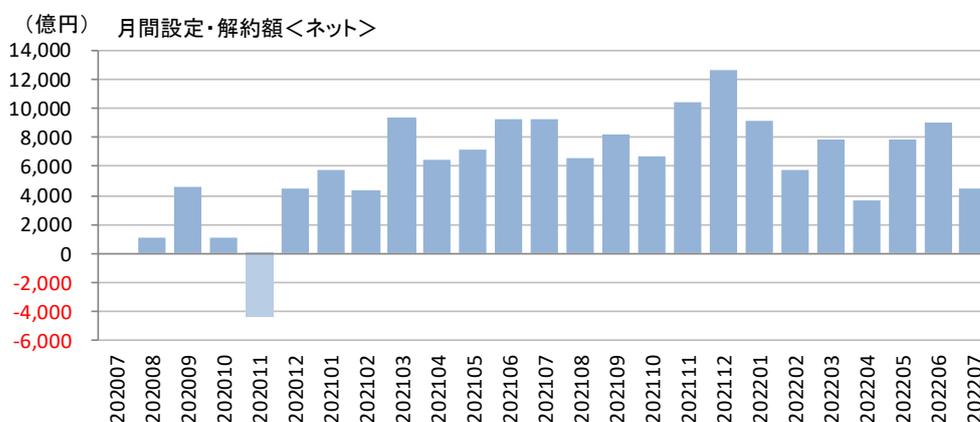
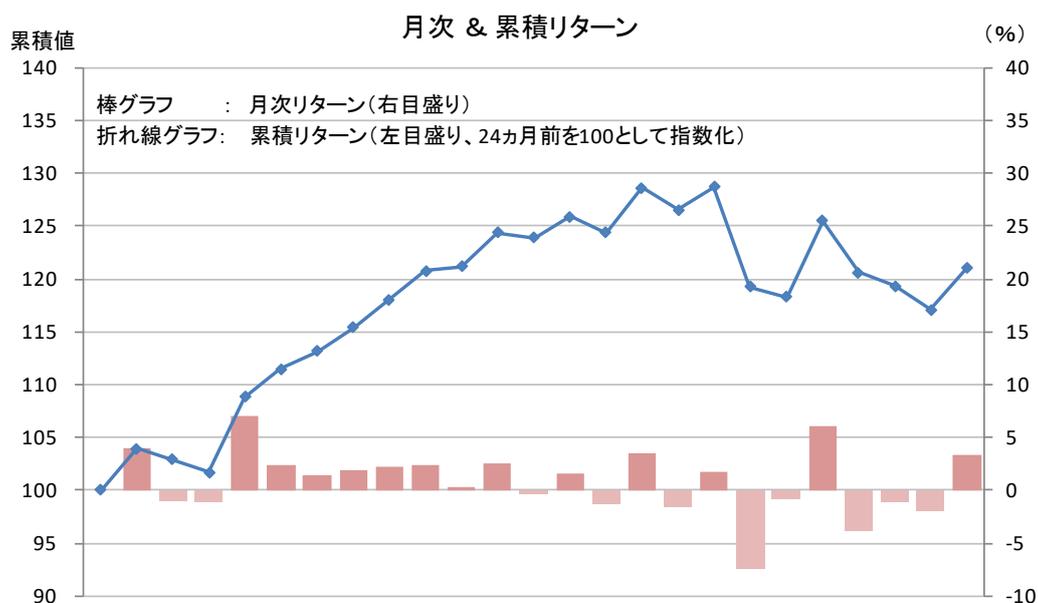


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2022年7月

「総合」 +3.38 %
(前月 -1.88 %)



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		15,756	15,241	515	3.38	
国内株式		19,508	18,761	747	3.98	
一般		18,903	18,261	642	3.51	
フリー		17,667	17,038	629	3.69	
バリュー		24,748	24,052	696	2.89	
小型		38,641	36,674	1,967	5.36	
その他		19,510	18,686	824	4.41	
日経225		18,834	17,887	947	5.29	
TOPIX		19,057	18,377	680	3.70	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	17,981	17,318	663	3.83	
国内債券		12,843	12,781	62	0.48	
一般		12,843	12,781	62	0.48	
外国株式(先進国)		20,482	19,523	959	4.91	
グローバル		22,140	21,184	956	4.51	
除く日本		34,522	33,287	1,236	3.71	
含む日本		19,491	18,596	895	4.81	
その他		16,961	16,031	930	5.80	
北米		20,483	19,884	599	3.01	
米国		26,303	24,813	1,490	6.00	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	21,935	21,602	333	1.54	
欧州		22,474	22,093	381	1.72	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	9,861	10,041	-180	-1.79	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	10,545	10,568	-23	-0.22	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	38,805	39,201	-395	-1.01	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	20,216	19,686	530	2.69	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	43,564	42,479	1,085	2.55	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	13,441	13,105	335	2.56	
エマージング株式		18,534	18,603	-69	-0.37	
グローバル		18,063	18,297	-234	-1.28	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	23,309	23,894	-585	-2.45	
その他		19,550	19,523	28	0.14	
欧州		9,849	10,491	-642	-6.12	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,348	1,477	-129	-8.74	
アジア・オセアニア		18,211	18,655	-444	-2.38	
中国		44,335	46,978	-2,643	-5.63	
インド	10,000 (2004.09.30)	48,786	46,804	1,981	4.23	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	16,379	16,582	-203	-1.23	
タイ		21,669	22,875	-1,206	-5.27	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,415	7,579	-165	-2.17	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	23,279	24,444	-1,165	-4.77	
韓国	10,000 (1997.06.30)	27,946	27,602	345	1.25	
香港		22,379	24,138	-1,758	-7.28	
台湾	10,000 (2008.03.31)	23,937	24,434	-497	-2.03	
中南米	7,427 (2006.04.28)	9,221	9,132	89	0.98	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	8,349	8,245	104	1.26	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	11,762	12,152	-390	-3.21	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	13,814	13,644	170	1.25	
トルコ		20,760	21,762	-1,002	-4.60	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	24,657	24,717	-60	-0.24	

※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		15,756	15,241	515	3.38
外国債券(先進国)		18,776	18,462	315	1.70
グローバル		18,739	18,456	284	1.54
除く日本		20,605	20,313	292	1.44
含む日本		17,531	17,249	281	1.63
その他		19,155	18,708	447	2.39
北米	9,052 (2013.05.31)	10,744	10,516	228	2.17
米国		17,989	17,547	442	2.52
カナダ	10,000 (2003.05.30)	17,060	16,855	205	1.22
欧州	10,000 (1998.07.31)	14,328	14,011	318	2.27
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,539	10,471	67	0.64
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	21,277	20,801	476	2.29
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	26,312	25,686	626	2.44
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,636	11,327	309	2.72
複合地域	10,000 (2001.11.30)	19,130	18,629	501	2.69
エマージング債券		17,604	17,742	-139	-0.78
グローバル		17,716	17,816	-99	-0.56
米ドル建て		18,111	18,147	-35	-0.19
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,645	12,857	-212	-1.65
その他	8,647 (2005.03.31)	14,111	14,262	-151	-1.06
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,050	1,308	-257	-19.67
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	14,940	15,221	-281	-1.85
インド	10,000 (2011.08.31)	19,423	19,626	-203	-1.04
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	17,362	17,633	-270	-1.53
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	12,537	12,641	-104	-0.82
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	14,962	14,956	6	0.04
トルコ	10,000 (2011.04.28)	3,053	3,202	-150	-4.67
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,038	10,044	-6	-0.06
ハイイールド債券		24,864	24,359	505	2.07
グローバル	10,000 (1997.06.30)	23,311	23,110	201	0.87
北米		25,262	24,618	644	2.62
その他	10,000 (2004.03.31)	21,811	21,699	112	0.51
欧州	10,000 (2006.04.28)	22,208	21,850	358	1.64
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	13,217	13,747	-529	-3.85
複合地域	10,000 (2004.03.31)	21,849	21,569	279	1.30
複合資産		18,989	18,620	369	1.98
安定	10,000 (1998.10.30)	16,042	15,784	258	1.64
安定成長		20,844	20,487	357	1.74
成長		25,348	24,747	601	2.43
国内バランス		12,667	12,552	115	0.91
安定		12,886	12,774	112	0.88
一般		15,911	15,694	217	1.38
その他	10,000 (2018.10.31)	13,598	12,381	1,217	9.83

※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		15,756	15,241	515	3.38	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	36,243	35,191	1,052	2.99	
日本	10,000 (2003.10.31)	36,243	35,191	1,052	2.99	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	36,119	34,331	1,788	5.21	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	29,800	28,474	1,327	4.66	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	33,329	31,934	1,395	4.37	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	29,566	28,213	1,353	4.79	
北米	10,000 (2003.09.30)	38,351	36,154	2,197	6.08	
その他	10,000 (2004.04.30)	32,091	31,498	593	1.88	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,283	5,261	22	0.42	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	23,923	23,757	166	0.70	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	17,508	16,589	919	5.54	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,458	7,276	182	2.50	
複数国	10,000 (2004.04.30)	48,252	45,811	2,441	5.33	
その他		6,388	6,267	121	1.93	
絶対収益型		7,625	7,549	76	1.01	
ロング・ショート		8,354	8,180	174	2.12	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,391	11,294	97	0.86	
GTAA		11,673	11,692	-19	-0.17	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,162	7,093	69	0.98	
CB		19,711	19,508	203	1.04	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	20,714	21,453	-738	-3.44	
日本		19,606	19,535	72	0.37	
グローバル		34,397	33,976	421	1.24	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	11,619	12,199	-580	-4.75	
全業種	10,000 (2004.12.30)	11,872	12,487	-614	-4.92	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	18,504	19,362	-858	-4.43	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	9,905	10,753	-848	-7.89	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	15,994	16,089	-95	-0.59	

※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	0.33	1.47	-2.30	-5.96
国内株式	2.42	2.70	0.09	-4.99
一般	2.28	2.43	-0.68	-5.66
フリー	2.10	1.95	-2.40	-7.30
バリュー	2.85	4.06	5.61	0.37
小型	1.56	1.48	-10.80	-12.91
その他	2.84	3.40	3.60	-2.26
日経225	3.62	3.85	3.33	-2.67
TOPIX	2.31	3.63	4.26	-1.39
JPX日経400	2.08	3.33	4.43	-1.90
国内債券	-0.83	-2.30	-3.44	-2.97
一般	-0.83	-2.30	-3.44	-2.97
外国株式(先進国)	0.33	0.78	-6.44	-11.02
グローバル	-0.23	-0.12	-9.02	-12.17
除く日本	0.78	4.60	6.11	-2.93
含む日本	-0.59	-1.71	-13.38	-15.04
その他	1.61	2.88	0.46	-8.25
北米	2.08	11.39	22.26	9.18
米国	1.78	2.31	-0.19	-8.99
カナダ	0.08	6.37	8.87	4.68
欧州	-1.42	-1.67	-5.00	-9.41
ドイツ	-2.89	-7.96	-11.25	-12.36
イギリス	1.71	7.64	14.65	8.13
アジア・オセアニア	1.02	1.08	-2.02	-3.16
オーストラリア	-1.92	18.97	18.16	9.70
ニュージーランド	-5.53	5.67	-1.33	-5.02
複合地域	2.63	30.00	74.74	44.07
エマーGING株式	0.62	0.39	0.90	-2.70
グローバル	0.62	-1.20	-4.14	-5.02
BRICS	1.34	-13.70	-18.36	-14.20
その他	0.62	1.64	4.01	-1.18
欧州	-10.03	-62.81	-64.69	-65.58
ロシア	-58.54	-88.58	-89.77	-89.89
アジア・オセアニア	1.61	-0.52	-2.81	-5.64
中国	13.60	0.87	-10.32	-6.06
インド	-0.81	5.06	16.27	3.87
インドネシア	-4.26	18.41	36.78	16.97
タイ	-5.41	4.58	12.75	4.28
フィリピン	-10.27	-6.01	9.13	-7.33
ベトナム	-7.66	-3.05	14.48	-2.79
韓国	-12.66	-6.98	-26.33	-21.45
香港	9.85	3.37	-2.57	5.71
台湾	-3.95	-13.81	-8.36	-20.67
中南米	-4.87	12.03	3.12	21.73
ブラジル	-8.48	7.95	-6.60	23.18
メキシコ	-2.94	15.11	15.14	9.37
中東・アフリカ	-5.84	9.17	21.84	9.33
トルコ	-13.33	9.61	3.83	7.65
複合地域	2.58	-1.75	0.59	-6.99

※[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	0.33	1.47	-2.30	-5.96
外国債券(先進国)	0.91	0.67	-1.10	-1.40
グローバル	0.67	-0.88	-2.54	-2.54
除く日本	1.53	1.21	-0.67	-0.73
含む日本	-0.10	-2.76	-4.23	-4.17
その他	1.91	6.96	4.68	3.15
北米	-0.10	-2.72	-4.16	-4.60
米国	1.39	4.55	5.61	1.40
カナダ	4.90	11.74	11.91	10.78
欧州	-1.10	-5.97	-8.88	-7.29
イギリス	-0.17	1.07	-0.13	-0.32
アジア・オセアニア	2.28	10.29	5.79	5.22
オーストラリア	2.36	10.27	6.06	5.29
ニュージーランド	2.69	7.53	-0.33	1.92
複合地域	2.02	6.56	2.39	2.70
エマージング債券	-1.36	3.52	2.06	2.91
グローバル	-1.64	-2.16	-5.75	-3.76
米ドル建て	-2.51	-3.08	-7.28	-5.05
現地通貨建て	0.97	0.62	-0.94	0.25
その他	-1.03	10.62	12.20	11.40
ロシア	-86.57	-89.27	-90.16	-90.45
アジア・オセアニア	-0.31	2.34	1.44	0.60
インド	0.43	7.96	13.56	7.10
インドネシア	0.66	9.95	18.38	9.07
ブラジル	-2.09	21.11	17.40	27.32
メキシコ	7.98	17.72	17.05	16.58
トルコ	-7.30	2.44	-31.14	1.66
複合地域	5.44	-3.52	-4.77	-7.17
ハイイールド債券	-0.11	5.18	6.00	3.03
グローバル	-1.57	1.02	-0.56	-0.76
北米	0.87	7.20	9.95	4.96
その他	-3.76	-0.36	-5.18	-2.48
欧州	-3.27	0.31	-4.05	-1.73
アジア・オセアニア	-5.95	-3.14	-9.91	-5.46
複合地域	-0.91	1.22	0.71	-1.63
複合資産	0.15	0.18	-1.06	-3.23
安定	-0.27	-1.48	-3.00	-3.94
安定成長	0.21	0.98	0.22	-2.56
成長	0.80	2.73	2.74	-1.85
国内バランス	0.04	-0.23	-2.86	-2.23
安定	-0.01	-0.33	-3.00	-2.27
一般	0.23	0.49	-1.61	-3.33
その他	0.24	-6.71	-13.27	-14.35

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

＜1＞パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別③

	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	0.33	1.47	-2.30	-5.96
国内REIT	3.10	6.02	-3.57	0.20
日本	3.10	6.02	-3.57	0.20
外国REIT	-3.59	9.92	15.77	2.21
グローバル	-4.24	7.87	12.09	0.78
除く日本	-4.98	7.48	12.99	0.10
含む日本	-3.90	8.04	11.75	1.08
北米	-3.30	11.20	19.58	3.10
その他	-2.38	11.66	10.13	3.20
欧州	-9.71	-9.09	-13.73	-12.47
アジア・オセアニア	-0.52	13.91	10.79	6.53
オーストラリア	-7.20	9.89	13.00	-4.74
複合地域	-3.30	9.13	12.08	4.39
複数国	-3.58	8.48	11.46	1.48
その他	-2.11	-1.48	-3.90	-7.42
絶対収益型	-1.67	-2.63	-5.48	-5.82
ロング・ショート	-0.14	-1.71	-4.70	-4.14
マーケットニュートラル	0.88	-3.38	-5.62	-7.19
GTAA	-0.19	0.62	-0.72	-3.38
その他スタイル	-2.06	-2.89	-5.87	-6.07
CB	-3.91	-5.24	-10.61	-10.14
アジア・オセアニア	-0.25	4.56	5.78	2.48
日本	-0.38	-0.78	-1.70	-3.19
グローバル	-4.16	-5.71	-11.38	-10.76
コモディティ	-4.45	14.60	22.73	17.78
全業種	-3.23	29.29	54.95	39.41
貴金属	-5.58	4.33	3.72	3.75
エネルギー	5.21	41.26	79.02	56.22
その他コモディティ	-1.15	27.97	42.23	32.93

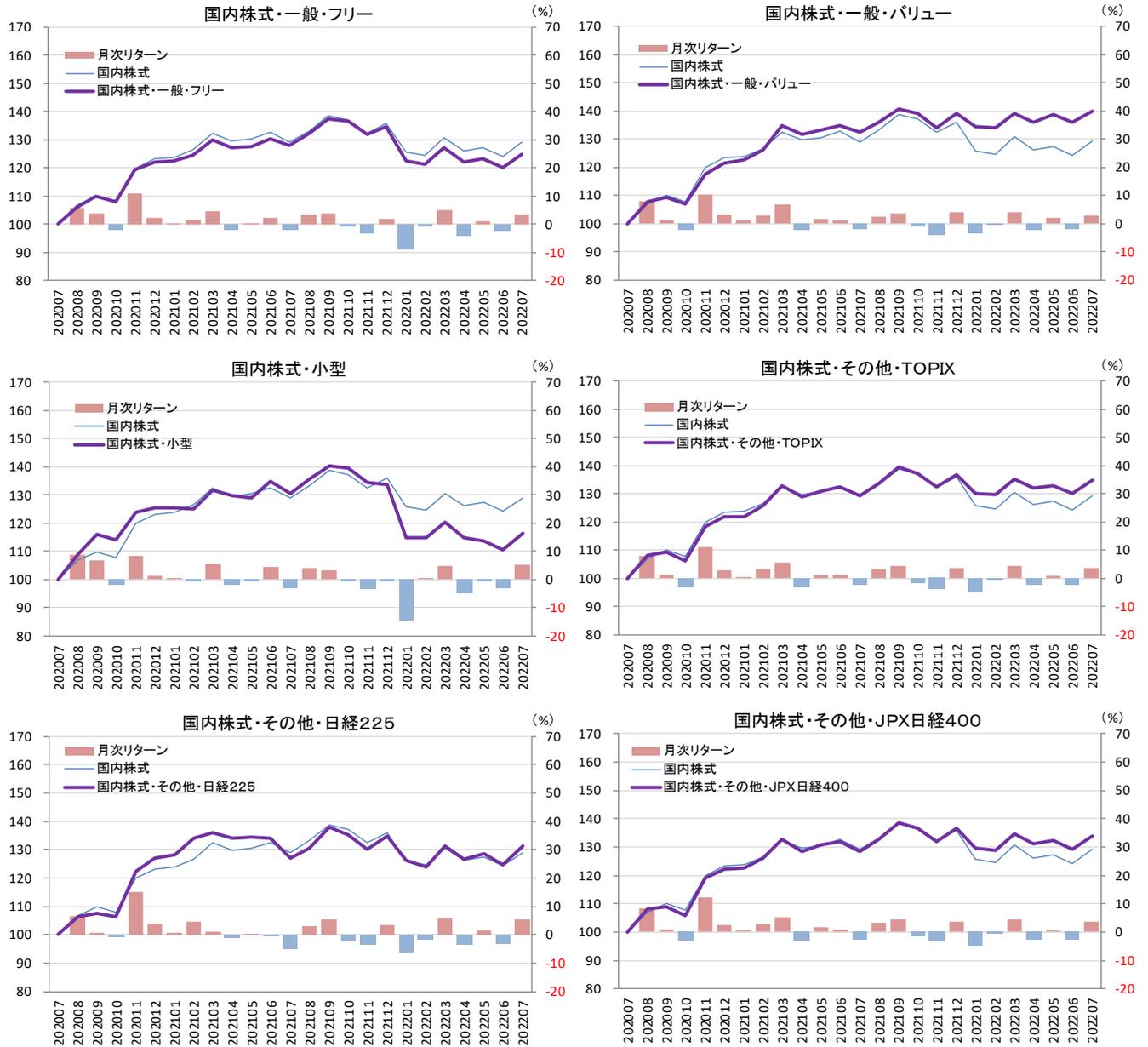
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

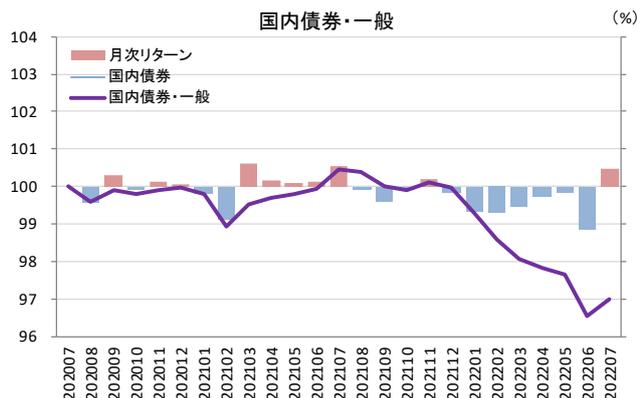
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

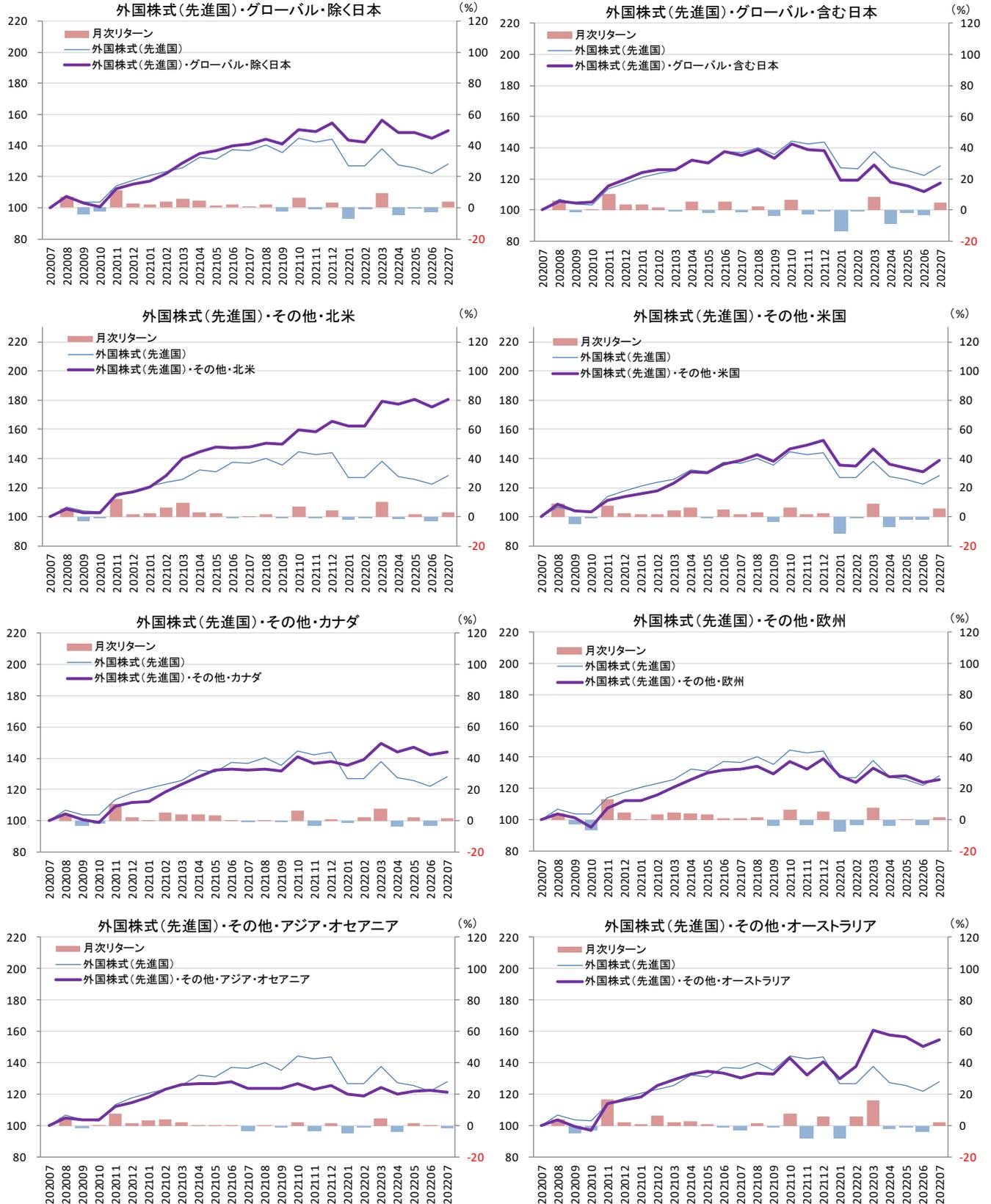


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

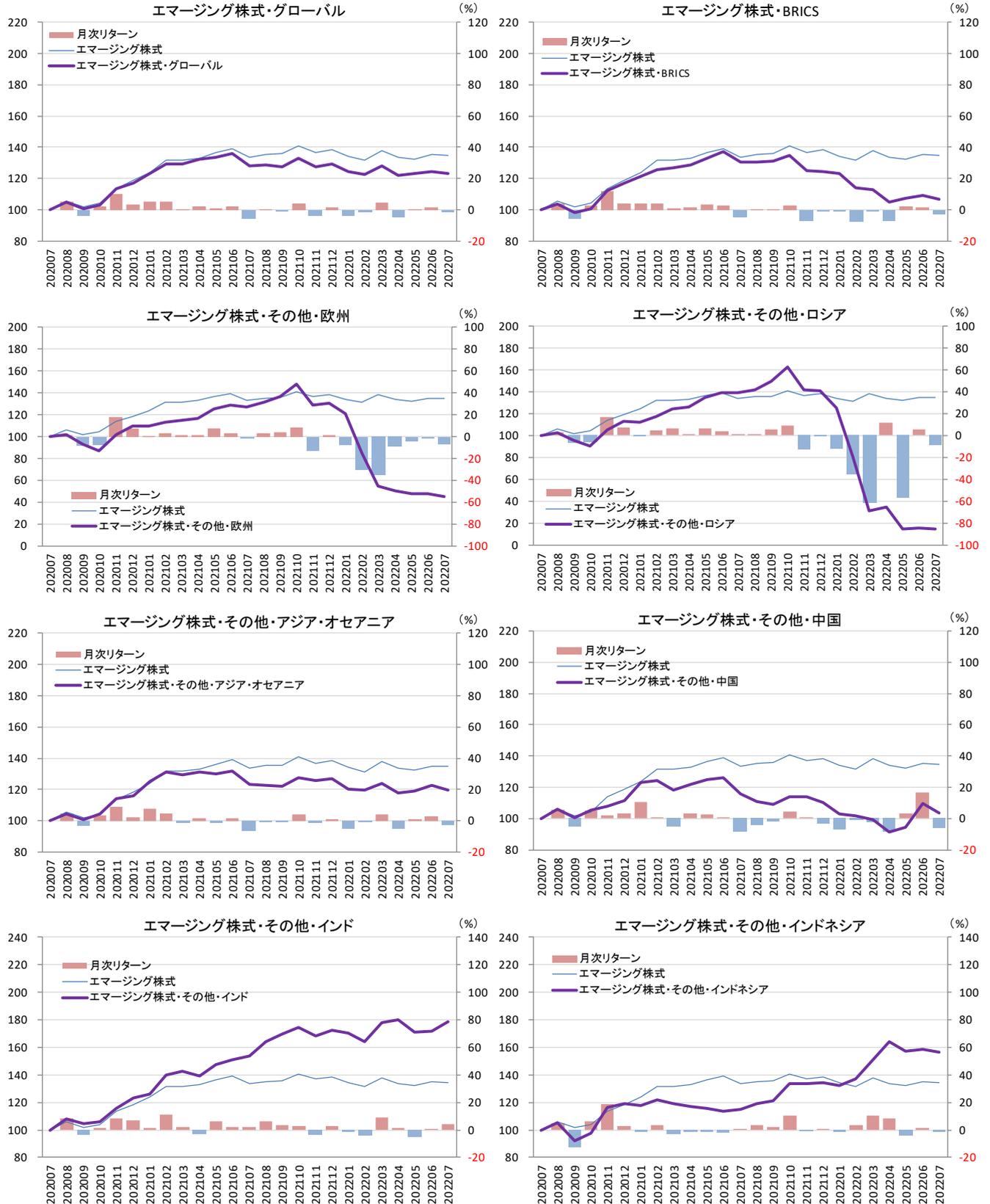


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマージング株式]

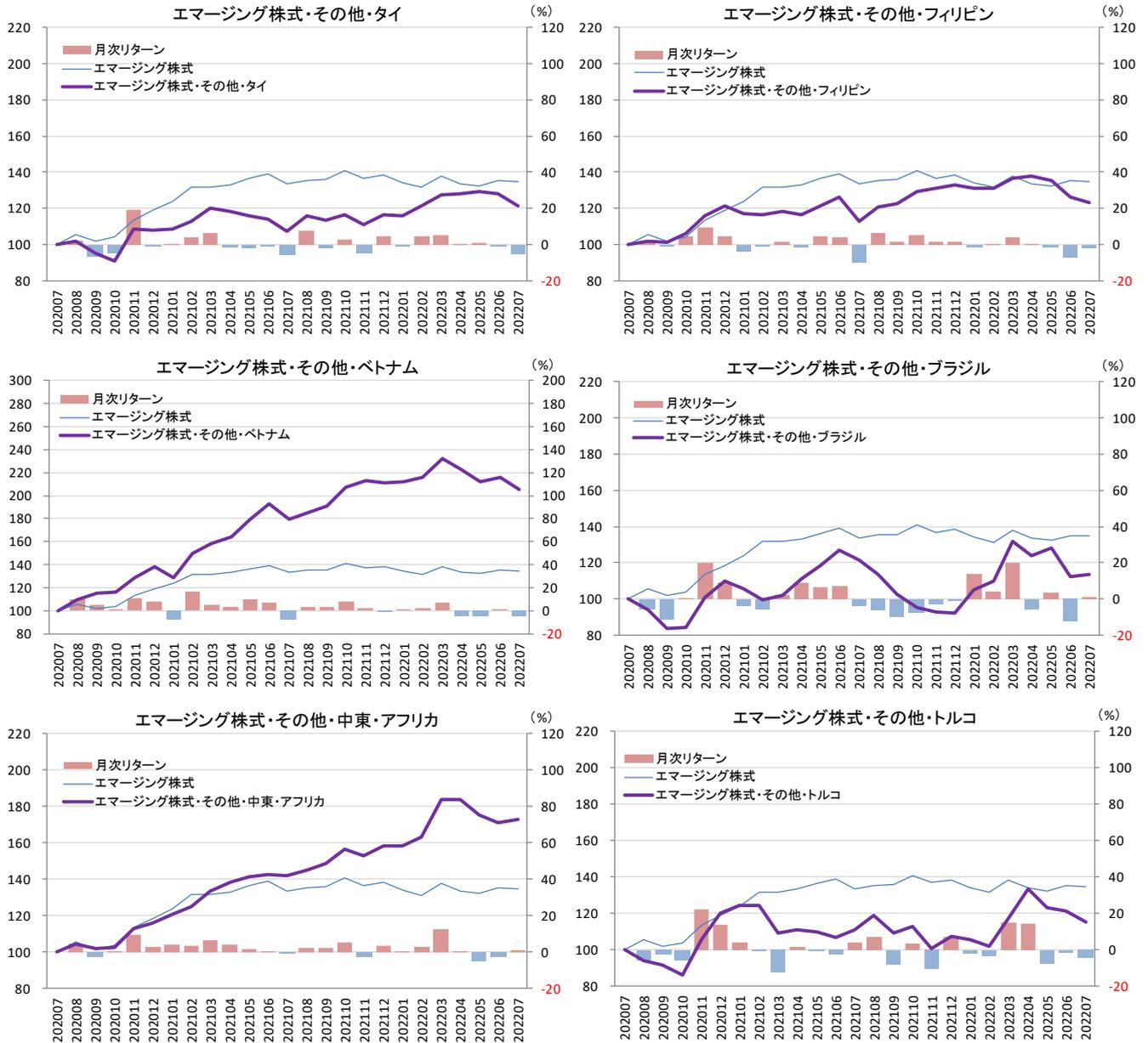


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

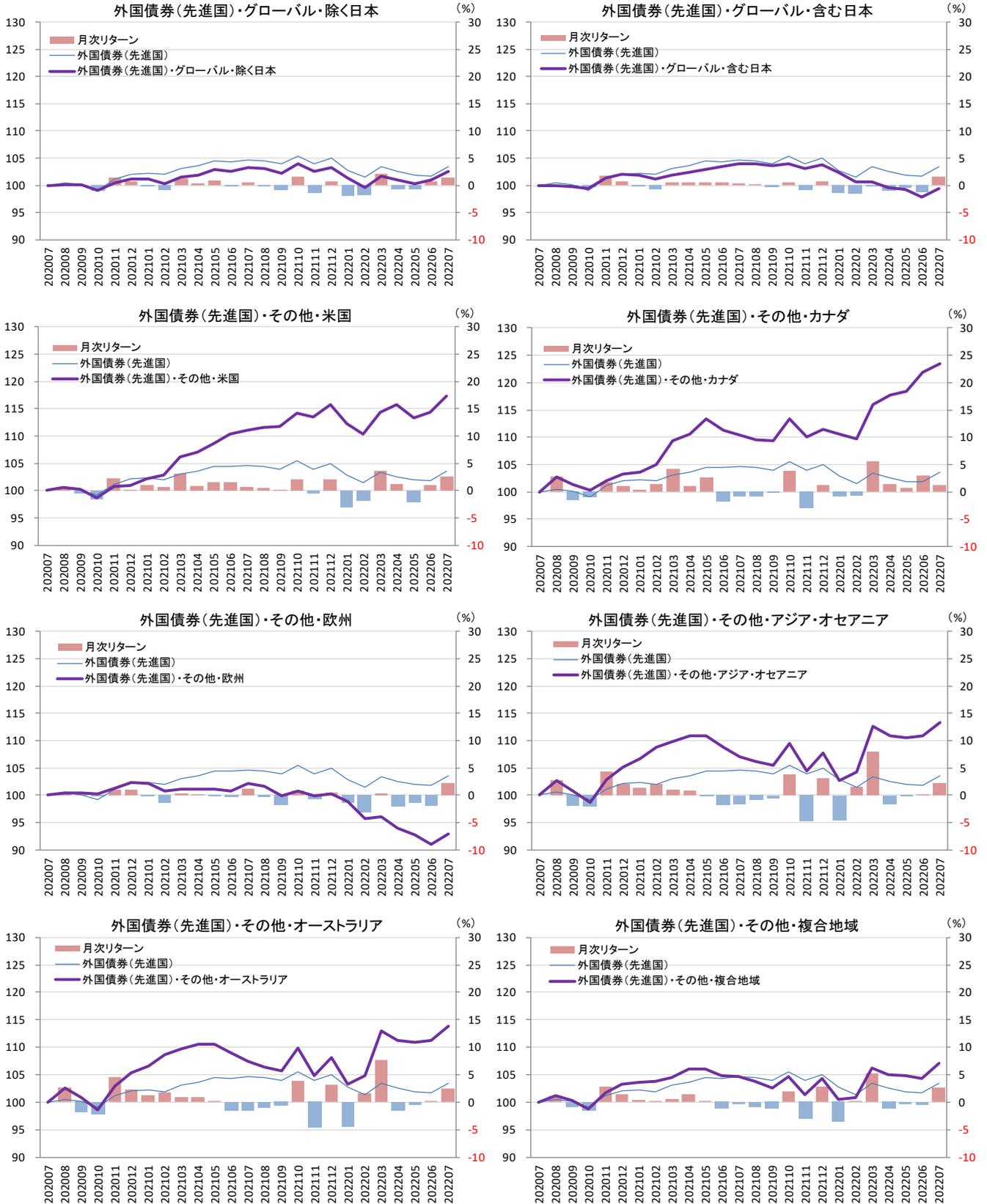


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

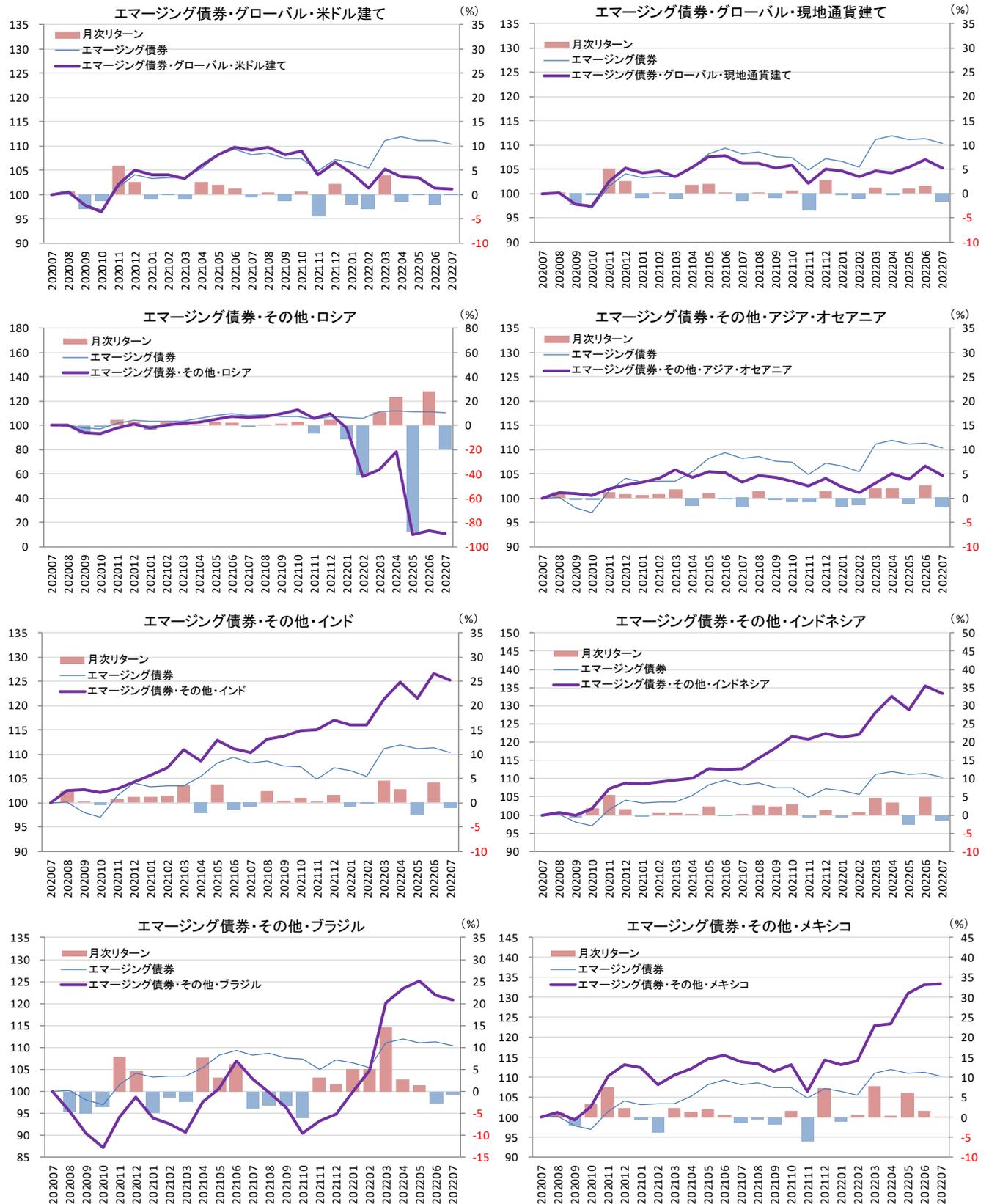


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

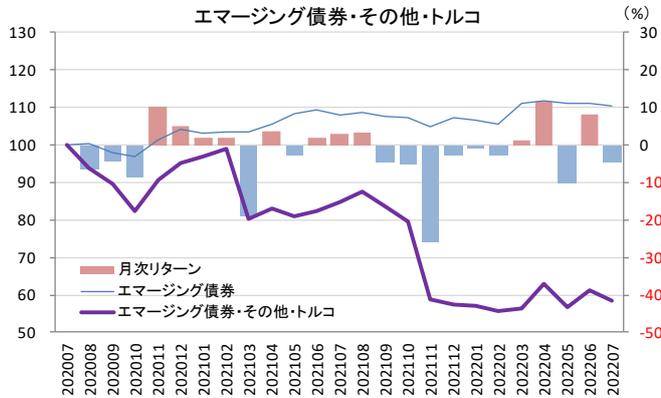


<1>パフォーマンス・サマリー

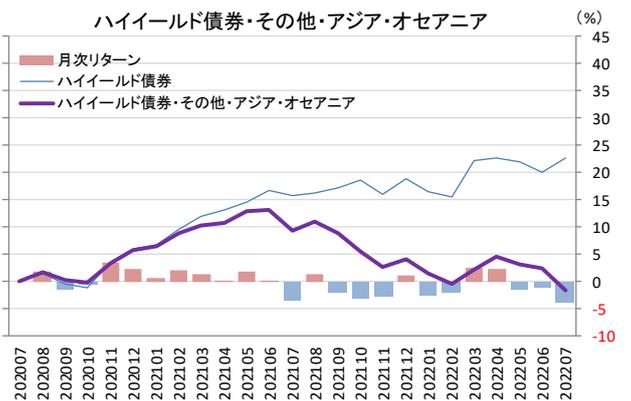
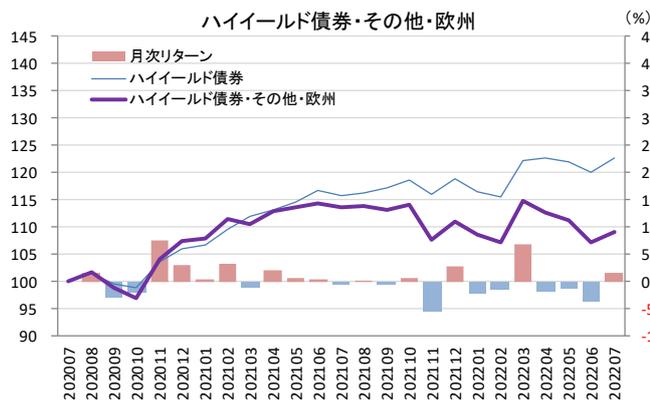
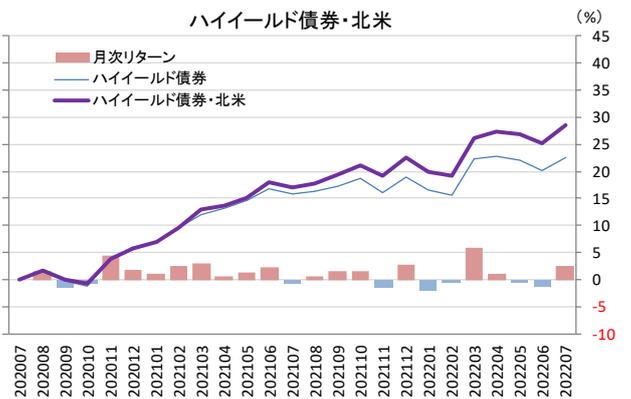
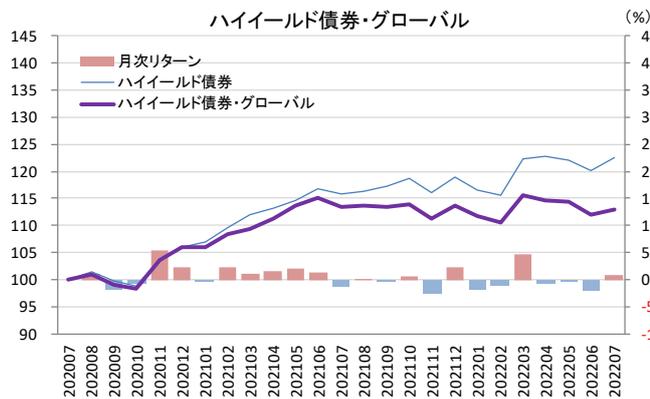
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

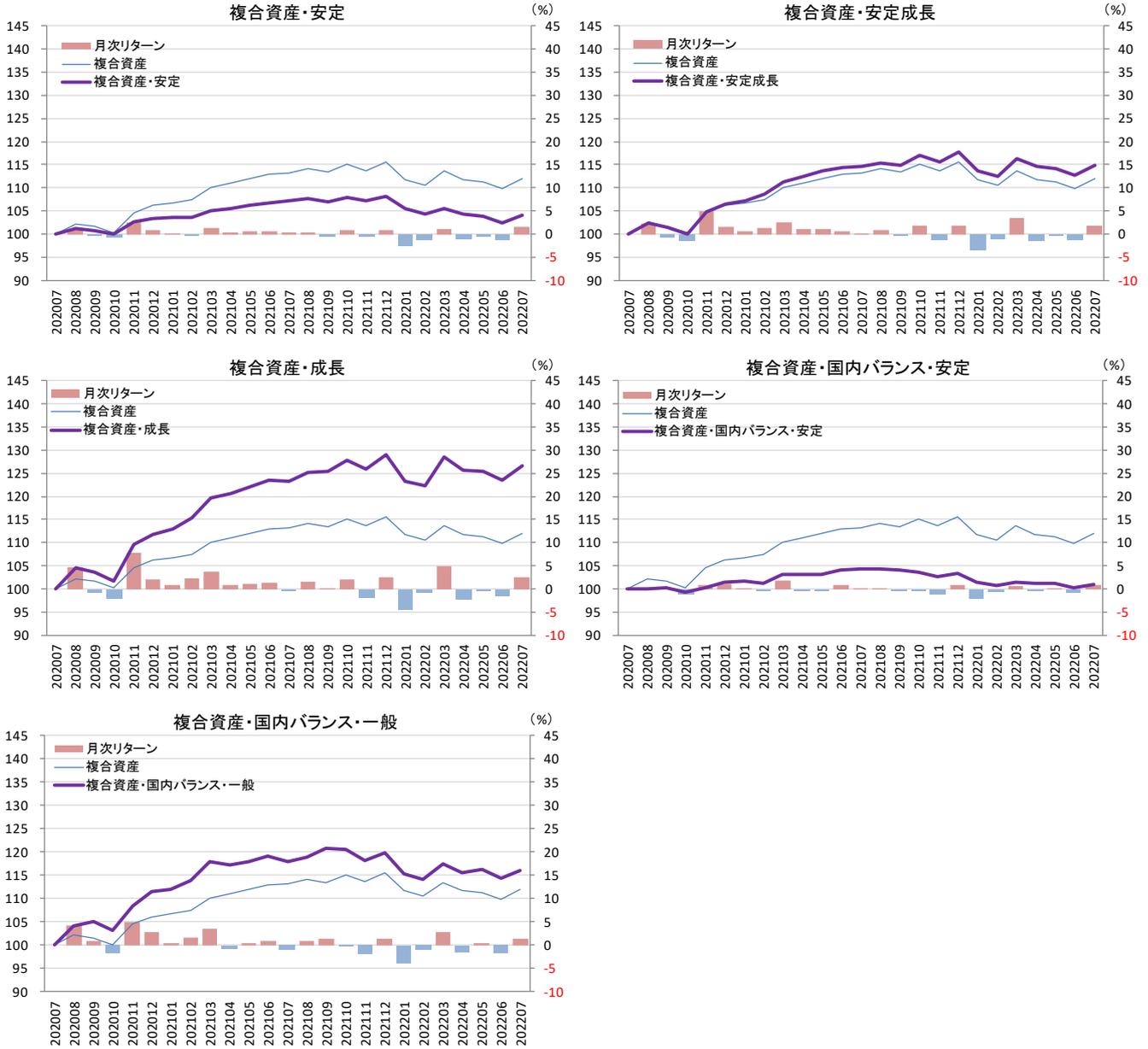


<1>パフォーマンス・サマリー

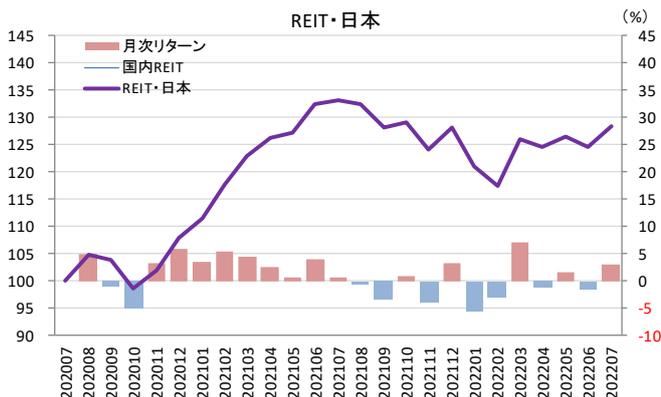
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

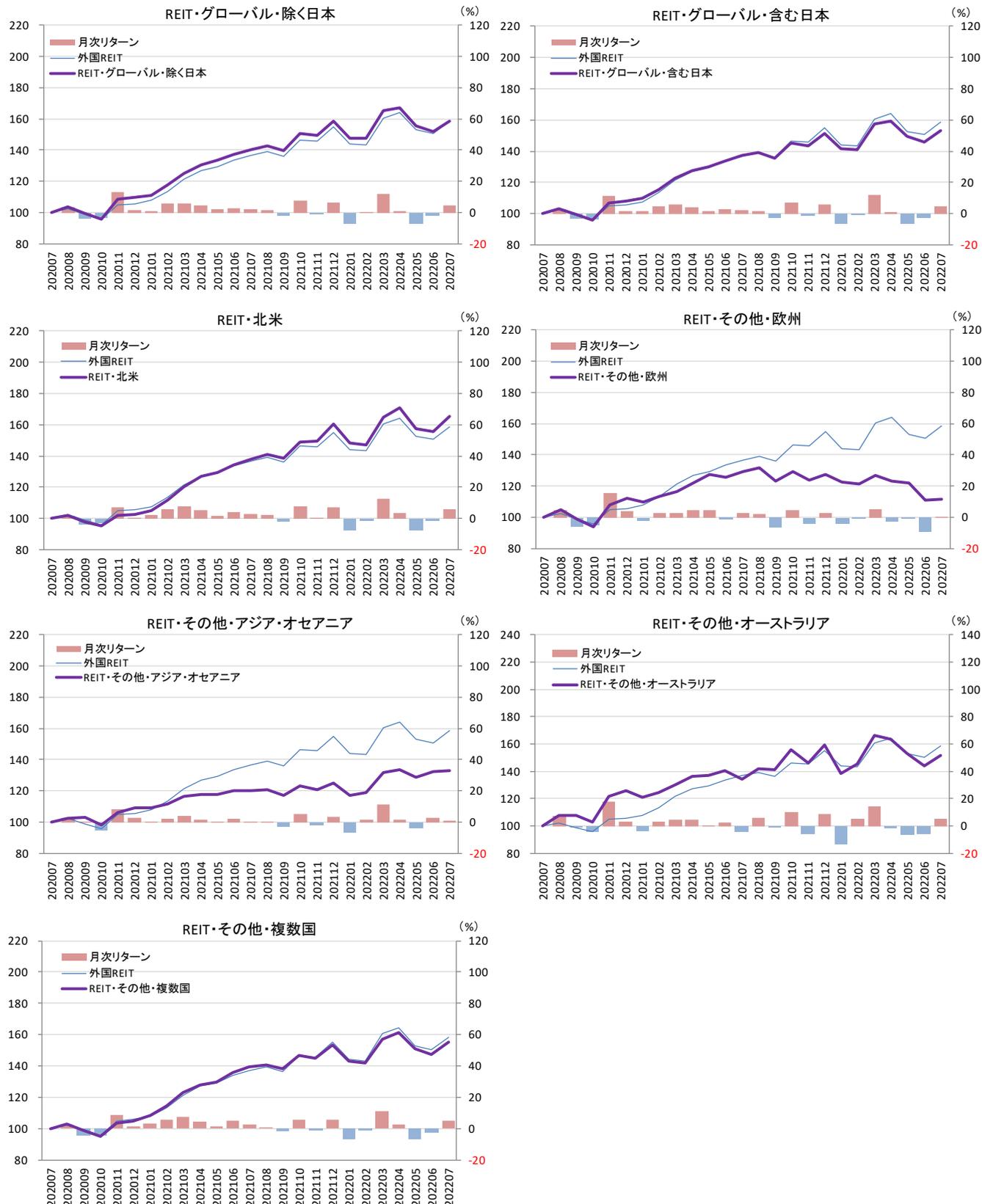


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

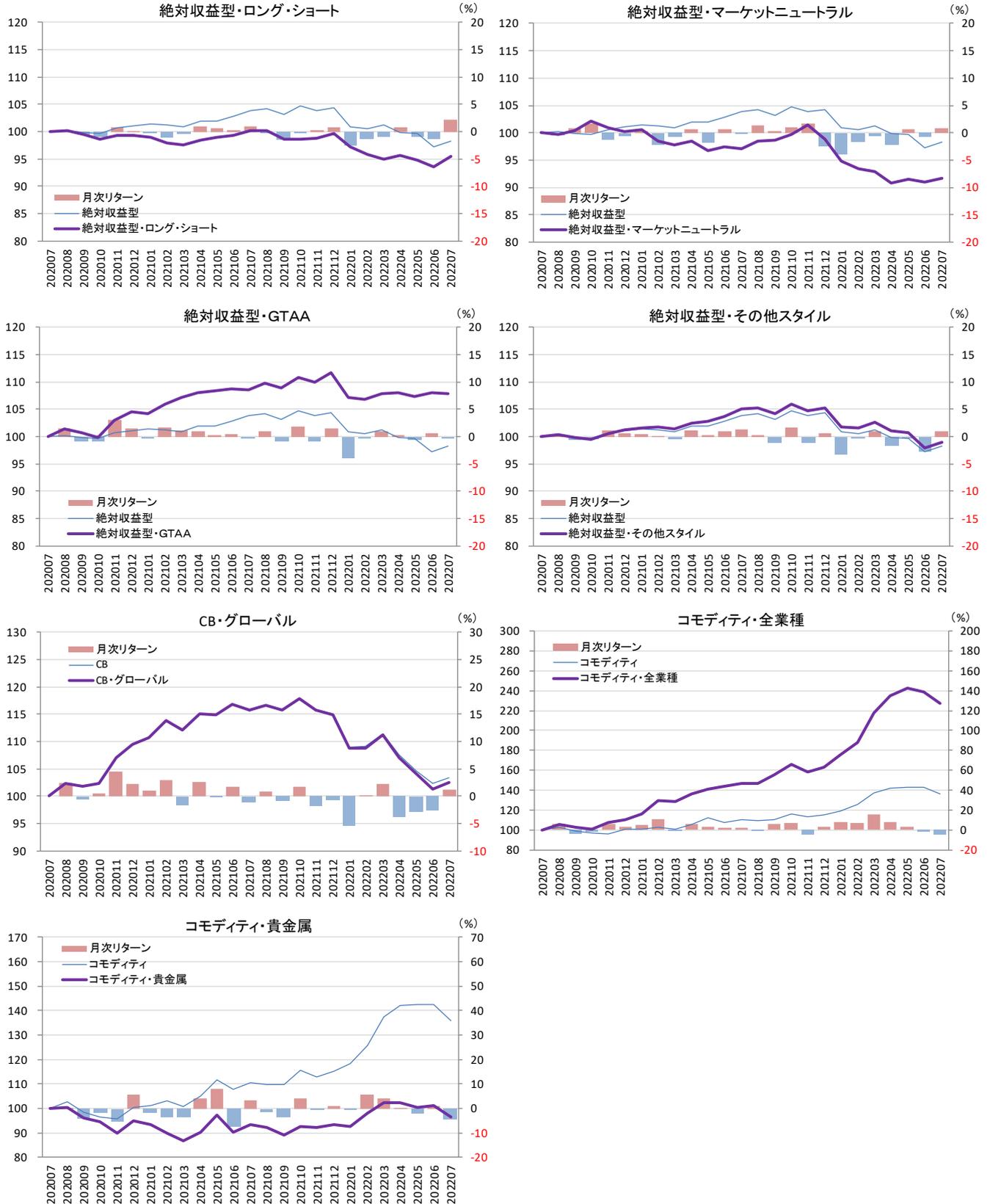


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



＜1＞パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	3.38		
1	外国株式(先進国)・グローバル	4.51	27.56	1.24
2	外国株式(先進国)・その他	5.80	12.35	0.71
3	国内株式・一般	3.51	6.61	0.23
4	国内株式・その他	4.41	4.65	0.21
5	REIT・北米	6.08	2.97	0.18
6	外国債券(先進国)・グローバル	1.54	7.79	0.12
7	複合資産・安定成長	1.74	6.68	0.12
8	REIT・グローバル	4.66	2.20	0.10
9	REIT・日本	2.99	3.31	0.10
10	複合資産・安定	1.64	4.60	0.07
11	複合資産・成長	2.43	2.65	0.07
12	ブルベア	13.25	0.48	0.06
13	外国債券(先進国)・その他	2.39	1.92	0.05
14	国内株式・小型	5.36	0.75	0.04
15	複合資産・その他	9.83	0.40	0.04
16	ハイイールド債券・北米	2.62	1.38	0.04
17	国内債券・一般	0.48	5.11	0.02
18	絶対収益型	1.01	1.37	0.01
19	複合資産・国内バランス	0.91	0.97	0.01
20	REIT・その他	1.88	0.40	0.01
21	国内株式・業種特化	4.43	0.08	0.00
22	エマージング株式・その他	0.14	2.14	0.00
23	ハイイールド債券・グローバル	0.87	0.30	0.00
24	CB	1.04	0.12	0.00
25	ハイイールド債券・その他	0.51	0.23	0.00
26	エマージング株式・BRICS	-2.45	0.06	-0.00
27	エマージング債券・グローバル	-0.56	0.70	-0.00
28	エマージング債券・その他	-1.06	0.59	-0.01
29	エマージング株式・グローバル	-1.28	1.07	-0.01
30	コモディティ	-4.75	0.54	-0.03
	合計		100.00	3.38

◆計算定義

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

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

<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	-2.30		
1	REIT・北米	19.58	2.94	0.49
2	REIT・グローバル	12.09	2.28	0.24
3	国内株式・その他	3.60	4.49	0.21
4	外国株式(先進国)・その他	0.46	11.24	0.15
5	ハイイールド債券・北米	9.95	1.39	0.12
6	外国債券(先進国)・その他	4.68	2.02	0.09
7	コモディティ	22.73	0.51	0.09
8	エマージング株式・その他	4.01	2.31	0.08
9	複合資産・成長	2.74	2.42	0.07
10	エマージング債券・その他	12.20	0.63	0.07
11	REIT・その他	10.13	0.44	0.04
12	複合資産・安定成長	0.22	6.56	0.03
13	ハイイールド債券・グローバル	-0.56	0.32	-0.00
14	国内株式・業種特化	-6.54	0.08	-0.01
15	エマージング株式・BRICS	-18.36	0.07	-0.02
16	CB	-10.61	0.15	-0.02
17	ハイイールド債券・その他	-5.18	0.27	-0.02
18	国内株式・一般	-0.68	6.78	-0.02
19	複合資産・国内バランス	-2.86	1.05	-0.03
20	エマージング債券・グローバル	-5.75	0.75	-0.05
21	エマージング株式・グローバル	-4.14	1.10	-0.05
22	複合資産・その他	-13.27	0.49	-0.08
23	絶対収益型	-5.48	1.28	-0.09
24	国内株式・小型	-10.80	0.83	-0.09
25	ブルベア	-20.42	0.49	-0.11
26	複合資産・安定	-3.00	4.53	-0.15
27	REIT・日本	-3.57	3.31	-0.17
28	国内債券・一般	-3.44	4.98	-0.19
29	外国債券(先進国)・グローバル	-2.54	7.67	-0.22
30	外国株式(先進国)・グローバル	-9.02	28.63	-2.67
	合計		100.00	-2.30

◆計算定義

日次寄与度(%) = 日次リターン(%) × 前日の純資産額構成比

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

＜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	21.99	27.34	108.14	12.56	11.23	10.90	0.55	0.44	0.70
国内株式	30.10	32.17	217.79	16.03	15.75	16.32	0.57	0.37	0.75
一般	29.04	28.36	201.28	15.74	15.63	16.56	0.57	0.33	0.70
フリー	28.09	27.98	202.10	16.11	15.98	17.15	0.54	0.32	0.68
バリュー	31.85	28.83	205.10	15.09	14.85	15.25	0.64	0.35	0.77
小型	20.54	28.68	298.07	20.65	19.36	18.24	0.31	0.27	0.81
その他	33.39	40.67	240.21	16.04	15.57	15.97	0.63	0.46	0.82
日経225	34.59	49.28	261.69	17.41	16.64	16.53	0.60	0.50	0.83
TOPIX	32.01	32.61	217.10	15.13	14.80	15.57	0.64	0.40	0.79
JPX日経400	32.54	32.32	-	15.47	14.92	-	0.64	0.39	-
国内債券	-4.35	-1.29	6.28	1.97	1.73	1.71	-0.73	-0.13	0.36
一般	-4.35	-1.29	6.28	1.97	1.73	1.71	-0.73	-0.13	0.36
外国株式(先進国)	41.10	56.43	193.74	18.89	17.46	15.91	0.65	0.54	0.72
グローバル	38.87	54.28	201.60	18.98	17.59	15.91	0.61	0.52	0.73
除く日本	53.73	73.32	287.88	18.59	17.37	16.50	0.83	0.67	0.88
含む日本	34.44	48.77	180.64	19.52	17.95 ↑	15.97	0.53	0.46	0.68
その他	45.86	61.56	180.84	19.12	17.46	16.12	0.70	0.58	0.67
北米	75.85	98.69	235.53	19.17	18.73	17.29	1.08	0.79	0.74
米国	52.89	81.09	211.47	18.33	17.26	16.40	0.83	0.73	0.73
カナダ	30.96	30.10	59.56	20.98	18.48	15.99	0.45	0.29	0.30
欧州	28.01	27.19	161.47	19.25	17.60	16.43	0.45	0.28	0.61
ドイツ	18.99	7.63	-	24.15	21.82	-	0.25	0.07	-
イギリス	22.69	13.43	-	18.89	17.36	-	0.37	0.15	-
アジア・オセアニア	19.28	25.99	162.94	15.71	14.60	15.41	0.39	0.33	0.66
オーストラリア	26.91	25.06	112.69	28.39	23.39	20.10	0.29	0.20	0.39
ニュージーランド	24.94	51.10	335.64	20.81	18.05	18.36	0.37	0.48	0.86
複合地域	57.97	39.74	-	38.29	32.58	-	0.43	0.21	-
エマージング株式	29.22	29.05	123.95	20.27	17.87	17.13	0.44	0.30	0.49
グローバル	27.46	32.62	99.24	18.96	17.66	17.10	0.45	0.33	0.42
BRICS	-0.30	15.04	99.17	23.27	20.60	19.78	-0.00	0.14	0.36
その他	31.62	28.87	136.84	20.96	18.33	17.38	0.46	0.29	0.52
欧州	-61.30	-56.95	-42.09	38.83	32.01 ↑	27.02	-0.70	-0.48	-0.20
ロシア	-86.71	-82.31	-77.22	59.82 ↑	48.10 ↑	38.44	-0.82	-0.61	-0.36
アジア・オセアニア	18.40	17.76	114.32	18.14	17.03	16.33	0.32	0.20	0.49
中国	38.37	49.41	252.92	20.58 ↑	20.60 ↑	21.76	0.56	0.41	0.62
インド	57.12	46.76	267.01	26.07	23.24	23.23	0.62	0.34	0.60
インドネシア	12.74	13.19	54.96	30.76	26.42	24.49	0.13	0.10	0.18
タイ	-10.23	-0.34	46.60	24.37	21.25	18.74	-0.14	-0.00	0.21
フィリピン	-13.59	-17.14	48.84	22.84	19.79	19.55	-0.21	-0.18	0.21
ベトナム	56.22	70.69	259.93	28.59	25.60	21.51	0.56	0.44	0.64
韓国	46.92	9.71	70.06	25.75	23.18	19.31	0.53	0.08	0.28
香港	-4.20	3.20	69.31	20.75 ↑	19.41 ↑	18.86	-0.07	0.03	0.29
台湾	61.61	48.51	245.98	19.47	20.38	17.87	0.89	0.41	0.74
中南米	6.45	17.42	30.21	34.48	30.06	26.10	0.06	0.11	0.10
ブラジル	-17.85	-2.33	-6.79	37.54	34.23	31.59	-0.17	-0.01	-0.02
メキシコ	35.83	2.61	-	31.35	28.28	-	0.34	0.02	-
中東・アフリカ	47.98	48.19	151.36	20.16	17.84	16.74	0.69	0.46	0.58
トルコ	-4.97	-40.31	-27.52	32.52	34.09	30.48	-0.05	-0.29	-0.10
複合地域	20.11	16.46	97.68	18.35	16.84	15.71	0.34	0.19	0.45

※[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	21.99	27.34	108.14	12.56	11.23	10.90	0.55	0.44	0.70
外国債券(先進国)	6.22	5.92	36.93	4.82	4.32	6.20 ↓	0.43	0.28	0.52
グローバル	3.97	5.26	39.25	3.99	3.61	5.63	0.33	0.30	0.60
除く日本	7.53	8.50	45.28	3.78 ↑	3.71	6.16	0.66	0.45	0.62
含む日本	0.46	2.08	33.25	4.86	4.05	5.29	0.04	0.11	0.55
その他	14.71	10.16	37.97	8.26 ↑	7.28	8.16 ↓	0.57	0.27	0.40
北米	3.87	4.48	-	5.58	4.48	-	0.23	0.21	-
米国	15.21	17.92	63.83	8.15	6.79	6.74	0.60	0.50	0.75
カナダ	22.19	18.26	37.12	7.36	7.28	8.67	0.94	0.47	0.37
欧州	-6.68	-5.31	42.08	4.74 ↑	4.62	7.59	-0.47	-0.23	0.47
イギリス	16.44	8.61	-	7.71 ↓	7.76	-	0.68	0.22	-
アジア・オセアニア	16.45	8.17	35.53	10.86	9.51	9.77	0.48	0.17	0.32
オーストラリア	17.08	8.36	34.44	10.90	9.55	9.76	0.50	0.17	0.31
ニュージーランド	6.88	2.52	-	9.62	9.03	-	0.24	0.06	-
複合地域	16.40	15.36	47.16	5.89 ↑	5.42	7.74	0.89	0.54	0.51
エマージング債券	0.56	-0.44	34.38	11.92	10.62	11.45	0.02	-0.00	0.26
グローバル	-5.98	-7.72	23.49	13.66	12.11	11.90	-0.15	-0.13	0.18
米ドル建て	-7.23	-8.82	24.04	14.42	12.62	12.25	-0.17	-0.14	0.18
現地通貨建て	-1.71	-3.53	20.51	11.40	10.83	11.05	-0.05	-0.06	0.17
その他	9.27	8.99	48.79	11.23	10.04	12.09	0.27	0.18	0.34
ロシア	-90.36	-89.59	-87.58	63.89 ↑	50.31 ↑	39.63 ↑	-0.85	-0.72	-0.48
アジア・オセアニア	5.72	8.99	57.87	7.67	6.47	7.70	0.25	0.27	0.61
インド	20.71	22.51	118.02	9.29	8.76	11.78	0.70	0.48	0.69
インドネシア	30.51	31.73	51.53	15.32	14.19	15.57	0.61	0.40	0.27
ブラジル	-7.15	-8.58	32.69	20.10	18.88	18.52	-0.12	-0.09	0.15
メキシコ	28.61	28.94	57.24	18.52	16.80	15.88	0.47	0.31	0.29
トルコ	-44.96	-64.05	-66.68	27.11	33.63	26.56	-0.66	-0.55	-0.39
複合地域	-7.47	-2.49	8.73	13.68	12.06	12.73	-0.18	-0.04	0.07
ハイイールド債券	14.33	14.20	85.17	12.93	11.11	11.00	0.36	0.25	0.58
グローバル	5.04	4.53	64.16	13.07	11.13	11.12	0.13	0.08	0.46
北米	20.35	21.74	101.31	12.63	10.98	10.90	0.51	0.37	0.67
その他	-1.66	-5.19	54.60	14.69	12.52	12.09	-0.04	-0.08	0.37
欧州	-0.36	-5.06	63.39	15.53	13.38	12.97	-0.01	-0.07	0.39
アジア・オセアニア	-7.98	-7.47	45.85	13.27	10.95	10.61	-0.20	-0.14	0.36
複合地域	14.80	16.61	102.73	9.65	8.44	9.62	0.49	0.37	0.76
複合資産	11.30	15.86	88.08	7.39	6.77	7.87	0.50	0.45	0.83
安定	4.17	7.15	60.98	4.93	4.65	6.24	0.28	0.31	0.78
安定成長	14.36	19.52	96.15	7.94	7.31	8.25	0.58	0.50	0.84
成長	27.14	33.50	150.44	11.00	10.56	10.87	0.76	0.57	0.88
国内バランス	-3.21	1.11	35.93	4.40	3.79	5.82	-0.24	0.07	0.54
安定	-4.16	0.03	26.40	4.26	3.59	3.28	-0.32	0.01	0.72
一般	15.11	18.85	73.97	8.42	8.28	9.38	0.57	0.43	0.61

※[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	21.99	27.34	108.14	12.56	11.23	10.90	0.55	0.44	0.70
国内REIT	10.63	38.28	196.41	17.96	14.64	16.47	0.19	0.46	0.70
日本	10.63	38.28	196.41	17.96	14.64	16.47	0.19	0.46	0.70
外国REIT	36.71	51.80	184.69	20.44 ↑	17.67 ↑	16.08	0.54	0.50	0.69
グローバル	29.98	40.92	153.22	21.45	18.30 ↑	16.30	0.43	0.39	0.60
除く日本	35.45	50.42	187.27	22.22	18.86 ↑	16.59	0.48	0.45	0.67
含む日本	28.26	38.53	147.58	21.20 ↑	18.12 ↑	16.21	0.41	0.37	0.59
北米	46.21	64.01	215.63	19.78 ↑	17.58 ↑	16.34	0.68	0.59	0.75
その他	15.65	35.53	167.33	22.27	18.40	16.09	0.22	0.34	0.64
欧州	-2.25	-4.87	87.44	22.04	18.92	17.99	-0.03	-0.05	0.36
アジア・オセアニア	14.50	39.03	177.20	20.25	17.07	15.66	0.23	0.40	0.69
オーストラリア	14.78	27.10	124.10	35.05	28.06	22.70	0.14	0.18	0.37
複合地域	6.94	0.70	88.18	29.28	24.42	20.56	0.08	0.01	0.32
複数国	38.39	62.57	255.79	19.18 ↑	16.44 ↑	15.12	0.60	0.62	0.90
その他									
絶対収益型	-2.71	-2.81	1.18	3.61 ↑	3.13	2.95	-0.24	-0.17	0.04
ロング・ショート	-8.85	-8.27	-9.23	3.40	3.52	3.12	-0.89	-0.47	-0.31
マーケットニュートラル	-5.06	-4.80	33.02	4.97	4.51	5.76	-0.34	-0.21	0.50
GTAA	8.20	11.03	20.92	5.06	4.34	3.47	0.53	0.50	0.55
その他スタイル	-2.26	-3.24	4.14	3.87 ↑	3.29 ↑	3.84	-0.19	-0.19	0.11
CB	5.95	5.89	46.93	10.22	8.54	7.90 ↓	0.19	0.14	0.50
アジア・オセアニア	35.15	40.79	141.45	14.13	12.18	11.82	0.75	0.58	0.78
日本	-0.66	-2.88	41.65	5.46	5.30	6.28	-0.03	-0.10	0.56
グローバル	5.38	5.42	45.05	10.52	8.76	7.95 ↓	0.17	0.13	0.48
コモディティ	49.71	56.09	17.96	13.13 ↑	11.30 ↑	12.67	1.10	0.83	0.13
全業種	86.33	83.10	41.55	22.39	18.85 ↑	17.00	1.03	0.68	0.21
貴金属	28.07	36.52	15.46	13.82	11.97	13.18	0.62	0.54	0.11
エネルギー	112.05	149.44	45.38	41.74	36.42	31.13	0.68	0.55	0.12
その他コモディティ	58.62	45.95	32.44	21.98	19.01	16.97	0.76	0.42	0.17

※[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

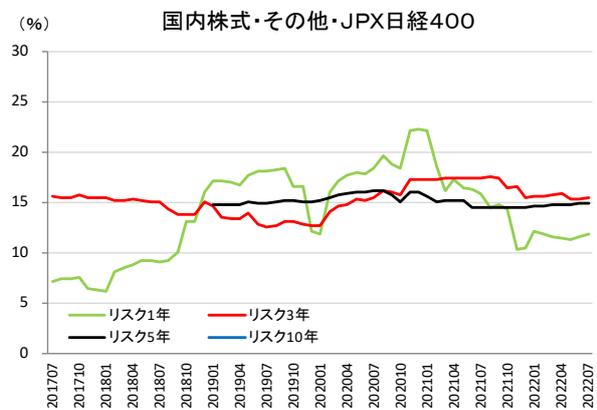
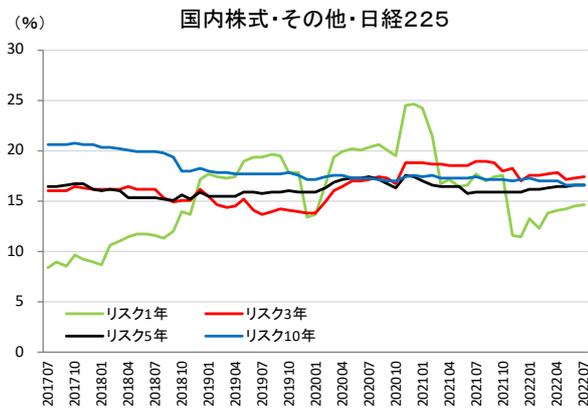
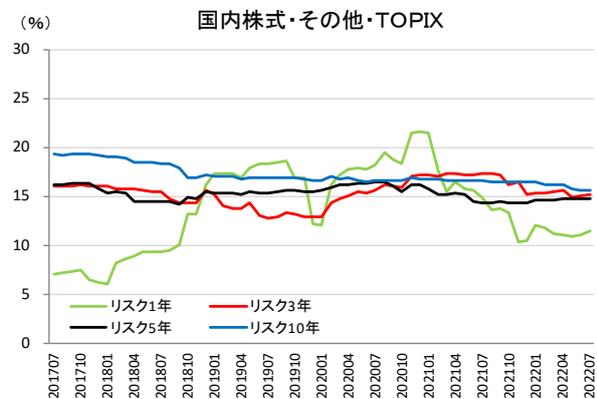
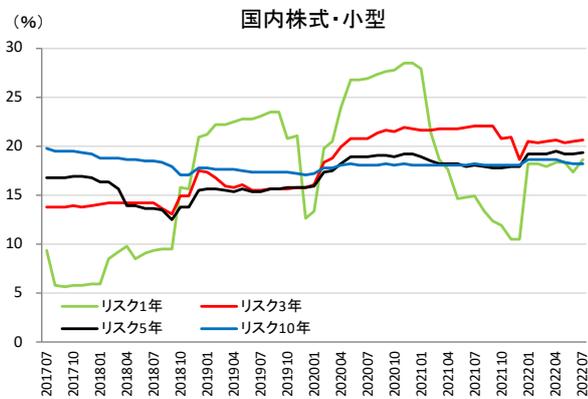
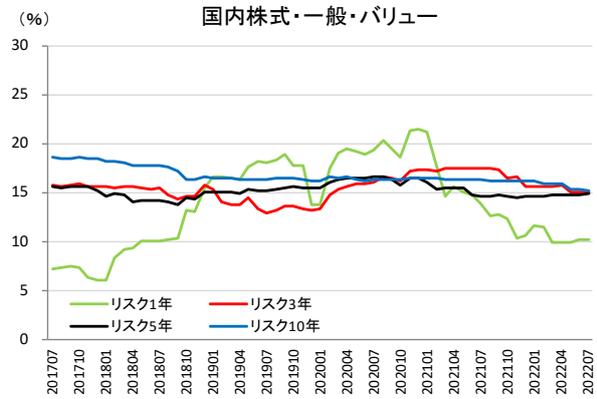
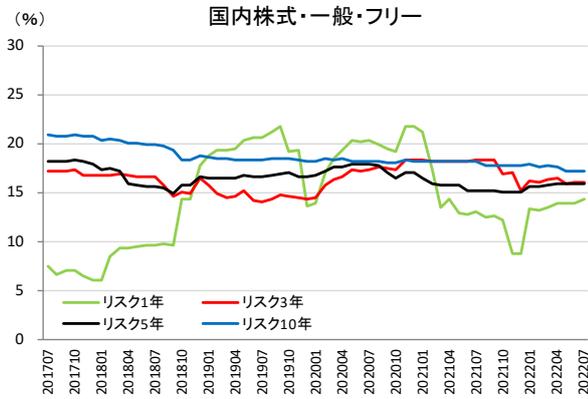
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

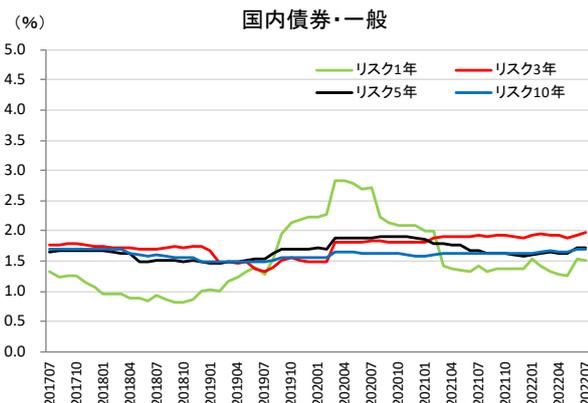
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

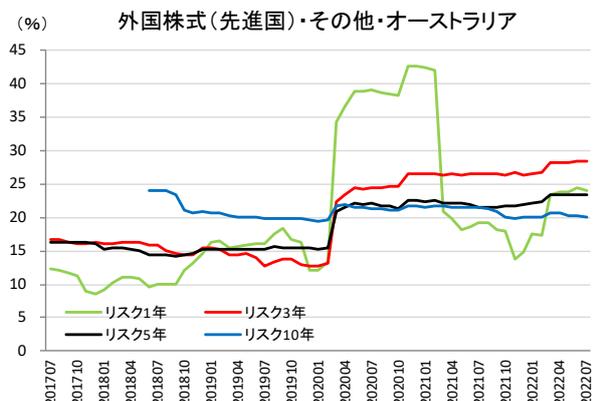
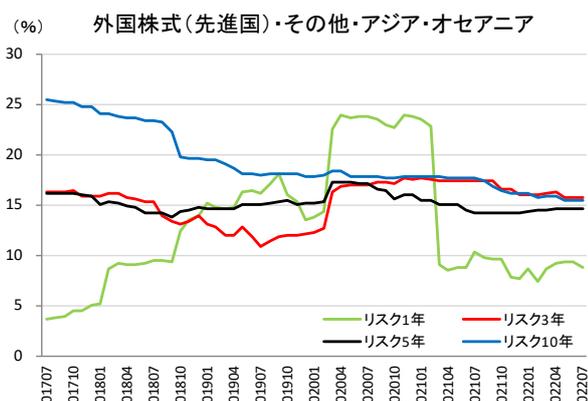
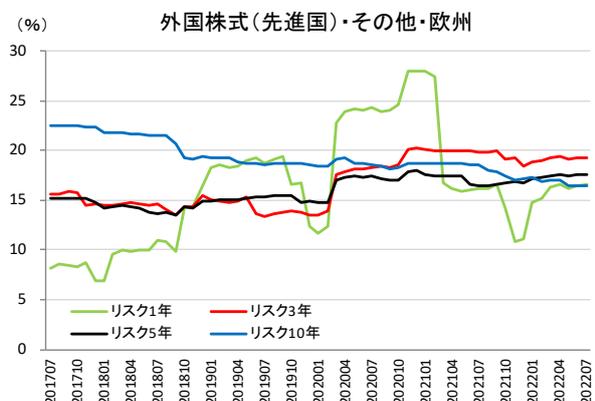
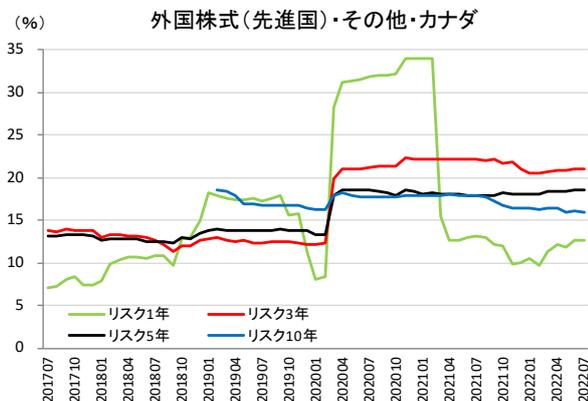
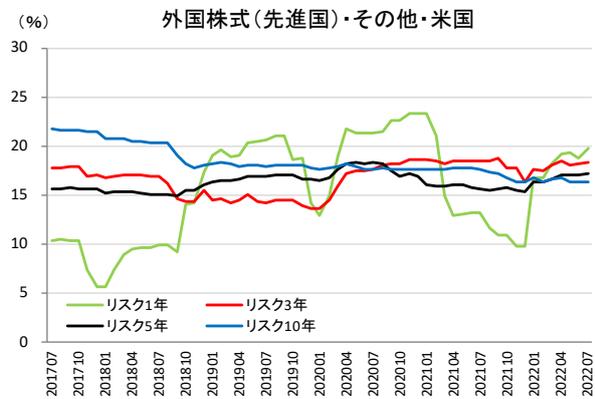
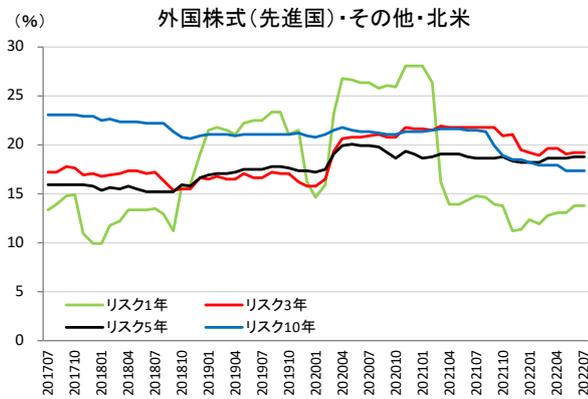
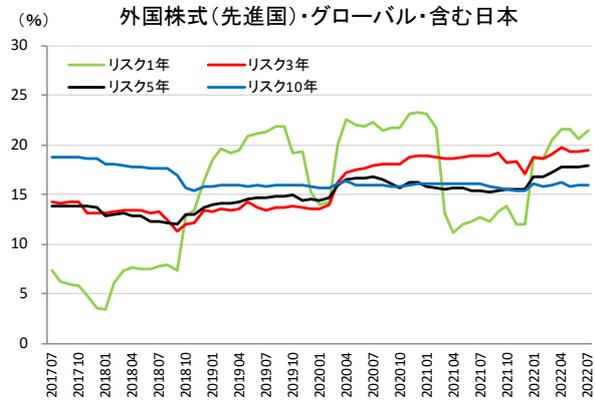
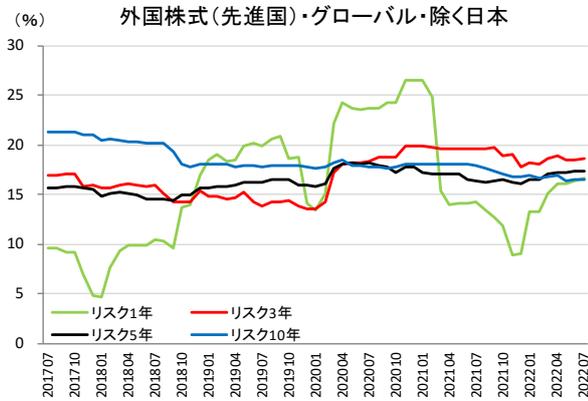


<2> リスク・サマリー

(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)]

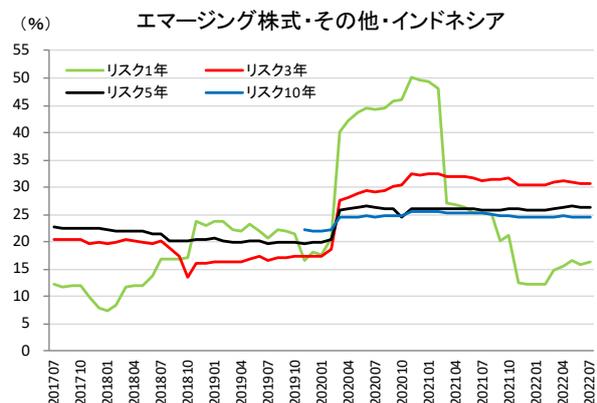
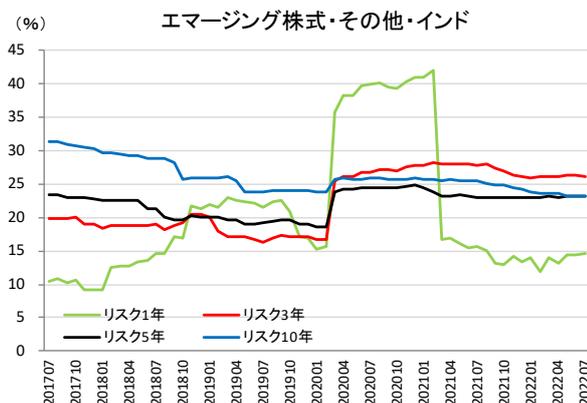
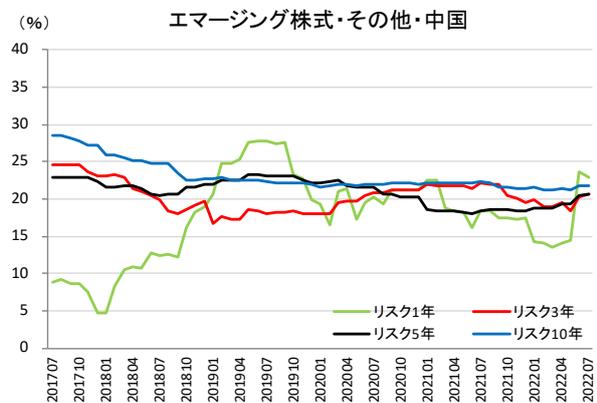
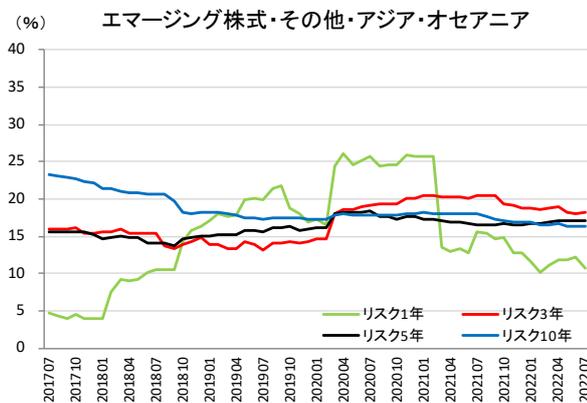
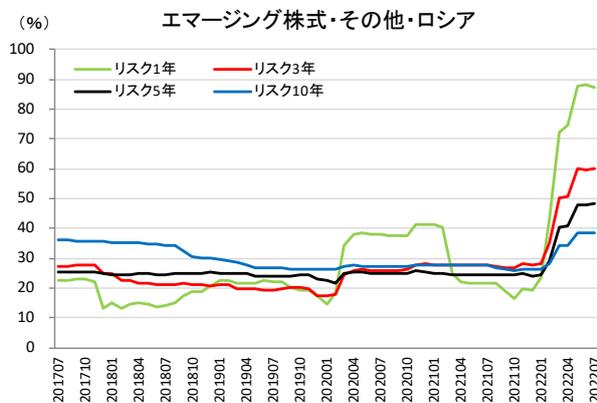
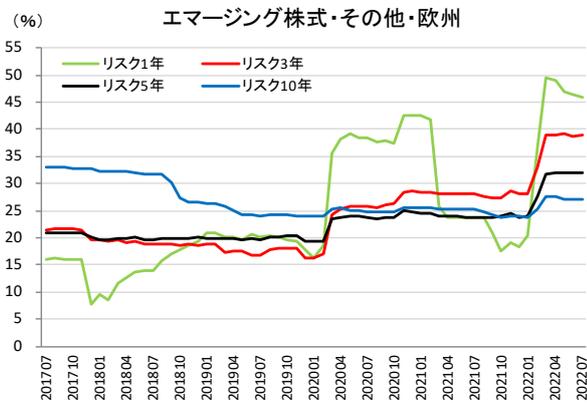
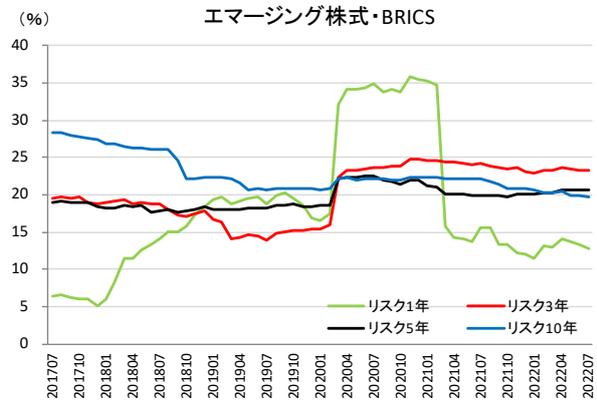
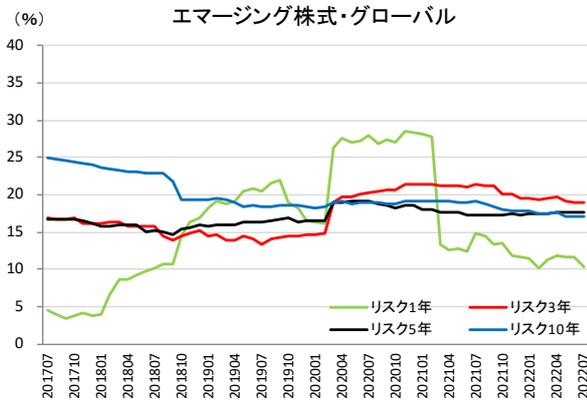


<2> リスク・サマリー

(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]

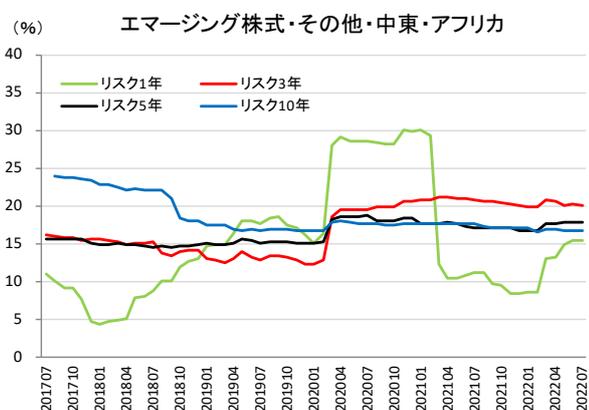
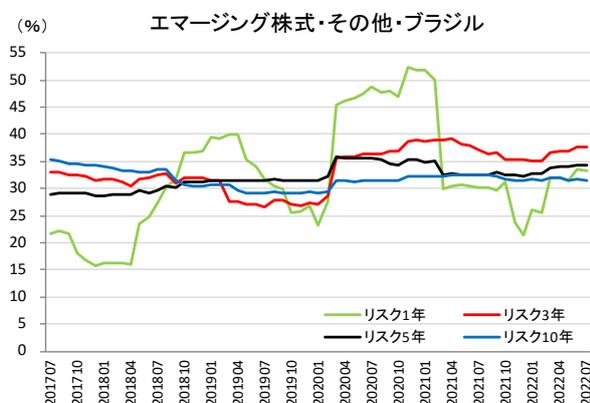
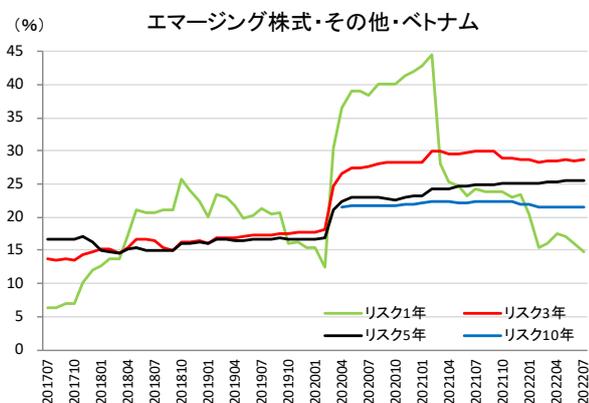
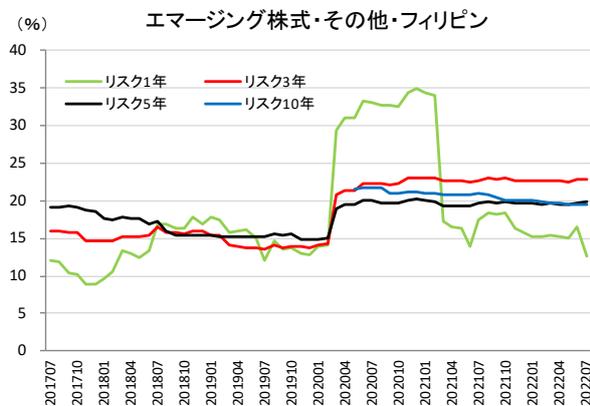
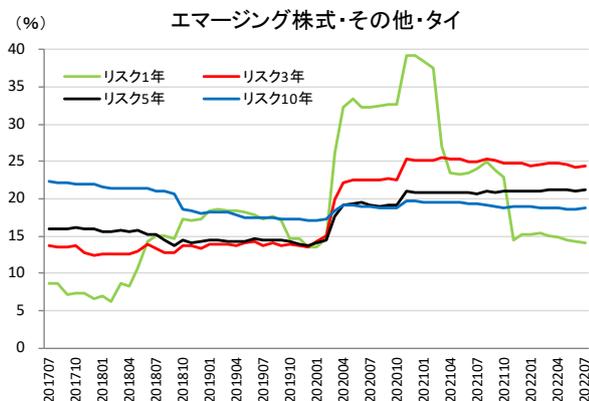


<2> リスク・サマリー

(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]

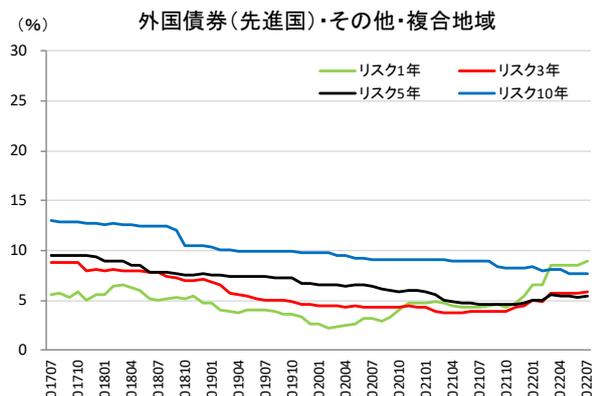
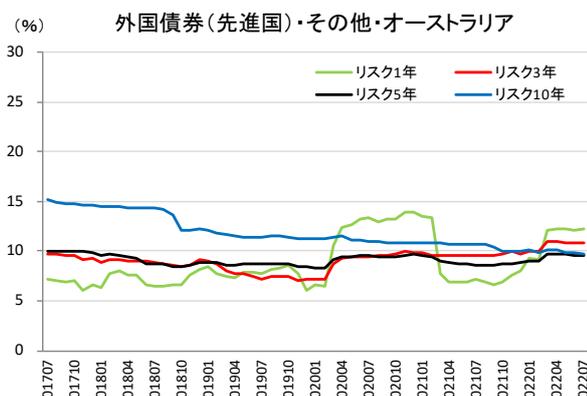
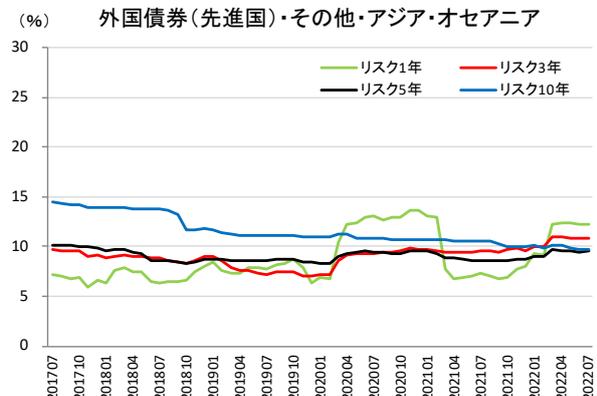
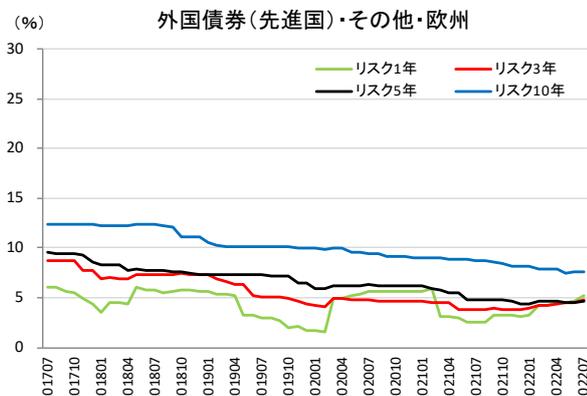
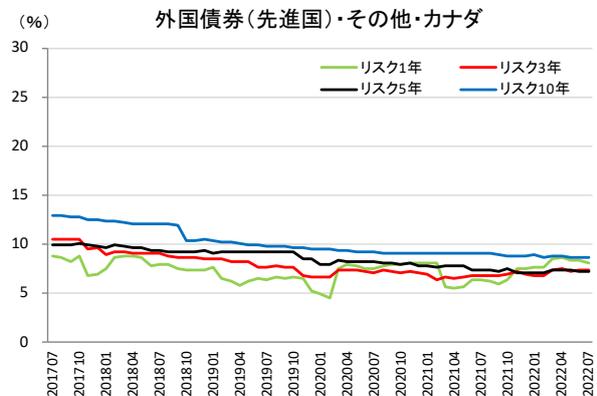
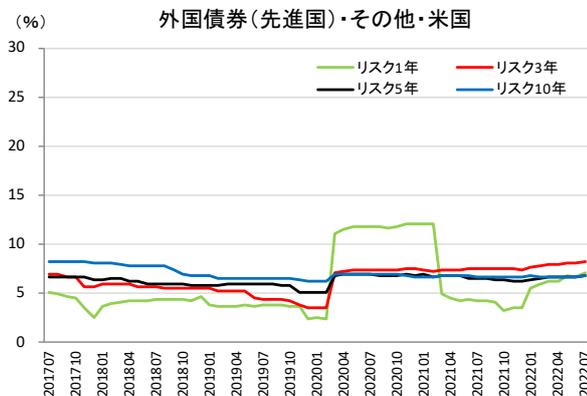
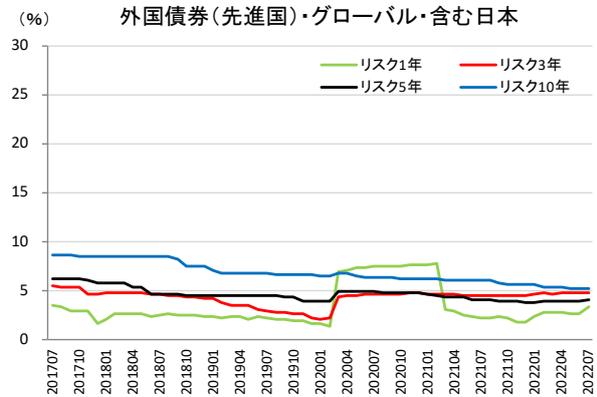
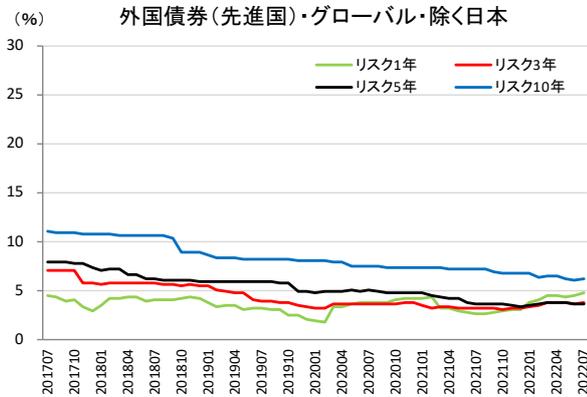


<2> リスク・サマリー

(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)]

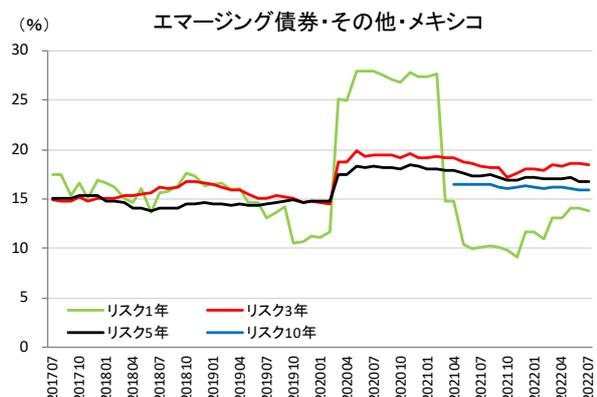
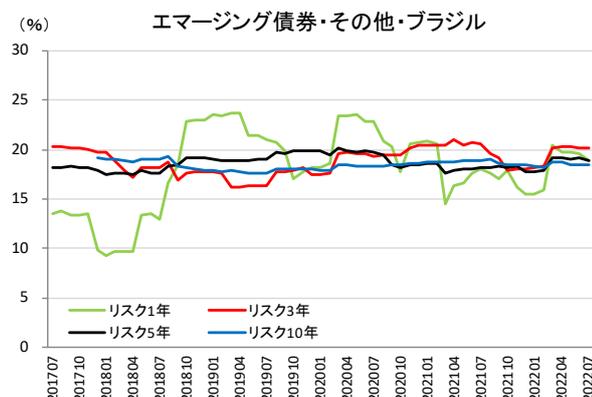
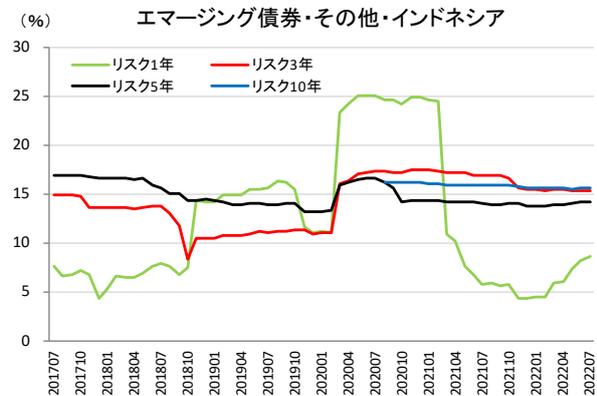
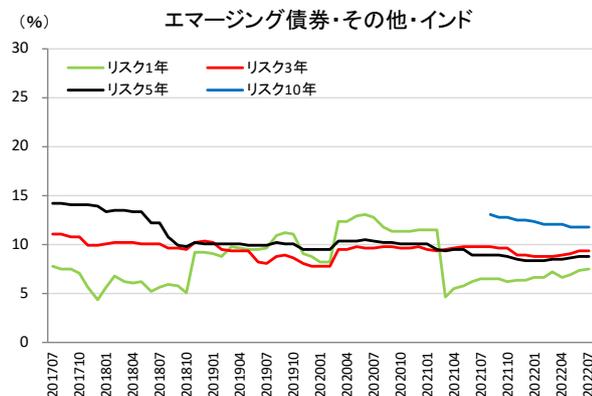
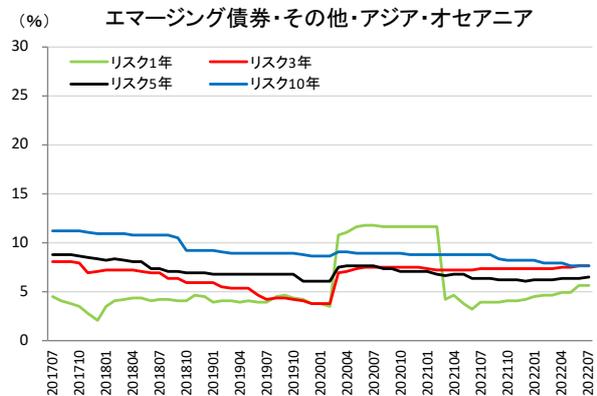
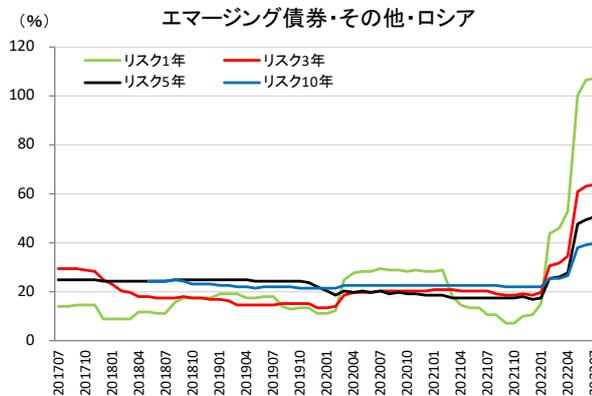
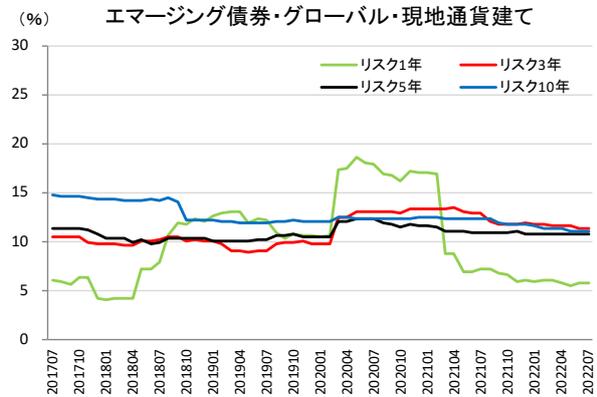
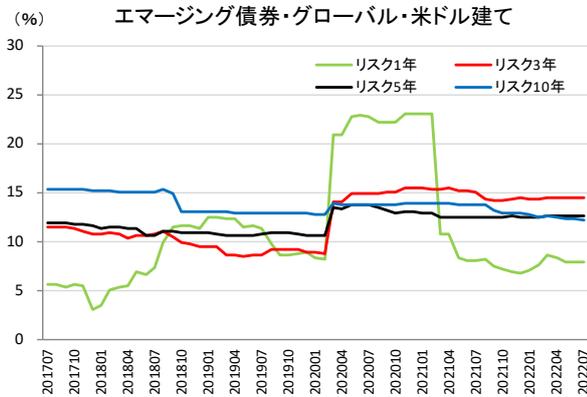


<2> リスク・サマリー

(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]

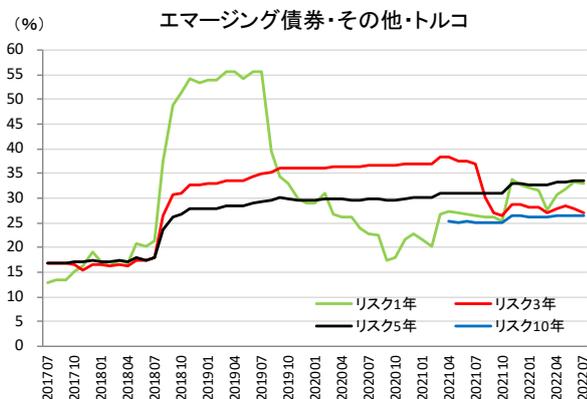


<2> リスク・サマリー

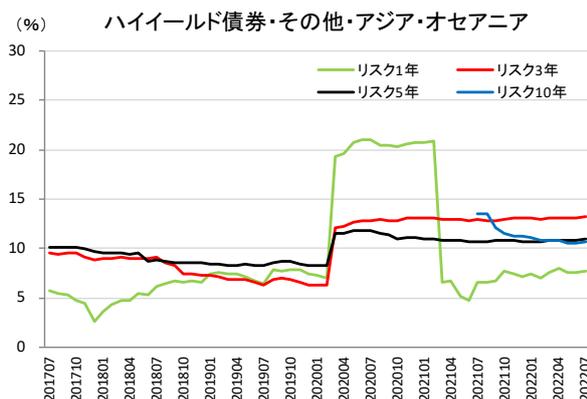
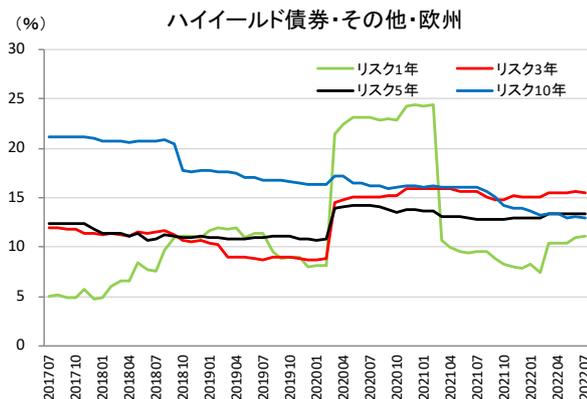
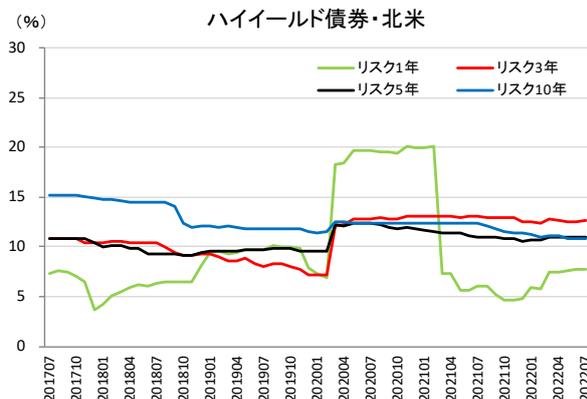
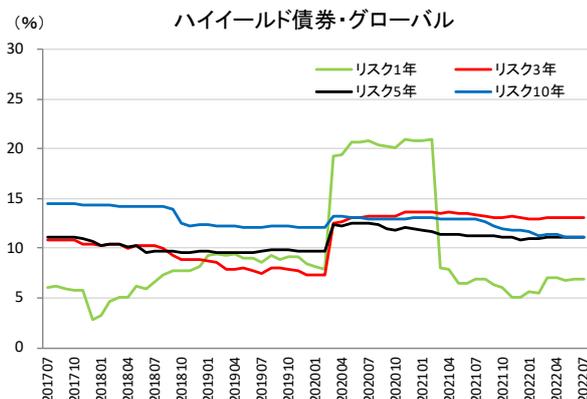
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

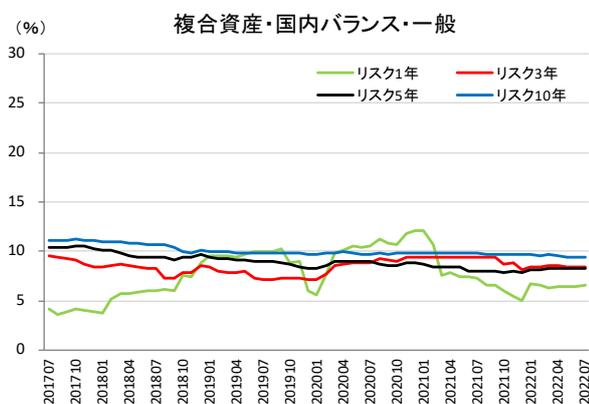
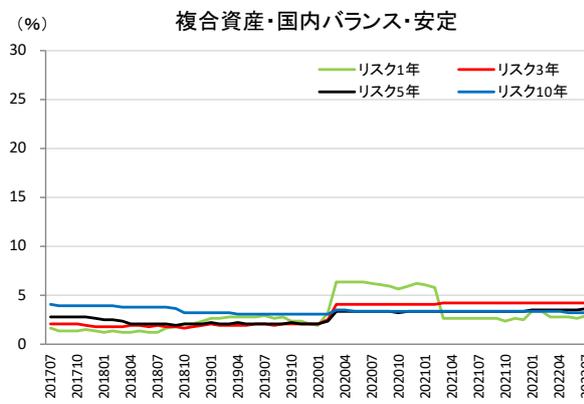
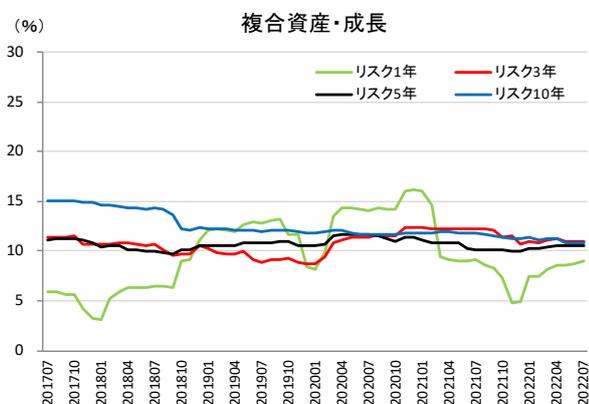
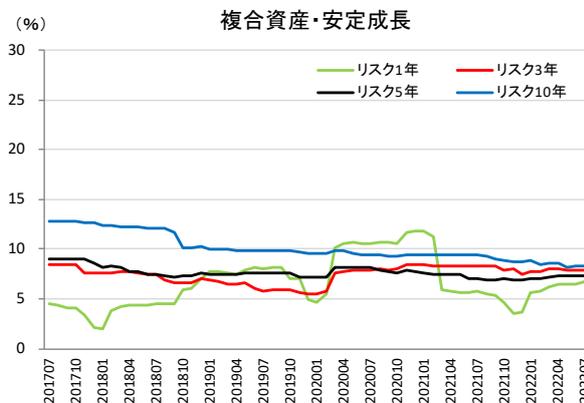
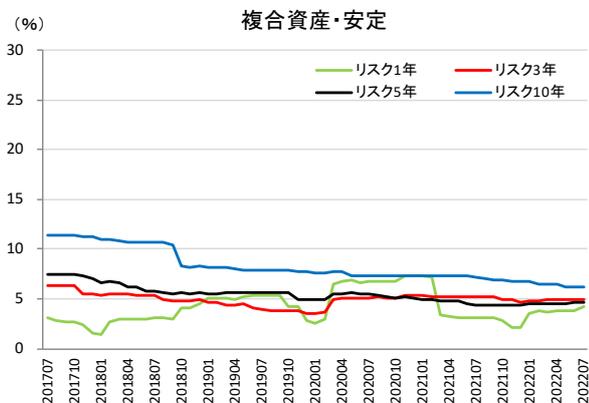


<2>リスク・サマリー

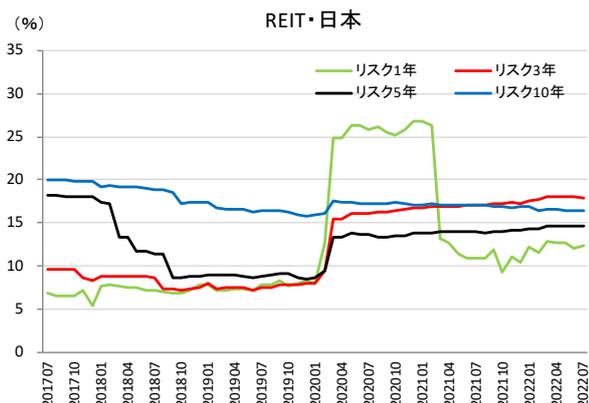
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

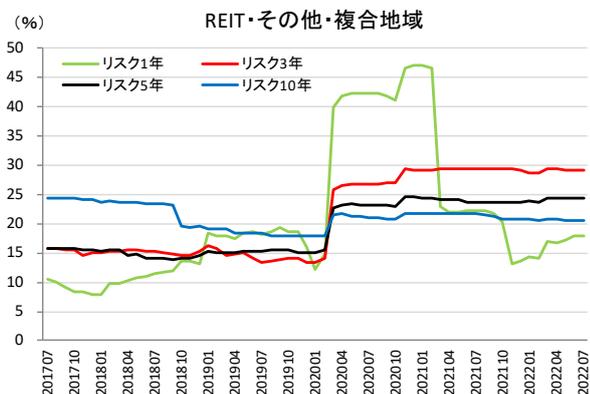
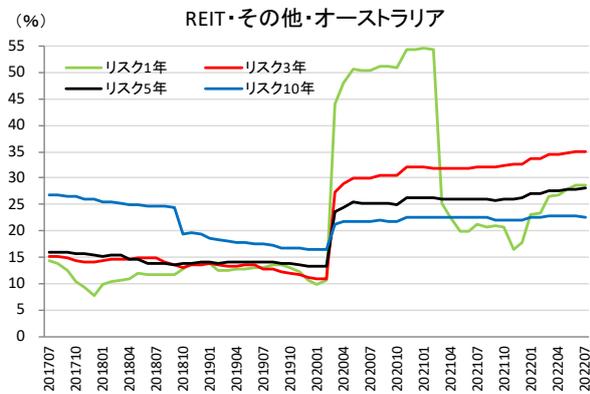
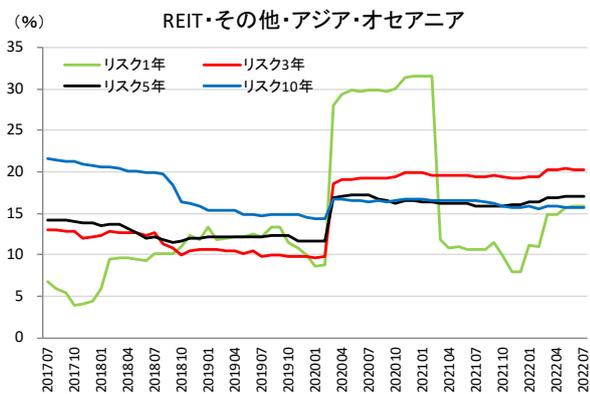
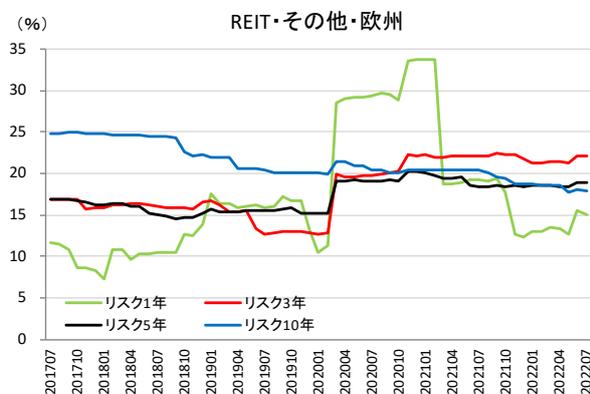
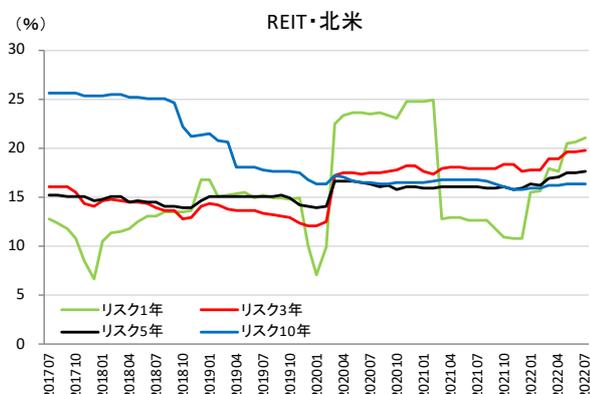
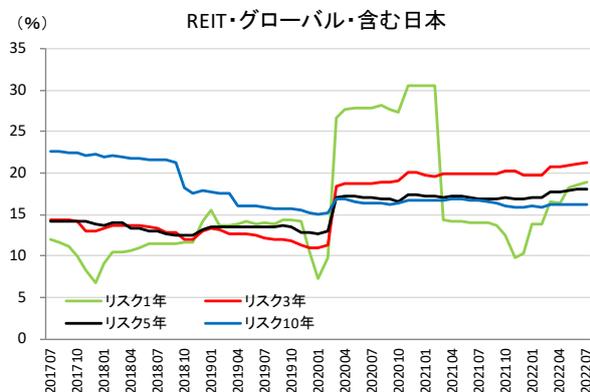
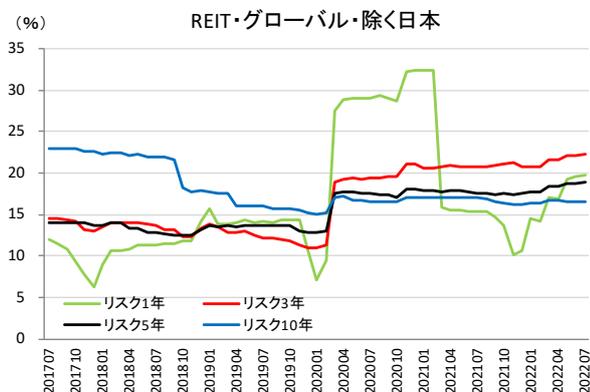


<2> リスク・サマリー

(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]

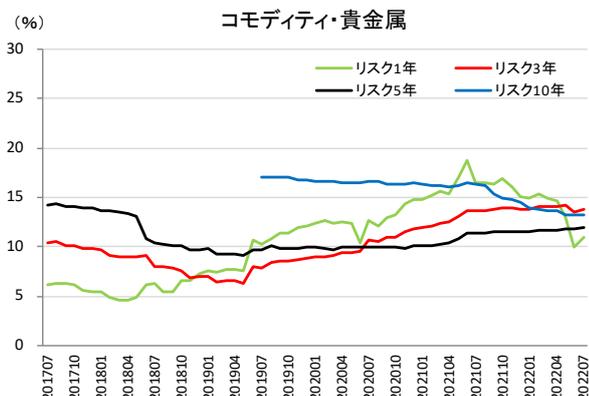
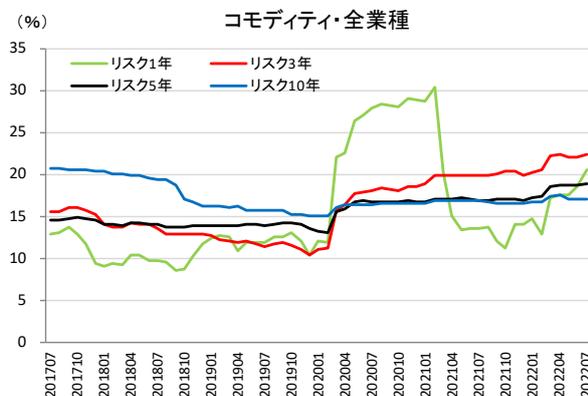
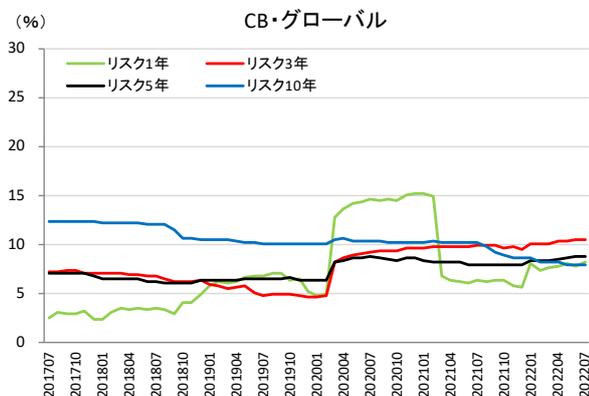
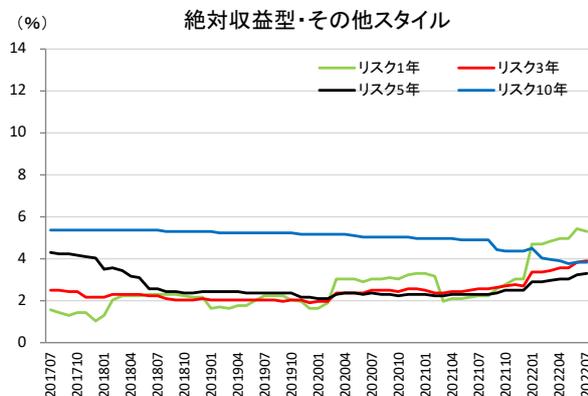
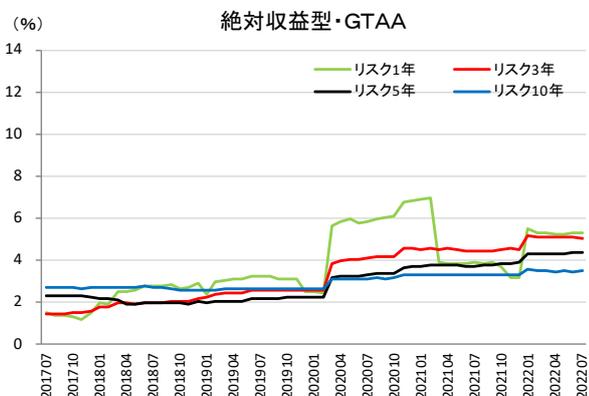
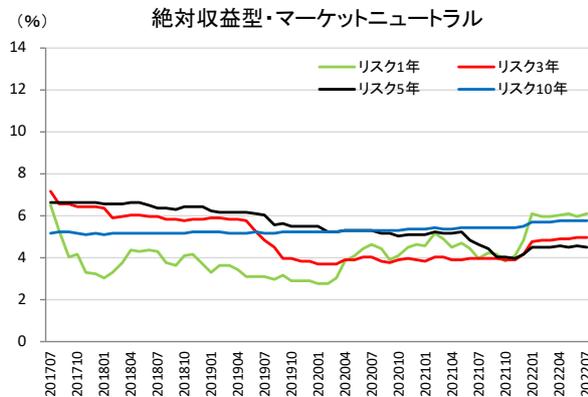
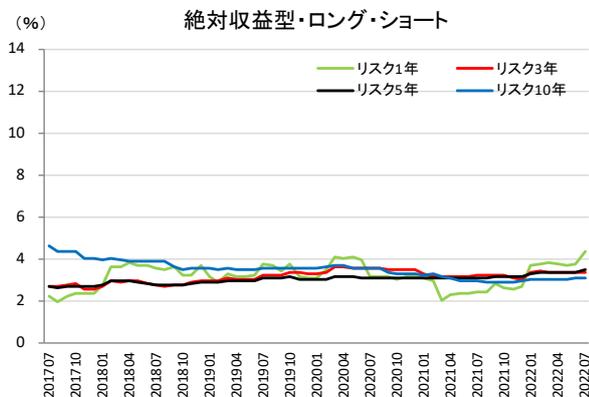


<2> リスク・サマリー

(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	4,504	21,426	38,730	92,413
国内株式	-640	1,002	2,851	5,222
一般	213	1,040	1,598	2,323
フリー	145	792	1,342	2,173
バリュー	67	249	257	151
小型	6	33	159	-140
その他	-857	-76	1,081	3,012
日経225	-587	-147	638	2,164
TOPIX	-281	-7	225	598
JPX日経400	-5	7	19	51
国内債券	264	640	1,911	6,087
一般	264	640	1,911	6,087
外国株式(先進国)	2,856	12,717	25,558	65,159
グローバル	1,733	6,956	11,873	30,889
除く日本	704	3,011	5,149	9,379
含む日本	1,029	3,945	6,725	21,510
その他	1,123	5,761	13,685	34,269
北米	4	14	31	42
米国	1,157	5,892	14,086	35,211
カナダ	-2	-9	-20	-47
欧州	-9	-2	-52	54
ドイツ	0	0	0	-1
イギリス	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-1	-1	-1	-4
オーストラリア	-28	-144	-386	-1,011
ニュージーランド	0	0	0	-1
複合地域	0	11	27	27
エマージング株式	-103	-249	-649	-2,128
グローバル	4	126	157	307
BRICS	-3	-9	-38	-70
その他	-105	-366	-768	-2,365
欧州	0	0	-1	-21
ロシア	0	0	1	-23
アジア・オセアニア	-52	-222	-395	-899
中国	-54	-91	-199	-749
インド	16	-9	-101	-538
インドネシア	-4	-5	-10	-15
タイ	0	-1	-2	-16
フィリピン	-2	-4	-6	-14
ベトナム	-6	-8	10	19
韓国	0	0	0	0
香港	-1	-1	0	2
台湾	-1	0	1	5
中南米	0	-2	-5	-9
ブラジル	-1	-10	-59	-98
メキシコ	0	-2	-2	-6
中東・アフリカ	0	-9	4	1
トルコ	0	-3	-3	-5
複合地域	0	0	-1	-1

<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	4,504	21,426	38,730	92,413
外国債券(先進国)	592	1,606	1,263	3,535
グローバル	666	1,864	2,207	5,873
除く日本	505	697	481	1,510
含む日本	161	1,167	1,726	4,363
その他	-74	-259	-944	-2,338
北米	-1	-2	-5	-8
米国	35	109	-34	-313
カナダ	-19	-53	-103	-205
欧州	-12	-38	-65	-214
イギリス	0	0	-1	-4
アジア・オセアニア	-13	-40	-114	-246
オーストラリア	-58	-209	-551	-1,185
ニュージーランド	-1	-3	-9	-16
複合地域	-5	-23	-61	-144
エマージング債券	72	-82	-447	-1,428
グローバル	119	105	56	-251
米ドル建て	113	95	35	-220
現地通貨建て	7	10	21	-31
その他	-47	-187	-504	-1,177
ロシア	0	0	-3	-18
アジア・オセアニア	-2	-8	-16	-45
インド	-18	-72	-179	-519
インドネシア	-1	-8	-26	-76
ブラジル	-15	-90	-218	-368
メキシコ	-7	-21	-43	-84
トルコ	0	-1	-1	-5
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイイールド債券	91	78	-199	-1,100
グローバル	0	-5	-48	-104
北米	102	136	-19	-665
その他	-11	-53	-132	-331
欧州	-9	-42	-109	-267
アジア・オセアニア	-2	-10	-21	-61
複合地域	0	-1	-1	-3
複合資産	753	2,953	4,562	11,847
安定	97	319	646	4,790
安定成長	391	1,586	2,414	4,664
成長	351	1,304	2,147	3,945
国内バランス	-70	-179	-430	-955
安定	-85	-229	-493	-1,003
一般	-2	-3	-8	-30
その他	-15	-78	-214	-597

<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	4,504	21,426	38,730	92,413
国内REIT	460	1,450	2,016	1,717
日本	460	1,450	2,016	1,717
外国REIT	109	559	254	-1,220
グローバル	24	6	-307	-911
除く日本	72	105	27	79
含む日本	-48	-99	-334	-994
北米	101	652	810	283
その他	-15	-99	-249	-592
欧州	-1	-2	-7	-20
アジア・オセアニア	-7	-72	-172	-378
オーストラリア	-7	-17	-52	-152
複合地域	0	-1	-3	-8
複数国	-1	-6	-15	-33
その他	49	753	1,610	4,723
絶対収益型	54	485	1,086	2,786
ロング・ショート	-8	9	10	69
マーケットニュートラル	-20	-32	-63	-186
GTAA	-14	8	21	35
その他スタイル	94	500	1,115	2,852
CB	-3	-22	-59	-247
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-2
日本	0	-1	-2	-7
グローバル	-2	-20	-56	-238
コモディティ	5	60	-22	99
全業種	-140	-204	-270	-214
貴金属	149	265	271	368
エネルギー	-4	0	-20	-51
その他コモディティ	0	-1	-3	-3

< 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	852,719	100.00	5,430	100.00
国内株式	102,450	12.01	840	15.47
一般	56,268	6.60	538	9.91
フリー	44,021	5.16	438	8.07
バリュー	12,247	1.44	100	1.84
小型	6,500	0.76	92	1.69
その他	39,036	4.58	204	3.76
日経225	20,255	2.38	69	1.27
TOPIX	15,554	1.82	80	1.47
JPX日経400	717	0.08	16	0.29
国内債券	42,756	5.01	140	2.58
一般	42,756	5.01	140	2.58
外国株式(先進国)	343,935	40.33	1,161	21.38
グローバル	237,127	27.81	805	14.83
除く日本	64,115	7.52	192	3.54
含む日本	173,012	20.29	613	11.29
その他	106,808	12.53	356	6.56
北米	233	0.03	9	0.17
米国	101,272	11.88	262	4.83
カナダ	175	0.02	2	0.04
欧州	1,611	0.19	44	0.81
ドイツ	14	0.00	1	0.02
イギリス	10	0.00	3	0.06
アジア・オセアニア	48	0.01	3	0.06
オーストラリア	3,394	0.40	30	0.55
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	36	0.00	1	0.02
エマージング株式	27,255	3.20	322	5.93
グローバル	8,941	1.05	95	1.75
BRICS	475	0.06	7	0.13
その他	17,839	2.09	220	4.05
欧州	51	0.01	6	0.11
ロシア	10	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,811	0.56	91	1.68
中国	2,330	0.27	34	0.63
インド	8,492	1.00	30	0.55
インドネシア	143	0.02	4	0.07
タイ	30	0.00	3	0.06
フィリピン	34	0.00	5	0.09
ベトナム	1,146	0.13	12	0.22
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	57	0.01	2	0.04
ブラジル	522	0.06	15	0.28
メキシコ	14	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	115	0.01	5	0.09
トルコ	38	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	852,719	100.00	5,430	100.00
外国債券(先進国)	81,885	9.60	807	14.86
グローバル	65,785	7.71	532	9.80
除く日本	31,358	3.68	230	4.24
含む日本	34,427	4.04	302	5.56
その他	16,100	1.89	275	5.06
北米	70	0.01	6	0.11
米国	5,253	0.62	159	2.93
カナダ	836	0.10	4	0.07
欧州	1,043	0.12	33	0.61
イギリス	19	0.00	7	0.13
アジア・オセアニア	1,666	0.20	10	0.18
オーストラリア	5,944	0.70	38	0.70
ニュージーランド	81	0.01	9	0.17
複合地域	1,188	0.14	8	0.15
エマージング債券	10,861	1.27	269	4.95
グローバル	5,979	0.70	191	3.52
米ドル建て	4,475	0.52	146	2.69
現地通貨建て	1,504	0.18	45	0.83
その他	4,882	0.57	78	1.44
ロシア	8	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	262	0.03	6	0.11
インド	2,253	0.26	17	0.31
インドネシア	297	0.03	7	0.13
ブラジル	1,559	0.18	21	0.39
メキシコ	268	0.03	7	0.13
トルコ	50	0.01	4	0.07
複合地域	32	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	16,210	1.90	245	4.51
グローバル	2,551	0.30	34	0.63
北米	11,689	1.37	149	2.74
その他	1,969	0.23	62	1.14
欧州	1,549	0.18	40	0.74
アジア・オセアニア	383	0.04	21	0.39
複合地域	37	0.00	1	0.02
複合資産	129,409	15.18	999	18.40
安定	38,694	4.54	281	5.17
安定成長	56,494	6.63	412	7.59
成長	22,665	2.66	256	4.71
国内バランス	8,050	0.94	33	0.61
安定	7,565	0.89	9	0.17
一般	308	0.04	19	0.35
その他	3,506	0.41	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	852,719	100.00	5,430	100.00
国内REIT	28,396	3.33	136	2.50
日本	28,396	3.33	136	2.50
外国REIT	48,222	5.66	285	5.25
グローバル	19,030	2.23	152	2.80
除く日本	6,030	0.71	65	1.20
含む日本	13,000	1.52	87	1.60
北米	25,791	3.02	79	1.45
その他	3,401	0.40	54	0.99
欧州	129	0.02	10	0.18
アジア・オセアニア	2,357	0.28	28	0.52
オーストラリア	577	0.07	12	0.22
複合地域	57	0.01	3	0.06
複数国	280	0.03	1	0.02
その他	21,340	2.50	226	4.16
絶対収益型	11,489	1.35	109	2.01
ロング・ショート	867	0.10	37	0.68
マーケットニュートラル	572	0.07	16	0.29
GTAA	436	0.05	13	0.24
その他スタイル	9,534	1.12	42	0.77
CB	1,004	0.12	29	0.53
アジア・オセアニア	36	0.00	1	0.02
日本	33	0.00	3	0.06
グローバル	935	0.11	25	0.46
コモディティ	4,569	0.54	35	0.64
全業種	1,723	0.20	14	0.26
貴金属	2,735	0.32	19	0.35
エネルギー	92	0.01	1	0.02
その他コモディティ	19	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	13,230	9.6	2.78	3.02	1.188
国内株式	17,167	13.1	0.88	0.90	1.048
一般	15,983	12.8	1.21	1.24	1.398
フリー	15,548	12.1	1.24	1.27	1.440
バリュー	17,887	16.0	1.12	1.13	1.246
小型	22,132	13.7	0.70	0.80	1.701
その他	18,097	13.5	0.37	0.37	0.426
日経225	19,328	15.0	0.42	0.42	0.494
TOPIX	18,897	14.4	0.13	0.13	0.262
JPX日経400	16,692	7.9	0.06	0.06	0.505
国内債券	10,674	11.5	0.18	0.18	0.409
一般	10,674	11.5	0.18	0.18	0.409
外国株式(先進国)	15,422	7.2	3.22	3.65	1.344
グローバル	15,922	7.0	2.41	2.64	1.398
除く日本	22,223	9.7	0.50	0.51	0.618
含む日本	13,949	6.2	3.14	3.44	1.688
その他	14,289	7.6	5.00	5.85	1.224
北米	16,554	8.4	11.37	11.45	1.737
米国	15,172	6.8	4.80	5.70	1.195
カナダ	6,160	11.3	7.99	7.99	1.990
欧州	12,809	11.7	4.24	4.97	1.633
ドイツ	11,941	8.3	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,262	6.0	10.90	10.63	1.871
アジア・オセアニア	9,171	11.7	5.07	5.43	1.665
オーストラリア	9,919	7.9	10.51	10.07	1.823
ニュージーランド	16,525	10.0	1.76	1.82	1.672
複合地域	11,702	9.3	8.52	5.13	1.705
エマージング株式	13,539	10.1	2.90	3.01	1.662
グローバル	12,827	7.8	0.39	0.40	1.084
BRICS	14,122	16.2	0.81	0.98	2.069
その他	13,828	10.9	4.22	4.38	1.940
欧州	4,981	16.1	0.12	0.13	1.951
ロシア	2,090	13.2	3.02	33.02	1.232
アジア・オセアニア	14,703	11.7	4.28	4.89	1.732
中国	16,346	7.9	1.68	2.04	1.939
インド	16,248	11.7	5.33	5.14	2.064
インドネシア	12,901	12.3	2.16	1.81	1.833
タイ	11,626	10.0	2.21	1.98	1.816
フィリピン	9,950	9.0	0.47	0.43	1.742
ベトナム	16,719	5.5	2.23	2.14	1.924
韓国	12,571	3.6	0.00	0.00	1.804
香港	14,408	12.9	1.47	1.53	0.858
台湾	9,970	9.7	17.53	23.07	1.661
中南米	8,345	15.5	0.00	0.00	2.042
ブラジル	5,658	11.7	3.38	4.28	1.944
メキシコ	10,222	9.4	0.00	0.00	1.898
中東・アフリカ	14,073	11.0	3.29	3.26	2.076
トルコ	7,047	21.0	0.00	0.00	2.035
複合地域	21,241	14.2	1.72	1.73	1.941

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目録見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

<5> 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別②

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	13,230	9.6	2.78	3.02	1.188
外国債券(先進国)	10,046	10.0	1.52	1.58	0.986
グローバル	10,583	9.8	1.11	1.18	0.917
除く日本	11,679	12.0	1.04	1.07	0.715
含む日本	9,748	8.2	1.19	1.28	1.102
その他	9,007	10.3	3.12	3.15	1.268
北米	10,246	8.3	2.09	2.19	1.775
米国	9,577	9.3	3.90	3.99	1.255
カナダ	7,459	11.5	1.67	1.51	1.378
欧州	7,795	12.1	1.57	1.66	1.150
イギリス	7,765	7.4	2.55	2.71	1.340
アジア・オセアニア	9,021	12.1	2.70	2.63	1.418
オーストラリア	8,509	13.3	3.23	3.25	1.249
ニュージーランド	9,572	8.1	1.60	1.66	1.355
複合地域	5,308	12.3	2.33	2.31	1.193
エマージング債券	8,431	10.6	4.65	4.81	1.488
グローバル	8,478	11.0	3.37	3.85	1.379
米ドル建て	8,473	11.5	3.47	4.02	1.478
現地通貨建て	8,495	9.6	3.09	3.33	1.083
その他	8,317	9.4	6.21	6.00	1.621
ロシア	862	9.4	4.06	43.98	1.592
アジア・オセアニア	9,376	11.6	6.32	6.83	1.631
インド	9,800	7.7	7.00	6.69	1.702
インドネシア	8,944	9.7	6.20	5.57	1.672
ブラジル	8,411	12.9	5.53	5.11	1.582
メキシコ	7,394	9.4	5.93	5.44	1.400
トルコ	1,752	9.4	6.14	9.85	1.457
複合地域	3,498	15.9	2.90	3.14	1.210
ハイイールド債券	9,084	11.5	5.92	6.05	1.672
グローバル	7,413	11.4	3.84	4.02	1.510
北米	10,426	12.2	5.90	5.73	1.692
その他	6,777	9.8	8.75	10.58	1.765
欧州	6,949	9.3	8.66	10.39	1.740
アジア・オセアニア	6,562	10.3	9.46	11.87	1.865
複合地域	4,386	18.3	5.22	5.47	1.800
複合資産	12,910	9.3	1.22	1.31	0.981
安定	11,463	9.1	1.03	1.08	1.102
安定成長	12,625	9.7	1.50	1.62	0.992
成長	15,317	9.2	0.45	0.48	0.793
国内バランス	11,668	9.1	2.24	2.39	0.940
安定	10,668	11.0	2.31	2.47	0.918
一般	12,182	9.1	1.30	1.39	1.296
その他	9,913	2.5	1.44	1.74	0.767

(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	13,230	9.6	2.78	3.02	1.188
国内REIT	14,647	9.4	8.19	10.05	0.923
日本	14,647	9.4	8.19	10.05	0.923
外国REIT	12,987	8.6	8.52	8.11	1.498
グローバル	14,345	8.4	4.08	3.92	1.285
除く日本	15,688	6.3	3.25	3.28	0.961
含む日本	13,341	10.0	4.46	4.21	1.435
北米	12,194	9.1	11.90	11.23	1.621
その他	10,328	8.4	7.72	7.81	1.765
欧州	7,030	8.5	3.92	4.84	1.823
アジア・オセアニア	11,963	8.0	9.53	9.69	1.813
オーストラリア	9,922	7.8	4.56	4.30	1.705
複合地域	7,082	10.5	0.94	0.94	0.792
複数国	12,157	18.3	2.16	1.97	1.650
その他					
絶対収益型	10,569	5.9	0.07	0.07	1.777
ロング・ショート	10,581	4.9	0.19	0.22	1.450
マーケットニュートラル	9,935	5.4	0.56	0.59	1.314
GTAA	11,260	8.6	0.46	0.53	1.505
その他スタイル	10,531	6.2	0.01	0.00	1.850
CB	12,169	9.9	0.76	0.85	1.430
アジア・オセアニア	10,258	12.1	2.42	2.34	1.823
日本	10,908	11.2	0.66	0.66	0.930
グローバル	12,397	9.6	0.70	0.80	1.433
コモディティ	12,038	6.8	0.77	0.57	1.006
全業種	11,233	9.9	2.01	1.50	1.467
貴金属	11,961	4.2	0.00	0.00	0.718
エネルギー	19,127	13.4	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	17,667	5.8	0.00	0.00	0.506

(注1) 平均値

基準価額（円）と設定来年数（年）は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り（%）

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

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

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

【照会先】

三菱アセット・ブレインズ株式会社

システムグループ 川真田、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