

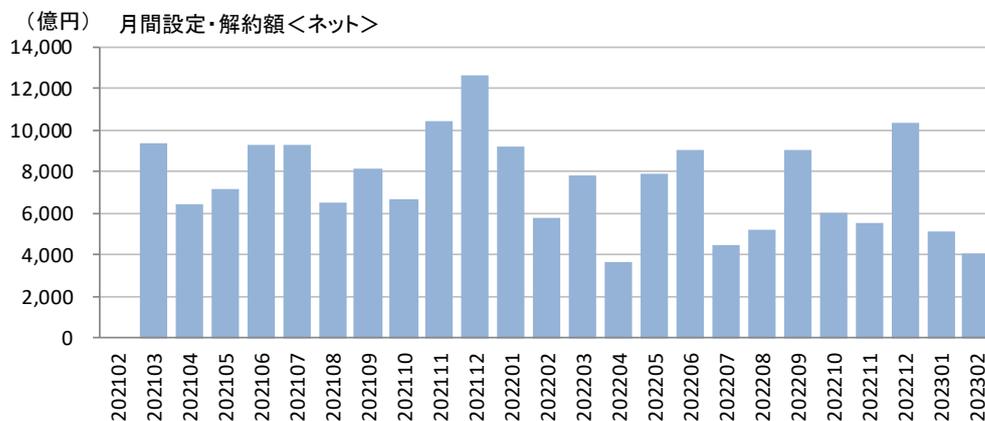
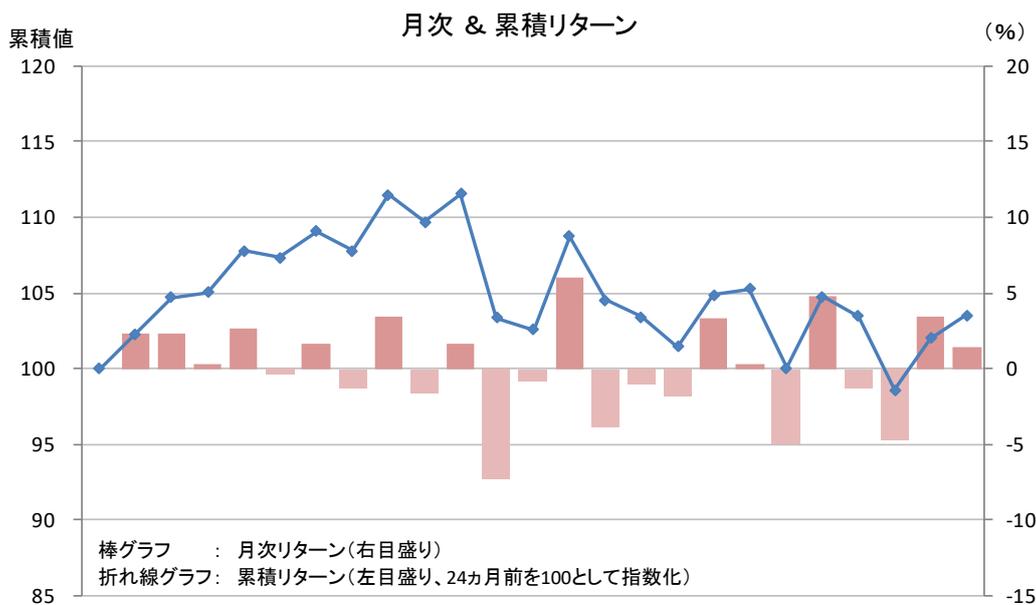
# 投信指数 MAB-FPI

## パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

### 2023年2月

**「総合」 +1.46 %**  
**(前月 +3.47 %)**



# 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		15,550	15,326	223	1.46
国内株式		20,003	19,860	143	0.72
一般		19,515	19,338	177	0.92
フリー		18,188	18,048	140	0.78
バリュー		25,797	25,440	357	1.40
小型		40,099	40,381	-283	-0.70
その他		19,763	19,631	132	0.67
日経225		18,746	18,660	85	0.46
TOPIX		19,810	19,628	182	0.93
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	18,711	18,538	173	0.93
国内債券		12,446	12,365	81	0.66
一般		12,446	12,365	81	0.66
外国株式(先進国)		20,435	19,863	572	2.88
グローバル		22,283	21,682	602	2.78
除く日本		35,347	34,358	989	2.88
含む日本		19,491	18,972	519	2.73
その他		16,605	16,106	499	3.10
北米		21,390	20,664	727	3.52
米国		25,690	24,880	809	3.25
カナダ	10,000 (2009.02.27)	21,443	21,236	206	0.97
欧州		24,424	23,801	624	2.62
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	11,988	11,559	429	3.71
イギリス	9,683 (2014.05.30)	11,154	10,921	233	2.14
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	39,079	40,098	-1,019	-2.54
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	20,183	20,542	-358	-1.74
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	46,643	47,409	-766	-1.62
複合地域	10,000 (2013.04.30)	14,199	13,959	240	1.72
エマージング株式		18,175	18,375	-200	-1.09
グローバル		18,240	18,554	-313	-1.69
BRICS	10,000 (2005.09.30)	22,810	23,594	-784	-3.32
その他		18,878	19,014	-136	-0.71
欧州		12,033	11,834	198	1.68
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,348	1,330	18	1.36
アジア・オセアニア		18,046	18,522	-477	-2.57
中国		40,732	43,382	-2,650	-6.11
インド	10,000 (2004.09.30)	47,379	46,403	976	2.10
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	16,909	16,514	395	2.39
タイ		23,723	24,505	-782	-3.19
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,711	7,879	-167	-2.12
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	19,977	20,919	-942	-4.50
韓国	10,000 (1997.06.30)	26,355	27,604	-1,249	-4.53
香港		21,937	23,296	-1,360	-5.84
中南米	7,427 (2006.04.28)	10,202	10,229	-27	-0.26
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	8,453	8,692	-240	-2.76
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	14,731	14,447	285	1.97
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	12,474	12,640	-166	-1.31
トルコ		38,020	35,842	2,178	6.08
複合地域	10,000 (2005.08.31)	24,939	24,966	-27	-0.11

※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		15,550	15,326	223	1.46
外国債券(先進国)		18,017	18,066	-48	-0.27
グローバル		18,015	18,043	-28	-0.16
除く日本		19,532	19,493	39	0.20
含む日本		17,061	17,138	-77	-0.45
その他		18,243	18,378	-136	-0.74
北米	9,052 (2013.05.31)	10,335	10,366	-31	-0.30
米国		16,996	17,136	-140	-0.81
カナダ	10,000 (2003.05.30)	16,025	15,808	217	1.38
欧州	10,000 (1998.07.31)	13,639	13,686	-48	-0.35
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,114	10,151	-37	-0.36
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	20,501	20,748	-247	-1.19
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	25,371	25,651	-280	-1.09
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	10,910	11,244	-334	-2.97
複合地域	10,000 (2001.11.30)	17,761	17,660	101	0.57
エマージング債券		18,226	17,920	306	1.71
グローバル		18,375	18,244	131	0.72
米ドル建て		18,705	18,593	112	0.60
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	13,280	13,144	136	1.04
その他	8,647 (2005.03.31)	14,566	14,138	428	3.03
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,230	1,253	-23	-1.86
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	15,252	15,101	151	1.00
インド	10,000 (2011.08.31)	19,298	18,762	536	2.86
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	17,984	17,505	479	2.74
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	13,385	12,929	456	3.52
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	16,958	16,300	659	4.04
トルコ	10,000 (2011.04.28)	4,030	3,648	382	10.48
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,736	10,597	139	1.31
ハイイールド債券		25,522	25,042	480	1.92
グローバル	10,000 (1997.06.30)	23,967	23,846	121	0.51
北米		25,771	25,189	582	2.31
その他	10,000 (2004.03.31)	23,275	22,994	282	1.23
欧州	10,000 (2006.04.28)	23,576	23,274	302	1.30
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,447	14,323	124	0.86
複合地域	10,000 (2004.03.31)	22,481	21,993	489	2.22
複合資産		18,602	18,483	119	0.65
安定	10,000 (1998.10.30)	15,612	15,551	61	0.39
安定成長		20,539	20,372	167	0.82
成長		25,396	25,097	299	1.19
国内バランス		12,250	12,181	69	0.56
安定		12,422	12,356	66	0.53
一般		15,958	15,815	143	0.91
その他	10,000 (2018.10.31)	11,300	11,742	-442	-3.77

※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		15,550	15,326	223	1.46
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	34,029	33,515	514	1.53
日本	10,000 (2003.10.31)	34,029	33,515	514	1.53
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	33,368	33,059	309	0.94
グローバル	10,000 (2004.01.30)	27,733	27,517	216	0.79
除く日本	10,000 (2004.04.30)	31,216	30,988	228	0.74
含む日本	10,000 (2004.01.30)	27,430	27,210	220	0.81
北米	10,000 (2003.09.30)	35,151	34,608	543	1.57
その他	10,000 (2004.04.30)	30,219	31,116	-897	-2.88
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,186	5,176	10	0.19
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	22,314	23,179	-865	-3.73
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	17,037	17,495	-458	-2.62
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,490	7,442	49	0.65
複数国	10,000 (2004.04.30)	44,485	43,664	821	1.88
その他		6,180	6,247	-67	-1.07
絶対収益型		7,418	7,514	-96	-1.28
ロング・ショート		8,175	8,161	14	0.17
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,196	11,222	-26	-0.23
GTAA		11,346	11,383	-37	-0.32
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	6,960	7,066	-106	-1.50
CB		19,795	19,796	-0	-0.00
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	20,337	20,209	129	0.64
日本		19,634	19,570	64	0.33
グローバル		34,556	34,562	-6	-0.02
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	11,506	11,794	-288	-2.44
全業種	10,000 (2004.12.30)	11,046	11,109	-62	-0.56
貴金属	10,000 (2009.07.31)	18,935	19,611	-676	-3.45
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	8,930	8,754	176	2.01
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	15,204	15,044	159	1.06

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

[色塗りの基準]月次リターン> 総合

## ＜1＞パフォーマンス・サマリー

## (2) 期間別リターン

## 「総合」およびファンド分類別①

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)	
総合	0.03	-1.64	0.95	4.98	
国内株式	-0.68	0.82	6.28	5.10	
一般	-0.32	1.33	6.60	5.12	
フリー	-0.66	1.03	5.98	4.99	
バリュー	0.88	2.39	8.79	5.59	
小型	-2.78	0.32	5.17	3.50	
その他	-0.85	0.17	6.04	5.30	
日経225	-1.77	-1.50	5.19	5.15	
TOPIX	0.53	2.74	8.21	5.37	
JPX日経400	0.49	2.80	8.25	5.41	
国内債券	-0.95	-2.80	-4.65	0.51	
一般	-0.95	-2.80	-4.65	0.51	
外国株式(先進国)	1.49	-0.50	0.85	7.92	
グローバル	2.19	0.21	0.75	8.38	
除く日本	0.99	1.83	7.86	7.16	
含む日本	2.68	-0.39	-1.65	8.87	
その他	-0.02	-2.00	1.22	6.95	
北米	-1.23	2.80	16.34	5.40	
米国	-0.04	-2.20	0.63	7.00	
カナダ	-2.22	-3.92	1.47	4.27	
欧州	5.34	11.06	10.44	8.36	
ドイツ	7.87	23.13	17.21	11.46	
イギリス	2.03	5.91	12.04	3.91	
アジア・オセアニア	1.03	-0.66	2.70	4.97	
オーストラリア	-1.61	-1.71	11.84	5.15	
ニュージーランド	2.12	1.91	8.89	1.86	
複合地域	-6.77	-1.81	31.83	2.60	
エマーシング株式	-2.04	-5.57	0.46	2.44	
グローバル	1.00	-1.59	1.19	4.78	
BRICS	-2.34	-6.49	-8.50	1.28	
その他	-3.58	-7.55	0.26	1.27	
欧州	6.09	20.56	-35.40	5.44	
ロシア	-6.68	-6.54	-82.26	2.13	
アジア・オセアニア	1.54	-2.57	-0.68	5.02	
中国	4.14	-5.33	-6.32	3.43	
インド	-8.41	-9.06	6.02	-1.40	
インドネシア	-0.92	-3.16	18.31	6.64	
タイ	-1.07	2.04	9.30	-1.21	
フィリピン	-2.29	-1.56	-2.28	3.69	
ベトナム	2.44	-21.61	-18.42	2.99	
韓国	-2.92	-5.45	-14.06	3.39	
香港	6.49	-1.70	4.89	2.80	
中南米	-0.27	0.70	17.40	5.26	
ブラジル	-5.67	-8.86	4.76	0.37	
メキシコ	7.13	23.56	36.30	14.85	
中東・アフリカ	-8.33	-13.89	-4.11	-1.46	
トルコ	4.80	48.02	107.92	-2.57	
複合地域	2.36	-1.03	0.95	6.60	

※[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②

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来 (%)
総合	0.03	-1.64	0.95	4.98
外国債券(先進国)	-1.40	-3.25	-2.09	1.51
グローバル	-1.34	-3.03	-3.11	1.30
除く日本	-2.26	-3.85	-2.38	1.66
含む日本	-0.53	-2.33	-3.82	1.01
その他	-1.65	-4.17	1.93	2.41
北米	-0.22	-3.54	-4.43	1.74
米国	-2.02	-5.46	0.47	1.58
カナダ	-2.10	-5.10	5.65	2.51
欧州	-1.70	-1.84	-7.57	0.96
イギリス	-1.49	-0.42	-1.59	4.11
アジア・オセアニア	-1.37	-3.16	4.69	3.16
オーストラリア	-1.03	-3.11	4.70	3.53
ニュージーランド	-4.00	-4.11	0.02	0.25
複合地域	-2.50	-5.85	-1.35	1.70
エマージング債券	0.38	-0.57	8.29	3.54
グローバル	0.63	0.21	4.05	3.17
米ドル建て	0.50	-0.25	3.10	2.98
現地通貨建て	1.00	1.60	6.82	3.71
その他	0.05	-1.61	13.35	4.02
ロシア	-18.05	10.46	-78.65	2.35
アジア・オセアニア	1.57	-0.43	5.78	3.36
インド	-2.37	-4.12	7.35	2.81
インドネシア	3.31	-1.46	13.04	6.46
ブラジル	1.84	-0.78	23.12	4.72
メキシコ	3.74	9.61	32.42	8.39
トルコ	7.44	16.49	38.65	7.14
複合地域	2.32	4.65	16.52	4.74
ハイイールド債券	0.68	0.17	8.88	4.35
グローバル	1.78	0.58	5.04	3.63
北米	0.06	-0.43	10.09	4.35
その他	3.22	3.70	7.90	5.31
欧州	2.31	3.65	7.93	5.20
アジア・オセアニア	7.11	4.06	7.93	5.87
複合地域	0.86	1.76	6.16	3.78
複合資産	-0.81	-1.83	-0.77	2.70
安定	-0.97	-2.37	-2.97	1.70
安定成長	-0.65	-1.48	0.52	2.99
成長	-0.09	-0.15	3.70	4.17
国内バランス	-1.55	-3.24	-2.85	0.14
安定	-1.67	-3.49	-3.27	-0.03
一般	-0.55	-0.61	1.82	2.20
その他	-5.98	-10.84	-19.43	4.26

※[色塗りの基準]期間別リターン&gt;総合

## &lt;1&gt;パフォーマンス・サマリー

## (2) 期間別リターン

## 「総合」およびファンド分類別③

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	0.03	-1.64	0.95	4.98
国内REIT	-5.00	-7.42	2.53	-1.45
日本	-5.00	-7.42	2.53	-1.45
外国REIT	0.64	-5.76	2.17	7.03
グローバル	1.10	-5.21	0.74	7.10
除く日本	1.78	-4.65	0.62	7.80
含む日本	0.77	-5.48	0.77	6.77
北米	0.28	-6.17	3.16	7.30
その他	0.88	-5.68	3.06	4.59
欧州	5.43	2.85	-9.73	7.04
アジア・オセアニア	0.83	-7.15	4.40	4.12
オーストラリア	0.81	-1.89	1.49	5.54
複合地域	0.96	1.35	7.50	5.18
複数国	-0.65	-6.14	1.15	5.28
その他	-0.42	-3.04	-4.74	2.71
絶対収益型	-0.94	-2.41	-4.90	0.10
ロング・ショート	0.03	-0.79	-2.50	0.96
マーケットニュートラル	-0.82	-1.74	-3.46	-0.83
GTAA	-1.49	-3.01	-1.87	0.23
その他スタイル	-1.00	-2.55	-5.41	0.07
CB	2.25	-0.66	-4.88	3.30
アジア・オセアニア	4.28	-3.89	3.40	4.16
日本	-0.78	-0.57	-0.65	0.72
グローバル	2.27	-0.60	-5.35	3.33
コモディティ	-0.92	-2.51	6.78	-0.19
全業種	-5.85	-11.10	12.30	-1.86
貴金属	1.79	2.62	0.95	0.62
エネルギー	-4.01	-10.70	21.21	0.34
その他コモディティ	-6.68	-8.55	14.76	-0.51

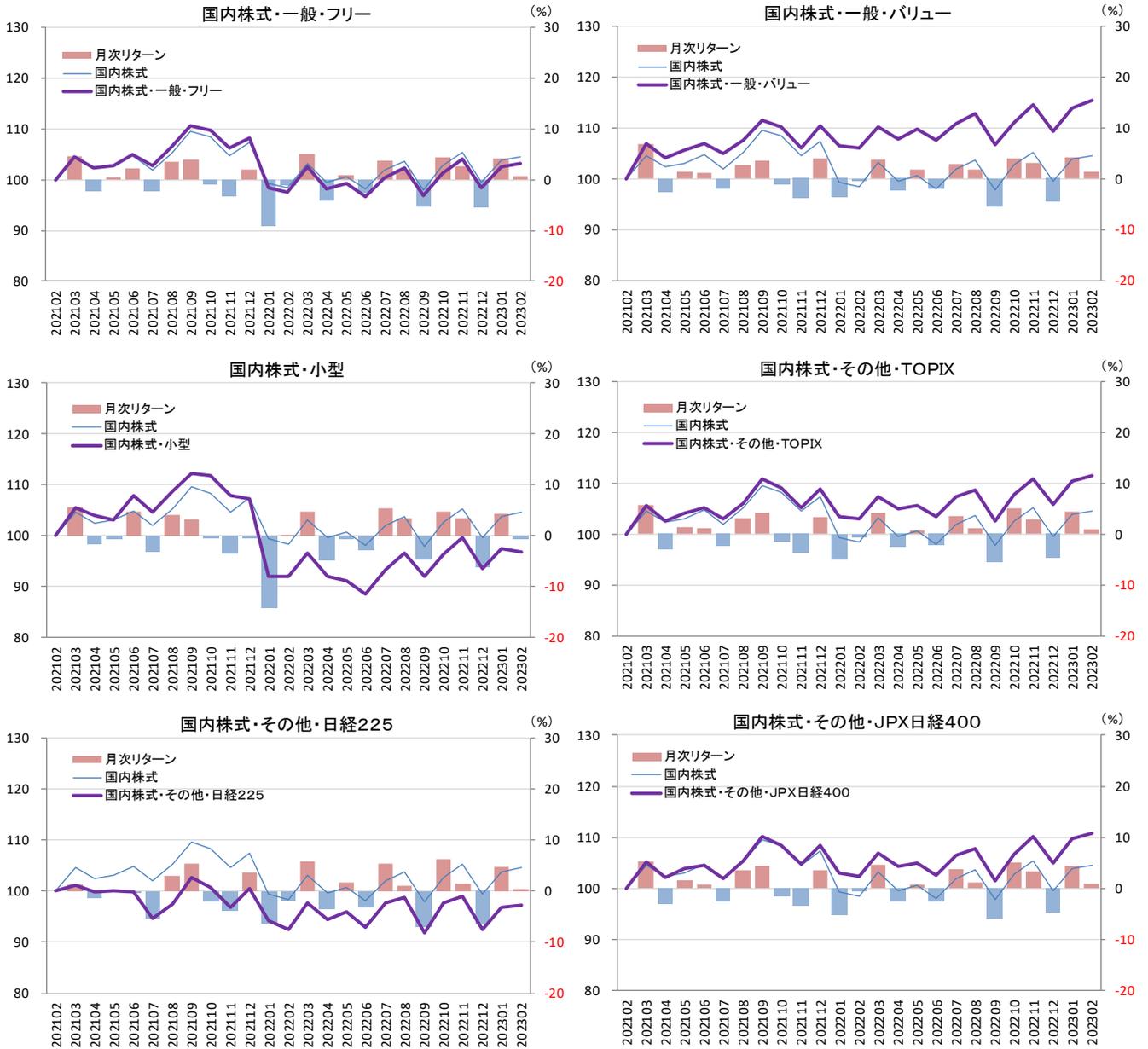
※[色塗りの基準]期間別リターン&gt;総合

<1>パフォーマンス・サマリー

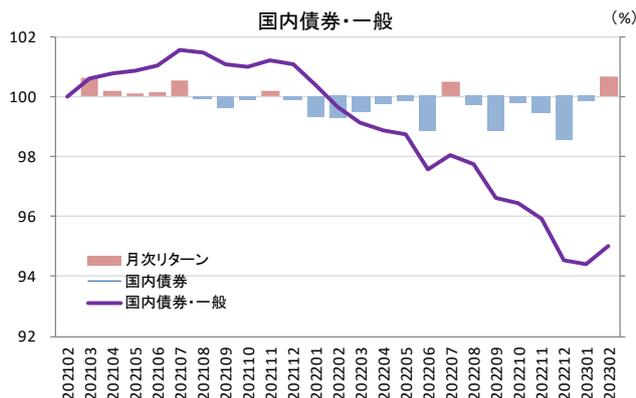
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

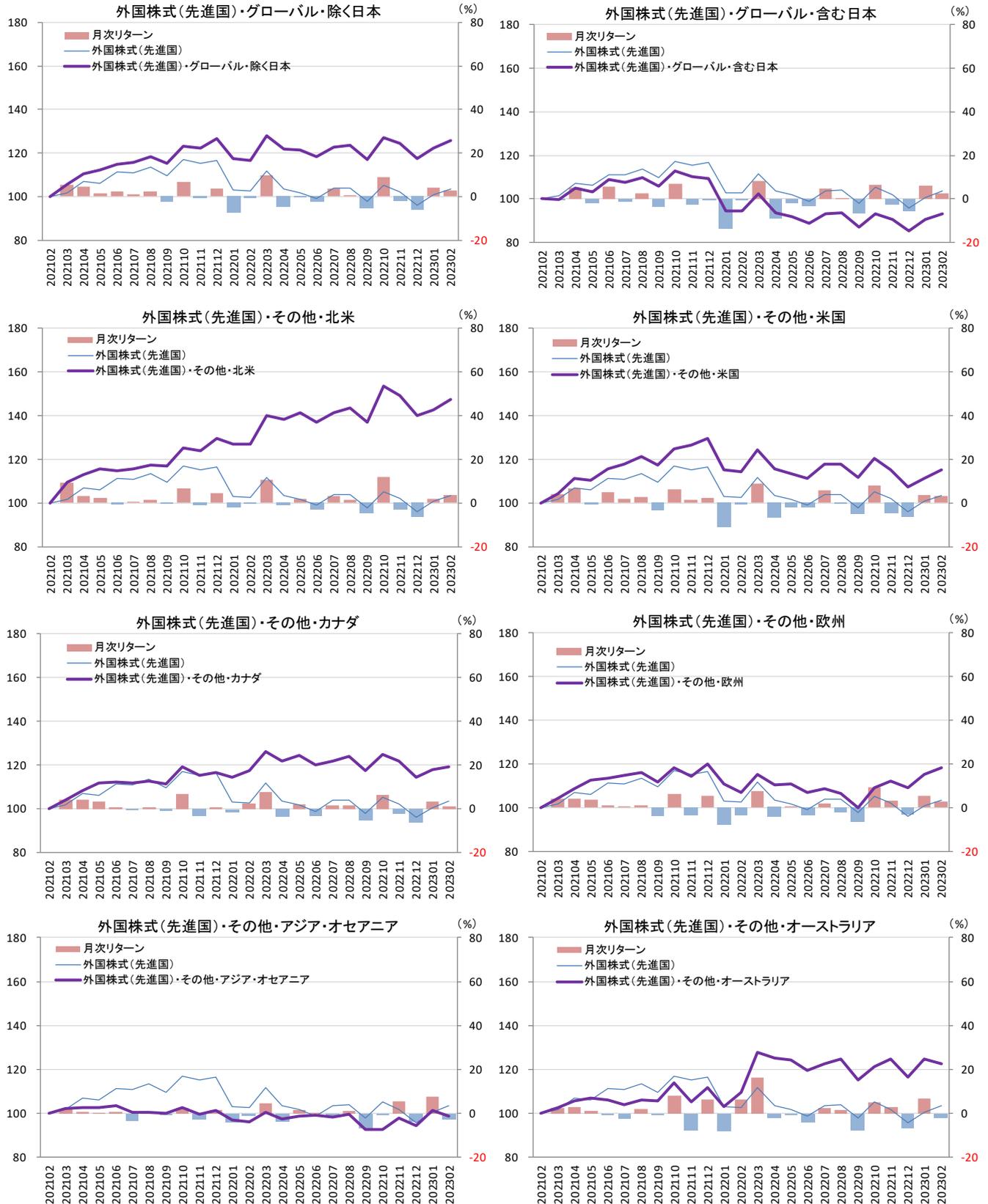


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

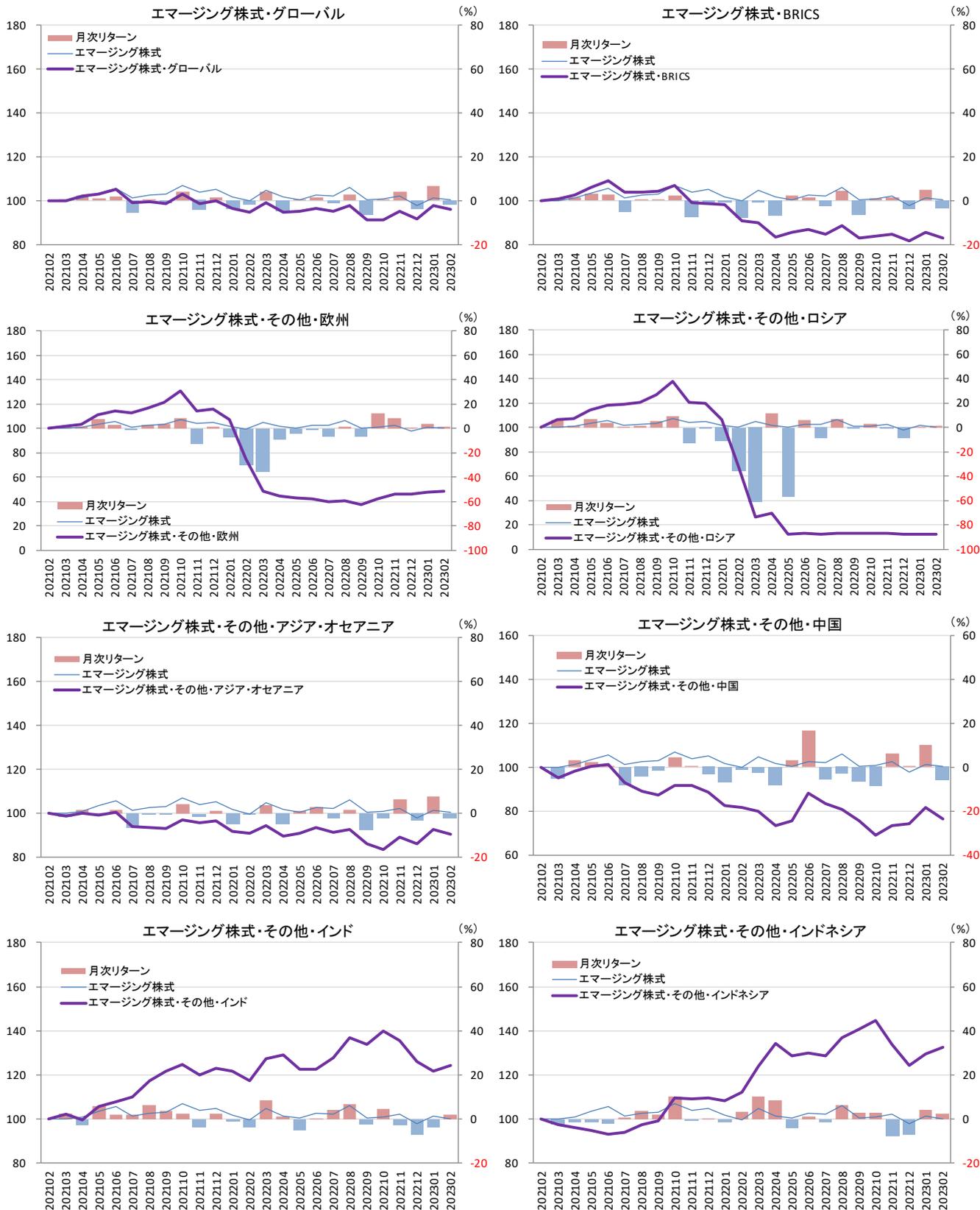


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

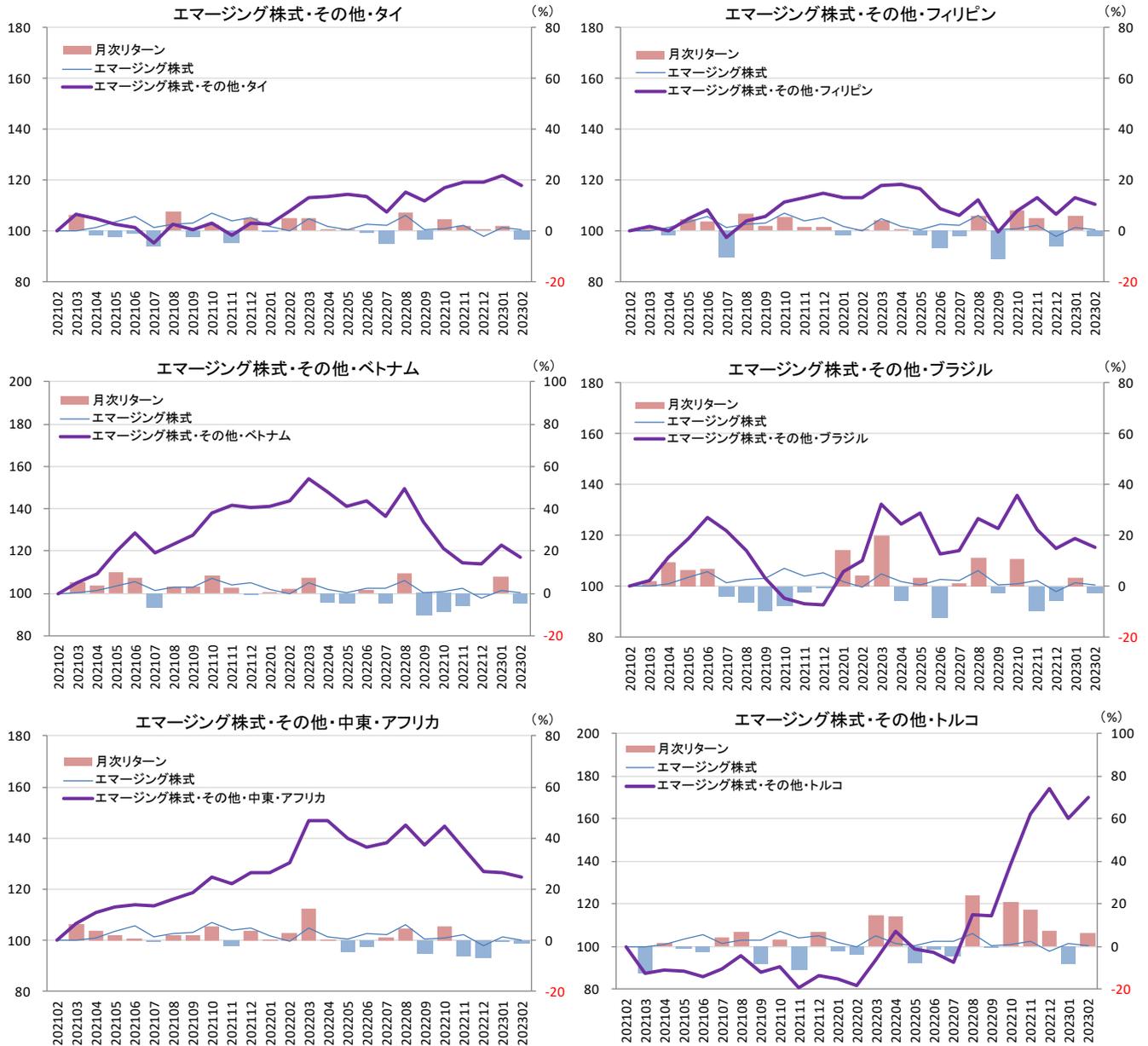


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

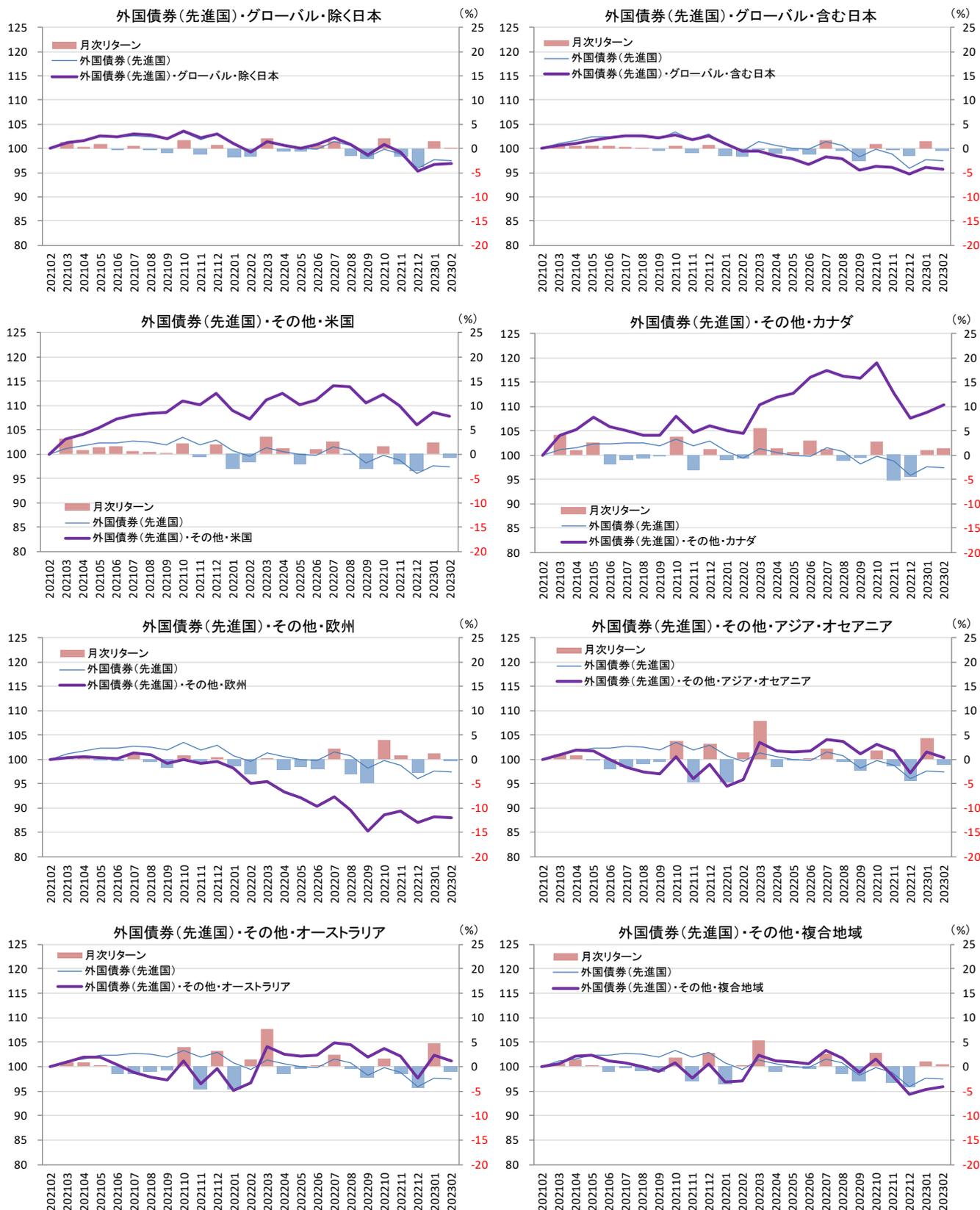


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

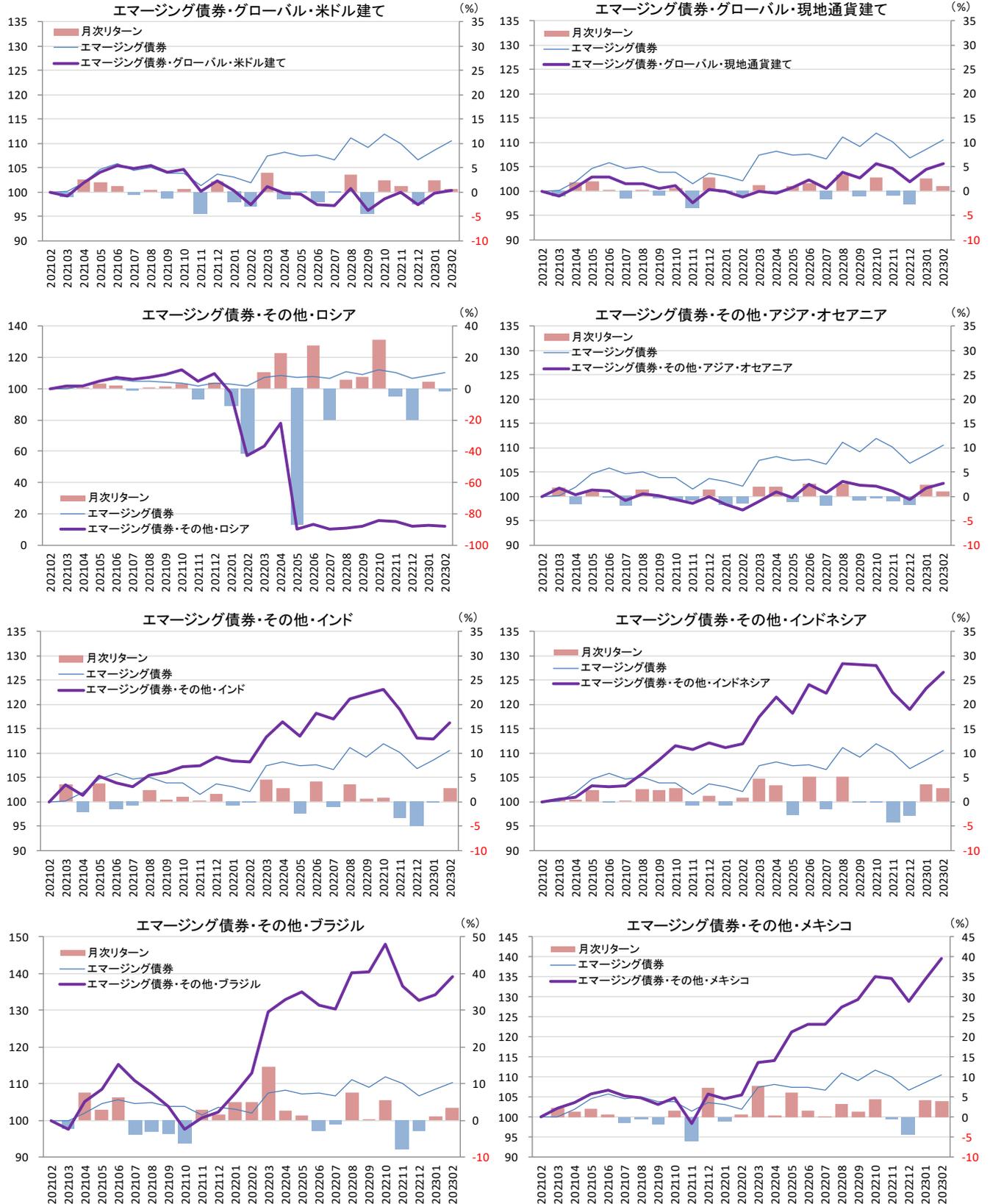


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

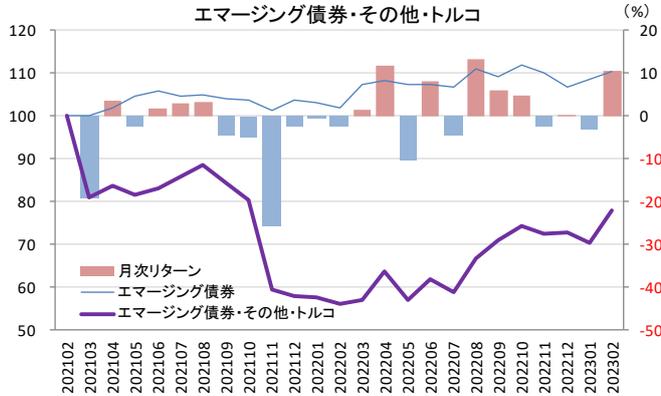


<1>パフォーマンス・サマリー

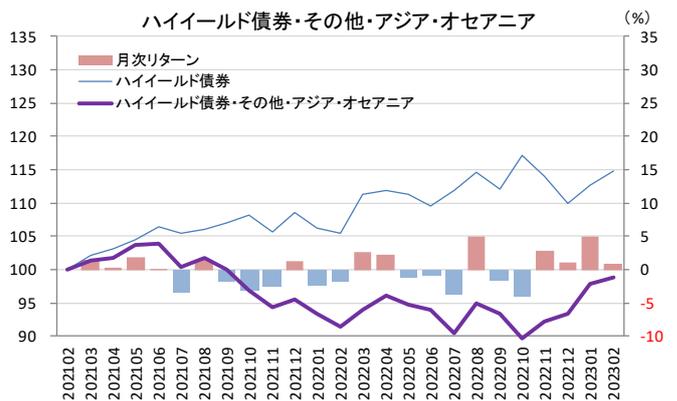
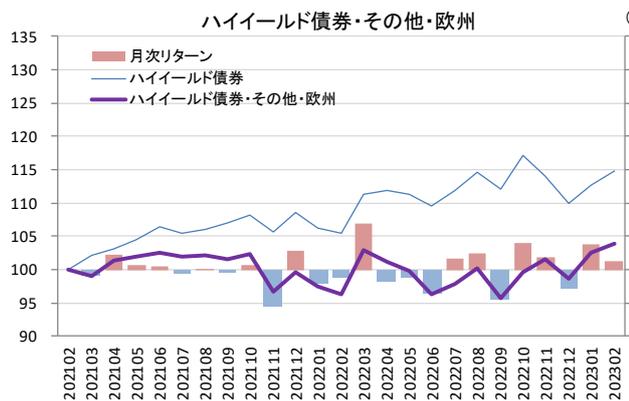
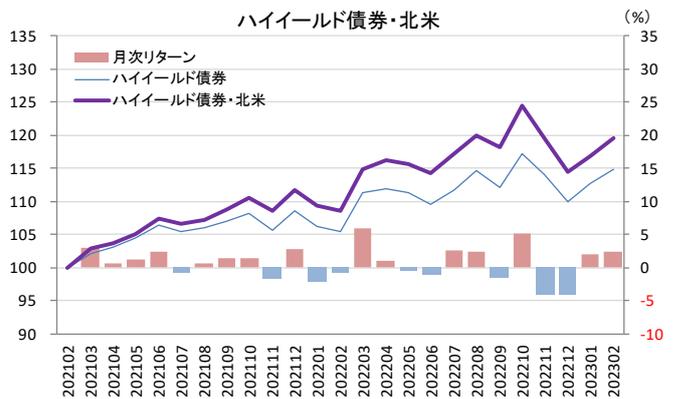
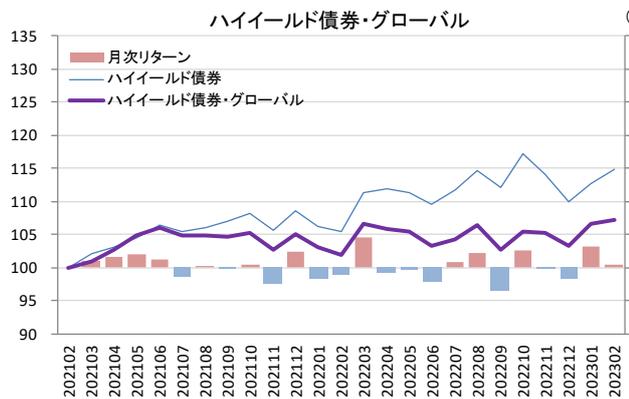
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

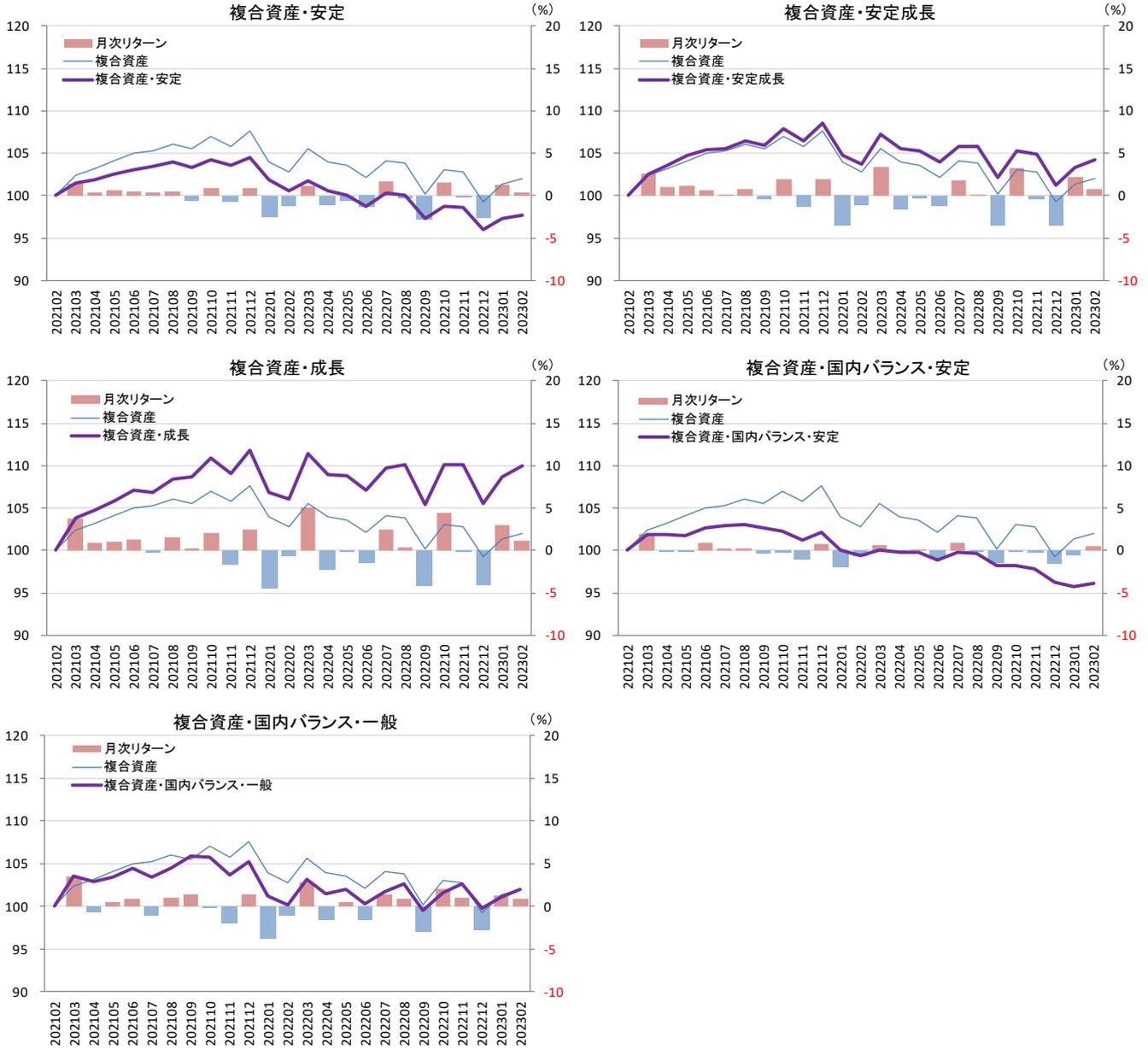


<1>パフォーマンス・サマリー

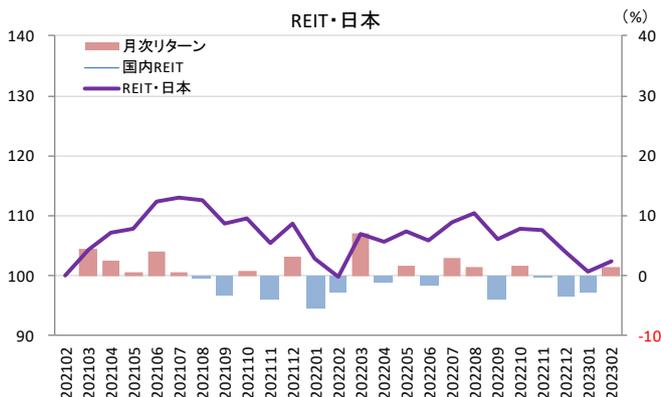
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

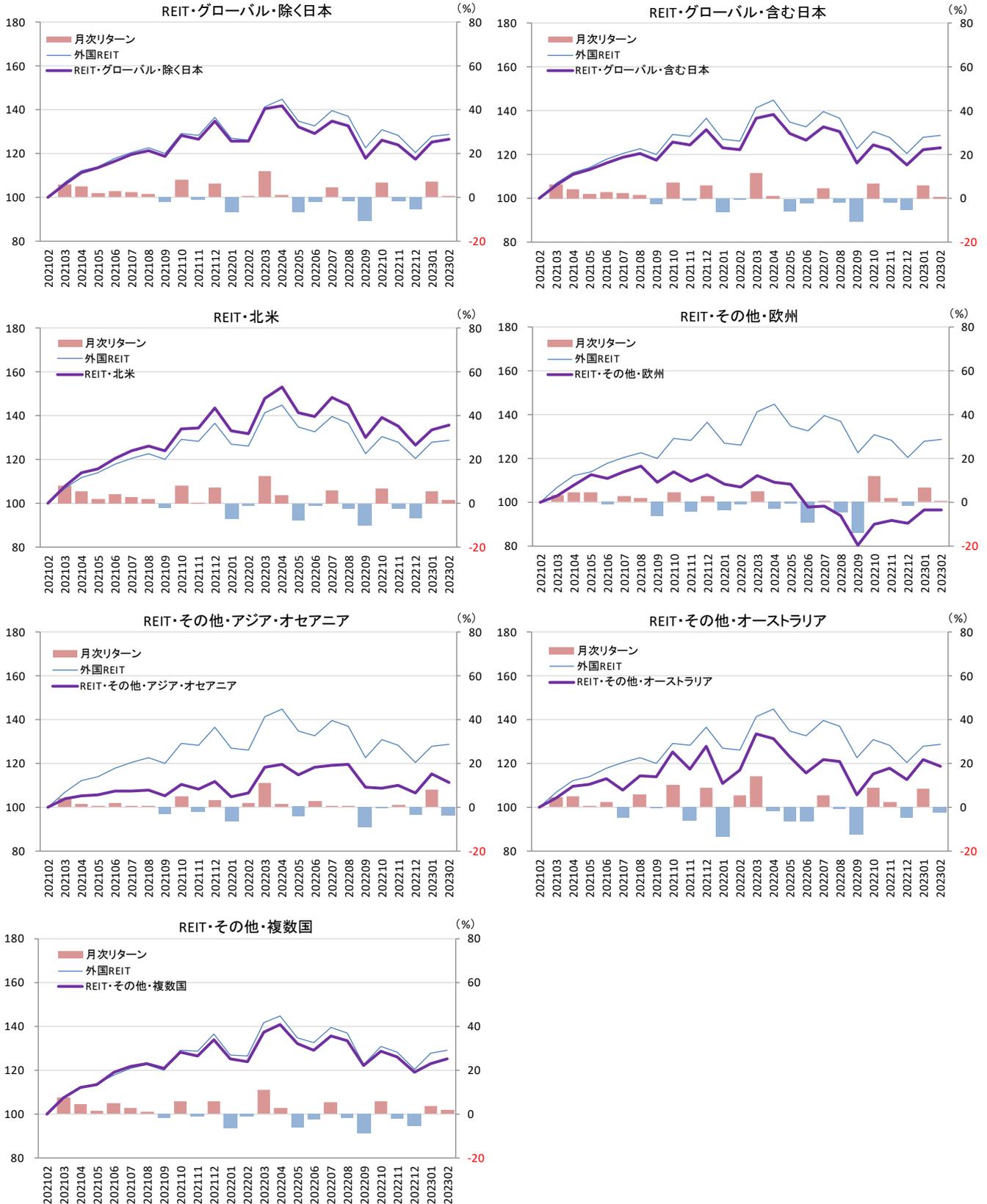


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

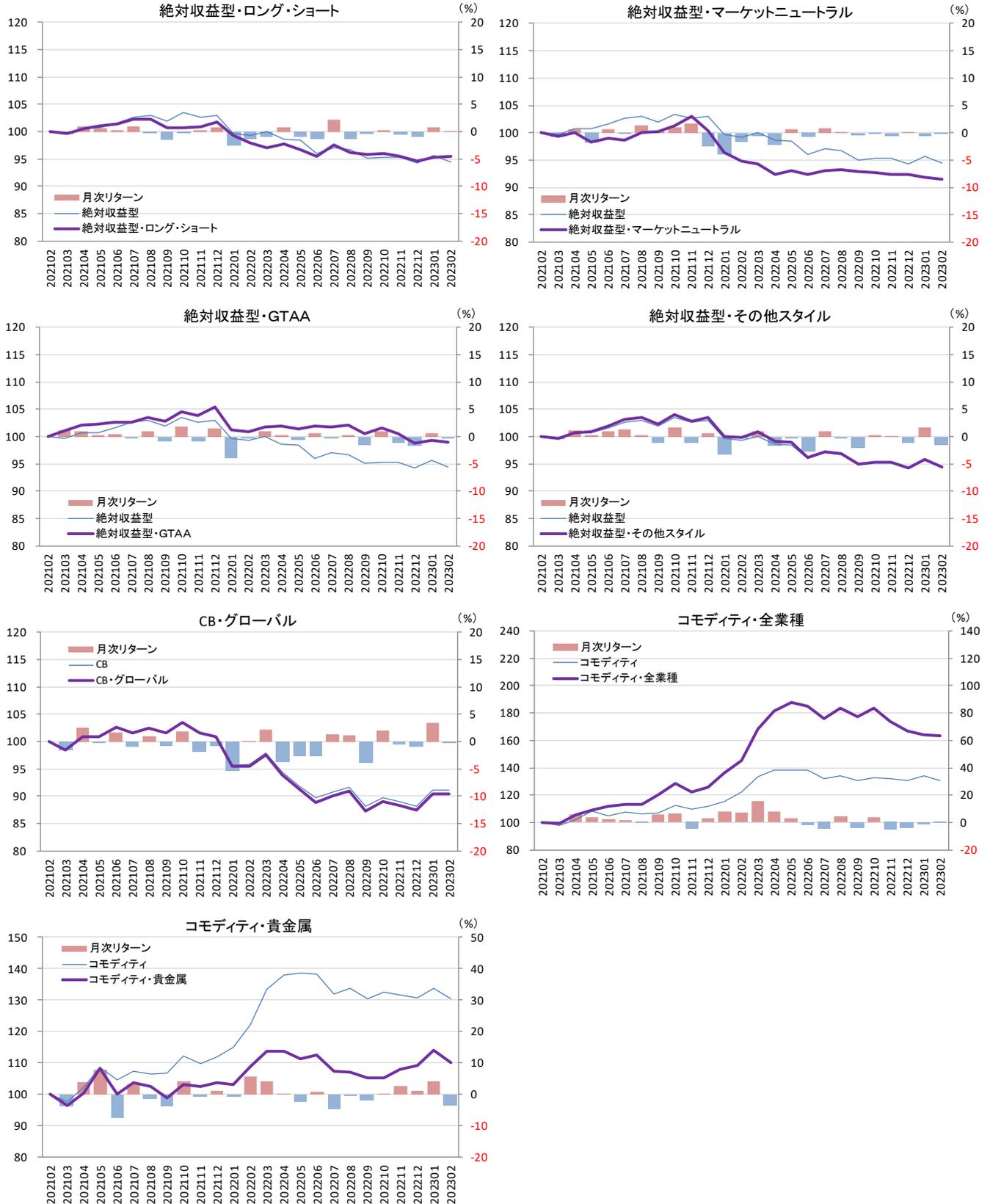


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]





## &lt;1&gt;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	1.46		
1	外国株式(先進国)・グローバル	2.78	28.21	0.77
2	外国株式(先進国)・その他	3.10	13.13	0.40
3	国内株式・一般	0.92	6.80	0.06
4	複合資産・安定成長	0.82	6.62	0.06
5	REIT・日本	1.53	3.10	0.05
6	REIT・北米	1.57	2.72	0.04
7	複合資産・成長	1.19	2.88	0.03
8	ハイイールド債券・北米	2.31	1.44	0.03
9	国内株式・その他	0.67	4.78	0.03
10	国内債券・一般	0.66	4.82	0.03
11	複合資産・安定	0.39	4.31	0.02
12	REIT・グローバル	0.79	2.00	0.02
13	エマージング債券・その他	3.03	0.51	0.02
14	エマージング債券・グローバル	0.72	0.68	0.01
15	複合資産・国内バランス	0.56	0.83	0.00
16	ブルベア	0.57	0.51	0.00
17	ハイイールド債券・その他	1.23	0.22	0.00
18	ハイイールド債券・グローバル	0.51	0.30	0.00
19	国内株式・業種特化	0.56	0.08	0.00
20	CB	0.00	0.22	0.00
21	エマージング株式・BRICS	-3.32	0.05	-0.00
22	国内株式・小型	-0.70	0.78	-0.01
23	REIT・その他	-2.88	0.36	-0.01
24	外国債券(先進国)・グローバル	-0.16	7.55	-0.01
25	複合資産・その他	-3.77	0.35	-0.01
26	外国債券(先進国)・その他	-0.74	1.77	-0.01
27	コモディティ	-2.44	0.56	-0.01
28	エマージング株式・その他	-0.71	2.03	-0.02
29	絶対収益型	-1.28	1.35	-0.02
30	エマージング株式・グローバル	-1.69	1.07	-0.02
	合計		100.00	1.46

## ◆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	0.95				
1	国内株式・一般	6.60		6.68		0.44
2	国内株式・その他	6.04		4.64		0.33
3	外国株式(先進国)・その他	1.22		12.50		0.29
4	外国株式(先進国)・グローバル	0.75		27.85		0.29
5	ハイイールド債券・北米	10.09		1.41		0.11
6	複合資産・成長	3.70		2.69		0.10
7	REIT・北米	3.16		2.86		0.09
8	エマージング債券・その他	13.35		0.58		0.06
9	複合資産・安定成長	0.52		6.65		0.05
10	国内株式・小型	5.17		0.77		0.04
11	外国債券(先進国)・その他	1.93		1.87		0.03
12	REIT・日本	2.53		3.27		0.03
13	エマージング債券・グローバル	4.05		0.71		0.02
14	コモディティ	6.78		0.56		0.02
15	REIT・グローバル	0.74		2.14		0.02
16	ハイイールド債券・その他	7.90		0.24		0.02
17	ハイイールド債券・グローバル	5.04		0.31		0.01
18	REIT・その他	3.06		0.39		0.01
19	エマージング株式・グローバル	1.19		1.06		0.00
20	国内株式・業種特化	2.02		0.08		0.00
21	エマージング株式・BRICS	-8.50		0.06		-0.01
22	CB	-4.88		0.17		-0.01
23	エマージング株式・その他	0.26		2.12		-0.02
24	複合資産・国内バランス	-2.85		0.94		-0.03
25	絶対収益型	-4.90		1.36		-0.08
26	ブルベア	-17.77		0.49		-0.09
27	複合資産・その他	-19.43		0.38		-0.10
28	複合資産・安定	-2.97		4.54		-0.15
29	外国債券(先進国)・グローバル	-3.11		7.65		-0.25
30	国内債券・一般	-4.65		5.04		-0.28
	合計			100.00		0.95

#### ◆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	19.73	22.98	66.07	13.11	11.83	10.88	0.47	0.36	0.48
国内株式	38.36	19.55	142.36	14.92	16.03	16.11	0.77	0.23	0.58
一般	38.01	17.10	131.38	14.42	15.82	16.25	0.79	0.21	0.54
フリー	36.74	16.08	129.71	14.85	16.18	16.82	0.74	0.19	0.52
バリュー	41.74	20.11	139.54	13.59 ↓	15.02	14.95	0.91	0.25	0.61
小型	39.85	8.86	212.26	18.68 ↓	19.54	18.17	0.63	0.09	0.66
その他	37.56	28.64	155.61	15.56	15.96	15.88	0.72	0.33	0.62
日経225	35.29	33.70	168.82	17.34	17.00	16.57	0.61	0.35	0.63
TOPIX	40.73	25.20	146.47	14.03 ↓	15.11	15.32	0.86	0.31	0.62
JPX日経400	40.12	26.47	-	14.61	15.29	-	0.82	0.32	-
国内債券	-7.55	-4.82	1.93	1.92	1.92	1.82	-1.33	-0.49	0.11
一般	-7.55	-4.82	1.93	1.92	1.92	1.82	-1.33	-0.49	0.11
外国株式(先進国)	38.74	48.37	129.82	19.45	18.24	16.02	0.59	0.45	0.54
グローバル	36.44	46.52	138.94	19.54	18.36	16.00	0.56	0.43	0.57
除く日本	57.31	66.70	200.32	18.91	18.05	16.55	0.86	0.60	0.70
含む日本	30.29	40.56	123.35	20.13	18.73	16.09	0.46	0.38	0.52
その他	45.48	53.34	110.71	19.65	18.24	16.28	0.68	0.49	0.48
北米	94.12	102.09	190.59	19.55	19.27	17.48	1.27	0.79	0.64
米国	50.49	66.91	146.64	18.89	18.07	16.67	0.77	0.60	0.57
カナダ	27.63	29.63	25.89	21.70	18.80	16.05	0.39	0.29	0.15
欧州	34.36	34.23	107.00	19.96	18.25	16.38	0.52	0.33	0.46
ドイツ	43.85	26.56	-	25.20	22.78	-	0.51	0.21	-
イギリス	33.81	19.09	-	18.57	17.63	-	0.55	0.20	-
アジア・オセアニア	19.53	18.16	86.43	16.01	15.26	15.24	0.38	0.23	0.42
オーストラリア	37.05	26.63	53.93	28.58	23.99	20.06	0.39	0.20	0.22
ニュージーランド	36.31	53.53	233.73	19.91	17.94	18.14	0.55	0.50	0.71
複合地域	97.14	46.41	-	38.80	33.47	-	0.66	0.24	-
エマージング株式	24.23	17.86	66.09	20.00	18.04	16.82	0.38	0.19	0.31
グローバル	25.96	22.16	55.79	18.78	18.15	16.96	0.43	0.23	0.27
BRICS	-2.09	-3.98	49.92	22.55	20.79	19.53	-0.03	-0.04	0.21
その他	24.57	17.20	71.63	20.72	18.43	17.05	0.37	0.18	0.33
欧州	-52.15	-55.48	-47.25	39.23	32.66	26.95	-0.55	-0.46	-0.23
ロシア	-87.10	-85.67	-81.91	59.43	47.96	38.16	-0.83	-0.67	-0.41
アジア・オセアニア	17.84	7.77	57.91	18.52 ↑	17.81	16.34	0.31	0.09	0.29
中国	8.67	17.52	141.76	22.55 ↑	21.78	21.66	0.13	0.15	0.43
インド	45.51	40.48	162.97	26.34	23.48	22.96	0.51	0.30	0.44
インドネシア	36.10	11.86	20.98	29.89	26.96	24.46	0.36	0.09	0.08
タイ	23.88	-10.79	23.02	23.89	21.38	18.66	0.31	-0.10	0.11
フィリピン	5.44	-13.45	0.97	23.94	20.96	19.26	0.08	-0.13	0.01
ベトナム	50.14	10.56	126.19	30.43	26.48	21.43	0.48	0.08	0.40
韓国	34.59	-2.80	22.95	28.00 ↑	24.84	20.25	0.37	-0.02	0.10
香港	-2.87	-11.03	34.24	23.67 ↑	21.84 ↑	19.99 ↑	-0.04	-0.10	0.15
中南米	30.16	15.95	12.93	33.73	30.93	26.37	0.27	0.10	0.05
ブラジル	-3.50	-14.69	-25.07	36.53	34.99	31.90	-0.03	-0.09	-0.09
メキシコ	65.88	48.30	40.16	31.59	28.96	23.82	0.58	0.28	0.14
中東・アフリカ	41.78	24.78	78.43	20.68	18.77	16.91	0.60	0.24	0.35
トルコ	79.19	11.39	-5.56	36.12	36.95	32.26	0.60	0.06	-0.02
複合地域	25.97	14.62	51.41	19.14	18.08	16.01	0.42	0.16	0.27

※[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	19.73	22.98	66.07	13.11	11.83	10.88	0.47	0.36	0.48
外国債券(先進国)	0.01	4.17	11.74	5.51 ↑	4.57	5.91	0.01	0.19	0.19
グローバル	-2.55	3.11	14.02	4.67	3.89	5.34	-0.18	0.17	0.25
除く日本	-1.23	5.06	15.06	4.98	4.22	5.88	-0.08	0.24	0.24
含む日本	-3.99	1.00	13.03	5.23	4.23	5.06	-0.25	0.06	0.25
その他	9.06	8.92	11.52	8.92	7.54	8.02	0.33	0.23	0.14
北米	-3.18	2.34	-	6.06	4.82	-	-0.17	0.10	-
米国	5.61	14.87	34.09	8.88 ↑	7.11	6.76	0.21	0.40	0.44
カナダ	14.40	17.51	11.42	8.61	7.48	8.74	0.54	0.44	0.13
欧州	-11.53	-11.11	6.07	6.45	5.55	7.13 ↓	-0.62	-0.41	0.08
イギリス	4.48	2.32	-	10.81	9.59	-	0.14	0.05	-
アジア・オセアニア	14.63	8.59	10.70	11.15	9.72	9.69	0.42	0.18	0.11
オーストラリア	15.03	8.88	10.31	11.25	9.77	9.69	0.43	0.18	0.10
ニュージーランド	2.22	1.04	-	10.14 ↑	9.11	-	0.08	0.03	-
複合地域	4.22	10.73	14.44	7.21	5.92	7.59	0.20	0.35	0.18
エマージング債券	5.52	5.10	14.41	11.62	10.91	11.26	0.16	0.10	0.12
グローバル	-2.04	-2.90	6.95	13.60	12.36	11.79	-0.05	-0.04	0.06
米ドル建て	-3.78	-3.95	7.26	14.50	12.90	12.19	-0.09	-0.06	0.06
現地通貨建て	3.83	-0.21	1.57	10.80	11.04	10.69	0.12	-0.00	0.02
その他	15.22	15.22	22.02	11.11	10.64	11.80	0.44	0.27	0.17
ロシア	-89.20	-88.82	-89.05	67.80	53.31	41.31	-0.77	-0.66	-0.48
アジア・オセアニア	3.79	13.08	33.09	7.86	6.51	7.42	0.16	0.39	0.39
インド	18.97	26.97	67.82	9.62 ↑	9.09	11.47	0.62	0.54	0.46
インドネシア	28.92	37.08	30.79	15.53	14.45	15.53	0.57	0.45	0.18
ブラジル	11.47	-1.59	12.08	19.11	19.63	18.54	0.19	-0.01	0.06
メキシコ	35.90	60.40	40.42	18.16	16.51	15.72	0.59	0.60	0.22
トルコ	-30.81	-47.37	-65.51	27.43	34.27	26.99	-0.42	-0.35	-0.37
複合地域	-3.73	-0.03	-4.87	13.39	12.06	12.38	-0.09	0.00	-0.04
ハイイールド債券	17.47	19.75	50.74	13.30	11.45	10.78	0.42	0.32	0.39
グローバル	8.49	8.14	34.33	12.97	11.32	10.81	0.21	0.14	0.28
北米	22.48	27.45	63.62	13.28	11.46	10.75	0.53	0.44	0.47
その他	6.05	2.99	27.34	14.92	12.83	11.79	0.13	0.05	0.21
欧州	7.46	2.79	30.07	15.89	13.76	12.60	0.15	0.04	0.21
アジア・オセアニア	-0.27	2.08	27.23	13.82	11.54	10.55	-0.00	0.04	0.23
複合地域	16.40	20.73	60.55	10.22 ↑	8.80	9.20	0.51	0.44	0.53
複合資産	7.88	10.92	49.31	7.92	7.18	7.59	0.33	0.30	0.54
安定	0.19	2.93	31.52	5.46	4.93	5.91	0.02	0.13	0.47
安定成長	11.34	15.22	54.72	8.46	7.71	7.96	0.43	0.38	0.56
成長	27.33	27.34	99.36	11.06	10.96	10.72	0.76	0.46	0.67
国内バランス	-6.78	-4.67	14.62	4.22	3.88	5.51	-0.54	-0.24	0.25
安定	-7.94	-5.26	14.11	4.09	3.70	3.23	-0.66	-0.28	0.41
一般	14.82	9.73	46.65	8.06	8.25	9.19	0.59	0.23	0.43

※[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	19.73	22.98	66.07	13.11	11.83	10.88	0.47	0.36	0.48
国内REIT	1.54	27.33	90.82	17.20	14.74	15.94	0.03	0.34	0.42
日本	1.54	27.33	90.82	17.20	14.74	15.94	0.03	0.34	0.42
外国REIT	25.69	54.41	111.80	21.98	18.41	16.43	0.36	0.50	0.47
グローバル	20.00	42.18	87.05	22.93	19.11	16.70	0.27	0.38	0.39
除く日本	24.34	51.61	111.29	23.77	19.70	17.03	0.32	0.44	0.46
含む日本	18.42	39.44	82.50	22.64	18.91	16.59	0.26	0.37	0.37
北米	33.31	69.61	136.42	21.39	18.26	16.68	0.47	0.61	0.54
その他	9.77	28.35	95.10	23.39	19.04	16.26	0.14	0.27	0.43
欧州	-10.09	-8.60	43.22	24.44	20.71	18.68	-0.14	-0.08	0.20
アジア・オセアニア	8.33	28.93	86.64	21.41	17.69	15.78	0.13	0.30	0.41
オーストラリア	13.29	27.65	62.99	36.48	28.98	23.11	0.12	0.17	0.22
複合地域	10.08	1.65	43.63	29.55	24.91	20.68	0.11	0.01	0.18
複数国	25.46	62.97	155.96	20.00	17.06	15.26	0.39	0.60	0.65
その他									
絶対収益型	-4.20	-7.32	-3.32	3.87	3.22	2.93	-0.36	-0.46	-0.11
ロング・ショート	-8.28	-10.42	-11.69	3.37	3.32	3.13	-0.83	-0.64	-0.39
マーケットニュートラル	-4.71	-11.60	28.23	4.80	4.22	5.69	-0.33	-0.57	0.44
GTAA	4.32	5.60	13.15	5.29	4.46	3.49	0.27	0.25	0.36
その他スタイル	-4.20	-6.98	-2.43	4.20	↑ 3.45	3.52	-0.33	-0.41	-0.07
CB	5.64	5.93	26.01	10.54	8.83	7.79	0.18	0.14	0.30
アジア・オセアニア	29.23	34.31	95.74	13.99	12.39	11.71	0.64	0.49	0.59
日本	2.19	-5.92	30.97	4.61	↓ 5.16	6.16	0.16	-0.23	0.44
グローバル	4.99	5.68	24.66	10.86	9.06	7.87	0.15	0.13	0.28
コモディティ	42.18	47.36	2.14	13.38	11.34	12.34	0.93	0.71	0.02
全業種	84.99	61.39	12.91	22.34	19.27	16.97	1.02	0.52	0.07
貴金属	15.76	36.36	4.04	13.30	12.18	12.97	0.38	0.53	0.03
エネルギー	117.70	90.69	14.92	41.74	36.95	31.37	0.71	0.37	0.04
その他コモディティ	66.49	46.26	18.22	21.57	19.03	16.97	0.86	0.42	0.10

※[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

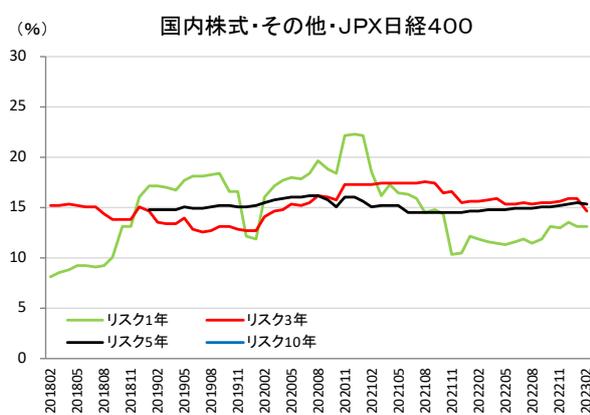
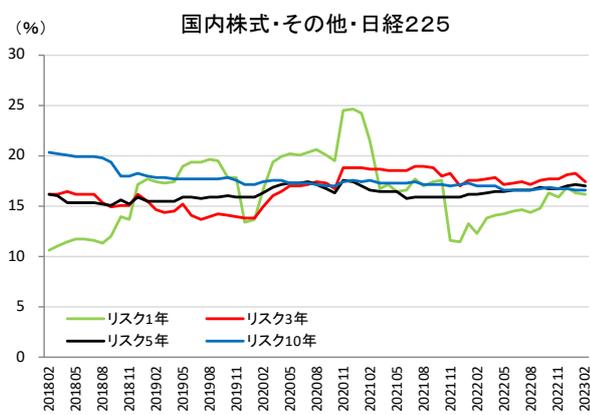
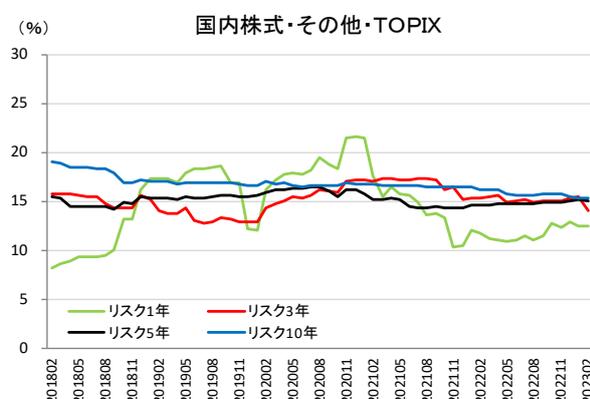
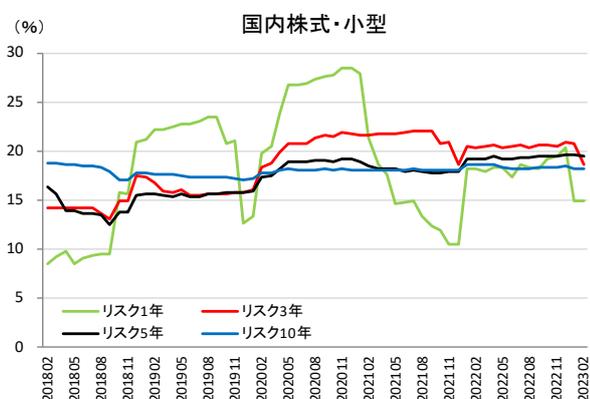
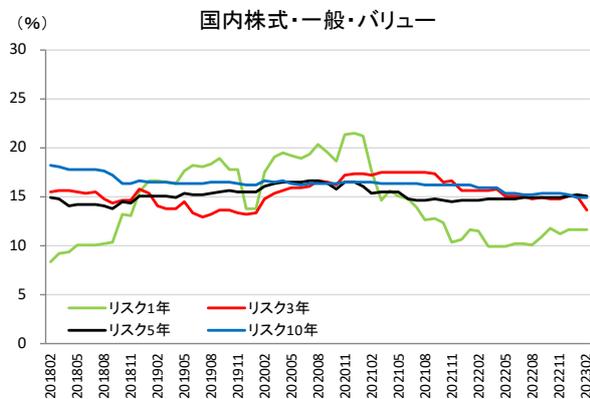
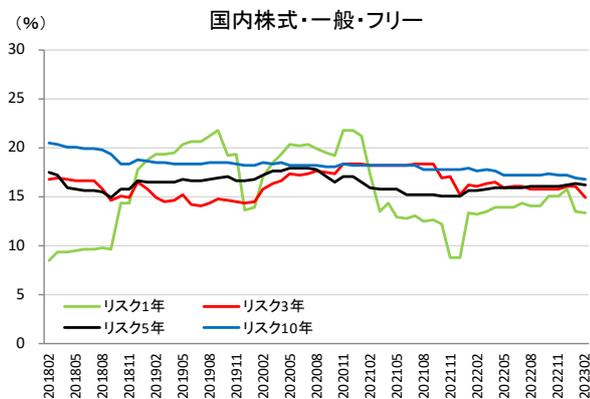
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

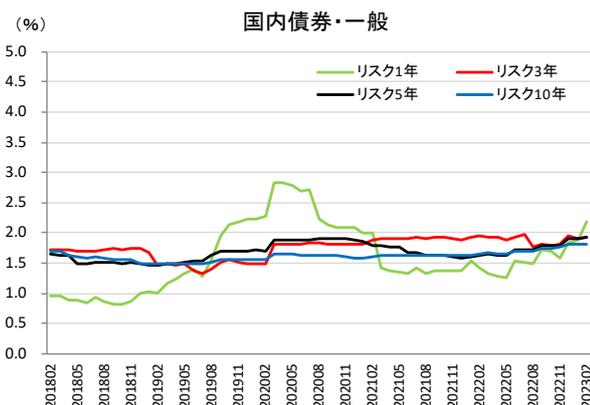
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

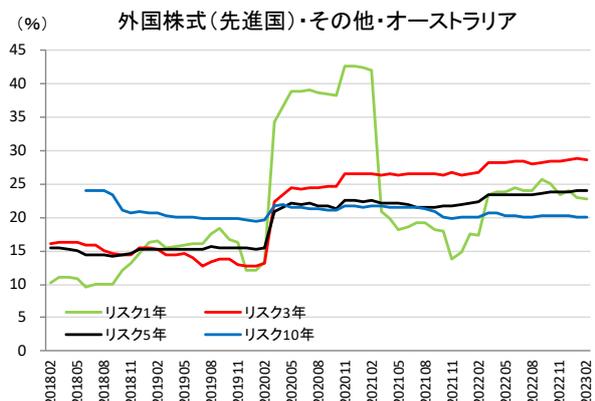
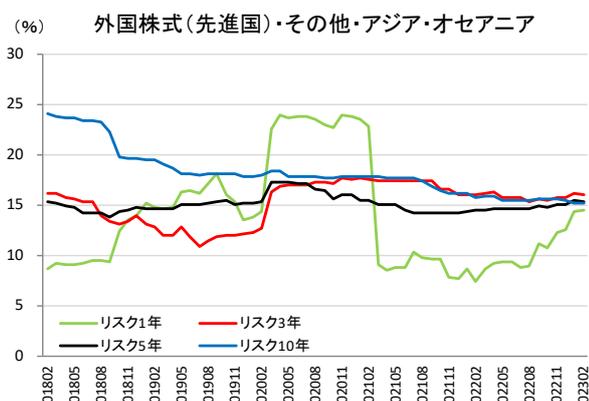
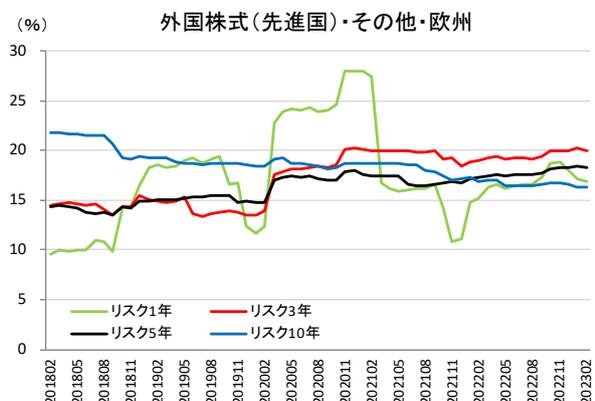
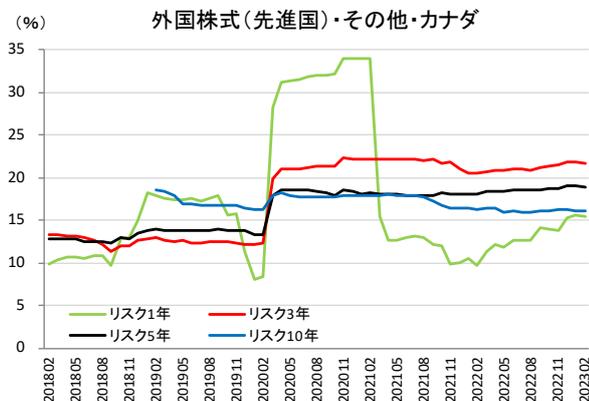
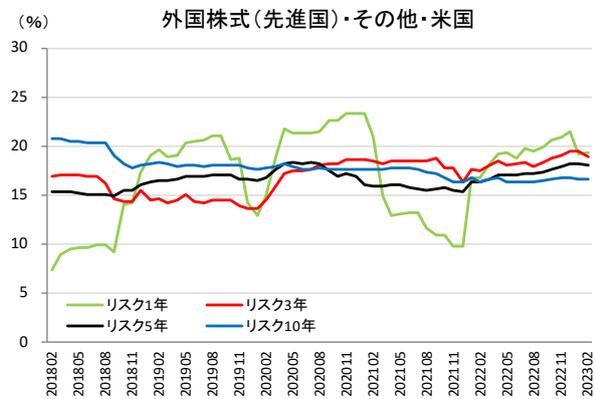
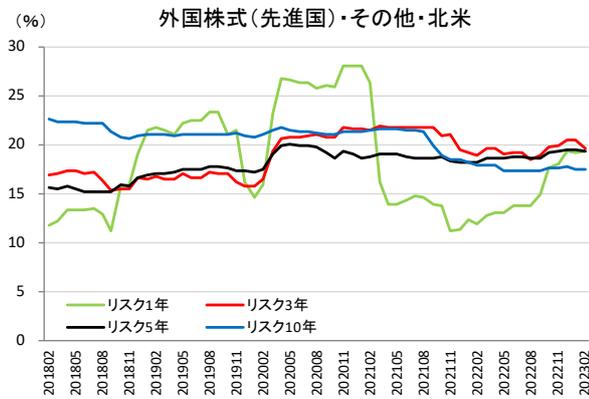
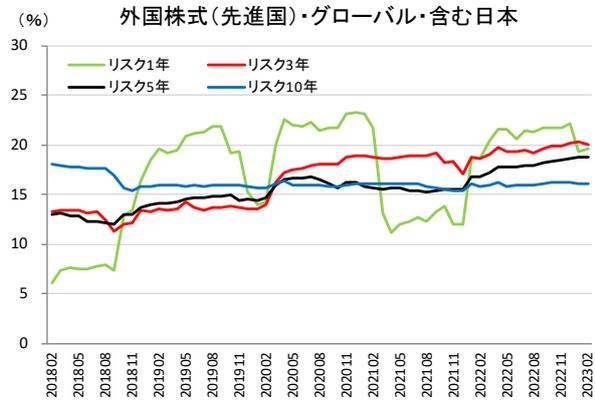
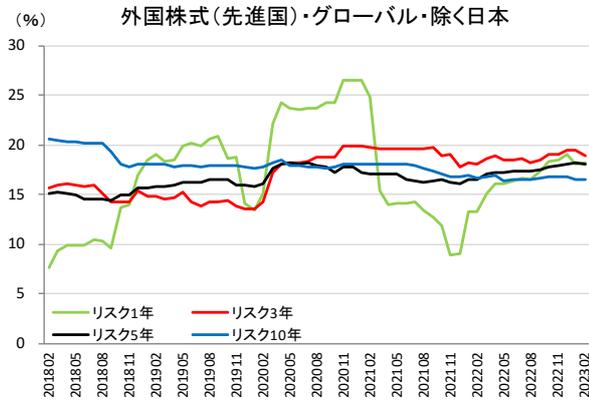


<2> リスク・サマリー

(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)]

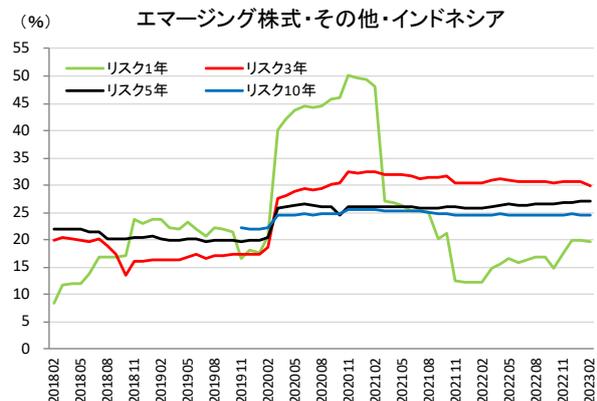
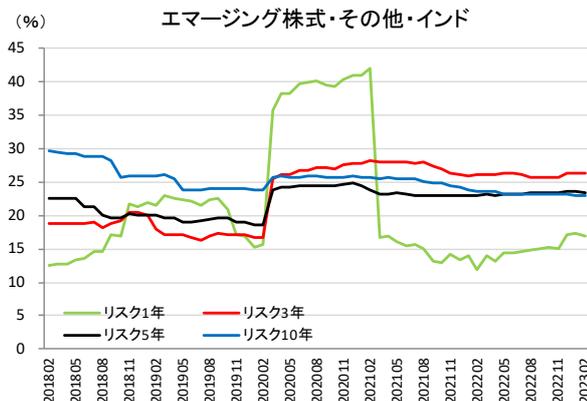
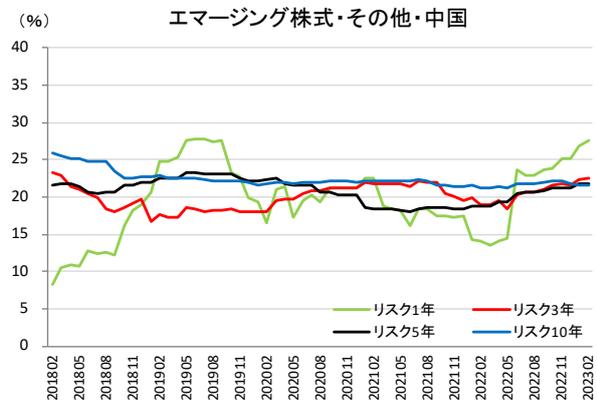
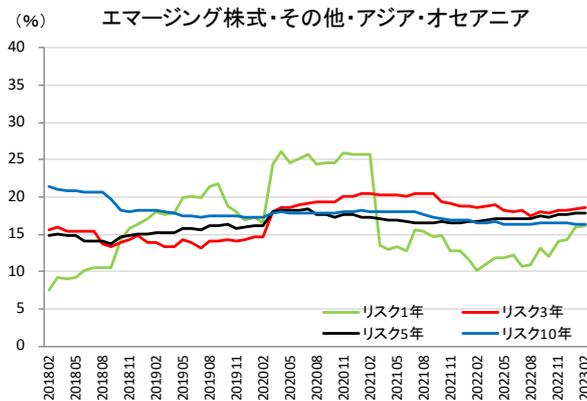
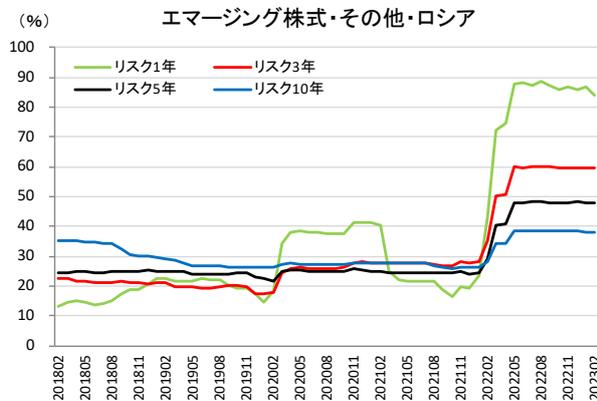
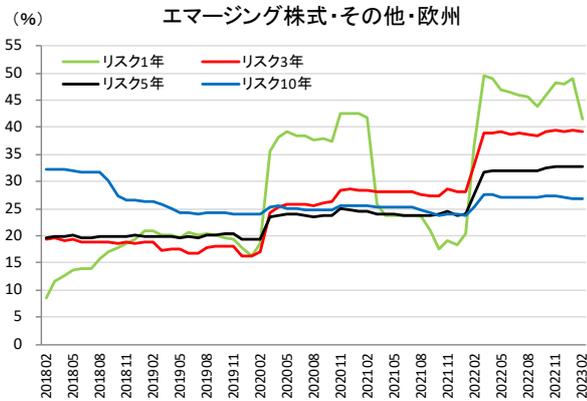
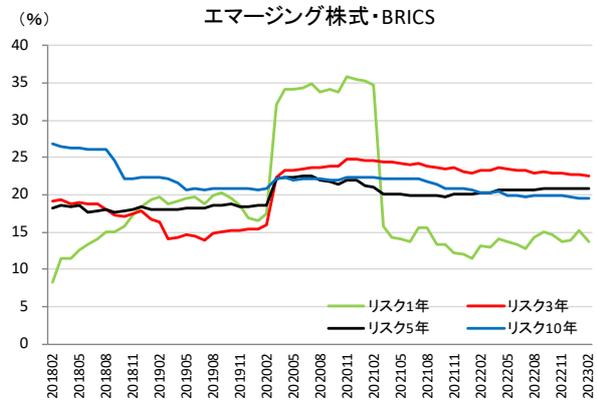
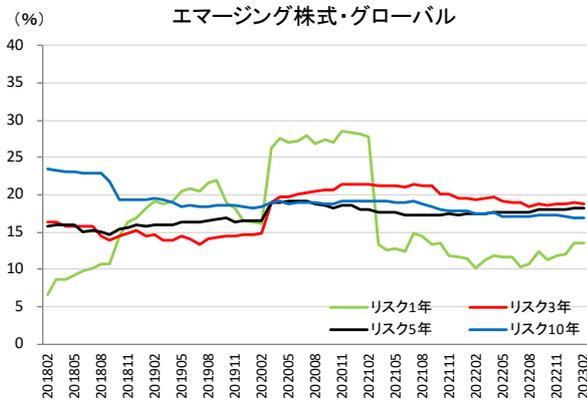


<2> リスク・サマリー

(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]

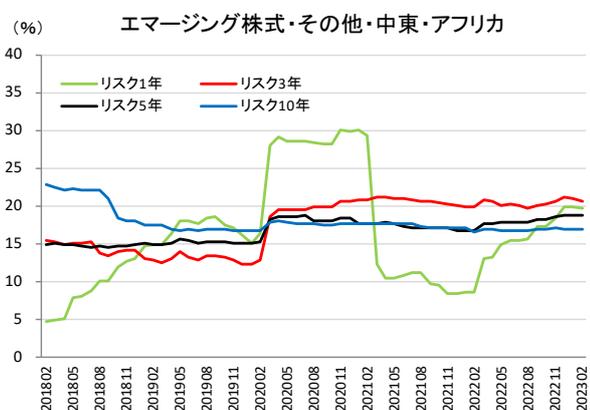
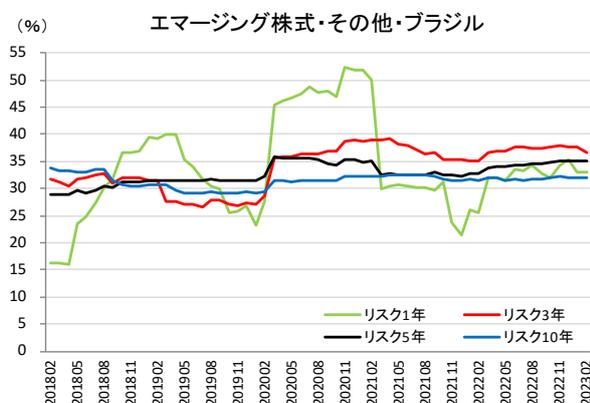
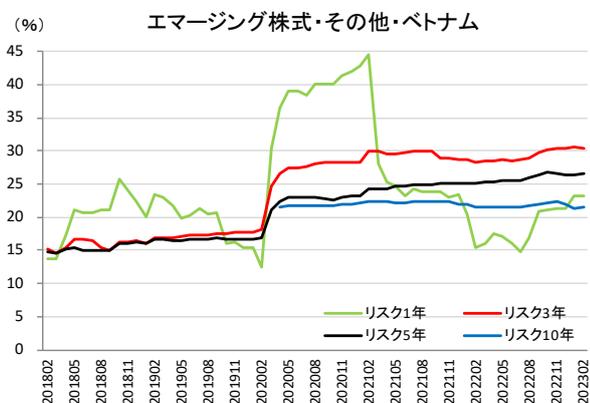
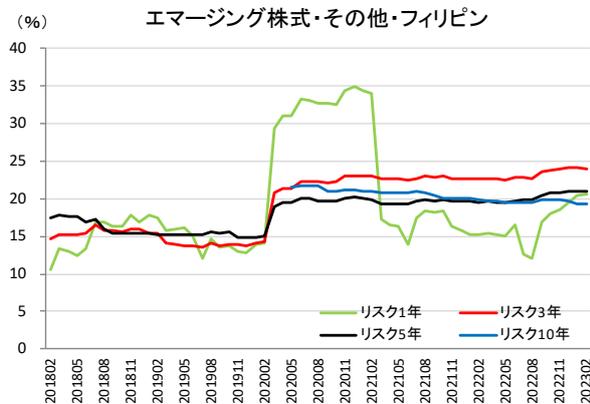
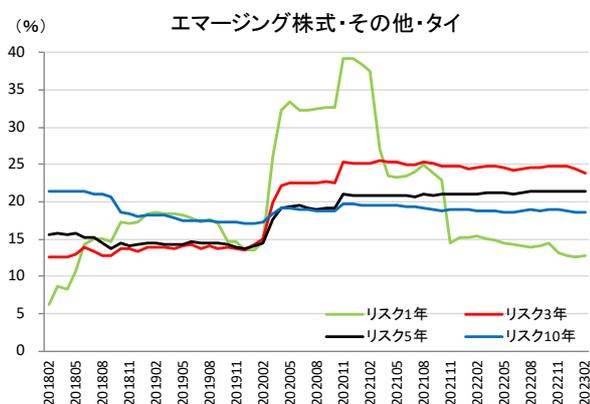


<2> リスク・サマリー

(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]

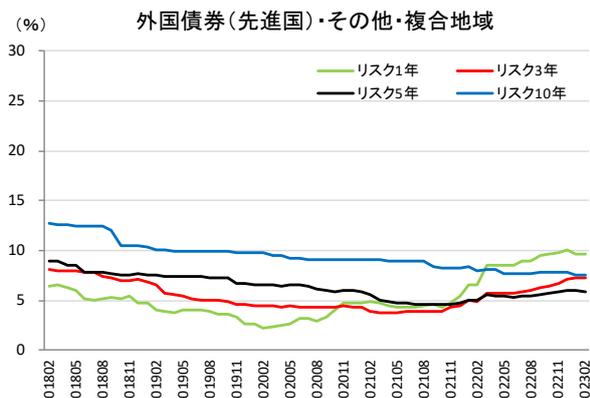
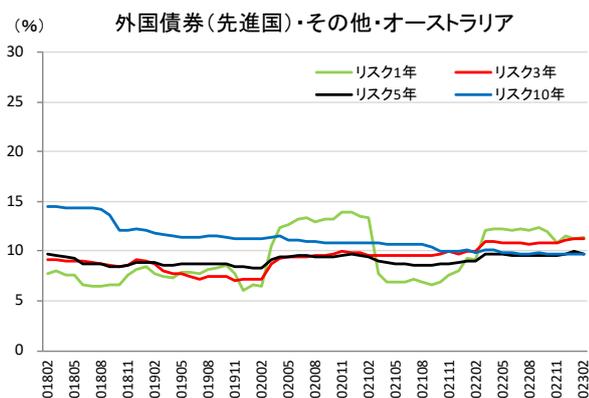
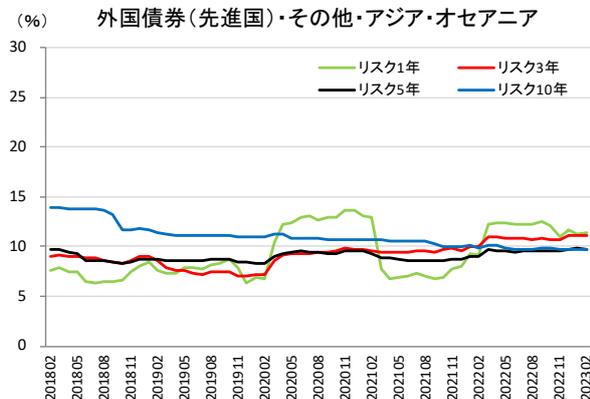
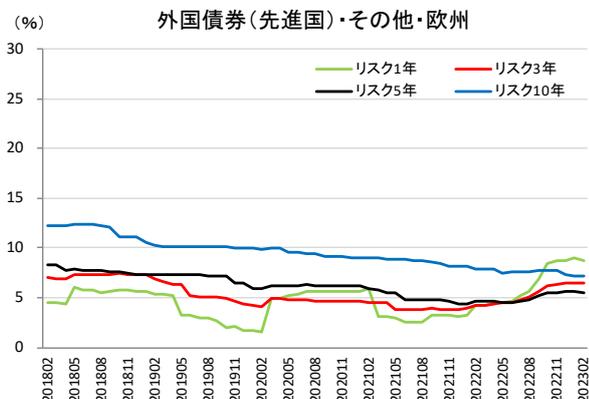
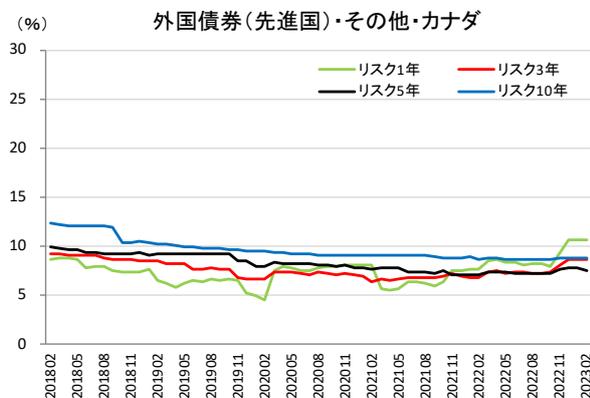
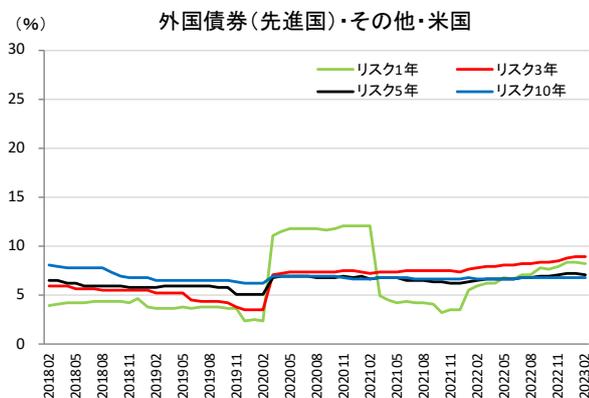
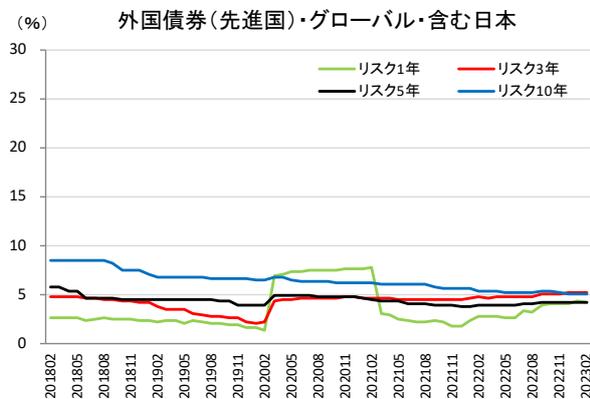
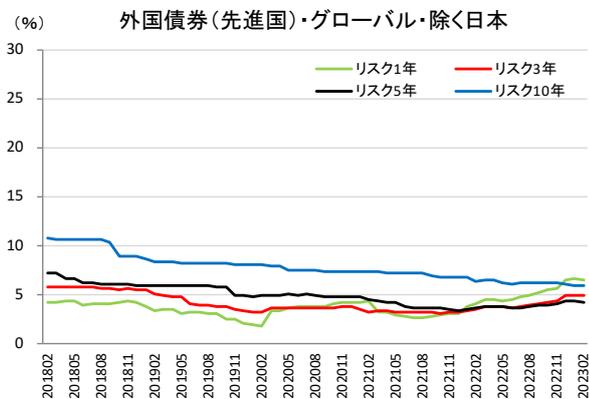


<2> リスク・サマリー

(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)]

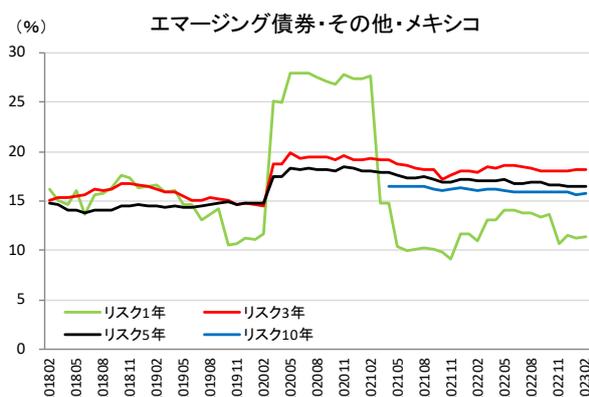
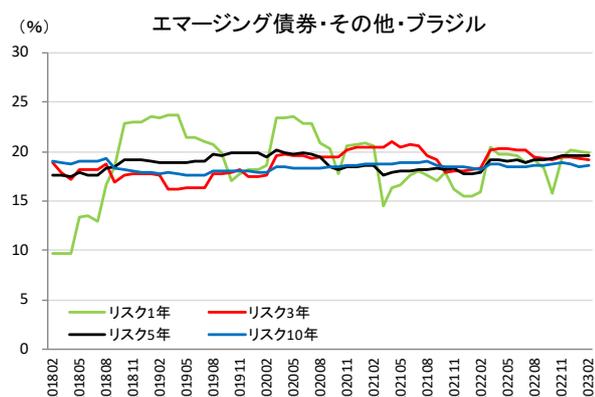
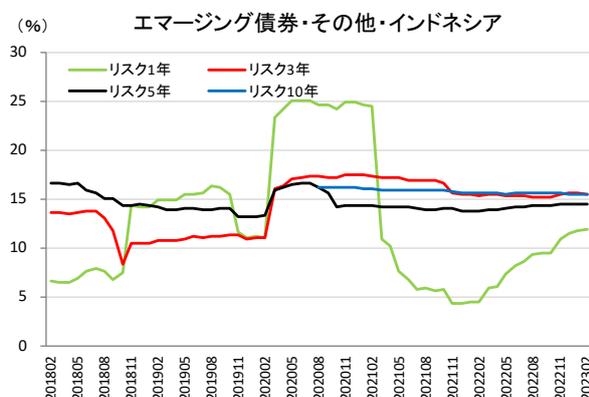
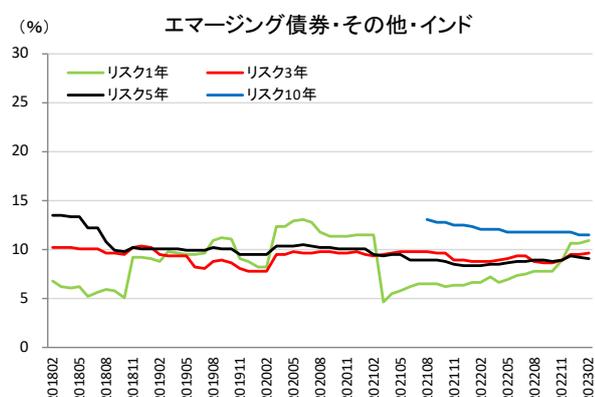
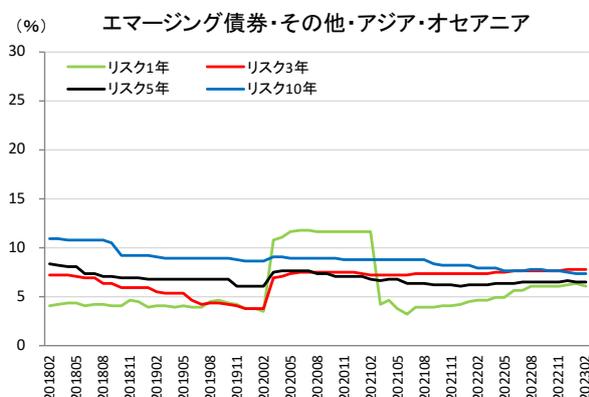
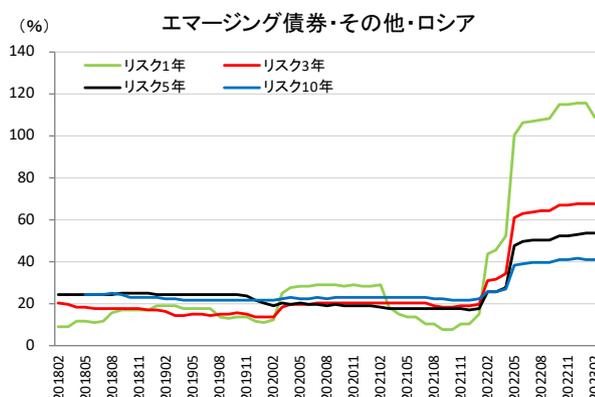
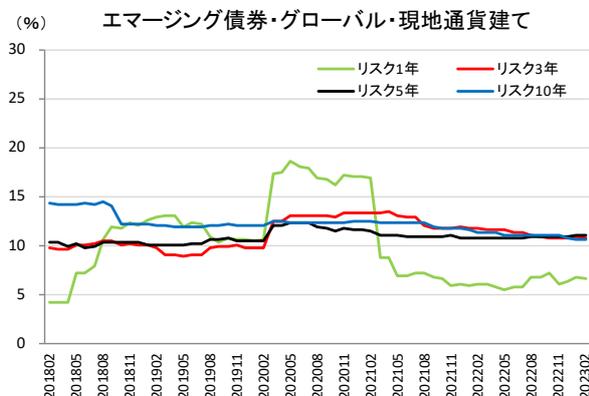
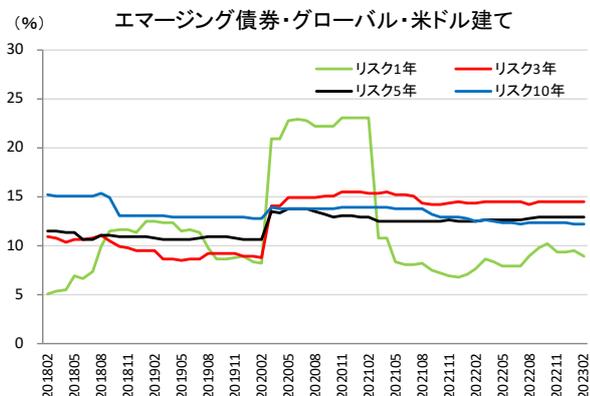


<2>リスク・サマリー

(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]

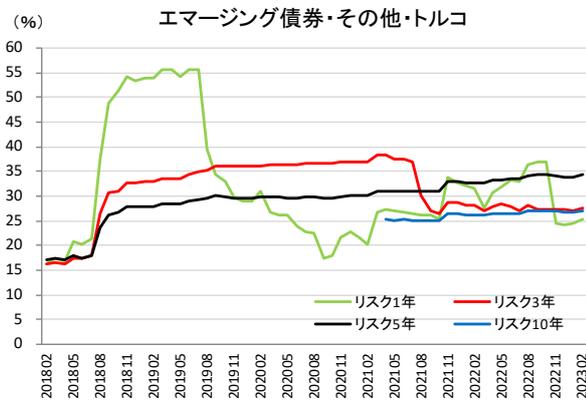


<2> リスク・サマリー

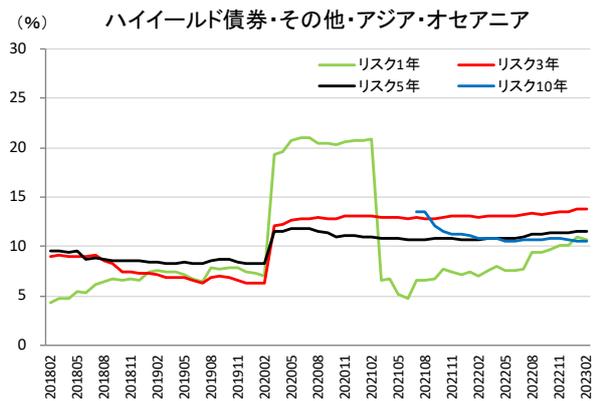
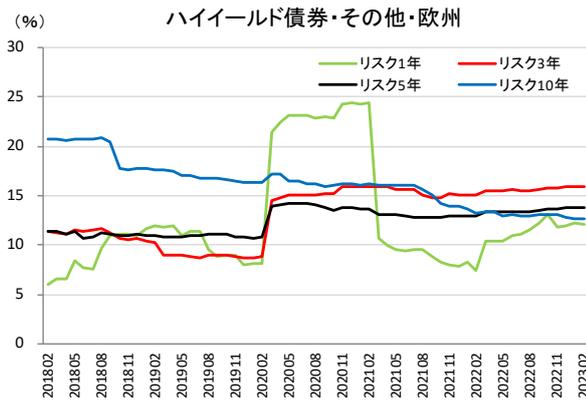
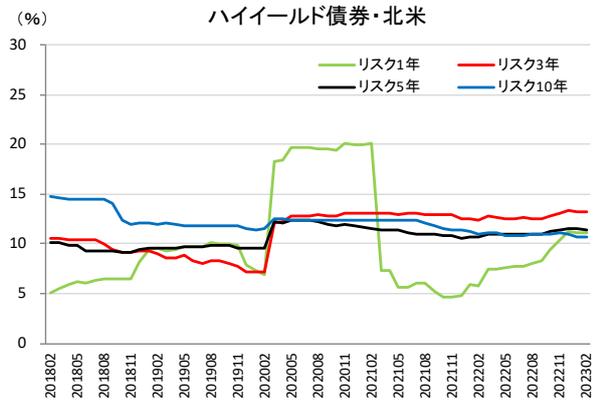
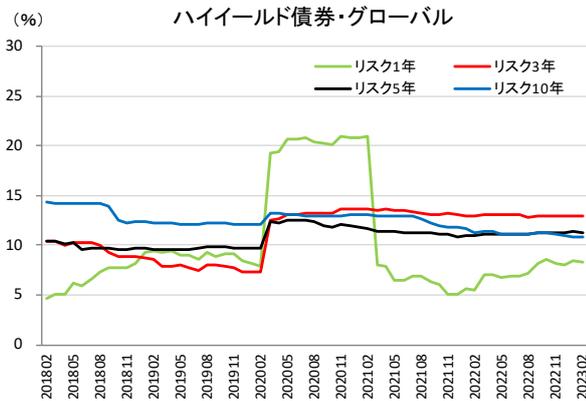
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

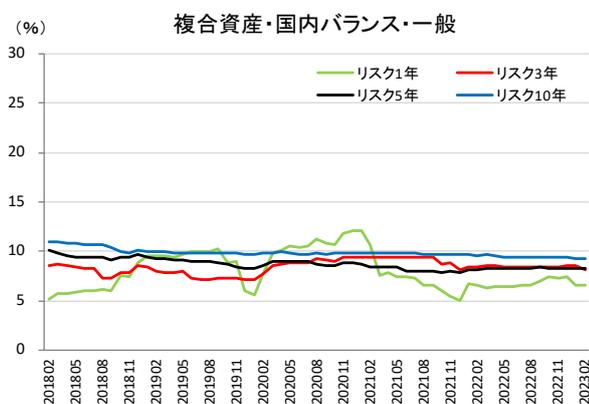
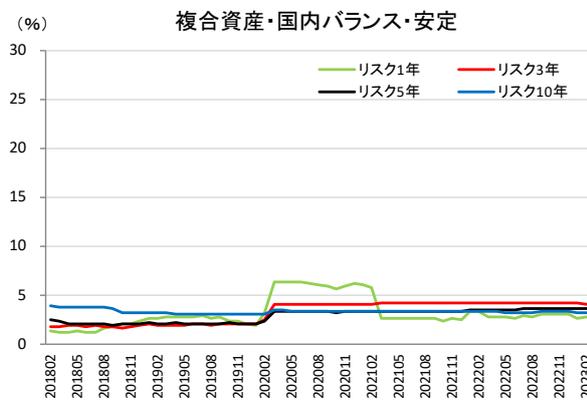
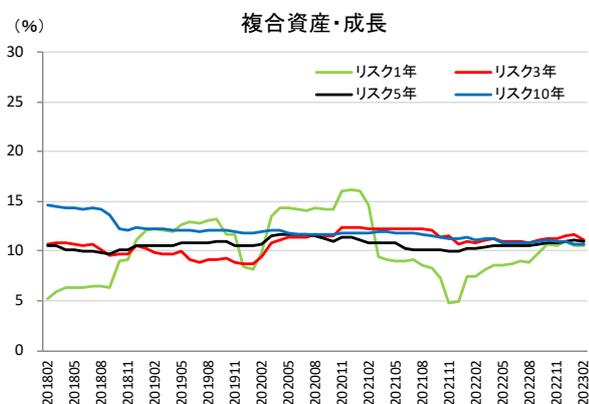
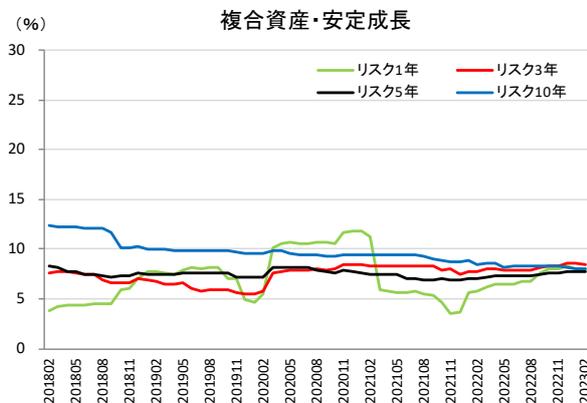
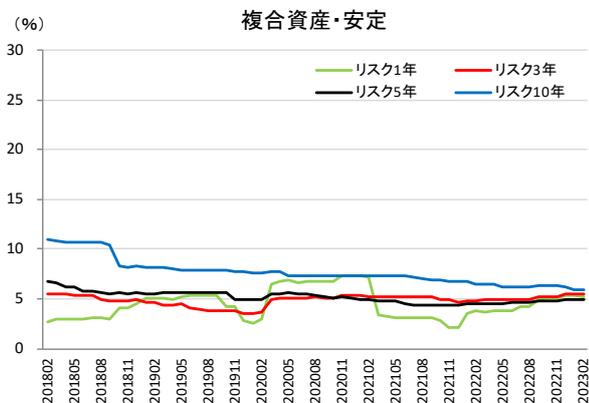


<2>リスク・サマリー

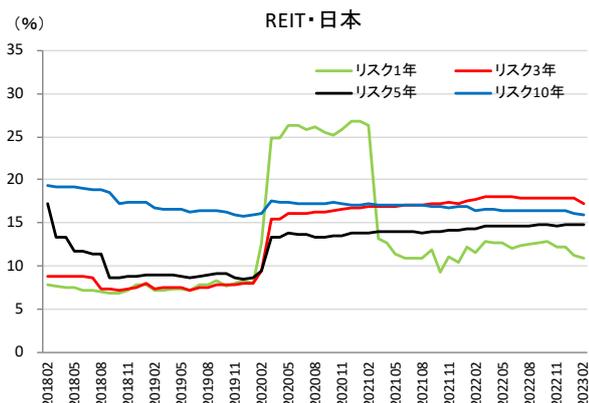
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

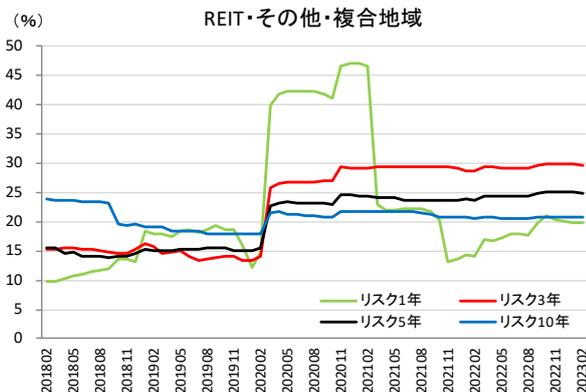
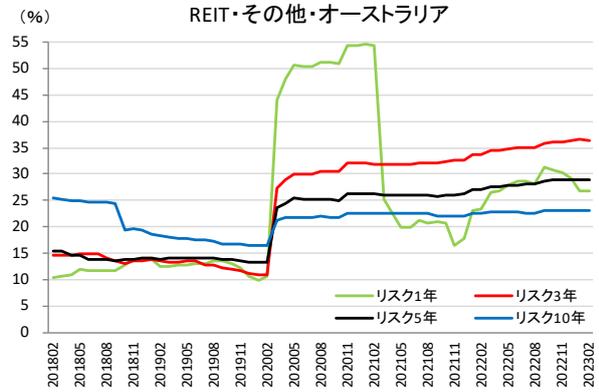
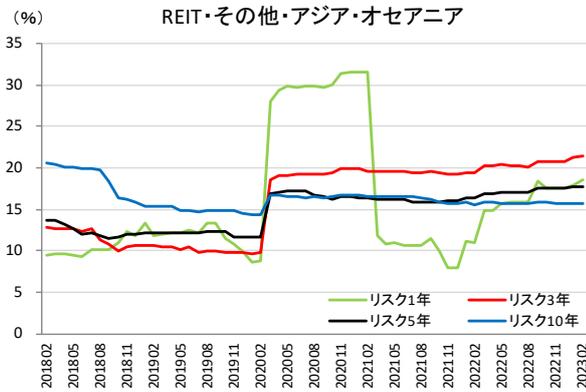
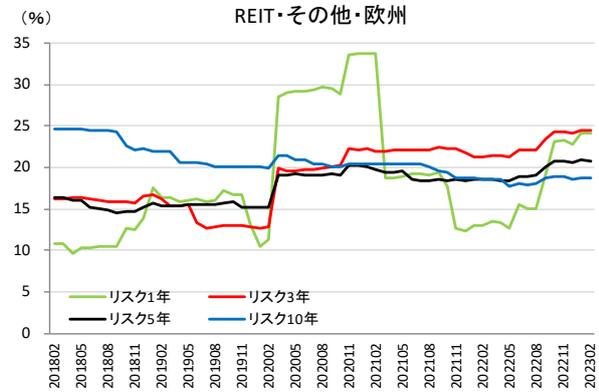
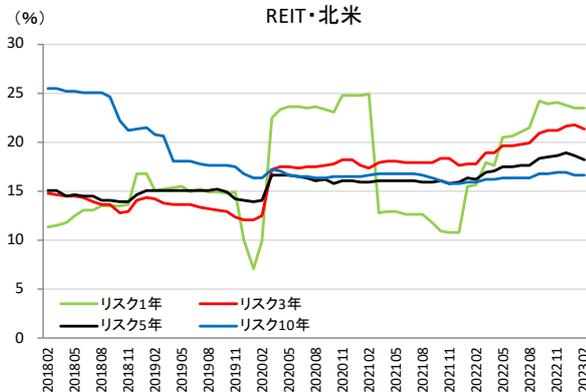
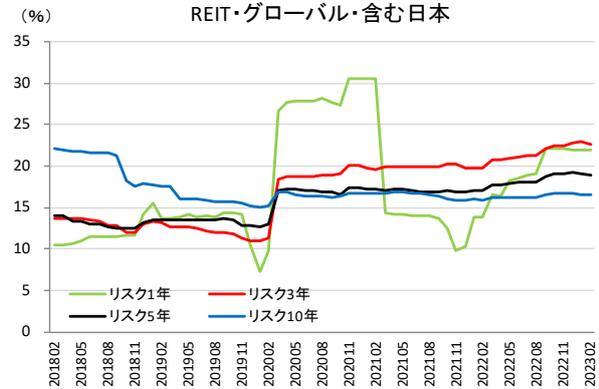
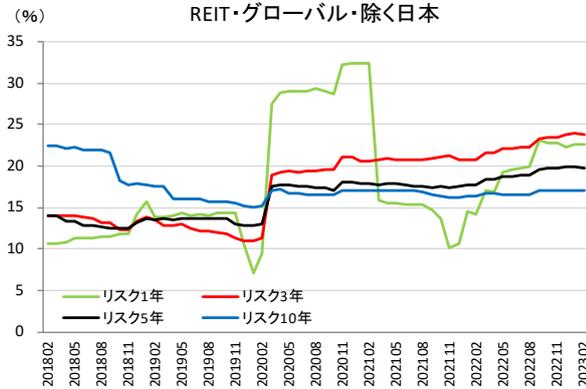


<2> リスク・サマリー

(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]

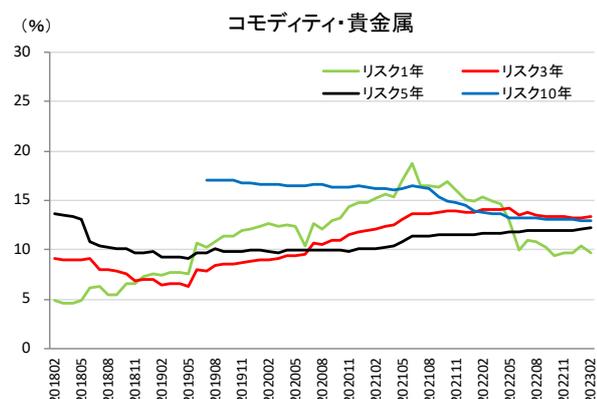
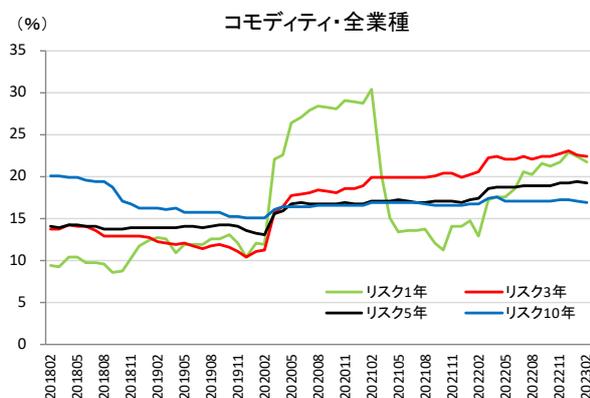
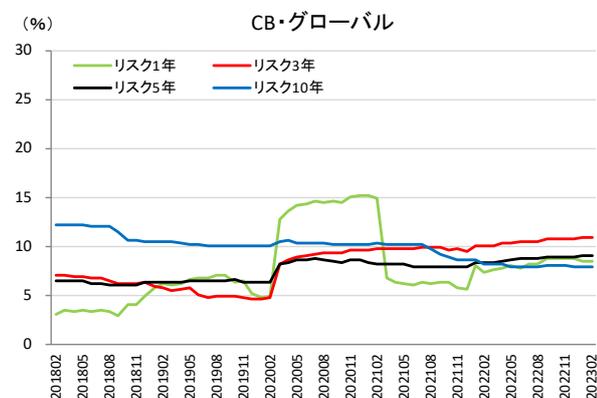
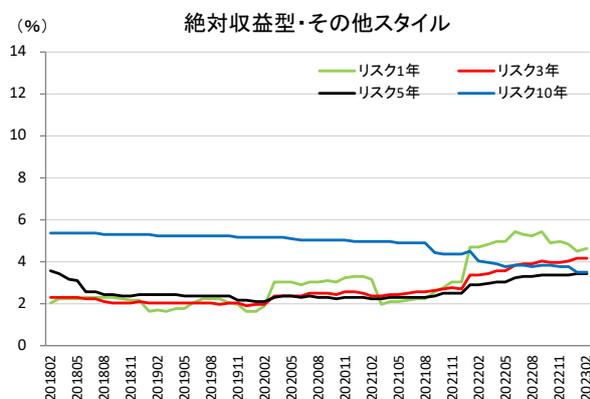
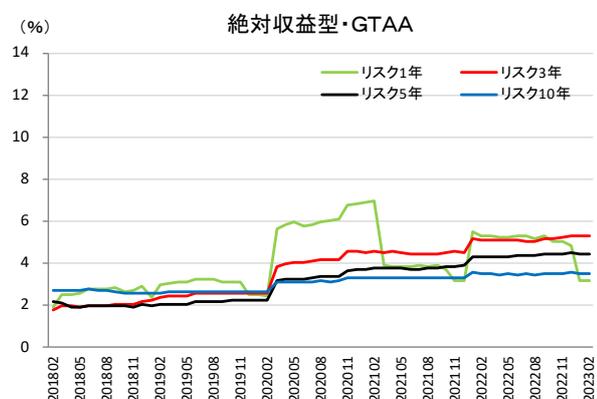
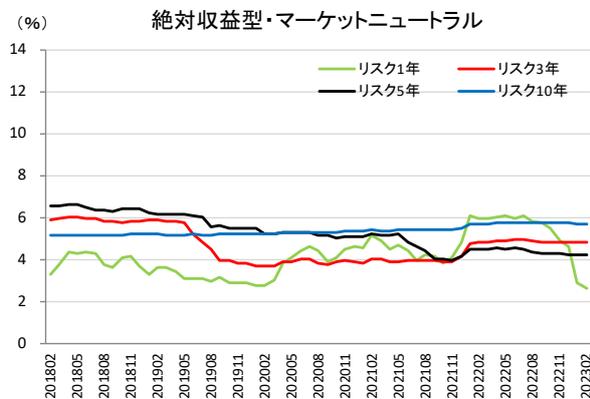
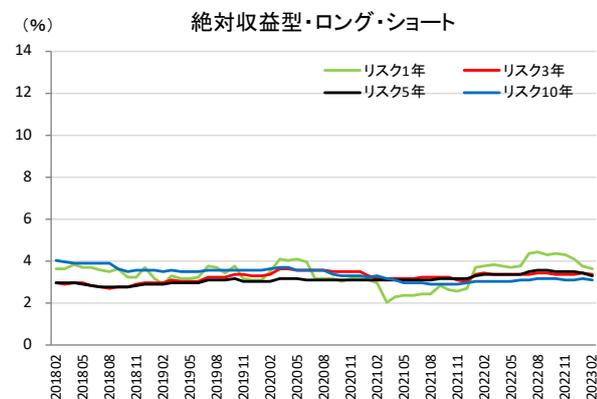


<2> リスク・サマリー

(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	4,099	19,590	40,216	78,424
国内株式	117	2,661	4,857	6,756
一般	291	980	1,988	3,573
フリー	162	561	1,361	2,650
バリュー	129	419	628	923
小型	30	85	92	208
その他	-219	1,566	2,752	2,950
日経225	-229	1,192	2,002	1,827
TOPIX	-36	204	477	651
JPX日経400	-5	22	24	31
国内債券	-458	-607	259	2,253
一般	-458	-607	259	2,253
外国株式(先進国)	1,383	8,035	19,123	42,860
グローバル	679	3,769	8,607	20,100
除く日本	356	2,052	4,514	9,580
含む日本	323	1,717	4,093	10,520
その他	704	4,266	10,516	22,760
北米	46	244	686	718
米国	727	4,174	10,098	22,762
カナダ	-1	-4	-11	-30
欧州	-19	-47	-87	-158
ドイツ	-1	-1	-1	-2
イギリス	0	0	0	0
アジア・オセアニア	0	-2	-1	-3
オーストラリア	-49	-98	-170	-555
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	0	1	3	30
エマージング株式	474	1,284	1,378	776
グローバル	54	197	258	441
BRICS	-2	-9	-19	-56
その他	423	1,096	1,138	391
欧州	0	0	0	0
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	1	27	-105	-509
中国	-2	-48	-167	-361
インド	362	909	1,197	1,132
インドネシア	8	18	21	8
タイ	0	-2	-4	-5
フィリピン	0	0	0	-6
ベトナム	65	209	256	258
韓国	-4	-4	-4	-4
香港	0	-1	1	1
中南米	0	-1	-4	-9
ブラジル	-1	1	-34	-92
メキシコ	0	-1	-3	-5
中東・アフリカ	-1	-4	-6	-4
トルコ	-4	-6	-9	-12
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	4,099	19,590	40,216	78,424
外国債券(先進国)	1,384	3,731	3,977	5,887
グローバル	1,125	3,174	3,380	6,202
除く日本	498	820	160	961
含む日本	627	2,355	3,220	5,240
その他	259	557	597	-315
北米	1	2	1	-4
米国	318	738	1,071	1,090
カナダ	-5	-17	-60	-172
欧州	-6	-13	-17	-73
イギリス	0	-1	-1	-3
アジア・オセアニア	-2	-8	-47	-167
オーストラリア	-40	-128	-313	-882
ニュージーランド	-1	-1	-3	-12
複合地域	-5	-15	-34	-92
エマージング債券	6	-2	-257	-676
グローバル	5	31	-28	54
米ドル建て	-55	-45	-102	-55
現地通貨建て	61	76	75	109
その他	1	-33	-229	-729
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-1	-4	-11	-29
インド	10	18	-25	-194
インドネシア	0	-2	-7	-32
ブラジル	-10	-33	-150	-382
メキシコ	-2	-11	-24	-67
トルコ	-1	-2	-2	-4
複合地域	0	-1	-1	-3
ハイイールド債券	222	622	1,205	1,153
グローバル	-5	-25	30	-11
北米	235	673	1,247	1,366
その他	-8	-26	-72	-202
欧州	-16	-45	-90	-200
アジア・オセアニア	7	20	19	0
複合地域	0	0	-1	-2
複合資産	385	1,726	4,660	9,608
安定	-74	-151	314	968
安定成長	221	990	2,307	4,937
成長	345	1,126	2,384	4,636
国内バランス	-123	-307	-419	-825
安定	-151	-392	-665	-1,151
一般	-1	-3	-8	-16
その他	17	67	74	-109

## &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	4,099	19,590	40,216	78,424
国内REIT	181	754	2,093	4,306
日本	181	754	2,093	4,306
外国REIT	146	577	1,346	1,610
グローバル	-67	-99	-71	-411
除く日本	71	144	170	198
含む日本	-137	-243	-241	-608
北米	206	663	1,420	2,270
その他	7	14	-3	-250
欧州	0	-2	-4	-10
アジア・オセアニア	14	35	34	-134
オーストラリア	-5	-15	-25	-79
複合地域	-1	0	0	-3
複数国	-1	-4	-8	-24
その他	258	810	1,576	3,893
絶対収益型	55	212	494	1,581
ロング・ショート	-7	-13	-18	3
マーケットニュートラル	-11	-36	-50	-120
GTAA	-1	-13	-21	7
その他スタイル	73	271	574	1,679
CB	147	291	296	1,058
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-2
日本	0	-2	-3	-5
グローバル	148	294	301	1,066
コモディティ	84	148	354	340
全業種	15	27	-6	-318
貴金属	69	121	372	701
エネルギー	-1	-2	-14	-43
その他コモディティ	1	1	1	-1

## &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	876,110	100.00	5,369	100.00
国内株式	109,230	12.47	830	15.46
一般	59,933	6.84	531	9.89
フリー	46,556	5.31	434	8.08
バリュー	13,376	1.53	97	1.81
小型	6,788	0.77	91	1.69
その他	41,829	4.77	202	3.76
日経225	21,749	2.48	69	1.29
TOPIX	16,609	1.90	80	1.49
JPX日経400	764	0.09	15	0.28
国内債券	41,964	4.79	143	2.66
一般	41,964	4.79	143	2.66
外国株式(先進国)	361,552	41.27	1,156	21.53
グローバル	246,832	28.17	805	14.99
除く日本	70,781	8.08	189	3.52
含む日本	176,050	20.09	616	11.47
その他	114,720	13.09	351	6.54
北米	922	0.11	11	0.20
米国	108,937	12.43	264	4.92
カナダ	154	0.02	2	0.04
欧州	1,627	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	40	0.00	2	0.04
オーストラリア	2,963	0.34	23	0.43
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	40	0.00	1	0.02
エマージング株式	27,559	3.15	309	5.76
グローバル	9,264	1.06	92	1.71
BRICS	441	0.05	7	0.13
その他	17,855	2.04	210	3.91
欧州	62	0.01	6	0.11
ロシア	10	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,531	0.52	87	1.62
中国	1,934	0.22	32	0.60
インド	9,171	1.05	31	0.58
インドネシア	161	0.02	4	0.07
タイ	11	0.00	2	0.04
フィリピン	29	0.00	4	0.07
ベトナム	1,224	0.14	13	0.24
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	15	0.00	1	0.02
中南米	58	0.01	2	0.04
ブラジル	470	0.05	13	0.24
メキシコ	7	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	97	0.01	5	0.09
トルコ	57	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	876,110	100.00	5,369	100.00
外国債券(先進国)	82,252	9.39	768	14.30
グローバル	66,715	7.61	529	9.85
除く日本	30,034	3.43	228	4.25
含む日本	36,681	4.19	301	5.61
その他	15,537	1.77	239	4.45
北米	68	0.01	6	0.11
米国	5,911	0.67	131	2.44
カナダ	706	0.08	4	0.07
欧州	967	0.11	31	0.58
イギリス	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,519	0.17	9	0.17
オーストラリア	5,236	0.60	36	0.67
ニュージーランド	71	0.01	9	0.17
複合地域	1,050	0.12	8	0.15
エマージング債券	10,590	1.21	260	4.84
グローバル	6,009	0.69	185	3.45
米ドル建て	4,376	0.50	142	2.64
現地通貨建て	1,633	0.19	43	0.80
その他	4,581	0.52	75	1.40
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	2,118	0.24	16	0.30
インドネシア	289	0.03	7	0.13
ブラジル	1,441	0.16	21	0.39
メキシコ	252	0.03	5	0.09
トルコ	61	0.01	4	0.07
複合地域	32	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	17,393	1.99	246	4.58
グローバル	2,593	0.30	37	0.69
北米	12,870	1.47	147	2.74
その他	1,931	0.22	62	1.15
欧州	1,482	0.17	40	0.75
アジア・オセアニア	413	0.05	21	0.39
複合地域	36	0.00	1	0.02
複合資産	131,308	14.99	1,019	18.98
安定	37,650	4.30	276	5.14
安定成長	58,073	6.63	426	7.93
成長	25,435	2.90	269	5.01
国内バランス	7,214	0.82	32	0.60
安定	6,472	0.74	9	0.17
一般	288	0.03	18	0.34
その他	2,936	0.34	16	0.30

## &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③

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	876,110	100.00	5,369	100.00
国内REIT	27,485	3.14	135	2.51
日本	27,485	3.14	135	2.51
外国REIT	43,768	5.00	277	5.16
グローバル	17,270	1.97	151	2.81
除く日本	5,787	0.66	65	1.21
含む日本	11,483	1.31	86	1.60
北米	23,442	2.68	74	1.38
その他	3,056	0.35	52	0.97
欧州	119	0.01	10	0.19
アジア・オセアニア	2,117	0.24	26	0.48
オーストラリア	517	0.06	12	0.22
複合地域	56	0.01	3	0.06
複数国	246	0.03	1	0.02
その他	23,009	2.63	226	4.21
絶対収益型	11,737	1.34	100	1.86
ロング・ショート	812	0.09	34	0.63
マーケットニュートラル	497	0.06	13	0.24
GTAA	412	0.05	13	0.24
その他スタイル	9,928	1.13	39	0.73
CB	2,091	0.24	31	0.58
アジア・オセアニア	33	0.00	1	0.02
日本	24	0.00	1	0.02
グローバル	2,034	0.23	29	0.54
コモディティ	4,908	0.56	35	0.65
全業種	1,581	0.18	13	0.24
貴金属	3,241	0.37	20	0.37
エネルギー	67	0.01	1	0.02
その他コモディティ	19	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	13,107	10.0	2.11	2.22	1.155
国内株式	17,671	13.7	0.69	0.65	1.037
一般	16,431	13.3	0.92	0.87	1.387
フリー	15,884	12.6	0.90	0.86	1.430
バリュー	18,875	16.7	1.00	0.93	1.237
小型	23,066	14.2	0.56	0.53	1.705
その他	18,547	14.1	0.36	0.35	0.416
日経225	19,228	15.6	0.41	0.40	0.481
TOPIX	19,624	15.0	0.14	0.13	0.257
JPX日経400	17,498	8.5	0.06	0.05	0.501
国内債券	10,394	11.8	0.15	0.16	0.440
一般	10,394	11.8	0.15	0.16	0.440
外国株式(先進国)	15,397	7.6	1.83	1.86	1.268
グローバル	15,830	7.4	1.62	1.59	1.345
除く日本	22,603	10.3	0.48	0.47	0.595
含む日本	13,752	6.5	2.09	2.05	1.646
その他	14,402	7.9	2.27	2.43	1.103
北米	15,402	7.4	9.77	10.09	1.614
米国	14,921	7.1	2.06	2.23	1.070
カナダ	6,119	11.9	6.92	7.28	1.989
欧州	14,096	12.4	1.61	1.56	1.578
ドイツ	14,516	8.9	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,563	6.6	9.22	9.21	1.793
アジア・オセアニア	9,769	13.2	2.70	2.67	1.636
オーストラリア	10,541	8.1	9.18	9.04	1.822
ニュージーランド	17,590	10.6	1.22	1.14	1.672
複合地域	11,583	9.8	14.19	12.09	1.705
エマージング株式	13,217	10.7	2.36	2.41	1.638
グローバル	12,857	8.3	0.34	0.34	1.057
BRICS	13,803	16.8	0.86	0.93	2.065
その他	13,355	11.5	3.46	3.54	1.929
欧州	5,953	16.7	0.19	0.16	1.961
ロシア	2,345	13.8	0.00	0.00	1.267
アジア・オセアニア	14,423	12.5	2.56	2.72	1.692
中国	14,744	8.6	0.48	0.51	1.941
インド	15,232	11.9	4.94	4.96	2.047
インドネシア	12,984	12.9	4.03	3.56	1.834
タイ	13,526	10.9	1.72	1.60	1.818
フィリピン	10,958	10.5	0.65	0.65	1.730
ベトナム	13,954	5.6	0.95	1.21	1.907
韓国	11,855	4.2	0.00	0.00	1.804
香港	13,890	13.5	1.71	1.66	0.858
中南米	9,320	16.1	0.00	0.00	2.042
ブラジル	5,326	12.0	3.76	4.24	1.950
メキシコ	12,156	9.9	0.00	0.00	1.667
中東・アフリカ	12,519	11.6	0.32	0.36	2.083
トルコ	12,598	21.6	0.00	0.00	2.029
複合地域	21,416	14.8	1.71	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	13,107	10.0	2.11	2.22	1.155
外国債券(先進国)	9,723	10.4	1.45	1.52	0.988
グローバル	10,153	10.3	1.10	1.15	0.924
除く日本	11,110	12.6	0.99	1.02	0.700
含む日本	9,427	8.6	1.20	1.27	1.107
その他	8,773	10.6	2.88	3.05	1.263
北米	9,773	8.8	2.29	2.45	1.772
米国	9,587	9.0	3.21	3.62	1.246
カナダ	7,046	12.1	1.69	1.63	1.378
欧州	7,117	12.9	1.69	1.77	1.156
イギリス	7,068	7.8	3.89	4.19	1.307
アジア・オセアニア	8,803	12.9	2.59	2.54	1.423
オーストラリア	8,295	14.2	3.09	3.12	1.244
ニュージーランド	8,768	8.7	1.58	1.63	1.358
複合地域	5,172	12.8	2.47	2.51	1.196
エマージング債券	8,584	11.2	4.47	4.35	1.467
グローバル	8,666	11.6	3.19	3.21	1.350
米ドル建て	8,550	12.1	3.46	3.49	1.485
現地通貨建て	9,046	9.9	2.42	2.41	0.989
その他	8,383	10.1	6.15	5.84	1.620
ロシア	911	10.0	0.00	0.00	1.596
アジア・オセアニア	9,322	12.2	6.77	6.92	1.629
インド	9,433	8.5	6.84	6.91	1.703
インドネシア	9,142	10.3	5.92	5.55	1.672
ブラジル	8,914	13.5	5.44	4.72	1.581
メキシコ	7,651	10.0	6.32	5.07	1.381
トルコ	2,156	10.0	7.00	5.47	1.460
複合地域	3,705	16.5	2.31	2.02	1.210
ハイイールド債券	9,128	11.9	5.69	5.54	1.667
グローバル	7,594	10.8	3.63	3.52	1.481
北米	10,370	12.8	5.75	5.56	1.690
その他	7,099	10.4	8.04	8.17	1.768
欧州	7,317	9.9	7.46	7.45	1.739
アジア・オセアニア	6,815	10.9	10.33	10.98	1.866
複合地域	4,371	18.9	5.52	5.49	1.800
複合資産	12,594	9.4	1.06	1.13	0.964
安定	11,072	9.3	0.94	0.97	1.087
安定成長	12,319	9.8	1.38	1.48	0.974
成長	14,987	9.1	0.16	0.15	0.790
国内バランス	11,438	9.7	2.13	2.27	0.943
安定	10,423	11.6	2.27	2.43	0.917
一般	11,919	9.7	0.97	0.95	1.285
その他	8,272	3.0	1.32	1.73	0.758

(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	13,107	10.0	2.11	2.22	1.155
国内REIT	13,724	10.0	9.45	11.01	0.925
日本	13,724	10.0	9.45	11.01	0.925
外国REIT	12,011	9.0	8.38	9.16	1.486
グローバル	13,182	8.8	3.56	3.77	1.256
除く日本	14,549	6.9	2.24	2.49	0.926
含む日本	12,149	10.2	4.23	4.42	1.422
北米	11,270	9.6	12.09	13.32	1.621
その他	9,665	8.7	7.23	7.67	1.753
欧州	6,443	9.1	4.49	5.15	1.817
アジア・オセアニア	11,199	8.1	8.83	9.38	1.800
オーストラリア	9,527	8.4	4.42	4.63	1.703
複合地域	7,192	11.1	0.85	0.92	0.781
複数国	11,069	18.8	2.15	2.17	1.650
その他					
絶対収益型	10,152	5.9	0.04	0.04	1.907
ロング・ショート	10,021	4.9	0.30	0.29	1.458
マーケットニュートラル	9,663	5.4	0.33	0.34	1.287
GTAA	10,811	9.2	0.02	0.02	1.490
その他スタイル	10,148	5.9	0.00	0.00	1.997
CB	12,076	9.4	0.76	0.82	1.213
アジア・オセアニア	9,932	12.7	2.44	2.42	1.823
日本	13,392	23.3	0.37	0.37	0.770
グローバル	12,104	8.8	0.71	0.77	1.208
コモディティ	11,598	7.1	0.53	0.55	0.922
全業種	9,982	10.7	1.63	1.70	1.297
貴金属	12,107	4.5	0.00	0.00	0.738
エネルギー	17,244	14.0	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	16,794	6.4	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