

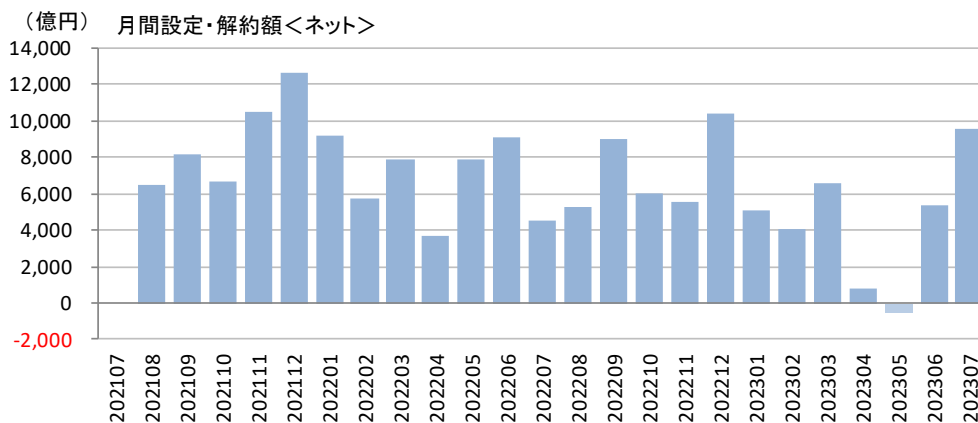
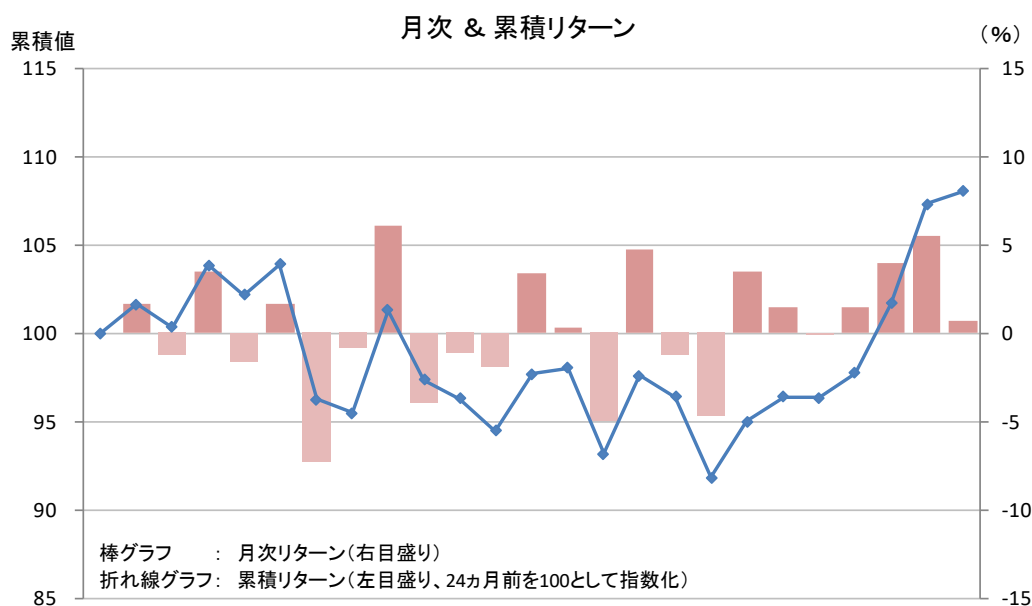
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2023年7月

「総合」 +0.68 %
(前月 +5.53 %)



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		17,425	17,307	118	0.68
国内株式		23,505	23,305	200	0.86
一般		22,743	22,513	231	1.03
フリー		21,165	21,010	155	0.74
バリュー		30,180	29,615	565	1.91
小型		43,513	43,699	-186	-0.43
その他		23,799	23,612	188	0.79
日経225		22,866	22,884	-17	-0.08
TOPIX		23,377	23,036	340	1.48
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	22,163	21,878	285	1.30
国内債券		12,535	12,685	-149	-1.18
一般		12,535	12,685	-149	-1.18
外国株式(先進国)		23,999	23,634	365	1.54
グローバル		25,912	25,502	410	1.61
除く日本		40,987	40,410	577	1.43
含む日本		22,691	22,315	375	1.68
その他		19,916	19,639	277	1.41
北米		25,294	24,726	569	2.30
米国		30,951	30,524	427	1.40
カナダ	10,000 (2009.02.27)	21,900	21,848	52	0.24
欧州		26,785	26,544	241	0.91
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	13,702	13,408	294	2.19
イギリス	9,683 (2014.05.30)	11,193	11,059	134	1.21
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	41,669	41,106	562	1.37
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	21,514	21,155	359	1.70
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	48,250	48,340	-91	-0.19
複合地域	10,000 (2013.04.30)	15,071	14,334	737	5.14
エマージング株式		20,711	20,417	294	1.44
グローバル		20,591	20,110	481	2.39
BRICS	10,000 (2005.09.30)	25,718	24,978	740	2.96
その他		21,626	21,418	208	0.97
欧州		15,314	14,494	821	5.66
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,081	1,076	5	0.50
アジア・オセアニア		19,842	19,409	433	2.23
中国		40,298	39,977	321	0.80
インド	10,000 (2004.09.30)	56,079	56,030	48	0.09
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	18,106	18,450	-344	-1.87
タイ		24,942	23,496	1,446	6.15
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,190	8,221	-32	-0.38
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	24,499	23,376	1,124	4.81
韓国	10,000 (1997.06.30)	36,032	33,967	2,065	6.08
香港		23,216	22,391	824	3.68
中南米	7,427 (2006.04.28)	12,698	12,364	335	2.71
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	10,646	10,441	205	1.96
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	17,750	17,224	526	3.06
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	14,080	13,499	580	4.30
トルコ		38,607	33,923	4,685	13.81
複合地域	10,000 (2005.08.31)	26,000	26,969	-968	-3.59

※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		17,425	17,307	118	0.68
外国債券(先進国)		18,600	18,825	-225	-1.20
グローバル		18,595	18,795	-200	-1.06
除く日本		20,438	20,803	-365	-1.75
含む日本		17,411	17,499	-88	-0.50
その他		18,840	19,175	-336	-1.75
北米	9,052 (2013.05.31)	10,575	10,694	-120	-1.12
米国		17,488	17,820	-332	-1.86
カナダ	10,000 (2003.05.30)	16,945	17,459	-514	-2.95
欧州	10,000 (1998.07.31)	14,092	14,217	-125	-0.88
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,962	10,919	44	0.40
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	21,107	21,490	-383	-1.78
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	26,108	26,587	-479	-1.80
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,340	11,556	-216	-1.87
複合地域	10,000 (2001.11.30)	18,920	19,094	-174	-0.91
エマージング債券		20,130	20,317	-187	-0.92
グローバル		20,089	20,160	-71	-0.35
米ドル建て		20,249	20,343	-95	-0.47
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	14,905	14,913	-8	-0.06
その他	8,647 (2005.03.31)	16,303	16,576	-272	-1.64
ロシア	10,000 (2008.05.30)	490	524	-34	-6.48
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	15,782	16,166	-384	-2.37
中国	13,833 (2018.07.31)	18,361	18,439	-78	-0.42
インド	10,000 (2011.08.31)	20,624	21,259	-635	-2.99
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	19,582	20,147	-565	-2.80
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	16,634	16,526	108	0.65
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	20,248	20,430	-183	-0.89
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,681	2,910	-229	-7.86
複合地域	10,000 (2006.08.31)	12,178	12,187	-9	-0.07
ハイイールド債券		27,178	27,471	-293	-1.07
グローバル	10,000 (1997.06.30)	25,563	25,713	-150	-0.58
北米		27,509	27,840	-331	-1.19
その他	10,000 (2004.03.31)	24,313	24,512	-199	-0.81
欧州	10,000 (2006.04.28)	24,806	24,862	-56	-0.22
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,675	15,114	-439	-2.90
複合地域	10,000 (2004.03.31)	23,969	24,192	-224	-0.92
複合資産		19,883	19,913	-29	-0.15
安定	10,000 (1998.10.30)	16,226	16,324	-98	-0.60
安定成長		22,084	22,124	-40	-0.18
成長		28,114	27,944	170	0.61
国内バランス		12,489	12,566	-77	-0.61
安定		12,571	12,671	-99	-0.78
一般		17,351	17,242	109	0.63
その他	10,000 (2018.10.31)	12,317	12,312	5	0.04

※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		17,425	17,307	118	0.68
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	35,092	34,788	305	0.88
日本	10,000 (2003.10.31)	35,092	34,788	305	0.88
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	34,788	34,817	-29	-0.08
グローバル	10,000 (2004.01.30)	28,781	28,608	173	0.61
除く日本	10,000 (2004.04.30)	32,251	32,039	212	0.66
含む日本	10,000 (2004.01.30)	28,531	28,368	163	0.58
北米	10,000 (2003.09.30)	36,873	37,136	-263	-0.71
その他	10,000 (2004.04.30)	30,826	30,523	304	0.99
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,259	4,978	281	5.64
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	22,781	22,577	204	0.90
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	17,196	17,039	157	0.92
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,669	7,459	210	2.82
複数国	10,000 (2004.04.30)	46,203	46,431	-228	-0.49
その他		6,808	6,678	130	1.95
絶対収益型		7,500	7,467	33	0.44
ロング・ショート		8,159	8,250	-91	-1.11
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,326	11,336	-10	-0.09
GTAA		11,242	11,409	-168	-1.47
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,051	7,005	46	0.66
CB		20,371	20,361	11	0.05
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	21,571	21,636	-65	-0.30
日本		20,344	20,436	-92	-0.45
グローバル		35,543	35,521	22	0.06
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	12,381	12,123	258	2.13
全業種	10,000 (2004.12.30)	11,779	11,276	504	4.47
貴金属	10,000 (2009.07.31)	20,468	20,271	196	0.97
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	10,026	9,147	878	9.60
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	16,237	15,756	481	3.05

※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	10.50	13.69	10.59	17.64
国内株式	13.06	18.35	20.49	23.51
一般	12.72	17.61	20.32	22.52
フリー	12.54	17.27	19.80	22.17
バリュー	13.17	18.63	21.95	23.54
小型	7.57	7.75	12.61	12.31
その他	14.43	21.24	21.98	26.81
日経225	15.03	22.54	21.41	28.27
TOPIX	13.03	19.10	22.67	24.34
JPX日経400	13.67	19.55	23.26	24.86
国内債券	-0.62	1.38	-2.40	1.24
一般	-0.62	1.38	-2.40	1.24
外国株式(先進国)	15.82	20.82	17.17	26.75
グローバル	15.45	19.51	17.04	26.03
除く日本	13.86	19.29	18.73	24.25
含む日本	16.12	19.60	16.42	26.74
その他	16.58	23.65	17.42	28.27
北米	16.94	22.41	23.49	24.64
米国	16.93	24.40	17.67	28.91
カナダ	4.60	3.13	-0.16	6.49
欧州	5.76	12.54	19.18	18.83
ドイツ	8.90	18.54	38.95	27.40
イギリス	0.92	2.49	6.14	4.27
アジア・オセアニア	7.50	3.92	7.38	11.92
オーストラリア	8.96	4.73	6.42	12.08
ニュージーランド	5.53	1.77	10.76	5.37
複合地域	12.90	7.97	12.13	8.89
エマージング株式	14.26	12.71	11.75	16.73
グローバル	13.60	10.98	13.99	18.28
BRICS	15.30	9.00	10.33	14.19
その他	14.60	13.74	10.62	16.00
欧州	17.60	29.41	55.49	34.20
ロシア	-0.49	-18.73	-19.82	-18.12
アジア・オセアニア	11.71	7.12	8.96	15.48
中国	3.22	-7.11	-9.11	2.32
インド	16.78	20.85	14.95	16.71
インドネシア	3.80	9.64	10.54	14.19
タイ	6.97	1.78	15.10	3.87
フィリピン	6.36	3.95	10.45	10.12
ベトナム	21.48	17.12	5.24	26.30
韓国	32.39	30.53	28.93	41.36
香港	8.22	-0.35	3.74	8.79
中南米	26.08	24.14	37.71	31.01
ブラジル	27.40	22.47	27.51	26.42
メキシコ	15.55	22.87	50.92	38.39
中東・アフリカ	10.47	11.39	1.92	11.22
トルコ	10.88	7.72	85.97	-1.06
複合地域	5.58	4.14	5.45	11.14

※[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か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	10.50	13.69	10.59	17.64
外国債券(先進国)	2.46	2.96	-0.94	4.79
グローバル	2.37	3.06	-0.77	4.57
除く日本	3.03	4.85	-0.81	6.38
含む日本	1.81	1.60	-0.68	3.08
その他	2.82	2.51	-1.65	5.76
北米	2.10	2.01	-1.57	4.10
米国	1.43	2.05	-2.79	4.52
カナダ	5.76	7.19	-0.67	8.39
欧州	2.41	2.96	-1.65	4.31
イギリス	5.84	7.99	4.02	12.84
アジア・オセアニア	3.42	1.73	-0.80	6.20
オーストラリア	3.69	1.78	-0.78	6.54
ニュージーランド	2.37	0.85	-2.54	4.20
複合地域	4.90	7.13	-1.10	8.34
エマージング債券	8.55	12.33	14.35	14.35
グローバル	8.48	10.11	13.39	12.79
米ドル建て	8.12	8.91	11.80	11.48
現地通貨建て	9.42	13.39	17.87	16.40
その他	8.66	15.32	15.54	16.42
ロシア	-5.45	-60.92	-53.38	-59.24
アジア・オセアニア	3.02	4.51	5.64	6.95
中国	1.76	1.94	-0.70	3.55
インド	5.19	9.93	6.18	9.87
インドネシア	4.77	11.87	12.79	15.92
ブラジル	16.22	28.65	32.67	30.14
メキシコ	15.86	24.22	35.33	29.41
トルコ	-20.37	-26.51	-12.19	-28.74
複合地域	9.49	14.92	21.32	18.81
ハイイールド債券	6.44	8.53	9.31	11.13
グローバル	6.30	7.20	9.66	10.53
北米	6.56	9.21	8.90	11.39
その他	5.73	5.74	11.47	10.00
欧州	6.32	6.58	11.70	10.69
アジア・オセアニア	3.58	2.46	11.03	7.54
複合地域	6.12	8.98	9.70	10.65
複合資産	5.24	7.58	4.71	9.77
安定	3.04	4.34	1.14	5.69
安定成長	5.72	8.40	5.95	10.73
成長	8.67	12.02	10.91	15.32
国内バランス	0.46	2.53	-1.40	2.10
安定	-0.22	1.74	-2.45	1.17
一般	6.32	9.72	9.05	11.12
その他	3.74	4.90	-9.42	13.64

※[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か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	10.50	13.69	10.59	17.64
国内REIT	1.36	4.71	-3.17	1.62
日本	1.36	4.71	-3.17	1.62
外国REIT	8.37	5.23	-3.69	11.58
グローバル	8.27	4.59	-3.42	11.15
除く日本	8.78	4.08	-3.23	11.38
含む日本	8.00	4.86	-3.50	11.05
北米	8.98	6.54	-3.85	12.56
その他	4.31	-0.93	-3.94	6.69
欧州	6.79	1.61	-0.46	8.55
アジア・オセアニア	3.47	-1.72	-4.77	6.30
オーストラリア	5.79	-1.70	-1.78	6.53
複合地域	6.07	3.06	2.84	7.69
複数国	7.10	5.81	-4.25	9.34
その他	6.67	8.99	6.59	13.16
絶対収益型	1.13	-0.19	-1.64	1.20
ロング・ショート	-0.77	-0.02	-2.33	0.77
マーケットニュートラル	1.38	0.93	-0.57	0.32
GTAA	-2.00	-1.24	-3.69	-0.69
その他スタイル	1.38	-0.22	-1.56	1.37
CB	3.79	2.91	3.35	6.30
アジア・オセアニア	5.14	6.74	4.14	10.48
日本	3.54	3.95	3.76	4.36
グローバル	3.77	2.84	3.33	6.28
コモディティ	3.22	4.98	6.56	7.41
全業種	10.01	6.04	-0.78	4.65
貴金属	0.11	4.37	10.61	8.76
エネルギー	15.07	14.52	1.22	12.65
その他コモディティ	8.74	7.93	1.52	6.25

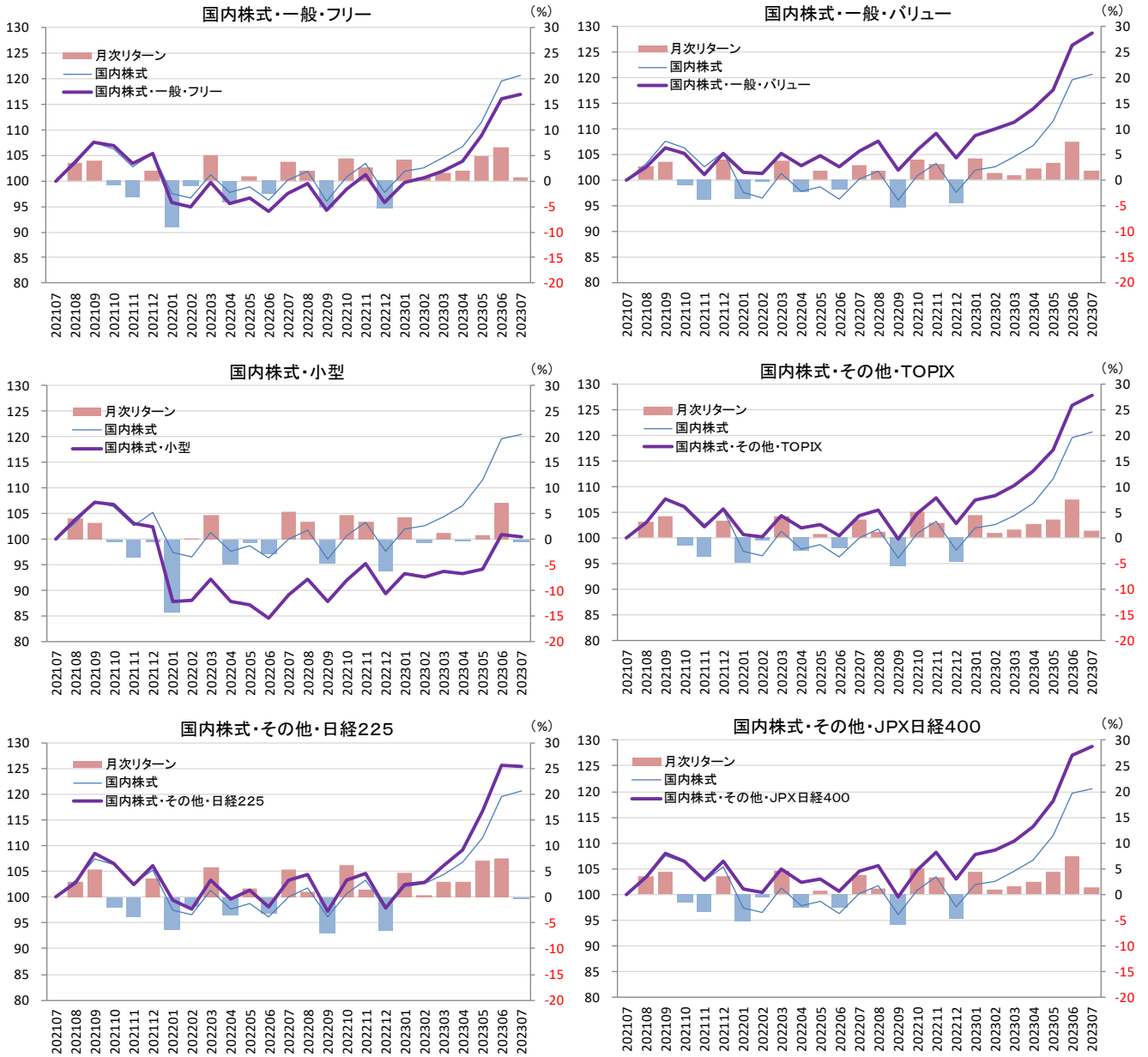
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

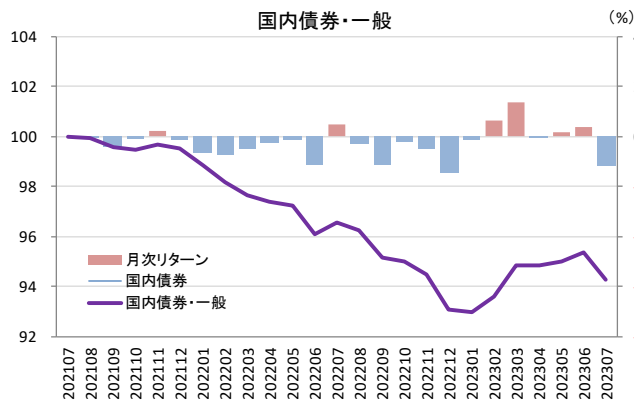
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

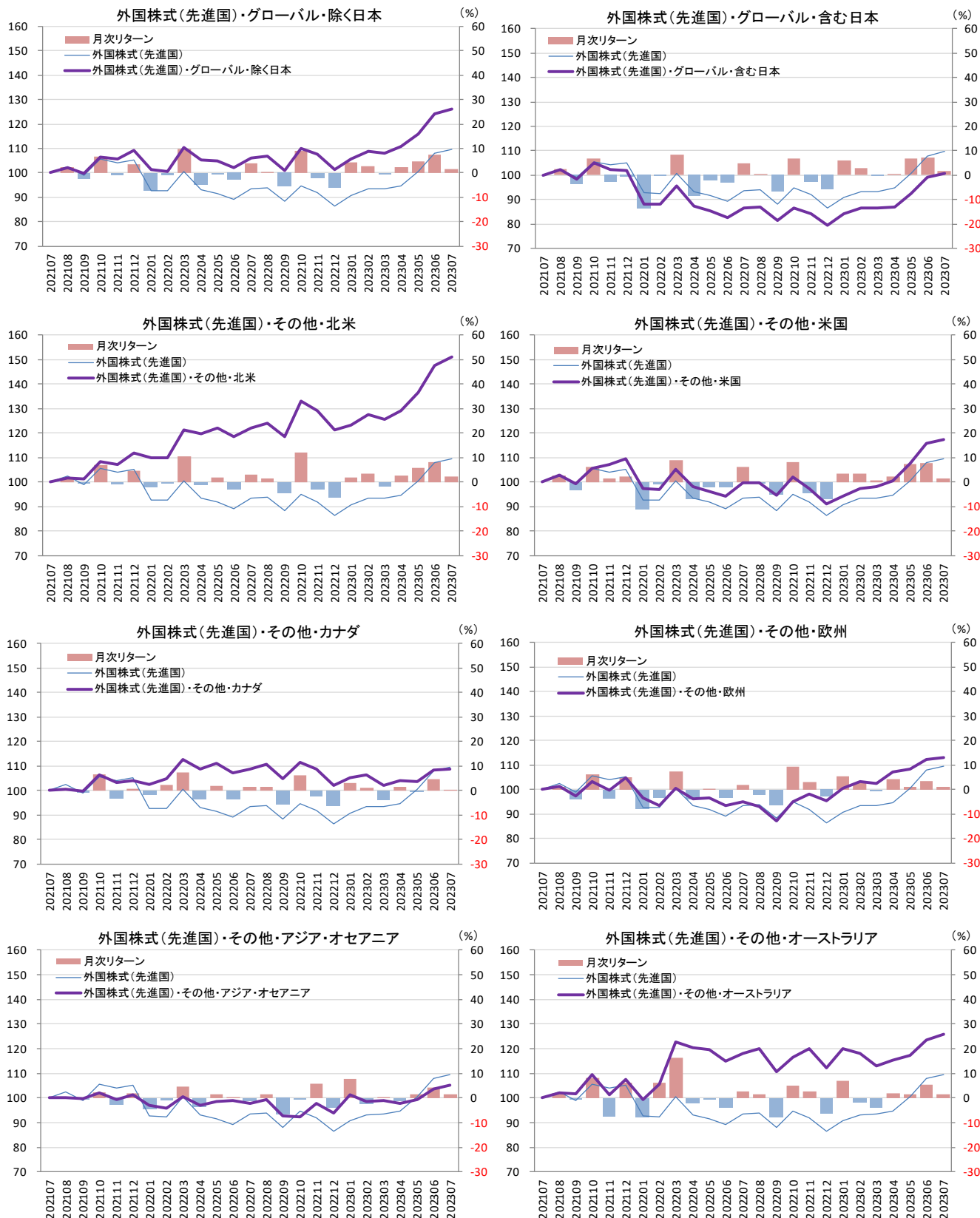


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

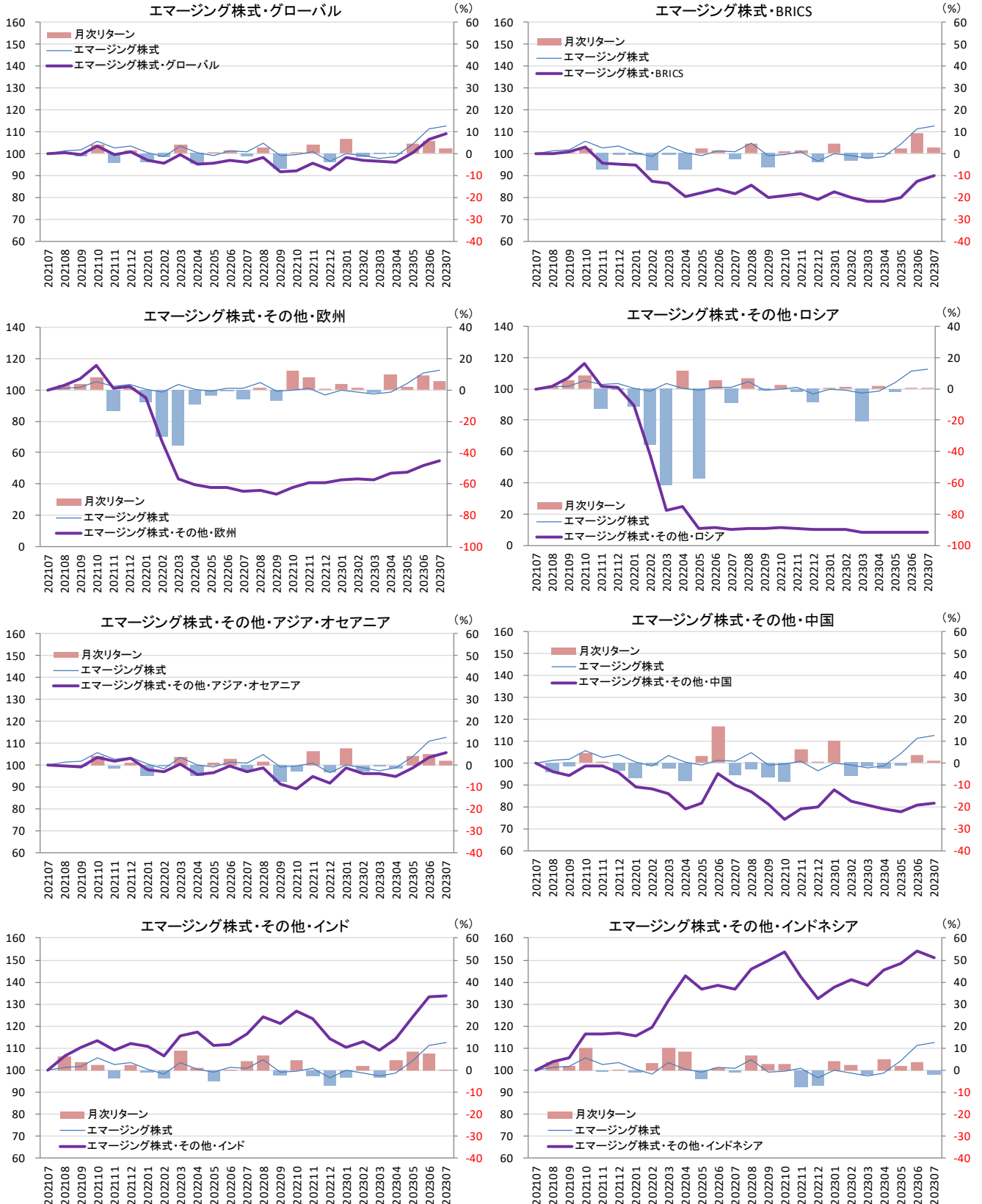


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

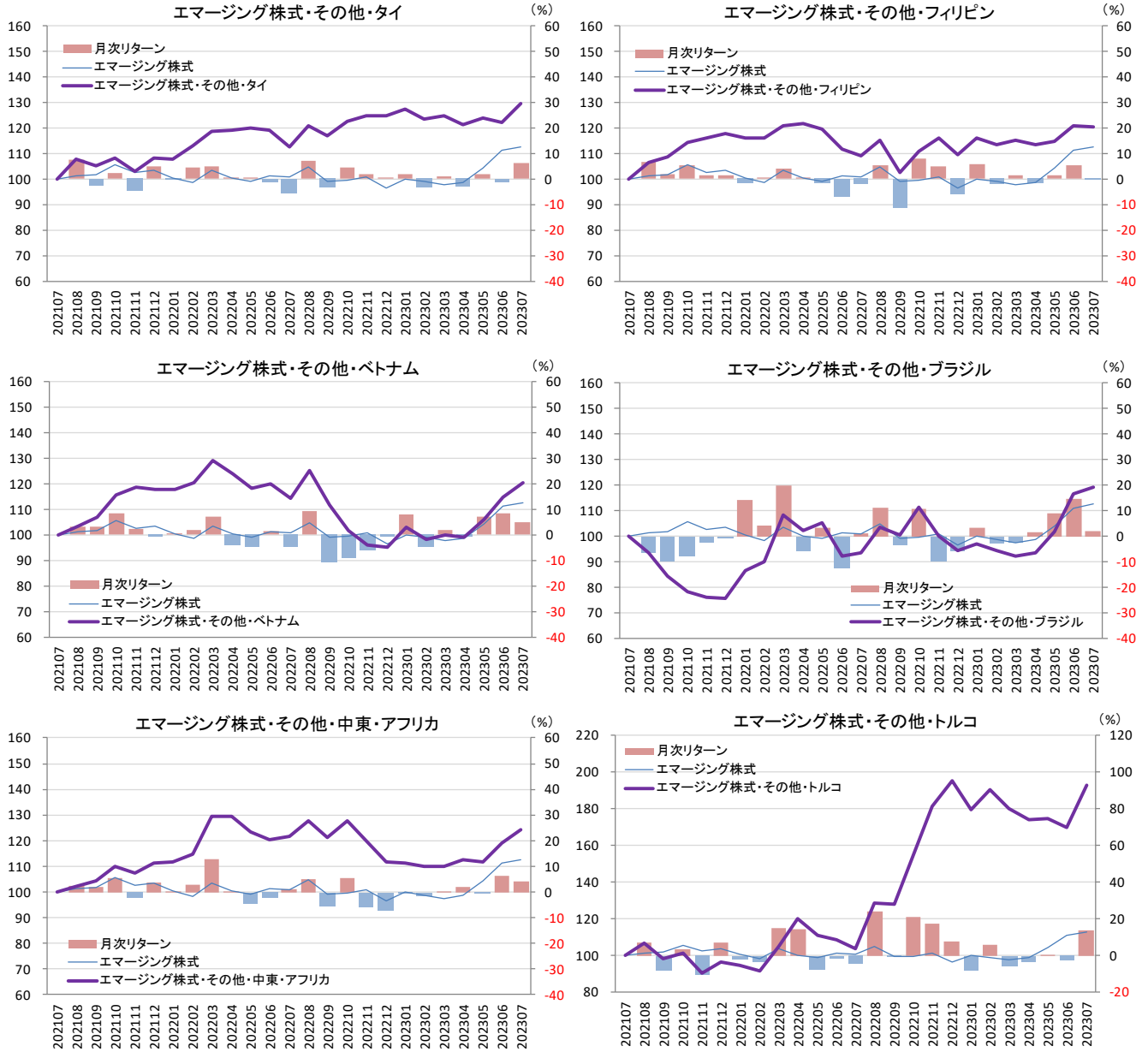


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

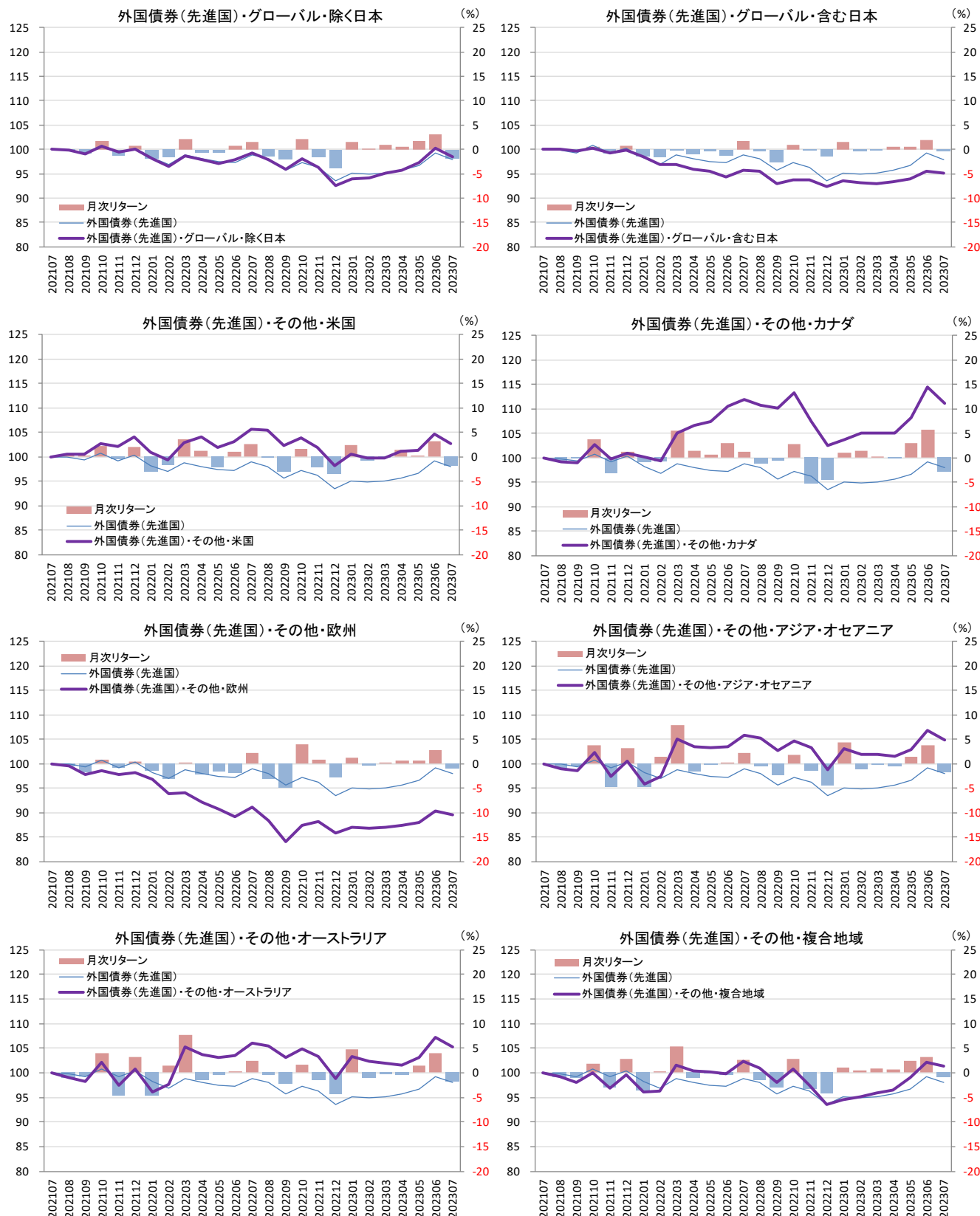


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

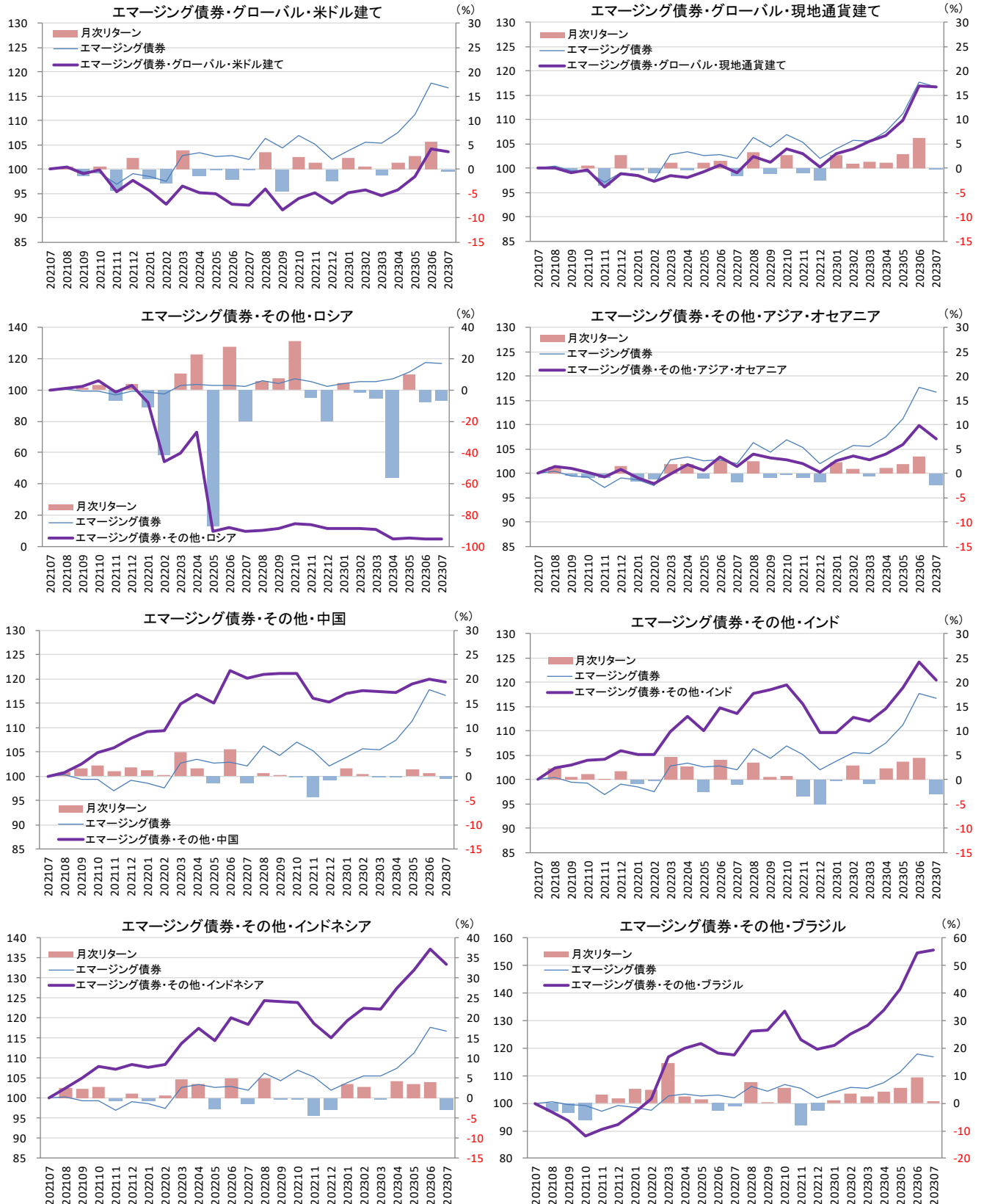


<1>パフォーマンス・サマリー

(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

[エマージング債券]

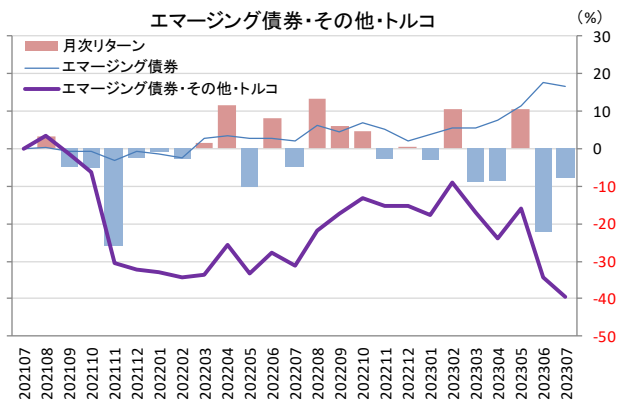
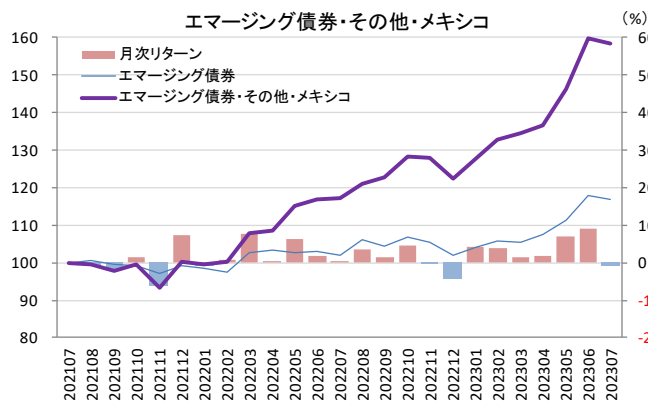


<1>パフォーマンス・サマリー

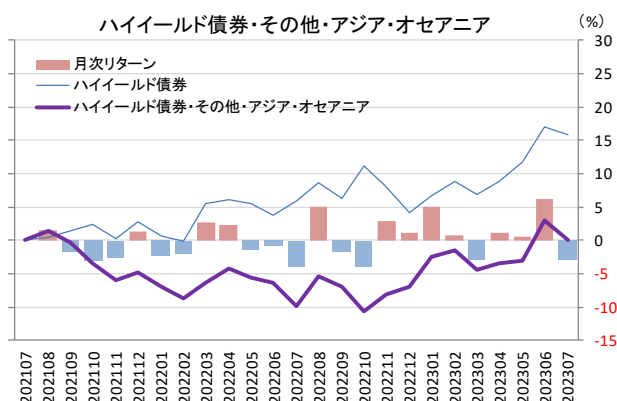
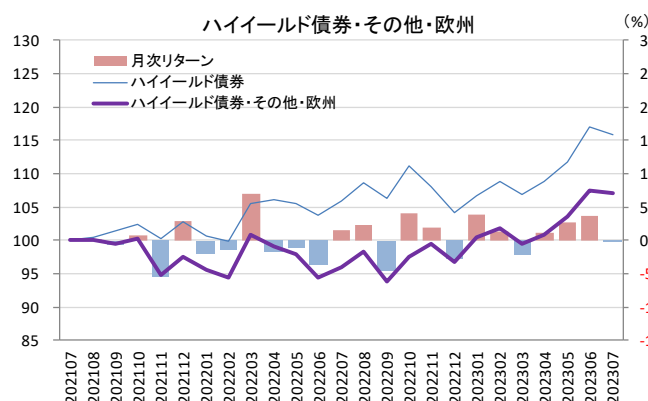
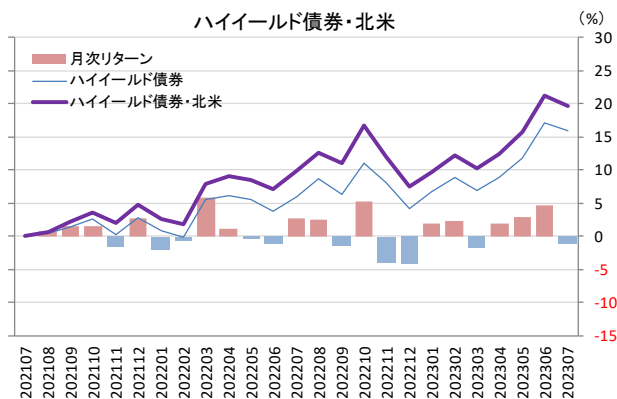
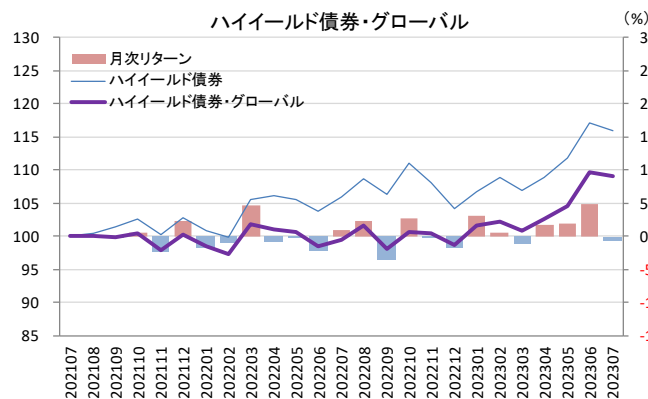
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

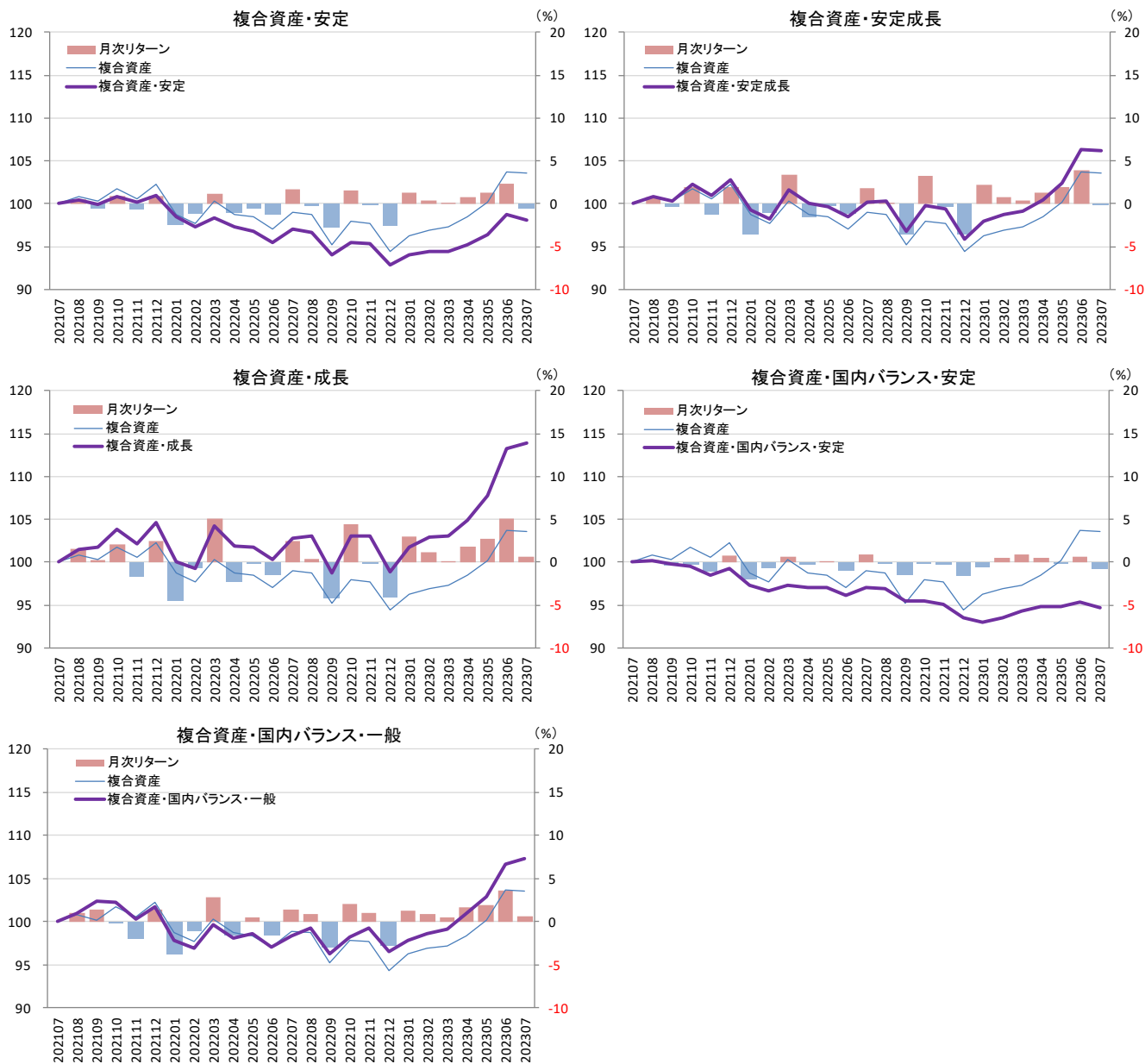


<1>パフォーマンス・サマリー

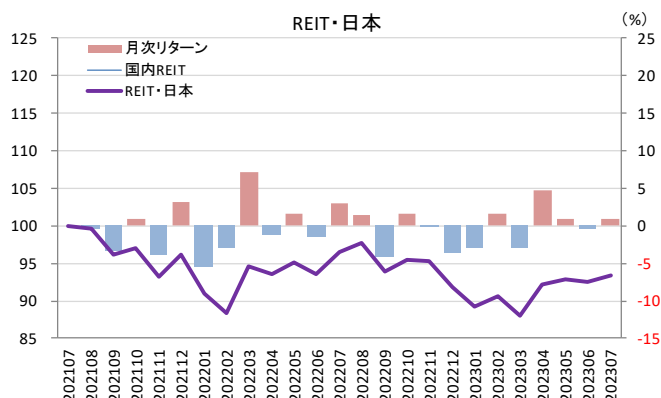
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

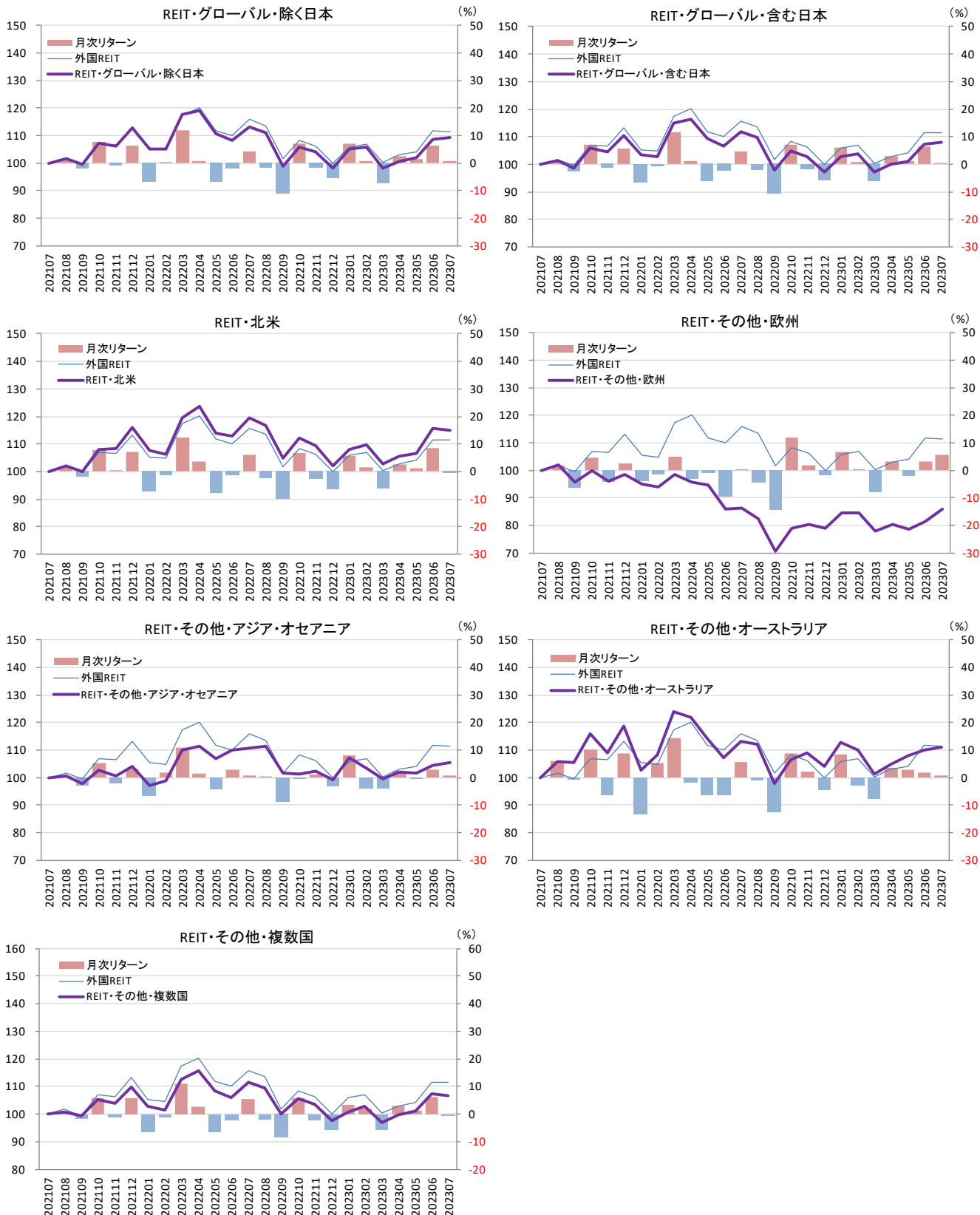


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

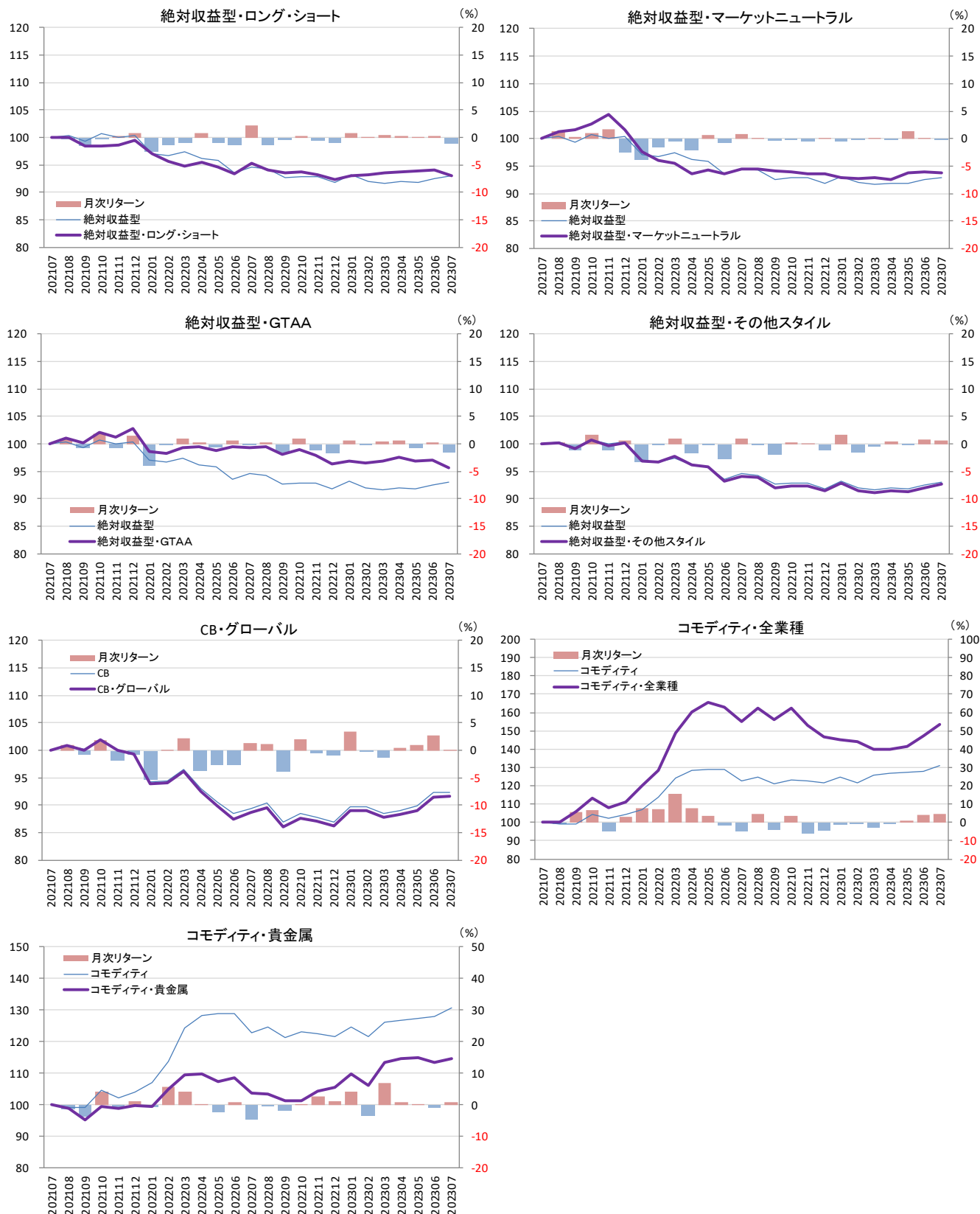


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	0.68		
1	外国株式(先進国)・グローバル	1.61	29.17	0.47
2	外国株式(先進国)・その他	1.41	13.94	0.20
3	国内株式・一般	1.03	7.20	0.07
4	国内株式・その他	0.79	4.78	0.04
5	エマージング株式・グローバル	2.39	1.06	0.03
6	REIT・日本	0.88	2.83	0.02
7	エマージング株式・その他	0.97	2.26	0.02
8	複合資産・成長	0.61	3.00	0.02
9	コモディティ	2.13	0.57	0.01
10	REIT・グローバル	0.61	1.82	0.01
11	絶対収益型	0.44	1.18	0.01
12	REIT・その他	0.99	0.30	0.00
13	国内株式・業種特化	1.76	0.08	0.00
14	エマージング株式・BRICS	2.96	0.05	0.00
15	複合資産・その他	0.04	0.32	0.00
16	CB	0.05	0.29	0.00
17	ハイイールド債券・その他	-0.81	0.19	-0.00
18	ハイイールド債券・グローバル	-0.58	0.27	-0.00
19	エマージング債券・グローバル	-0.35	0.66	-0.00
20	国内株式・小型	-0.43	0.76	-0.00
21	複合資産・国内バランス	-0.61	0.71	-0.00
22	エマージング債券・その他	-1.64	0.51	-0.01
23	複合資産・安定成長	-0.18	6.43	-0.01
24	ハイイールド債券・北米	-1.19	1.46	-0.02
25	REIT・北米	-0.71	2.51	-0.02
26	複合資産・安定	-0.60	3.94	-0.02
27	外国債券(先進国)・その他	-1.75	1.70	-0.03
28	国内債券・一般	-1.18	4.21	-0.05
29	外国債券(先進国)・グローバル	-1.06	7.22	-0.08
	合計		100.00	0.68

◆計算定義

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

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

<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	10.59		
1	外国株式(先進国)・グローバル	17.04	28.16	4.84
2	外国株式(先進国)・その他	17.42	13.13	2.40
3	国内株式・一般	20.32	6.88	1.35
4	国内株式・その他	21.98	4.73	1.04
5	複合資産・安定成長	5.95	6.62	0.40
6	複合資産・成長	10.91	2.86	0.33
7	エマージング株式・その他	10.62	2.09	0.21
8	エマージング株式・グローバル	13.99	1.06	0.14
9	ハイイールド債券・北米	8.90	1.45	0.12
10	国内株式・小型	12.61	0.77	0.09
11	エマージング債券・グローバル	13.39	0.69	0.08
12	エマージング債券・その他	15.54	0.54	0.07
13	コモディティ	6.56	0.57	0.04
14	ハイイールド債券・グローバル	9.66	0.29	0.03
15	複合資産・安定	1.14	4.33	0.03
16	ハイイールド債券・その他	11.47	0.22	0.02
17	国内株式・業種特化	21.91	0.08	0.02
18	CB	3.35	0.23	0.01
19	エマージング株式・BRICS	10.33	0.05	0.00
20	複合資産・国内バランス	-1.40	0.84	-0.02
21	REIT・その他	-3.94	0.35	-0.02
22	絶対収益型	-1.64	1.32	-0.03
23	外国債券(先進国)・その他	-1.65	1.79	-0.04
24	複合資産・その他	-9.42	0.35	-0.05
25	外国債券(先進国)・グローバル	-0.77	7.54	-0.09
26	REIT・グローバル	-3.42	1.96	-0.11
27	国内債券・一般	-2.40	4.77	-0.14
28	REIT・北米	-3.85	2.66	-0.15
29	REIT・日本	-3.17	3.15	-0.15
	合計		100.00	10.59

◆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	33.87	36.27	81.50	10.93	12.09	10.63	0.94	0.53	0.58
国内株式	55.59	41.96	143.35	13.51 ↓	16.34	15.53	1.18	0.45	0.60
一般	53.90	39.02	133.19	13.03 ↓	16.08	15.58	1.19	0.43	0.57
フリー	49.48	37.64	129.60	13.44 ↓	16.44	15.97	1.07	0.40	0.54
バリュー	70.44	42.93	144.08	12.21 ↓	15.24	14.64	1.60	0.49	0.64
小型	31.22	20.51	165.05	15.96 ↓	19.74	16.96 ↓	0.60	0.19	0.60
その他	62.99	52.90	159.93	14.40 ↓	16.30	15.56	1.23	0.55	0.65
日経225	59.19	58.52	175.66	16.01	17.42	16.32	1.05	0.56	0.65
TOPIX	65.60	47.56	148.54	13.08 ↓	15.37	14.87	1.40	0.53	0.64
JPX日経400	65.15	49.57	-	13.63 ↓	15.59	-	1.34	0.54	-
国内債券	-5.33	-4.10	3.11	2.02	2.09	1.84	-0.88	-0.38	0.17
一般	-5.33	-4.10	3.11	2.02	2.09	1.84	-0.88	-0.38	0.17
外国株式(先進国)	50.08	69.59	148.46	16.60	18.47	15.92	0.87	0.61	0.60
グローバル	45.39	66.28	154.71	16.76	18.57	15.86	0.79	0.58	0.62
除く日本	77.87	85.75	211.37	15.50	18.09	16.36	1.37	0.73	0.74
含む日本	36.50	60.34	139.70	17.56	19.01	15.96	0.62	0.52	0.57
その他	63.15	77.29	136.05	16.65	18.47	16.31	1.07	0.66	0.55
北米	123.19	119.42	206.98	15.39	19.44	17.44	2.00	0.88	0.68
米国	63.19	90.30	171.22	16.86	18.28	16.68	1.05	0.75	0.63
カナダ	43.96	27.27	22.01	13.21 ↓	18.82	15.94	0.98	0.26	0.13
欧州	50.04	44.91	101.50	15.80 ↓	18.09	15.99	0.92	0.43	0.45
ドイツ	60.64	44.18	-	20.46 ↓	22.45	-	0.84	0.34	-
イギリス	56.17	18.94	-	13.92	17.44	-	1.15	0.20	-
アジア・オセアニア	30.44	25.35	93.16	11.32 ↓	15.25	14.71	0.82	0.31	0.46
オーストラリア	64.58	35.03	72.10	19.71 ↓	24.00	19.75	0.92	0.26	0.28
ニュージーランド	32.80	57.47	219.45	15.86 ↓	17.99	17.52	0.63	0.53	0.70
複合地域	193.68	38.62	52.17	29.11 ↓	33.66	26.59	1.49	0.20	0.16
エマージング株式	50.45	39.91	94.97	12.17 ↓	18.06	16.46	1.20	0.39	0.42
グローバル	40.19	45.20	78.82	13.20 ↓	18.12	16.63	0.91	0.43	0.36
BRICS	17.50	16.27	77.52	15.25	20.75	19.28	0.36	0.15	0.31
その他	56.26	39.12	103.11	12.14	18.49	16.69	1.32	0.37	0.44
欧州	-30.01	-35.82	-30.63	35.42	33.16	27.14	-0.32	-0.25	-0.13
ロシア	-88.56	-88.03	-84.63	57.25	48.60	38.59	-0.90	-0.71	-0.44
アジア・オセアニア	30.36	25.29	70.81	14.02 ↓	17.75	15.98	0.66	0.26	0.35
中国	-5.80	26.89	135.81	19.85 ↓	21.60	21.01	-0.10	0.23	0.43
インド	105.63	64.21	247.84	16.08	23.62	22.42	1.69	0.44	0.59
インドネシア	73.36	36.24	34.59	19.22	26.23	23.94	1.05	0.24	0.13
タイ	39.67	3.94	38.49	17.04	20.94	18.26	0.69	0.04	0.18
フィリピン	36.35	0.21	6.86	16.21 ↓	20.21	18.70	0.67	0.00	0.04
ベトナム	116.02	57.49	153.82	22.17 ↓	26.18	21.24	1.32	0.36	0.46
韓国	43.62	42.67	70.13	24.06 ↓	25.87	20.61	0.53	0.29	0.27
香港	13.97	-2.16	43.62	22.04	21.89	19.74	0.20	-0.02	0.19
中南米	86.83	55.74	60.42	26.43	30.24	26.45	0.88	0.31	0.18
ブラジル	44.80	28.04	13.04	29.48	34.17	31.91	0.45	0.15	0.04
メキシコ	169.68	63.10	64.60	22.22 ↓	27.94	23.66	1.77	0.37	0.22
中東・アフリカ	76.56	42.37	81.53	14.46	18.74	16.70	1.45	0.39	0.37
トルコ	114.82	65.69	1.40	33.14	36.56	31.94	0.88	0.29	0.00
複合地域	32.10	23.04	48.65	15.15	18.22	15.72	0.64	0.23	0.26

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

[リスクの矢印] 直近6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	33.87	36.27	81.50	10.93	12.09	10.63	0.94	0.53	0.58
外国債券(先進国)	2.53	7.35	16.53	4.50	4.73	5.35	0.19	0.31	0.29
グローバル	0.10	6.19	16.73	3.97	4.03	4.77	0.02	0.31	0.33
除く日本	1.67	9.39	19.20	5.10 ↑	4.50	5.39	0.11	0.41	0.33
含む日本	-1.19	3.13	14.63	3.41 ↓	4.30	4.49 ↓	-0.11	0.15	0.31
その他	11.21	12.40	19.62	7.32	7.70	7.55	0.50	0.31	0.24
北米	-1.29	4.18	22.03	4.29 ↓	4.99	4.66	-0.09	0.17	0.43
米国	14.05	15.97	34.65	6.40	7.29	6.59	0.70	0.42	0.46
カナダ	22.62	22.63	13.93	8.62 ↑	7.96 ↑	8.66	0.82	0.53	0.15
欧州	-8.53	-7.61	3.19	5.98	5.38	6.64	-0.48	-0.28	0.05
イギリス	14.57	13.58	-	10.23	9.60	-	0.46	0.27	-
アジア・オセアニア	12.42	12.75	20.57	9.45	9.83	9.19	0.42	0.25	0.21
オーストラリア	13.02	13.02	20.15	9.46	9.90	9.26	0.44	0.25	0.20
ニュージーランド	1.84	6.07	-	9.15	9.23	-	0.07	0.13	-
複合地域	5.95	17.30	25.27	7.37	6.15	7.04	0.27	0.53	0.33
エマージング債券	26.23	22.40	36.13	7.66	10.98	10.91	1.06	0.38	0.29
グローバル	15.90	12.33	25.08	8.14 ↓	12.37	11.41	0.62	0.19	0.20
米ドル建て	13.14	9.80	24.58	8.69 ↓	12.93	11.81	0.49	0.15	0.19
現地通貨建て	24.05	19.58	16.89	7.30	11.02	10.44	1.02	0.33	0.15
その他	39.84	35.57	49.48	8.88	10.77	11.51	1.34	0.59	0.36
ロシア	-95.10	-95.26	-95.60	73.47	58.85	44.95 ↑	-0.86	-0.78	-0.60
アジア・オセアニア	10.64	18.36	40.44	5.32	6.78	7.02	0.65	0.51	0.49
中国	38.97	32.73	-	6.01 ↓	6.26	-	1.93	0.94	-
インド	33.06	37.72	89.21	8.20	9.47	10.90	1.22	0.70	0.61
インドネシア	50.39	61.24	64.25	8.63	14.45	15.03	1.69	0.70	0.34
ブラジル	60.27	35.26	53.20	17.49	19.55	18.55	0.98	0.32	0.24
メキシコ	80.44	78.52	63.96	12.12	16.51	15.43	1.80	0.75	0.33
トルコ	-48.66	-49.55	-75.22	31.11 ↑	35.56	28.05	-0.64	-0.36	-0.46
複合地域	21.11	13.21	12.71	9.97	12.16	11.95	0.66	0.21	0.10
ハイイールド債券	34.07	28.22	60.64	7.98	11.57	10.50	1.29	0.44	0.46
グローバル	23.83	18.30	46.64	7.34 ↓	11.34	10.49	1.01	0.30	0.37
北米	40.00	34.36	72.45	8.32	11.62	10.49	1.43	0.53	0.54
その他	19.20	12.75	35.15	9.15	12.79	11.50	0.66	0.19	0.27
欧州	21.85	13.90	37.19	10.14 ↓	13.66	12.24	0.67	0.20	0.26
アジア・オセアニア	9.32	7.44	33.29	9.12	11.84	10.39	0.33	0.13	0.28
複合地域	23.23	27.38	57.41	7.37	8.88	8.82	0.98	0.56	0.53
複合資産	17.23	17.86	51.52	6.43	7.31	7.22	0.85	0.46	0.59
安定	5.16	6.87	30.03	4.41	5.04	5.39 ↓	0.39	0.27	0.50
安定成長	21.60	22.91	59.29	6.86	7.84	7.61	0.99	0.54	0.63
成長	40.40	39.20	101.19	9.38	11.08	10.48	1.28	0.62	0.69
国内バランス	0.45	-3.04	9.55	2.98	3.93	5.05	0.06	-0.15	0.18
安定	-1.38	-4.50	11.48	2.85	3.74	3.07	-0.15	-0.23	0.36
一般	26.45	20.68	47.37	6.96 ↓	8.36	8.85	1.17	0.46	0.45

※[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	33.87	36.27	81.50	10.93	12.09	10.63	0.94	0.53	0.58
国内REIT	24.36	25.56	95.28	11.53 ↓	14.89	13.22 ↓	0.66	0.32	0.52
日本	24.36	25.56	95.28	11.53 ↓	14.89	13.22 ↓	0.66	0.32	0.52
外国REIT	52.54	44.29	107.98	17.52	18.84	16.31	0.86	0.41	0.47
グローバル	49.29	32.84	85.67	17.70	19.49	16.50	0.81	0.30	0.39
除く日本	53.63	40.25	109.69	18.41	20.13	16.85	0.84	0.35	0.46
含む日本	47.77	30.67	81.49	17.42	19.27	16.38	0.80	0.29	0.38
北米	58.87	57.27	130.31	18.20	18.74	16.66	0.92	0.51	0.52
その他	31.49	24.58	94.13	15.13 ↓	19.18	15.85	0.63	0.24	0.43
欧州	10.83	-11.94	31.76	19.94	21.14	18.33	0.18	-0.12	0.15
アジア・オセアニア	26.72	26.16	99.06	13.82 ↓	17.73	15.14	0.60	0.27	0.47
オーストラリア	49.06	21.97	73.82	23.63	29.13	22.74	0.60	0.14	0.25
複合地域	52.34	3.57	39.62	18.70	24.94	20.19	0.81	0.03	0.17
複数国	48.84	50.85	150.50	16.19	17.38	14.97	0.88	0.50	0.64
その他									
絶対収益型	-3.38	-4.39	-1.43	3.59	3.23	2.75	-0.31	-0.27	-0.05
ロング・ショート	-6.74	-7.95	-10.00	3.16	3.32	3.06	-0.72	-0.48	-0.34
マーケットニュートラル	-8.83	-8.20	23.48	4.23 ↓	4.12	5.46	-0.71	-0.40	0.39
GTAA	3.85	7.94	8.83	4.39	4.45	3.43	0.30	0.35	0.25
その他スタイル	-2.65	-4.31	-0.52	3.99	3.48	3.04	-0.22	-0.24	-0.01
CB	6.79	9.75	26.57	7.41 ↓	8.89	7.66	0.30	0.22	0.31
アジア・オセアニア	42.32	47.94	102.39	10.09	12.32	11.44	1.24	0.66	0.64
日本	4.92	-2.59	20.20	4.48	5.17	5.38	0.37	-0.09	0.35
グローバル	5.94	9.33	25.40	7.64 ↓	9.12	7.75	0.26	0.20	0.30
コモディティ	44.72	60.88	15.89	10.91 ↓	11.19	12.09	1.20	0.90	0.12
全業種	125.10	68.14	22.08	16.66 ↓	19.22	16.95	1.87	0.57	0.12
貴金属	7.00	59.33	40.23	12.46 ↓	12.26	11.46 ↓	0.19	0.80	0.30
エネルギー	212.86	81.89	19.64	28.46	37.09	31.45	1.63	0.34	0.06
その他コモディティ	96.91	50.26	30.11	16.22 ↓	19.11	16.97	1.56	0.45	0.16

※[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

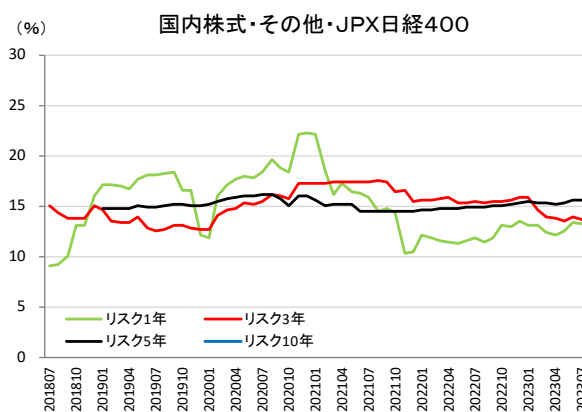
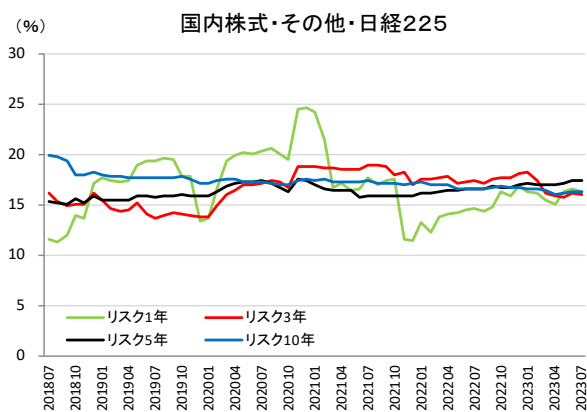
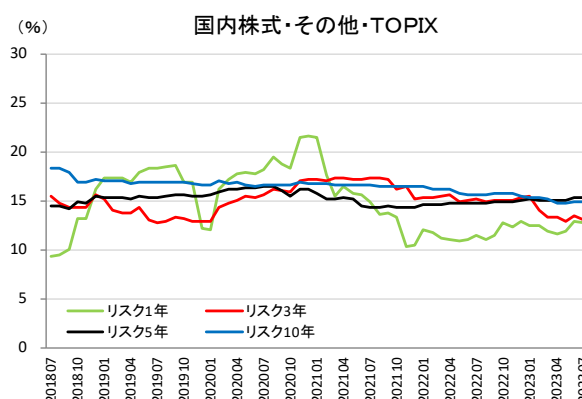
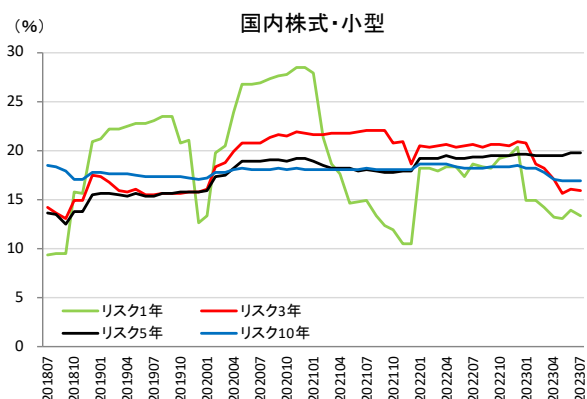
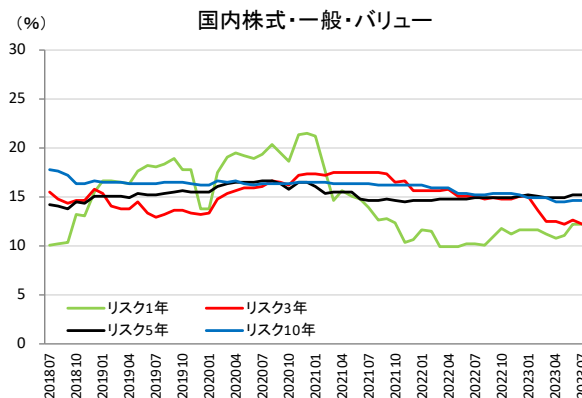
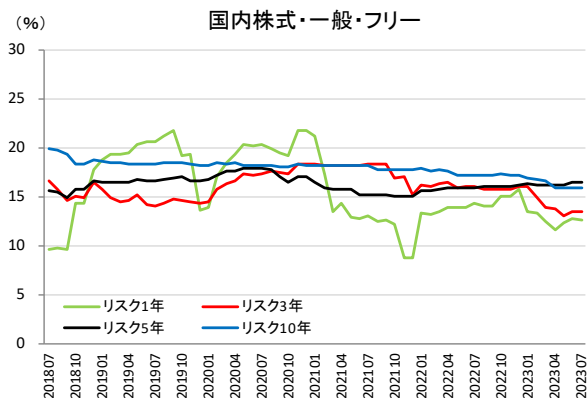
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

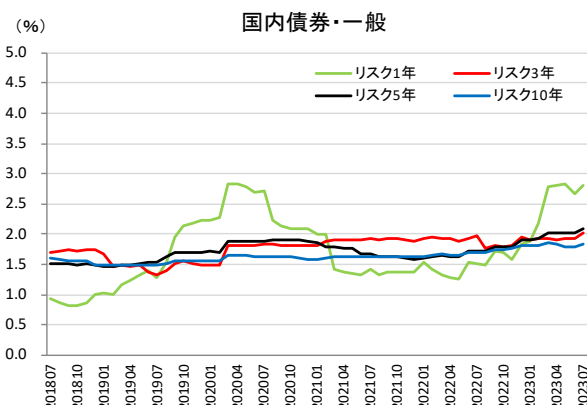
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

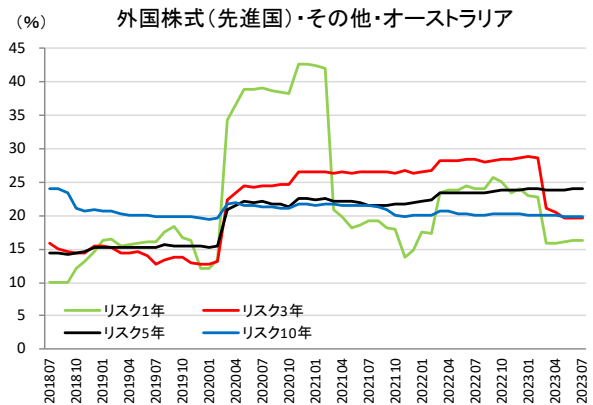
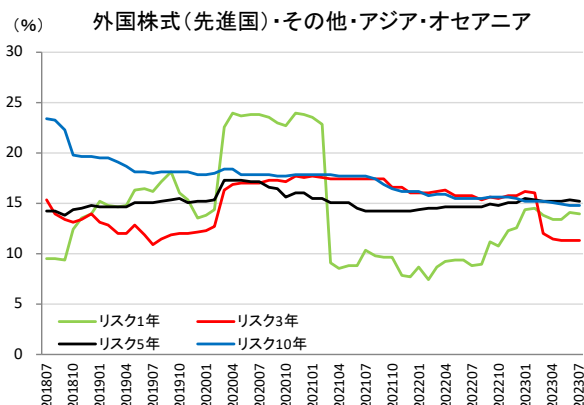
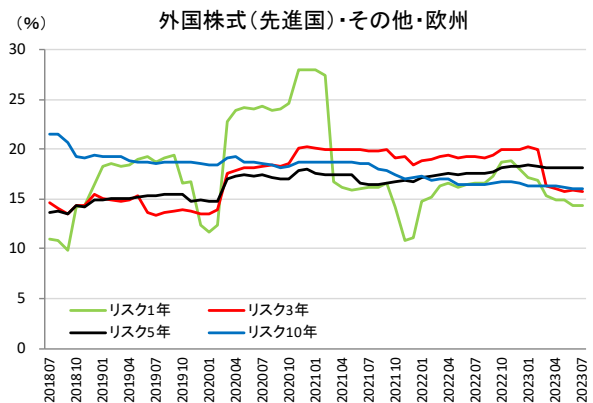
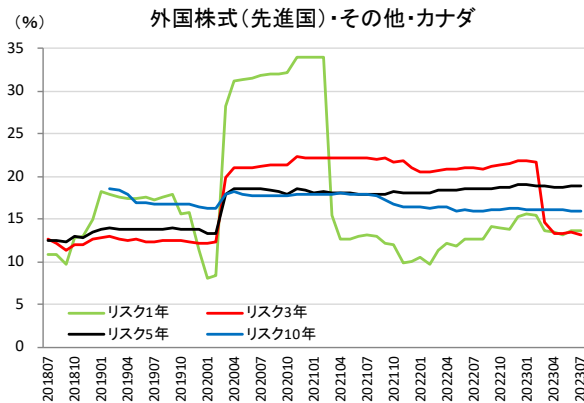
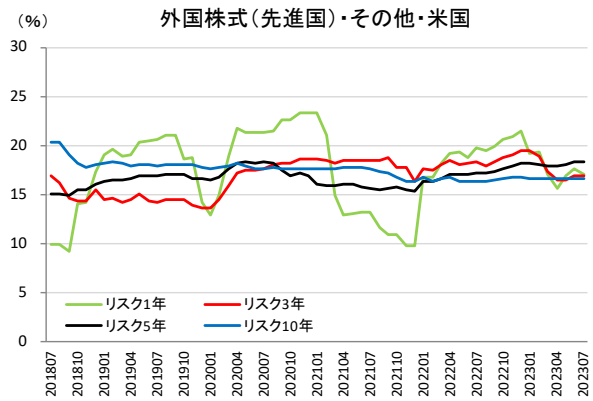
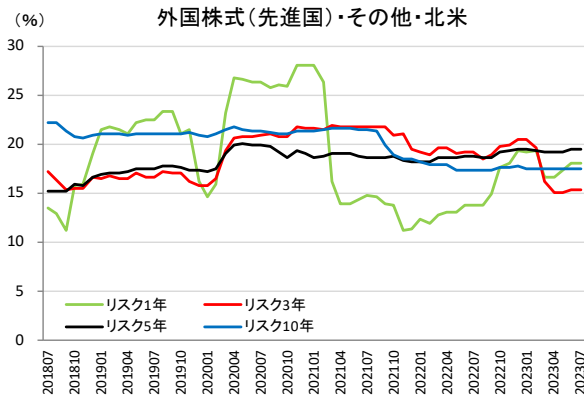
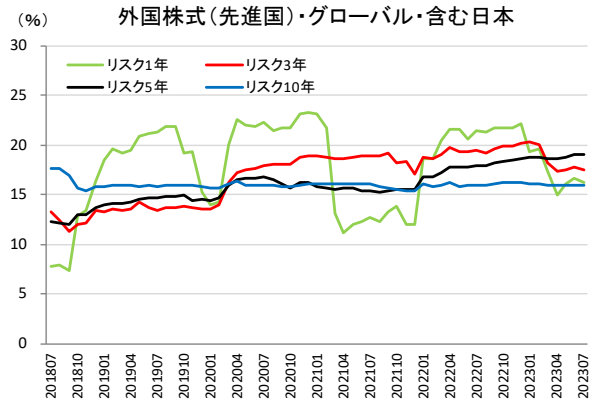
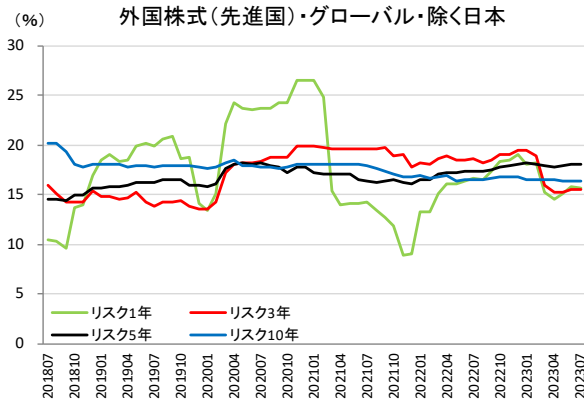


<2> リスク・サマリー

(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)]

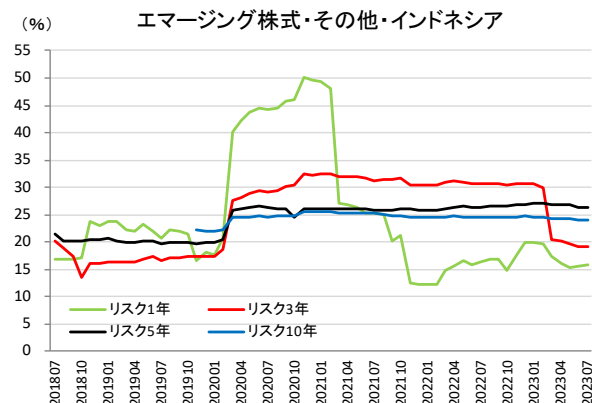
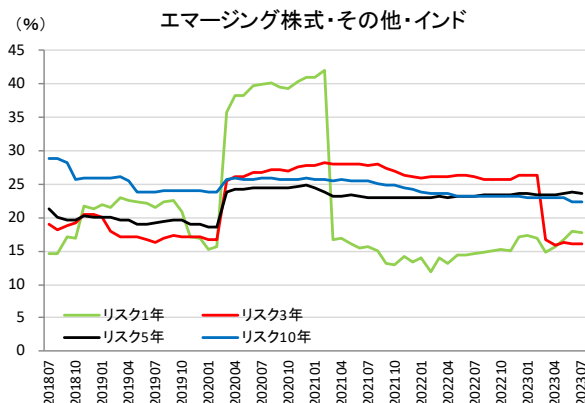
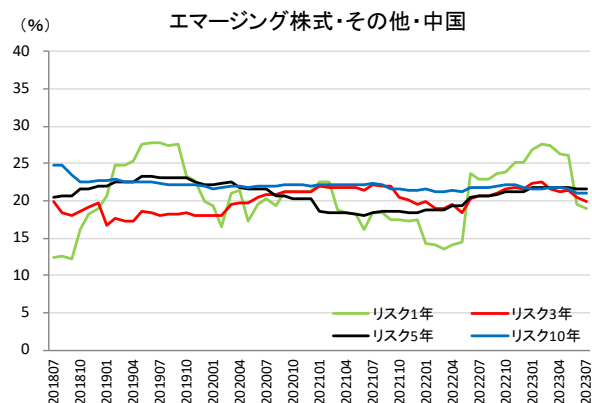
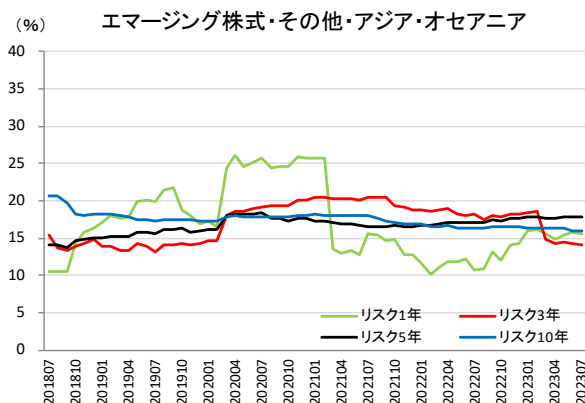
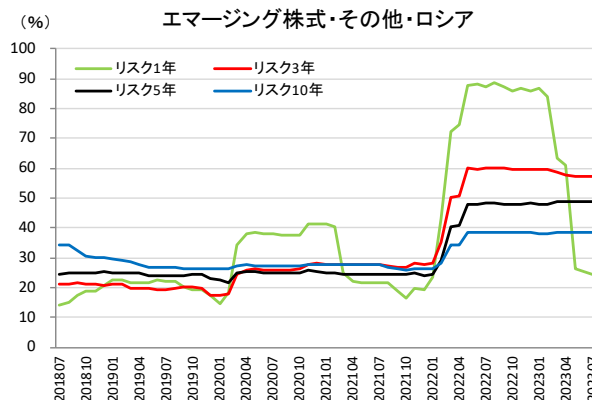
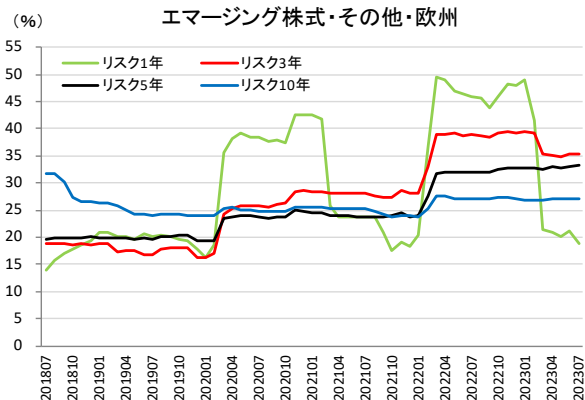
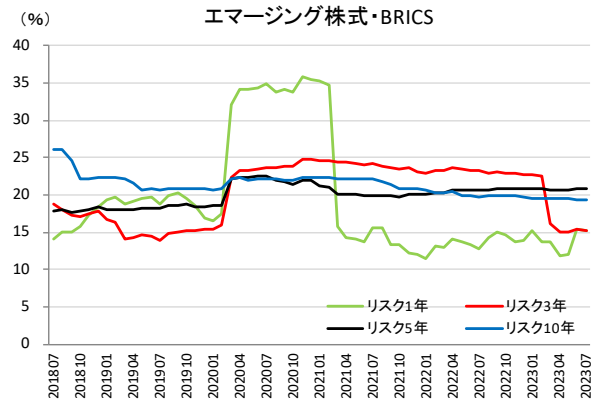
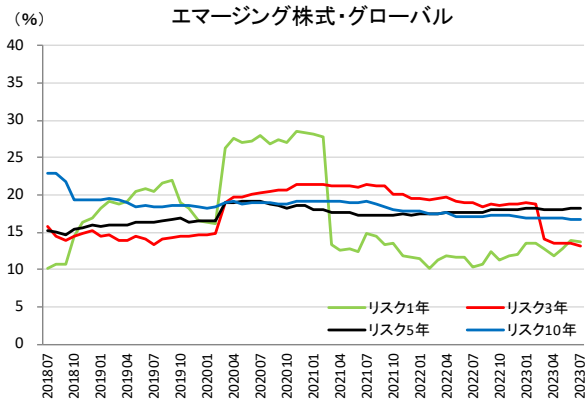


<2> リスク・サマリー

(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]

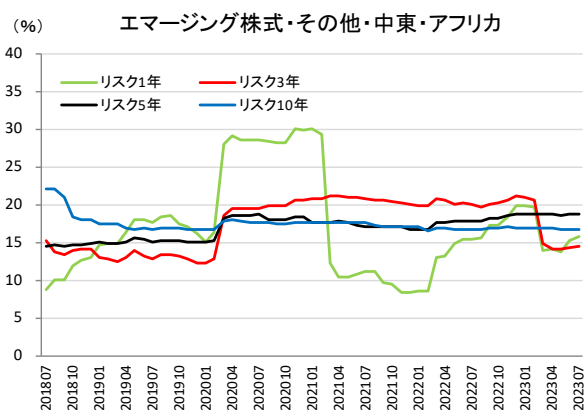
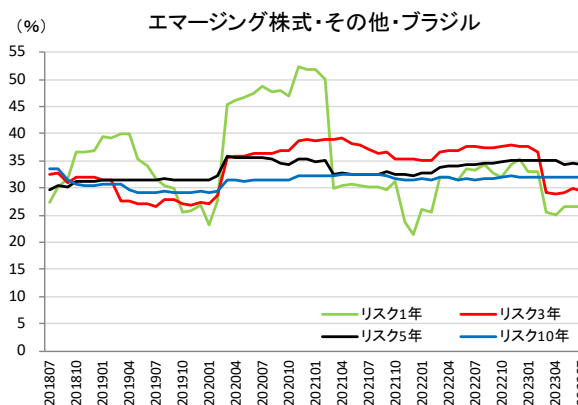
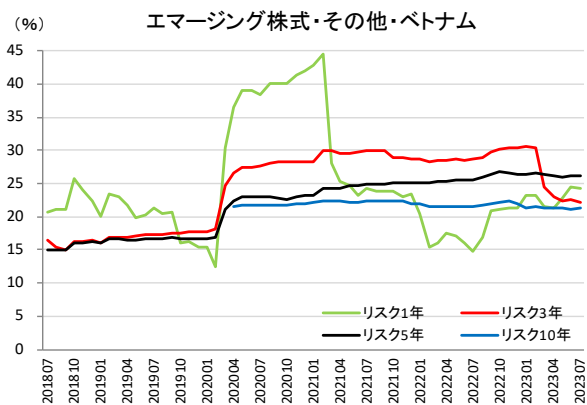
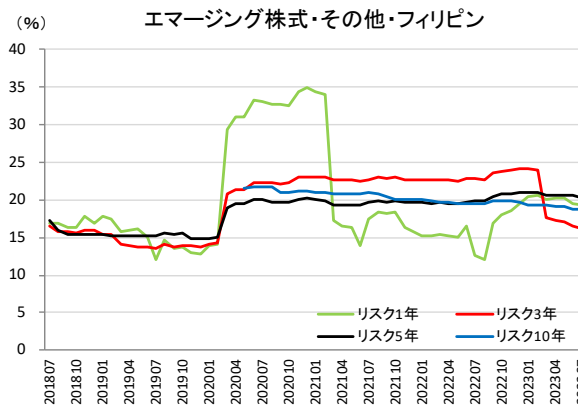
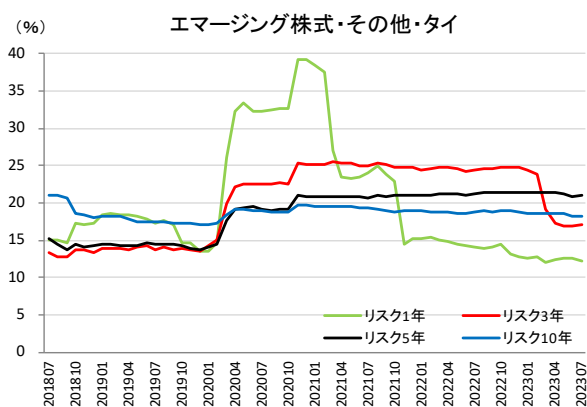


<2> リスク・サマリー

(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]

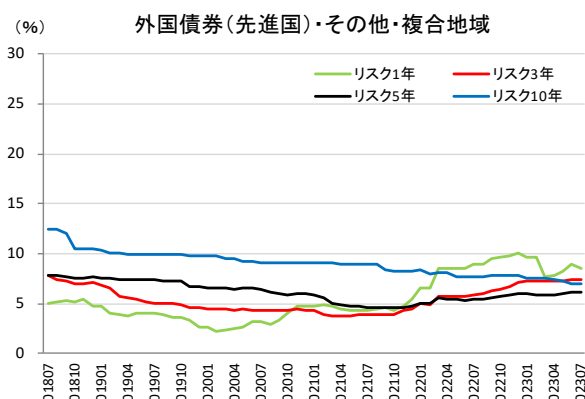
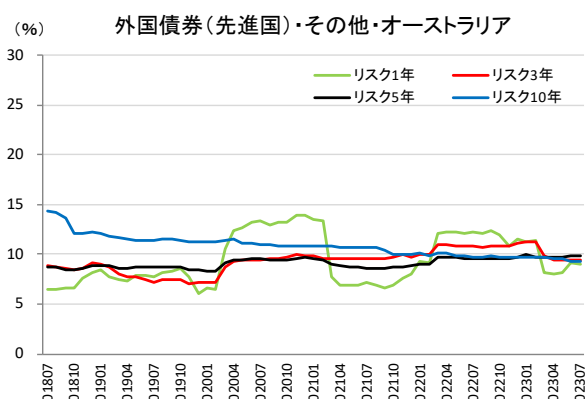
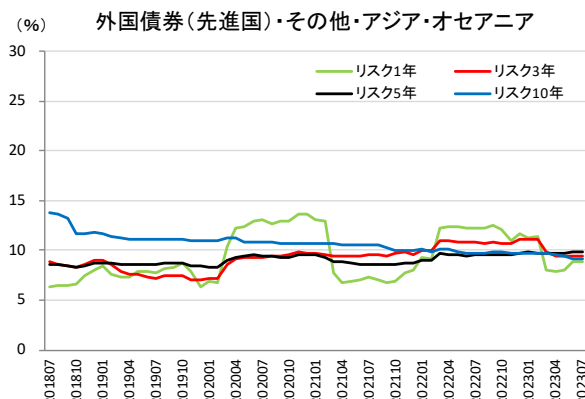
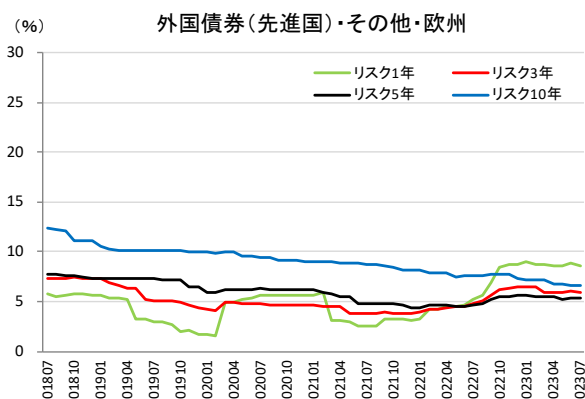
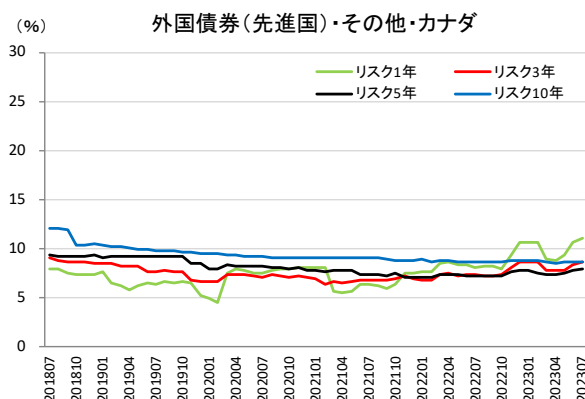
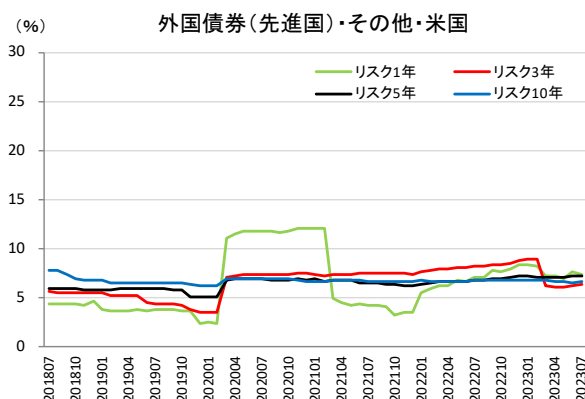
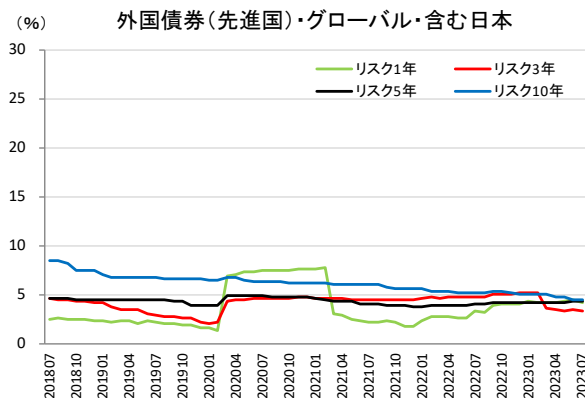
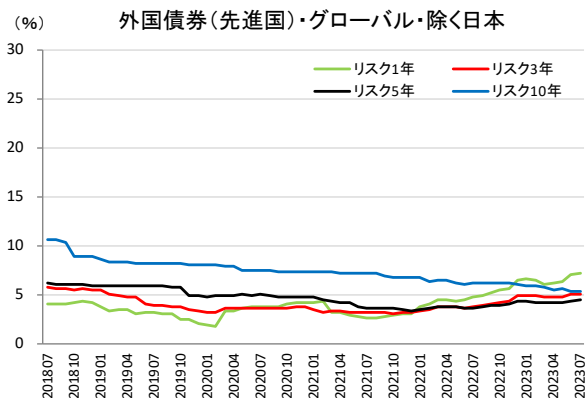


<2> リスク・サマリー

(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)]

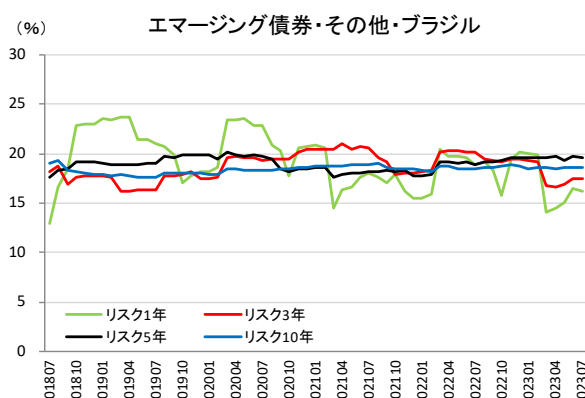
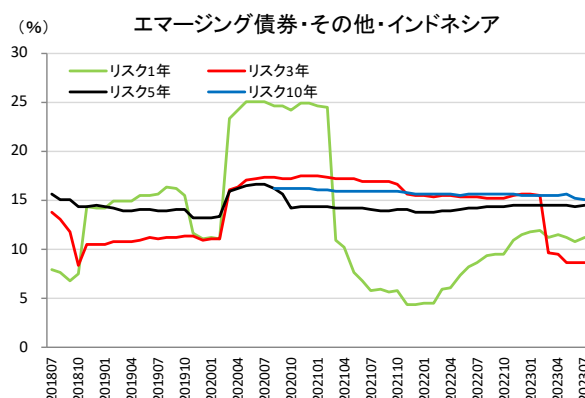
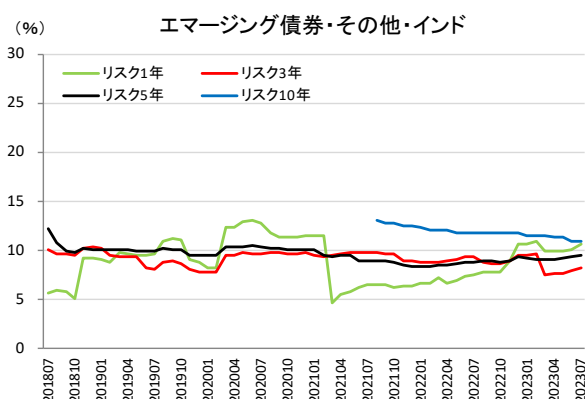
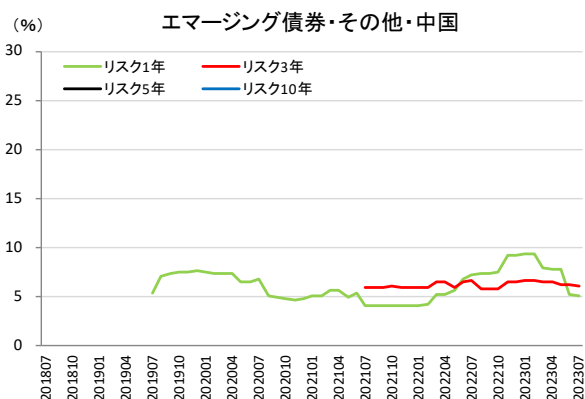
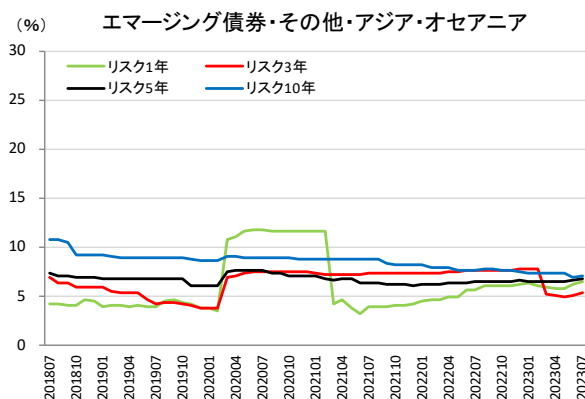
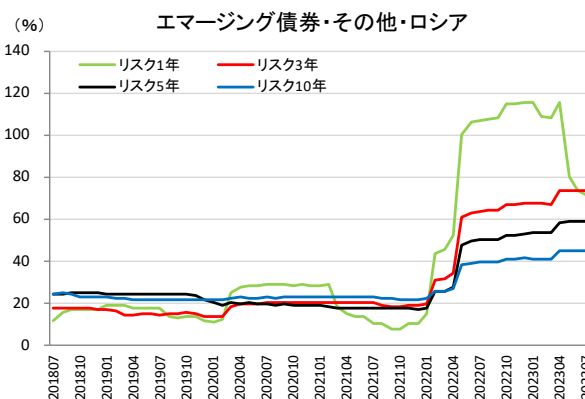
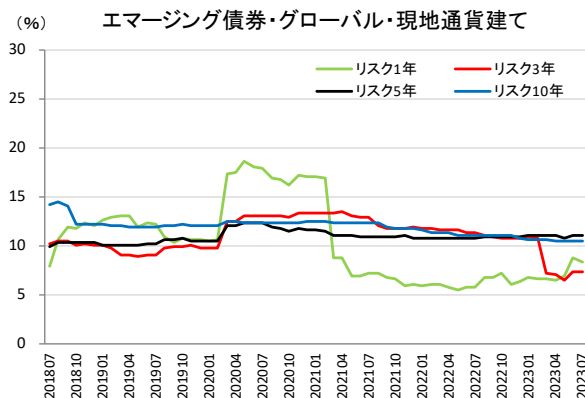
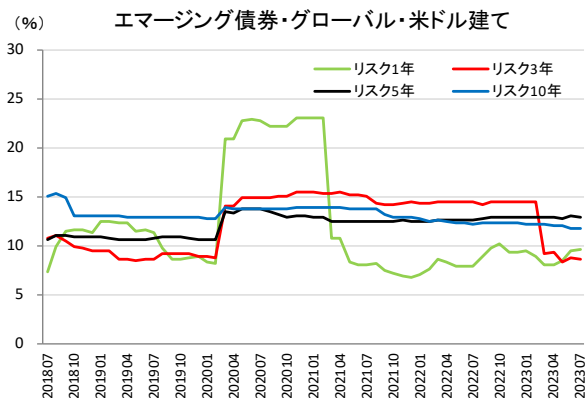


<2> リスク・サマリー

(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]

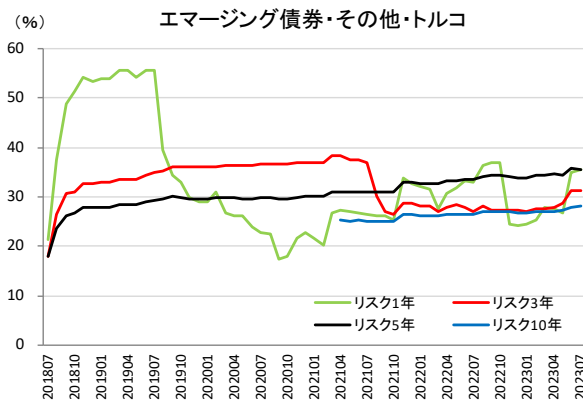
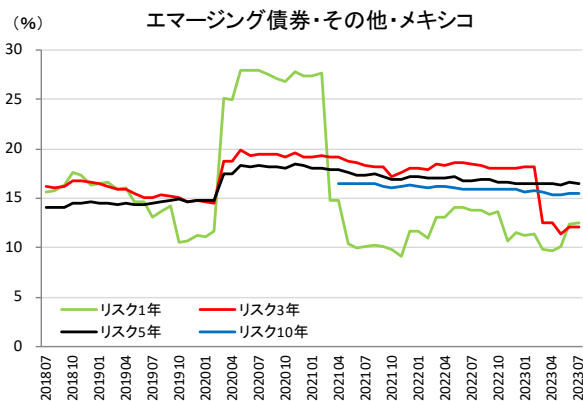


<2>リスク・サマリー

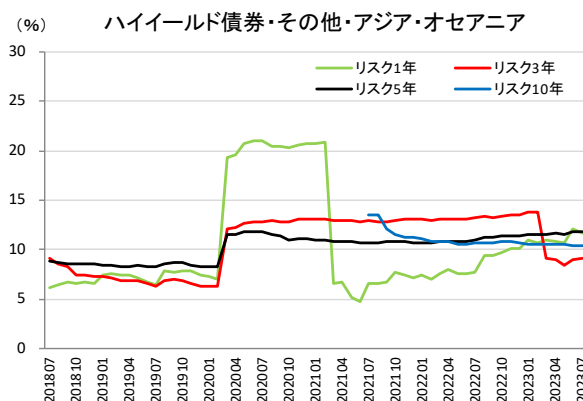
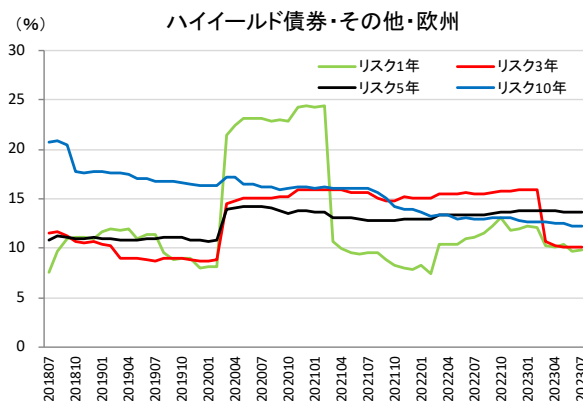
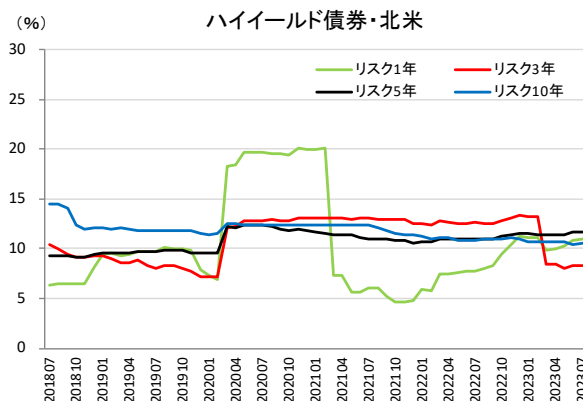
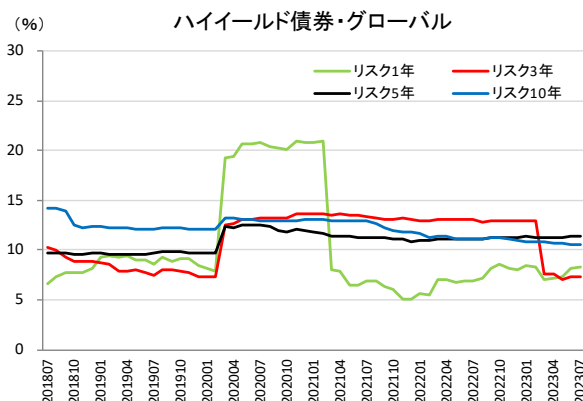
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

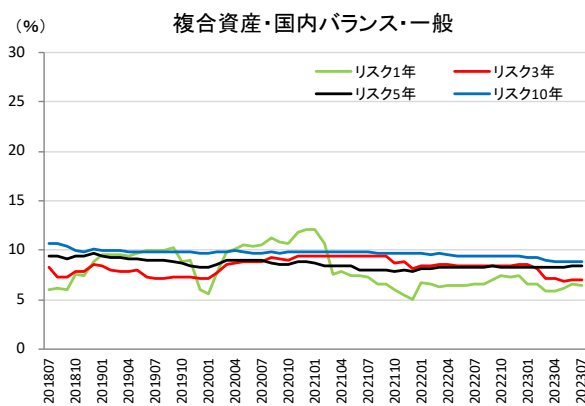
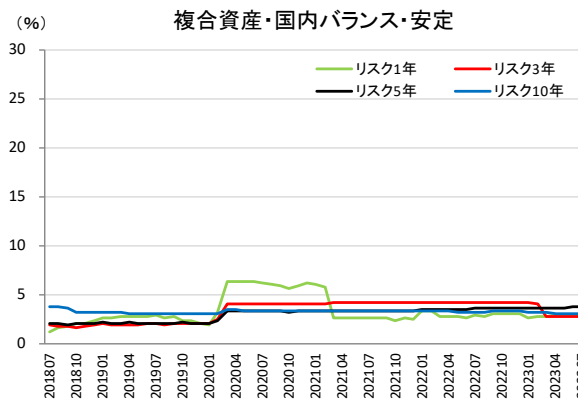
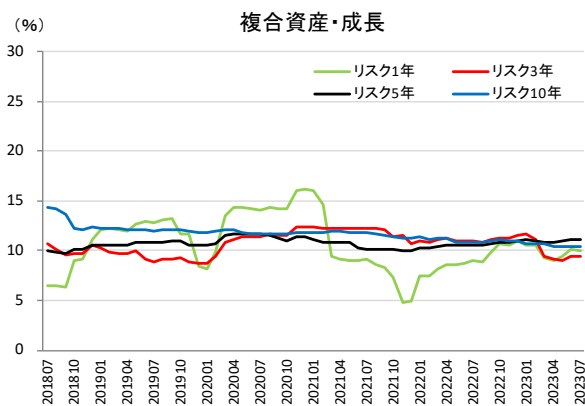
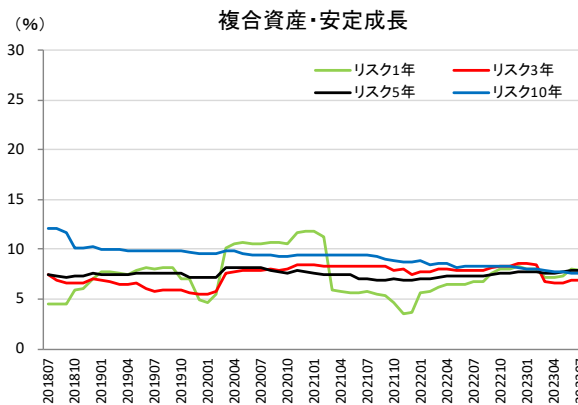
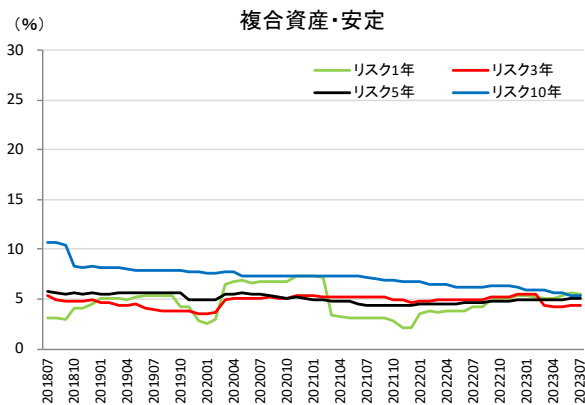


<2>リスク・サマリー

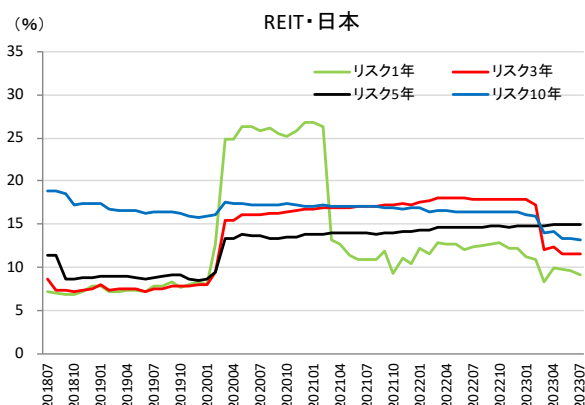
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

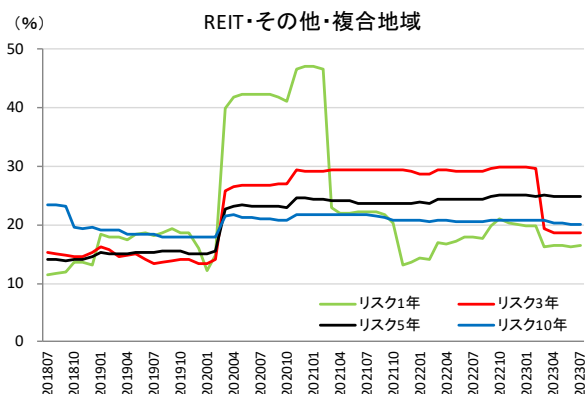
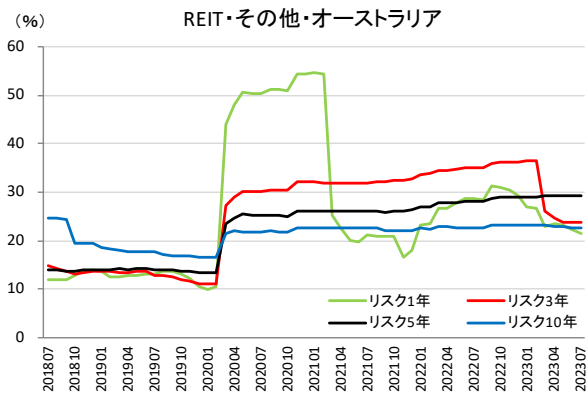
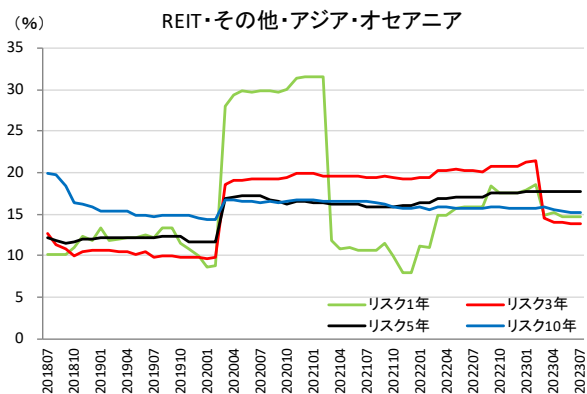
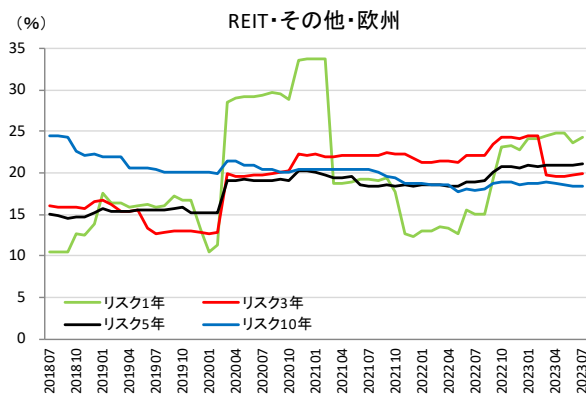
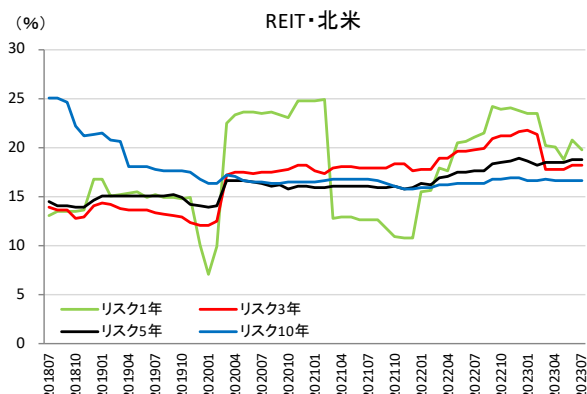
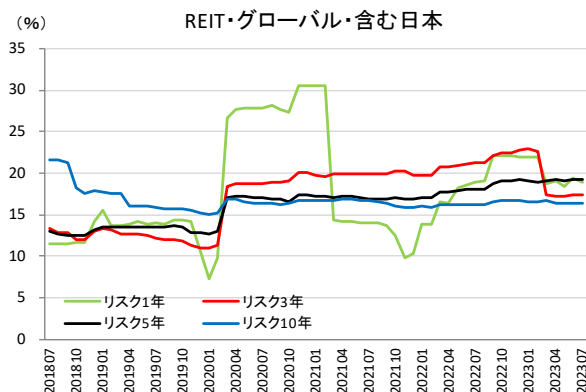
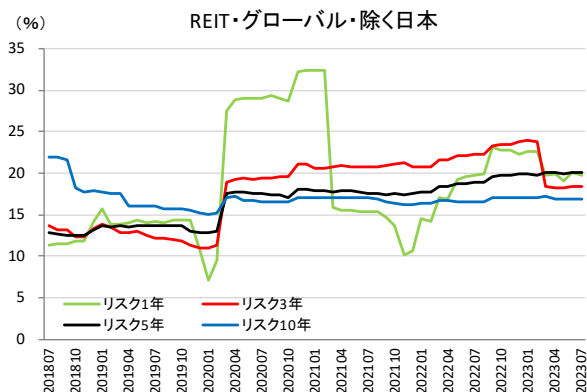


<2> リスク・サマリー

(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]

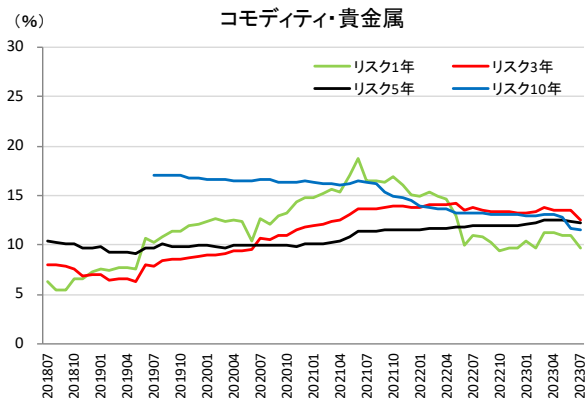
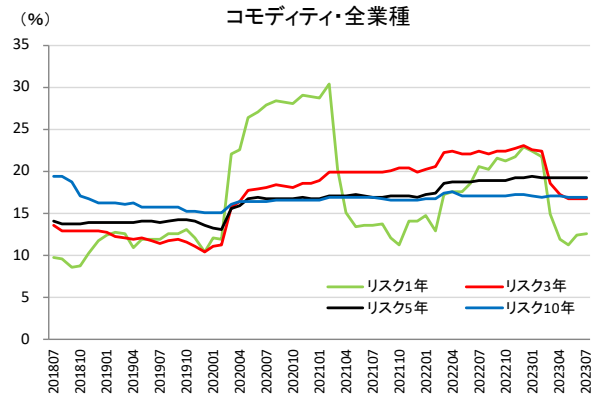
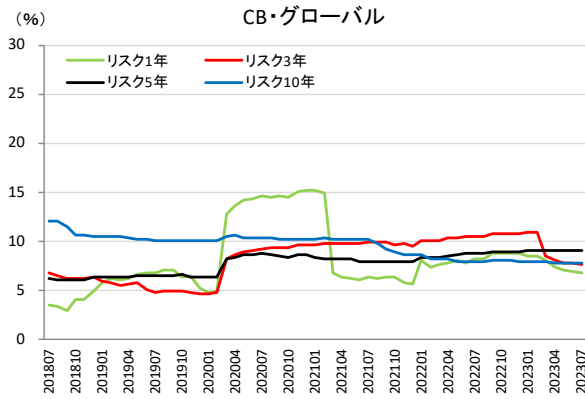
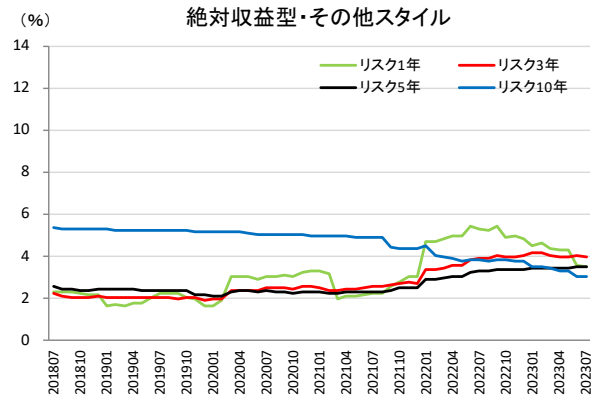
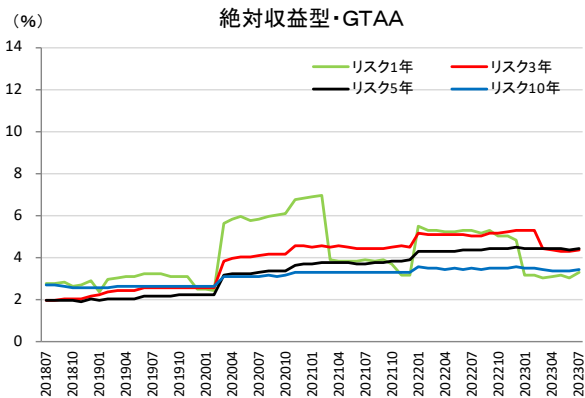
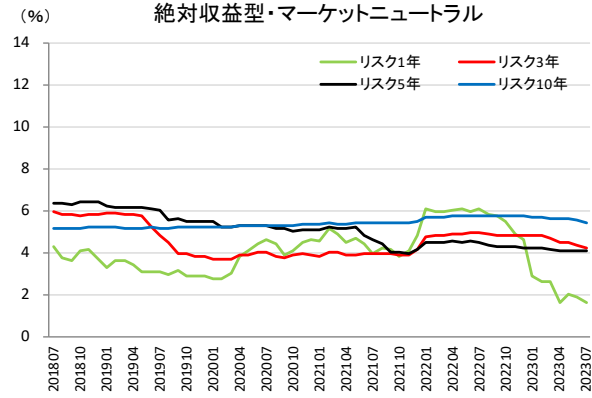
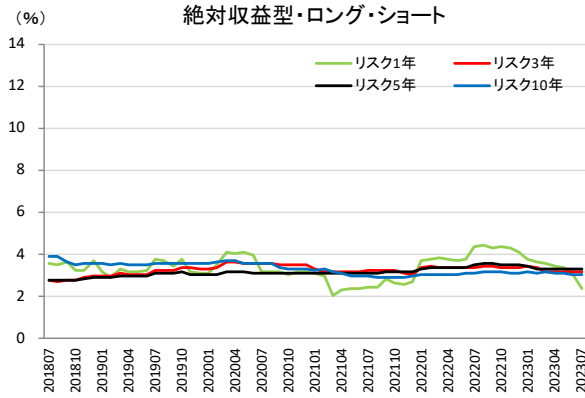


<2>リスク・サマリー

(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	9,514	14,409	25,878	67,239
国内株式	1,693	1,346	1,374	5,660
一般	833	2,283	3,249	5,083
フリー	229	211	607	1,905
バリュー	604	2,072	2,642	3,178
小型	141	261	298	350
その他	709	-1,202	-2,205	188
日経225	503	-1,355	-2,913	-1,222
TOPIX	188	359	757	1,217
JPX日経400	12	-31	-61	-41
国内債券	1,149	1,186	-1,185	-137
一般	1,149	1,186	-1,185	-137
外国株式(先進国)	3,327	4,648	10,534	30,858
グローバル	2,102	3,388	6,830	16,055
除く日本	471	1,550	3,334	8,146
含む日本	1,632	1,837	3,496	7,909
その他	1,225	1,260	3,705	14,803
北米	66	159	280	925
米国	1,222	1,300	3,766	14,463
カナダ	-2	-9	-12	-23
欧州	-22	-66	-126	-206
ドイツ	1	-1	-1	-2
イギリス	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-1	-2	-2	-3
オーストラリア	-39	-119	-198	-353
ニュージーランド	0	0	-1	-2
複合地域	-1	-2	0	4
エマージング株式	1,210	2,353	3,535	4,359
グローバル	90	169	383	615
BRICS	-4	-11	-17	-36
その他	1,124	2,195	3,169	3,780
欧州	1	2	2	1
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-49	-203	-240	-403
中国	-42	-96	-122	-319
インド	1,228	2,525	3,470	4,322
インドネシア	9	10	21	30
タイ	0	0	0	-4
フィリピン	0	1	1	0
ベトナム	-8	5	98	276
韓国	0	0	-4	-4
香港	0	0	0	2
中南米	-2	-5	-5	-10
ブラジル	-9	-35	-37	-80
メキシコ	0	0	1	-3
中東・アフリカ	-1	-4	-6	-11
トルコ	-2	-4	-9	-14
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	9,514	14,409	25,878	67,239
外国債券(先進国)	554	2,186	4,676	7,750
グローバル	461	1,954	3,684	6,476
除く日本	226	492	1,082	1,036
含む日本	235	1,462	2,601	5,440
その他	94	232	992	1,274
北米	2	8	22	23
米国	178	497	1,290	2,092
カナダ	-13	-46	-62	-133
欧州	-7	-13	100	90
イギリス	0	-1	-1	-2
アジア・オセアニア	-4	-16	-19	-81
オーストラリア	-57	-178	-296	-635
ニュージーランド	2	5	3	0
複合地域	-7	-25	-44	-79
エマージング債券	192	138	166	-172
グローバル	161	128	159	120
米ドル建て	141	107	86	24
現地通貨建て	20	21	72	97
その他	31	10	7	-293
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-2	-5	-8	-22
中国	1	-1	22	4
インド	66	148	180	128
インドネシア	9	14	14	5
ブラジル	-40	-135	-180	-356
メキシコ	-2	-8	-15	-44
トルコ	1	-2	-3	-5
複合地域	-1	-1	-2	-4
ハイイールド債券	200	470	952	2,019
グローバル	-16	-62	-92	-61
北米	229	600	1,157	2,271
その他	-13	-68	-114	-190
欧州	-14	-54	-108	-195
アジア・オセアニア	0	-14	-5	6
複合地域	0	-1	-1	-2
複合資産	680	1,191	2,643	7,801
安定	-64	-349	-529	6
安定成長	356	707	1,597	4,140
成長	461	1,084	2,097	4,481
国内バランス	-73	-253	-553	-899
安定	-90	-290	-653	-1,238
一般	-2	-12	-18	-27
その他	1	2	31	72

<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	9,514	14,409	25,878	67,239
国内REIT	67	177	649	2,937
日本	67	177	649	2,937
外国REIT	4	205	1,243	2,573
グローバル	14	-154	75	85
除く日本	149	180	601	753
含む日本	-135	-334	-526	-668
北米	12	407	1,198	2,548
その他	-22	-48	-30	-60
欧州	-8	-10	-11	-16
アジア・オセアニア	-7	-19	17	25
オーストラリア	-6	-14	-25	-50
複合地域	0	-1	-2	-2
複数国	-2	-4	-8	-17
その他	437	509	1,291	3,592
絶対収益型	210	115	-12	550
ロング・ショート	-2	-6	-27	-40
マーケットニュートラル	-9	-39	-93	-147
GTAA	-2	-31	-41	-52
その他スタイル	222	215	169	801
CB	-12	6	768	1,725
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-2
日本	0	0	-1	-4
グローバル	-12	7	770	1,731
コモディティ	142	361	565	886
全業種	18	39	104	75
貴金属	129	324	464	830
エネルギー	-5	-4	-7	-23
その他コモディティ	0	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	994,051	100.00	5,393	100.00
国内株式	128,650	12.94	813	15.08
一般	72,167	7.26	511	9.48
フリー	54,076	5.44	419	7.77
バリュー	18,091	1.82	92	1.71
小型	7,604	0.76	91	1.69
その他	48,063	4.84	205	3.80
日経225	23,430	2.36	71	1.32
TOPIX	20,476	2.06	82	1.52
JPX日経400	839	0.08	15	0.28
国内債券	41,501	4.17	145	2.69
一般	41,501	4.17	145	2.69
外国株式(先進国)	430,308	43.29	1,187	22.01
グローバル	291,245	29.30	825	15.30
除く日本	85,195	8.57	194	3.60
含む日本	206,049	20.73	631	11.70
その他	139,063	13.99	362	6.71
北米	1,297	0.13	13	0.24
米国	132,966	13.38	274	5.08
カナダ	141	0.01	2	0.04
欧州	1,650	0.17	43	0.80
ドイツ	18	0.00	1	0.02
イギリス	9	0.00	3	0.06
アジア・オセアニア	38	0.00	1	0.02
オーストラリア	2,891	0.29	23	0.43
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	41	0.00	1	0.02
エマージング株式	34,292	3.45	307	5.69
グローバル	10,731	1.08	92	1.71
BRICS	479	0.05	7	0.13
その他	23,082	2.32	208	3.86
欧州	80	0.01	6	0.11
ロシア	8	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,643	0.47	85	1.58
中国	1,769	0.18	33	0.61
インド	14,037	1.41	32	0.59
インドネシア	186	0.02	5	0.09
タイ	11	0.00	2	0.04
フィリピン	31	0.00	4	0.07
ベトナム	1,537	0.15	13	0.24
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	16	0.00	1	0.02
中南米	67	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	83	0.01	3	0.06
トルコ	53	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	994,051	100.00	5,393	100.00
外国債券(先進国)	87,680	8.82	768	14.24
グローバル	71,088	7.15	526	9.75
除く日本	31,862	3.21	225	4.17
含む日本	39,226	3.95	301	5.58
その他	16,592	1.67	242	4.49
北米	91	0.01	8	0.15
米国	6,982	0.70	133	2.47
カナダ	684	0.07	4	0.07
欧州	1,080	0.11	30	0.56
イギリス	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,531	0.15	9	0.17
オーストラリア	5,068	0.51	36	0.67
ニュージーランド	77	0.01	9	0.17
複合地域	1,068	0.11	8	0.15
エマージング債券	11,627	1.17	254	4.71
グローバル	6,611	0.67	180	3.34
米ドル建て	4,807	0.48	140	2.60
現地通貨建て	1,804	0.18	40	0.74
その他	5,016	0.50	74	1.37
ロシア	4	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	237	0.02	6	0.11
中国	155	0.02	10	0.19
インド	2,374	0.24	16	0.30
インドネシア	321	0.03	7	0.13
ブラジル	1,576	0.16	22	0.41
メキシコ	281	0.03	5	0.09
トルコ	35	0.00	2	0.04
複合地域	34	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	18,874	1.90	248	4.60
グローバル	2,638	0.27	37	0.69
北米	14,382	1.45	149	2.76
その他	1,854	0.19	62	1.15
欧州	1,426	0.14	40	0.74
アジア・オセアニア	391	0.04	21	0.39
複合地域	37	0.00	1	0.02
複合資産	142,047	14.29	1,038	19.25
安定	38,530	3.88	282	5.23
安定成長	63,476	6.39	428	7.94
成長	29,992	3.02	283	5.25
国内バランス	6,856	0.69	29	0.54
安定	6,004	0.60	9	0.17
一般	291	0.03	15	0.28
その他	3,193	0.32	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	994,051	100.00	5,393	100.00
国内REIT	27,764	2.79	134	2.48
日本	27,764	2.79	134	2.48
外国REIT	45,084	4.54	278	5.15
グローバル	17,815	1.79	151	2.80
除く日本	6,487	0.65	65	1.21
含む日本	11,328	1.14	86	1.59
北米	24,281	2.44	75	1.39
その他	2,988	0.30	52	0.96
欧州	107	0.01	10	0.19
アジア・オセアニア	2,088	0.21	26	0.48
オーストラリア	492	0.05	12	0.22
複合地域	56	0.01	3	0.06
複数国	246	0.02	1	0.02
その他	26,222	2.64	221	4.10
絶対収益型	11,774	1.18	95	1.76
ロング・ショート	779	0.08	30	0.56
マーケットニュートラル	420	0.04	14	0.26
GTAA	359	0.04	11	0.20
その他スタイル	10,151	1.02	39	0.72
CB	2,796	0.28	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	2,738	0.28	33	0.61
コモディティ	5,775	0.58	37	0.69
全業種	1,781	0.18	13	0.24
貴金属	3,902	0.39	22	0.41
エネルギー	69	0.01	1	0.02
その他コモディティ	23	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	14,374	10.2	2.13	2.19	1.139
国内株式	20,620	14.0	0.99	0.86	1.035
一般	19,381	13.7	1.38	1.21	1.382
フリー	18,783	13.0	1.14	1.01	1.424
バリュー	22,107	17.2	2.11	1.83	1.255
小型	24,928	14.6	0.95	0.83	1.709
その他	21,857	14.3	0.40	0.33	0.398
日経225	23,064	15.6	0.42	0.35	0.462
TOPIX	22,798	15.1	0.14	0.12	0.246
JPX日経400	20,669	8.9	0.47	0.39	0.488
国内債券	10,430	12.0	0.14	0.15	0.454
一般	10,430	12.0	0.14	0.15	0.454
外国株式(先進国)	17,235	7.7	2.10	2.00	1.223
グローバル	17,743	7.6	1.87	1.81	1.310
除く日本	25,630	10.4	0.49	0.45	0.563
含む日本	15,318	6.7	2.45	2.38	1.619
その他	16,077	7.9	2.57	2.41	1.039
北米	15,696	5.1	1.38	1.39	1.455
米国	16,885	7.1	2.46	2.28	1.011
カナダ	6,190	12.3	6.42	6.89	1.989
欧州	15,072	12.8	2.26	2.05	1.497
ドイツ	16,592	9.3	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,448	7.0	8.86	9.35	1.780
アジア・オセアニア	11,189	17.1	3.26	3.13	1.639
オーストラリア	10,814	8.5	8.31	8.61	1.822
ニュージーランド	17,997	11.0	1.82	1.67	1.672
複合地域	11,959	10.3	9.40	9.20	1.705
エマージング株式	14,499	10.8	2.68	2.55	1.644
グローバル	14,285	8.2	0.29	0.25	1.018
BRICS	15,660	17.2	0.87	0.84	2.065
その他	14,555	11.7	3.84	3.66	1.927
欧州	7,804	17.1	0.79	0.49	1.950
ロシア	961	14.2	0.00	0.00	1.164
アジア・オセアニア	15,492	12.9	2.05	2.03	1.675
中国	14,311	8.7	1.31	1.37	1.931
インド	17,602	11.9	5.19	4.92	2.013
インドネシア	13,323	10.6	2.55	2.34	1.824
タイ	14,204	11.3	1.70	1.50	1.818
フィリピン	11,646	11.0	0.57	0.52	1.714
ベトナム	16,997	6.0	0.78	0.77	1.897
韓国	16,208	4.6	0.00	0.00	1.804
香港	14,700	13.9	1.60	1.56	0.858
中南米	11,791	16.5	0.00	0.00	2.038
ブラジル	6,742	12.2	3.76	3.46	1.952
メキシコ	14,401	10.3	2.06	1.39	1.667
中東・アフリカ	13,824	11.6	0.93	0.91	2.139
トルコ	12,981	22.0	0.51	0.28	2.025
複合地域	22,281	15.2	1.73	1.67	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

< 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	14,374	10.2	2.13	2.19	1.139
外国債券(先進国)	10,044	10.6	1.36	1.44	0.985
グローバル	10,511	10.6	1.08	1.13	0.921
除く日本	11,622	12.8	0.90	0.92	0.690
含む日本	9,681	8.9	1.24	1.31	1.108
その他	9,028	10.6	2.48	2.71	1.258
北米	10,038	7.0	2.01	2.12	1.562
米国	9,816	8.9	2.62	3.02	1.245
カナダ	7,390	12.5	1.51	1.55	1.378
欧州	7,355	13.6	1.51	1.54	1.117
イギリス	7,347	8.2	3.82	3.78	1.301
アジア・オセアニア	9,020	13.3	2.39	2.48	1.431
オーストラリア	8,476	14.6	2.73	2.89	1.244
ニュージーランド	9,023	9.1	1.45	1.52	1.365
複合地域	5,551	13.3	2.23	2.25	1.196
エマージング債券	9,366	11.6	4.03	3.75	1.421
グローバル	9,334	12.1	2.84	2.60	1.269
米ドル建て	9,089	12.6	3.14	2.88	1.398
現地通貨建て	10,191	10.2	2.04	1.86	0.927
その他	9,445	10.4	5.60	5.27	1.622
ロシア	693	10.4	0.00	0.00	1.560
アジア・オセアニア	9,674	12.6	6.60	6.83	1.627
中国	11,610	3.9	1.39	1.40	1.240
インド	9,913	8.9	6.31	6.42	1.705
インドネシア	9,826	10.7	5.49	5.18	1.671
ブラジル	11,009	13.3	4.92	3.88	1.578
メキシコ	8,900	10.4	5.51	4.31	1.379
トルコ	1,511	10.8	6.78	8.26	1.474
複合地域	4,176	16.9	1.72	1.44	1.210
ハイールド債券	9,631	12.2	5.24	5.13	1.667
グローバル	7,870	11.2	3.44	3.21	1.477
北米	11,003	13.0	5.34	5.26	1.689
その他	7,386	10.8	7.04	6.82	1.767
欧州	7,758	10.3	6.26	5.95	1.738
アジア・オセアニア	6,813	11.3	10.02	10.16	1.868
複合地域	4,555	19.3	5.47	5.27	1.800
複合資産	13,482	9.6	1.00	1.03	0.942
安定	11,484	9.5	0.93	0.94	1.073
安定成長	13,160	10.1	1.30	1.34	0.951
成長	16,317	9.1	0.17	0.16	0.777
国内バランス	12,367	10.7	2.10	2.19	0.946
安定	10,671	12.0	1.95	2.06	0.916
一般	13,402	11.3	1.08	1.01	1.270
その他	9,176	3.4	1.25	1.48	0.729

(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	14,374	10.2	2.13	2.19	1.139
国内REIT	14,148	10.2	8.12	9.88	0.917
日本	14,148	10.2	8.12	9.88	0.917
外国REIT	12,227	9.2	7.66	9.03	1.469
グローバル	13,424	8.9	3.07	3.39	1.215
除く日本	14,857	7.1	1.80	2.09	0.874
含む日本	12,341	10.3	3.80	4.13	1.410
北米	11,576	9.9	11.19	13.39	1.622
その他	9,690	9.2	6.32	7.21	1.750
欧州	6,331	9.5	4.85	4.98	1.831
アジア・オセアニア	11,258	8.5	7.54	8.70	1.795
オーストラリア	9,532	8.8	4.30	4.63	1.701
複合地域	7,366	11.5	0.84	0.90	0.778
複数国	11,392	19.3	1.97	2.11	1.650
その他					
絶対収益型	10,390	6.4	0.02	0.02	1.945
ロング・ショート	10,318	5.8	0.30	0.30	1.499
マーケットニュートラル	9,805	5.4	0.00	0.00	1.285
GTAA	10,980	10.5	0.02	0.02	1.531
その他スタイル	10,439	6.3	0.00	0.00	2.024
CB	12,341	8.7	0.82	0.80	1.190
アジア・オセアニア	10,431	13.1	2.34	2.30	1.823
日本	13,876	23.7	0.38	0.36	0.770
グローバル	12,352	8.2	0.78	0.76	1.186
コモディティ	12,345	7.1	0.17	0.18	0.910
全業種	10,632	11.1	0.54	0.60	1.282
貴金属	12,785	4.5	0.00	0.00	0.739
エネルギー	19,360	14.4	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	17,935	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