

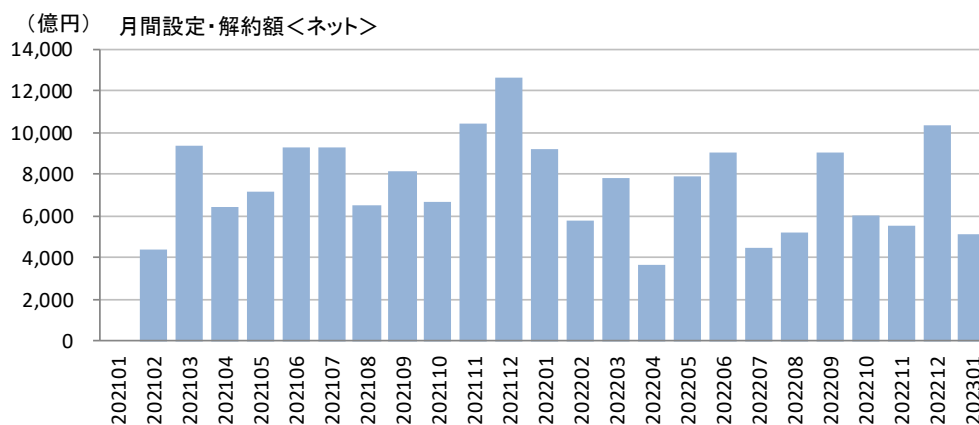
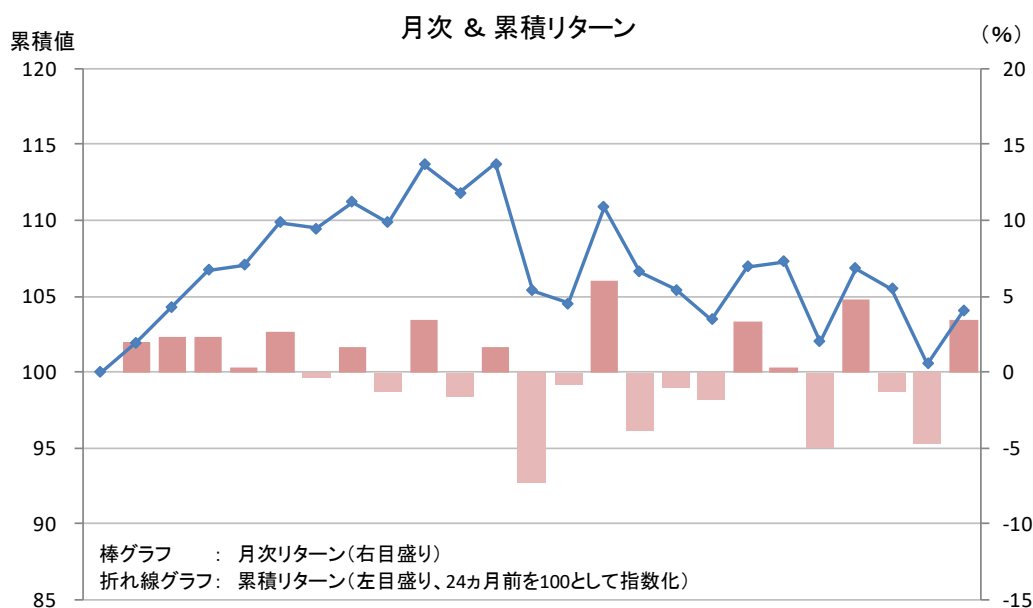
# 投信指数 MAB-FPI

## パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

### 2023年1月

**「総合」 +3.47 %**  
**(前月 -4.72 %)**



# 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

## &lt;1&gt;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		15,326	14,812	515	3.47	
国内株式		19,860	19,031	828	4.35	
一般		19,338	18,564	774	4.17	
フリー		18,048	17,324	724	4.18	
バリュー		25,440	24,430	1,010	4.13	
小型		40,381	38,742	1,639	4.23	
その他		19,631	18,768	863	4.60	
日経225		18,660	17,827	834	4.68	
TOPIX		19,628	18,801	827	4.40	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	18,538	17,750	788	4.44	
国内債券		12,365	12,382	-17	-0.14	
一般		12,365	12,382	-17	-0.14	
外国株式(先進国)		19,863	18,934	929	4.91	
グローバル		21,682	20,561	1,121	5.45	
除く日本		34,358	32,986	1,371	4.16	
含む日本		18,972	17,903	1,070	5.97	
その他		16,106	15,526	580	3.74	
北米		20,664	20,294	369	1.82	
米国		24,880	24,010	871	3.63	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	21,236	20,565	671	3.26	
欧州		23,801	22,540	1,261	5.59	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	11,559	10,756	804	7.47	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	10,921	10,734	187	1.74	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	40,098	37,230	2,869	7.71	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	20,542	19,195	1,346	7.01	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	47,409	45,791	1,618	3.53	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	13,959	13,840	119	0.86	
エマージング株式		18,375	17,742	633	3.57	
グローバル		18,554	17,408	1,145	6.58	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	23,594	22,522	1,072	4.76	
その他		19,014	18,642	372	1.99	
欧州		11,834	11,412	422	3.70	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,330	1,320	10	0.76	
アジア・オセアニア		18,522	17,183	1,340	7.80	
中国		43,382	39,382	4,000	10.16	
インド	10,000 (2004.09.30)	46,403	48,051	-1,648	-3.43	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	16,514	15,856	658	4.15	
タイ		24,505	24,013	492	2.05	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,879	7,437	442	5.94	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	20,919	19,398	1,521	7.84	
韓国	10,000 (1997.06.30)	27,604	25,490	2,114	8.29	
香港		23,296	21,340	1,957	9.17	
中南米	7,427 (2006.04.28)	10,229	9,693	536	5.53	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	8,692	8,421	271	3.22	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	14,447	12,826	1,620	12.63	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	12,640	12,659	-19	-0.15	
トルコ		35,842	39,021	-3,179	-8.15	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	24,966	23,394	1,571	6.72	

※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

## &lt;1&gt;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		15,326	14,812	515	3.47
外国債券(先進国)		18,066	17,750	316	1.78
グローバル		18,043	17,783	260	1.46
除く日本		19,493	19,213	280	1.46
含む日本		17,138	16,891	247	1.46
その他		18,378	17,813	565	3.17
北米	9,052 (2013.05.31)	10,366	10,159	208	2.05
米国		17,136	16,732	404	2.42
カナダ	10,000 (2003.05.30)	15,808	15,633	175	1.12
欧州	10,000 (1998.07.31)	13,686	13,509	177	1.31
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,151	9,715	436	4.48
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	20,748	19,874	875	4.40
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	25,651	24,505	1,146	4.68
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,244	10,883	362	3.32
複合地域	10,000 (2001.11.30)	17,660	17,464	196	1.12
エマージング債券		17,920	17,604	316	1.80
グローバル		18,244	17,810	434	2.44
米ドル建て		18,593	18,163	429	2.36
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	13,144	12,805	339	2.65
その他	8,647 (2005.03.31)	14,138	14,004	134	0.96
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,253	1,201	52	4.30
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	15,101	14,756	345	2.34
インド	10,000 (2011.08.31)	18,762	18,771	-9	-0.05
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	17,505	16,893	612	3.62
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	12,929	12,782	147	1.15
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	16,300	15,645	654	4.18
トルコ	10,000 (2011.04.28)	3,648	3,762	-114	-3.03
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,597	10,250	347	3.38
ハイイールド債券		25,042	24,457	585	2.39
グローバル	10,000 (1997.06.30)	23,846	23,127	719	3.11
北米		25,189	24,697	492	1.99
その他	10,000 (2004.03.31)	22,994	22,102	892	4.03
欧州	10,000 (2006.04.28)	23,274	22,410	863	3.85
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,323	13,646	677	4.96
複合地域	10,000 (2004.03.31)	21,993	21,662	331	1.53
複合資産		18,483	18,113	369	2.04
安定	10,000 (1998.10.30)	15,551	15,352	199	1.30
安定成長		20,372	19,943	429	2.15
成長		25,097	24,379	719	2.95
国内バランス		12,181	12,232	-51	-0.42
安定		12,356	12,426	-69	-0.56
一般		15,815	15,615	200	1.28
その他	10,000 (2018.10.31)	11,742	10,838	904	8.34

※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&gt; 総合

## &lt;1&gt;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		15,326	14,812	515	3.47	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	33,515	34,531	-1,016	-2.94	
日本	10,000 (2003.10.31)	33,515	34,531	-1,016	-2.94	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	33,059	31,177	1,882	6.04	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	27,517	25,894	1,623	6.27	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	30,988	28,956	2,031	7.01	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	27,210	25,692	1,518	5.91	
北米	10,000 (2003.09.30)	34,608	32,760	1,849	5.64	
その他	10,000 (2004.04.30)	31,116	28,894	2,222	7.69	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,176	4,845	331	6.83	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	23,179	21,432	1,748	8.16	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	17,495	16,142	1,352	8.38	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,442	7,122	320	4.49	
複数国	10,000 (2004.04.30)	43,664	42,255	1,409	3.33	
その他		6,247	6,017	230	3.83	
絶対収益型		7,514	7,411	103	1.39	
ロング・ショート		8,161	8,096	64	0.79	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,222	11,290	-68	-0.60	
GTAA		11,383	11,320	63	0.56	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,066	6,955	111	1.59	
CB		19,796	19,164	632	3.30	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	20,209	19,524	684	3.50	
日本		19,570	19,493	77	0.39	
グローバル		34,562	33,444	1,118	3.34	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	11,794	11,528	267	2.31	
全業種	10,000 (2004.12.30)	11,109	11,256	-147	-1.31	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	19,611	18,819	792	4.21	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	8,754	8,900	-146	-1.64	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	15,044	15,282	-237	-1.55	

※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	-2.63	-2.73	-1.30	3.47
国内株式	1.11	1.80	4.55	4.35
一般	1.53	2.30	4.78	4.17
フリー	1.27	2.16	4.15	4.18
バリュー	2.47	2.80	6.97	4.13
小型	1.30	4.50	6.05	4.23
その他	0.44	0.62	4.04	4.60
日経225	-0.89	-0.92	2.89	4.68
TOPIX	2.52	3.00	6.73	4.40
JPX日経400	2.86	3.10	6.53	4.44
国内債券	-2.12	-3.72	-5.94	-0.14
一般	-2.12	-3.72	-5.94	-0.14
外国株式(先進国)	-4.34	-3.02	-2.26	4.91
グローバル	-3.01	-2.07	-2.19	5.45
除く日本	-3.91	-0.48	4.11	4.16
含む日本	-2.65	-2.66	-4.33	5.97
その他	-7.14	-5.04	-2.31	3.74
北米	-7.24	0.88	12.37	1.82
米国	-7.62	-5.41	-3.23	3.63
カナダ	-5.53	-3.18	2.98	3.26
欧州	5.82	5.90	4.14	5.59
ドイツ	9.59	17.22	7.89	7.47
イギリス	2.68	3.56	11.48	1.74
アジア・オセアニア	9.53	3.33	4.45	7.71
オーストラリア	2.97	1.61	20.88	7.01
ニュージーランド	5.73	8.83	15.00	3.53
複合地域	-11.93	3.86	35.01	0.86
エマージング株式	0.39	-0.86	-0.47	3.57
グローバル	7.00	2.72	1.48	6.58
BRICS	2.35	1.22	-12.65	4.76
その他	-2.90	-2.74	-1.15	1.99
欧州	12.83	20.16	-55.32	3.70
ロシア	-9.23	-1.33	-88.73	0.76
アジア・オセアニア	10.81	1.71	1.18	7.80
中国	17.96	-2.15	-1.30	10.16
インド	-12.88	-4.88	-0.07	-3.43
インドネシア	-10.40	0.83	19.38	4.15
タイ	4.07	13.09	18.26	2.05
フィリピン	4.75	6.26	-0.13	5.94
ベトナム	1.11	-10.14	-12.88	7.84
韓国	10.42	-1.23	-8.12	8.29
香港	30.48	4.10	7.61	9.17
中南米	-8.03	10.93	24.28	5.53
ブラジル	-12.64	4.11	12.38	3.22
メキシコ	4.85	22.83	41.39	12.63
中東・アフリカ	-12.64	-8.50	-0.11	-0.15
トルコ	15.71	72.64	89.24	-8.15
複合地域	12.37	1.25	-0.52	6.72

※[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	-2.63	-2.73	-1.30	3.47
外国債券(先進国)	-2.15	-3.78	-3.14	1.78
グローバル	-2.02	-3.72	-4.57	1.46
除く日本	-4.08	-5.40	-4.26	1.46
含む日本	-0.21	-2.24	-4.94	1.46
その他	-2.69	-4.06	2.62	3.17
北米	-0.31	-3.51	-6.13	2.05
米国	-3.24	-4.74	-0.41	2.42
カナダ	-8.54	-7.34	3.54	1.12
欧州	-0.48	-4.48	-10.19	1.31
イギリス	-0.40	-3.68	-2.65	4.48
アジア・オセアニア	-1.49	-2.48	7.55	4.40
オーストラリア	-1.35	-2.51	7.50	4.68
ニュージーランド	0.24	-3.36	3.92	3.32
複合地域	-6.20	-7.68	-1.63	1.12
エマージング債券	-2.89	1.80	5.38	1.80
グローバル	0.67	2.98	0.76	2.44
米ドル建て	1.26	2.66	-0.51	2.36
現地通貨建て	-0.96	3.95	4.59	2.65
その他	-7.24	0.19	10.83	0.96
ロシア	-20.59	19.28	-87.20	4.30
アジア・オセアニア	-0.33	1.08	3.44	2.34
インド	-8.17	-3.41	4.29	-0.05
インドネシア	-3.75	0.82	10.85	3.62
ブラジル	-9.24	3.13	24.90	1.15
メキシコ	-0.66	8.94	28.24	4.18
トルコ	-5.14	19.49	22.40	-3.03
複合地域	1.50	5.57	1.85	3.38
ハイイールド債券	-3.92	0.72	5.94	2.39
グローバル	1.11	2.30	3.35	3.11
北米	-6.11	-0.29	6.89	1.99
その他	4.09	5.42	5.05	4.03
欧州	2.99	4.80	5.13	3.85
アジア・オセアニア	9.32	8.37	4.97	4.96
複合地域	-3.34	0.66	1.88	1.53
複合資産	-1.62	-2.67	-2.49	2.04
安定	-1.53	-3.06	-4.50	1.30
安定成長	-1.85	-2.27	-1.31	2.15
成長	-1.32	-0.99	1.72	2.95
国内バランス	-2.35	-3.83	-4.06	-0.42
安定	-2.53	-4.11	-4.43	-0.56
一般	-0.47	-0.61	-0.12	1.28
その他	0.84	-13.65	-19.44	8.34

※[色塗りの基準]期間別リターン&gt;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	-2.63	-2.73	-1.30	3.47
国内REIT	-6.57	-7.53	-1.96	-2.94
日本	-6.57	-7.53	-1.96	-2.94
外国REIT	-2.28	-8.47	0.60	6.04
グローバル	-1.42	-7.66	-0.40	6.27
除く日本	-0.61	-7.03	-0.07	7.01
含む日本	-1.80	-7.97	-0.57	5.91
北米	-3.82	-9.76	0.35	5.64
その他	5.07	-3.04	8.26	7.69
欧州	7.13	-2.03	-10.94	6.83
アジア・オセアニア	6.05	-3.11	10.37	8.16
オーストラリア	5.85	-0.08	9.80	8.38
複合地域	1.57	-0.22	8.89	4.49
複数国	-4.58	-9.51	-1.84	3.33
その他	0.51	-2.20	-3.66	3.83
絶対収益型	0.31	-1.46	-4.05	1.39
ロング・ショート	-0.73	-2.31	-3.98	0.79
マーケットニュートラル	-1.08	-1.48	-4.81	-0.60
GTAA	-2.20	-2.48	-1.88	0.56
その他スタイル	0.62	-1.35	-4.20	1.59
CB	1.52	0.43	-4.83	3.30
アジア・オセアニア	-0.55	-2.44	2.00	3.50
日本	-0.46	-0.19	-0.96	0.39
グローバル	1.59	0.48	-5.26	3.34
コモディティ	1.03	1.50	16.32	2.31
全業種	-10.61	-6.43	20.98	-1.31
貴金属	8.30	5.98	10.57	4.21
エネルギー	-14.96	-11.62	24.85	-1.64
その他コモディティ	-9.92	-5.94	20.37	-1.55

※[色塗りの基準]期間別リターン＞総合

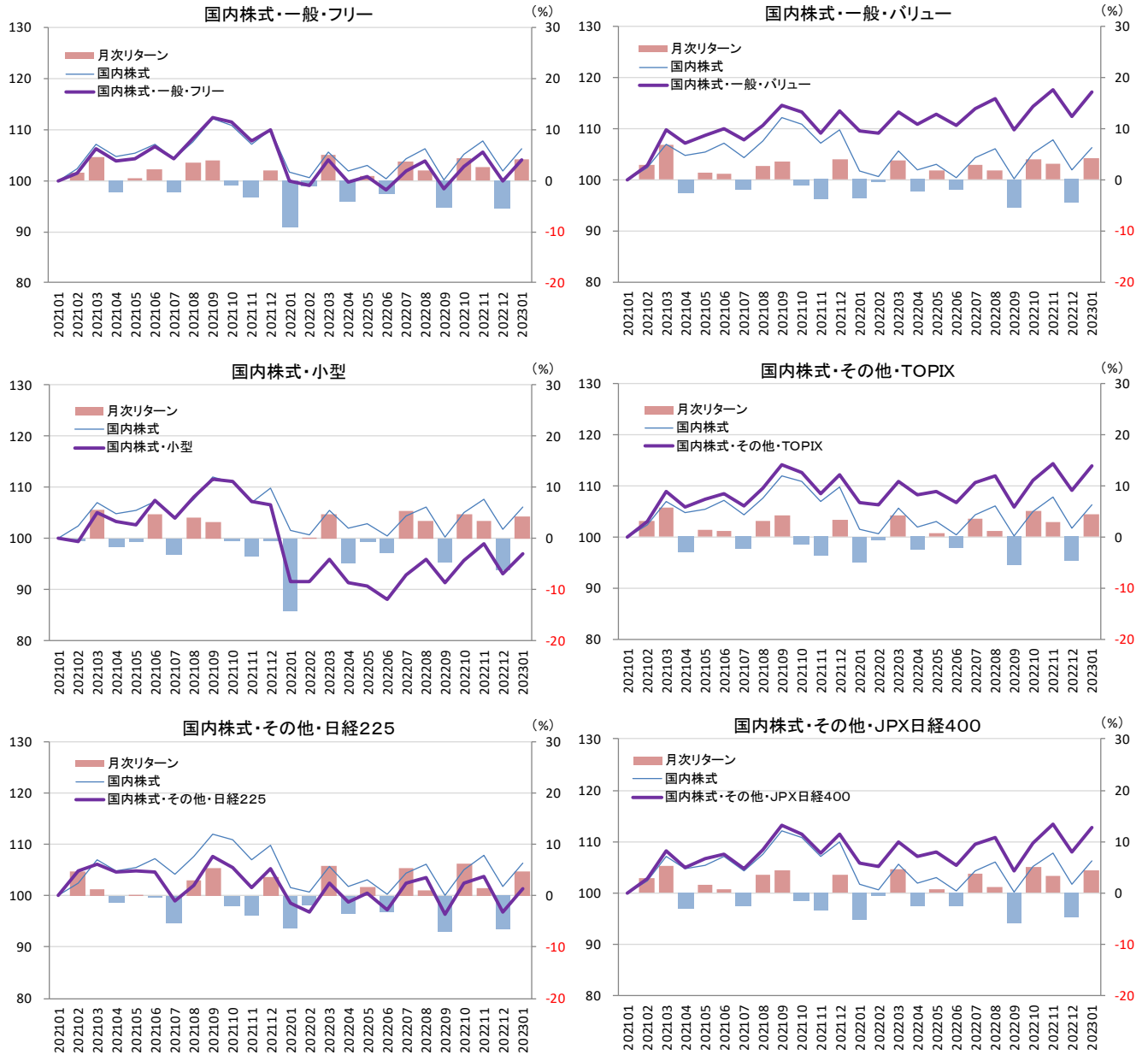


<1>パフォーマンス・サマリー

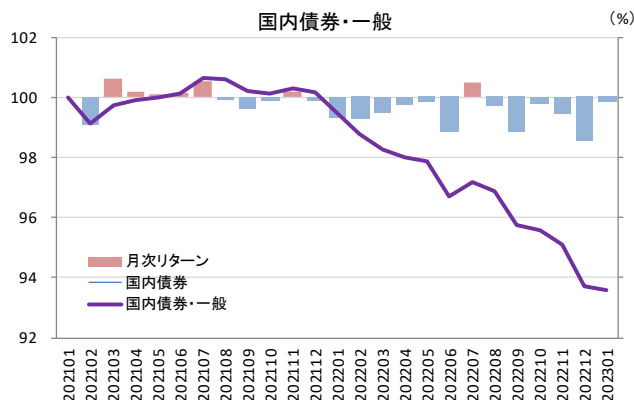
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

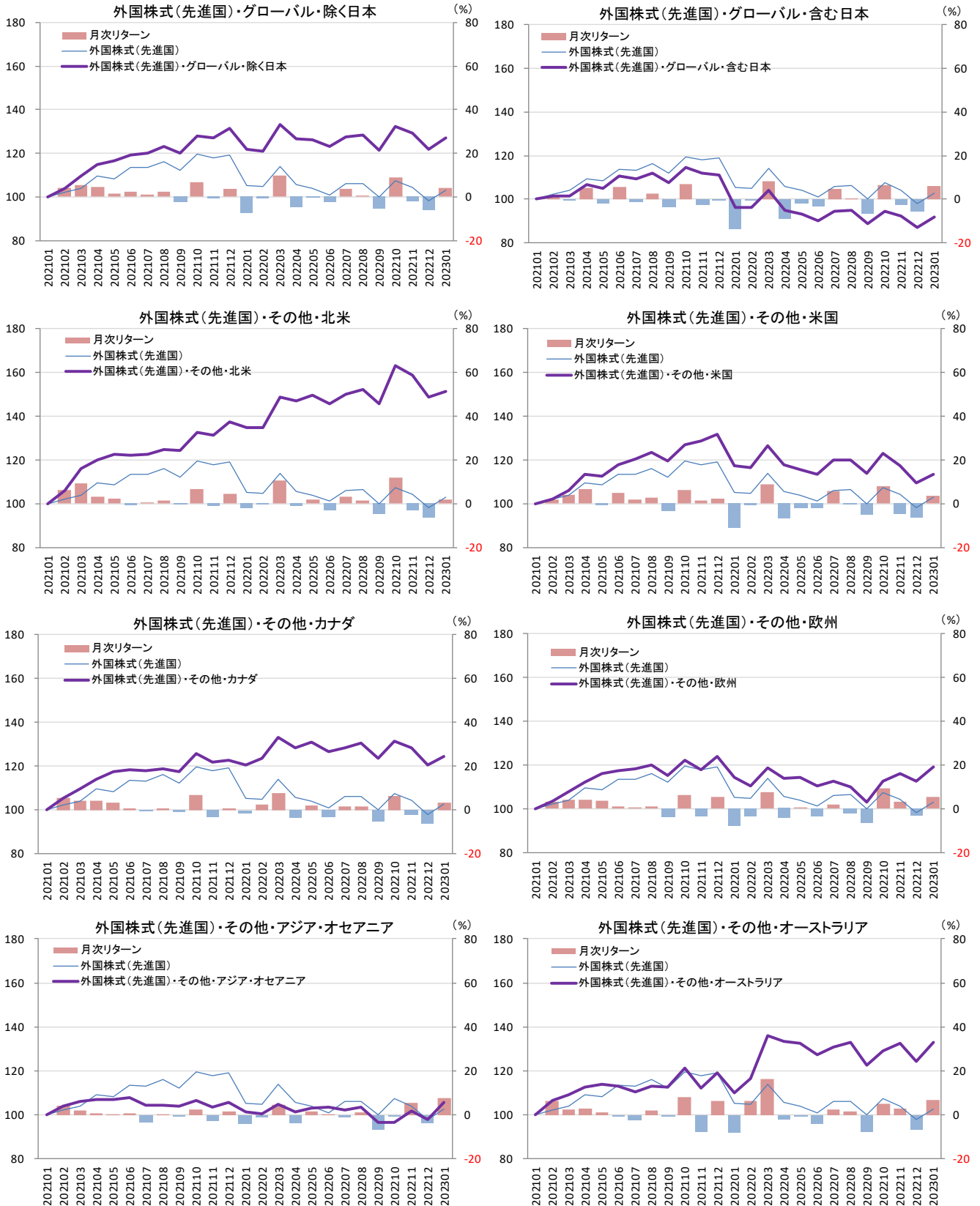


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

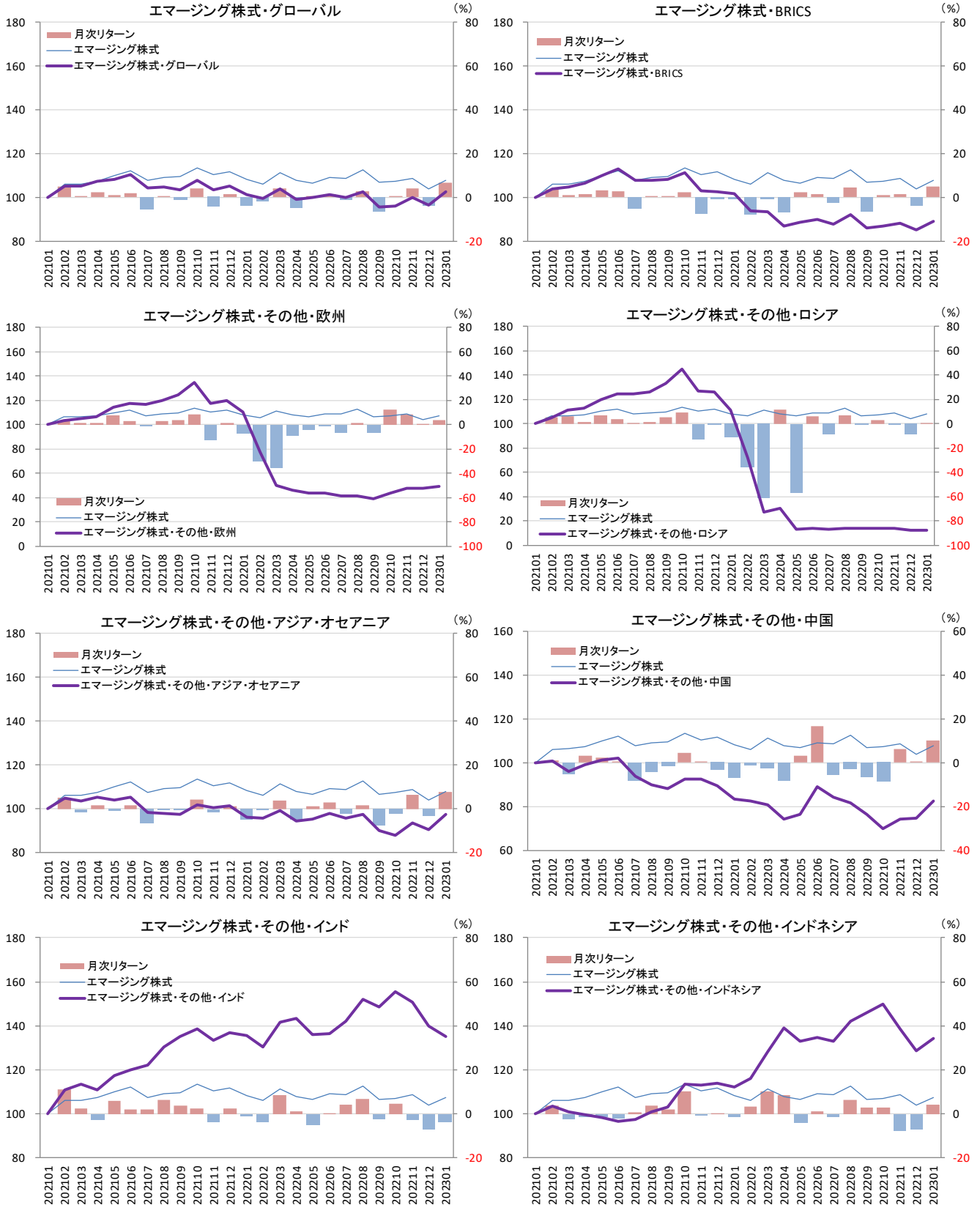


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマーシング株式]

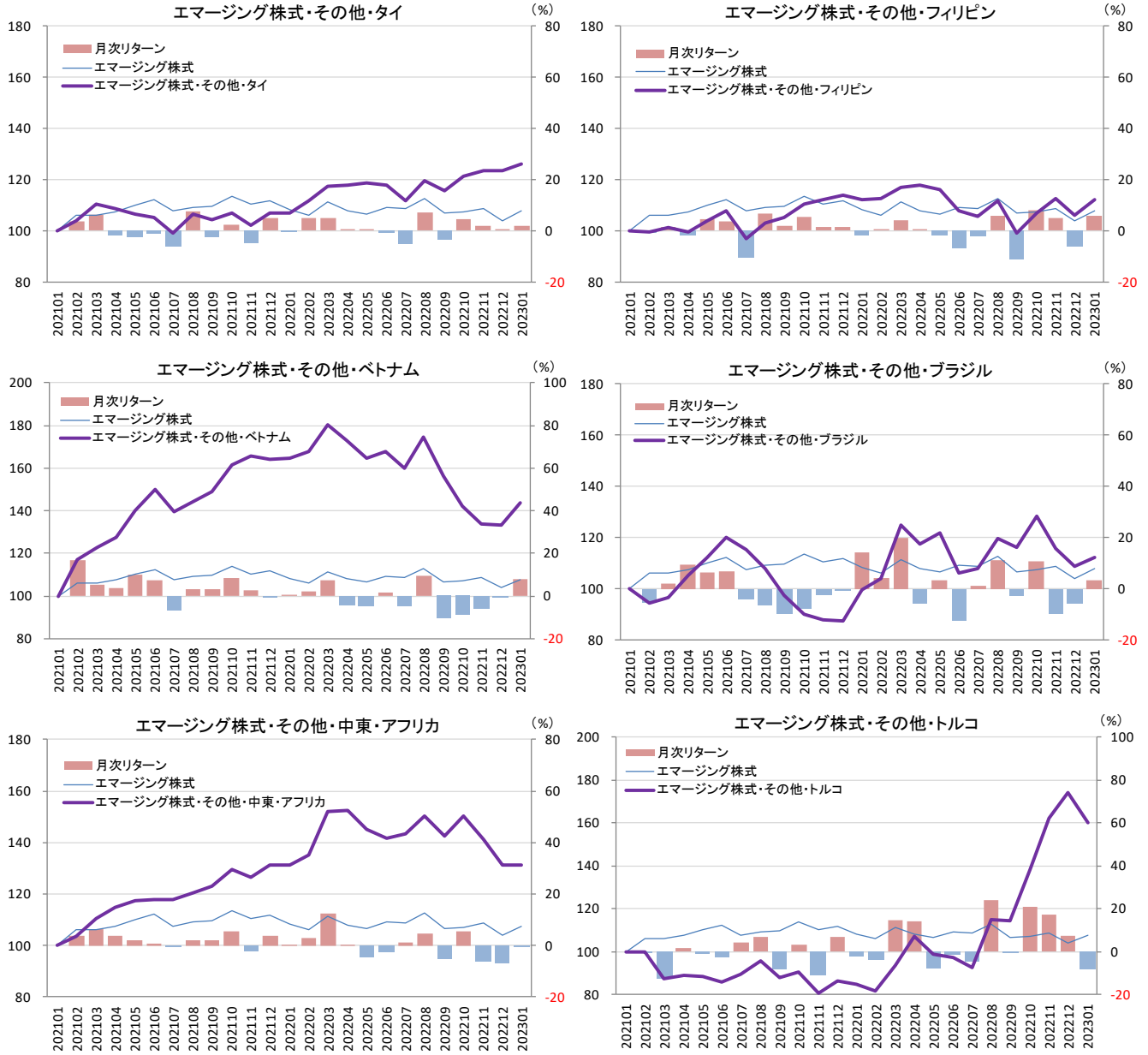


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

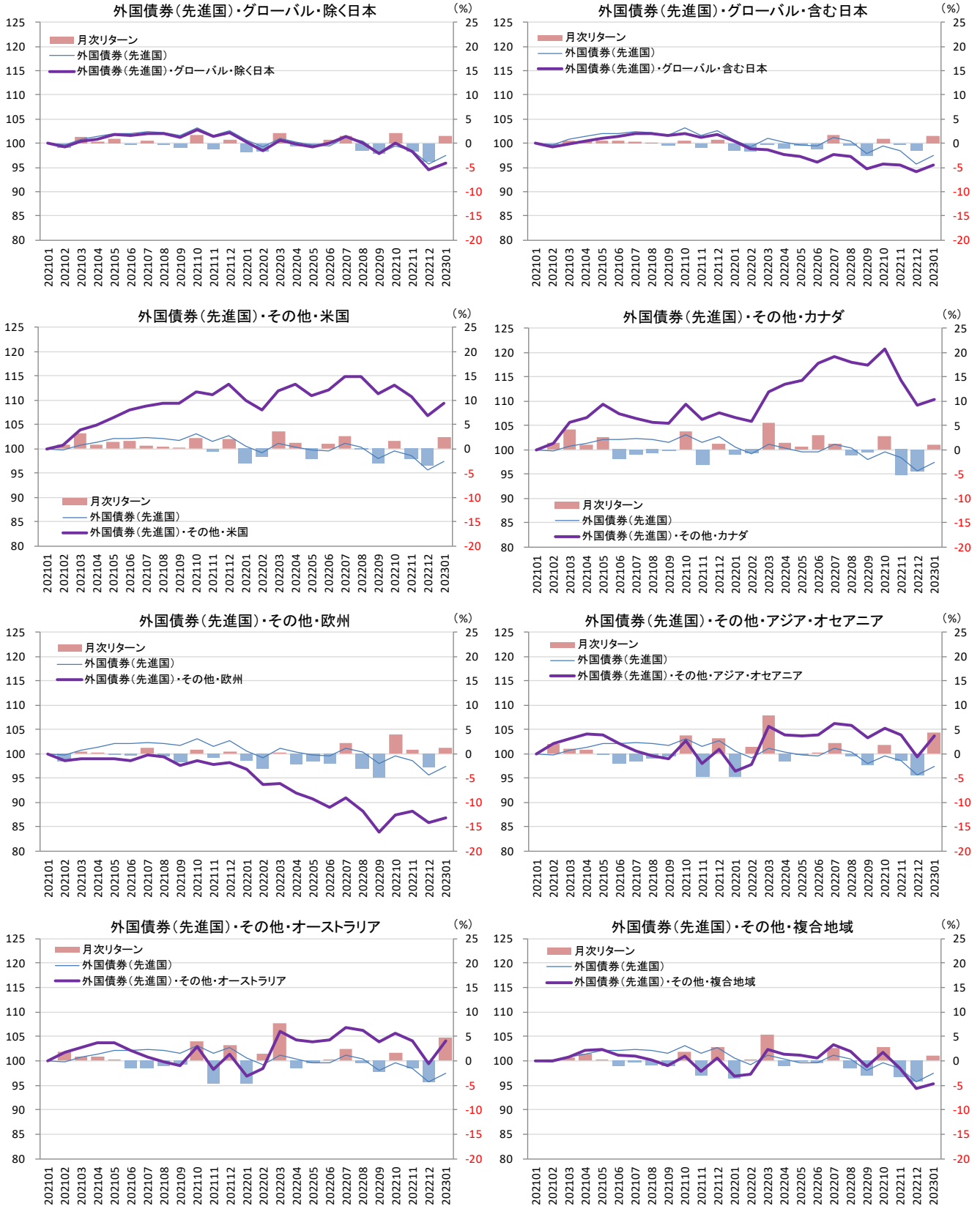


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

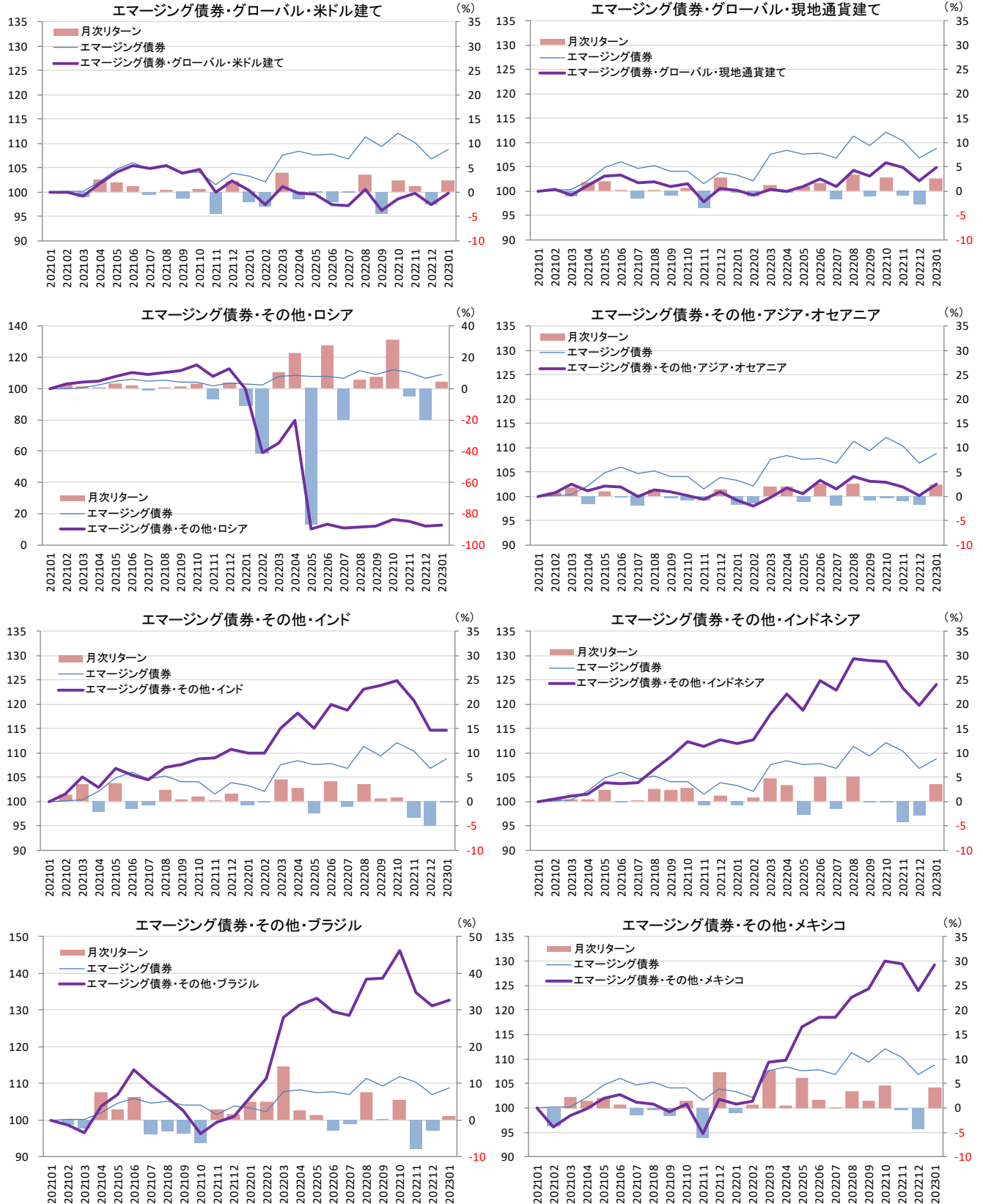


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

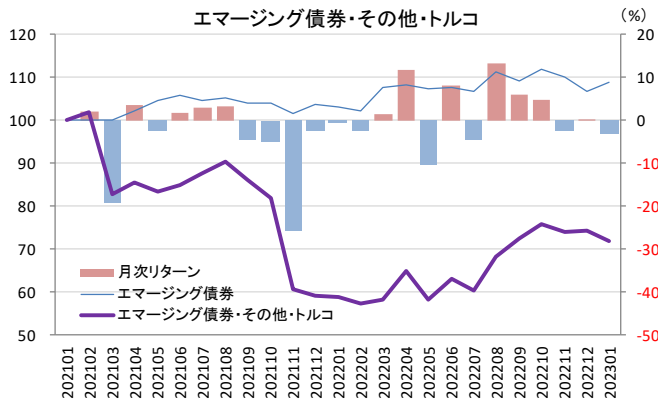


<1>パフォーマンス・サマリー

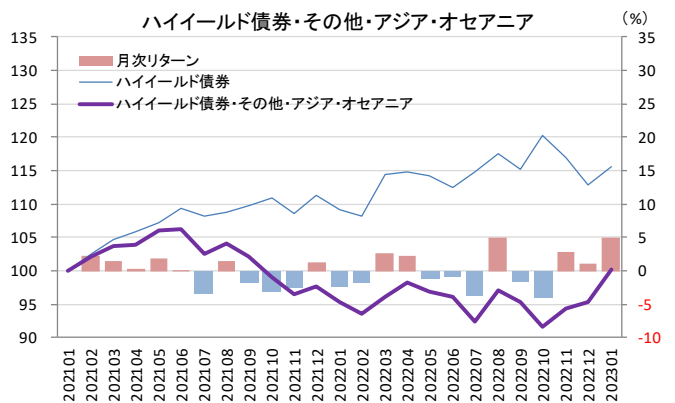
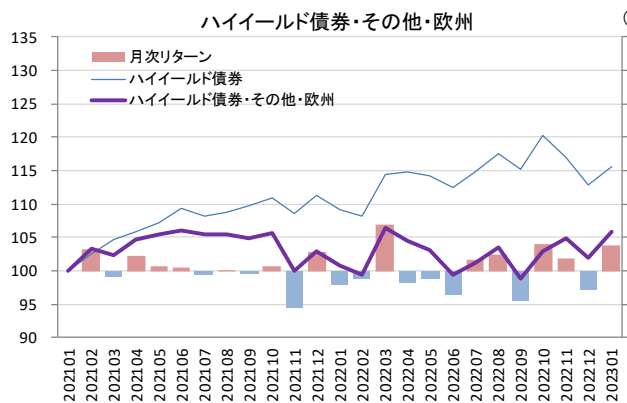
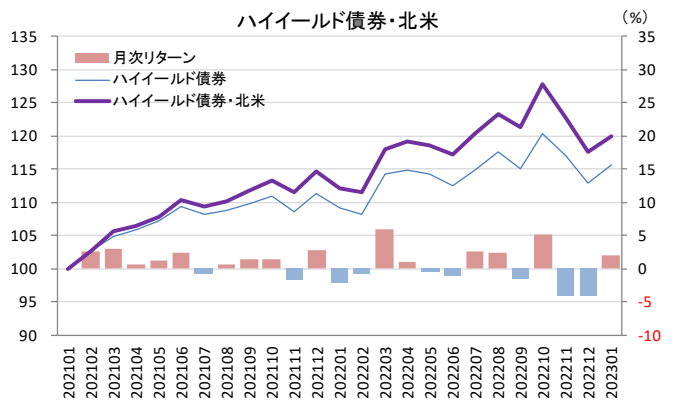
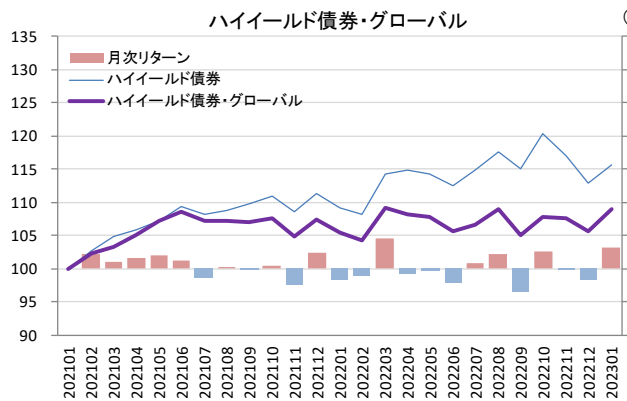
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

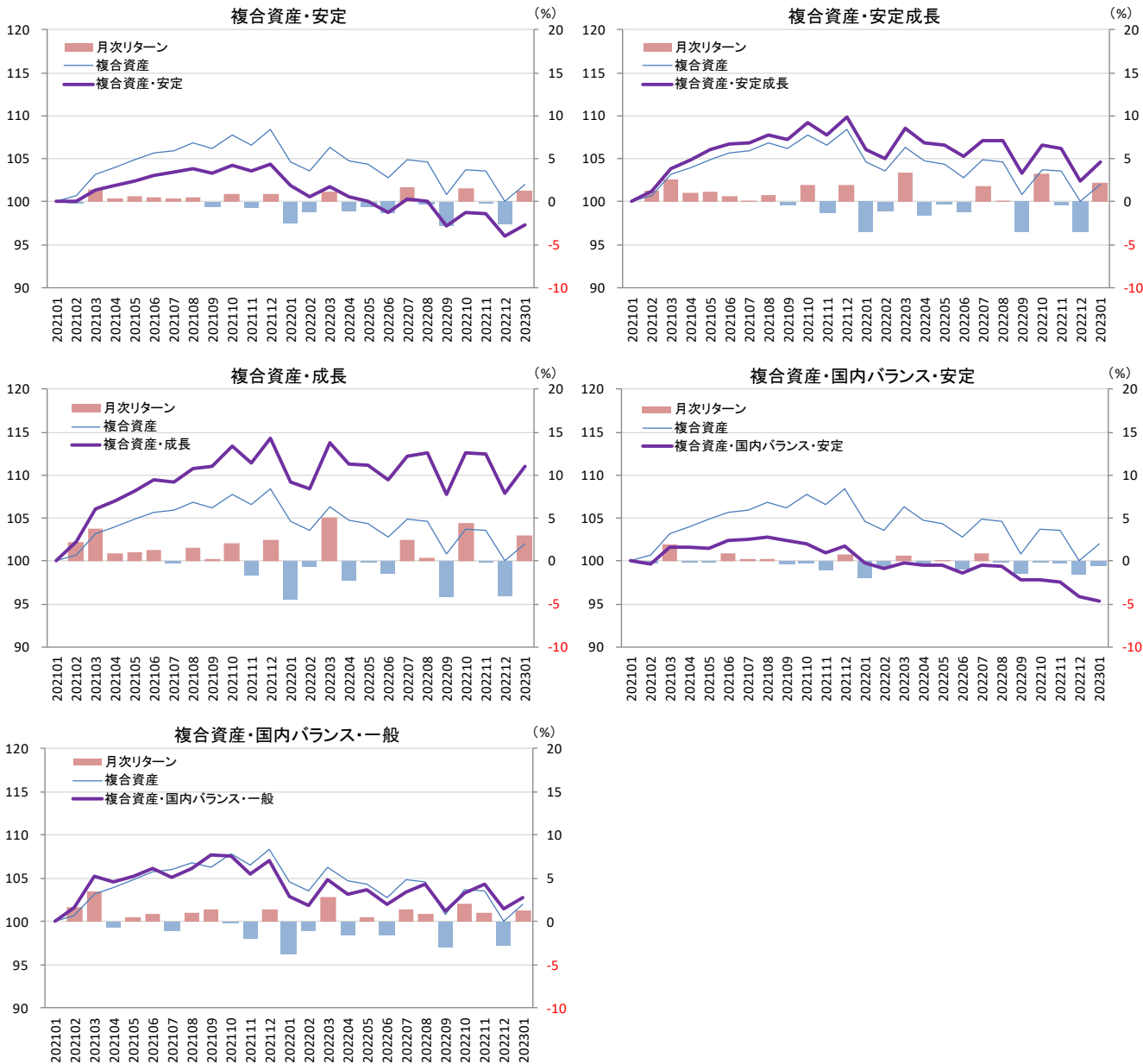


<1>パフォーマンス・サマリー

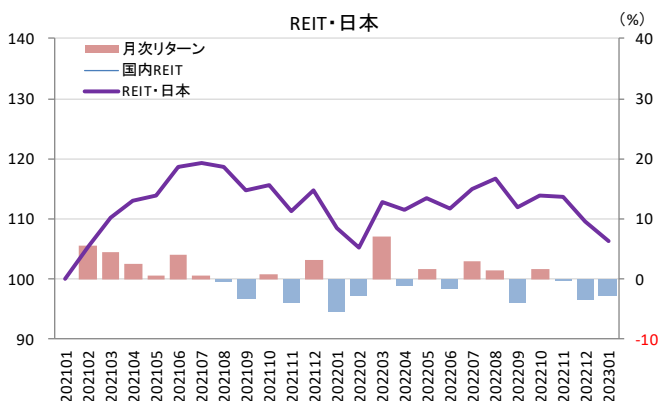
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]



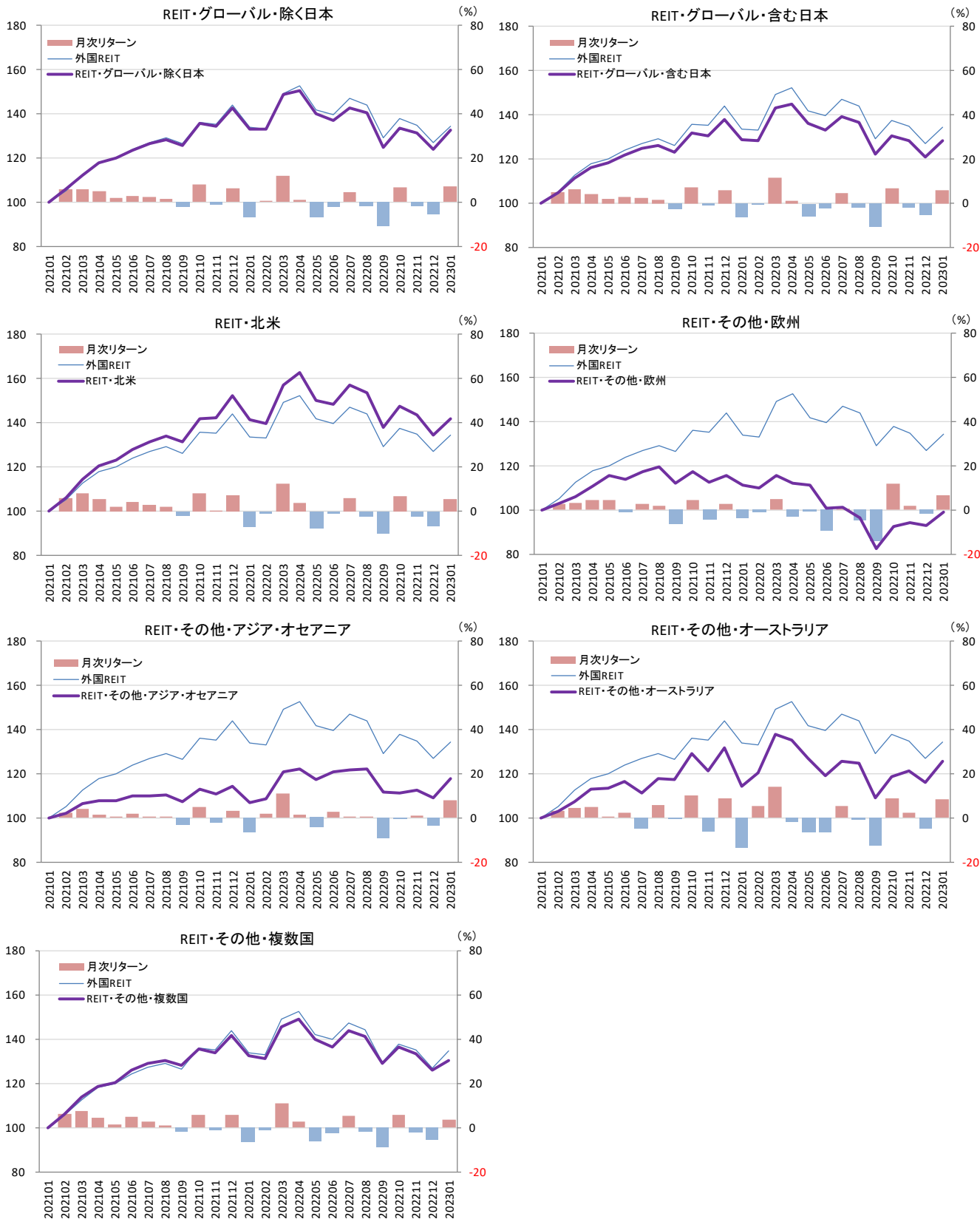


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

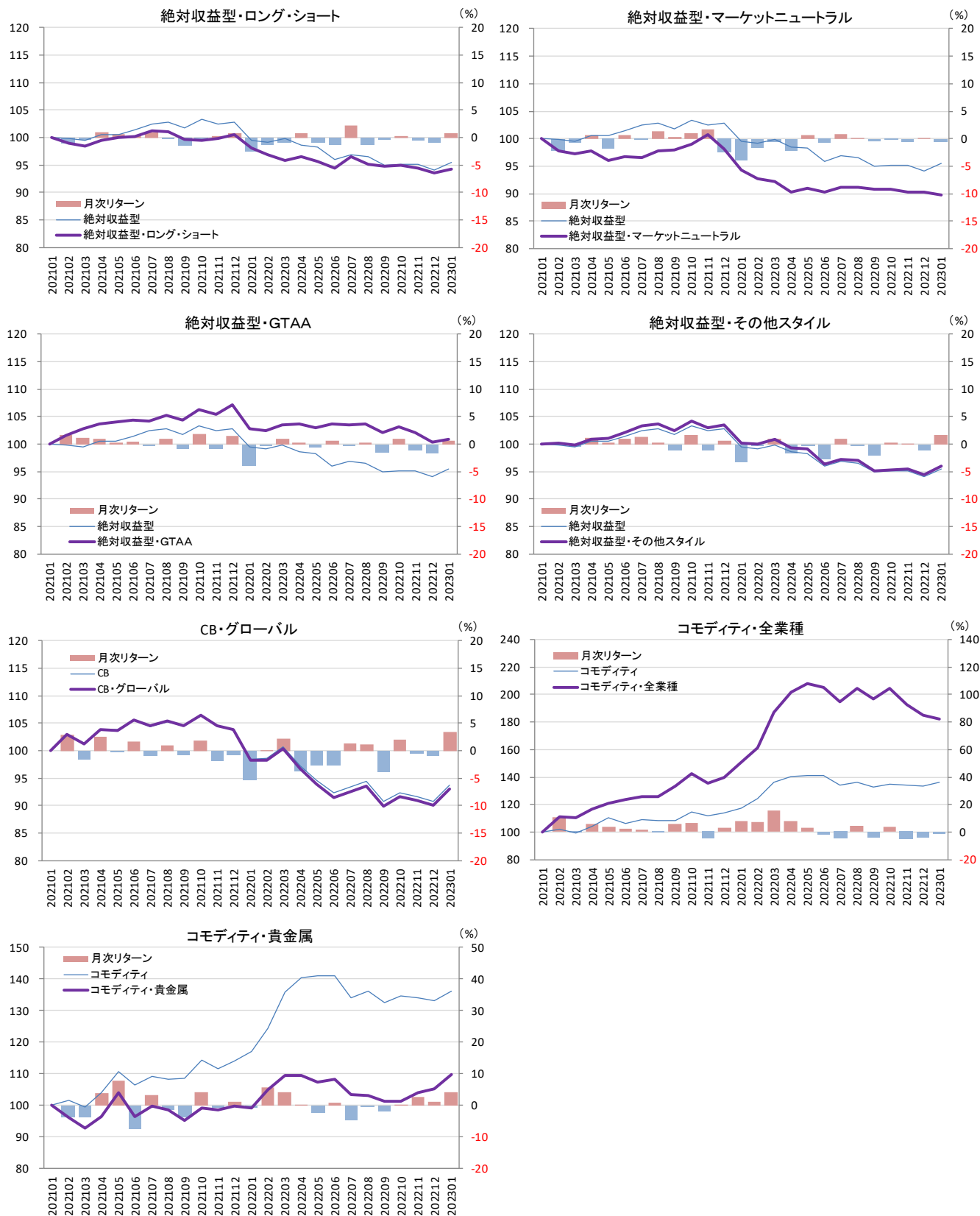


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]





## <1>パフォーマンス・サマリー

### (4) 対「総合」寄与度分析

#### ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	3.47		
1	外国株式(先進国)・グローバル	5.45	27.63	1.49
2	外国株式(先進国)・その他	3.74	12.79	0.49
3	国内株式・一般	4.17	6.79	0.28
4	国内株式・その他	4.60	4.85	0.22
5	REIT・北米	5.64	2.66	0.15
6	複合資産・安定成長	2.15	6.72	0.15
7	REIT・グローバル	6.27	1.98	0.12
8	外国債券(先進国)・グローバル	1.46	7.72	0.11
9	複合資産・成長	2.95	2.87	0.09
10	エマージング株式・グローバル	6.58	1.08	0.07
11	ブルベア	13.00	0.50	0.06
12	複合資産・安定	1.30	4.44	0.06
13	外国債券(先進国)・その他	3.17	1.80	0.06
14	エマージング株式・その他	1.99	2.05	0.04
15	国内株式・小型	4.23	0.78	0.03
16	ハイイールド債券・北米	1.99	1.45	0.03
17	複合資産・その他	8.34	0.35	0.03
18	REIT・その他	7.69	0.36	0.03
19	絶対収益型	1.39	1.39	0.02
20	エマージング債券・グローバル	2.44	0.70	0.02
21	コモディティ	2.31	0.58	0.01
22	ハイイールド債券・グローバル	3.11	0.30	0.01
23	ハイイールド債券・その他	4.03	0.22	0.01
24	CB	3.30	0.23	0.01
25	エマージング債券・その他	0.96	0.53	0.01
26	国内株式・業種特化	6.47	0.08	0.00
27	エマージング株式・BRICS	4.76	0.05	0.00
28	複合資産・国内バランス	-0.42	0.88	-0.00
29	国内債券・一般	-0.14	5.00	-0.01
30	REIT・日本	-2.94	3.23	-0.10
	合計		100.00	3.47

#### ◆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	-1.30			
1	国内株式・一般	4.78		6.68	0.33
2	国内株式・その他	4.04		4.62	0.25
3	ハイイールド債券・北米	6.89		1.41	0.07
4	コモディティ	16.32		0.56	0.06
5	複合資産・成長	1.72		2.66	0.05
6	エマージング債券・その他	10.83		0.59	0.05
7	国内株式・小型	6.05		0.77	0.05
8	外国債券(先進国)・その他	2.62		1.89	0.04
9	REIT・その他	8.26		0.39	0.03
10	REIT・北米	0.35		2.88	0.02
11	ハイイールド債券・その他	5.05		0.24	0.01
12	ハイイールド債券・グローバル	3.35		0.31	0.01
13	エマージング株式・グローバル	1.48		1.07	0.00
14	国内株式・業種特化	-1.33		0.08	-0.00
15	エマージング債券・グローバル	0.76		0.72	-0.00
16	REIT・グローバル	-0.40		2.16	-0.00
17	CB	-4.83		0.16	-0.01
18	エマージング株式・BRICS	-12.65		0.06	-0.01
19	複合資産・国内バランス	-4.06		0.95	-0.04
20	エマージング株式・その他	-1.15		2.14	-0.05
21	絶対収益型	-4.05		1.36	-0.07
22	複合資産・安定成長	-1.31		6.65	-0.07
23	REIT・日本	-1.96		3.27	-0.10
24	複合資産・その他	-19.44		0.39	-0.11
25	ブルベア	-22.07		0.49	-0.12
26	外国株式(先進国)・その他	-2.31		12.37	-0.15
27	複合資産・安定	-4.50		4.57	-0.25
28	国内債券・一般	-5.94		5.06	-0.36
29	外国債券(先進国)・グローバル	-4.57		7.67	-0.42
30	外国株式(先進国)・グローバル	-2.19		27.86	-0.51
	合計			100.00	-1.29

#### ◆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	12.68	17.22	65.43	13.42 ↑	11.93	10.88	0.30	0.27	0.48
国内株式	23.37	14.13	149.29	16.26	16.14	16.13	0.45	0.17	0.59
一般	23.31	11.47	136.84	15.71	15.94	16.27	0.46	0.14	0.55
フリー	22.49	10.66	135.24	16.09	16.29	16.84	0.44	0.13	0.53
バリュー	25.47	13.78	144.48	15.07	15.14	14.97	0.52	0.18	0.63
小型	20.16	6.57	228.41	20.77	19.59	18.19	0.31	0.07	0.69
その他	23.63	22.63	164.07	16.70	16.09	15.91	0.44	0.26	0.64
日経225	22.83	27.33	177.64	18.23	17.15	16.60	0.39	0.29	0.65
TOPIX	25.08	19.44	153.40	15.48	15.22	15.34	0.50	0.24	0.64
JPX日経400	24.95	20.55	-	15.93	15.41	-	0.49	0.25	-
国内債券	-7.63	-5.13	1.95	1.91	1.90	1.82	-1.35	-0.53	0.11
一般	-7.63	-5.13	1.95	1.91	1.90	1.82	-1.35	-0.53	0.11
外国株式(先進国)	26.64	38.64	124.21	19.85	18.33	16.00	0.41	0.37	0.53
グローバル	25.13	37.15	132.61	19.89	18.44	15.99	0.39	0.36	0.55
除く日本	41.80	54.73	193.03	19.54	18.19	16.54	0.63	0.50	0.69
含む日本	20.14	31.89	117.33	20.41	18.81	16.08	0.31	0.30	0.50
その他	30.86	42.60	107.91	20.22 ↑	18.34	16.27	0.47	0.40	0.47
北米	72.00	84.08	177.54	20.41	19.50	17.47	0.97	0.67	0.62
米国	34.65	55.45	141.72	19.53 ↑	18.17	16.65	0.54	0.51	0.55
カナダ	21.92	21.44	22.75	21.85	18.99	16.06	0.31	0.21	0.13
欧州	24.94	24.08	99.68	20.19	18.41	16.38	0.38	0.24	0.44
ドイツ	30.23	12.14	-	25.51	23.07	-	0.36	0.10	-
イギリス	21.61	11.43	-	19.14	17.75	-	0.35	0.13	-
アジア・オセアニア	16.75	14.79	97.38	16.22	15.41 ↑	15.22	0.33	0.18	0.46
オーストラリア	30.67	23.43	62.51	28.87	24.06	20.07	0.32	0.18	0.25
ニュージーランド	33.59	55.36	242.75	20.03	17.92	18.12	0.51	0.52	0.72
複合地域	69.70	32.29	-	39.76	33.72	-	0.49	0.17	-
エマージング株式	21.94	13.66	65.94	20.08	18.17	16.82	0.34	0.14	0.31
グローバル	23.68	20.03	57.01	18.89	18.20	16.96	0.39	0.21	0.27
BRICS	-4.11	-3.87	50.81	22.69	20.78	19.52	-0.06	-0.04	0.22
その他	22.18	11.98	70.92	20.79	18.59	17.05	0.33	0.13	0.32
欧州	-56.74	-56.84	-49.39	39.38	32.64	26.95	-0.62	-0.47	-0.24
ロシア	-88.39	-85.72	-82.73	59.44	47.96	38.16	-0.86	-0.67	-0.42
アジア・オセアニア	19.40	5.78	61.90	18.46	17.88	16.31	0.33	0.07	0.30
中国	20.84	20.41	147.96	22.32 ↑	21.67	21.59	0.29	0.18	0.44
インド	39.05	28.53	145.33	26.42	23.71	23.03	0.44	0.22	0.41
インドネシア	17.91	6.28	28.46	30.75	26.99	24.59	0.18	0.05	0.10
タイ	18.05	-7.49	30.61	24.29	21.33	18.65	0.24	-0.07	0.15
フィリピン	2.13	-16.05	9.71	24.12	21.06 ↑	19.35	0.03	-0.16	0.05
ベトナム	46.67	12.98	128.32	30.61 ↑	26.42	21.41	0.45	0.10	0.40
韓国	34.66	-3.94	34.24	28.00 ↑	24.89 ↑	20.23	0.37	-0.03	0.15
香港	4.64	-10.51	36.32	23.41 ↑	21.81 ↑	19.95 ↑	0.07	-0.10	0.16
中南米	14.65	13.98	12.43	34.60	30.95	26.37	0.14	0.09	0.05
ブラジル	-15.31	-13.91	-22.51	37.53	34.98	31.88	-0.14	-0.08	-0.08
メキシコ	47.79	38.01	-	32.23	29.09	-	0.43	0.23	-
中東・アフリカ	34.78	25.64	83.79	21.07	18.76	16.90	0.50	0.25	0.37
トルコ	50.95	2.70	-11.40	36.78 ↑	36.89 ↑	32.21	0.40	0.02	-0.04
複合地域	23.57	10.85	51.18	19.20	18.16 ↑	16.01	0.38	0.12	0.26

※[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 か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	12.68	17.22	65.43	13.42 ↑	11.93	10.88	0.30	0.27	0.48
外国債券(先進国)	0.51	2.03	12.50	5.50 ↑	4.69 ↑	5.91	0.04	0.09	0.20
グローバル	-1.80	1.35	14.76	4.69 ↑	3.99	5.34	-0.12	0.08	0.26
除く日本	-0.64	2.44	15.26	5.01 ↑	4.36	5.88	-0.04	0.12	0.24
含む日本	-3.17	0.03	14.23	5.23 ↑	4.28	5.05	-0.20	0.01	0.27
その他	9.00	6.01	12.69	8.92 ↑	7.70	8.01	0.33	0.16	0.15
北米	-2.01	1.41	-	6.09 ↑	4.85 ↑	-	-0.11	0.07	-
米国	5.75	13.91	37.34	8.88 ↑	7.15	6.76	0.22	0.37	0.48
カナダ	12.11	10.66	9.99	8.62 ↑	7.76	8.73	0.45	0.27	0.11
欧州	-10.94	-12.93	5.56	6.46 ↑	5.63 ↑	7.13 ↓	-0.58	-0.48	0.08
イギリス	3.90	-0.70	-	10.83 ↑	9.70 ↑	-	0.12	-0.01	-
アジア・オセアニア	14.43	5.55	12.68	11.16	9.88	9.68	0.41	0.11	0.12
オーストラリア	14.87	5.49	11.60	11.26	9.94	9.68	0.42	0.11	0.11
ニュージーランド	3.68	1.48	-	10.02	9.08	-	0.12	0.04	-
複合地域	4.32	7.01	14.49	7.21 ↑	6.06	7.59	0.20	0.23	0.18
エマージング債券	2.77	0.41	13.19	11.60	10.97	11.25	0.08	0.01	0.11
グローバル	-3.51	-6.44	6.27	13.60	12.42	11.79	-0.08	-0.10	0.05
米ドル建て	-4.83	-7.65	6.63	14.50	12.98	12.19	-0.11	-0.12	0.05
現地通貨建て	0.65	-2.44	1.50	10.86	11.05	10.69	0.02	-0.04	0.01
その他	10.61	8.78	20.64	11.04	10.64	11.78	0.31	0.16	0.16
ロシア	-89.36	-88.62	-88.87	67.81	53.31	41.31	-0.78	-0.66	-0.48
アジア・オセアニア	3.76	9.86	33.58	7.86	6.56	7.43	0.16	0.30	0.40
インド	17.66	19.23	65.01	9.55 ↑	9.18	11.45	0.59	0.39	0.45
インドネシア	22.83	28.96	31.21	15.58	14.53	15.54	0.46	0.36	0.18
ブラジル	2.77	-7.37	10.29	19.24	19.60	18.52	0.05	-0.08	0.05
メキシコ	27.35	51.86	37.94	18.17	16.48	15.69	0.46	0.53	0.21
トルコ	-43.13	-52.96	-68.58	27.03	33.90	26.76	-0.63	-0.41	-0.41
複合地域	-6.85	-0.91	-3.28	13.41	12.05	12.41	-0.17	-0.01	-0.03
ハイイールド債券	13.70	14.29	49.08	13.31	11.51	10.77	0.33	0.24	0.38
グローバル	6.84	4.66	34.44	12.99	11.40	10.81	0.17	0.08	0.28
北米	18.12	21.17	61.21	13.29	11.52	10.74	0.43	0.34	0.46
その他	2.93	-1.06	27.16	14.96	12.88	11.79	0.07	-0.01	0.21
欧州	3.75	-1.47	28.98	15.95	13.82	12.59	0.08	-0.02	0.21
アジア・オセアニア	-1.09	-0.99	28.19	13.81	11.58	10.56	-0.02	-0.01	0.24
複合地域	13.97	14.79	56.01	10.17	8.87	9.19	0.44	0.32	0.50
複合資産	4.11	7.72	50.05	8.12 ↑	7.26	7.59	0.17	0.21	0.55
安定	-1.57	0.64	31.62	5.51 ↑	5.00 ↑	5.91	-0.09	0.03	0.47
安定成長	7.27	11.41	55.41	8.65 ↑	7.80	7.96	0.28	0.29	0.57
成長	18.98	21.96	100.53	11.61	11.07	10.73	0.52	0.37	0.67
国内バランス	-9.57	-5.78	16.42	4.39	3.88	5.54	-0.74	-0.29	0.28
安定	-10.55	-6.05	14.77	4.24	3.69	3.24	-0.85	-0.33	0.43
一般	8.29	6.16	49.20	8.60	8.32	9.21	0.32	0.15	0.44

※[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	12.68	17.22	65.43	13.42	↑ 11.93	10.88	0.30	0.27	0.48
国内REIT	-8.12	22.72	101.06	17.83	14.78	16.07	-0.15	0.29	0.45
日本	-8.12	22.72	101.06	17.83	14.78	16.07	-0.15	0.29	0.45
外国REIT	17.57	43.45	113.48	22.29	↑ 18.69	16.43	0.25	0.40	0.48
グローバル	12.34	32.30	88.41	23.22	↑ 19.36	16.70	0.17	0.30	0.39
除く日本	16.83	41.15	112.31	24.03	↑ 19.96	17.03	0.22	0.36	0.46
含む日本	10.74	29.72	83.83	22.94	↑ 19.16	16.59	0.15	0.28	0.38
北米	23.21	56.43	137.20	21.78	↑ 18.55	16.69	0.33	0.51	0.54
その他	10.06	24.60	105.65	23.38	19.19	16.23	0.14	0.24	0.46
欧州	-13.53	-14.56	40.53	24.52	↑ 20.90	↑ 18.69	-0.19	-0.15	0.19
アジア・オセアニア	10.28	26.10	98.50	21.32	17.82	15.73	0.16	0.27	0.45
オーストラリア	12.66	24.35	72.16	36.50	29.06	23.10	0.11	0.15	0.24
複合地域	0.80	-4.12	43.16	29.96	25.02	20.68	0.01	-0.03	0.18
複数国	15.04	51.68	158.08	20.44	↑ 17.27	15.26	0.24	0.51	0.65
その他									
絶対収益型	-3.82	-7.29	-2.28	3.84	3.21	2.91	-0.33	-0.45	-0.08
ロング・ショート	-9.75	-12.49	-12.32	3.43	3.43	3.14	-0.97	-0.76	-0.41
マーケットニュートラル	-5.33	-11.77	30.05	4.82	4.22	5.70	-0.37	-0.58	0.47
GTAA	4.15	6.23	14.29	5.29	4.46	3.50	0.26	0.28	0.39
その他スタイル	-3.55	-6.82	-1.12	4.14	3.44	3.49	-0.28	-0.40	-0.03
CB	3.66	4.36	26.56	10.60	8.86	7.79	0.12	0.10	0.31
アジア・オセアニア	29.03	29.32	94.05	13.99	12.50	11.71	0.64	0.43	0.59
日本	-2.68	-7.40	34.92	5.30	5.18	6.24	-0.16	-0.29	0.49
グローバル	3.10	4.16	25.23	10.92	9.09	7.87	0.10	0.09	0.29
コモディティ	46.77	47.33	1.51	13.22	11.34	12.36	1.03	0.71	0.01
全業種	78.92	57.94	10.48	22.55	19.33	16.99	0.95	0.50	0.06
貴金属	24.85	38.29	4.06	13.25	12.11	12.97	0.58	0.56	0.03
エネルギー	99.42	81.62	6.37	42.10	37.00	31.43	0.62	0.34	0.02
その他コモディティ	53.30	37.61	12.97	22.13	19.20	17.00	0.69	0.35	0.07

※[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

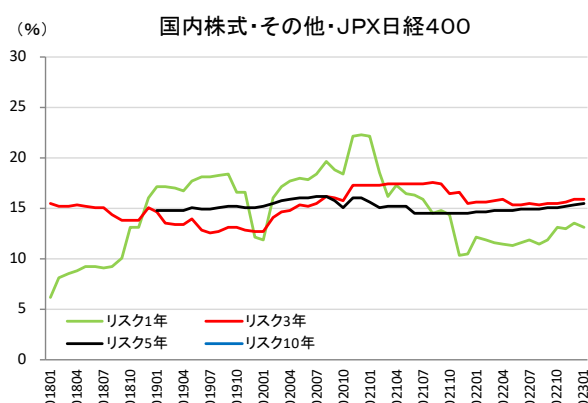
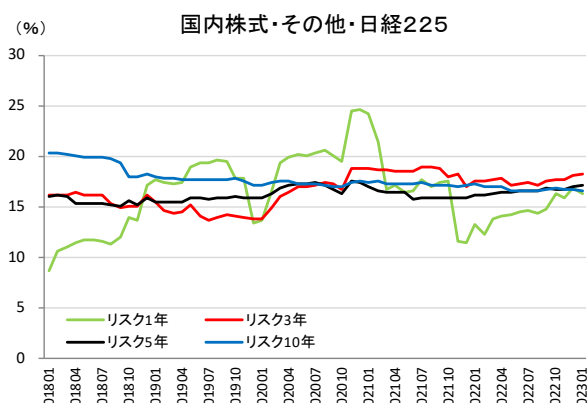
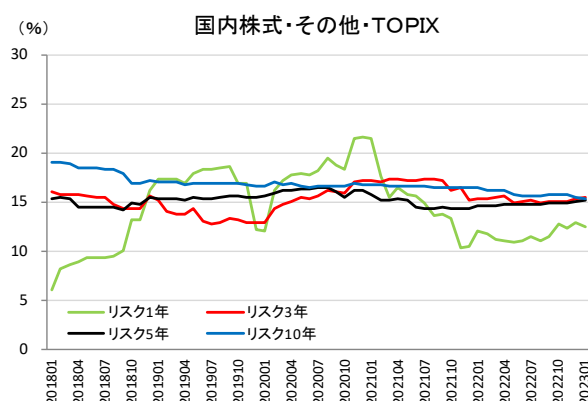
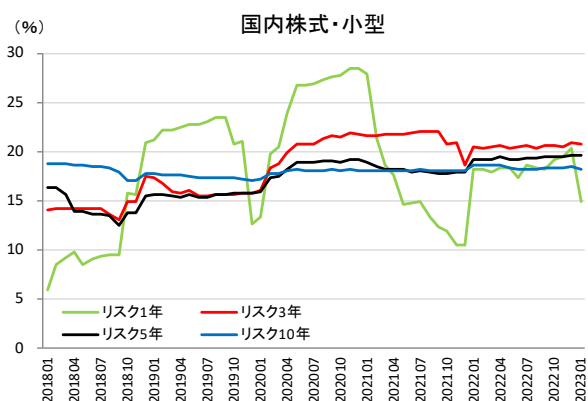
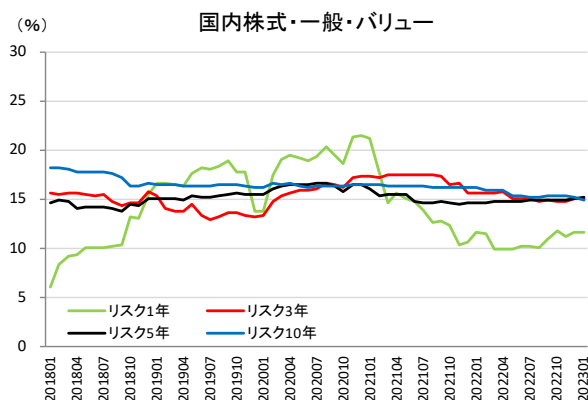
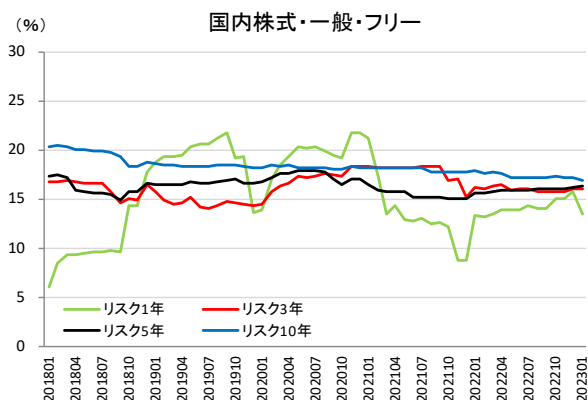


<2> リスク・サマリー

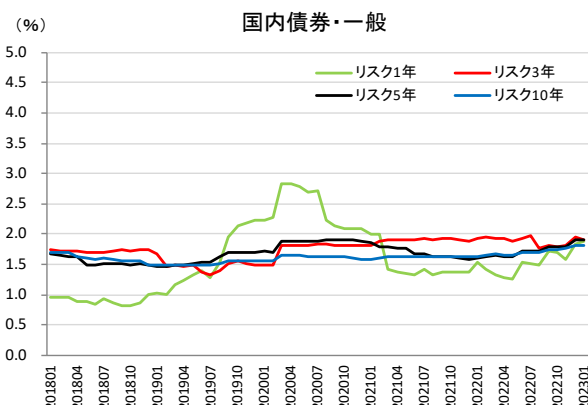
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

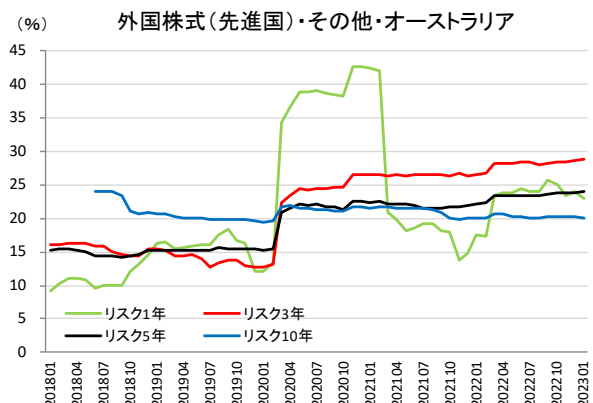
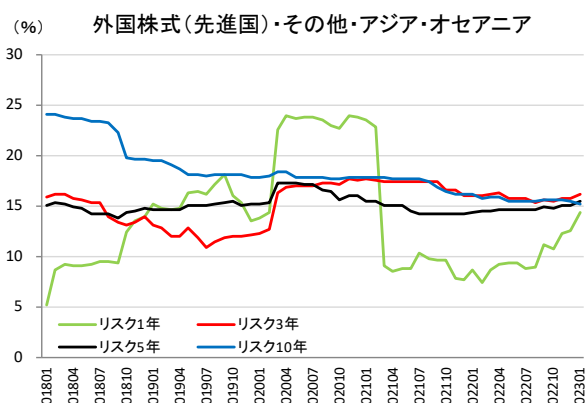
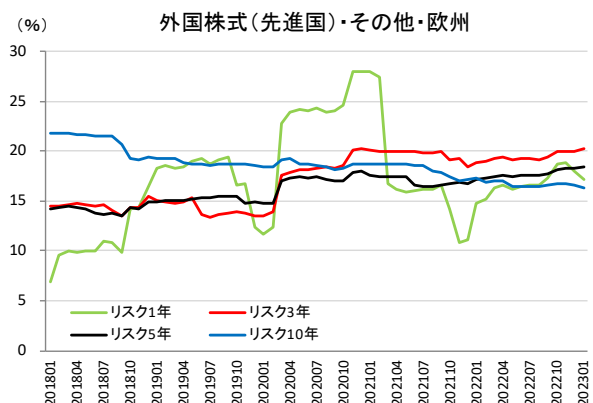
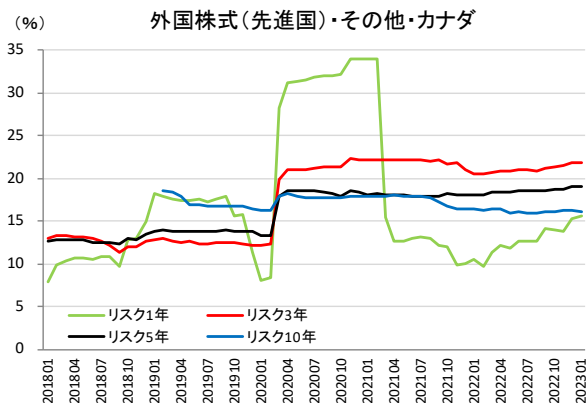
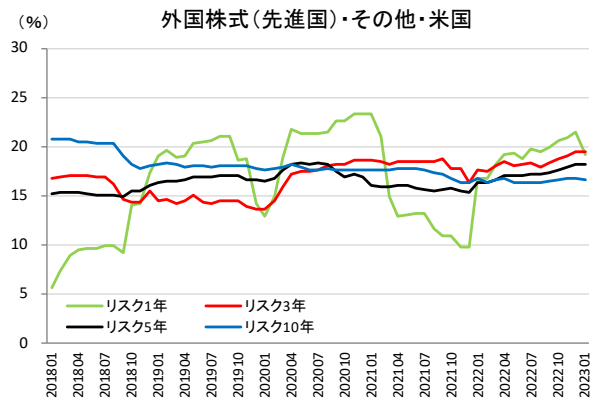
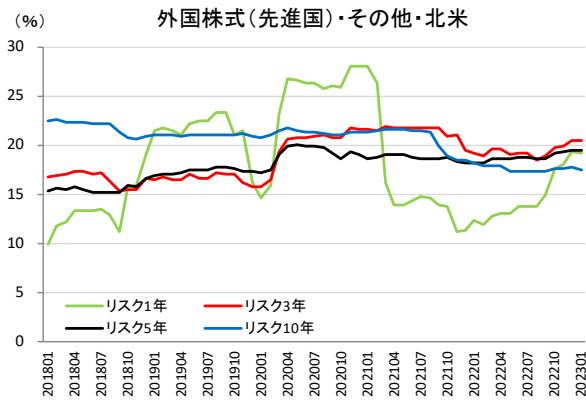
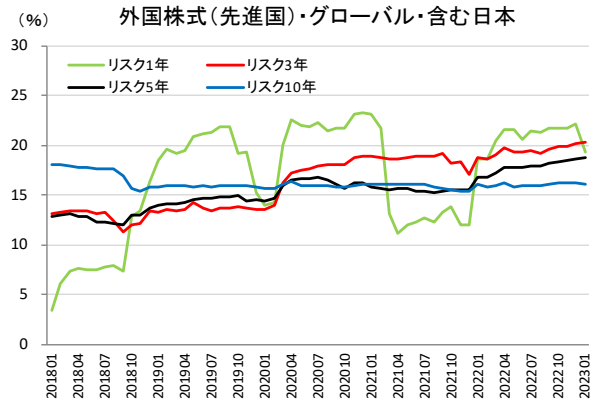
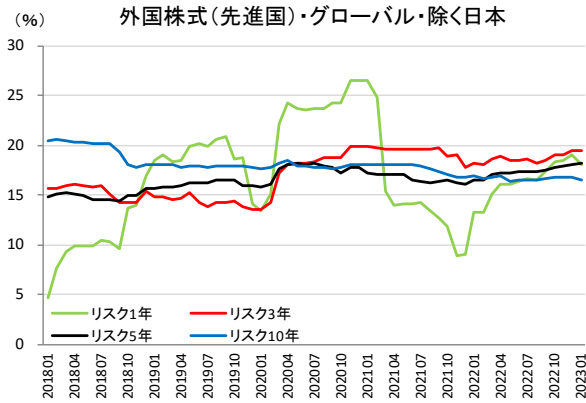


<2> リスク・サマリー

(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)]

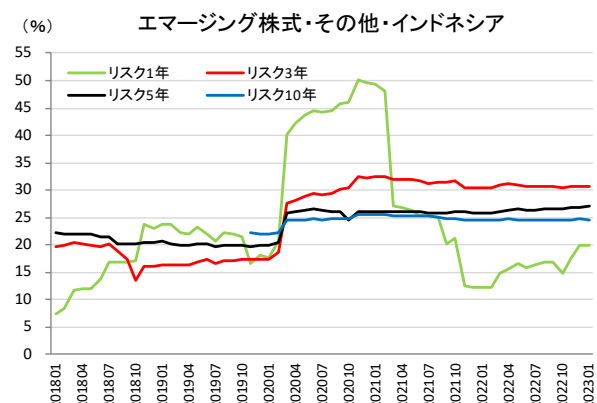
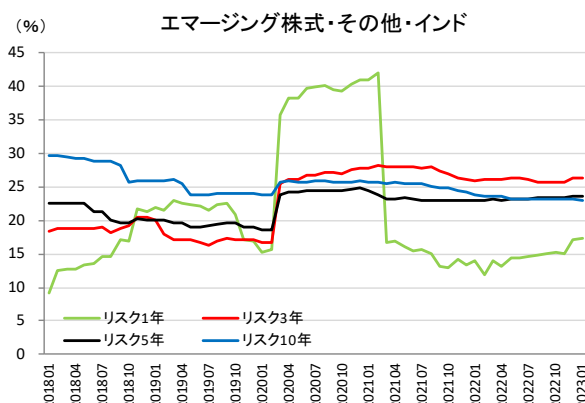
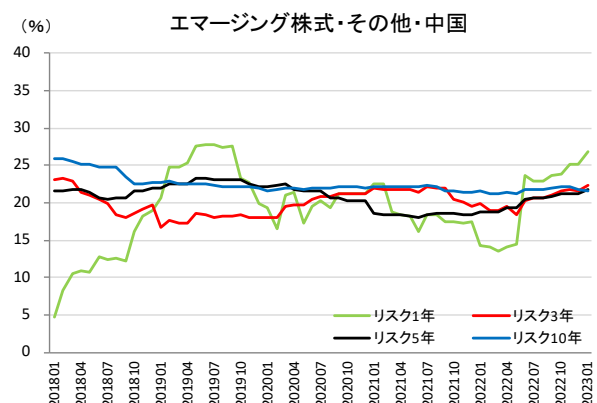
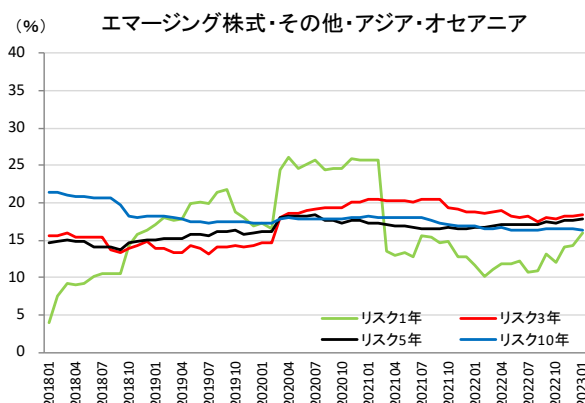
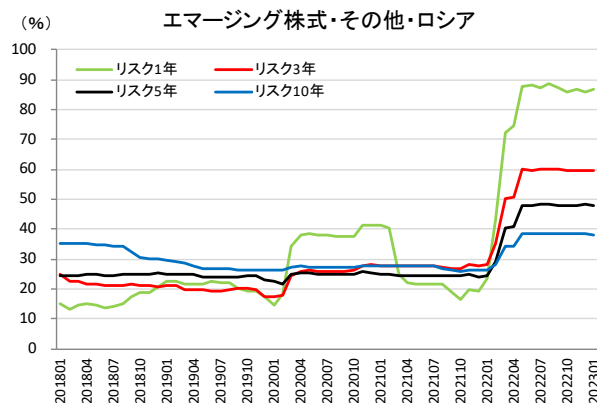
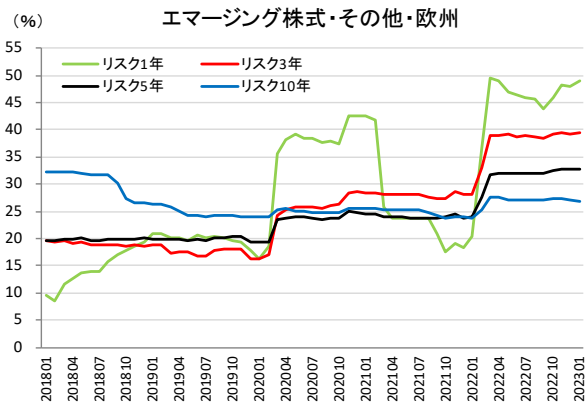
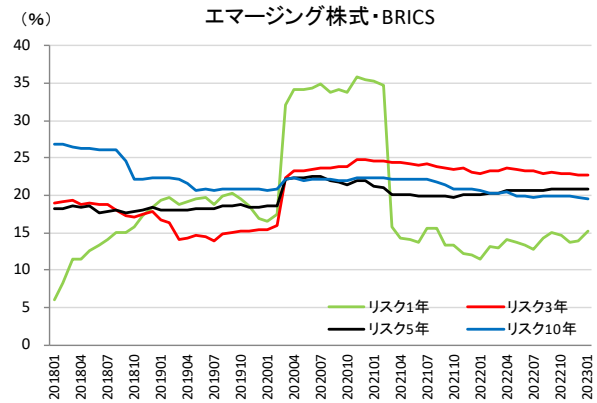
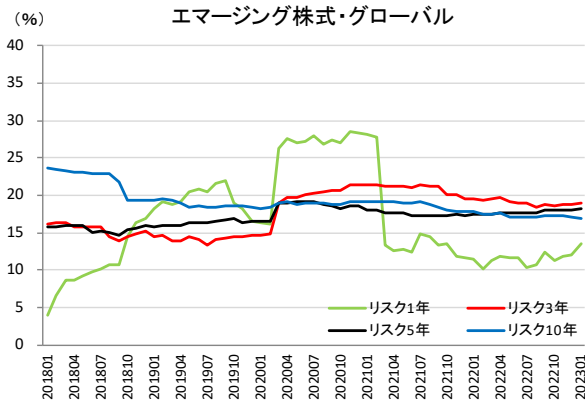


<2> リスク・サマリー

(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]

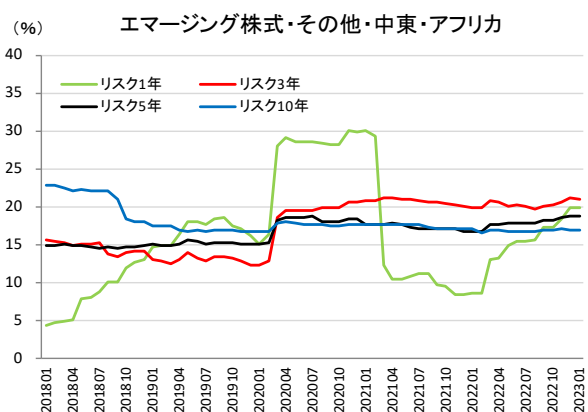
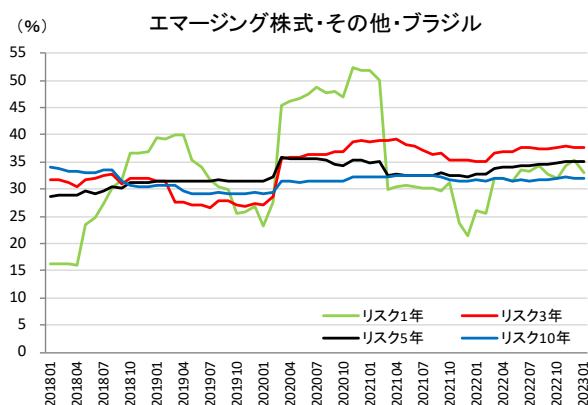
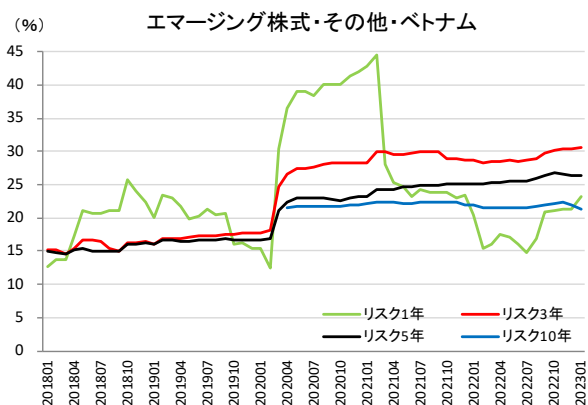
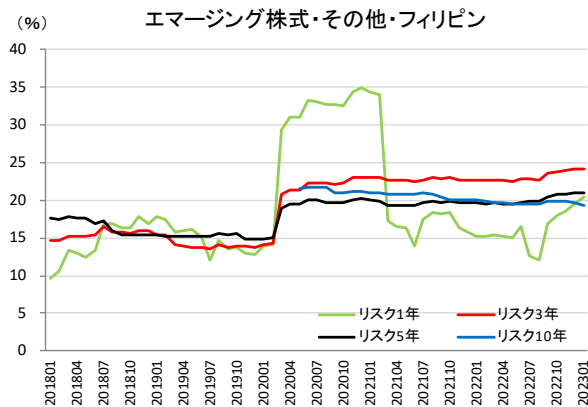
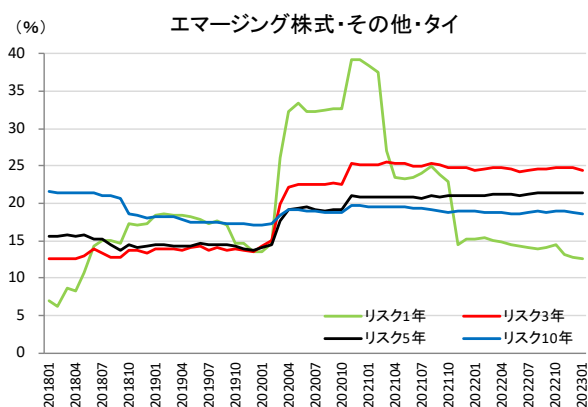


<2> リスク・サマリー

(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]

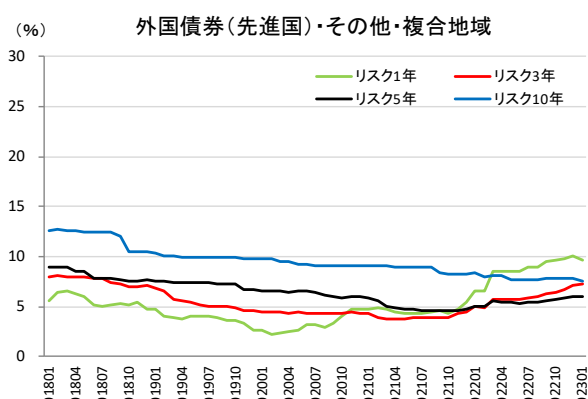
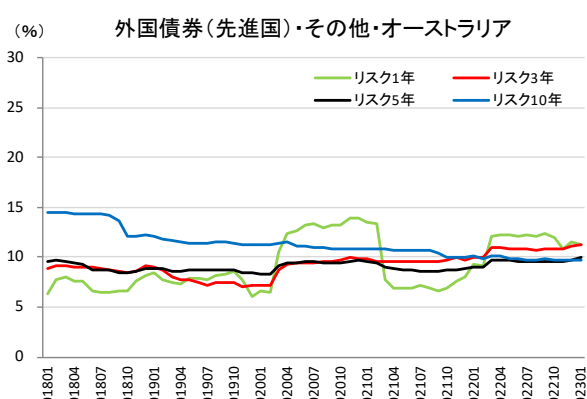
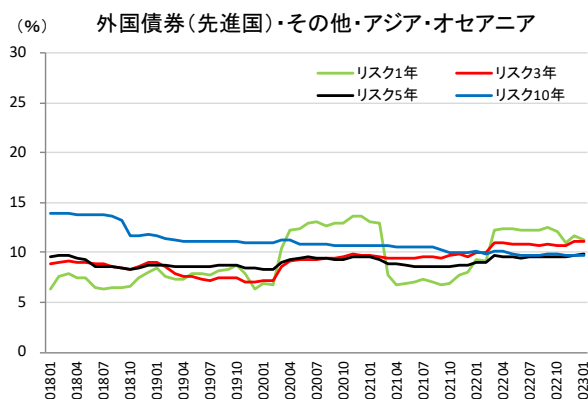
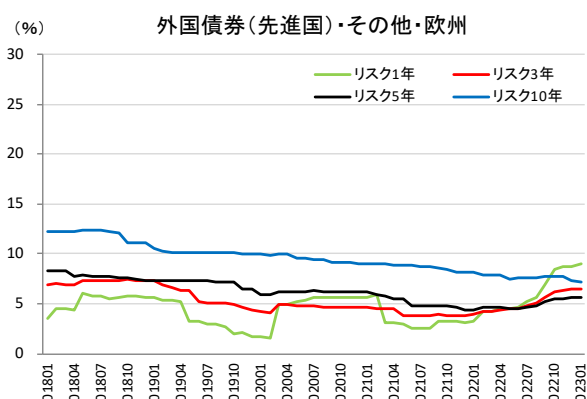
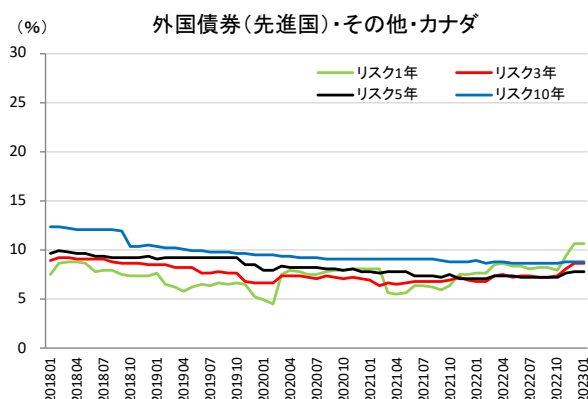
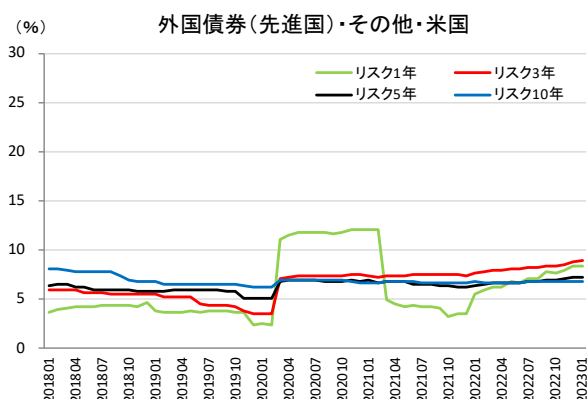
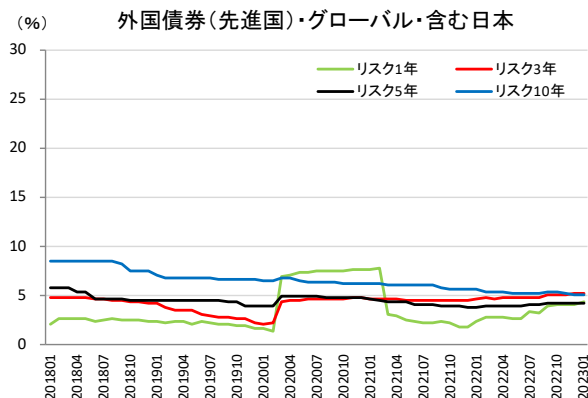
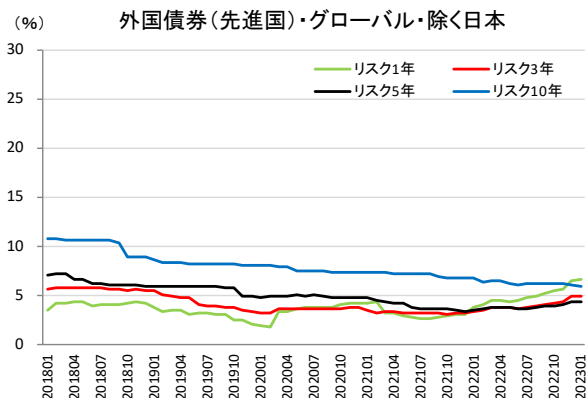


<2> リスク・サマリー

(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)]

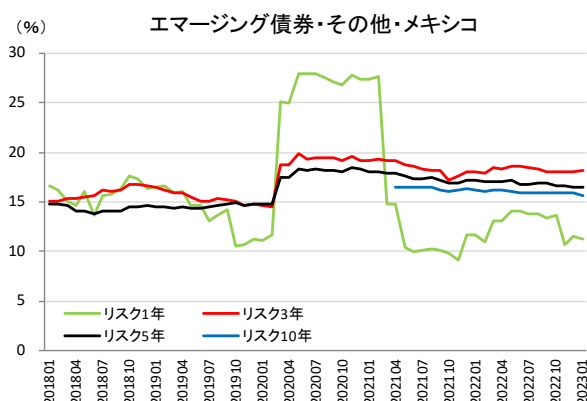
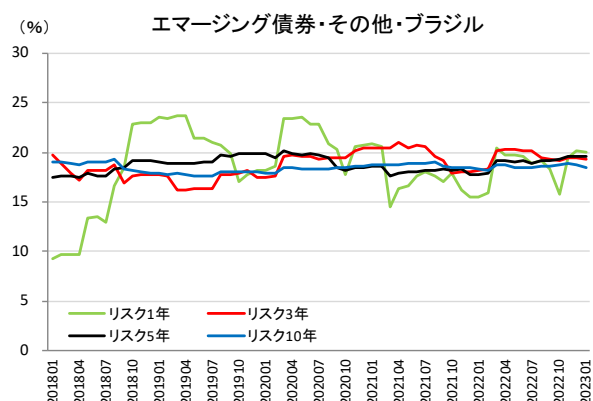
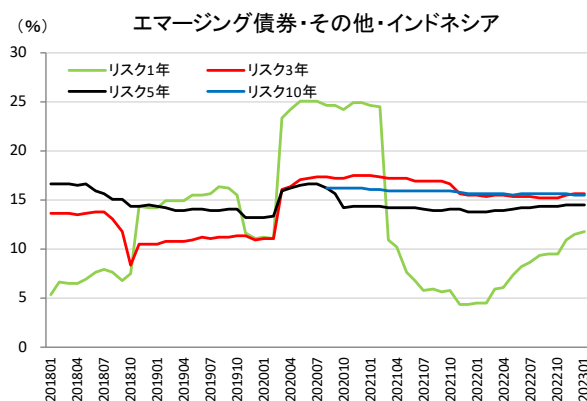
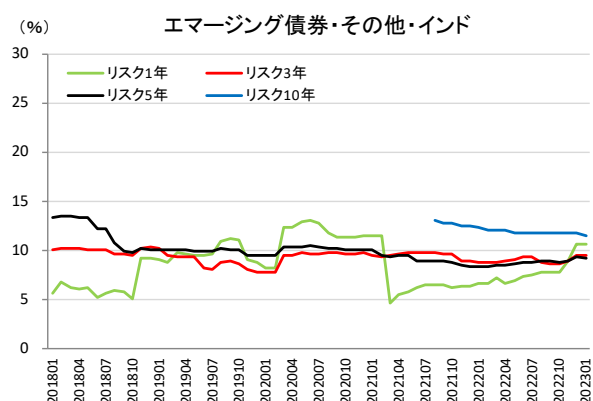
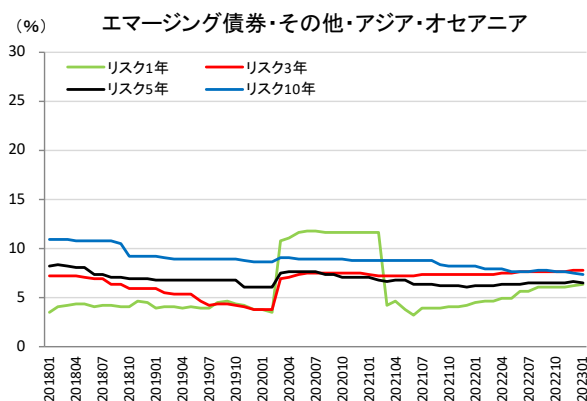
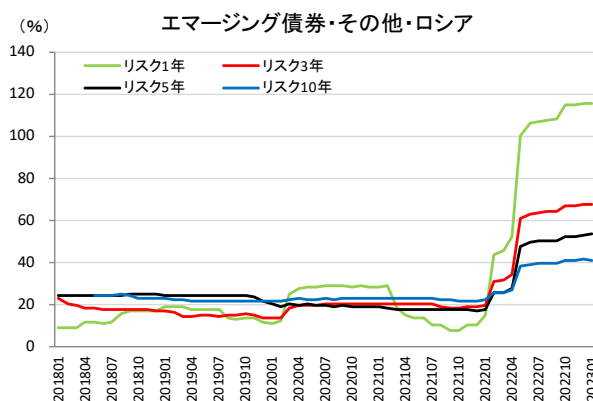
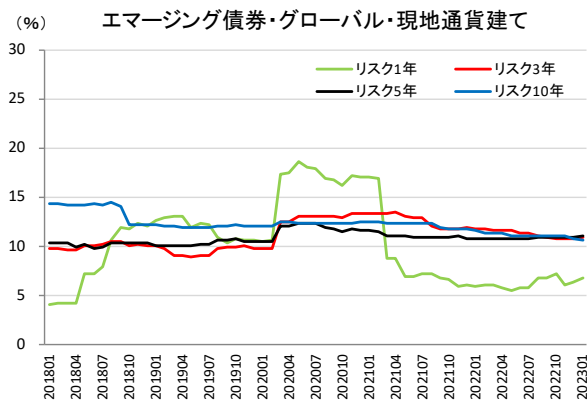
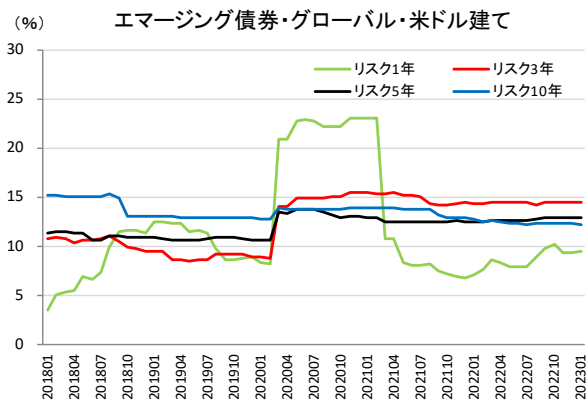


<2>リスク・サマリー

(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]

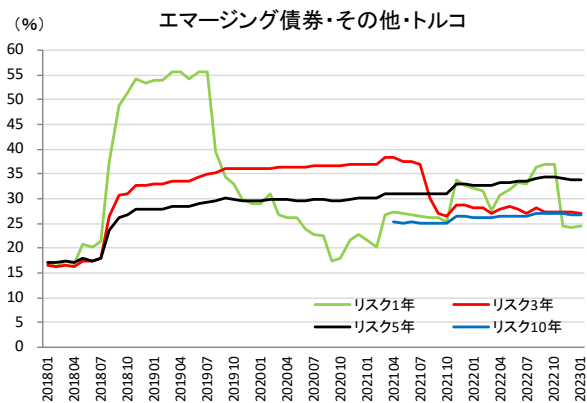


<2> リスク・サマリー

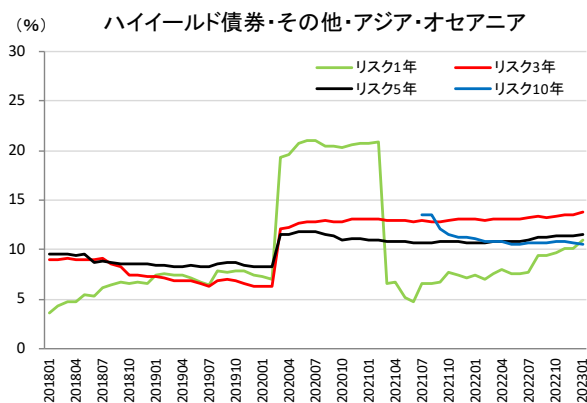
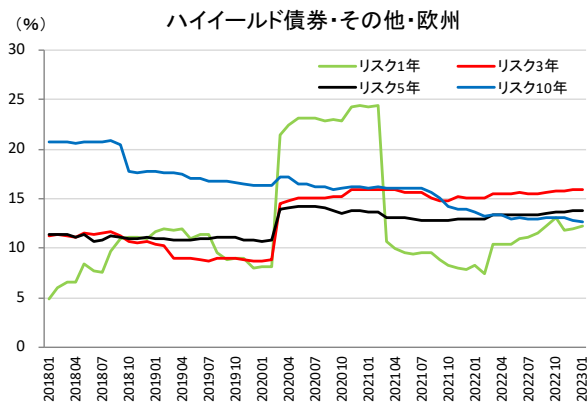
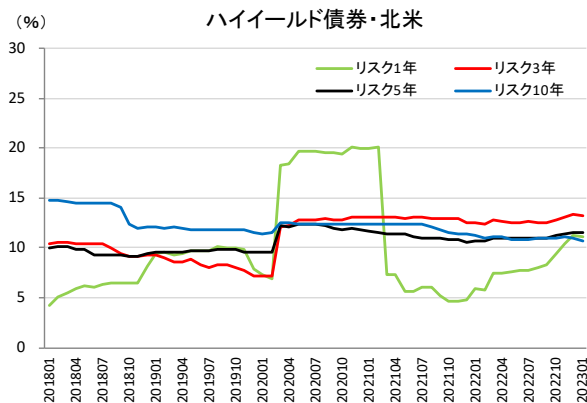
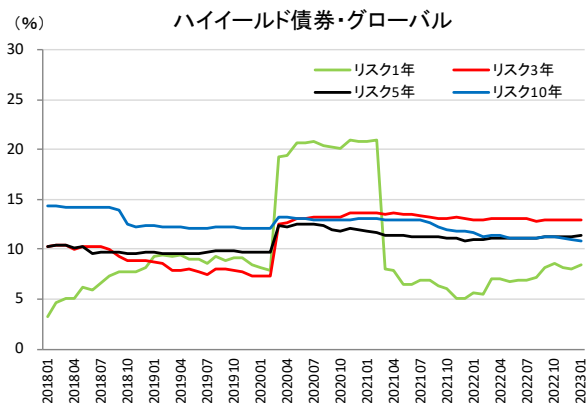
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

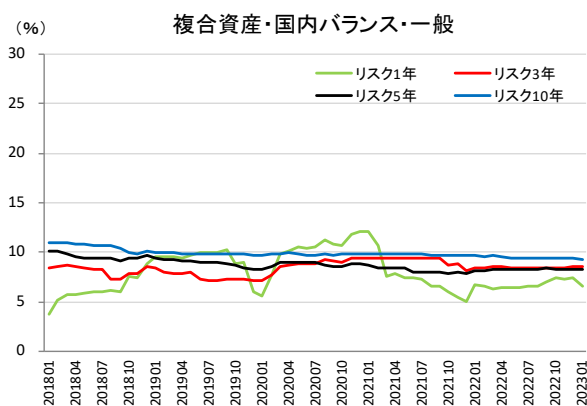
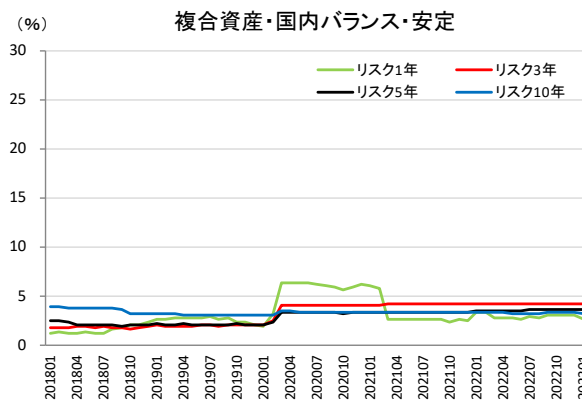
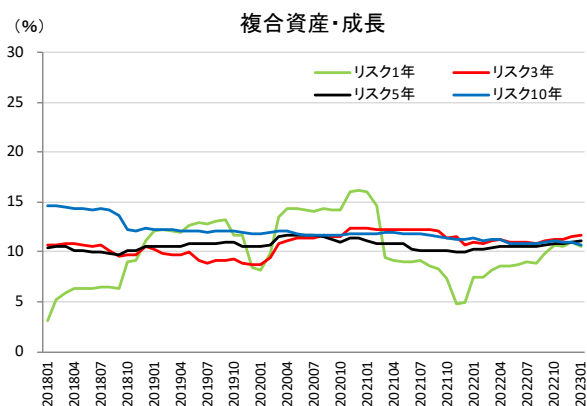
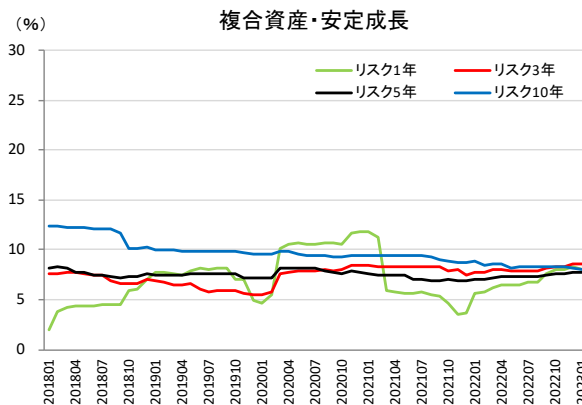
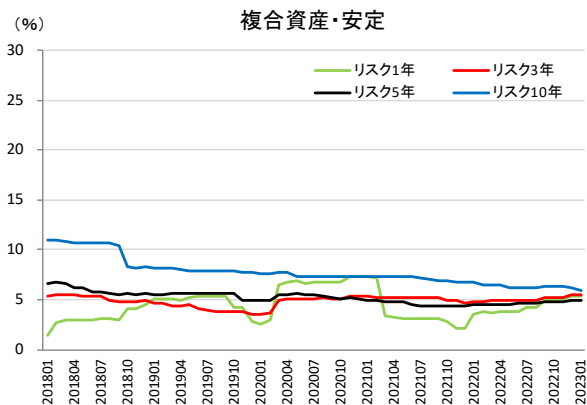


<2>リスク・サマリー

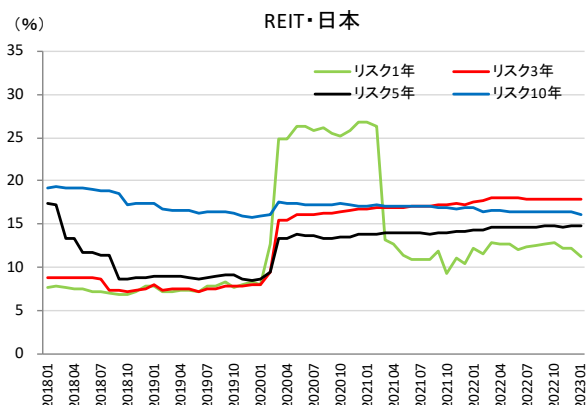
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]



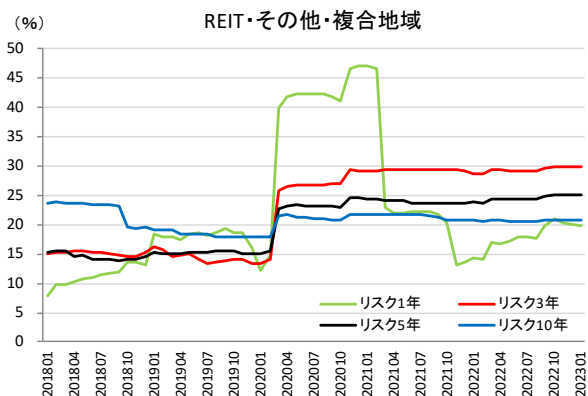
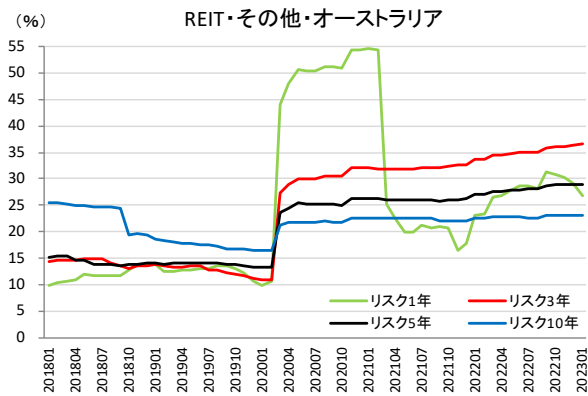
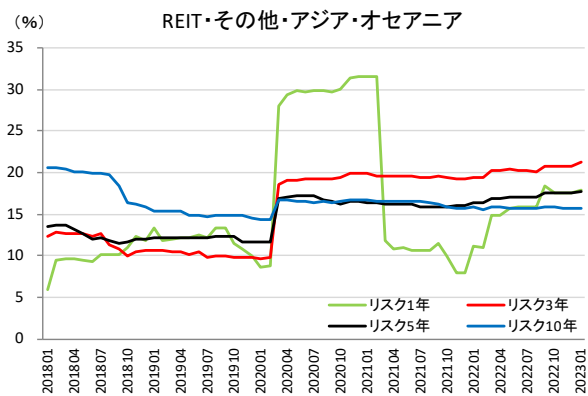
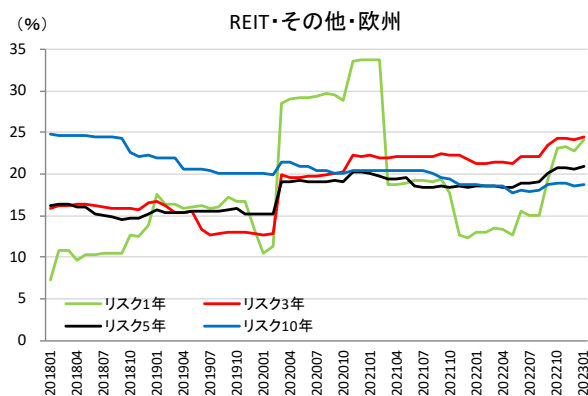
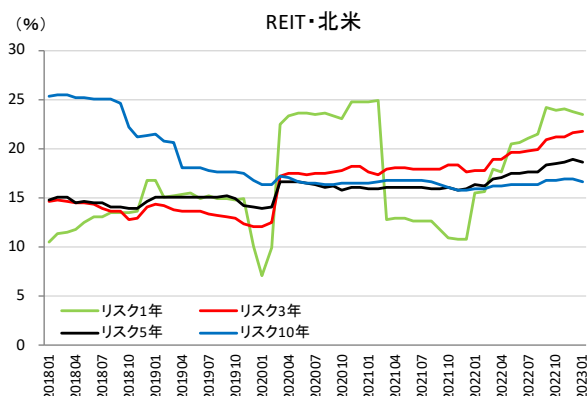
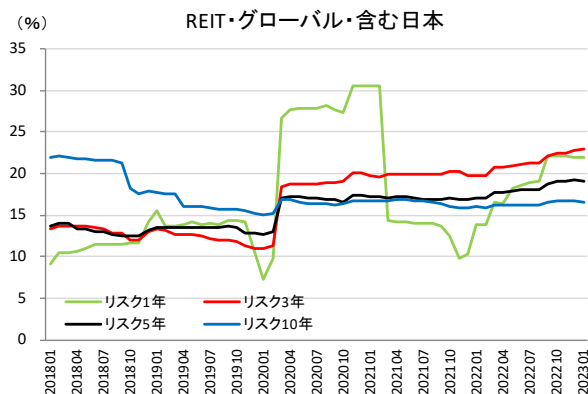
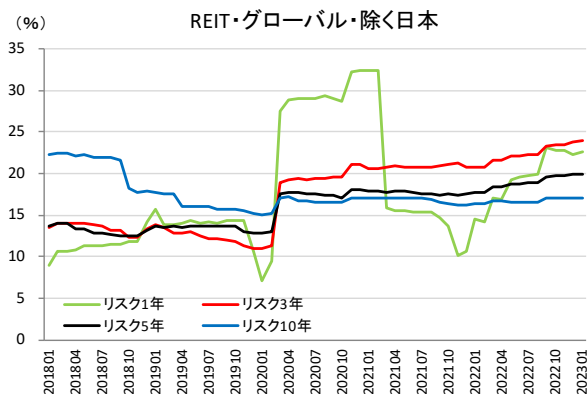


<2> リスク・サマリー

(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]

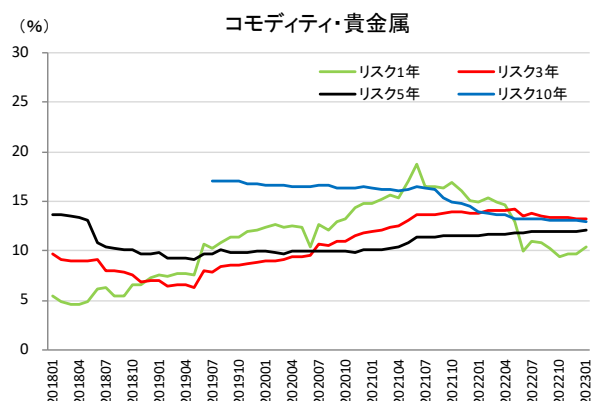
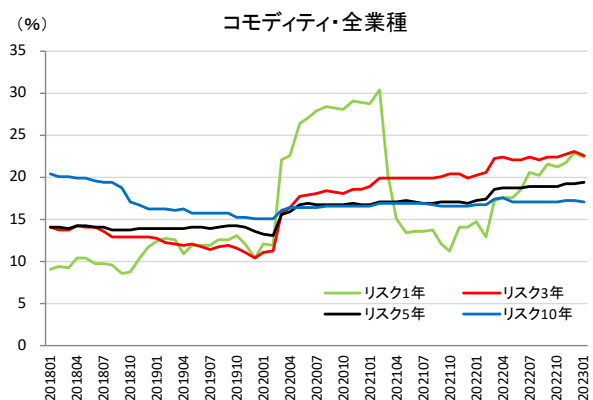
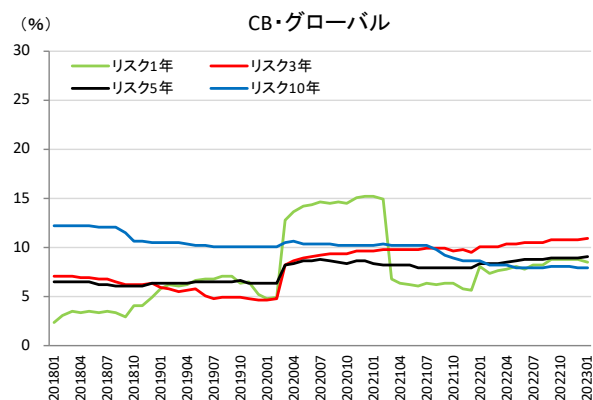
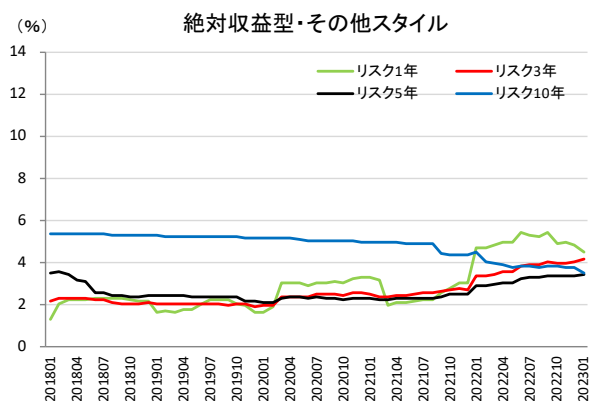
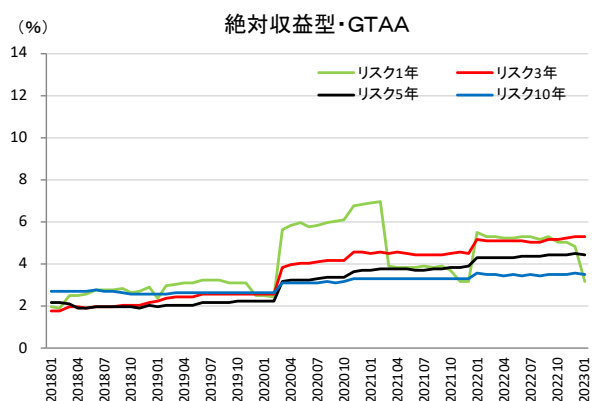
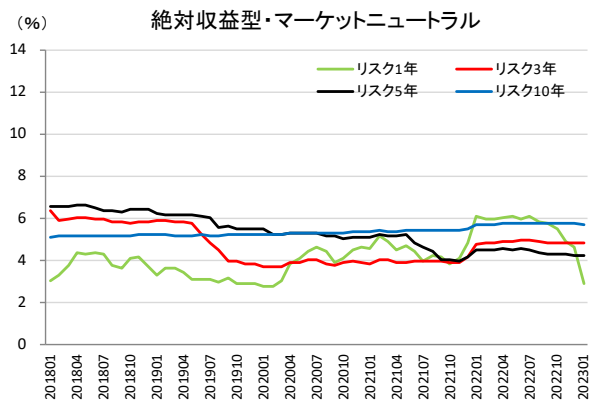
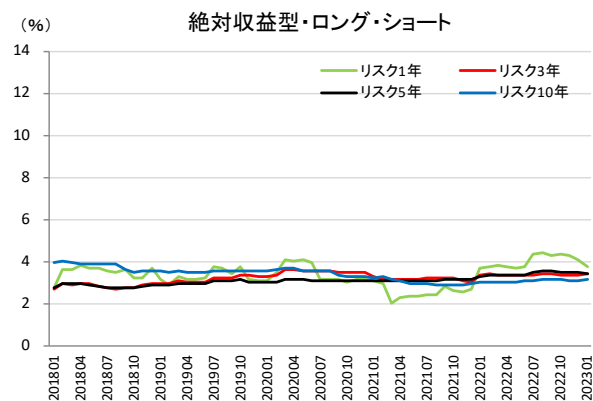


<2> リスク・サマリー

(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]



## &lt; 3 &gt; 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	5,122	21,054	41,365	80,097
国内株式	292	2,136	4,289	7,143
一般	377	805	1,835	3,433
フリー	227	477	1,299	2,641
バリュー	150	329	535	793
小型	41	47	52	211
その他	-142	1,270	2,395	3,480
日経225	-206	935	1,693	2,332
TOPIX	22	210	460	686
JPX日経400	-3	7	20	39
国内債券	-52	13	1,048	2,958
一般	-52	13	1,048	2,958
外国株式(先進国)	2,737	10,006	20,319	45,872
グローバル	1,460	4,271	9,224	21,100
除く日本	791	2,432	4,809	9,963
含む日本	669	1,839	4,415	11,138
その他	1,276	5,735	11,095	24,772
北米	60	621	646	677
米国	1,250	5,257	10,694	24,772
カナダ	-1	-5	-11	-31
欧州	-16	-55	-80	-132
ドイツ	0	-1	-1	-1
イギリス	1	0	0	0
アジア・オセアニア	-1	-2	-1	-2
オーストラリア	-17	-81	-155	-541
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	1	0	4	32
エマージング株式	405	1,017	823	174
グローバル	94	174	232	389
BRICS	-2	-10	-20	-57
その他	312	853	611	-158
欧州	0	0	-1	-2
ロシア	0	0	0	1
アジア・オセアニア	18	-13	-162	-559
中国	-11	-89	-197	-396
インド	261	760	852	751
インドネシア	3	20	8	-1
タイ	-1	-3	-4	-5
フィリピン	0	0	-1	-7
ベトナム	50	187	178	188
韓国	0	0	0	0
香港	-1	-1	2	2
中南米	0	-1	-5	-9
ブラジル	0	1	-43	-101
メキシコ	-1	-2	-4	-6
中東・アフリカ	0	-3	-6	-2
トルコ	-6	-2	-5	-8
複合地域	0	0	-1	-1

## &lt;3&gt; 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	5,122	21,054	41,365	80,097
外国債券(先進国)	840	2,707	3,078	4,340
グローバル	627	2,368	2,794	5,000
除く日本	164	384	-46	435
含む日本	463	1,985	2,839	4,565
その他	213	338	284	-660
北米	1	1	1	-5
米国	264	544	803	769
カナダ	-4	-24	-71	-174
欧州	-3	-9	-9	-75
イギリス	0	-1	-2	-3
アジア・オセアニア	1	-15	-62	-176
オーストラリア	-42	-141	-339	-890
ニュージーランド	0	-1	-3	-12
複合地域	-4	-16	-34	-95
エマージング債券	33	-51	-338	-786
グローバル	37	20	-38	19
米ドル建て	28	6	-62	-26
現地通貨建て	9	14	24	45
その他	-4	-71	-300	-804
ロシア	0	0	0	-3
アジア・オセアニア	-1	-5	-13	-30
インド	9	2	-52	-231
インドネシア	0	-4	-9	-35
ブラジル	-10	-44	-176	-394
メキシコ	-3	-12	-28	-71
トルコ	0	-1	-2	-3
複合地域	0	-1	-1	-3
ハイイールド債券	122	662	1,066	868
グローバル	-7	-25	30	-17
北米	129	718	1,112	1,094
その他	0	-31	-76	-208
欧州	-11	-43	-87	-196
アジア・オセアニア	11	13	12	-10
複合地域	0	-1	-1	-3
複合資産	496	2,031	5,159	9,723
安定	-37	-97	536	1,181
安定成長	319	1,101	2,544	4,956
成長	322	1,142	2,385	4,536
国内バランス	-122	-182	-346	-776
安定	-140	-329	-585	-1,078
一般	-1	-4	-8	-16
その他	13	67	41	-173

## &lt;3&gt; 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	5,122	21,054	41,365	80,097
国内REIT	198	1,024	2,288	4,303
日本	198	1,024	2,288	4,303
外国REIT	236	690	1,329	1,584
グローバル	-16	15	10	-298
除く日本	35	126	152	179
含む日本	-50	-111	-142	-476
北米	241	669	1,349	2,160
その他	11	6	-30	-279
欧州	0	-3	-4	-11
アジア・オセアニア	15	25	8	-164
オーストラリア	-4	-13	-25	-77
複合地域	0	0	0	-3
複数国	-1	-4	-8	-23
その他	-185	821	2,304	3,918
絶対収益型	29	279	563	1,651
ロング・ショート	0	-5	-13	0
マーケットニュートラル	-8	-30	-54	-117
GTAA	-12	-7	-11	10
その他スタイル	47	317	632	1,747
CB	-4	141	956	897
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-2
日本	-1	-2	-3	-5
グローバル	-4	144	961	904
コモディティ	12	191	320	301
全業種	20	8	-29	-296
貴金属	-8	184	365	635
エネルギー	0	-2	-16	-37
その他コモディティ	0	1	1	-2

## &lt; 4 &gt; 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	860,883	100.00	5,374	100.00
国内株式	108,393	12.59	831	15.46
一般	59,129	6.87	532	9.90
フリー	46,065	5.35	434	8.08
バリュー	13,064	1.52	98	1.82
小型	6,818	0.79	91	1.69
その他	41,779	4.85	202	3.76
日経225	21,880	2.54	69	1.28
TOPIX	16,500	1.92	80	1.49
JPX日経400	762	0.09	15	0.28
国内債券	42,151	4.90	143	2.66
一般	42,151	4.90	143	2.66
外国株式(先進国)	350,472	40.71	1,158	21.55
グローバル	239,815	27.86	805	14.98
除く日本	68,467	7.95	190	3.54
含む日本	171,349	19.90	615	11.44
その他	110,657	12.85	353	6.57
北米	846	0.10	11	0.20
米国	104,846	12.18	266	4.95
カナダ	154	0.02	2	0.04
欧州	1,605	0.19	43	0.80
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	41	0.00	2	0.04
オーストラリア	3,087	0.36	23	0.43
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	39	0.00	1	0.02
エマージング株式	27,426	3.19	311	5.79
グローバル	9,370	1.09	92	1.71
BRICS	458	0.05	7	0.13
その他	17,598	2.04	212	3.94
欧州	61	0.01	6	0.11
ロシア	10	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,657	0.54	87	1.62
中国	2,061	0.24	32	0.60
インド	8,629	1.00	31	0.58
インドネシア	150	0.02	4	0.07
タイ	29	0.00	3	0.06
フィリピン	29	0.00	4	0.07
ベトナム	1,218	0.14	13	0.24
韓国	5	0.00	1	0.02
香港	16	0.00	1	0.02
中南米	59	0.01	2	0.04
ブラジル	486	0.06	13	0.24
メキシコ	13	0.00	2	0.04
中東・アフリカ	99	0.01	5	0.09
トルコ	58	0.01	2	0.04
複合地域	18	0.00	2	0.04

## ＜4＞純資産額、ファンド本数

## 「総合」およびファンド分類別②

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	860,883	100.00	5,374	100.00
外国債券(先進国)	81,216	9.43	769	14.31
グローバル	65,776	7.64	528	9.83
除く日本	29,501	3.43	228	4.24
含む日本	36,275	4.21	300	5.58
その他	15,440	1.79	241	4.48
北米	68	0.01	6	0.11
米国	5,668	0.66	133	2.47
カナダ	702	0.08	4	0.07
欧州	978	0.11	31	0.58
イギリス	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,543	0.18	9	0.17
オーストラリア	5,346	0.62	36	0.67
ニュージーランド	74	0.01	9	0.17
複合地域	1,051	0.12	8	0.15
エマージング債券	10,458	1.21	263	4.89
グローバル	5,980	0.69	185	3.44
米ドル建て	4,417	0.51	142	2.64
現地通貨建て	1,563	0.18	43	0.80
その他	4,478	0.52	78	1.45
ロシア	10	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	243	0.03	6	0.11
インド	2,060	0.24	17	0.32
インドネシア	282	0.03	7	0.13
ブラジル	1,408	0.16	21	0.39
メキシコ	256	0.03	7	0.13
トルコ	57	0.01	4	0.07
複合地域	32	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	16,920	1.97	246	4.58
グローバル	2,592	0.30	37	0.69
北米	12,402	1.44	147	2.74
その他	1,926	0.22	62	1.15
欧州	1,486	0.17	40	0.74
アジア・オセアニア	405	0.05	21	0.39
複合地域	36	0.00	1	0.02
複合資産	130,180	15.12	1,011	18.81
安定	37,588	4.37	274	5.10
安定成長	57,457	6.67	425	7.91
成長	24,796	2.88	264	4.91
国内バランス	7,306	0.85	32	0.60
安定	6,598	0.77	9	0.17
一般	287	0.03	18	0.33
その他	3,035	0.35	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	860,883	100.00	5,374	100.00
国内REIT	27,106	3.15	136	2.53
日本	27,106	3.15	136	2.53
外国REIT	43,549	5.06	279	5.19
グローバル	17,250	2.00	151	2.81
除く日本	5,686	0.66	65	1.21
含む日本	11,564	1.34	86	1.60
北米	23,141	2.69	76	1.41
その他	3,158	0.37	52	0.97
欧州	120	0.01	10	0.19
アジア・オセアニア	2,200	0.26	26	0.48
オーストラリア	539	0.06	12	0.22
複合地域	57	0.01	3	0.06
複数国	243	0.03	1	0.02
その他	23,011	2.67	227	4.22
絶対収益型	11,840	1.38	101	1.88
ロング・ショート	824	0.10	35	0.65
マーケットニュートラル	509	0.06	13	0.24
GTAA	414	0.05	13	0.24
その他スタイル	10,005	1.16	39	0.73
CB	1,950	0.23	32	0.60
アジア・オセアニア	33	0.00	1	0.02
日本	30	0.00	3	0.06
グローバル	1,887	0.22	28	0.52
コモディティ	4,945	0.57	34	0.63
全業種	1,575	0.18	13	0.24
貴金属	3,286	0.38	19	0.35
エネルギー	66	0.01	1	0.02
その他コモディティ	18	0.00	1	0.02



## &lt; 5 &gt; 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	13,017	9.9	2.11	2.29	1.158
国内株式	17,529	13.6	0.66	0.64	1.035
一般	16,252	13.2	0.89	0.86	1.388
フリー	15,742	12.5	0.88	0.86	1.431
バリュー	18,509	16.5	0.93	0.89	1.238
小型	23,134	14.2	0.54	0.52	1.702
その他	18,402	14.0	0.34	0.34	0.417
日経225	19,145	15.5	0.40	0.39	0.481
TOPIX	19,451	14.9	0.12	0.12	0.258
JPX日経400	17,336	8.4	0.06	0.06	0.502
国内債券	10,306	11.7	0.15	0.16	0.438
一般	10,306	11.7	0.15	0.16	0.438
外国株式(先進国)	15,083	7.5	1.87	1.96	1.277
グローバル	15,533	7.3	1.59	1.60	1.351
除く日本	22,026	10.2	0.48	0.48	0.602
含む日本	13,527	6.5	2.04	2.06	1.651
その他	14,056	7.8	2.47	2.74	1.118
北米	15,220	7.3	9.56	10.09	1.620
米国	14,515	7.0	2.23	2.54	1.084
カナダ	6,028	11.8	7.05	7.31	1.989
欧州	13,640	12.3	1.56	1.60	1.582
ドイツ	13,997	8.8	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,443	6.5	9.49	9.54	1.806
アジア・オセアニア	9,995	13.1	2.69	2.62	1.636
オーストラリア	10,837	8.0	9.82	8.98	1.822
ニュージーランド	17,879	10.5	1.27	1.12	1.672
複合地域	11,387	9.8	14.78	12.29	1.705
エマージング株式	13,554	10.6	2.44	2.64	1.634
グローバル	13,160	8.2	0.33	0.33	1.061
BRICS	14,298	16.7	0.81	0.90	2.069
その他	13,700	11.4	3.62	3.93	1.928
欧州	5,876	16.6	0.17	0.16	1.959
ロシア	2,300	13.7	1.09	5.40	1.264
アジア・オセアニア	14,955	12.4	2.77	2.91	1.702
中国	15,650	8.5	0.48	0.50	1.942
インド	14,925	11.8	5.27	5.79	2.050
インドネシア	12,537	12.8	4.19	3.69	1.834
タイ	12,942	10.5	5.63	5.13	1.816
フィリピン	11,174	10.5	0.66	0.65	1.730
ベトナム	14,620	5.5	1.10	1.33	1.912
韓国	12,417	4.1	0.00	0.00	1.804
香港	14,751	13.4	1.65	1.56	0.858
中南米	9,348	16.0	0.00	0.00	2.042
ブラジル	5,489	11.9	3.90	4.12	1.950
メキシコ	12,557	9.9	0.00	0.00	1.878
中東・アフリカ	12,563	11.5	0.35	0.35	2.085
トルコ	11,829	21.5	0.00	0.00	2.028
複合地域	21,439	14.7	1.69	1.73	1.941

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目録見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

## &lt; 5 &gt; 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	13,017	9.9	2.11	2.29	1.158
外国債券(先進国)	9,721	10.3	1.43	1.52	0.989
グローバル	10,146	10.3	1.07	1.14	0.926
除く日本	11,064	12.5	1.00	1.04	0.707
含む日本	9,448	8.6	1.13	1.23	1.104
その他	8,790	10.5	2.91	3.05	1.256
北米	9,772	8.8	2.24	2.45	1.772
米国	9,539	8.9	3.22	3.67	1.226
カナダ	6,965	12.0	1.68	1.65	1.378
欧州	7,158	12.8	1.65	1.76	1.154
イギリス	7,145	7.7	3.81	4.19	1.308
アジア・オセアニア	8,904	12.8	2.62	2.51	1.422
オーストラリア	8,413	14.1	3.16	3.12	1.245
ニュージーランド	9,074	8.6	1.62	1.60	1.358
複合地域	5,129	12.8	2.47	2.52	1.195
エマージング債券	8,529	11.1	4.45	4.44	1.473
グローバル	8,642	11.6	3.15	3.27	1.363
米ドル建て	8,569	12.0	3.37	3.52	1.481
現地通貨建て	8,884	10.0	2.50	2.54	1.028
その他	8,262	9.9	6.21	6.02	1.621
ロシア	919	9.9	0.68	5.27	1.597
アジア・オセアニア	9,350	12.1	6.58	6.95	1.629
インド	9,324	8.2	6.83	7.11	1.703
インドネシア	8,901	10.2	5.96	5.70	1.672
ブラジル	8,626	13.4	5.68	4.87	1.581
メキシコ	7,854	9.9	6.23	5.18	1.397
トルコ	1,997	9.9	6.83	6.03	1.458
複合地域	3,662	16.4	2.17	2.18	1.210
ハイイールド債券	9,056	11.8	5.62	5.67	1.666
グローバル	7,629	10.7	3.58	3.56	1.480
北米	10,273	12.8	5.68	5.69	1.689
その他	7,023	10.3	8.01	8.41	1.767
欧州	7,204	9.8	7.49	7.77	1.739
アジア・オセアニア	6,807	10.8	10.13	11.01	1.867
複合地域	4,296	18.8	5.39	5.59	1.800
複合資産	12,539	9.4	1.06	1.15	0.968
安定	11,059	9.3	0.93	0.99	1.090
安定成長	12,250	9.8	1.37	1.50	0.978
成長	14,917	9.2	0.16	0.16	0.792
国内バランス	11,335	9.6	2.18	2.36	0.942
安定	10,355	11.5	2.32	2.52	0.917
一般	11,811	9.6	0.96	0.96	1.290
その他	8,732	2.9	1.28	1.67	0.763

(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

## &lt; 5 &gt; 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	13,017	9.9	2.11	2.29	1.158
国内REIT	13,506	9.8	9.21	11.23	0.928
日本	13,506	9.8	9.21	11.23	0.928
外国REIT	12,054	8.9	8.23	9.17	1.488
グローバル	13,200	8.7	3.60	3.85	1.260
除く日本	14,501	6.8	2.38	2.65	0.936
含む日本	12,217	10.1	4.20	4.45	1.419
北米	11,232	9.5	11.79	13.36	1.622
その他	9,926	8.7	7.45	7.52	1.756
欧州	6,488	9.0	4.45	5.18	1.816
アジア・オセアニア	11,591	8.0	9.06	9.16	1.803
オーストラリア	9,805	8.3	4.62	4.48	1.703
複合地域	7,130	11.0	0.86	0.92	0.783
複数国	10,884	18.8	2.12	2.21	1.650
その他					
絶対収益型	10,341	6.0	0.03	0.03	1.908
ロング・ショート	10,510	5.3	0.20	0.20	1.461
マーケットニュートラル	9,678	5.3	0.33	0.33	1.291
GTAA	10,896	9.1	0.02	0.02	1.493
その他スタイル	10,166	5.8	0.00	0.00	1.998
CB	11,897	9.4	0.77	0.82	1.217
アジア・オセアニア	9,889	12.6	2.42	2.43	1.823
日本	10,723	11.7	0.52	0.52	0.892
グローバル	12,094	9.1	0.71	0.77	1.211
コモディティ	11,906	7.3	0.55	0.55	0.909
全業種	10,028	10.6	1.72	1.71	1.297
貴金属	12,681	4.7	0.00	0.00	0.723
エネルギー	16,905	13.9	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	16,618	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 川真田、青木

電話番号 : 03-6721-1033

Eメール : mab-index@mab.co.jp

〒107-0062 東京都港区南青山1丁目1番1号 新青山ビル西館8階

URL : <https://www.mab.jp/business/information/mab-fpi/>

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第1085号 助言・代理業、投資運用業

加入協会名 一般社団法人 日本投資顧問業協会