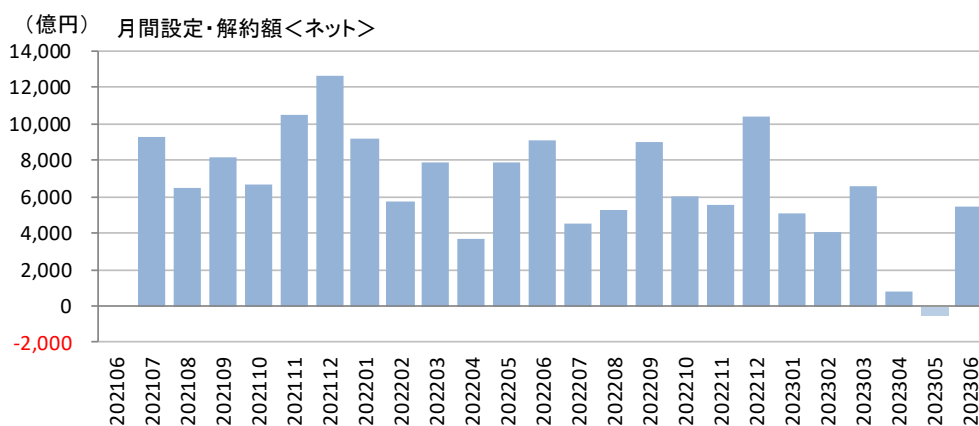
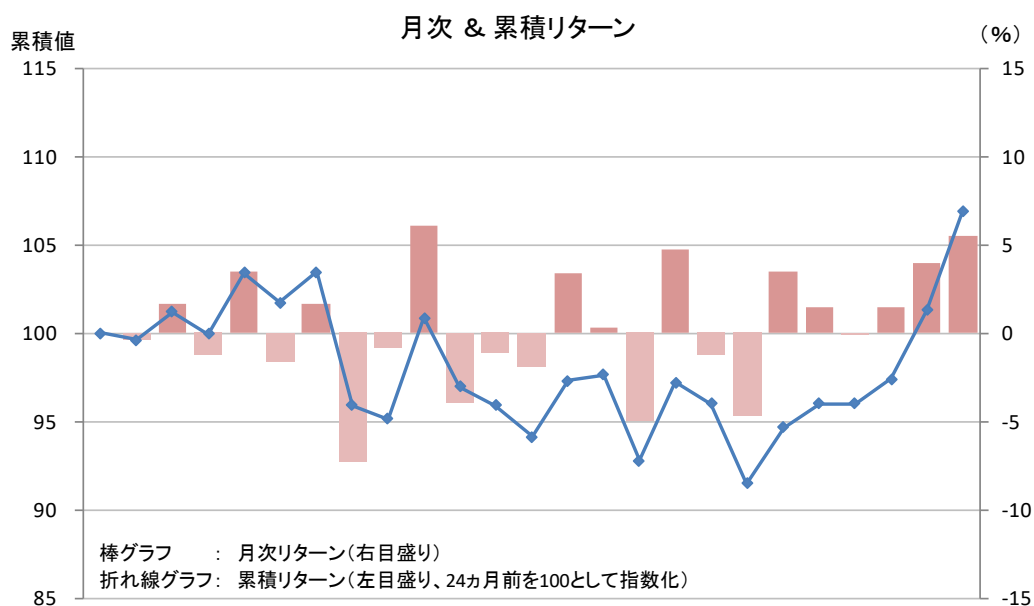


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2023年6月

「総合」 +5.53 %
 (前月 +4.01 %)



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		17,307	16,400	906	5.53	
国内株式		23,305	21,741	1,563	7.19	
一般		22,513	21,084	1,429	6.78	
フリー		21,010	19,715	1,295	6.57	
バリュー		29,615	27,563	2,051	7.44	
小型		43,699	40,790	2,909	7.13	
その他		23,612	21,897	1,715	7.83	
日経225		22,884	21,280	1,604	7.54	
TOPIX		23,036	21,423	1,614	7.53	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	21,878	20,348	1,530	7.52	
国内債券		12,685	12,637	48	0.38	
一般		12,685	12,637	48	0.38	
外国株式(先進国)		23,634	22,035	1,599	7.26	
グローバル		25,502	23,801	1,701	7.15	
除く日本		40,410	37,654	2,756	7.32	
含む日本		22,315	20,841	1,474	7.07	
その他		19,639	18,271	1,368	7.49	
北米		24,726	22,903	1,823	7.96	
米国		30,524	28,371	2,153	7.59	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	21,848	20,880	968	4.63	
欧州		26,544	25,625	919	3.59	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	13,408	12,745	663	5.20	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	11,059	10,878	180	1.66	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	41,106	39,417	1,689	4.29	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	21,155	20,079	1,076	5.36	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	48,340	46,717	1,623	3.47	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	14,334	13,139	1,195	9.09	
エマージング株式		20,417	19,142	1,275	6.66	
グローバル		20,110	18,955	1,154	6.09	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	24,978	22,835	2,143	9.39	
その他		21,418	20,040	1,378	6.88	
欧州		14,494	13,286	1,208	9.09	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,076	1,066	10	0.91	
アジア・オセアニア		19,409	18,494	915	4.95	
中国		39,977	38,512	1,465	3.80	
インド	10,000 (2004.09.30)	56,030	52,075	3,955	7.60	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	18,450	17,765	685	3.86	
タイ		23,496	23,795	-299	-1.26	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,221	7,800	421	5.40	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	23,376	21,577	1,799	8.34	
韓国	10,000 (1997.06.30)	33,967	31,054	2,912	9.38	
香港		22,391	21,084	1,308	6.20	
中南米	7,427 (2006.04.28)	12,364	10,967	1,396	12.73	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	10,441	9,096	1,346	14.80	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	17,224	15,873	1,351	8.51	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	13,499	12,680	819	6.46	
トルコ		33,923	34,868	-945	-2.71	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	26,969	25,617	1,351	5.28	

※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		17,307	16,400	906	5.53	
外国債券(先進国)		18,825	18,341	484	2.64	
グローバル		18,795	18,353	442	2.41	
除く日本		20,803	20,173	630	3.12	
含む日本		17,499	17,188	312	1.81	
その他		19,175	18,507	668	3.61	
北米	9,052 (2013.05.31)	10,694	10,492	202	1.92	
米国		17,820	17,262	557	3.23	
カナダ	10,000 (2003.05.30)	17,459	16,499	960	5.82	
欧州	10,000 (1998.07.31)	14,217	13,837	380	2.75	
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,919	10,395	523	5.04	
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	21,490	20,688	802	3.87	
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	26,587	25,562	1,025	4.01	
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,556	11,215	341	3.04	
複合地域	10,000 (2001.11.30)	19,094	18,491	603	3.26	
エマージング債券		20,317	19,195	1,122	5.85	
グローバル		20,160	19,046	1,114	5.85	
米ドル建て		20,343	19,251	1,093	5.68	
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	14,913	14,029	884	6.30	
その他	8,647 (2005.03.31)	16,576	15,660	915	5.85	
ロシア	10,000 (2008.05.30)	524	569	-45	-7.98	
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	16,166	15,616	550	3.52	
インド	10,000 (2011.08.31)	21,259	20,339	920	4.52	
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	20,147	19,369	778	4.02	
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	16,526	15,094	1,432	9.49	
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	20,430	18,717	1,714	9.16	
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,910	3,726	-817	-21.92	
複合地域	10,000 (2006.08.31)	12,187	11,492	695	6.05	
ハイイールド債券		27,471	26,232	1,238	4.72	
グローバル	10,000 (1997.06.30)	25,713	24,501	1,212	4.95	
北米		27,840	26,583	1,258	4.73	
その他	10,000 (2004.03.31)	24,512	23,505	1,007	4.29	
欧州	10,000 (2006.04.28)	24,862	23,958	903	3.77	
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	15,114	14,240	874	6.14	
複合地域	10,000 (2004.03.31)	24,192	23,135	1,058	4.57	
複合資産		19,913	19,228	685	3.56	
安定	10,000 (1998.10.30)	16,324	15,945	379	2.38	
安定成長		22,124	21,298	826	3.88	
成長		27,944	26,583	1,361	5.12	
国内バランス		12,566	12,452	114	0.92	
安定		12,671	12,595	76	0.60	
一般		17,242	16,638	604	3.63	
その他	10,000 (2018.10.31)	12,312	11,849	464	3.91	

※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		17,307	16,400	906	5.53	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	34,788	34,918	-131	-0.37	
日本	10,000 (2003.10.31)	34,788	34,918	-131	-0.37	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	34,817	32,464	2,353	7.25	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	28,608	26,902	1,706	6.34	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	32,039	30,110	1,929	6.41	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	28,368	26,685	1,683	6.31	
北米	10,000 (2003.09.30)	37,136	34,238	2,897	8.46	
その他	10,000 (2004.04.30)	30,523	29,640	883	2.98	
欧州	10,000 (2006.12.29)	4,978	4,823	156	3.23	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	22,577	21,958	620	2.82	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	17,039	16,711	328	1.96	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,459	7,187	271	3.78	
複数国	10,000 (2004.04.30)	46,431	43,731	2,699	6.17	
その他		6,678	6,541	137	2.10	
絶対収益型		7,467	7,411	56	0.76	
ロング・ショート		8,250	8,235	16	0.19	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,336	11,315	20	0.18	
GTAA		11,409	11,384	25	0.22	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,005	6,945	59	0.85	
CB		20,361	19,822	539	2.72	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	21,636	20,973	663	3.16	
日本		20,436	19,858	578	2.91	
グローバル		35,521	34,583	938	2.71	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	12,123	12,055	68	0.56	
全業種	10,000 (2004.12.30)	11,276	10,838	438	4.04	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	20,271	20,490	-218	-1.06	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	9,147	8,646	501	5.80	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	15,756	14,757	999	6.77	

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

[色塗りの基準]月次リターン> 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	11.34	16.84	13.55	16.84
国内株式	14.50	22.45	24.22	22.45
一般	13.81	21.27	23.28	21.27
フリー	13.86	21.28	23.31	21.28
バリュー	13.62	21.22	23.13	21.22
小型	7.68	12.79	19.15	12.79
その他	16.67	25.81	26.36	25.81
日経225	18.43	28.37	27.93	28.37
TOPIX	14.37	22.53	25.35	22.53
JPX日経400	15.03	23.26	26.33	23.26
国内債券	0.56	2.45	-0.75	2.45
一般	0.56	2.45	-0.75	2.45
外国株式(先進国)	15.60	24.82	21.06	24.82
グローバル	14.65	24.03	20.38	24.03
除く日本	14.97	22.50	21.40	22.50
含む日本	14.53	24.65	20.00	24.65
その他	17.62	26.49	22.51	26.49
北米	17.44	21.84	24.35	21.84
米国	17.97	27.13	23.01	27.13
カナダ	6.01	6.24	1.14	6.24
欧州	9.36	17.76	20.15	17.76
ドイツ	10.08	24.66	33.53	24.66
イギリス	2.69	3.02	4.64	3.02
アジア・オセアニア	4.73	10.41	4.86	10.41
オーストラリア	9.28	10.21	7.46	10.21
ニュージーランド	3.47	5.57	13.80	5.57
複合地域	8.00	3.57	9.37	3.57
エマージング株式	13.86	15.08	9.75	15.08
グローバル	10.51	15.52	9.91	15.52
BRICS	11.60	10.90	4.54	10.90
その他	15.63	14.89	9.71	14.89
欧州	22.20	27.01	38.16	27.01
ロシア	0.71	-18.52	-27.18	-18.52
アジア・オセアニア	7.72	12.96	4.04	12.96
中国	-0.04	1.51	-14.90	1.51
インド	22.14	16.61	19.71	16.61
インドネシア	11.05	16.36	11.26	16.36
タイ	-2.00	-2.15	2.72	-2.15
フィリピン	5.11	10.55	8.47	10.55
ベトナム	14.95	20.51	-4.37	20.51
韓国	22.36	33.25	23.06	33.25
香港	2.23	4.93	-7.23	4.93
中南米	23.71	27.56	35.39	27.56
ブラジル	26.67	23.99	26.63	23.99
メキシコ	14.62	34.28	41.74	34.28
中東・アフリカ	8.05	6.64	-1.06	6.64
トルコ	-5.69	-13.07	55.88	-13.07
複合地域	9.26	15.28	9.11	15.28

※[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	11.34	16.84	13.55	16.84
外国債券(先進国)	4.26	6.06	1.97	6.06
グローバル	4.06	5.69	1.84	5.69
除く日本	5.49	8.27	2.41	8.27
含む日本	2.89	3.60	1.45	3.60
その他	5.11	7.65	2.50	7.65
北米	4.33	5.27	1.70	5.27
米国	4.86	6.50	1.56	6.50
カナダ	8.90	11.68	3.59	11.68
欧州	3.98	5.24	1.47	5.24
イギリス	6.80	12.39	4.27	12.39
アジア・オセアニア	4.84	8.13	3.31	8.13
オーストラリア	5.04	8.50	3.51	8.50
ニュージーランド	3.88	6.19	2.02	6.19
複合地域	6.51	9.34	2.50	9.34
エマージング債券	11.68	15.41	14.51	15.41
グローバル	10.33	13.19	13.16	13.19
米ドル建て	10.16	12.00	12.10	12.00
現地通貨建て	10.79	16.46	15.99	16.46
その他	13.44	18.37	16.22	18.37
ロシア	-55.15	-56.41	-59.95	-56.41
アジア・オセアニア	6.76	9.55	6.21	9.55
インド	10.98	13.25	8.32	13.25
インドネシア	12.44	19.26	14.26	19.26
ブラジル	20.47	29.30	30.73	29.30
メキシコ	18.92	30.58	36.60	30.58
トルコ	-20.89	-22.65	-9.15	-22.65
複合地域	11.94	18.90	21.34	18.90
ハイイールド債券	9.56	12.32	12.78	12.32
グローバル	8.69	11.18	11.26	11.18
北米	9.96	12.73	13.09	12.73
その他	7.87	10.90	12.96	10.90
欧州	7.85	10.94	13.78	10.94
アジア・オセアニア	7.85	10.76	9.95	10.76
複合地域	9.06	11.68	12.16	11.68
複合資産	6.67	9.93	6.94	9.93
安定	4.49	6.33	3.42	6.33
安定成長	7.30	10.93	7.99	10.93
成長	9.90	14.62	12.92	14.62
国内バランス	1.73	2.73	0.11	2.73
安定	1.11	1.97	-0.81	1.97
一般	7.48	10.42	9.87	10.42
その他	4.98	13.60	-0.56	13.60

※[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	11.34	16.84	13.55	16.84
国内REIT	5.24	0.74	-1.15	0.74
日本	5.24	0.74	-1.15	0.74
外国REIT	11.31	11.68	1.42	11.68
グローバル	10.45	10.48	0.47	10.48
除く日本	10.64	10.65	0.33	10.65
含む日本	10.35	10.41	0.55	10.41
北米	12.63	13.36	2.72	13.36
その他	6.12	5.64	-3.10	5.64
欧州	4.46	2.76	-5.37	2.76
アジア・オセアニア	5.19	5.35	-4.97	5.35
オーストラリア	8.43	5.56	2.71	5.56
複合地域	4.57	4.74	2.51	4.74
複数国	10.76	9.88	1.35	9.88
その他	5.57	11.00	6.57	11.00
絶対収益型	1.02	0.76	-1.09	0.76
ロング・ショート	0.55	1.90	0.86	1.90
マーケットニュートラル	1.18	0.41	0.37	0.41
GTAA	0.15	0.79	-2.42	0.79
その他スタイル	1.08	0.71	-1.25	0.71
CB	4.25	6.25	4.37	6.25
アジア・オセアニア	6.29	10.82	0.86	10.82
日本	3.95	4.84	4.61	4.84
グローバル	4.23	6.21	4.55	6.21
コモディティ	1.58	5.17	-0.63	5.17
全業種	5.01	0.18	-9.70	0.18
貴金属	0.00	7.72	4.70	7.72
エネルギー	5.92	2.78	-14.93	2.78
その他コモディティ	6.56	3.10	-2.07	3.10

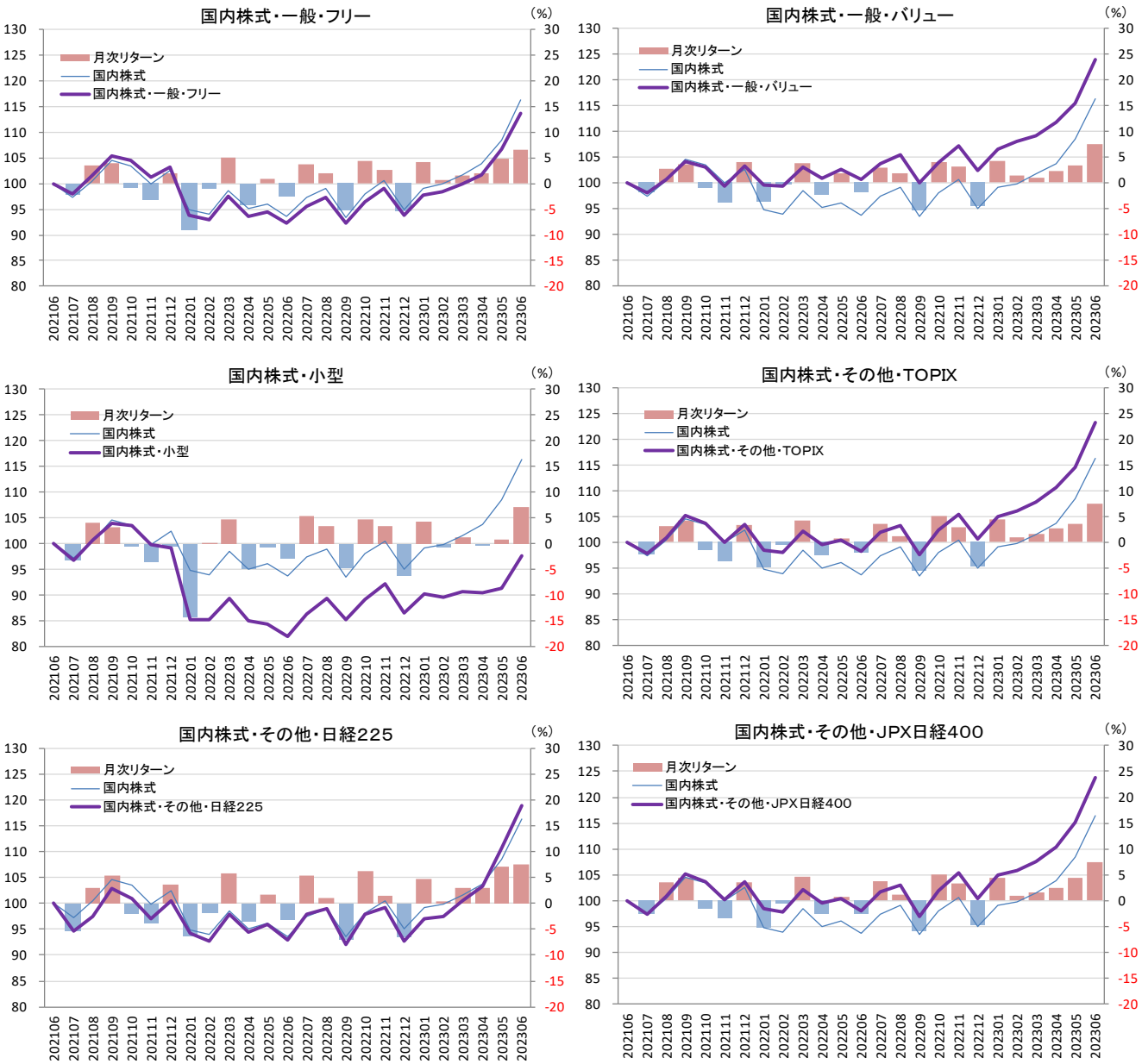
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

＜1＞パフォーマンス・サマリー

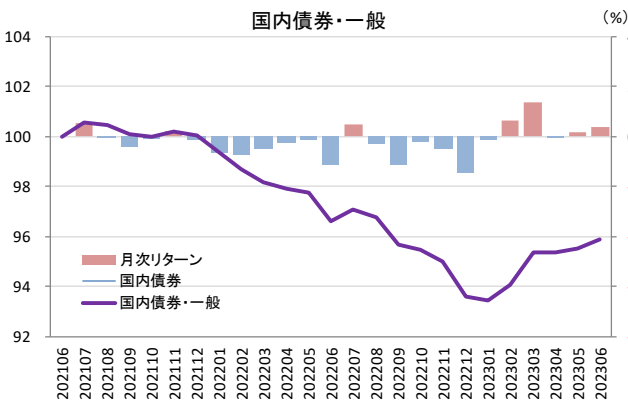
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

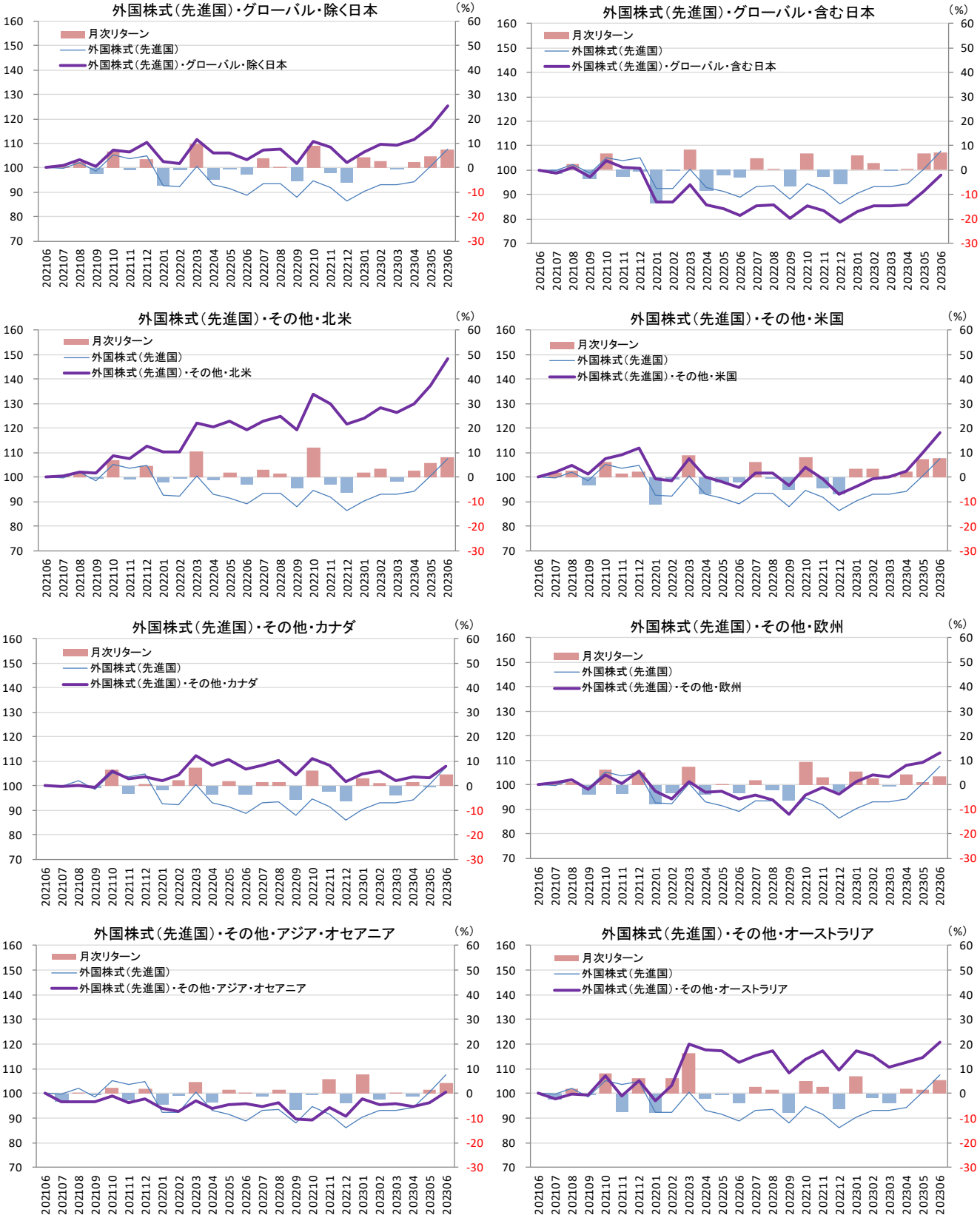


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

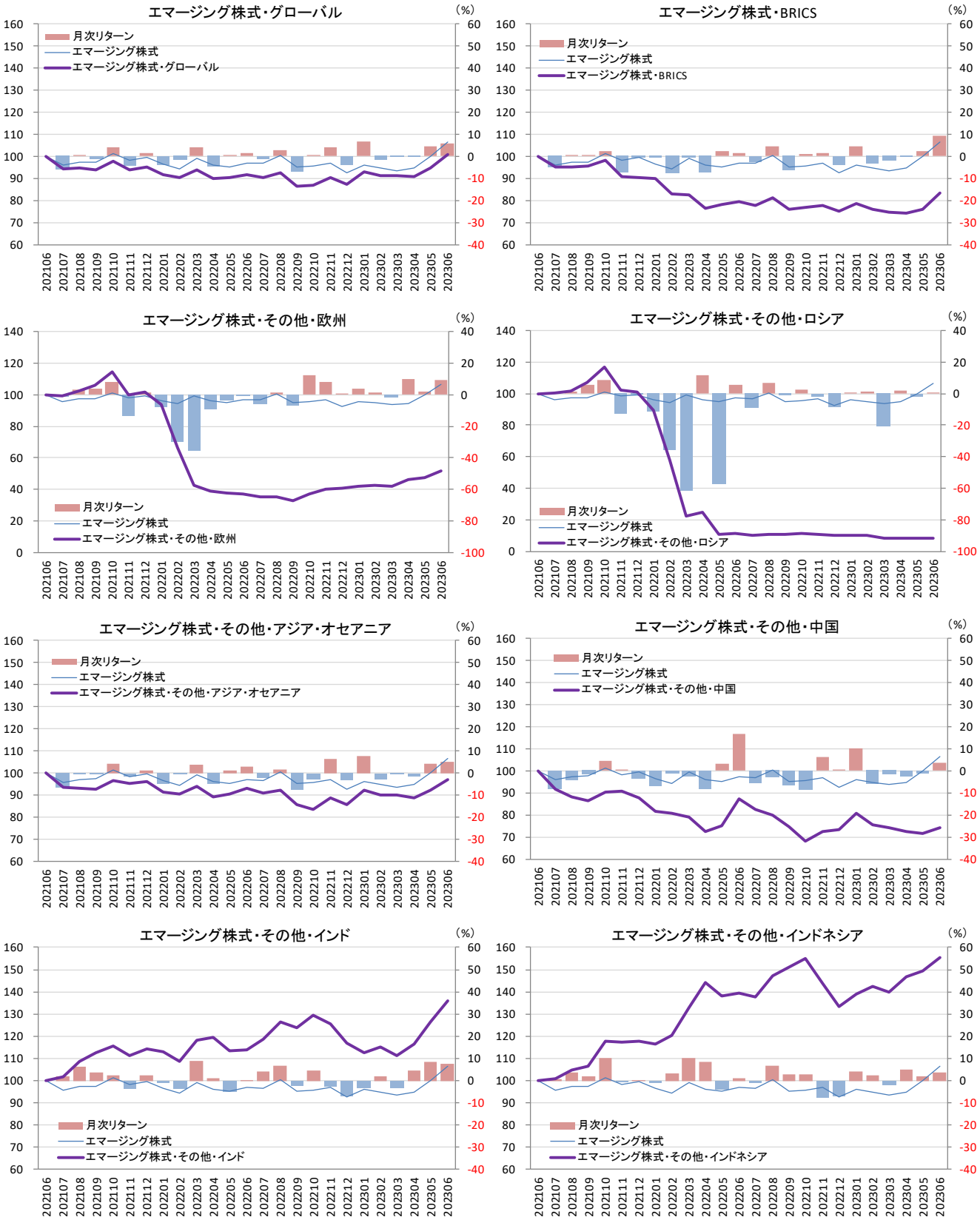


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

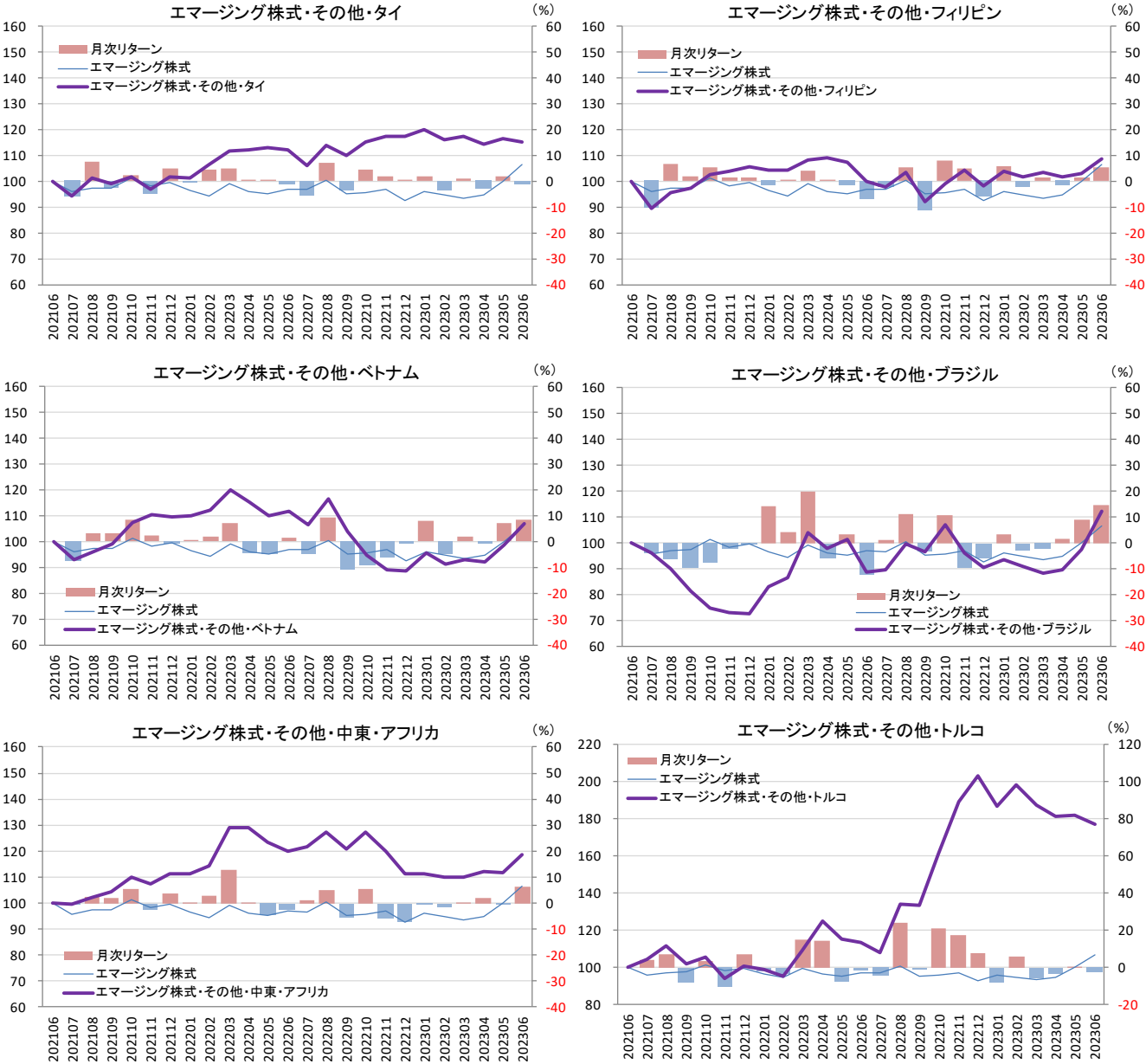


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

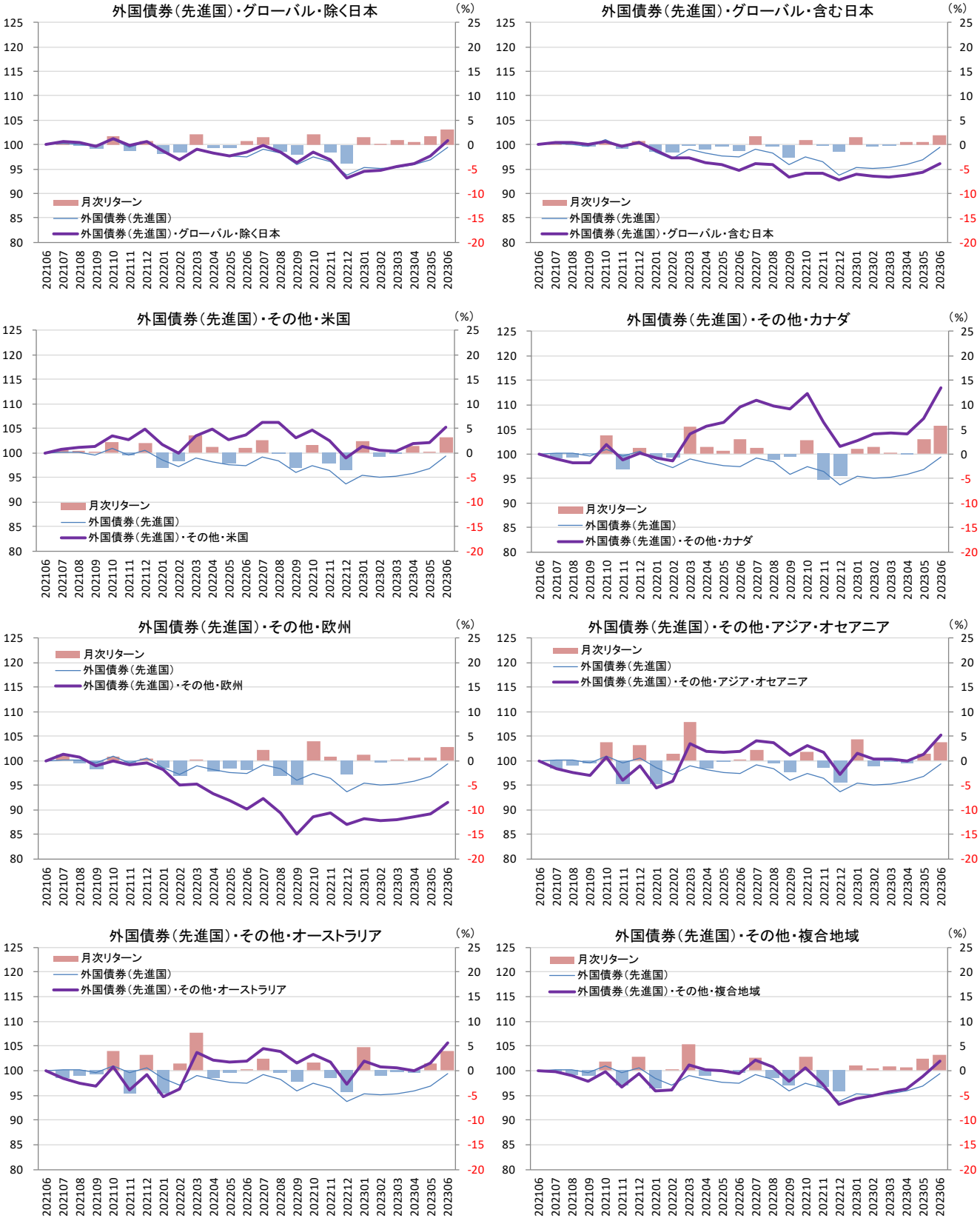


＜1＞パフォーマンス・サマリー

(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)]

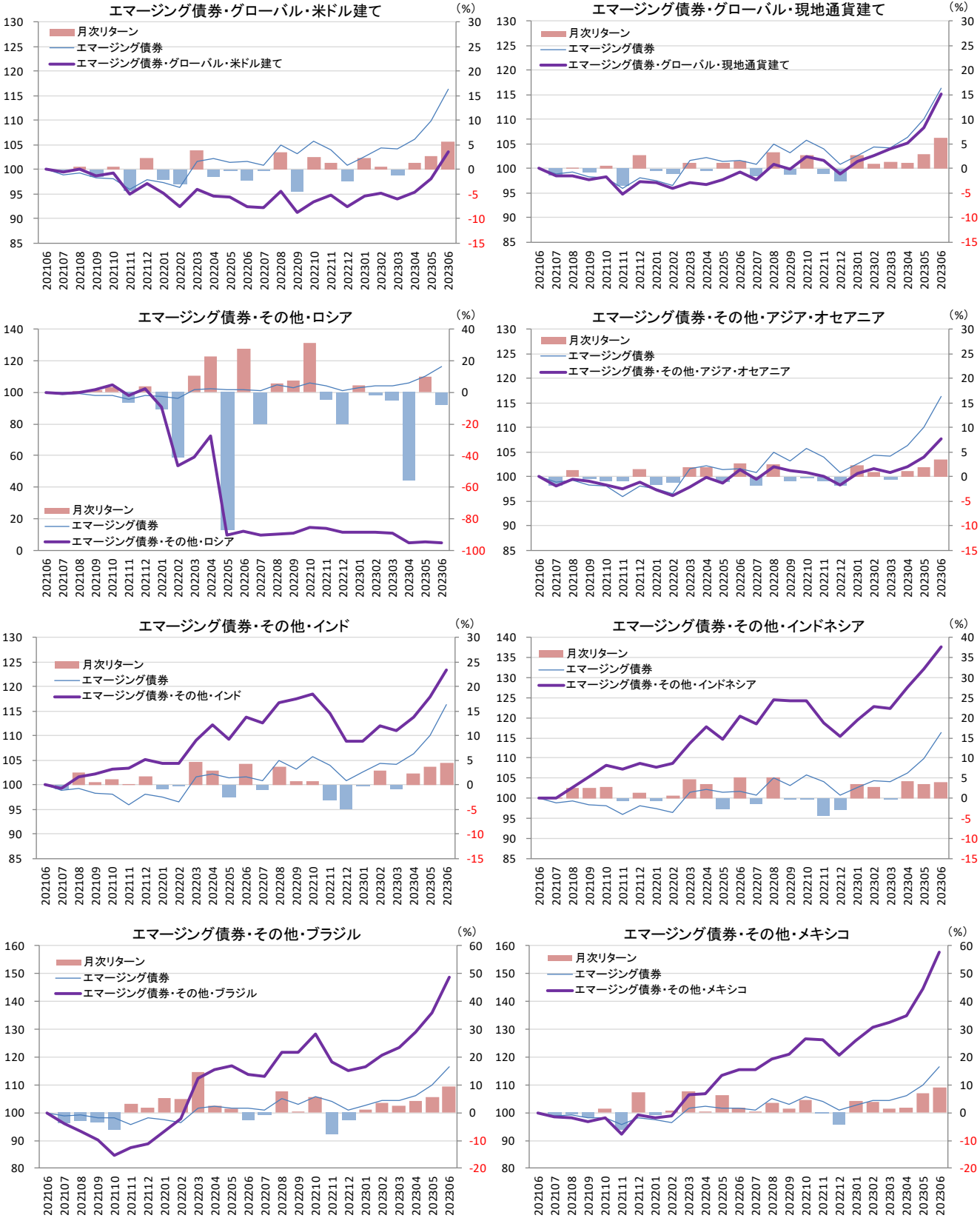


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

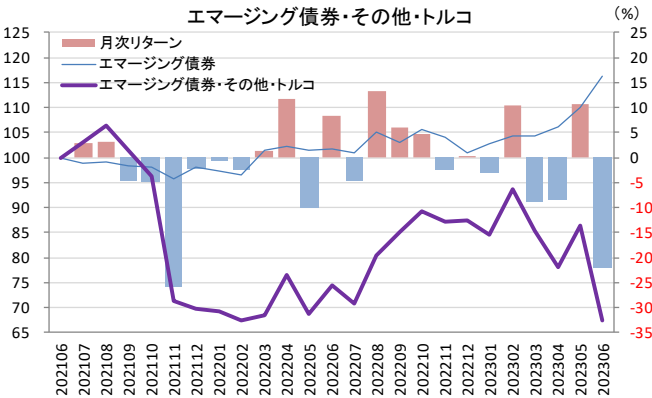


＜1＞パフォーマンス・サマリー

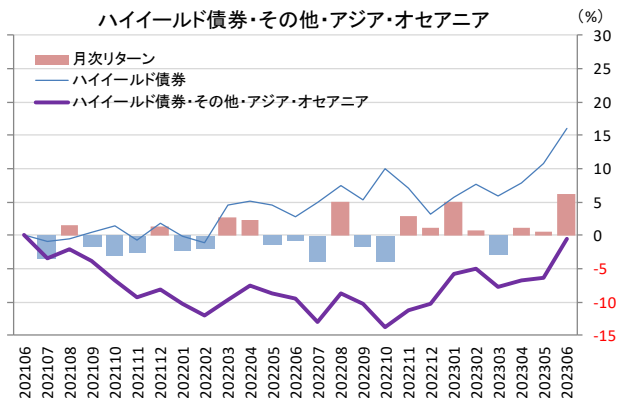
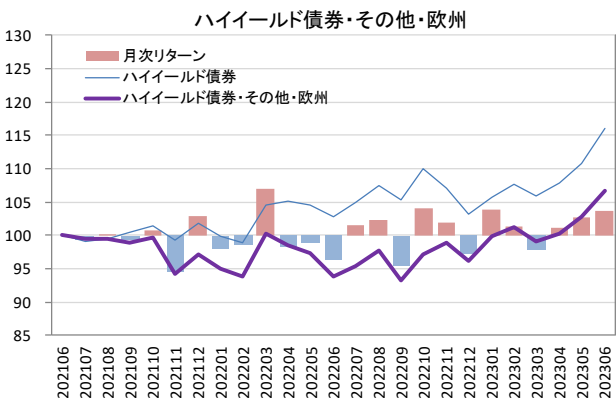
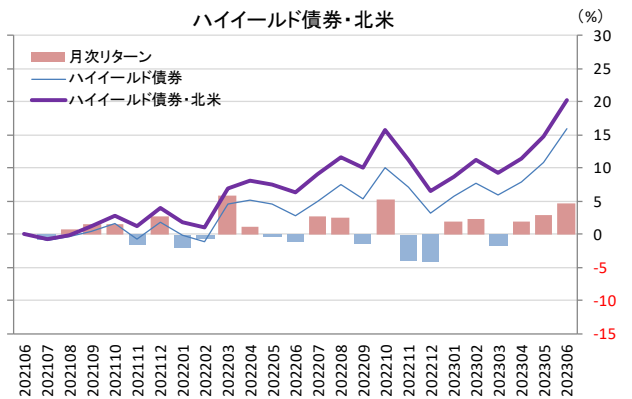
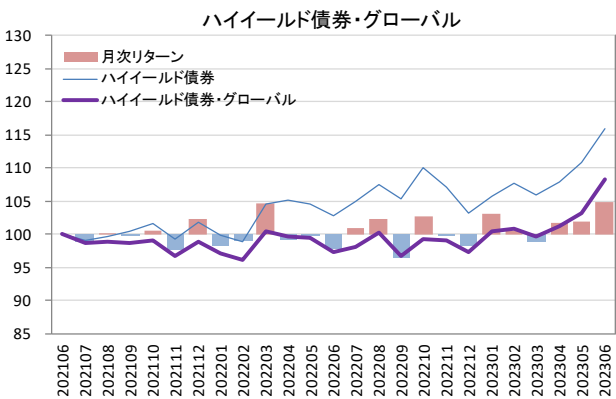
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

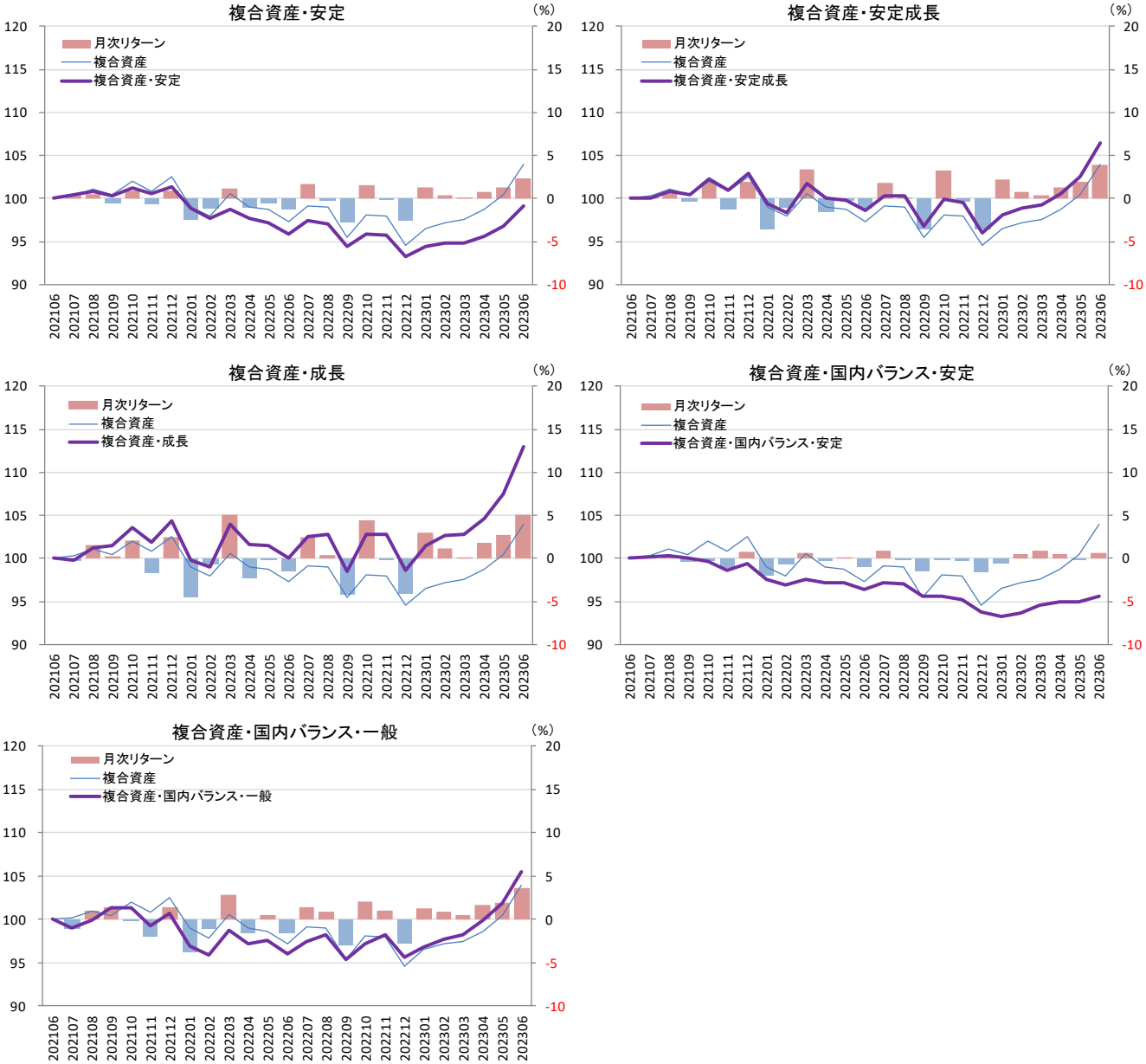


＜1＞パフォーマンス・サマリー

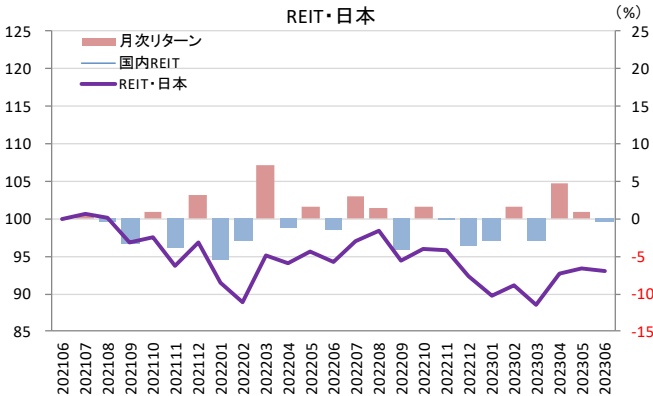
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

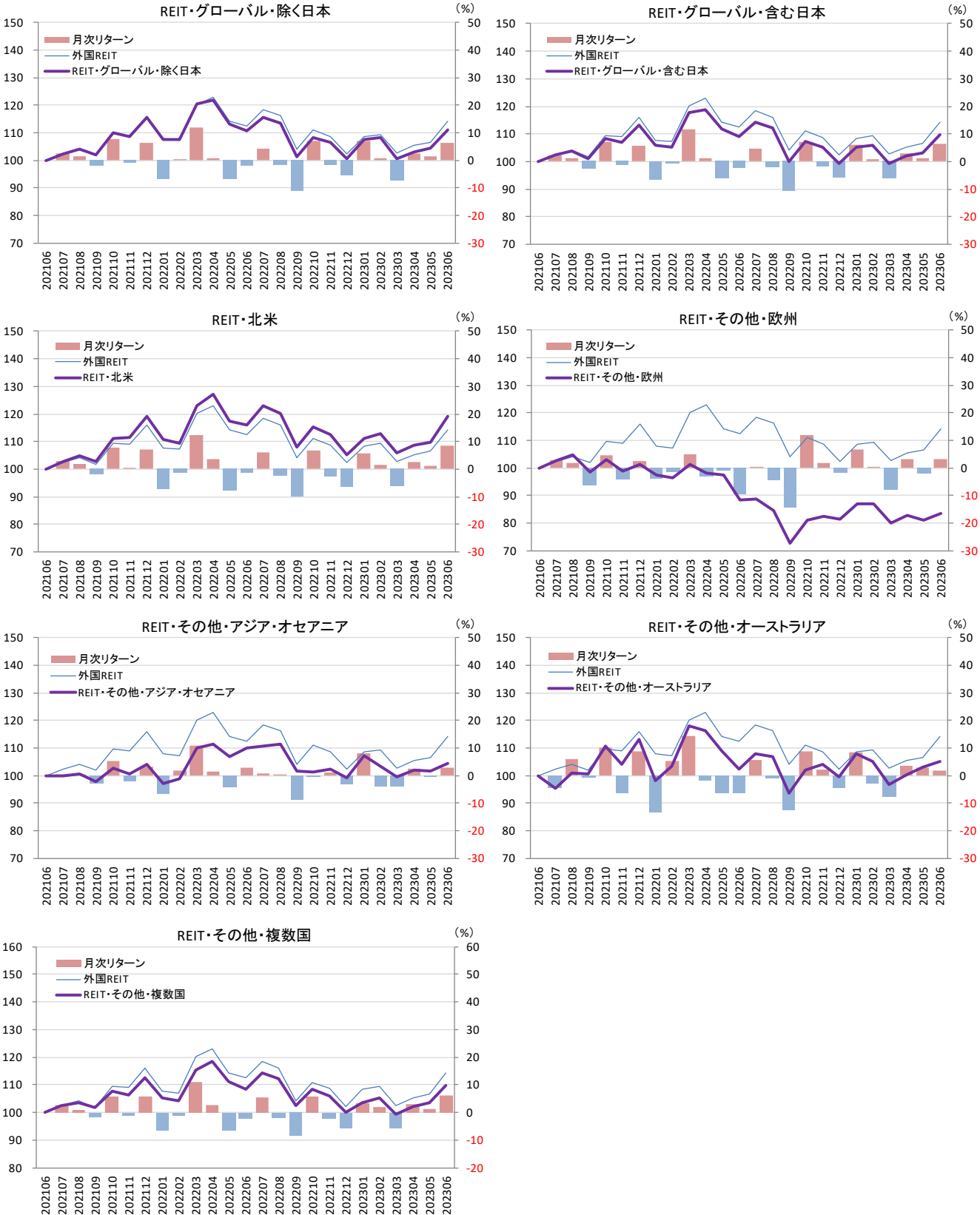


＜1＞パフォーマンス・サマリー

(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]

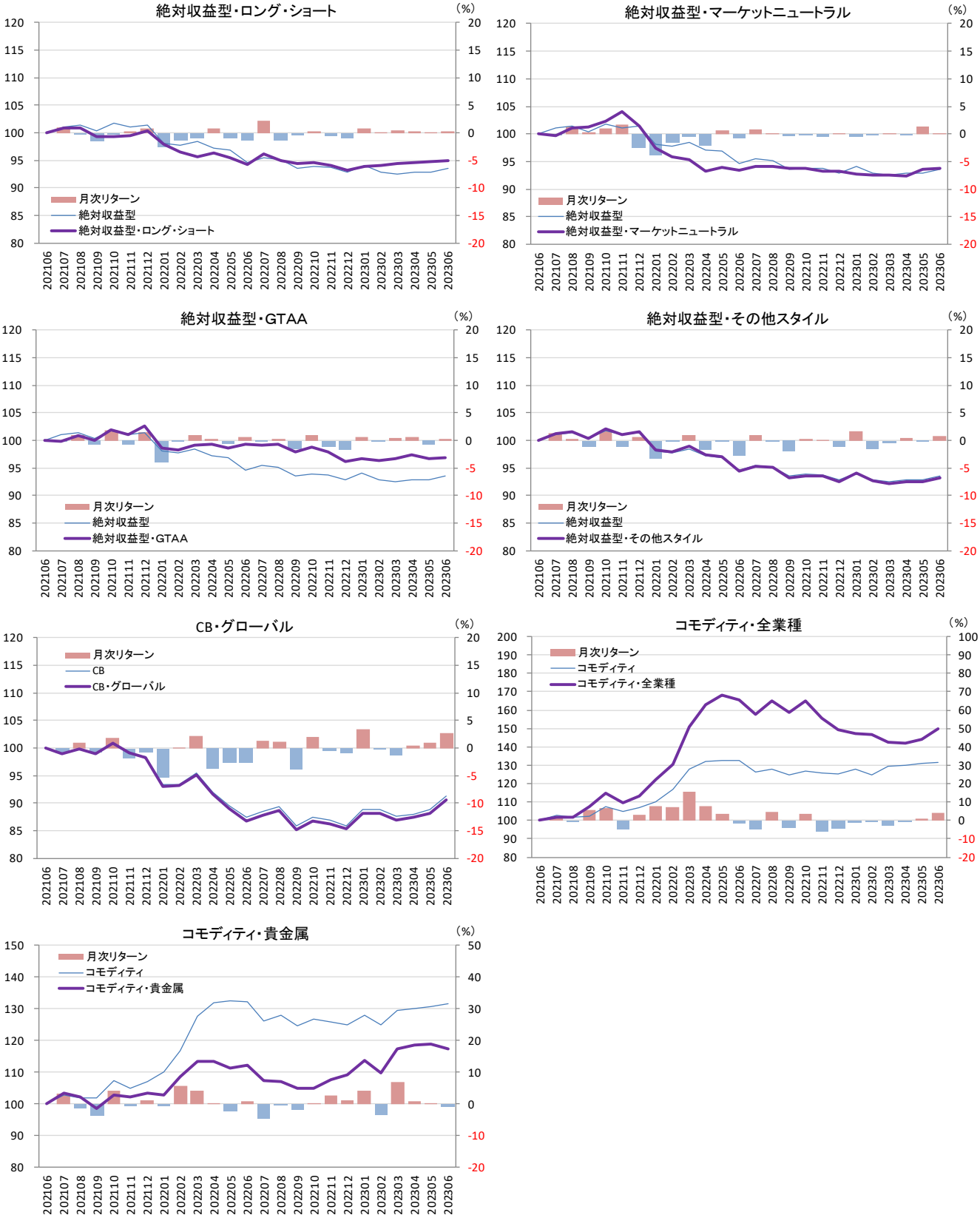


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	5.53				
1	外国株式(先進国)・グローバル	7.15		28.88		2.05
2	外国株式(先進国)・その他	7.49		13.77		1.02
3	国内株式・一般	6.78		7.27		0.49
4	国内株式・その他	7.83		4.82		0.38
5	複合資産・安定成長	3.88		6.51		0.25
6	REIT・北米	8.46		2.48		0.21
7	外国債券(先進国)・グローバル	2.41		7.27		0.18
8	複合資産・成長	5.12		2.99		0.15
9	エマージング株式・その他	6.88		2.17		0.15
10	REIT・グローバル	6.34		1.82		0.11
11	複合資産・安定	2.38		4.04		0.10
12	ハイイールド債券・北米	4.73		1.46		0.07
13	エマージング株式・グローバル	6.09		1.06		0.06
14	外国債券(先進国)・その他	3.61		1.74		0.06
15	国内株式・小型	7.13		0.76		0.05
16	エマージング債券・グローバル	5.85		0.66		0.04
17	ブルベア	6.38		0.56		0.04
18	エマージング債券・その他	5.85		0.52		0.03
19	国内債券・一般	0.38		4.27		0.02
20	ハイイールド債券・グローバル	4.95		0.28		0.01
21	複合資産・その他	3.91		0.33		0.01
22	絶対収益型	0.76		1.21		0.01
23	REIT・その他	2.98		0.31		0.01
24	ハイイールド債券・その他	4.29		0.20		0.01
25	CB	2.72		0.29		0.01
26	複合資産・国内バランス	0.92		0.74		0.01
27	国内株式・業種特化	6.87		0.08		0.01
28	エマージング株式・BRICS	9.39		0.05		0.00
29	コモディティ	0.56		0.57		0.00
30	REIT・日本	-0.37		2.90		-0.01
	合計			100.00		5.53

◆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	13.55				
1	外国株式(先進国)・グローバル	20.38		28.03		5.71
2	外国株式(先進国)・その他	22.51		13.00		2.97
3	国内株式・一般	23.28		6.83		1.52
4	国内株式・その他	26.36		4.72		1.21
5	複合資産・安定成長	7.99		6.64		0.54
6	複合資産・成長	12.92		2.83		0.38
7	ブルベア	38.51		0.50		0.20
8	エマージング株式・その他	9.71		2.08		0.19
9	ハイイールド債券・北米	13.09		1.44		0.17
10	複合資産・安定	3.42		4.38		0.14
11	国内株式・小型	19.15		0.77		0.13
12	外国債券(先進国)・グローバル	1.84		7.59		0.12
13	エマージング株式・グローバル	9.91		1.06		0.10
14	エマージング債券・グローバル	13.16		0.69		0.08
15	エマージング債券・その他	16.22		0.55		0.08
16	REIT・北米	2.72		2.70		0.06
17	外国債券(先進国)・その他	2.50		1.81		0.05
18	ハイイールド債券・グローバル	11.26		0.30		0.03
19	ハイイールド債券・その他	12.96		0.22		0.03
20	国内株式・業種特化	25.11		0.08		0.02
21	CB	4.37		0.22		0.01
22	エマージング株式・BRICS	4.54		0.05		0.00
23	複合資産・国内バランス	0.11		0.86		-0.00
24	複合資産・その他	-0.56		0.35		-0.00
25	コモディティ	-0.63		0.56		-0.01
26	REIT・グローバル	0.47		2.00		-0.01
27	REIT・その他	-3.10		0.36		-0.02
28	絶対収益型	-1.09		1.33		-0.02
29	国内債券・一般	-0.75		4.84		-0.06
30	REIT・日本	-1.15		3.19		-0.07
	合計			100.00		13.55

◆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	35.40	37.46	81.22	10.94	12.09	10.63	0.97	0.55	0.58
国内株式	50.56	42.06	143.18	13.68	16.34	15.53	1.07	0.45	0.60
一般	49.67	39.13	133.11	13.15	16.08	15.58	1.10	0.43	0.57
フリー	46.64	38.03	130.85	13.50	16.44	15.97	1.01	0.41	0.55
バリュー	60.61	42.29	140.02	12.62	15.23	14.64	1.36	0.48	0.63
小型	27.96	20.16	174.77	16.09	19.75	16.97	0.53	0.19	0.63
その他	56.10	53.47	157.49	14.67	16.30	15.56	1.09	0.55	0.64
日経225	55.11	60.30	175.49	16.16	17.41	16.32	0.98	0.57	0.65
TOPIX	56.59	47.26	144.39	13.47	15.37	14.88	1.20	0.53	0.63
JPX日経400	56.55	49.36	-	13.99	15.59	-	1.15	0.54	-
国内債券	-3.92	-3.27	4.64	1.94	2.03	1.80	-0.67	-0.31	0.26
一般	-3.92	-3.27	4.64	1.94	2.03	1.80	-0.67	-0.31	0.26
外国株式(先進国)	54.93	71.57	152.94	16.73	18.48	15.94	0.94	0.62	0.61
グローバル	50.42	68.10	159.66	16.91	18.59	15.88	0.86	0.59	0.63
除く日本	82.16	90.45	220.24	15.55	18.14	16.39	1.42	0.76	0.75
含む日本	41.62	61.46	143.77	17.75	19.01	15.98	0.69	0.53	0.58
その他	67.22	79.66	139.07	16.71	18.48	16.32	1.12	0.67	0.56
北米	125.24	120.92	211.60	15.40	19.45	17.46	2.02	0.89	0.69
米国	67.46	93.03	173.02	16.93	18.30	16.69	1.11	0.77	0.63
カナダ	50.62	31.20	26.13	13.38	18.86	15.97	1.10	0.30	0.15
欧州	53.34	50.24	110.04	15.83	18.18	16.05	0.97	0.47	0.48
ドイツ	62.90	50.49	-	20.49 ↓	22.60	-	0.86	0.38	-
イギリス	53.77	20.36	-	13.95 ↓	17.46	-	1.11	0.22	-
アジア・オセアニア	31.15	27.36	95.85	11.33	15.29	14.72	0.84	0.33	0.47
オーストラリア	67.27	35.38	72.42	19.74	24.01	19.75	0.95	0.26	0.28
ニュージーランド	39.69	57.74	233.12	16.02 ↓	17.99	17.54	0.74	0.53	0.73
複合地域	173.67	33.78	49.60	29.25 ↓	33.61	26.57	1.36	0.18	0.16
エマージング株式	55.85	44.24	95.17	12.37 ↓	18.14	16.46	1.29	0.42	0.42
グローバル	45.36	47.66	78.56	13.51 ↓	18.17	16.63	0.99	0.45	0.36
BRICS	20.54	20.40	76.82	15.47	20.91	19.27	0.42	0.18	0.30
その他	61.89	44.27	103.61	12.29 ↓	18.57	16.69	1.42	0.41	0.44
欧州	-33.80	-36.73	-31.69	35.24	33.12	27.11	-0.36	-0.26	-0.14
ロシア	-88.63	-87.42	-84.01	57.24	48.70	38.62	-0.90	-0.70	-0.43
アジア・オセアニア	33.72	26.12	70.94	14.19 ↓	17.77	15.98	0.72	0.27	0.35
中国	0.83	25.34	144.75	20.37	21.61	21.04	0.02	0.22	0.45
インド	115.51	74.72	242.76	16.11 ↓	23.74	22.43	1.81	0.50	0.59
インドネシア	76.45	50.02	29.40	19.14 ↓	26.39	24.00	1.09	0.32	0.11
タイ	27.06	3.23	27.99	16.95	20.91	18.19	0.49	0.03	0.14
フィリピン	30.56	10.09	12.85	16.51 ↓	20.63	18.77 ↓	0.56	0.10	0.07
ベトナム	96.12	47.67	146.04	22.51	26.16	21.20	1.12	0.31	0.44
韓国	54.72	34.70	70.28	25.07	25.76	20.61	0.63	0.24	0.27
香港	9.33	-3.84	46.47	21.97	21.85	19.78	0.14	-0.03	0.20
中南米	98.16	71.92	53.55	26.73	30.73	26.45	0.96	0.37	0.17
ブラジル	57.21	43.22	8.77	29.97	34.67	31.92	0.54	0.22	0.03
メキシコ	161.48	80.23	66.13	22.29	28.50	23.67	1.70	0.44	0.22
中東・アフリカ	72.75	42.07	83.88	14.38	18.73	16.73	1.39	0.39	0.38
トルコ	74.67	36.88	-12.86	32.94	36.27	31.67	0.62	0.18	-0.04
複合地域	43.31	31.31	59.55	15.06 ↓	18.15	15.69	0.85	0.31	0.31

※[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

(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	35.40	37.46	81.22	10.94	12.09	10.63	0.97	0.55	0.58
外国債券(先進国)	4.98	9.58	17.78	4.48	4.70	5.33 ↓	0.37	0.40	0.31
グローバル	2.30	8.14	18.59	3.96	4.01	4.76 ↓	0.20	0.40	0.36
除く日本	4.65	12.21	21.71	5.02	4.43	5.35 ↓	0.31	0.53	0.37
含む日本	0.38	4.40	16.08	3.46	4.30	4.49 ↓	0.05	0.21	0.34
その他	14.70	15.70	20.35	7.24	7.65	7.53 ↓	0.65	0.39	0.25
北米	1.13	5.23	24.31	4.31	4.96	4.64	0.09	0.21	0.48
米国	16.50	18.80	36.99	6.26	7.23	6.56	0.84	0.49	0.49
カナダ	25.56	28.40	18.84	8.39	7.83	8.61	0.94	0.66	0.20
欧州	-6.40	-5.56	5.79	6.04	5.40	6.65 ↓	-0.36	-0.20	0.09
イギリス	18.39	13.75	-	10.41	9.60	-	0.56	0.28	-
アジア・オセアニア	16.76	16.40	21.31	9.41	9.80	9.18 ↓	0.57	0.32	0.21
オーストラリア	17.65	16.67	20.06	9.42	9.86	9.26	0.59	0.32	0.20
ニュージーランド	5.38	10.11	-	9.12 ↓	9.22	-	0.20	0.22	-
複合地域	8.04	19.20	25.72	7.35	6.13	7.04 ↓	0.36	0.59	0.33
エマージング債券	28.86	27.48	35.69	7.61	11.03	10.91	1.16	0.45	0.29
グローバル	18.09	16.49	25.25	8.15	12.44	11.41	0.70	0.25	0.20
米ドル建て	15.88	14.07	24.93	8.72	13.00	11.81	0.58	0.21	0.19
現地通貨建て	24.03	23.26	16.39	7.30	11.08	10.44	1.02	0.39	0.15
その他	43.28	42.05	46.77	8.74	10.78	11.55	1.46	0.68	0.34
ロシア	-95.17	-94.77	-95.24	73.49	58.86 ↑	44.93	-0.86	-0.76	-0.58
アジア・オセアニア	12.71	21.95	43.67	5.10	6.67	6.97 ↓	0.80	0.61	0.53
インド	37.91	44.18	93.23	7.88	9.34	10.86 ↓	1.44	0.82	0.63
インドネシア	50.75	68.18	56.04	8.60 ↓	14.35	15.22	1.71	0.77	0.30
ブラジル	64.31	42.23	46.54	17.51	19.68	18.60	1.03	0.37	0.21
メキシコ	87.90	92.56	69.11	12.05	16.68	15.43	1.94	0.84	0.35
トルコ	-48.55	-50.56	-73.86	31.10 ↑	35.65	27.97	-0.64	-0.37	-0.45
複合地域	20.84	18.38	12.23	9.97	12.30	11.95	0.66	0.28	0.10
ハイイールド債券	38.56	32.43	63.55	7.94	11.57	10.49	1.45	0.50	0.48
グローバル	27.81	22.70	48.43	7.39	11.40	10.49	1.16	0.37	0.39
北米	45.04	38.70	75.98	8.26	11.61	10.48	1.60	0.59	0.56
その他	21.88	16.04	36.81	9.13	12.81	11.49	0.75	0.24	0.28
欧州	24.09	16.45	37.35	10.15	13.68	12.24	0.74	0.23	0.26
アジア・オセアニア	13.09	13.35	38.49	8.92	11.80	10.34	0.47	0.22	0.32
複合地域	27.79	30.85	63.19	7.42	8.88	8.84 ↓	1.15	0.63	0.57
複合資産	18.46	19.42	53.30	6.42	7.32	7.22 ↓	0.91	0.50	0.61
安定	6.78	8.41	33.26	4.41	5.04	5.41 ↓	0.51	0.33	0.54
安定成長	22.98	24.84	60.46	6.85	7.85	7.61 ↓	1.05	0.58	0.64
成長	40.29	40.96	102.90	9.38	11.09	10.48	1.28	0.64	0.70
国内バランス	1.02	-2.44	9.80	2.96	3.92	5.05	0.12	-0.12	0.19
安定	-0.59	-3.83	12.64	2.81	3.73	3.06	-0.06	-0.20	0.40
一般	24.21	20.42	45.37	7.04	8.36	8.86	1.07	0.46	0.43

※[色塗りの基準] 累積リターン> 総合、リスク< 総合、シャープ・レシオ>=0.5

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

＜2＞リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別③

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	35.40	37.46	81.22	10.94	12.09	10.63	0.97	0.55	0.58
国内REIT	24.50	25.33	83.11	11.53 ↓	14.89	13.35	0.66	0.31	0.47
日本	24.50	25.33	83.11	11.53 ↓	14.89	13.35	0.66	0.31	0.47
外国REIT	56.60	45.02	110.60	17.51	18.84	16.31	0.92	0.41	0.47
グローバル	51.45	32.90	86.79	17.70	19.49	16.50	0.84	0.30	0.39
除く日本	56.09	40.46	111.78	18.42	20.13	16.85	0.87	0.35	0.46
含む日本	49.86	30.74	82.57	17.43	19.27	16.38	0.83	0.29	0.38
北米	64.95	57.95	134.76	18.18	18.73	16.66	1.00	0.51	0.54
その他	32.81	27.79	91.53	15.14 ↓	19.23	15.86	0.66	0.26	0.42
欧州	6.73	-14.38	32.42	19.72	21.02	18.34	0.11	-0.14	0.16
アジア・オセアニア	28.39	30.84	98.57	13.85 ↓	17.82	15.14	0.63	0.31	0.47
オーストラリア	49.42	23.04	70.01	23.63	29.13	22.75	0.61	0.15	0.24
複合地域	48.57	3.82	39.40	18.69	24.95	20.19	0.76	0.03	0.17
複数国	52.50	51.16	148.18	16.17	17.38	14.99	0.94	0.50	0.64
その他									
絶対収益型	-2.67	-4.86	-1.30	3.65	3.22	2.75	-0.24	-0.30	-0.04
ロング・ショート	-5.10	-7.41	-8.24	3.15	3.30	3.06	-0.54	-0.45	-0.28
マーケットニュートラル	-7.24	-8.61	27.68	4.37 ↓	4.13	5.55	-0.56	-0.42	0.45
GTAA	6.51	9.24	10.54	4.32 ↓	4.39	3.40	0.50	0.41	0.30
その他スタイル	-2.15	-4.72	-1.31	4.03	3.47	3.04 ↓	-0.17	-0.27	-0.04
CB	9.57	10.64	27.79	7.54 ↓	8.89	7.66	0.41	0.23	0.33
アジア・オセアニア	43.29	48.91	105.19	10.06 ↓	12.31	11.43	1.27	0.68	0.65
日本	4.65	-1.02	21.30	4.49	5.20	5.38	0.35	-0.03	0.36
グローバル	8.86	10.21	26.61	7.79 ↓	9.12	7.75	0.37	0.22	0.31
コモディティ	51.42	54.74	15.78	11.40 ↓	11.23	12.09	1.30	0.82	0.12
全業種	125.49	58.51	18.79	16.67	19.19	16.90	1.87	0.50	0.10
貴金属	15.57	54.33	47.73	13.45	12.34	11.62 ↓	0.37	0.74	0.34
エネルギー	183.85	65.87	15.93	28.32 ↓	36.92	31.37	1.47	0.29	0.05
その他コモディティ	101.67	45.14	23.03	16.34	19.10	16.97	1.61	0.41	0.12

※[色塗りの基準] 累積リターン> 総合、リスク< 総合、シャープ・レシオ>=0.5

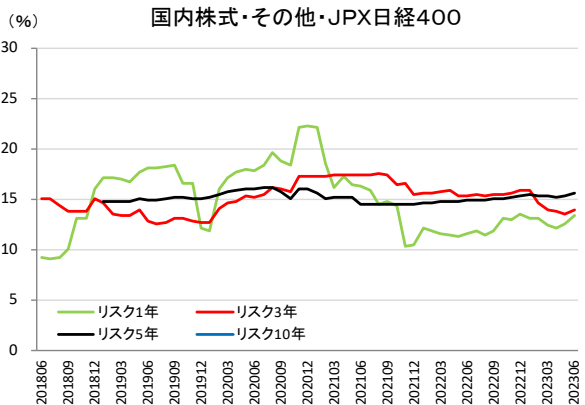
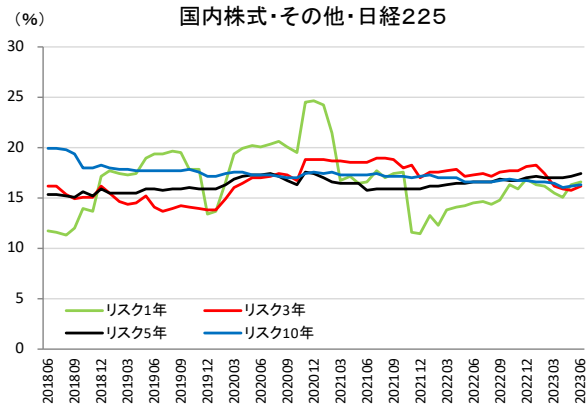
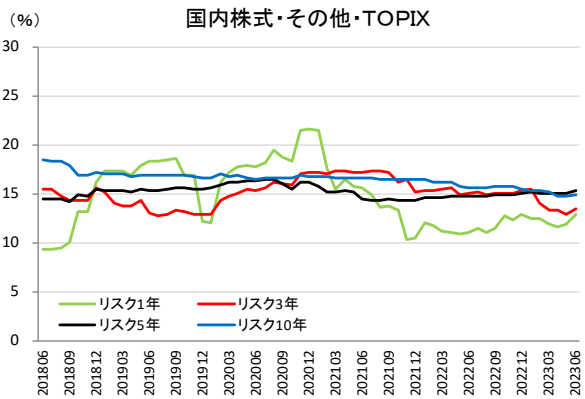
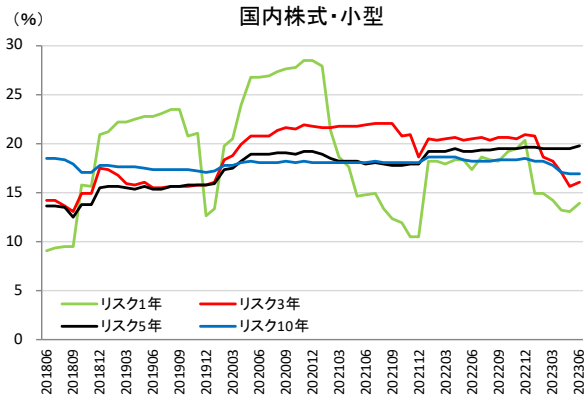
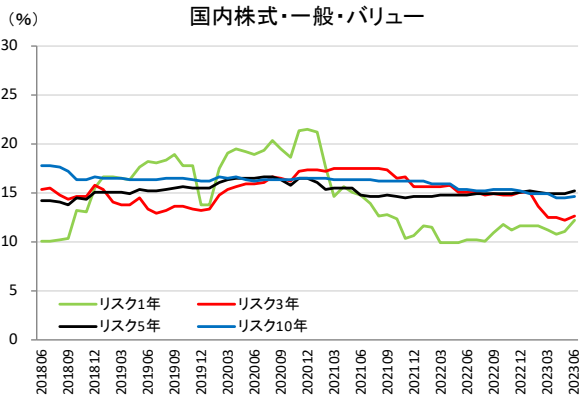
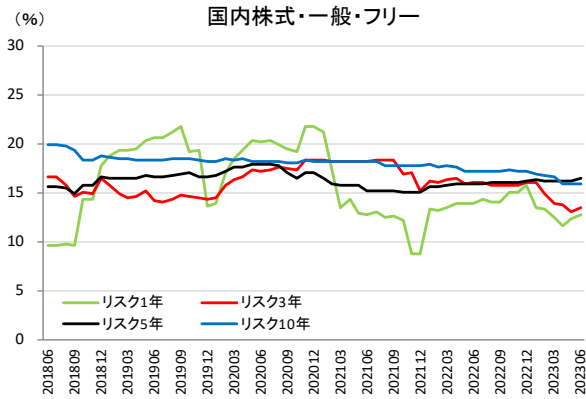
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

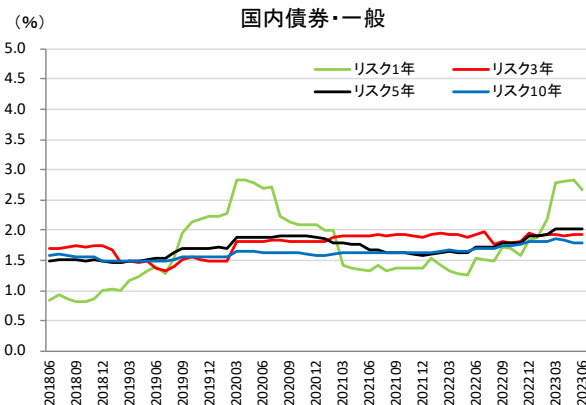
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

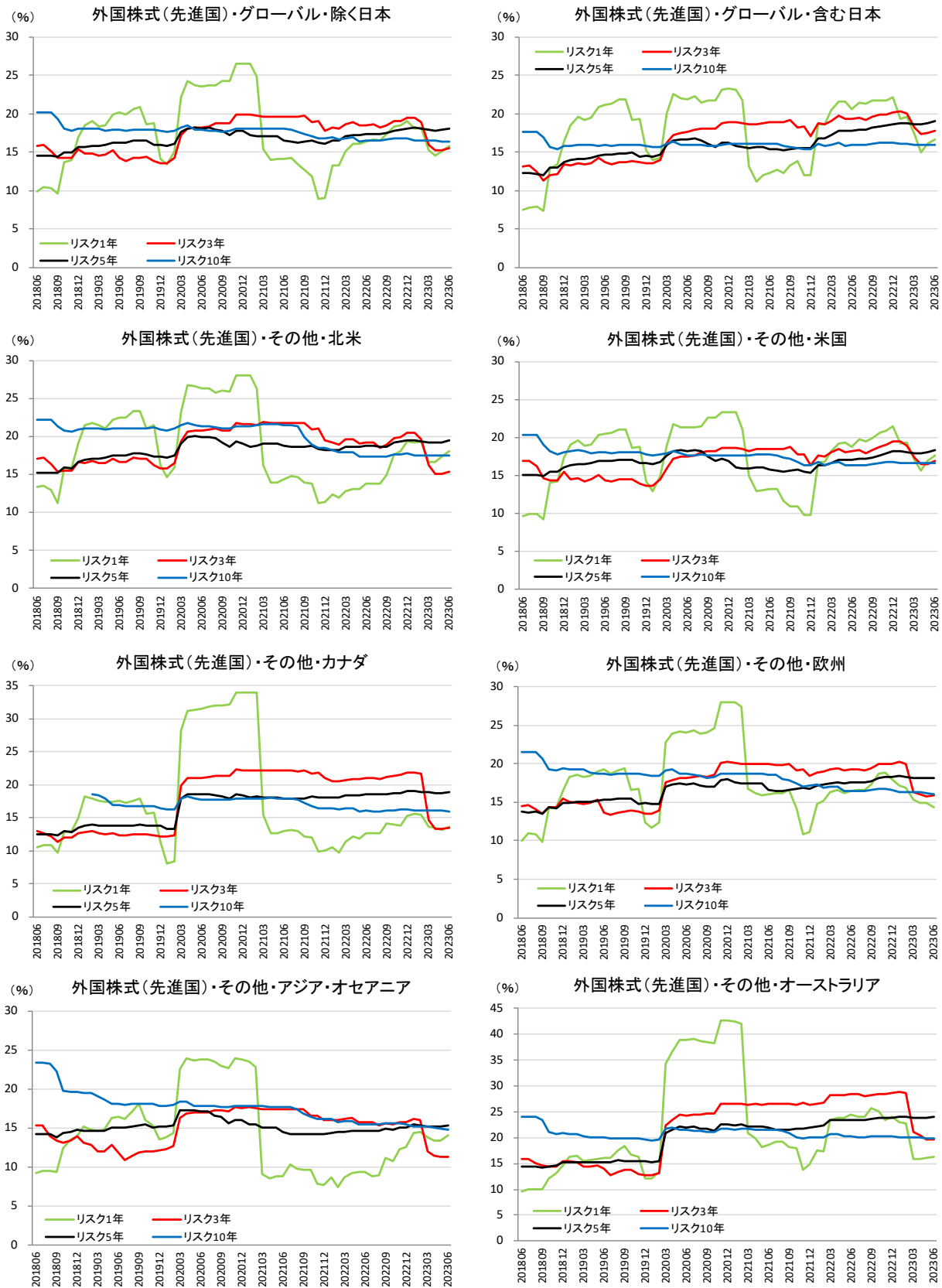


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

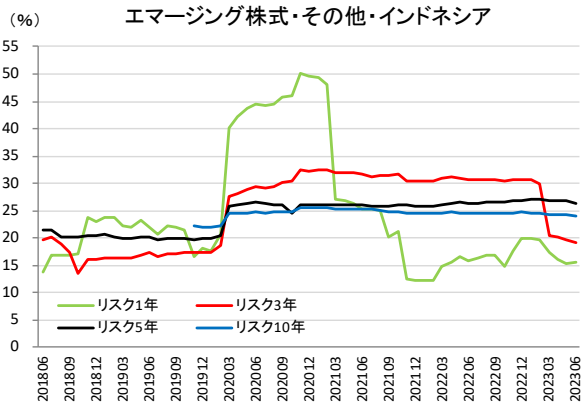
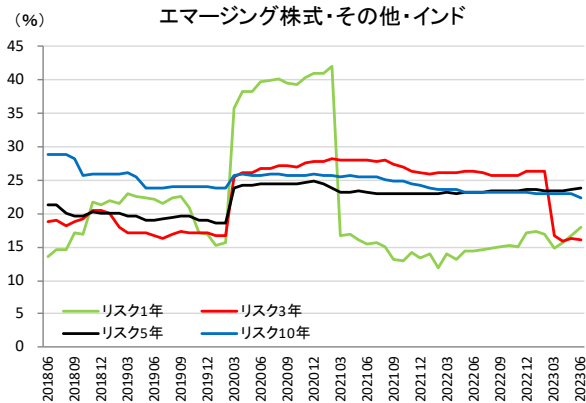
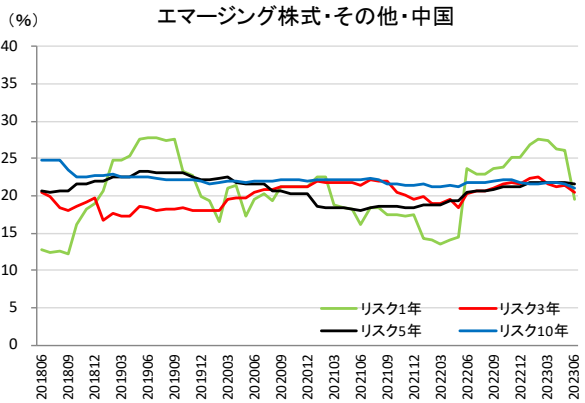
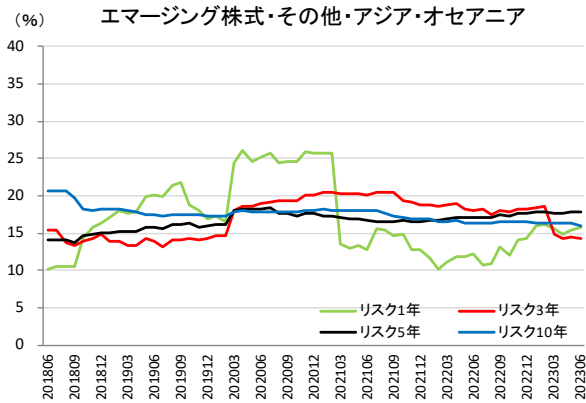
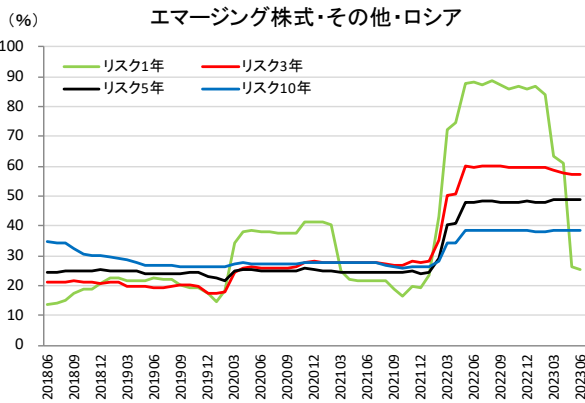
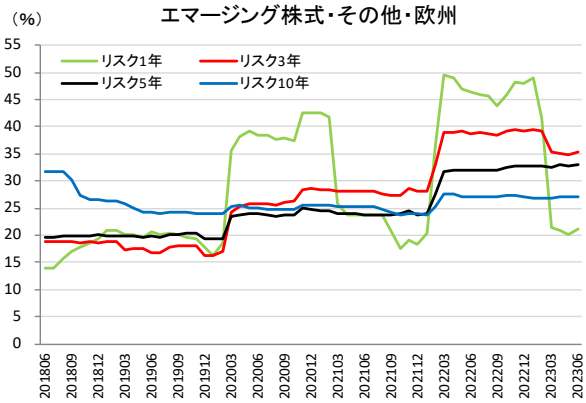
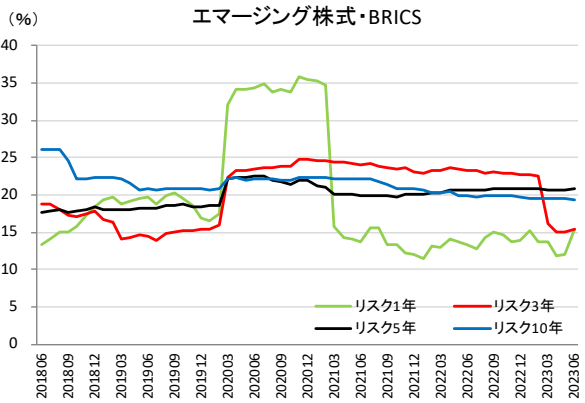
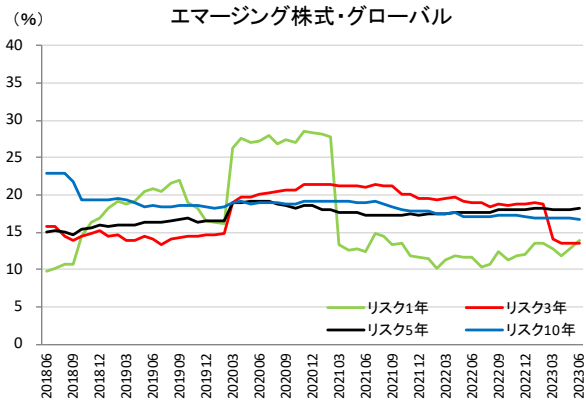


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

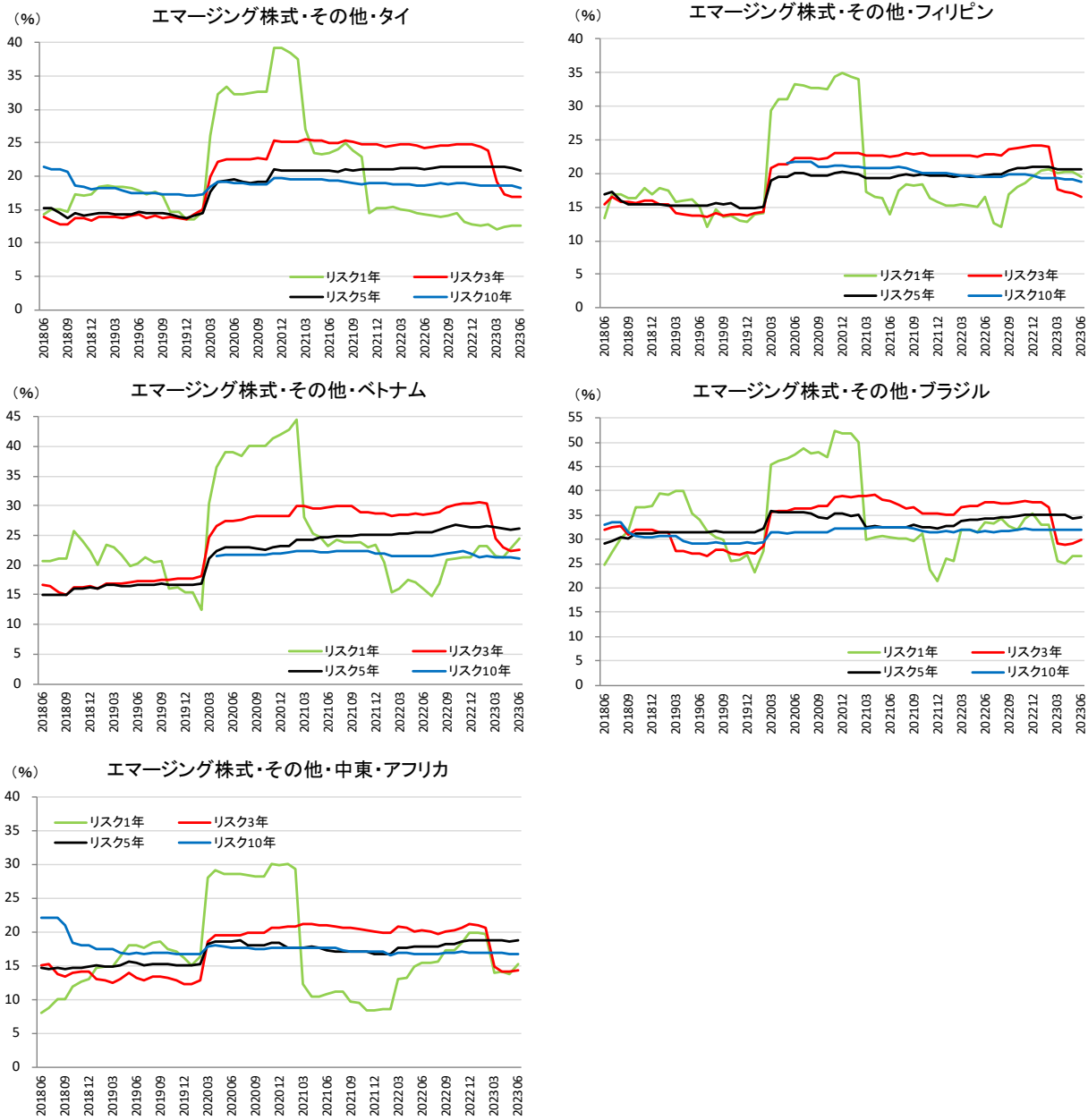


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

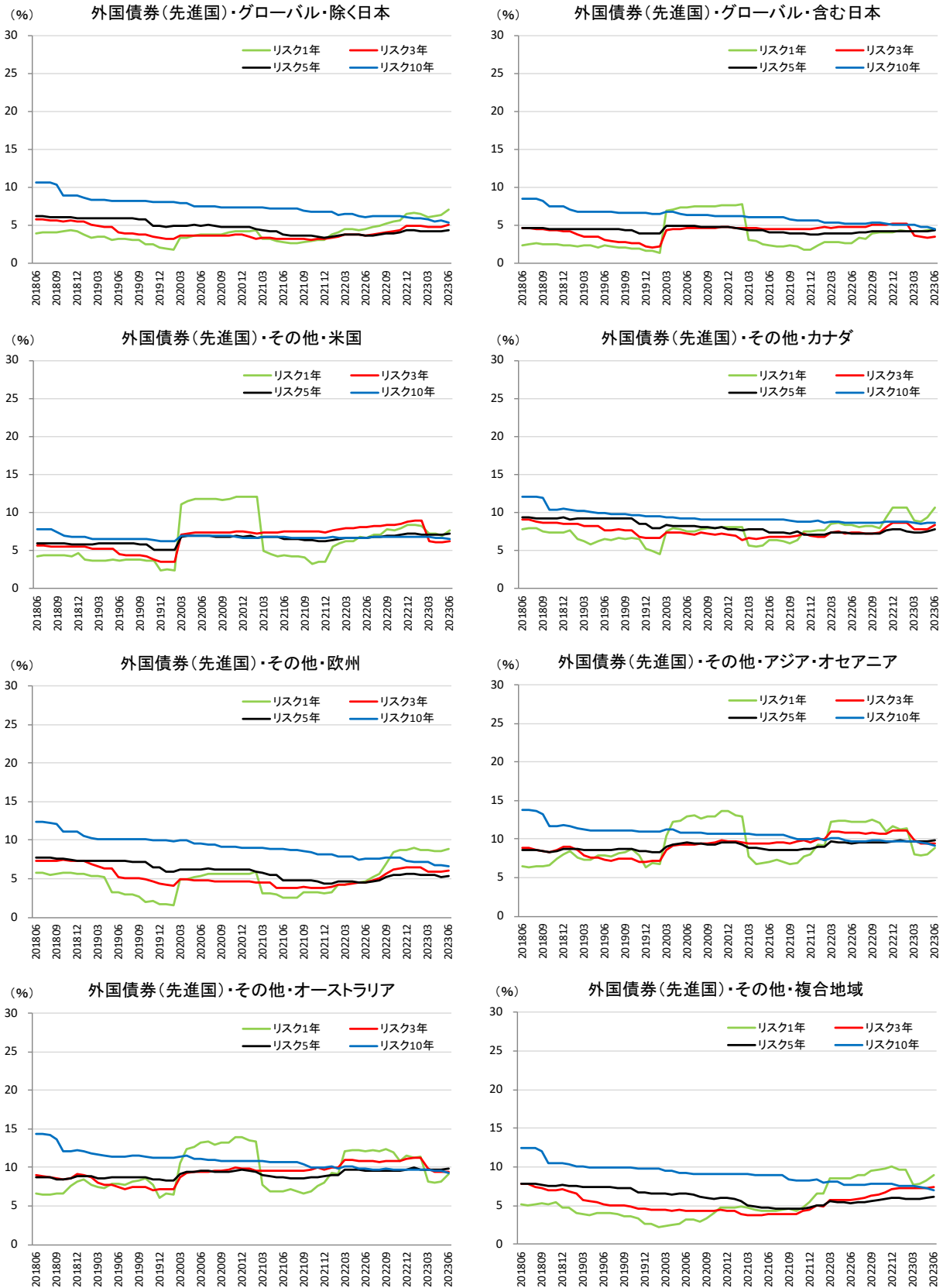


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

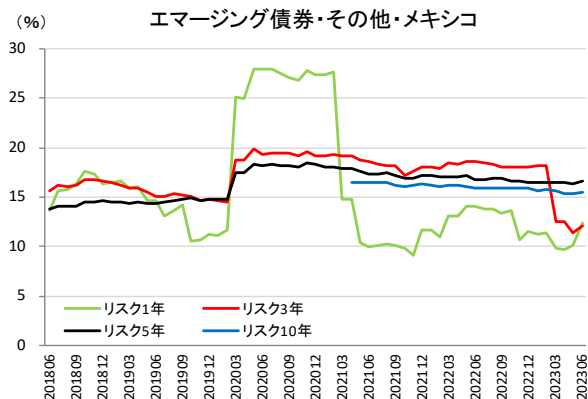
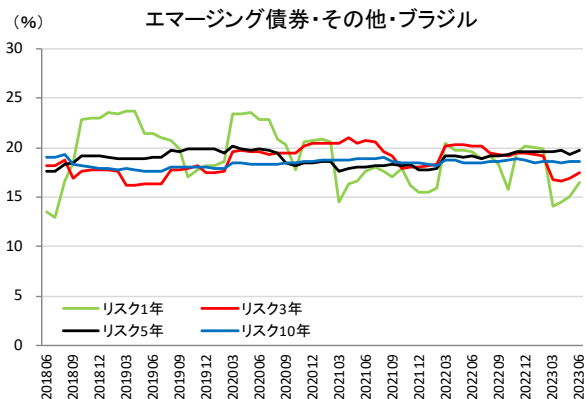
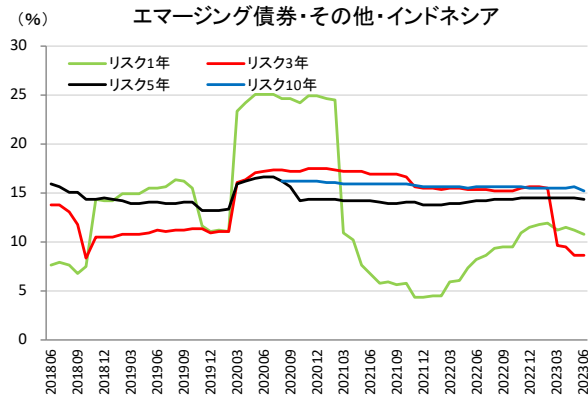
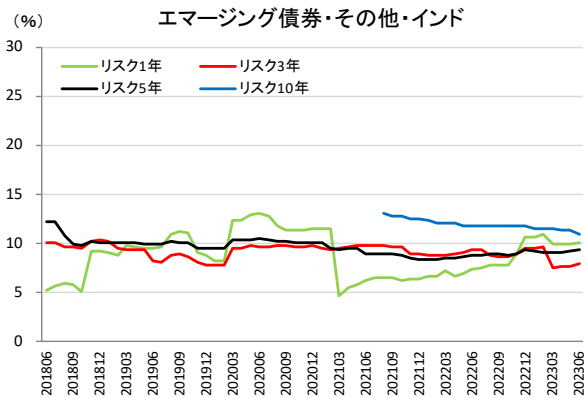
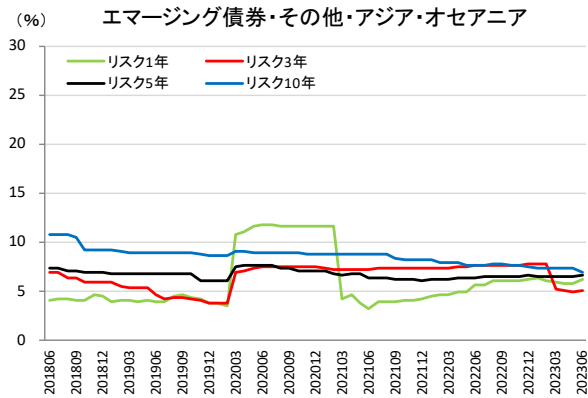
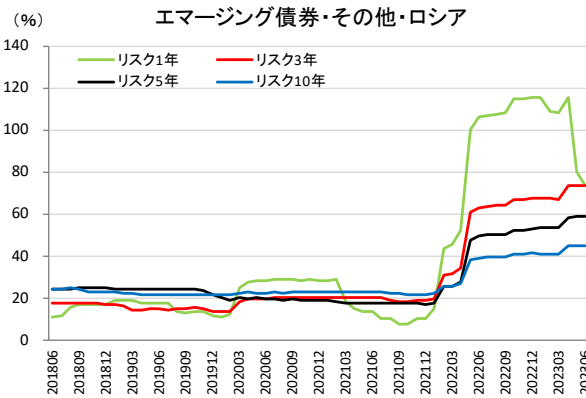
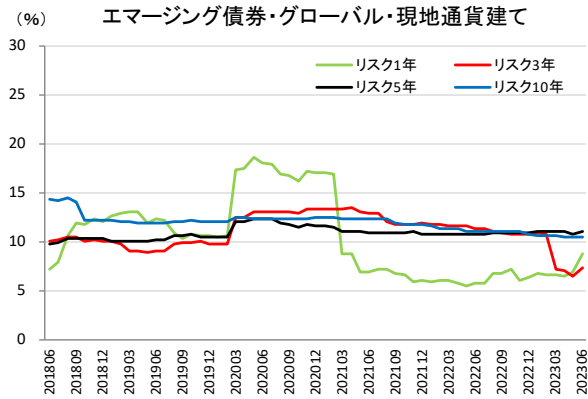
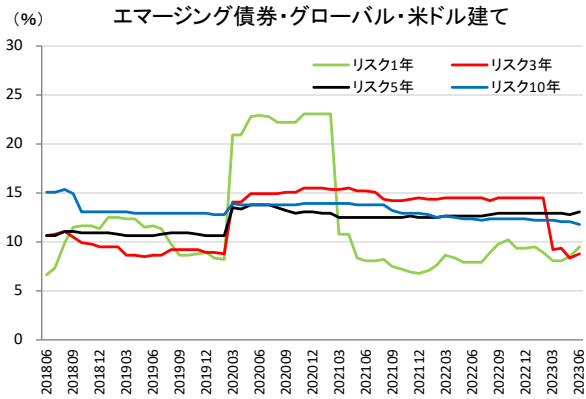


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

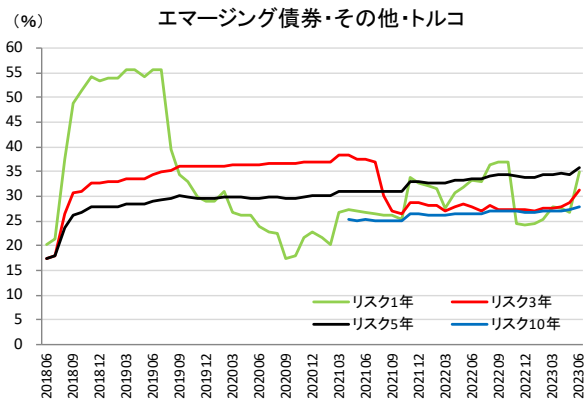


<2> リスク・サマリー

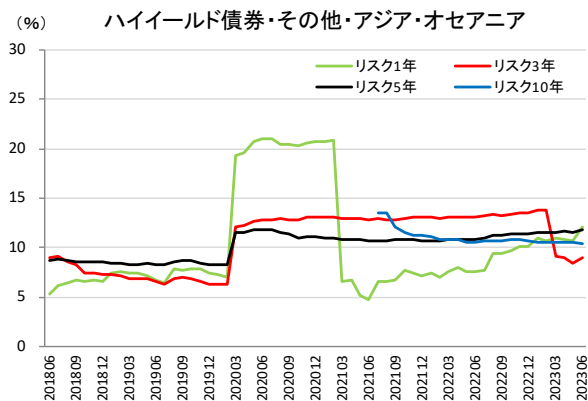
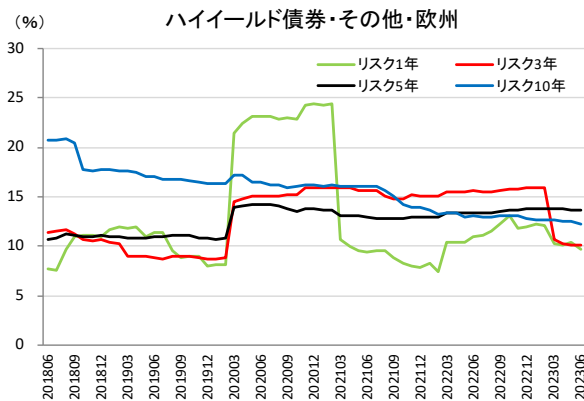
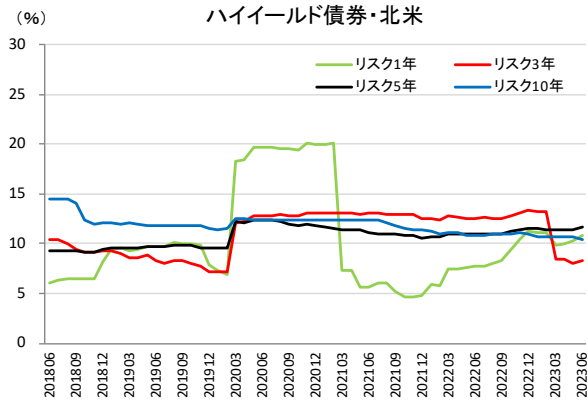
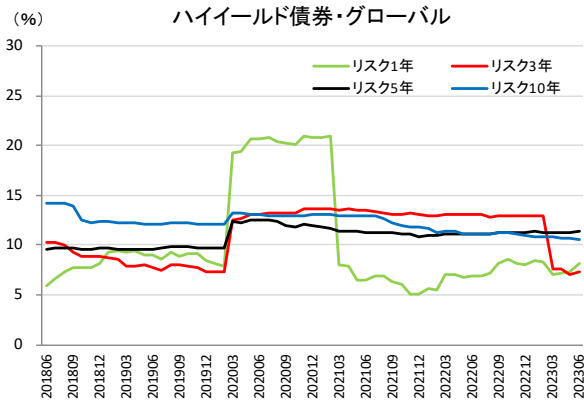
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

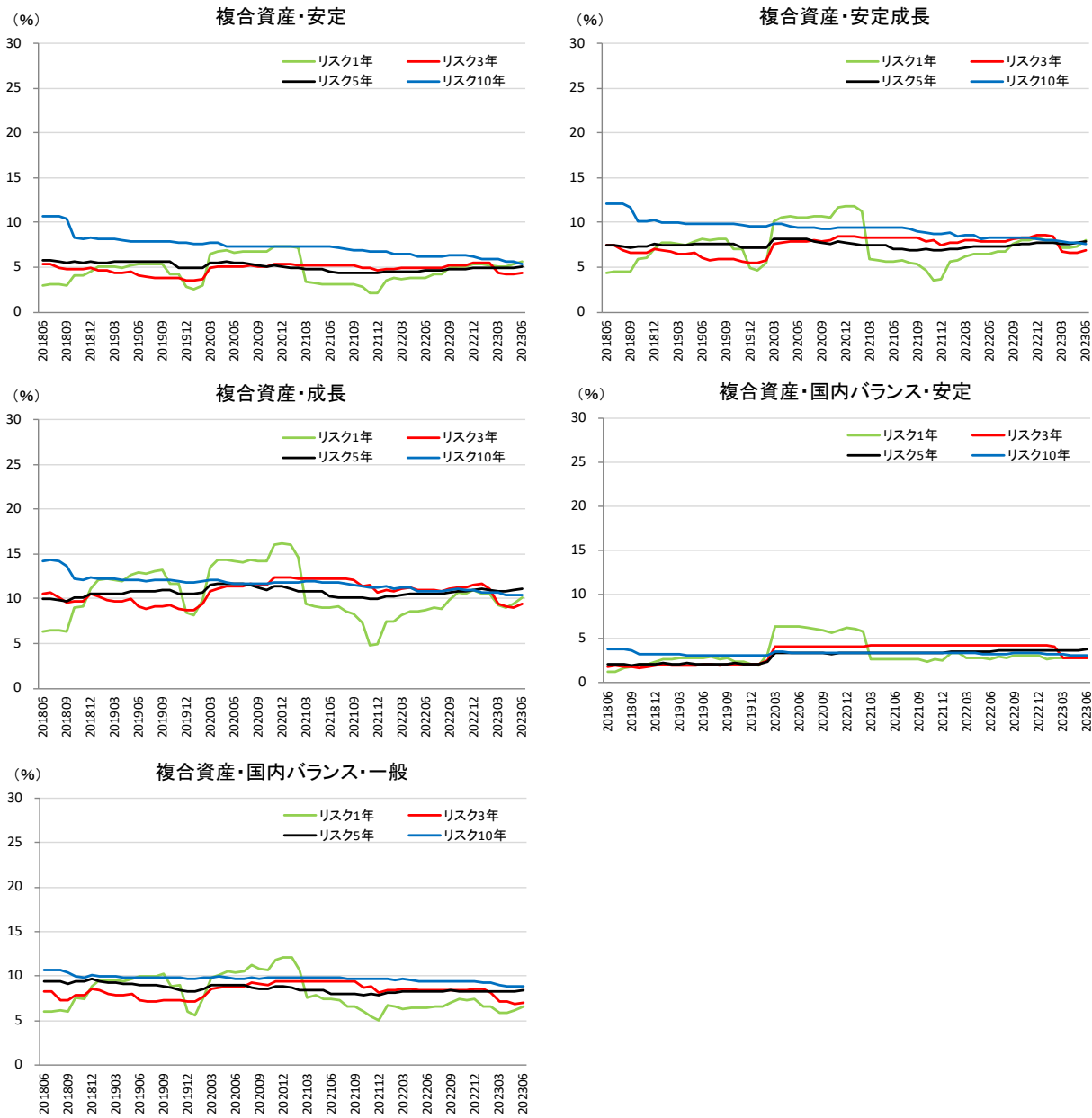


＜2＞リスク・サマリー

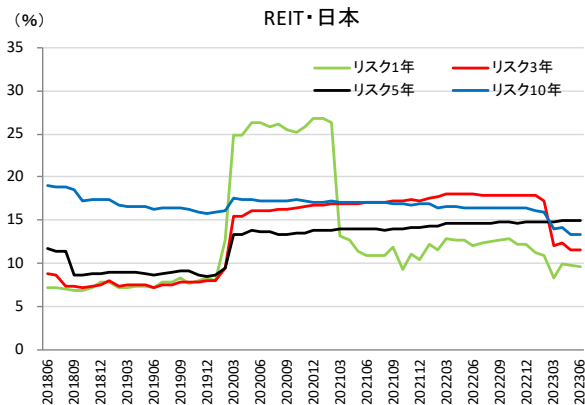
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]



＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

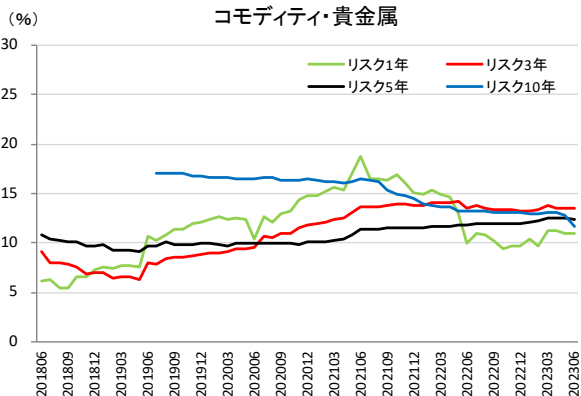
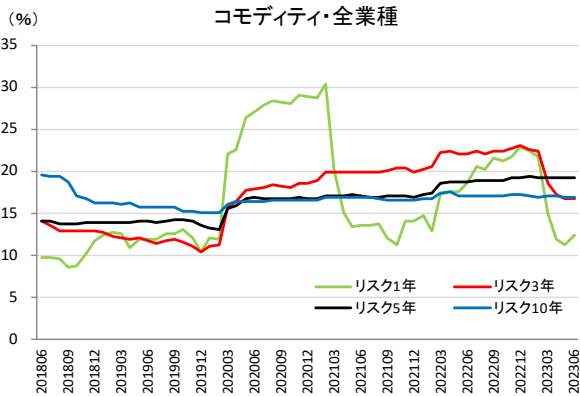
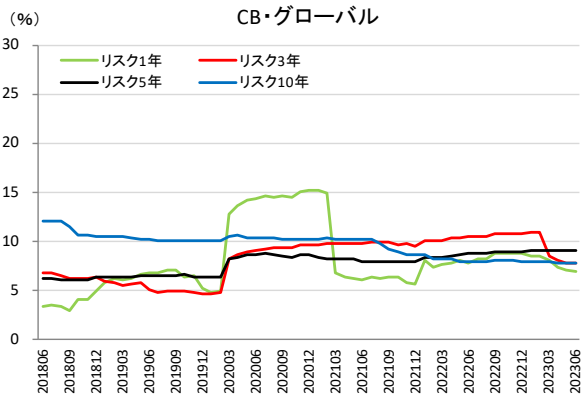
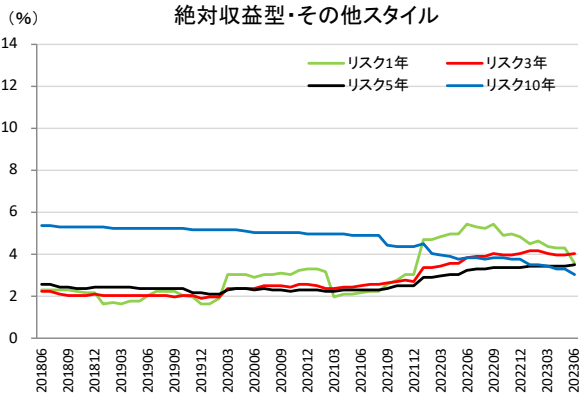
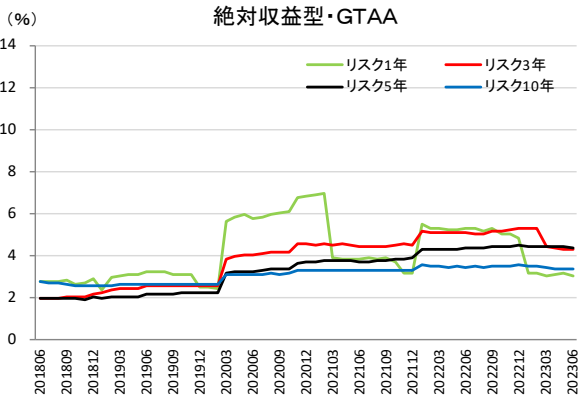
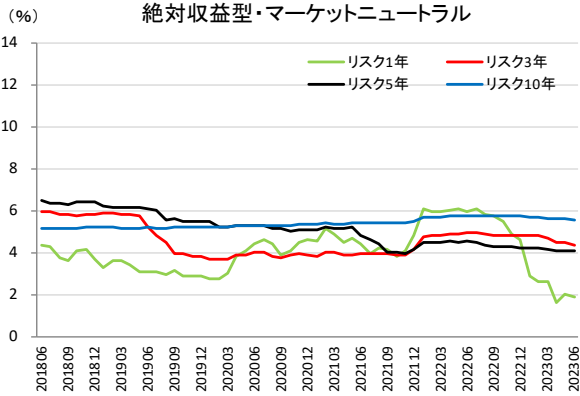
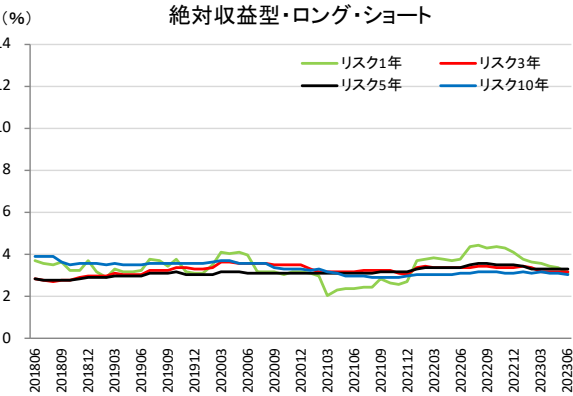


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	5,406	5,709	21,499	62,249
国内株式	804	-766	-35	3,325
一般	589	1,741	2,793	4,464
フリー	-30	34	604	1,821
バリュー	619	1,707	2,189	2,643
小型	144	124	199	215
その他	62	-2,627	-3,065	-1,381
日経225	35	-2,878	-3,629	-2,315
TOPIX	156	426	590	749
JPX日経400	-4	-66	-76	-58
国内債券	96	-1,005	-2,387	-1,024
一般	96	-1,005	-2,387	-1,024
外国株式(先進国)	1,400	2,092	9,971	30,404
グローバル	1,126	1,709	6,197	15,697
除く日本	719	1,368	3,662	8,389
含む日本	407	341	2,535	7,308
その他	274	384	3,774	14,707
北米	69	131	273	864
米国	274	443	3,811	14,404
カナダ	-5	-8	-11	-23
欧州	-13	-83	-119	-193
ドイツ	0	-1	-2	-2
イギリス	0	0	1	0
アジア・オセアニア	0	-1	-2	-3
オーストラリア	-50	-95	-176	-342
ニュージーランド	0	0	-1	-2
複合地域	-1	-1	1	5
エマージング株式	787	1,419	2,732	3,047
グローバル	51	133	387	528
BRICS	-4	-9	-15	-35
その他	740	1,295	2,360	2,554
欧州	0	1	1	1
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-77	-186	-173	-407
中国	-38	-72	-91	-331
インド	867	1,574	2,506	3,113
インドネシア	2	0	16	17
タイ	0	0	-1	-4
フィリピン	0	1	1	-1
ベトナム	14	15	156	278
韓国	0	0	-4	-4
香港	0	0	-1	1
中南米	-2	-3	-3	-8
ブラジル	-23	-28	-28	-72
メキシコ	1	1	1	-3
中東・アフリカ	-2	-4	-5	-10
トルコ	-1	-3	-13	-13
複合地域	0	0	0	-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	5,406	5,709	21,499	62,249
外国債券(先進国)	1,390	2,218	4,958	7,787
グローバル	1,347	1,676	3,849	6,681
除く日本	198	107	1,019	1,314
含む日本	1,149	1,570	2,829	5,366
その他	43	542	1,110	1,106
北米	1	9	21	20
米国	157	642	1,376	1,949
カナダ	-25	-39	-54	-139
欧州	-5	121	104	85
イギリス	0	0	-1	-2
アジア・オセアニア	-9	-12	-14	-90
オーストラリア	-72	-159	-281	-637
ニュージーランド	4	3	1	-3
複合地域	-8	-23	-42	-77
エマージング債券	-9	-127	7	-292
グローバル	-10	-89	35	80
米ドル建て	-12	-78	-26	-4
現地通貨建て	2	-11	61	83
その他	1	-38	-28	-372
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-2	-5	-8	-23
インド	61	91	124	45
インドネシア	3	6	5	-5
ブラジル	-57	-118	-150	-331
メキシコ	-2	-9	-16	-48
トルコ	-2	-3	-4	-6
複合地域	0	-1	-2	-3
ハイイールド債券	184	400	875	1,911
グローバル	-25	-58	-82	-46
北米	237	530	1,058	2,144
その他	-28	-72	-101	-188
欧州	-22	-58	-106	-190
アジア・オセアニア	-5	-13	6	4
複合地域	0	-1	-1	-2
複合資産	455	666	2,462	7,880
安定	-148	-401	-501	167
安定成長	242	482	1,560	4,174
成長	439	836	1,960	4,378
国内バランス	-81	-254	-601	-897
安定	-97	-280	-703	-1,232
一般	-4	-12	-17	-26
その他	4	2	43	56

<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	5,406	5,709	21,499	62,249
国内REIT	61	199	778	3,328
日本	61	199	778	3,328
外国REIT	112	657	1,479	2,683
グローバル	-105	99	46	95
除く日本	22	348	487	676
含む日本	-127	-249	-441	-582
北米	238	587	1,431	2,640
その他	-20	-29	3	-53
欧州	-1	-3	-4	-9
アジア・オセアニア	-12	-12	39	25
オーストラリア	-5	-11	-23	-51
複合地域	-1	-1	-2	-2
複数国	-1	-3	-8	-16
その他	126	-45	658	3,200
絶対収益型	4	-236	-194	397
ロング・ショート	0	-8	-25	-44
マーケットニュートラル	-9	-50	-92	-157
GTAA	-8	-36	-51	-63
その他スタイル	22	-116	-6	673
CB	29	10	776	1,734
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-2
日本	0	-1	-2	-5
グローバル	30	11	779	1,741
コモディティ	108	262	435	751
全業種	5	58	107	-80
貴金属	103	203	327	849
エネルギー	-1	-2	-2	-22
その他コモディティ	2	2	3	4

< 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	980,661	100.00	5,399	100.00
国内株式	126,286	12.88	820	15.19
一般	71,012	7.24	523	9.69
フリー	53,710	5.48	428	7.93
バリュー	17,302	1.76	95	1.76
小型	7,510	0.77	90	1.67
その他	46,972	4.79	201	3.72
日経225	22,934	2.34	69	1.28
TOPIX	19,991	2.04	80	1.48
JPX日経400	816	0.08	15	0.28
国内債券	40,845	4.17	144	2.67
一般	40,845	4.17	144	2.67
外国株式(先進国)	421,930	43.03	1,183	21.91
グローバル	285,531	29.12	823	15.24
除く日本	83,643	8.53	194	3.59
含む日本	201,888	20.59	629	11.65
その他	136,400	13.91	360	6.67
北米	1,204	0.12	13	0.24
米国	130,372	13.29	272	5.04
カナダ	144	0.01	2	0.04
欧州	1,661	0.17	43	0.80
ドイツ	17	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	1	0.02
オーストラリア	2,901	0.30	23	0.43
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	40	0.00	1	0.02
エマージング株式	32,658	3.33	306	5.67
グローバル	10,392	1.06	91	1.69
BRICS	470	0.05	7	0.13
その他	21,796	2.22	208	3.85
欧州	76	0.01	6	0.11
ロシア	8	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,601	0.47	85	1.57
中国	1,797	0.18	33	0.61
インド	12,839	1.31	32	0.59
インドネシア	181	0.02	4	0.07
タイ	11	0.00	2	0.04
フィリピン	32	0.00	4	0.07
ベトナム	1,475	0.15	13	0.24
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	16	0.00	1	0.02
中南米	68	0.01	2	0.04
ブラジル	532	0.05	12	0.22
メキシコ	9	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	85	0.01	4	0.07
トルコ	48	0.00	2	0.04
複合地域	19	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	980,661	100.00	5,399	100.00
外国債券(先進国)	88,271	9.00	770	14.26
グローバル	71,443	7.29	527	9.76
除く日本	32,220	3.29	227	4.20
含む日本	39,223	4.00	300	5.56
その他	16,828	1.72	243	4.50
北米	90	0.01	8	0.15
米国	6,952	0.71	134	2.48
カナダ	718	0.07	4	0.07
欧州	1,098	0.11	30	0.56
イギリス	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,567	0.16	9	0.17
オーストラリア	5,230	0.53	36	0.67
ニュージーランド	77	0.01	9	0.17
複合地域	1,087	0.11	8	0.15
エマージング債券	11,591	1.18	257	4.76
グローバル	6,497	0.66	181	3.35
米ドル建て	4,709	0.48	141	2.61
現地通貨建て	1,788	0.18	40	0.74
その他	5,094	0.52	76	1.41
ロシア	4	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	246	0.03	6	0.11
インド	2,392	0.24	16	0.30
インドネシア	323	0.03	7	0.13
ブラジル	1,612	0.16	22	0.41
メキシコ	287	0.03	5	0.09
トルコ	41	0.00	4	0.07
複合地域	35	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	18,954	1.93	248	4.59
グローバル	2,676	0.27	37	0.69
北米	14,385	1.47	149	2.76
その他	1,893	0.19	62	1.15
欧州	1,450	0.15	40	0.74
アジア・オセアニア	405	0.04	21	0.39
複合地域	38	0.00	1	0.02
複合資産	141,756	14.46	1,036	19.19
安定	38,892	3.97	280	5.19
安定成長	63,331	6.46	430	7.96
成長	29,353	2.99	281	5.20
国内バランス	6,980	0.71	29	0.54
安定	6,151	0.63	9	0.17
一般	292	0.03	15	0.28
その他	3,199	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	980,661	100.00	5,399	100.00
国内REIT	27,657	2.82	135	2.50
日本	27,657	2.82	135	2.50
外国REIT	45,423	4.63	279	5.17
グローバル	17,743	1.81	152	2.82
除く日本	6,305	0.64	66	1.22
含む日本	11,438	1.17	86	1.59
北米	24,682	2.52	75	1.39
その他	2,999	0.31	52	0.96
欧州	109	0.01	10	0.19
アジア・オセアニア	2,091	0.21	26	0.48
オーストラリア	495	0.05	12	0.22
複合地域	55	0.01	3	0.06
複数国	249	0.03	1	0.02
その他	25,291	2.58	221	4.09
絶対収益型	11,512	1.17	95	1.76
ロング・ショート	790	0.08	30	0.56
マーケットニュートラル	430	0.04	14	0.26
GTAA	366	0.04	11	0.20
その他スタイル	9,863	1.01	39	0.72
CB	2,808	0.29	35	0.65
アジア・オセアニア	34	0.00	1	0.02
日本	24	0.00	1	0.02
グローバル	2,750	0.28	33	0.61
コモディティ	5,514	0.56	37	0.69
全業種	1,687	0.17	13	0.24
貴金属	3,736	0.38	22	0.41
エネルギー	68	0.01	1	0.02
その他コモディティ	22	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	14,319	10.2	2.09	2.09	1.143
国内株式	20,503	14.0	0.84	0.71	1.038
一般	19,178	13.6	1.12	0.95	1.383
フリー	18,648	12.8	0.99	0.84	1.425
バリュー	21,563	17.0	1.53	1.32	1.254
小型	25,270	14.7	0.78	0.65	1.707
その他	21,878	14.5	0.40	0.32	0.399
日経225	23,457	15.9	0.45	0.35	0.464
TOPIX	22,780	15.4	0.14	0.11	0.246
JPX日経400	20,404	8.8	0.49	0.40	0.489
国内債券	10,571	12.0	0.15	0.15	0.450
一般	10,571	12.0	0.15	0.15	0.450
外国株式(先進国)	17,037	7.7	1.94	1.80	1.231
グローバル	17,546	7.6	1.64	1.58	1.315
除く日本	25,243	10.3	0.47	0.43	0.566
含む日本	15,172	6.7	2.13	2.06	1.626
その他	15,875	7.9	2.57	2.27	1.054
北米	15,450	5.0	1.45	1.44	1.496
米国	16,673	7.2	2.44	2.13	1.026
カナダ	6,509	12.3	5.72	6.13	1.989
欧州	14,940	12.7	2.17	1.97	1.506
ドイツ	16,236	9.3	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,308	6.9	8.83	9.41	1.786
アジア・オセアニア	11,038	17.0	3.22	3.17	1.639
オーストラリア	10,655	8.5	8.47	8.69	1.822
ニュージーランド	18,230	10.9	1.23	1.10	1.672
複合地域	11,374	10.2	9.64	9.67	1.705
エマージング株式	14,224	10.8	2.59	2.40	1.647
グローバル	13,959	8.2	0.30	0.26	1.032
BRICS	15,199	17.1	0.84	0.86	2.064
その他	14,307	11.7	3.74	3.47	1.931
欧州	7,403	17.0	0.50	0.35	1.952
ロシア	955	14.1	0.00	0.00	1.171
アジア・オセアニア	15,172	12.8	1.96	2.04	1.680
中国	14,049	8.6	1.22	1.40	1.931
インド	17,632	11.9	5.17	4.66	2.026
インドネシア	14,359	13.2	2.52	2.30	1.834
タイ	13,402	11.3	1.62	1.61	1.818
フィリピン	11,684	10.9	0.57	0.53	1.715
ベトナム	16,201	6.0	0.76	0.83	1.901
韓国	15,279	4.5	0.00	0.00	1.804
香港	14,178	13.8	1.48	1.62	0.858
中南米	11,451	16.5	0.00	0.00	2.039
ブラジル	6,657	12.1	3.76	3.49	1.951
メキシコ	13,974	10.3	2.00	1.43	1.667
中東・アフリカ	13,286	11.1	1.01	1.04	2.111
トルコ	11,489	21.9	0.00	0.00	2.031
複合地域	23,086	15.1	1.72	1.61	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	14,319	10.2	2.09	2.09	1.143
外国債券(先進国)	10,196	10.6	1.39	1.42	0.986
グローバル	10,670	10.5	1.09	1.10	0.921
除く日本	11,854	12.8	0.92	0.91	0.693
含む日本	9,774	8.9	1.24	1.28	1.109
その他	9,168	10.6	2.61	2.72	1.259
北米	10,187	6.9	2.08	2.13	1.575
米国	9,969	9.0	2.83	3.07	1.247
カナダ	7,646	12.4	1.53	1.50	1.378
欧州	7,407	13.5	1.52	1.53	1.115
イギリス	7,344	8.1	3.91	3.81	1.302
アジア・オセアニア	9,175	13.2	2.45	2.43	1.429
オーストラリア	8,636	14.5	2.85	2.89	1.244
ニュージーランド	9,192	9.0	1.50	1.50	1.362
複合地域	5,594	13.2	2.29	2.25	1.197
エマージング債券	9,359	11.4	4.06	3.77	1.443
グローバル	9,357	11.9	2.90	2.68	1.304
米ドル建て	9,117	12.4	3.21	2.98	1.440
現地通貨建て	10,201	10.2	2.07	1.91	0.947
その他	9,363	10.3	5.55	5.16	1.621
ロシア	703	10.4	0.00	0.00	1.563
アジア・オセアニア	9,855	12.5	6.45	6.64	1.627
インド	10,254	8.8	6.26	6.25	1.704
インドネシア	10,121	10.6	5.40	5.03	1.671
ブラジル	10,951	13.2	4.85	3.89	1.579
メキシコ	9,072	10.4	5.47	4.24	1.380
トルコ	1,544	10.3	6.89	8.19	1.461
複合地域	4,184	16.8	1.71	1.43	1.210
ハイイールド債券	9,676	12.1	5.35	5.08	1.668
グローバル	7,909	11.1	3.47	3.21	1.481
北米	11,043	13.0	5.46	5.18	1.689
その他	7,446	10.7	7.20	6.94	1.767
欧州	7,749	10.2	6.58	6.17	1.738
アジア・オセアニア	7,004	11.2	9.62	9.85	1.868
複合地域	4,618	19.3	5.52	5.20	1.800
複合資産	13,484	9.5	1.03	1.04	0.945
安定	11,553	9.5	0.95	0.94	1.075
安定成長	13,161	10.0	1.34	1.34	0.954
成長	16,265	9.1	0.17	0.15	0.776
国内バランス	12,346	10.6	2.15	2.22	0.945
安定	10,752	11.9	2.03	2.11	0.916
一般	13,348	11.2	1.03	0.96	1.272
その他	9,158	3.3	1.41	1.51	0.733

(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	14,319	10.2	2.09	2.09	1.143
国内REIT	14,175	10.2	8.56	10.24	0.920
日本	14,175	10.2	8.56	10.24	0.920
外国REIT	12,143	9.2	8.15	9.05	1.476
グローバル	13,325	8.9	3.26	3.45	1.227
除く日本	14,800	7.1	1.92	2.16	0.891
含む日本	12,194	10.2	4.00	4.17	1.413
北米	11,564	9.8	11.87	13.29	1.622
その他	9,521	9.1	6.42	7.30	1.750
欧州	5,906	9.4	4.70	5.10	1.819
アジア・オセアニア	11,135	8.5	7.62	8.82	1.796
オーストラリア	9,460	8.7	4.54	4.67	1.701
複合地域	7,181	11.4	0.86	0.93	0.778
複数国	11,468	19.2	2.08	2.09	1.650
その他					
絶対収益型	10,464	6.4	0.02	0.02	1.937
ロング・ショート	10,414	5.7	0.30	0.30	1.497
マーケットニュートラル	9,792	5.3	0.00	0.00	1.287
GTAA	11,116	10.4	0.02	0.02	1.535
その他スタイル	10,512	6.2	0.00	0.00	2.020
CB	12,379	8.7	0.85	0.82	1.189
アジア・オセアニア	10,483	13.0	2.25	2.29	1.823
日本	13,939	23.6	0.38	0.36	0.770
グローバル	12,389	8.1	0.81	0.77	1.185
コモディティ	12,033	7.1	0.16	0.20	0.916
全業種	10,120	11.0	0.53	0.65	1.285
貴金属	12,663	4.4	0.00	0.00	0.749
エネルギー	17,664	14.3	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	17,404	6.8	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