4.55	6.48	0.37	0.40	0.70
安定成長	14.79	22.09	87.62	8.05	7.25	8.55	0.59	0.57	0.76
成長	25.15	36.94	134.98	11.29	10.50	11.21	0.69	0.62	0.80
国内バランス	-2.07	1.78	31.95	4.38	3.76	6.03	-0.15	0.11	0.47
安定	-2.86	0.28	24.69	4.25	3.56	3.35	-0.22	0.03	0.66
一般	14.09	22.96	67.33	8.57	8.26	9.58	0.53	0.52	0.55

※[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	21.62	30.92	99.63	12.62	11.09 ↑	11.14	0.54	0.50	0.64
国内REIT	14.92	33.33	179.33	18.00	14.62	16.58	0.27	0.41	0.65
日本	14.92	33.33	179.33	18.00	14.62	16.58	0.27	0.41	0.65
外国REIT	43.34	59.01	193.36	19.80	17.22	16.08	0.65	0.57	0.71
グローバル	35.44	48.28	164.69	20.96	17.92	16.36	0.51	0.46	0.62
除く日本	42.70	62.19	203.98	21.68	18.44	16.67	0.58	0.55	0.71
含む日本	33.07	45.00	157.78	20.73	17.75	16.27	0.48	0.44	0.61
北米	53.62	70.87	222.05	18.93 ↑	17.01	16.26	0.81	0.67	0.76
その他	22.48	44.34	171.61	22.16	18.26	16.24	0.32	0.42	0.65
欧州	3.31	10.00	77.29	21.50	18.47	18.53	0.05	0.11	0.32
アジア・オセアニア	20.56	49.31	186.95	20.19	16.95	15.93	0.32	0.50	0.70
オーストラリア	25.05	35.17	152.18	34.55	27.69	22.86	0.22	0.23	0.42
複合地域	6.43	6.64	98.56	29.41	24.32	20.88	0.07	0.05	0.34
複数国	46.93	69.50	264.11	18.51	15.95	15.06	0.74	0.70	0.92
その他									
絶対収益型	0.41	0.32	2.01	3.35 ↑	2.94 ↑	2.92	0.05	0.04	0.07
ロング・ショート	-5.96	-6.34	-8.41	3.37	3.38	3.05	-0.59	-0.37	-0.29
マーケットニュートラル	-6.23	-2.39	30.39	4.91 ↑	4.58 ↑	5.76	-0.43	-0.10	0.47
GTAA	10.31	11.31	20.57	5.11	4.32	3.46	0.66	0.51	0.54
その他スタイル	1.40	-0.45	4.04	3.54 ↑	3.03 ↑	3.91 ↓	0.14	-0.02	0.10
CB	10.38	12.01	47.24	10.10 ↑	8.37 ↑	8.19	0.33	0.28	0.48
アジア・オセアニア	32.94	45.76	130.60	13.81	11.69	11.74	0.72	0.67	0.74
日本	-1.26	-1.64	40.80	5.47	5.31	6.33	-0.07	-0.05	0.55
グローバル	10.19	11.81	45.79	10.36 ↑	8.56 ↑	8.27	0.32	0.27	0.46
コモディティ	58.92	62.31	18.78	12.96 ↑	11.17	13.41	1.29	0.91	0.13
全業種	79.83	87.82	39.06	22.42 ↑	18.71 ↑	17.49	0.97	0.72	0.19
貴金属	48.82	44.03	15.72	14.05	11.72	13.65 ↓	1.01	0.65	0.11
エネルギー	77.05	133.14	17.73	41.86	36.24	31.53	0.50	0.51	0.05
その他コモディティ	54.53	56.31	45.20	22.29 ↑	19.02	17.89	0.70	0.49	0.21

※[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

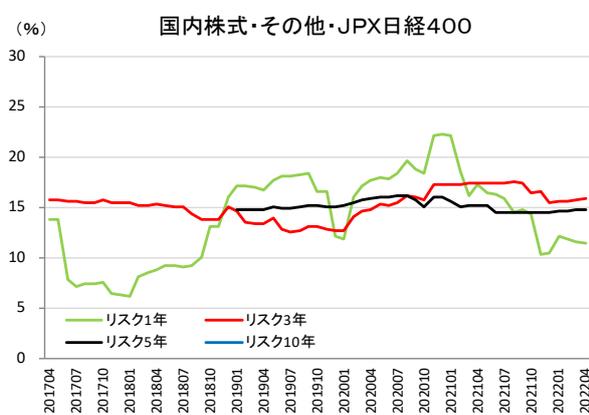
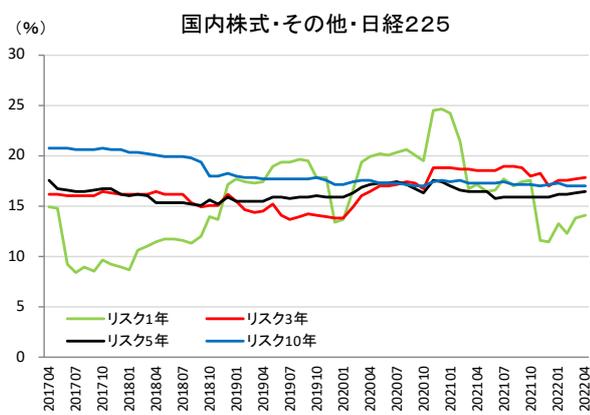
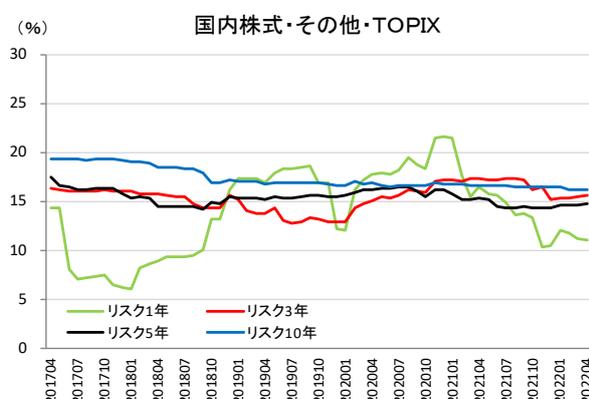
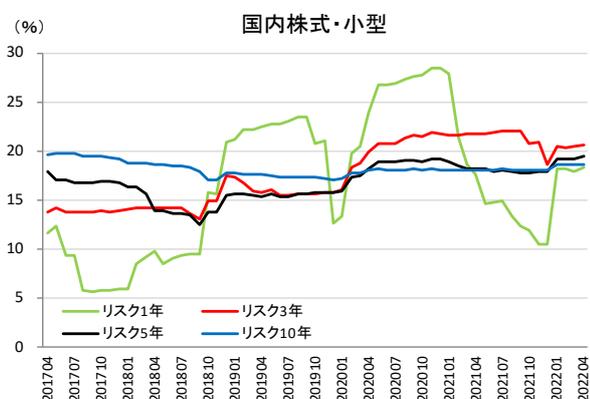
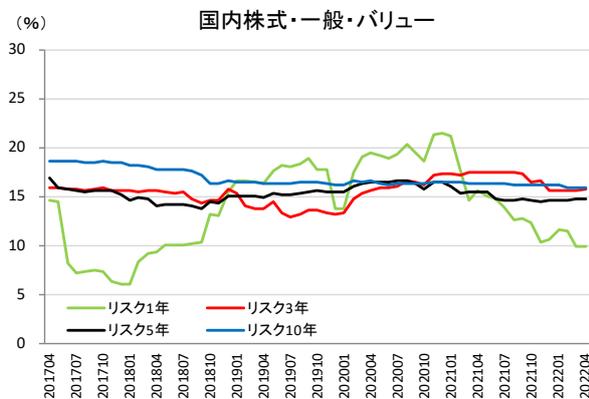
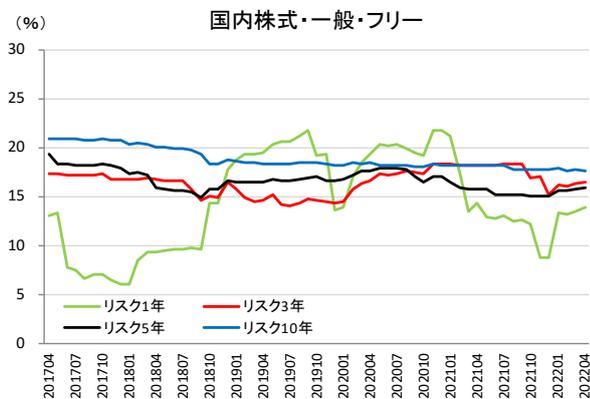
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2>リスク・サマリー

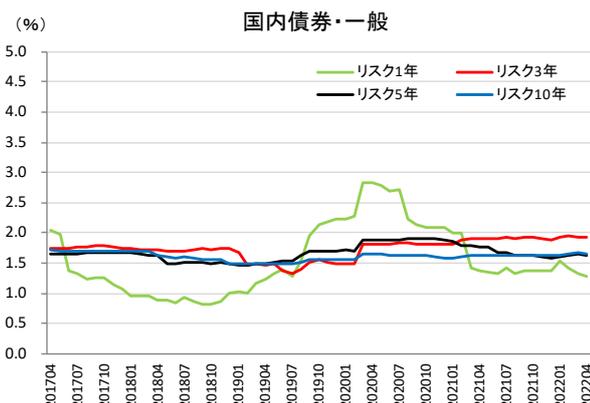
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

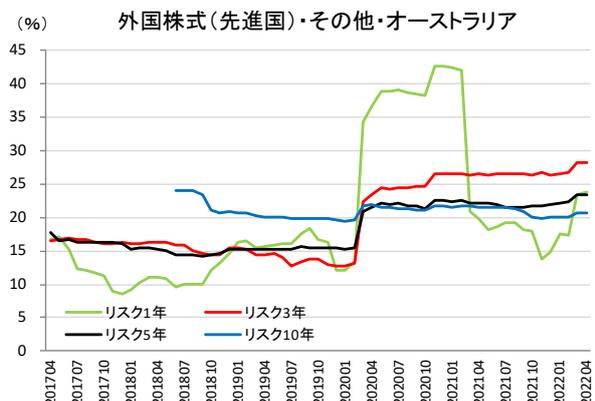
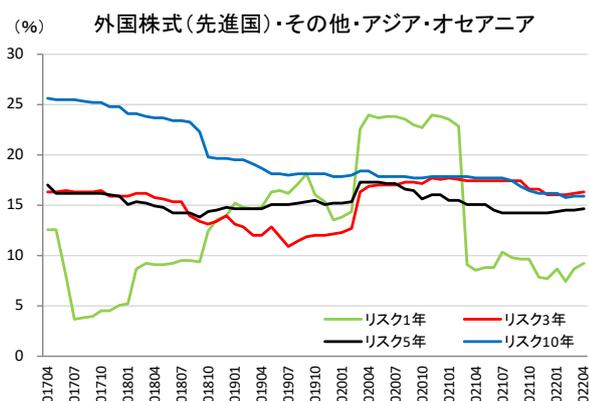
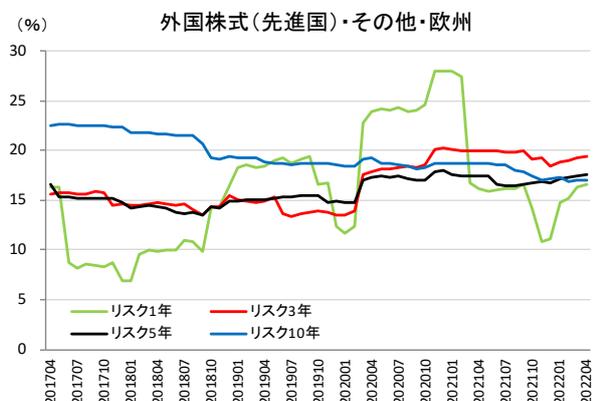
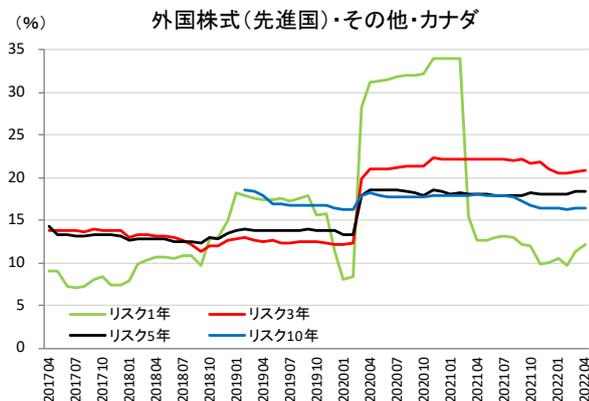
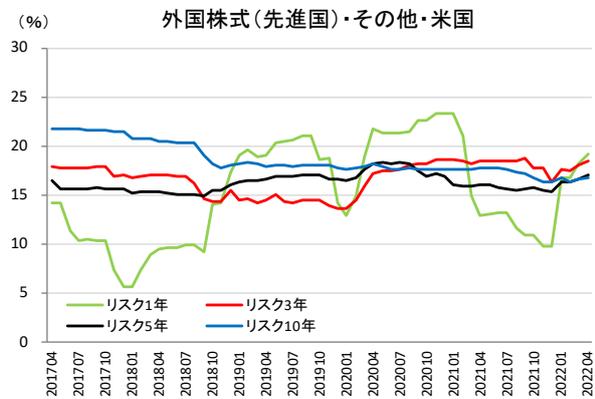
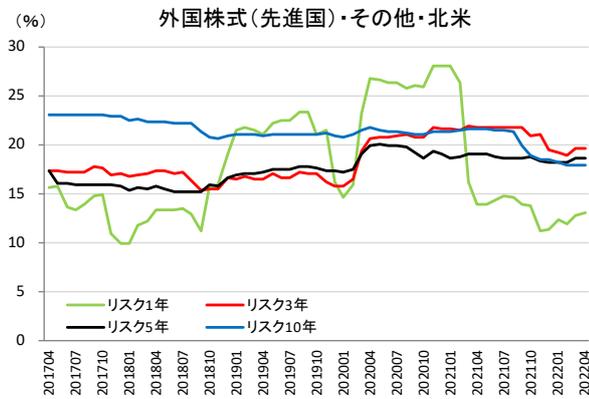
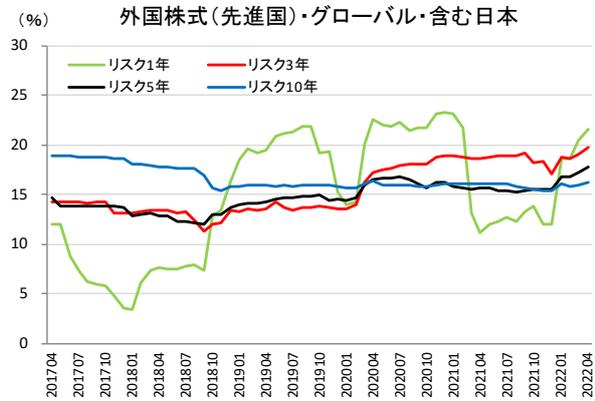
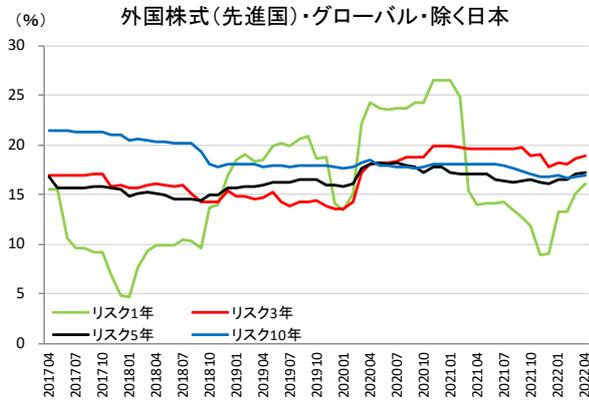


<2> リスク・サマリー

(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)]

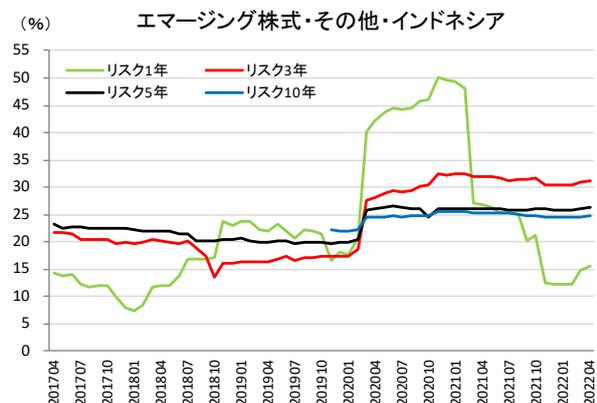
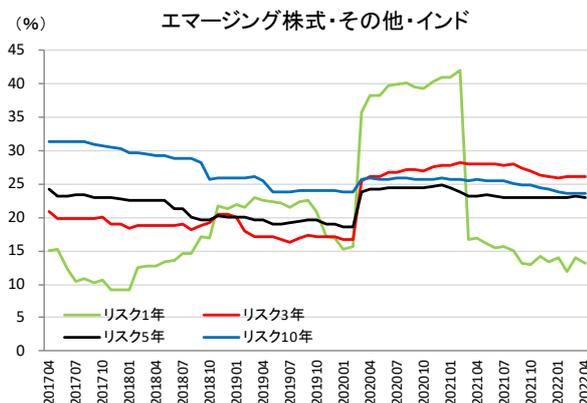
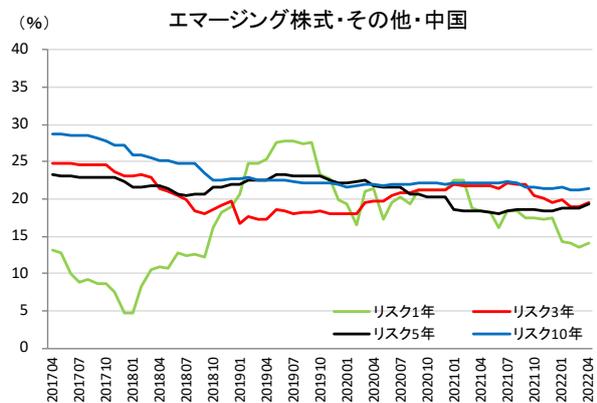
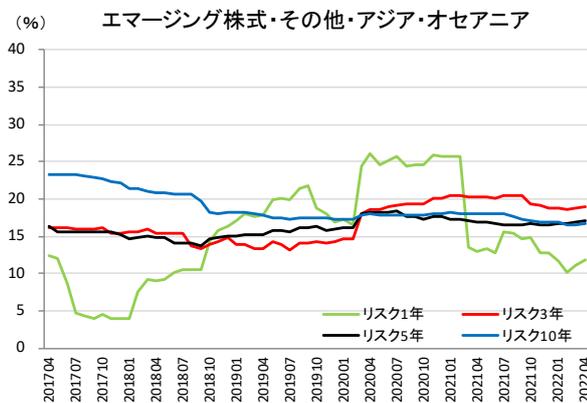
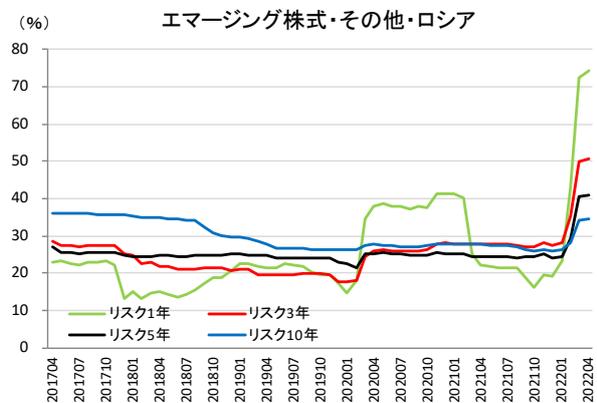
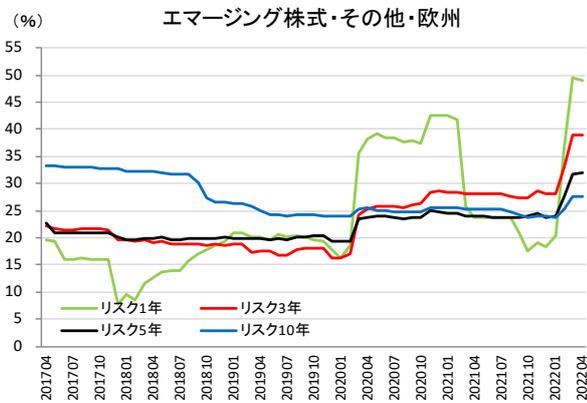
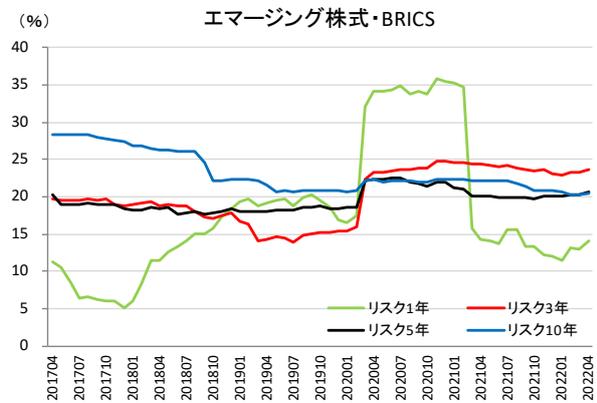
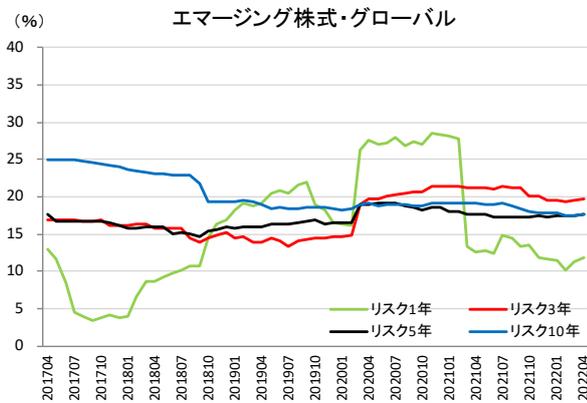


<2> リスク・サマリー

(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]

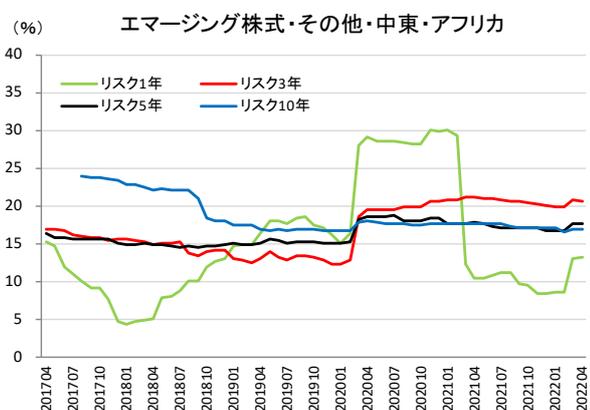
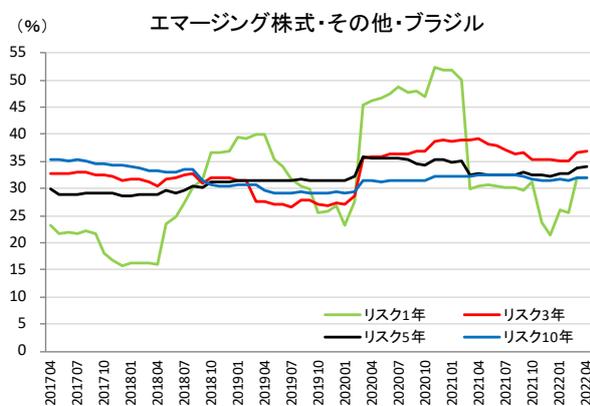
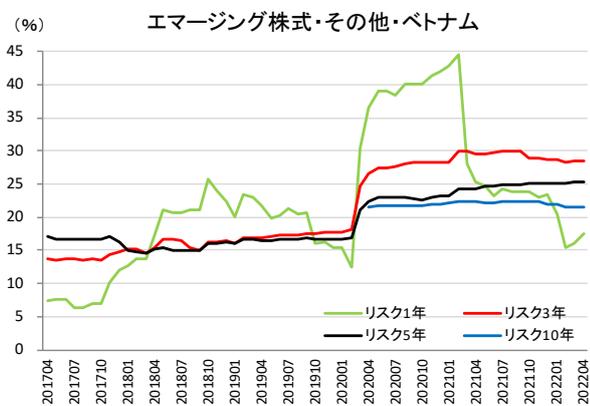
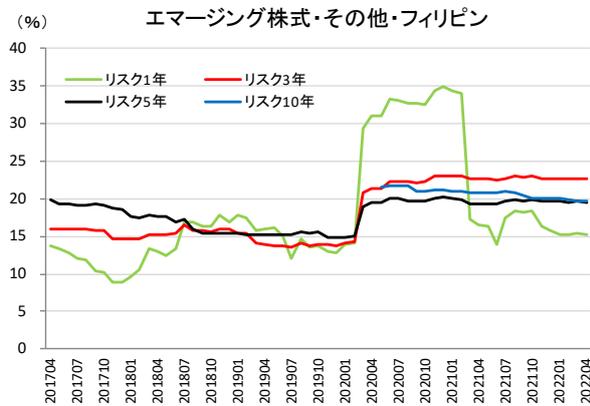
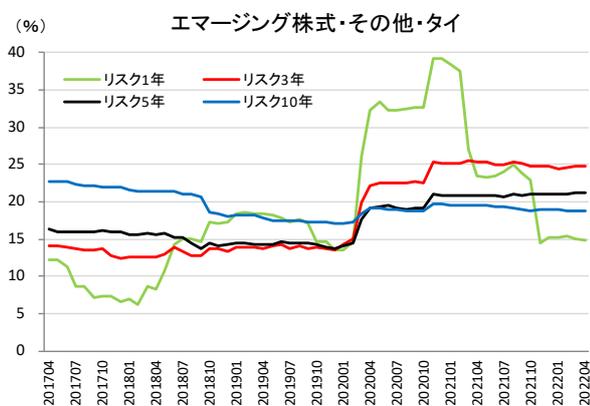


<2> リスク・サマリー

(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]

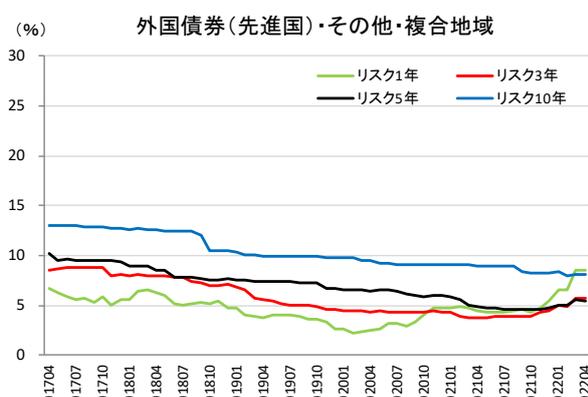
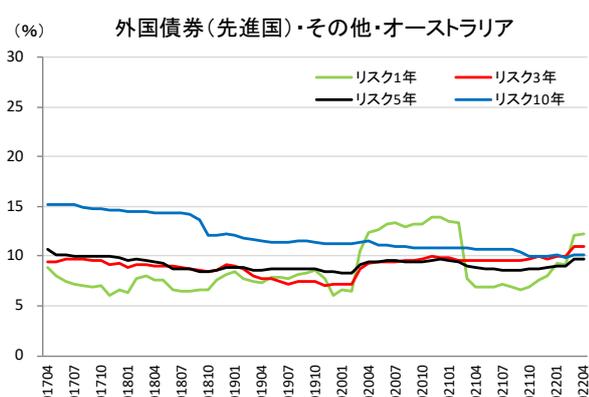
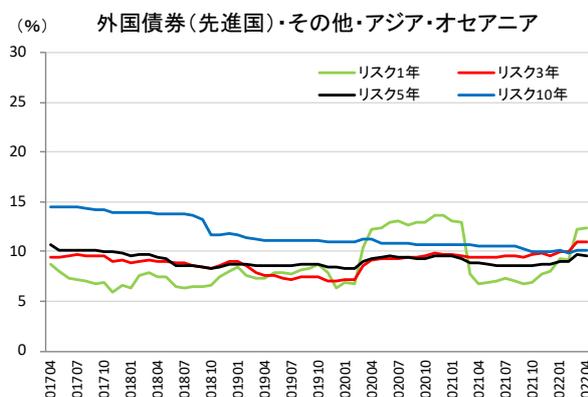
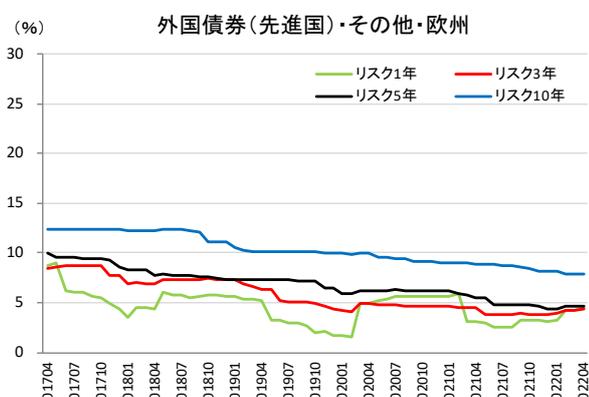
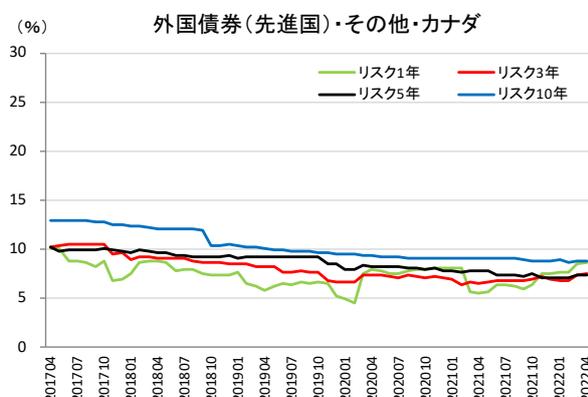
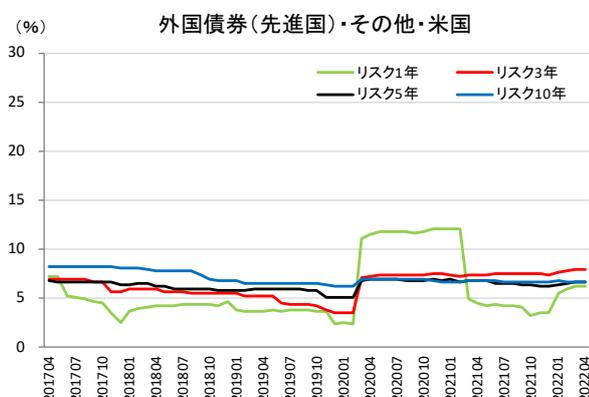
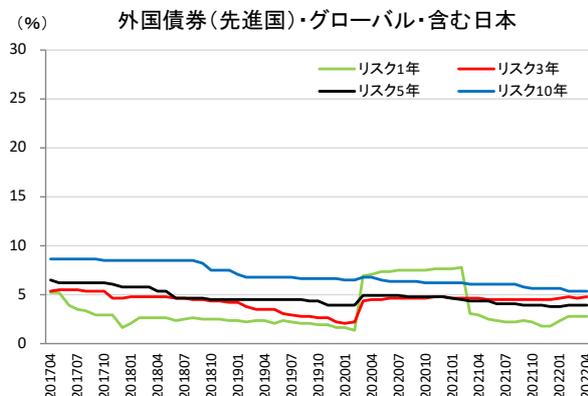
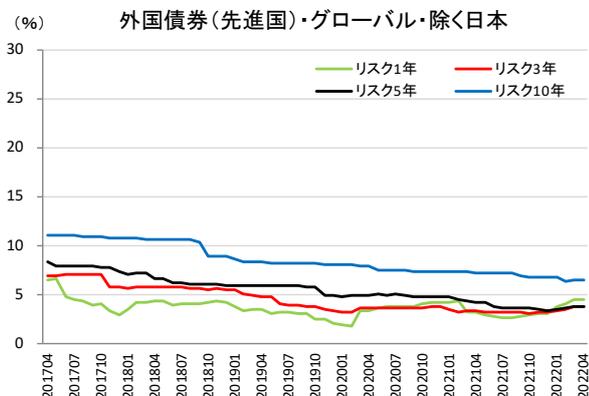


<2>リスク・サマリー

(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)]

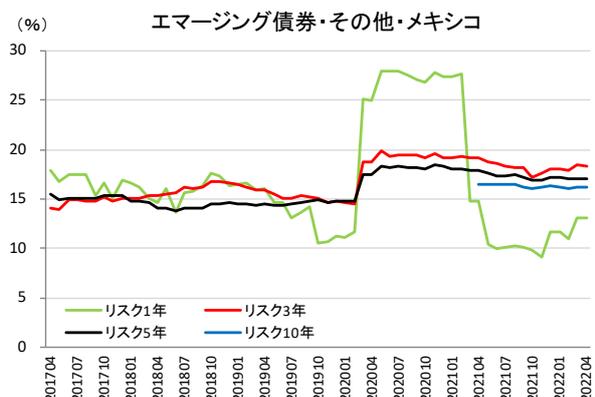
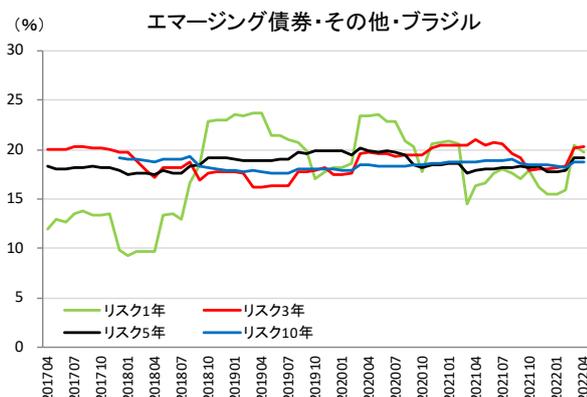
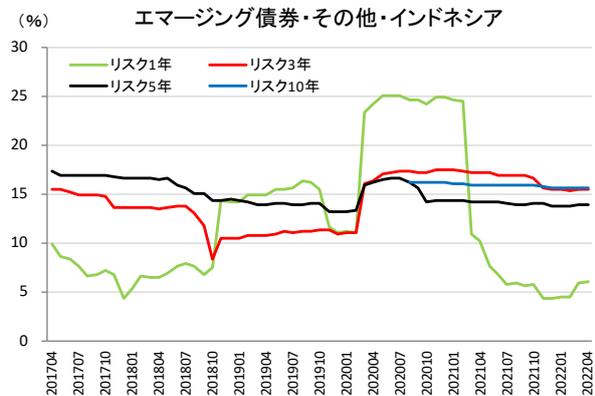
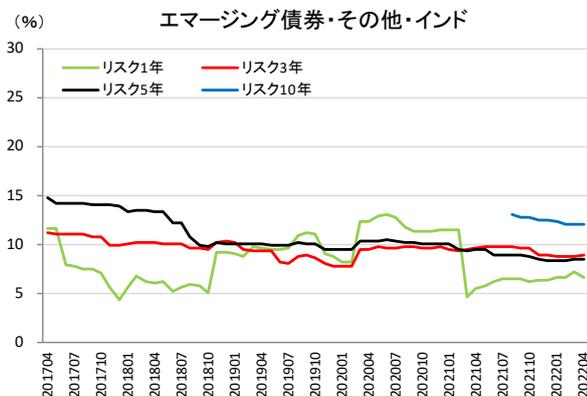
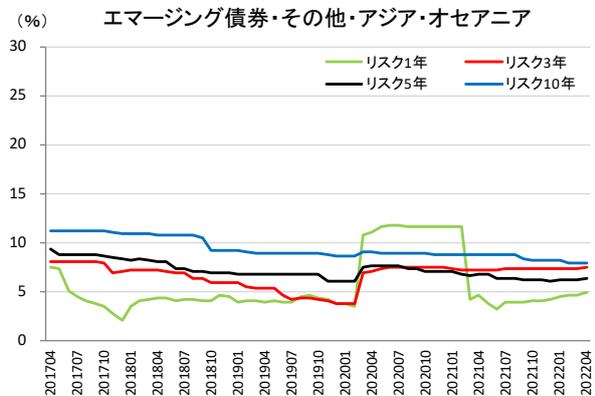
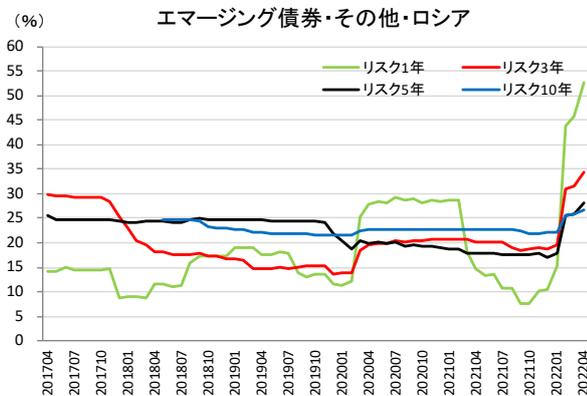
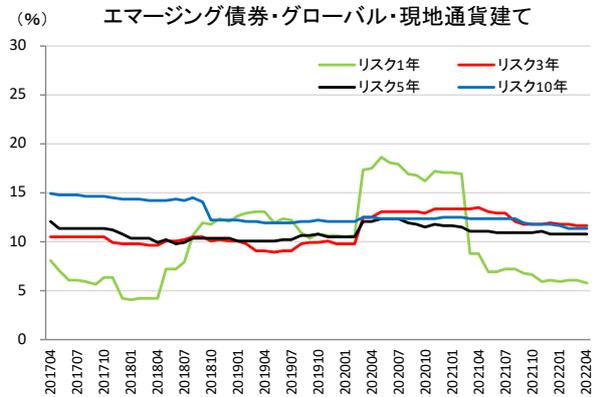
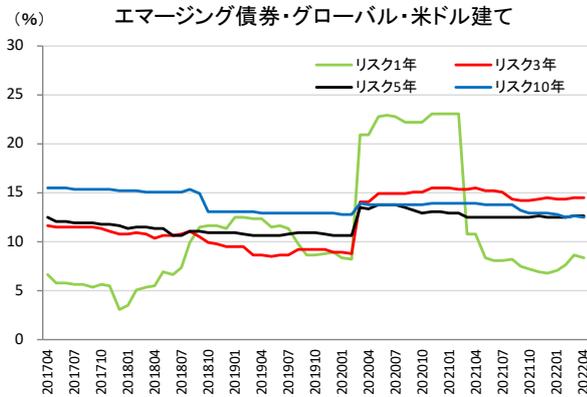


<2> リスク・サマリー

(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]

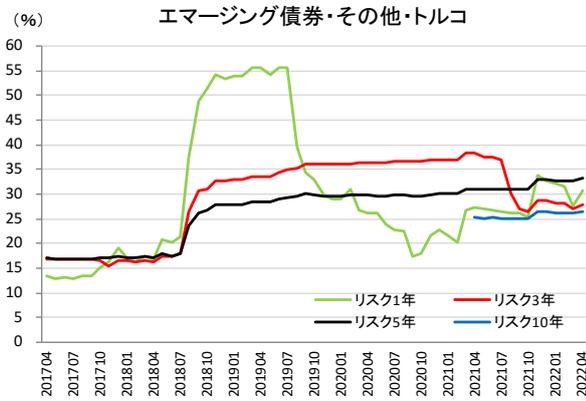


<2> リスク・サマリー

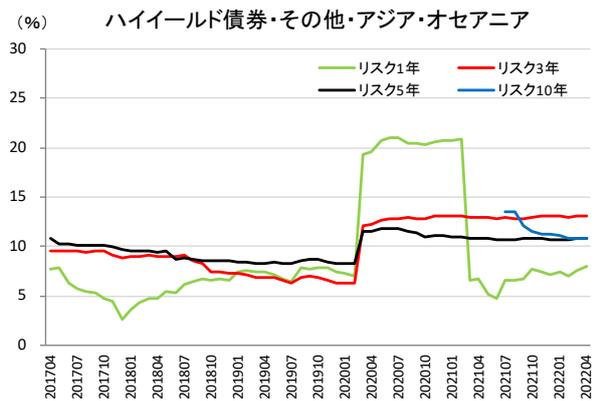
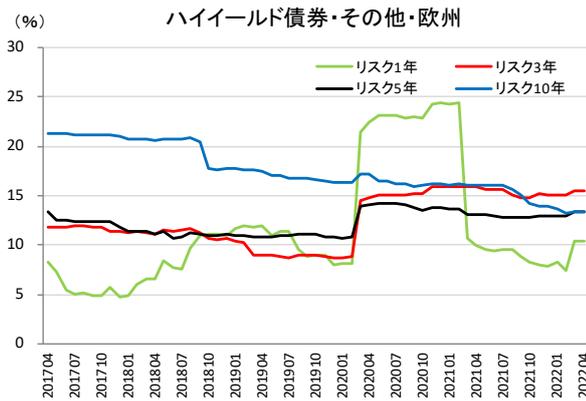
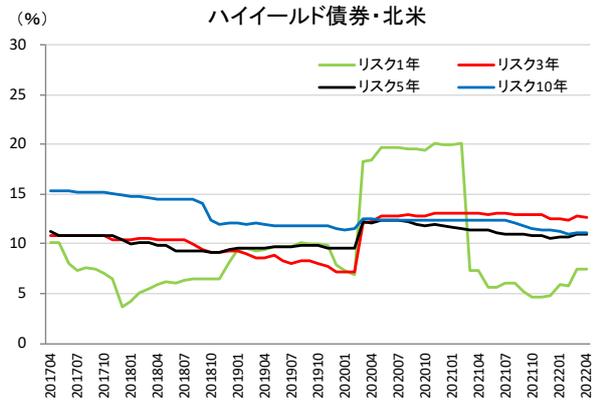
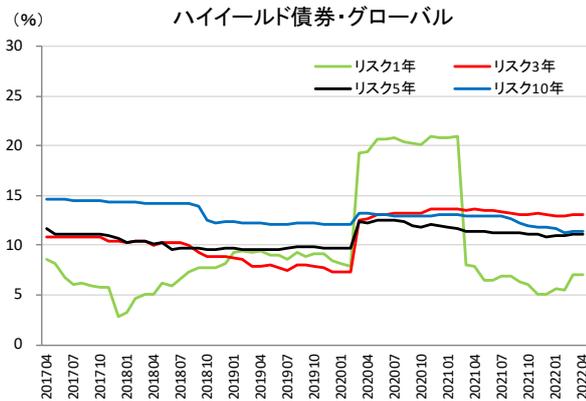
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

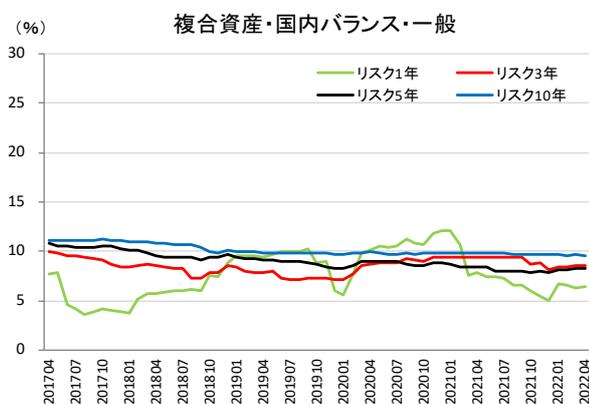
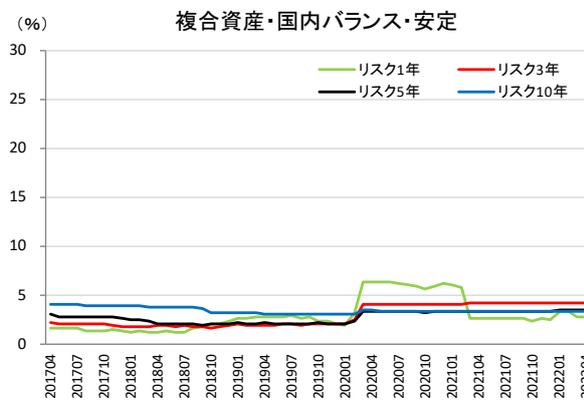
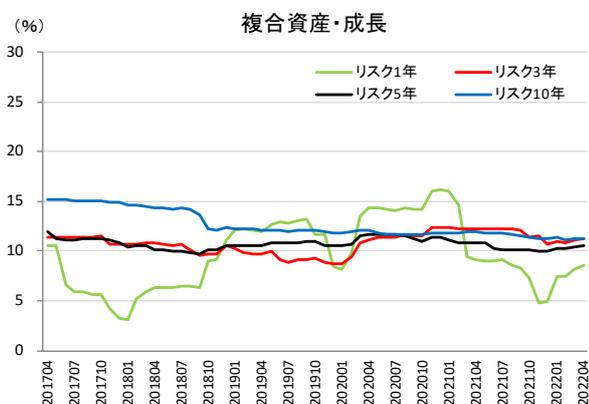
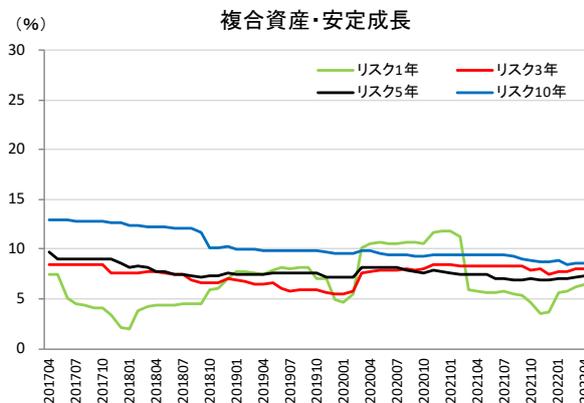
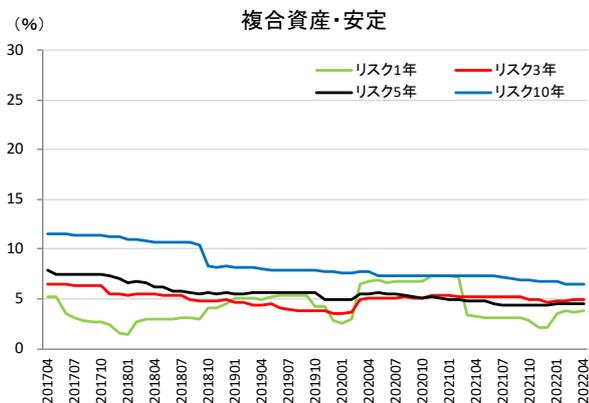


<2>リスク・サマリー

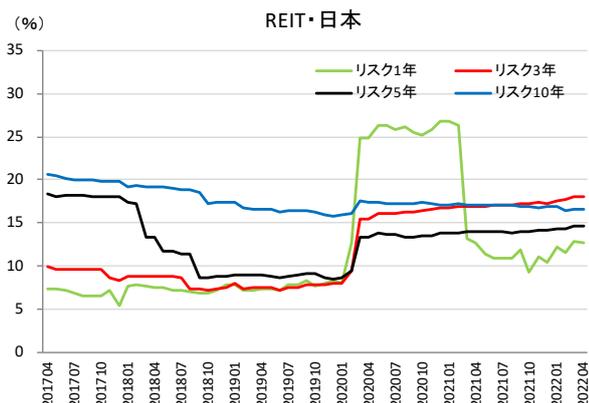
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

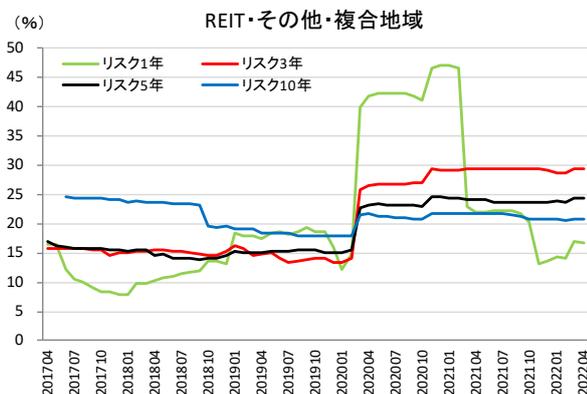
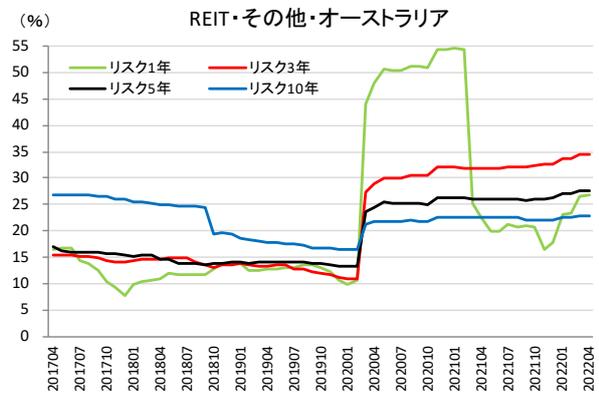
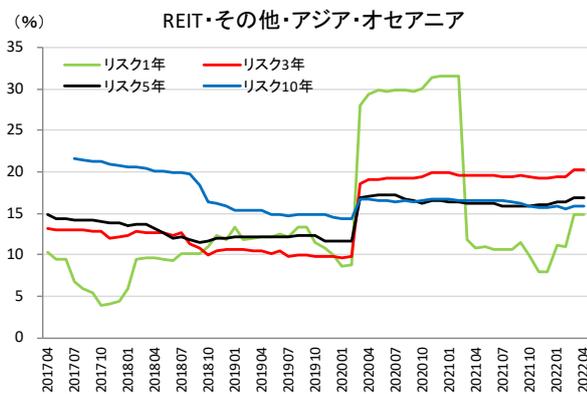
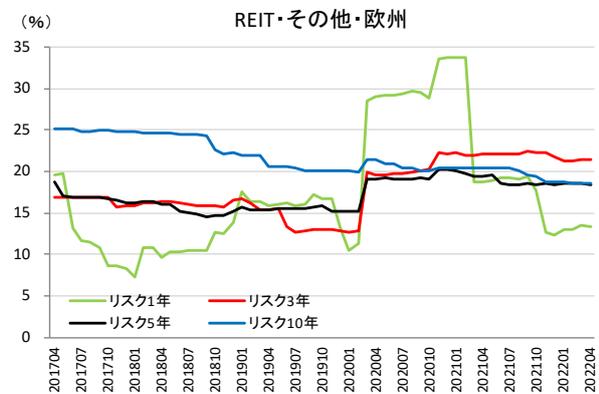
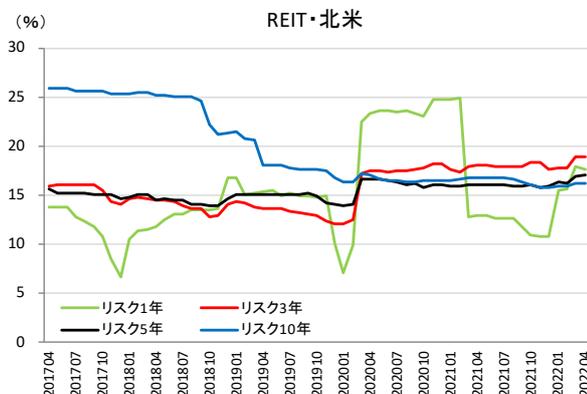
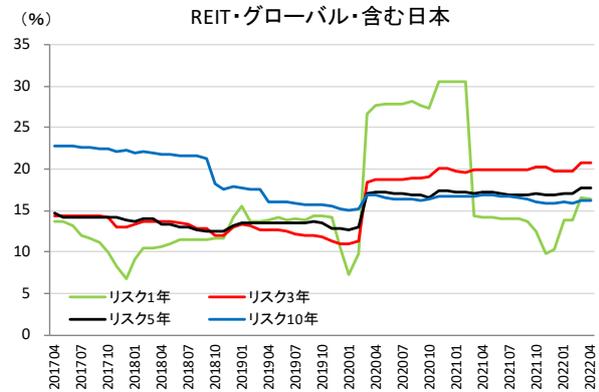
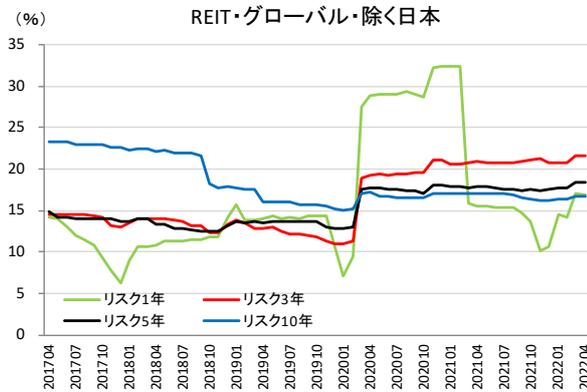


<2> リスク・サマリー

(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]

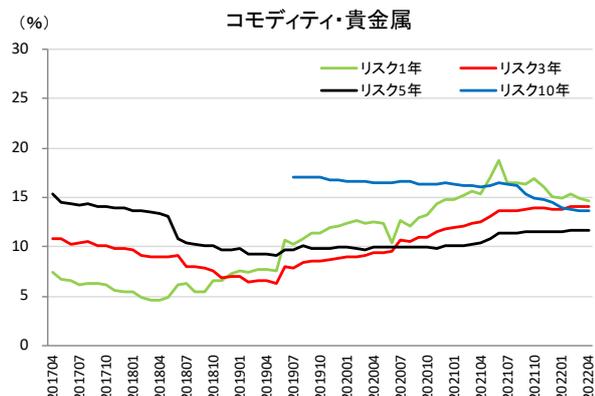
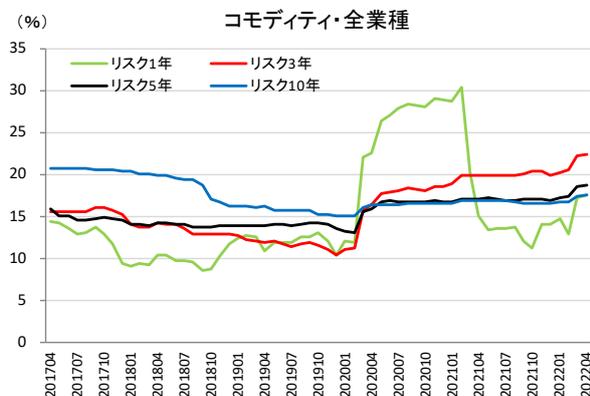
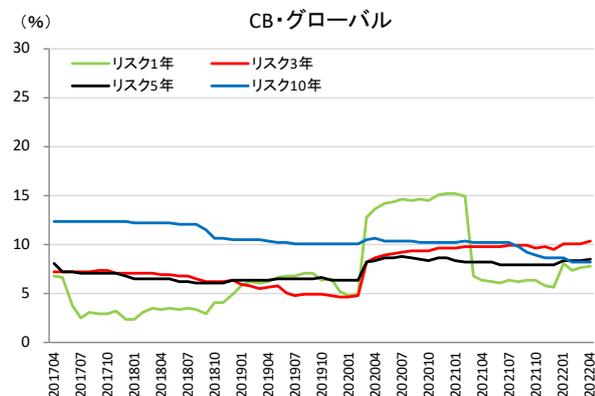
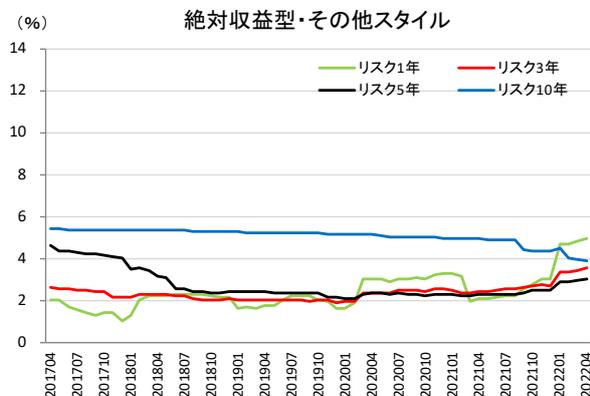
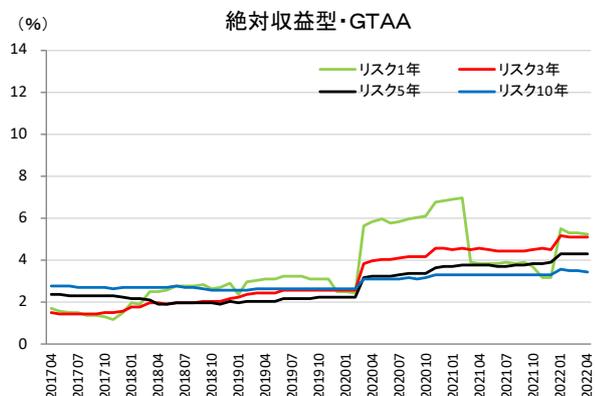
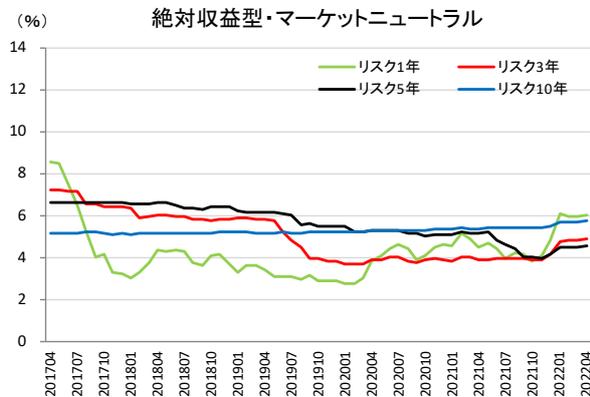
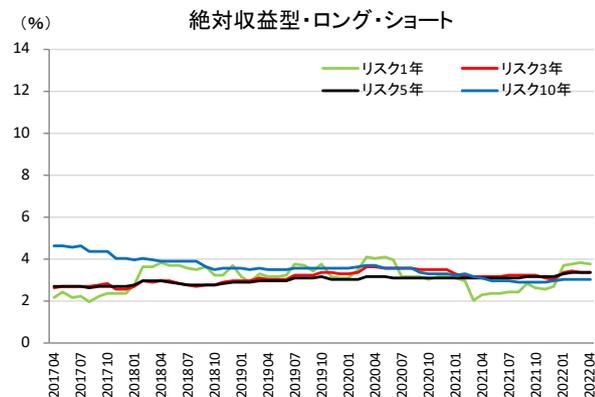


<2> リスク・サマリー

(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]



## &lt; 3 &gt; 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	3,680	17,308	49,598	96,702
国内株式	831	1,850	3,994	5,460
一般	73	556	1,310	1,158
フリー	106	549	1,303	1,275
バリュー	-33	7	7	-117
小型	49	126	39	-256
その他	711	1,160	2,638	4,539
日経225	568	788	2,210	3,904
TOPIX	97	232	281	398
JPX日経400	15	11	39	68
国内債券	762	1,272	2,522	7,835
一般	762	1,272	2,522	7,835
外国株式(先進国)	2,848	12,838	35,556	72,455
グローバル	773	4,919	15,727	37,133
除く日本	426	2,137	4,327	9,899
含む日本	347	2,782	11,400	27,233
その他	2,075	7,919	19,829	35,322
北米	5	17	26	21
米国	2,230	8,190	20,327	36,278
カナダ	-5	-11	-25	-54
欧州	-33	-51	-28	265
ドイツ	0	0	-1	-4
イギリス	0	0	0	-1
アジア・オセアニア	0	1	1	-2
オーストラリア	-130	-242	-486	-1,194
ニュージーランド	0	0	0	-2
複合地域	9	16	15	15
エマージング株式	-185	-399	-1,165	-2,485
グローバル	-17	31	78	381
BRICS	-8	-29	-41	-80
その他	-160	-402	-1,201	-2,785
欧州	0	-1	-8	-28
ロシア	0	1	-20	-36
アジア・オセアニア	-71	-173	-462	-860
中国	-36	-108	-405	-677
インド	-53	-92	-253	-1,042
インドネシア	0	-5	-11	-9
タイ	0	-1	-12	-6
フィリピン	-1	-2	-8	-14
ベトナム	16	18	43	11
韓国	0	0	0	0
香港	0	1	2	3
台湾	0	1	2	7
中南米	-2	-3	-5	-8
ブラジル	-18	-48	-74	-123
メキシコ	0	0	-2	-5
中東・アフリカ	5	13	16	6
トルコ	0	0	-2	-2
複合地域	0	0	0	-2

## &lt;3&gt; 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	3,680	17,308	49,598	96,702
外国債券(先進国)	-669	-339	1,488	3,542
グローバル	-270	345	2,812	6,348
除く日本	-297	-214	426	-115
含む日本	27	559	2,386	6,463
その他	-399	-684	-1,324	-2,805
北米	-1	-4	-6	-7
米国	-119	-143	-229	-609
カナダ	-28	-50	-94	-211
欧州	-8	-27	-137	-208
イギリス	-1	-1	-2	-4
アジア・オセアニア	-41	-73	-136	-288
オーストラリア	-179	-341	-635	-1,306
ニュージーランド	-2	-6	-10	-19
複合地域	-19	-38	-74	-145
エマージング債券	-123	-365	-841	-1,952
グローバル	23	-48	-189	-560
米ドル建て	11	-59	-181	-490
現地通貨建て	12	11	-9	-69
その他	-146	-316	-651	-1,393
ロシア	0	-3	-10	-28
アジア・オセアニア	-3	-8	-26	-50
インド	-48	-107	-262	-672
インドネシア	-8	-17	-38	-96
ブラジル	-67	-128	-220	-346
メキシコ	-10	-22	-45	-87
トルコ	0	0	-1	-1
複合地域	0	-1	-2	-5
ハイイールド債券	-119	-277	-685	-1,609
グローバル	-20	-42	-81	-154
北米	-68	-155	-416	-1,092
その他	-31	-80	-189	-363
欧州	-29	-67	-156	-297
アジア・オセアニア	-1	-12	-32	-63
複合地域	0	-1	-2	-3
複合資産	255	1,612	6,279	11,273
安定	-50	328	3,255	5,461
安定成長	207	828	2,029	4,345
成長	238	843	1,836	3,634
国内バランス	-84	-251	-505	-992
安定	-90	-263	-512	-983
一般	-2	-5	-15	-39
その他	-55	-136	-337	-1,176

## &lt;3&gt; 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	3,680	17,308	49,598	96,702
国内REIT	230	564	487	-289
日本	230	564	487	-289
外国REIT	-537	-305	-815	-2,260
グローバル	-350	-314	-508	-1,215
除く日本	-170	-76	-14	71
含む日本	-180	-237	-499	-1,290
北米	-108	159	3	-504
その他	-80	-150	-310	-541
欧州	-2	-5	-12	-22
アジア・オセアニア	-51	-99	-203	-303
オーストラリア	-21	-35	-74	-174
複合地域	-1	-2	-5	-4
複数国	-4	-9	-17	-38
その他	386	857	2,776	4,731
絶対収益型	280	601	1,544	2,613
ロング・ショート	13	1	45	64
マーケットニュートラル	3	-31	-61	-223
GTAA	4	13	23	21
その他スタイル	260	614	1,527	2,720
CB	-12	-37	-131	-321
アジア・オセアニア	0	0	-1	-2
日本	0	-1	-3	-7
グローバル	-12	-36	-127	-312
コモディティ	-45	-86	-73	129
全業種	-80	-70	-77	31
貴金属	42	6	40	181
エネルギー	-5	-20	-34	-81
その他コモディティ	-1	-2	-2	-1

## &lt; 4 &gt; 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	833,375	100.00	5,443	100.00
国内株式	99,640	11.96	845	15.52
一般	54,620	6.55	541	9.94
フリー	42,413	5.09	437	8.03
バリュー	12,207	1.46	104	1.91
小型	6,367	0.76	92	1.69
その他	38,001	4.56	206	3.78
日経225	19,647	2.36	69	1.27
TOPIX	15,212	1.83	80	1.47
JPX日経400	694	0.08	16	0.29
国内債券	42,489	5.10	139	2.55
一般	42,489	5.10	139	2.55
外国株式(先進国)	331,141	39.73	1,156	21.24
グローバル	231,330	27.76	798	14.66
除く日本	60,646	7.28	192	3.53
含む日本	170,684	20.48	606	11.13
その他	99,811	11.98	358	6.58
北米	219	0.03	9	0.17
米国	93,903	11.27	263	4.83
カナダ	186	0.02	2	0.04
欧州	1,648	0.20	44	0.81
ドイツ	15	0.00	1	0.02
イギリス	10	0.00	3	0.06
アジア・オセアニア	50	0.01	3	0.06
オーストラリア	3,741	0.45	31	0.57
ニュージーランド	14	0.00	1	0.02
複合地域	24	0.00	1	0.02
エマージング株式	27,536	3.30	326	5.99
グローバル	8,811	1.06	98	1.80
BRICS	478	0.06	7	0.13
その他	18,247	2.19	221	4.06
欧州	57	0.01	6	0.11
ロシア	24	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,991	0.60	93	1.71
中国	2,142	0.26	35	0.64
インド	8,658	1.04	29	0.53
インドネシア	157	0.02	4	0.07
タイ	33	0.00	3	0.06
フィリピン	42	0.01	5	0.09
ベトナム	1,255	0.15	11	0.20
韓国	5	0.00	1	0.02
香港	13	0.00	1	0.02
台湾	10	0.00	1	0.02
中南米	61	0.01	2	0.04
ブラジル	587	0.07	15	0.28
メキシコ	16	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	131	0.02	5	0.09
トルコ	47	0.01	2	0.04
複合地域	18	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	833,375	100.00	5,443	100.00
外国債券(先進国)	79,862	9.58	807	14.83
グローバル	63,651	7.64	529	9.72
除く日本	30,279	3.63	230	4.23
含む日本	33,372	4.00	299	5.49
その他	16,211	1.95	278	5.11
北米	72	0.01	6	0.11
米国	5,120	0.61	157	2.88
カナダ	851	0.10	4	0.07
欧州	1,105	0.13	35	0.64
イギリス	19	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	1,680	0.20	11	0.20
オーストラリア	6,076	0.73	39	0.72
ニュージーランド	93	0.01	10	0.18
複合地域	1,195	0.14	8	0.15
エマージング債券	11,244	1.35	268	4.92
グローバル	6,023	0.72	191	3.51
米ドル建て	4,533	0.54	146	2.68
現地通貨建て	1,489	0.18	45	0.83
その他	5,221	0.63	77	1.41
ロシア	61	0.01	5	0.09
アジア・オセアニア	275	0.03	6	0.11
インド	2,353	0.28	17	0.31
インドネシア	333	0.04	8	0.15
ブラジル	1,703	0.20	21	0.39
メキシコ	272	0.03	7	0.13
トルコ	56	0.01	4	0.07
複合地域	31	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	16,403	1.97	252	4.63
グローバル	2,628	0.32	38	0.70
北米	11,620	1.39	150	2.76
その他	2,155	0.26	64	1.18
欧州	1,683	0.20	40	0.73
アジア・オセアニア	433	0.05	23	0.42
複合地域	39	0.00	1	0.02
複合資産	126,709	15.20	997	18.32
安定	38,584	4.63	281	5.16
安定成長	55,045	6.61	408	7.50
成長	21,206	2.54	259	4.76
国内バランス	8,275	0.99	32	0.59
安定	7,843	0.94	9	0.17
一般	312	0.04	18	0.33
その他	3,599	0.43	17	0.31

## &lt; 4 &gt; 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	833,375	100.00	5,443	100.00
国内REIT	26,754	3.21	136	2.50
日本	26,754	3.21	136	2.50
外国REIT	50,473	6.06	291	5.35
グローバル	20,079	2.41	156	2.87
除く日本	6,268	0.75	65	1.19
含む日本	13,812	1.66	91	1.67
北米	26,739	3.21	79	1.45
その他	3,655	0.44	56	1.03
欧州	148	0.02	10	0.18
アジア・オセアニア	2,500	0.30	30	0.55
オーストラリア	648	0.08	12	0.22
複合地域	60	0.01	3	0.06
複数国	298	0.04	1	0.02
その他	21,125	2.53	226	4.15
絶対収益型	11,193	1.34	109	2.00
ロング・ショート	859	0.10	37	0.68
マーケットニュートラル	599	0.07	16	0.29
GTAA	429	0.05	13	0.24
その他スタイル	9,227	1.11	42	0.77
CB	1,108	0.13	31	0.57
アジア・オセアニア	37	0.00	1	0.02
日本	35	0.00	3	0.06
グローバル	1,037	0.12	27	0.50
コモディティ	4,721	0.57	35	0.64
全業種	1,993	0.24	14	0.26
貴金属	2,620	0.31	19	0.35
エネルギー	88	0.01	1	0.02
その他コモディティ	20	0.00	1	0.02

## &lt; 5 &gt; 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	13,200	9.4	3.32	3.62	1.207
国内株式	16,759	12.9	1.01	1.07	1.053
一般	15,599	12.6	1.42	1.49	1.401
フリー	15,177	11.9	1.48	1.57	1.445
バリュー	17,369	15.4	1.18	1.20	1.248
小型	21,774	13.4	1.09	1.27	1.703
その他	17,590	13.1	0.38	0.38	0.434
日経225	18,662	14.8	0.39	0.42	0.499
TOPIX	18,495	14.2	0.13	0.13	0.278
JPX日経400	16,354	7.6	0.18	0.18	0.507
国内債券	10,749	11.4	0.19	0.20	0.406
一般	10,749	11.4	0.19	0.20	0.406
外国株式(先進国)	15,450	7.0	4.24	4.98	1.378
グローバル	15,930	6.9	3.03	3.60	1.423
除く日本	22,087	9.4	0.54	0.54	0.629
含む日本	13,979	6.1	3.95	4.71	1.706
その他	14,380	7.4	6.97	8.15	1.273
北米	16,531	8.1	11.91	12.11	1.740
米国	15,233	6.6	6.82	8.09	1.241
カナダ	6,114	11.1	8.77	8.73	1.991
欧州	13,101	11.4	5.98	6.50	1.650
ドイツ	12,296	8.1	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,359	5.7	11.87	11.61	1.877
アジア・オセアニア	9,225	11.4	8.11	9.45	1.667
オーストラリア	10,106	7.7	10.64	10.30	1.825
ニュージーランド	17,599	9.8	2.29	2.27	1.672
複合地域	11,402	9.0	8.64	5.26	1.705
エマージング株式	13,438	9.9	3.53	3.69	1.681
グローバル	12,779	7.7	0.46	0.48	1.117
BRICS	13,970	15.9	0.82	1.04	2.069
その他	13,713	10.7	5.10	5.32	1.944
欧州	5,390	15.9	0.45	0.83	1.951
ロシア	3,516	12.9	7.62	13.70	1.910
アジア・オセアニア	14,360	11.4	4.96	6.38	1.736
中国	14,633	7.8	2.82	4.26	1.949
インド	16,568	11.9	6.26	5.56	2.067
インドネシア	13,909	12.0	1.24	0.95	1.860
タイ	12,295	9.8	1.96	1.88	1.820
フィリピン	11,046	8.7	0.44	0.37	1.777
ベトナム	18,741	5.7	3.00	2.59	1.923
韓国	14,393	3.3	0.00	0.00	1.804
香港	13,116	12.7	1.34	1.68	0.858
台湾	10,380	9.4	17.94	22.16	1.661
中南米	8,840	15.3	0.00	0.00	2.041
ブラジル	6,172	11.5	4.44	4.91	1.941
メキシコ	10,535	9.1	0.00	0.00	1.905
中東・アフリカ	15,080	10.7	5.36	5.44	2.064
トルコ	8,040	20.8	0.00	0.00	2.032
複合地域	20,743	13.9	1.61	1.77	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

## &lt;5&gt; 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	13,200	9.4	3.32	3.62	1.207
外国債券(先進国)	9,975	9.8	1.64	1.70	1.004
グローバル	10,515	9.6	1.20	1.27	0.933
除く日本	11,513	11.7	1.09	1.13	0.732
含む日本	9,748	8.0	1.31	1.40	1.115
その他	8,948	10.1	3.28	3.30	1.284
北米	10,237	8.0	2.22	2.29	1.776
米国	9,542	9.2	4.42	4.15	1.307
カナダ	7,156	11.3	1.65	1.58	1.378
欧州	8,028	11.4	1.55	1.62	1.149
イギリス	7,851	7.2	2.65	2.75	1.342
アジア・オセアニア	8,544	11.6	2.71	2.80	1.417
オーストラリア	8,338	13.0	3.26	3.48	1.250
ニュージーランド	9,262	7.8	1.58	1.72	1.365
複合地域	5,296	12.0	2.30	2.35	1.193
エマージング債券	8,652	10.4	4.95	4.94	1.519
グローバル	8,737	10.8	3.77	4.10	1.430
米ドル建て	8,815	11.2	3.88	4.22	1.536
現地通貨建て	8,483	9.3	3.42	3.75	1.105
その他	8,444	9.4	6.32	5.90	1.623
ロシア	3,484	9.2	6.05	8.44	1.618
アジア・オセアニア	9,387	11.4	6.22	6.75	1.633
インド	9,873	7.5	6.92	6.54	1.701
インドネシア	8,761	9.5	6.44	5.71	1.666
ブラジル	8,613	12.6	5.93	5.08	1.583
メキシコ	6,949	9.2	5.92	5.78	1.402
トルコ	1,901	9.1	7.32	10.73	1.457
複合地域	3,337	15.7	3.13	3.60	1.210
ハイイールド債券	9,210	11.2	6.09	6.08	1.675
グローバル	7,775	10.8	4.08	4.09	1.522
北米	10,485	12.1	6.03	5.76	1.693
その他	7,071	9.5	8.87	10.28	1.766
欧州	7,223	9.0	8.84	10.21	1.740
アジア・オセアニア	6,920	10.0	9.29	11.00	1.863
複合地域	4,487	18.1	5.19	5.35	1.800
複合資産	12,906	9.1	1.35	1.43	0.990
安定	11,505	8.9	1.11	1.14	1.101
安定成長	12,646	9.6	1.65	1.77	1.007
成長	15,169	8.9	0.55	0.58	0.799
国内バランス	11,644	9.1	2.32	2.46	0.938
安定	10,677	10.7	2.33	2.46	0.918
一般	12,210	9.3	1.86	1.99	1.306
その他	10,202	2.3	1.63	1.89	0.782

(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

## &lt; 5 &gt; 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	13,200	9.4	3.32	3.62	1.207
国内REIT	14,261	9.2	8.32	9.86	0.927
日本	14,261	9.2	8.32	9.86	0.927
外国REIT	13,577	8.3	9.10	7.79	1.503
グローバル	14,878	8.2	4.76	4.17	1.299
除く日本	16,676	6.1	4.18	4.00	0.990
含む日本	13,594	9.7	5.03	4.25	1.439
北米	12,918	8.8	12.52	10.52	1.621
その他	10,880	8.1	7.85	7.69	1.764
欧州	7,937	8.2	3.80	4.03	1.825
アジア・オセアニア	12,209	7.7	9.81	9.75	1.811
オーストラリア	10,777	7.6	4.41	3.89	1.707
複合地域	7,214	10.2	1.05	0.91	0.802
複数国	12,673	18.0	2.33	1.89	1.650
その他					
絶対収益型	10,568	5.7	0.08	0.09	1.781
ロング・ショート	10,570	4.7	0.20	0.23	1.457
マーケットニュートラル	9,890	5.2	0.55	0.58	1.306
GTAA	11,266	8.4	0.91	1.04	1.487
その他スタイル	10,558	5.9	0.00	0.00	1.859
CB	12,536	9.3	3.26	4.13	1.407
アジア・オセアニア	10,344	11.8	2.36	2.32	1.823
日本	11,160	11.0	0.48	0.48	0.938
グローバル	12,770	9.0	3.38	4.31	1.408
コモディティ	12,541	6.6	0.74	0.49	1.039
全業種	11,636	9.7	1.74	1.16	1.445
貴金属	12,631	4.0	0.00	0.00	0.732
エネルギー	18,180	13.2	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	17,873	5.6	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、青木

電話番号 : 03-6721-1033

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