

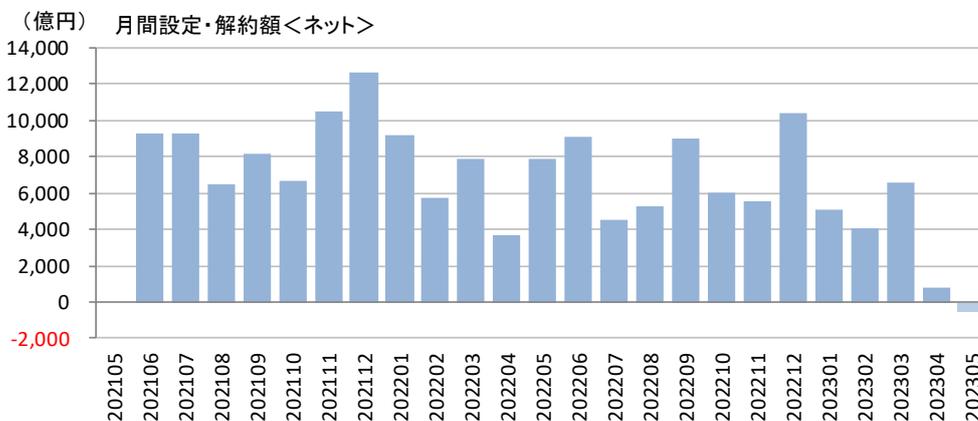
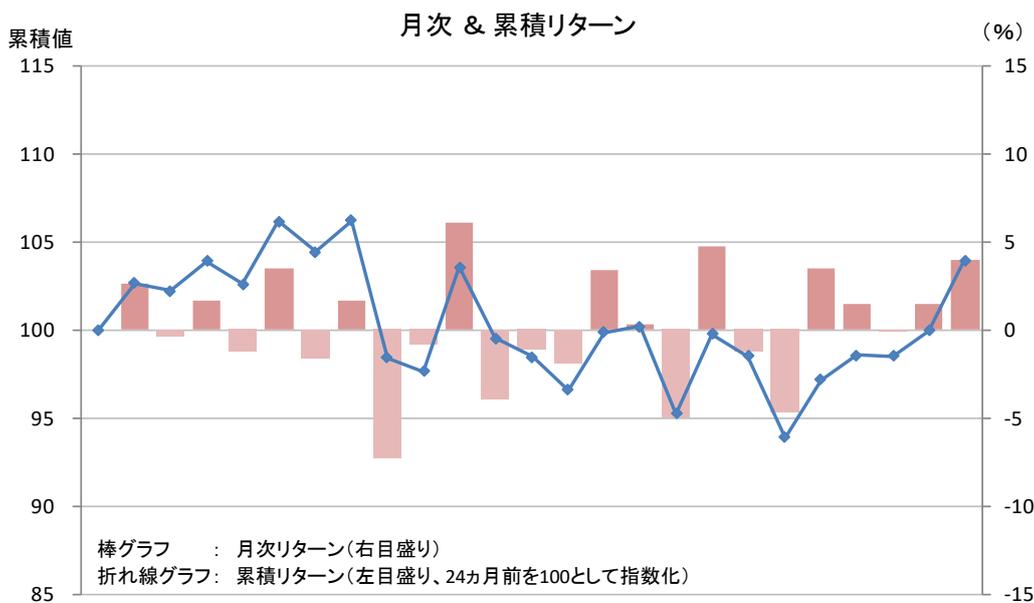
# 投信指数 MAB-FPI

## パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

### 2023年5月

**「総合」 +4.01 %**  
**(前月 +1.45 %)**



# 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		16,400	15,769	632	4.01	
国内株式		21,741	20,789	952	4.58	
一般		21,084	20,177	907	4.49	
フリー		19,715	18,806	909	4.83	
バリュー		27,563	26,669	895	3.36	
小型		40,790	40,452	339	0.84	
その他		21,897	20,799	1,098	5.28	
日経225		21,280	19,879	1,401	7.05	
TOPIX		21,423	20,682	741	3.58	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	20,348	19,498	850	4.36	
国内債券		12,637	12,613	23	0.18	
一般		12,637	12,613	23	0.18	
外国株式(先進国)		22,035	20,722	1,314	6.34	
グローバル		23,801	22,443	1,357	6.05	
除く日本		37,654	35,998	1,655	4.60	
含む日本		20,841	19,541	1,300	6.65	
その他		18,271	17,084	1,187	6.95	
北米		22,903	21,631	1,272	5.88	
米国		28,371	26,469	1,902	7.19	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	20,880	20,937	-57	-0.27	
欧州		25,625	25,325	300	1.18	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	12,745	12,582	163	1.29	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	10,878	11,091	-212	-1.92	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	39,417	38,763	654	1.69	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	20,079	19,745	335	1.70	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	46,717	45,723	994	2.17	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	13,139	13,350	-210	-1.58	
エマージング株式		19,142	18,126	1,016	5.60	
グローバル		18,955	18,126	829	4.58	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	22,835	22,305	530	2.38	
その他		20,040	18,871	1,169	6.20	
欧州		13,286	13,022	264	2.02	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,066	1,087	-20	-1.88	
アジア・オセアニア		18,494	17,762	733	4.12	
中国		38,512	39,039	-527	-1.35	
インド	10,000 (2004.09.30)	52,075	48,020	4,056	8.45	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	17,765	17,442	322	1.85	
タイ		23,795	23,317	478	2.05	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,800	7,700	100	1.30	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	21,577	20,167	1,410	6.99	
韓国	10,000 (1997.06.30)	31,054	27,217	3,837	14.10	
香港		21,084	21,453	-370	-1.72	
中南米	7,427 (2006.04.28)	10,967	10,071	896	8.89	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,096	8,357	739	8.84	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	15,873	15,361	512	3.33	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	12,680	12,745	-65	-0.51	
トルコ		34,868	34,818	50	0.14	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	25,617	24,627	990	4.02	

※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		16,400	15,769	632	4.01
外国債券(先進国)		18,341	18,154	187	1.03
グローバル		18,353	18,165	188	1.04
除く日本		20,173	19,838	335	1.69
含む日本		17,188	17,102	86	0.50
その他		18,507	18,322	185	1.01
北米	9,052 (2013.05.31)	10,492	10,357	135	1.30
米国		17,262	17,241	21	0.12
カナダ	10,000 (2003.05.30)	16,499	16,022	477	2.98
欧州	10,000 (1998.07.31)	13,837	13,760	77	0.56
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,395	10,357	38	0.36
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	20,688	20,408	281	1.38
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	25,562	25,179	383	1.52
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,215	11,078	137	1.24
複合地域	10,000 (2001.11.30)	18,491	18,037	455	2.52
エマージング債券		19,195	18,544	652	3.51
グローバル		19,046	18,519	527	2.85
米ドル建て		19,251	18,728	523	2.79
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	14,029	13,622	407	2.99
その他	8,647 (2005.03.31)	15,660	15,004	657	4.38
ロシア	10,000 (2008.05.30)	569	518	51	9.88
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	15,616	15,320	296	1.93
インド	10,000 (2011.08.31)	20,339	19,606	733	3.74
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	19,369	18,691	678	3.63
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	15,094	14,312	782	5.46
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	18,717	17,476	1,241	7.10
トルコ	10,000 (2011.04.28)	3,726	3,367	360	10.68
複合地域	10,000 (2006.08.31)	11,492	11,123	369	3.32
ハイイールド債券		26,232	25,534	699	2.74
グローバル	10,000 (1997.06.30)	24,501	24,047	454	1.89
北米		26,583	25,815	767	2.97
その他	10,000 (2004.03.31)	23,505	22,996	509	2.21
欧州	10,000 (2006.04.28)	23,958	23,332	626	2.68
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,240	14,168	72	0.51
複合地域	10,000 (2004.03.31)	23,135	22,587	548	2.43
複合資産		19,228	18,893	335	1.78
安定	10,000 (1998.10.30)	15,945	15,747	198	1.25
安定成長		21,298	20,888	410	1.96
成長		26,583	25,871	712	2.75
国内バランス		12,452	12,431	20	0.16
安定		12,595	12,598	-4	-0.03
一般		16,638	16,319	319	1.95
その他	10,000 (2018.10.31)	11,849	11,873	-24	-0.20

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

[色塗りの基準]月次リターン&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		16,400	15,769	632	4.01
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	34,918	34,621	297	0.86
日本	10,000 (2003.10.31)	34,918	34,621	297	0.86
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	32,464	32,101	363	1.13
グローバル	10,000 (2004.01.30)	26,902	26,582	320	1.21
除く日本	10,000 (2004.04.30)	30,110	29,648	462	1.56
含む日本	10,000 (2004.01.30)	26,685	26,416	268	1.02
北米	10,000 (2003.09.30)	34,238	33,836	402	1.19
その他	10,000 (2004.04.30)	29,640	29,554	86	0.29
欧州	10,000 (2006.12.29)	4,823	4,925	-102	-2.07
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	21,958	22,017	-59	-0.27
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	16,711	16,255	456	2.80
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,187	7,231	-43	-0.60
複数国	10,000 (2004.04.30)	43,731	43,139	593	1.37
その他		6,541	6,383	158	2.48
絶対収益型		7,411	7,416	-5	-0.07
ロング・ショート		8,235	8,222	13	0.15
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,315	11,172	143	1.28
GTAA		11,384	11,471	-86	-0.75
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	6,945	6,955	-9	-0.13
CB		19,822	19,628	193	0.98
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	20,973	20,516	457	2.23
日本		19,858	19,647	211	1.07
グローバル		34,583	34,251	332	0.97
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	12,055	11,995	60	0.50
全業種	10,000 (2004.12.30)	10,838	10,708	130	1.21
貴金属	10,000 (2009.07.31)	20,490	20,445	44	0.22
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	8,646	8,713	-67	-0.77
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	14,757	14,931	-174	-1.16

※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	5.47	5.50	5.59	10.72
国内株式	8.69	7.95	12.95	14.24
一般	8.04	7.69	12.71	13.58
フリー	8.39	7.68	12.80	13.80
バリュー	6.85	7.78	12.40	12.83
小型	1.72	-1.10	8.04	5.29
その他	10.80	9.85	14.09	16.67
日経225	13.52	11.51	15.21	19.37
TOPIX	8.14	8.72	14.16	13.94
JPX日経400	8.75	9.28	14.67	14.64
国内債券	1.53	0.57	-2.28	2.06
一般	1.53	0.57	-2.28	2.06
外国株式(先進国)	7.83	9.44	9.78	16.38
グローバル	6.81	9.15	8.97	15.76
除く日本	6.53	7.58	10.17	14.15
含む日本	6.93	9.79	8.53	16.41
その他	10.03	10.01	11.56	17.68
北米	7.07	5.76	11.93	12.86
米国	10.44	10.39	12.02	18.16
カナダ	-2.62	-4.78	-6.67	1.53
欧州	4.92	10.52	12.05	13.69
ドイツ	6.32	14.68	17.89	18.50
イギリス	-2.47	-0.49	1.63	1.34
アジア・オセアニア	0.86	1.90	0.88	5.88
オーストラリア	-0.52	-2.11	-2.04	4.61
ニュージーランド	0.16	2.29	9.37	2.02
複合地域	-7.47	-13.73	-10.38	-5.06
エマージング株式	5.32	3.17	5.11	7.89
グローバル	3.92	4.96	4.99	8.89
BRICS	0.11	-2.23	-2.83	1.39
その他	6.16	2.35	5.30	7.50
欧州	10.41	17.14	26.06	16.42
ロシア	-20.94	-26.22	-23.65	-19.26
アジア・オセアニア	2.49	4.07	1.97	7.63
中国	-5.45	-1.53	-4.44	-2.21
インド	9.91	0.67	11.51	8.37
インドネシア	5.06	4.10	8.40	12.04
タイ	0.30	-0.77	3.08	-0.90
フィリピン	1.15	-1.16	-4.12	4.88
ベトナム	8.01	10.64	-10.21	11.23
韓国	17.83	14.40	-0.53	21.83
香港	-3.89	2.35	-2.28	-1.20
中南米	7.50	7.20	7.82	13.15
ブラジル	7.61	1.50	-3.54	8.01
メキシコ	7.75	15.43	24.95	23.75
中東・アフリカ	1.66	-6.82	-9.41	0.17
トルコ	-8.29	-3.88	57.55	-10.64
複合地域	2.72	5.14	3.98	9.50

※[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	5.47	5.50	5.59	10.72
外国債券(先進国)	1.80	0.37	-0.80	3.33
グローバル	1.88	0.52	-0.86	3.21
除く日本	3.28	0.94	0.07	4.99
含む日本	0.74	0.21	-1.63	1.76
その他	1.45	-0.22	-0.61	3.90
北米	1.52	1.30	-1.42	3.29
米国	1.57	-0.49	-0.58	3.17
カナダ	2.96	0.79	0.82	5.54
欧州	1.45	-0.27	-3.11	2.43
イギリス	2.78	1.25	-1.14	7.00
アジア・オセアニア	0.91	-0.47	-0.35	4.10
オーストラリア	0.75	-0.29	-0.17	4.31
ニュージーランド	2.79	-1.31	-1.41	3.06
複合地域	4.11	1.51	-1.20	5.88
エマージング債券	5.32	5.71	8.36	9.04
グローバル	3.65	4.31	5.61	6.94
米ドル建て	2.92	3.43	3.81	5.99
現地通貨建て	5.64	6.70	10.81	9.56
その他	7.51	7.57	11.81	11.83
ロシア	-53.72	-62.07	-44.37	-52.63
アジア・オセアニア	2.39	3.99	5.36	5.83
インド	5.39	2.90	7.96	8.35
インドネシア	7.70	11.27	15.44	14.65
ブラジル	12.77	14.85	16.24	18.09
メキシコ	10.37	14.49	27.21	19.63
トルコ	-7.54	-0.66	25.95	-0.94
複合地域	7.04	9.52	18.12	12.11
ハイイールド債券	2.78	3.49	6.00	7.26
グローバル	2.23	4.05	3.79	5.94
北米	3.15	3.21	6.70	7.63
その他	0.98	4.24	5.03	6.35
欧州	1.62	3.97	5.67	6.91
アジア・オセアニア	-1.43	5.58	2.69	4.36
複合地域	2.91	3.80	6.25	6.80
複合資産	3.37	2.53	1.78	6.15
安定	2.13	1.14	-0.38	3.86
安定成長	3.70	3.02	2.71	6.79
成長	4.67	4.58	5.84	9.04
国内バランス	1.65	0.07	-1.71	1.80
安定	1.39	-0.30	-2.29	1.36
一般	4.26	3.69	4.31	6.55
その他	4.86	-1.41	-10.90	9.32

※[色塗りの基準]期間別リターン&gt;総合

## ＜1＞パフォーマンス・サマリー

## (2) 期間別リターン

## 「総合」およびファンド分類別③

	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	5.47	5.50	5.59	10.72
国内REIT	2.61	-2.52	-2.30	1.12
日本	2.61	-2.52	-2.30	1.12
外国REIT	-2.71	-2.08	-6.87	4.13
グローバル	-3.00	-1.93	-7.70	3.89
除く日本	-3.54	-1.82	-7.74	3.98
含む日本	-2.72	-1.97	-7.67	3.86
北米	-2.60	-2.33	-6.41	4.51
その他	-1.92	-1.05	-5.66	2.58
欧州	-7.00	-1.95	-16.87	-0.45
アジア・オセアニア	-1.60	-0.78	-4.89	2.46
オーストラリア	-1.91	-1.12	-5.47	3.52
複合地域	-4.04	-3.12	-5.13	0.93
複数国	-1.69	-2.33	-6.81	3.49
その他	5.84	5.40	0.78	8.72
絶対収益型	-0.10	-1.04	-4.17	0.00
ロング・ショート	0.74	0.77	-0.63	1.71
マーケットニュートラル	1.07	0.24	-0.50	0.22
GTAA	0.34	-1.16	-2.02	0.57
その他スタイル	-0.21	-1.21	-4.78	-0.14
CB	0.13	2.38	-0.74	3.43
アジア・オセアニア	3.12	7.54	4.03	7.42
日本	1.14	0.36	0.87	1.87
グローバル	0.08	2.34	-0.94	3.40
コモディティ	4.77	3.81	-1.25	4.58
全業種	-1.89	-7.63	-14.52	-3.71
貴金属	8.21	10.15	6.80	8.88
エネルギー	-3.18	-7.06	-15.90	-2.85
その他コモディティ	-2.94	-9.42	-11.65	-3.43

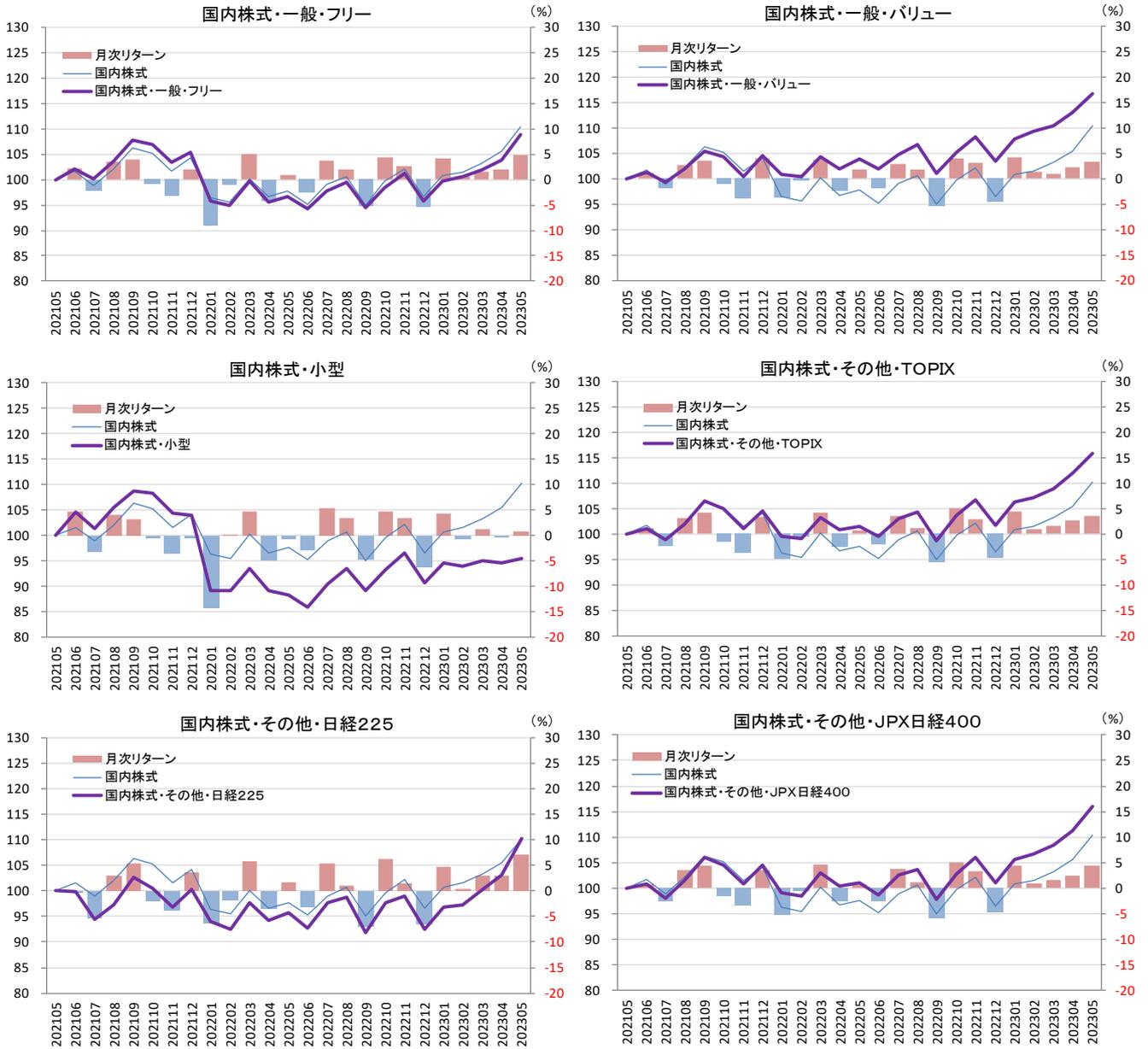
※[色塗りの基準]期間別リターン&gt;総合

<1>パフォーマンス・サマリー

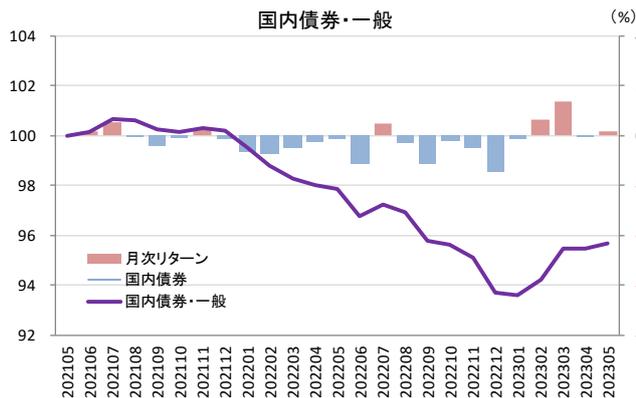
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

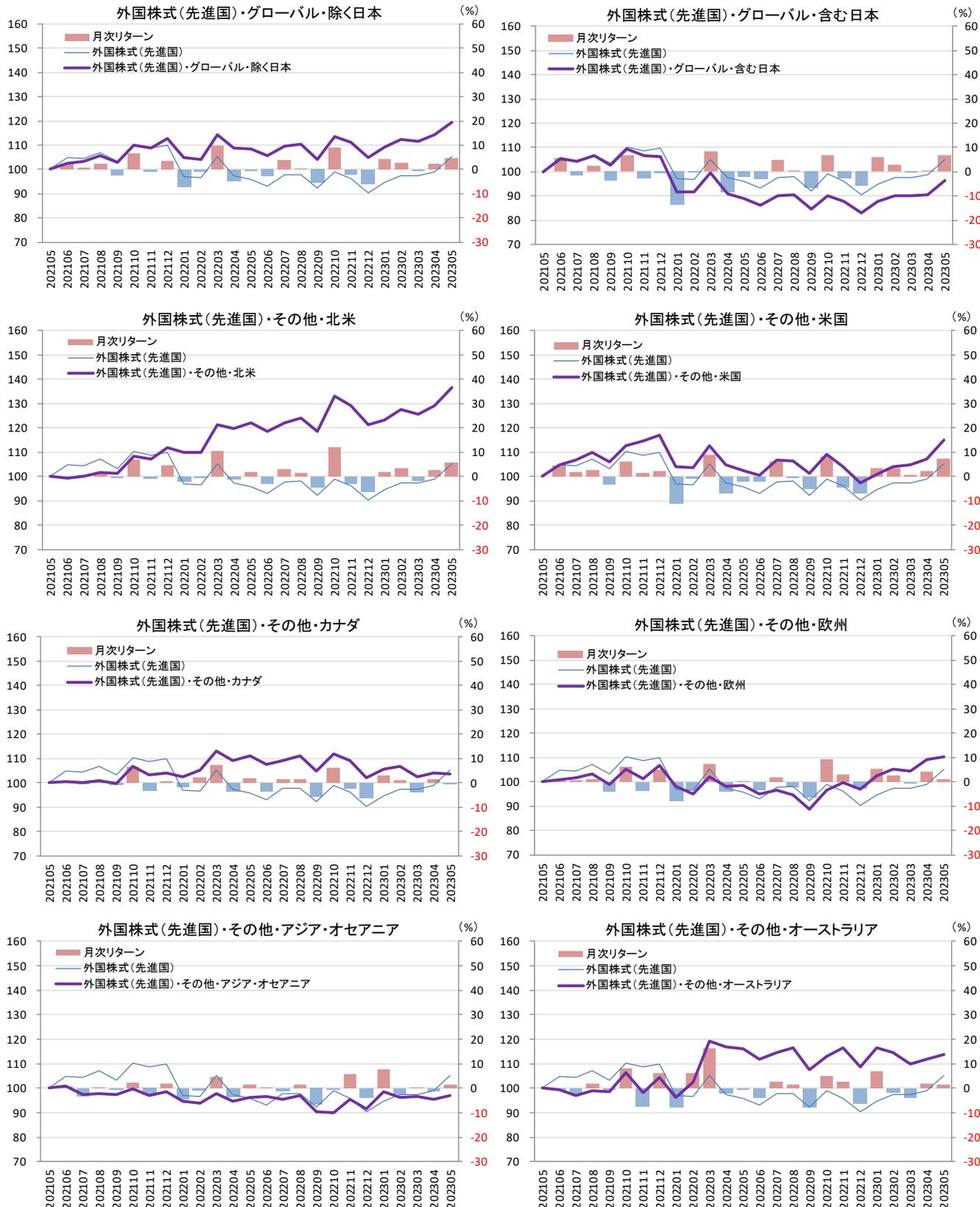


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

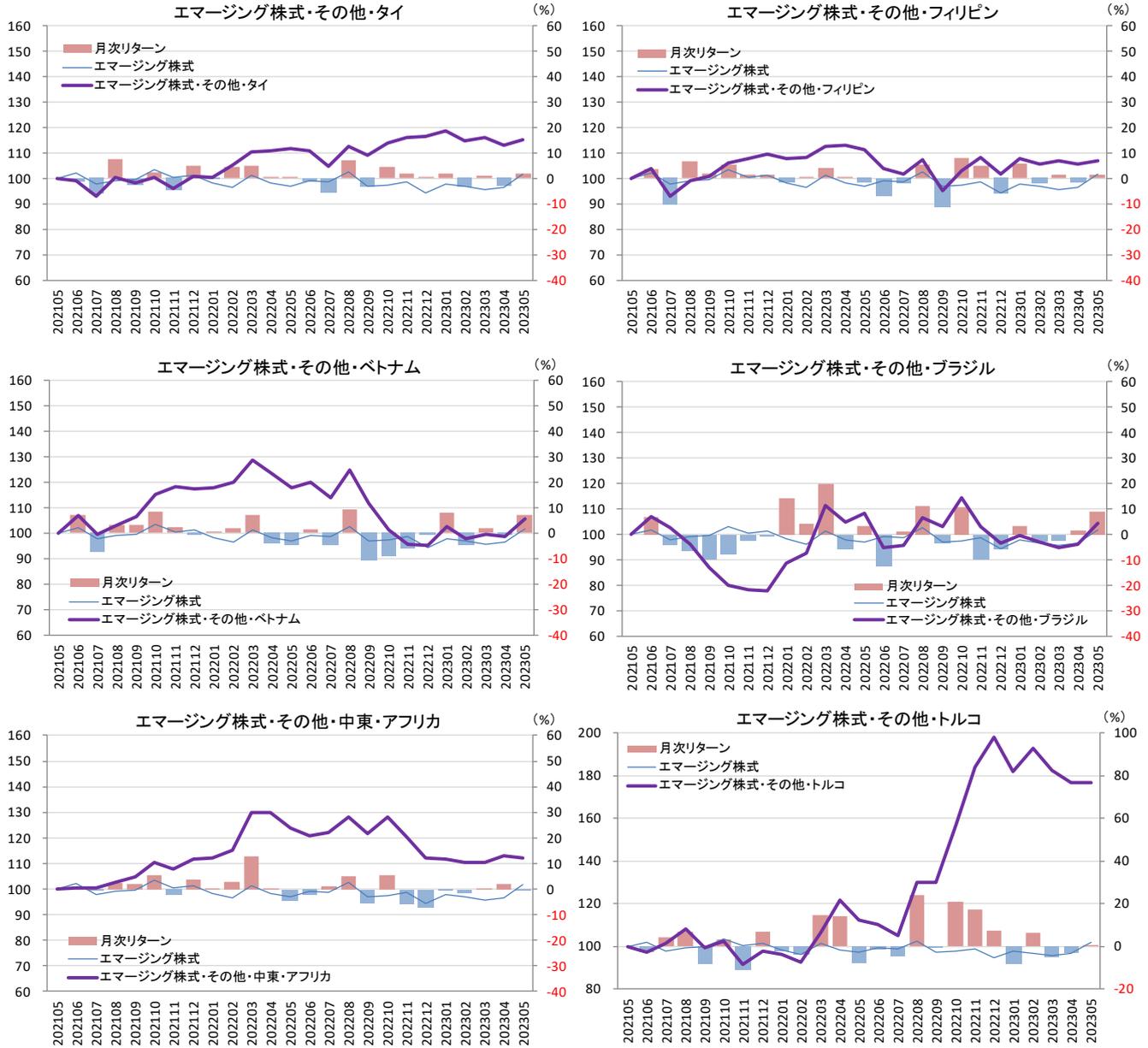


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

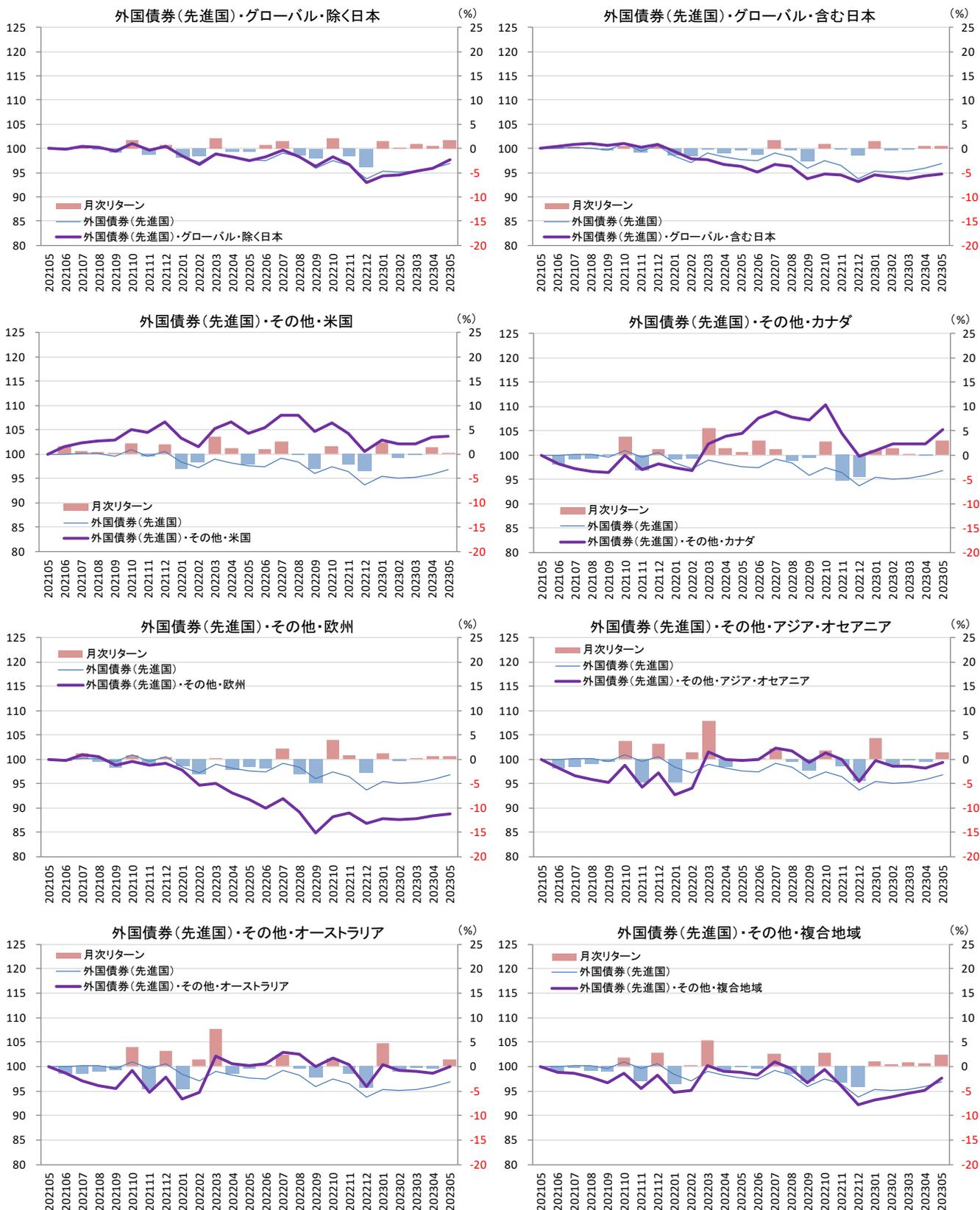


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

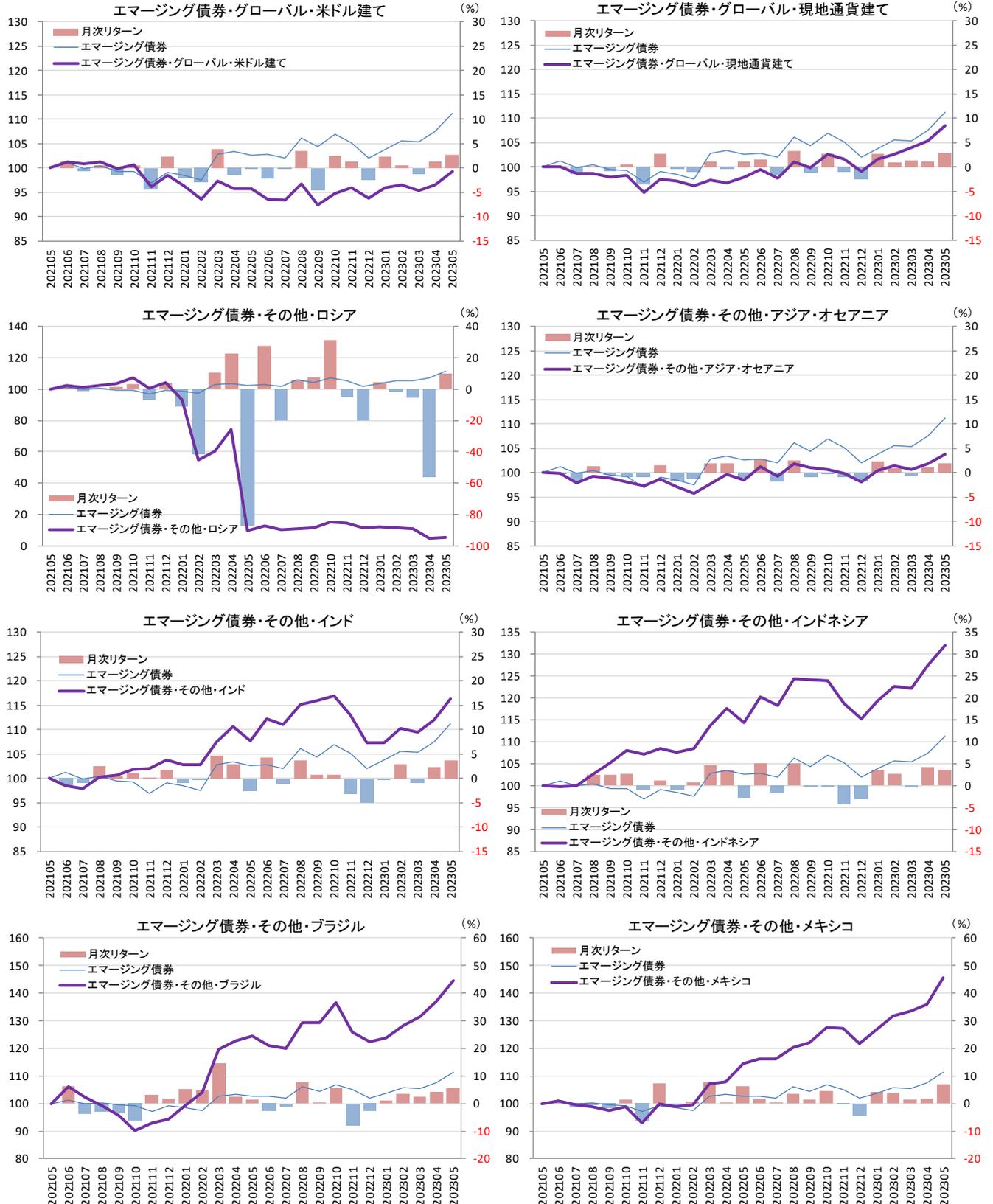


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマーシング債券]

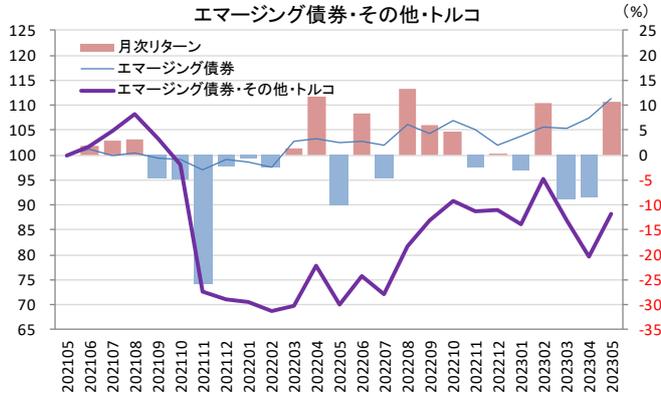


<1>パフォーマンス・サマリー

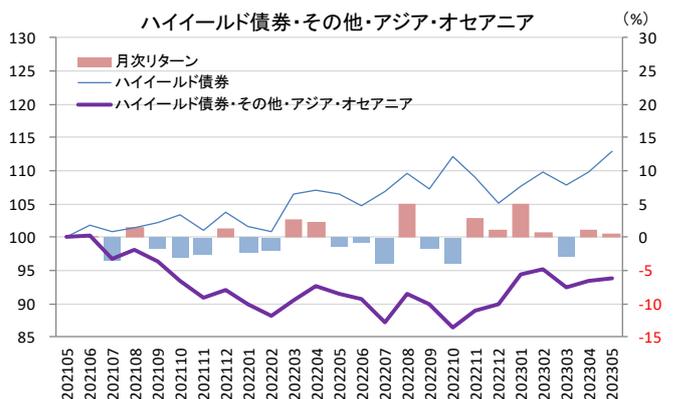
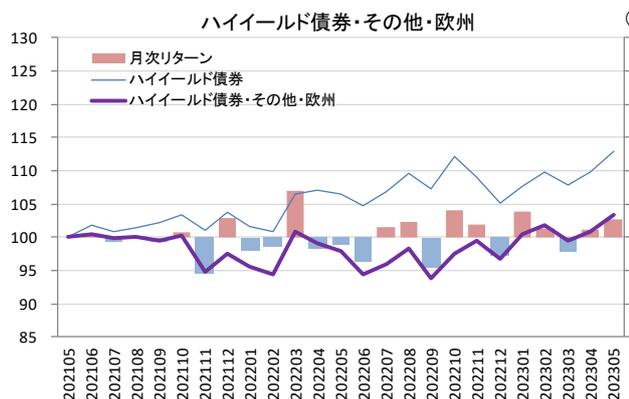
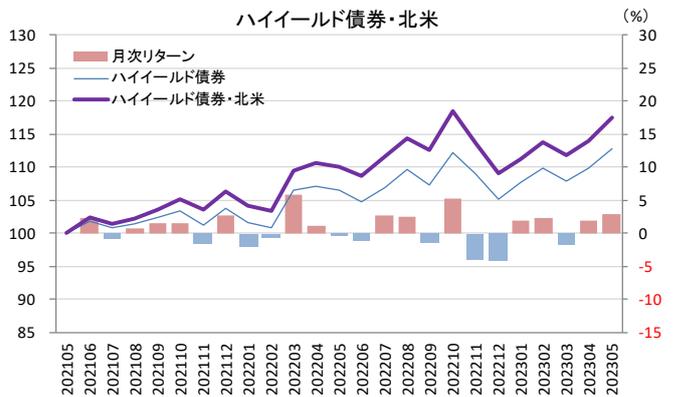
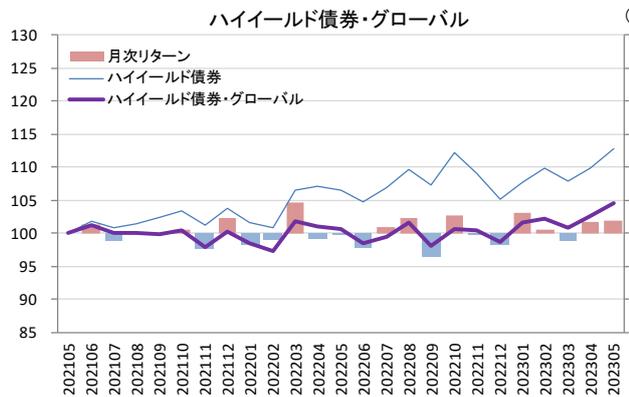
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

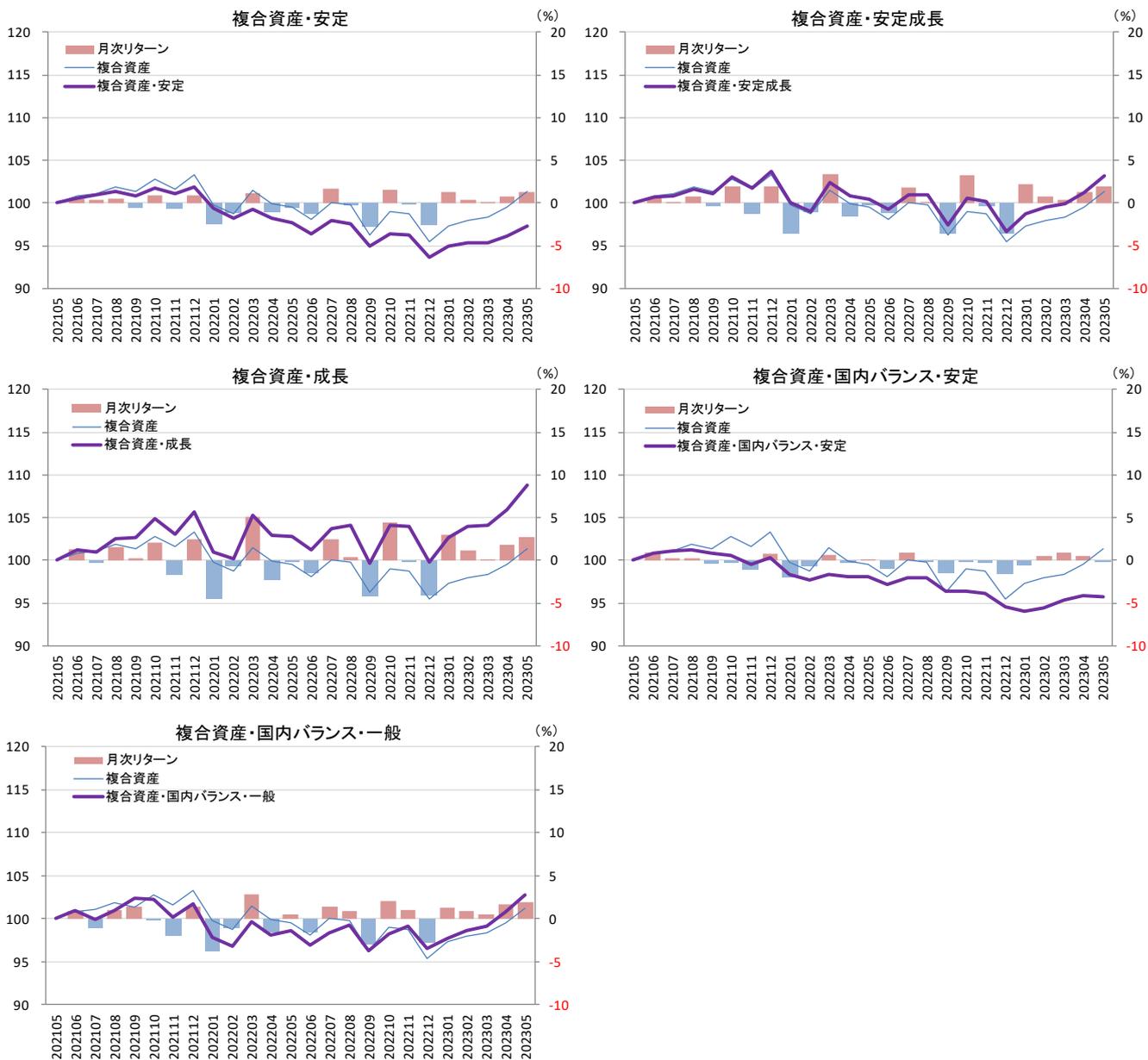


<1>パフォーマンス・サマリー

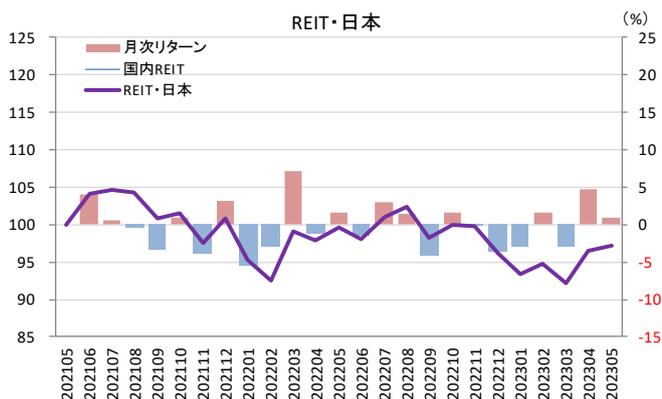
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

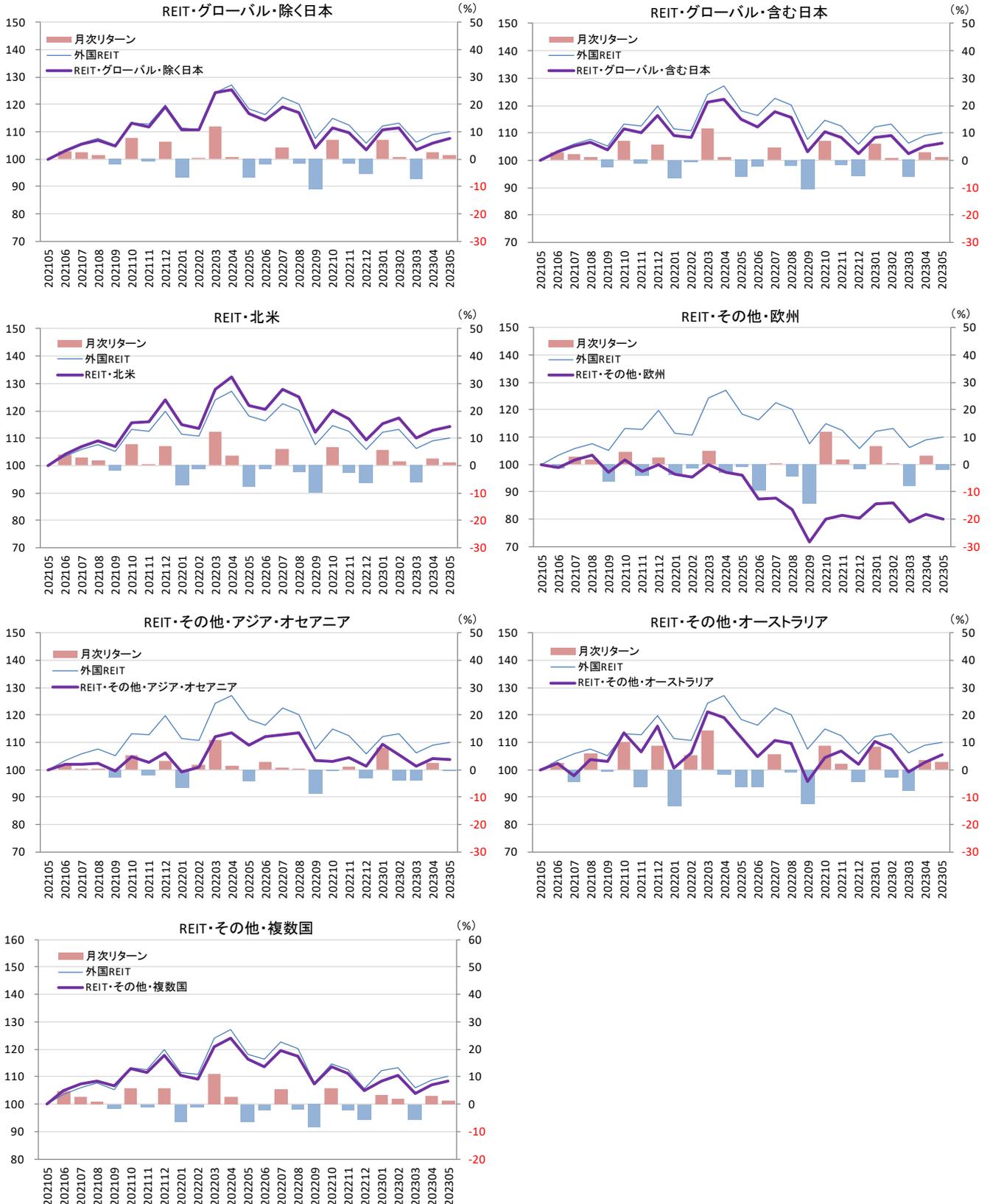


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

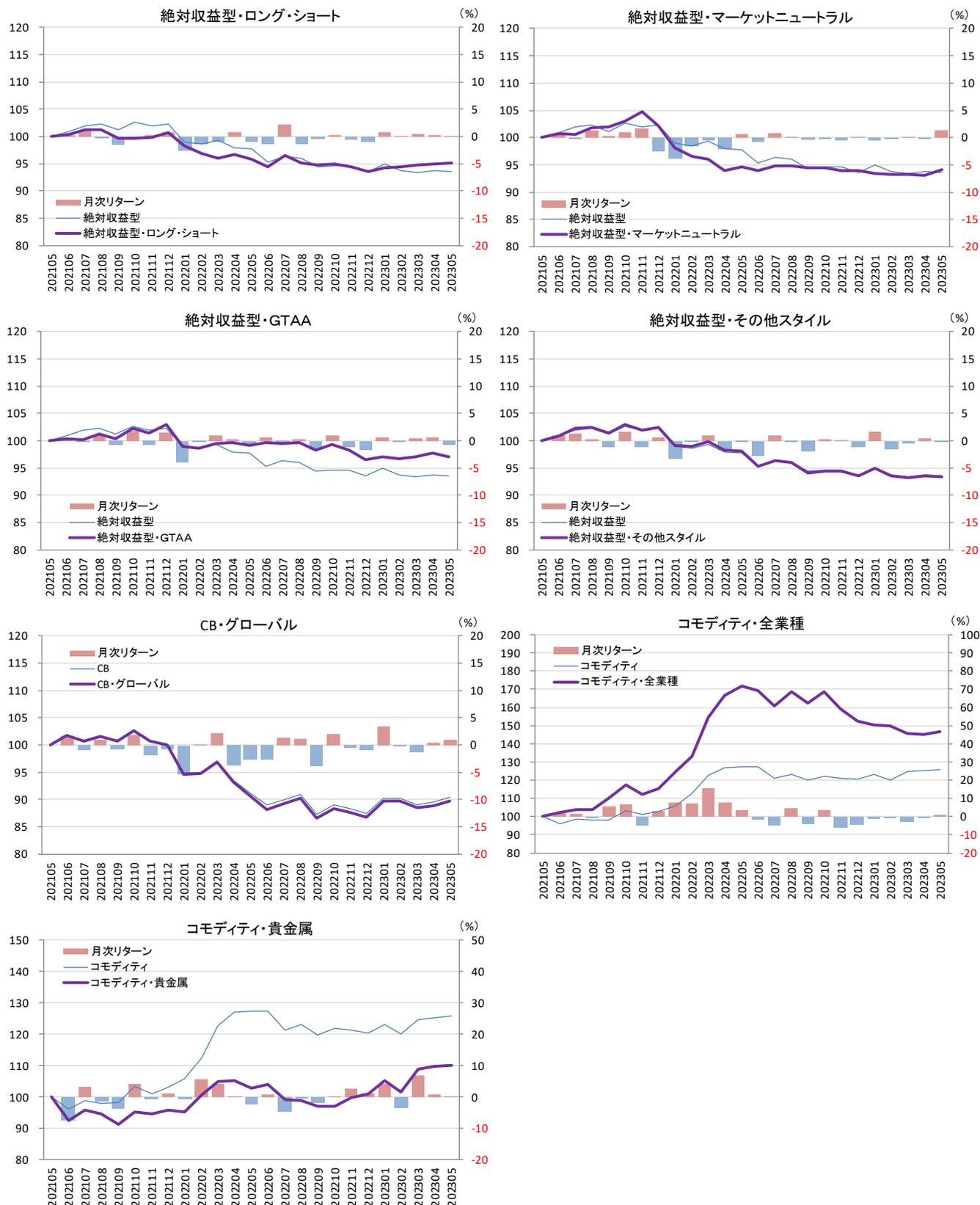


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]





## ＜1＞パフォーマンス・サマリー

## (4) 対「総合」寄与度分析

## ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	4.01		
1	外国株式(先進国)・グローバル	6.05	28.40	1.70
2	外国株式(先進国)・その他	6.95	13.51	0.93
3	国内株式・一般	4.49	7.08	0.32
4	国内株式・その他	5.28	4.80	0.25
5	複合資産・安定成長	1.96	6.62	0.13
6	エマージング株式・その他	6.20	2.09	0.13
7	複合資産・成長	2.75	2.98	0.08
8	外国債券(先進国)・グローバル	1.04	7.49	0.08
9	ブルベア	11.92	0.53	0.06
10	複合資産・安定	1.25	4.17	0.05
11	エマージング株式・グローバル	4.58	1.05	0.05
12	ハイイールド債券・北米	2.97	1.46	0.04
13	REIT・北米	1.19	2.50	0.03
14	REIT・日本	0.86	3.04	0.03
15	REIT・グローバル	1.21	1.86	0.02
16	エマージング債券・その他	4.38	0.52	0.02
17	エマージング債券・グローバル	2.85	0.67	0.02
18	外国債券(先進国)・その他	1.01	1.78	0.02
19	国内債券・一般	0.18	4.45	0.01
20	国内株式・小型	0.84	0.76	0.01
21	国内株式・業種特化	6.90	0.08	0.01
22	ハイイールド債券・グローバル	1.89	0.28	0.01
23	ハイイールド債券・その他	2.21	0.20	0.00
24	CB	0.98	0.30	0.00
25	コモディティ	0.50	0.59	0.00
26	複合資産・国内バランス	0.16	0.78	0.00
27	エマージング株式・BRICS	2.38	0.05	0.00
28	REIT・その他	0.29	0.33	0.00
29	複合資産・その他	-0.20	0.34	-0.00
30	絶対収益型	-0.07	1.26	-0.00
	合計		100.00	4.01

## ◆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

## &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

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	5.59		
1	外国株式(先進国)・グローバル	8.97	27.91	2.58
2	外国株式(先進国)・その他	11.56	12.85	1.60
3	国内株式・一般	12.71	6.78	0.82
4	国内株式・その他	14.09	4.71	0.68
5	複合資産・安定成長	2.71	6.66	0.19
6	複合資産・成長	5.84	2.80	0.18
7	ブルベア	15.99	0.49	0.10
8	エマージング株式・その他	5.30	2.08	0.09
9	ハイイールド債券・北米	6.70	1.43	0.08
10	国内株式・小型	8.04	0.77	0.06
11	エマージング債券・その他	11.81	0.56	0.06
12	エマージング株式・グローバル	4.99	1.06	0.05
13	エマージング債券・グローバル	5.61	0.70	0.04
14	ハイイールド債券・グローバル	3.79	0.30	0.01
15	ハイイールド債券・その他	5.03	0.22	0.01
16	国内株式・業種特化	9.38	0.08	0.01
17	CB	-0.74	0.21	-0.00
18	エマージング株式・BRICS	-2.83	0.05	-0.00
19	外国債券(先進国)・その他	-0.61	1.82	-0.01
20	コモディティ	-1.25	0.57	-0.02
21	複合資産・国内バランス	-1.71	0.89	-0.02
22	REIT・その他	-5.66	0.36	-0.03
23	複合資産・安定	-0.38	4.43	-0.04
24	複合資産・その他	-10.90	0.36	-0.05
25	絶対収益型	-4.17	1.35	-0.07
26	外国債券(先進国)・グローバル	-0.86	7.63	-0.08
27	REIT・日本	-2.30	3.23	-0.12
28	国内債券・一般	-2.28	4.92	-0.16
29	REIT・北米	-6.41	2.74	-0.18
30	REIT・グローバル	-7.70	2.03	-0.18
	合計		100.00	5.59

## ◆計算定義

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

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

## <2>リスク・サマリー

### (1) 期間別リスク・リターン

#### 「総合」およびファンド分類別①

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	30.42	30.27	61.25	10.61 ↓	11.89	10.72	0.88	0.46	0.46
国内株式	41.73	31.57	120.41	13.21 ↓	16.08	15.44	0.94	0.35	0.53
一般	41.30	29.11	110.09	12.72 ↓	15.85	15.53 ↓	0.96	0.33	0.50
フリー	39.21	28.45	106.33	13.11 ↓	16.23	15.96 ↓	0.89	0.32	0.47
バリュー	48.60	30.76	120.87	12.14 ↓	14.94	14.50	1.17	0.37	0.57
小型	21.16	11.08	143.78	15.65 ↓	19.52	16.96 ↓	0.42	0.11	0.55
その他	46.07	42.12	137.61	14.16 ↓	15.99	15.41	0.95	0.46	0.59
日経225	47.09	49.89	154.55	15.74 ↓	17.15	16.19	0.87	0.49	0.61
TOPIX	45.34	35.78	127.05	12.98 ↓	15.07	14.73	1.03	0.42	0.58
JPX日経400	45.47	37.83	-	13.51 ↓	15.30	-	0.99	0.44	-
国内債券	-4.52	-3.62	4.34	1.92	2.02	1.80	-0.78	-0.35	0.24
一般	-4.52	-3.62	4.34	1.92	2.02	1.80	-0.78	-0.35	0.24
外国株式(先進国)	48.76	59.75	119.89	16.39	18.27	15.99	0.87	0.54	0.51
グローバル	45.00	56.22	125.59	16.59	18.39	15.95	0.80	0.51	0.53
除く日本	73.20	78.21	177.65	15.20	17.93	16.46	1.32	0.69	0.65
含む日本	37.10	49.83	111.94	17.46	18.82	16.04	0.64	0.45	0.49
その他	58.82	68.56	108.62	16.34	18.25	16.33	1.02	0.61	0.47
北米	111.22	105.42	173.97	15.05	19.23	17.43	1.88	0.81	0.61
米国	58.79	80.99	139.50	16.55	18.07	16.68	1.01	0.70	0.55
カナダ	47.55	24.40	12.98	13.25 ↓	18.78	16.05	1.05	0.24	0.08
欧州	52.56	44.05	88.08	15.81 ↓	18.14	16.22	0.96	0.42	0.40
ドイツ	62.93	37.43	-	20.50 ↓	22.61	-	0.86	0.29	-
イギリス	51.86	17.96	-	13.96	17.46	-	1.07	0.19	-
アジア・オセアニア	30.56	19.48	71.35	11.28 ↓	15.24	14.97	0.83	0.24	0.37
オーストラリア	62.44	30.37	50.72	19.61 ↓	23.92	19.87	0.90	0.23	0.21
ニュージーランド	45.03	55.58	199.62	16.38 ↓	17.96	17.71	0.81	0.52	0.66
複合地域	141.98	19.97	28.75	29.28	33.43	26.52	1.17	0.11	0.10
エマージング株式	56.52	30.55	60.81	12.44	18.03	16.84	1.30	0.31	0.29
グローバル	45.92	34.90	49.18	13.56	18.08	16.96	0.99	0.34	0.24
BRICS	17.59	6.34	41.42	15.02 ↓	20.58	19.51	0.37	0.06	0.18
その他	62.69	30.11	66.95	12.37	18.46	17.08	1.43	0.29	0.31
欧州	-38.13	-42.89	-43.18	34.81 ↓	32.85	27.11	-0.42	-0.32	-0.20
ロシア	-88.64	-87.63	-85.34	57.23	48.69	38.68	-0.90	-0.70	-0.45
アジア・オセアニア	36.05	14.83	46.12	14.41	17.79	16.28	0.75	0.16	0.24
中国	8.36	13.40	102.50	21.31	21.76	21.55	0.13	0.12	0.34
インド	117.94	58.52	166.67	16.27	23.61	23.01	1.82	0.41	0.45
インドネシア	86.04	31.70	8.43	19.63 ↓	26.72	24.35	1.17	0.21	0.03
タイ	31.04	-3.73	13.79	16.92 ↓	21.21	18.61	0.56	-0.03	0.07
フィリピン	36.45	-1.14	-6.80	17.18 ↓	20.66	19.15	0.64	-0.01	-0.04
ベトナム	74.60	38.54	107.66	22.42 ↓	25.94	21.28	0.91	0.26	0.36
韓国	44.31	15.61	38.47	24.63	25.64	20.75	0.53	0.12	0.16
香港	9.24	-12.35	24.05	21.96 ↓	21.72	19.98	0.14	-0.12	0.11
中南米	88.52	47.36	18.86	26.17	30.35	26.51	0.90	0.27	0.07
ブラジル	48.53	14.91	-20.47	29.22	34.33	32.02	0.48	0.08	-0.07
メキシコ	141.66	74.95	39.08	22.08 ↓	28.37	23.74	1.55	0.42	0.14
中東・アフリカ	65.49	31.34	61.16	14.09	18.57	16.79	1.30	0.30	0.29
トルコ	94.07	30.87	-26.28	33.01 ↓	36.41	32.16	0.75	0.15	-0.09
複合地域	44.92	21.33	38.28	15.19	18.09	15.89	0.87	0.22	0.21

※[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	30.42	30.27	61.25	10.61 ↓	11.89	10.72	0.88	0.46	0.46
外国債券(先進国)	4.01	6.88	7.62	4.33 ↓	4.56	5.64 ↓	0.31	0.30	0.13
グローバル	1.31	5.93	9.32	3.80 ↓	3.87	5.04	0.12	0.31	0.18
除く日本	3.02	9.48	11.18	4.77	4.23	5.60	0.22	0.44	0.19
含む日本	-0.12	2.55	7.90	3.38 ↓	4.23	4.79	-0.00	0.13	0.16
その他	13.43	11.20	7.87	7.10 ↓	7.51	7.80	0.61	0.29	0.10
北米	0.96	3.49	15.90	4.28 ↓	4.89	4.89	0.08	0.15	0.31
米国	13.64	16.15	27.30	6.04 ↓	7.11	6.64	0.73	0.43	0.37
カナダ	20.48	20.54	6.10	7.84	7.46	8.61	0.82	0.52	0.07
欧州	-7.35	-7.10	-1.33	5.90 ↓	5.28	6.73 ↓	-0.42	-0.27	-0.02
イギリス	13.36	8.25	-	10.05	9.35	-	0.43	0.18	-
アジア・オセアニア	16.55	10.77	7.19	9.39 ↓	9.69	9.48	0.56	0.22	0.07
オーストラリア	17.32	10.91	6.64	9.39 ↓	9.74	9.50	0.59	0.22	0.07
ニュージーランド	5.45	5.31	-	9.12 ↓	9.16	-	0.20	0.12	-
複合地域	7.09	15.90	13.11	7.24 ↑	5.98	7.34 ↓	0.32	0.51	0.17
エマージング債券	24.27	18.60	17.25	7.03 ↓	10.79	11.12	1.07	0.33	0.15
グローバル	14.38	7.96	8.01	7.61 ↓	12.23	11.62	0.61	0.13	0.07
米ドル建て	12.91	5.97	7.78	8.30 ↓	12.80	12.02	0.50	0.09	0.06
現地通貨建て	17.64	13.26	1.66	6.48 ↓	10.81	10.51	0.86	0.24	0.02
その他	37.61	32.60	27.32	8.27	10.55	11.73	1.36	0.55	0.21
ロシア	-94.66	-94.34	-95.26	73.51 ↑	58.80 ↑	44.93 ↑	-0.85	-0.74	-0.58
アジア・オセアニア	11.57	17.09	28.38	4.91 ↓	6.52	7.32	0.76	0.50	0.35
インド	34.64	37.38	64.02	7.62	9.18	11.41	1.37	0.72	0.45
インドネシア	51.40	54.50	34.04	8.65 ↓	14.48	15.58	1.72	0.63	0.19
ブラジル	51.64	26.86	23.22	16.86	19.32	18.56	0.88	0.25	0.11
メキシコ	69.19	81.62	43.27	11.40 ↓	16.31	15.39	1.68	0.78	0.24
トルコ	-32.20	-40.34	-70.07	28.69	34.40	27.33	-0.42	-0.28	-0.42
複合地域	14.86	10.07	-1.13	9.43 ↓	12.05	11.99 ↓	0.50	0.16	-0.01
ハイイールド債券	34.06	26.95	44.78	7.62 ↓	11.41	10.68	1.35	0.43	0.35
グローバル	24.09	16.02	30.48	6.99 ↓	11.22	10.70	1.07	0.27	0.25
北米	39.56	33.79	56.30	7.97 ↓	11.46	10.66	1.48	0.53	0.43
その他	20.29	10.40	20.86	8.97 ↓	12.69	11.71	0.71	0.16	0.16
欧州	23.06	11.61	22.11	10.07 ↓	13.59	12.45	0.71	0.17	0.16
アジア・オセアニア	10.02	4.83	19.81	8.42 ↓	11.52	10.51	0.39	0.09	0.17
複合地域	24.55	26.51	47.10	7.09 ↓	8.69	8.95 ↓	1.07	0.56	0.44
複合資産	15.18	15.34	41.25	6.16 ↓	7.17	7.32	0.79	0.41	0.48
安定	4.80	5.81	23.66	4.22 ↓	4.93	5.61	0.38	0.24	0.38
安定成長	19.22	20.30	47.32	6.57 ↓	7.69	7.70	0.92	0.49	0.51
成長	34.59	34.03	85.49	9.05 ↓	10.91	10.48	1.15	0.56	0.61
国内バランス	-0.19	-3.23	8.87	2.92 ↓	3.89	5.04 ↓	-0.01	-0.16	0.17
安定	-1.48	-4.25	11.81	2.79 ↓	3.72	3.05	-0.17	-0.22	0.37
一般	20.04	15.71	40.51	6.82 ↓	8.23	8.79 ↓	0.93	0.36	0.39

※[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	30.42	30.27	61.25	10.61 ↓	11.89	10.72	0.88	0.46	0.46
国内REIT	22.99	28.14	86.29	11.58 ↓	14.90	13.35 ↓	0.62	0.34	0.48
日本	22.99	28.14	86.29	11.58 ↓	14.90	13.35 ↓	0.62	0.34	0.48
外国REIT	47.08	40.36	84.32	17.17 ↓	18.66	16.32	0.80	0.38	0.39
グローバル	43.50	29.53	63.40	17.44 ↓	19.37	16.57	0.74	0.28	0.30
除く日本	48.20	36.12	84.35	18.17 ↓	20.00	16.95	0.77	0.32	0.37
含む日本	41.92	27.56	59.81	17.17 ↓	19.15	16.45	0.72	0.26	0.29
北米	52.32	52.42	104.63	17.72 ↓	18.50	16.59	0.85	0.48	0.45
その他	33.55	23.61	75.01	15.17 ↓	19.20	15.97	0.67	0.23	0.36
欧州	4.68	-16.71	14.76	19.65 ↓	20.97	18.64	0.08	-0.17	0.07
アジア・オセアニア	30.62	25.98	76.08	13.98 ↓	17.81	15.42	0.67	0.27	0.38
オーストラリア	48.31	20.45	52.53	23.63 ↓	29.13	22.93	0.60	0.13	0.19
複合地域	46.64	-2.22	21.97	18.64 ↓	24.93	20.39	0.73	-0.02	0.10
複数国	43.34	48.30	126.63	15.92 ↓	17.28	14.94	0.80	0.48	0.57
その他									
絶対収益型	-3.05	-5.99	-4.56	3.63	3.20	2.85	-0.28	-0.37	-0.16
ロング・ショート	-5.34	-8.01	-10.12	3.14	3.30	3.11	-0.57	-0.49	-0.34
マーケットニュートラル	-5.77	-9.17	23.77	4.51 ↓	4.13	5.63	-0.43	-0.45	0.38
GTAA	6.67	7.80	9.62	4.32 ↓	4.43	3.40	0.51	0.35	0.27
その他スタイル	-2.78	-5.89	-6.09	4.00	3.44	3.28 ↓	-0.23	-0.34	-0.19
CB	9.80	7.20	19.25	7.56 ↓	8.82	7.74	0.42	0.16	0.23
アジア・オセアニア	45.74	40.24	85.89	10.24 ↓	12.37	11.63	1.31	0.57	0.55
日本	1.72	-4.05	19.40	4.18 ↓	5.03	5.32 ↓	0.14	-0.16	0.34
グローバル	9.18	6.85	18.25	7.82 ↓	9.05	7.83	0.38	0.15	0.22
コモディティ	57.29	51.08	5.80	11.54 ↓	11.29	12.37	1.41	0.77	0.05
全業種	125.18	51.27	7.15	16.66 ↓	19.15	16.98	1.87	0.45	0.04
貴金属	20.88	50.24	24.21	13.53	12.47	12.82	0.48	0.68	0.17
エネルギー	199.48	65.01	6.77	28.70 ↓	36.90	31.34	1.54	0.29	0.02
その他コモディティ	92.14	35.39	9.03	16.10 ↓	18.91	16.94	1.51	0.33	0.05

※[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

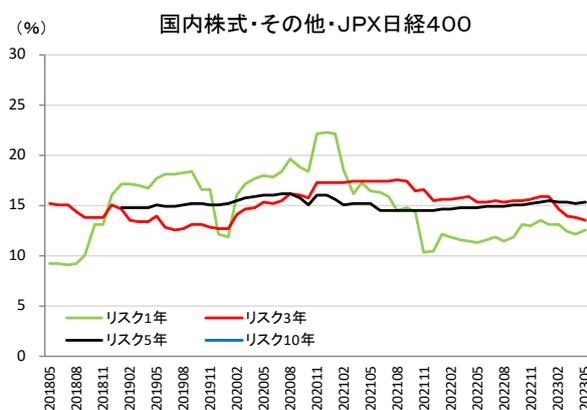
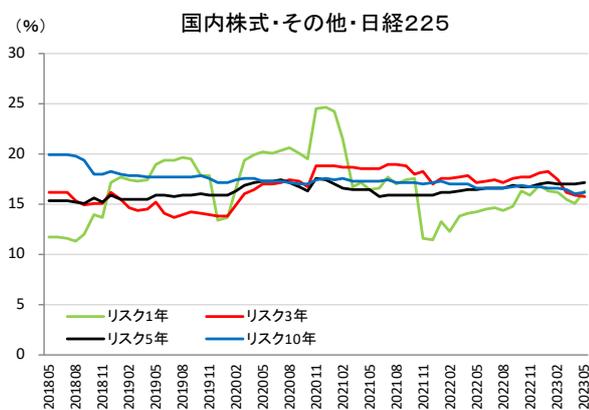
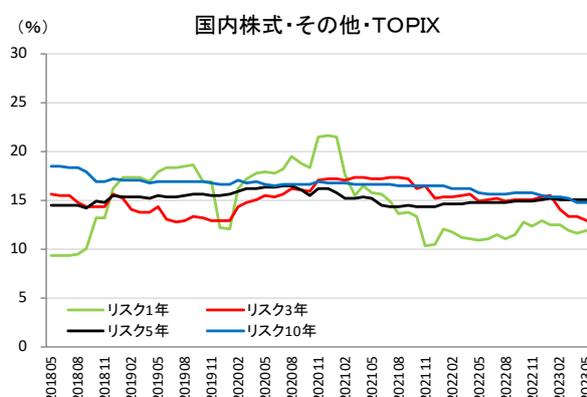
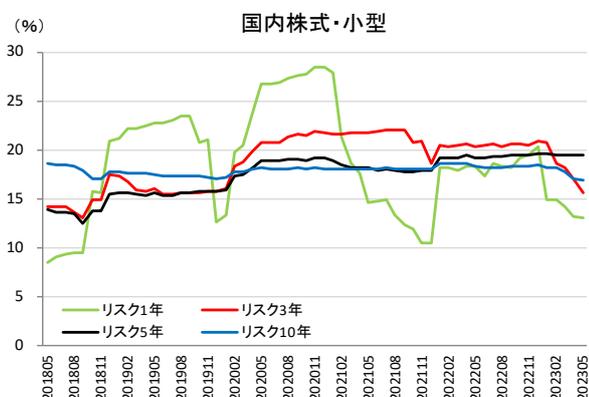
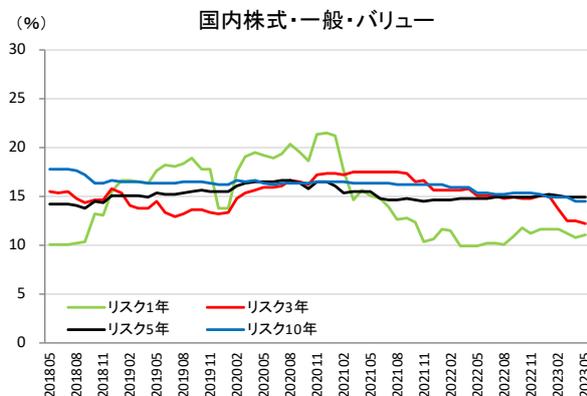
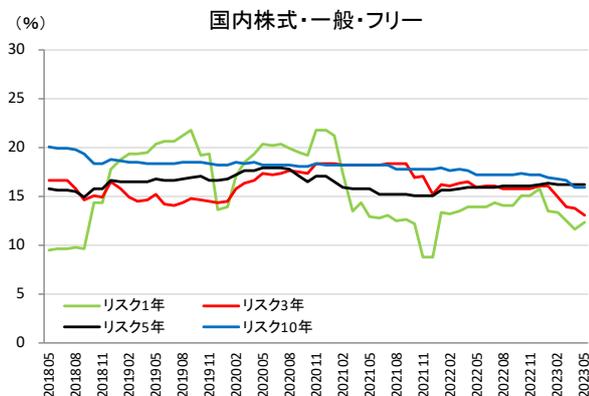
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

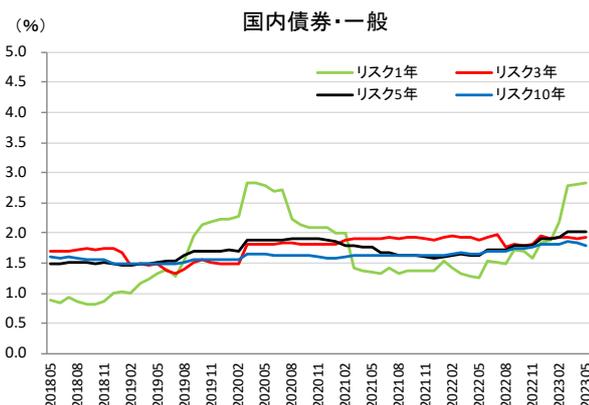
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

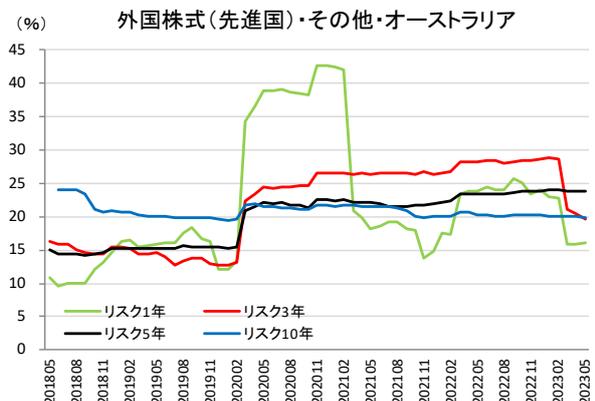
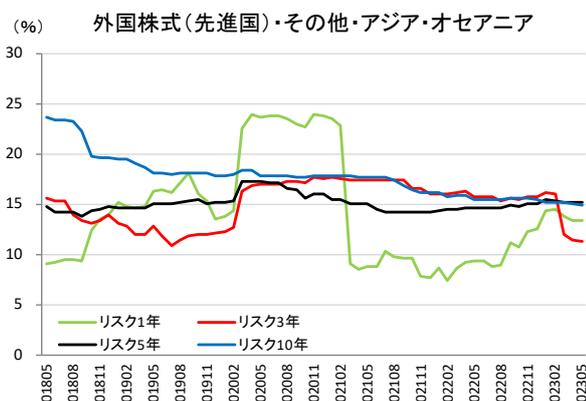
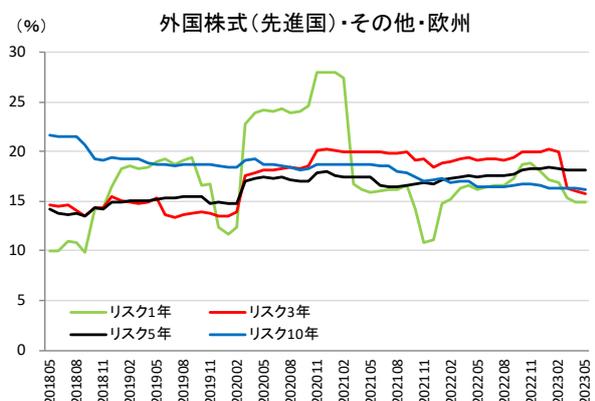
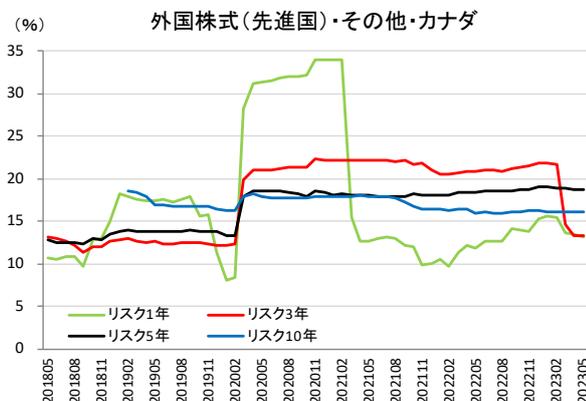
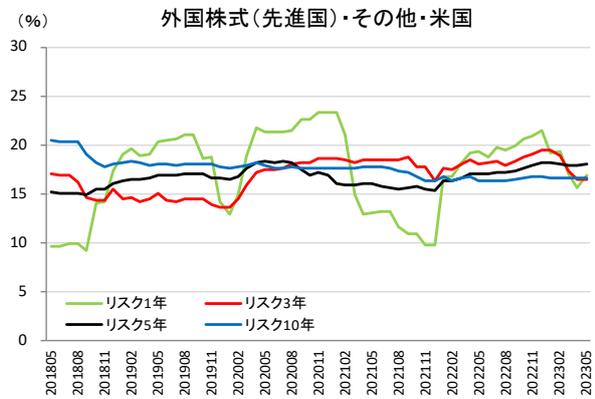
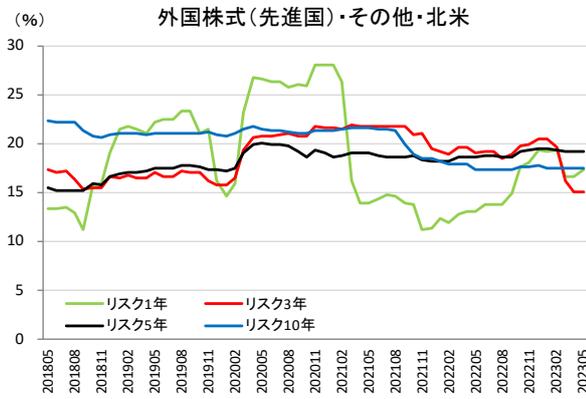
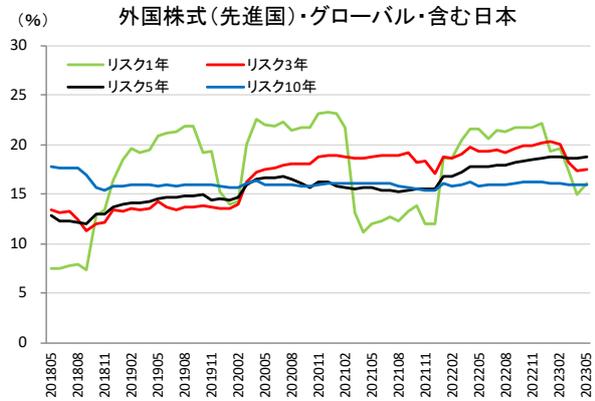
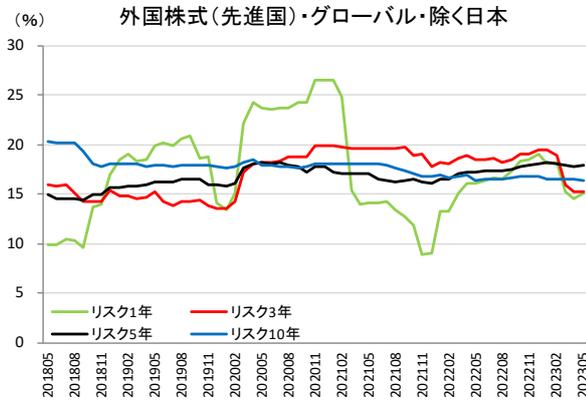


<2> リスク・サマリー

(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)]

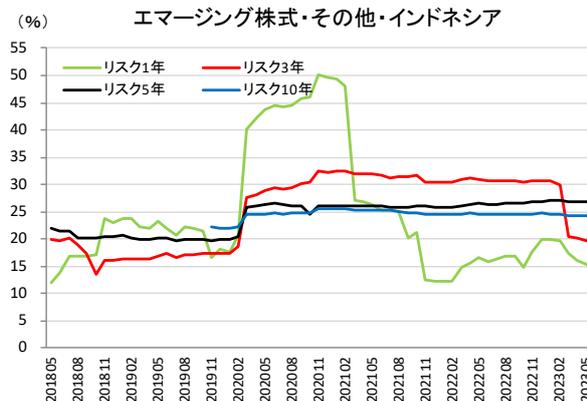
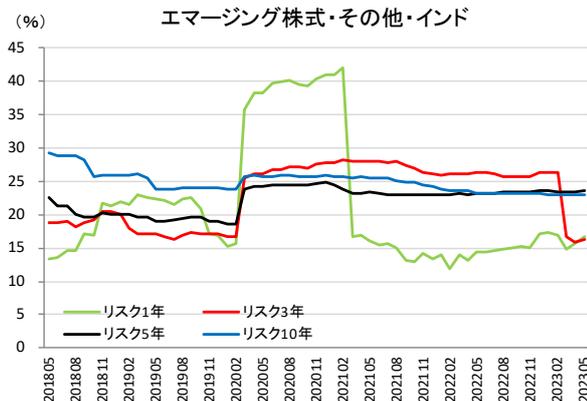
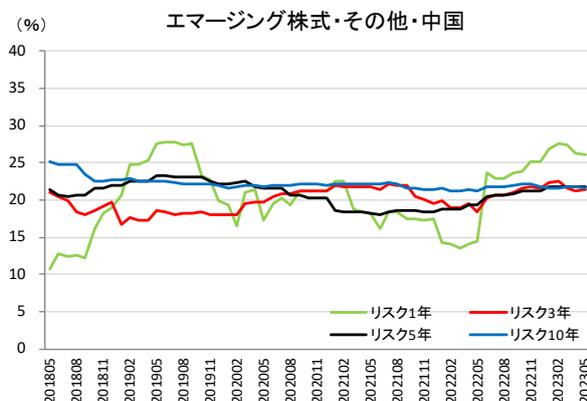
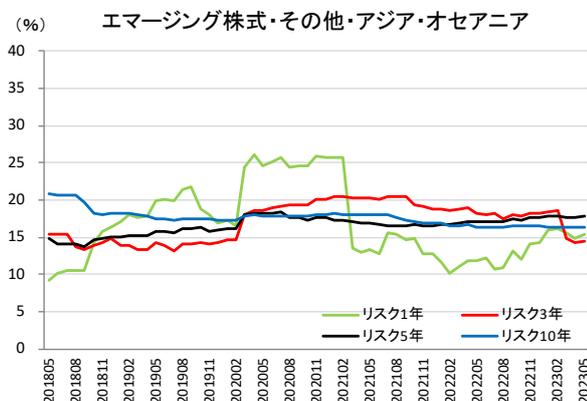
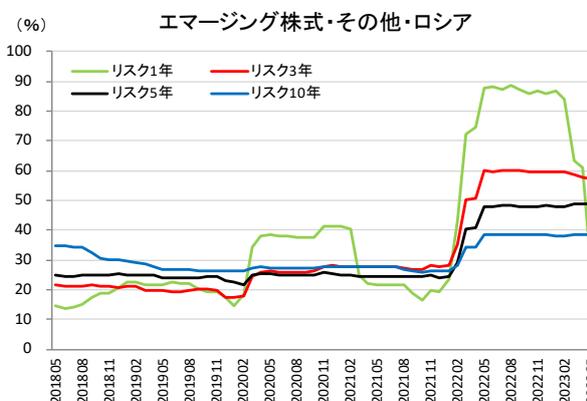
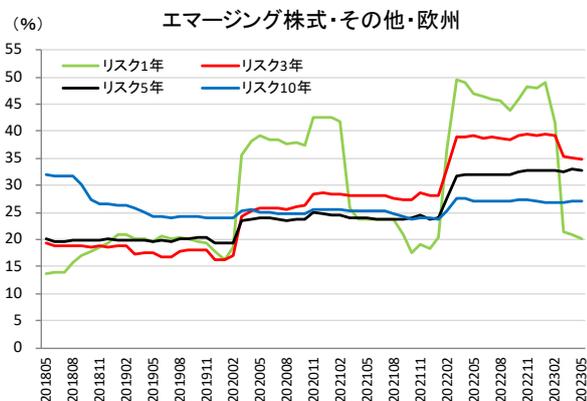
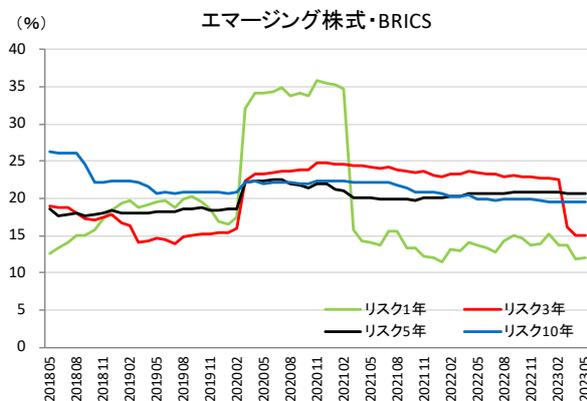
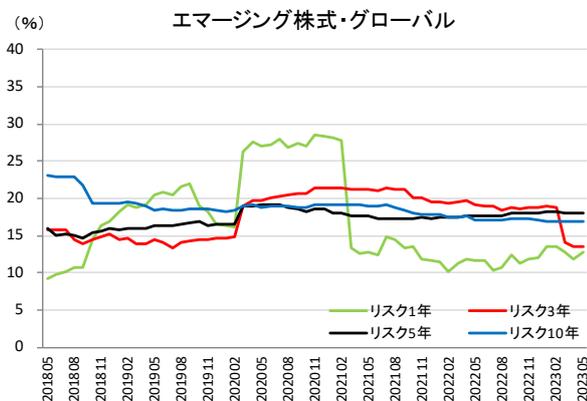


<2> リスク・サマリー

(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]

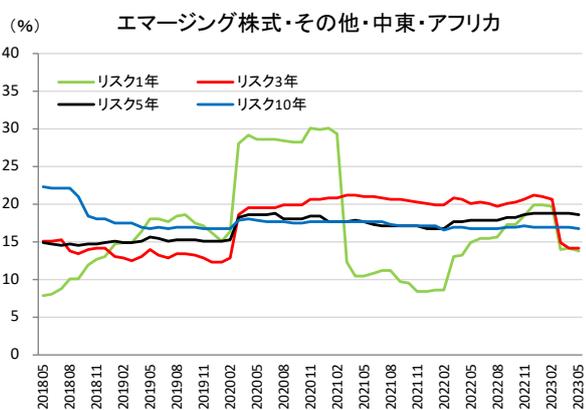
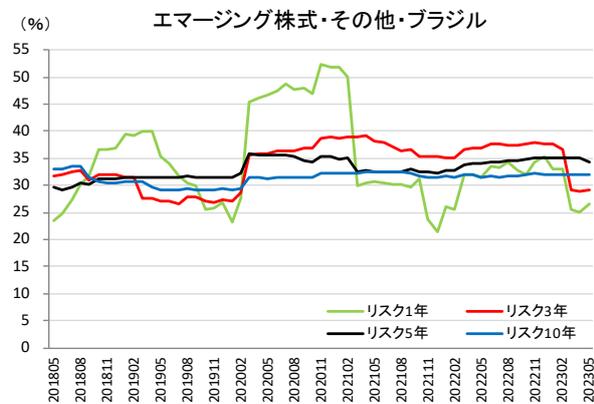
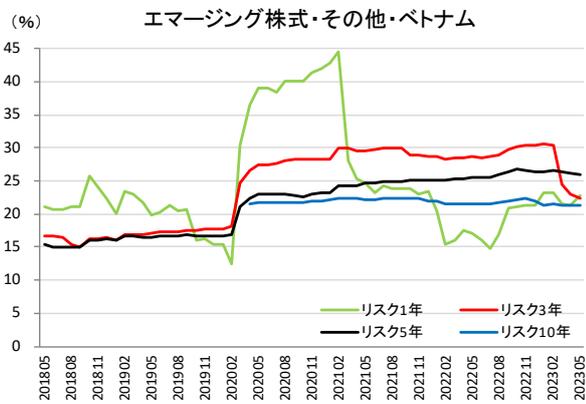
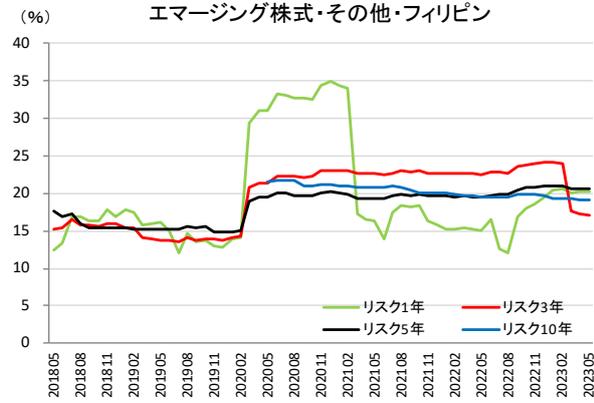
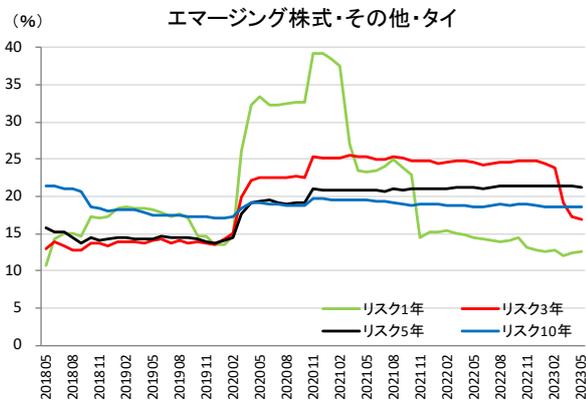


<2> リスク・サマリー

(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]

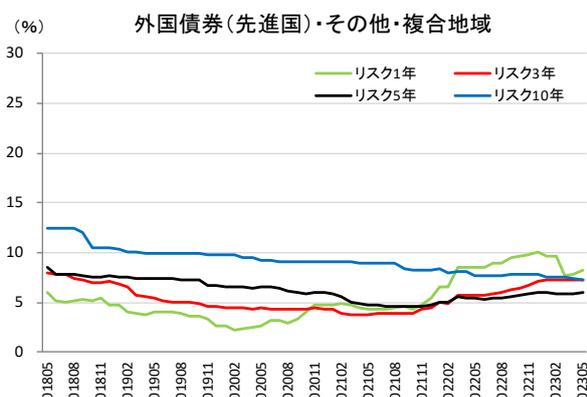
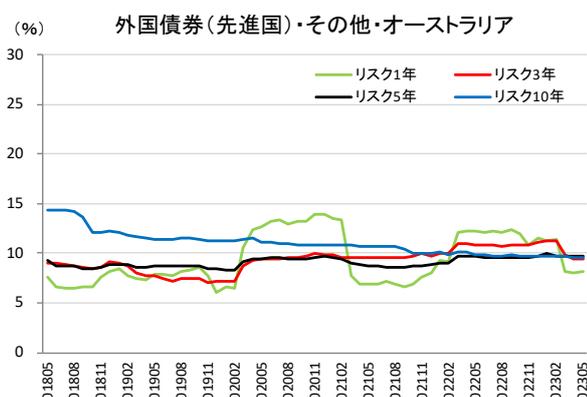
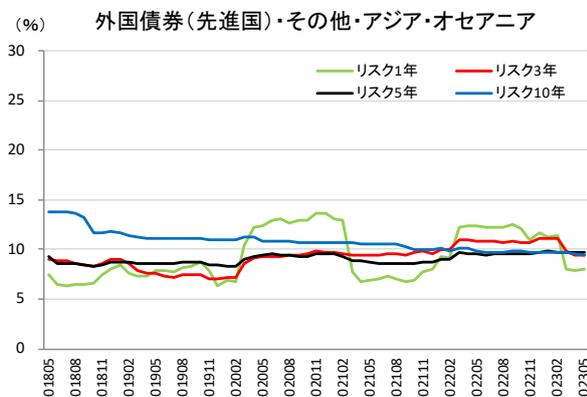
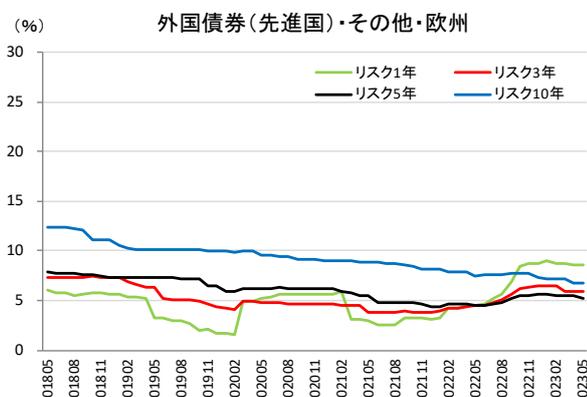
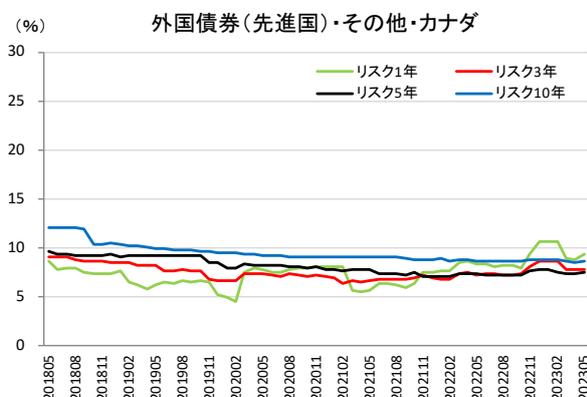
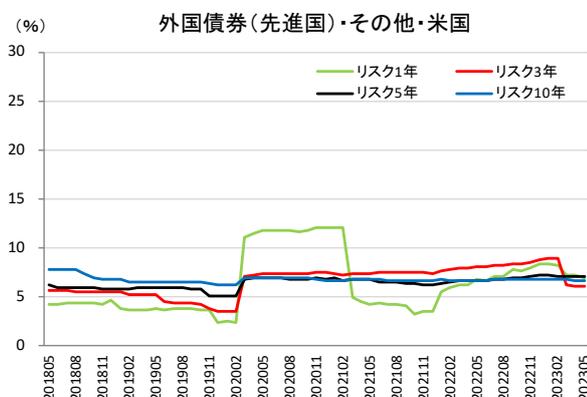
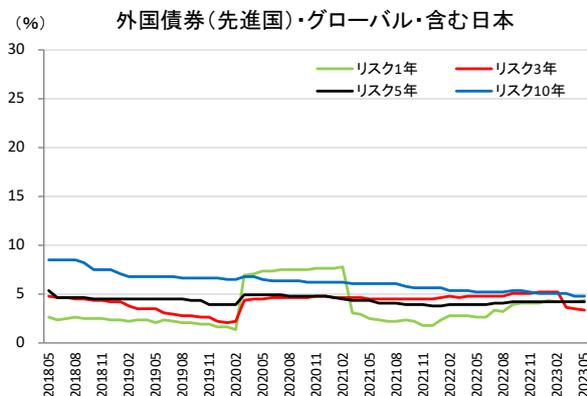
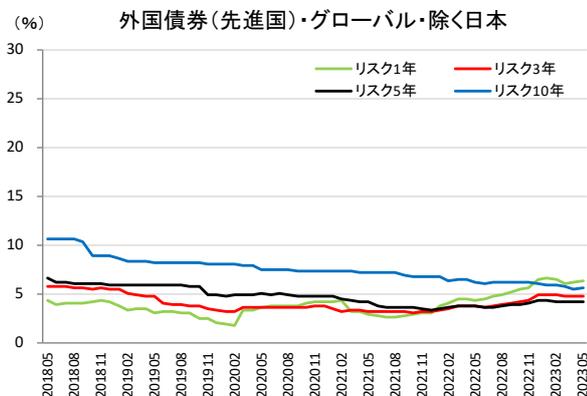


<2> リスク・サマリー

(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)]

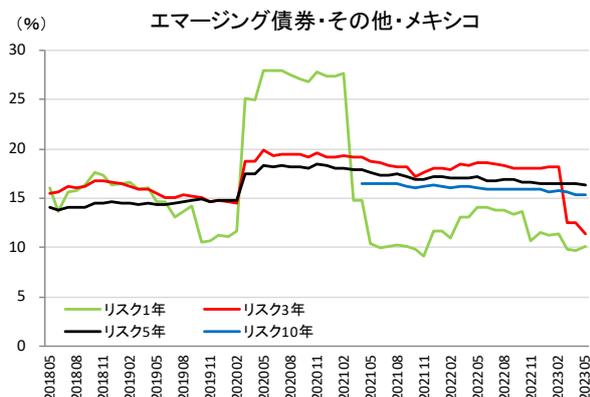
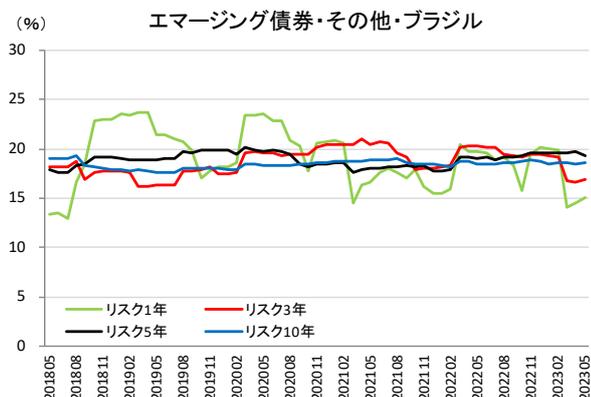
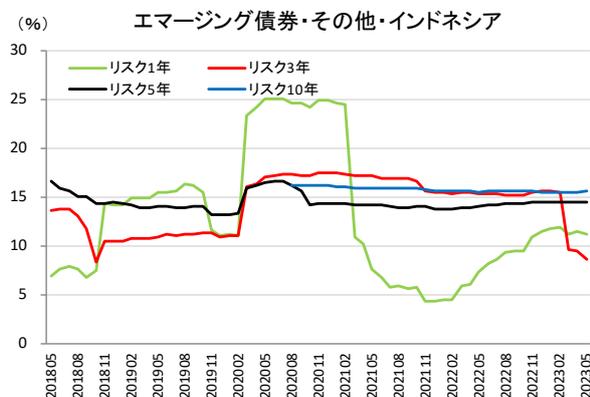
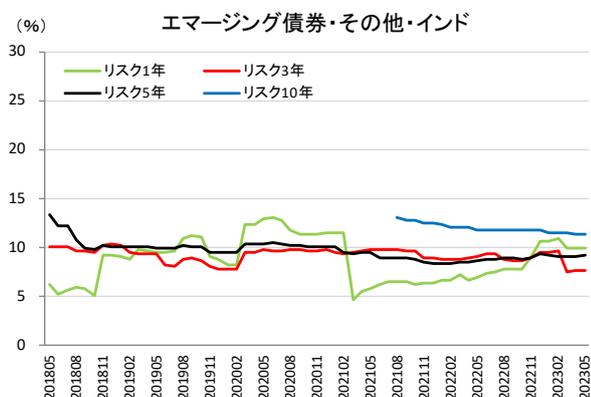
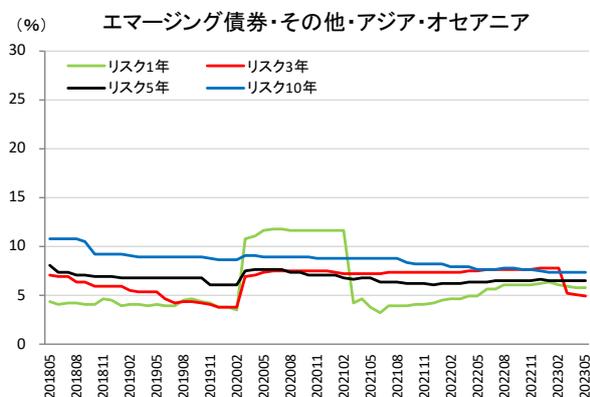
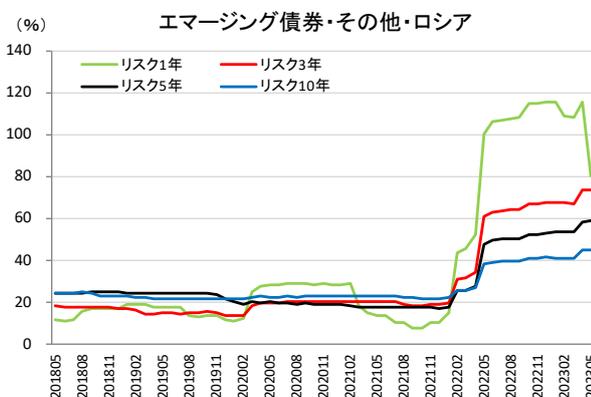
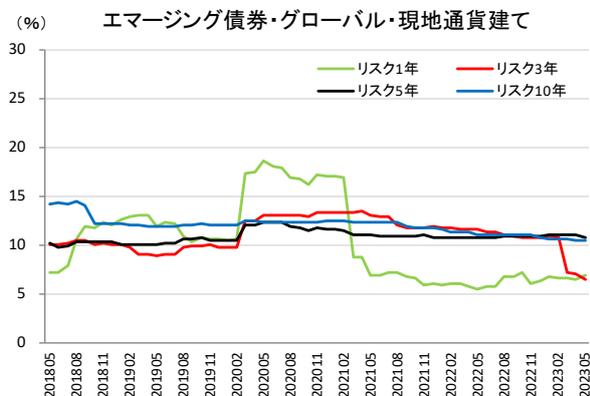
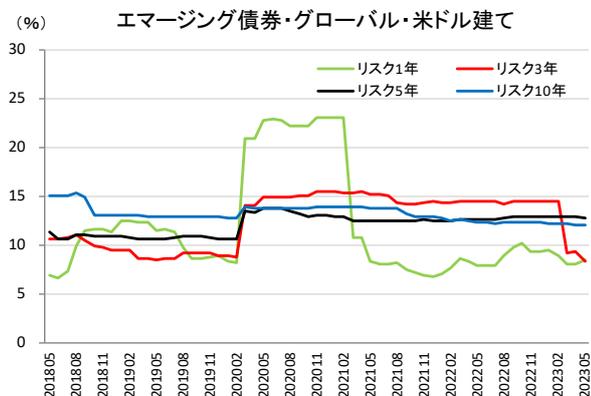


<2> リスク・サマリー

(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]

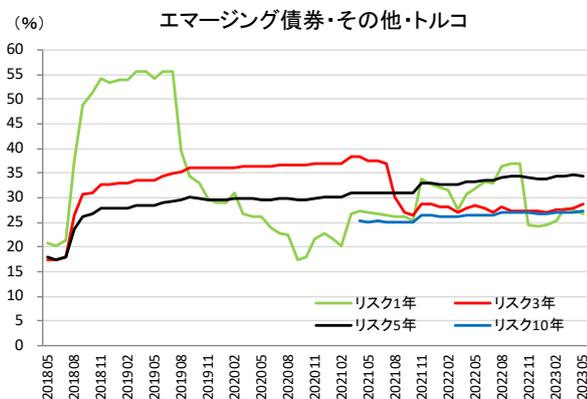


<2> リスク・サマリー

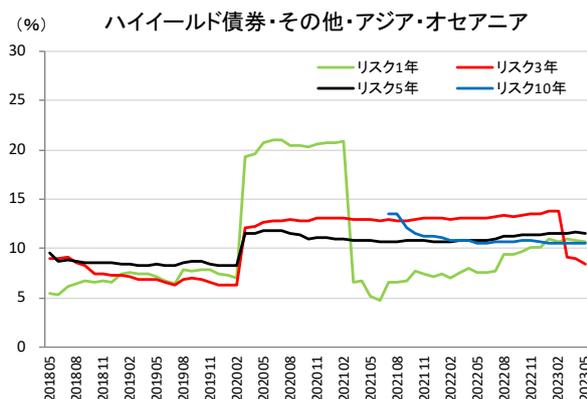
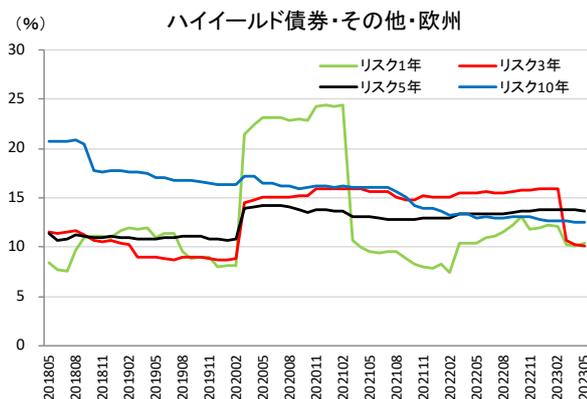
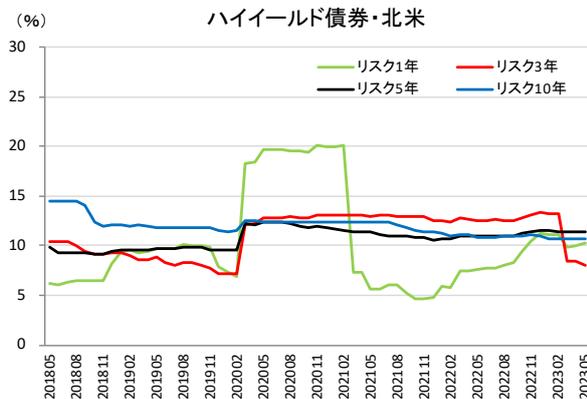
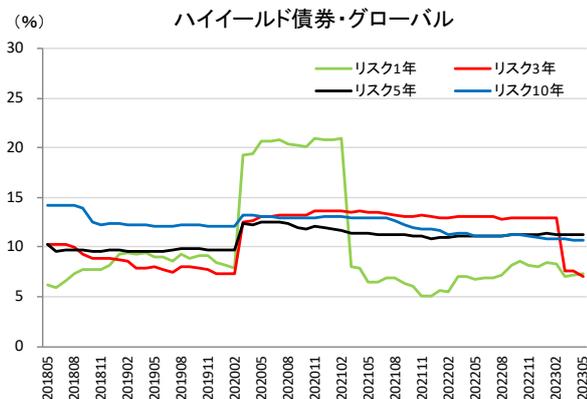
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

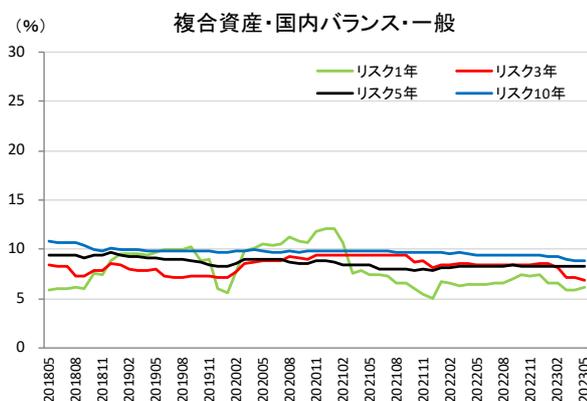
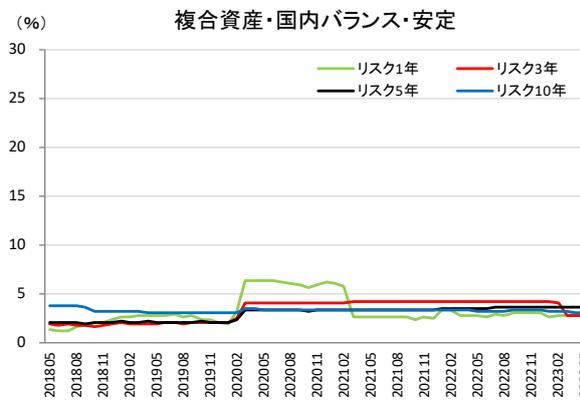
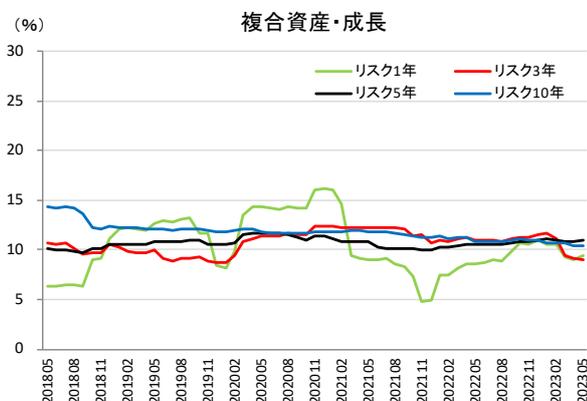
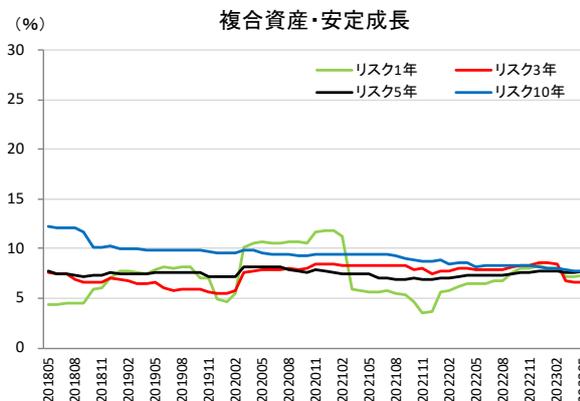
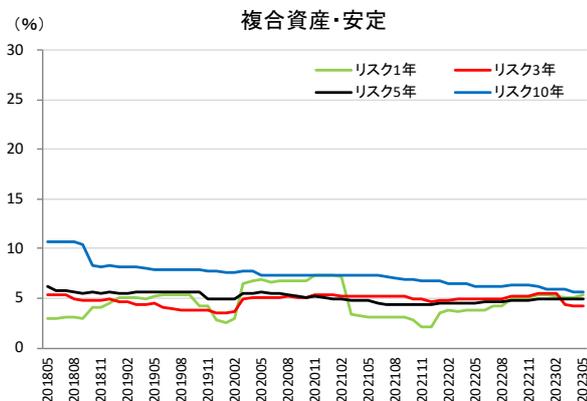


<2>リスク・サマリー

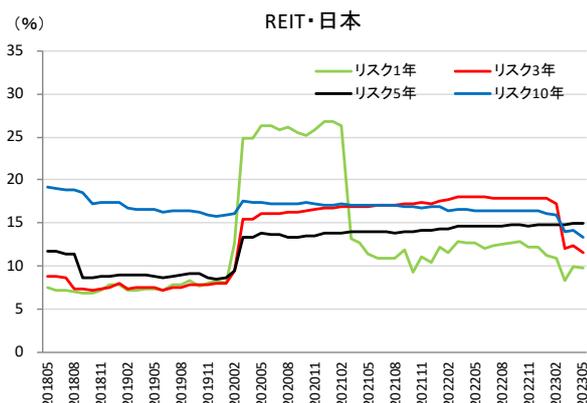
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

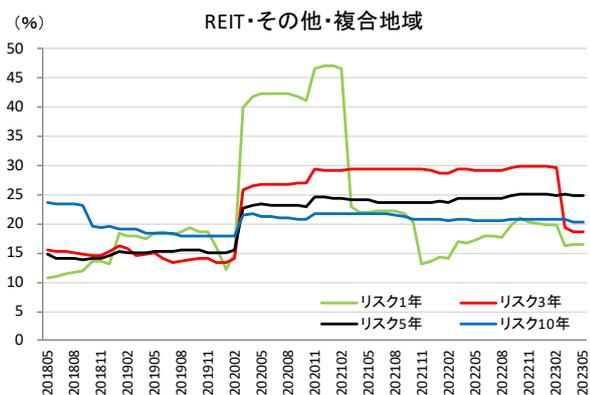
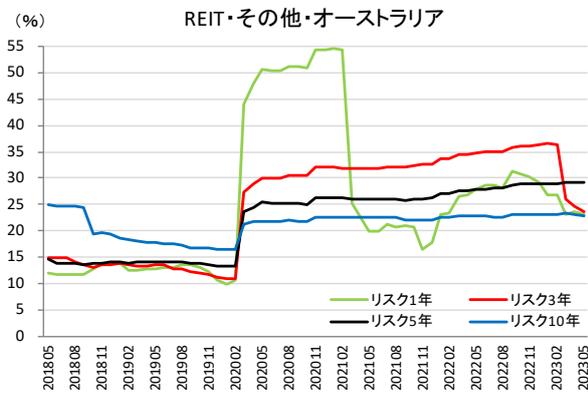
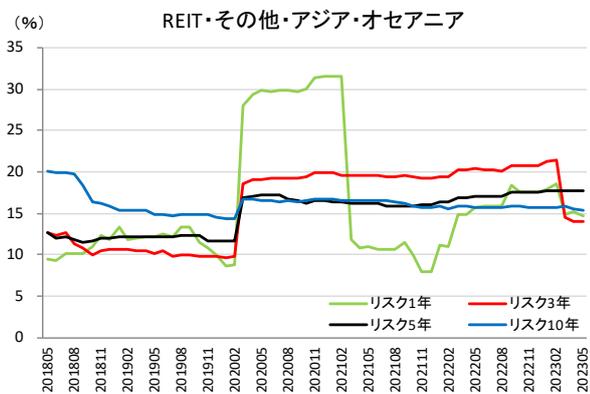
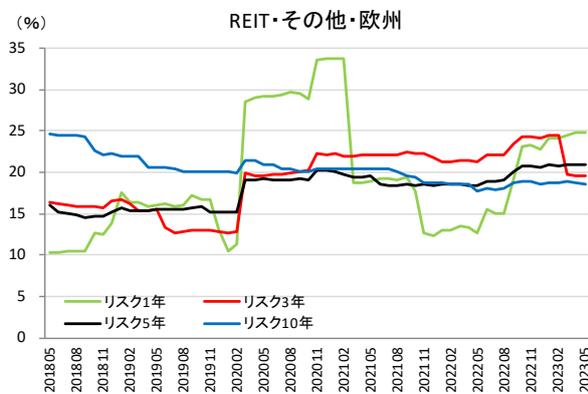
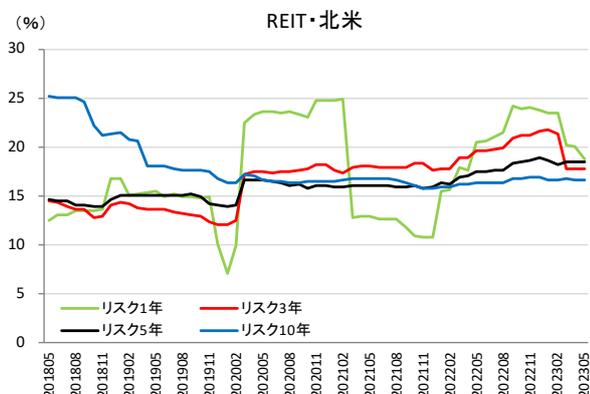
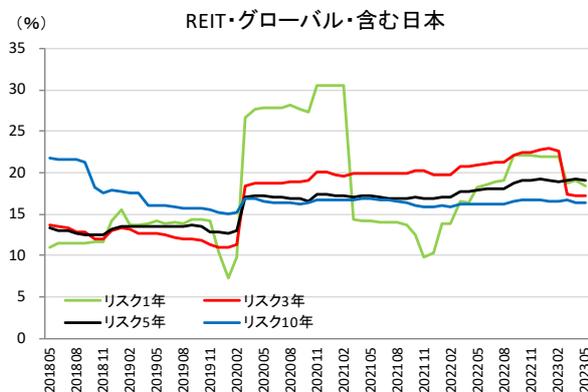
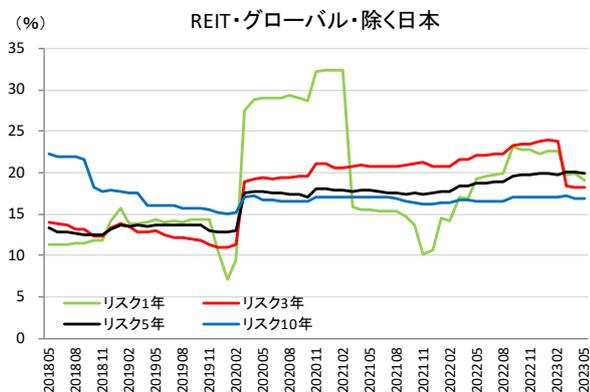


<2> リスク・サマリー

(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]

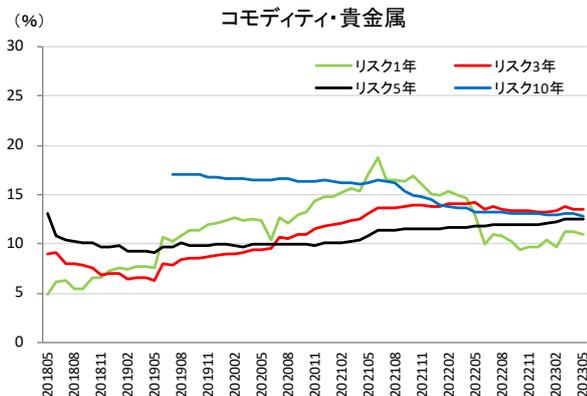
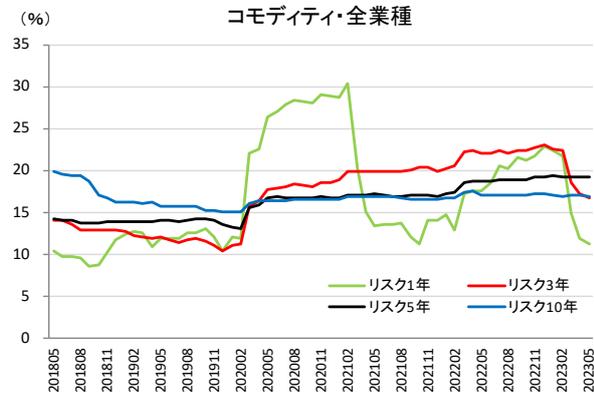
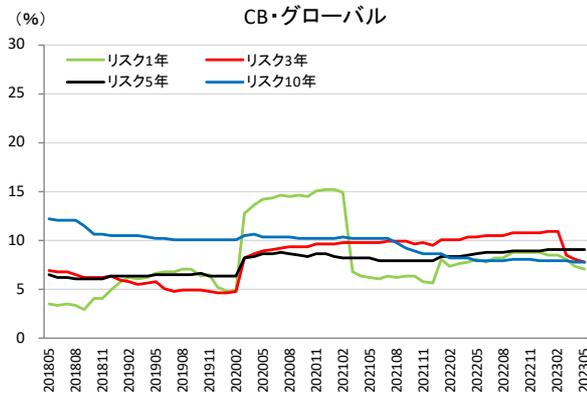
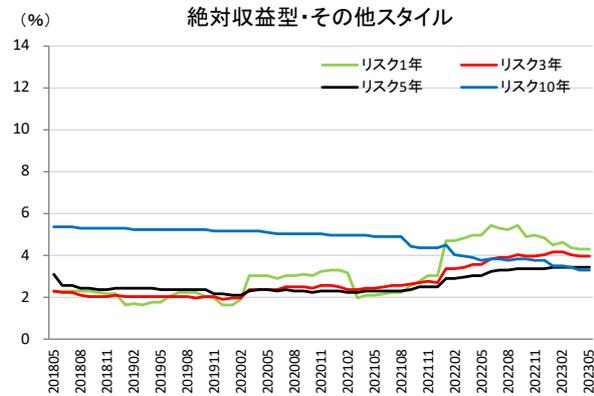
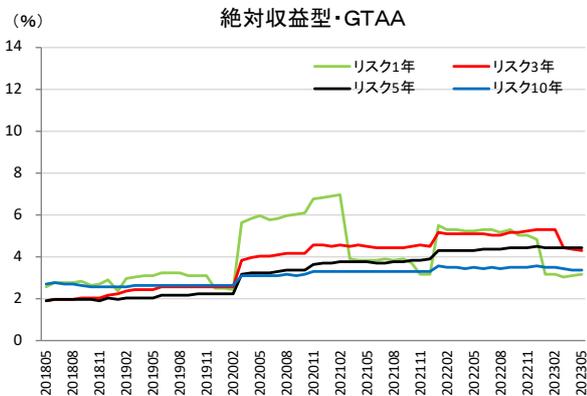
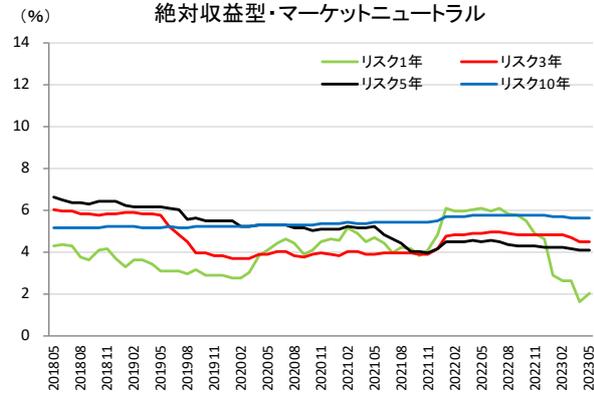
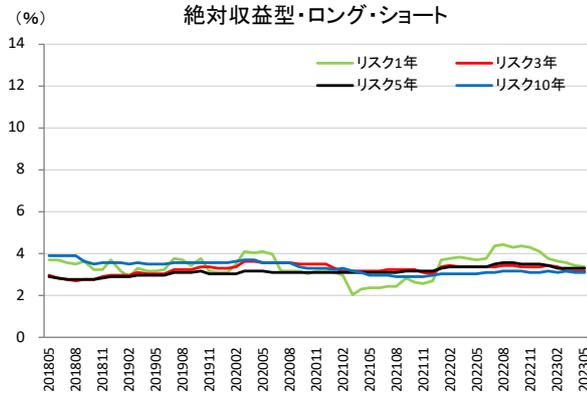


<2> リスク・サマリー

(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	-525	6,866	26,435	65,867
国内株式	-1,164	-1,249	1,409	3,588
一般	863	1,539	2,518	4,312
フリー	13	247	808	2,162
バリュー	851	1,292	1,711	2,150
小型	-24	-18	68	85
その他	-1,987	-2,770	-1,206	-827
日経225	-1,906	-3,234	-2,044	-1,935
TOPIX	15	449	653	770
JPX日経400	-39	-64	-42	-49
国内債券	-60	-1,973	-2,580	-763
一般	-60	-1,973	-2,580	-763
外国株式(先進国)	-72	4,442	12,467	33,237
グローバル	164	2,929	6,695	17,027
除く日本	365	1,793	3,844	8,832
含む日本	-201	1,135	2,851	8,194
その他	-235	1,514	5,772	16,210
北米	24	98	342	796
米国	-195	1,553	5,718	15,953
カナダ	-2	-4	-9	-23
欧州	-31	-72	-119	-178
ドイツ	-1	-1	-1	-2
イギリス	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-1	-1	-3	-4
オーストラリア	-29	-59	-158	-337
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	0	1	2	8
エマージング株式	360	1,068	2,352	2,222
グローバル	28	187	385	543
BRICS	-3	-7	-16	-33
その他	335	887	1,982	1,712
欧州	1	1	1	0
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-77	-115	-88	-401
中国	-17	-41	-88	-306
インド	434	1,017	1,926	2,243
インドネシア	-1	3	21	13
タイ	0	0	-2	-4
フィリピン	1	1	2	-1
ベトナム	-1	28	236	266
韓国	0	0	-4	-4
香港	1	1	-1	1
中南米	-1	-1	-1	-7
ブラジル	-3	-4	-3	-56
メキシコ	0	0	-1	-4
中東・アフリカ	-1	-2	-6	-11
トルコ	-1	-2	-8	-12
複合地域	0	0	0	-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か月	6か月	1年
総合	-525	6,866	26,435	65,867
外国債券(先進国)	243	1,348	5,079	7,302
グローバル	146	751	3,926	6,347
除く日本	68	161	980	1,361
含む日本	78	590	2,945	4,986
その他	97	596	1,154	955
北米	5	18	20	18
米国	164	637	1,377	1,833
カナダ	-8	-19	-37	-135
欧州	-1	118	105	79
イギリス	0	0	-1	-2
アジア・オセアニア	-3	-3	-11	-99
オーストラリア	-49	-128	-256	-654
ニュージーランド	-1	-3	-4	-8
複合地域	-10	-24	-39	-78
エマージング債券	-44	-21	-24	-356
グローバル	-22	4	34	80
米ドル建て	-21	14	-32	-3
現地通貨建て	0	-10	66	84
その他	-22	-25	-59	-437
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-2	-4	-8	-25
インド	22	44	61	-42
インドネシア	2	2	-1	-10
ブラジル	-38	-72	-106	-323
メキシコ	-4	-9	-21	-55
トルコ	-1	-1	-3	-4
複合地域	0	-1	-2	-3
ハイイールド債券	85	345	967	1,733
グローバル	-21	-46	-71	-27
北米	134	455	1,128	1,940
その他	-27	-64	-90	-181
欧州	-18	-56	-102	-186
アジア・オセアニア	-9	-8	12	7
複合地域	0	0	-1	-2
複合資産	61	1,129	2,853	8,802
安定	-134	-241	-392	549
安定成長	110	780	1,769	4,618
成長	186	855	1,981	4,476
国内バランス	-98	-275	-582	-869
安定	-103	-314	-706	-1,213
一般	-5	-10	-13	-22
その他	-3	11	77	28

## &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	-525	6,866	26,435	65,867
国内REIT	49	339	1,094	3,846
日本	49	339	1,094	3,846
外国REIT	90	983	1,558	2,827
グローバル	-62	233	134	213
除く日本	9	359	503	693
含む日本	-72	-126	-370	-481
北米	157	744	1,405	2,683
その他	-5	7	20	-68
欧州	-1	-2	-4	-8
アジア・オセアニア	1	22	57	8
オーストラリア	-3	-9	-24	-50
複合地域	0	0	-1	-1
複数国	-1	-4	-8	-17
その他	-74	456	1,260	3,429
絶対収益型	-99	-282	-70	593
ロング・ショート	-3	-17	-31	-40
マーケットニュートラル	-20	-64	-100	-155
GTAA	-21	-30	-43	-45
その他スタイル	-29	-149	123	847
CB	-11	604	895	1,700
アジア・オセアニア	0	0	-1	-2
日本	0	-1	-3	-5
グローバル	-11	605	899	1,707
コモディティ	111	231	379	657
全業種	16	67	94	-130
貴金属	92	164	285	803
エネルギー	2	0	-2	-17
その他コモディティ	0	1	2	2

## &lt; 4 &gt; 純資産額、ファンド本数

## 「総合」およびファンド分類別①

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	926,165	100.00	5,380	100.00
国内株式	117,247	12.66	825	15.33
一般	66,101	7.14	528	9.81
フリー	50,556	5.46	432	8.03
バリュー	15,545	1.68	96	1.78
小型	6,880	0.74	90	1.67
その他	43,533	4.70	201	3.74
日経225	21,321	2.30	69	1.28
TOPIX	18,445	1.99	80	1.49
JPX日経400	764	0.08	15	0.28
国内債券	40,598	4.38	144	2.68
一般	40,598	4.38	144	2.68
外国株式(先進国)	392,994	42.43	1,173	21.80
グローバル	265,867	28.71	815	15.15
除く日本	77,268	8.34	194	3.61
含む日本	188,599	20.36	621	11.54
その他	127,127	13.73	358	6.65
北米	1,055	0.11	14	0.26
米国	121,366	13.10	268	4.98
カナダ	143	0.02	2	0.04
欧州	1,627	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	39	0.00	2	0.04
オーストラリア	2,822	0.30	23	0.43
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	37	0.00	1	0.02
エマージング株式	29,926	3.23	306	5.69
グローバル	9,750	1.05	90	1.67
BRICS	434	0.05	7	0.13
その他	19,742	2.13	209	3.88
欧州	69	0.01	6	0.11
ロシア	8	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,466	0.48	85	1.58
中国	1,768	0.19	33	0.61
インド	11,133	1.20	32	0.59
インドネシア	173	0.02	4	0.07
タイ	11	0.00	2	0.04
フィリピン	30	0.00	4	0.07
ベトナム	1,348	0.15	13	0.24
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	15	0.00	1	0.02
中南米	62	0.01	2	0.04
ブラジル	485	0.05	12	0.22
メキシコ	8	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	97	0.01	5	0.09
トルコ	51	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	926,165	100.00	5,380	100.00
外国債券(先進国)	84,737	9.15	763	14.18
グローバル	68,505	7.40	523	9.72
除く日本	31,073	3.36	225	4.18
含む日本	37,432	4.04	298	5.54
その他	16,232	1.75	240	4.46
北米	87	0.01	8	0.15
米国	6,594	0.71	131	2.43
カナダ	704	0.08	4	0.07
欧州	1,075	0.12	30	0.56
イギリス	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,520	0.16	9	0.17
オーストラリア	5,110	0.55	36	0.67
ニュージーランド	70	0.01	9	0.17
複合地域	1,063	0.11	8	0.15
エマージング債券	10,995	1.19	256	4.76
グローバル	6,162	0.67	181	3.36
米ドル建て	4,479	0.48	141	2.62
現地通貨建て	1,683	0.18	40	0.74
その他	4,833	0.52	75	1.39
ロシア	4	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	240	0.03	6	0.11
インド	2,241	0.24	16	0.30
インドネシア	309	0.03	7	0.13
ブラジル	1,531	0.17	21	0.39
メキシコ	265	0.03	5	0.09
トルコ	55	0.01	4	0.07
複合地域	33	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	17,996	1.94	247	4.59
グローバル	2,581	0.28	37	0.69
北米	13,562	1.46	148	2.75
その他	1,853	0.20	62	1.15
欧州	1,426	0.15	40	0.74
アジア・オセアニア	390	0.04	21	0.39
複合地域	36	0.00	1	0.02
複合資産	136,556	14.74	1,035	19.24
安定	38,146	4.12	282	5.24
安定成長	60,807	6.57	429	7.97
成長	27,504	2.97	279	5.19
国内バランス	7,024	0.76	29	0.54
安定	6,219	0.67	9	0.17
一般	287	0.03	15	0.28
その他	3,075	0.33	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	926,165	100.00	5,380	100.00
国内REIT	27,894	3.01	135	2.51
日本	27,894	3.01	135	2.51
外国REIT	42,572	4.60	277	5.15
グローバル	16,836	1.82	151	2.81
除く日本	5,916	0.64	66	1.23
含む日本	10,920	1.18	85	1.58
北米	22,786	2.46	74	1.38
その他	2,950	0.32	52	0.97
欧州	107	0.01	10	0.19
アジア・オセアニア	2,061	0.22	26	0.48
オーストラリア	492	0.05	12	0.22
複合地域	54	0.01	3	0.06
複数国	236	0.03	1	0.02
その他	24,650	2.66	219	4.07
絶対収益型	11,423	1.23	97	1.80
ロング・ショート	790	0.09	32	0.59
マーケットニュートラル	438	0.05	14	0.26
GTAA	373	0.04	11	0.20
その他スタイル	9,757	1.05	39	0.72
CB	2,707	0.29	33	0.61
アジア・オセアニア	34	0.00	1	0.02
日本	23	0.00	1	0.02
グローバル	2,650	0.29	31	0.58
コモディティ	5,376	0.58	35	0.65
全業種	1,617	0.17	13	0.24
貴金属	3,674	0.40	20	0.37
エネルギー	65	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	13,621	10.1	1.98	2.12	1.147
国内株式	19,042	13.9	0.74	0.68	1.040
一般	17,807	13.5	0.98	0.91	1.383
フリー	17,296	12.8	0.89	0.82	1.425
バリュー	20,107	17.0	1.30	1.21	1.248
小型	23,526	14.6	0.64	0.59	1.704
その他	20,332	14.4	0.37	0.33	0.404
日経225	21,818	15.8	0.40	0.35	0.467
TOPIX	21,193	15.3	0.14	0.13	0.253
JPX日経400	19,004	8.8	0.32	0.28	0.492
国内債券	10,539	12.0	0.15	0.15	0.450
一般	10,539	12.0	0.15	0.15	0.450
外国株式(先進国)	16,052	7.7	1.74	1.74	1.246
グローバル	16,553	7.6	1.52	1.57	1.326
除く日本	23,607	10.3	0.45	0.45	0.575
含む日本	14,350	6.7	1.96	2.03	1.634
その他	14,910	7.9	2.21	2.10	1.078
北米	14,226	5.3	1.48	1.61	1.556
米国	15,590	7.2	2.08	1.94	1.049
カナダ	6,059	12.2	5.52	6.38	1.989
欧州	14,531	12.6	1.57	1.55	1.556
ドイツ	15,433	9.2	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,274	6.8	8.48	9.36	1.771
アジア・オセアニア	9,838	13.4	2.51	2.55	1.637
オーストラリア	10,373	8.4	8.05	9.07	1.822
ニュージーランド	17,618	10.8	1.23	1.14	1.672
複合地域	10,426	10.1	8.62	10.55	1.705
エマージング株式	13,453	10.8	2.44	2.41	1.642
グローバル	13,200	8.3	0.34	0.33	1.038
BRICS	13,954	17.0	0.89	0.94	2.064
その他	13,545	11.6	3.53	3.47	1.931
欧州	6,709	16.9	0.37	0.29	1.954
ロシア	945	14.0	0.00	0.00	1.169
アジア・オセアニア	14,485	12.7	2.05	2.16	1.686
中国	13,526	8.5	1.57	1.51	1.934
インド	16,465	11.8	4.86	4.69	2.034
インドネシア	13,814	13.1	3.54	3.42	1.834
タイ	13,550	11.2	1.60	1.58	1.818
フィリピン	11,082	10.8	0.57	0.59	1.718
ベトナム	14,975	5.9	0.79	0.91	1.904
韓国	13,969	4.4	0.00	0.00	1.804
香港	13,350	13.8	1.66	1.72	0.858
中南米	10,147	16.4	0.00	0.00	2.040
ブラジル	5,777	12.0	3.28	3.94	1.952
メキシコ	12,878	10.2	1.92	1.55	1.667
中東・アフリカ	12,802	11.8	0.28	0.35	2.084
トルコ	11,718	21.8	0.00	0.00	2.030
複合地域	21,925	15.0	1.72	1.69	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	13,621	10.1	1.98	2.12	1.147
外国債券(先進国)	9,928	10.6	1.38	1.47	0.986
グローバル	10,402	10.6	1.08	1.13	0.923
除く日本	11,503	12.8	0.94	0.95	0.695
含む日本	9,571	8.9	1.21	1.28	1.111
その他	8,895	10.7	2.60	2.87	1.253
北米	9,951	6.9	2.11	2.21	1.604
米国	9,692	9.1	2.78	3.29	1.231
カナダ	7,234	12.3	1.57	1.59	1.378
欧州	7,219	13.4	1.51	1.58	1.119
イギリス	7,092	8.1	3.83	4.04	1.305
アジア・オセアニア	8,868	13.2	2.46	2.53	1.428
オーストラリア	8,380	14.4	2.88	3.02	1.245
ニュージーランド	8,940	8.9	1.48	1.53	1.357
複合地域	5,329	13.1	2.29	2.34	1.196
エマーGING債券	8,860	11.4	4.11	4.01	1.448
グローバル	8,842	11.9	2.89	2.88	1.313
米ドル建て	8,623	12.4	3.17	3.19	1.446
現地通貨建て	9,615	10.1	2.14	2.06	0.959
その他	8,904	10.3	5.68	5.47	1.620
ロシア	717	10.3	0.00	0.00	1.568
アジア・オセアニア	9,576	12.4	6.62	6.86	1.627
インド	9,841	8.8	6.54	6.54	1.704
インドネシア	9,745	10.5	5.68	5.21	1.672
ブラジル	10,043	13.7	4.69	4.25	1.579
メキシコ	8,335	10.3	5.57	4.64	1.380
トルコ	1,959	10.2	6.95	5.96	1.461
複合地域	3,950	16.8	1.76	1.52	1.210
ハイイールド債券	9,277	12.1	5.31	5.34	1.667
グローバル	7,628	11.0	3.42	3.40	1.480
北米	10,587	13.0	5.42	5.41	1.689
その他	7,136	10.6	7.17	7.46	1.767
欧州	7,446	10.1	6.53	6.65	1.739
アジア・オセアニア	6,674	11.1	9.65	10.65	1.868
複合地域	4,436	19.2	5.44	5.41	1.800
複合資産	12,994	9.4	1.02	1.06	0.951
安定	11,293	9.3	0.93	0.96	1.078
安定成長	12,691	9.9	1.33	1.40	0.961
成長	15,514	9.0	0.15	0.15	0.780
国内バランス	12,040	10.5	1.94	2.04	0.944
安定	10,637	11.8	2.07	2.19	0.916
一般	12,894	11.1	0.95	0.93	1.274
その他	8,913	3.2	1.31	1.56	0.742

(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	13,621	10.1	1.98	2.12	1.147
国内REIT	14,151	10.2	8.59	10.46	0.921
日本	14,151	10.2	8.59	10.46	0.921
外国REIT	11,507	9.1	7.94	9.60	1.477
グローバル	12,619	8.9	3.20	3.70	1.233
除く日本	13,926	7.0	1.90	2.32	0.897
含む日本	11,605	10.3	3.91	4.45	1.415
北米	10,757	9.9	11.61	14.23	1.622
その他	9,344	9.0	6.54	7.55	1.751
欧州	5,814	9.3	4.49	5.56	1.819
アジア・オセアニア	10,955	8.4	7.87	9.10	1.796
オーストラリア	9,284	8.6	4.25	4.75	1.702
複合地域	6,888	11.3	0.82	0.96	0.780
複数国	10,821	19.1	2.02	2.22	1.650
その他					
絶対収益型	10,281	6.2	0.02	0.02	1.934
ロング・ショート	10,133	5.4	0.30	0.30	1.493
マーケットニュートラル	9,724	5.2	0.00	0.00	1.291
GTAA	11,110	10.3	0.02	0.02	1.535
その他スタイル	10,318	6.1	0.00	0.00	2.018
CB	12,070	9.1	0.81	0.83	1.188
アジア・オセアニア	10,181	12.9	2.39	2.36	1.823
日本	13,545	23.5	0.37	0.37	0.770
グローバル	12,084	8.5	0.76	0.78	1.183
コモディティ	12,002	7.4	0.16	0.21	0.912
全業種	9,637	10.9	0.54	0.71	1.288
貴金属	13,090	4.8	0.00	0.00	0.745
エネルギー	16,696	14.3	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	16,301	6.7	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、川真田

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