

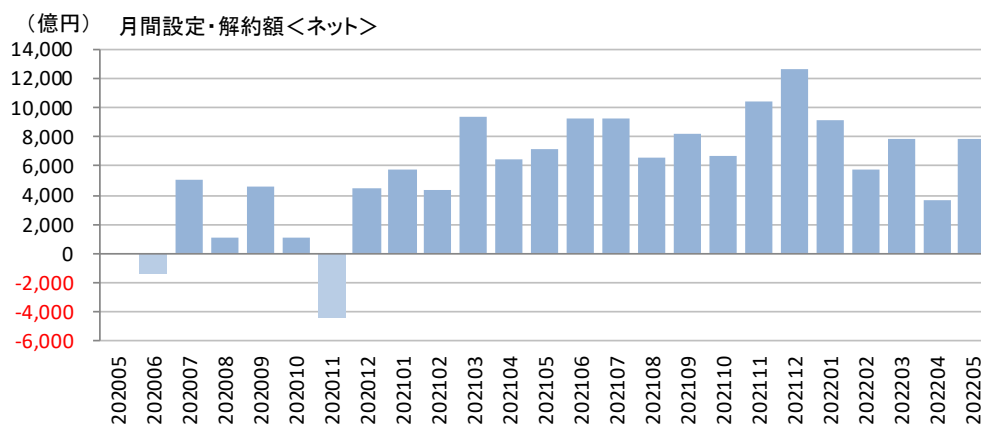
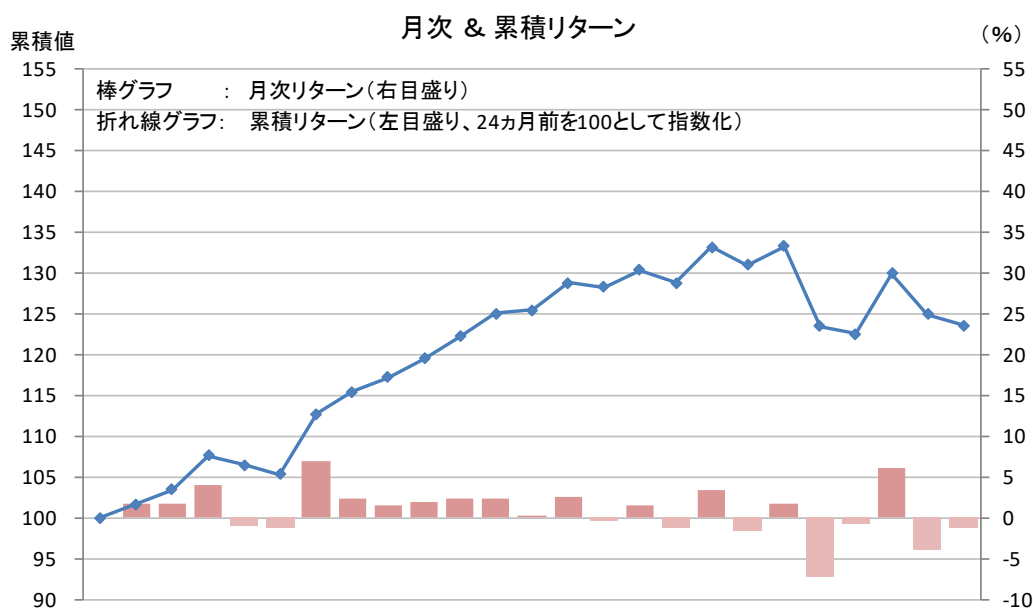
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2022年5月

「総合」 **-1.10%**
(前月 **-3.86%**)



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		15,532	15,704	-172	-1.10
国内株式		19,249	19,046	203	1.06
一般		18,706	18,483	223	1.21
フリー		17,478	17,304	174	1.01
バリュー		24,522	24,062	460	1.91
小型		37,755	38,048	-293	-0.77
その他		19,192	18,971	221	1.16
日経225		18,470	18,176	294	1.62
TOPIX		18,765	18,627	138	0.74
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	17,745	17,615	131	0.74
国内債券		12,931	12,951	-20	-0.15
一般		12,931	12,951	-20	-0.15
外国株式(先進国)		20,073	20,414	-342	-1.67
グローバル		21,841	22,192	-351	-1.58
除く日本		34,178	34,253	-76	-0.22
含む日本		19,202	19,607	-405	-2.07
その他		16,378	16,692	-314	-1.88
北米		20,462	20,065	396	1.98
米国		25,326	25,842	-516	-2.00
カナダ	10,000 (2009.02.27)	22,372	21,917	455	2.08
欧州		22,869	22,797	72	0.32
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	10,811	10,154	657	6.47
イギリス	9,683 (2014.05.30)	10,703	10,368	336	3.24
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	39,074	38,414	661	1.72
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	20,498	20,612	-113	-0.55
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	42,715	46,116	-3,401	-7.38
複合地域	10,000 (2013.04.30)	14,662	13,096	1,566	11.95
エマージング株式		18,211	18,420	-209	-1.13
グローバル		18,055	17,952	103	0.58
BRICS	10,000 (2005.09.30)	23,500	23,000	500	2.18
その他		19,032	19,430	-399	-2.05
欧州		10,539	10,946	-407	-3.72
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,396	3,252	-1,856	-57.06
アジア・オセアニア		18,137	17,922	215	1.20
中国		40,301	39,029	1,272	3.26
インド	10,000 (2004.09.30)	46,698	49,183	-2,486	-5.05
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	16,389	17,108	-719	-4.21
タイ		23,084	22,909	175	0.77
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,136	8,264	-128	-1.55
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	24,030	25,211	-1,180	-4.68
韓国	10,000 (1997.06.30)	31,221	31,997	-776	-2.42
香港		21,576	20,372	1,204	5.91
台湾	10,000 (2008.03.31)	25,805	24,921	884	3.55
中南米	7,427 (2006.04.28)	10,172	9,693	479	4.94
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,429	9,123	307	3.36
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	12,703	12,118	585	4.83
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	13,998	14,670	-673	-4.59
トルコ		22,131	23,953	-1,822	-7.61
複合地域	10,000 (2005.08.31)	24,637	24,037	600	2.49

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000
[色塗りの基準]月次リターン> 総合

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別②

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		15,532	15,704	-172	-1.10
外国債券(先進国)		18,489	18,606	-117	-0.63
グローバル		18,512	18,614	-102	-0.55
除く日本		20,158	20,296	-137	-0.68
含む日本		17,472	17,548	-76	-0.43
その他		18,621	18,796	-175	-0.93
北米	9,052 (2013.05.31)	10,643	10,755	-111	-1.04
米国		17,363	17,742	-379	-2.14
カナダ	10,000 (2003.05.30)	16,365	16,262	103	0.63
欧州	10,000 (1998.07.31)	14,282	14,487	-206	-1.42
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,515	10,557	-42	-0.40
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	20,760	20,803	-42	-0.20
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	25,604	25,706	-102	-0.40
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,376	11,330	45	0.40
複合地域	10,000 (2001.11.30)	18,715	18,752	-36	-0.19
エマージング債券		17,714	17,847	-133	-0.75
グローバル		18,035	18,012	23	0.13
米ドル建て		18,543	18,579	-35	-0.19
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,661	12,524	137	1.09
その他	8,647 (2005.03.31)	14,006	14,258	-251	-1.76
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,023	7,824	-6,801	-86.92
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	14,821	14,987	-166	-1.11
インド	10,000 (2011.08.31)	18,839	19,339	-500	-2.58
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	16,779	17,248	-469	-2.72
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	12,986	12,805	181	1.41
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	14,713	13,857	856	6.18
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,959	3,293	-335	-10.16
複合地域	10,000 (2006.08.31)	9,729	9,520	209	2.19
ハイイールド債券		24,747	24,892	-145	-0.58
グローバル	10,000 (1997.06.30)	23,607	23,682	-75	-0.32
北米		24,913	25,043	-130	-0.52
その他	10,000 (2004.03.31)	22,378	22,662	-284	-1.25
欧州	10,000 (2006.04.28)	22,674	22,958	-284	-1.24
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	13,867	14,053	-186	-1.32
複合地域	10,000 (2004.03.31)	21,774	22,049	-275	-1.25
複合資産		18,892	18,960	-67	-0.36
安定	10,000 (1998.10.30)	16,006	16,086	-80	-0.50
安定成長		20,736	20,801	-65	-0.31
成長		25,116	25,146	-30	-0.12
国内バランス		12,668	12,661	7	0.05
安定		12,890	12,887	3	0.02
一般		15,951	15,875	76	0.48
その他	10,000 (2018.10.31)	13,298	13,566	-268	-1.97

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

[色塗りの基準]月次リターン> 総合

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別③

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)	
総合		15,532	15,704	-172	-1.10	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	35,740	35,153	587	1.67	
日本	10,000 (2003.10.31)	35,740	35,153	587	1.67	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	34,861	37,464	-2,604	-6.95	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	29,146	31,119	-1,973	-6.34	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	32,635	35,077	-2,443	-6.96	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	28,900	30,764	-1,864	-6.06	
北米	10,000 (2003.09.30)	36,583	39,660	-3,077	-7.76	
その他	10,000 (2004.04.30)	31,419	32,872	-1,453	-4.42	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,802	5,852	-50	-0.85	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	23,086	24,049	-963	-4.01	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	17,678	18,867	-1,190	-6.31	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,576	7,712	-136	-1.77	
複数国	10,000 (2004.04.30)	46,925	50,046	-3,122	-6.24	
その他		6,490	6,525	-35	-0.53	
絶対収益型		7,733	7,755	-21	-0.28	
ロング・ショート		8,287	8,365	-77	-0.93	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,372	11,291	81	0.72	
GTAA		11,619	11,695	-76	-0.65	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,294	7,313	-19	-0.27	
CB		19,970	20,514	-544	-2.65	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	20,160	20,767	-606	-2.92	
日本		19,687	19,680	6	0.03	
グローバル		34,911	35,891	-980	-2.73	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	12,208	12,161	47	0.39	
全業種	10,000 (2004.12.30)	12,679	12,269	409	3.34	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	19,185	19,597	-411	-2.10	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	10,281	9,415	866	9.20	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	16,703	16,181	522	3.23	

※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	0.84	-5.72	-1.54	-7.29
国内株式	2.28	-3.81	-2.32	-6.25
一般	2.19	-4.44	-1.85	-6.64
フリー	1.84	-6.54	-3.40	-8.29
バリュー	3.41	3.47	3.86	-0.54
小型	-0.98	-15.42	-11.63	-14.91
その他	2.97	-0.37	-1.34	-3.85
日経225	3.65	-1.10	-4.24	-4.55
TOPIX	2.51	0.47	1.57	-2.90
JPX日経400	2.66	0.20	1.14	-3.19
国内債券	-0.94	-2.44	-2.13	-2.30
一般	-0.94	-2.44	-2.13	-2.30
外国株式(先進国)	-0.93	-11.89	-4.22	-12.79
グローバル	-1.26	-12.97	-6.71	-13.36
除く日本	4.29	-0.44	8.51	-3.90
含む日本	-3.11	-16.71	-11.14	-16.30
その他	-0.16	-9.11	2.87	-11.40
北米	11.28	14.06	22.14	9.06
米国	-0.79	-10.29	2.66	-12.37
カナダ	5.87	7.61	11.29	6.77
欧州	3.41	-3.02	-1.61	-7.82
ドイツ	5.70	1.27	-4.79	-3.92
イギリス	7.51	17.00	14.16	9.75
アジア・オセアニア	2.69	-0.72	-3.72	-2.49
オーストラリア	13.58	18.21	16.32	11.24
ニュージーランド	-0.28	-2.97	-3.02	-6.87
複合地域	36.12	60.62	84.54	57.16
エマージング株式	0.66	-3.35	-3.01	-4.39
グローバル	0.16	-3.57	-7.91	-5.06
BRICS	-5.73	-13.95	-19.35	-13.50
その他	1.08	-2.91	-0.16	-3.80
欧州	-43.41	-62.55	-61.53	-63.16
ロシア	-81.63	-89.60	-89.02	-89.53
アジア・オセアニア	-0.18	-5.06	-8.24	-6.03
中国	-7.32	-17.41	-24.58	-14.61
インド	4.50	1.94	15.84	-0.58
インドネシア	14.67	17.57	35.43	17.04
タイ	6.35	16.50	11.85	11.09
フィリピン	3.10	3.22	11.42	1.68
ベトナム	-1.87	-0.37	17.82	0.34
韓国	1.81	-8.96	-14.90	-12.25
香港	3.16	-0.24	-14.89	1.91
台湾	-5.43	-7.56	4.29	-14.47
中南米	17.06	39.17	16.26	34.28
ブラジル	16.86	38.35	8.28	39.12
メキシコ	17.53	33.85	28.95	18.12
中東・アフリカ	7.61	14.81	23.95	10.78
トルコ	21.03	22.55	12.16	14.76
複合地域	-0.27	-5.11	-4.04	-7.07

※[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	0.84	-5.72	-1.54	-7.29
外国債券(先進国)	0.48	-1.90	-2.38	-2.91
グローバル	-0.43	-3.07	-3.13	-3.72
除く日本	0.75	-2.20	-2.49	-2.88
含む日本	-1.51	-3.87	-3.69	-4.49
その他	4.05	2.78	0.76	0.28
北米	-1.58	-4.84	-3.68	-5.49
米国	2.64	-0.16	4.29	-2.13
カナダ	7.90	7.64	4.49	6.27
欧州	-3.22	-7.20	-8.32	-7.59
イギリス	2.31	1.46	-1.64	-0.55
アジア・オセアニア	6.01	5.87	-0.20	2.67
オーストラリア	5.67	5.80	0.20	2.46
ニュージーランド	4.29	1.90	-4.66	-0.36
複合地域	3.95	3.35	-1.21	0.48
エマージング債券	5.25	5.85	2.65	3.56
グローバル	2.12	0.36	-3.78	-2.03
米ドル建て	2.21	-0.54	-4.32	-2.79
現地通貨建て	1.84	3.18	-2.13	0.37
その他	9.00	12.74	10.89	10.58
ロシア	-82.23	-90.31	-90.29	-90.70
アジア・オセアニア	2.79	1.30	-1.50	-0.20
インド	4.80	5.66	7.73	3.89
インドネシア	5.47	6.74	14.41	5.40
ブラジル	19.45	34.04	24.39	31.88
メキシコ	14.89	23.13	14.42	14.64
トルコ	1.78	-3.85	-30.02	-1.48
複合地域	5.59	-7.62	-8.96	-10.03
ハイイールド債券	5.58	5.26	6.47	2.55
グローバル	3.46	2.82	0.67	0.50
北米	6.42	6.34	10.08	3.51
その他	3.74	2.66	-3.41	0.06
欧州	3.79	3.27	-2.05	0.33
アジア・オセアニア	3.60	0.47	-8.56	-0.81
複合地域	2.82	0.56	-0.17	-1.97
複合資産	0.77	-2.11	-0.49	-3.72
安定	-0.52	-3.33	-2.31	-4.16
安定成長	1.49	-1.20	0.46	-3.06
成長	2.55	-0.29	2.78	-2.74
国内バランス	0.47	-1.39	-1.89	-2.22
安定	0.37	-1.46	-1.97	-2.25
一般	1.78	-1.66	-1.42	-3.09
その他	-5.18	-13.55	-9.52	-16.23

※[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	0.84	-5.72	-1.54	-7.29
国内REIT	7.69	1.99	-0.42	-1.19
日本	7.69	1.99	-0.42	-1.19
外国REIT	6.75	4.95	18.24	-1.36
グローバル	5.87	4.37	15.45	-1.44
除く日本	5.20	4.21	16.57	-1.99
含む日本	6.17	4.45	15.00	-1.19
北米	7.37	5.31	22.01	-1.65
その他	7.15	5.56	9.49	1.04
欧州	0.99	-1.36	-3.84	-3.88
アジア・オセアニア	8.01	6.15	9.00	2.80
オーストラリア	5.30	4.73	11.65	-3.81
複合地域	8.73	13.13	13.04	6.05
複数国	6.70	4.42	16.37	-1.31
その他	0.05	-4.39	-1.65	-5.93
絶対収益型	-0.85	-4.11	-2.31	-4.49
ロング・ショート	-1.15	-4.10	-4.25	-4.90
マーケットニュートラル	-1.94	-9.68	-5.33	-7.34
GTAA	0.50	-2.36	-0.94	-3.82
その他スタイル	-0.87	-3.84	-1.97	-4.35
CB	-4.04	-9.50	-8.91	-8.96
アジア・オセアニア	2.50	1.62	-1.18	-0.26
日本	-0.38	-1.84	-1.76	-2.79
グローバル	-4.38	-10.08	-9.41	-9.43
コモディティ	13.29	26.24	27.49	23.75
全業種	28.90	53.42	71.93	48.88
貴金属	2.29	8.82	3.01	7.57
エネルギー	39.54	77.24	105.18	62.14
その他コモディティ	26.08	42.45	49.77	38.83

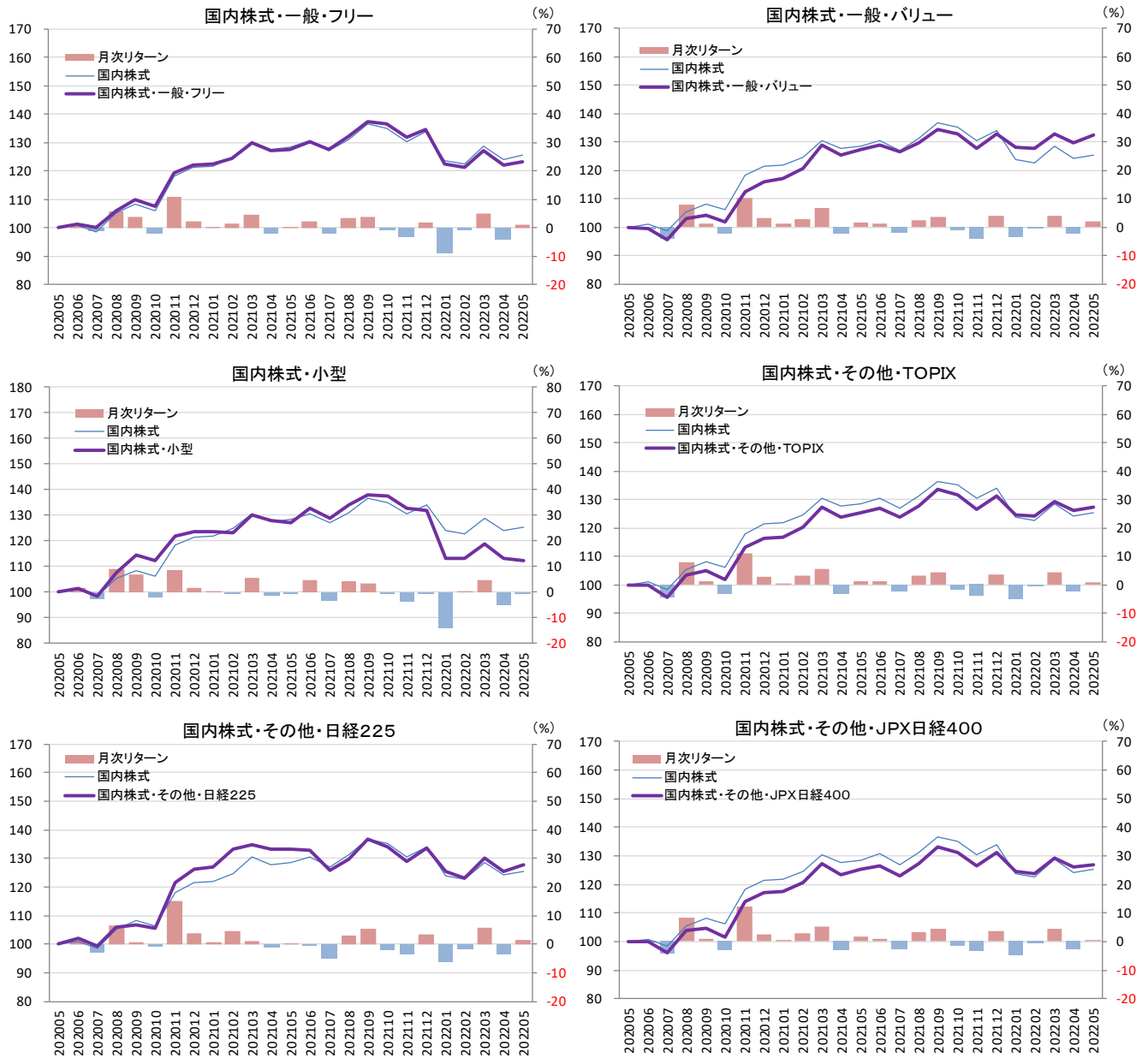
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

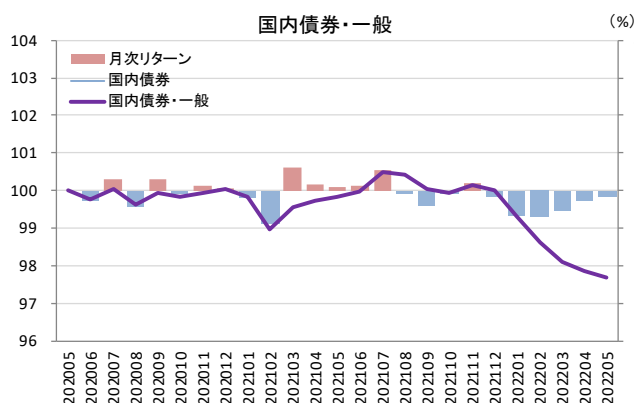
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

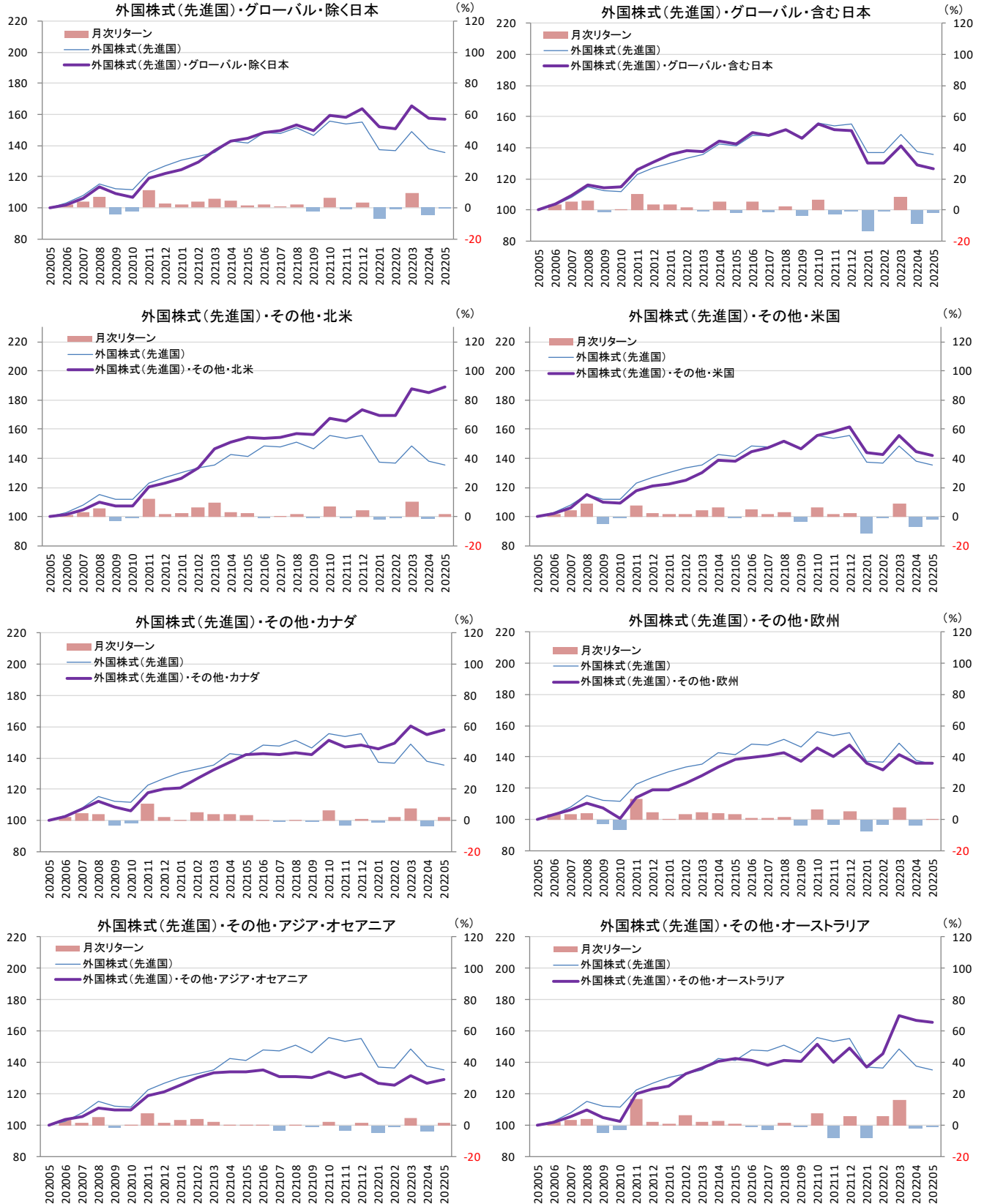


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

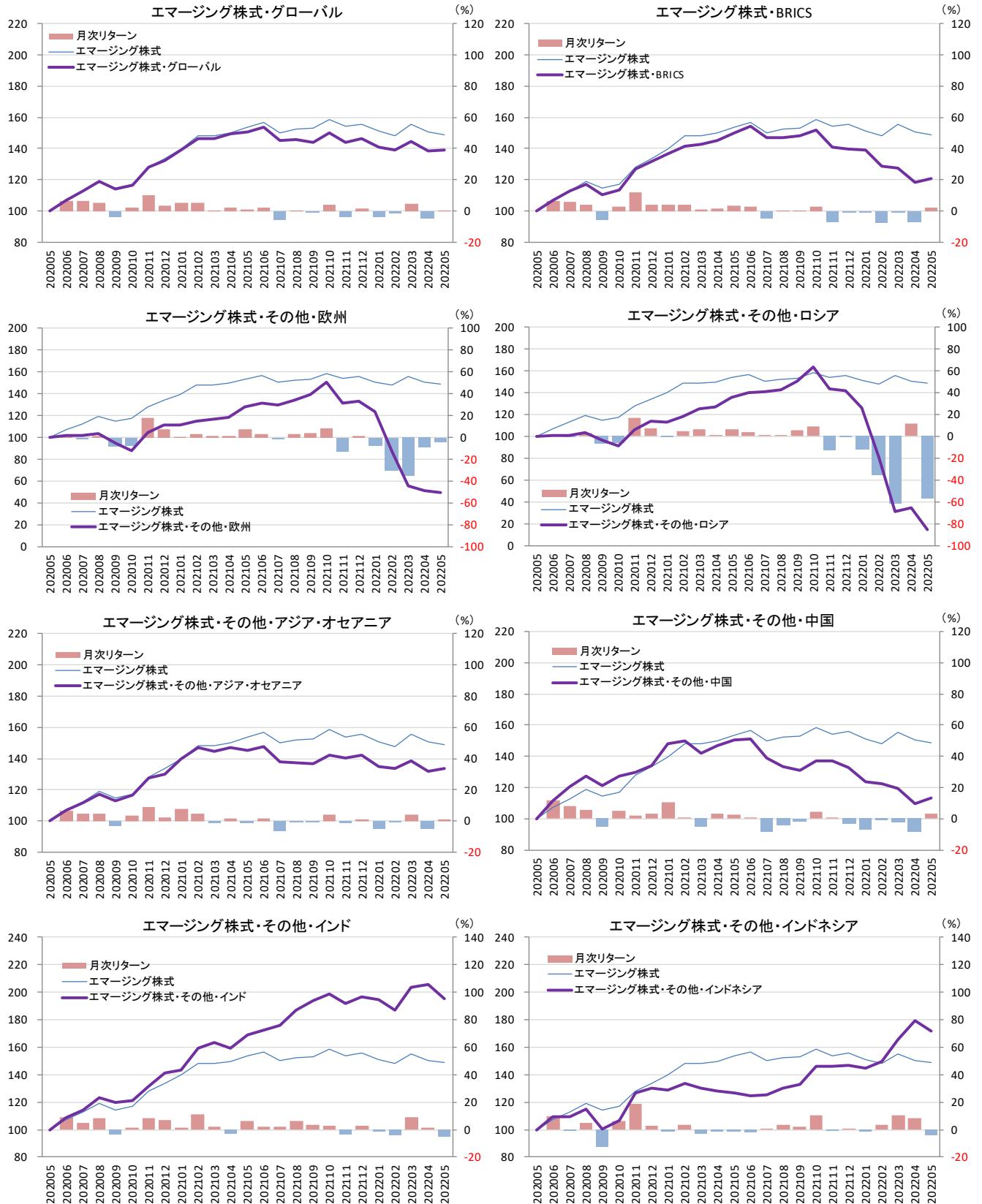


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマージング株式]

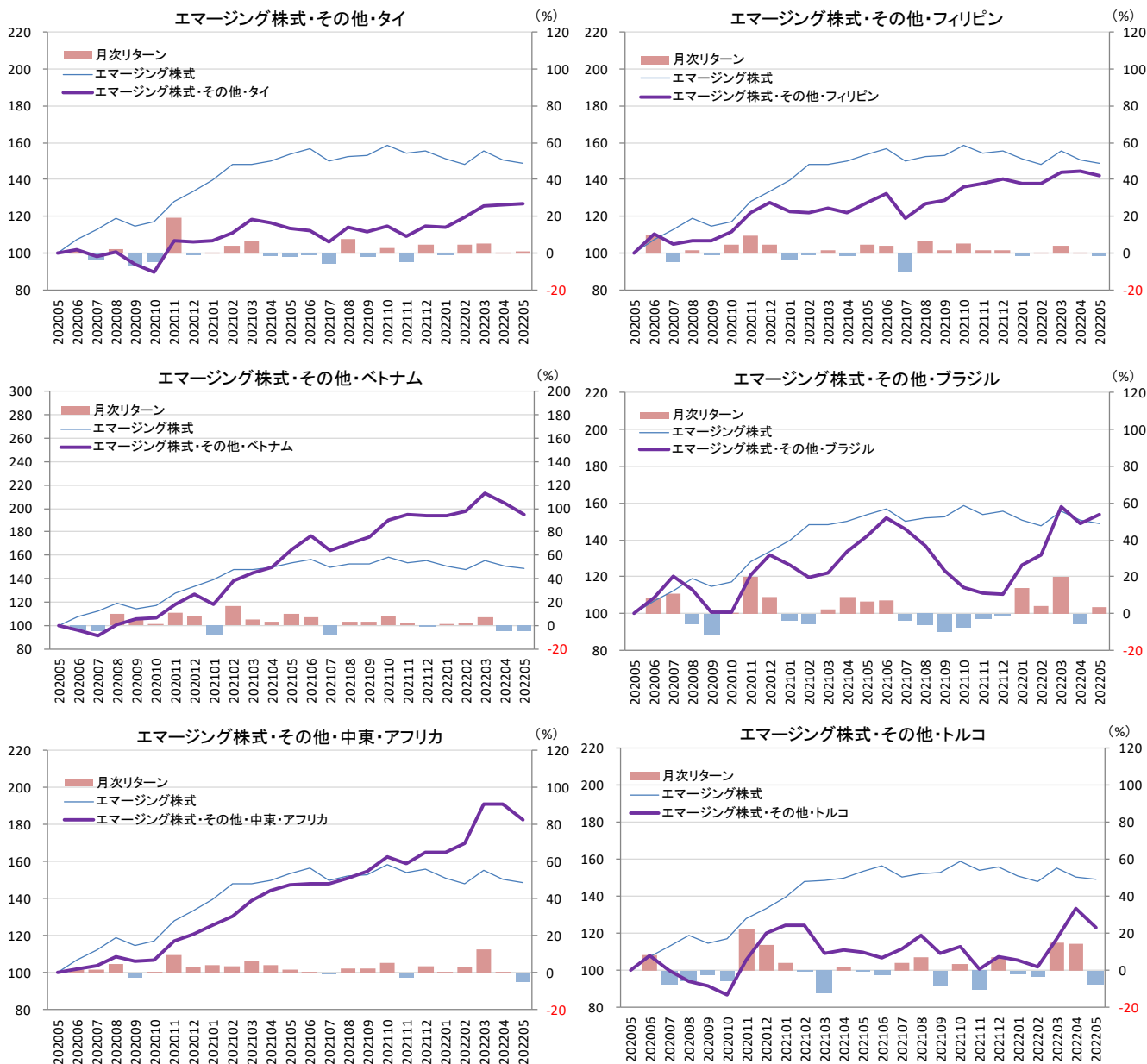


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

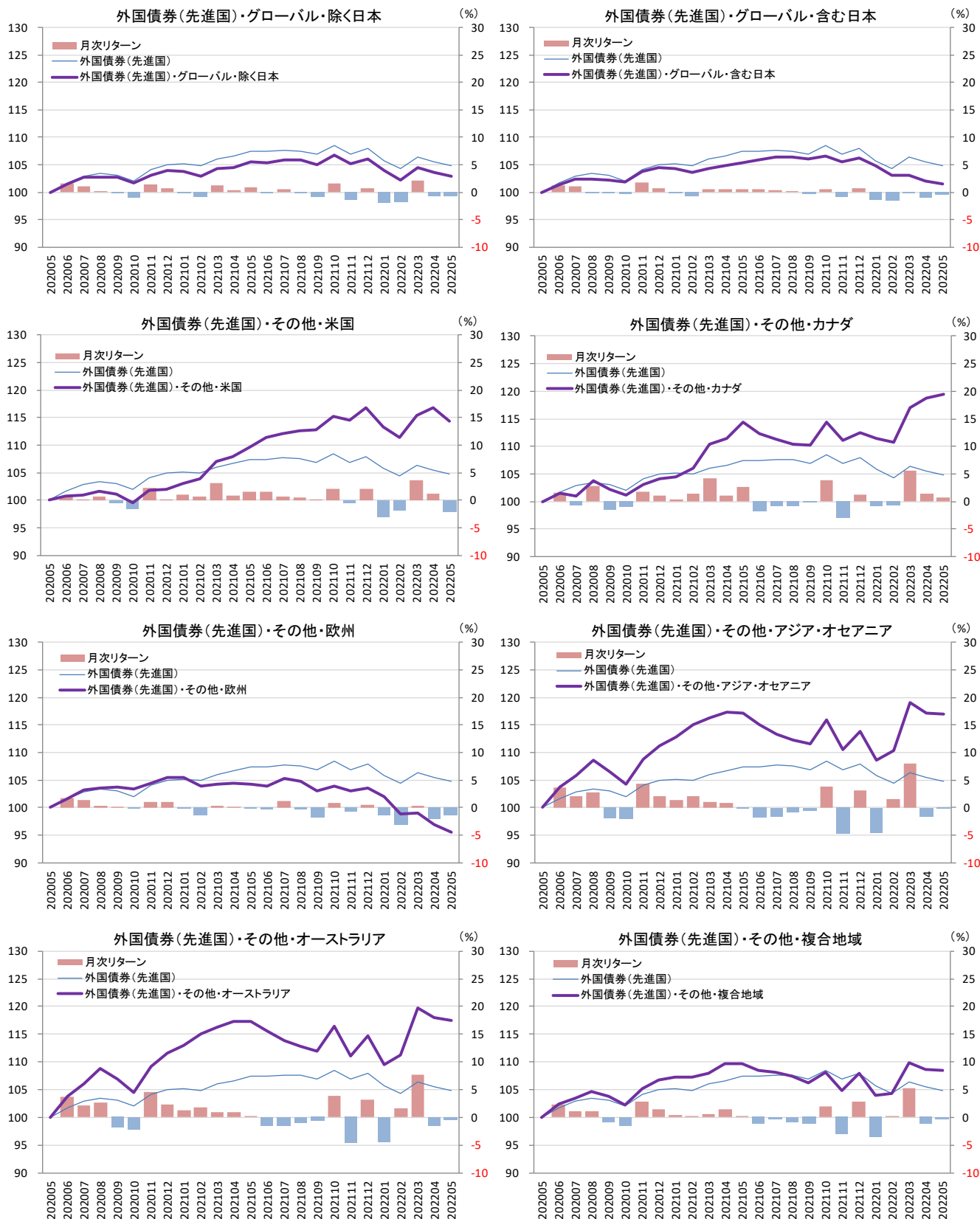


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

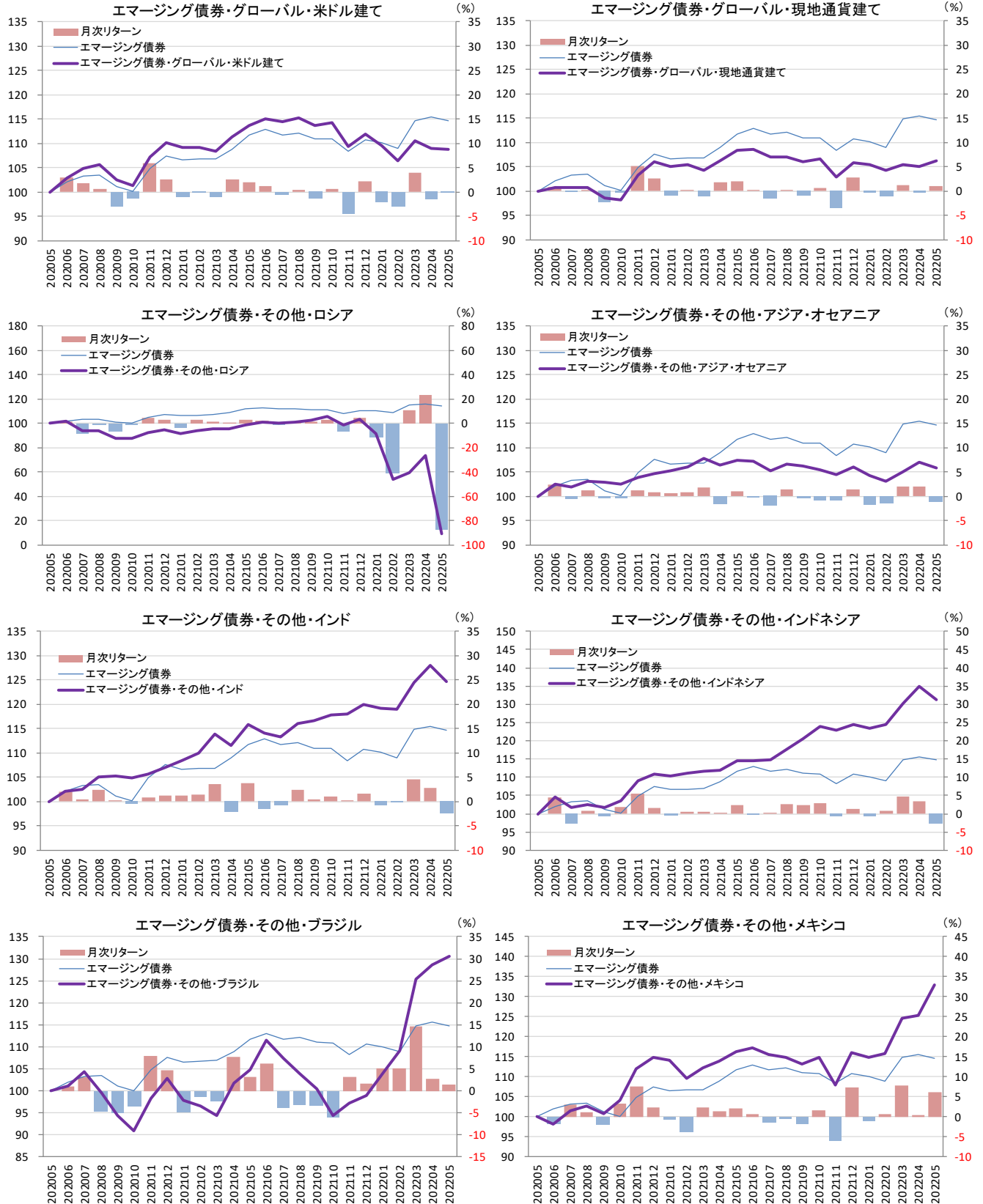


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

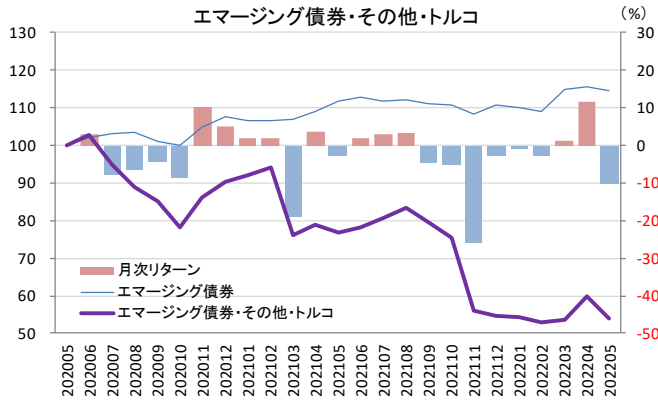


<1>パフォーマンス・サマリー

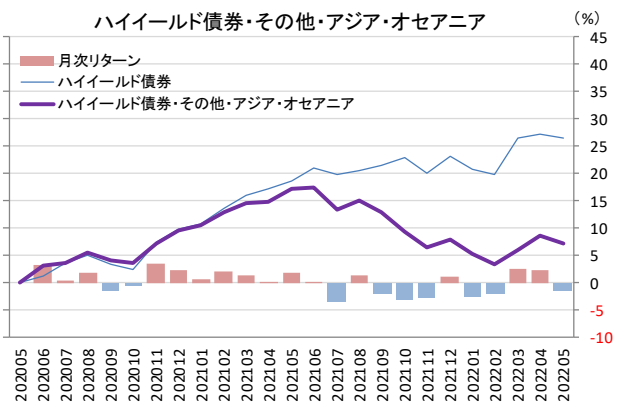
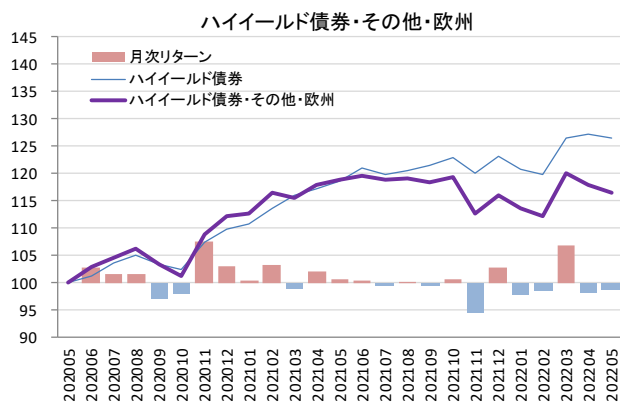
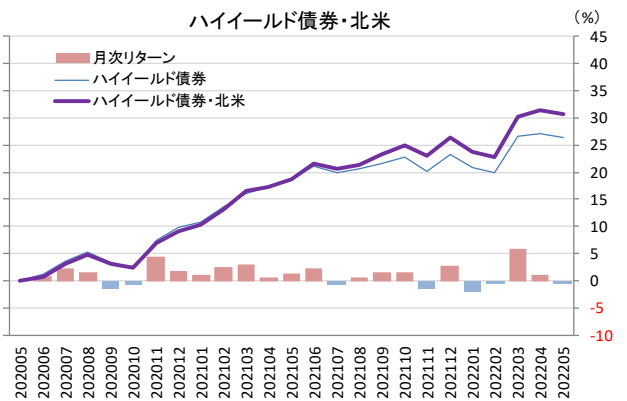
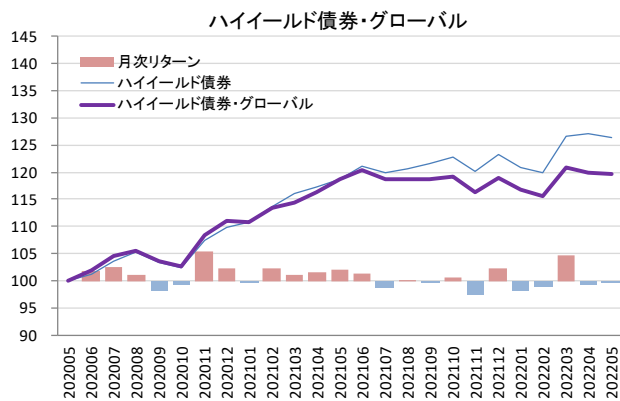
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

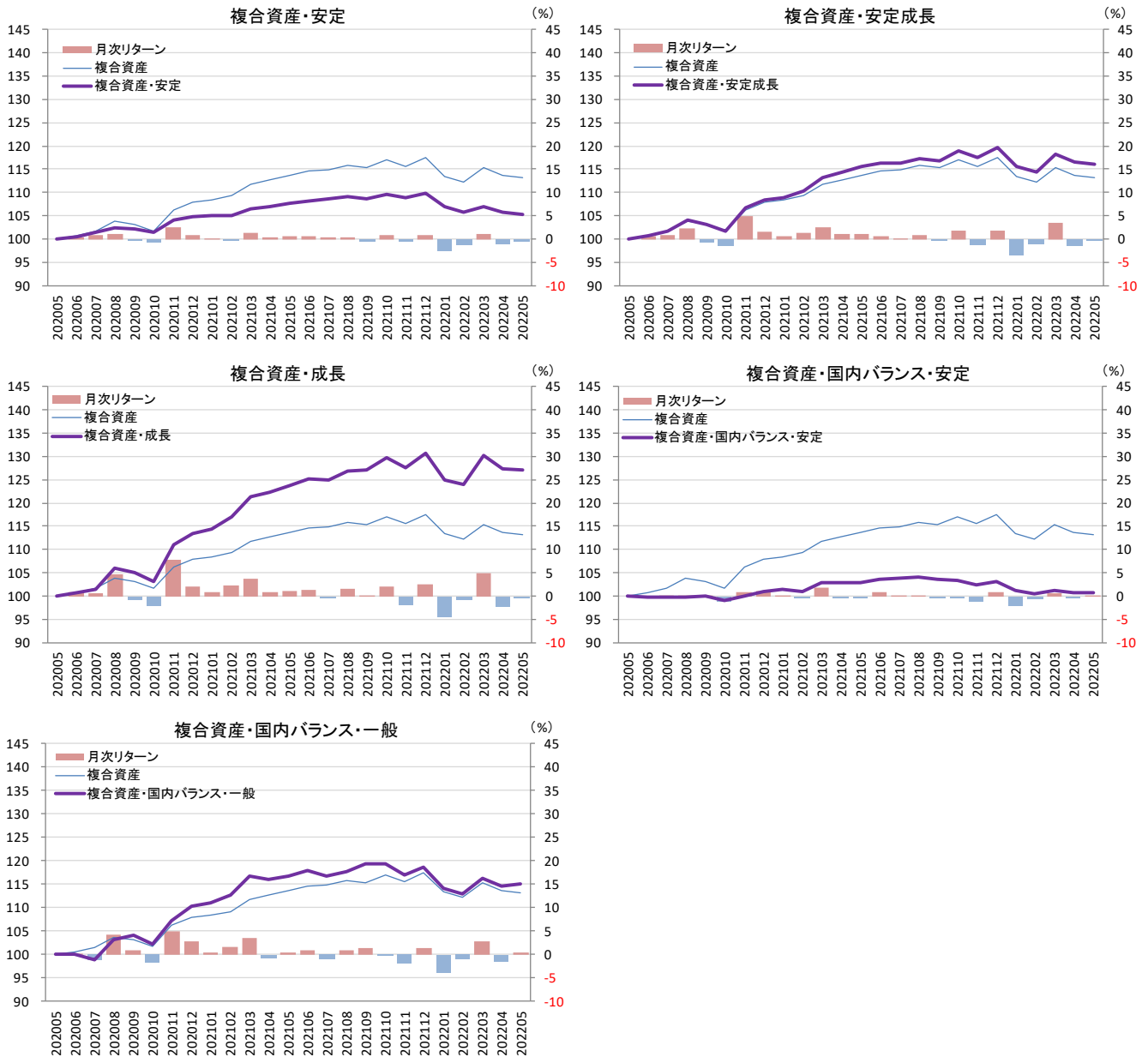


<1>パフォーマンス・サマリー

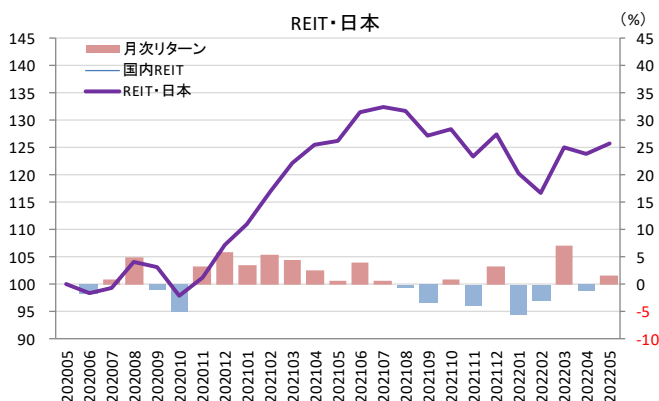
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

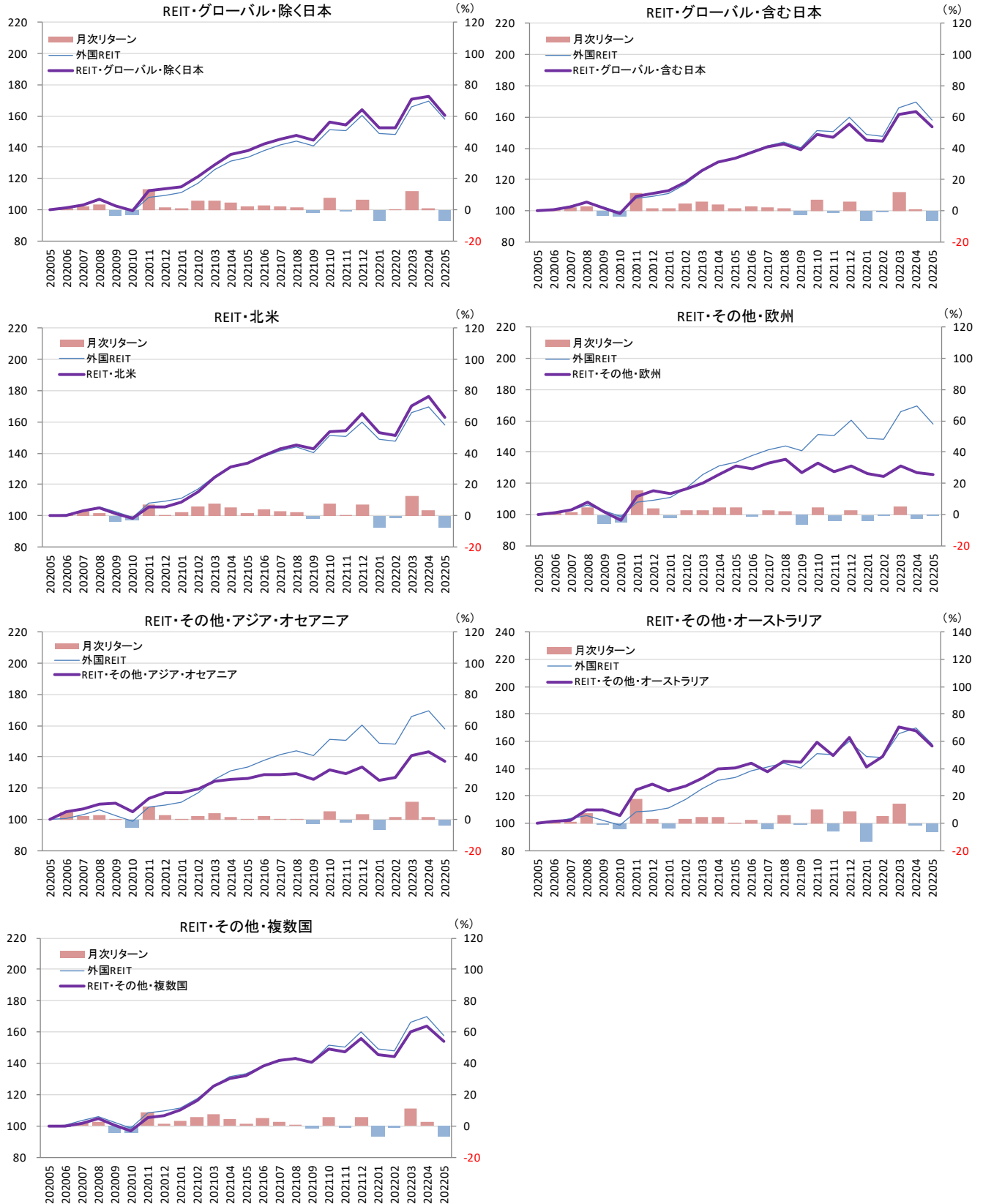


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

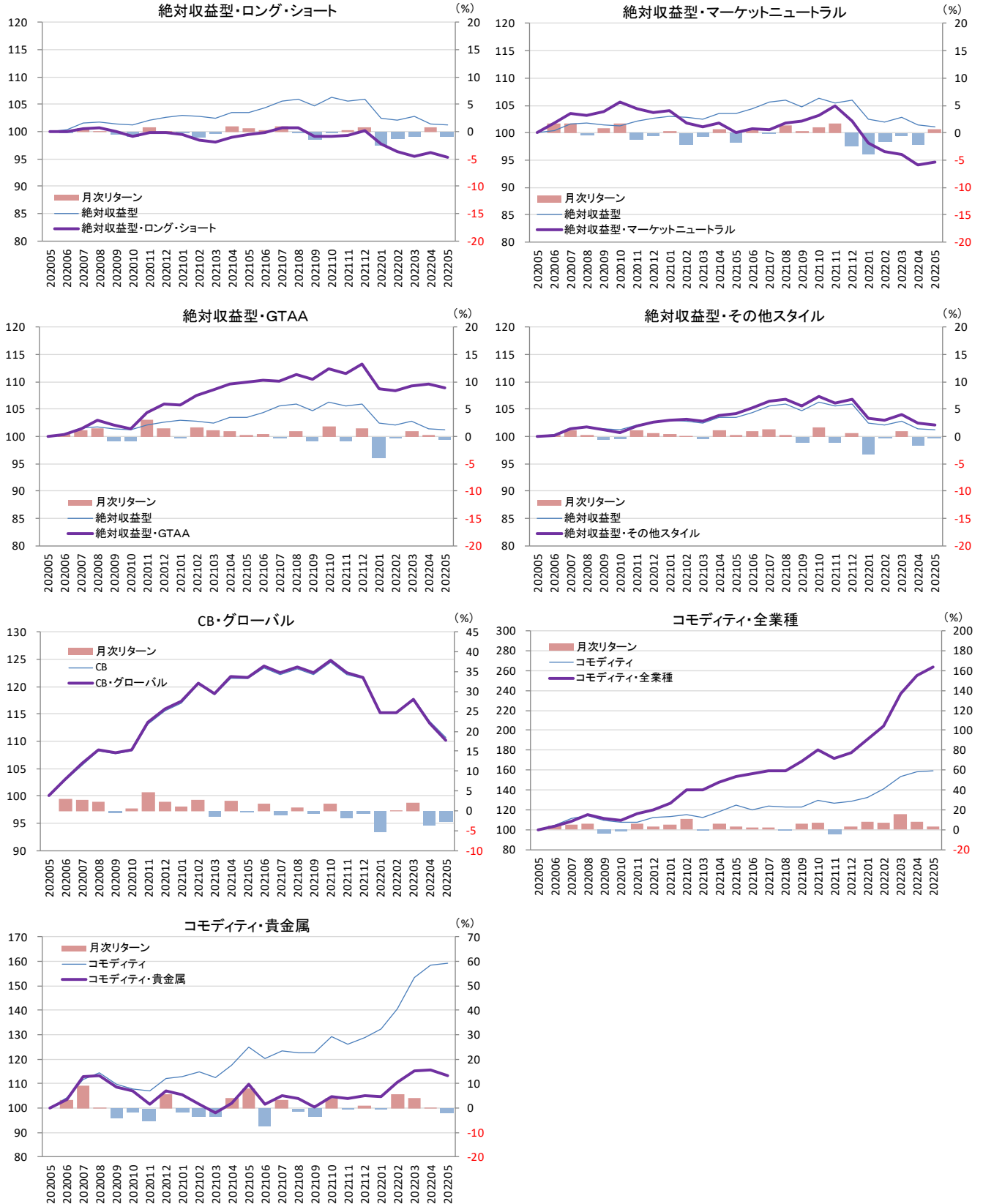


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



＜1＞パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	-1.10		
1	国内株式・一般	1.21	6.69	0.09
2	国内株式・その他	1.16	4.66	0.06
3	REIT・日本	1.67	3.32	0.06
4	エマージング株式・グローバル	0.58	1.07	0.01
5	コモディティ	0.39	0.58	0.00
6	エマージング株式・BRICS	2.18	0.06	0.00
7	エマージング債券・グローバル	0.13	0.73	0.00
8	国内株式・業種特化	1.02	0.08	0.00
9	複合資産・国内バランス	0.05	1.01	0.00
10	複合資産・成長	-0.12	2.59	-0.00
11	ハイイールド債券・グローバル	-0.32	0.32	-0.00
12	ハイイールド債券・その他	-1.25	0.26	-0.00
13	CB	-2.65	0.13	-0.00
14	絶対収益型	-0.28	1.39	-0.00
15	国内株式・小型	-0.77	0.76	-0.00
16	ブルベア	-1.85	0.48	-0.01
17	国内債券・一般	-0.15	5.23	-0.01
18	複合資産・その他	-1.97	0.42	-0.01
19	ハイイールド債券・北米	-0.52	1.40	-0.01
20	エマージング債券・その他	-1.76	0.62	-0.01
21	外国債券(先進国)・その他	-0.93	1.95	-0.02
22	複合資産・安定成長	-0.31	6.70	-0.02
23	REIT・その他	-4.42	0.42	-0.02
24	複合資産・安定	-0.50	4.70	-0.02
25	外国債券(先進国)・グローバル	-0.55	7.77	-0.04
26	エマージング株式・その他	-2.05	2.16	-0.05
27	REIT・グローバル	-6.34	2.27	-0.16
28	外国株式(先進国)・その他	-1.88	11.91	-0.22
29	REIT・北米	-7.76	2.98	-0.26
30	外国株式(先進国)・グローバル	-1.58	27.35	-0.44
	合計		100.00	-1.10

◆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	-1.54		
1	REIT・北米	22.01	2.94	0.53
2	REIT・グローバル	15.45	2.32	0.30
3	外国株式(先進国)・その他	2.87	10.72	0.16
4	ハイイールド債券・北米	10.08	1.42	0.13
5	コモディティ	27.49	0.48	0.12
6	複合資産・成長	2.78	2.34	0.07
7	エマージング債券・その他	10.89	0.66	0.06
8	複合資産・安定成長	0.46	6.54	0.04
9	REIT・その他	9.49	0.45	0.04
10	外国債券(先進国)・その他	0.76	2.10	0.01
11	ハイイールド債券・グローバル	0.67	0.33	0.00
12	国内株式・その他	-1.34	4.44	-0.00
13	国内株式・業種特化	-3.16	0.08	-0.00
14	REIT・日本	-0.42	3.40	-0.00
15	エマージング株式・その他	-0.16	2.40	-0.01
16	CB	-8.91	0.16	-0.01
17	ハイイールド債券・その他	-3.41	0.29	-0.01
18	エマージング株式・BRICS	-19.35	0.07	-0.02
19	複合資産・国内バランス	-1.89	1.09	-0.02
20	エマージング債券・グローバル	-3.78	0.78	-0.03
21	絶対収益型	-2.31	1.24	-0.04
22	複合資産・その他	-9.52	0.52	-0.04
23	国内株式・一般	-1.85	6.85	-0.09
24	国内株式・小型	-11.63	0.86	-0.09
25	エマージング株式・グローバル	-7.91	1.11	-0.11
26	複合資産・安定	-2.31	4.51	-0.12
27	国内債券・一般	-2.13	4.90	-0.12
28	ブルベア	-21.51	0.47	-0.12
29	外国債券(先進国)・グローバル	-3.13	7.66	-0.26
30	外国株式(先進国)・グローバル	-6.71	28.84	-1.89
	合計		100.00	-1.54

◆計算定義

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

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

<2>リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別①

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	24.80	28.38	113.52	12.41	11.11 ↑	10.85	0.62	0.46	0.73
国内株式	33.29	34.97	219.32	15.83 ↓	15.65	16.40	0.64	0.40	0.75
一般	32.63	31.84	203.62	15.58 ↓	15.56	16.64	0.64	0.37	0.71
フリー	31.62	31.33	204.81	15.93 ↓	15.90	17.20	0.60	0.36	0.69
バリュー	35.69	32.80	207.07	15.03 ↓	14.81	15.39	0.71	0.40	0.77
小型	21.01	31.65	297.74	20.38	19.21	18.28	0.32	0.30	0.81
その他	36.72	41.78	240.54	15.83 ↓	15.43	16.05	0.70	0.47	0.81
日経225	37.94	48.45	261.03	17.11 ↓	16.44	16.54	0.66	0.50	0.83
TOPIX	34.70	34.83	219.58	14.97 ↓	14.72	15.73	0.70	0.42	0.78
JPX日経400	35.39	34.36	-	15.30 ↓	14.82	-	0.70	0.41	-
国内債券	-2.97	-0.87	7.41	1.89	1.64	1.66	-0.51	-0.08	0.43
一般	-2.97	-0.87	7.41	1.89	1.64	1.66	-0.51	-0.08	0.43
外国株式(先進国)	47.59	57.03	202.86	18.71	17.29 ↑	15.84	0.74	0.55	0.74
グローバル	46.38	55.63	212.77	18.82	17.43 ↑	15.84	0.72	0.53	0.76
除く日本	61.77	75.99	305.61	18.45	17.25	16.46	0.94	0.70	0.91
含む日本	41.72	49.74	190.30	19.35	17.77 ↑	15.89	0.64	0.48	0.71
その他	49.78	60.44	187.23	18.90	17.27 ↑	16.06	0.76	0.58	0.69
北米	88.61	102.03	260.00	19.02	18.62	17.33 ↓	1.24	0.81	0.79
米国	57.69	78.10	208.92	18.11	17.06 ↑	16.31	0.91	0.72	0.73
カナダ	38.17	38.20	70.63	20.83	18.41	15.97	0.55	0.37	0.34
欧州	35.21	31.38	184.98	19.14	17.50	16.42	0.55	0.32	0.67
ドイツ	32.34	18.78	-	23.76	21.55	-	0.41	0.16	-
イギリス	24.88	14.19	-	18.86 ↓	17.35	-	0.41	0.16	-
アジア・オセアニア	23.47	32.81	172.49	15.74	14.65	15.40	0.46	0.40	0.68
オーストラリア	34.33	32.21	140.71	28.23	23.36	20.18	0.37	0.25	0.46
ニュージーランド	32.10	60.74	-	20.94 ↑	18.32 ↑	-	0.47	0.55	-
複合地域	71.55	55.55	-	37.64	32.14	-	0.52	0.29	-
エマージング株式	29.05	32.77	127.50	20.28	17.89	17.14	0.44	0.33	0.50
グローバル	35.34	38.68	107.82	19.06	17.67	17.10	0.56	0.38	0.44
BRICS	6.51	21.53	110.97	23.40	20.64	19.79	0.09	0.19	0.39
その他	28.01	31.40	137.51	20.99	18.35	17.38	0.41	0.31	0.52
欧州	-55.72	-52.82	-30.83	39.07 ↑	31.99 ↑	27.08	-0.61	-0.43	-0.13
ロシア	-85.22	-82.16	-73.96	59.86 ↑	47.91 ↑	38.41 ↑	-0.79	-0.61	-0.33
アジア・オセアニア	24.09	22.34	119.39	18.16	16.99	16.29	0.41	0.24	0.50
中国	35.93	48.32	205.87	18.29 ↓	19.26	21.15	0.59	0.43	0.56
インド	41.05	47.59	267.32	26.32	23.22	23.21	0.46	0.35	0.60
インドネシア	22.71	15.19	61.18	30.93	26.47	24.50	0.23	0.11	0.20
タイ	0.92	9.39	61.34	24.56	21.11	18.66	0.01	0.09	0.26
フィリピン	-0.19	-8.34	76.20	22.55	19.55	19.51	-0.00	-0.09	0.30
ベトナム	62.52	83.91	258.42	28.69	25.53	21.46	0.61	0.51	0.63
韓国	55.19	24.92	92.25	25.28	22.53	18.91	0.63	0.20	0.36
香港	-3.65	5.08	71.12	19.31	18.45	18.36	-0.06	0.06	0.30
台湾	89.94	70.14	269.34	19.07 ↓	20.20 ↑	17.74	1.25	0.56	0.79
中南米	26.56	37.65	53.59	33.96	29.77	25.93	0.24	0.22	0.17
ブラジル	1.51	15.88	10.30	36.94	33.93	31.41	0.01	0.09	0.03
メキシコ	42.51	18.92	-	31.18	28.22	-	0.40	0.13	-
中東・アフリカ	54.34	54.45	160.73	20.04	17.78	16.73	0.78	0.51	0.60
トルコ	20.87	-29.84	-6.44	33.18	34.19	30.79	0.20	-0.20	-0.02
複合地域	26.91	20.17	108.91	18.47	16.89	15.74	0.45	0.22	0.49

※[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	24.80	28.38	113.52	12.41	11.11	↑ 10.85	0.62	0.46	0.73
外国債券(先進国)	6.12	6.71	40.77	4.76	4.33	6.24 ↓	0.43	0.31	0.56
グローバル	4.43	5.53	41.01	3.95	3.59	5.63 ↓	0.38	0.31	0.62
除く日本	6.98	8.33	46.06	3.76	3.73	6.17 ↓	0.61	0.44	0.63
含む日本	1.79	2.56	35.73	4.76	3.96	5.26	0.13	0.14	0.59
その他	12.48	11.33	43.15	8.18	7.32	↑ 8.25	0.49	0.30	0.44
北米	3.41	3.45	-	5.39	4.34	-	0.21	0.17	-
米国	12.45	13.95	59.81	8.07	↑ 6.72	6.71	0.50	0.40	0.72
カナダ	20.32	19.01	34.50	7.29	7.32	8.63	0.88	0.49	0.35
欧州	-6.04	-2.52	40.85	4.47	↑ 4.57	7.53 ↓	-0.45	-0.10	0.46
イギリス	13.10	9.79	-	7.88	7.78	-	0.54	0.25	-
アジア・オセアニア	14.31	11.15	42.31	10.82	9.60	9.87	0.42	0.23	0.36
オーストラリア	14.39	11.28	41.01	10.85	9.65	↑ 9.87	0.43	0.23	0.35
ニュージーランド	7.06	5.31	-	9.58	9.12	-	0.24	0.12	-
複合地域	15.28	17.59	51.08	5.72	5.45	7.76 ↓	0.85	0.61	0.54
エマージング債券	6.48	3.87	41.06	12.07	10.68	11.49	0.18	0.08	0.30
グローバル	1.07	-2.97	33.54	13.83	12.14	11.98	0.03	-0.05	0.25
米ドル建て	0.18	-3.41	35.03	14.54	12.64	12.32	0.01	-0.05	0.25
現地通貨建て	4.46	-1.35	26.90	11.62	10.81	11.08	0.13	-0.02	0.22
その他	13.82	12.58	48.60	11.30	↑ 10.06	↑ 12.10	0.39	0.24	0.33
ロシア	-90.04	-90.38	-87.29	60.73	↑ 47.86	↑ 38.15	-0.88	-0.78	-0.49
アジア・オセアニア	6.85	9.02	64.29	7.46	6.33	7.69 ↓	0.30	0.28	0.66
インド	20.59	21.68	117.05	9.08	8.63	11.74 ↓	0.71	0.47	0.69
インドネシア	36.24	28.20	51.11	15.30	14.04	15.49	0.71	0.37	0.27
ブラジル	3.53	1.94	37.57	20.26	19.07	18.51	0.06	0.02	0.18
メキシコ	32.10	37.27	69.39	18.54	17.15	16.01	0.53	0.38	0.34
トルコ	-33.78	-64.69	-65.55	28.43	33.36	26.45	-0.45	-0.56	-0.38
複合地域	-7.05	-3.09	12.51	13.64	12.06	↑ 12.77	-0.17	-0.05	0.09
ハイイールド債券	17.25	16.80	91.13	12.87	11.07	11.00	0.43	0.29	0.61
グローバル	9.84	9.26	73.13	13.04	11.11	11.12	0.25	0.16	0.51
北米	21.79	22.72	104.58	12.55	10.93	10.88	0.54	0.39	0.68
その他	5.26	1.52	67.59	14.66	12.52	12.09 ↓	0.12	0.03	0.44
欧州	6.85	2.08	77.96	15.47	13.36	12.97 ↓	0.15	0.03	0.46
アジア・オセアニア	-1.76	-1.45	60.07	13.10	10.82	10.57	-0.04	-0.02	0.46
複合地域	16.76	19.21	105.62	9.62	8.46	9.62	0.55	0.43	0.78
複合資産	13.83	16.68	92.02	7.31	6.69	7.84 ↓	0.61	0.47	0.86
安定	6.40	7.88	64.15	4.86	4.55	6.22 ↓	0.44	0.35	0.82
安定成長	17.16	20.48	100.53	7.90	7.25	8.23 ↓	0.69	0.53	0.88
成長	30.49	34.84	155.32	10.92	10.49	10.85	0.85	0.59	0.91
国内バランス	-1.78	1.28	37.49	4.38	3.75	5.87	-0.13	0.08	0.55
安定	-2.81	-0.04	27.24	4.25	3.55	3.28	-0.22	0.01	0.74
一般	18.15	21.23	76.83	8.34 ↓	8.23	9.43	0.69	0.48	0.62

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

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

<2> リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別③

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	24.80	28.38	113.52	12.41	11.11 ↑	10.85	0.62	0.46	0.73
国内REIT	15.30	34.53	199.65	18.01	14.63	16.46	0.27	0.42	0.70
日本	15.30	34.53	199.65	18.01	14.63	16.46	0.27	0.42	0.70
外国REIT	36.17	50.00	195.31	20.27 ↑	17.55 ↑	16.05	0.54	0.48	0.71
グローバル	30.52	40.94	168.83	21.28	18.18 ↑	16.29	0.44	0.39	0.64
除く日本	36.50	51.87	208.26	22.07	18.77 ↑	16.61	0.50	0.47	0.72
含む日本	28.65	38.34	162.48	21.01 ↑	17.99 ↑	16.19	0.42	0.38	0.63
北米	44.10	60.03	220.65	19.58 ↑	17.42 ↑	16.28	0.66	0.57	0.76
その他	18.35	37.37	179.73	22.34	18.41 ↑	16.13	0.26	0.36	0.67
欧州	6.76	5.93	108.98	21.36	18.44	17.77	0.10	0.07	0.43
アジア・オセアニア	16.03	40.77	197.00	20.36 ↑	17.08 ↑	15.79	0.25	0.42	0.73
オーストラリア	21.30	30.34	161.28	34.73	27.83	22.73	0.19	0.20	0.44
複合地域	11.62	4.26	115.25	29.15	24.34	20.65	0.13	0.04	0.39
複数国	39.44	60.68	265.51	18.96 ↑	16.25 ↑	15.04	0.62	0.61	0.92
その他									
絶対収益型	0.18	-0.67	3.85	3.35 ↑	2.92	2.85	0.03	-0.03	0.13
ロング・ショート	-6.96	-8.23	-8.68	3.39	3.36	3.05	-0.69	-0.49	-0.30
マーケットニュートラル	-5.88	-3.20	32.09	4.93 ↑	4.53	5.75	-0.40	-0.13	0.49
GTAA	10.29	10.52	20.05	5.11	4.33 ↑	3.47	0.66	0.48	0.53
その他スタイル	1.26	-1.12	7.62	3.55 ↑	3.02	3.74 ↓	0.13	-0.06	0.20
CB	9.94	8.48	54.45	10.14 ↑	8.47 ↑	7.89 ↓	0.32	0.20	0.56
アジア・オセアニア	36.05	42.19	138.12	13.54	11.79	11.60	0.80	0.62	0.78
日本	-0.22	-2.39	43.81	5.44	5.30	6.29	-0.01	-0.08	0.59
グローバル	9.63	8.19	53.32	10.41 ↑	8.66 ↑	7.94 ↓	0.30	0.19	0.55
コモディティ	64.27	63.87	34.86	12.73	11.15	12.87	1.42	0.93	0.24
全業種	96.07	95.29	61.84	22.04	18.72 ↑	17.12	1.14	0.77	0.29
貴金属	46.20	41.68	27.81	14.15	11.78	13.17 ↓	0.96	0.62	0.19
エネルギー	115.09	154.79	53.45	41.38	36.37	31.19	0.70	0.57	0.14
その他コモディティ	71.44	63.65	68.32	21.75	19.02	17.54	0.91	0.55	0.30

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

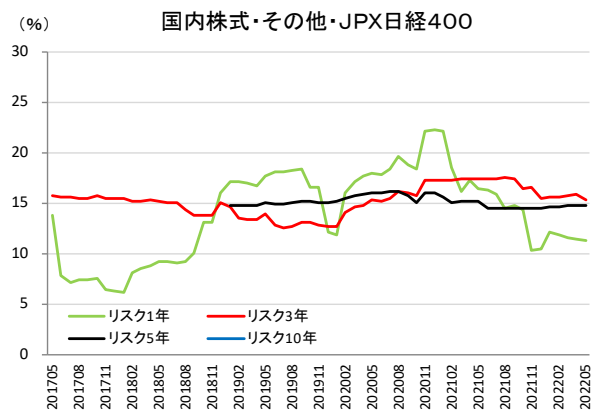
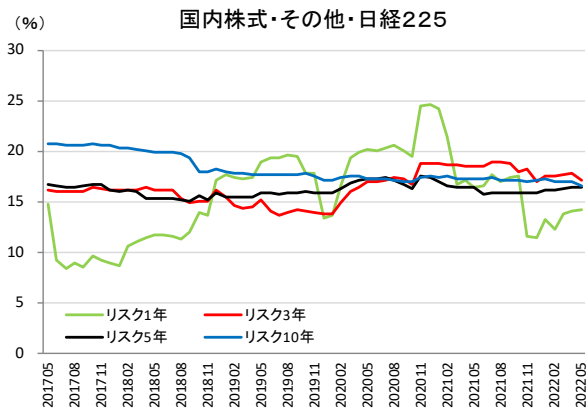
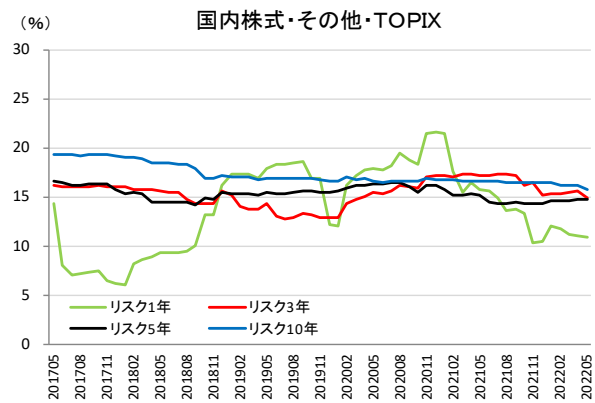
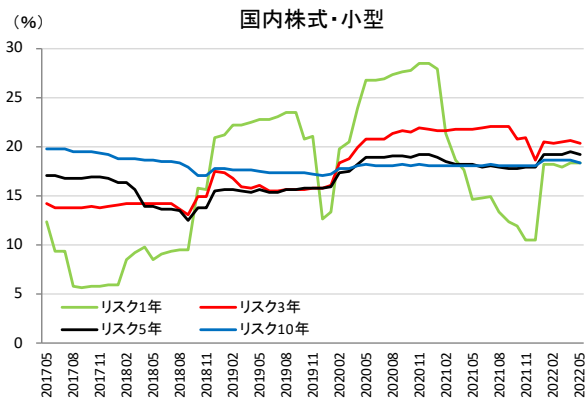
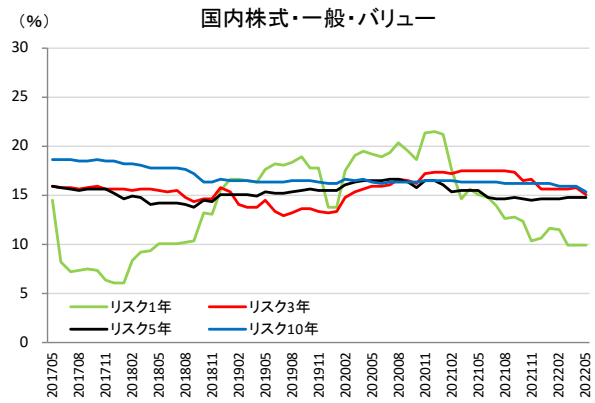
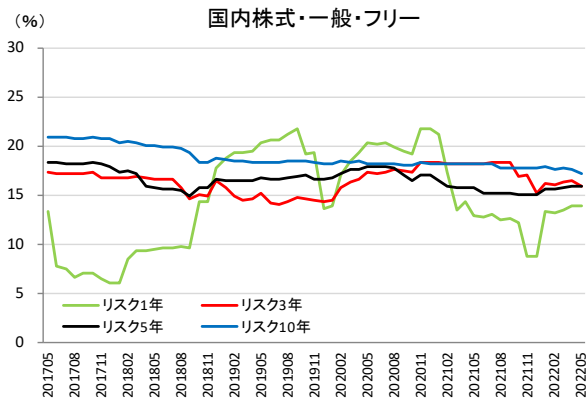
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2>リスク・サマリー

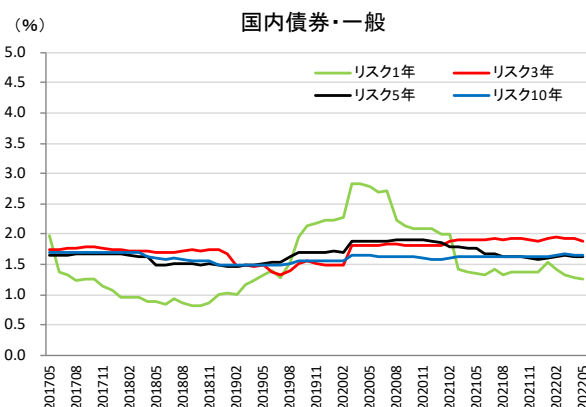
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

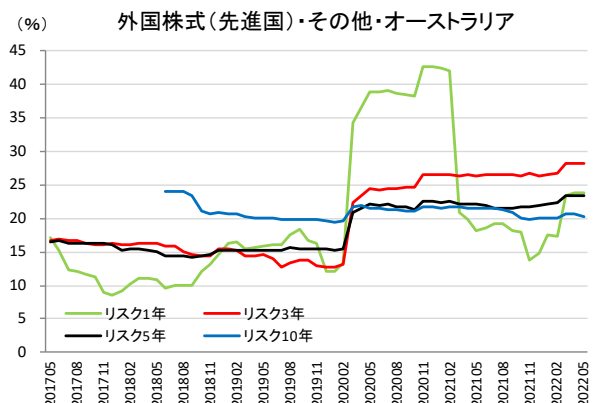
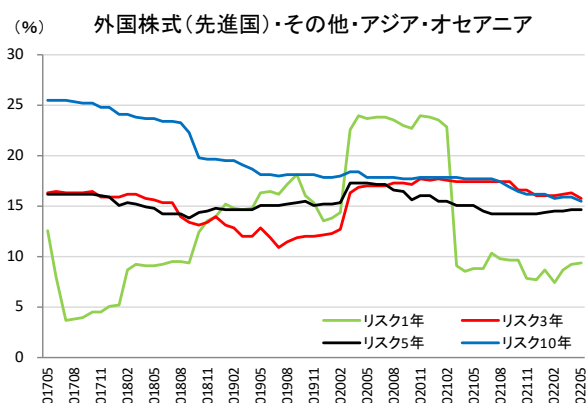
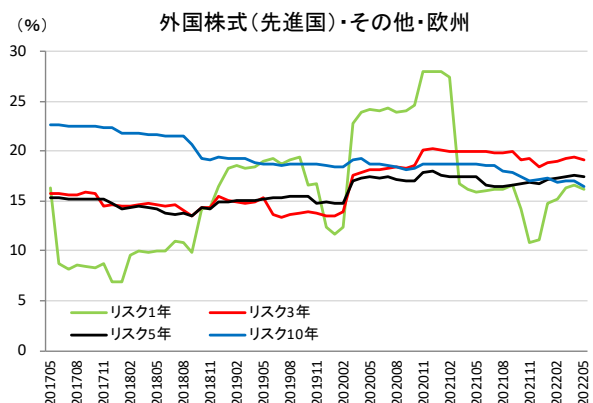
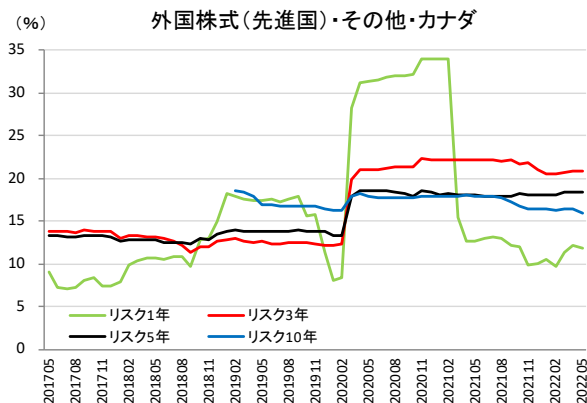
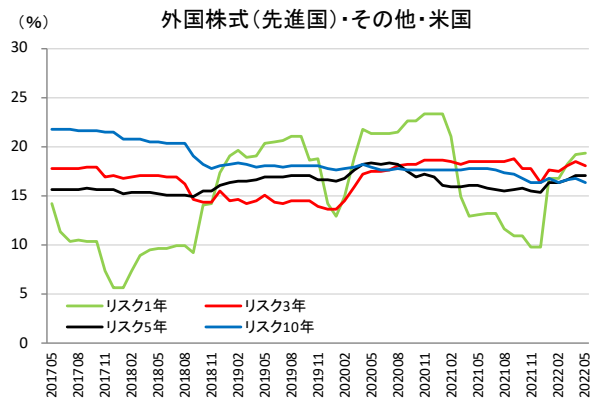
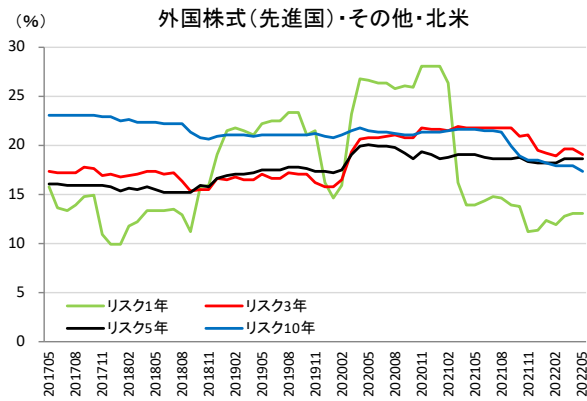
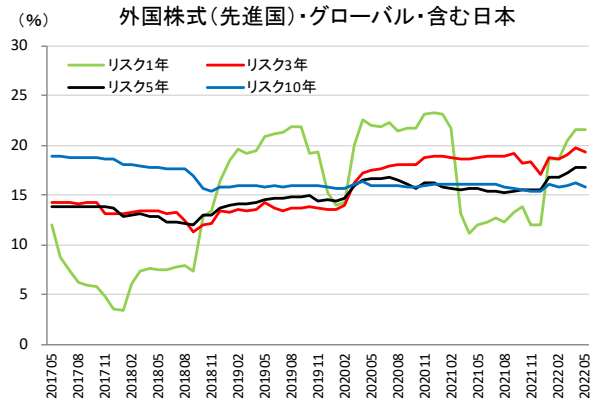
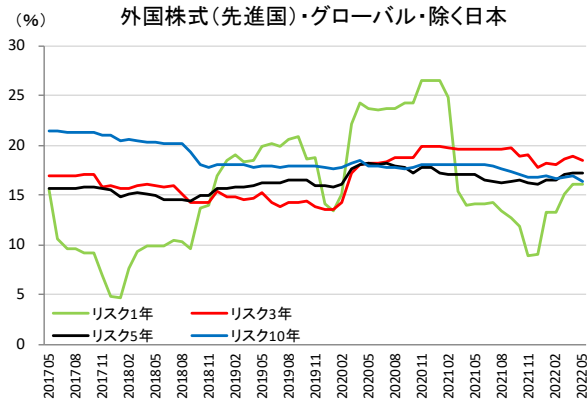


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

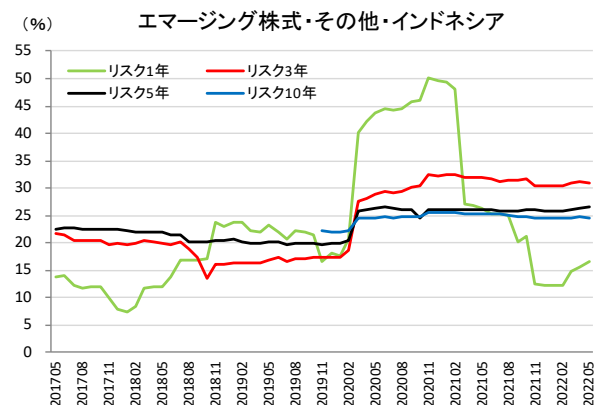
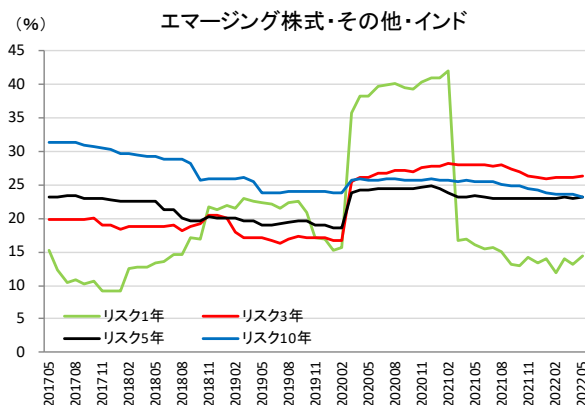
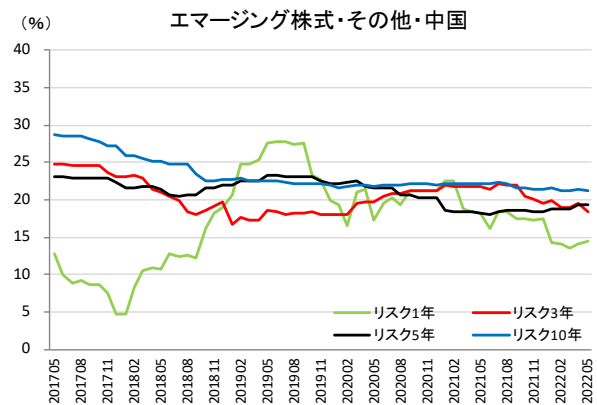
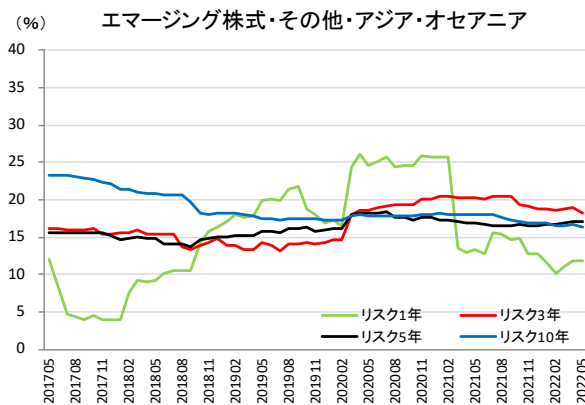
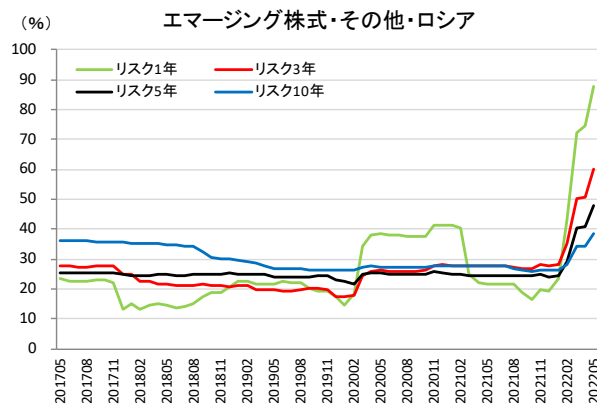
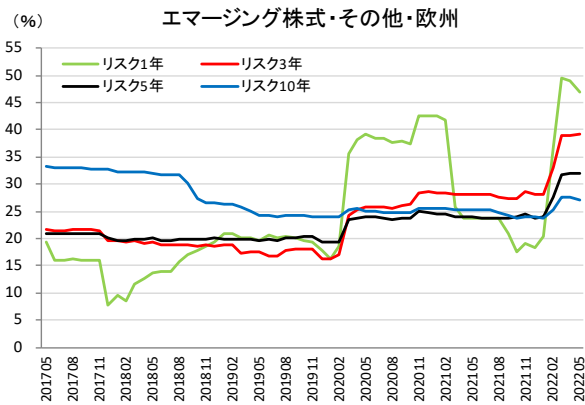
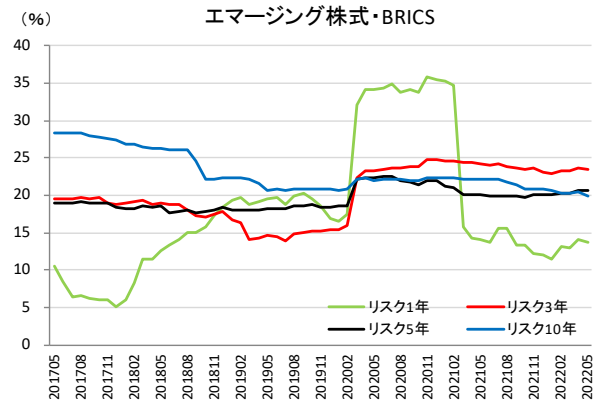
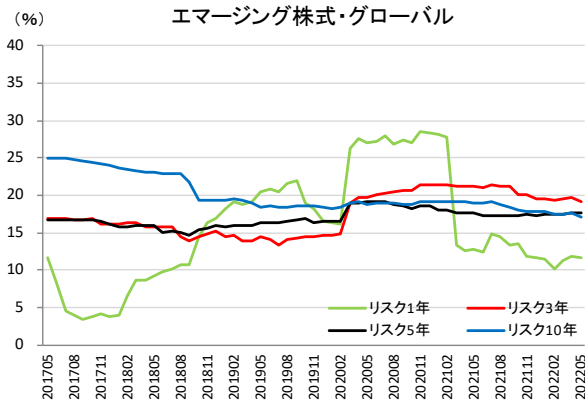


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

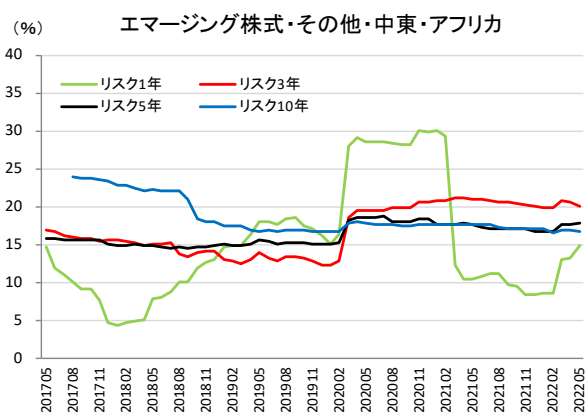
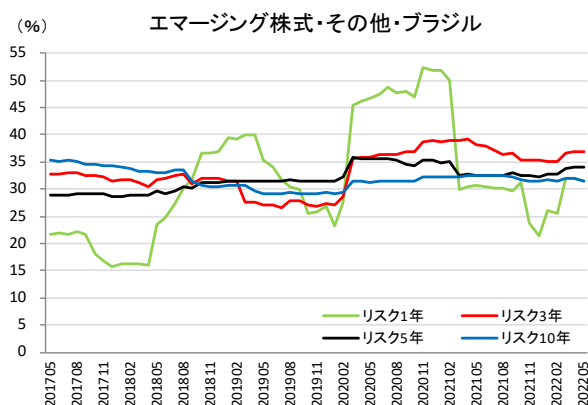
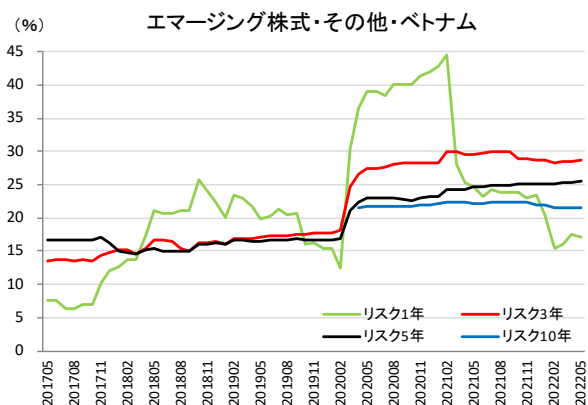
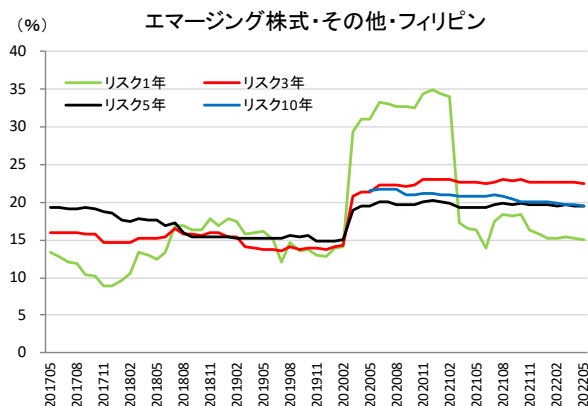
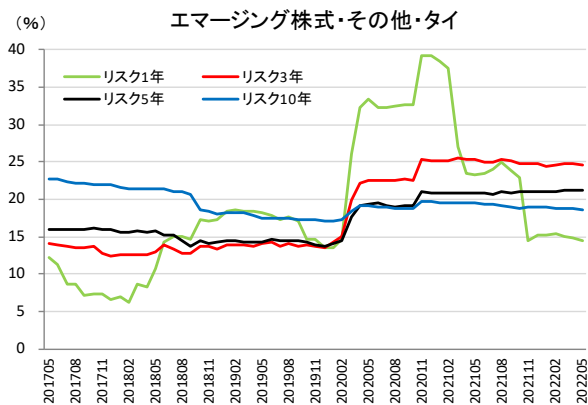


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

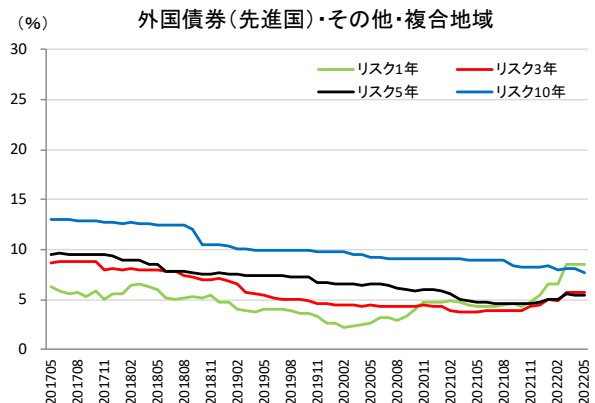
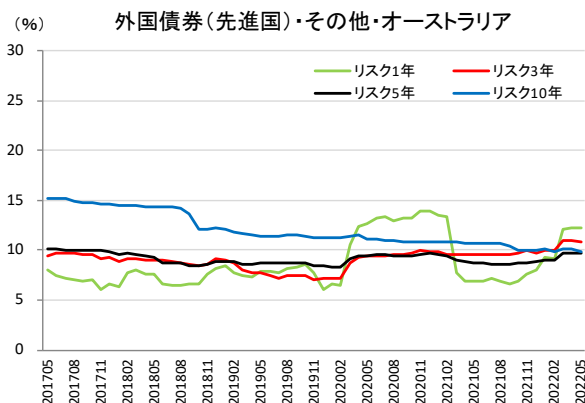
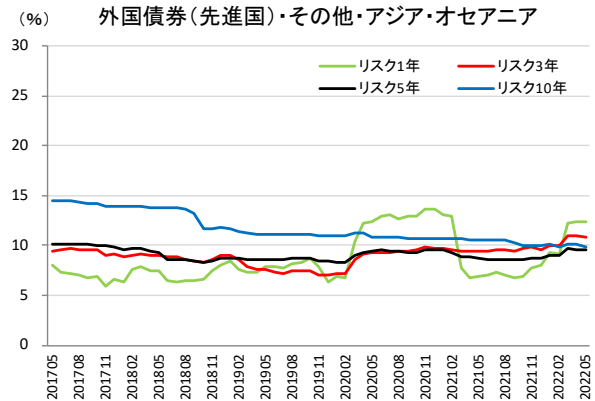
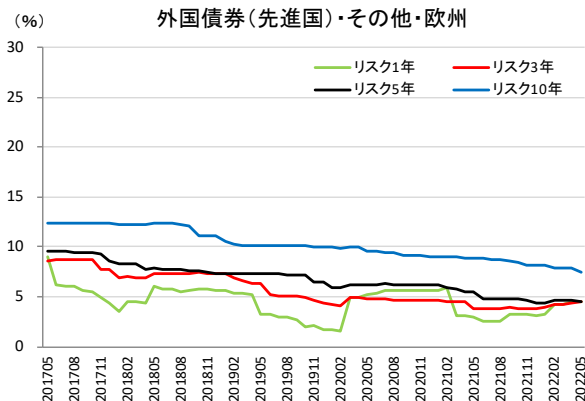
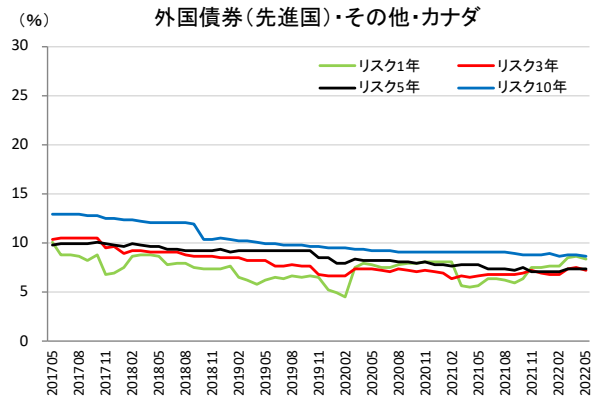
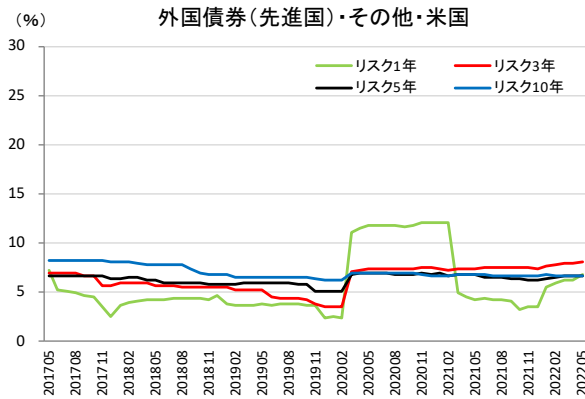
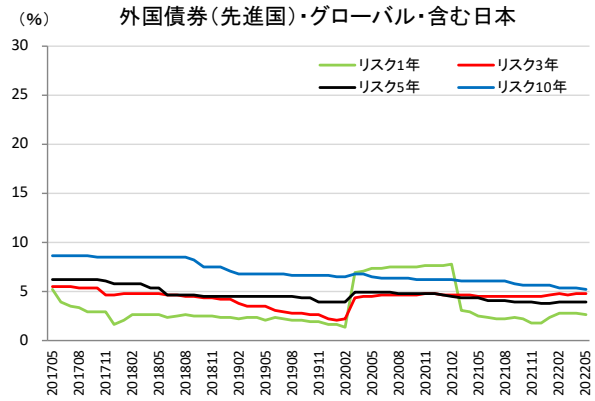
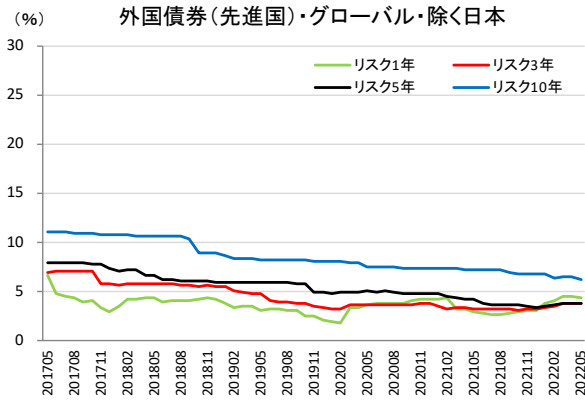


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

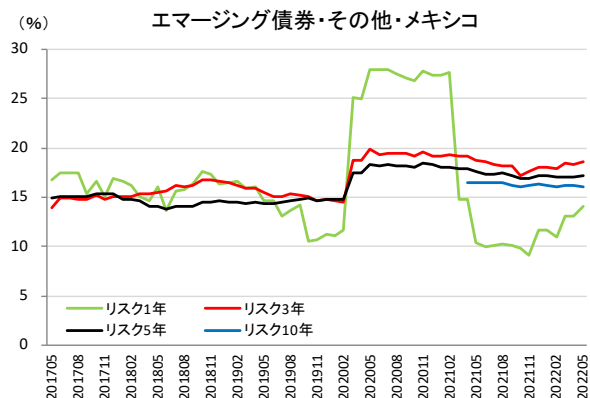
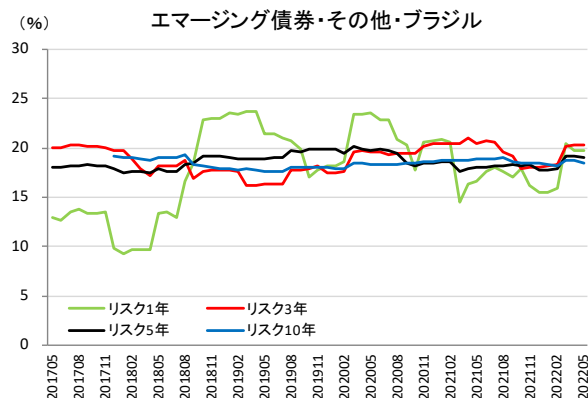
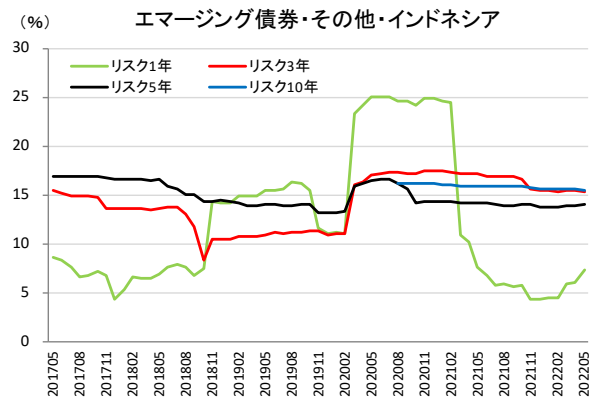
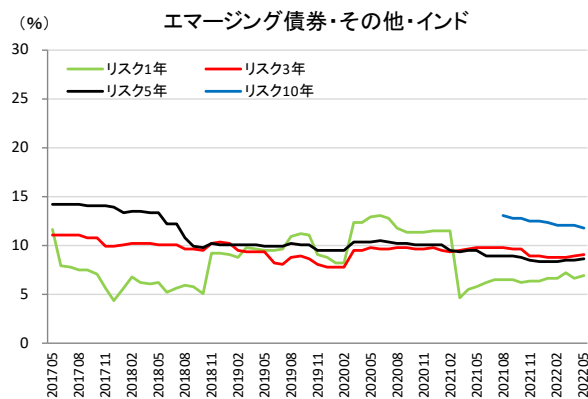
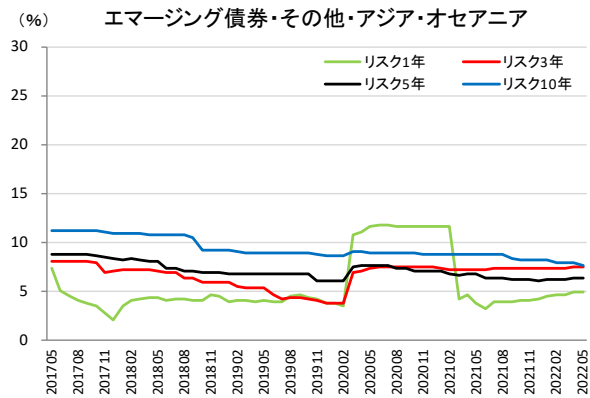
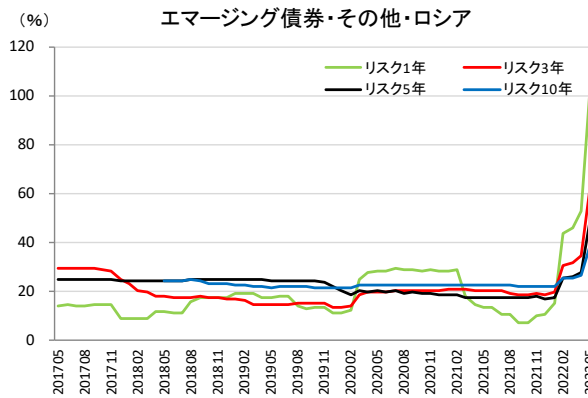
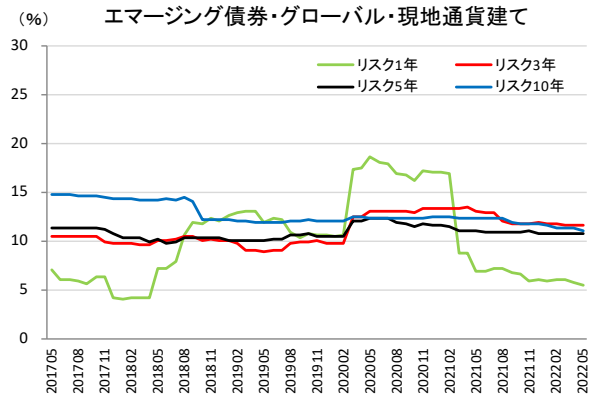
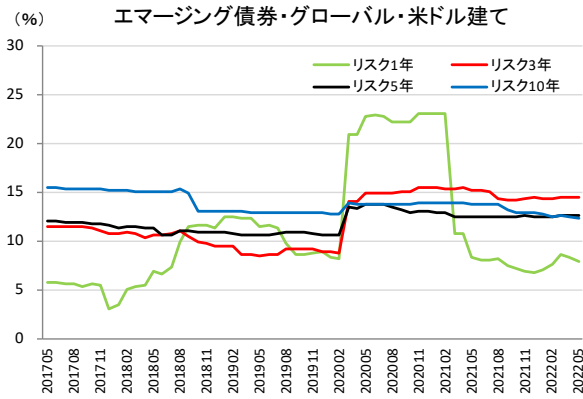


<2>リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

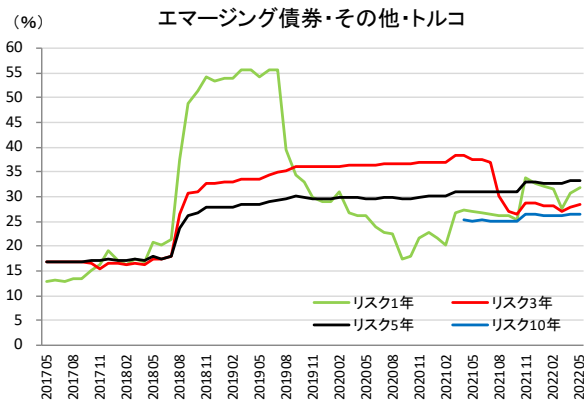


<2> リスク・サマリー

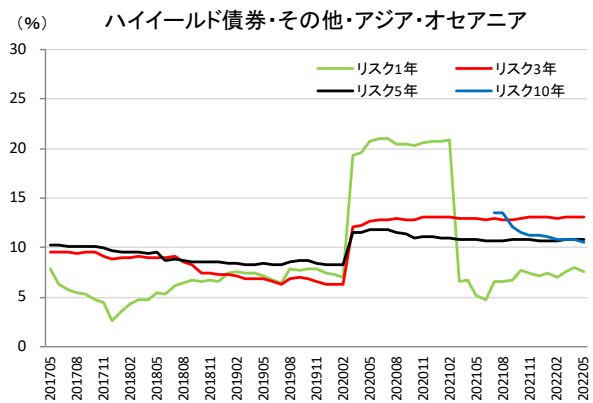
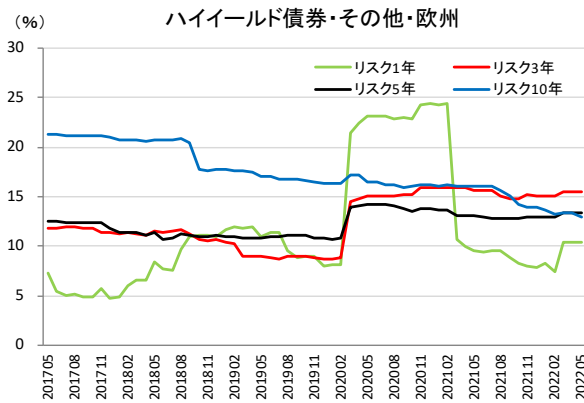
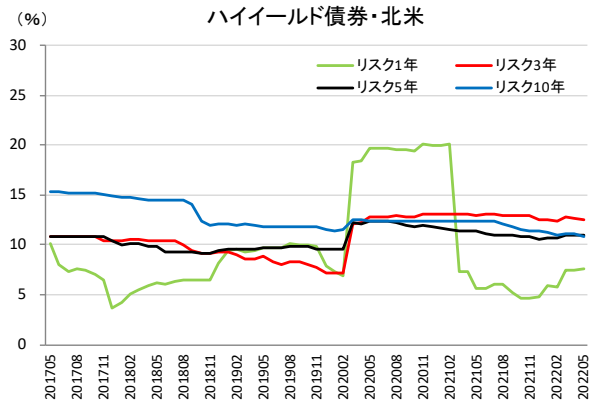
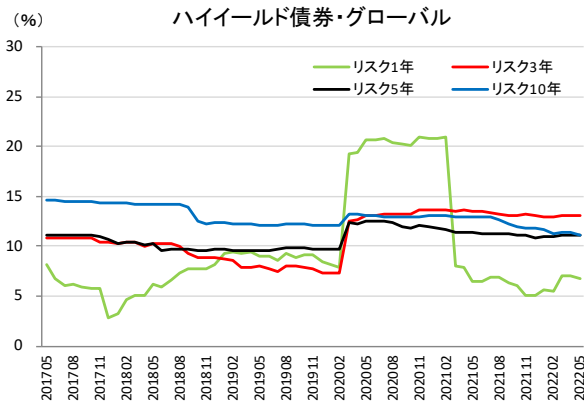
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

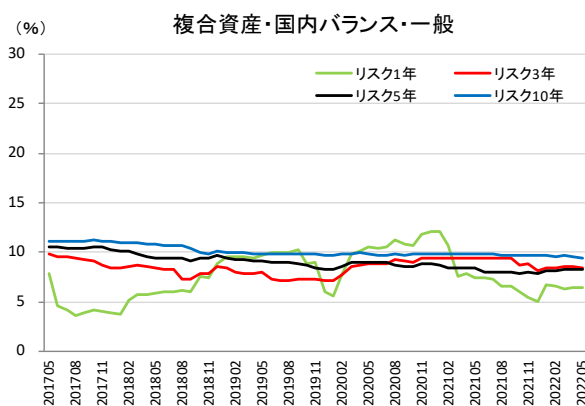
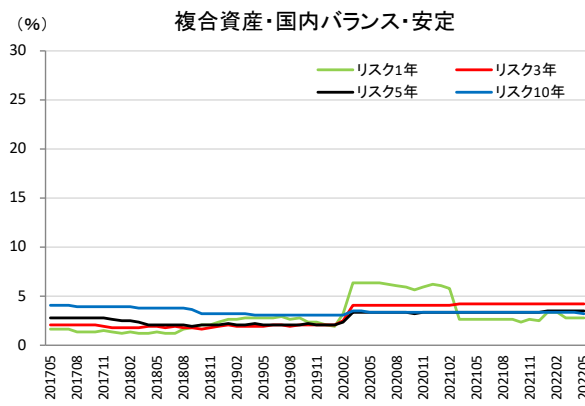
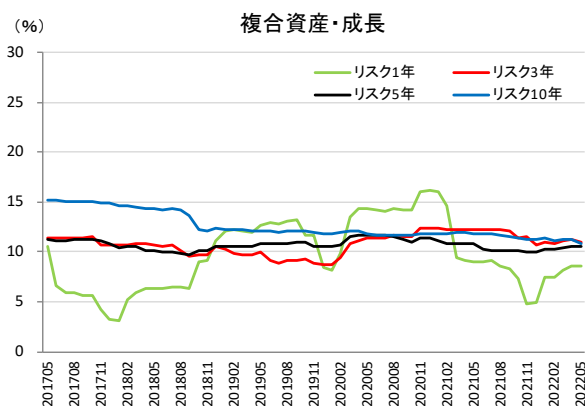
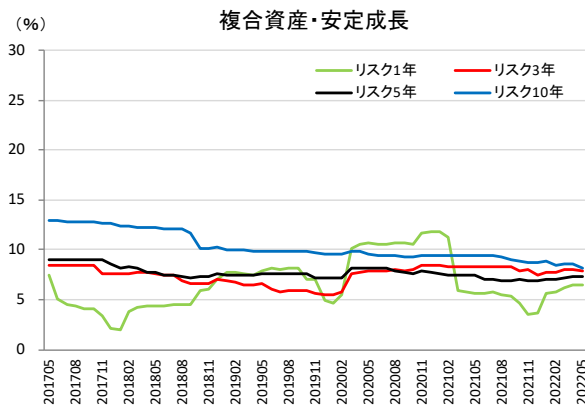
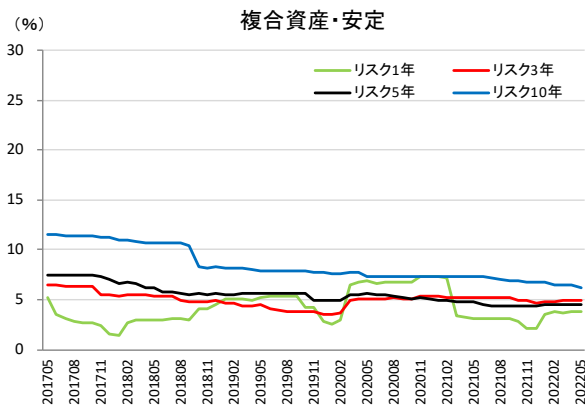


<2>リスク・サマリー

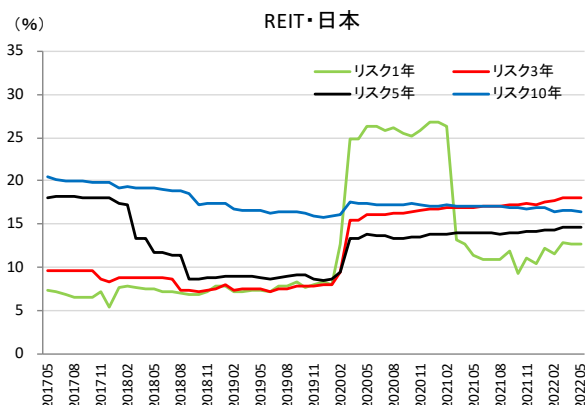
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

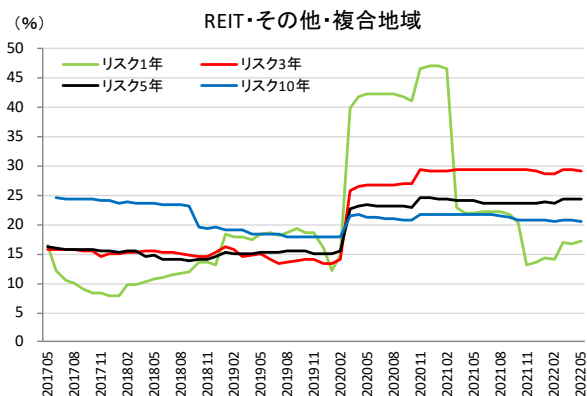
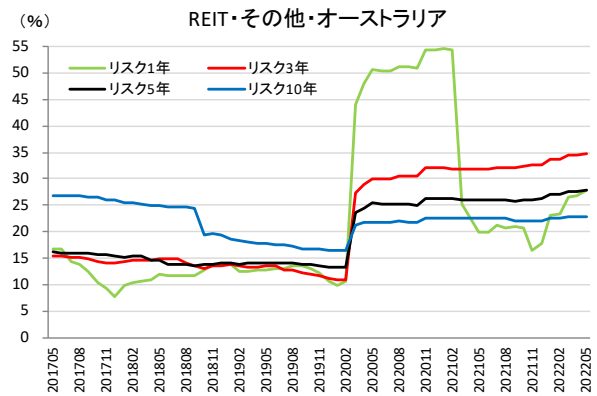
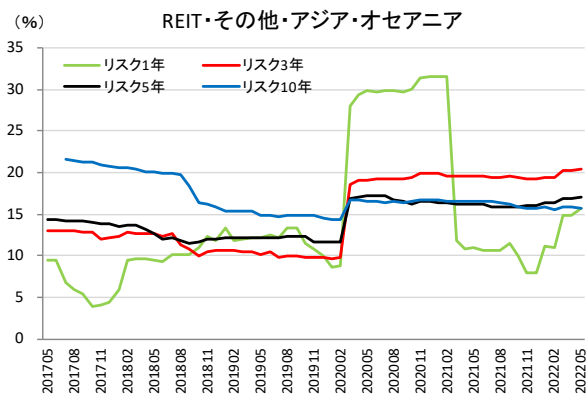
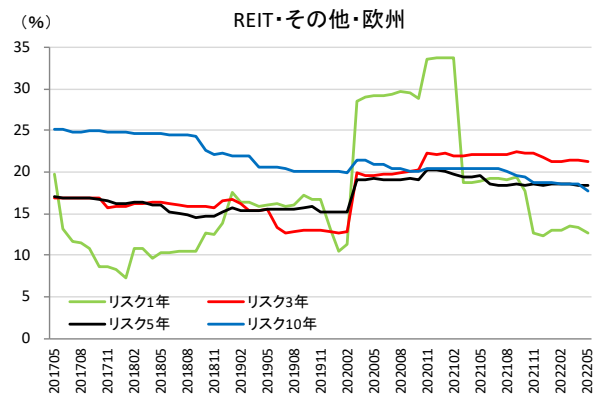
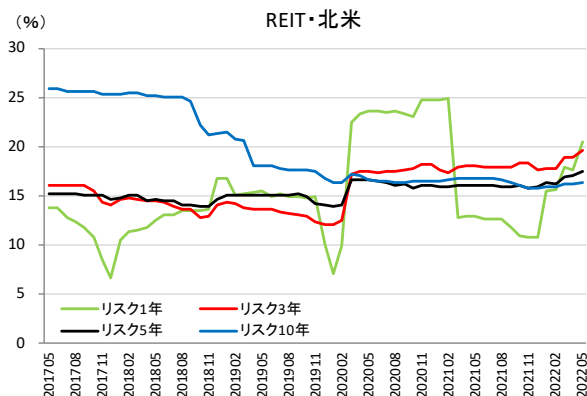
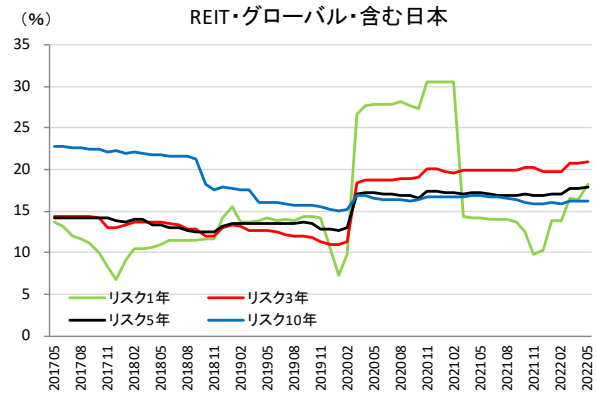
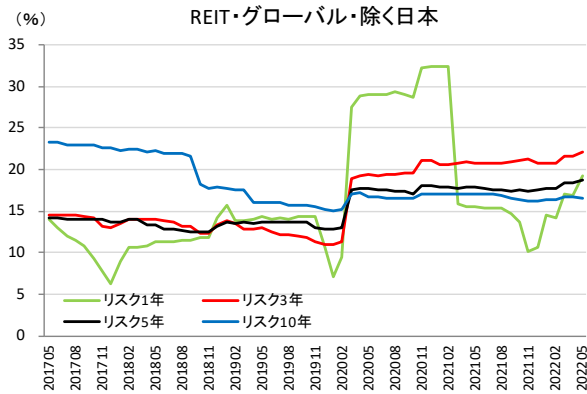


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

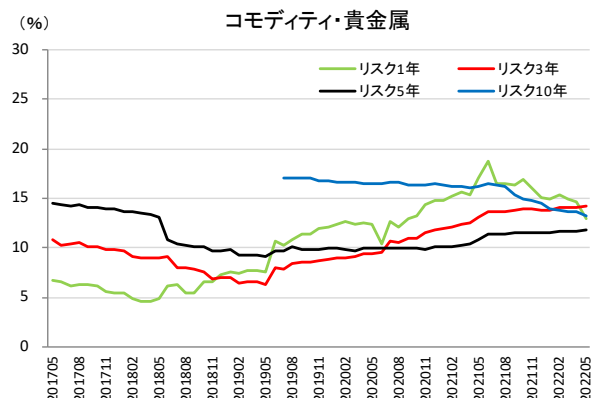
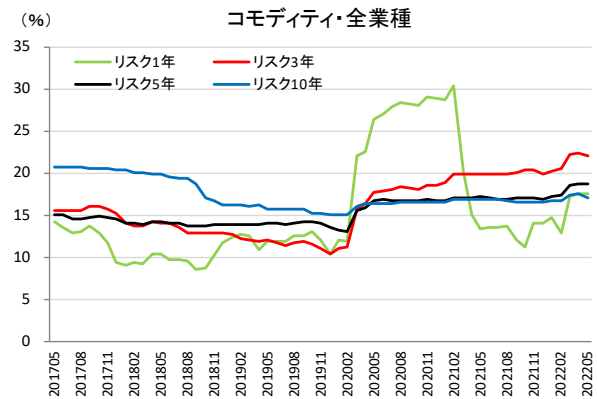
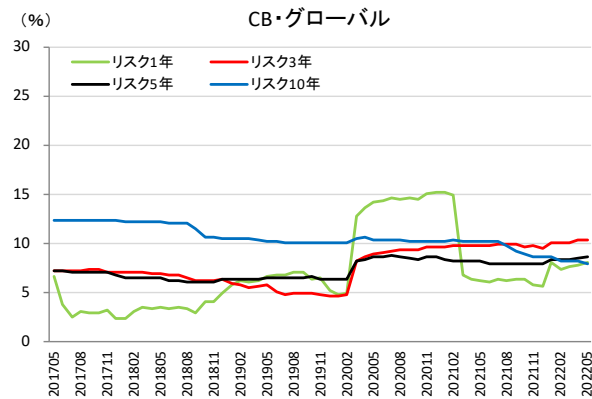
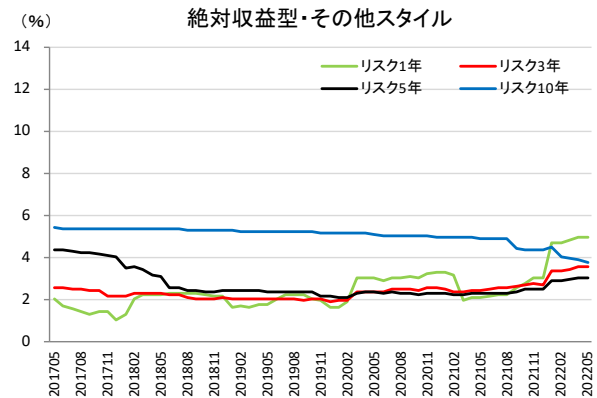
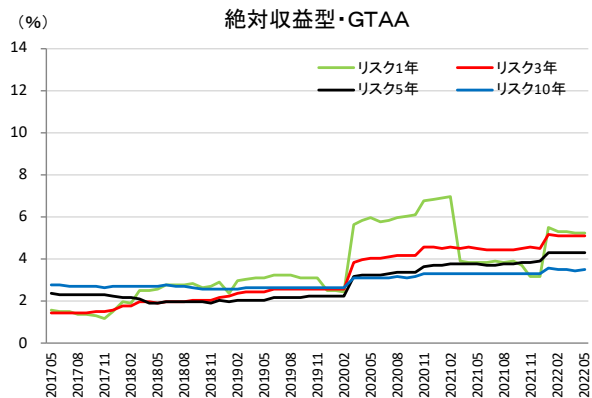
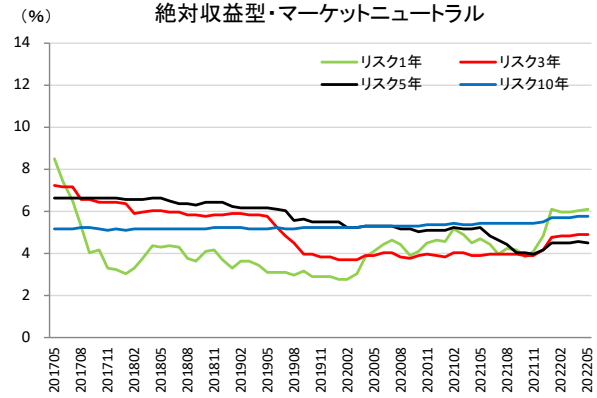
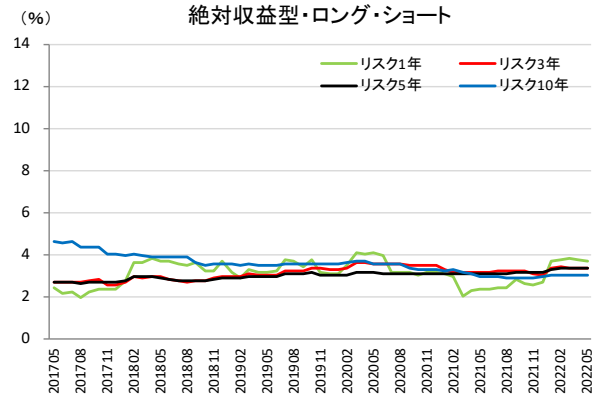


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



< 3 > 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	7,887	19,422	47,022	97,452
国内株式	575	1,923	4,283	6,295
一般	394	801	1,643	1,961
フリー	338	736	1,554	1,997
バリュー	56	65	89	-35
小型	12	105	123	-255
その他	163	1,011	2,498	4,569
日経225	21	530	2,128	3,543
TOPIX	98	330	175	752
JPX日経400	7	16	46	71
国内債券	19	1,042	2,067	7,091
一般	19	1,042	2,067	7,091
外国株式(先進国)	5,610	14,053	33,128	71,208
グローバル	2,761	5,998	14,485	34,760
除く日本	1,147	2,543	4,546	9,392
含む日本	1,614	3,455	9,939	25,368
その他	2,850	8,055	18,642	36,448
北米	8	20	31	31
米国	2,899	8,352	19,046	37,329
カナダ	-2	-11	-21	-51
欧州	5	-52	-9	255
ドイツ	0	0	-1	-3
イギリス	0	0	0	-1
アジア・オセアニア	1	0	2	-1
オーストラリア	-70	-276	-430	-1,134
ニュージーランド	0	0	0	-2
複合地域	9	23	25	24
エマージング株式	-104	-377	-1,061	-2,328
グローバル	57	87	123	403
BRICS	-4	-29	-42	-77
その他	-157	-434	-1,142	-2,654
欧州	0	1	-4	-25
ロシア	0	1	-14	-34
アジア・オセアニア	-98	-222	-454	-927
中国	-24	-95	-317	-723
インド	-20	-94	-272	-829
インドネシア	1	-1	-6	-10
タイ	0	-1	-2	-5
フィリピン	-1	-3	-7	-14
ベトナム	-4	20	7	45
韓国	0	0	0	0
香港	0	1	2	3
台湾	0	1	2	6
中南米	0	-3	-5	-8
ブラジル	-2	-40	-75	-122
メキシコ	-1	-1	-2	-6
中東・アフリカ	-6	5	8	0
トルコ	-2	-2	-3	-4
複合地域	0	-1	-1	-2

<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別②

(単位:億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	7,887	19,422	47,022	97,452
外国債券(先進国)	111	-65	237	3,734
グローバル	186	606	1,314	6,371
除く日本	-52	-239	152	1,065
含む日本	238	846	1,162	5,307
その他	-75	-672	-1,077	-2,637
北米	0	-3	-5	-7
米国	35	-103	-173	-517
カナダ	-13	-57	-88	-204
欧州	-15	-35	-70	-210
イギリス	0	-1	-2	-4
アジア・オセアニア	-9	-71	-116	-266
オーストラリア	-62	-356	-548	-1,254
ニュージーランド	-1	-6	-9	-19
複合地域	-9	-39	-65	-148
エマージング債券	-80	-341	-739	-1,811
グローバル	-4	-23	-142	-491
米ドル建て	-5	-38	-139	-437
現地通貨建て	1	15	-3	-54
その他	-76	-318	-597	-1,320
ロシア	0	0	-8	-23
アジア・オセアニア	-2	-8	-20	-48
インド	-28	-108	-225	-612
インドネシア	-5	-20	-34	-93
ブラジル	-26	-131	-217	-349
メキシコ	-6	-22	-42	-83
トルコ	0	-1	-1	-3
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイイールド債券	-19	-234	-540	-1,497
グローバル	0	-30	-68	-131
北米	0	-119	-304	-1,016
その他	-20	-85	-168	-349
欧州	-15	-70	-139	-282
アジア・オセアニア	-5	-14	-27	-64
複合地域	0	-1	-2	-3
複合資産	826	1,936	6,364	11,526
安定	-9	179	2,952	5,138
安定成長	512	1,101	2,202	4,569
成長	417	1,014	1,985	3,795
国内バランス	-55	-232	-465	-987
安定	-66	-252	-491	-994
一般	-1	-5	-10	-36
その他	-39	-127	-310	-989

<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別③

(単位:億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	7,887	19,422	47,022	97,452
国内REIT	413	800	1,060	253
日本	413	800	1,060	253
外国REIT	192	-233	-337	-1,928
グローバル	-29	-388	-480	-1,139
除く日本	-5	-134	-74	49
含む日本	-24	-254	-411	-1,193
北米	268	330	425	-212
その他	-47	-175	-282	-577
欧州	-1	-4	-10	-21
アジア・オセアニア	-37	-120	-191	-343
オーストラリア	-6	-37	-60	-170
複合地域	-1	-2	-5	-5
複数国	-3	-11	-16	-37
その他	343	918	2,562	4,908
絶対収益型	230	706	1,493	2,817
ロング・ショート	14	26	50	68
マーケットニュートラル	-5	-28	-48	-176
GTAA	11	22	24	37
その他スタイル	209	683	1,458	2,866
CB	-15	-38	-97	-312
アジア・オセアニア	0	0	-1	-2
日本	0	-1	-3	-7
グローバル	-15	-37	-94	-303
コモディティ	44	-84	30	117
全業種	-15	-118	-73	-13
貴金属	59	62	130	201
エネルギー	0	-25	-25	-69
その他コモディティ	-1	-2	-3	-2

<4> 純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別①

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	830,744	100.00	5,438	100.00
国内株式	101,257	12.19	844	15.52
一般	55,650	6.70	540	9.93
フリー	43,153	5.19	436	8.02
バリュー	12,496	1.50	104	1.91
小型	6,331	0.76	92	1.69
その他	38,612	4.65	206	3.79
日経225	19,995	2.41	69	1.27
TOPIX	15,421	1.86	80	1.47
JPX日経400	706	0.08	16	0.29
国内債券	42,436	5.11	138	2.54
一般	42,436	5.11	138	2.54
外国株式(先進国)	330,796	39.82	1,157	21.28
グローバル	230,257	27.72	799	14.69
除く日本	61,684	7.43	192	3.53
含む日本	168,573	20.29	607	11.16
その他	100,539	12.10	358	6.58
北米	228	0.03	9	0.17
米国	94,722	11.40	263	4.84
カナダ	187	0.02	2	0.04
欧州	1,653	0.20	44	0.81
ドイツ	16	0.00	1	0.02
イギリス	10	0.00	3	0.06
アジア・オセアニア	51	0.01	3	0.06
オーストラリア	3,622	0.44	31	0.57
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	37	0.00	1	0.02
エマージング株式	27,059	3.26	325	5.98
グローバル	8,917	1.07	98	1.80
BRICS	484	0.06	7	0.13
その他	17,658	2.13	220	4.05
欧州	55	0.01	6	0.11
ロシア	10	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,940	0.59	93	1.71
中国	2,178	0.26	34	0.63
インド	8,174	0.98	29	0.53
インドネシア	151	0.02	4	0.07
タイ	33	0.00	3	0.06
フィリピン	40	0.00	5	0.09
ベトナム	1,188	0.14	11	0.20
韓国	5	0.00	1	0.02
香港	14	0.00	1	0.02
台湾	11	0.00	1	0.02
中南米	64	0.01	2	0.04
ブラジル	601	0.07	15	0.28
メキシコ	16	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	119	0.01	5	0.09
トルコ	41	0.00	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	830,744	100.00	5,438	100.00
外国債券(先進国)	79,346	9.55	804	14.78
グローバル	63,425	7.63	529	9.73
除く日本	29,991	3.61	230	4.23
含む日本	33,433	4.02	299	5.50
その他	15,921	1.92	275	5.06
北米	71	0.01	6	0.11
米国	5,030	0.61	157	2.89
カナダ	842	0.10	4	0.07
欧州	1,073	0.13	35	0.64
イギリス	19	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	1,664	0.20	10	0.18
オーストラリア	5,961	0.72	38	0.70
ニュージーランド	81	0.01	9	0.17
複合地域	1,181	0.14	8	0.15
エマージング債券	11,035	1.33	268	4.93
グローバル	6,007	0.72	191	3.51
米ドル建て	4,504	0.54	146	2.68
現地通貨建て	1,503	0.18	45	0.83
その他	5,028	0.61	77	1.42
ロシア	8	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	269	0.03	6	0.11
インド	2,252	0.27	17	0.31
インドネシア	317	0.04	8	0.15
ブラジル	1,694	0.20	21	0.39
メキシコ	281	0.03	7	0.13
トルコ	49	0.01	4	0.07
複合地域	31	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	16,203	1.95	250	4.60
グローバル	2,611	0.31	38	0.70
北米	11,505	1.38	150	2.76
その他	2,086	0.25	62	1.14
欧州	1,635	0.20	40	0.74
アジア・オセアニア	414	0.05	21	0.39
複合地域	38	0.00	1	0.02
複合資産	126,957	15.28	999	18.37
安定	38,355	4.62	281	5.17
安定成長	55,316	6.66	409	7.52
成長	21,599	2.60	259	4.76
国内バランス	8,208	0.99	33	0.61
安定	7,762	0.93	9	0.17
一般	312	0.04	19	0.35
その他	3,479	0.42	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	830,744	100.00	5,438	100.00
国内REIT	27,448	3.30	137	2.52
日本	27,448	3.30	137	2.52
外国REIT	46,847	5.64	289	5.31
グローバル	18,721	2.25	156	2.87
除く日本	5,815	0.70	65	1.20
含む日本	12,906	1.55	91	1.67
北米	24,703	2.97	79	1.45
その他	3,422	0.41	54	0.99
欧州	145	0.02	10	0.18
アジア・オセアニア	2,343	0.28	28	0.51
オーストラリア	599	0.07	12	0.22
複合地域	58	0.01	3	0.06
複数国	276	0.03	1	0.02
その他	21,360	2.57	227	4.17
絶対収益型	11,393	1.37	109	2.00
ロング・ショート	865	0.10	37	0.68
マーケットニュートラル	598	0.07	16	0.29
GTAA	437	0.05	13	0.24
その他スタイル	9,412	1.13	42	0.77
CB	1,063	0.13	31	0.57
アジア・オセアニア	35	0.00	1	0.02
日本	34	0.00	3	0.06
グローバル	993	0.12	27	0.50
コモディティ	4,782	0.58	35	0.64
全業種	2,042	0.25	14	0.26
貴金属	2,624	0.32	19	0.35
エネルギー	96	0.01	1	0.02
その他コモディティ	20	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	13,121	9.5	3.18	3.53	1.197
国内株式	16,858	13.0	0.98	1.04	1.050
一般	15,718	12.7	1.37	1.44	1.398
フリー	15,271	12.0	1.43	1.51	1.442
バリュー	17,595	15.5	1.15	1.17	1.245
小型	21,599	13.5	1.10	1.28	1.703
その他	17,759	13.2	0.37	0.38	0.433
日経225	18,963	14.8	0.39	0.42	0.498
TOPIX	18,622	14.3	0.13	0.13	0.274
JPX日経400	16,475	7.7	0.18	0.18	0.506
国内債券	10,724	11.5	0.19	0.19	0.406
一般	10,724	11.5	0.19	0.19	0.406
外国株式(先進国)	15,340	7.1	4.06	4.78	1.361
グローバル	15,843	6.9	2.98	3.51	1.410
除く日本	22,036	9.5	0.53	0.53	0.625
含む日本	13,884	6.1	3.91	4.63	1.698
その他	14,218	7.5	6.50	7.65	1.249
北米	16,749	8.2	11.22	11.30	1.738
米国	14,996	6.6	6.35	7.57	1.217
カナダ	6,246	11.2	8.55	8.64	1.990
欧州	13,260	11.5	5.59	6.46	1.644
ドイツ	13,091	8.2	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,460	5.8	10.55	10.35	1.875
アジア・オセアニア	9,286	11.5	8.14	9.28	1.666
オーストラリア	9,905	7.8	10.36	10.16	1.825
ニュージーランド	16,301	9.8	2.33	2.45	1.672
複合地域	12,765	9.1	8.24	4.70	1.705
エマージング株式	13,411	10.0	3.09	3.35	1.666
グローバル	12,847	7.8	0.43	0.45	1.103
BRICS	14,282	16.0	0.82	1.02	2.069
その他	13,634	10.8	4.50	4.88	1.939
欧州	5,346	15.9	0.44	0.86	1.950
ロシア	2,052	13.0	2.93	31.93	1.808
アジア・オセアニア	14,502	11.5	4.61	5.71	1.733
中国	14,949	7.7	1.55	2.20	1.944
インド	15,743	11.9	5.74	5.67	2.066
インドネシア	13,195	12.1	1.25	0.99	1.861
タイ	12,382	9.9	2.00	1.86	1.820
フィリピン	10,894	8.8	0.42	0.38	1.776
ベトナム	17,911	5.8	2.24	2.12	1.924
韓国	14,044	3.4	0.00	0.00	1.804
香港	13,891	12.8	1.33	1.58	0.858
台湾	10,748	9.5	18.51	21.40	1.661
中南米	9,324	15.4	0.00	0.00	2.040
ブラジル	6,401	11.6	3.78	4.14	1.941
メキシコ	11,035	9.2	0.00	0.00	1.902
中東・アフリカ	14,303	10.8	5.63	6.03	2.072
トルコ	7,461	20.8	0.00	0.00	2.034
複合地域	21,224	14.0	1.64	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	13,121	9.5	3.18	3.53	1.197
外国債券(先進国)	9,898	9.9	1.59	1.68	0.999
グローバル	10,444	9.7	1.18	1.26	0.930
除く日本	11,435	11.8	1.08	1.14	0.729
含む日本	9,682	8.1	1.28	1.38	1.110
その他	8,846	10.1	3.16	3.28	1.276
北米	10,116	8.1	2.16	2.27	1.776
米国	9,372	9.3	4.11	4.19	1.280
カナダ	7,175	11.3	1.61	1.57	1.378
欧州	7,899	11.5	1.55	1.63	1.153
イギリス	7,808	7.3	2.57	2.74	1.341
アジア・オセアニア	8,826	11.9	2.67	2.77	1.417
オーストラリア	8,327	13.2	3.20	3.43	1.249
ニュージーランド	9,393	7.9	1.57	1.70	1.355
複合地域	5,316	12.1	2.30	2.36	1.193
エマージング債券	8,551	10.5	4.78	4.94	1.515
グローバル	8,689	10.9	3.65	4.04	1.425
米ドル建て	8,737	11.3	3.78	4.19	1.534
現地通貨建て	8,532	9.4	3.28	3.60	1.101
その他	8,210	9.5	6.12	6.01	1.622
ロシア	856	9.3	5.20	58.14	1.591
アジア・オセアニア	9,259	11.4	6.16	6.84	1.632
インド	9,568	7.6	6.70	6.76	1.701
インドネシア	8,494	9.6	6.26	5.84	1.666
ブラジル	8,743	12.7	5.72	4.97	1.583
メキシコ	7,345	9.2	5.80	5.44	1.402
トルコ	1,710	9.2	6.97	11.03	1.458
複合地域	3,400	15.8	3.11	3.53	1.210
ハイイールド債券	9,165	11.3	6.00	6.11	1.673
グローバル	7,686	10.9	3.96	4.06	1.518
北米	10,413	12.2	5.97	5.81	1.692
その他	7,054	9.6	8.75	10.38	1.765
欧州	7,157	9.1	8.73	10.28	1.739
アジア・オセアニア	6,982	10.1	9.16	11.25	1.864
複合地域	4,411	18.2	5.15	5.44	1.800
複合資産	12,867	9.2	1.30	1.40	0.989
安定	11,466	9.0	1.07	1.12	1.103
安定成長	12,599	9.7	1.59	1.72	1.004
成長	15,154	9.0	0.51	0.54	0.798
国内バランス	11,664	8.9	2.33	2.46	0.939
安定	10,688	10.8	2.33	2.46	0.918
一般	12,179	8.9	1.85	1.98	1.303
その他	9,943	2.4	1.56	1.87	0.786

(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	13,121	9.5	3.18	3.53	1.197
国内REIT	14,472	9.3	8.40	9.89	0.926
日本	14,472	9.3	8.40	9.89	0.926
外国REIT	12,696	8.4	8.95	8.38	1.502
グローバル	13,850	8.3	4.56	4.30	1.300
除く日本	15,415	6.1	4.02	4.05	0.984
含む日本	12,731	9.8	4.80	4.42	1.442
北米	12,019	8.9	12.42	11.51	1.620
その他	10,353	8.2	7.82	8.01	1.764
欧州	7,690	8.3	3.75	4.14	1.828
アジア・オセアニア	11,718	7.9	9.76	10.11	1.812
オーストラリア	10,060	7.6	4.40	4.17	1.705
複合地域	7,154	10.3	0.98	0.93	0.797
複数国	11,863	18.1	2.31	2.02	1.650
その他					
絶対収益型	10,521	5.7	0.09	0.10	1.781
ロング・ショート	10,490	4.8	0.20	0.23	1.452
マーケットニュートラル	9,911	5.3	0.55	0.58	1.304
GTAA	11,160	8.4	1.01	1.19	1.496
その他スタイル	10,529	6.0	0.00	0.00	1.859
CB	12,161	9.4	3.30	4.35	1.409
アジア・オセアニア	10,022	11.9	2.31	2.39	1.823
日本	11,127	11.1	0.47	0.47	0.934
グローバル	12,355	9.1	3.44	4.55	1.410
コモディティ	12,611	6.7	0.86	0.57	1.042
全業種	12,000	9.8	2.01	1.32	1.443
貴金属	12,372	4.1	0.00	0.00	0.732
エネルギー	19,853	13.3	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	18,450	5.7	0.00	0.00	0.506

(注1) 平均値

基準価額（円）と設定来年数（年）は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り（%）

実績分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数÷実績決算回数))÷1年前もしくは設定日の基準価額×100

予想分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数÷実績決算回数))÷当月末の基準価額×100

- 本レポートに関する著作権、知的財産権等一切の権利は三菱アセット・ブレインズ株式会社（以下、MAB）に帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。
- 本レポートは、MABが信頼できると判断した情報源から入手した本レポート作成基準日現在における情報をもとに作成しておりますが、当該情報の正確性を保証するものではありません。
- MABは、本レポートの利用に関連して発生した一切の損害について何らの責任も負いません。
- 本レポート中のグラフ・数値等は、あくまでも本レポート作成基準日までの過去の実績を示すものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。
- 本レポートは、情報提供を目的としたものであり、投資信託の勧誘のために作成されたものではありません。
- MAB 投信指数「MAB-FPI」（以下、本指数）に関する著作権、知的財産権等一切の権利は MAB に帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。また、本指数を商業的に利用する場合には MAB の利用許諾が必要です。

【照会先】

三菱アセット・ブレインズ株式会社

システムグループ 川眞田、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