

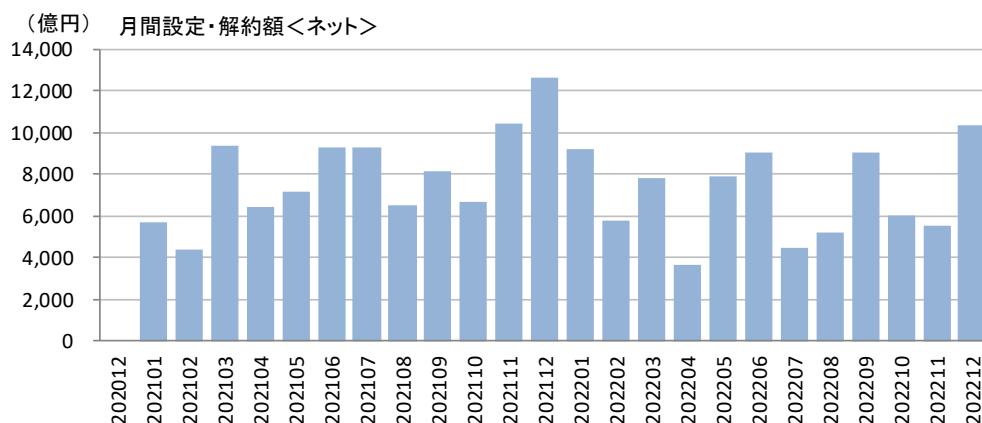
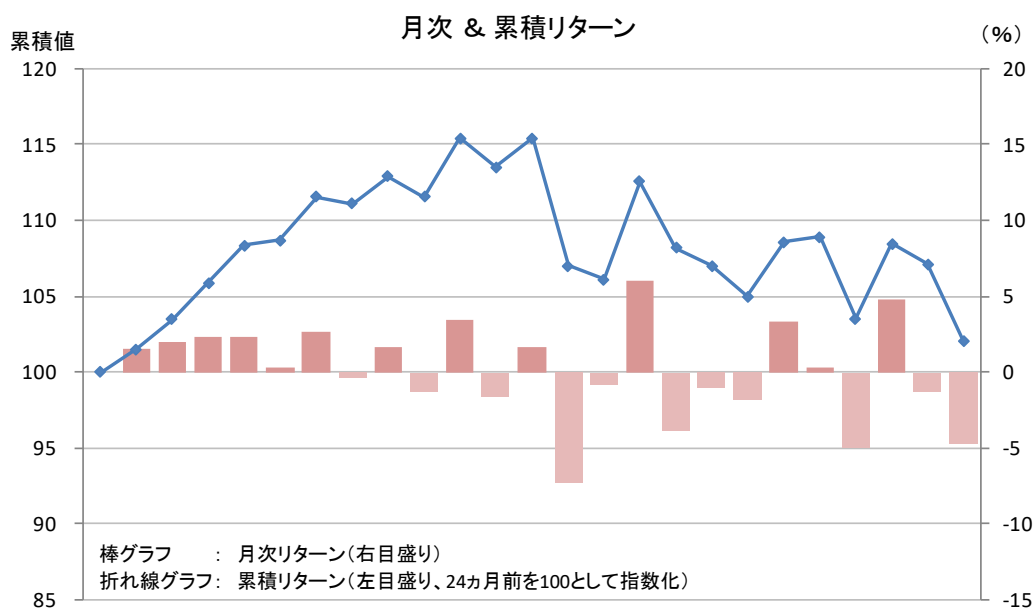
投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2022年12月

「総合」 －4.72 %

(前月 －1.24 %)



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		14,812	15,545	-734	-4.72	
国内株式		19,031	20,140	-1,109	-5.51	
一般		18,564	19,578	-1,014	-5.18	
フリー		17,324	18,309	-985	-5.38	
バリュー		24,430	25,573	-1,143	-4.47	
小型		38,742	41,244	-2,502	-6.07	
その他		18,768	19,933	-1,166	-5.85	
日経225		17,827	19,084	-1,257	-6.59	
TOPIX		18,801	19,705	-904	-4.59	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	17,750	18,620	-871	-4.68	
国内債券		12,382	12,565	-183	-1.45	
一般		12,382	12,565	-183	-1.45	
外国株式(先進国)		18,934	20,135	-1,201	-5.97	
グローバル		20,561	21,805	-1,245	-5.71	
除く日本		32,986	34,999	-2,013	-5.75	
含む日本		17,903	18,983	-1,080	-5.69	
その他		15,526	16,608	-1,082	-6.52	
北米		20,294	21,656	-1,362	-6.29	
米国		24,010	25,701	-1,691	-6.58	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	20,565	21,930	-1,364	-6.22	
欧州		22,540	23,185	-645	-2.78	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	10,756	11,113	-358	-3.22	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	10,734	10,932	-197	-1.81	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	37,230	38,681	-1,451	-3.75	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	19,195	20,513	-1,318	-6.42	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	45,791	45,673	119	0.26	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	13,840	15,230	-1,390	-9.13	
エマージング株式		17,742	18,553	-811	-4.37	
グローバル		17,408	18,059	-651	-3.60	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	22,522	23,357	-834	-3.57	
その他		18,642	19,579	-937	-4.78	
欧州		11,412	11,342	70	0.61	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,320	1,445	-125	-8.62	
アジア・オセアニア		17,183	17,771	-588	-3.31	
中国		39,382	39,112	271	0.69	
インド	10,000 (2004.09.30)	48,051	51,729	-3,678	-7.11	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	15,856	17,065	-1,209	-7.09	
タイ		24,013	23,980	32	0.13	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,437	7,892	-455	-5.77	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	19,398	19,502	-104	-0.53	
韓国	10,000 (1997.06.30)	25,490	27,146	-1,656	-6.10	
香港		21,340	20,599	741	3.60	
中南米	7,427 (2006.04.28)	9,693	10,230	-538	-5.25	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	8,421	8,961	-540	-6.02	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	12,826	13,751	-924	-6.72	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	12,659	13,608	-949	-6.97	
トルコ		39,021	36,277	2,744	7.57	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	23,394	24,365	-970	-3.98	

※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		14,812	15,545	-734	-4.72	
外国債券(先進国)		17,750	18,273	-523	-2.86	
グローバル		17,783	18,259	-476	-2.60	
除く日本		19,213	19,984	-771	-3.86	
含む日本		16,891	17,152	-261	-1.52	
その他		17,813	18,548	-735	-3.96	
北米	9,052 (2013.05.31)	10,159	10,358	-199	-1.92	
米国		16,732	17,347	-615	-3.55	
カナダ	10,000 (2003.05.30)	15,633	16,369	-736	-4.50	
欧州	10,000 (1998.07.31)	13,509	13,874	-365	-2.63	
イギリス	10,069 (2014.07.31)	9,715	10,267	-552	-5.37	
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	19,874	20,786	-912	-4.39	
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	24,505	25,635	-1,131	-4.41	
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	10,883	11,365	-482	-4.24	
複合地域	10,000 (2001.11.30)	17,464	18,216	-752	-4.13	
エマージング債券		17,604	18,158	-554	-3.05	
グローバル		17,810	18,260	-450	-2.46	
米ドル建て		18,163	18,612	-448	-2.41	
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	12,805	13,149	-344	-2.62	
その他	8,647 (2005.03.31)	14,004	14,558	-554	-3.81	
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,201	1,500	-299	-19.93	
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	14,756	15,016	-260	-1.73	
インド	10,000 (2011.08.31)	18,771	19,766	-995	-5.04	
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	16,893	17,408	-514	-2.96	
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	12,782	13,143	-361	-2.75	
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	15,645	16,348	-702	-4.30	
トルコ	10,000 (2011.04.28)	3,762	3,751	11	0.28	
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,250	10,493	-242	-2.31	
ハイイールド債券		24,457	25,349	-892	-3.52	
グローバル	10,000 (1997.06.30)	23,127	23,548	-421	-1.79	
北米		24,697	25,756	-1,059	-4.11	
その他	10,000 (2004.03.31)	22,102	22,549	-447	-1.98	
欧州	10,000 (2006.04.28)	22,410	23,043	-633	-2.75	
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	13,646	13,488	158	1.17	
複合地域	10,000 (2004.03.31)	21,662	22,289	-627	-2.81	
複合資産		18,113	18,753	-639	-3.41	
安定	10,000 (1998.10.30)	15,352	15,766	-414	-2.62	
安定成長		19,943	20,673	-730	-3.53	
成長		24,379	25,419	-1,040	-4.09	
国内バランス		12,232	12,443	-211	-1.69	
安定		12,426	12,633	-207	-1.64	
一般		15,615	16,046	-432	-2.69	
その他	10,000 (2018.10.31)	10,838	12,019	-1,180	-9.82	

※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		14,812	15,545	-734	-4.72	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	34,531	35,820	-1,289	-3.60	
日本	10,000 (2003.10.31)	34,531	35,820	-1,289	-3.60	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	31,177	33,154	-1,978	-5.96	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	25,894	27,432	-1,538	-5.61	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	28,956	30,669	-1,713	-5.59	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	25,692	27,220	-1,528	-5.61	
北米	10,000 (2003.09.30)	32,760	35,054	-2,294	-6.54	
その他	10,000 (2004.04.30)	28,894	29,955	-1,061	-3.54	
欧州	10,000 (2006.12.29)	4,845	4,919	-74	-1.50	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	21,432	22,130	-698	-3.15	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	16,142	16,900	-758	-4.48	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,122	7,419	-297	-4.01	
複数国	10,000 (2004.04.30)	42,255	44,776	-2,521	-5.63	
その他		6,017	6,206	-190	-3.05	
絶対収益型		7,411	7,489	-78	-1.04	
ロング・ショート		8,096	8,172	-76	-0.92	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,290	11,288	2	0.02	
GTAA		11,320	11,518	-198	-1.72	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	6,955	7,030	-75	-1.07	
CB		19,164	19,360	-196	-1.01	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	19,524	19,503	22	0.11	
日本		19,493	19,788	-295	-1.49	
グローバル		33,444	33,791	-347	-1.03	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	11,528	11,612	-85	-0.73	
全業種	10,000 (2004.12.30)	11,256	11,733	-478	-4.07	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	18,819	18,601	218	1.17	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	8,900	9,303	-403	-4.34	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	15,282	16,292	-1,010	-6.20	

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

[色塗りの基準]月次リターン> 総合

<1>パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別①

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来 (%)
総合	-1.42	-2.82	-11.59	-11.59
国内株式	1.65	1.44	-7.31	-7.31
一般	1.65	1.65	-7.35	-7.35
フリー	1.45	1.68	-9.10	-9.10
バリュー	2.38	1.57	-0.91	-0.91
小型	1.76	5.64	-12.68	-12.68
その他	1.63	0.43	-5.98	-5.98
日経225	0.65	-0.34	-7.88	-7.88
TOPIX	3.18	2.31	-2.71	-2.71
JPX日経400	3.53	2.49	-3.16	-3.16
国内債券	-2.16	-3.12	-6.45	-6.45
一般	-2.16	-3.12	-6.45	-6.45
外国株式(先進国)	-2.02	-3.02	-17.74	-17.74
グローバル	-1.37	-2.94	-18.44	-18.44
除く日本	0.42	-0.90	-7.25	-7.25
含む日本	-2.06	-3.73	-21.96	-21.96
その他	-3.41	-3.15	-16.01	-16.01
北米	2.04	2.06	8.17	8.17
米国	-3.75	-3.24	-16.92	-16.92
カナダ	-2.62	-4.80	-1.85	-1.85
欧州	9.38	2.02	-9.15	-9.15
ドイツ	16.85	7.11	-4.41	-4.41
イギリス	8.46	1.57	10.07	10.07
アジア・オセアニア	1.47	-5.03	-7.10	-7.10
オーストラリア	1.23	-2.49	4.17	4.17
ニュージーランド	5.60	7.80	-0.16	-0.16
複合地域	2.60	5.61	48.35	48.35
エマージング株式	-2.62	-4.63	-6.85	-6.85
グローバル	0.50	-4.86	-8.46	-8.46
BRICS	-1.24	-5.74	-17.10	-17.10
その他	-4.20	-4.51	-5.77	-5.77
欧州	22.45	8.78	-60.11	-60.11
ロシア	-7.67	-10.63	-90.10	-90.10
アジア・オセアニア	0.16	-7.89	-10.97	-10.97
中国	-2.10	-16.17	-16.55	-16.55
インド	-5.67	2.66	2.30	2.30
インドネシア	-11.63	-4.38	13.23	13.23
タイ	6.75	4.97	15.56	15.56
フィリピン	6.80	-1.88	-7.05	-7.05
ベトナム	-14.76	-20.64	-19.00	-19.00
韓国	8.20	-7.65	-28.36	-28.36
香港	5.89	-11.59	0.80	0.80
中南米	-2.38	6.14	27.96	27.96
ブラジル	-6.39	2.13	24.24	24.24
メキシコ	4.42	5.55	19.27	19.27
中東・アフリカ	-7.76	-7.22	0.18	0.18
トルコ	52.23	79.31	102.34	102.34
複合地域	0.67	-5.35	-11.75	-11.75

※[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	-1.42	-2.82	-11.59	-11.59
外国債券(先進国)	-2.34	-3.86	-6.80	-6.80
グローバル	-1.98	-3.64	-7.51	-7.51
除く日本	-3.40	-5.41	-7.44	-7.44
含む日本	-0.75	-2.08	-7.66	-7.66
その他	-3.84	-4.78	-4.07	-4.07
北米	-1.87	-3.40	-9.80	-9.80
米国	-4.04	-4.64	-5.69	-5.69
カナダ	-7.00	-7.25	1.52	1.52
欧州	2.22	-3.58	-12.59	-12.59
イギリス	3.49	-7.22	-8.12	-8.12
アジア・オセアニア	-3.87	-4.46	-1.72	-1.72
オーストラリア	-4.19	-4.60	-1.94	-1.94
ニュージーランド	-0.24	-3.92	-4.68	-4.68
複合地域	-4.62	-6.25	-6.24	-6.24
エマージング債券	-2.21	-0.78	2.91	2.91
グローバル	0.77	-0.03	-3.25	-3.25
米ドル建て	1.37	0.09	-4.78	-4.78
現地通貨建て	-0.90	-0.40	1.51	1.51
その他	-5.84	-1.81	10.56	10.56
ロシア	0.17	-8.12	-89.08	-89.08
アジア・オセアニア	-2.88	-3.06	-0.64	-0.64
インド	-7.36	-4.36	3.51	3.51
インドネシア	-7.25	-4.19	6.12	6.12
ブラジル	-5.39	1.11	29.80	29.80
メキシコ	-0.31	4.61	21.91	21.91
トルコ	2.47	17.46	25.27	25.27
複合地域	0.76	2.06	-5.21	-5.21
ハイイールド債券	-1.94	0.40	1.35	1.35
グローバル	0.62	0.07	-1.54	-1.54
北米	-3.13	0.32	2.61	2.61
その他	2.50	1.86	-1.18	-1.18
欧州	3.23	2.56	-0.84	-0.84
アジア・オセアニア	-0.02	-0.73	-2.40	-2.40
複合地域	-0.05	0.43	-2.48	-2.48
複合資産	-0.86	-2.72	-7.69	-7.69
安定	-1.27	-2.74	-8.07	-8.07
安定成長	-0.86	-2.65	-6.77	-6.77
成長	0.13	-1.49	-5.60	-5.60
国内バランス	-1.82	-2.55	-5.58	-5.58
安定	-1.98	-2.73	-5.76	-5.76
一般	0.26	-0.51	-5.13	-5.13
その他	-0.25	-12.46	-31.73	-31.73

※[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	-1.42	-2.82	-11.59	-11.59
国内REIT	-2.11	-1.88	-4.53	-4.53
日本	-2.11	-1.88	-4.53	-4.53
外国REIT	-1.77	-9.19	-11.78	-11.78
グローバル	-0.78	-9.06	-12.43	-12.43
除く日本	-0.73	-9.32	-13.04	-13.04
含む日本	-0.80	-8.94	-12.16	-12.16
北米	-2.70	-9.39	-11.93	-11.93
その他	-0.23	-8.27	-7.08	-7.08
欧州	12.15	-7.91	-19.74	-19.74
アジア・オセアニア	-2.24	-9.79	-4.57	-4.57
オーストラリア	6.34	-2.69	-12.17	-12.17
複合地域	5.89	-2.12	-0.31	-0.31
複数国	-2.45	-7.76	-11.13	-11.13
その他	-0.91	-3.99	-12.80	-12.80
絶対収益型	-0.80	-1.83	-8.47	-8.47
ロング・ショート	-1.29	-1.02	-7.09	-7.09
マーケットニュートラル	-0.53	-0.03	-8.01	-8.01
GTAA	-1.77	-3.18	-6.30	-6.30
その他スタイル	-0.69	-1.94	-8.79	-8.79
CB	0.05	-1.76	-12.63	-12.63
アジア・オセアニア	-6.82	-8.99	-3.40	-3.40
日本	-0.45	-0.21	-3.75	-3.75
グローバル	0.20	-1.56	-13.24	-13.24
コモディティ	0.36	-5.51	16.85	16.85
全業種	-5.98	-9.86	32.17	32.17
貴金属	3.99	-2.81	5.51	5.51
エネルギー	-3.98	-17.24	40.36	40.36
その他コモディティ	-4.25	-5.02	27.01	27.01

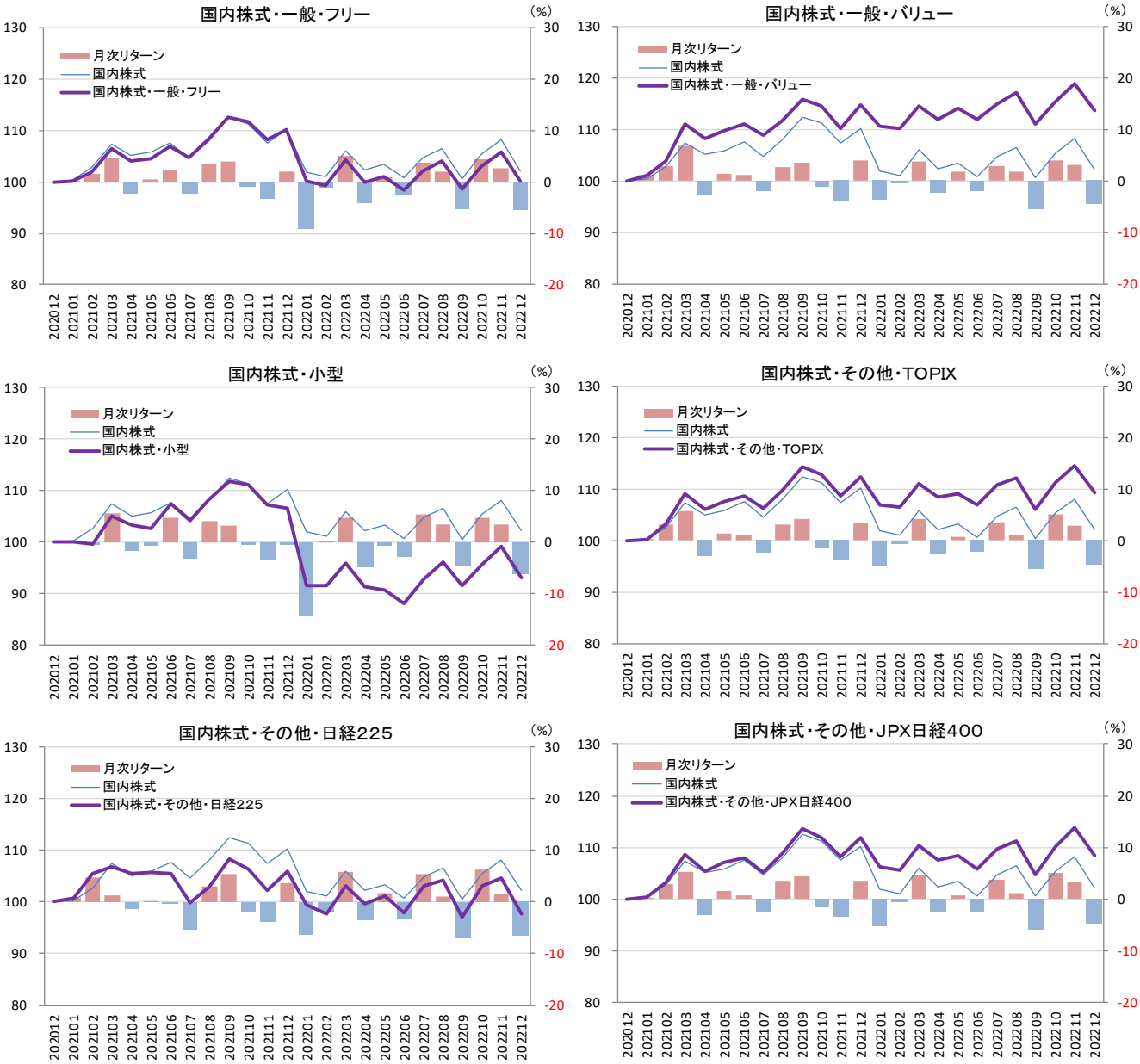
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

＜1＞パフォーマンス・サマリー

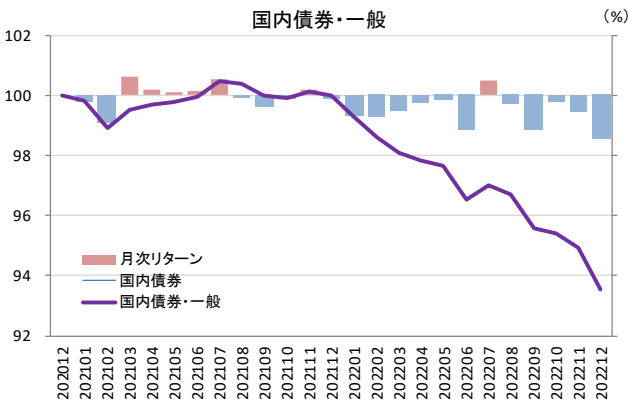
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

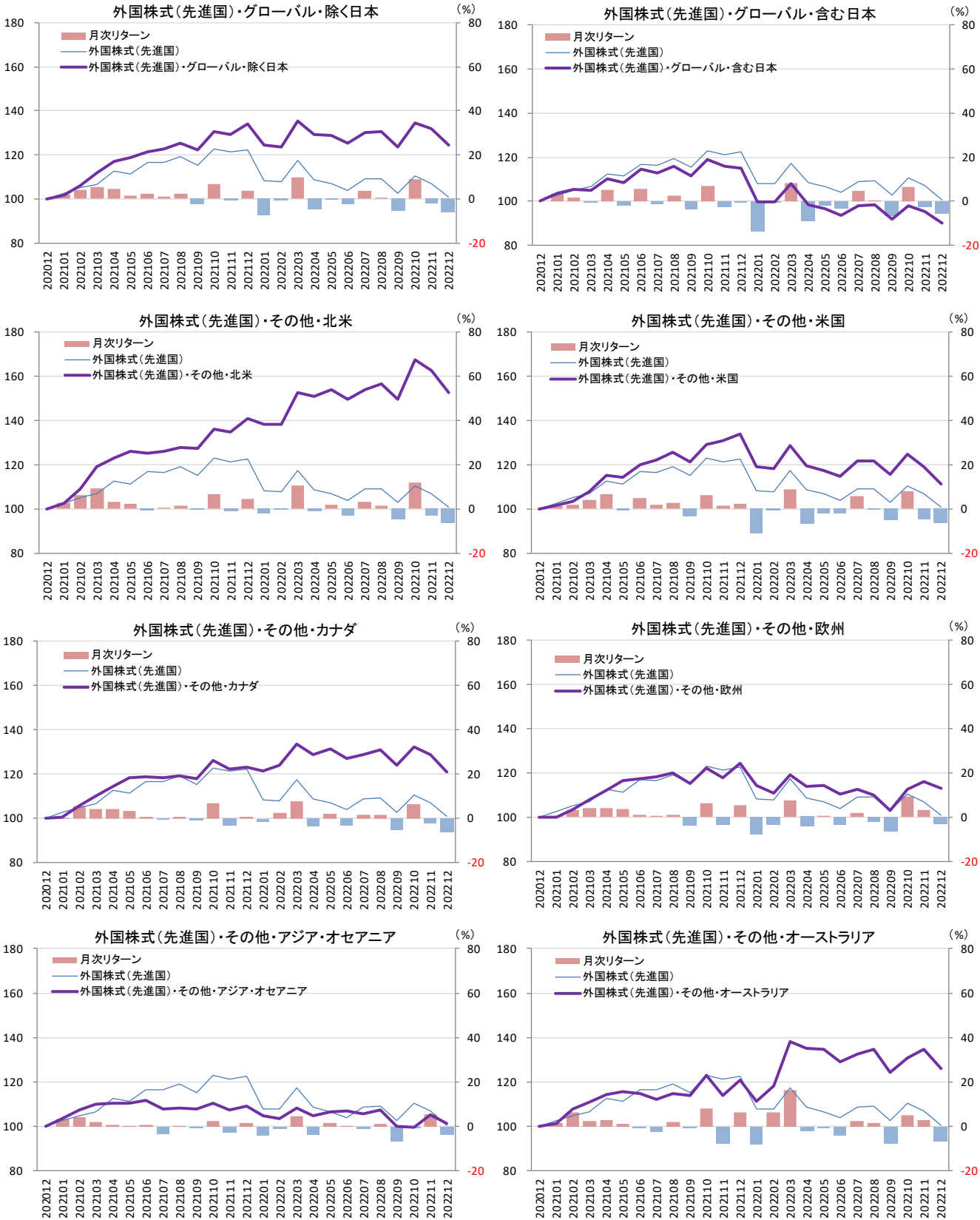


< 1 > パフォーマンス・サマリー

(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)]

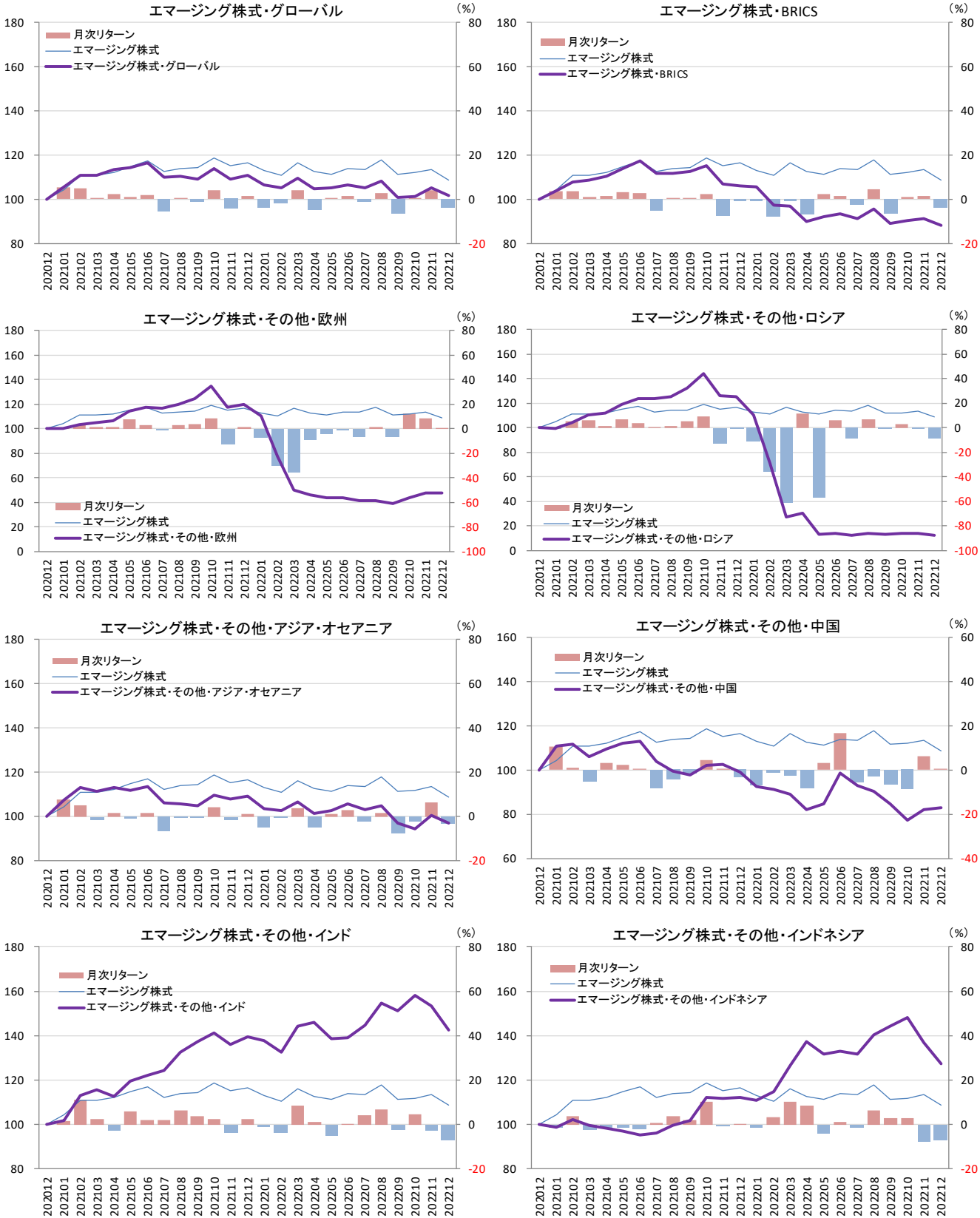


＜1＞パフォーマンス・サマリー

(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]

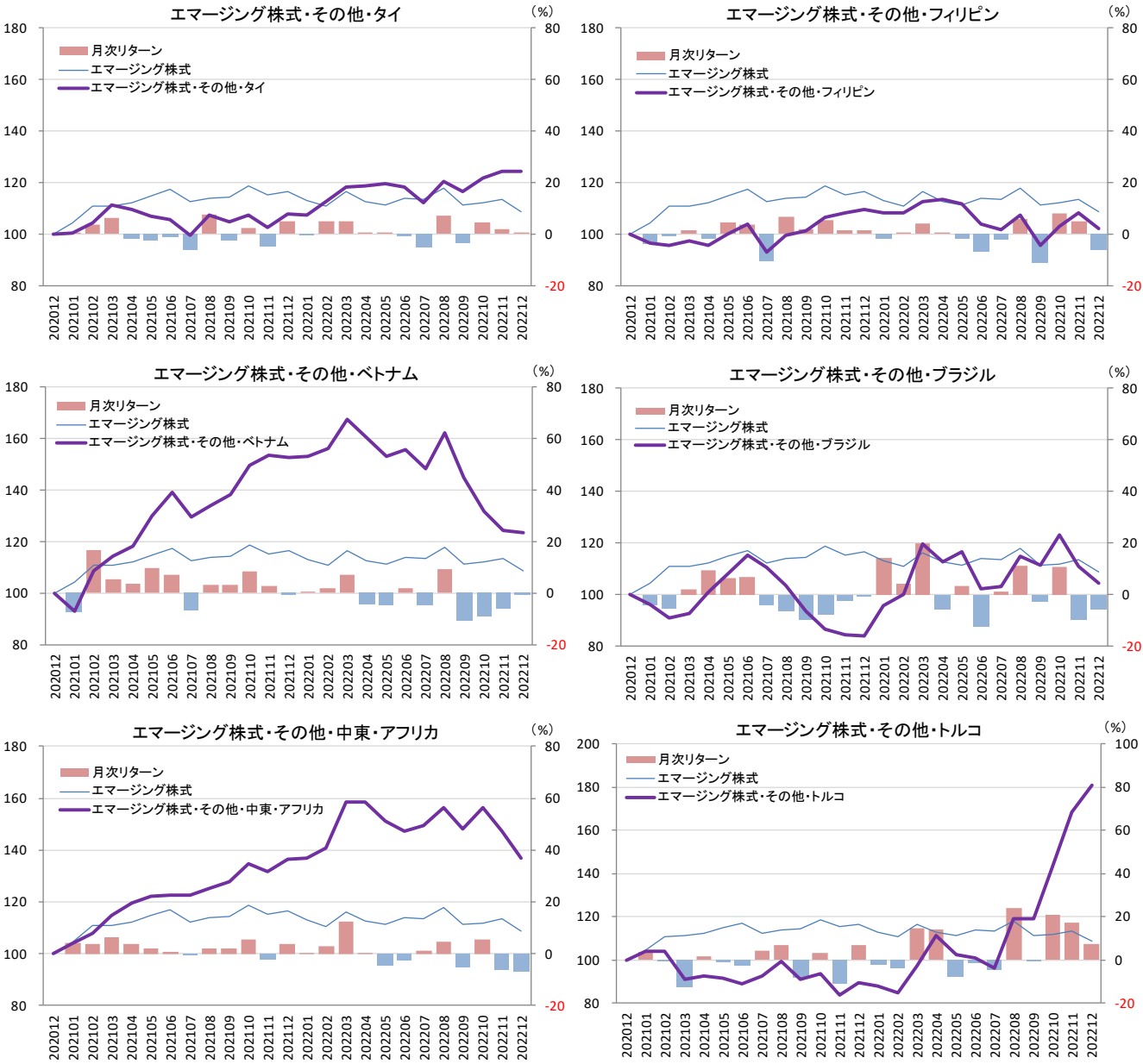


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

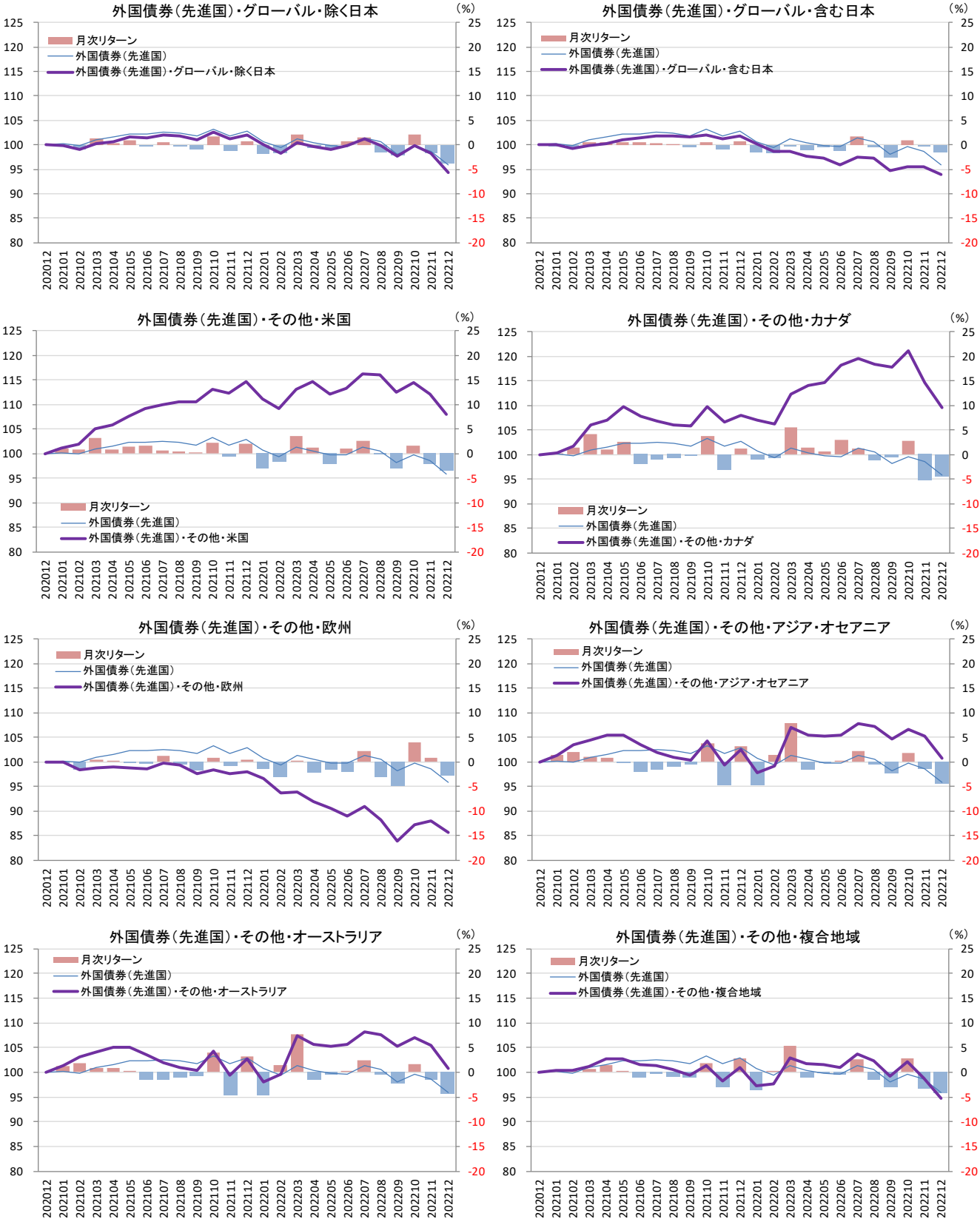


＜1＞パフォーマンス・サマリー

(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)]

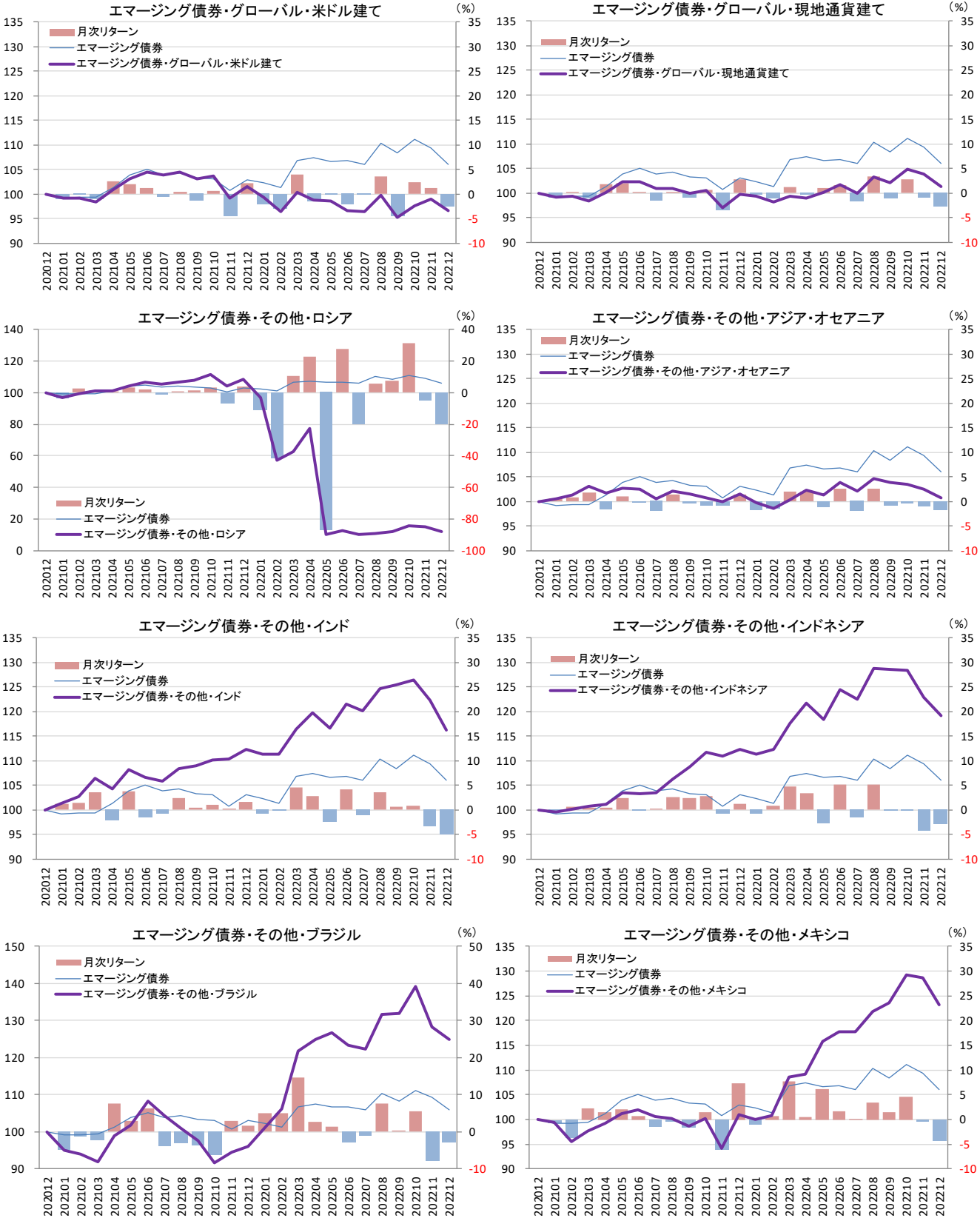


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

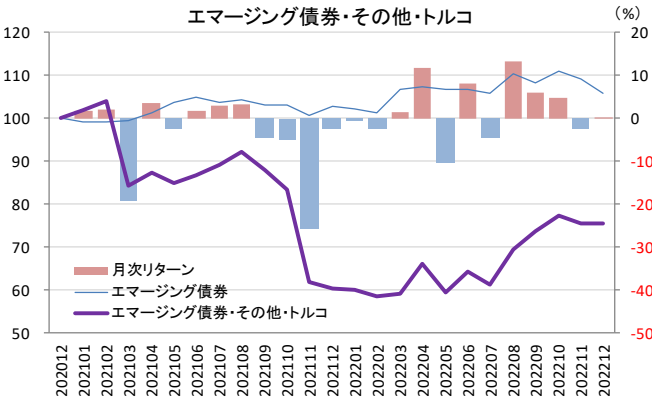


<1>パフォーマンス・サマリー

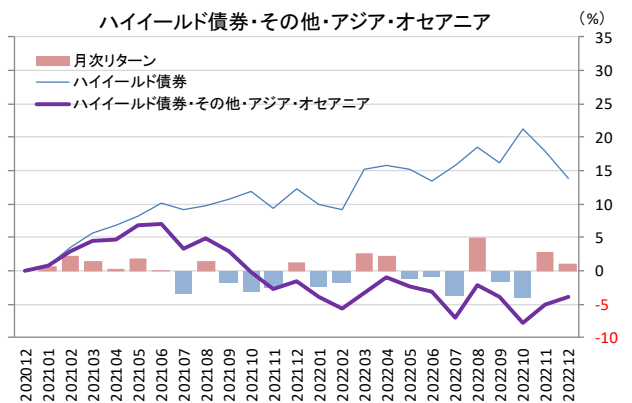
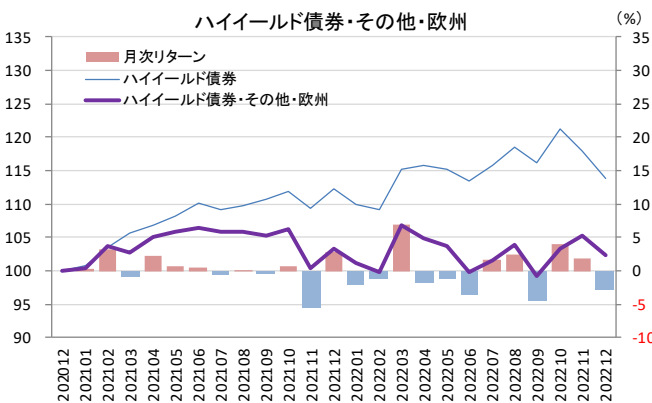
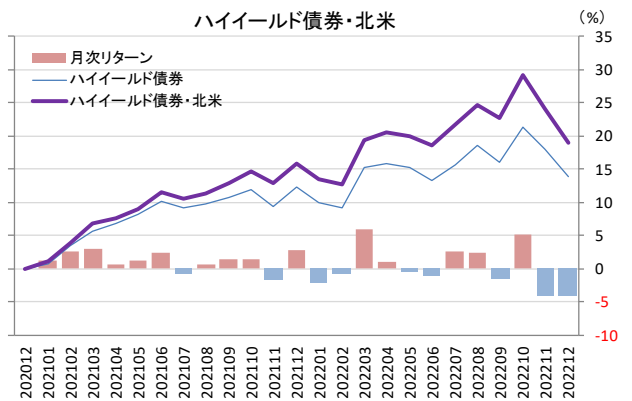
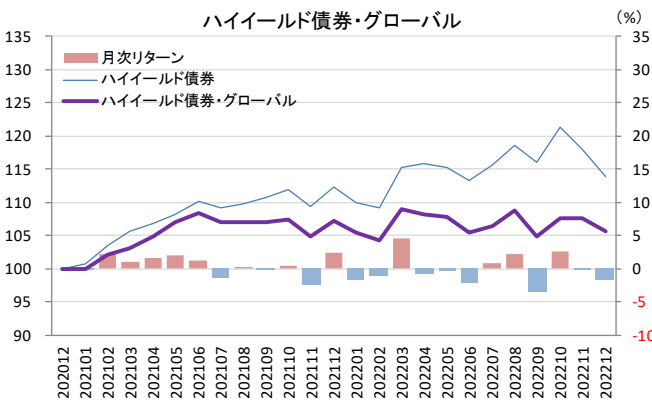
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

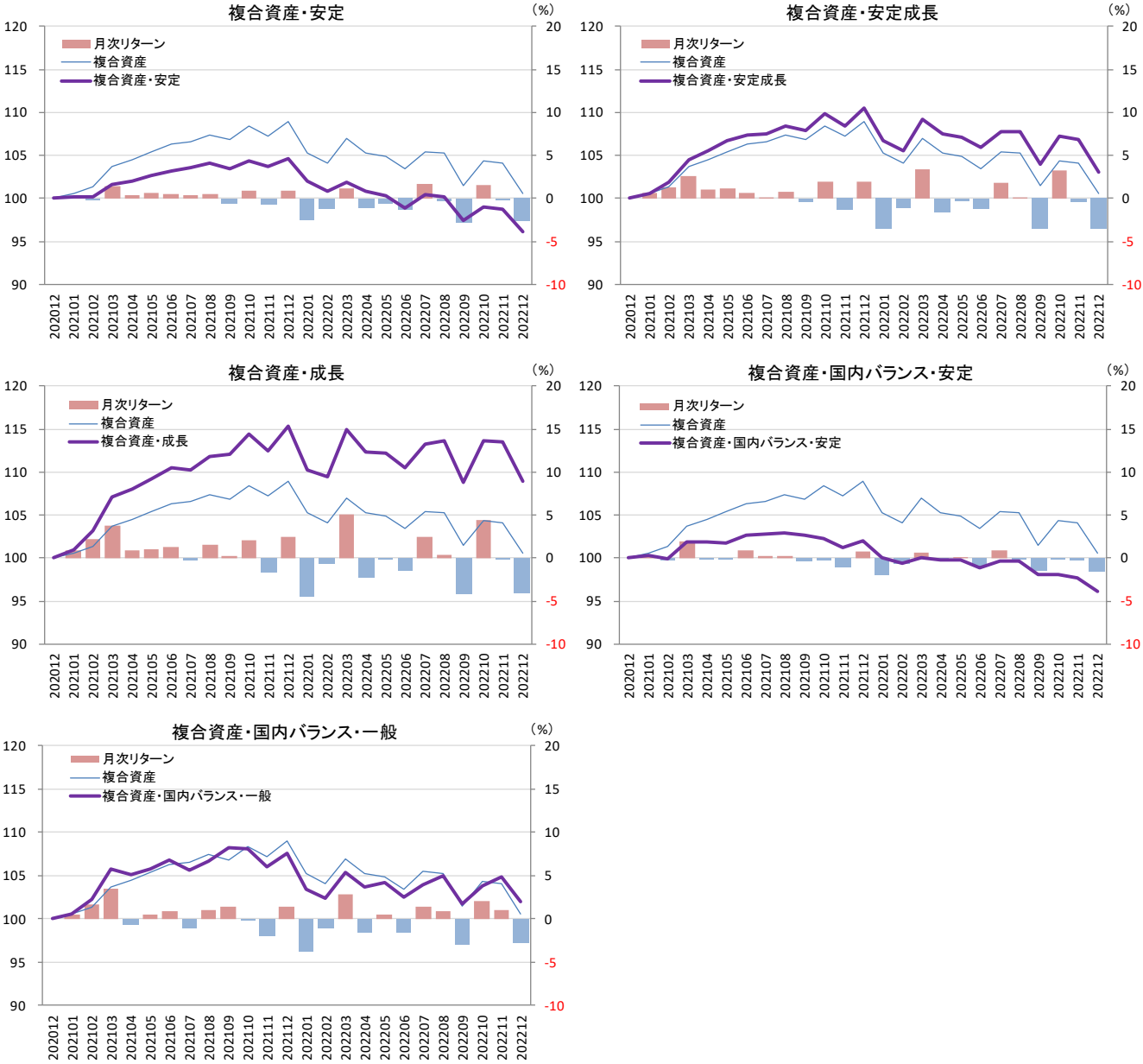


＜1＞パフォーマンス・サマリー

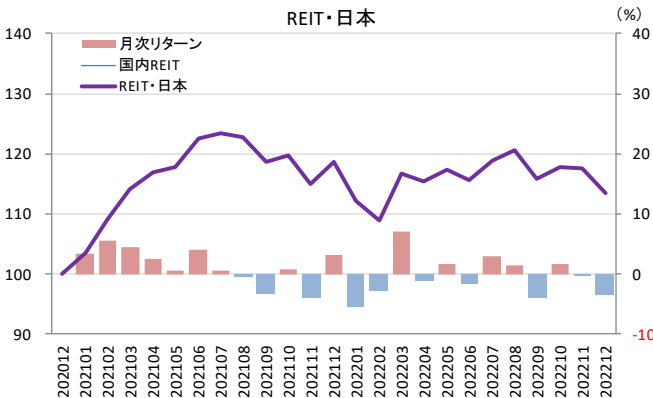
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

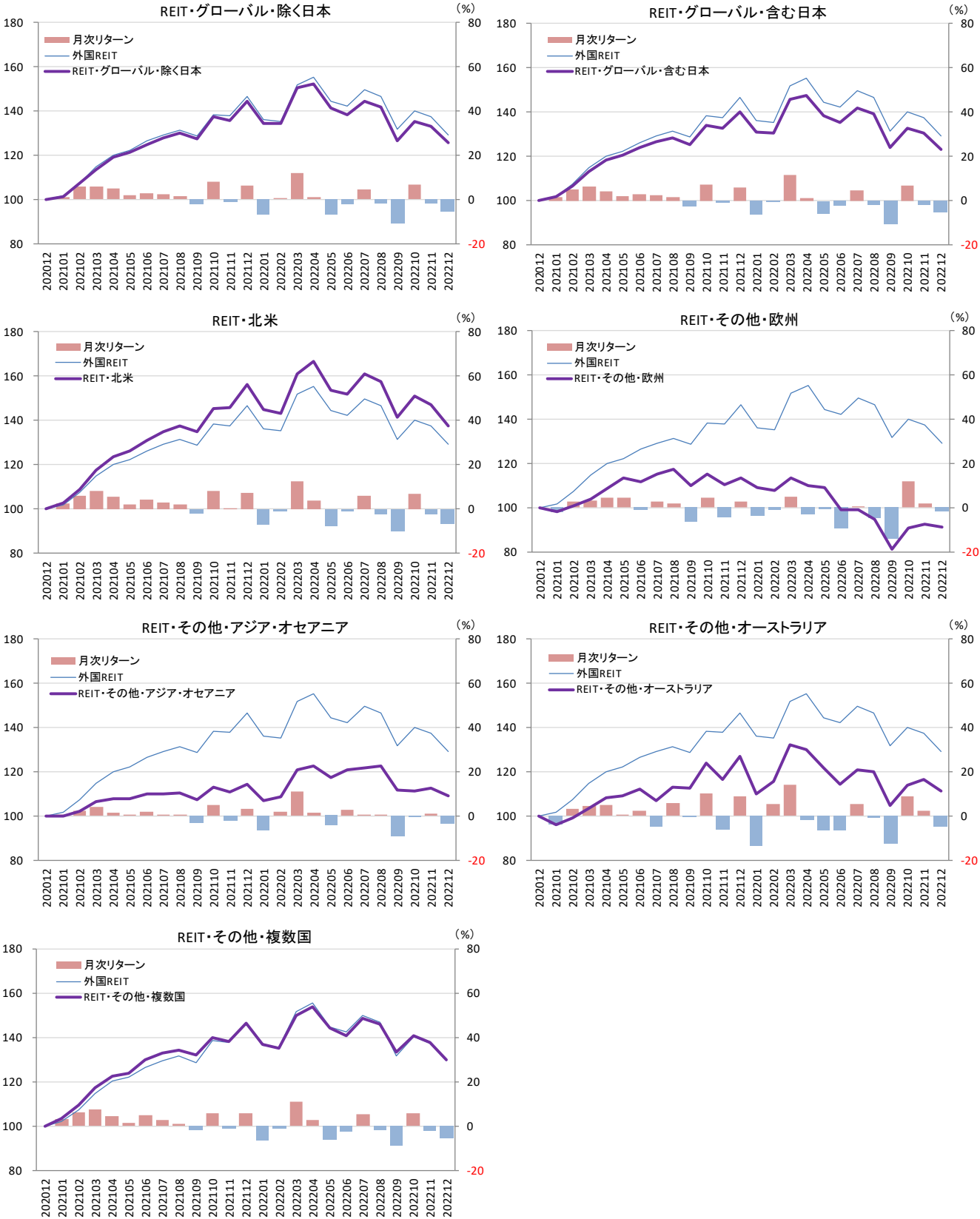


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

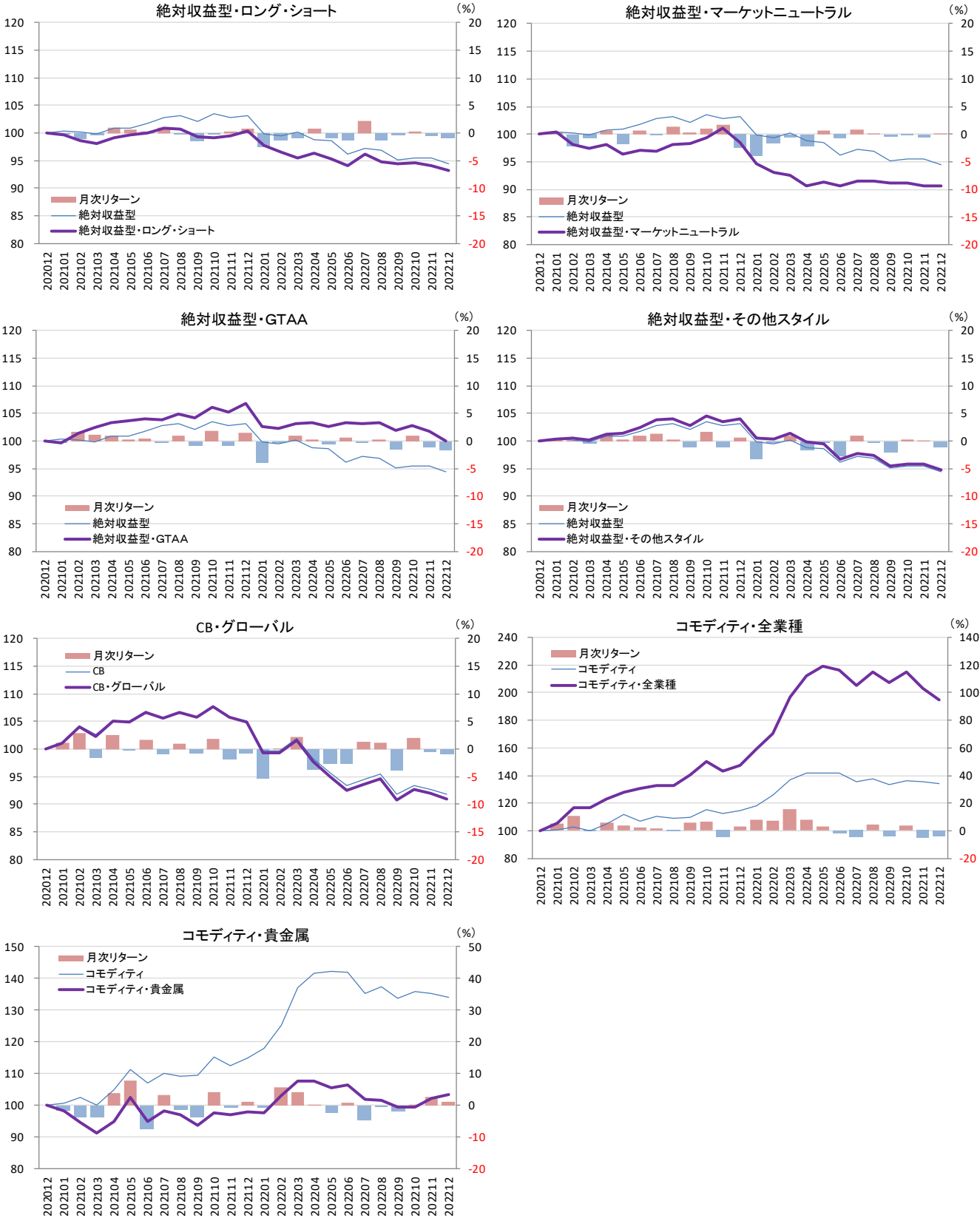


＜1＞パフォーマンス・サマリー

(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	-4.72		
1	エマージング株式・BRICS	-3.57	0.05	-0.00
2	CB	-1.01	0.21	-0.00
3	コモディティ	-0.73	0.57	-0.00
4	ハイイールド債券・その他	-1.98	0.22	-0.00
5	国内株式・業種特化	-7.12	0.07	-0.01
6	ハイイールド債券・グローバル	-1.79	0.31	-0.01
7	REIT・その他	-3.54	0.35	-0.01
8	絶対収益型	-1.04	1.38	-0.01
9	複合資産・国内バランス	-1.69	0.90	-0.02
10	エマージング債券・グローバル	-2.46	0.71	-0.02
11	エマージング債券・その他	-3.81	0.54	-0.02
12	複合資産・その他	-9.82	0.35	-0.04
13	エマージング株式・グローバル	-3.60	1.05	-0.04
14	国内株式・小型	-6.07	0.79	-0.05
15	ブルベア	-12.13	0.48	-0.06
16	ハイイールド債券・北米	-4.11	1.45	-0.06
17	外国債券(先進国)・その他	-3.96	1.80	-0.07
18	国内債券・一般	-1.45	5.06	-0.07
19	エマージング株式・その他	-4.78	2.05	-0.10
20	REIT・グローバル	-5.61	1.99	-0.11
21	複合資産・成長	-4.09	2.84	-0.12
22	複合資産・安定	-2.62	4.50	-0.12
23	REIT・日本	-3.60	3.34	-0.12
24	REIT・北米	-6.54	2.67	-0.18
25	外国債券(先進国)・グローバル	-2.60	7.61	-0.20
26	複合資産・安定成長	-3.53	6.72	-0.24
27	国内株式・その他	-5.85	4.75	-0.28
28	国内株式・一般	-5.18	6.82	-0.36
29	外国株式(先進国)・その他	-6.52	12.83	-0.84
30	外国株式(先進国)・グローバル	-5.71	27.60	-1.58
合計			100.00	-4.72

◆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	-11.59		
1	コモディティ	16.85	0.55	0.07
2	エマージング債券・その他	10.56	0.59	0.06
3	ハイイールド債券・北米	2.61	1.40	0.03
4	ハイイールド債券・その他	-1.18	0.24	-0.01
5	ハイイールド債券・グローバル	-1.54	0.31	-0.01
6	エマージング株式・BRICS	-17.10	0.06	-0.01
7	国内株式・業種特化	-17.53	0.08	-0.02
8	CB	-12.63	0.16	-0.02
9	REIT・その他	-7.08	0.40	-0.03
10	エマージング債券・グローバル	-3.25	0.72	-0.03
11	複合資産・国内バランス	-5.58	0.97	-0.06
12	外国債券(先進国)・その他	-4.07	1.90	-0.07
13	国内株式・小型	-12.68	0.77	-0.11
14	エマージング株式・グローバル	-8.46	1.07	-0.11
15	複合資産・成長	-5.60	2.62	-0.12
16	絶対収益型	-8.47	1.35	-0.13
17	エマージング株式・その他	-5.77	2.16	-0.15
18	REIT・日本	-4.53	3.26	-0.15
19	複合資産・その他	-31.73	0.41	-0.16
20	国内株式・その他	-5.98	4.58	-0.18
21	REIT・グローバル	-12.43	2.19	-0.25
22	ブルベア	-44.31	0.50	-0.27
23	REIT・北米	-11.93	2.90	-0.30
24	国内債券・一般	-6.45	5.06	-0.35
25	複合資産・安定	-8.07	4.58	-0.39
26	複合資産・安定成長	-6.77	6.63	-0.44
27	国内株式・一般	-7.35	6.67	-0.48
28	外国債券(先進国)・グローバル	-7.51	7.67	-0.61
29	外国株式(先進国)・その他	-16.01	12.26	-1.82
30	外国株式(先進国)・グローバル	-18.44	27.95	-5.49
合計			100.00	-11.59

◆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	8.80	13.10	71.52	13.30	↑ 11.85	11.05	0.22	0.21	0.50
国内株式	14.74	11.46	162.04	16.25	16.06	16.34	0.29	0.14	0.62
一般	14.68	8.90	151.46	15.72	15.86	16.53	0.30	0.11	0.58
フリー	13.79	8.28	151.18	16.10	16.21	17.13	0.28	0.10	0.56
バリュー	17.17	10.41	157.04	15.06	15.05	15.18	0.36	0.14	0.65
小型	10.18	6.95	250.26	20.86	19.60	18.44	0.16	0.07	0.72
その他	15.67	18.70	172.66	16.61	15.98	16.03	0.30	0.22	0.66
日経225	15.05	23.32	184.05	18.14	17.05	16.67	0.27	0.25	0.66
TOPIX	17.22	15.58	165.30	15.41	15.11	15.53	0.35	0.20	0.66
JPX日経400	17.37	16.59	-	15.84	15.30	-	0.35	0.21	-
国内債券	-7.06	-5.23	2.45	1.95	1.90	1.82	-1.22	-0.54	0.14
一般	-7.06	-5.23	2.45	1.95	1.90	1.82	-1.22	-0.54	0.14
外国株式(先進国)	21.39	33.90	136.90	19.70	18.23	16.27	0.34	0.33	0.55
グローバル	19.40	32.30	144.99	19.70	18.32	16.25	0.31	0.32	0.58
除く日本	35.80	51.08	213.59	19.47	18.13	16.84	0.55	0.48	0.72
含む日本	14.36	26.60	127.54	20.17	18.66	16.32	0.23	0.26	0.53
その他	26.59	37.73	120.13	20.15	↑ 18.30	16.50	0.41	0.36	0.50
北米	69.74	77.94	199.46	20.42	↑ 19.53	17.70	0.95	0.63	0.66
米国	31.53	52.58	154.17	19.47	↑ 18.13	↑ 16.83	0.49	0.49	0.58
カナダ	17.77	15.51	28.69	21.81	18.98	16.23	0.26	0.16	0.16
欧州	16.71	19.71	108.67	20.02	18.27	16.59	0.27	0.20	0.46
ドイツ	17.25	6.06	-	25.33	22.85	-	0.22	0.05	-
イギリス	16.74	8.89	-	19.20	17.74	-	0.28	0.10	-
アジア・オセアニア	4.49	6.88	105.81	15.81	15.05	15.50	0.10	0.09	0.48
オーストラリア	18.30	12.13	69.84	28.75	23.93	20.28	0.20	0.10	0.27
ニュージーランド	24.57	47.82	261.79	20.13	17.91	18.28	0.38	0.46	0.75
複合地域	58.04	26.49	-	40.03	33.78	-	0.41	0.14	-
エマージング株式	15.81	12.38	75.56	20.06	18.14	17.04	0.25	0.13	0.34
グローバル	12.61	16.88	59.70	18.68	18.05	17.03	0.22	0.18	0.28
BRICS	-11.75	-2.93	56.60	22.61	20.83	19.65	-0.18	-0.03	0.23
その他	18.49	11.73	84.30	20.81	18.58	17.30	0.28	0.12	0.36
欧州	-59.05	-55.65	-46.31	39.25	32.75	27.12	-0.65	-0.46	-0.22
ロシア	-88.43	-84.82	-80.98	59.43	48.11	38.34	-0.86	-0.65	-0.40
アジア・オセアニア	5.79	1.28	65.25	18.19	17.60	16.43	0.11	0.02	0.31
中国	9.79	13.31	155.56	21.61	21.27	21.76	0.15	0.12	0.45
インド	45.78	32.63	180.36	26.28	23.64	23.17	0.51	0.25	0.47
インドネシア	10.43	1.51	33.83	30.74	26.94	24.70	0.11	0.01	0.12
タイ	6.94	-5.85	37.91	24.74	21.38	18.79	0.09	-0.05	0.17
フィリピン	-9.97	-23.38	18.36	24.21	20.93	↑ 19.77	-0.14	-0.25	0.09
ベトナム	34.72	12.83	148.60	30.40	26.41	21.93	0.34	0.09	0.44
韓国	22.49	-10.66	26.16	27.71	24.62	20.08	0.25	-0.09	0.12
香港	-10.52	-13.90	35.14	23.15	21.54	↑ 19.91	-0.16	-0.14	0.15
中南米	4.85	15.83	16.58	34.58	31.01	26.47	0.05	0.10	0.06
ブラジル	-21.99	-9.32	-19.43	37.59	35.16	31.95	-0.21	-0.05	-0.07
メキシコ	32.11	27.92	-	31.55	28.64	-	0.31	0.18	-
中東・アフリカ	33.34	27.75	94.45	21.10	18.76	16.97	0.48	0.27	0.41
トルコ	72.04	12.08	3.10	36.35	↑ 36.68	32.16	0.55	0.06	0.01
複合地域	9.37	5.11	54.20	19.20	17.93	↑ 16.10	0.16	0.06	0.28

※[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	8.80	13.10	71.52	13.30	↑	11.85	11.05	0.22	0.21	0.50	
外国債券(先進国)	-1.12	-1.32	15.89	5.41	↑	4.68	↑	6.07	-0.06	-0.05	0.25
グローバル	-2.66	-1.77	17.91	4.61	↑	4.00	↑	5.48	-0.19	-0.08	0.30
除く日本	-1.52	-0.90	19.18	4.94	↑	4.39	↑	6.06	-0.10	-0.03	0.29
含む日本	-4.02	-2.84	16.50	5.16	↑	4.27		5.15	-0.26	-0.13	0.30
その他	4.55	1.37	15.34	8.78	↑	7.60		8.14	0.17	0.04	0.18
北米	-2.75	-2.17	-	6.01	↑	4.81	↑	-	-0.15	-0.08	-
米国	4.39	7.97	38.88	8.80	↑	7.21		6.81	0.17	0.22	0.49
カナダ	10.56	6.56	12.78	8.61	↑	7.85	↑	8.80	0.40	0.17	0.14
欧州	-11.76	-14.34	10.04	6.41	↑	5.59	↑	7.33	-0.63	-0.54	0.13
イギリス	-0.28	-4.09	-	10.52	↑	9.50	↑	-	-0.01	-0.08	-
アジア・オセアニア	6.53	0.43	14.06	11.05		9.69		9.75	0.20	0.01	0.14
オーストラリア	6.74	0.17	12.77	11.11		9.73		9.74	0.20	0.01	0.12
ニュージーランド	-1.93	-2.34	-	9.93		8.97		-	-0.06	-0.05	-
複合地域	3.68	4.87	20.33	7.19	↑	6.06	↑	7.83	0.17	0.16	0.24
エマージング債券	0.17	-2.17	17.91	11.57		10.95		11.39	0.01	-0.04	0.15
グローバル	-6.37	-9.37	9.30	13.53		12.38		11.89	-0.16	-0.15	0.08
米ドル建て	-7.50	-10.63	9.72	14.43		12.94		12.28	-0.18	-0.17	0.08
現地通貨建て	-2.86	-4.81	4.75	10.76		10.98		10.82	-0.09	-0.09	0.04
その他	8.54	6.83	28.52	11.05		10.65		12.00	0.25	0.13	0.21
ロシア	-89.98	-89.24	-88.57	67.70		53.25		41.35	-0.79	-0.67	-0.47
アジア・オセアニア	1.85	4.61	36.94	7.75		6.60		7.54	0.08	0.14	0.42
インド	17.73	15.53	81.45	9.55	↑	9.31	↑	11.83	0.59	0.32	0.52
インドネシア	22.59	21.36	30.85	15.56		14.52		15.53	0.45	0.27	0.18
ブラジル	-2.53	-6.55	17.67	19.39		19.62		18.68	-0.04	-0.07	0.09
メキシコ	24.00	48.85	44.15	18.07		16.42		15.87	0.41	0.51	0.24
トルコ	-38.00	-52.53	-65.56	27.30		33.89		26.84	-0.54	-0.41	-0.38
複合地域	-10.25	-3.67	-1.78	13.25		11.96		12.46	-0.27	-0.06	-0.01
ハイイールド債券	9.50	9.98	56.66	13.30		11.50		10.99	0.23	0.17	0.42
グローバル	2.14	0.59	39.55	12.92		11.32		10.98	0.06	0.01	0.31
北米	14.30	16.68	70.79	13.31	↑	11.53		10.99	0.34	0.28	0.50
その他	-2.70	-5.66	30.83	14.81		12.76		11.93	-0.06	-0.09	0.23
欧州	-2.05	-5.59	34.54	15.85		13.71		12.80	-0.04	-0.08	0.24
アジア・オセアニア	-6.31	-7.51	29.32	13.50		11.39		10.60	-0.16	-0.13	0.25
複合地域	10.73	11.38	63.37	10.20	↑	8.89		9.37	0.34	0.25	0.54
複合資産	2.25	5.59	57.08	8.04	↑	7.21		7.84	0.10	0.16	0.59
安定	-2.58	-0.76	37.47	5.46	↑	4.96	↑	6.16	-0.15	-0.02	0.53
安定成長	5.00	8.99	62.89	8.57	↑	7.75		8.22	0.19	0.23	0.61
成長	14.78	18.95	110.34	11.54		11.01		10.95	0.41	0.32	0.71
国内バランス	-8.75	-4.78	22.07	4.41		3.89		5.70	-0.67	-0.24	0.35
安定	-9.56	-5.05	18.09	4.26		3.69		3.31	-0.77	-0.27	0.51
一般	6.44	6.48	55.47	8.59		8.33		9.35	0.25	0.16	0.48

※[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	8.80	13.10	71.52	13.30	↑ 11.85	11.05	0.22	0.21	0.50
国内REIT	-2.16	32.50	132.31	17.86	14.82	16.43	-0.04	0.39	0.54
日本	-2.16	32.50	132.31	17.86	14.82	16.43	-0.04	0.39	0.54
外国REIT	13.14	25.87	119.64	22.08	↑ 18.84	↑ 16.56	0.19	0.25	0.49
グローバル	7.40	16.83	92.39	22.98	↑ 19.42	↑ 16.79	0.11	0.16	0.40
除く日本	10.77	23.63	114.08	23.75	↑ 19.99	↑ 17.06	0.15	0.22	0.46
含む日本	6.26	14.96	88.45	22.73	↑ 19.24	↑ 16.70	0.09	0.15	0.39
北米	19.80	36.05	146.05	21.62	↑ 18.85	↑ 16.85	0.29	0.34	0.56
その他	2.67	12.26	109.37	22.99	18.97	16.33	0.04	0.13	0.47
欧州	-20.15	-20.75	36.12	24.18	20.67	18.61	-0.30	-0.22	0.17
アジア・オセアニア	2.68	13.89	99.96	20.83	17.52	15.77	0.04	0.15	0.46
オーストラリア	3.12	8.19	74.05	36.25	28.99	23.14	0.03	0.06	0.25
複合地域	-5.92	-10.81	45.90	29.90	24.98	20.73	-0.07	-0.09	0.19
複数国	14.84	39.95	175.15	20.43	↑ 17.41	↑ 15.52	0.23	0.40	0.69
その他									
絶対収益型	-4.85	-7.49	-1.55	3.74	3.19	2.95	-0.43	-0.47	-0.05
ロング・ショート	-10.16	-11.73	-12.47	3.39	3.50	3.13	-1.03	-0.69	-0.42
マーケットニュートラル	-5.01	-10.35	34.05	4.81	4.25	5.73	-0.35	-0.50	0.52
GTAA	4.21	7.18	15.73	5.30	4.49	3.54	0.27	0.32	0.42
その他スタイル	-4.67	-7.34	1.85	4.03	3.39	3.76	-0.39	-0.43	0.05
CB	0.72	1.53	28.95	10.44	8.74	7.89	0.03	0.04	0.33
アジア・オセアニア	25.19	25.63	101.99	13.90	12.42	11.89	0.56	0.38	0.61
日本	-3.80	-7.94	37.74	5.30	5.18	6.28	-0.24	-0.31	0.52
グローバル	0.18	1.33	27.34	10.76	8.97	7.95	0.01	0.03	0.31
コモディティ	42.25	45.39	7.47	13.25	11.32	12.61	0.94	0.69	0.06
全業種	69.40	60.34	21.67	23.00	19.31	17.20	0.84	0.52	0.12
貴金属	24.73	35.39	6.45	13.24	12.01	13.07	0.58	0.52	0.05
エネルギー	78.61	88.48	17.22	42.87	36.97	31.52	0.50	0.37	0.05
その他コモディティ	45.38	40.22	24.31	22.55	19.18	17.19	0.59	0.37	0.13

※[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

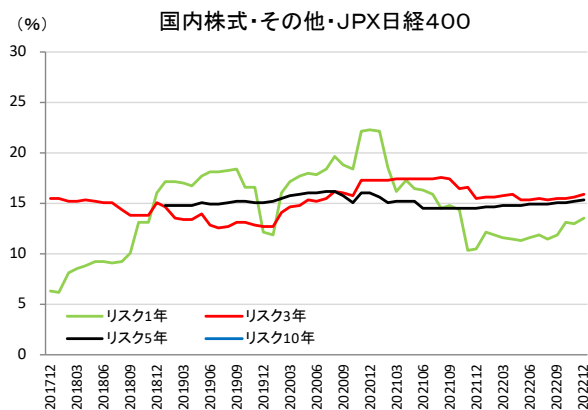
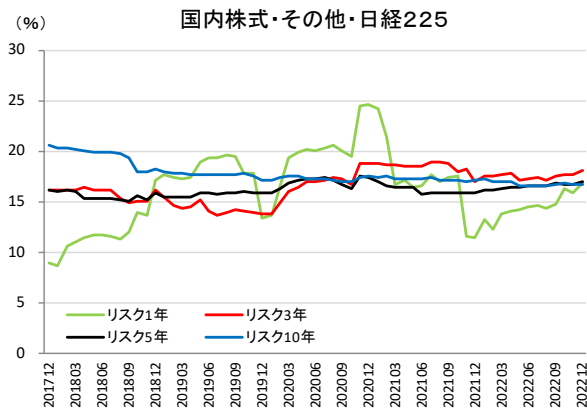
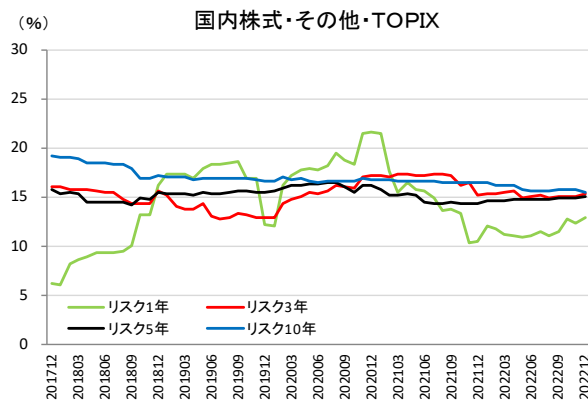
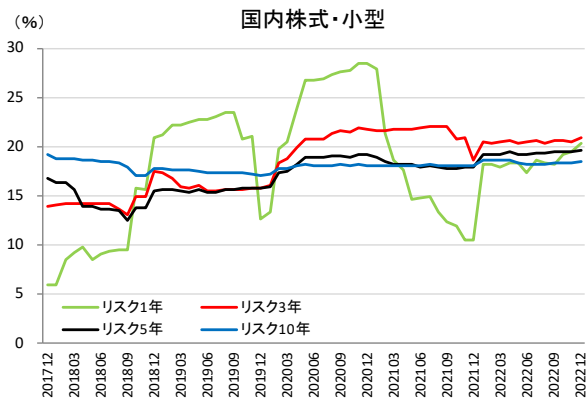
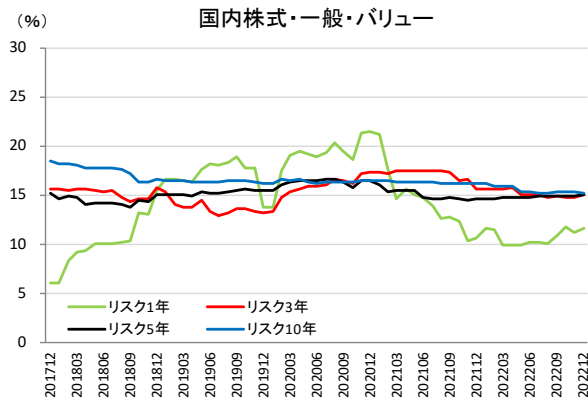
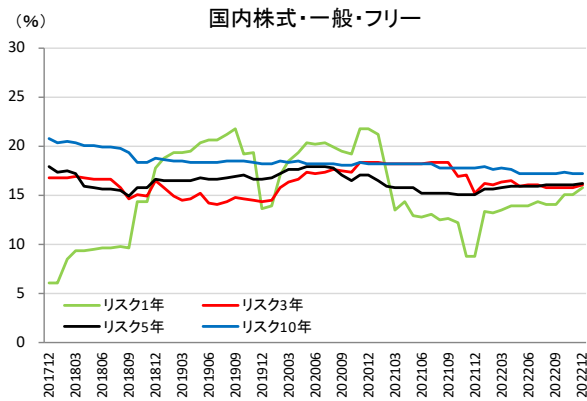
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

＜2＞リスク・サマリー

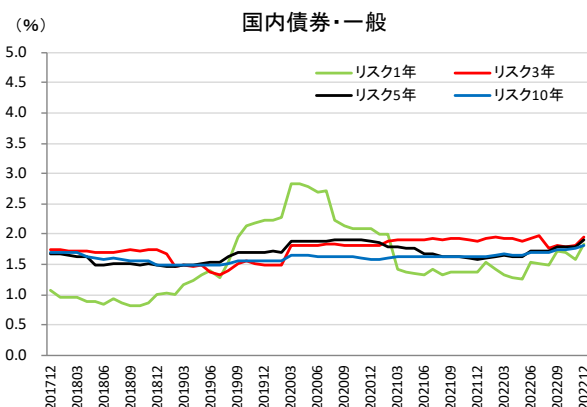
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

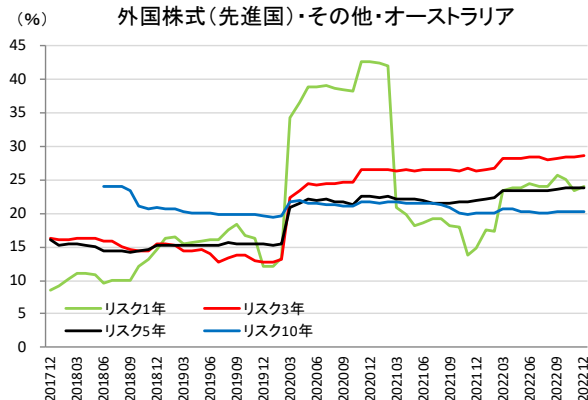
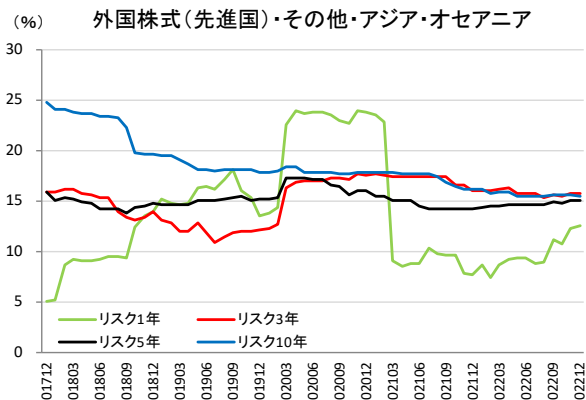
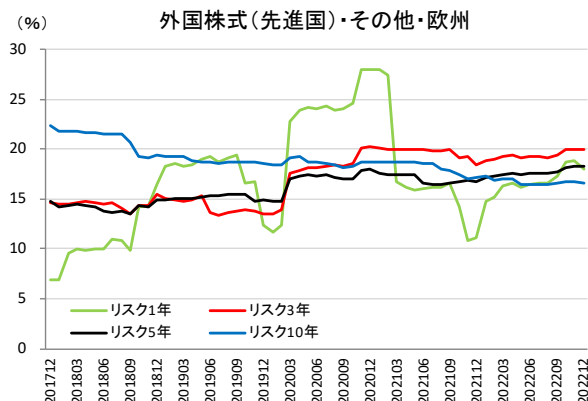
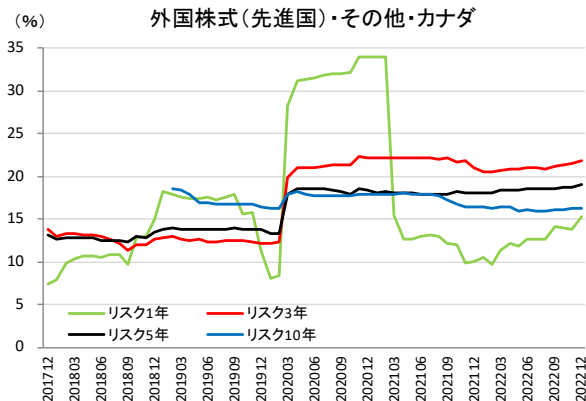
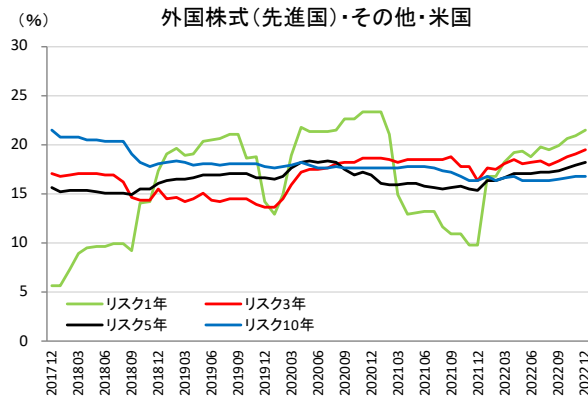
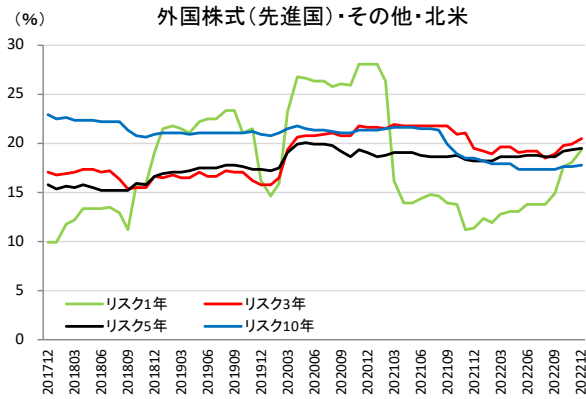
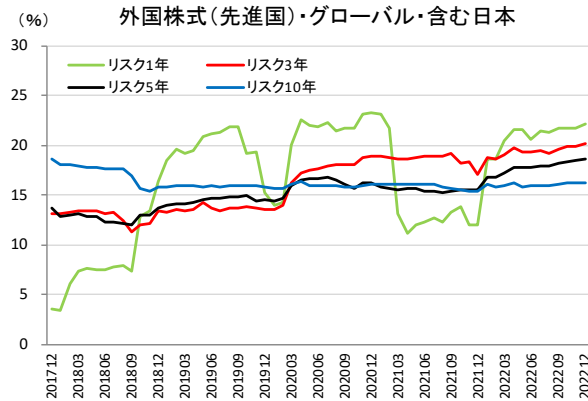
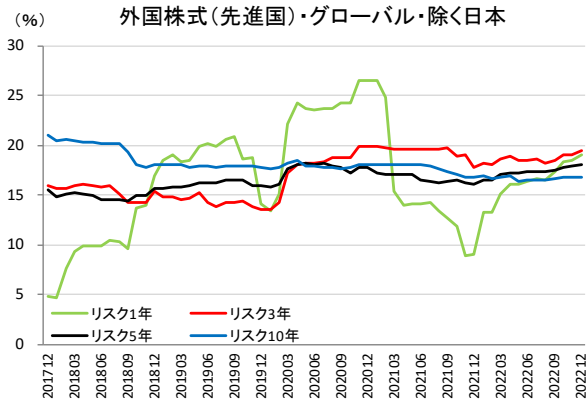


＜2＞リスク・サマリー

(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)]

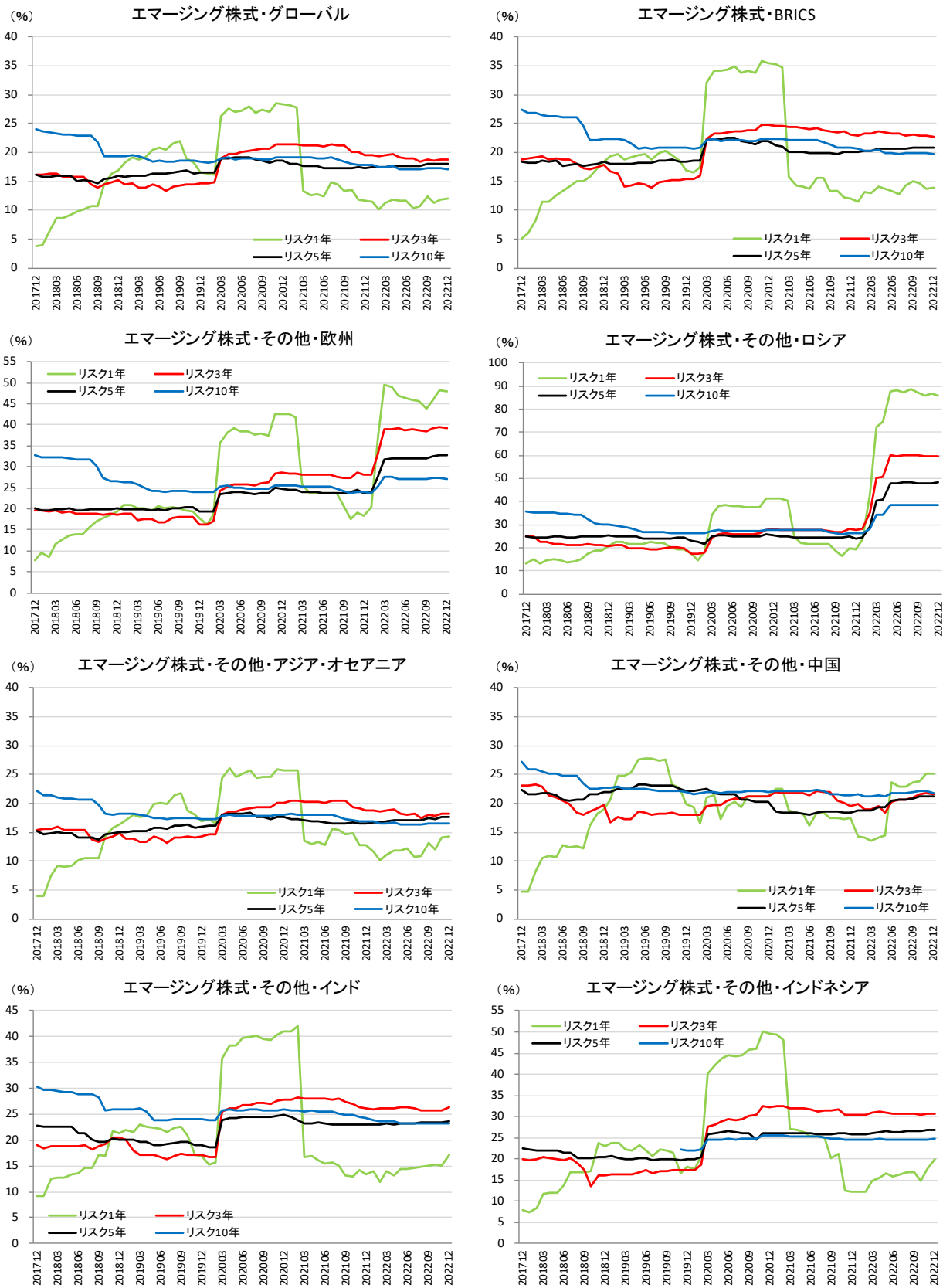


＜2＞リスク・サマリー

(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]

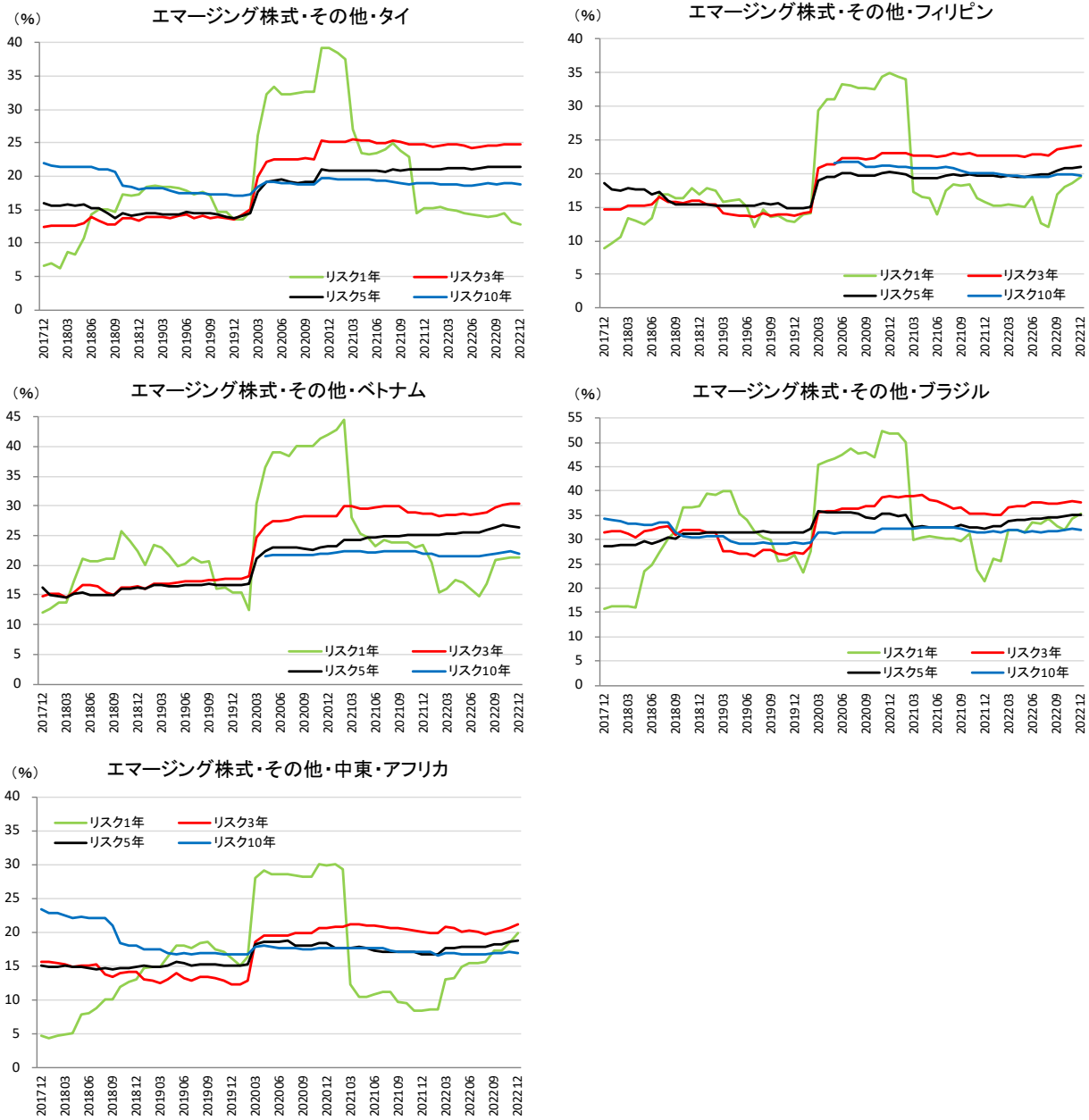


<2> リスク・サマリー

(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]

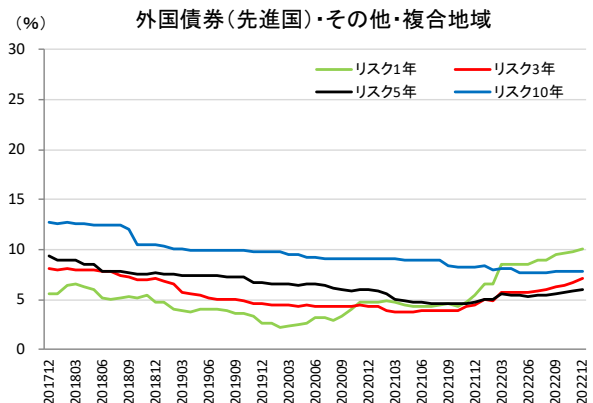
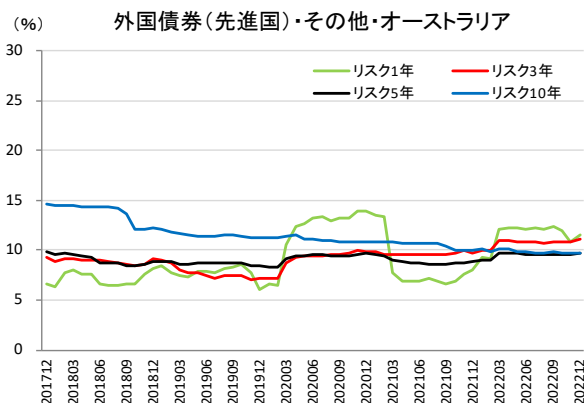
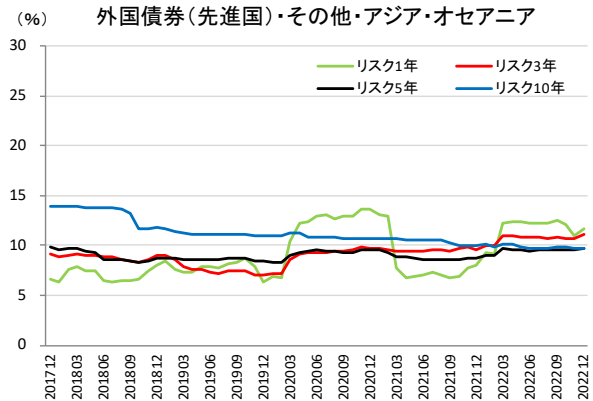
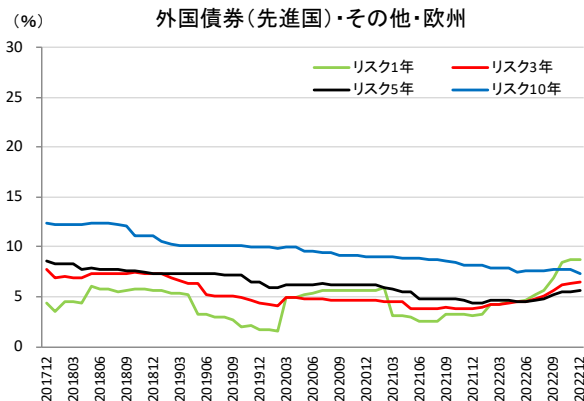
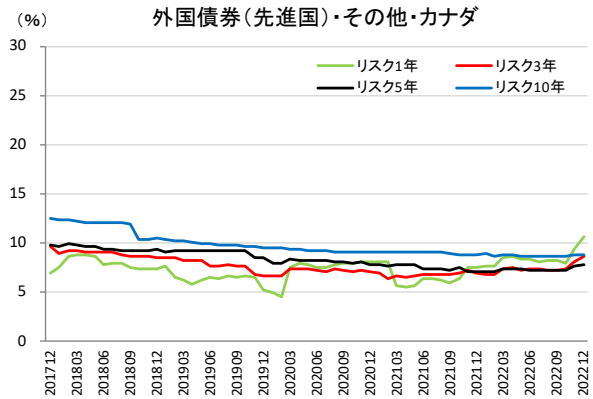
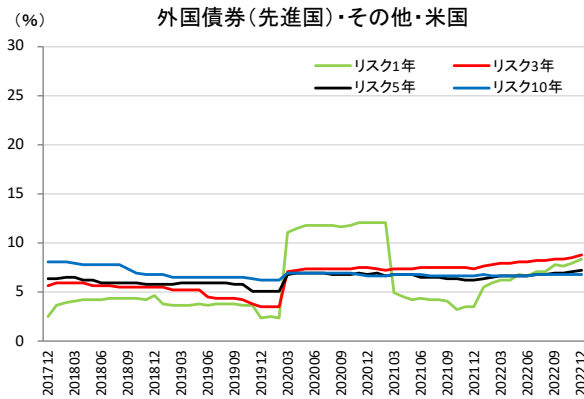
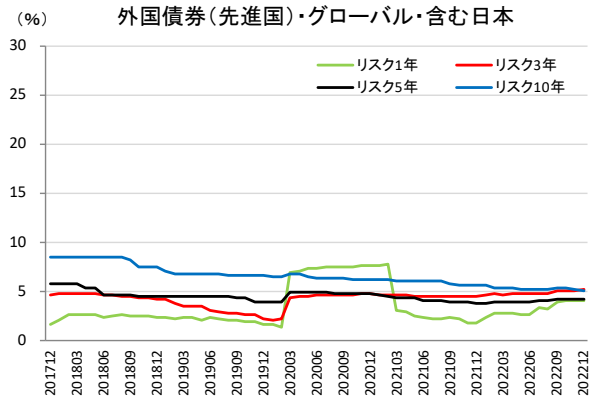
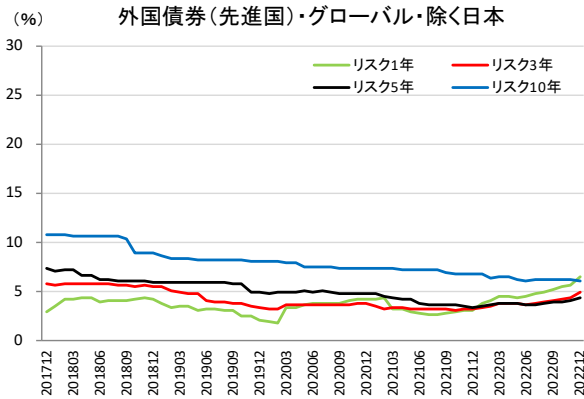


＜2＞リスク・サマリー

(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)]

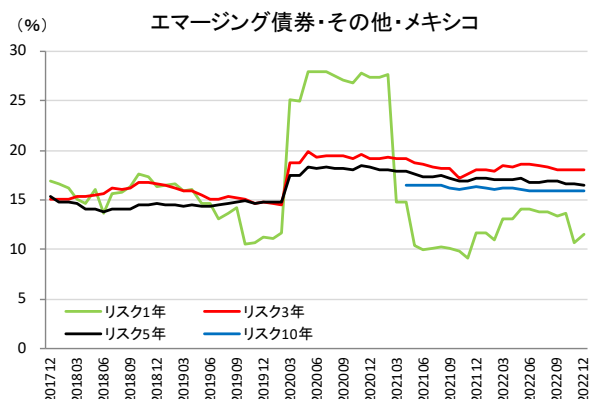
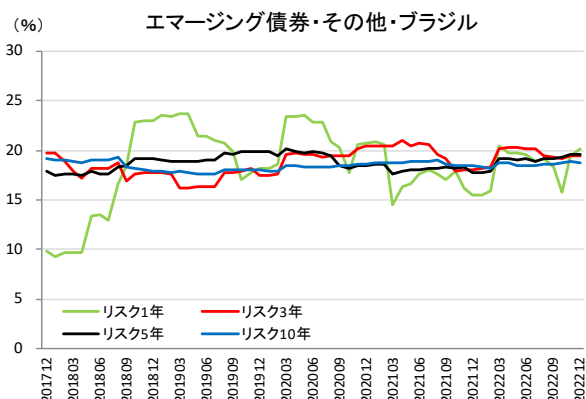
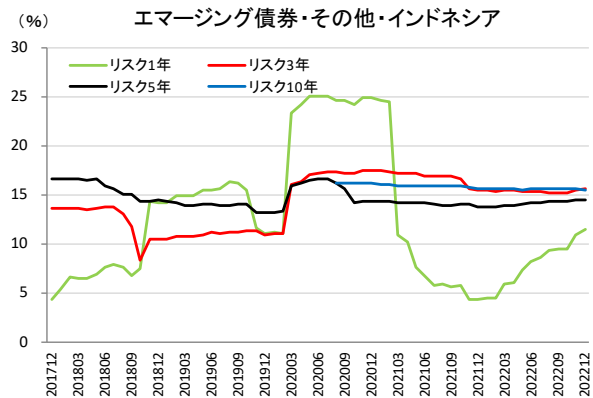
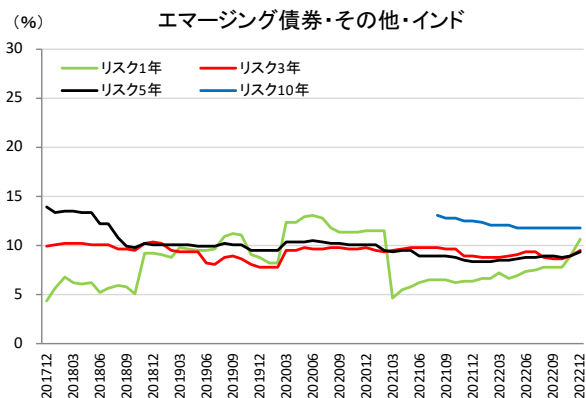
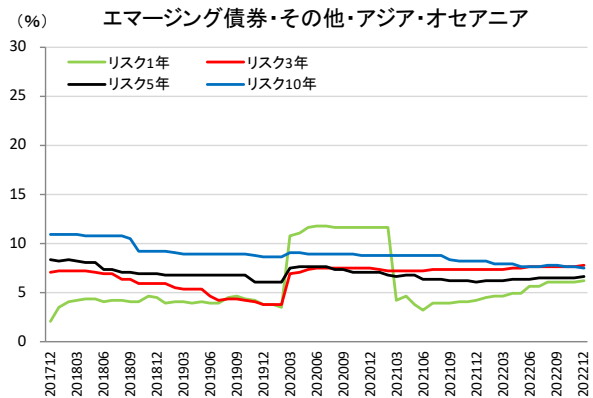
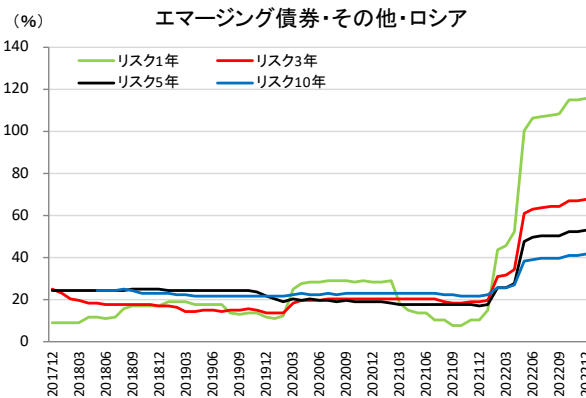
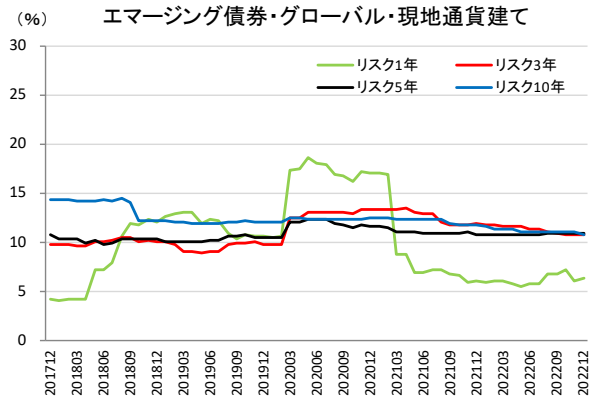
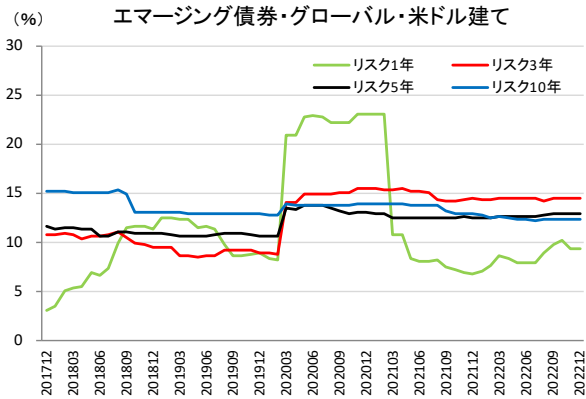


＜2＞リスク・サマリー

(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]

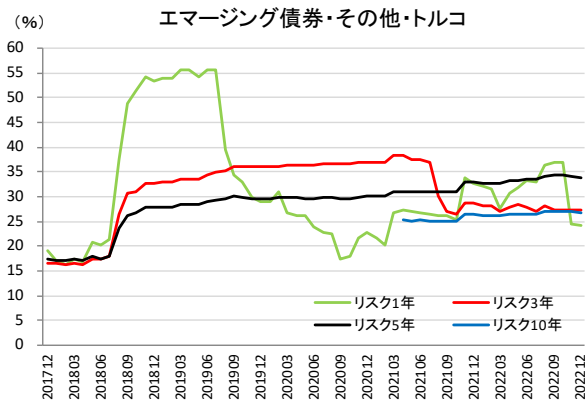


<2> リスク・サマリー

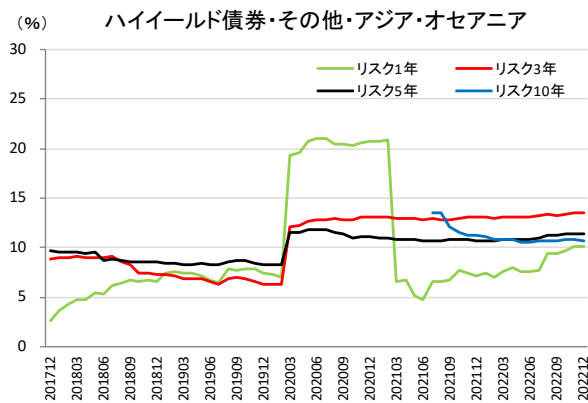
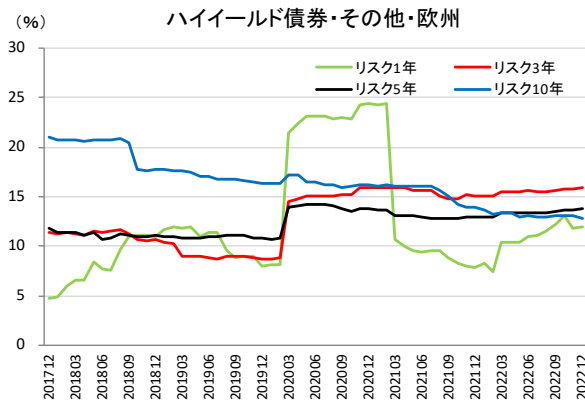
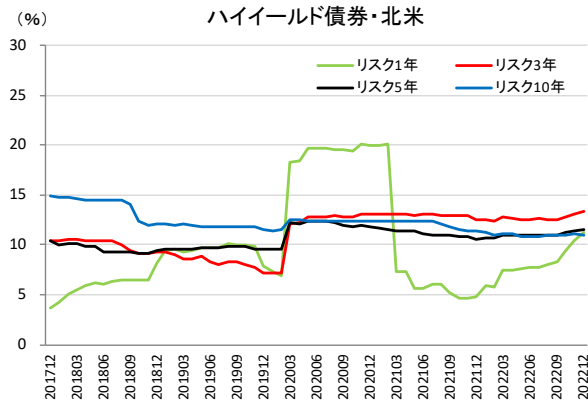
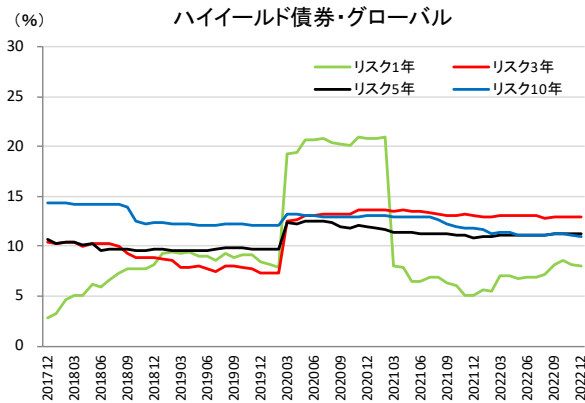
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

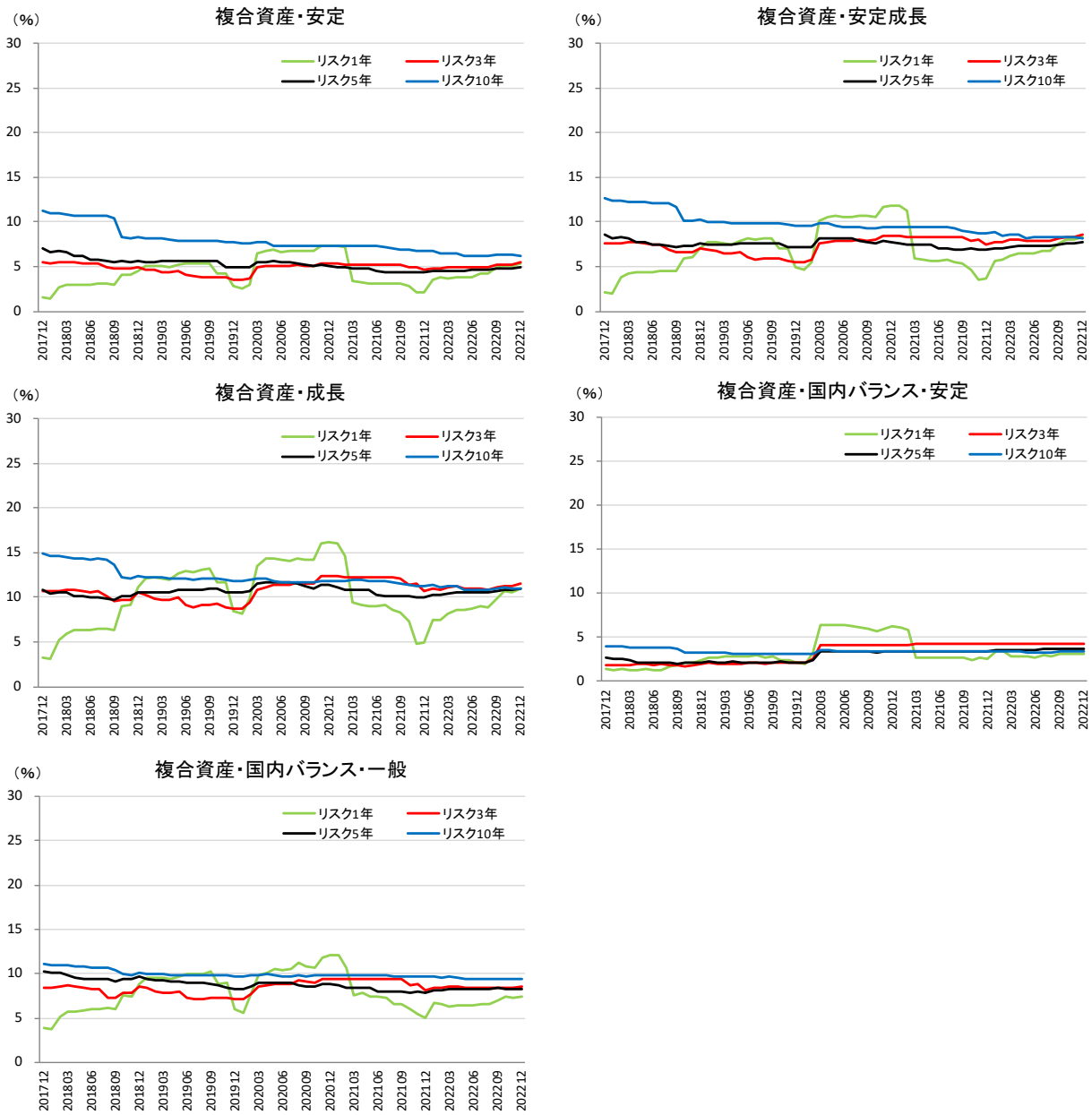


＜2＞リスク・サマリー

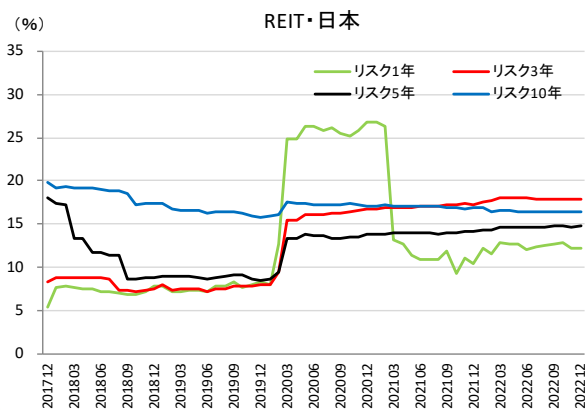
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

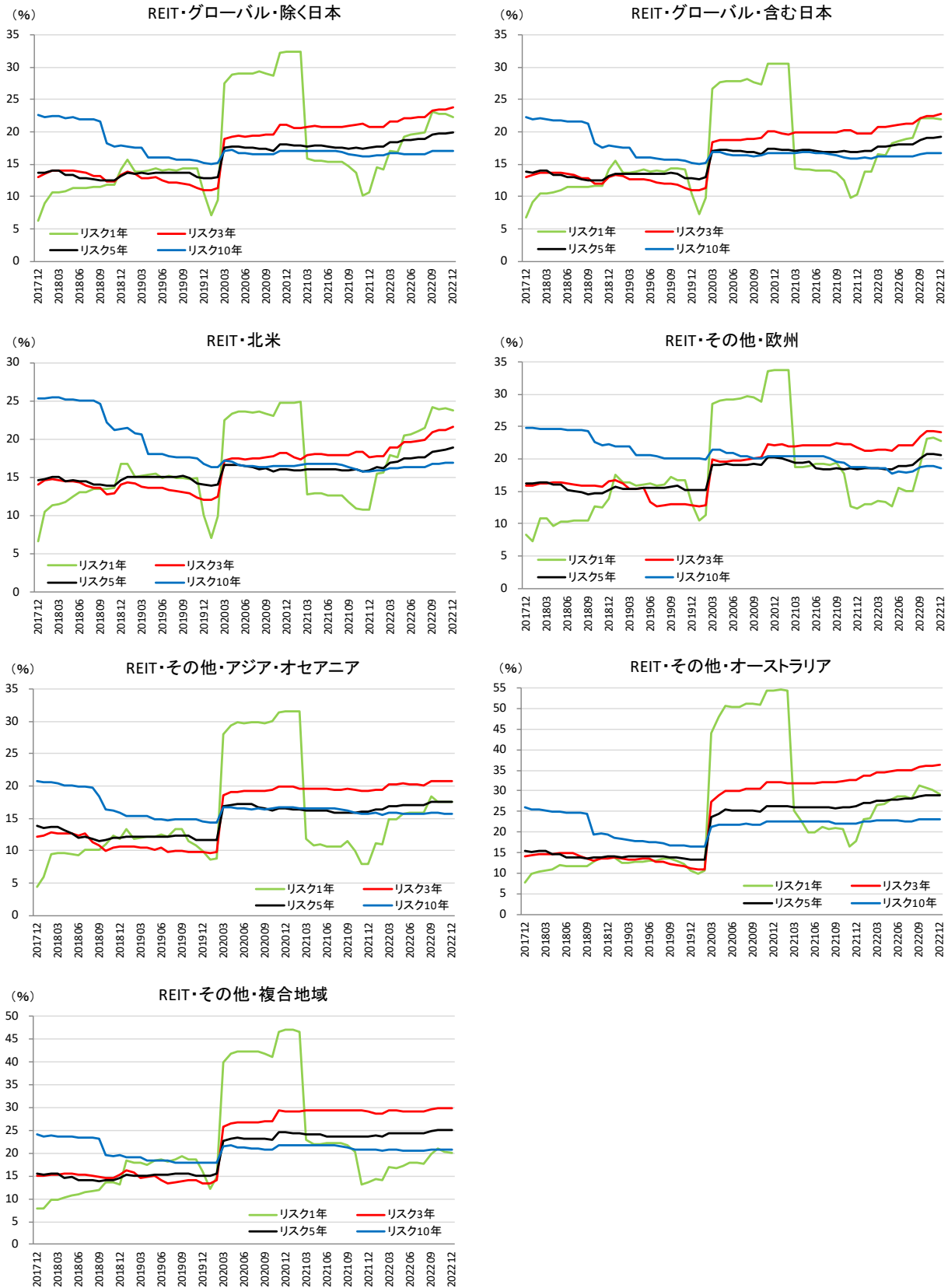


<2> リスク・サマリー

(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]

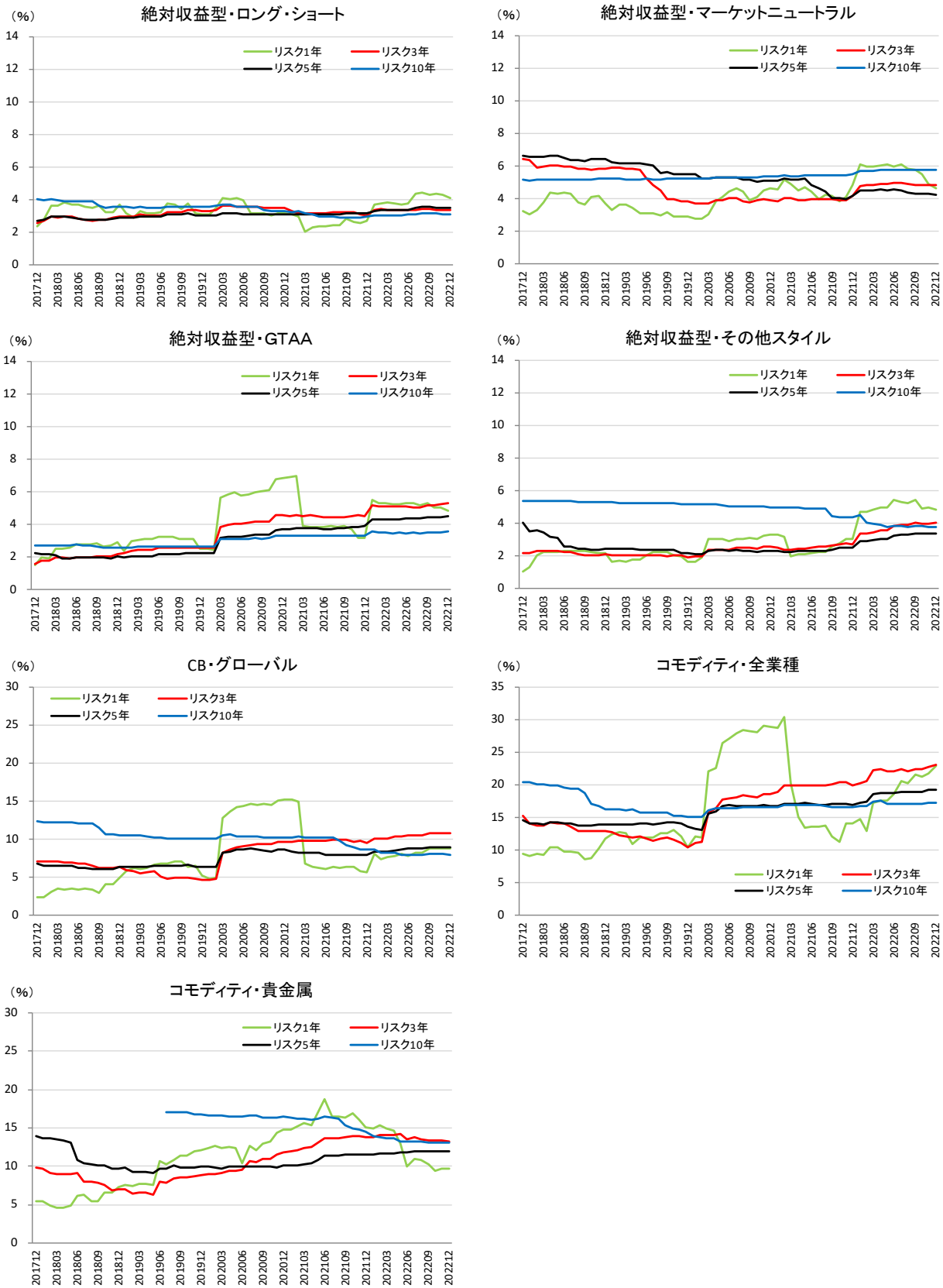


＜2＞リスク・サマリー

(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	10,335	21,936	40,711	84,124
国内株式	2,249	2,152	3,354	8,231
一般	314	797	1,671	3,421
フリー	173	542	1,217	2,762
バリュー	140	255	454	659
小型	14	1	16	162
その他	1,922	1,359	1,677	4,643
日経225	1,622	976	1,308	3,754
TOPIX	218	271	158	462
JPX日経400	30	13	18	62
国内債券	-98	514	1,363	2,677
一般	-98	514	1,363	2,677
外国株式(先進国)	3,893	11,026	20,415	47,627
グローバル	1,620	4,453	9,491	20,970
除く日本	899	2,493	4,724	9,286
含む日本	721	1,960	4,767	11,684
その他	2,273	6,573	10,924	26,657
北米	138	572	590	625
米国	2,184	6,128	10,584	26,715
カナダ	-2	-7	-12	-34
欧州	-12	-40	-73	-99
ドイツ	0	-1	-1	-2
イギリス	-1	-1	-1	-1
アジア・オセアニア	0	1	0	0
オーストラリア	-33	-80	-166	-579
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	0	2	4	32
エマージング株式	402	640	312	-499
グローバル	49	90	142	314
BRICS	-5	-12	-21	-60
その他	358	562	191	-753
欧州	0	-1	-1	-3
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	7	-66	-235	-665
中国	-35	-117	-239	-440
インド	284	592	605	376
インドネシア	7	21	2	-5
タイ	-1	-2	-2	-4
フィリピン	0	0	-3	-7
ベトナム	94	161	122	128
韓国	0	0	0	0
香港	0	2	2	3
中南米	0	-3	-5	-10
ブラジル	2	-22	-44	-113
メキシコ	0	-2	-3	-6
中東・アフリカ	-3	-4	-5	-1
トルコ	5	4	1	-2
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	10,335	21,936	40,711	84,124
外国債券(先進国)	1,508	1,564	2,827	3,785
グローバル	1,421	1,365	2,830	4,793
除く日本	158	-376	294	485
含む日本	1,264	1,741	2,536	4,308
その他	87	199	-3	-1,008
北米	0	0	-1	-5
米国	158	433	574	478
カナダ	-8	-31	-86	-181
欧州	-4	-11	-19	-78
イギリス	0	0	-1	-3
アジア・オセアニア	-7	-25	-76	-191
オーストラリア	-46	-149	-355	-915
ニュージーランド	0	-1	-4	-13
複合地域	-5	-18	-35	-98
エマージング債券	-41	-186	-299	-924
グローバル	-11	-51	45	-45
米ドル建て	-18	-61	23	-79
現地通貨建て	7	10	22	34
その他	-30	-135	-344	-879
ロシア	0	0	0	-5
アジア・オセアニア	-2	-6	-15	-31
インド	-2	-23	-79	-274
インドネシア	-3	-8	-10	-40
ブラジル	-13	-72	-181	-409
メキシコ	-6	-13	-32	-73
トルコ	-1	-1	-2	-2
複合地域	0	-1	-1	-3
ハイイールド債券	278	685	1,036	654
グローバル	-13	-17	37	-23
北米	308	754	1,086	910
その他	-17	-53	-87	-233
欧州	-18	-50	-84	-204
アジア・オセアニア	1	-2	-1	-26
複合地域	0	0	-1	-3
複合資産	846	2,621	5,418	12,200
安定	-40	367	668	3,520
安定成長	451	1,140	2,614	5,069
成長	459	1,183	2,418	4,576
国内バランス	-62	-125	-295	-720
安定	-100	-297	-529	-1,007
一般	-1	-4	-9	-16
その他	37	56	13	-246

<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	10,335	21,936	40,711	84,124
国内REIT	375	1,220	2,550	4,260
日本	375	1,220	2,550	4,260
外国REIT	189	653	1,198	1,285
グローバル	-18	-21	48	-384
除く日本	38	17	189	115
含む日本	-56	-38	-141	-503
北米	210	682	1,205	1,997
その他	-3	-8	-56	-329
欧州	-2	-3	-5	-14
アジア・オセアニア	6	11	-14	-203
オーストラリア	-6	-12	-28	-83
複合地域	0	0	0	-4
複数国	-2	-4	-9	-25
その他	735	1,048	2,537	4,829
絶対収益型	129	277	591	1,933
ロング・ショート	-6	-13	-19	11
マーケットニュートラル	-17	-25	-65	-111
GTAA	0	-8	-13	24
その他スタイル	151	320	679	1,997
CB	148	146	958	882
アジア・オセアニア	0	0	-1	-2
日本	-2	-2	-3	-5
グローバル	150	149	962	889
コモディティ	53	232	317	329
全業種	-8	-22	-186	-311
貴金属	61	258	522	683
エネルギー	0	-4	-20	-40
その他コモディティ	1	0	0	-2

< 4 > 純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別①

	純資産額 (億円)	構成比(%)		本数	構成比(%)
総合	828,460	100.00		5,377	100.00
国内株式	103,668	12.51		834	15.51
一般	56,492	6.82		535	9.95
フリー	44,044	5.32		436	8.11
バリュー	12,448	1.50		99	1.84
小型	6,505	0.79		91	1.69
その他	40,060	4.84		202	3.76
日経225	21,081	2.54		69	1.28
TOPIX	15,785	1.91		80	1.49
JPX日経400	732	0.09		15	0.28
国内債券	42,269	5.10		142	2.64
一般	42,269	5.10		142	2.64
外国株式(先進国)	331,792	40.05		1,159	21.55
グローバル	226,294	27.32		804	14.95
除く日本	65,065	7.85		190	3.53
含む日本	161,229	19.46		614	11.42
その他	105,498	12.73		355	6.60
北米	771	0.09		11	0.20
米国	99,962	12.07		264	4.91
カナダ	151	0.02		2	0.04
欧州	1,544	0.19		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	39	0.00		2	0.04
オーストラリア	2,956	0.36		26	0.48
ニュージーランド	13	0.00		1	0.02
複合地域	38	0.00		1	0.02
エマージング株式	26,104	3.15		311	5.78
グローバル	8,704	1.05		92	1.71
BRICS	439	0.05		7	0.13
その他	16,961	2.05		212	3.94
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	4,312	0.52		87	1.62
中国	1,885	0.23		32	0.60
インド	8,669	1.05		31	0.58
インドネシア	141	0.02		4	0.07
タイ	30	0.00		3	0.06
フィリピン	27	0.00		4	0.07
ベトナム	1,082	0.13		13	0.24
韓国	4	0.00		1	0.02
香港	16	0.00		1	0.02
中南米	56	0.01		2	0.04
ブラジル	472	0.06		13	0.24
メキシコ	12	0.00		2	0.04
中東・アフリカ	100	0.01		5	0.09
トルコ	71	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	828,460	100.00	5,377	100.00
外国債券(先進国)	79,072	9.54	773	14.38
グローバル	64,259	7.76	527	9.80
除く日本	28,937	3.49	228	4.24
含む日本	35,321	4.26	299	5.56
その他	14,813	1.79	246	4.58
北米	66	0.01	6	0.11
米国	5,311	0.64	138	2.57
カナダ	699	0.08	4	0.07
欧州	969	0.12	31	0.58
イギリス	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,480	0.18	9	0.17
オーストラリア	5,160	0.62	36	0.67
ニュージーランド	72	0.01	9	0.17
複合地域	1,046	0.13	8	0.15
エマージング債券	10,313	1.24	264	4.91
グローバル	5,853	0.71	186	3.46
米ドル建て	4,336	0.52	143	2.66
現地通貨建て	1,517	0.18	43	0.80
その他	4,461	0.54	78	1.45
ロシア	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	240	0.03	6	0.11
インド	2,064	0.25	17	0.32
インドネシア	274	0.03	7	0.13
ブラジル	1,407	0.17	21	0.39
メキシコ	250	0.03	7	0.13
トルコ	59	0.01	4	0.07
複合地域	31	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	16,480	1.99	246	4.58
グローバル	2,528	0.31	37	0.69
北米	12,090	1.46	147	2.73
その他	1,862	0.22	62	1.15
欧州	1,449	0.17	40	0.74
アジア・オセアニア	378	0.05	21	0.39
複合地域	35	0.00	1	0.02
複合資産	127,295	15.37	1,006	18.71
安定	37,244	4.50	276	5.13
安定成長	56,006	6.76	422	7.85
成長	23,780	2.87	260	4.84
国内バランス	7,468	0.90	32	0.60
安定	6,786	0.82	9	0.17
一般	284	0.03	18	0.33
その他	2,795	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	828,460	100.00	5,377	100.00
国内REIT	27,966	3.38	136	2.53
日本	27,966	3.38	136	2.53
外国REIT	41,158	4.97	279	5.19
グローバル	16,299	1.97	151	2.81
除く日本	5,291	0.64	65	1.21
含む日本	11,008	1.33	86	1.60
北米	21,920	2.65	76	1.41
その他	2,939	0.35	52	0.97
欧州	112	0.01	10	0.19
アジア・オセアニア	2,034	0.25	26	0.48
オーストラリア	502	0.06	12	0.22
複合地域	54	0.01	3	0.06
複数国	236	0.03	1	0.02
その他	22,344	2.70	227	4.22
絶対収益型	11,649	1.41	101	1.88
ロング・ショート	818	0.10	35	0.65
マーケットニュートラル	521	0.06	13	0.24
GTAA	424	0.05	13	0.24
その他スタイル	9,801	1.18	39	0.73
CB	1,894	0.23	32	0.60
アジア・オセアニア	32	0.00	1	0.02
日本	30	0.00	3	0.06
グローバル	1,831	0.22	28	0.52
コモディティ	4,824	0.58	35	0.65
全業種	1,575	0.19	13	0.24
貴金属	3,163	0.38	20	0.37
エネルギー	68	0.01	1	0.02
その他コモディティ	18	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	12,596	9.9	2.11	2.50	1.156
国内株式	16,792	13.5	0.61	0.65	1.034
一般	15,580	13.1	0.83	0.87	1.388
フリー	15,074	12.4	0.85	0.90	1.430
バリュー	17,805	16.3	0.76	0.75	1.241
小型	22,190	14.1	0.51	0.59	1.699
その他	17,614	14.0	0.32	0.35	0.417
日経225	18,290	15.4	0.37	0.40	0.482
TOPIX	18,635	14.9	0.12	0.12	0.259
JPX日経400	16,599	8.3	0.06	0.06	0.501
国内債券	10,331	11.7	0.15	0.16	0.438
一般	10,331	11.7	0.15	0.16	0.438
外国株式(先進国)	14,455	7.4	1.98	2.37	1.280
グローバル	14,877	7.3	1.72	1.91	1.352
除く日本	21,202	10.1	0.46	0.51	0.602
含む日本	12,919	6.4	2.24	2.49	1.655
その他	13,500	7.8	2.52	3.33	1.126
北米	15,071	7.2	9.91	10.90	1.624
米国	14,103	7.0	2.31	3.13	1.092
カナダ	5,812	11.8	7.57	8.37	1.990
欧州	12,812	12.1	1.54	1.77	1.589
ドイツ	13,024	8.8	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,197	6.4	10.11	10.23	1.851
アジア・オセアニア	9,435	13.0	2.77	2.97	1.635
オーストラリア	9,461	8.2	9.27	9.85	1.824
ニュージーランド	17,370	10.4	1.69	1.73	1.672
複合地域	11,290	9.7	16.38	12.40	1.705
エマージング株式	12,827	10.5	2.50	2.72	1.651
グローバル	12,355	8.1	0.32	0.35	1.071
BRICS	13,627	16.6	0.80	0.94	2.069
その他	13,005	11.3	3.68	3.99	1.937
欧州	5,559	16.5	0.17	0.17	1.964
ロシア	2,217	13.6	0.96	5.45	1.257
アジア・オセアニア	13,930	12.3	2.95	3.44	1.710
中国	14,228	8.4	0.46	0.54	1.944
インド	15,443	11.7	5.13	5.45	2.053
インドネシア	12,071	12.7	4.14	3.84	1.834
タイ	12,612	10.4	5.75	5.35	1.816
フィリピン	10,549	10.4	0.65	0.70	1.729
ベトナム	13,577	5.5	1.12	1.44	1.914
韓国	11,466	4.0	0.00	0.00	1.804
香港	13,512	13.3	1.69	1.70	0.858
中南米	8,916	16.0	0.00	0.00	2.042
ブラジル	5,324	11.9	4.41	4.27	1.950
メキシコ	11,152	9.8	0.00	0.00	1.885
中東・アフリカ	12,744	11.4	0.41	0.39	2.085
トルコ	12,920	21.4	0.00	0.00	2.025
複合地域	20,124	14.6	1.59	1.84	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	12,596	9.9	2.11	2.50	1.156
外国債券(先進国)	9,567	10.3	1.38	1.55	0.986
グローバル	10,004	10.2	1.05	1.16	0.925
除く日本	10,919	12.4	0.99	1.08	0.707
含む日本	9,306	8.5	1.09	1.23	1.103
その他	8,630	10.4	2.80	3.20	1.252
北米	9,598	8.7	2.22	2.51	1.772
米国	9,406	8.8	3.12	3.90	1.216
カナダ	6,865	11.9	1.66	1.66	1.378
欧州	7,057	12.7	1.65	1.79	1.156
イギリス	6,929	7.6	3.76	4.41	1.310
アジア・オセアニア	8,530	12.7	2.50	2.61	1.420
オーストラリア	8,052	14.0	3.03	3.29	1.243
ニュージーランド	8,782	8.5	1.55	1.67	1.359
複合地域	5,103	12.7	2.40	2.55	1.195
エマージング債券	8,341	11.0	4.50	4.57	1.478
グローバル	8,420	11.5	3.17	3.43	1.368
米ドル建て	8,342	12.0	3.37	3.69	1.485
現地通貨建て	8,681	9.9	2.57	2.69	1.035
その他	8,152	9.8	6.26	6.08	1.621
ロシア	904	9.9	1.19	10.99	1.596
アジア・オセアニア	9,080	12.0	6.47	7.07	1.629
インド	9,341	8.1	6.78	7.11	1.703
インドネシア	8,593	10.1	5.87	5.87	1.672
ブラジル	8,540	13.3	5.94	4.91	1.580
メキシコ	7,607	9.8	6.12	5.36	1.398
トルコ	2,063	9.8	7.15	6.21	1.458
複合地域	3,547	16.3	2.22	2.40	1.210
ハイイールド債券	8,827	11.7	5.52	5.83	1.665
グローバル	7,406	10.6	3.55	3.70	1.481
北米	10,043	12.7	5.56	5.79	1.688
その他	6,791	10.2	7.97	8.92	1.766
欧州	6,977	9.7	7.55	8.32	1.739
アジア・オセアニア	6,557	10.7	9.85	11.52	1.866
複合地域	4,251	18.8	5.22	5.65	1.800
複合資産	12,272	9.4	1.07	1.23	0.970
安定	10,919	9.2	0.90	1.00	1.089
安定成長	11,994	9.8	1.34	1.55	0.980
成長	14,551	9.3	0.32	0.36	0.793
国内バランス	11,219	9.5	2.22	2.44	0.941
安定	10,336	11.4	2.34	2.58	0.917
一般	11,636	9.5	1.30	1.41	1.291
その他	8,037	2.8	1.22	1.90	0.774

(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	12,596	9.9	2.11	2.50	1.156
国内REIT	13,864	9.8	8.73	10.91	0.928
日本	13,864	9.8	8.73	10.91	0.928
外国REIT	11,305	8.8	7.64	9.67	1.490
グローバル	12,383	8.6	3.45	4.18	1.264
除く日本	13,571	6.7	2.35	2.97	0.940
含む日本	11,485	10.0	3.98	4.77	1.420
北米	10,576	9.4	10.84	13.94	1.622
その他	9,241	8.6	6.99	8.19	1.756
欧州	6,002	8.9	4.34	5.55	1.821
アジア・オセアニア	10,792	8.0	8.62	10.05	1.804
オーストラリア	9,056	8.2	3.99	4.82	1.704
複合地域	6,904	10.9	0.76	0.97	0.777
複数国	10,553	18.7	1.98	2.27	1.650
その他					
絶対収益型	10,259	5.9	0.03	0.03	1.903
ロング・ショート	10,415	5.2	0.19	0.20	1.462
マーケットニュートラル	9,725	5.2	0.33	0.33	1.292
GTAA	10,832	9.0	0.02	0.02	1.503
その他スタイル	10,047	5.7	0.00	0.00	1.994
CB	11,524	9.4	0.69	0.83	1.215
アジア・オセアニア	9,574	12.5	2.36	2.51	1.823
日本	10,759	11.6	0.65	0.69	0.901
グローバル	11,675	9.0	0.63	0.77	1.210
コモディティ	11,635	7.0	0.63	0.58	0.910
全業種	10,208	10.5	1.92	1.75	1.302
貴金属	12,022	4.4	0.00	0.00	0.713
エネルギー	17,186	13.8	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	16,880	6.3	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