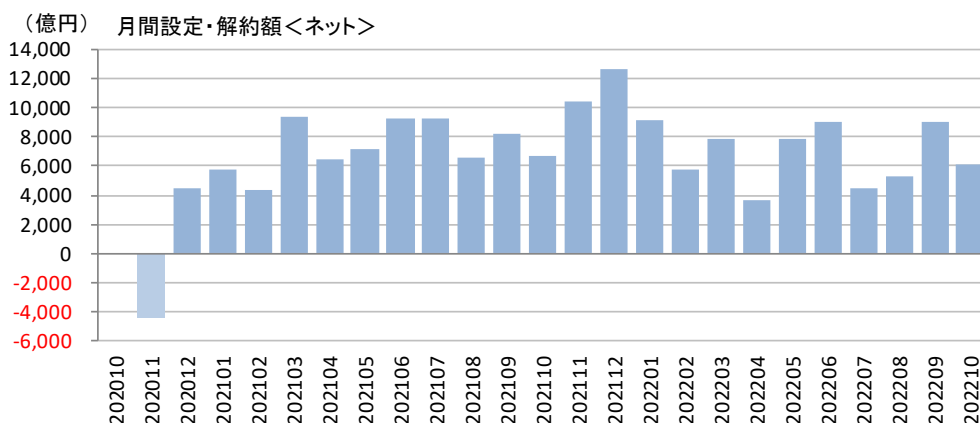
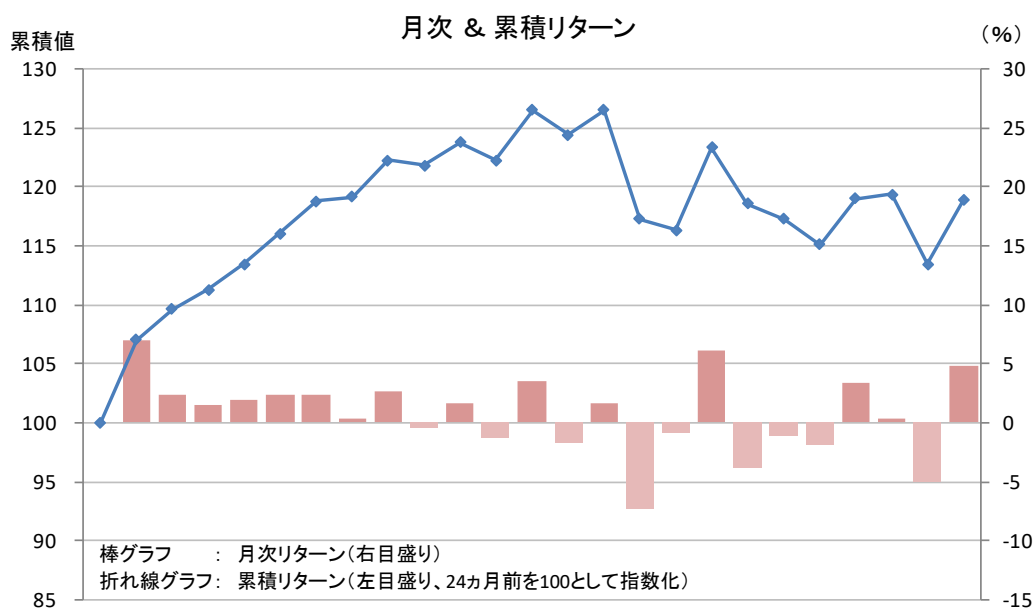


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2022年10月

「総合」 +4.75 %
(前月 -4.96 %)



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		15,740	15,026	714	4.75	
国内株式		19,642	18,722	920	4.92	
一般		19,045	18,262	784	4.29	
フリー		17,821	17,077	745	4.36	
バリュー		24,826	23,861	964	4.04	
小型		39,863	38,073	1,791	4.70	
その他		19,544	18,468	1,077	5.83	
日経225		18,827	17,712	1,115	6.29	
TOPIX		19,145	18,221	924	5.07	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	18,023	17,144	880	5.13	
国内債券		12,633	12,656	-23	-0.18	
一般		12,633	12,656	-23	-0.18	
外国株式(先進国)		20,764	19,324	1,440	7.45	
グローバル		22,355	20,847	1,508	7.24	
除く日本		35,758	32,849	2,908	8.85	
含む日本		19,488	18,279	1,209	6.62	
その他		17,345	16,073	1,272	7.91	
北米		22,276	19,888	2,389	12.01	
米国		26,933	24,945	1,988	7.97	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	22,481	21,118	1,363	6.45	
欧州		22,492	20,608	1,884	9.14	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	10,547	9,205	1,343	14.59	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	10,635	9,897	739	7.46	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	36,608	36,692	-84	-0.23	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	19,949	18,963	986	5.20	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	44,840	43,363	1,476	3.40	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	15,849	13,489	2,360	17.50	
エマージング株式		18,303	18,219	85	0.46	
グローバル		17,340	17,321	19	0.11	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	23,052	22,805	246	1.08	
その他		19,581	19,460	122	0.63	
欧州		10,489	9,319	1,170	12.55	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,466	1,430	36	2.49	
アジア・オセアニア		16,716	17,155	-439	-2.56	
中国		36,777	40,229	-3,452	-8.58	
インド	10,000 (2004.09.30)	53,264	50,938	2,326	4.57	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	18,430	17,943	487	2.71	
タイ		23,546	22,495	1,051	4.67	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,521	6,964	557	8.00	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	20,689	22,757	-2,068	-9.09	
韓国	10,000 (1997.06.30)	24,999	23,558	1,441	6.11	
香港		17,854	20,152	-2,298	-11.40	
中南米	7,427 (2006.04.28)	11,123	9,929	1,194	12.02	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,950	8,996	955	10.61	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	13,778	12,284	1,494	12.17	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	14,468	13,724	744	5.42	
トルコ		30,976	25,632	5,343	20.85	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	22,217	23,240	-1,023	-4.40	

※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		15,740	15,026	714	4.75	
外国債券(先進国)		18,463	18,174	289	1.59	
グローバル		18,415	18,142	272	1.50	
除く日本		20,323	19,889	435	2.19	
含む日本		17,173	17,019	154	0.91	
その他		18,886	18,524	361	1.95	
北米	9,052 (2013.05.31)	10,399	10,352	46	0.45	
米国		17,710	17,436	275	1.58	
カナダ	10,000 (2003.05.30)	17,285	16,811	474	2.82	
欧州	10,000 (1998.07.31)	13,753	13,215	537	4.06	
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,192	9,387	805	8.57	
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	21,062	20,673	389	1.88	
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	26,003	25,576	427	1.67	
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,217	10,909	308	2.82	
複合地域	10,000 (2001.11.30)	18,827	18,309	518	2.83	
エマージング債券		18,454	18,002	452	2.51	
グローバル		18,122	17,674	448	2.54	
米ドル建て		18,362	17,918	444	2.48	
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	13,272	12,922	350	2.71	
その他	8,647 (2005.03.31)	15,241	14,872	368	2.48	
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,578	1,199	378	31.56	
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	15,152	15,193	-41	-0.27	
インド	10,000 (2011.08.31)	20,430	20,262	168	0.83	
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	18,187	18,214	-27	-0.15	
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	14,245	13,509	736	5.45	
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	16,409	15,693	715	4.56	
トルコ	10,000 (2011.04.28)	3,846	3,671	175	4.76	
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,441	10,173	268	2.63	
ハイイールド債券		26,065	24,942	1,123	4.50	
グローバル	10,000 (1997.06.30)	23,585	22,984	602	2.62	
北米		26,829	25,496	1,333	5.23	
その他	10,000 (2004.03.31)	22,091	21,562	529	2.45	
欧州	10,000 (2006.04.28)	22,599	21,710	890	4.10	
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	13,103	13,648	-545	-4.00	
複合地域	10,000 (2004.03.31)	22,754	21,673	1,080	4.98	
複合資産		18,787	18,270	517	2.83	
安定	10,000 (1998.10.30)	15,794	15,549	245	1.57	
安定成長		20,757	20,117	639	3.18	
成長		25,434	24,346	1,087	4.47	
国内バランス		12,475	12,458	16	0.13	
安定		12,677	12,677	-0	-0.00	
一般		15,889	15,574	315	2.02	
その他	10,000 (2018.10.31)	11,644	10,866	779	7.17	

※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		15,740	15,026	714	4.75	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	35,870	35,277	594	1.68	
日本	10,000 (2003.10.31)	35,870	35,277	594	1.68	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	33,829	31,740	2,089	6.58	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	27,913	26,097	1,816	6.96	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	31,179	29,168	2,011	6.89	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	27,709	25,900	1,809	6.98	
北米	10,000 (2003.09.30)	35,984	33,668	2,316	6.88	
その他	10,000 (2004.04.30)	29,615	28,960	655	2.26	
欧州	10,000 (2006.12.29)	4,831	4,320	511	11.84	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	21,858	21,922	-65	-0.29	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	16,528	15,180	1,348	8.88	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,326	6,725	601	8.94	
複数国	10,000 (2004.04.30)	45,757	43,317	2,440	5.63	
その他		6,215	6,072	144	2.36	
絶対収益型		7,491	7,470	20	0.27	
ロング・ショート		8,221	8,202	19	0.23	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,345	11,351	-6	-0.05	
GTAA		11,639	11,524	115	1.00	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,022	7,004	19	0.27	
CB		19,500	19,154	346	1.81	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	20,320	20,953	-634	-3.02	
日本		19,661	19,582	79	0.41	
グローバル		34,021	33,376	645	1.93	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	11,674	11,486	188	1.63	
全業種	10,000 (2004.12.30)	12,427	11,972	455	3.80	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	18,107	18,097	10	0.06	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	10,294	9,269	1,025	11.06	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	16,702	15,960	742	4.65	

※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	-0.10	0.23	-6.02	-6.05
国内株式	0.69	3.13	-5.22	-4.33
一般	0.75	3.04	-5.98	-4.95
フリー	0.87	2.99	-7.81	-6.49
バリュー	0.31	3.17	0.82	0.69
小型	3.16	4.77	-13.82	-10.15
その他	0.18	3.02	-2.21	-2.09
日経225	-0.04	3.58	-2.97	-2.71
TOPIX	0.46	2.78	-1.24	-0.93
JPX日経400	0.23	2.32	-1.67	-1.67
国内債券	-1.64	-2.46	-4.50	-4.56
一般	-1.64	-2.46	-4.50	-4.56
外国株式(先進国)	1.38	1.71	-10.09	-9.79
グローバル	0.97	0.73	-12.84	-11.32
除く日本	3.58	4.39	3.26	0.54
含む日本	-0.01	-0.61	-17.60	-15.05
その他	2.27	3.91	-2.87	-6.17
北米	8.75	11.02	22.92	18.73
米国	2.39	4.22	-3.22	-6.81
カナダ	2.49	2.57	4.82	7.29
欧州	0.08	-1.34	-7.98	-9.34
ドイツ	6.96	3.87	-7.05	-6.26
イギリス	0.85	2.58	12.33	9.06
アジア・オセアニア	-5.66	-4.70	-9.58	-8.65
オーストラリア	-1.32	-3.21	6.30	8.26
ニュージーランド	2.93	-2.77	-5.76	-2.24
複合地域	17.92	21.02	67.09	69.89
エマージング株式	-1.24	-0.63	-5.63	-3.91
グローバル	-4.00	-3.41	-11.20	-8.82
BRICS	-1.10	0.23	-21.74	-15.15
その他	0.16	0.78	-2.24	-1.03
欧州	6.50	-4.18	-67.55	-63.34
ロシア	8.70	-54.93	-90.46	-89.01
アジア・オセアニア	-8.21	-6.73	-13.71	-13.39
中国	-17.05	-5.77	-24.50	-22.07
インド	9.18	8.30	12.04	13.40
インドネシア	12.52	7.72	31.94	31.61
タイ	8.66	2.78	13.36	13.31
フィリピン	1.44	-8.99	-3.11	-6.00
ベトナム	-11.12	-17.94	-12.02	-13.61
韓国	-10.55	-21.87	-29.98	-29.74
香港	-20.22	-12.36	-23.13	-15.67
中南米	20.62	14.74	44.29	46.83
ブラジル	19.18	9.07	42.47	46.80
メキシコ	17.14	13.70	32.81	28.12
中東・アフリカ	4.74	-1.38	15.98	14.50
トルコ	49.20	29.32	53.11	60.62
複合地域	-9.90	-7.57	-17.02	-16.20

※[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	-0.10	0.23	-6.02	-6.05
外国債券(先進国)	-1.67	-0.77	-3.47	-3.05
グローバル	-1.73	-1.07	-4.62	-4.23
除く日本	-1.37	0.14	-2.71	-2.09
含む日本	-2.04	-2.13	-6.31	-6.12
その他	-1.41	0.48	1.25	1.70
北米	-3.21	-3.31	-7.51	-7.66
米国	-1.55	-0.18	1.21	-0.17
カナダ	1.32	6.29	10.29	12.24
欧州	-4.02	-5.07	-11.34	-11.02
イギリス	-3.29	-3.46	-4.85	-3.61
アジア・オセアニア	-1.01	1.25	2.42	4.16
オーストラリア	-1.17	1.16	2.53	4.06
ニュージーランド	-3.59	-1.00	-3.85	-1.74
複合地域	-1.58	0.40	0.80	1.08
エマージング債券	4.83	3.40	7.72	7.88
グローバル	2.29	0.61	-3.38	-1.55
米ドル建て	1.38	-1.17	-5.82	-3.74
現地通貨建て	4.96	5.97	4.30	5.22
その他	8.01	6.89	22.69	20.32
ロシア	50.21	-79.83	-86.01	-85.65
アジア・オセアニア	1.42	1.10	2.71	2.02
インド	5.19	5.64	14.75	12.66
インドネシア	4.75	5.44	14.79	14.25
ブラジル	13.62	11.24	51.56	44.66
メキシコ	9.67	18.42	29.05	27.85
トルコ	25.97	16.78	-7.38	28.07
複合地域	4.01	9.67	-3.39	-3.44
ハイイールド債券	4.83	4.71	8.39	8.01
グローバル	1.18	-0.41	0.20	0.41
北米	6.20	7.13	12.64	11.47
その他	1.28	-2.52	-3.59	-1.23
欧州	1.76	-1.56	-2.72	0.00
アジア・オセアニア	-0.87	-6.77	-7.53	-6.28
複合地域	4.14	3.20	2.52	2.44
複合資産	-1.06	-0.91	-3.77	-4.26
安定	-1.55	-1.82	-5.25	-5.43
安定成長	-0.42	-0.21	-2.39	-2.97
成長	0.34	1.15	-0.71	-1.51
国内バランス	-1.51	-1.47	-3.95	-3.71
安定	-1.62	-1.63	-4.08	-3.86
一般	-0.14	0.09	-3.98	-3.46
その他	-14.37	-14.17	-24.98	-26.65

※[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	-0.10	0.23	-6.02	-6.05
国内REIT	-1.03	2.04	-1.64	-0.83
日本	-1.03	2.04	-1.64	-0.83
外国REIT	-6.34	-9.70	1.30	-4.28
グローバル	-6.33	-10.30	-1.19	-5.61
除く日本	-6.45	-11.11	-1.52	-6.36
含む日本	-6.28	-9.93	-1.04	-5.27
北米	-6.17	-9.27	3.92	-3.26
その他	-7.72	-9.91	-3.30	-4.76
欧州	-8.55	-17.43	-21.14	-19.96
アジア・オセアニア	-8.63	-9.11	-1.51	-2.67
オーストラリア	-5.60	-12.40	-8.02	-10.07
複合地域	-1.76	-5.00	4.39	2.55
複数国	-5.17	-8.57	0.57	-3.77
その他	-2.70	-4.75	-9.61	-9.92
絶対収益型	-1.76	-3.40	-7.84	-7.49
ロング・ショート	-1.59	-1.72	-4.65	-5.66
マーケットニュートラル	-0.41	0.48	-8.36	-7.57
GTAA	-0.29	-0.48	-2.97	-3.66
その他スタイル	-1.95	-3.98	-8.41	-7.91
CB	-1.07	-4.94	-13.19	-11.10
アジア・オセアニア	-1.90	-2.15	1.10	0.53
日本	0.28	-0.10	-3.44	-2.92
グローバル	-1.09	-5.21	-13.94	-11.74
コモディティ	0.47	-4.00	17.92	18.33
全業種	4.67	1.29	43.41	45.92
貴金属	-2.14	-7.60	2.11	1.52
エネルギー	3.93	9.34	60.73	62.35
その他コモディティ	4.43	3.22	35.83	38.82

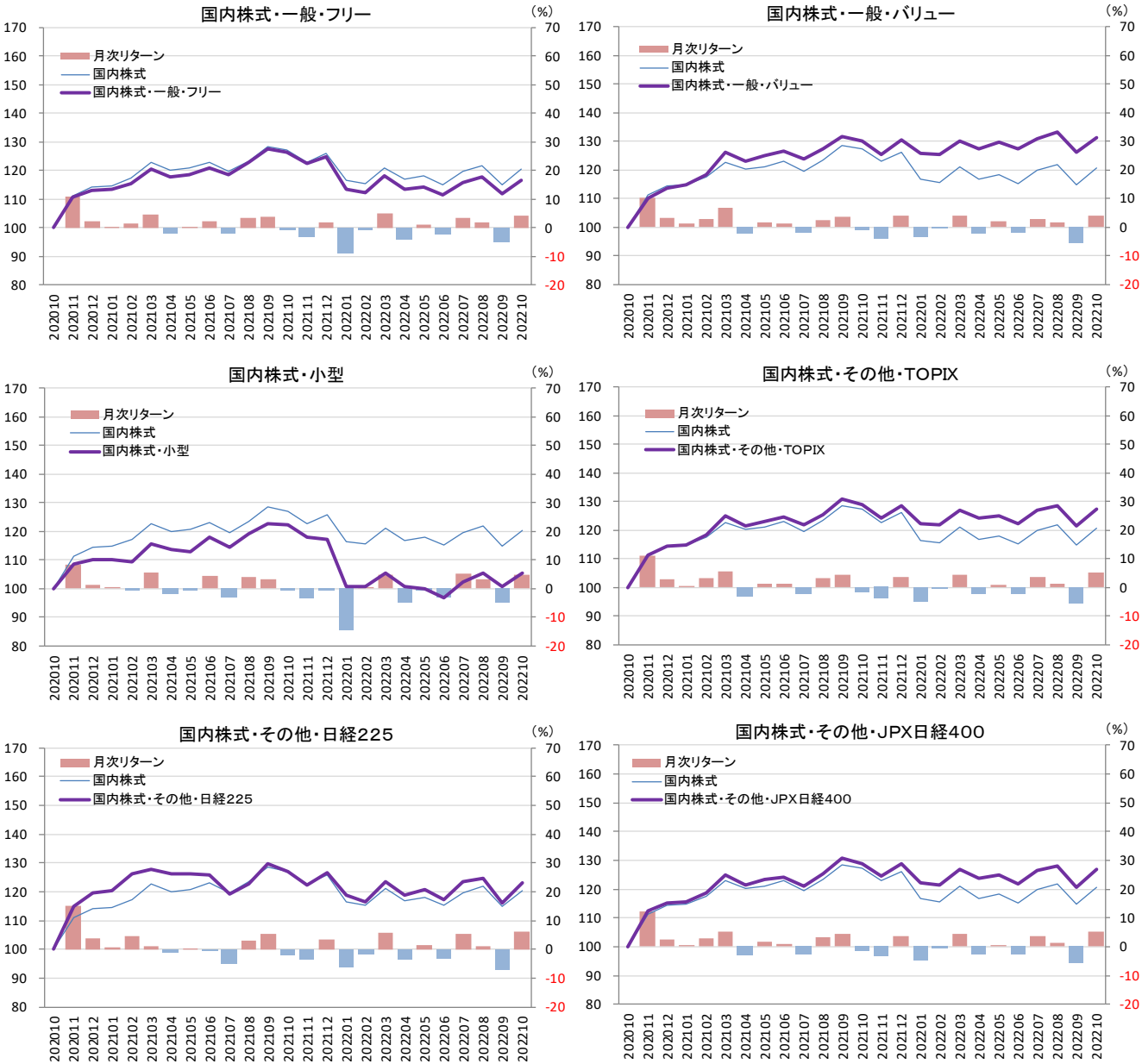
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

＜1＞パフォーマンス・サマリー

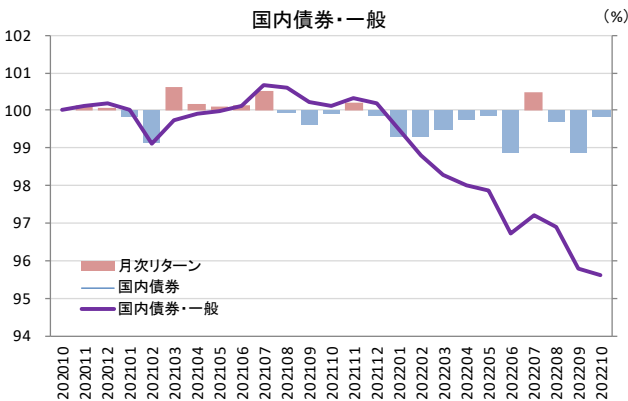
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

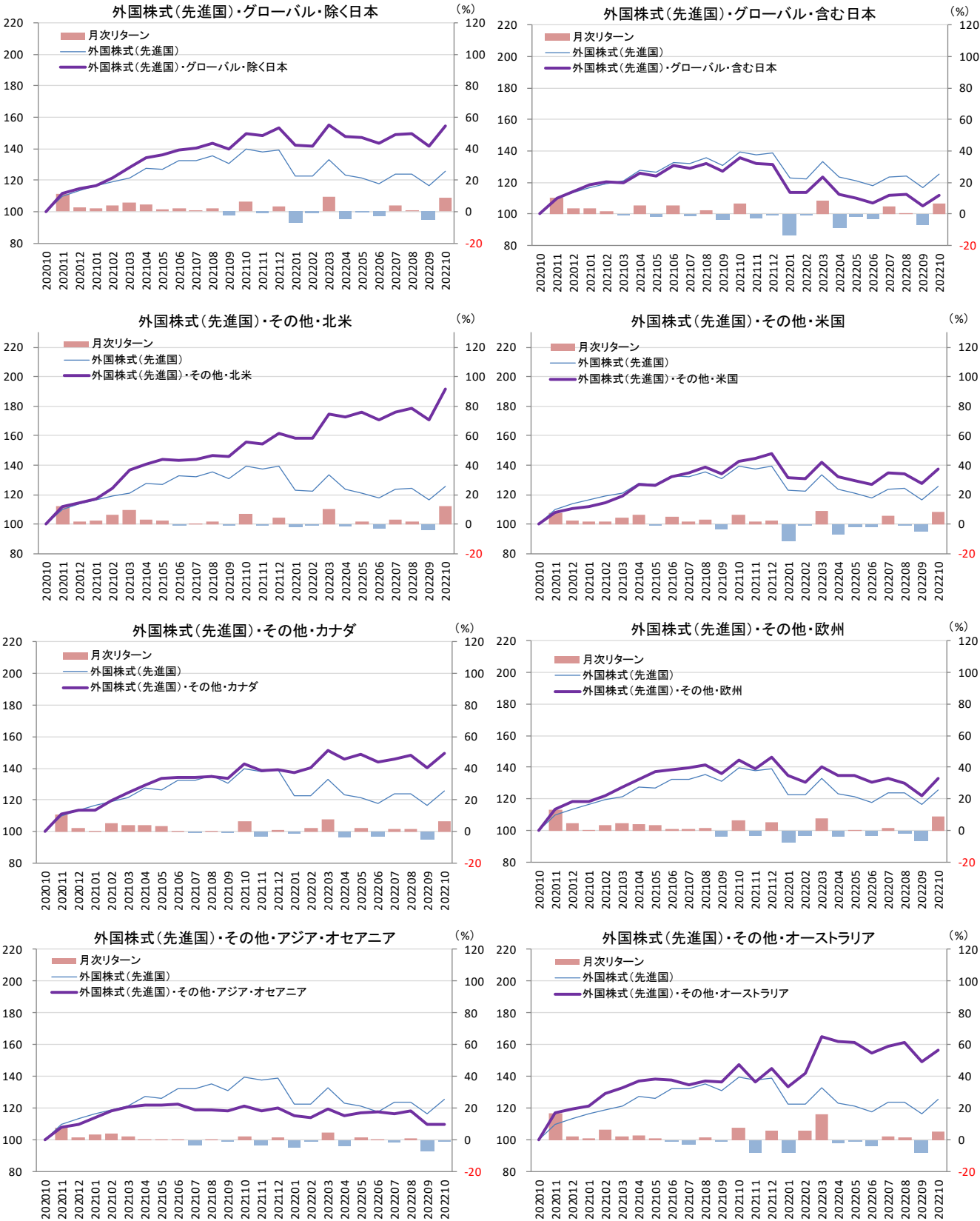


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24 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)]

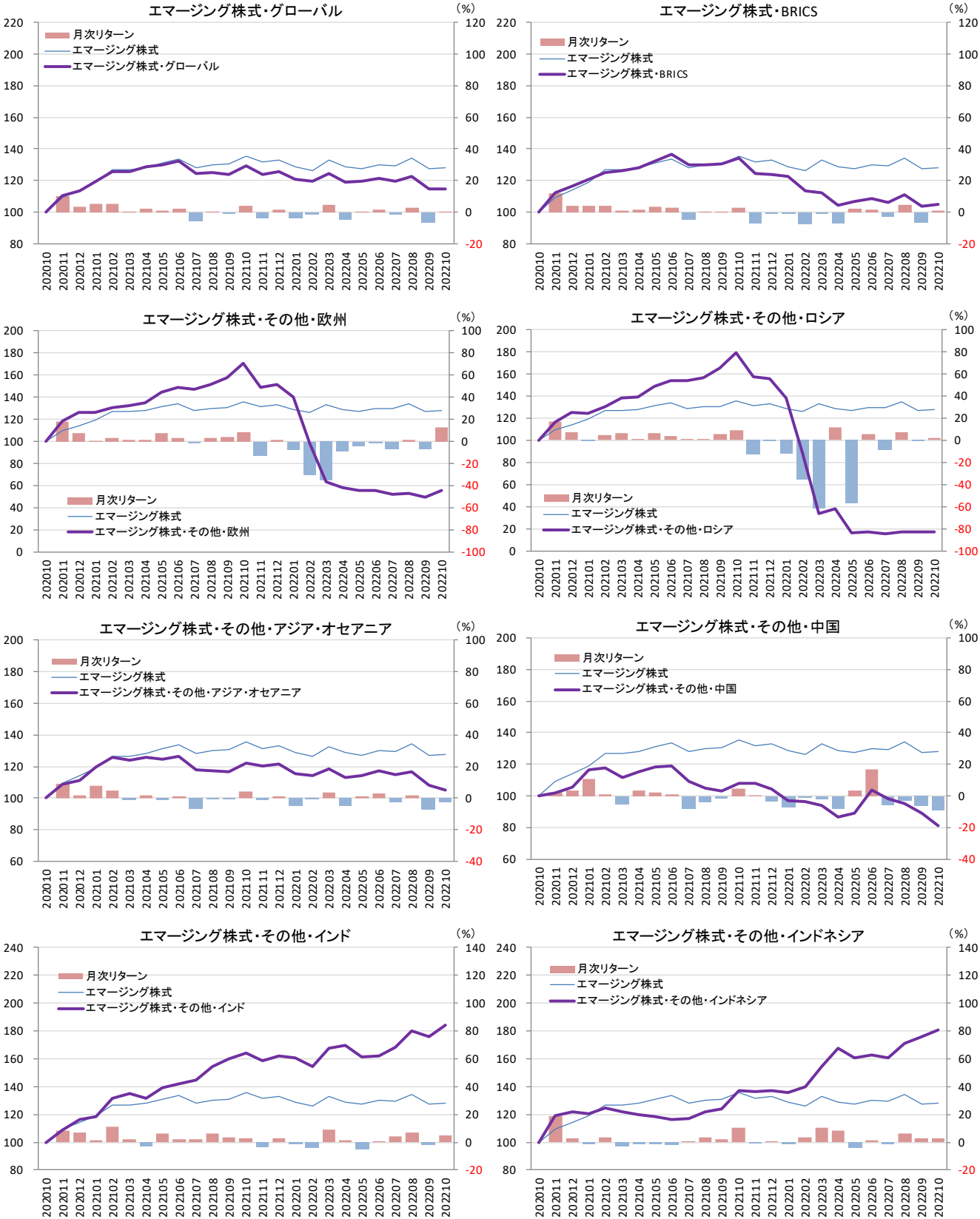


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24 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]

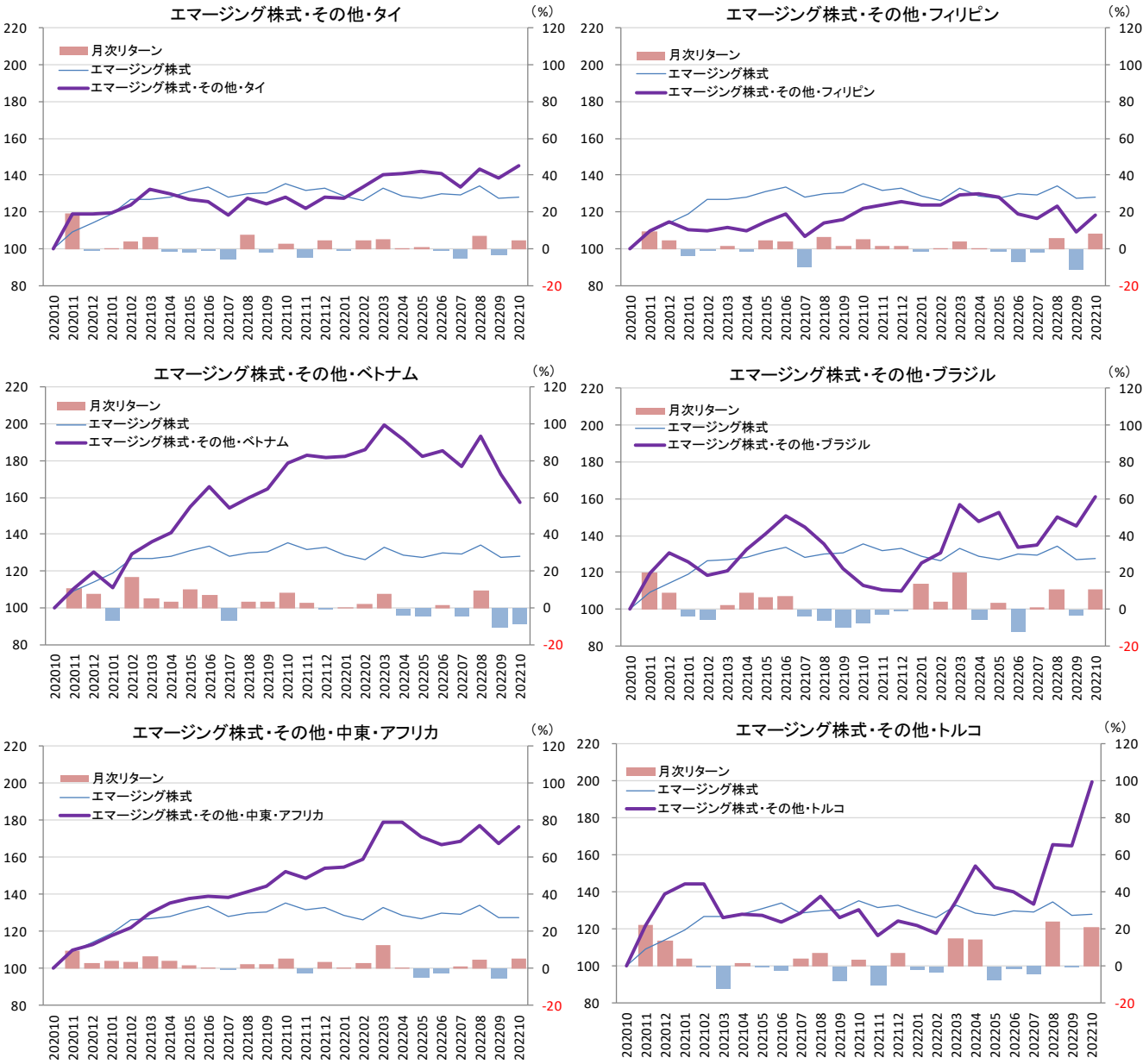


＜1＞パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24 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)]

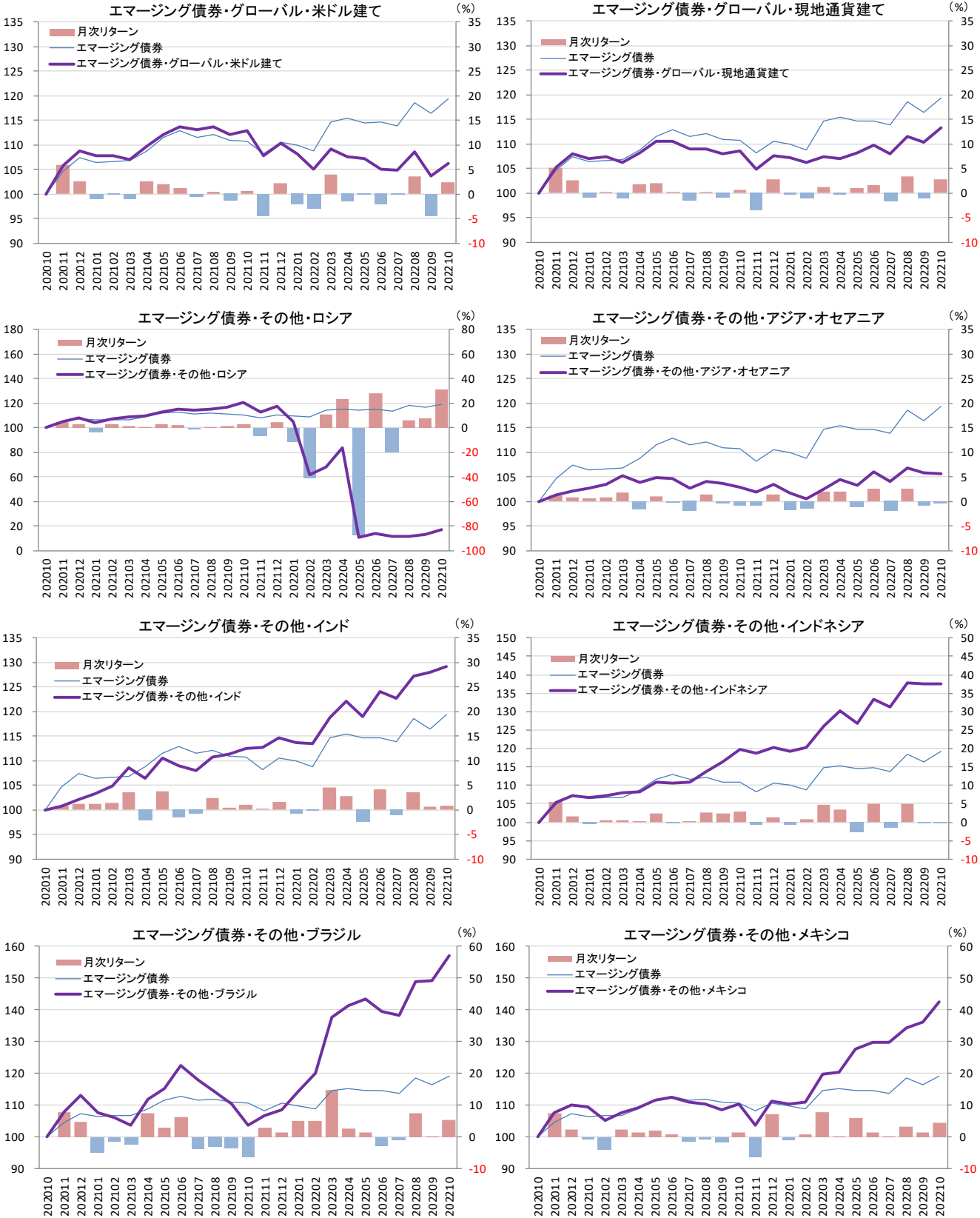


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24 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]

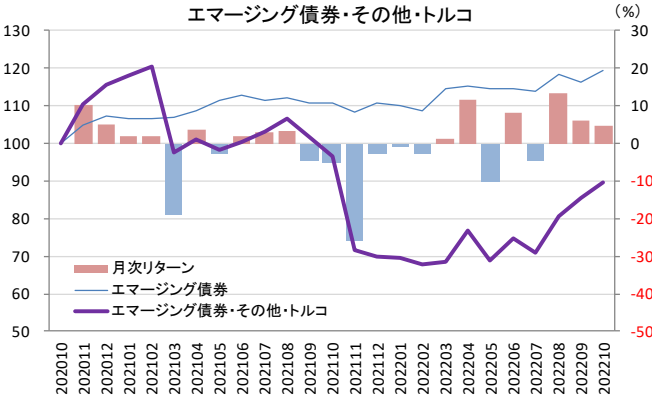


＜1＞パフォーマンス・サマリー

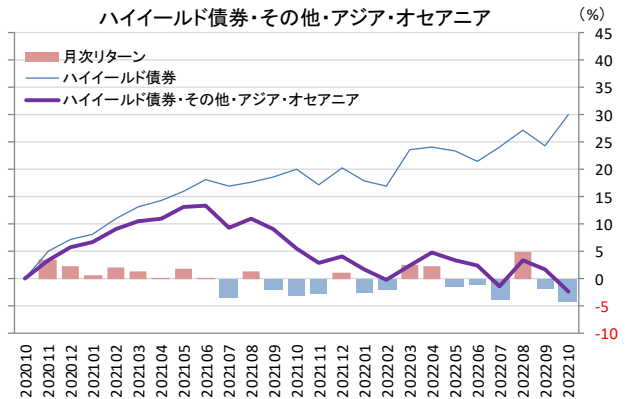
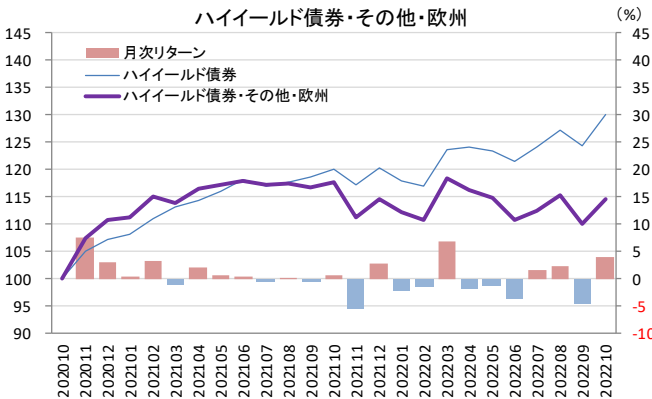
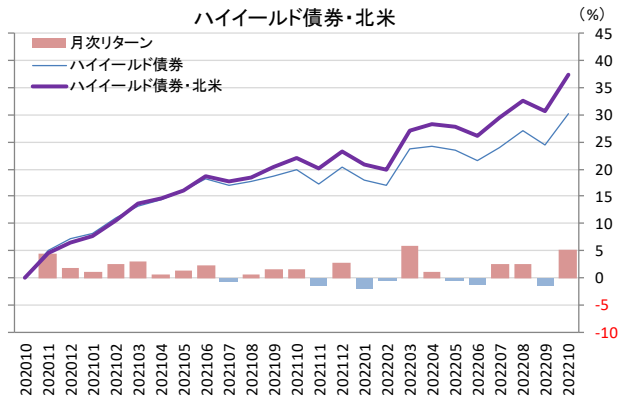
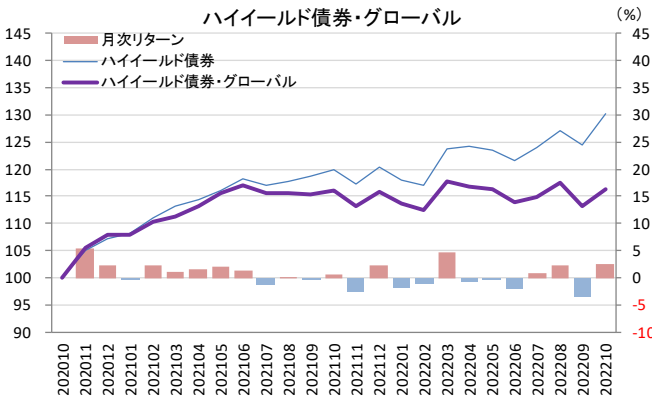
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

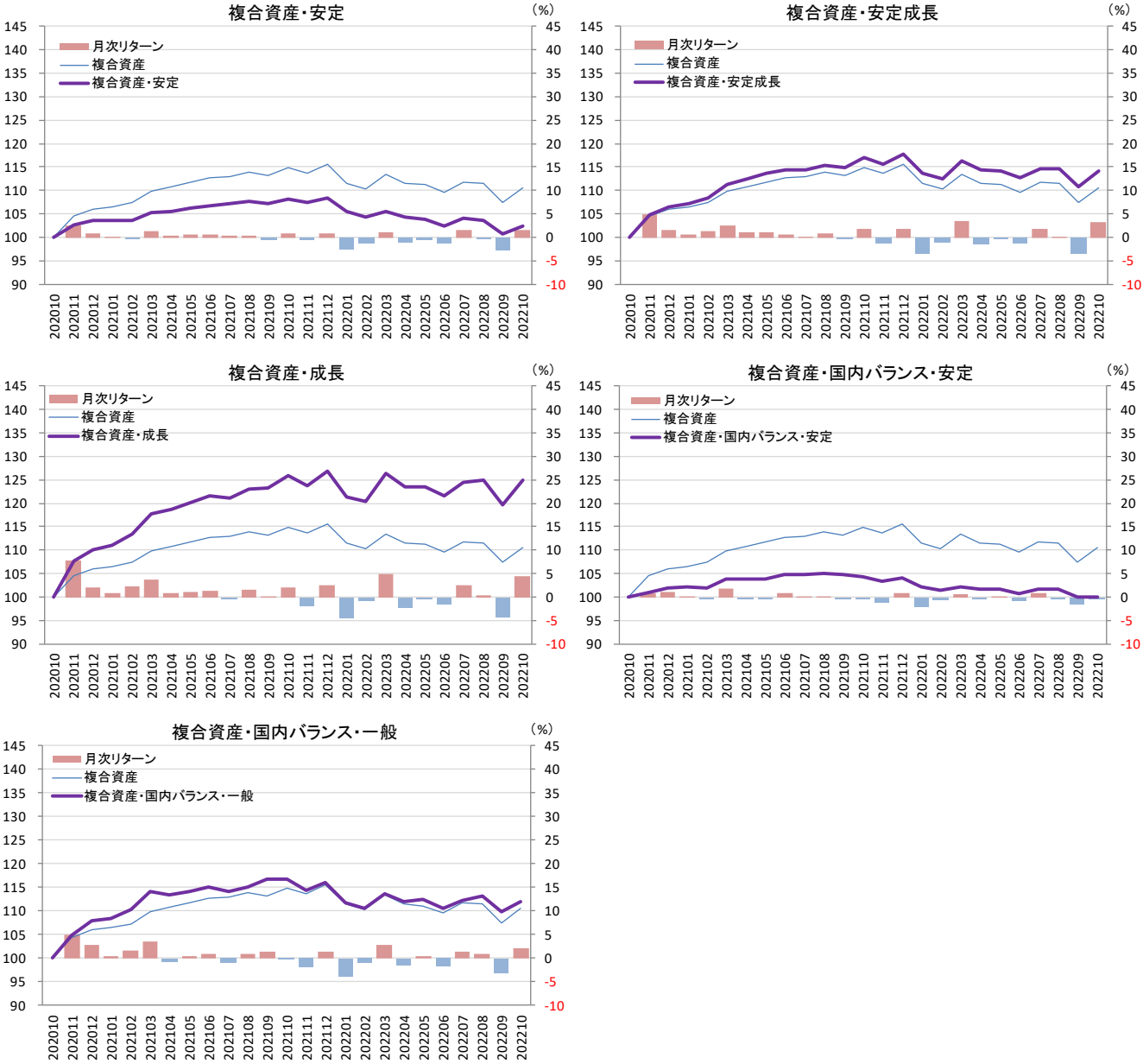


＜1＞パフォーマンス・サマリー

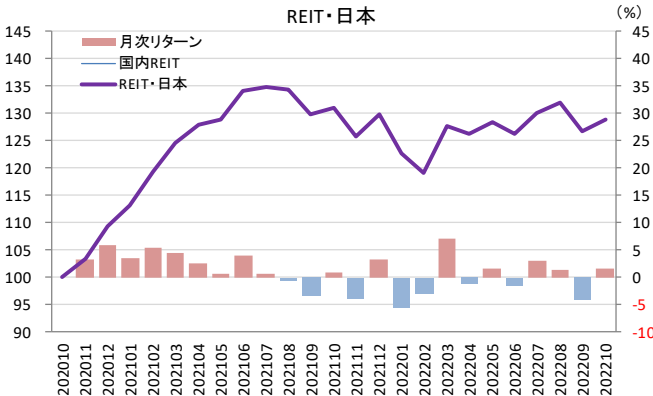
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

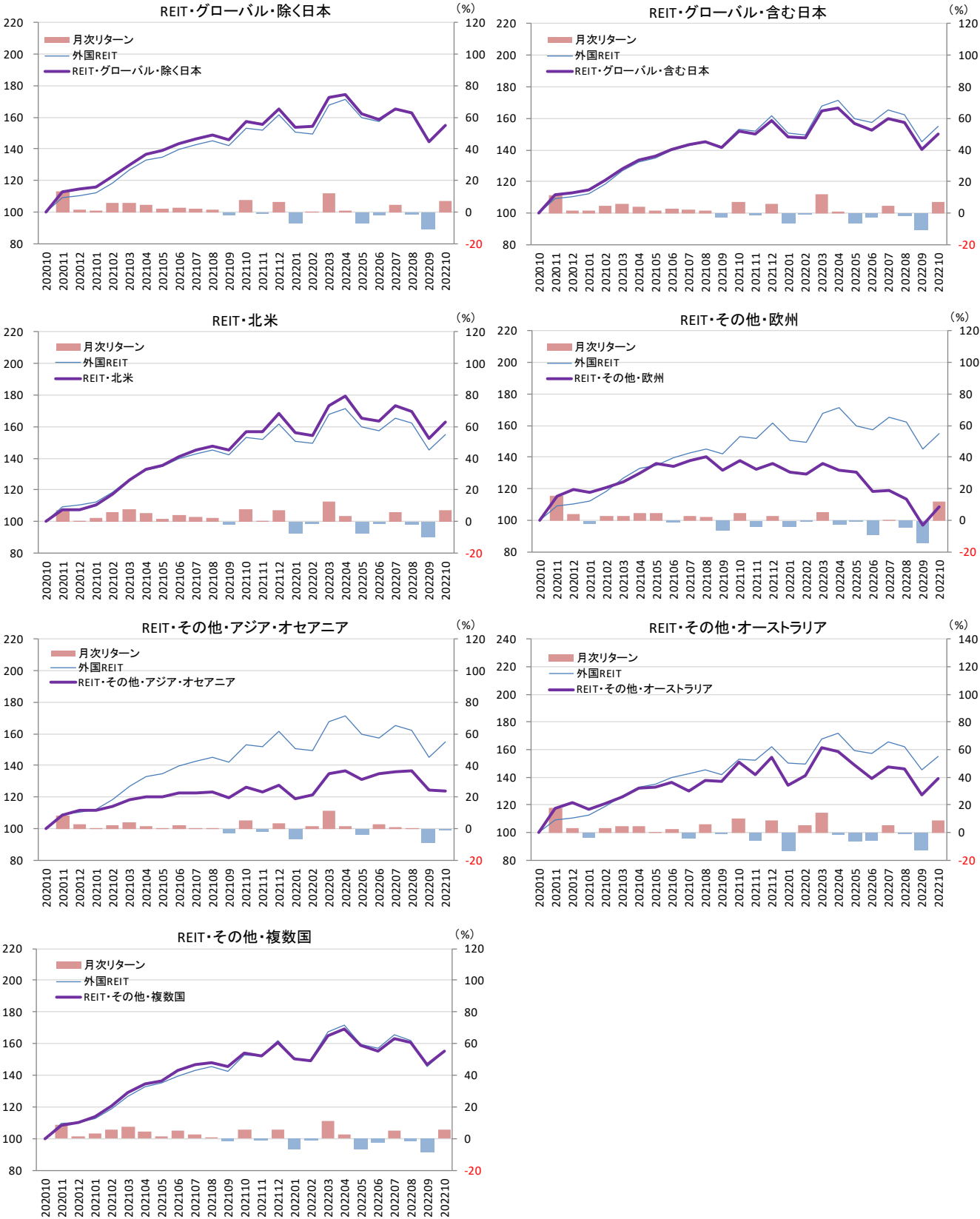


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

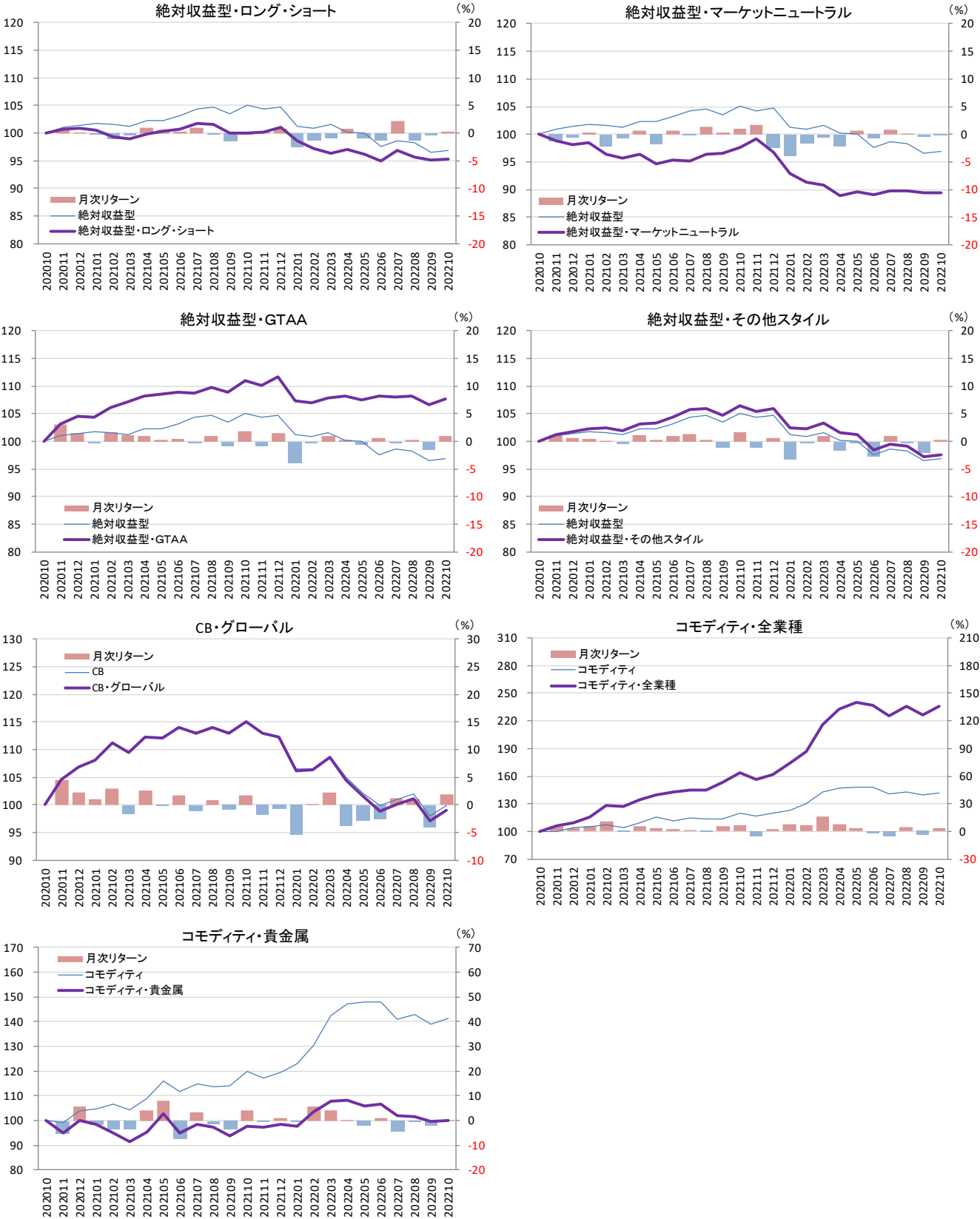


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24 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	4.75				
1	外国株式(先進国)・グローバル	7.24		27.68		1.99
2	外国株式(先進国)・その他	7.91		12.81		1.01
3	国内株式・一般	4.29		6.71		0.28
4	国内株式・その他	5.83		4.70		0.27
5	複合資産・安定成長	3.18		6.68		0.21
6	REIT・北米	6.88		2.73		0.19
7	REIT・グローバル	6.96		2.00		0.14
8	複合資産・成長	4.47		2.76		0.12
9	外国債券(先進国)・グローバル	1.50		7.63		0.12
10	ハイイールド債券・北米	5.23		1.46		0.07
11	複合資産・安定	1.57		4.53		0.07
12	REIT・日本	1.68		3.31		0.05
13	ブルベア	9.71		0.46		0.05
14	国内株式・小型	4.70		0.78		0.04
15	外国債券(先進国)・その他	1.95		1.83		0.04
16	複合資産・その他	7.17		0.33		0.02
17	エマージング債券・グローバル	2.54		0.71		0.02
18	エマージング債券・その他	2.48		0.60		0.01
19	エマージング株式・その他	0.63		2.09		0.01
20	コモディティ	1.63		0.56		0.01
21	ハイイールド債券・グローバル	2.62		0.31		0.01
22	REIT・その他	2.26		0.36		0.01
23	ハイイールド債券・その他	2.45		0.23		0.01
24	国内株式・業種特化	6.33		0.07		0.00
25	CB	1.81		0.21		0.00
26	絶対収益型	0.27		1.37		0.00
27	複合資産・国内バランス	0.13		0.92		0.00
28	エマージング株式・BRICS	1.08		0.06		0.00
29	エマージング株式・グローバル	0.11		1.04		0.00
30	国内債券・一般	-0.18		5.08		-0.01
合計				100.00		4.75

◆計算定義

日次寄与度(%) = 日次リターン(%) × 前日の純資産額構成比

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

<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	-6.02		
1	ハイイールド債券・北米	12.64	1.39	0.16
2	REIT・北米	3.92	2.93	0.13
3	エマージング債券・その他	22.69	0.61	0.11
4	コモディティ	17.92	0.53	0.07
5	外国債券(先進国)・その他	1.25	1.94	0.03
6	複合資産・成長	-0.71	2.53	0.01
7	国内株式・その他	-2.21	4.53	0.01
8	ハイイールド債券・グローバル	0.20	0.31	-0.00
9	国内株式・業種特化	-12.21	0.08	-0.01
10	REIT・グローバル	-1.19	2.24	-0.01
11	ハイイールド債券・その他	-3.59	0.25	-0.01
12	REIT・その他	-3.30	0.41	-0.01
13	エマージング株式・BRICS	-21.74	0.06	-0.02
14	CB	-13.19	0.15	-0.02
15	エマージング債券・グローバル	-3.38	0.73	-0.03
16	複合資産・国内バランス	-3.95	0.99	-0.04
17	外国株式(先進国)・その他	-2.87	11.93	-0.06
18	REIT・日本	-1.64	3.25	-0.06
19	エマージング株式・その他	-2.24	2.21	-0.08
20	絶対収益型	-7.84	1.32	-0.12
21	国内株式・小型	-13.82	0.79	-0.13
22	複合資産・その他	-24.98	0.44	-0.13
23	複合資産・安定成長	-2.39	6.59	-0.14
24	エマージング株式・グローバル	-11.20	1.08	-0.15
25	ブルベア	-34.62	0.50	-0.20
26	国内債券・一般	-4.50	5.03	-0.25
27	複合資産・安定	-5.25	4.56	-0.26
28	外国債券(先進国)・グローバル	-4.62	7.66	-0.39
29	国内株式・一般	-5.98	6.68	-0.40
30	外国株式(先進国)・グローバル	-12.84	28.28	-4.02
	合計		100.00	-6.02

◆計算定義

日次寄与度 (%) = 日次リターン (%) × 前日の純資産額構成比

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

<2> リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別①

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	18.75	22.84	100.22	12.94	11.62	11.11	0.46	0.37	0.65
国内株式	23.46	20.27	213.14	15.86	15.85	16.50	0.46	0.24	0.73
一般	22.75	16.87	198.49	15.36	15.67	16.70	0.46	0.20	0.69
フリー	22.36	16.61	199.23	15.73	16.02	17.29	0.44	0.20	0.67
バリュー	23.37	17.00	201.74	14.73 ↓	14.89	15.40	0.49	0.22	0.76
小型	20.88	18.97	296.37	20.58	19.48	18.37	0.32	0.18	0.80
その他	24.33	27.64	231.37	16.18	15.73	16.21	0.47	0.32	0.79
日経225	25.46	34.67	249.50	17.65	16.78	16.81	0.45	0.37	0.79
TOPIX	23.38	21.23	213.01	15.08	14.92	15.75	0.48	0.27	0.77
JPX日経400	22.98	21.69	-	15.48	15.09	-	0.46	0.27	-
国内債券	-5.73	-3.06	4.45	1.79	1.79	1.75	-1.07	-0.32	0.25
一般	-5.73	-3.06	4.45	1.79	1.79	1.75	-1.07	-0.32	0.25
外国株式(先進国)	42.49	50.37	184.84	19.26	17.92	16.18	0.65	0.48	0.68
グローバル	39.44	46.69	191.70	19.37	18.05	16.19	0.61	0.44	0.70
除く日本	57.24	69.52	277.69	19.02	17.85	16.80	0.86	0.63	0.85
含む日本	33.93	39.95	170.16	19.88	18.39	16.24	0.52	0.38	0.64
その他	49.47	59.44	171.72	19.46	17.90	16.38	0.74	0.55	0.64
北米	99.16	106.67	248.62	19.77	19.23	17.59	1.31	0.81	0.76
米国	57.35	76.84	209.36	18.72	17.66	16.63	0.87	0.69	0.72
カナダ	34.47	29.50	52.08	21.36	18.74	16.16	0.49	0.29	0.27
欧州	24.41	21.40	136.72	20.00	18.20	16.76	0.38	0.22	0.54
ドイツ	19.80	4.60	-	25.10	22.69	-	0.25	0.04	-
イギリス	22.03	10.69	-	19.19	17.75	-	0.36	0.12	-
アジア・オセアニア	8.19	11.22	126.89	15.45	14.84	15.54	0.17	0.15	0.55
オーストラリア	24.81	21.92	97.69	28.42	23.77	20.30	0.27	0.17	0.35
ニュージーランド	34.26	55.02	294.65	20.44	18.22	18.38	0.51	0.51	0.80
複合地域	95.78	55.36	-	39.41	33.48	-	0.64	0.28	-
エマージング株式	24.70	20.12	106.10	19.89	18.04	17.22	0.39	0.21	0.44
グローバル	20.58	20.06	81.84	18.64 ↓	17.92	17.23	0.35	0.21	0.36
BRICS	-2.71	3.41	84.15	22.84	20.79	19.90	-0.04	0.03	0.32
その他	28.40	21.77	119.82	20.57	18.47	17.45	0.42	0.22	0.47
欧州	-60.14	-58.01	-42.88	39.10	32.54	27.34	-0.67	-0.49	-0.20
ロシア	-86.14	-82.93	-75.95	59.76	48.03	38.48 ↑	-0.81	-0.62	-0.35
アジア・オセアニア	8.95	1.45	82.58	17.91 ↓	17.34	16.52	0.16	0.02	0.38
中国	9.97	9.93	175.63	21.50 ↑	21.12 ↑	22.07	0.15	0.09	0.48
インド	63.43	53.19	255.44	25.67	23.33	23.13	0.69	0.38	0.58
インドネシア	30.06	26.08	63.39	30.52	26.58	24.47	0.30	0.18	0.21
タイ	2.72	-3.18	47.47	24.76	21.42	18.88	0.04	-0.03	0.21
フィリピン	-10.33	-18.60	41.37	23.82	20.74 ↑	19.97	-0.15	-0.19	0.18
ベトナム	37.21	42.70	205.55	30.26	26.76	22.22	0.37	0.28	0.53
韓国	26.46	-8.44	39.55	27.32	24.21 ↑	19.98	0.30	-0.07	0.17
香港	-19.76	-24.32	23.32	21.43 ↑	20.37 ↑	19.39	-0.33	-0.26	0.11
中南米	29.66	33.00	51.44	34.46	30.68	26.50	0.26	0.19	0.16
ブラジル	-1.18	7.38	6.89	37.53	34.76	31.94	-0.01	0.04	0.02
メキシコ	47.00	33.01	-	31.35	28.51	-	0.44	0.21	-
中東・アフリカ	61.00	53.52	148.10	20.16	18.25	16.94	0.85	0.49	0.56
トルコ	52.14	-6.88	-2.57	35.28 ↑	36.74 ↑	31.94	0.43	-0.04	-0.01
複合地域	10.12	1.35	64.90	18.37	17.32	15.98	0.18	0.02	0.32

※[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	18.75	22.84	100.22	12.94	11.62	11.11	0.46	0.37	0.65
外国債券(先進国)	3.60	3.43	30.67	5.11 ↑	4.51	6.25	0.24	0.16	0.43
グローバル	1.43	2.32	32.34	4.34 ↑	3.83	5.69	0.12	0.13	0.50
除く日本	4.79	5.89	38.00	4.27 ↑	3.99	6.23	0.38	0.30	0.53
含む日本	-1.77	-1.09	26.87	5.11 ↑	4.23	5.34	-0.11	-0.04	0.45
その他	11.94	8.75	32.55	8.37	7.42	8.21	0.46	0.23	0.35
北米	-0.27	0.37	-	5.91 ↑	4.74 ↑	-	-0.01	0.02	-
米国	11.51	14.01	57.10	8.41	6.96	6.80	0.44	0.39	0.68
カナダ	23.75	19.78	36.18	7.39	7.23	8.71	1.00	0.51	0.36
欧州	-10.12	-11.19	26.16	6.23 ↑	5.51 ↑	7.81	-0.56	-0.42	0.30
イギリス	6.53	2.36	-	10.03 ↑	9.20 ↑	-	0.22	0.06	-
アジア・オセアニア	14.28	8.17	30.93	10.72	9.58	9.79	0.43	0.17	0.28
オーストラリア	14.50	7.91	29.70	10.77	9.62	9.78	0.43	0.16	0.27
ニュージーランド	4.57	4.62	-	9.74	8.98	-	0.16	0.11	-
複合地域	12.88	15.67	40.71	6.41 ↑	5.68	7.84	0.65	0.53	0.44
エマージング債券	6.17	3.06	33.71	11.50	10.84	11.51	0.18	0.06	0.26
グローバル	-2.72	-6.88	19.88	13.60	12.34	11.99	-0.07	-0.11	0.15
米ドル建て	-4.50	-8.99	19.23	14.48	12.90	12.37	-0.10	-0.14	0.14
現地通貨建て	2.69	1.09	21.40	10.83 ↓	10.95	11.10	0.08	0.02	0.18
その他	18.41	16.34	52.57	10.50 ↓	10.28	12.13	0.55	0.30	0.36
ロシア	-86.18	-85.55	-82.75	66.96 ↑	52.57 ↑	40.99 ↑	-0.72	-0.61	-0.39
アジア・オセアニア	5.92	8.01	51.06	7.66	6.54	7.66	0.26	0.24	0.55
インド	28.40	26.02	112.35	8.68 ↓	8.85	11.74	1.00	0.54	0.67
インドネシア	33.74	34.85	55.43	15.13	14.29	15.56	0.67	0.43	0.29
ブラジル	7.17	3.64	43.00	19.20	19.25	18.68	0.12	0.04	0.20
メキシコ	33.69	50.37	66.85	18.07	16.61	15.94	0.56	0.51	0.33
トルコ	-35.94	-51.66	-59.95	27.36	34.30	27.02	-0.50	-0.39	-0.32
複合地域	-4.48	3.62	11.20	13.42	12.04	12.76	-0.11	0.06	0.08
ハイイールド債券	19.59	17.27	83.26	13.03	11.31	11.08	0.47	0.29	0.56
グローバル	6.66	3.41	56.59	12.98	11.31	11.19	0.17	0.06	0.41
北米	27.34	26.45	102.87	12.80	11.20	10.99	0.66	0.43	0.67
その他	-0.54	-5.29	45.08	14.77	12.74	12.14	-0.01	-0.08	0.31
欧州	1.18	-4.30	52.73	15.78	13.69	13.06	0.03	-0.06	0.33
アジア・オセアニア	-8.55	-11.02	35.61	13.40	11.31	10.76	-0.22	-0.20	0.29
複合地域	18.60	18.10	93.04	9.96	8.73	9.65	0.59	0.39	0.71
複合資産	7.58	11.30	78.28	7.77	7.05	7.99	0.32	0.31	0.75
安定	1.24	3.17	52.98	5.26 ↑	4.83	6.32	0.08	0.14	0.69
安定成長	11.12	15.48	86.11	8.29	7.58	8.37	0.44	0.39	0.77
成長	23.62	27.13	142.68	11.25	10.83	11.05	0.65	0.46	0.84
国内バランス	-7.40	-1.63	32.39	4.33	3.85	5.84	-0.58	-0.07	0.49
安定	-8.29	-2.10	24.29	4.19	3.65	3.32	-0.67	-0.11	0.66
一般	9.88	11.40	70.91	8.42	8.26	9.45	0.38	0.27	0.58

※[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	18.75	22.84	100.22	12.94	11.62	11.11	0.46	0.37	0.65
国内REIT	-1.95	41.73	160.23	17.81	14.73	16.45	-0.04	0.49	0.61
日本	-1.95	41.73	160.23	17.81	14.73	16.45	-0.04	0.49	0.61
外国REIT	20.93	40.80	165.55	21.71 ↑	18.58 ↑	16.58	0.30	0.38	0.62
グローバル	14.60	31.45	130.94	22.68 ↑	19.23 ↑	16.83	0.21	0.29	0.52
除く日本	18.40	38.78	157.97	23.44 ↑	19.79 ↑	17.12	0.25	0.34	0.58
含む日本	13.35	29.43	126.22	22.43 ↑	19.05 ↑	16.74	0.19	0.28	0.51
北米	28.67	52.21	201.38	21.16 ↑	18.51 ↑	16.82	0.42	0.48	0.69
その他	5.54	22.06	137.70	22.88	18.96	16.43	0.08	0.22	0.55
欧州	-17.03	-15.81	56.05	24.23 ↑	20.77 ↑	18.88	-0.25	-0.16	0.24
アジア・オセアニア	4.77	23.45	124.56	20.73	17.53	15.84	0.08	0.25	0.53
オーストラリア	6.60	17.65	94.88	36.11	28.94	23.17	0.06	0.12	0.30
複合地域	-0.10	-0.31	68.33	29.81	25.08	20.85	-0.00	-0.00	0.26
複数国	21.31	55.73	230.15	20.10 ↑	17.12 ↑	15.52	0.33	0.54	0.82
その他									
絶対収益型	-3.11	-6.15	1.53	3.72	3.17	2.97	-0.27	-0.38	0.05
ロング・ショート	-8.55	-10.43	-9.77	3.39	3.50	3.14	-0.86	-0.61	-0.32
マーケットニュートラル	-3.26	-8.21	33.04	4.85	4.33	5.74	-0.22	-0.38	0.50
GTAA	8.71	9.72	21.72	5.15	4.40	3.51	0.55	0.43	0.57
その他スタイル	-3.14	-6.15	6.33	4.00	3.37	3.81	-0.26	-0.36	0.16
CB	4.96	2.98	39.67	10.45	8.73	8.00	0.16	0.07	0.42
アジア・オセアニア	34.18	32.00	127.17	13.62	12.29	11.89	0.76	0.47	0.72
日本	-2.79	-5.85	42.07	5.23	5.16	6.28	-0.17	-0.22	0.57
グローバル	4.46	2.65	37.77	10.77	8.96	8.06	0.14	0.06	0.40
コモディティ	47.07	50.26	16.82	13.32	11.30	12.70	1.03	0.75	0.12
全業種	93.62	81.32	45.48	22.35	18.94	17.12	1.10	0.67	0.22
貴金属	20.83	31.62	6.11	13.42	11.97	13.08	0.49	0.48	0.05
エネルギー	130.07	137.43	49.99	42.11	36.54	31.39	0.76	0.52	0.13
その他コモディティ	67.03	56.36	43.31	22.04	18.93	17.07	0.85	0.50	0.21

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

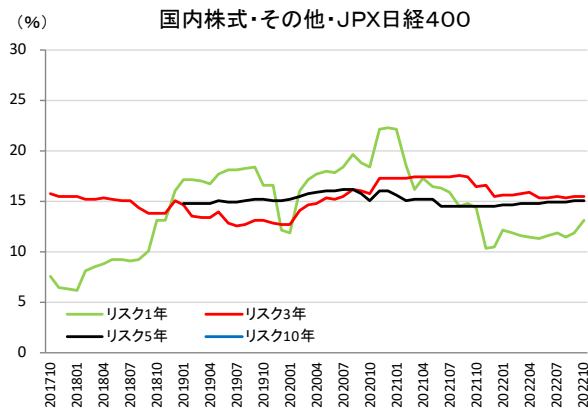
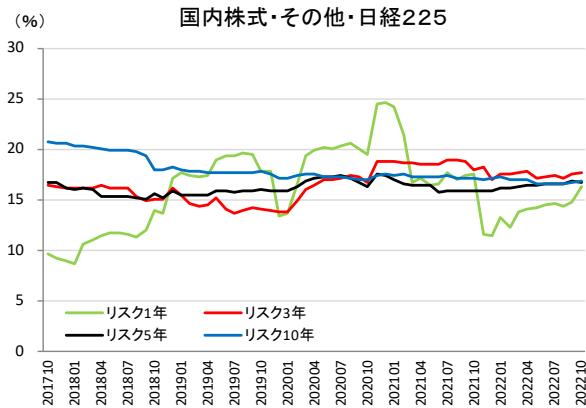
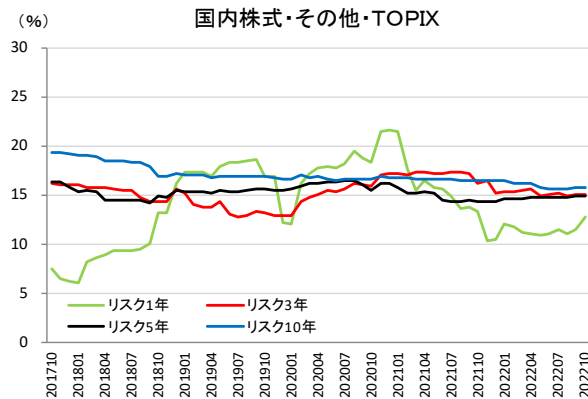
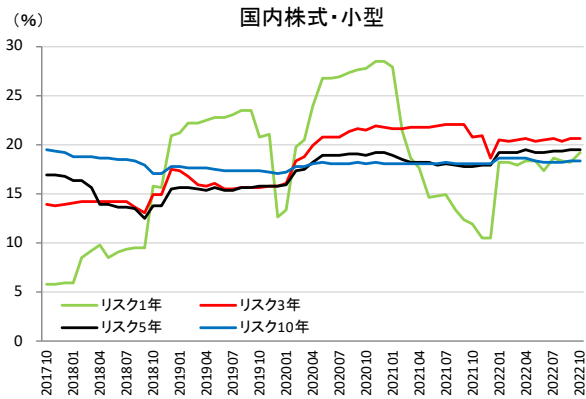
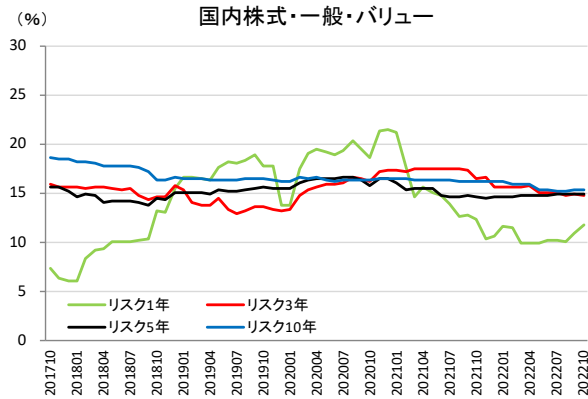
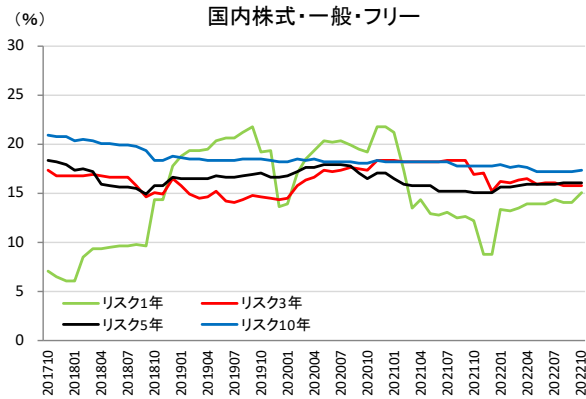
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

＜2＞リスク・サマリー

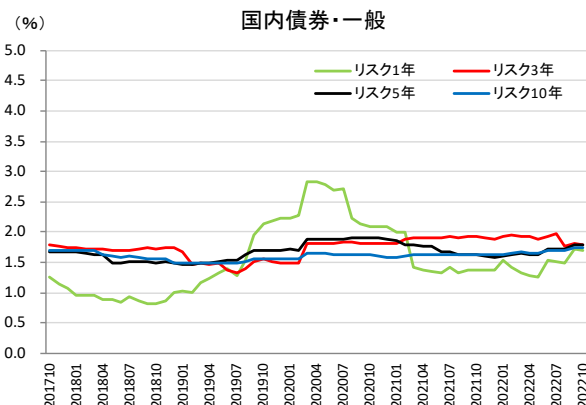
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

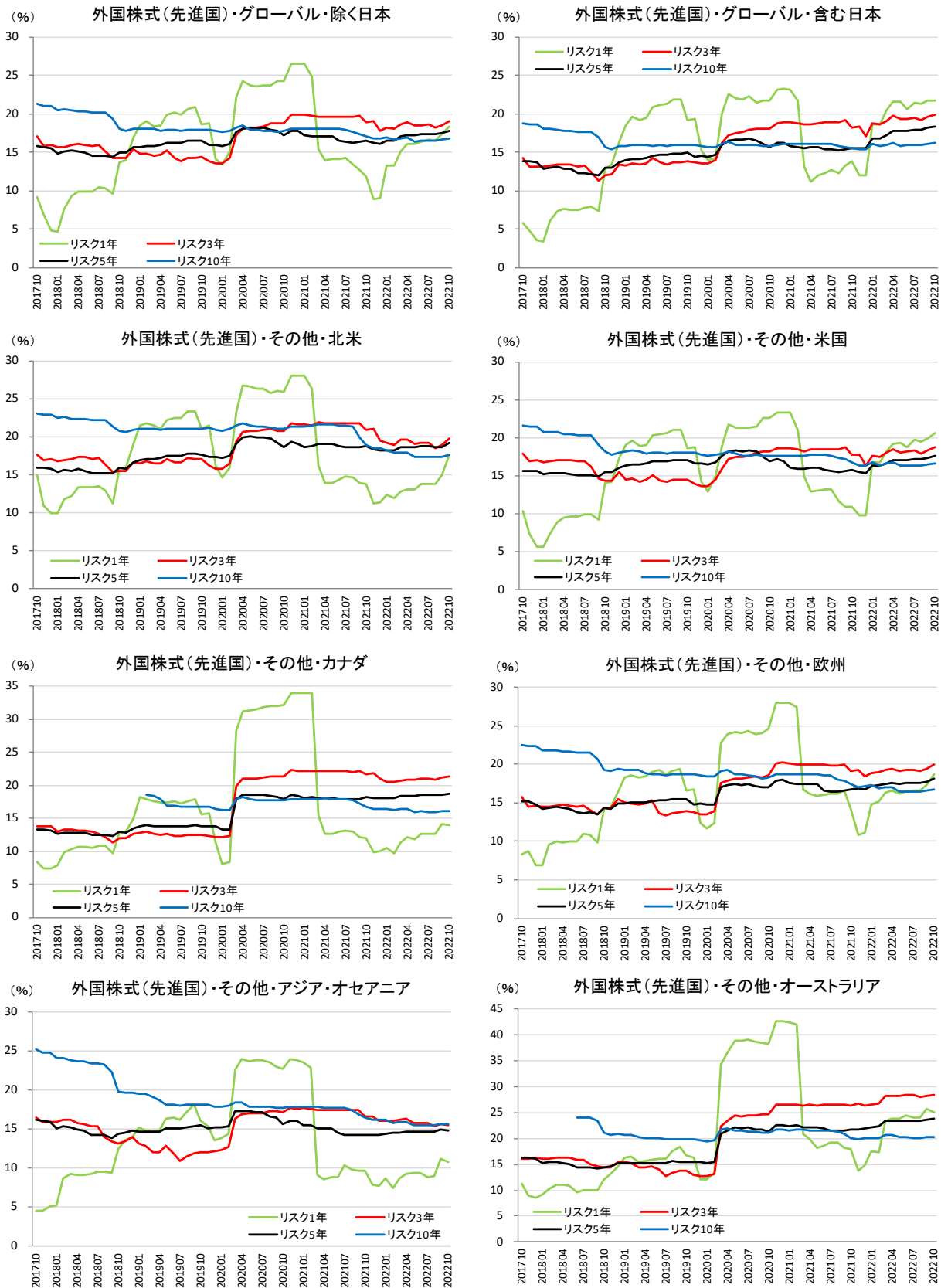


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

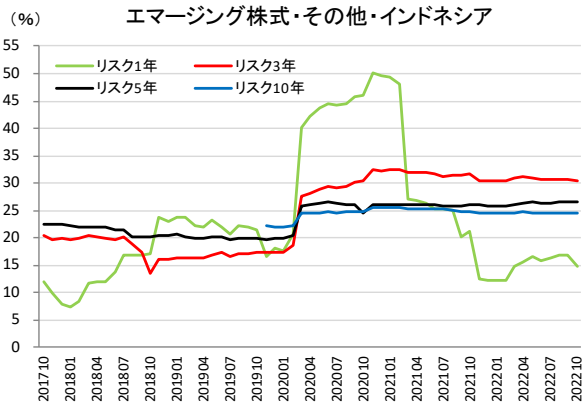
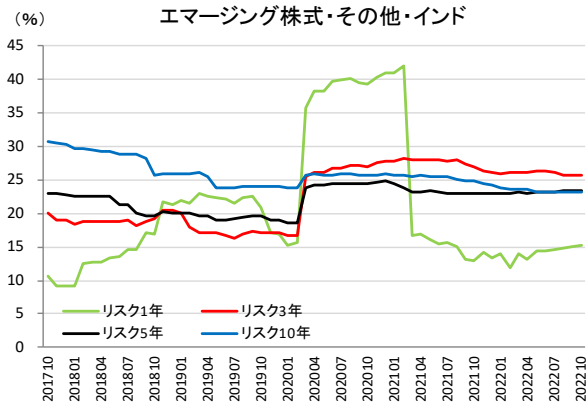
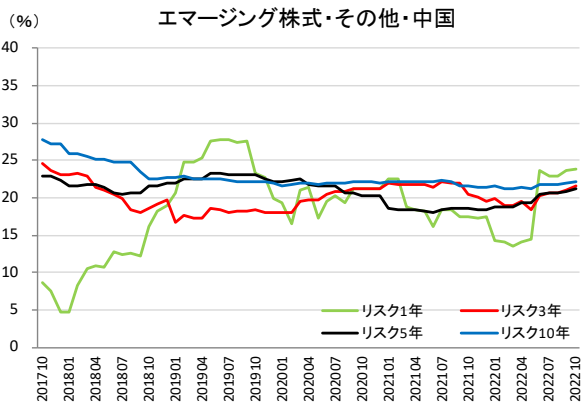
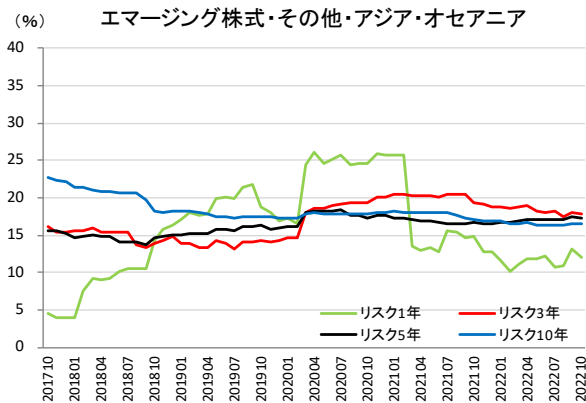
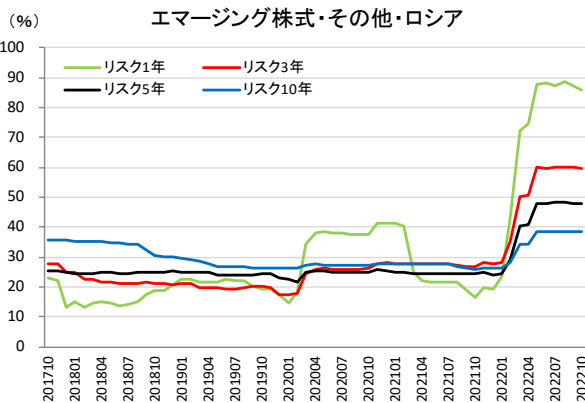
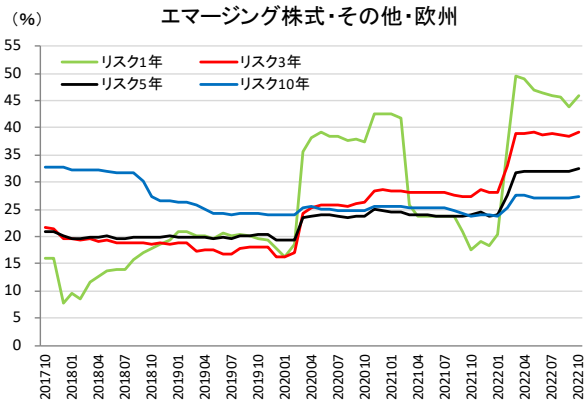
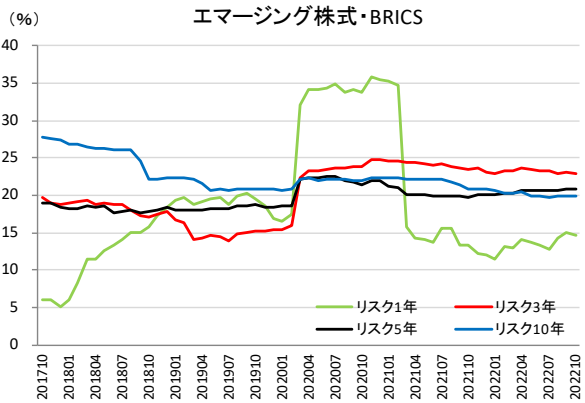
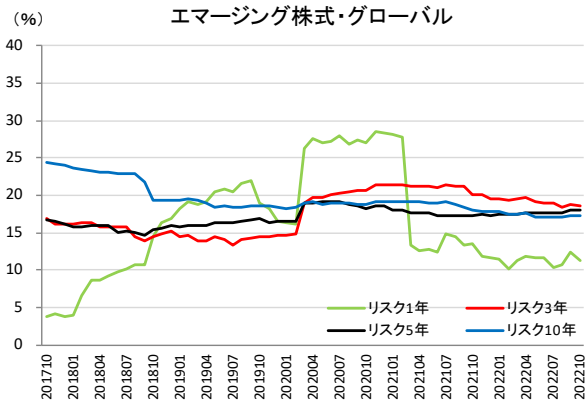


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

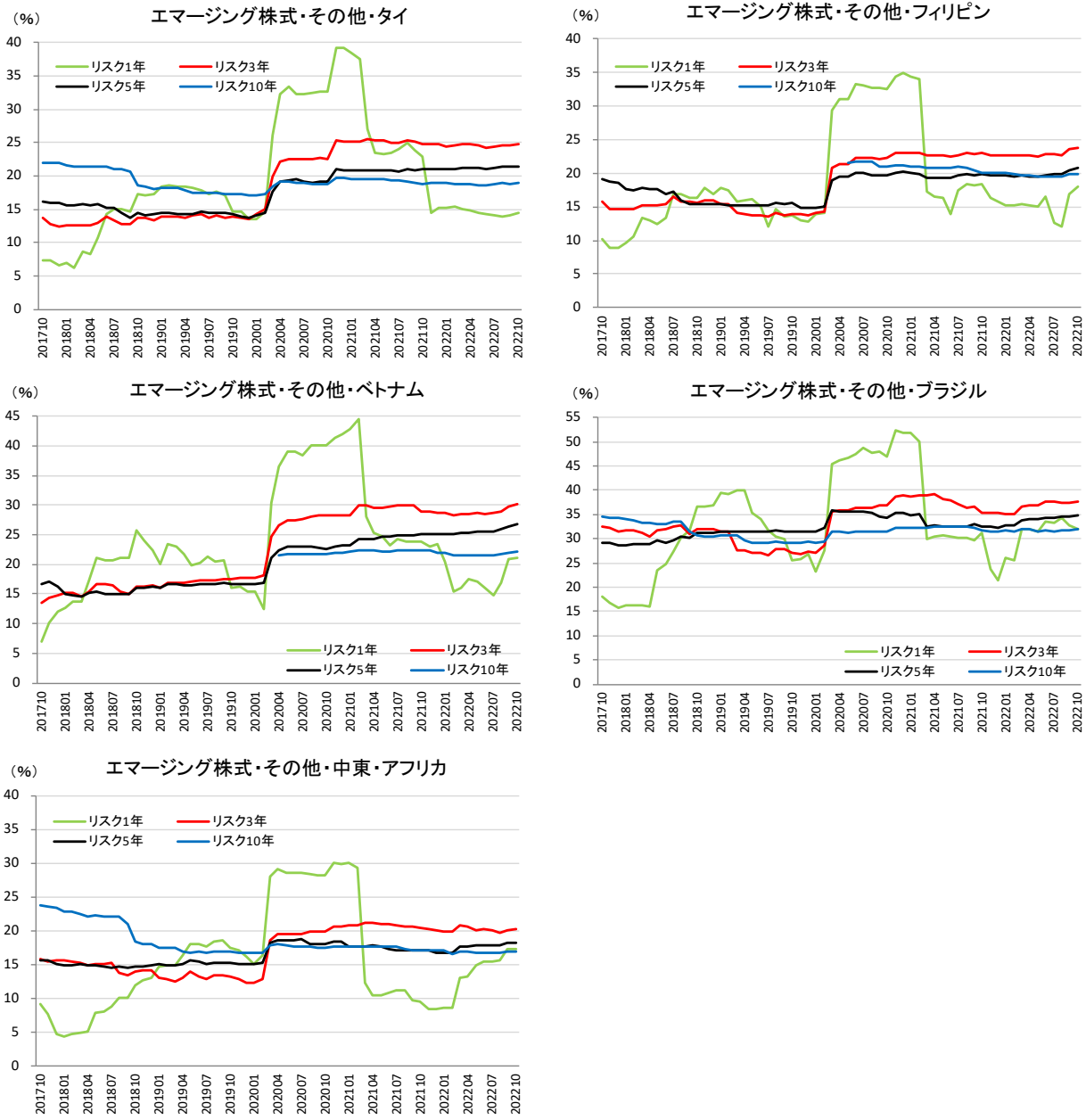


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

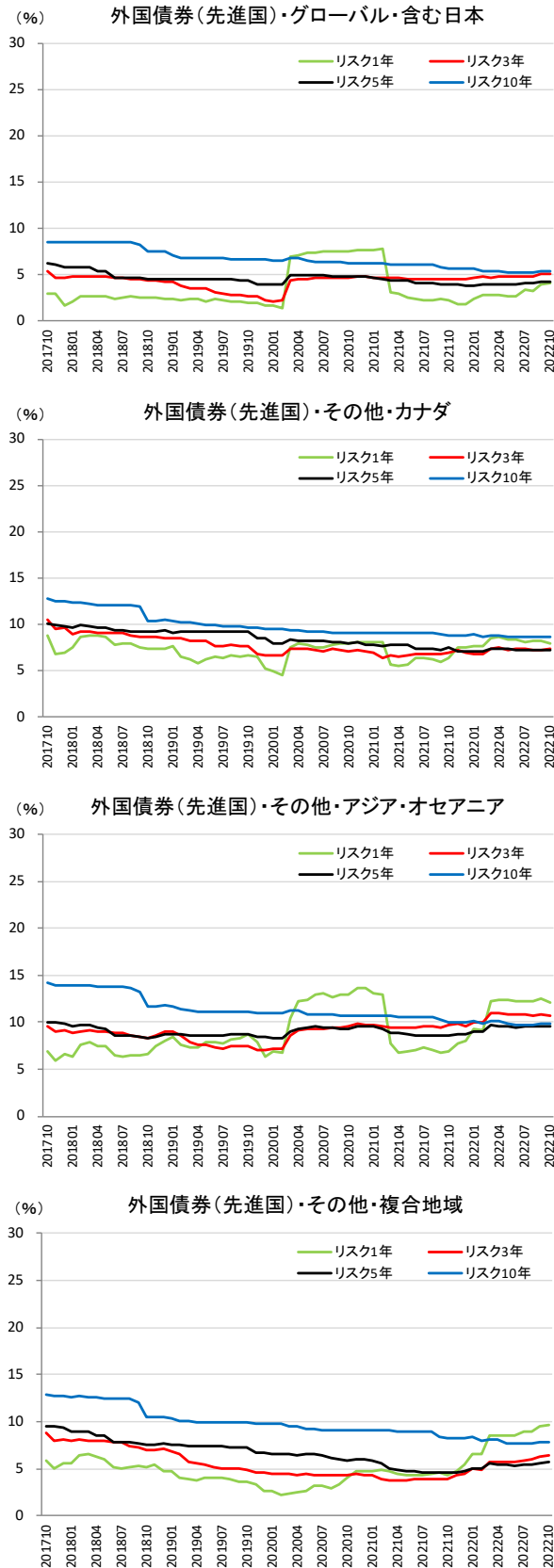
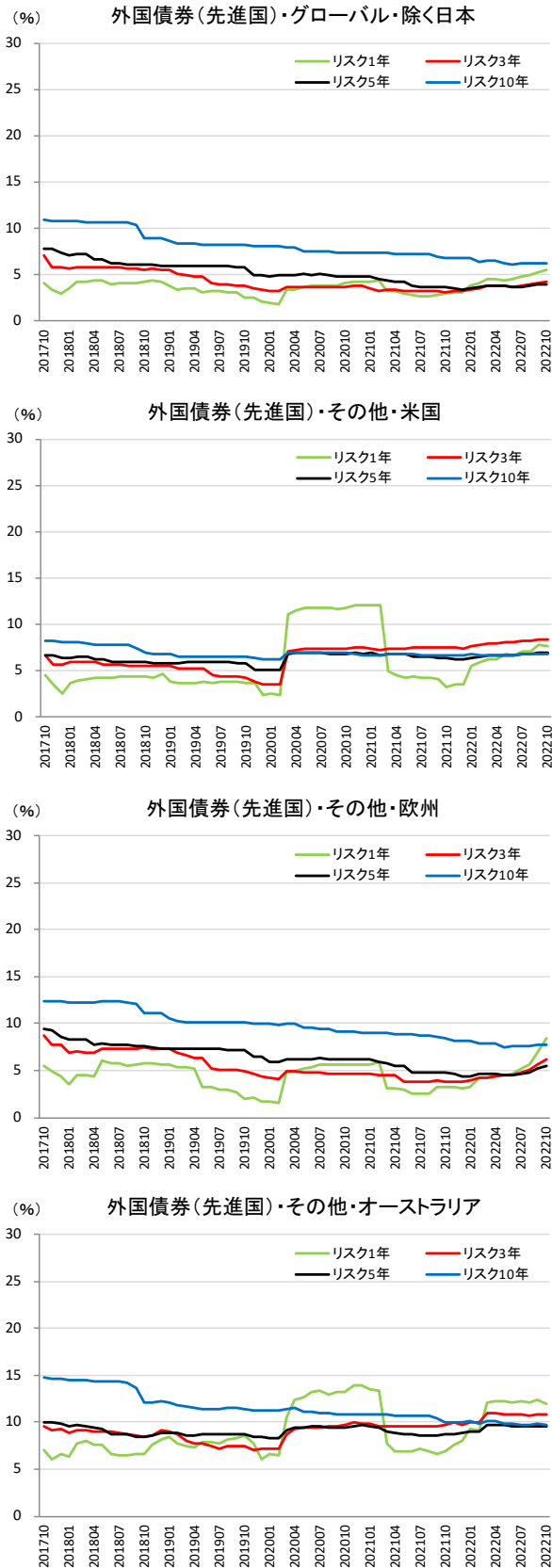


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

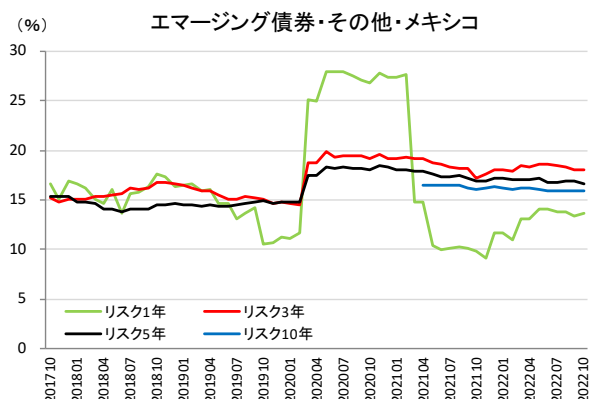
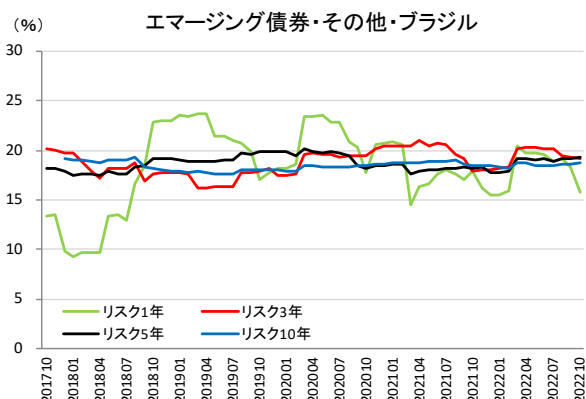
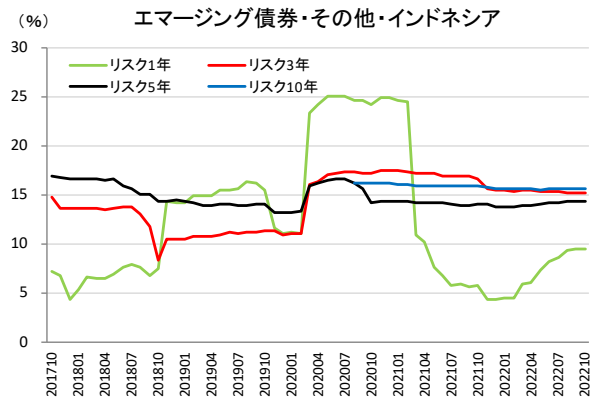
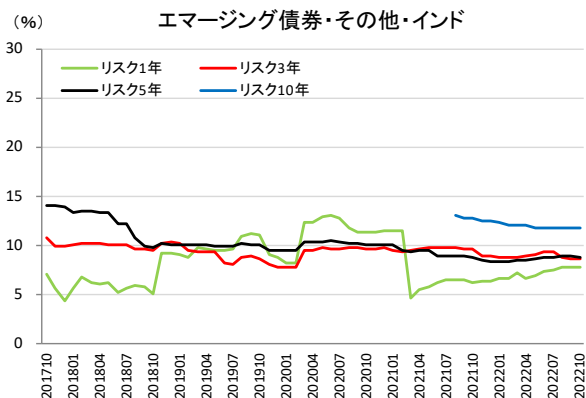
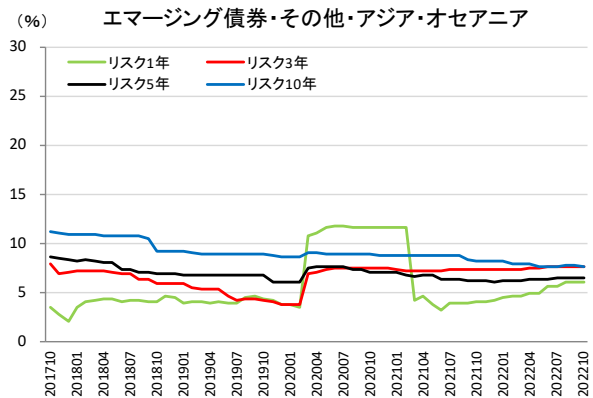
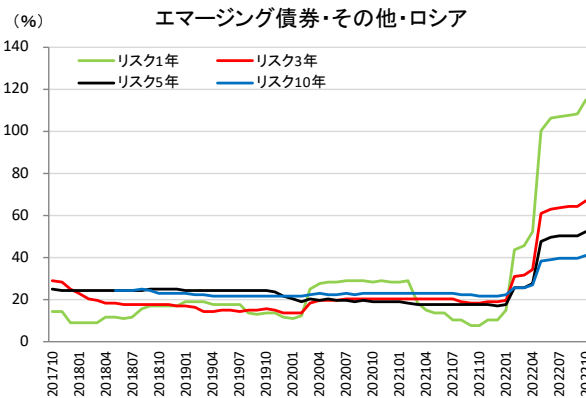
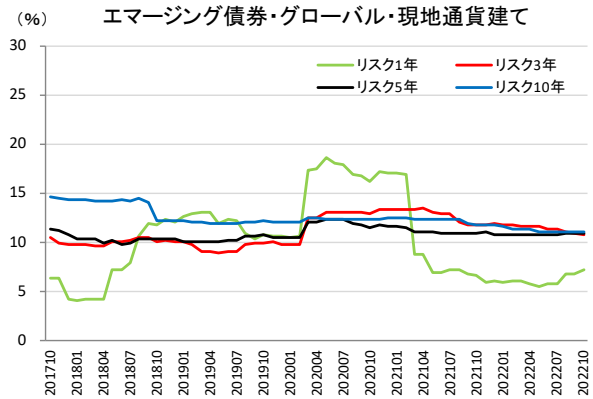
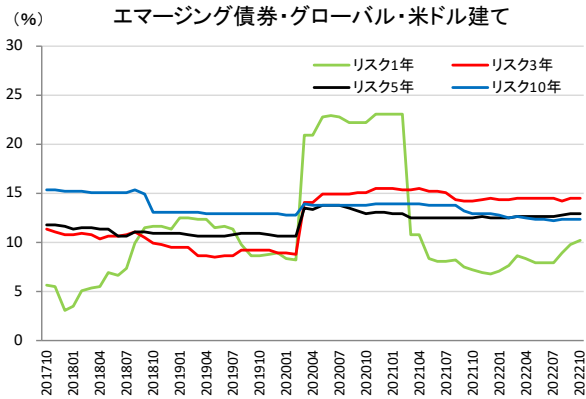


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

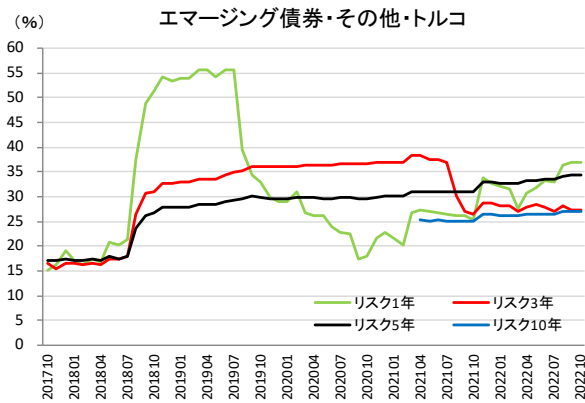


<2> リスク・サマリー

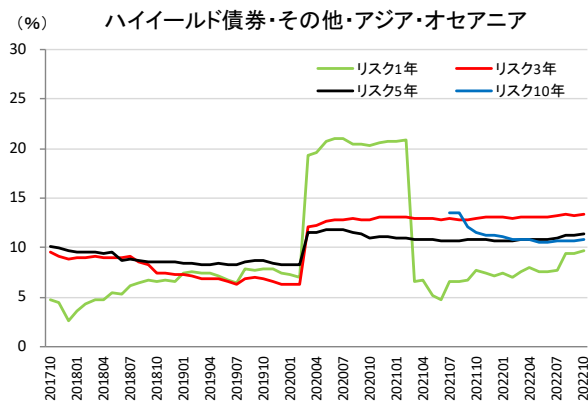
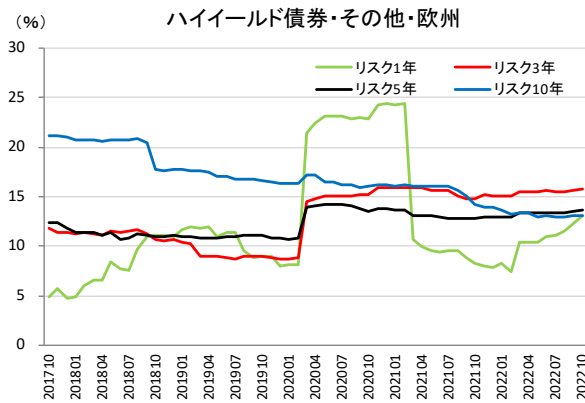
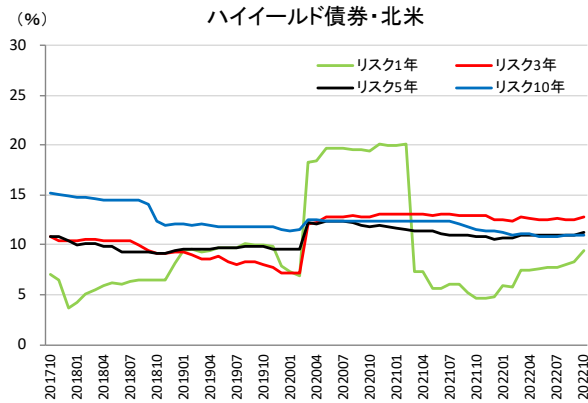
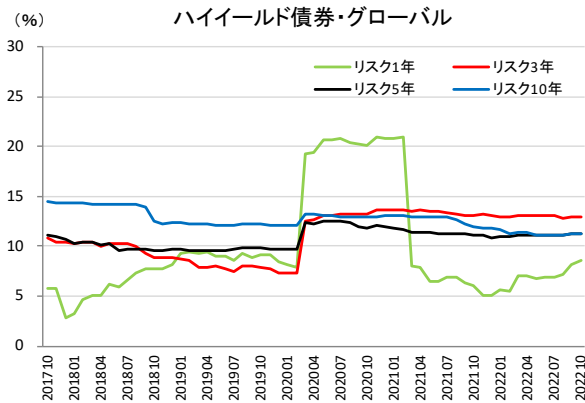
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

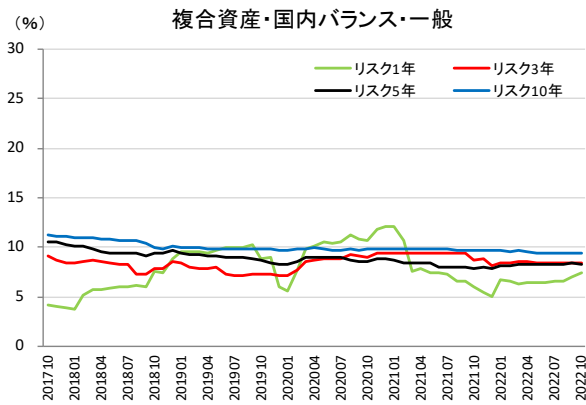
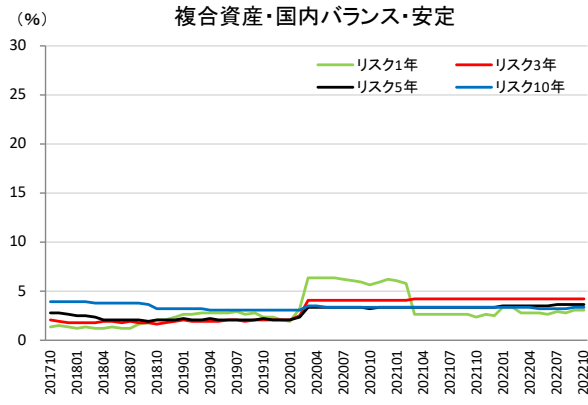
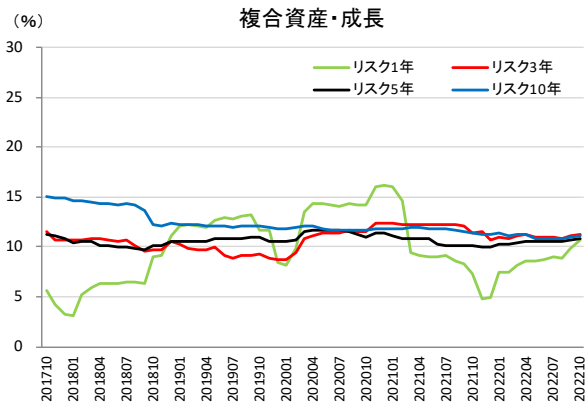
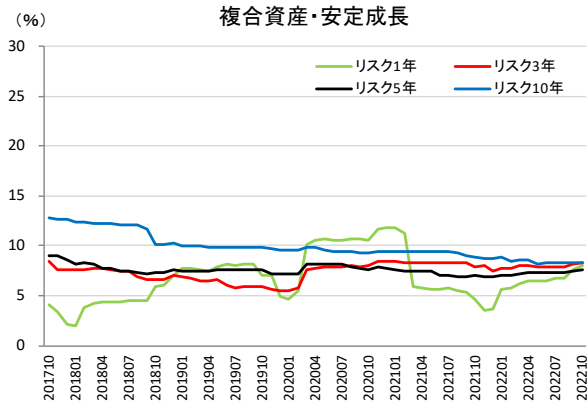
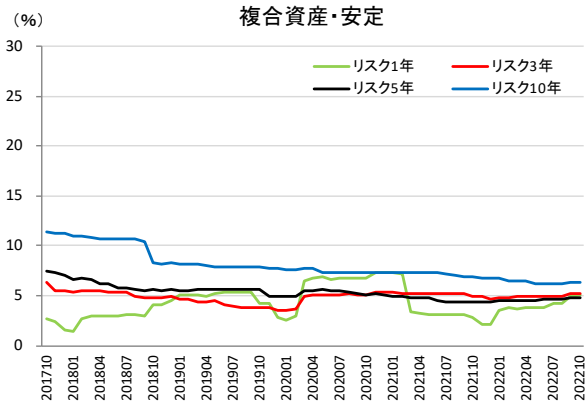


＜2＞リスク・サマリー

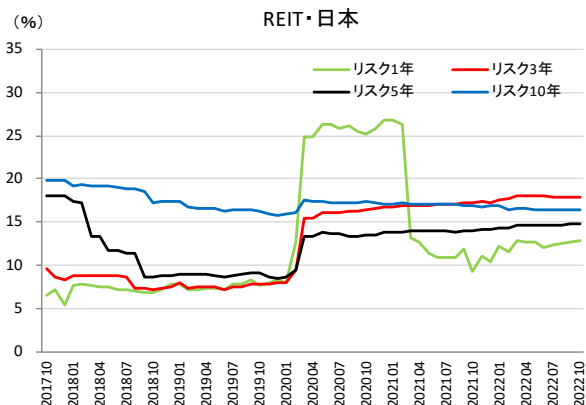
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]



＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

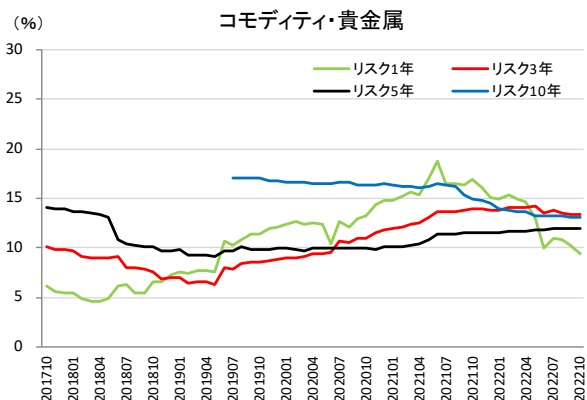
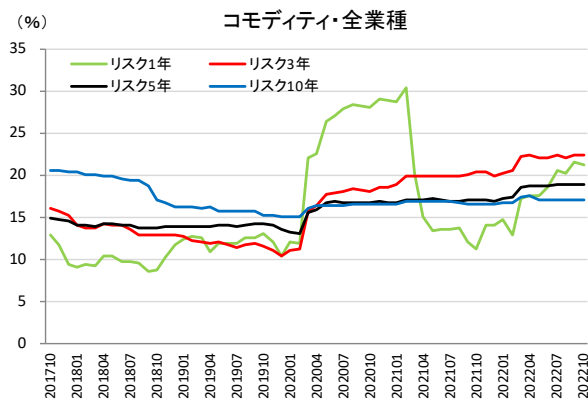
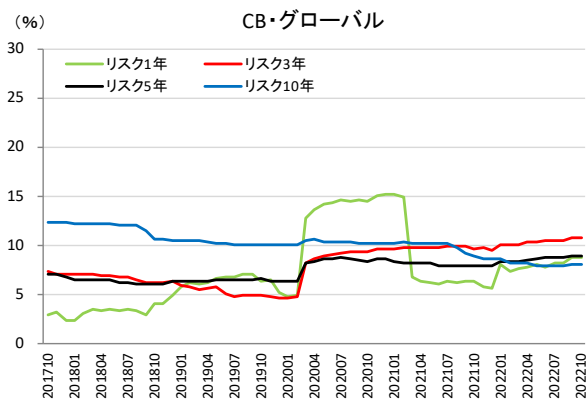
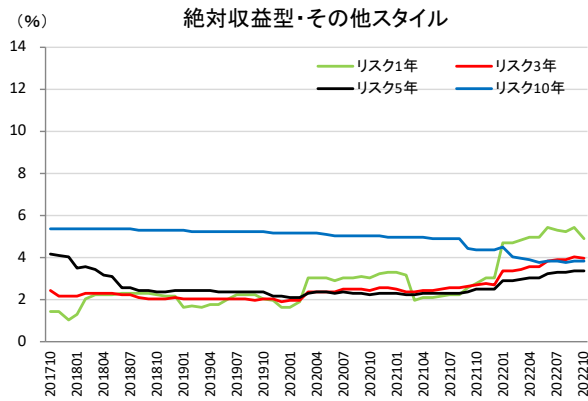
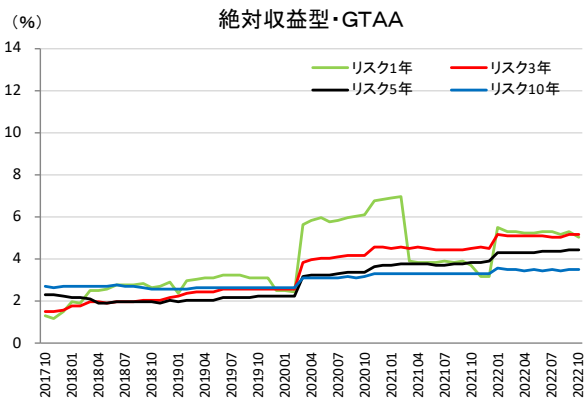
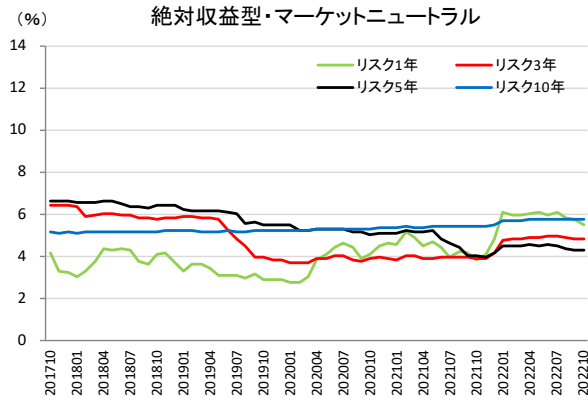
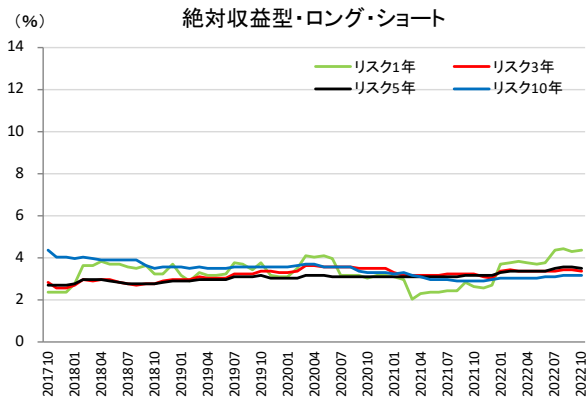


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	6,111	20,381	41,808	91,403
国内株式	325	2,163	3,168	7,161
一般	369	1,030	2,071	3,382
フリー	293	823	1,615	2,919
バリュー	76	207	456	463
小型	-4	5	38	77
その他	-39	1,134	1,061	3,696
日経225	-152	765	620	2,827
TOPIX	84	250	245	526
JPX日経400	3	13	20	59
国内債券	449	1,035	1,674	4,196
一般	449	1,035	1,674	4,196
外国株式(先進国)	3,806	10,344	23,056	58,615
グローバル	1,664	4,967	11,925	27,651
除く日本	860	2,381	5,397	9,725
含む日本	804	2,586	6,528	17,926
その他	2,142	5,377	11,131	30,964
北米	10	24	38	64
米国	2,147	5,453	11,338	31,670
カナダ	-3	-6	-14	-39
欧州	-1	-24	-26	-54
ドイツ	0	0	0	-2
イギリス	0	0	0	0
アジア・オセアニア	1	1	-1	0
オーストラリア	-16	-74	-219	-704
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	3	4	15	31
エマージング株式	30	-193	-443	-1,608
グローバル	10	58	183	261
BRICS	-3	-9	-18	-60
その他	24	-241	-608	-1,809
欧州	0	0	0	-9
ロシア	0	0	0	-20
アジア・オセアニア	-34	-150	-372	-835
中国	-40	-108	-199	-605
インド	95	93	84	-169
インドネシア	5	-11	-17	-28
タイ	0	-1	-2	-14
フィリピン	0	0	-4	-12
ベトナム	23	-9	-17	26
韓国	0	0	0	0
香港	1	3	2	4
中南米	-2	-4	-5	-10
ブラジル	-23	-43	-54	-127
メキシコ	0	-2	-3	-5
中東・アフリカ	-1	-2	-11	4
トルコ	-1	-3	-6	-8
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	6,111	20,381	41,808	91,403
外国債券(先進国)	-296	377	1,981	3,466
グローバル	-369	431	2,294	5,104
除く日本	-591	-425	272	696
含む日本	222	855	2,022	4,408
その他	73	-54	-313	-1,638
北米	0	0	-2	-8
米国	153	259	368	138
カナダ	-11	-47	-100	-194
欧州	-5	0	-38	-175
イギリス	0	-1	-1	-3
アジア・オセアニア	-8	-47	-87	-223
オーストラリア	-50	-198	-407	-1,043
ニュージーランド	0	-2	-5	-15
複合地域	-6	-18	-41	-115
エマージング債券	-101	-286	-369	-1,210
グローバル	-33	-57	48	-142
米ドル建て	-39	-68	27	-154
現地通貨建て	5	11	21	12
その他	-68	-229	-416	-1,068
ロシア	0	0	0	-10
アジア・オセアニア	-2	-8	-17	-42
インド	-16	-54	-126	-388
インドネシア	-4	-5	-14	-51
ブラジル	-38	-132	-222	-442
メキシコ	-5	-16	-37	-83
トルコ	0	0	-1	-3
複合地域	0	-1	-1	-3
ハイイールド債券	146	406	484	-200
グローバル	2	56	50	-30
北米	166	395	532	117
その他	-22	-45	-98	-287
欧州	-18	-43	-85	-241
アジア・オセアニア	-3	-1	-11	-43
複合地域	0	-1	-1	-3
複合資産	1,088	3,130	6,084	12,360
安定	427	632	950	4,204
安定成長	359	1,445	3,029	5,057
成長	364	1,243	2,552	4,387
国内バランス	-64	-164	-343	-848
安定	-108	-256	-485	-998
一般	-1	-4	-7	-22
その他	2	-26	-104	-441

<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別③

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	6,111	20,381	41,808	91,403
国内REIT	393	1,264	2,713	3,202
日本	393	1,264	2,713	3,202
外国REIT	208	643	1,203	388
グローバル	-50	-4	1	-506
除く日本	-73	28	132	117
含む日本	22	-32	-131	-627
北米	262	683	1,337	1,339
その他	-4	-36	-135	-445
欧州	0	-1	-4	-15
アジア・オセアニア	0	-18	-90	-293
オーストラリア	-2	-12	-29	-103
複合地域	0	0	-2	-6
複数国	-1	-5	-10	-27
その他	62	1,498	2,256	5,032
絶対収益型	27	284	772	2,315
ロング・ショート	-8	-8	3	49
マーケットニュートラル	-3	-23	-55	-116
GTAA	-13	-4	4	27
その他スタイル	50	315	815	2,342
CB	1	815	793	662
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-2
日本	0	-1	-2	-5
グローバル	1	817	797	670
コモディティ	52	130	192	124
全業種	-11	-38	-238	-311
貴金属	66	181	446	485
エネルギー	-2	-14	-14	-48
その他コモディティ	0	0	-1	-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	867,505	100.00	5,389	100.00
国内株式	105,207	12.13	838	15.55
一般	57,592	6.64	538	9.98
フリー	45,113	5.20	438	8.13
バリュー	12,479	1.44	100	1.86
小型	6,689	0.77	91	1.69
その他	40,290	4.64	203	3.77
日経225	21,077	2.43	69	1.28
TOPIX	15,884	1.83	80	1.48
JPX日経400	732	0.08	16	0.30
国内債券	43,070	4.96	141	2.62
一般	43,070	4.96	141	2.62
外国株式(先進国)	357,540	41.21	1,162	21.56
グローバル	243,702	28.09	806	14.96
除く日本	68,863	7.94	193	3.58
含む日本	174,839	20.15	613	11.38
その他	113,839	13.12	356	6.61
北米	275	0.03	10	0.19
米国	108,506	12.51	266	4.94
カナダ	171	0.02	2	0.04
欧州	1,585	0.18	44	0.82
ドイツ	15	0.00	1	0.02
イギリス	9	0.00	3	0.06
アジア・オセアニア	40	0.00	2	0.04
オーストラリア	3,180	0.37	26	0.48
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	44	0.01	1	0.02
エマージング株式	26,513	3.06	316	5.86
グローバル	8,633	1.00	95	1.76
BRICS	458	0.05	7	0.13
その他	17,423	2.01	214	3.97
欧州	54	0.01	6	0.11
ロシア	11	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,238	0.49	88	1.63
中国	1,833	0.21	32	0.59
インド	9,211	1.06	30	0.56
インドネシア	148	0.02	4	0.07
タイ	31	0.00	3	0.06
フィリピン	28	0.00	4	0.07
ベトナム	1,011	0.12	13	0.24
韓国	4	0.00	1	0.02
香港	13	0.00	1	0.02
中南米	65	0.01	2	0.04
ブラジル	574	0.07	15	0.28
メキシコ	15	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	118	0.01	5	0.09
トルコ	53	0.01	2	0.04
複合地域	16	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	867,505	100.00	5,389	100.00
外国債券(先進国)	80,531	9.28	779	14.46
グローバル	64,880	7.48	529	9.82
除く日本	30,432	3.51	229	4.25
含む日本	34,448	3.97	300	5.57
その他	15,651	1.80	250	4.64
北米	67	0.01	6	0.11
米国	5,368	0.62	139	2.58
カナダ	796	0.09	4	0.07
欧州	996	0.11	33	0.61
イギリス	10	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,592	0.18	9	0.17
オーストラリア	5,602	0.65	36	0.67
ニュージーランド	76	0.01	9	0.17
複合地域	1,145	0.13	8	0.15
エマージング債券	10,979	1.27	266	4.94
グローバル	6,009	0.69	188	3.49
米ドル建て	4,429	0.51	143	2.65
現地通貨建て	1,580	0.18	45	0.84
その他	4,970	0.57	78	1.45
ロシア	12	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	253	0.03	6	0.11
インド	2,278	0.26	17	0.32
インドネシア	302	0.03	7	0.13
ブラジル	1,616	0.19	21	0.39
メキシコ	273	0.03	7	0.13
トルコ	61	0.01	4	0.07
複合地域	32	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	17,174	1.98	244	4.53
グローバル	2,612	0.30	33	0.61
北米	12,649	1.46	149	2.76
その他	1,913	0.22	62	1.15
欧州	1,507	0.17	40	0.74
アジア・オセアニア	368	0.04	21	0.39
複合地域	38	0.00	1	0.02
複合資産	130,779	15.08	995	18.46
安定	38,632	4.45	275	5.10
安定成長	57,489	6.63	415	7.70
成長	23,983	2.76	256	4.75
国内バランス	7,719	0.89	33	0.61
安定	7,142	0.82	9	0.17
一般	303	0.03	19	0.35
その他	2,957	0.34	16	0.30

< 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	867,505	100.00	5,389	100.00
国内REIT	28,688	3.31	135	2.51
日本	28,688	3.31	135	2.51
外国REIT	44,872	5.17	285	5.29
グローバル	17,656	2.04	153	2.84
除く日本	5,627	0.65	65	1.21
含む日本	12,029	1.39	88	1.63
北米	24,163	2.79	78	1.45
その他	3,054	0.35	54	1.00
欧州	115	0.01	10	0.19
アジア・オセアニア	2,096	0.24	28	0.52
オーストラリア	528	0.06	12	0.22
複合地域	56	0.01	3	0.06
複数国	260	0.03	1	0.02
その他	22,150	2.55	228	4.23
絶対収益型	11,546	1.33	107	1.99
ロング・ショート	843	0.10	37	0.69
マーケットニュートラル	547	0.06	16	0.30
GTAA	431	0.05	13	0.24
その他スタイル	9,639	1.11	40	0.74
CB	1,780	0.21	31	0.58
アジア・オセアニア	34	0.00	1	0.02
日本	32	0.00	3	0.06
グローバル	1,714	0.20	27	0.50
コモディティ	4,708	0.54	36	0.67
全業種	1,752	0.20	14	0.26
貴金属	2,855	0.33	20	0.37
エネルギー	81	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	13,171	9.8	2.36	2.62	1.171
国内株式	17,362	13.3	0.68	0.71	1.041
一般	16,158	13.0	0.94	0.96	1.392
フリー	15,732	12.2	0.96	0.99	1.433
バリュー	18,027	16.3	0.86	0.87	1.244
小型	22,758	13.9	0.50	0.60	1.699
その他	18,179	13.8	0.34	0.35	0.420
日経225	19,317	15.3	0.37	0.38	0.482
TOPIX	18,978	14.7	0.12	0.12	0.260
JPX日経400	16,721	8.1	0.06	0.06	0.503
国内債券	10,525	11.6	0.16	0.17	0.435
一般	10,525	11.6	0.16	0.17	0.435
外国株式(先進国)	15,555	7.3	2.40	2.71	1.301
グローバル	15,941	7.2	1.86	2.02	1.369
除く日本	22,760	9.9	0.45	0.47	0.607
含む日本	13,795	6.3	2.43	2.64	1.669
その他	14,680	7.7	3.55	4.18	1.155
北米	16,915	7.7	10.29	9.99	1.733
米国	15,599	6.8	3.37	4.02	1.125
カナダ	6,491	11.6	7.36	7.59	1.989
欧州	12,775	11.9	2.51	2.89	1.610
ドイツ	12,772	8.6	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,107	6.2	10.90	10.79	1.872
アジア・オセアニア	9,435	12.8	4.98	5.71	1.635
オーストラリア	9,593	8.0	9.30	9.76	1.824
ニュージーランド	17,009	10.3	1.63	1.76	1.672
複合地域	12,929	9.5	16.11	10.83	1.705
エマージング株式	12,812	10.4	2.60	2.74	1.676
グローバル	12,230	8.1	0.34	0.37	1.102
BRICS	14,047	16.4	0.69	0.92	2.068
その他	13,030	11.2	3.77	3.96	1.951
欧州	5,188	16.4	0.11	0.12	1.956
ロシア	2,615	13.4	0.91	4.93	1.257
アジア・オセアニア	13,281	12.1	3.48	4.30	1.732
中国	13,292	8.2	0.67	0.92	1.940
インド	17,575	12.0	4.85	4.76	2.059
インドネシア	14,217	12.5	2.72	2.34	1.834
タイ	12,380	10.3	5.69	5.44	1.816
フィリピン	10,663	10.2	0.67	0.70	1.729
ベトナム	14,433	5.3	1.90	2.34	1.925
韓国	11,245	3.8	0.00	0.00	1.804
香港	11,305	13.2	1.54	2.03	0.858
中南米	10,125	15.8	0.00	0.00	2.043
ブラジル	6,778	12.0	3.57	3.12	1.946
メキシコ	11,973	9.6	0.00	0.00	1.884
中東・アフリカ	14,718	11.2	3.01	3.14	2.078
トルコ	10,432	21.3	0.00	0.00	2.031
複合地域	19,167	14.4	1.57	1.93	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	13,171	9.8	2.36	2.62	1.171
外国債券(先進国)	9,992	10.1	1.45	1.55	0.984
グローバル	10,425	10.1	1.08	1.16	0.919
除く日本	11,597	12.3	1.01	1.06	0.709
含む日本	9,531	8.4	1.15	1.26	1.104
その他	9,074	10.2	2.91	3.09	1.256
北米	9,921	8.5	2.26	2.47	1.772
米国	9,901	8.7	3.47	3.87	1.224
カナダ	7,447	11.8	1.63	1.50	1.378
欧州	7,443	12.4	1.63	1.76	1.156
イギリス	7,237	7.5	3.70	4.20	1.311
アジア・オセアニア	9,042	12.6	2.53	2.54	1.419
オーストラリア	8,506	13.8	3.03	3.15	1.244
ニュージーランド	9,134	8.3	1.54	1.65	1.358
複合地域	5,397	12.5	2.37	2.36	1.197
エマージング債券	8,590	10.8	4.64	4.45	1.487
グローバル	8,481	11.3	3.21	3.52	1.376
米ドル建て	8,348	11.8	3.37	3.77	1.490
現地通貨建て	8,901	9.8	2.78	2.82	1.059
その他	8,854	9.7	6.38	5.59	1.620
ロシア	1,015	9.7	2.28	16.74	1.602
アジア・オセアニア	9,452	11.9	6.44	6.82	1.630
インド	10,353	8.0	6.83	6.48	1.701
インドネシア	9,316	9.9	5.84	5.40	1.672
ブラジル	9,531	13.1	6.34	4.46	1.579
メキシコ	7,952	9.7	6.08	5.04	1.398
トルコ	2,148	9.6	5.73	6.78	1.458
複合地域	3,623	16.2	2.47	2.62	1.210
ハイイールド債券	9,207	11.8	5.65	5.57	1.669
グローバル	7,239	11.7	3.65	3.73	1.489
北米	10,667	12.5	5.68	5.35	1.691
その他	6,744	10.0	8.26	9.55	1.765
欧州	7,043	9.5	7.98	9.05	1.740
アジア・オセアニア	6,280	10.6	9.72	12.05	1.865
複合地域	4,506	18.6	5.17	5.33	1.800
複合資産	12,755	9.4	1.16	1.27	0.972
安定	11,247	9.2	1.02	1.08	1.091
安定成長	12,460	9.8	1.41	1.56	0.981
成長	15,272	9.3	0.38	0.42	0.791
国内バランス	11,617	9.3	2.23	2.41	0.941
安定	10,538	11.2	2.33	2.52	0.918
一般	12,152	9.3	1.25	1.35	1.290
その他	8,389	2.6	1.35	1.90	0.769

(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	13,171	9.8	2.36	2.62	1.171
国内REIT	14,572	9.7	8.60	10.40	0.932
日本	14,572	9.7	8.60	10.40	0.932
外国REIT	11,855	8.7	8.11	8.82	1.493
グローバル	13,064	8.4	3.73	4.04	1.271
除く日本	14,597	6.6	2.71	3.08	0.948
含む日本	11,932	9.8	4.21	4.48	1.422
北米	11,193	9.3	11.41	12.39	1.622
その他	9,388	8.6	7.21	8.19	1.758
欧州	6,047	8.7	4.15	5.45	1.819
アジア・オセアニア	10,788	8.3	8.99	10.17	1.808
オーストラリア	9,301	8.1	4.03	4.65	1.702
複合地域	7,108	10.7	0.80	0.95	0.780
複数国	11,469	18.5	2.06	2.09	1.650
その他					
絶対収益型	10,614	6.1	0.05	0.06	1.899
ロング・ショート	10,585	5.1	0.19	0.21	1.459
マーケットニュートラル	9,885	5.7	0.32	0.32	1.303
GTAA	11,146	8.9	0.45	0.52	1.508
その他スタイル	10,699	6.5	0.01	0.00	1.993
CB	12,030	9.5	0.70	0.83	1.227
アジア・オセアニア	10,005	12.3	2.37	2.40	1.823
日本	11,185	11.5	0.67	0.67	0.925
グローバル	12,198	9.2	0.64	0.77	1.221
コモディティ	11,945	6.9	0.76	0.62	0.944
全業種	11,419	10.2	2.04	1.67	1.307
貴金属	11,592	4.3	0.00	0.00	0.721
エネルギー	19,878	13.7	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	18,449	6.1	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