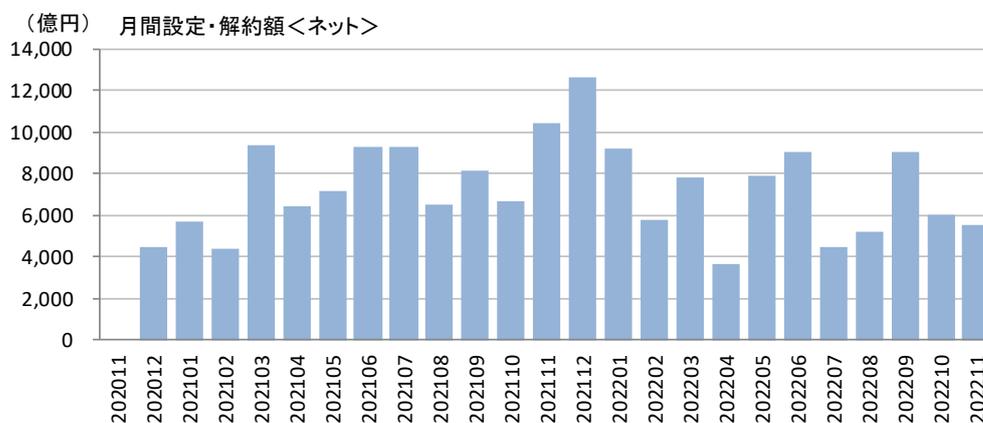
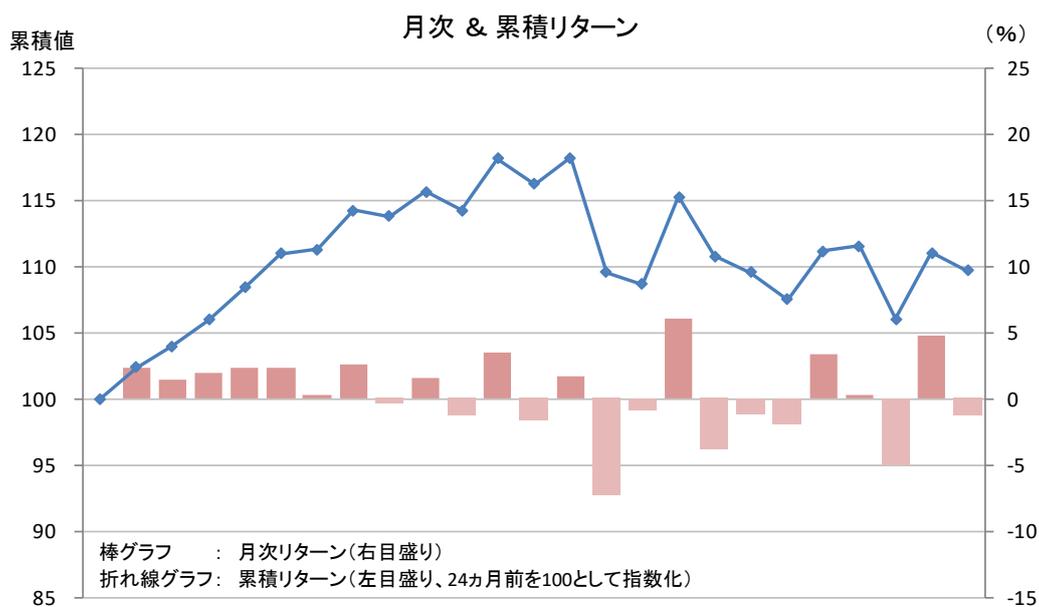


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2022年11月

「総合」 **-1.24 %**
(前月 **+4.75 %**)



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		15,545	15,740	-195	-1.24
国内株式		20,140	19,642	498	2.54
一般		19,578	19,045	532	2.80
フリー		18,309	17,821	488	2.74
バリュー		25,573	24,826	747	3.01
小型		41,244	39,863	1,381	3.46
その他		19,933	19,544	389	1.99
日経225		19,084	18,827	257	1.36
TOPIX		19,705	19,145	560	2.92
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	18,620	18,023	597	3.31
国内債券		12,565	12,633	-68	-0.54
一般		12,565	12,633	-68	-0.54
外国株式(先進国)		20,135	20,764	-629	-3.03
グローバル		21,805	22,355	-550	-2.46
除く日本		34,999	35,758	-759	-2.12
含む日本		18,983	19,488	-505	-2.59
その他		16,608	17,345	-737	-4.25
北米		21,656	22,276	-620	-2.79
米国		25,701	26,933	-1,232	-4.57
カナダ	10,000 (2009.02.27)	21,930	22,481	-551	-2.45
欧州		23,185	22,492	694	3.08
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	11,113	10,547	566	5.36
イギリス	9,683 (2014.05.30)	10,932	10,635	296	2.79
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	38,681	36,608	2,073	5.66
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	20,513	19,949	564	2.83
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	45,673	44,840	833	1.86
複合地域	10,000 (2013.04.30)	15,230	15,849	-619	-3.91
エマージング株式		18,553	18,303	250	1.37
グローバル		18,059	17,340	719	4.15
BRICS	10,000 (2005.09.30)	23,357	23,052	305	1.32
その他		19,579	19,581	-2	-0.01
欧州		11,342	10,489	853	8.13
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,445	1,466	-21	-1.41
アジア・オセアニア		17,771	16,716	1,055	6.31
中国		39,112	36,777	2,335	6.35
インド	10,000 (2004.09.30)	51,729	53,264	-1,536	-2.88
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	17,065	18,430	-1,364	-7.40
タイ		23,980	23,546	434	1.84
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,892	7,521	371	4.93
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	19,502	20,689	-1,187	-5.74
韓国	10,000 (1997.06.30)	27,146	24,999	2,148	8.59
香港		20,599	17,854	2,745	15.37
中南米	7,427 (2006.04.28)	10,230	11,123	-892	-8.02
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	8,961	9,950	-989	-9.94
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	13,751	13,778	-27	-0.20
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	13,608	14,468	-861	-5.95
トルコ		36,277	30,976	5,301	17.11
複合地域	10,000 (2005.08.31)	24,365	22,217	2,148	9.67

※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		15,545	15,740	-195	-1.24
外国債券(先進国)		18,273	18,463	-190	-1.03
グローバル		18,259	18,415	-156	-0.85
除く日本		19,984	20,323	-339	-1.67
含む日本		17,152	17,173	-21	-0.12
その他		18,548	18,886	-338	-1.79
北米	9,052 (2013.05.31)	10,358	10,399	-41	-0.40
米国		17,347	17,710	-364	-2.05
カナダ	10,000 (2003.05.30)	16,369	17,285	-915	-5.30
欧州	10,000 (1998.07.31)	13,874	13,753	122	0.88
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,267	10,192	75	0.74
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	20,786	21,062	-276	-1.31
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	25,635	26,003	-367	-1.41
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,365	11,217	147	1.31
複合地域	10,000 (2001.11.30)	18,216	18,827	-611	-3.25
エマージング債券		18,158	18,454	-296	-1.61
グローバル		18,260	18,122	138	0.76
米ドル建て		18,612	18,362	250	1.36
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	13,149	13,272	-123	-0.93
その他	8,647 (2005.03.31)	14,558	15,241	-683	-4.48
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,500	1,578	-77	-4.91
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	15,016	15,152	-136	-0.89
インド	10,000 (2011.08.31)	19,766	20,430	-664	-3.25
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	17,408	18,187	-779	-4.28
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	13,143	14,245	-1,102	-7.74
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	16,348	16,409	-61	-0.37
トルコ	10,000 (2011.04.28)	3,751	3,846	-95	-2.46
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,493	10,441	52	0.50
ハイイールド債券		25,349	26,065	-716	-2.75
グローバル	10,000 (1997.06.30)	23,548	23,585	-37	-0.16
北米		25,756	26,829	-1,073	-4.00
その他	10,000 (2004.03.31)	22,549	22,091	458	2.07
欧州	10,000 (2006.04.28)	23,043	22,599	444	1.96
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	13,488	13,103	385	2.94
複合地域	10,000 (2004.03.31)	22,289	22,754	-465	-2.04
複合資産		18,753	18,787	-34	-0.18
安定	10,000 (1998.10.30)	15,766	15,794	-28	-0.18
安定成長		20,673	20,757	-83	-0.40
成長		25,419	25,434	-15	-0.06
国内バランス		12,443	12,475	-32	-0.26
安定		12,633	12,677	-44	-0.35
一般		16,046	15,889	158	0.99
その他	10,000 (2018.10.31)	12,019	11,644	374	3.21

※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		15,545	15,740	-195	-1.24
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	35,820	35,870	-50	-0.14
日本	10,000 (2003.10.31)	35,820	35,870	-50	-0.14
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	33,154	33,829	-674	-1.99
グローバル	10,000 (2004.01.30)	27,432	27,913	-481	-1.72
除く日本	10,000 (2004.04.30)	30,669	31,179	-510	-1.63
含む日本	10,000 (2004.01.30)	27,220	27,709	-489	-1.76
北米	10,000 (2003.09.30)	35,054	35,984	-930	-2.58
その他	10,000 (2004.04.30)	29,955	29,615	340	1.15
欧州	10,000 (2006.12.29)	4,919	4,831	87	1.81
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	22,130	21,858	272	1.24
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	16,900	16,528	372	2.25
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,419	7,326	92	1.26
複数国	10,000 (2004.04.30)	44,776	45,757	-981	-2.14
その他		6,206	6,215	-9	-0.15
絶対収益型		7,489	7,491	-2	-0.03
ロング・ショート		8,172	8,221	-49	-0.59
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,288	11,345	-57	-0.50
GTAA		11,518	11,639	-121	-1.04
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,030	7,022	8	0.11
CB		19,360	19,500	-140	-0.72
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	19,503	20,320	-817	-4.02
日本		19,788	19,661	127	0.65
グローバル		33,791	34,021	-230	-0.68
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	11,612	11,674	-61	-0.53
全業種	10,000 (2004.12.30)	11,733	12,427	-694	-5.58
貴金属	10,000 (2009.07.31)	18,601	18,107	493	2.73
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	9,303	10,294	-991	-9.62
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	16,292	16,702	-410	-2.46

※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か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	-1.67	0.08	-5.64	-7.21
国内株式	1.52	4.63	0.64	-1.91
一般	1.65	4.66	0.02	-2.29
フリー	1.70	4.75	-2.09	-3.93
バリュー	1.50	4.29	7.90	3.72
小型	3.18	9.24	-7.61	-7.04
その他	1.03	3.86	3.48	-0.14
日経225	0.27	3.32	2.19	-1.38
TOPIX	2.19	5.01	5.50	1.96
JPX日経400	2.30	4.93	5.14	1.59
国内債券	-1.87	-2.83	-5.20	-5.07
一般	-1.87	-2.83	-5.20	-5.07
外国株式(先進国)	-1.96	0.31	-11.62	-12.52
グローバル	-1.94	-0.16	-13.11	-13.50
除く日本	0.83	2.40	1.96	-1.59
含む日本	-2.98	-1.14	-17.66	-17.25
その他	-1.98	1.40	-7.84	-10.15
北米	4.07	5.84	20.71	15.43
米国	-2.16	1.48	-8.96	-11.07
カナダ	-1.73	-1.98	5.48	4.66
欧州	5.43	1.38	-1.68	-6.55
ドイツ	14.15	2.80	4.10	-1.23
イギリス	3.80	2.13	19.49	12.09
アジア・オセアニア	-1.67	-1.01	-1.72	-3.47
オーストラリア	-0.11	0.07	18.30	11.32
ニュージーランド	-0.21	6.93	3.75	-0.42
複合地域	5.32	3.88	66.85	63.25
エマージング株式	-3.60	1.88	-1.53	-2.60
グローバル	-2.57	0.02	-3.55	-5.04
BRICS	-4.25	-0.61	-14.48	-14.02
その他	-4.12	2.88	-0.12	-1.04
欧州	13.64	7.62	-59.69	-60.36
ロシア	0.15	3.49	-89.24	-89.17
アジア・オセアニア	-4.05	-2.02	-6.98	-7.92
中国	-9.10	-2.95	-19.85	-17.13
インド	-0.71	10.77	12.92	10.13
インドネシア	-2.26	4.13	22.43	21.87
タイ	3.14	3.88	21.03	15.40
フィリピン	0.74	-3.00	0.13	-1.36
ベトナム	-23.47	-18.85	-19.14	-18.57
韓国	-2.62	-13.05	-20.85	-23.70
香港	-7.69	-4.53	-4.76	-2.70
中南米	0.98	0.57	39.97	35.05
ブラジル	-3.38	-4.97	31.48	32.21
メキシコ	15.33	8.25	44.89	27.87
中東・アフリカ	-6.06	-2.79	11.61	7.69
トルコ	41.24	63.92	100.88	88.11
複合地域	-3.31	-1.10	-6.16	-8.09

※[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	-1.67	0.08	-5.64	-7.21
外国債券(先進国)	-1.88	-1.17	-3.05	-4.05
グローバル	-1.72	-1.37	-4.40	-5.04
除く日本	-1.62	-0.86	-3.04	-3.72
含む日本	-1.81	-1.83	-5.63	-6.23
その他	-2.57	-0.39	2.37	-0.11
北米	-3.33	-2.68	-7.40	-8.03
米国	-3.51	-0.09	-0.25	-2.22
カナダ	-3.06	0.02	7.66	6.30
欧州	-0.14	-2.85	-9.85	-10.23
イギリス	1.08	-2.36	-0.94	-2.90
アジア・オセアニア	-1.81	0.12	6.00	2.79
オーストラリア	-2.10	0.12	5.93	2.59
ニュージーランド	-0.11	-0.10	1.80	-0.46
複合地域	-3.44	-2.67	0.59	-2.20
エマージング債券	-0.94	2.51	8.50	6.15
グローバル	-0.42	1.25	1.61	-0.80
米ドル建て	-0.75	0.37	-0.17	-2.43
現地通貨建て	0.60	3.85	7.16	4.24
その他	-1.66	3.94	17.18	14.93
ロシア	34.78	46.66	-85.79	-86.36
アジア・オセアニア	-1.96	1.32	2.63	1.11
インド	-1.79	4.92	10.86	9.00
インドネシア	-4.61	3.75	10.74	9.36
ブラジル	-2.58	1.21	35.66	33.47
メキシコ	5.66	11.11	36.81	27.38
トルコ	8.42	26.79	21.91	24.92
複合地域	2.28	7.85	-0.37	-2.96
ハイイールド債券	-0.51	2.43	7.82	5.04
グローバル	-1.18	-0.25	2.57	0.25
北米	-0.48	3.38	9.93	7.01
その他	0.46	0.76	3.44	0.82
欧州	1.30	1.63	4.95	1.96
アジア・オセアニア	-2.85	-2.74	-2.28	-3.53
複合地域	0.89	2.36	2.94	0.35
複合資産	-1.03	-0.74	-2.84	-4.43
安定	-1.42	-1.50	-4.79	-5.60
安定成長	-0.84	-0.30	-1.50	-3.36
成長	-0.06	1.21	0.91	-1.57
国内バランス	-1.71	-1.78	-3.14	-3.96
安定	-1.85	-1.99	-3.42	-4.19
一般	-0.06	0.60	-1.07	-2.51
その他	-5.17	-9.62	-21.87	-24.29

※[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	-1.67	0.08	-5.64	-7.21
国内REIT	-2.55	0.23	2.22	-0.97
日本	-2.55	0.23	2.22	-0.97
外国REIT	-6.36	-4.89	-0.19	-6.18
グローバル	-6.24	-5.88	-1.77	-7.23
除く日本	-6.32	-6.02	-2.06	-7.89
含む日本	-6.20	-5.81	-1.62	-6.94
北米	-6.43	-4.18	0.91	-5.76
その他	-6.51	-4.66	0.64	-3.67
欧州	-2.45	-15.22	-16.38	-18.51
アジア・オセアニア	-7.92	-4.14	1.75	-1.46
オーストラリア	-2.68	-4.40	0.13	-8.05
複合地域	0.38	-2.07	10.78	3.85
複数国	-5.53	-4.58	-0.36	-5.83
その他	-2.62	-4.38	-8.57	-10.05
絶対収益型	-1.48	-3.16	-7.15	-7.51
ロング・ショート	-0.82	-1.39	-5.44	-6.22
マーケットニュートラル	-0.93	-0.74	-10.35	-8.03
GTAA	-1.54	-0.87	-3.21	-4.66
その他スタイル	-1.57	-3.61	-7.31	-7.80
CB	-2.84	-3.05	-12.27	-11.74
アジア・オセアニア	-7.84	-3.26	-1.70	-3.51
日本	0.21	0.51	-1.34	-2.29
グローバル	-2.80	-3.21	-12.97	-12.34
コモディティ	-1.61	-4.88	20.09	17.71
全業種	-5.57	-7.46	41.98	37.78
貴金属	0.81	-3.05	5.51	4.29
エネルギー	-6.97	-9.51	60.39	46.72
その他コモディティ	-2.01	-2.46	38.94	35.41

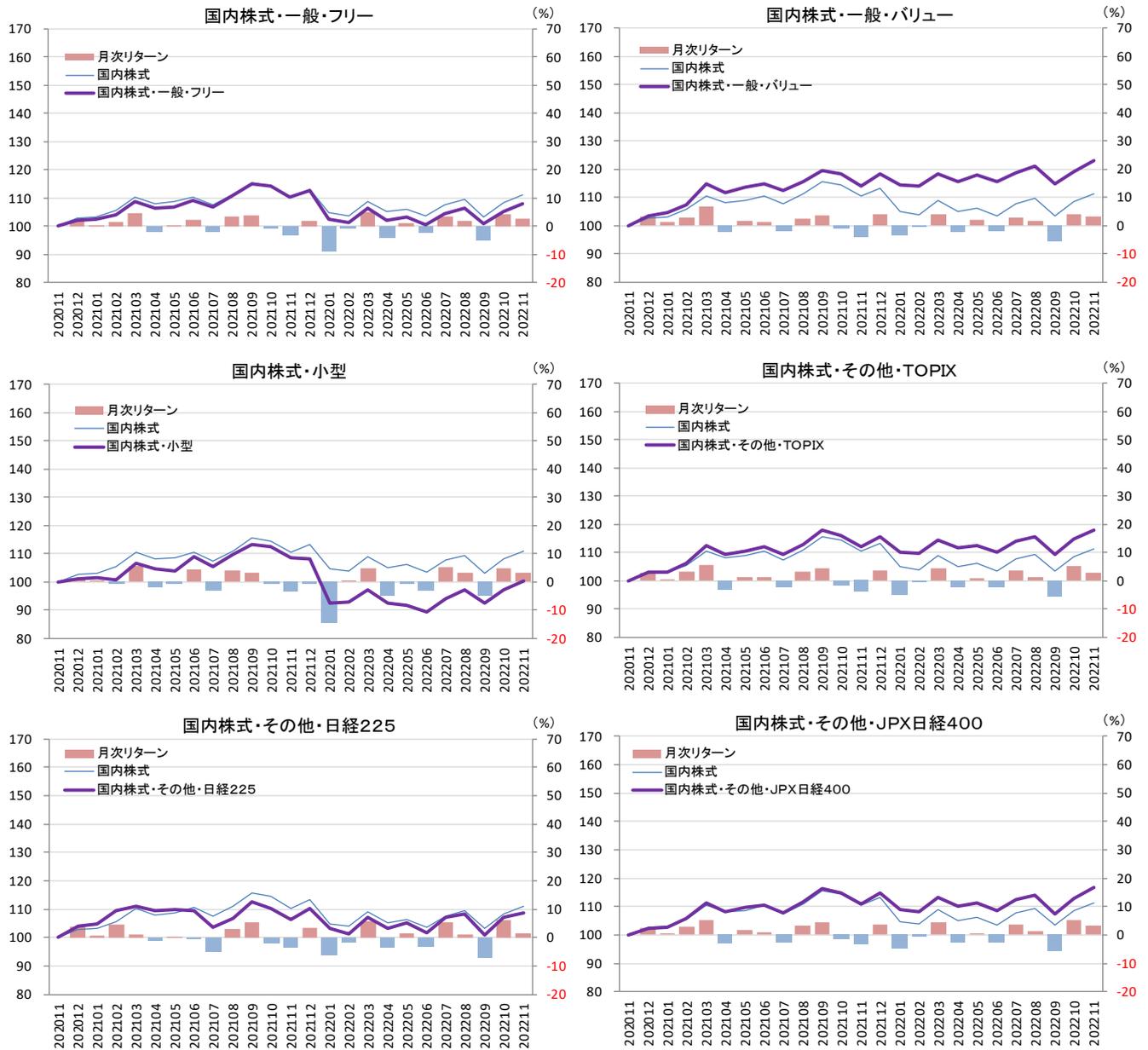
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

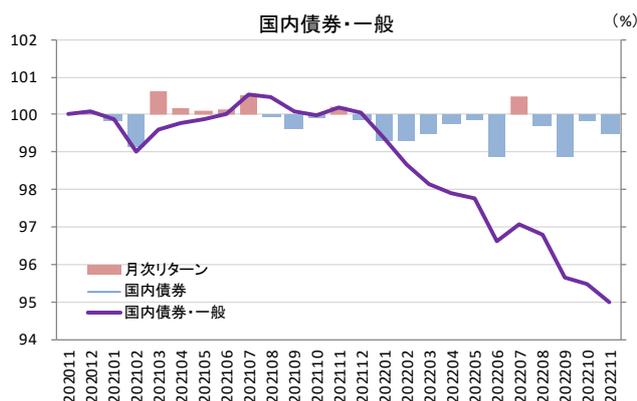
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

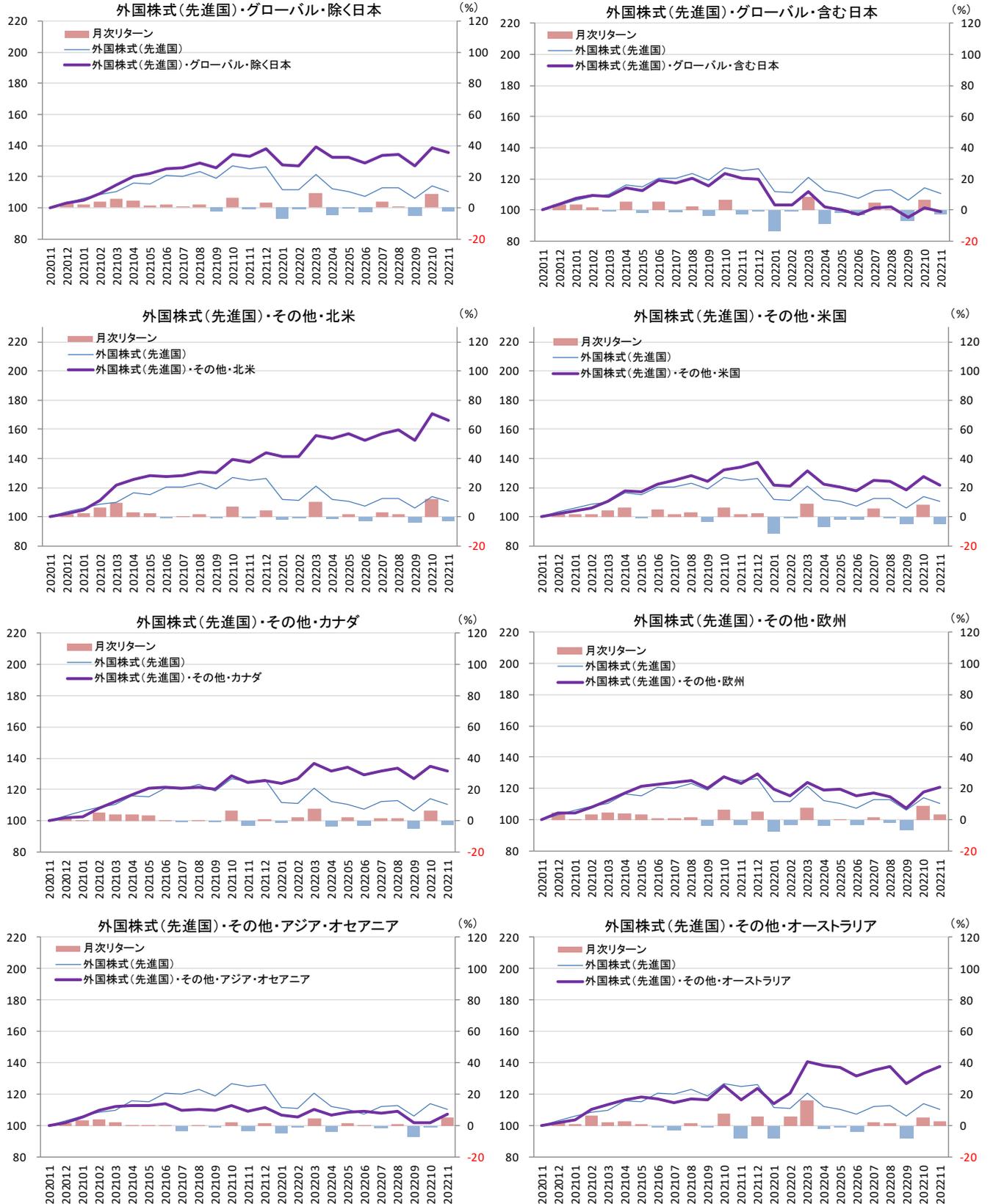


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

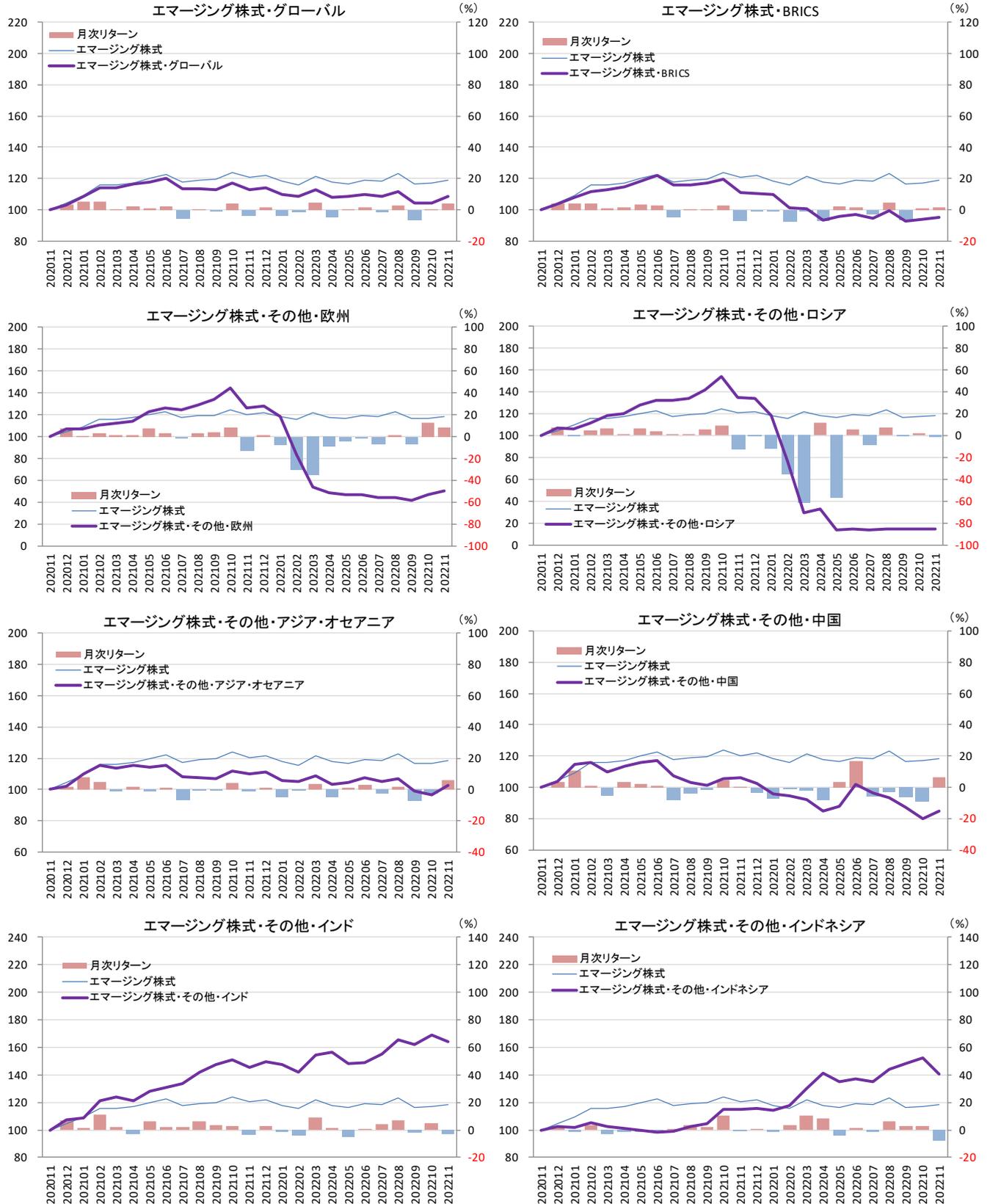


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマージング株式]

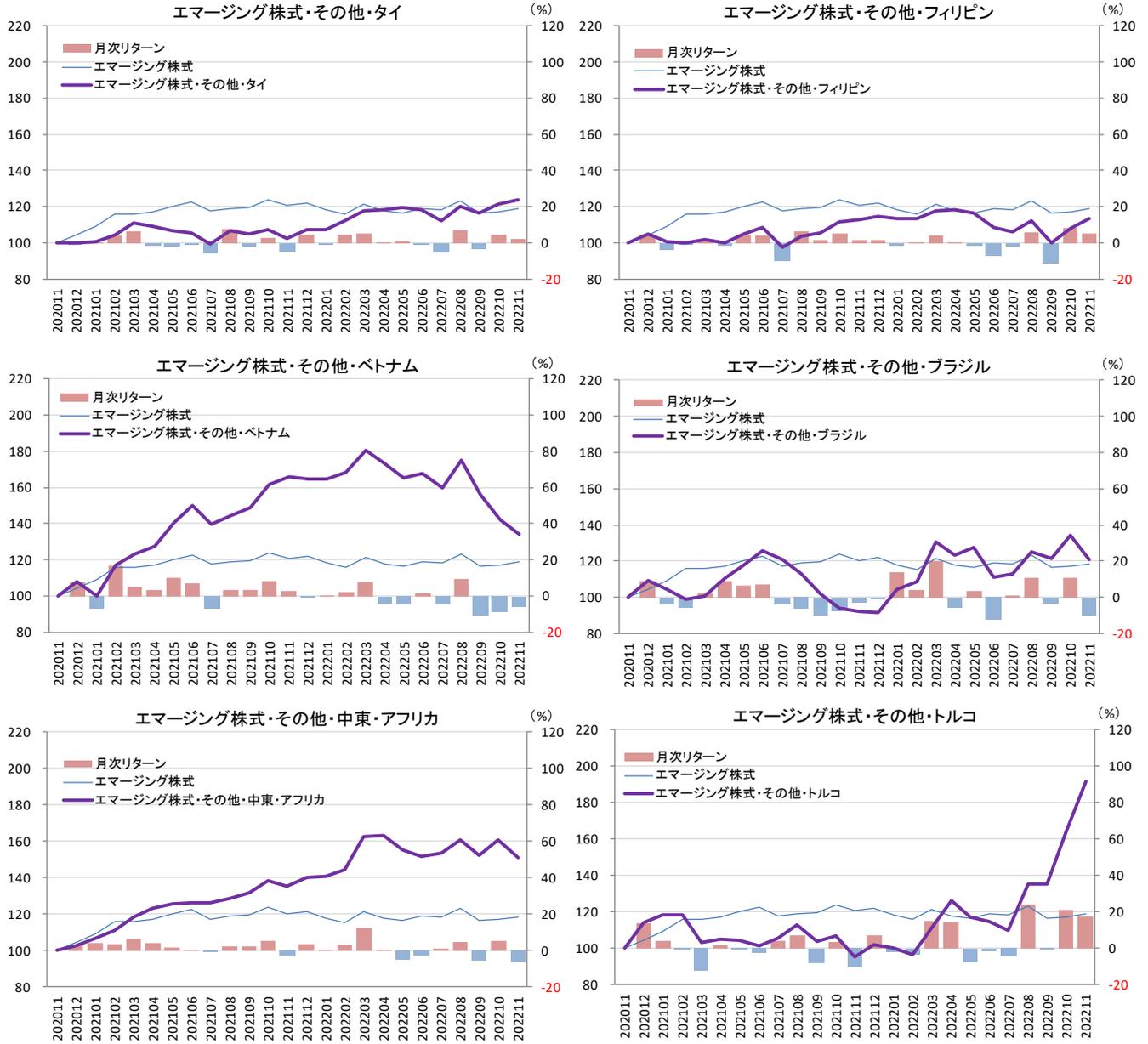


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

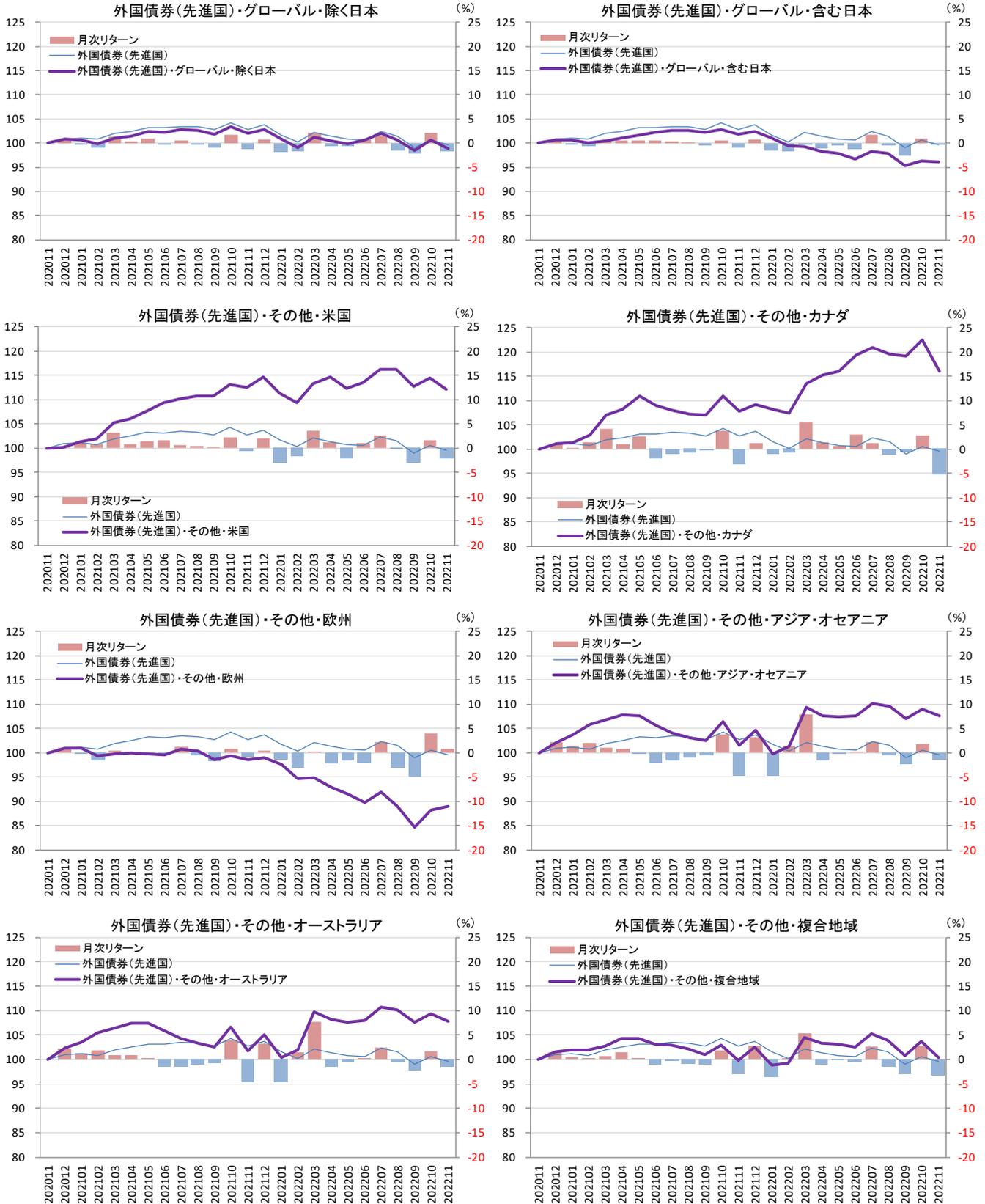


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

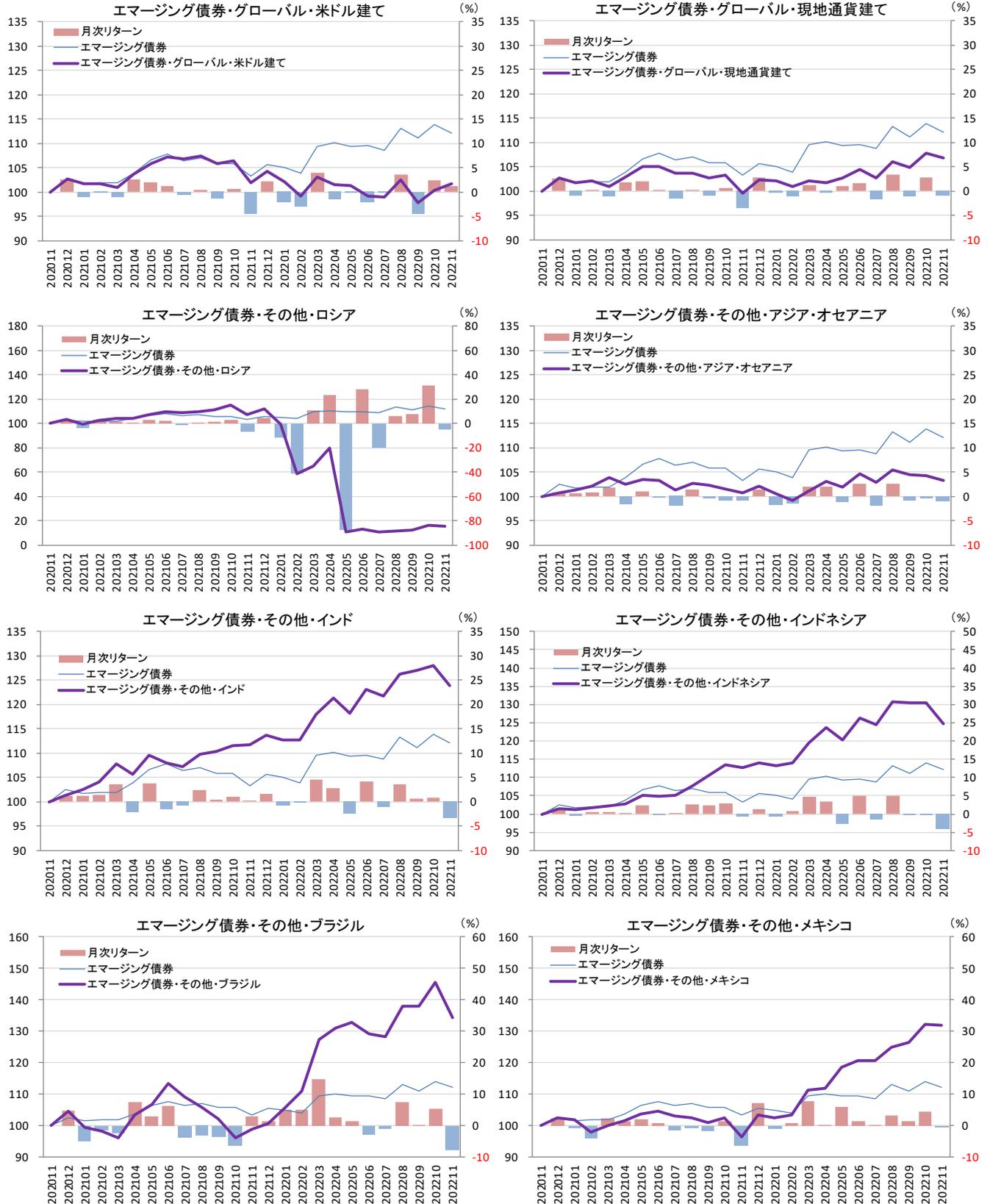


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

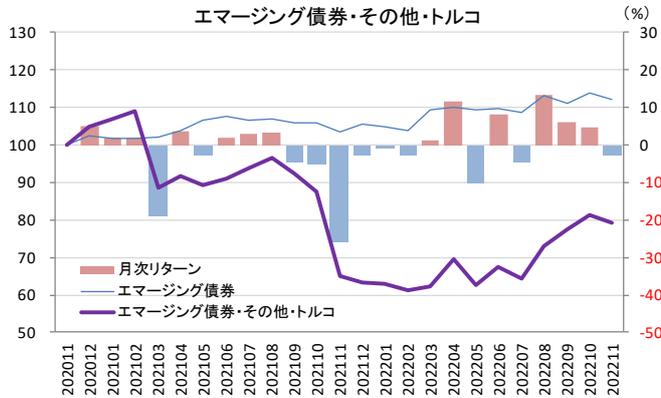


<1>パフォーマンス・サマリー

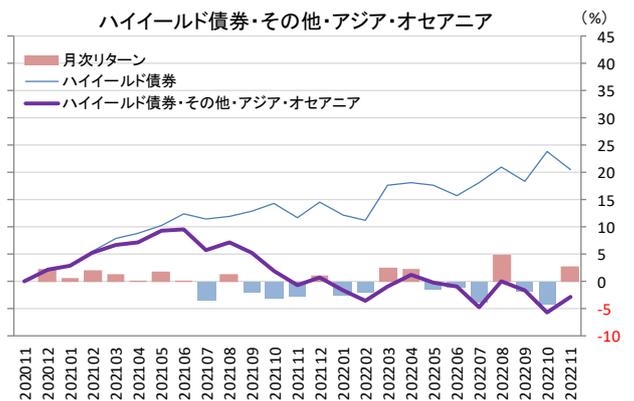
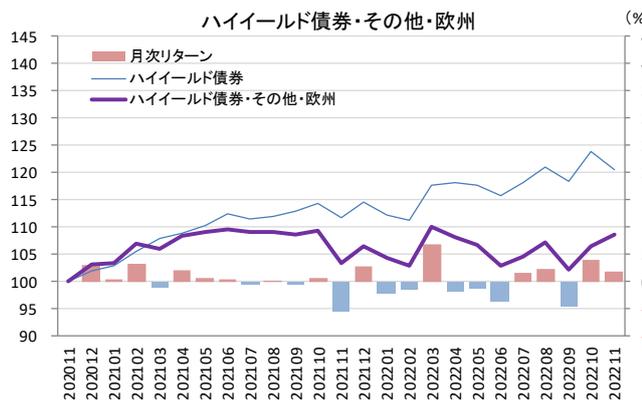
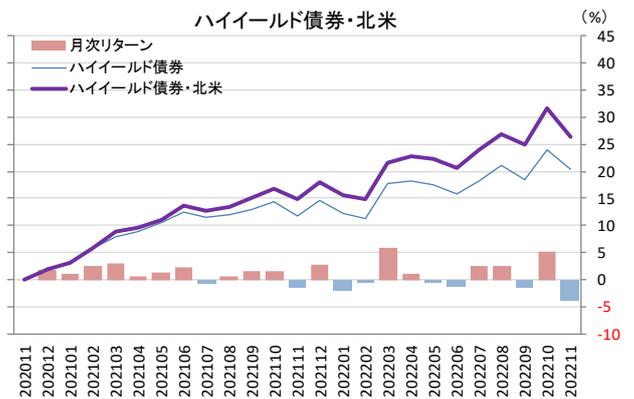
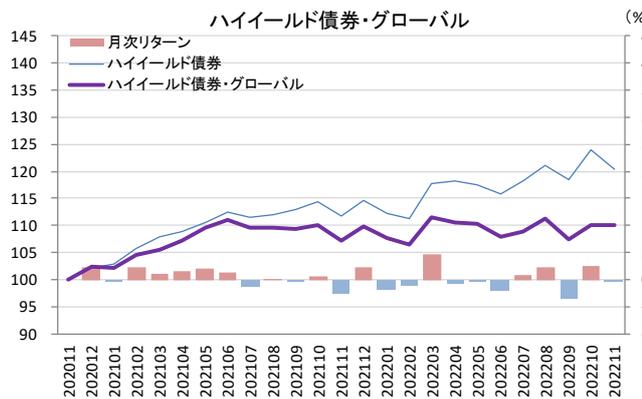
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

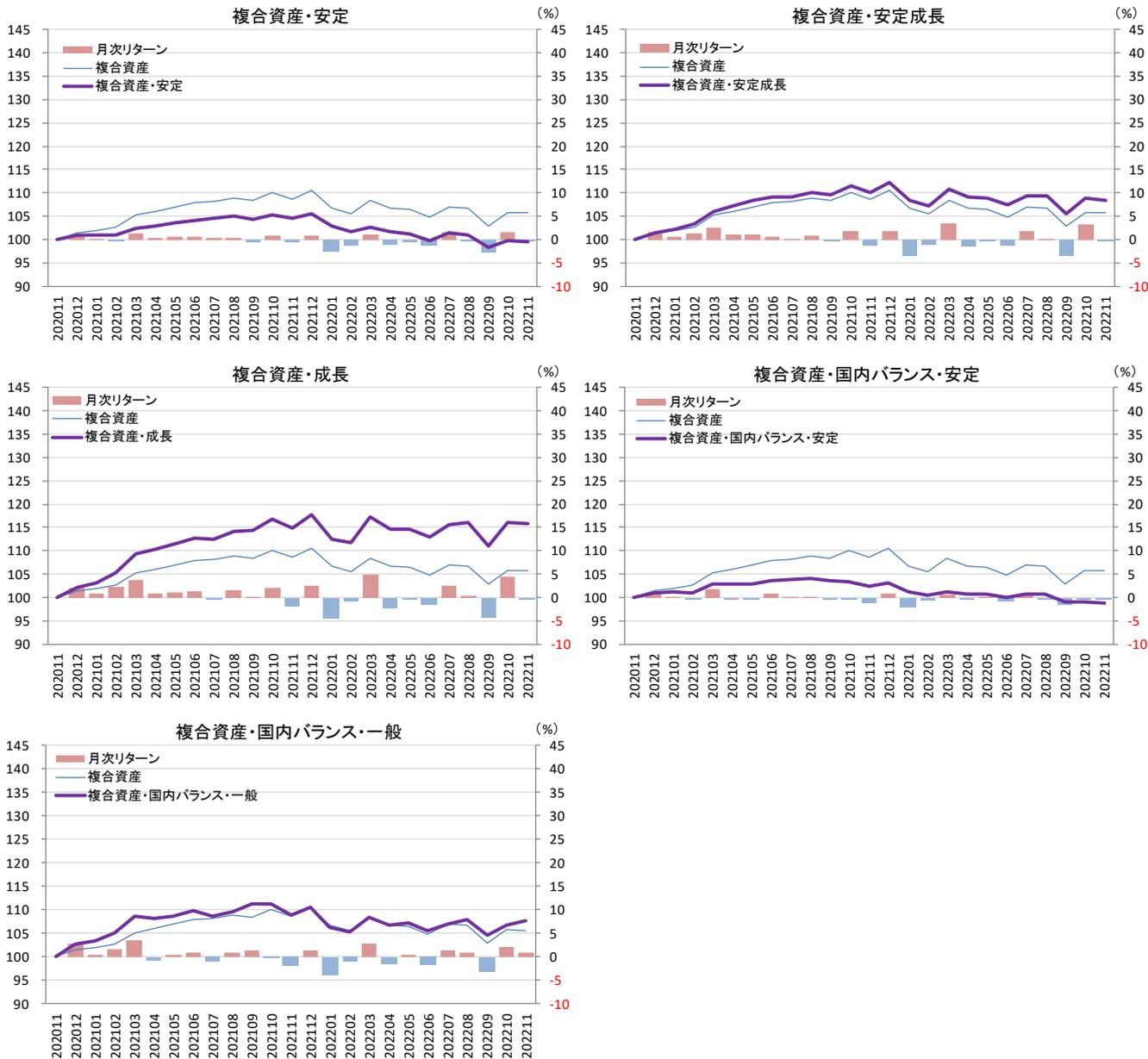


<1>パフォーマンス・サマリー

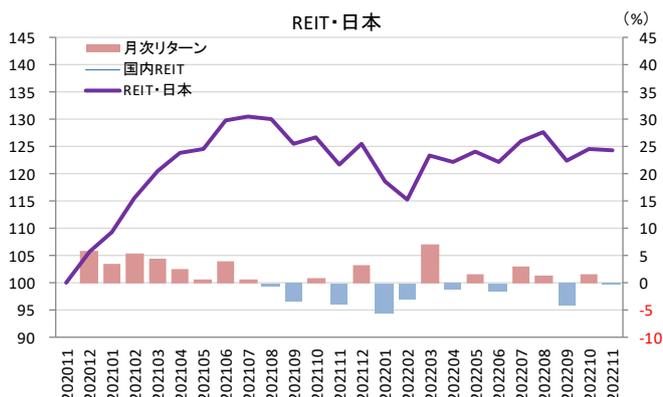
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

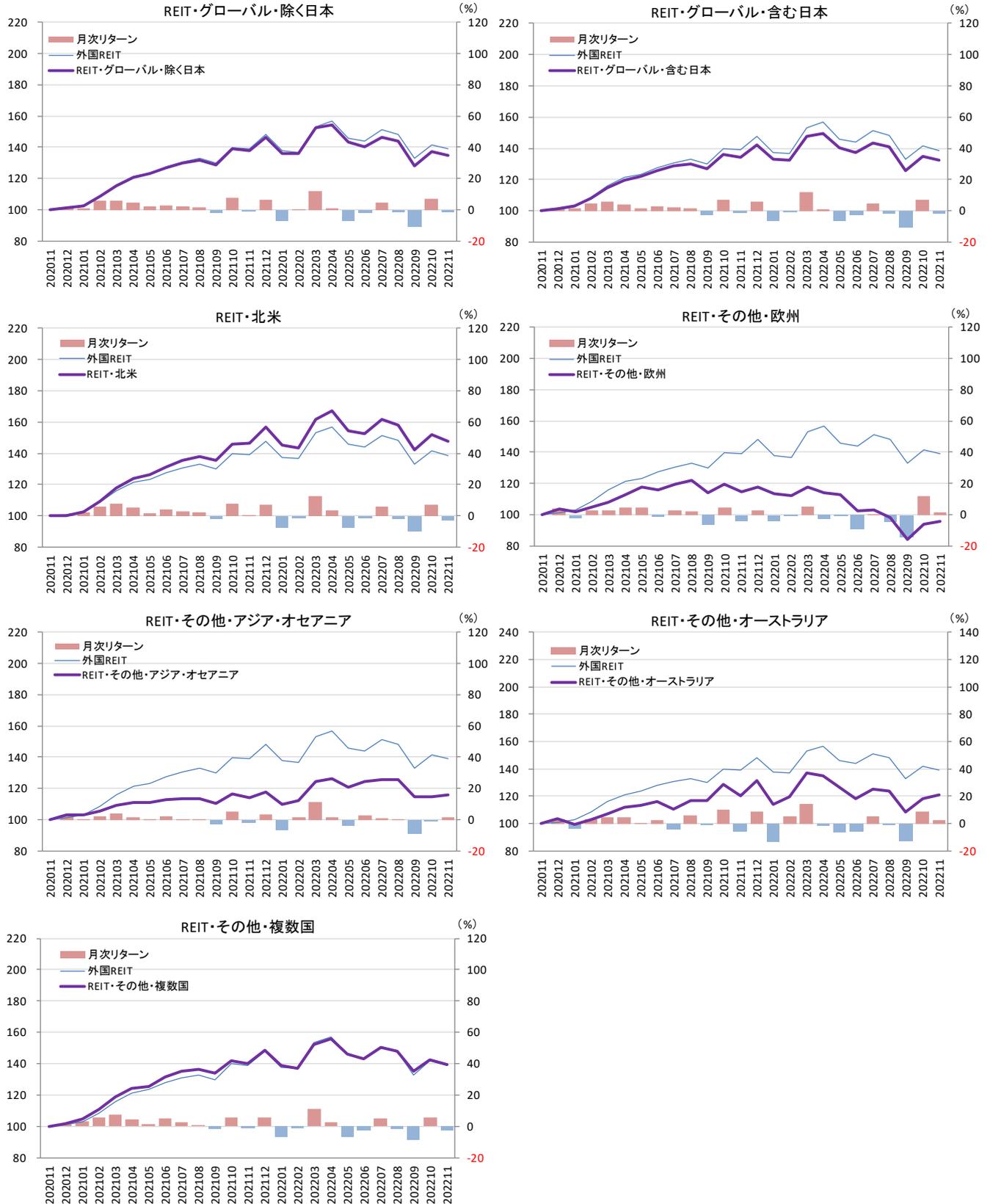


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

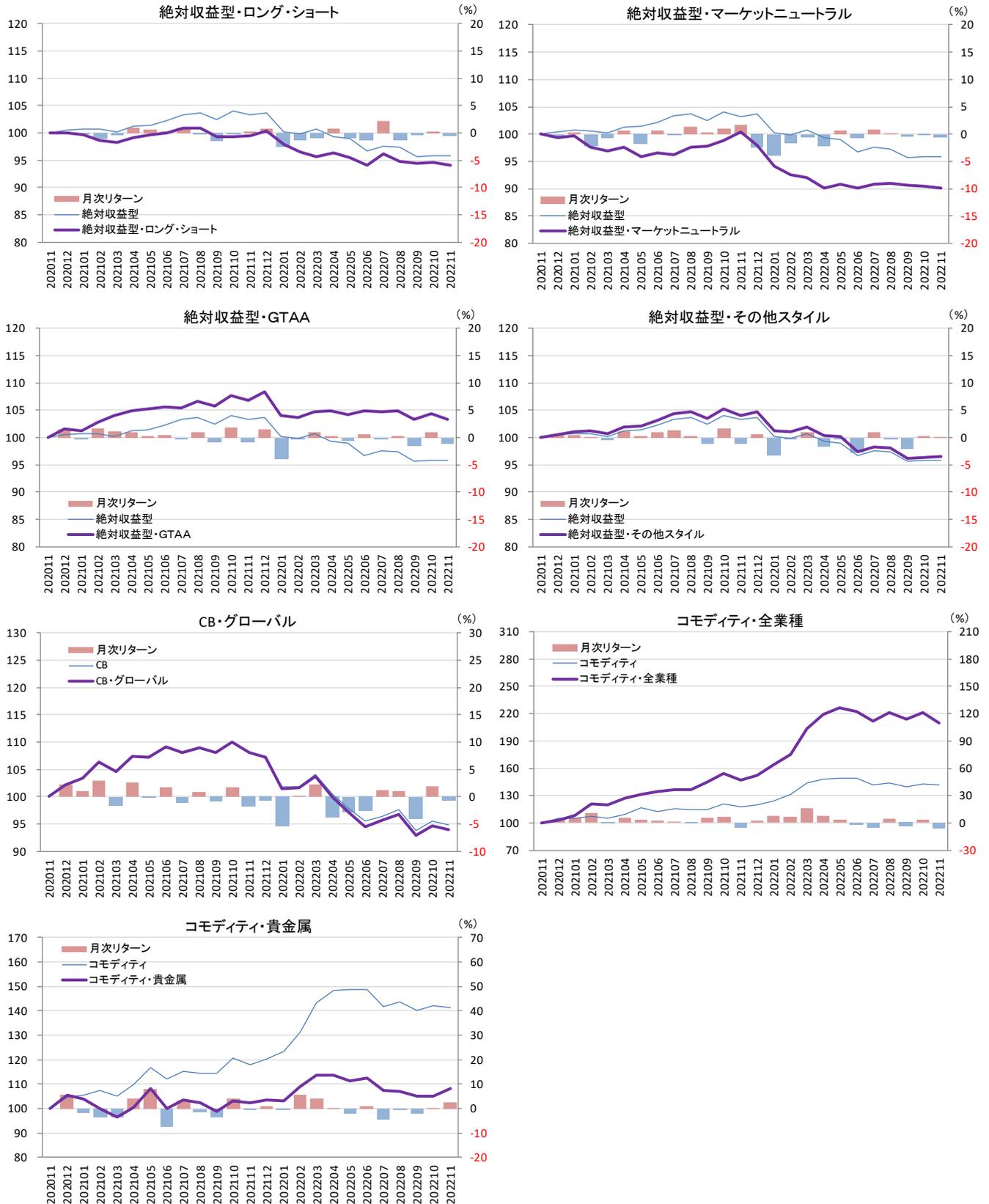


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



＜1＞パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	-1.24		
1	国内株式・一般	2.80	6.81	0.19
2	国内株式・その他	1.99	4.69	0.09
3	エマージング株式・グローバル	4.15	1.03	0.04
4	国内株式・小型	3.46	0.79	0.03
5	複合資産・その他	3.21	0.35	0.01
6	エマージング債券・グローバル	0.76	0.70	0.01
7	ハイイールド債券・その他	2.07	0.22	0.00
8	REIT・その他	1.15	0.35	0.00
9	国内株式・業種特化	3.73	0.08	0.00
10	ブルベア	0.16	0.48	0.00
11	エマージング株式・BRICS	1.32	0.05	0.00
12	絶対収益型	-0.03	1.34	-0.00
13	ハイイールド債券・グローバル	-0.16	0.30	-0.00
14	複合資産・成長	-0.06	2.80	-0.00
15	CB	-0.72	0.21	-0.00
16	エマージング株式・その他	-0.01	2.03	-0.00
17	複合資産・国内バランス	-0.26	0.89	-0.00
18	コモディティ	-0.53	0.56	-0.00
19	REIT・日本	-0.14	3.32	-0.00
20	複合資産・安定	-0.18	4.46	-0.01
21	複合資産・安定成長	-0.40	6.65	-0.03
22	エマージング債券・その他	-4.48	0.56	-0.03
23	国内債券・一般	-0.54	5.00	-0.03
24	外国債券(先進国)・その他	-1.79	1.79	-0.03
25	REIT・グローバル	-1.72	2.02	-0.03
26	ハイイールド債券・北米	-4.00	1.44	-0.06
27	外国債券(先進国)・グローバル	-0.85	7.47	-0.07
28	REIT・北米	-2.58	2.74	-0.07
29	外国株式(先進国)・その他	-4.25	12.92	-0.56
30	外国株式(先進国)・グローバル	-2.46	27.95	-0.69
	合計		100.00	-1.24

◆計算定義

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

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

＜1＞パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	-5.64		
1	国内株式・その他	3.48	4.55	0.24
2	ハイイールド債券・北米	9.93	1.39	0.12
3	エマージング債券・その他	17.18	0.60	0.09
4	コモディティ	20.09	0.54	0.08
5	REIT・日本	2.22	3.25	0.07
6	REIT・北米	0.91	2.92	0.05
7	外国債券(先進国)・その他	2.37	1.92	0.05
8	複合資産・成長	0.91	2.58	0.05
9	国内株式・一般	0.02	6.67	0.04
10	エマージング債券・グローバル	1.61	0.72	0.01
11	ハイイールド債券・その他	3.44	0.25	0.01
12	ハイイールド債券・グローバル	2.57	0.31	0.01
13	REIT・その他	0.64	0.41	0.00
14	国内株式・業種特化	-9.07	0.08	-0.01
15	エマージング株式・BRICS	-14.48	0.06	-0.01
16	CB	-12.27	0.15	-0.02
17	REIT・グローバル	-1.77	2.21	-0.03
18	エマージング株式・その他	-0.12	2.18	-0.03
19	複合資産・国内バランス	-3.14	0.98	-0.03
20	エマージング株式・グローバル	-3.55	1.07	-0.05
21	国内株式・小型	-7.61	0.78	-0.07
22	複合資産・安定成長	-1.50	6.61	-0.08
23	絶対収益型	-7.15	1.34	-0.11
24	複合資産・その他	-21.87	0.42	-0.11
25	ブルベア	-33.60	0.50	-0.19
26	複合資産・安定	-4.79	4.57	-0.24
27	国内債券・一般	-5.20	5.05	-0.29
28	外国債券(先進国)・グローバル	-4.40	7.67	-0.36
29	外国株式(先進国)・その他	-7.84	12.11	-0.73
30	外国株式(先進国)・グローバル	-13.11	28.11	-4.07
	合計		100.00	-5.64

◆計算定義

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

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

<2>リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別①

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	15.72	20.55	91.94	12.97	11.64	11.09	0.39	0.33	0.61
国内株式	23.53	20.64	204.70	15.86	15.86	16.45	0.46	0.24	0.72
一般	23.11	17.73	191.63	15.37	15.69	16.66	0.47	0.21	0.68
フリー	22.49	17.24	191.91	15.74	16.04	17.25	0.45	0.20	0.66
バリュー	24.60	18.72	195.89	14.77	14.93	15.35	0.52	0.24	0.75
小型	19.44	18.78	296.44	20.51	19.47	18.37	0.30	0.18	0.80
その他	24.71	27.35	219.19	16.19	15.73	16.15	0.47	0.32	0.76
日経225	25.22	32.36	234.98	17.65	16.74	16.74	0.44	0.35	0.77
TOPIX	24.60	22.96	206.15	15.12	14.96	15.70	0.51	0.28	0.75
JPX日経400	24.84	23.86	-	15.54	15.14	-	0.50	0.29	-
国内債券	-6.01	-3.80	3.63	1.81	1.80	1.76	-1.12	-0.41	0.21
一般	-6.01	-3.80	3.63	1.81	1.80	1.76	-1.12	-0.41	0.21
外国株式(先進国)	32.89	45.51	168.40	19.33	18.00	16.22	0.52	0.44	0.64
グローバル	30.47	42.72	176.64	19.38	18.10	16.21	0.48	0.41	0.66
除く日本	48.63	65.02	256.72	19.08	17.91	16.81	0.74	0.59	0.81
含む日本	24.90	36.10	156.40	19.87	18.45	16.27	0.39	0.35	0.61
その他	38.97	52.49	151.81	19.69	18.04	16.44	0.59	0.49	0.59
北米	83.85	99.69	240.74	19.87 ↑	19.32	17.63	1.13	0.77	0.74
米国	44.71	68.32	186.97	18.98 ↑	17.84	16.72	0.69	0.62	0.67
カナダ	27.52	27.41	45.02	21.42	18.78	16.18	0.40	0.27	0.23
欧州	24.84	25.87	132.83	20.01	18.23	16.73	0.39	0.26	0.53
ドイツ	23.86	10.79	-	25.23	22.80	-	0.29	0.09	-
イギリス	22.77	14.92	-	19.21	17.78	-	0.37	0.16	-
アジア・オセアニア	12.18	15.20	128.25	15.73	15.02	15.56	0.25	0.19	0.55
オーストラリア	28.58	25.28	96.37	28.43	23.79	20.30	0.31	0.20	0.34
ニュージーランド	32.36	59.52	282.93	20.40	18.21	18.35	0.48	0.54	0.78
複合地域	85.97	48.06	-	39.58	33.56	-	0.58	0.24	-
エマージング株式	25.16	20.91	100.84	19.90	18.04	17.19	0.39	0.22	0.42
グローバル	23.13	24.93	81.95	18.73	18.00	17.23	0.39	0.26	0.36
BRICS	-2.46	3.01	80.08	22.84	20.79	19.88	-0.03	0.03	0.31
その他	27.57	20.70	111.28	20.58	18.47	17.42	0.41	0.21	0.45
欧州	-56.71	-54.59	-39.42	39.51	32.79	27.46	-0.62	-0.44	-0.18
ロシア	-86.30	-83.16	-76.53	59.74	48.03	38.48	-0.81	-0.62	-0.35
アジア・オセアニア	14.55	6.90	84.93	18.23	17.55	16.56	0.26	0.08	0.38
中国	13.98	14.77	188.78	21.74 ↑	21.28 ↑	22.13	0.21	0.13	0.51
インド	57.24	47.34	223.02	25.80	23.39	23.10	0.63	0.35	0.54
インドネシア	28.04	15.28	49.65	30.64	26.82	24.60	0.28	0.11	0.17
タイ	4.86	-2.71	46.35	24.77	21.43	18.88	0.07	-0.02	0.21
フィリピン	-4.19	-15.54	35.71	23.97	20.86 ↑	19.83	-0.06	-0.16	0.16
ベトナム	33.83	23.31	185.87	30.42	26.66	22.33	0.34	0.16	0.50
韓国	39.70	-4.05	43.67	27.62 ↑	24.46 ↑	20.08 ↑	0.43	-0.03	0.18
香港	-8.93	-15.58	37.80	23.27 ↑	21.48 ↑	19.95 ↑	-0.13	-0.15	0.16
中南米	21.98	25.26	37.20	34.82	30.90	26.64	0.20	0.15	0.12
ブラジル	-7.81	-0.68	-3.67	37.96	35.06	32.11	-0.07	-0.00	-0.01
メキシコ	49.73	32.21	-	31.29	28.51	-	0.46	0.20	-
中東・アフリカ	48.73	42.45	131.20	20.61	18.50	17.08	0.69	0.40	0.51
トルコ	64.66	20.87	8.59	36.21 ↑	37.19 ↑	32.34	0.50	0.11	0.03
複合地域	18.08	10.55	72.14	19.11 ↑	17.83	16.18	0.30	0.12	0.35

※[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 カ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	15.72	20.55	91.94	12.97	11.64	11.09	0.39	0.33	0.61
外国債券(先進国)	2.53	2.96	25.27	5.15 ↑	4.53	6.19	0.17	0.14	0.37
グローバル	0.47	1.74	27.21	4.37 ↑	3.84	5.62	0.04	0.10	0.43
除く日本	2.97	4.39	31.06	4.40 ↑	4.06 ↑	6.17	0.23	0.22	0.44
含む日本	-2.01	-0.90	23.39	5.11	4.23	5.29	-0.13	-0.03	0.40
その他	10.19	8.12	25.99	8.45	7.45	8.17	0.39	0.22	0.29
北米	-0.99	0.09	-	5.91 ↑	4.74 ↑	-	-0.05	0.01	-
米国	8.62	12.68	50.16	8.52	7.02	6.82	0.33	0.35	0.61
カナダ	17.24	14.49	23.89	8.14 ↑	7.64	8.80	0.67	0.36	0.25
欧州	-9.10	-10.92	22.20	6.27 ↑	5.52 ↑	7.71	-0.49	-0.41	0.26
イギリス	6.66	2.67	-	10.03 ↑	9.20 ↑	-	0.22	0.06	-
アジア・オセアニア	13.65	8.36	25.22	10.75	9.57	9.76	0.41	0.17	0.23
オーストラリア	13.78	8.14	23.60	10.80	9.62	9.74	0.41	0.17	0.22
ニュージーランド	5.50	6.68	-	9.76	8.99	-	0.19	0.15	-
複合地域	8.75	12.55	32.11	6.74 ↑	5.88	7.87	0.43	0.41	0.36
エマージング債券	5.97	1.74	29.47	11.51	10.86	11.52	0.17	0.04	0.23
グローバル	-0.89	-5.71	18.16	13.59	12.35	11.98	-0.02	-0.09	0.14
米ドル建て	-2.17	-7.17	18.37	14.49	12.91	12.36	-0.05	-0.11	0.14
現地通貨建て	3.05	-0.15	15.72	10.82 ↓	10.96	11.04	0.10	0.00	0.13
その他	15.06	11.33	45.31	10.82	10.50	12.23	0.45	0.21	0.31
ロシア	-86.95	-86.07	-84.48	66.97 ↑	52.61 ↑	40.98	-0.74	-0.62	-0.41
アジア・オセアニア	4.33	7.40	45.26	7.68	6.56	7.62	0.19	0.23	0.50
インド	24.18	22.46	101.93	8.97	8.99	11.80	0.84	0.46	0.62
インドネシア	28.03	27.61	41.71	15.42	14.45	15.57	0.56	0.35	0.23
ブラジル	4.65	-4.29	32.12	19.47	19.58	18.86	0.08	-0.04	0.15
メキシコ	36.29	45.44	60.00	17.99	16.59	15.90	0.61	0.47	0.30
トルコ	-39.10	-48.61	-63.56	27.29	34.14	26.92	-0.56	-0.36	-0.36
複合地域	-4.30	1.97	9.46	13.43	12.01	12.75	-0.11	0.04	0.07
ハイイールド債券	16.50	15.36	73.82	13.17	11.38	11.11	0.40	0.26	0.51
グローバル	7.19	3.86	52.17	12.97	11.31	11.17	0.18	0.07	0.38
北米	22.38	22.79	90.50	13.08	11.36	11.08	0.53	0.37	0.60
その他	1.47	-1.85	43.29	14.82	12.76	12.11	0.03	-0.03	0.30
欧州	3.10	-0.70	50.29	15.81	13.69	13.03	0.07	-0.01	0.32
アジア・オセアニア	-5.85	-7.66	35.54	13.52	11.39	10.76	-0.15	-0.14	0.29
複合地域	16.10	16.02	81.75	10.06 ↑	8.79	9.62	0.51	0.35	0.64
複合資産	6.63	10.52	72.49	7.77	7.05	7.95	0.28	0.29	0.71
安定	0.64	2.78	48.39	5.25	4.83	6.27	0.05	0.12	0.64
安定成長	9.91	14.34	79.56	8.30	7.58	8.33	0.39	0.36	0.72
成長	21.53	26.03	134.34	11.24	10.84	11.02	0.60	0.44	0.81
国内バランス	-7.61	-2.80	29.33	4.33	3.82	5.81	-0.59	-0.14	0.45
安定	-8.54	-3.25	22.38	4.19	3.63	3.31	-0.69	-0.17	0.62
一般	9.95	10.74	68.32	8.42	8.24	9.43	0.39	0.26	0.57

※[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	15.72	20.55	91.94	12.97	11.64	11.09	0.39	0.33	0.61
国内REIT	-1.20	37.59	155.75	17.80	14.70	16.45	-0.02	0.45	0.60
日本	-1.20	37.59	155.75	17.80	14.70	16.45	-0.02	0.45	0.60
外国REIT	19.24	35.83	152.94	21.76	18.61 ↑	16.59	0.28	0.34	0.59
グローバル	13.00	26.84	120.39	22.71	19.25 ↑	16.83	0.18	0.26	0.49
除く日本	16.56	33.85	146.50	23.48	19.81 ↑	17.13	0.22	0.31	0.55
含む日本	11.80	24.85	115.79	22.46	19.07 ↑	16.74	0.17	0.24	0.48
北米	26.42	46.34	185.54	21.23 ↑	18.57 ↑	16.85	0.38	0.43	0.66
その他	7.15	20.65	134.02	22.88	18.95	16.42	0.10	0.20	0.54
欧州	-16.52	-15.80	51.95	24.25 ↑	20.77 ↑	18.84	-0.24	-0.16	0.23
アジア・オセアニア	6.72	22.00	115.62	20.73	17.51	15.77	0.11	0.23	0.51
オーストラリア	8.97	17.50	95.18	36.11	28.94	23.17	0.08	0.11	0.30
複合地域	-0.30	-1.16	65.42	29.81	25.07	20.84	-0.00	-0.01	0.25
複数国	19.28	49.57	214.95	20.16 ↑	17.17	15.54	0.30	0.49	0.78
その他									
絶対収益型	-3.54	-6.45	0.48	3.71	3.17	2.95	-0.31	-0.41	0.02
ロング・ショート	-9.53	-11.37	-11.11	3.37	3.49	3.13	-0.97	-0.67	-0.37
マーケットニュートラル	-4.18	-8.83	33.07	4.85	4.33	5.74	-0.29	-0.41	0.51
GTAA	7.00	8.16	19.84	5.20	4.44	3.52	0.44	0.37	0.52
その他スタイル	-3.41	-6.31	4.81	4.00	3.36	3.78	-0.28	-0.37	0.13
CB	3.26	3.09	36.09	10.45	8.73	7.99	0.11	0.07	0.39
アジア・オセアニア	27.47	27.99	111.48	13.91	12.44	11.96	0.61	0.41	0.65
日本	-2.05	-5.68	42.81	5.24	5.16	6.28	-0.13	-0.22	0.58
グローバル	2.76	2.84	34.41	10.77	8.96	8.06	0.09	0.07	0.37
コモディティ	48.18	48.87	11.65	13.28	11.31	12.64	1.06	0.74	0.09
全業種	82.48	70.65	31.43	22.76	19.18	17.17	0.98	0.59	0.16
貴金属	27.51	34.75	5.54	13.33 ↓	12.01	13.07	0.64	0.52	0.04
エネルギー	96.10	107.64	31.03	42.70	36.91	31.54	0.59	0.43	0.09
その他コモディティ	61.36	55.00	35.13	22.17	18.96	17.07	0.78	0.49	0.18

※[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

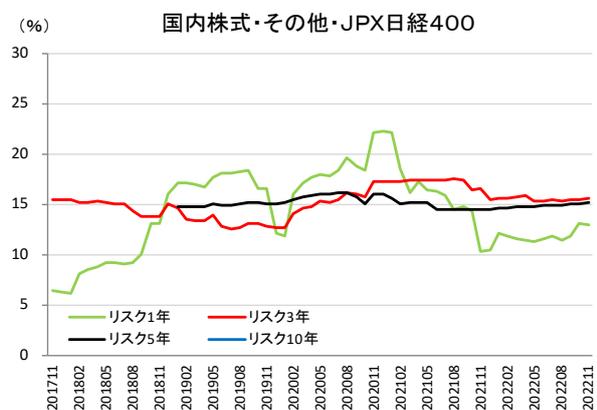
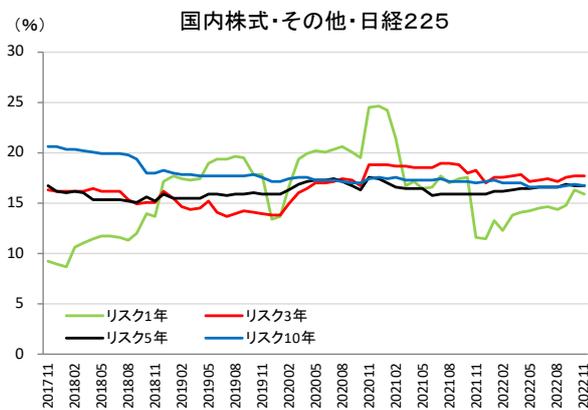
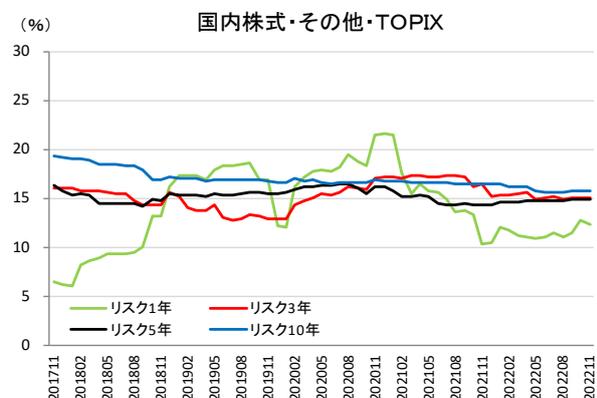
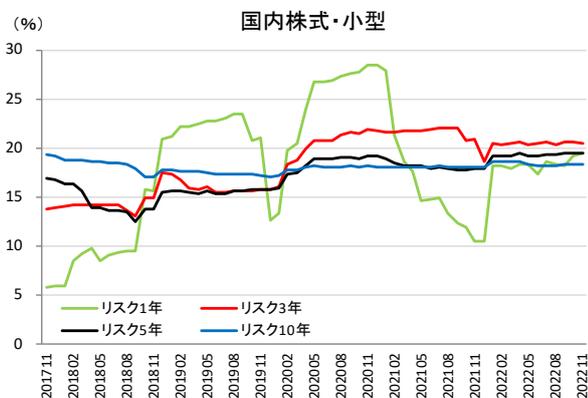
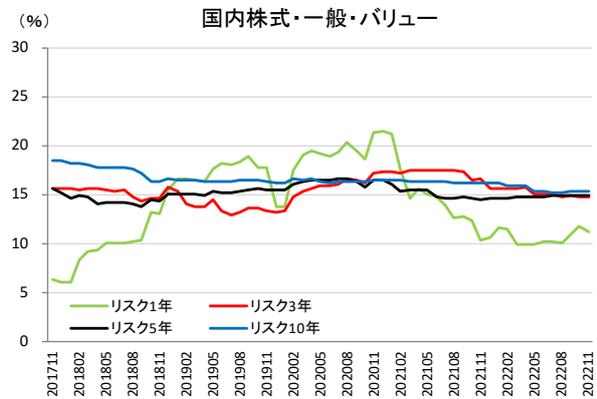
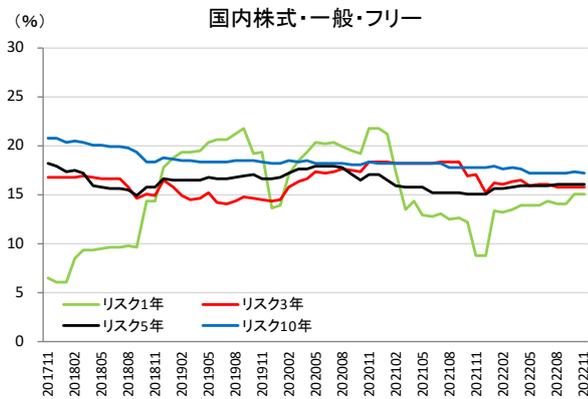
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2>リスク・サマリー

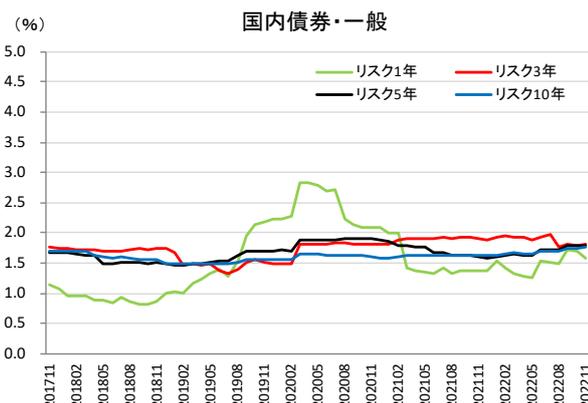
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

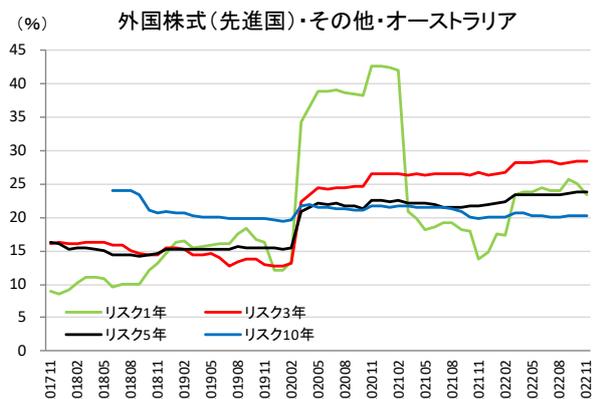
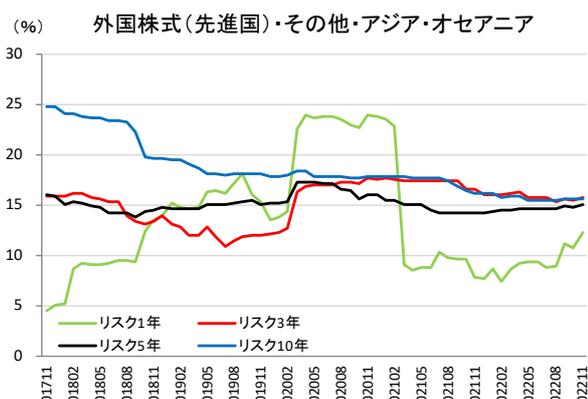
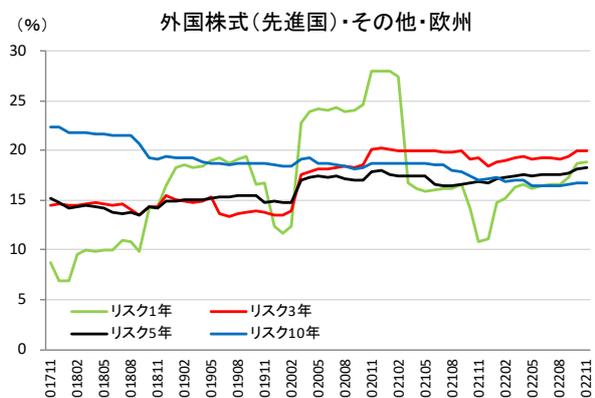
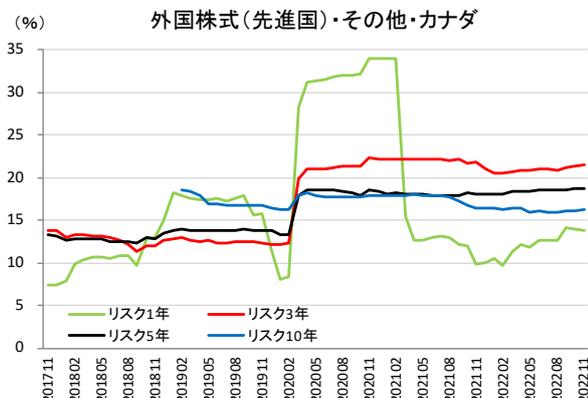
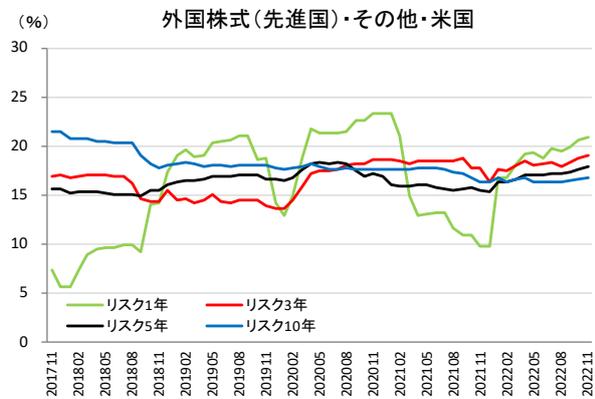
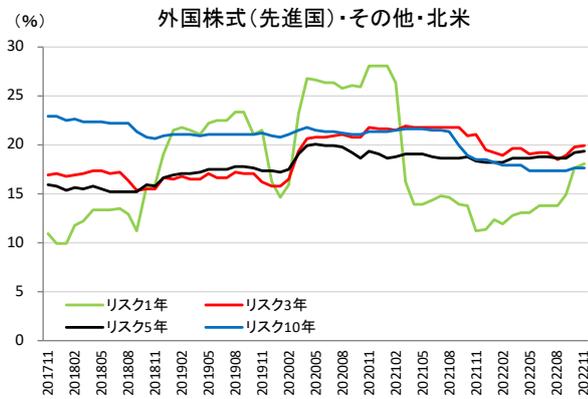
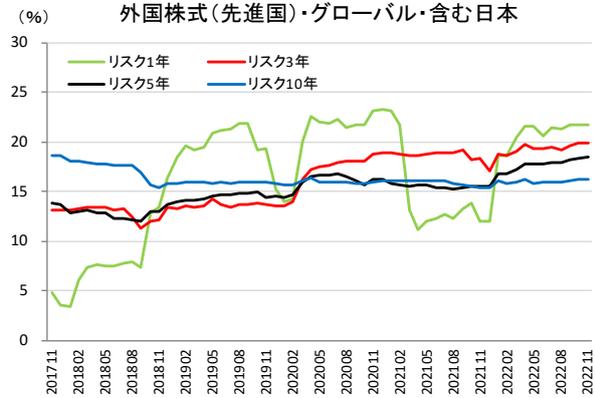
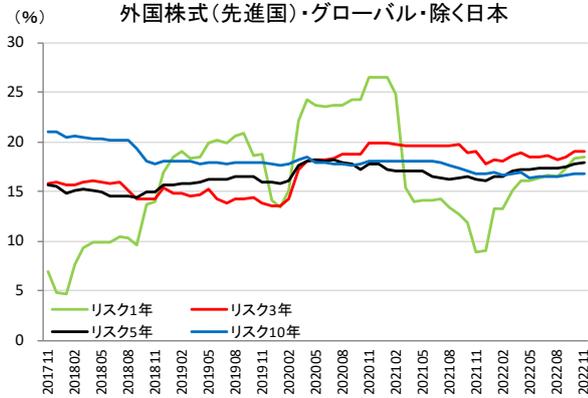


<2> リスク・サマリー

(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)]

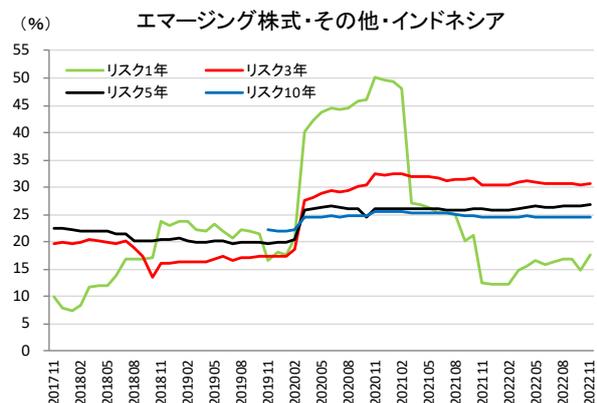
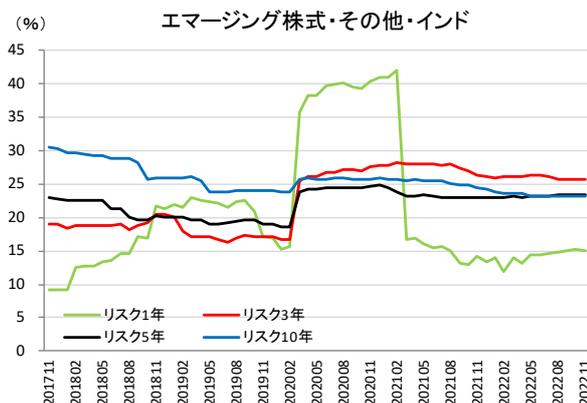
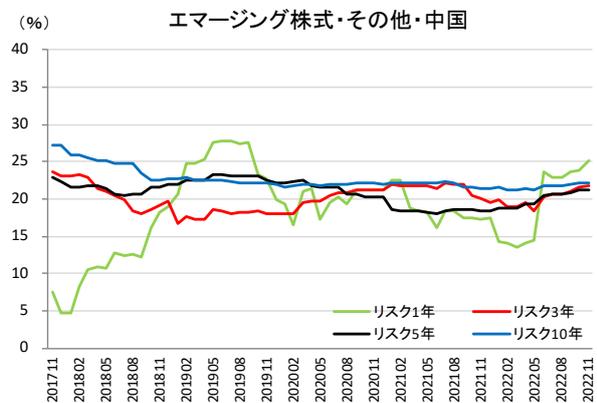
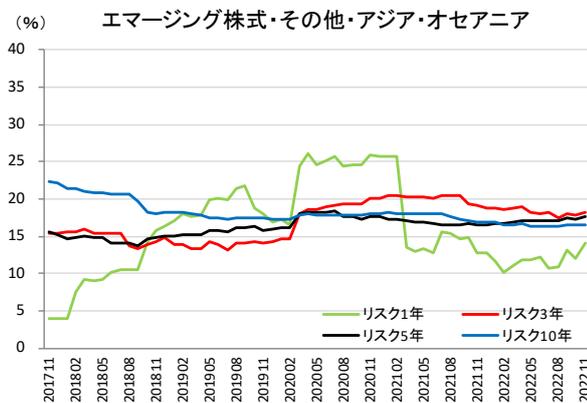
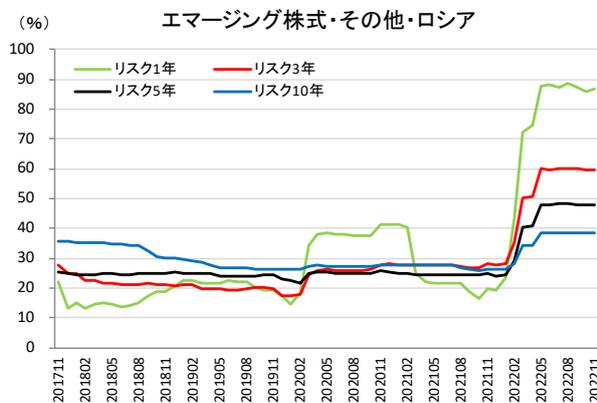
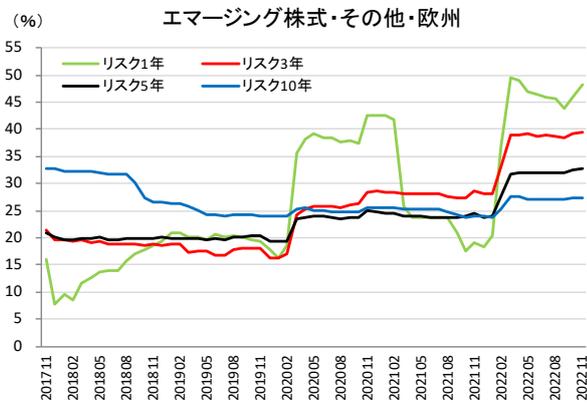
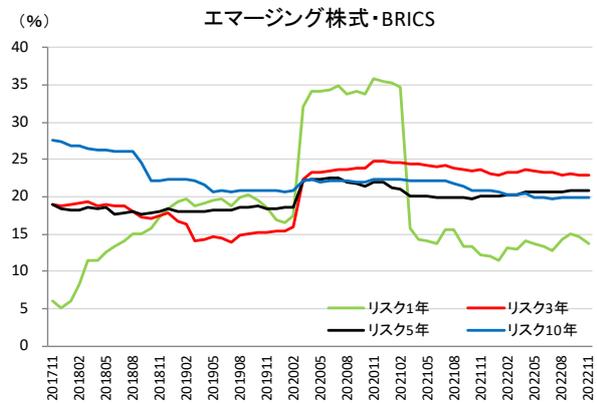
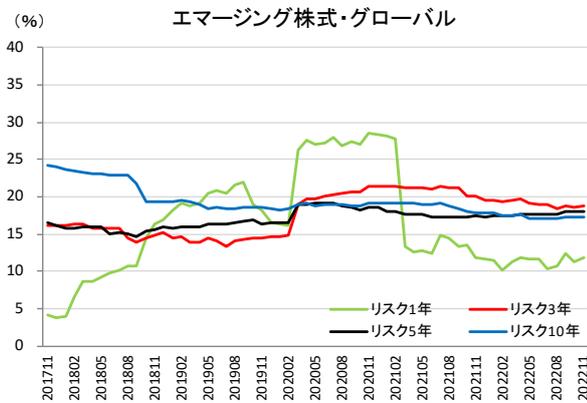


<2> リスク・サマリー

(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]

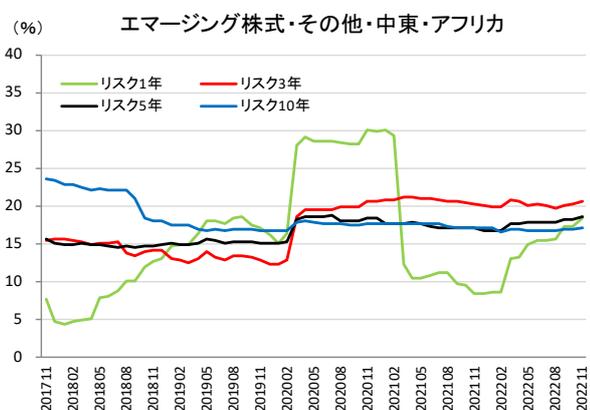
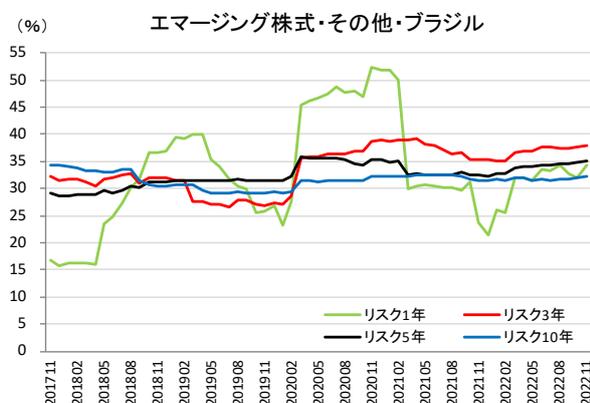
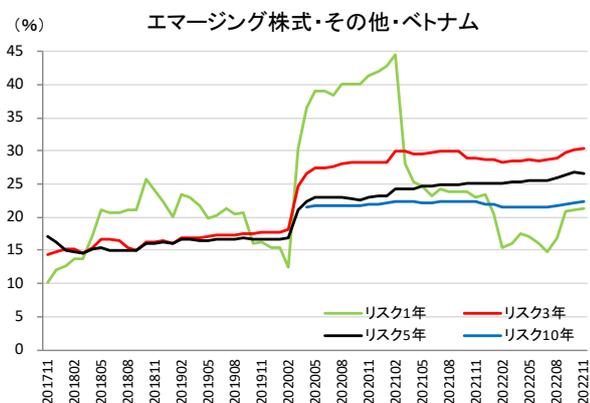
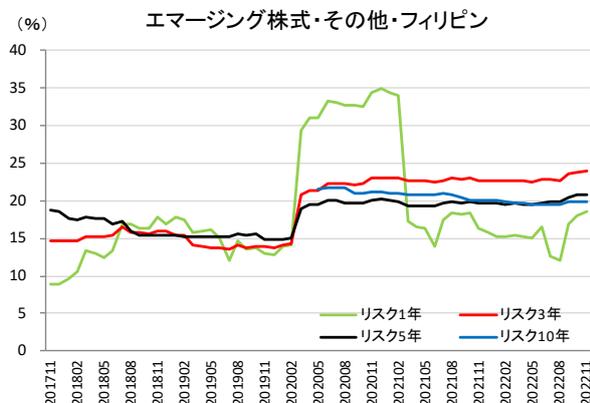
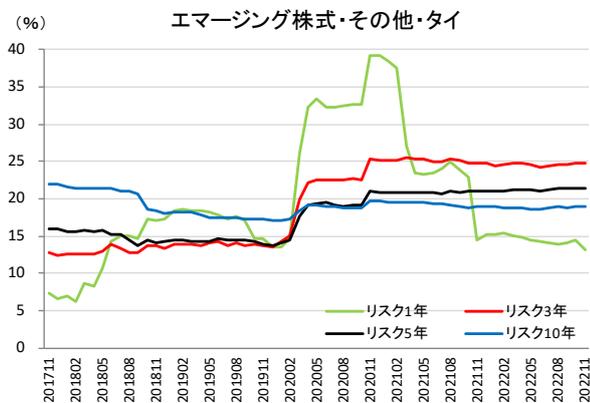


<2> リスク・サマリー

(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]

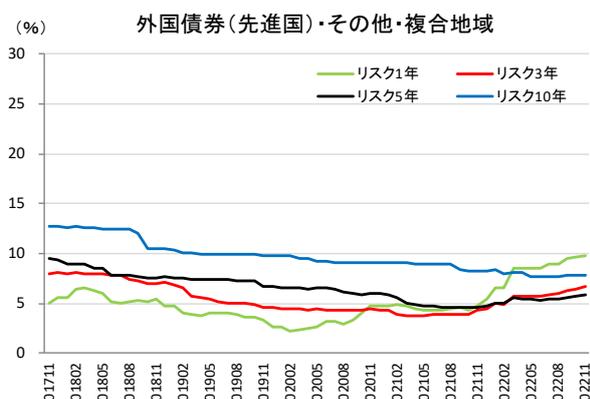
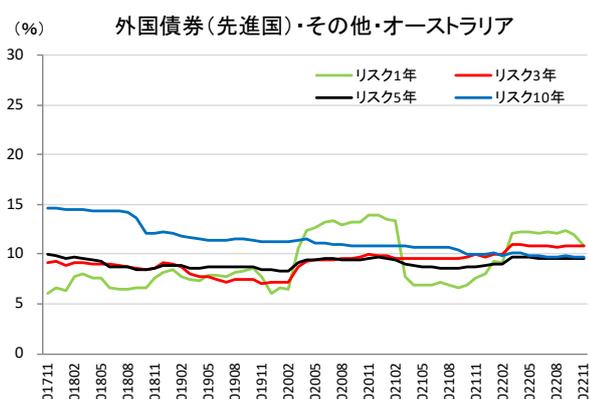
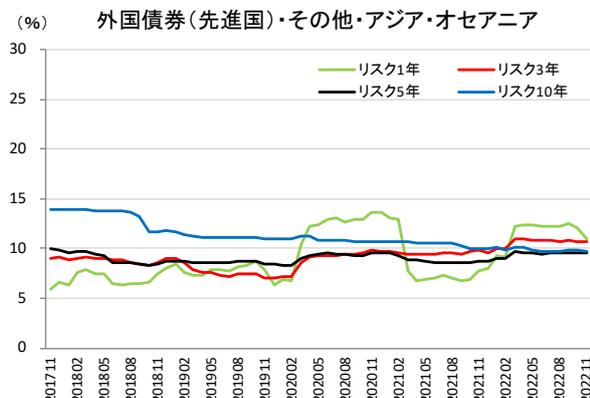
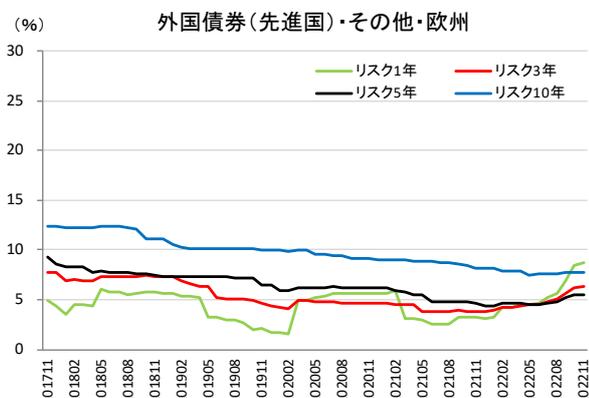
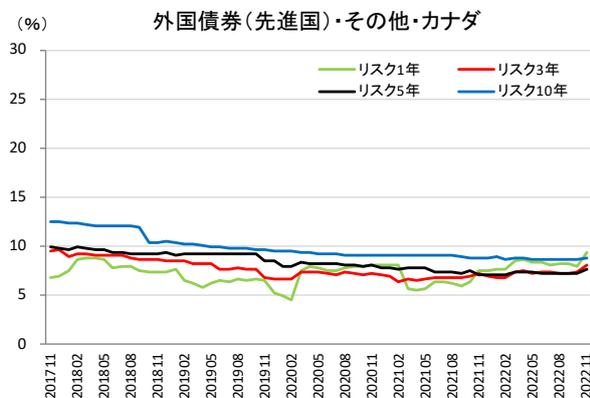
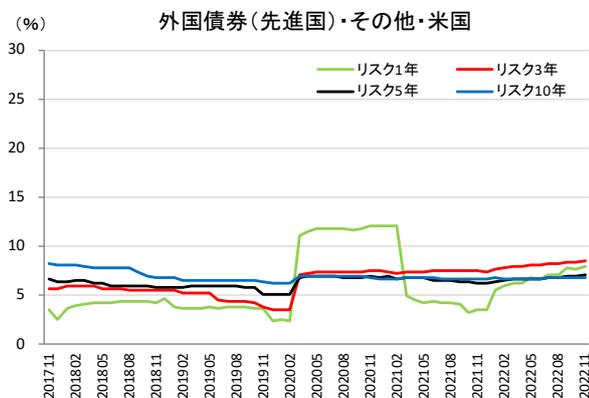
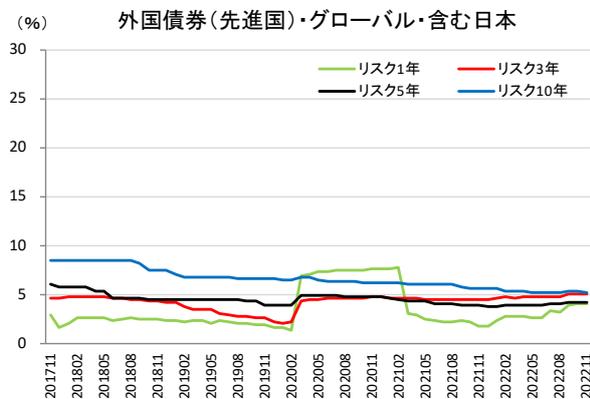
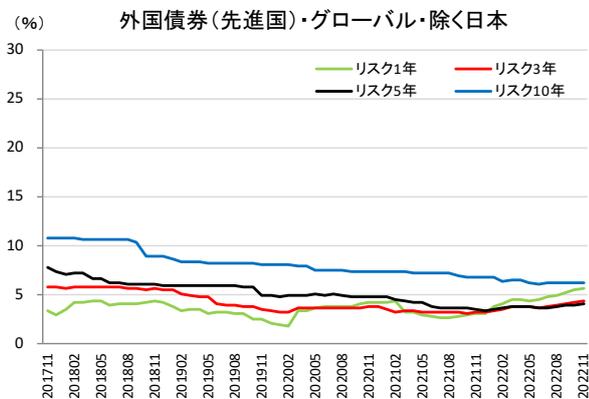


<2> リスク・サマリー

(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)]

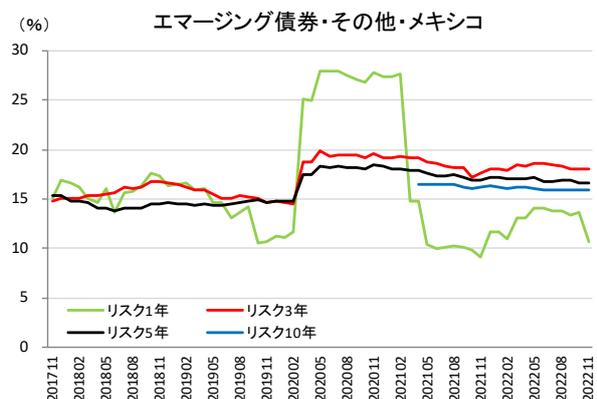
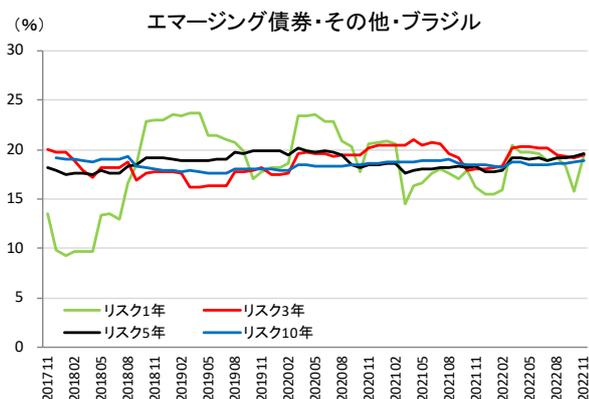
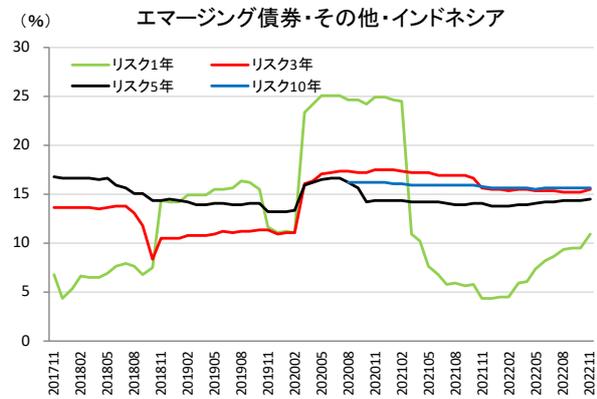
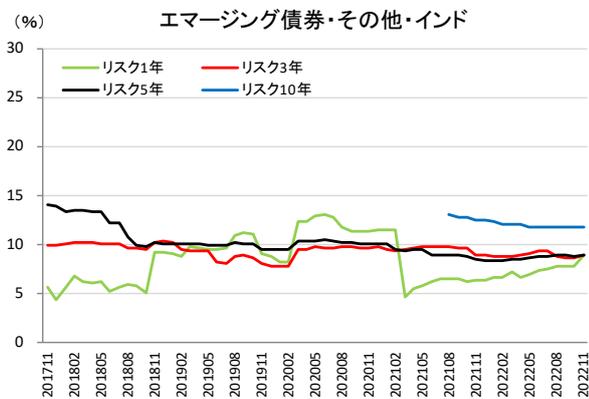
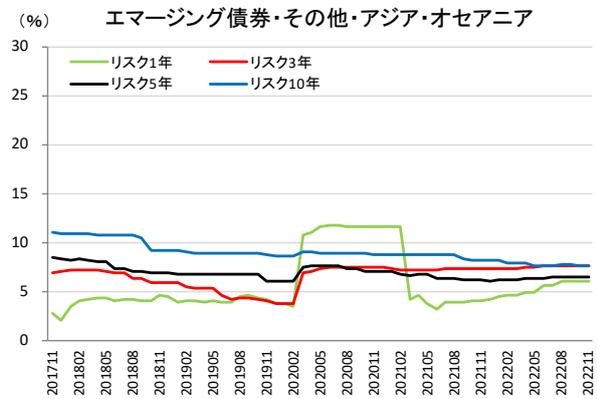
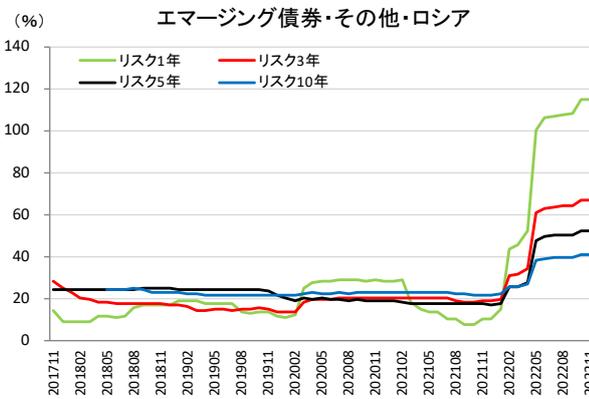
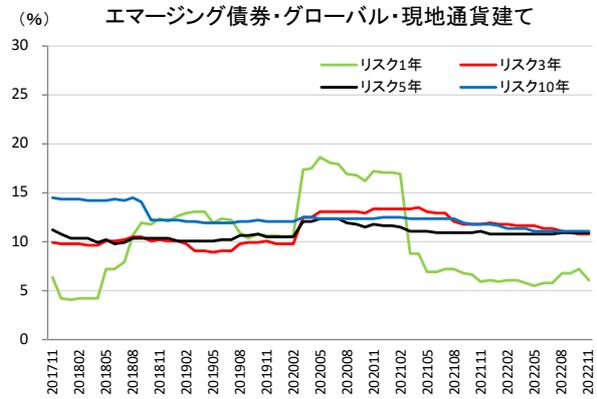
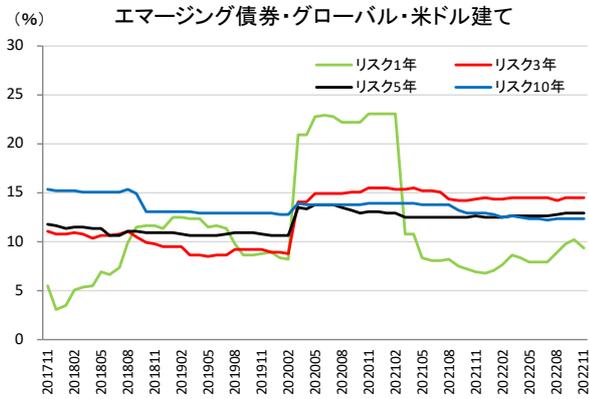


<2> リスク・サマリー

(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]

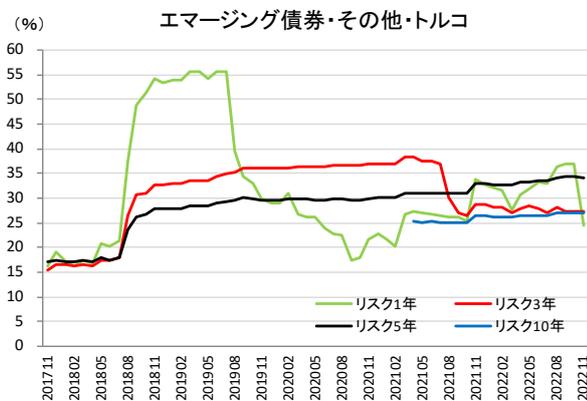


<2> リスク・サマリー

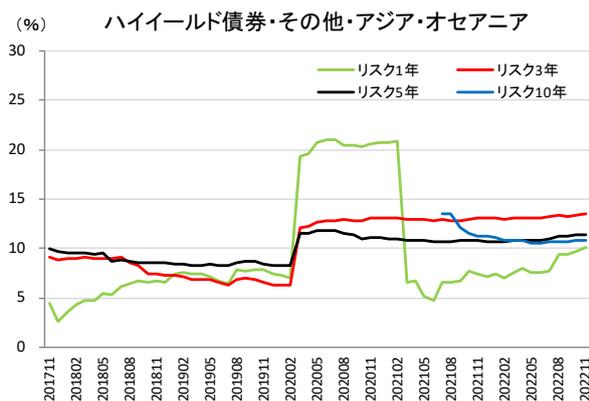
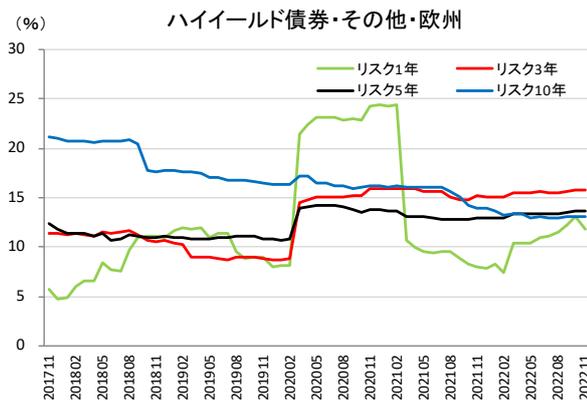
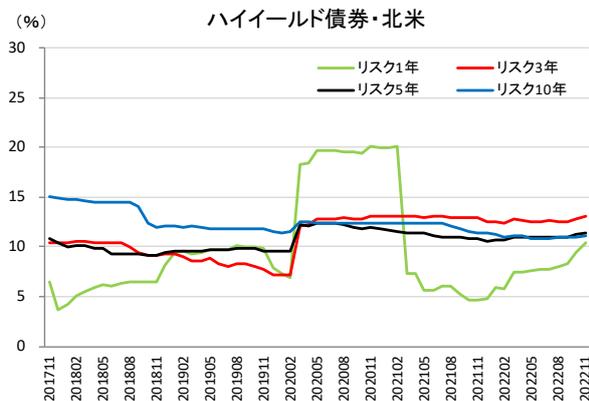
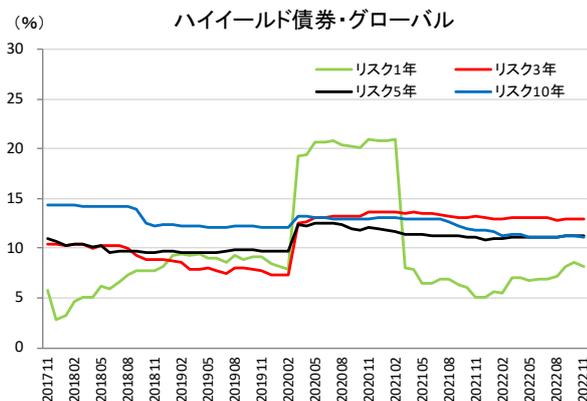
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

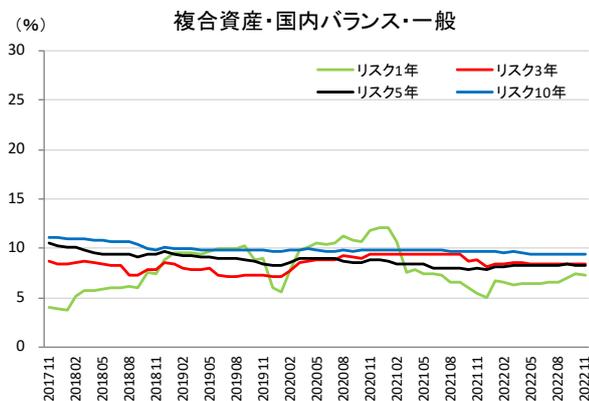
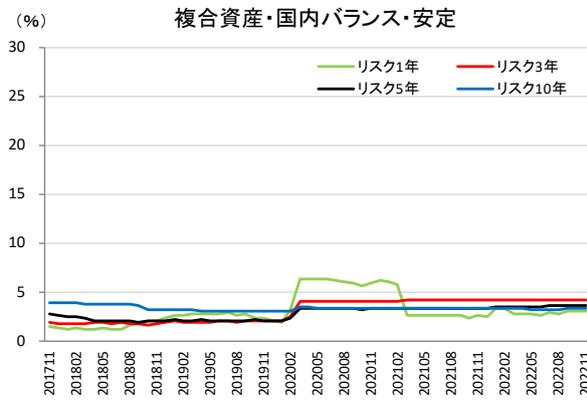
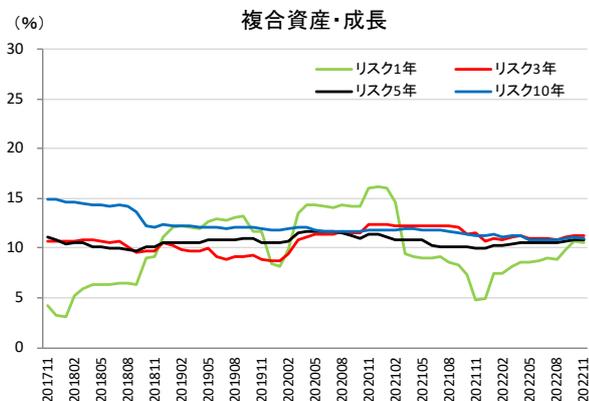
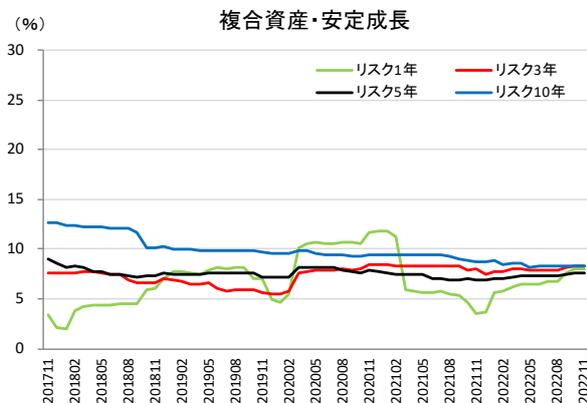
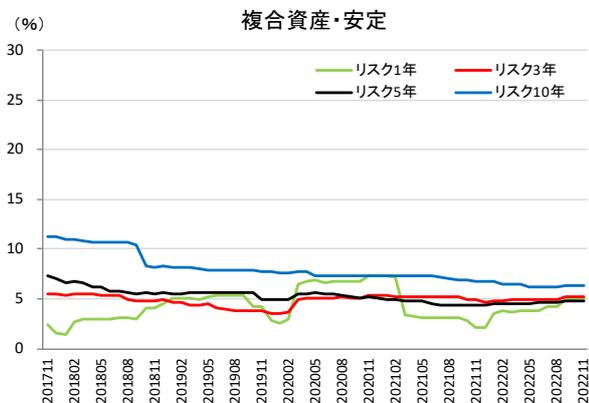


<2>リスク・サマリー

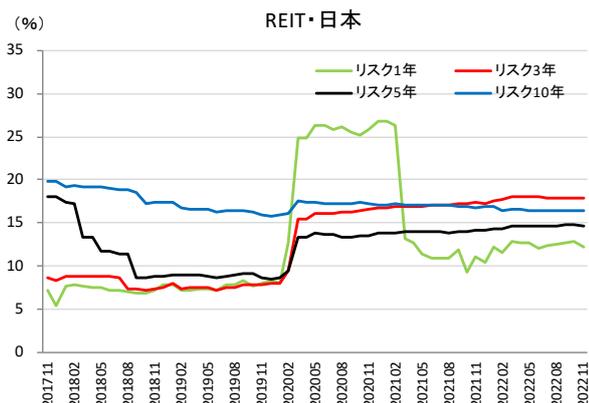
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

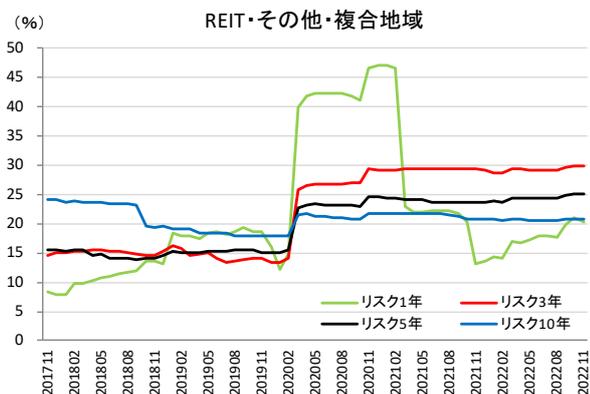
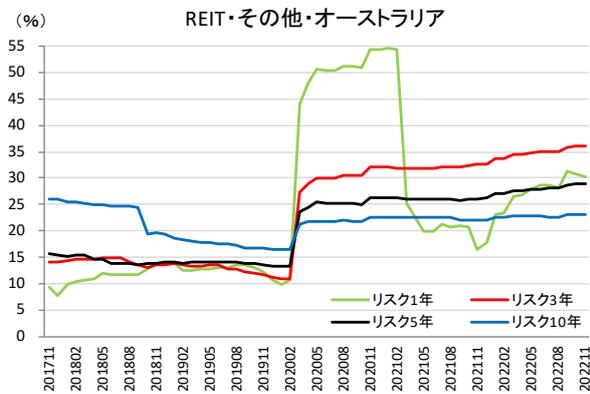
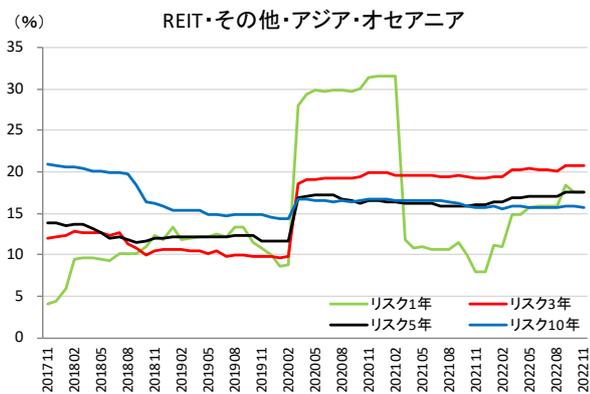
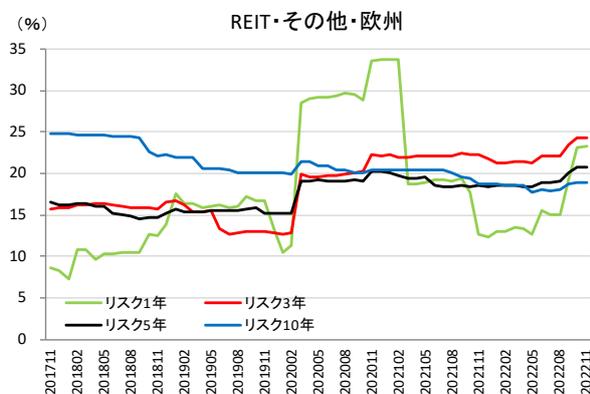
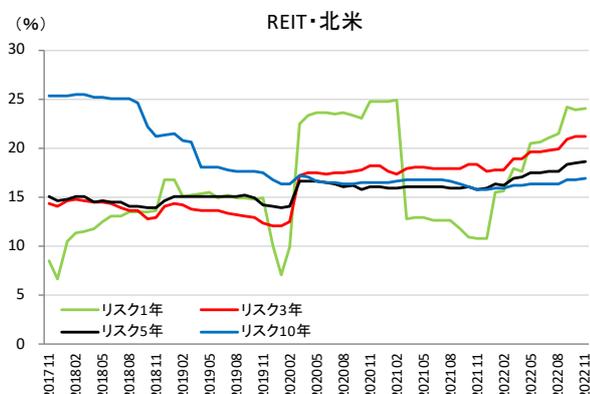
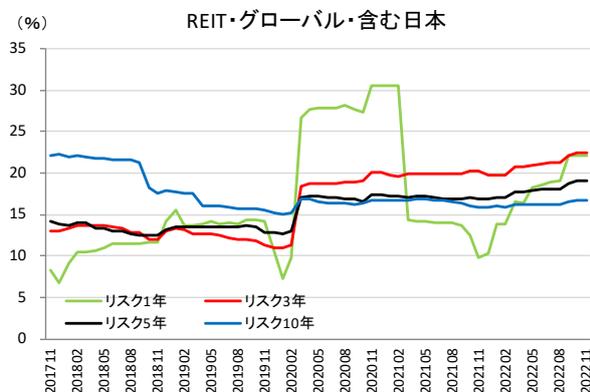
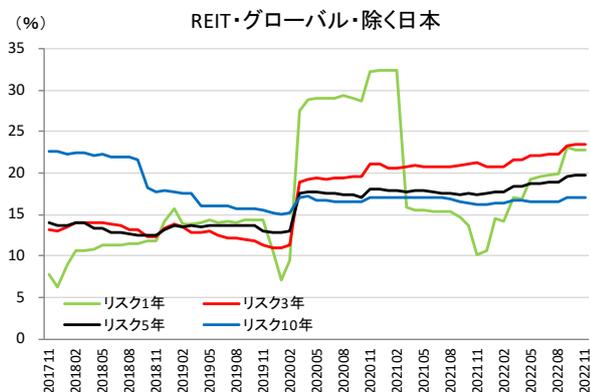


<2> リスク・サマリー

(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]

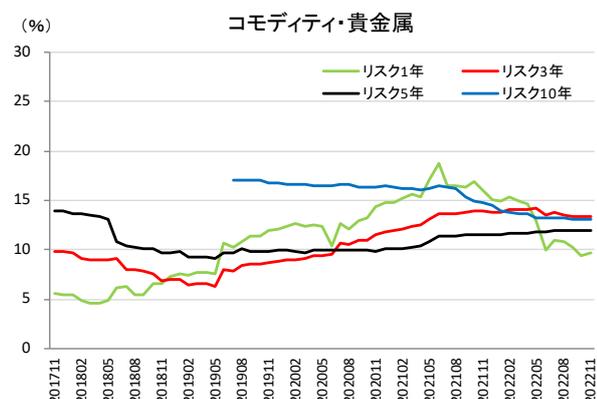
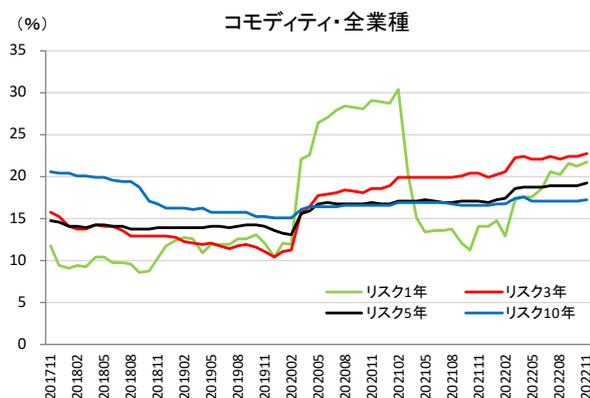
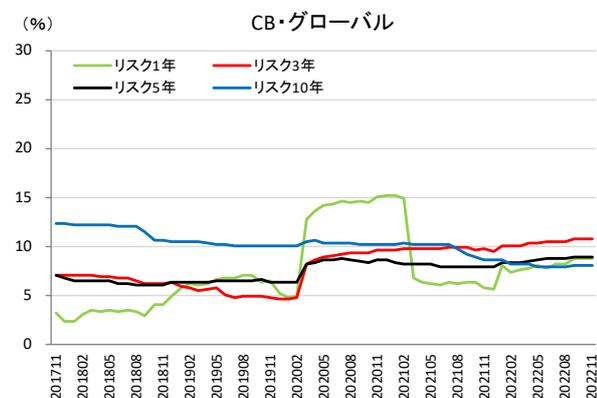
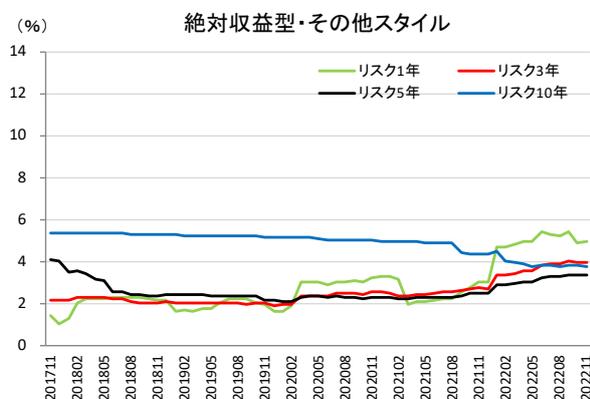
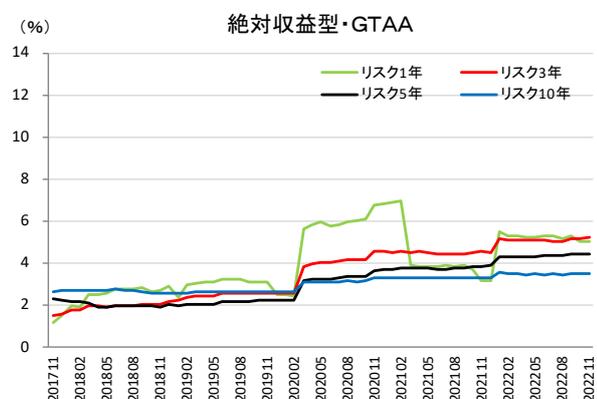
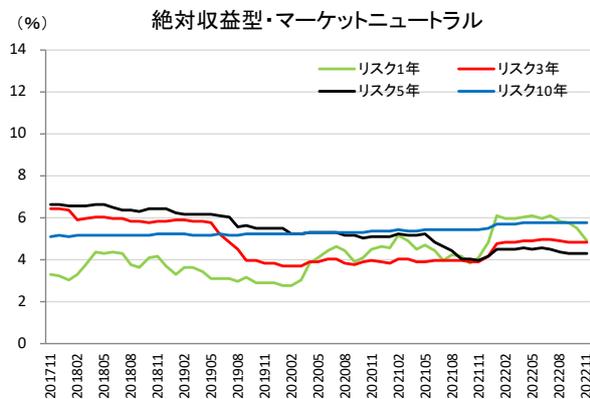
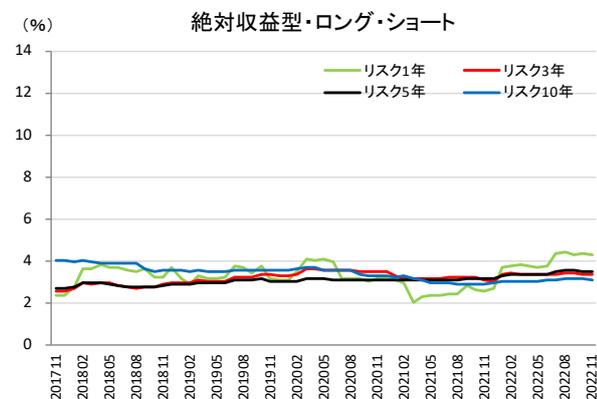


<2> リスク・サマリー

(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	5,570	20,636	39,442	86,444
国内株式	-403	2,204	2,187	6,463
一般	116	1,009	1,795	3,436
フリー	77	800	1,355	2,908
バリュー	39	209	440	528
小型	-8	6	17	140
その他	-509	1,193	386	2,879
日経225	-480	817	116	2,240
TOPIX	-30	273	117	291
JPX日経400	-20	3	-7	40
国内債券	162	865	1,817	3,884
一般	162	865	1,817	3,884
外国株式(先進国)	3,341	11,071	20,753	53,883
グローバル	1,182	4,838	10,331	24,818
除く日本	738	2,462	4,988	9,531
含む日本	443	2,376	5,343	15,288
その他	2,159	6,233	10,422	29,065
北米	424	442	454	485
米国	1,797	5,908	10,218	29,265
カナダ	-2	-7	-15	-36
欧州	-27	-40	-59	-68
ドイツ	0	0	-1	-1
イギリス	0	0	0	0
アジア・オセアニア	0	0	-1	0
オーストラリア	-32	-72	-180	-610
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	0	2	7	32
エマージング株式	208	94	-130	-1,192
グローバル	32	62	158	281
BRICS	-3	-10	-18	-59
その他	180	42	-270	-1,413
欧州	0	0	0	-5
ロシア	0	0	0	-14
アジア・オセアニア	-38	-132	-313	-767
中国	-43	-119	-218	-535
インド	212	287	316	44
インドネシア	10	3	-8	-14
タイ	-1	-1	-2	-4
フィリピン	0	-1	-3	-10
ベトナム	43	48	30	37
韓国	0	0	0	0
香港	0	2	2	3
中南米	0	-3	-5	-10
ブラジル	-1	-35	-52	-127
メキシコ	-1	-2	-4	-6
中東・アフリカ	0	-2	-5	3
トルコ	0	-3	-4	-7
複合地域	0	-1	-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	5,570	20,636	39,442	86,444
外国債券(先進国)	360	249	2,225	2,461
グローバル	320	208	2,424	3,738
除く日本	63	-658	382	535
含む日本	257	866	2,042	3,203
その他	39	41	-199	-1,277
北米	0	0	-2	-7
米国	123	333	456	283
カナダ	-11	-43	-98	-186
欧州	-3	-5	-25	-96
イギリス	0	-1	-1	-3
アジア・オセアニア	-10	-39	-88	-204
オーストラリア	-53	-185	-398	-946
ニュージーランド	0	-1	-4	-13
複合地域	-7	-19	-39	-104
エマージング債券	-42	-254	-331	-1,071
グローバル	-6	-58	46	-96
米ドル建て	-4	-57	29	-110
現地通貨建て	-2	-2	18	14
その他	-37	-195	-378	-975
ロシア	0	0	0	-8
アジア・オセアニア	-2	-8	-17	-37
インド	-5	-43	-104	-329
インドネシア	-2	-5	-10	-44
ブラジル	-20	-116	-217	-434
メキシコ	-3	-13	-34	-76
トルコ	0	0	-1	-2
複合地域	0	-1	-1	-3
ハイイールド債券	262	582	764	224
グローバル	-6	54	44	-24
北米	281	574	812	507
その他	-13	-46	-91	-259
欧州	-14	-44	-84	-223
アジア・オセアニア	0	-1	-6	-33
複合地域	0	-1	-1	-3
複合資産	688	2,933	5,948	12,308
安定	-20	464	940	3,891
安定成長	330	1,317	2,848	5,048
成長	360	1,258	2,495	4,480
国内バランス	1	-112	-287	-752
安定	-88	-273	-507	-998
一般	-3	-5	-9	-19
その他	17	7	-49	-359

<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	5,570	20,636	39,442	86,444
国内REIT	449	1,337	2,750	3,809
日本	449	1,337	2,750	3,809
外国REIT	262	772	1,272	932
グローバル	50	30	81	-401
除く日本	53	27	191	115
含む日本	-4	3	-109	-521
北米	213	758	1,279	1,704
その他	-1	-16	-88	-370
欧州	-1	-1	-4	-14
アジア・オセアニア	5	-1	-49	-240
オーストラリア	-4	-10	-26	-86
複合地域	0	0	-1	-5
複数国	-1	-4	-8	-25
その他	283	782	2,186	4,743
絶対収益型	122	281	662	2,156
ロング・ショート	1	-5	-9	41
マーケットニュートラル	-5	-13	-55	-103
GTAA	5	-8	-2	22
その他スタイル	119	303	724	2,182
CB	-3	5	805	708
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-2
日本	0	-1	-2	-4
グローバル	-3	7	808	715
コモディティ	127	206	278	306
全業種	-4	-33	-224	-299
貴金属	132	251	519	649
エネルギー	-2	-12	-16	-41
その他コモディティ	0	0	0	-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	860,278	100.00	5,373	100.00
国内株式	107,389	12.48	835	15.54
一般	59,278	6.89	535	9.96
フリー	46,389	5.39	436	8.11
バリュー	12,889	1.50	99	1.84
小型	6,911	0.80	91	1.69
その他	40,542	4.71	203	3.78
日経225	20,868	2.43	69	1.28
TOPIX	16,317	1.90	80	1.49
JPX日経400	737	0.09	16	0.30
国内債券	42,996	5.00	141	2.62
一般	42,996	5.00	141	2.62
外国株式(先進国)	349,222	40.59	1,161	21.61
グローバル	238,565	27.73	804	14.96
除く日本	68,114	7.92	192	3.57
含む日本	170,451	19.81	612	11.39
その他	110,657	12.86	357	6.64
北米	681	0.08	11	0.20
米国	104,874	12.19	266	4.95
カナダ	164	0.02	2	0.04
欧州	1,601	0.19	44	0.82
ドイツ	16	0.00	1	0.02
イギリス	9	0.00	3	0.06
アジア・オセアニア	42	0.00	2	0.04
オーストラリア	3,215	0.37	26	0.48
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	42	0.00	1	0.02
エマージング株式	26,977	3.14	312	5.81
グローバル	9,003	1.05	93	1.73
BRICS	461	0.05	7	0.13
その他	17,513	2.04	212	3.95
欧州	58	0.01	6	0.11
ロシア	10	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,460	0.52	88	1.64
中国	1,906	0.22	32	0.60
インド	9,094	1.06	30	0.56
インドネシア	145	0.02	4	0.07
タイ	30	0.00	3	0.06
フィリピン	29	0.00	4	0.07
ベトナム	997	0.12	13	0.24
韓国	5	0.00	1	0.02
香港	15	0.00	1	0.02
中南米	59	0.01	2	0.04
ブラジル	502	0.06	13	0.24
メキシコ	14	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	110	0.01	5	0.09
トルコ	61	0.01	2	0.04
複合地域	17	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	860,278	100.00	5,373	100.00
外国債券(先進国)	79,962	9.29	777	14.46
グローバル	64,588	7.51	529	9.85
除く日本	29,961	3.48	229	4.26
含む日本	34,627	4.03	300	5.58
その他	15,375	1.79	248	4.62
北米	67	0.01	6	0.11
米国	5,365	0.62	139	2.59
カナダ	742	0.09	4	0.07
欧州	1,001	0.12	32	0.60
イギリス	10	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,558	0.18	9	0.17
オーストラリア	5,458	0.63	36	0.67
ニュージーランド	76	0.01	9	0.17
複合地域	1,099	0.13	8	0.15
エマージング債券	10,723	1.25	266	4.95
グローバル	6,033	0.70	188	3.50
米ドル建て	4,473	0.52	143	2.66
現地通貨建て	1,561	0.18	45	0.84
その他	4,690	0.55	78	1.45
ロシア	12	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	247	0.03	6	0.11
インド	2,186	0.25	17	0.32
インドネシア	286	0.03	7	0.13
ブラジル	1,466	0.17	21	0.39
メキシコ	268	0.03	7	0.13
トルコ	59	0.01	4	0.07
複合地域	32	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	16,876	1.96	242	4.50
グローバル	2,594	0.30	33	0.61
北米	12,354	1.44	147	2.74
その他	1,928	0.22	62	1.15
欧州	1,516	0.18	40	0.74
アジア・オセアニア	375	0.04	21	0.39
複合地域	37	0.00	1	0.02
複合資産	131,031	15.23	994	18.50
安定	38,460	4.47	276	5.14
安定成長	57,499	6.68	413	7.69
成長	24,325	2.83	256	4.76
国内バランス	7,685	0.89	33	0.61
安定	7,015	0.82	9	0.17
一般	303	0.04	19	0.35
その他	3,061	0.36	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	860,278	100.00	5,373	100.00
国内REIT	28,870	3.36	135	2.51
日本	28,870	3.36	135	2.51
外国REIT	43,919	5.11	287	5.34
グローバル	17,348	2.02	153	2.85
除く日本	5,576	0.65	65	1.21
含む日本	11,772	1.37	88	1.64
北米	23,500	2.73	78	1.45
その他	3,071	0.36	56	1.04
欧州	116	0.01	10	0.19
アジア・オセアニア	2,111	0.25	30	0.56
オーストラリア	534	0.06	12	0.22
複合地域	56	0.01	3	0.06
複数国	253	0.03	1	0.02
その他	22,313	2.59	223	4.15
絶対収益型	11,657	1.36	104	1.94
ロング・ショート	831	0.10	35	0.65
マーケットニュートラル	539	0.06	15	0.28
GTAA	431	0.05	13	0.24
その他スタイル	9,769	1.14	40	0.74
CB	1,764	0.21	31	0.58
アジア・オセアニア	33	0.00	1	0.02
日本	32	0.00	3	0.06
グローバル	1,699	0.20	27	0.50
コモディティ	4,808	0.56	36	0.67
全業種	1,651	0.19	14	0.26
貴金属	3,066	0.36	20	0.37
エネルギー	71	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	13,162	9.8	2.29	2.52	1.164
国内株式	17,776	13.4	0.66	0.64	1.044
一般	16,487	13.0	0.89	0.86	1.391
フリー	16,042	12.3	0.92	0.89	1.432
バリュー	18,443	16.3	0.81	0.76	1.241
小型	23,603	14.0	0.52	0.57	1.699
その他	18,599	13.8	0.34	0.33	0.417
日経225	19,580	15.3	0.40	0.39	0.481
TOPIX	19,532	14.8	0.12	0.12	0.259
JPX日経400	17,277	8.2	0.06	0.05	0.502
国内債券	10,472	11.7	0.15	0.16	0.438
一般	10,472	11.7	0.15	0.16	0.438
外国株式(先進国)	15,275	7.4	2.25	2.55	1.291
グローバル	15,704	7.2	1.85	1.96	1.360
除く日本	22,378	10.0	0.46	0.48	0.609
含む日本	13,610	6.3	2.42	2.57	1.661
その他	14,307	7.7	3.11	3.80	1.141
北米	15,930	7.1	10.11	9.95	1.634
米国	15,026	6.9	2.88	3.62	1.109
カナダ	6,283	11.7	7.59	7.79	1.990
欧州	13,192	12.0	2.51	2.74	1.597
ドイツ	13,457	8.7	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,351	6.3	10.87	10.11	1.868
アジア・オセアニア	9,839	12.9	5.12	5.41	1.635
オーストラリア	9,911	8.1	9.95	9.35	1.825
ニュージーランド	17,325	10.3	1.77	1.73	1.672
複合地域	12,424	9.6	16.74	11.27	1.705
エマージング株式	13,232	10.4	2.58	2.61	1.659
グローバル	12,759	8.1	0.34	0.35	1.082
BRICS	14,214	16.5	0.76	0.91	2.069
その他	13,406	11.3	3.79	3.82	1.945
欧州	5,582	16.4	0.11	0.11	1.962
ロシア	2,574	13.5	1.04	4.99	1.263
アジア・オセアニア	14,164	12.1	3.27	3.62	1.727
中国	14,150	8.3	0.53	0.65	1.944
インド	17,003	12.0	5.07	4.92	2.057
インドネシア	13,092	12.6	4.70	4.13	1.834
タイ	12,582	10.4	5.99	5.35	1.816
フィリピン	11,189	10.3	0.67	0.66	1.729
ベトナム	13,709	5.4	1.09	1.41	1.921
韓国	12,211	3.9	0.00	0.00	1.804
香港	13,043	13.3	1.65	1.76	0.858
中南米	9,396	15.9	0.00	0.00	2.042
ブラジル	5,646	11.8	4.41	4.04	1.949
メキシコ	11,952	9.7	0.00	0.00	1.881
中東・アフリカ	13,694	11.3	2.99	3.38	2.083
トルコ	12,122	21.3	0.00	0.00	2.030
複合地域	20,951	14.5	1.63	1.77	1.941

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目録見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

<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	13,162	9.8	2.29	2.52	1.164
外国債券(先進国)	9,864	10.2	1.44	1.53	0.985
グローバル	10,300	10.2	1.07	1.14	0.921
除く日本	11,364	12.3	1.02	1.06	0.708
含む日本	9,488	8.5	1.12	1.22	1.106
その他	8,935	10.2	2.96	3.11	1.252
北米	9,822	8.6	2.26	2.48	1.772
米国	9,699	8.8	3.41	3.86	1.216
カナダ	7,131	11.8	1.68	1.59	1.378
欧州	7,355	12.3	1.65	1.75	1.154
イギリス	7,308	7.6	3.83	4.16	1.311
アジア・オセアニア	8,923	12.7	2.61	2.53	1.419
オーストラリア	8,417	13.9	3.16	3.17	1.244
ニュージーランド	9,204	8.4	1.60	1.62	1.358
複合地域	5,281	12.6	2.45	2.44	1.195
エマージング債券	8,547	10.9	4.65	4.48	1.482
グローバル	8,599	11.4	3.32	3.42	1.374
米ドル建て	8,530	11.9	3.51	3.66	1.488
現地通貨建て	8,817	9.9	2.77	2.74	1.048
その他	8,423	9.8	6.38	5.86	1.621
ロシア	992	9.8	1.85	13.19	1.601
アジア・オセアニア	9,333	11.9	6.51	6.91	1.629
インド	9,896	8.1	6.88	6.74	1.702
インドネシア	8,895	10.0	5.91	5.67	1.672
ブラジル	8,767	13.2	6.08	4.80	1.581
メキシコ	7,906	9.7	6.52	5.09	1.397
トルコ	2,091	9.7	7.37	6.60	1.458
複合地域	3,636	16.3	2.40	2.48	1.210
ハイイールド債券	9,066	11.9	5.73	5.68	1.667
グローバル	7,245	11.8	3.68	3.69	1.485
北米	10,390	12.6	5.74	5.57	1.690
その他	6,894	10.1	8.45	9.07	1.765
欧州	7,183	9.6	8.13	8.49	1.739
アジア・オセアニア	6,463	10.6	10.04	11.74	1.865
複合地域	4,394	18.7	5.33	5.46	1.800
複合資産	12,754	9.4	1.11	1.20	0.969
安定	11,247	9.2	0.91	0.96	1.090
安定成長	12,451	9.9	1.40	1.52	0.979
成長	15,259	9.3	0.34	0.36	0.790
国内バランス	11,706	9.4	2.23	2.39	0.942
安定	10,536	11.3	2.36	2.53	0.917
一般	12,280	9.4	1.29	1.33	1.287
その他	8,645	2.7	1.29	1.72	0.760

(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	13,162	9.8	2.29	2.52	1.164
国内REIT	14,469	9.8	8.97	10.44	0.929
日本	14,469	9.8	8.97	10.44	0.929
外国REIT	11,766	8.7	8.13	9.04	1.491
グローバル	12,926	8.5	3.73	4.04	1.267
除く日本	14,377	6.6	2.66	2.98	0.944
含む日本	11,854	9.9	4.24	4.54	1.419
北米	11,084	9.4	11.48	12.86	1.622
その他	9,549	8.4	7.29	7.99	1.757
欧州	6,136	8.8	4.32	5.29	1.820
アジア・オセアニア	10,886	7.8	9.01	9.89	1.807
オーストラリア	9,503	8.1	4.30	4.57	1.701
複合地域	7,182	10.8	0.82	0.94	0.780
複数国	11,203	18.6	2.09	2.14	1.650
その他					
絶対収益型	10,484	6.2	0.05	0.05	1.902
ロング・ショート	10,533	5.1	0.19	0.20	1.459
マーケットニュートラル	9,908	5.9	0.31	0.32	1.303
GTAA	11,034	8.9	0.46	0.53	1.503
その他スタイル	10,421	6.6	0.01	0.00	1.995
CB	11,859	9.6	0.72	0.83	1.226
アジア・オセアニア	9,583	12.4	2.40	2.50	1.823
日本	11,052	11.6	0.66	0.66	0.923
グローバル	12,033	9.2	0.66	0.78	1.220
コモディティ	11,858	7.0	0.74	0.61	0.923
全業種	10,935	10.3	2.12	1.75	1.305
貴金属	11,891	4.4	0.00	0.00	0.717
エネルギー	17,965	13.8	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	17,996	6.2	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