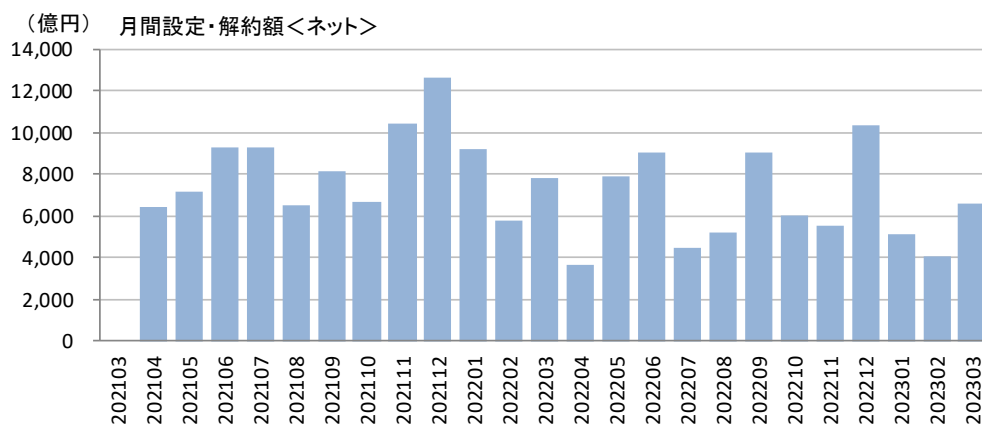
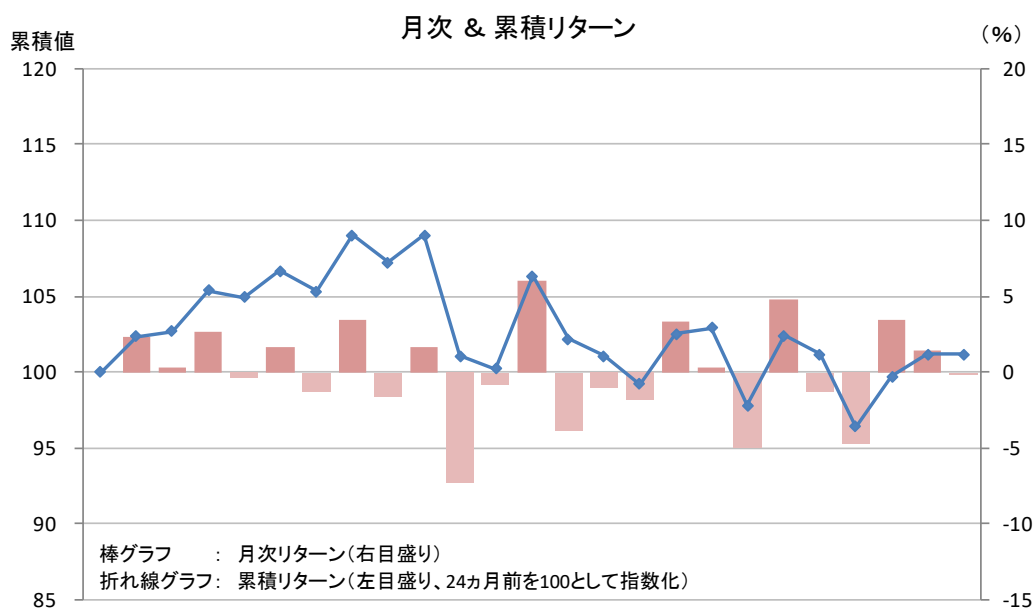


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2023年3月

「総合」 -0.04%
(前月 $+1.46\%$)



MAB-FPI について

MAB-FPI とは日本の公募追加型株式投資信託全体の動向を表す指数で、弊社が独自に開発したものです。
(FPI は Fund Performance Index の略)

■主な特徴

- ・国内籍の公募追加型株式投資信託をユニバースとします（但し、ETF は除く）。
- ・月末に翌月の採用ファンドを選定します（月次リバランス）。
- ・総合および各カテゴリー別の日次収益率は、個々の投資信託の日次収益率を前日の純資産額によって加重した平均値として計算します。
- ・指数は算出開始時点（原則、1997 年 3 月 31 日）を 10,000（単位：ポイント）とし、各カテゴリーの日次収益率を乗じて算出します。
- ・カテゴリーは全体を表す「総合」のほかファンド分類別（大分類、中分類、小分類）、各種区分別（ヘッジ種別、アクティブ/パッシブ別、他）など、様々なサブ・カテゴリー指数を算出します。

詳細については『MAB 投信指数「MAB-FPI」算出要領』をご参照下さい。

■本レポートの内容

掲載対象カテゴリー：「総合」

|--- ファンド分類別「大分類」
|--- " 「中分類」
|--- " 「小分類」

なお、「中分類」と「小分類」の掲載対象は原則、直近 5 年以上指数算出が可能なカテゴリーからの抜粋

＜1＞パフォーマンス・サマリー	
(1) 当月リターン	・ ・ ・ ・ ・ P. 3
(2) 期間別リターン	・ ・ ・ ・ ・ P. 6
(3) リターン推移	・ ・ ・ ・ ・ P. 9
(4) 対「総合」寄与度分析	・ ・ ・ ・ ・ P. 20
＜2＞リスク・サマリー	・ ・ ・ ・ ・ P. 22
＜3＞設定・解約額 [ネット金額]	・ ・ ・ ・ ・ P. 35
＜4＞純資産額、ファンド本数	・ ・ ・ ・ ・ P. 38
＜5＞属性、指標等	・ ・ ・ ・ ・ P. 41

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別①

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)	
総合		15,543	15,550	-6	-0.04	
国内株式		20,354	20,003	351	1.76	
一般		19,780	19,515	266	1.36	
フリー		18,453	18,188	265	1.45	
バリュー		26,064	25,797	267	1.04	
小型		40,583	40,099	485	1.21	
その他		20,239	19,763	476	2.41	
日経225		19,322	18,746	577	3.08	
TOPIX		20,143	19,810	333	1.68	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	19,019	18,711	308	1.65	
国内債券		12,615	12,446	169	1.36	
一般		12,615	12,446	169	1.36	
外国株式(先進国)		20,445	20,435	10	0.05	
グローバル		22,242	22,283	-41	-0.18	
除く日本		35,148	35,347	-198	-0.56	
含む日本		19,485	19,491	-6	-0.03	
その他		16,697	16,605	91	0.55	
北米		21,054	21,390	-336	-1.57	
米国		25,874	25,690	185	0.72	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	20,610	21,443	-833	-3.89	
欧州		24,273	24,424	-152	-0.62	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	12,180	11,988	192	1.61	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	10,769	11,154	-385	-3.45	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	39,250	39,079	170	0.44	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	19,359	20,183	-825	-4.09	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	46,717	46,643	74	0.16	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	13,273	14,199	-927	-6.53	
エマージング株式		17,932	18,175	-243	-1.34	
グローバル		18,196	18,240	-44	-0.24	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	22,382	22,810	-428	-1.87	
その他		18,523	18,878	-355	-1.88	
欧州		11,861	12,033	-172	-1.43	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,068	1,348	-280	-20.78	
アジア・オセアニア		18,017	18,046	-29	-0.16	
中国		39,993	40,732	-739	-1.81	
インド	10,000 (2004.09.30)	45,874	47,379	-1,505	-3.18	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	16,615	16,909	-294	-1.74	
タイ		23,975	23,723	252	1.06	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,822	7,711	110	1.43	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	20,336	19,977	359	1.80	
韓国	10,000 (1997.06.30)	27,760	26,355	1,405	5.33	
香港		21,903	21,937	-33	-0.15	
中南米	7,427 (2006.04.28)	9,994	10,202	-208	-2.04	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	8,243	8,453	-210	-2.48	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	15,027	14,731	296	2.01	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	12,494	12,474	20	0.16	
トルコ		35,970	38,020	-2,050	-5.39	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	24,683	24,939	-256	-1.03	

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

[色塗りの基準]月次リターン> 総合

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別②

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)	
総合		15,543	15,550	-6	-0.04	
外国債券(先進国)		18,056	18,017	39	0.21	
グローバル		18,062	18,015	48	0.26	
除く日本		19,721	19,532	188	0.96	
含む日本		17,008	17,061	-53	-0.31	
その他		18,243	18,243	0	0.00	
北米	9,052 (2013.05.31)	10,250	10,335	-85	-0.82	
米国		16,995	16,996	-2	-0.01	
カナダ	10,000 (2003.05.30)	16,033	16,025	7	0.05	
欧州	10,000 (1998.07.31)	13,672	13,639	34	0.25	
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,224	10,114	110	1.09	
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	20,498	20,501	-2	-0.01	
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	25,312	25,371	-58	-0.23	
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,125	10,910	215	1.97	
複合地域	10,000 (2001.11.30)	17,926	17,761	166	0.93	
エマージング債券		18,193	18,226	-33	-0.18	
グローバル		18,272	18,375	-103	-0.56	
米ドル建て		18,467	18,705	-238	-1.27	
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	13,461	13,280	180	1.36	
その他	8,647 (2005.03.31)	14,612	14,566	46	0.32	
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,167	1,230	-62	-5.05	
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	15,142	15,252	-110	-0.72	
インド	10,000 (2011.08.31)	19,155	19,298	-143	-0.74	
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	17,919	17,984	-65	-0.36	
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	13,718	13,385	333	2.49	
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	17,180	16,958	222	1.31	
トルコ	10,000 (2011.04.28)	3,678	4,030	-352	-8.74	
複合地域	10,000 (2006.08.31)	10,887	10,736	151	1.41	
ハイイールド債券		25,074	25,522	-447	-1.75	
グローバル	10,000 (1997.06.30)	23,658	23,967	-309	-1.29	
北米		25,319	25,771	-452	-1.75	
その他	10,000 (2004.03.31)	22,724	23,275	-552	-2.37	
欧州	10,000 (2006.04.28)	23,053	23,576	-523	-2.22	
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,014	14,447	-433	-2.99	
複合地域	10,000 (2004.03.31)	22,183	22,481	-298	-1.33	
複合資産		18,667	18,602	65	0.35	
安定	10,000 (1998.10.30)	15,623	15,612	11	0.07	
安定成長		20,619	20,539	80	0.39	
成長		25,426	25,396	30	0.12	
国内バランス		12,352	12,250	102	0.83	
安定		12,531	12,422	109	0.88	
一般		16,042	15,958	84	0.53	
その他	10,000 (2018.10.31)	11,728	11,300	428	3.79	

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

[色塗りの基準]月次リターン> 総合

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別③

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)	
総合		15,543	15,550	-6	-0.04	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	33,056	34,029	-973	-2.86	
日本	10,000 (2003.10.31)	33,056	34,029	-973	-2.86	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	31,278	33,368	-2,090	-6.26	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	25,902	27,733	-1,832	-6.60	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	28,958	31,216	-2,258	-7.23	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	25,706	27,430	-1,724	-6.29	
北米	10,000 (2003.09.30)	32,970	35,151	-2,181	-6.20	
その他	10,000 (2004.04.30)	28,763	30,219	-1,456	-4.82	
欧州	10,000 (2006.12.29)	4,766	5,186	-420	-8.10	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	21,464	22,314	-850	-3.81	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	15,714	17,037	-1,322	-7.76	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,133	7,490	-357	-4.77	
複数国	10,000 (2004.04.30)	41,920	44,485	-2,565	-5.77	
その他		6,326	6,180	146	2.37	
絶対収益型		7,392	7,418	-26	-0.35	
ロング・ショート		8,205	8,175	31	0.37	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,203	11,196	8	0.07	
GTAA		11,392	11,346	46	0.40	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	6,930	6,960	-30	-0.44	
CB		19,531	19,795	-264	-1.34	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	20,356	20,337	19	0.09	
日本		19,659	19,634	25	0.13	
グローバル		34,081	34,556	-475	-1.38	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	11,934	11,506	428	3.72	
全業種	10,000 (2004.12.30)	10,738	11,046	-309	-2.79	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	20,272	18,935	1,337	7.06	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	8,636	8,930	-294	-3.29	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	14,785	15,204	-418	-2.75	

※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	4.94	3.44	-4.85	4.94
国内株式	6.95	8.72	3.13	6.95
一般	6.55	8.32	3.07	6.55
フリー	6.52	8.06	2.29	6.52
バリュー	6.69	9.23	5.83	6.69
小型	4.75	6.59	1.57	4.75
その他	7.84	9.59	3.51	7.84
日経225	8.39	9.09	2.56	8.39
TOPIX	7.14	10.55	5.53	7.14
JPX日経400	7.15	10.94	5.27	7.15
国内債券	1.88	-0.32	-2.85	1.88
一般	1.88	-0.32	-2.85	1.88
外国株式(先進国)	7.98	5.80	-7.23	7.98
グローバル	8.18	6.70	-7.47	8.18
除く日本	6.55	7.00	-2.29	6.55
含む日本	8.84	6.60	-9.23	8.84
その他	7.54	3.88	-6.64	7.54
北米	3.74	5.87	3.56	3.74
米国	7.77	3.73	-6.80	7.77
カナダ	0.22	-2.41	-9.32	0.22
欧州	7.69	17.78	2.15	7.69
ドイツ	13.24	32.33	12.51	13.24
イギリス	0.33	8.82	2.22	0.33
アジア・オセアニア	5.43	6.97	-1.32	5.43
オーストラリア	0.85	2.09	-7.95	0.85
ニュージーランド	2.02	7.73	-1.99	2.02
複合地域	-4.10	-1.60	2.61	-4.10
エマージング株式	1.07	-1.57	-5.68	1.07
グローバル	4.53	5.05	-3.19	4.53
BRICS	-0.62	-1.85	-9.50	-0.62
その他	-0.64	-4.81	-6.89	-0.64
欧州	3.94	27.27	-1.39	3.94
ロシア	-19.10	-25.30	-63.31	-19.10
アジア・オセアニア	4.86	5.02	-4.51	4.86
中国	1.55	-0.59	-5.84	1.55
インド	-4.53	-9.94	-5.59	-4.53
インドネシア	4.78	-7.40	5.31	4.78
タイ	-0.16	6.58	5.11	-0.16
フィリピン	5.17	12.32	-4.79	5.17
ベトナム	4.84	-10.64	-22.63	4.84
韓国	8.90	17.84	-17.42	8.90
香港	2.64	8.69	1.17	2.64
中南米	3.11	0.66	-3.34	3.11
ブラジル	-2.12	-8.37	-14.89	-2.12
メキシコ	17.16	22.34	19.28	17.16
中東・アフリカ	-1.30	-8.96	-14.75	-1.30
トルコ	-7.82	40.33	71.41	-7.82
複合地域	5.51	6.21	-3.74	5.51

※[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	4.94	3.44	-4.85	4.94
外国債券(先進国)	1.73	-0.65	-3.74	1.73
グローバル	1.57	-0.44	-3.82	1.57
除く日本	2.64	-0.84	-3.55	2.64
含む日本	0.69	-0.07	-4.05	0.69
その他	2.41	-1.52	-3.46	2.41
北米	0.90	-0.99	-5.54	0.90
米国	1.57	-2.53	-3.03	1.57
カナダ	2.56	-4.63	0.06	2.56
欧州	1.21	3.46	-7.59	1.21
イギリス	5.24	8.91	-3.83	5.24
アジア・オセアニア	3.14	-0.85	-3.01	3.14
オーストラリア	3.30	-1.03	-3.02	3.30
ニュージーランド	2.23	1.98	-4.72	2.23
複合地域	2.65	-2.09	-5.46	2.65
エマージング債券	3.35	1.06	2.61	3.35
グローバル	2.59	3.38	0.22	2.59
米ドル建て	1.67	3.06	-2.05	1.67
現地通貨建て	5.12	4.17	7.02	5.12
その他	4.35	-1.75	5.43	4.35
ロシア	-2.82	-2.65	-81.64	-2.82
アジア・オセアニア	2.62	-0.33	2.98	2.62
インド	2.05	-5.46	1.84	2.05
インドネシア	6.07	-1.62	7.51	6.07
ブラジル	7.32	1.54	9.97	7.32
メキシコ	9.81	9.47	24.52	9.81
トルコ	-2.23	0.19	24.80	-2.23
複合地域	6.22	7.02	14.25	6.22
ハイイールド債券	2.52	0.53	1.22	2.52
グローバル	2.30	2.94	-0.90	2.30
北米	2.52	-0.69	2.17	2.52
その他	2.81	5.39	-0.68	2.81
欧州	2.87	6.19	-1.34	2.87
アジア・オセアニア	2.70	2.69	1.98	2.70
複合地域	2.41	2.35	-0.10	2.41
複合資産	3.05	2.17	-3.08	3.05
安定	1.77	0.48	-3.95	1.77
安定成長	3.39	2.50	-2.43	3.39
成長	4.30	4.43	-1.15	4.30
国内バランス	0.98	-0.86	-2.81	0.98
安定	0.85	-1.15	-3.07	0.85
一般	2.74	3.01	-0.52	2.74
その他	8.21	7.94	-17.93	8.21

※[色塗りの基準]期間別リターン> 総合

<1>パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別③

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来 (%)
総合	4.94	3.44	-4.85	4.94
国内REIT	-4.27	-6.30	-7.03	-4.27
日本	-4.27	-6.30	-7.03	-4.27
外国REIT	0.33	-1.45	-14.58	0.33
グローバル	0.03	-0.75	-15.88	0.03
除く日本	0.01	-0.72	-16.68	0.01
含む日本	0.05	-0.75	-15.50	0.05
北米	0.64	-2.07	-13.94	0.64
その他	-0.45	-0.68	-11.89	-0.45
欧州	-1.63	10.32	-21.01	-1.63
アジア・オセアニア	0.15	-2.09	-9.52	0.15
オーストラリア	-2.65	3.52	-18.09	-2.65
複合地域	0.16	6.06	-8.37	0.16
複数国	-0.79	-3.23	-14.08	-0.79
その他	5.15	4.19	-7.11	5.15
絶対収益型	-0.25	-1.05	-5.98	-0.25
ロング・ショート	1.34	0.04	-1.18	1.34
マーケットニュートラル	-0.77	-1.30	-2.85	-0.77
GTAA	0.63	-1.15	-2.36	0.63
その他スタイル	-0.37	-1.06	-6.77	-0.37
CB	1.92	1.97	-8.15	1.92
アジア・オセアニア	4.26	-2.85	-0.24	4.26
日本	0.85	0.39	-1.42	0.85
グローバル	1.90	2.11	-8.63	1.90
コモディティ	3.53	3.90	1.41	3.53
全業種	-4.60	-10.31	-5.67	-4.60
貴金属	7.72	12.02	3.61	7.72
エネルギー	-2.97	-6.83	-4.72	-2.97
その他コモディティ	-3.25	-7.36	-4.80	-3.25

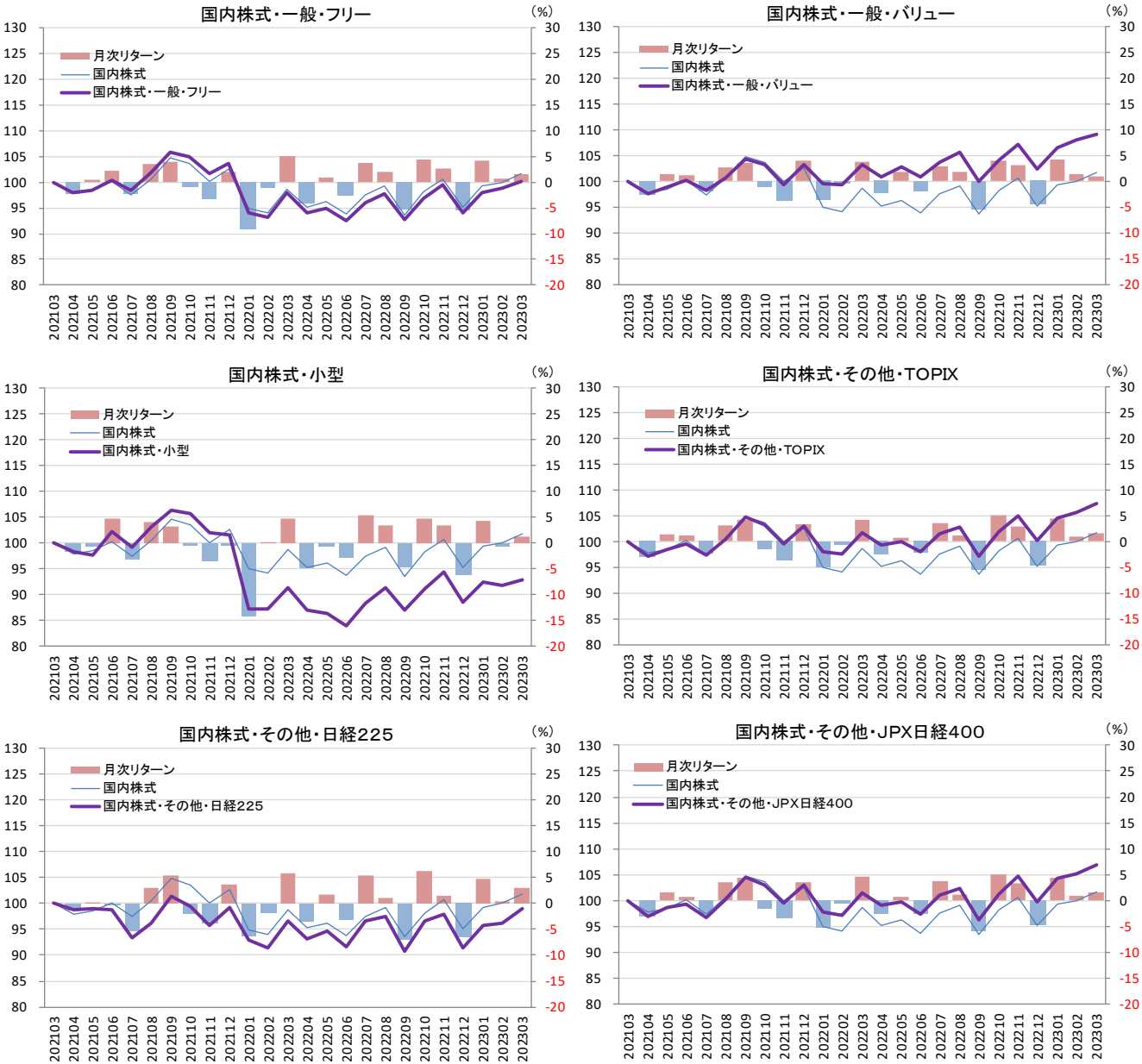
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

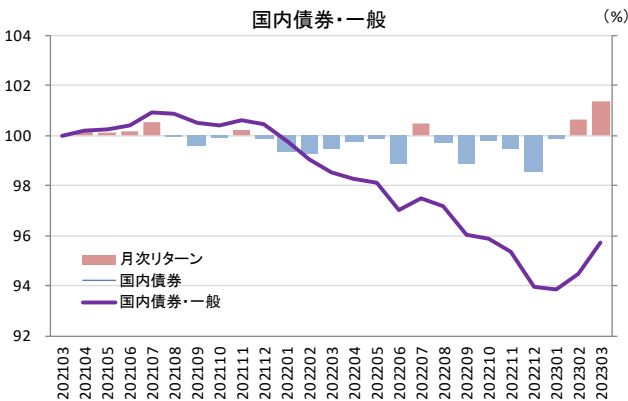
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

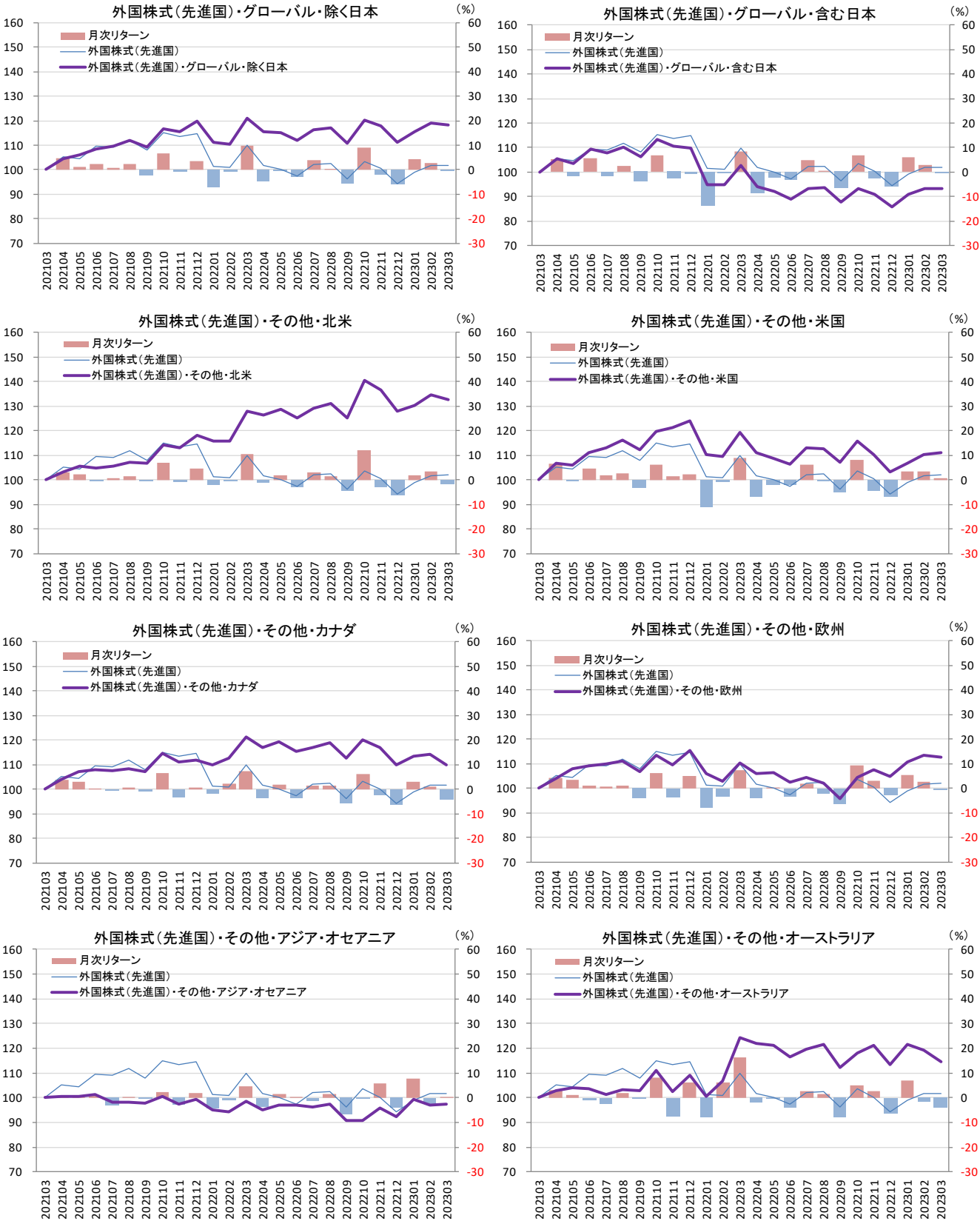


< 1 > パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]



＜1＞パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマージング株式]

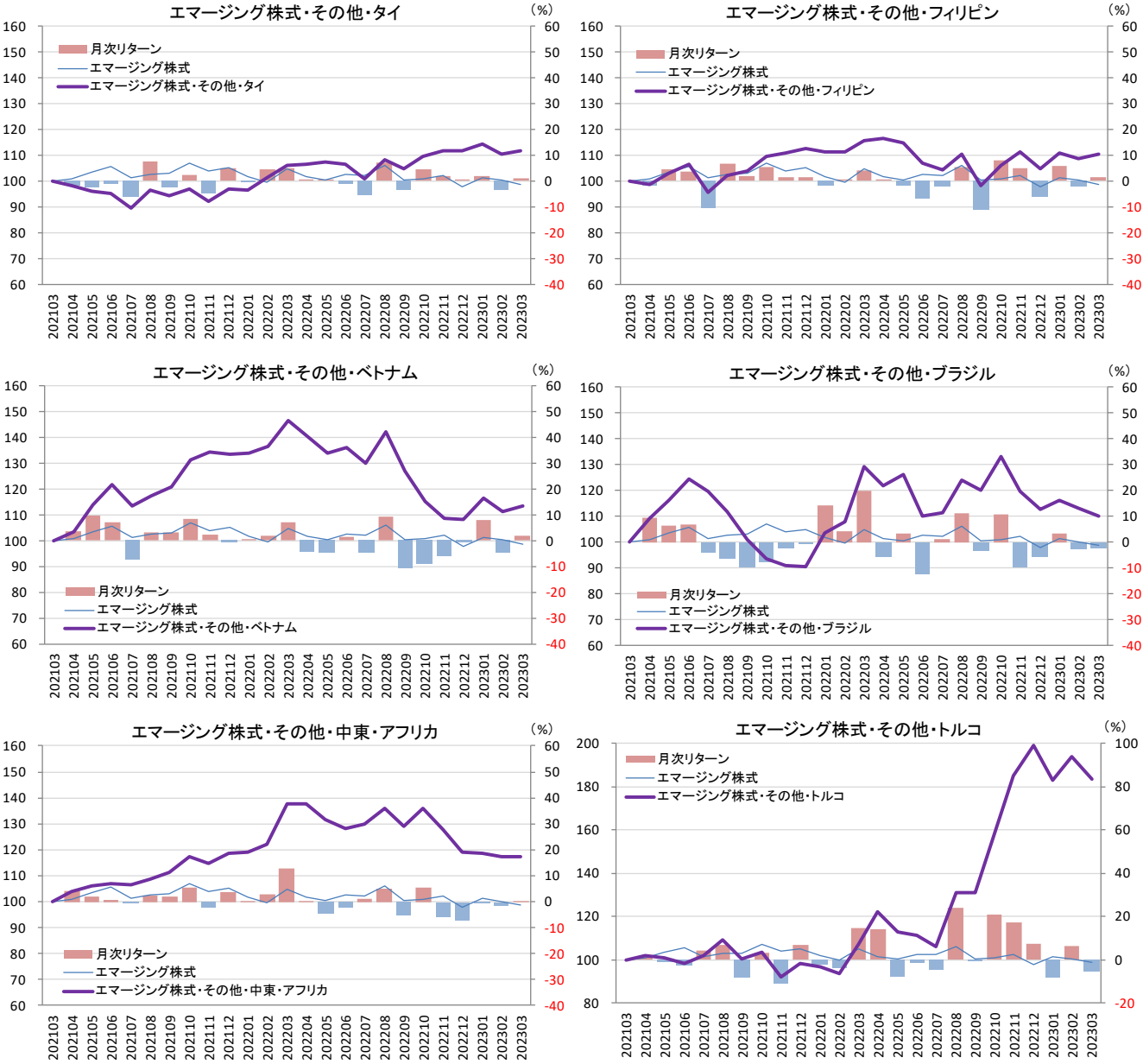


＜1＞パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

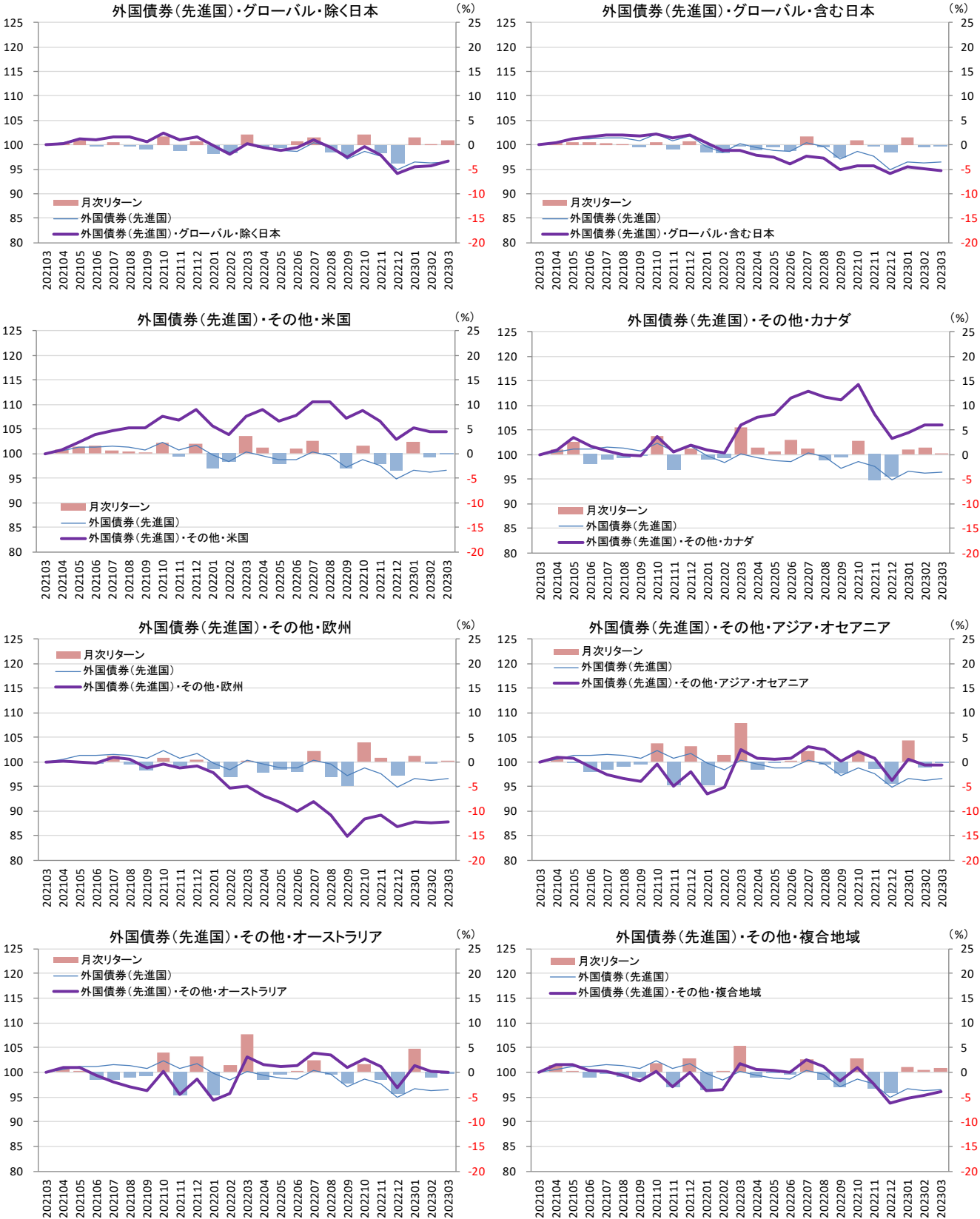


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

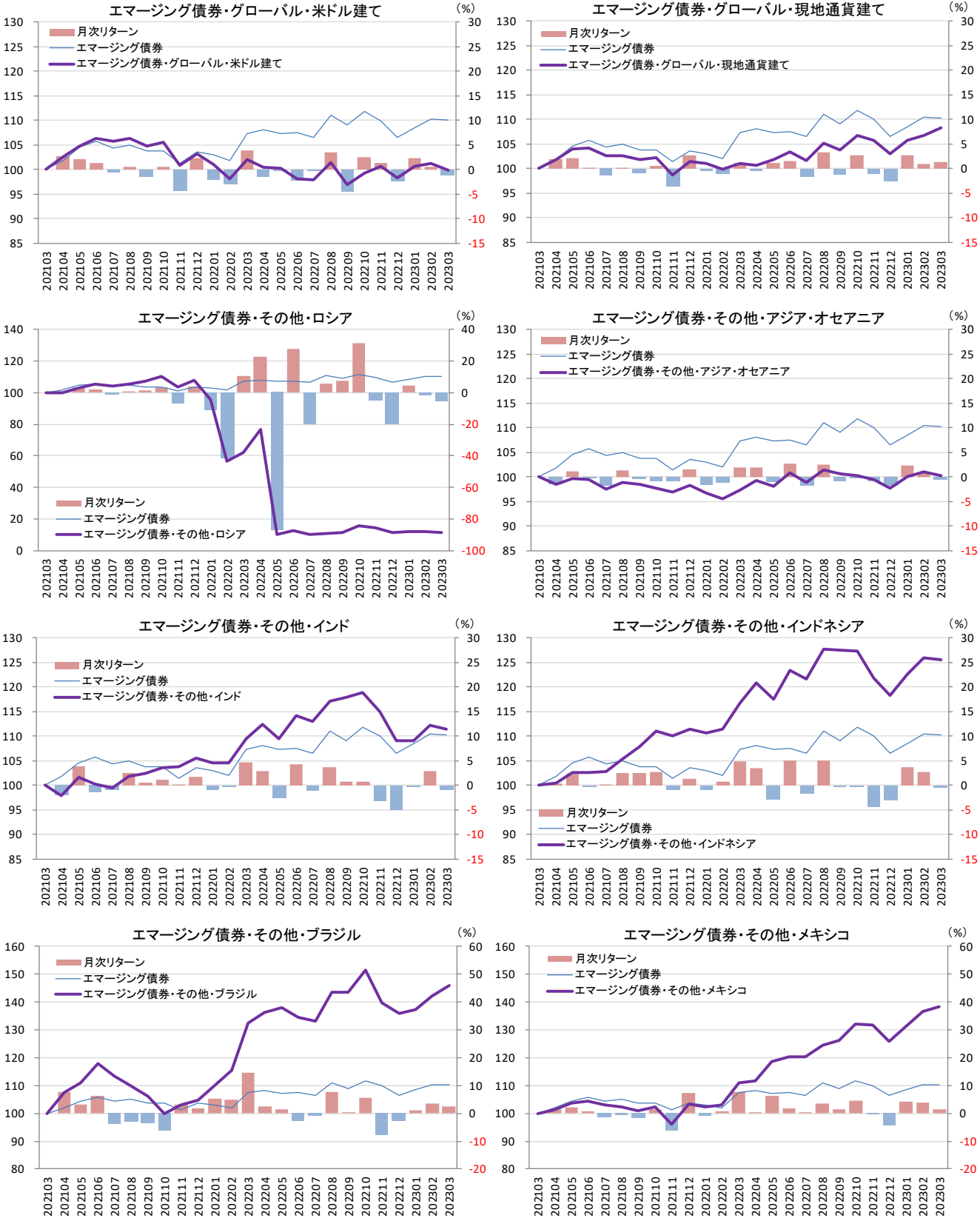


＜1＞パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

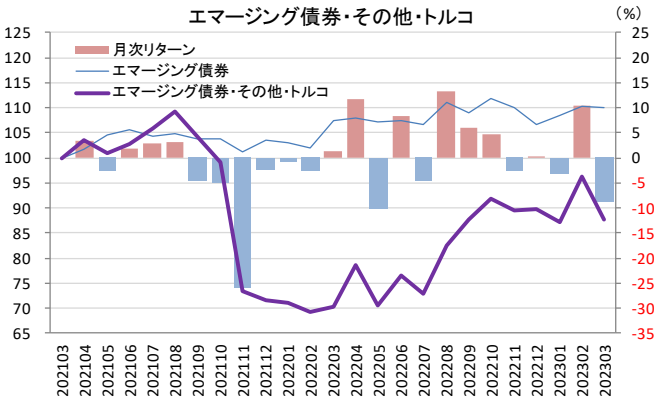


＜1＞パフォーマンス・サマリー

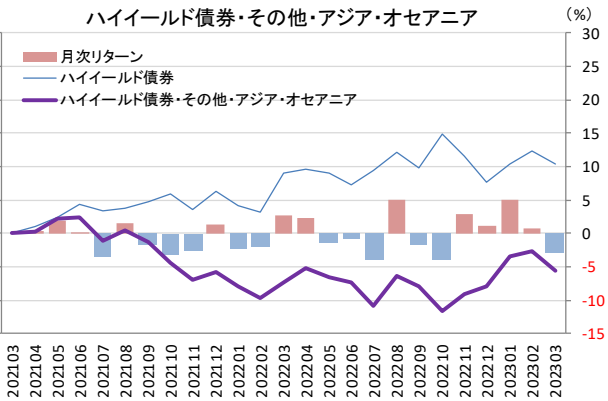
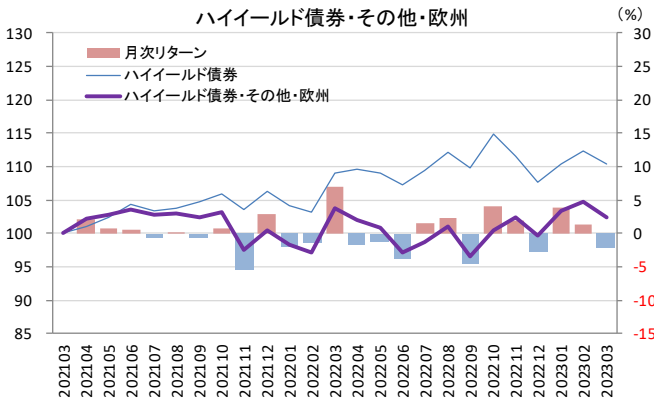
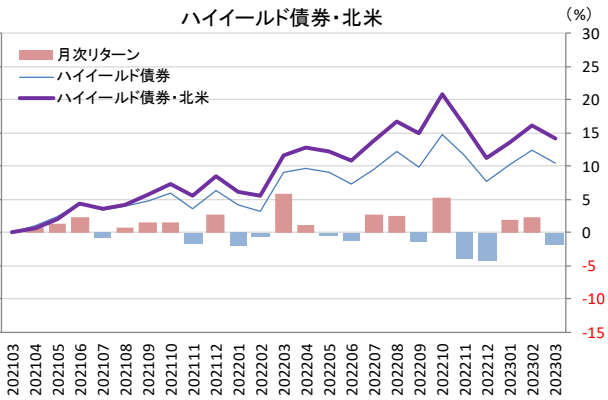
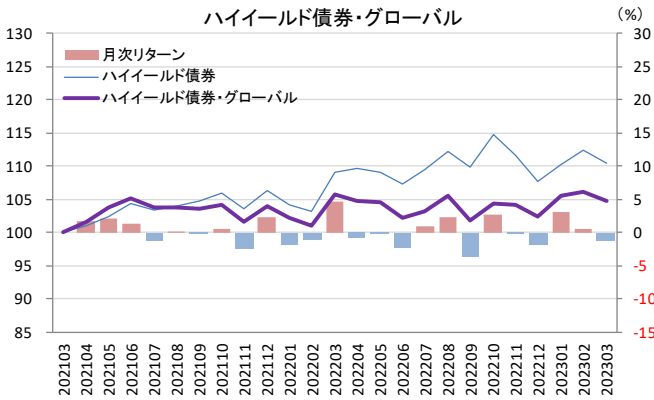
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

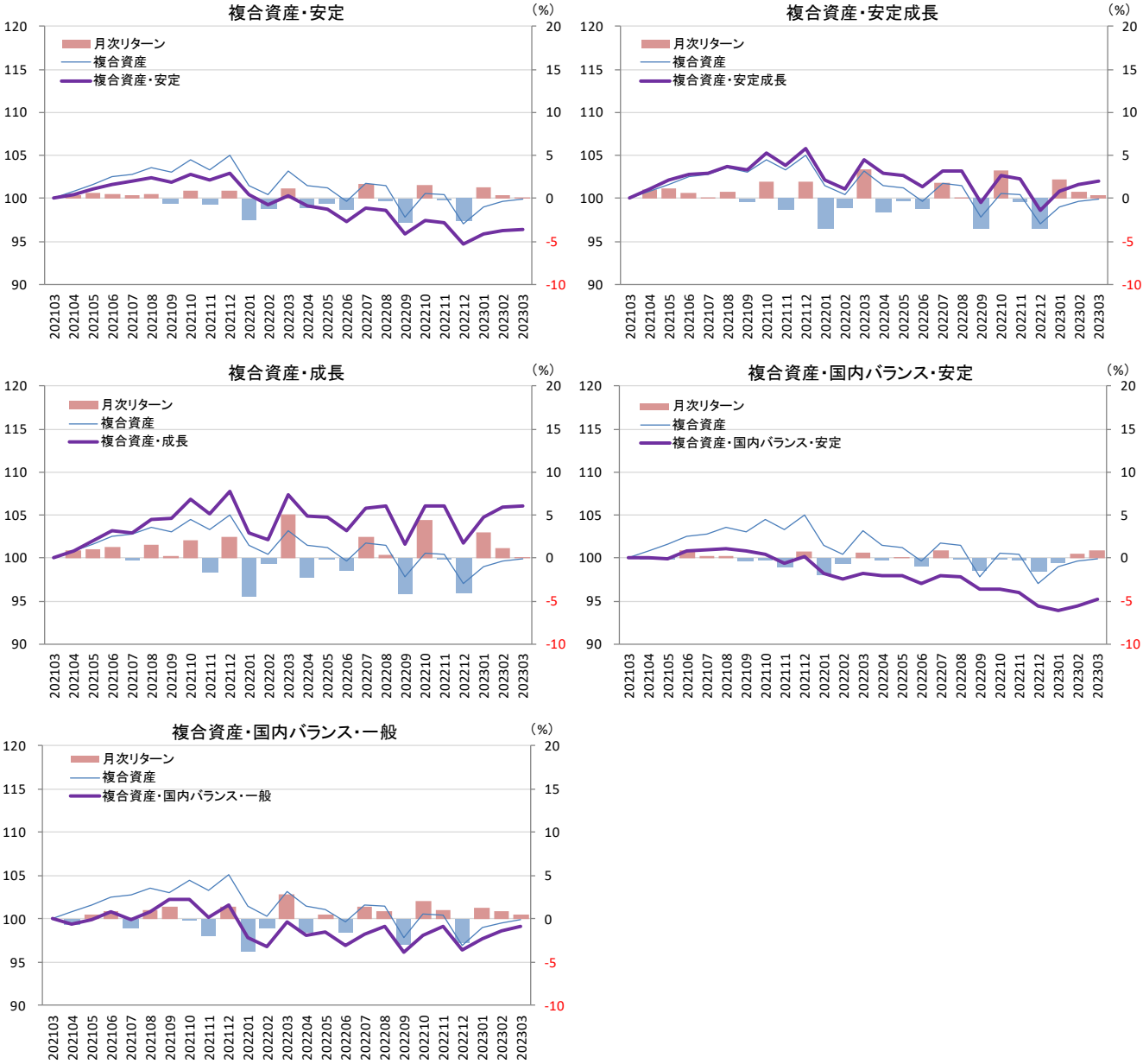


<1>パフォーマンス・サマリー

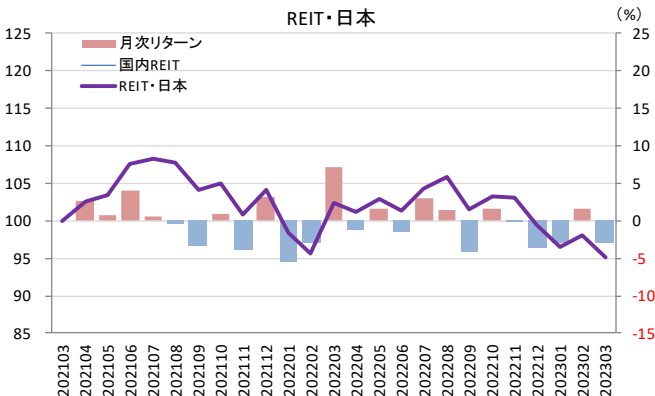
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

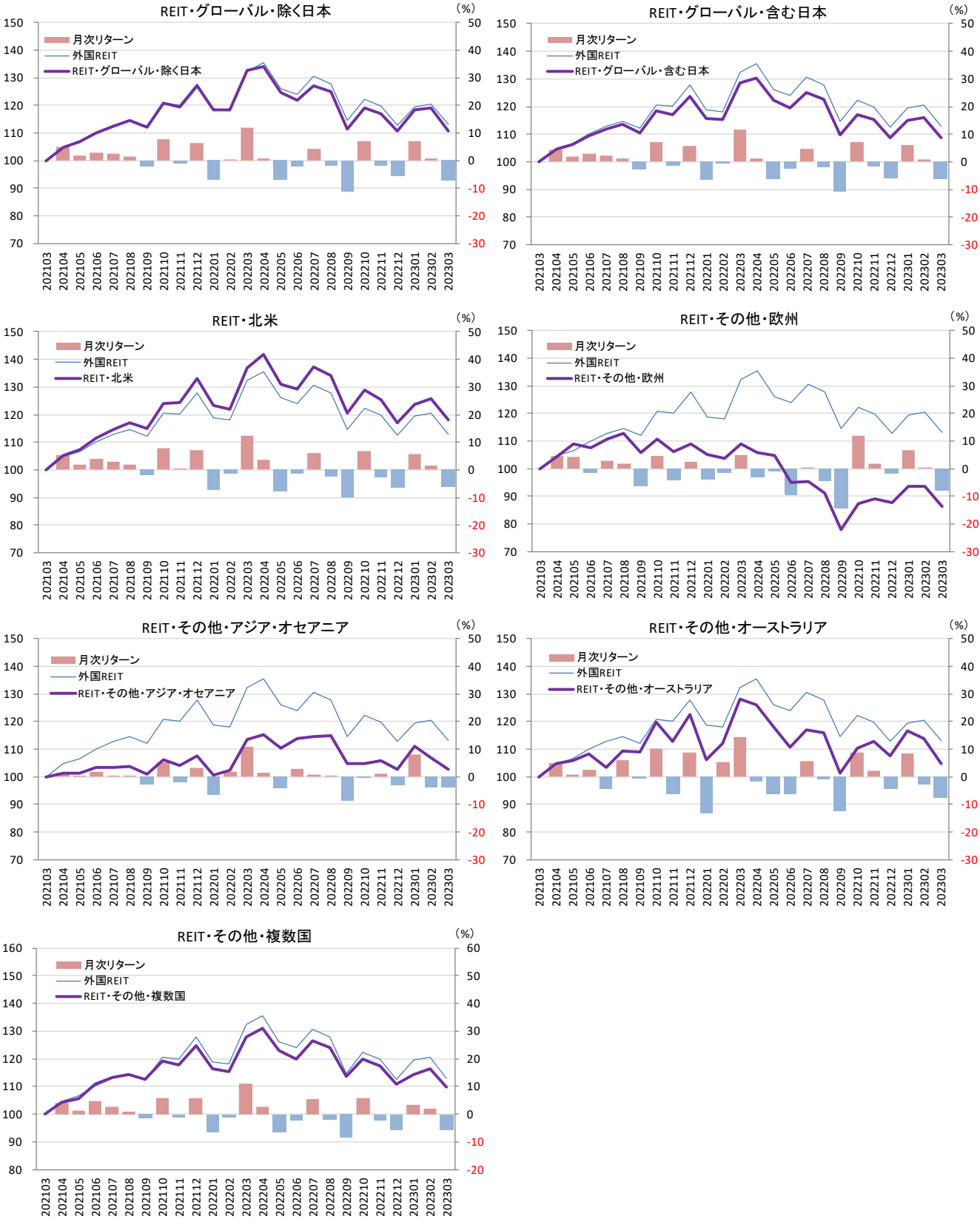


＜1＞パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

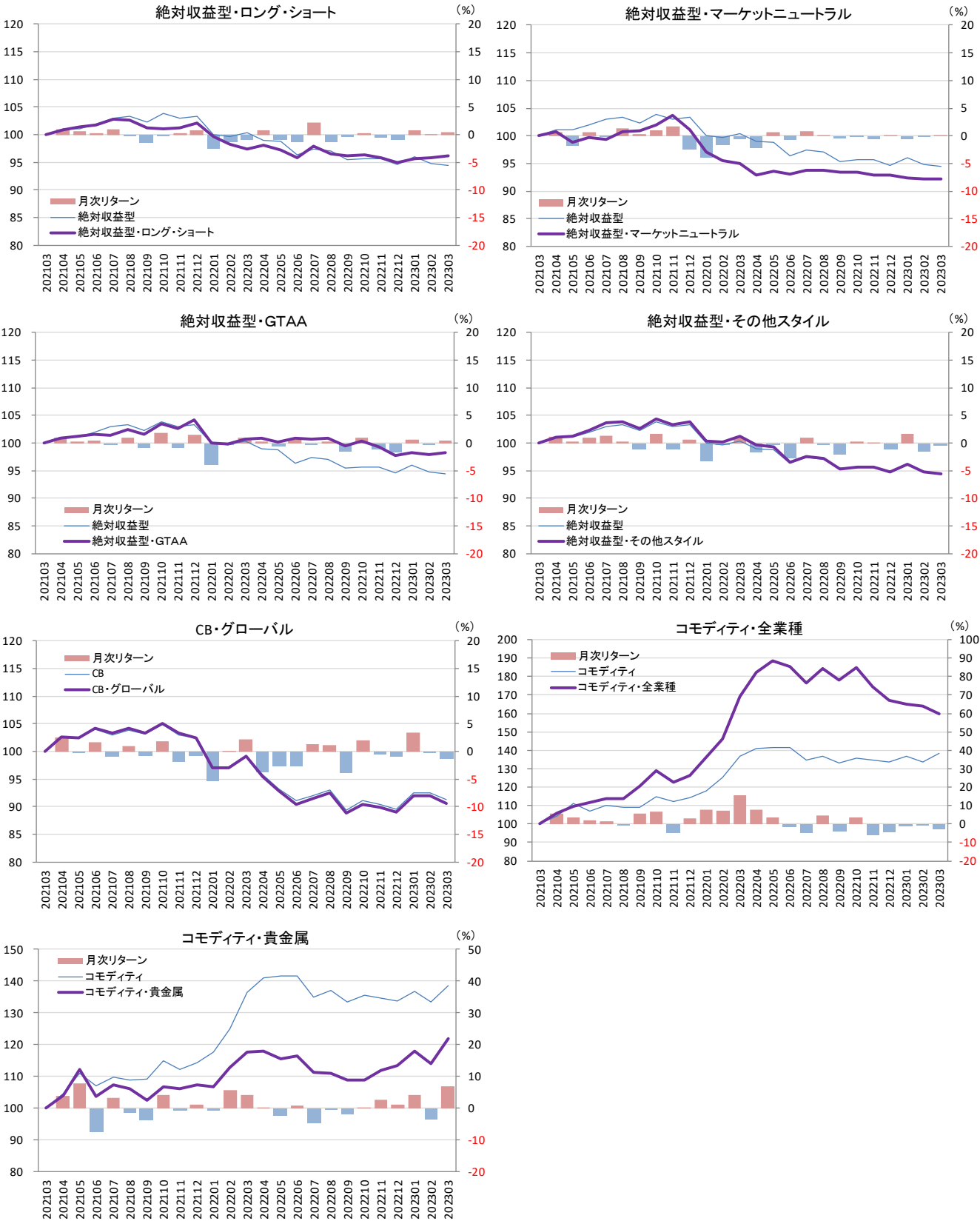


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	-0.04		
1	国内株式・その他	2.41	4.81	0.12
2	国内株式・一般	1.36	6.91	0.09
3	外国株式(先進国)・その他	0.55	13.12	0.09
4	国内債券・一般	1.36	4.80	0.06
5	ブルベア	10.31	0.50	0.05
6	複合資産・安定成長	0.39	6.68	0.03
7	コモディティ	3.72	0.58	0.02
8	外国債券(先進国)・グローバル	0.26	7.70	0.02
9	複合資産・その他	3.79	0.34	0.01
10	国内株式・小型	1.21	0.78	0.01
11	複合資産・国内バランス	0.83	0.83	0.01
12	複合資産・成長	0.12	2.93	0.00
13	複合資産・安定	0.07	4.32	0.00
14	国内株式・業種特化	2.14	0.08	0.00
15	エマージング債券・その他	0.32	0.52	0.00
16	外国債券(先進国)・その他	0.00	1.78	0.00
17	エマージング株式・BRICS	-1.87	0.05	-0.00
18	エマージング株式・グローバル	-0.24	1.05	-0.00
19	CB	-1.34	0.25	-0.00
20	エマージング債券・グローバル	-0.56	0.69	-0.00
21	ハイイールド債券・グローバル	-1.29	0.29	-0.00
22	絶対収益型	-0.35	1.35	-0.01
23	ハイイールド債券・その他	-2.37	0.22	-0.01
24	REIT・その他	-4.82	0.34	-0.02
25	ハイイールド債券・北米	-1.75	1.47	-0.03
26	エマージング株式・その他	-1.88	2.05	-0.04
27	外国株式(先進国)・グローバル	-0.18	28.02	-0.04
28	REIT・日本	-2.86	3.09	-0.09
29	REIT・グローバル	-6.60	1.88	-0.14
30	REIT・北米	-6.20	2.57	-0.17
	合計		100.00	-0.04

◆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	-4.85		
1	国内株式・その他	3.51	4.67	0.24
2	国内株式・一般	3.07	6.71	0.23
3	エマージング債券・その他	5.43	0.57	0.03
4	ハイイールド債券・北米	2.17	1.42	0.02
5	国内株式・小型	1.57	0.77	0.02
6	コモディティ	1.41	0.56	0.01
7	エマージング債券・グローバル	0.22	0.71	-0.00
8	国内株式・業種特化	-2.07	0.08	-0.00
9	複合資産・成長	-1.15	2.73	-0.00
10	ハイイールド債券・グローバル	-0.90	0.31	-0.00
11	ハイイールド債券・その他	-0.68	0.23	-0.00
12	エマージング株式・BRICS	-9.50	0.06	-0.01
13	CB	-8.15	0.18	-0.01
14	複合資産・国内バランス	-2.81	0.92	-0.03
15	エマージング株式・グローバル	-3.19	1.06	-0.04
16	REIT・その他	-11.89	0.38	-0.05
17	外国債券(先進国)・その他	-3.46	1.85	-0.06
18	複合資産・その他	-17.93	0.37	-0.08
19	ブルベア	-18.86	0.49	-0.09
20	絶対収益型	-5.98	1.36	-0.10
21	複合資産・安定成長	-2.43	6.65	-0.14
22	エマージング株式・その他	-6.89	2.10	-0.17
23	国内債券・一般	-2.85	5.01	-0.17
24	複合資産・安定	-3.95	4.50	-0.19
25	REIT・日本	-7.03	3.26	-0.26
26	外国債券(先進国)・グローバル	-3.82	7.64	-0.30
27	REIT・グローバル	-15.88	2.11	-0.37
28	REIT・北米	-13.94	2.83	-0.40
29	外国株式(先進国)・その他	-6.64	12.62	-0.67
30	外国株式(先進国)・グローバル	-7.47	27.85	-2.23
	合計		100.00	-4.85

◆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	35.50	25.09	60.15	10.92 ↓	11.79	10.84	0.98	0.39	0.45
国内株式	52.49	24.48	128.51	14.01 ↓	16.00	15.95	1.08	0.28	0.54
一般	51.41	21.76	117.47	13.48 ↓	15.78	16.10	1.10	0.26	0.50
フリー	50.06	20.80	114.01	13.97 ↓	16.13	16.62	1.04	0.24	0.48
バリュー	55.38	24.60	128.79	12.53 ↓	14.96	14.86	1.27	0.30	0.58
小型	51.34	11.17	178.98	18.14 ↓	19.54	17.75	0.82	0.11	0.61
その他	53.16	34.60	143.83	14.62 ↓	15.93	15.76	1.05	0.39	0.59
日経225	54.27	40.68	156.62	16.20 ↓	17.00	16.44	0.96	0.42	0.60
TOPIX	52.19	30.00	134.25	13.41 ↓	15.07	15.19	1.12	0.36	0.59
JPX日経400	52.05	30.99	-	13.94 ↓	15.26	-	1.08	0.37	-
国内債券	-4.69	-3.71	2.46	1.93	2.02	1.85	-0.81	-0.35	0.14
一般	-4.69	-3.71	2.46	1.93	2.02	1.85	-0.81	-0.35	0.14
外国株式(先進国)	61.75	54.28	120.51	17.23 ↓	18.12	15.98	1.01	0.50	0.52
グローバル	58.34	51.59	128.58	17.41 ↓	18.26	15.97	0.95	0.48	0.54
除く日本	85.94	73.29	188.41	15.95 ↓	17.90	16.54	1.44	0.65	0.68
含む日本	50.47	45.33	113.57	18.26 ↓	18.65	16.04	0.80	0.42	0.49
その他	71.64	61.64	103.66	17.22 ↓	18.07	16.25	1.15	0.56	0.45
北米	130.10	104.88	173.06	16.15 ↓	19.22	17.46	1.98	0.80	0.61
米国	70.71	75.79	138.80	17.38 ↓	17.91	16.64	1.12	0.67	0.55
カナダ	67.29	28.90	17.44	14.60 ↓	18.83	16.08	1.28	0.28	0.10
欧州	63.89	37.96	101.42	16.30 ↓	18.17	16.38	1.10	0.37	0.44
ドイツ	85.45	33.64	-	21.38 ↓	22.70	-	1.07	0.26	-
イギリス	61.63	20.22	-	14.04 ↓	17.59	-	1.24	0.22	-
アジア・オセアニア	45.32	21.31	78.08	11.93 ↓	15.21	15.17	1.11	0.26	0.39
オーストラリア	92.95	28.82	41.46	21.06 ↓	23.91	20.07	1.16	0.22	0.18
ニュージーランド	63.44	56.11	214.79	17.01 ↓	17.91	18.07	1.05	0.52	0.67
複合地域	197.27	36.57	-	30.98 ↓	33.65	-	1.41	0.19	-
エマージング株式	63.07	21.24	62.13	13.08 ↓	17.94	16.83	1.36	0.22	0.29
グローバル	57.31	26.99	52.50	14.12 ↓	18.03	16.96	1.16	0.27	0.25
BRICS	30.77	-0.02	47.67	16.12 ↓	20.64	19.54	0.58	0.00	0.20
その他	66.41	19.86	66.84	13.01 ↓	18.34	17.07	1.42	0.20	0.31
欧州	-32.93	-53.30	-46.89	35.43 ↓	32.58	26.94	-0.35	-0.43	-0.23
ロシア	-85.84	-87.98	-85.07	58.57	48.68	38.68	-0.82	-0.71	-0.45
アジア・オセアニア	43.62	12.17	54.42	14.85 ↓	17.70	16.33	0.87	0.13	0.27
中国	20.29	19.94	136.96	21.50	21.72	21.67	0.30	0.17	0.42
インド	111.21	42.16	159.84	16.73 ↓	23.44	22.98	1.69	0.31	0.44
インドネシア	107.81	19.26	11.45	20.45 ↓	26.72	24.39	1.35	0.14	0.05
タイ	63.05	-6.03	21.44	19.15 ↓	21.30	18.65	0.93	-0.06	0.11
フィリピン	46.08	-5.00	-1.61	17.68 ↓	20.69	19.23	0.76	-0.05	-0.01
ベトナム	115.09	8.81	113.16	24.47 ↓	26.46	21.31	1.19	0.07	0.37
韓国	69.96	3.42	31.21	26.03	24.94	20.31	0.74	0.03	0.14
香港	12.14	-6.42	35.09	22.24	21.72	19.98	0.18	-0.06	0.15
中南米	95.77	15.85	8.95	26.16 ↓	30.93	26.38	0.96	0.10	0.03
ブラジル	49.23	-14.02	-26.56	29.08 ↓	34.98	31.91	0.49	-0.08	-0.10
メキシコ	163.01	52.06	33.53	22.40 ↓	28.96	23.74	1.70	0.30	0.12
中東・アフリカ	84.71	26.50	75.29	14.86 ↓	18.76	16.90	1.53	0.26	0.34
トルコ	123.53	12.39	-18.18	32.92 ↓	36.92	32.19	0.94	0.07	-0.06
複合地域	51.66	17.06	46.98	15.69 ↓	18.03	16.00	0.95	0.18	0.25

※[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 ヶ月間のリスク推移の傾向を表したもので、↑：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	35.50	25.09	60.15	10.92 ↓	11.79	10.84	0.98	0.39	0.45
外国債券(先進国)	5.90	4.83	9.58	4.49 ↓	4.56	5.87	0.44	0.22	0.16
グローバル	2.19	3.36	12.45	3.90 ↓	3.89	5.31	0.19	0.18	0.22
除く日本	2.38	6.01	14.23	4.77	4.24	5.86	0.17	0.29	0.23
含む日本	2.29	0.71	10.86	3.64 ↓	4.24	5.03	0.22	0.04	0.21
その他	18.65	10.55	8.37	7.42 ↓	7.50	7.97	0.79	0.28	0.10
北米	3.10	1.40	-	4.56 ↓	4.84	-	0.23	0.07	-
米国	17.85	15.44	32.11	6.28 ↓	7.10	6.75	0.90	0.42	0.42
カナダ	21.54	19.46	8.63	7.78	7.43	8.70	0.87	0.49	0.10
欧州	-7.06	-11.18	6.12	5.94	5.55	7.13	-0.40	-0.42	0.08
イギリス	13.07	3.72	-	10.05	9.60 ↑	-	0.42	0.08	-
アジア・オセアニア	25.02	10.80	7.56	9.87 ↓	9.67	9.65	0.79	0.22	0.08
オーストラリア	25.80	10.90	6.53	9.85 ↓	9.72	9.64	0.81	0.22	0.07
ニュージーランド	11.39	3.72	-	9.42 ↓	9.14	-	0.39	0.08	-
複合地域	5.52	12.94	12.83	7.22 ↑	5.90	7.56	0.25	0.42	0.16
エマージング債券	23.95	6.18	13.59	7.31 ↓	10.90	11.26	1.02	0.11	0.11
グローバル	18.54	-1.87	5.31	8.55 ↓	12.34	11.79	0.69	-0.03	0.04
米ドル建て	17.08	-3.45	4.86	9.27 ↓	12.89	12.20	0.59	-0.05	0.04
現地通貨建て	21.64	1.79	1.90	7.15 ↓	11.06	10.69	0.95	0.04	0.02
その他	31.93	16.57	23.04	8.09 ↓	10.62	11.80	1.20	0.30	0.18
ロシア	-87.02	-89.06	-89.60	66.89	53.33	41.33	-0.74	-0.67	-0.49
アジア・オセアニア	14.27	13.35	29.70	5.23 ↓	6.50	7.41	0.88	0.40	0.36
インド	30.69	26.77	64.07	7.55 ↓	9.09	11.47	1.24	0.54	0.44
インドネシア	60.13	38.73	29.30	9.62 ↓	14.43	15.53	1.77	0.47	0.17
ブラジル	34.63	2.29	15.85	16.75 ↓	19.64	18.55	0.62	0.03	0.08
メキシコ	74.83	55.08	34.13	12.45 ↓	16.42	15.62	1.65	0.56	0.19
トルコ	-32.18	-48.61	-68.64	27.59	34.36	27.11	-0.44	-0.36	-0.40
複合地域	15.89	-0.38	-4.32	9.61 ↓	12.05	12.38	0.53	-0.00	-0.03
ハイイールド債券	39.65	20.18	44.73	8.17 ↓	11.44	10.78	1.45	0.33	0.35
グローバル	29.74	8.78	30.36	7.65 ↓	11.31	10.81	1.19	0.15	0.25
北米	44.65	27.90	56.47	8.48 ↓	11.45	10.75	1.55	0.44	0.43
その他	28.15	2.94	22.00	9.61 ↓	12.83	11.81	0.90	0.05	0.17
欧州	30.97	3.00	23.86	10.66 ↓	13.75	12.60	0.89	0.05	0.17
アジア・オセアニア	17.70	1.11	21.80	9.08 ↓	11.58	10.59	0.62	0.02	0.19
複合地域	29.51	20.69	55.58	7.56 ↓	8.80	9.20	1.20	0.44	0.49
複合資産	17.42	12.74	44.23	6.32 ↓	7.15	7.50	0.87	0.34	0.50
安定	6.17	3.92	28.01	4.34 ↓	4.91	5.85	0.47	0.17	0.43
安定成長	21.83	17.33	48.94	6.75 ↓	7.67	7.86	1.01	0.43	0.52
成長	40.19	30.33	91.46	9.42 ↓	10.90	10.66	1.27	0.50	0.63
国内バランス	-0.61	-3.60	10.47	2.90 ↓	3.90	5.32 ↓	-0.06	-0.18	0.19
安定	-1.87	-4.36	12.78	2.78 ↓	3.72	3.18	-0.22	-0.23	0.38
一般	22.87	12.33	39.18	7.09 ↓	8.20	9.01	1.01	0.29	0.37

※[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	35.50	25.09	60.15	10.92 ↓	11.79	10.84	0.98	0.39	0.45
国内REIT	24.35	24.77	48.82	12.12 ↓	14.80	14.04 ↓	0.62	0.31	0.29
日本	24.35	24.77	48.82	12.12 ↓	14.80	14.04 ↓	0.62	0.31	0.29
外国REIT	53.22	42.52	90.57	17.35 ↓	18.69	16.54	0.88	0.40	0.40
グローバル	49.67	31.24	67.86	17.65 ↓	19.39	16.82	0.82	0.29	0.32
除く日本	55.56	38.61	90.99	18.42 ↓	20.03	17.20	0.86	0.34	0.39
含む日本	47.77	29.20	64.13	17.36 ↓	19.16	16.69	0.80	0.28	0.30
北米	56.91	55.53	112.93	17.83 ↓	18.54	16.80	0.91	0.50	0.47
その他	47.26	23.47	72.55	15.87 ↓	19.18	16.20	0.87	0.23	0.35
欧州	11.33	-17.23	30.04	19.73 ↓	21.01	18.87	0.19	-0.17	0.14
アジア・オセアニア	41.87	25.24	74.51	14.50 ↓	17.79	15.83	0.85	0.26	0.36
オーストラリア	83.90	21.93	47.77	26.00 ↓	29.17	23.26	0.87	0.14	0.17
複合地域	67.61	-2.17	34.18	19.35 ↓	25.01	20.74	0.97	-0.02	0.14
複数国	48.57	51.35	118.50	16.08 ↓	17.32	15.10	0.88	0.50	0.54
その他									
絶対収益型	-2.30	-6.92	-4.53	3.65	3.20	2.92	-0.20	-0.43	-0.16
ロング・ショート	-5.75	-9.71	-11.07	3.15 ↓	3.32	3.14	-0.61	-0.60	-0.37
マーケットニュートラル	-3.25	-10.61	25.46	4.73	4.20	5.65	-0.23	-0.52	0.41
GTAA	10.02	7.54	11.50	4.41 ↓	4.41	3.45	0.74	0.34	0.32
その他スタイル	-2.42	-6.68	-5.25	4.01	3.44	3.43 ↓	-0.20	-0.39	-0.15
CB	17.31	6.04	22.47	8.17 ↓	8.83	7.80	0.67	0.14	0.26
アジア・オセアニア	52.08	35.52	91.93	10.43 ↓	12.38	11.70	1.44	0.51	0.58
日本	4.51	-4.17	23.23	4.43 ↓	5.11	5.84	0.34	-0.16	0.36
グローバル	16.94	5.74	21.26	8.45 ↓	9.06	7.87	0.64	0.13	0.25
コモディティ	62.43	55.18	3.52	11.99 ↓	11.38	12.38	1.47	0.81	0.03
全業種	123.63	60.74	7.49	18.59 ↓	19.29	16.99	1.66	0.52	0.04
貴金属	26.13	46.54	8.35	13.76	12.52	13.13	0.59	0.64	0.06
エネルギー	221.06	80.59	5.19	35.61 ↓	37.01	31.35	1.34	0.34	0.02
その他コモディティ	109.55	45.29	12.34	16.27 ↓	19.06	16.98	1.72	0.41	0.07

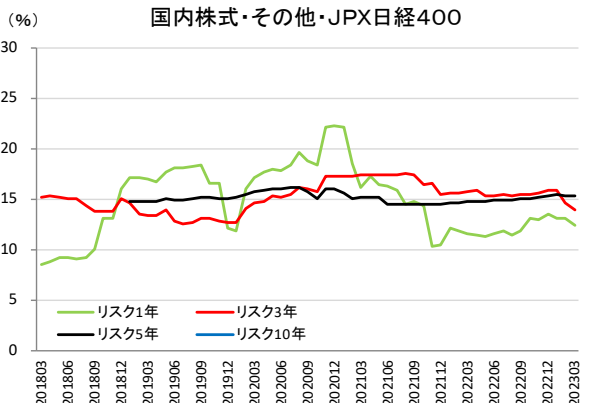
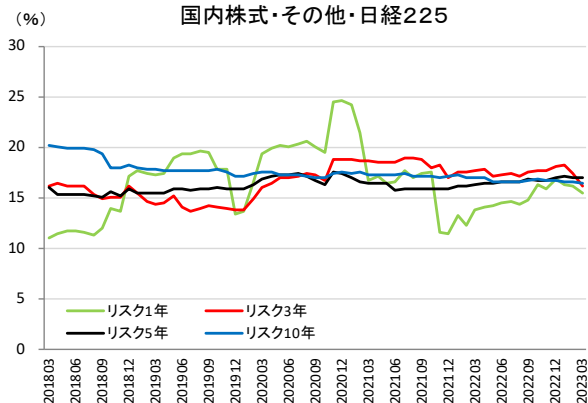
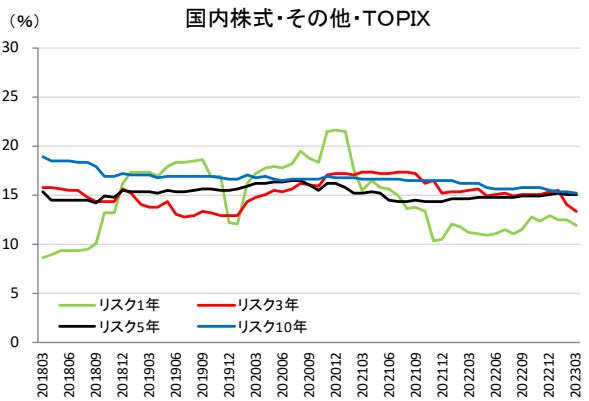
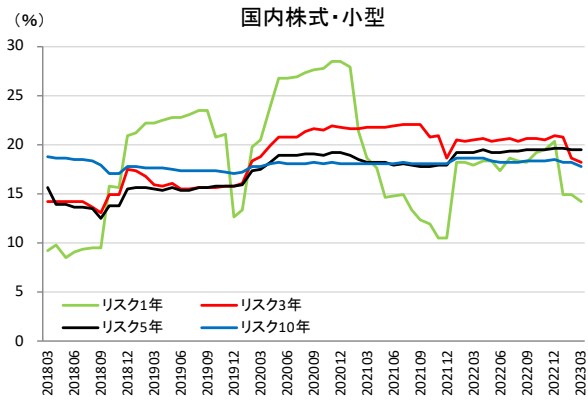
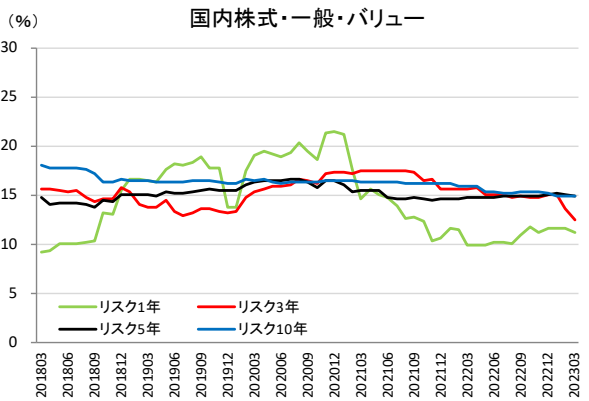
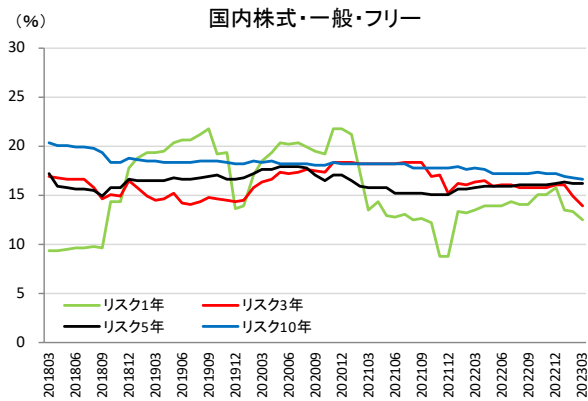
※[色塗りの基準] 累積リターン> 総合、リスク<総合、シャープ・レシオ>=0.5
[リスクの矢印] 直近 6 ヶ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

＜2＞リスク・サマリー

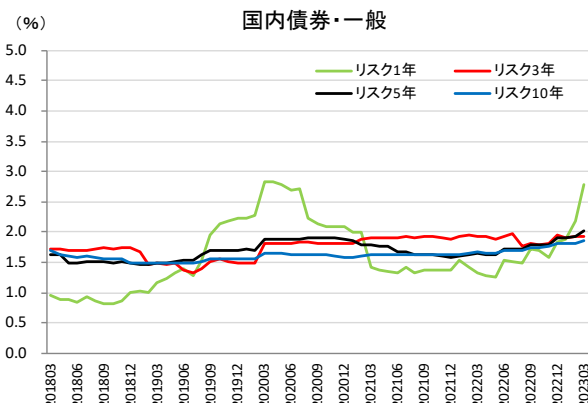
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

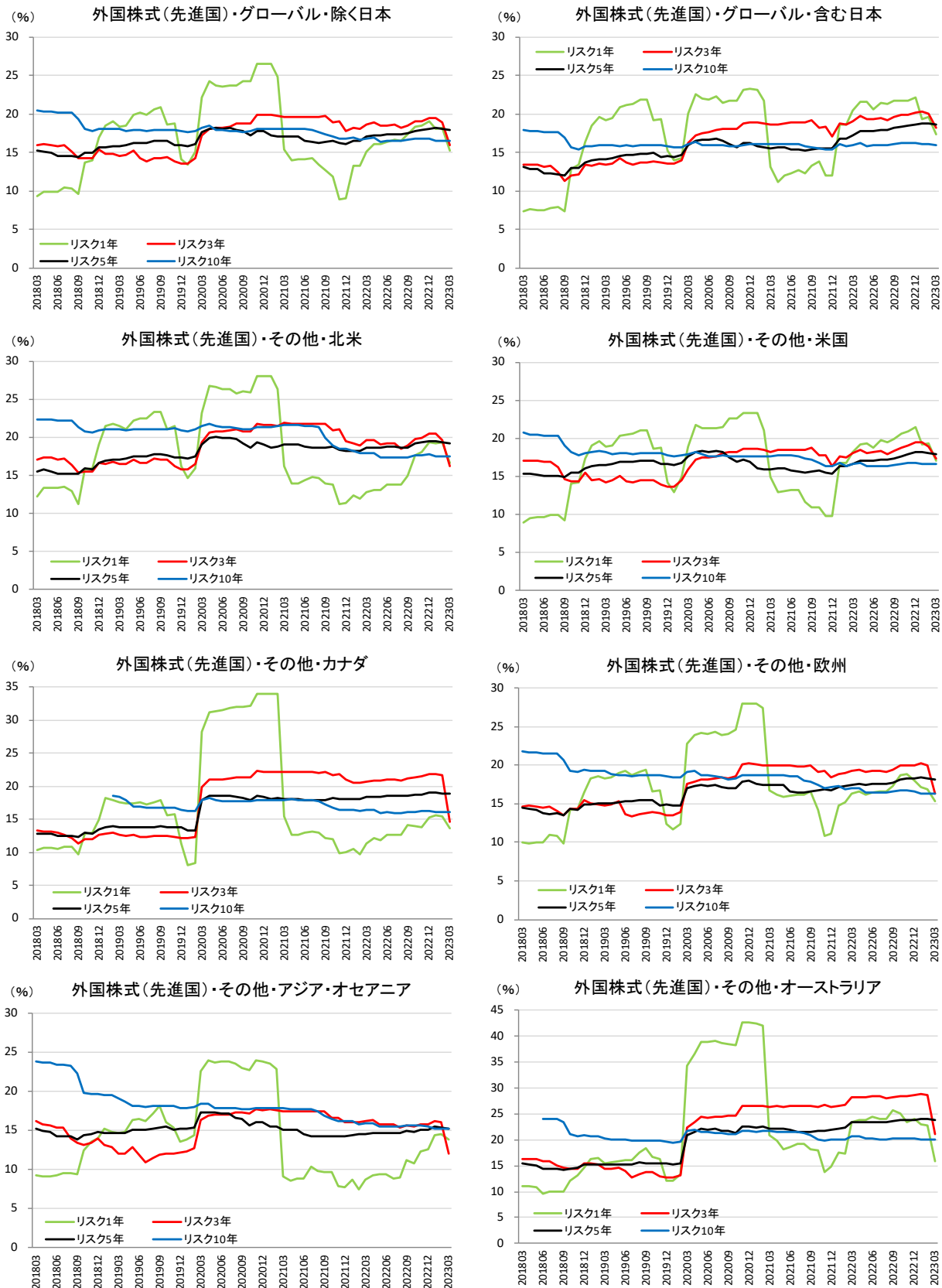


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

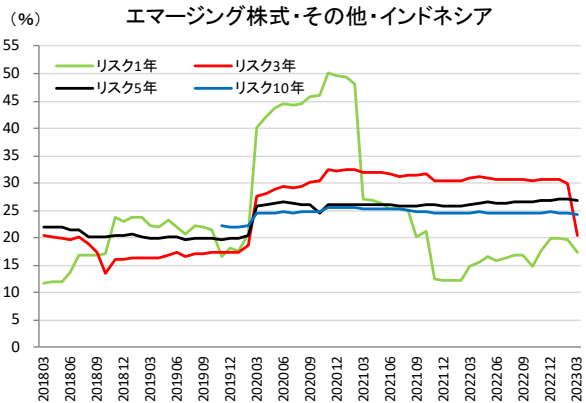
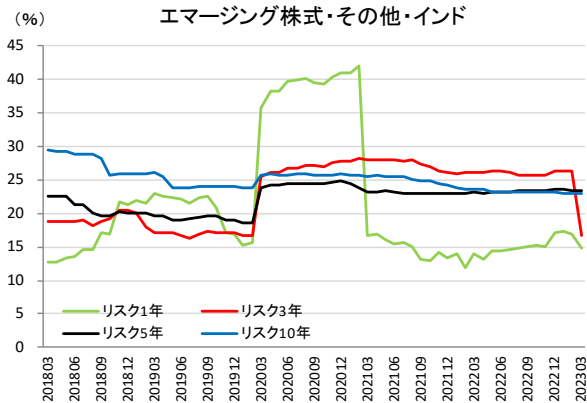
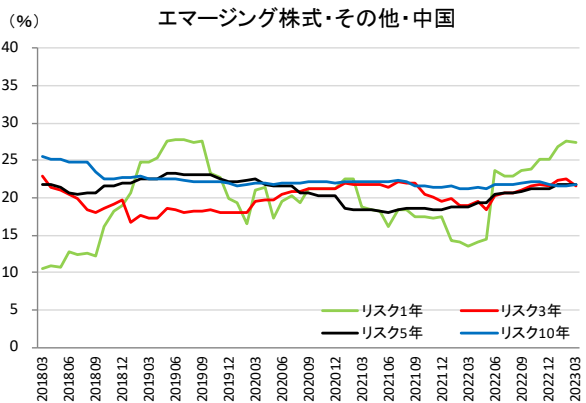
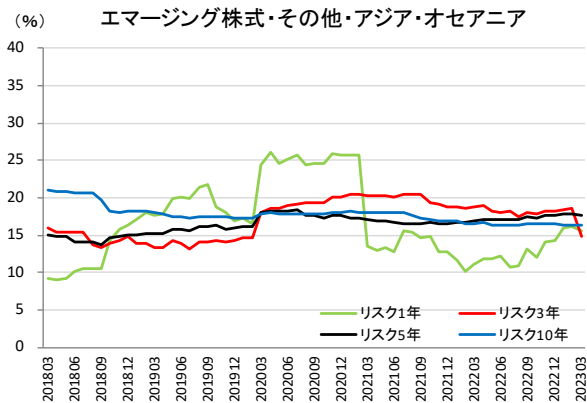
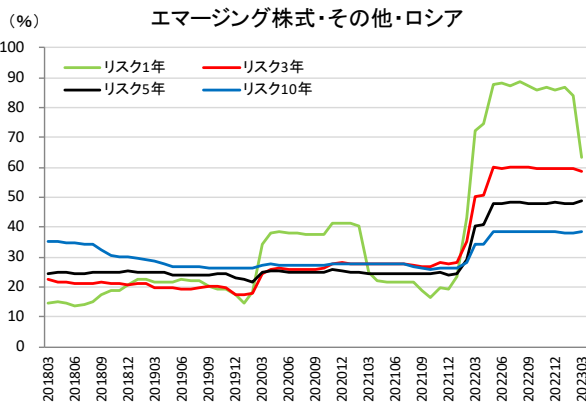
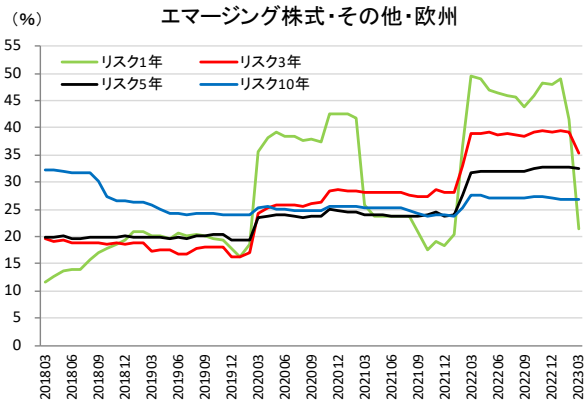
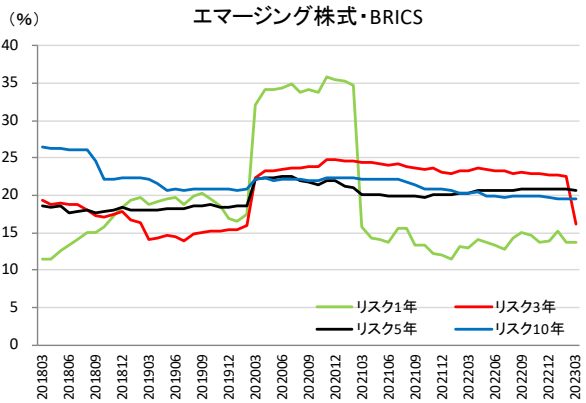
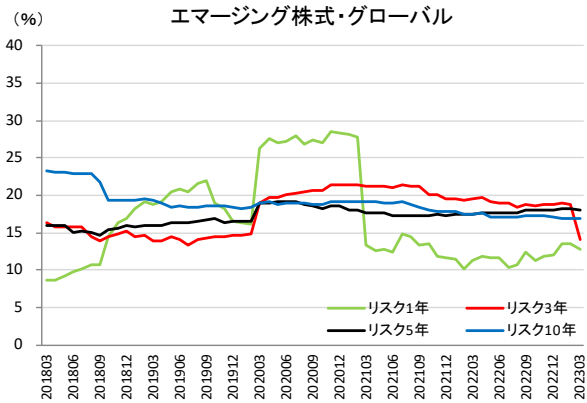


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

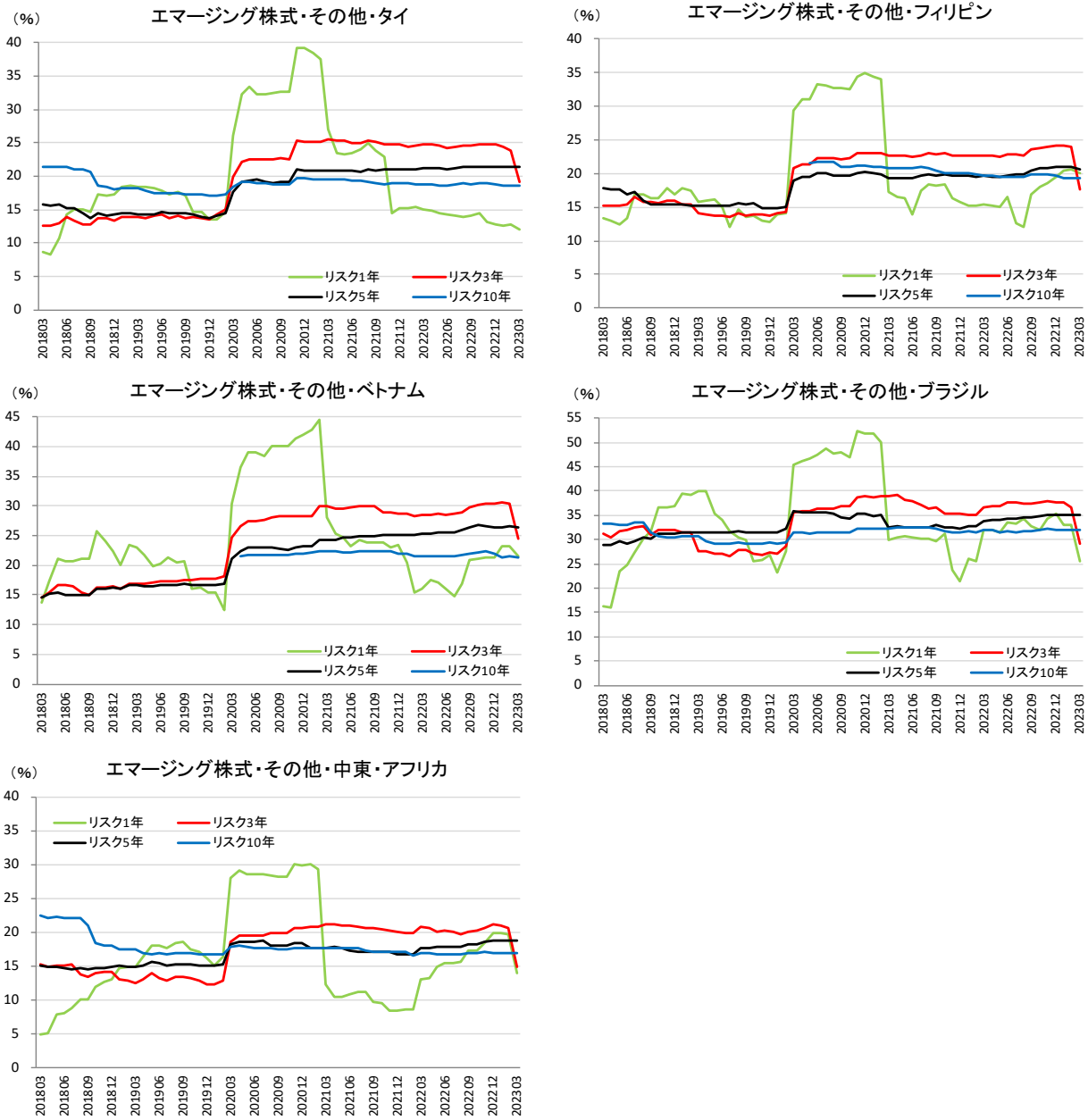


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

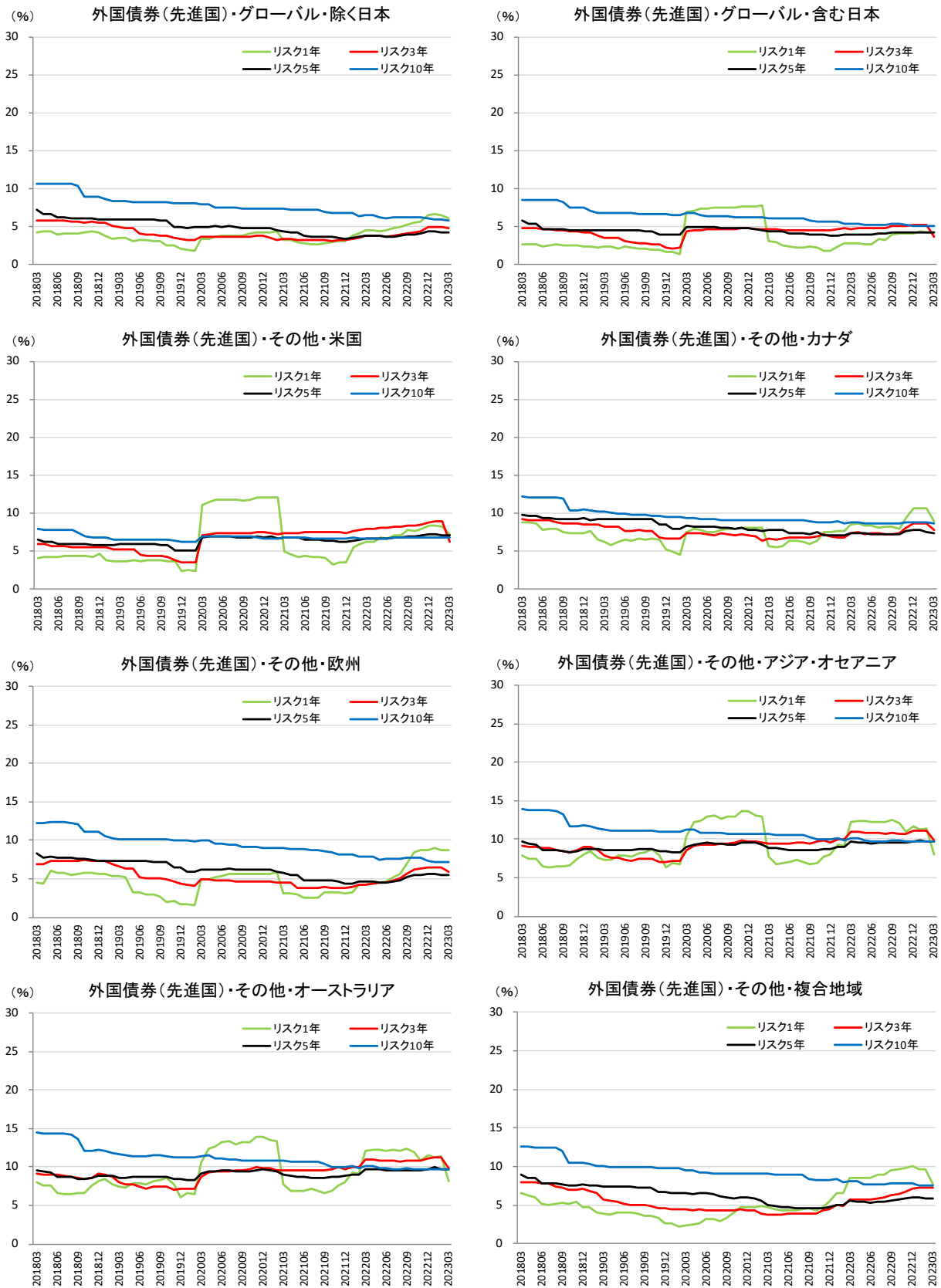


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

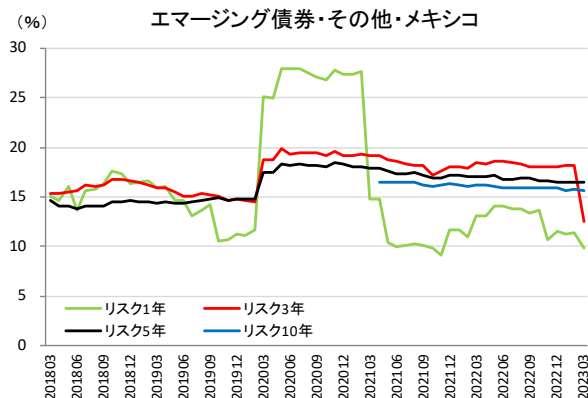
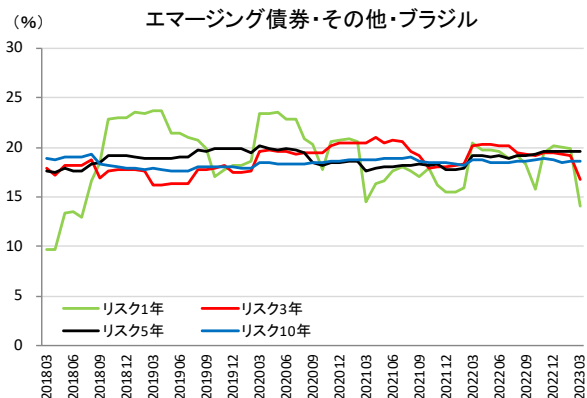
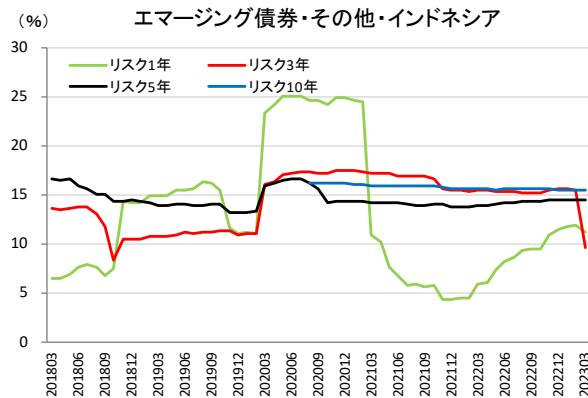
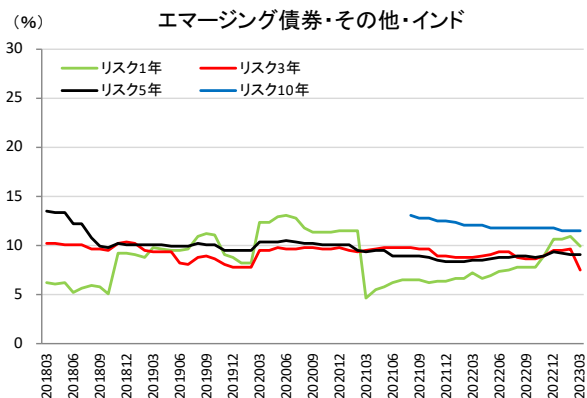
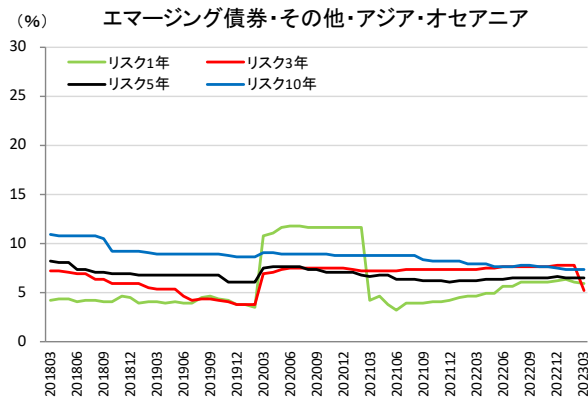
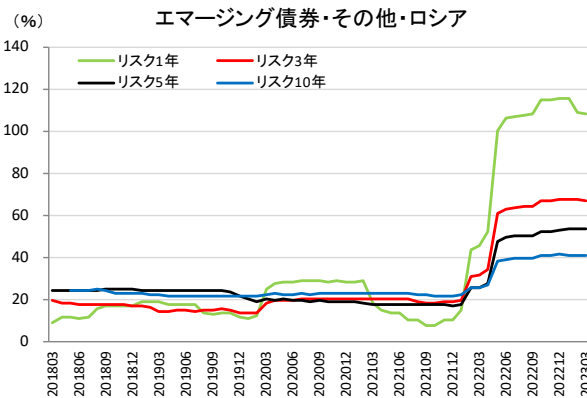
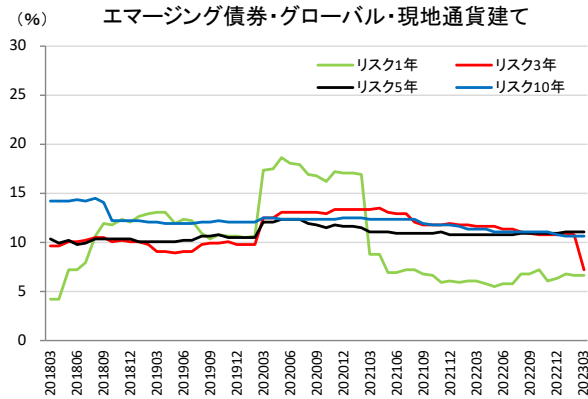
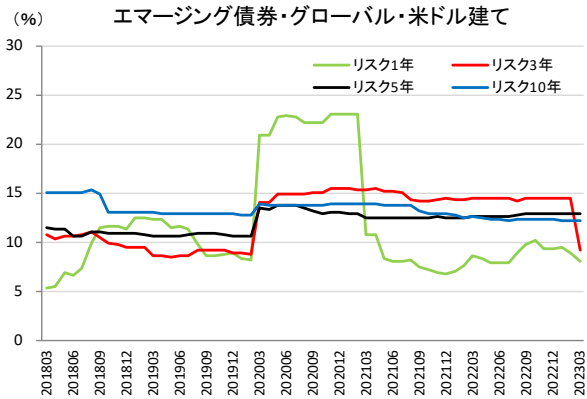


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

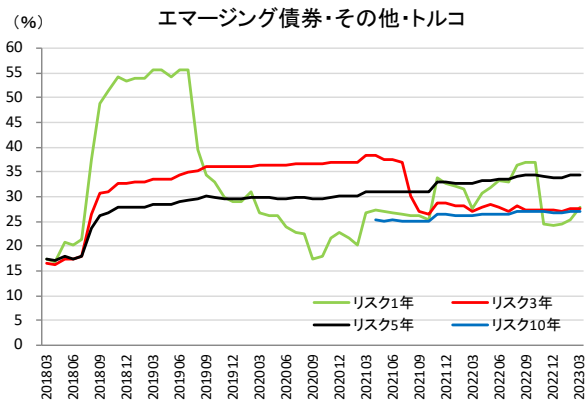


<2> リスク・サマリー

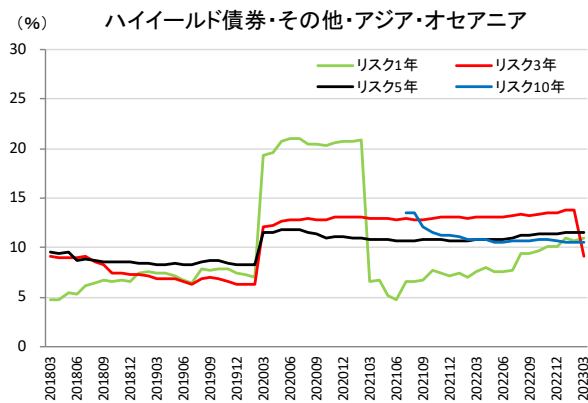
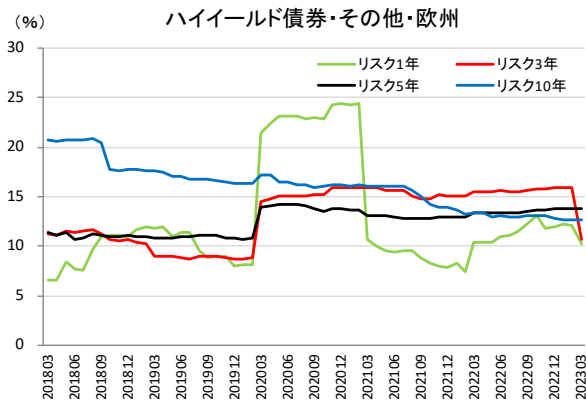
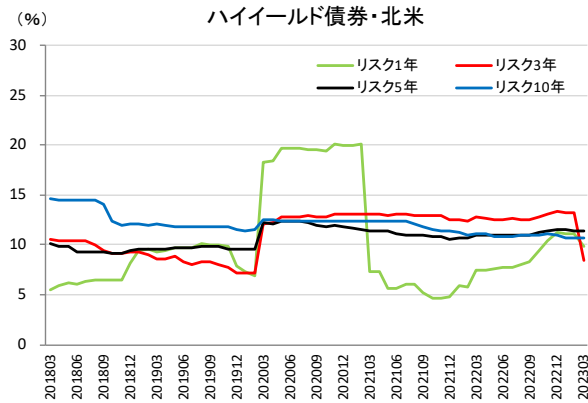
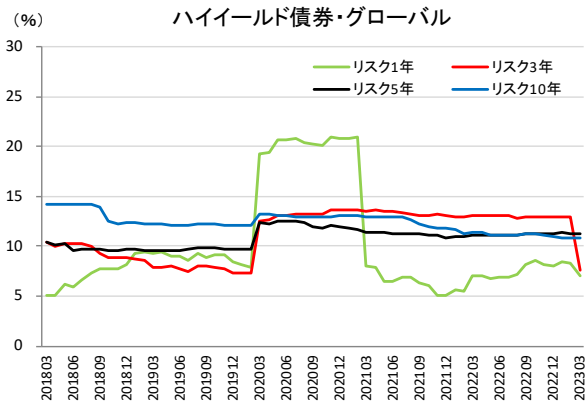
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

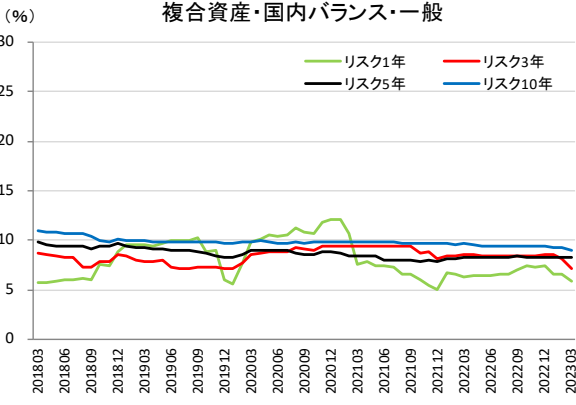
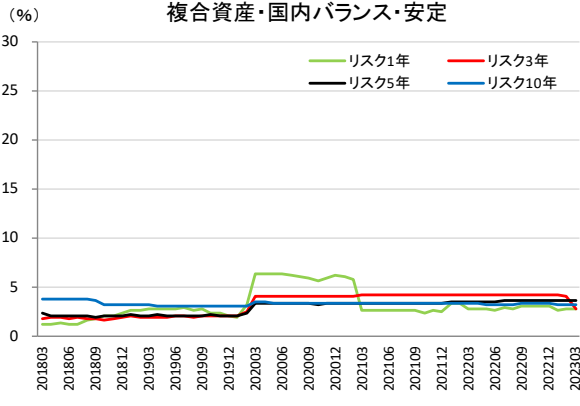
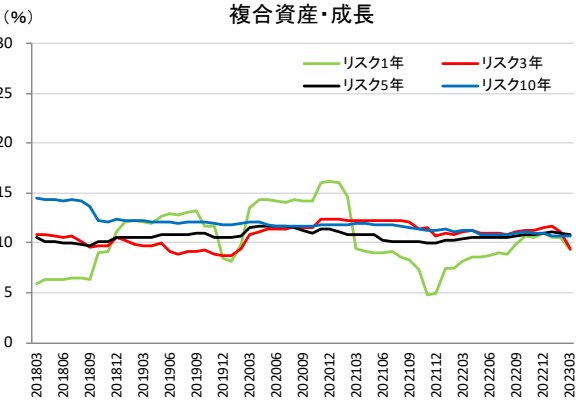
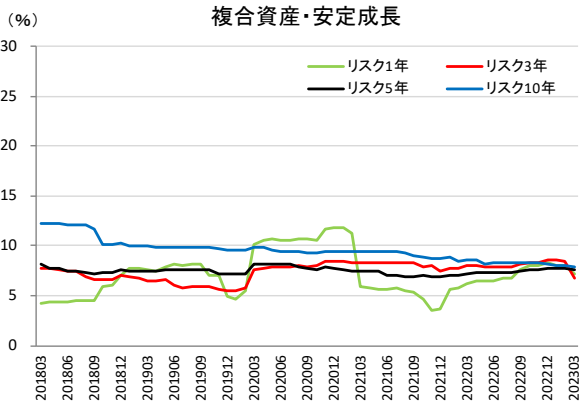
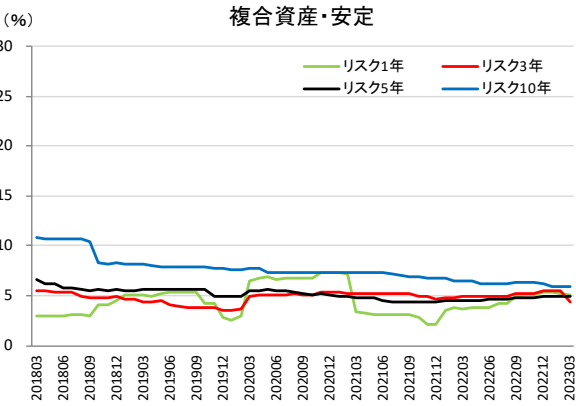


<2> リスク・サマリー

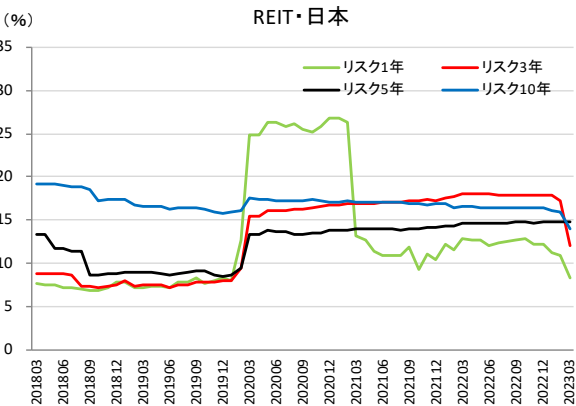
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]



＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

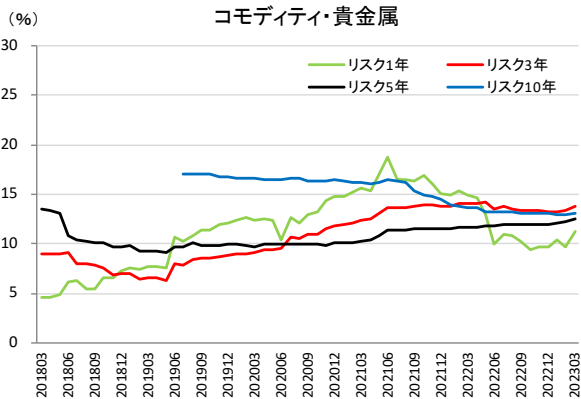
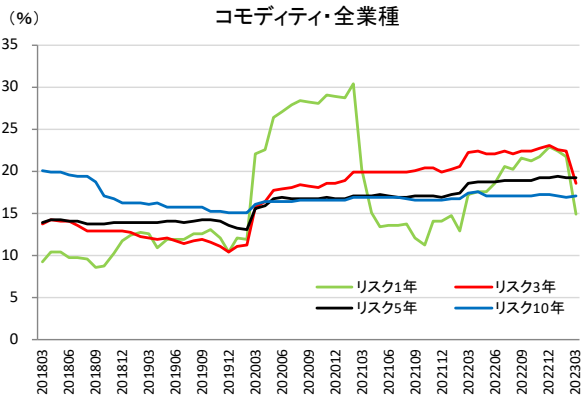
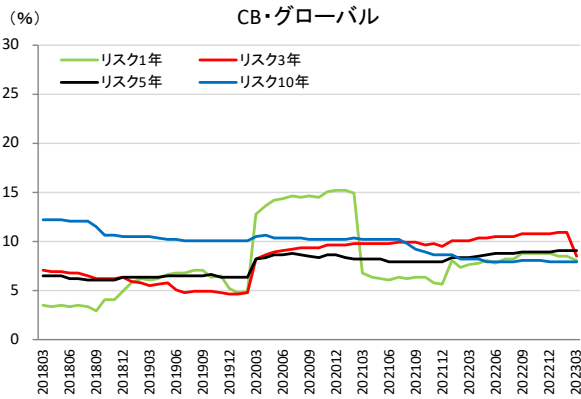
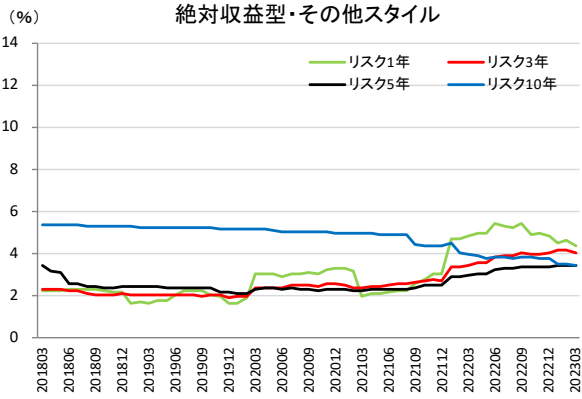
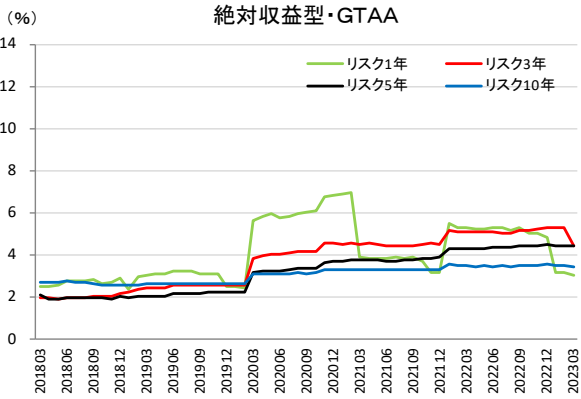
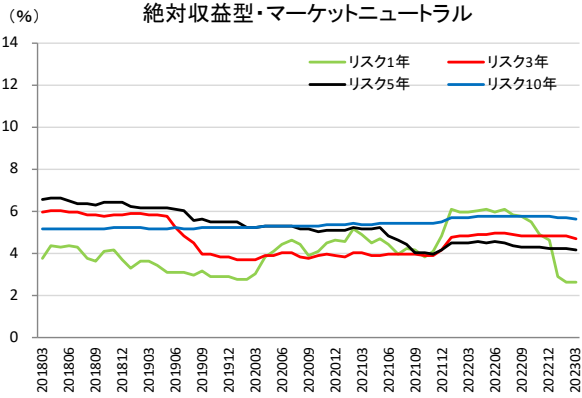
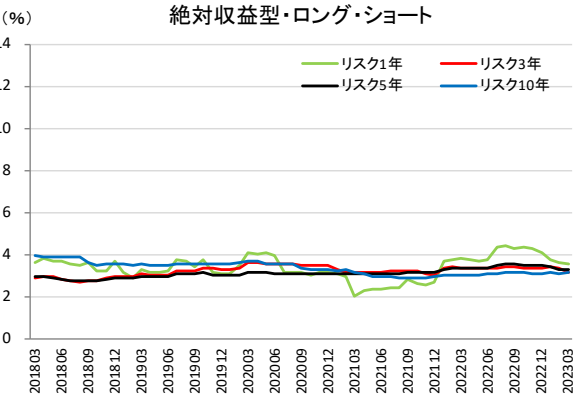


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	6,584	15,780	37,754	77,127
国内株式	325	728	2,887	6,560
一般	386	1,053	1,849	3,625
フリー	183	571	1,112	2,541
バリュー	203	482	737	1,084
小型	3	74	76	168
その他	-76	-441	924	2,732
日経225	-317	-755	226	1,564
TOPIX	180	165	437	695
JPX日経400	-2	-10	3	35
国内債券	-872	-1,382	-868	1,119
一般	-872	-1,382	-868	1,119
外国株式(先進国)	3,772	7,885	18,929	41,030
グローバル	2,355	4,494	8,955	19,988
除く日本	1,148	2,296	4,793	9,757
含む日本	1,208	2,197	4,162	10,231
その他	1,416	3,391	9,974	21,042
北米	36	142	714	747
米国	1,396	3,368	9,506	20,930
カナダ	-1	-3	-10	-27
欧州	-1	-36	-77	-135
ドイツ	0	-1	-2	-2
イギリス	0	1	0	0
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-3
オーストラリア	-14	-80	-160	-494
ニュージーランド	0	0	0	-1
複合地域	1	2	4	26
エマージング株式	432	1,312	1,954	1,295
グローバル	104	253	343	500
BRICS	-2	-5	-18	-40
その他	329	1,064	1,628	836
欧州	0	0	0	-1
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-5	14	-52	-462
中国	-7	-20	-137	-332
インド	308	931	1,524	1,460
インドネシア	5	16	37	16
タイ	0	-1	-3	-5
フィリピン	0	1	0	-5
ベトナム	26	141	301	277
韓国	0	-4	-4	-4
香港	0	-1	1	1
中南米	0	0	-3	-8
ブラジル	1	0	-22	-71
メキシコ	0	0	-2	-5
中東・アフリカ	0	-1	-5	-11
トルコ	0	-10	-7	-12
複合地域	0	0	-1	-1

<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別②

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	6,584	15,780	37,754	77,127
外国債券(先進国)	518	2,740	4,305	5,909
グローバル	421	2,171	3,538	5,929
除く日本	252	913	537	1,101
含む日本	168	1,258	3,001	4,828
その他	98	569	767	-19
北米	10	11	12	9
米国	152	734	1,167	1,262
カナダ	-6	-15	-46	-163
欧州	-9	-17	-29	-71
イギリス	0	0	-1	-3
アジア・オセアニア	-1	-2	-27	-147
オーストラリア	-40	-122	-271	-808
ニュージーランド	-1	-2	-3	-10
複合地域	-8	-18	-36	-90
エマージング債券	97	135	-51	-442
グローバル	83	124	74	177
米ドル建て	80	52	-9	67
現地通貨建て	3	72	83	110
その他	14	11	-124	-619
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-1	-3	-9	-27
インド	14	33	10	-148
インドネシア	-1	-1	-9	-27
ブラジル	-11	-31	-103	-355
メキシコ	-1	-7	-20	-63
トルコ	0	-1	-2	-4
複合地域	0	-1	-1	-3
ハイイールド債券	131	476	1,160	1,380
グローバル	-13	-24	-41	-13
北米	164	528	1,282	1,581
その他	-20	-28	-81	-188
欧州	-20	-47	-98	-194
アジア・オセアニア	0	19	17	8
複合地域	0	0	-1	-2
複合資産	921	1,799	4,421	9,669
安定	12	-99	268	740
安定成長	542	1,080	2,220	5,096
成長	458	1,125	2,308	4,734
国内バランス	-103	-348	-473	-835
安定	-131	-423	-720	-1,187
一般	-3	-5	-9	-17
その他	12	41	97	-64

<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別③

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	6,584	15,780	37,754	77,127
国内REIT	198	578	1,798	4,349
日本	198	578	1,798	4,349
外国REIT	439	820	1,478	1,936
グローバル	29	-53	-73	-371
除く日本	34	139	157	191
含む日本	-4	-192	-230	-561
北米	394	840	1,527	2,493
その他	15	33	25	-186
欧州	-1	-1	-4	-9
アジア・オセアニア	21	51	62	-80
オーストラリア	-3	-12	-24	-72
複合地域	0	-1	-1	-3
複数国	-2	-4	-8	-22
その他	624	688	1,741	4,321
絶対収益型	-43	41	318	1,342
ロング・ショート	-10	-17	-30	-6
マーケットニュートラル	-23	-42	-67	-117
GTAA	-2	-15	-23	-2
その他スタイル	-10	110	430	1,455
CB	623	766	912	1,692
アジア・オセアニア	0	0	-1	-2
日本	0	-1	-3	-5
グローバル	623	767	916	1,700
コモディティ	78	174	405	504
全業種	13	49	26	-277
貴金属	63	124	382	803
エネルギー	2	0	-5	-21
その他コモディティ	0	1	1	-1

< 4 > 純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別①

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	880,779	100.00	5,383	100.00
国内株式	111,373	12.64	826	15.34
一般	60,998	6.93	527	9.79
フリー	47,322	5.37	431	8.01
バリュー	13,677	1.55	96	1.78
小型	6,871	0.78	91	1.69
その他	42,797	4.86	202	3.75
日経225	22,131	2.51	69	1.28
TOPIX	17,074	1.94	80	1.49
JPX日経400	773	0.09	15	0.28
国内債券	41,644	4.73	144	2.68
一般	41,644	4.73	144	2.68
外国株式(先進国)	365,173	41.46	1,163	21.61
グローバル	248,468	28.21	809	15.03
除く日本	71,533	8.12	194	3.60
含む日本	176,935	20.09	615	11.42
その他	116,706	13.25	354	6.58
北米	910	0.10	14	0.26
米国	111,112	12.62	264	4.90
カナダ	146	0.02	2	0.04
欧州	1,615	0.18	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	2,806	0.32	23	0.43
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	38	0.00	1	0.02
エマージング株式	27,548	3.13	308	5.72
グローバル	9,283	1.05	89	1.65
BRICS	431	0.05	7	0.13
その他	17,834	2.02	212	3.94
欧州	61	0.01	6	0.11
ロシア	8	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,511	0.51	87	1.62
中国	1,892	0.21	33	0.61
インド	9,179	1.04	32	0.59
インドネシア	164	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	1,272	0.14	13	0.24
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	15	0.00	1	0.02
中南米	57	0.01	2	0.04
ブラジル	458	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	54	0.01	2	0.04
複合地域	17	0.00	2	0.04

< 4 > 純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別②

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	880,779	100.00	5,383	100.00
外国債券(先進国)	82,817	9.40	766	14.23
グローバル	67,218	7.63	523	9.72
除く日本	30,519	3.47	224	4.16
含む日本	36,699	4.17	299	5.55
その他	15,599	1.77	243	4.51
北米	77	0.01	8	0.15
米国	6,047	0.69	133	2.47
カナダ	699	0.08	4	0.07
欧州	960	0.11	31	0.58
イギリス	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,515	0.17	9	0.17
オーストラリア	5,171	0.59	36	0.67
ニュージーランド	72	0.01	9	0.17
複合地域	1,049	0.12	8	0.15
エマージング債券	10,624	1.21	258	4.79
グローバル	6,036	0.69	183	3.40
米ドル建て	4,384	0.50	141	2.62
現地通貨建て	1,652	0.19	42	0.78
その他	4,588	0.52	75	1.39
ロシア	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	239	0.03	6	0.11
インド	2,105	0.24	16	0.30
インドネシア	285	0.03	7	0.13
ブラジル	1,459	0.17	21	0.39
メキシコ	253	0.03	5	0.09
トルコ	55	0.01	4	0.07
複合地域	32	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	17,139	1.95	246	4.57
グローバル	2,539	0.29	37	0.69
北米	12,745	1.45	147	2.73
その他	1,855	0.21	62	1.15
欧州	1,421	0.16	40	0.74
アジア・オセアニア	398	0.05	21	0.39
複合地域	36	0.00	1	0.02
複合資産	132,572	15.05	1,038	19.28
安定	37,663	4.28	284	5.28
安定成長	58,776	6.67	432	8.03
成長	25,924	2.94	277	5.15
国内バランス	7,157	0.81	29	0.54
安定	6,388	0.73	9	0.17
一般	284	0.03	15	0.28
その他	3,052	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	880,779	100.00	5,383	100.00
国内REIT	26,676	3.03	135	2.51
日本	26,676	3.03	135	2.51
外国REIT	41,135	4.67	276	5.13
グローバル	16,104	1.83	150	2.79
除く日本	5,392	0.61	66	1.23
含む日本	10,712	1.22	84	1.56
北米	22,125	2.51	74	1.37
その他	2,906	0.33	52	0.97
欧州	108	0.01	10	0.19
アジア・オセアニア	2,043	0.23	26	0.48
オーストラリア	472	0.05	12	0.22
複合地域	54	0.01	3	0.06
複数国	229	0.03	1	0.02
その他	24,079	2.73	223	4.14
絶対収益型	11,643	1.32	99	1.84
ロング・ショート	796	0.09	32	0.59
マーケットニュートラル	474	0.05	13	0.24
GTAA	412	0.05	13	0.24
その他スタイル	9,873	1.12	40	0.74
CB	2,687	0.31	33	0.61
アジア・オセアニア	33	0.00	1	0.02
日本	23	0.00	1	0.02
グローバル	2,630	0.30	31	0.58
コモディティ	5,170	0.59	35	0.65
全業種	1,550	0.18	13	0.24
貴金属	3,535	0.40	20	0.37
エネルギー	66	0.01	1	0.02
その他コモディティ	19	0.00	1	0.02

< 5 > 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別①

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	13,052	10.0	1.92	2.23	1.148
国内株式	17,933	13.8	0.68	0.68	1.034
一般	16,642	13.4	0.91	0.92	1.386
フリー	16,099	12.6	0.85	0.87	1.429
バリュー	19,084	16.9	1.11	1.07	1.235
小型	23,285	14.3	0.56	0.55	1.706
その他	18,922	14.2	0.36	0.35	0.415
日経225	19,811	15.7	0.39	0.39	0.479
TOPIX	19,939	15.1	0.14	0.14	0.256
JPX日経400	17,763	8.6	0.32	0.31	0.499
国内債券	10,514	11.8	0.15	0.15	0.440
一般	10,514	11.8	0.15	0.15	0.440
外国株式(先進国)	15,236	7.6	1.68	1.87	1.259
グローバル	15,719	7.5	1.50	1.64	1.337
除く日本	22,176	10.1	0.45	0.49	0.582
含む日本	13,683	6.6	1.93	2.11	1.642
その他	14,131	7.9	2.05	2.36	1.094
北米	13,566	5.1	8.83	10.57	1.600
米国	14,708	7.1	1.89	2.17	1.063
カナダ	5,953	12.0	6.45	7.62	1.989
欧州	13,989	12.4	1.51	1.58	1.574
ドイツ	14,749	9.0	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,305	6.6	8.49	9.32	1.772
アジア・オセアニア	9,734	13.3	2.58	2.68	1.636
オーストラリア	10,061	8.2	7.76	9.27	1.822
ニュージーランド	17,618	10.7	1.10	1.14	1.672
複合地域	10,827	9.9	11.82	12.93	1.705
エマージング株式	13,067	10.7	2.19	2.47	1.628
グローバル	12,854	8.3	0.34	0.34	1.041
BRICS	13,617	16.9	0.85	0.95	2.065
その他	13,138	11.5	3.20	3.62	1.924
欧州	5,918	16.8	0.30	0.28	1.964
ロシア	944	13.9	0.00	0.00	1.169
アジア・オセアニア	14,361	12.6	2.17	2.39	1.683
中国	14,288	8.4	0.50	0.54	1.938
インド	14,542	11.6	4.66	5.26	2.041
インドネシア	12,772	13.0	3.67	3.65	1.834
タイ	13,619	11.0	1.63	1.59	1.818
フィリピン	11,103	10.6	0.61	0.64	1.730
ベトナム	14,173	5.7	0.90	1.19	1.905
韓国	12,487	4.3	0.00	0.00	1.804
香港	13,869	13.6	1.65	1.66	0.858
中南米	9,122	16.2	0.00	0.00	2.042
ブラジル	5,187	12.1	3.22	4.34	1.950
メキシコ	12,192	10.0	1.91	1.64	1.667
中東・アフリカ	12,437	11.7	0.28	0.36	2.086
トルコ	11,973	21.7	0.00	0.00	2.029
複合地域	21,180	14.8	1.65	1.75	1.941

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載の実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

< 5 > 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別②

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	13,052	10.0	1.92	2.23	1.148
外国債券(先進国)	9,742	10.4	1.35	1.50	0.984
グローバル	10,205	10.4	1.05	1.14	0.919
除く日本	11,250	12.7	0.94	0.99	0.692
含む日本	9,422	8.7	1.15	1.27	1.107
その他	8,747	10.5	2.63	3.01	1.264
北米	9,702	6.7	2.39	2.60	1.666
米国	9,486	8.9	2.82	3.53	1.251
カナダ	7,062	12.2	1.60	1.63	1.378
欧州	7,164	13.0	1.66	1.78	1.154
イギリス	7,099	7.9	3.76	4.14	1.306
アジア・オセアニア	8,795	13.0	2.41	2.55	1.425
オーストラリア	8,314	14.3	2.86	3.10	1.245
ニュージーランド	8,913	8.7	1.46	1.58	1.358
複合地域	5,208	12.9	2.31	2.46	1.196
エマージング債券	8,516	11.3	4.15	4.28	1.451
グローバル	8,560	11.7	2.95	3.11	1.324
米ドル建て	8,395	12.2	3.19	3.41	1.456
現地通貨建て	9,115	10.1	2.30	2.28	0.976
その他	8,409	10.2	5.72	5.82	1.619
ロシア	893	10.1	0.00	0.00	1.595
アジア・オセアニア	9,349	12.3	6.65	7.00	1.628
インド	9,361	8.6	6.53	6.95	1.703
インドネシア	9,070	10.4	5.68	5.60	1.672
ブラジル	9,125	13.6	4.78	4.63	1.580
メキシコ	7,723	10.1	5.89	5.02	1.381
トルコ	1,960	10.0	6.96	6.02	1.460
複合地域	3,752	16.6	2.09	1.87	1.210
ハイイールド債券	8,966	12.0	5.33	5.61	1.666
グローバル	7,476	10.9	3.41	3.55	1.477
北米	10,198	12.9	5.42	5.65	1.689
その他	6,936	10.4	7.39	8.16	1.767
欧州	7,184	10.0	6.74	7.38	1.739
アジア・オセアニア	6,588	11.0	9.92	11.16	1.867
複合地域	4,293	19.0	5.29	5.59	1.800
複合資産	12,592	9.3	1.02	1.11	0.959
安定	11,100	9.2	0.90	0.97	1.080
安定成長	12,307	9.8	1.34	1.47	0.969
成長	14,883	8.9	0.15	0.15	0.786
国内バランス	11,641	10.4	2.05	2.18	0.943
安定	10,524	11.7	2.19	2.34	0.917
一般	12,356	11.0	0.95	0.96	1.281
その他	8,821	3.0	1.24	1.60	0.752

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

< 5 > 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別③

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	13,052	10.0	1.92	2.23	1.148
国内REIT	13,317	10.0	8.78	11.28	0.923
日本	13,317	10.0	8.78	11.28	0.923
外国REIT	11,224	9.0	7.53	9.86	1.487
グローバル	12,270	8.8	3.15	3.97	1.254
除く日本	13,514	6.9	1.96	2.55	0.922
含む日本	11,292	10.2	3.75	4.68	1.421
北米	10,569	9.7	10.85	14.39	1.621
その他	9,139	8.8	6.50	7.96	1.753
欧州	5,806	9.1	4.49	5.74	1.819
アジア・オセアニア	10,804	8.2	7.87	9.58	1.798
オーストラリア	8,765	8.5	3.90	5.03	1.702
複合地域	6,898	11.1	0.73	0.97	0.777
複数国	10,412	18.9	1.94	2.31	1.650
その他					
絶対収益型	10,065	6.0	0.02	0.02	1.904
ロング・ショート	10,036	5.2	0.29	0.30	1.453
マーケットニュートラル	9,662	5.5	0.00	0.00	1.283
GTAA	10,839	9.3	0.02	0.02	1.488
その他スタイル	9,915	5.8	0.00	0.00	1.992
CB	11,784	8.9	0.73	0.83	1.185
アジア・オセアニア	9,921	12.8	2.36	2.42	1.823
日本	13,409	23.3	0.37	0.37	0.770
グローバル	11,792	8.4	0.67	0.78	1.181
コモディティ	11,982	7.2	0.39	0.51	0.909
全業種	9,729	10.8	1.31	1.70	1.296
貴金属	12,993	4.6	0.00	0.00	0.738
エネルギー	16,676	14.1	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	16,332	6.5	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 青木、川眞田

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