

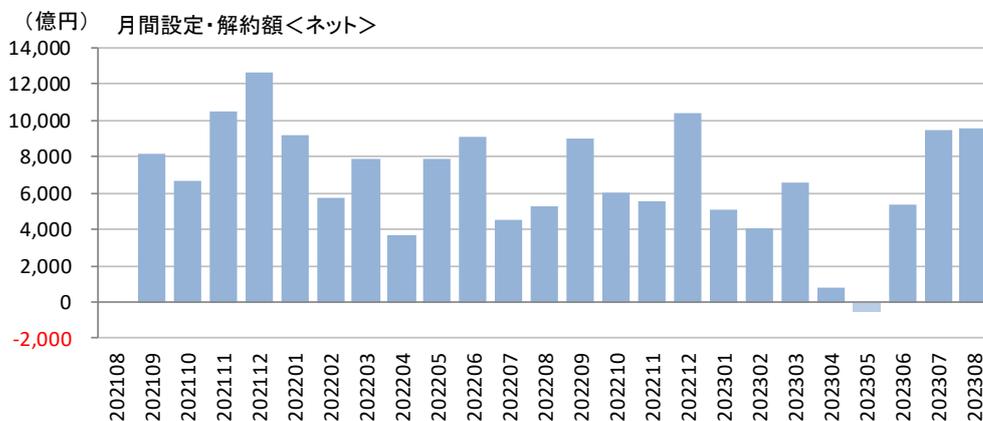
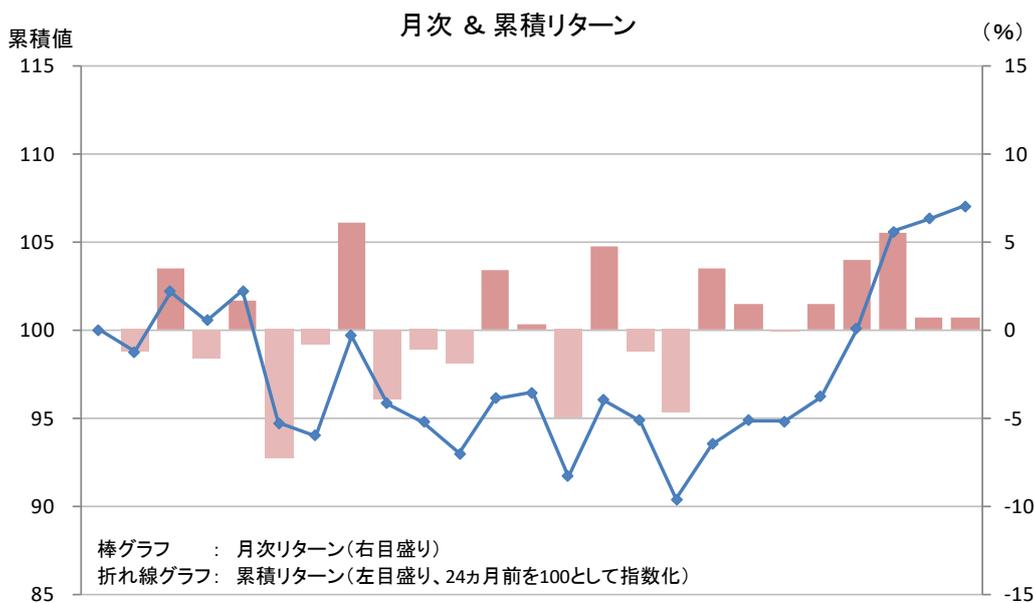
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2023年8月

「総合」 **+0.69 %**
 (前月 **+0.68 %**)



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		17,545	17,425	120	0.69
国内株式		23,517	23,505	12	0.05
一般		22,848	22,743	105	0.46
フリー		21,219	21,165	55	0.26
バリュー		30,500	30,180	320	1.06
小型		43,399	43,513	-113	-0.26
その他		23,684	23,799	-116	-0.49
日経225		22,489	22,866	-377	-1.65
TOPIX		23,471	23,377	95	0.41
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	22,199	22,163	36	0.16
国内債券		12,431	12,535	-104	-0.83
一般		12,431	12,535	-104	-0.83
外国株式(先進国)		24,189	23,999	190	0.79
グローバル		25,968	25,912	56	0.22
除く日本		41,600	40,987	613	1.50
含む日本		22,620	22,691	-70	-0.31
その他		20,312	19,916	396	1.99
北米		25,893	25,294	599	2.37
米国		31,598	30,951	647	2.09
カナダ	10,000 (2009.02.27)	22,089	21,900	189	0.86
欧州		27,050	26,785	265	0.99
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	13,597	13,702	-105	-0.77
イギリス	9,683 (2014.05.30)	11,217	11,193	24	0.22
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	40,734	41,669	-935	-2.24
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	21,038	21,514	-476	-2.21
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	46,638	48,250	-1,611	-3.34
複合地域	10,000 (2013.04.30)	15,942	15,071	871	5.78
エマージング株式		20,976	20,711	265	1.28
グローバル		20,489	20,591	-102	-0.50
BRICS	10,000 (2005.09.30)	25,353	25,718	-365	-1.42
その他		22,091	21,626	465	2.15
欧州		15,640	15,314	326	2.13
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,083	1,081	1	0.13
アジア・オセアニア		19,597	19,842	-245	-1.23
中国		38,937	40,298	-1,361	-3.38
インド	10,000 (2004.09.30)	58,301	56,079	2,222	3.96
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	18,800	18,106	695	3.84
タイ		25,653	24,942	711	2.85
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,850	8,190	-339	-4.14
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	25,323	24,499	824	3.36
韓国	10,000 (1997.06.30)	33,340	36,032	-2,692	-7.47
香港		22,207	23,216	-1,009	-4.35
中南米	7,427 (2006.04.28)	12,581	12,698	-117	-0.92
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	10,371	10,646	-275	-2.58
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	17,986	17,750	235	1.33
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	13,836	14,080	-244	-1.73
トルコ		44,734	38,607	6,126	15.87
複合地域	10,000 (2005.08.31)	25,914	26,000	-86	-0.33

※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		17,545	17,425	120	0.69
外国債券(先進国)		18,819	18,600	219	1.18
グローバル		18,801	18,595	206	1.11
除く日本		20,816	20,438	378	1.85
含む日本		17,499	17,411	87	0.50
その他		19,119	18,840	280	1.49
北米	9,052 (2013.05.31)	10,706	10,575	132	1.25
米国		17,772	17,488	284	1.62
カナダ	10,000 (2003.05.30)	17,229	16,945	284	1.68
欧州	10,000 (1998.07.31)	14,316	14,092	224	1.59
イギリス	10,069 (2014.07.31)	11,159	10,962	197	1.80
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	21,386	21,107	279	1.32
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	26,484	26,108	376	1.44
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,314	11,340	-26	-0.23
複合地域	10,000 (2001.11.30)	19,095	18,920	175	0.92
エマージング債券		20,533	20,130	403	2.00
グローバル		20,416	20,089	327	1.63
米ドル建て		20,601	20,249	352	1.74
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	15,104	14,905	200	1.34
その他	8,647 (2005.03.31)	16,711	16,303	407	2.50
ロシア	10,000 (2008.05.30)	487	490	-3	-0.57
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	15,997	15,782	215	1.36
中国	13,833 (2018.07.31)	18,600	18,361	240	1.31
インド	10,000 (2011.08.31)	21,390	20,624	766	3.71
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	20,022	19,582	440	2.25
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	16,812	16,634	178	1.07
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	20,681	20,248	434	2.14
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,768	2,681	87	3.26
複合地域	10,000 (2006.08.31)	12,441	12,178	263	2.16
ハイイールド債券		28,022	27,178	844	3.11
グローバル	10,000 (1997.06.30)	26,082	25,563	519	2.03
北米		28,474	27,509	965	3.51
その他	10,000 (2004.03.31)	24,684	24,313	370	1.52
欧州	10,000 (2006.04.28)	25,274	24,806	467	1.88
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,684	14,675	9	0.06
複合地域	10,000 (2004.03.31)	24,727	23,969	758	3.16
複合資産		19,986	19,883	103	0.52
安定	10,000 (1998.10.30)	16,274	16,226	48	0.30
安定成長		22,224	22,084	140	0.64
成長		28,323	28,114	210	0.75
国内バランス		12,526	12,489	37	0.30
安定		12,594	12,571	23	0.18
一般		17,428	17,351	77	0.44
その他	10,000 (2018.10.31)	12,198	12,317	-120	-0.97

※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		17,545	17,425	120	0.69
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	35,585	35,092	493	1.40
日本	10,000 (2003.10.31)	35,585	35,092	493	1.40
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	35,211	34,788	423	1.22
グローバル	10,000 (2004.01.30)	29,142	28,781	361	1.25
除く日本	10,000 (2004.04.30)	32,651	32,251	400	1.24
含む日本	10,000 (2004.01.30)	28,891	28,531	360	1.26
北米	10,000 (2003.09.30)	37,359	36,873	486	1.32
その他	10,000 (2004.04.30)	30,879	30,826	52	0.17
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,307	5,259	48	0.91
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	22,769	22,781	-12	-0.05
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	17,204	17,196	8	0.04
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,792	7,669	123	1.60
複数国	10,000 (2004.04.30)	46,971	46,203	768	1.66
その他		6,746	6,808	-62	-0.92
絶対収益型		7,436	7,500	-65	-0.86
ロング・ショート		8,154	8,159	-5	-0.07
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,409	11,326	83	0.74
GTAA		11,333	11,242	91	0.81
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	6,976	7,051	-74	-1.05
CB		20,450	20,371	78	0.39
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	21,944	21,571	373	1.73
日本		20,285	20,344	-59	-0.29
グローバル		35,676	35,543	133	0.37
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	12,586	12,381	205	1.65
全業種	10,000 (2004.12.30)	12,154	11,779	375	3.18
貴金属	10,000 (2009.07.31)	20,647	20,468	180	0.88
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	10,586	10,026	560	5.58
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	16,765	16,237	529	3.26

※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	6.98	12.83	10.98	18.45
国内株式	8.17	17.57	18.54	23.57
一般	8.37	17.08	18.64	23.08
フリー	7.63	16.66	17.86	22.48
バリュー	10.65	18.23	21.06	24.85
小型	6.40	8.23	8.58	12.02
その他	8.16	19.84	20.04	26.19
日経225	5.68	19.97	18.17	26.15
TOPIX	9.56	18.48	21.72	24.84
JPX日経400	9.10	18.64	21.96	25.07
国内債券	-1.63	-0.12	-2.91	0.40
一般	-1.63	-0.12	-2.91	0.40
外国株式(先進国)	9.77	18.37	17.78	27.75
グローバル	9.10	16.53	16.78	26.30
除く日本	10.48	17.69	19.84	26.11
含む日本	8.54	16.05	15.60	26.35
その他	11.17	22.32	19.88	30.83
北米	13.06	21.05	24.44	27.59
米国	11.38	23.00	20.29	31.61
カナダ	5.79	3.02	-1.02	7.41
欧州	5.56	10.75	23.00	20.01
ドイツ	6.69	13.43	39.66	26.42
イギリス	3.11	0.56	6.51	4.50
アジア・オセアニア	3.34	4.23	3.55	9.41
オーストラリア	4.77	4.23	2.45	9.60
ニュージーランド	-0.17	-0.01	1.90	1.85
複合地域	21.33	12.27	10.24	15.19
エマージング株式	9.58	15.41	8.99	18.23
グローバル	8.09	12.33	10.54	17.69
BRICS	11.03	11.15	3.94	12.57
その他	10.23	17.02	8.19	18.50
欧州	17.72	29.98	56.71	37.05
ロシア	1.54	-19.72	-24.97	-18.01
アジア・オセアニア	5.96	8.60	5.81	14.05
中国	1.10	-4.41	-9.51	-1.13
インド	11.96	23.05	11.90	21.33
インドネシア	5.83	11.19	7.67	18.57
タイ	7.81	8.14	10.34	6.83
フィリピン	0.64	1.80	0.21	5.56
ベトナム	17.36	26.76	-0.63	30.54
韓国	7.36	26.50	19.60	30.80
香港	5.33	1.23	-0.49	4.06
中南米	14.72	23.32	24.19	29.80
ブラジル	14.02	22.70	11.83	23.16
メキシコ	13.31	22.09	50.85	40.22
中東・アフリカ	9.11	10.92	-4.48	9.30
トルコ	28.29	17.66	74.16	14.64
複合地域	1.16	3.91	2.84	10.77

※[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カ月(%)	6カ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	6.98	12.83	10.98	18.45
外国債券(先進国)	2.61	4.45	1.05	6.03
グローバル	2.44	4.36	1.20	5.72
除く日本	3.19	6.57	2.47	8.34
含む日本	1.81	2.57	0.17	3.60
その他	3.31	4.81	0.44	7.33
北米	2.04	3.59	-0.07	5.39
米国	2.95	4.56	-1.15	6.21
カナダ	4.42	7.51	2.03	10.21
欧州	3.46	4.97	3.04	5.97
イギリス	7.35	10.33	9.87	14.86
アジア・オセアニア	3.37	4.32	1.03	7.61
オーストラリア	3.61	4.39	1.14	8.08
ニュージーランド	0.88	3.70	-0.56	3.96
複合地域	3.26	7.51	1.22	9.34
エマージング債券	6.97	12.66	12.02	16.64
グローバル	7.19	11.11	11.34	14.63
米ドル建て	7.01	10.13	9.86	13.42
現地通貨建て	7.66	13.74	15.56	17.96
その他	6.71	14.72	12.88	19.33
ロシア	-14.44	-60.40	-56.26	-59.47
アジア・オセアニア	2.44	4.89	4.44	8.41
中国	1.63	2.85	-0.02	4.90
インド	5.17	10.84	6.28	13.95
インドネシア	3.38	11.34	9.72	18.52
ブラジル	11.38	25.60	24.62	31.53
メキシコ	10.50	21.95	33.67	32.19
トルコ	-25.71	-31.31	-19.99	-26.41
複合地域	8.26	15.88	21.27	21.37
ハイイールド債券	6.82	9.80	9.99	14.58
グローバル	6.45	8.82	9.45	12.78
北米	7.12	10.49	10.02	15.29
その他	5.02	6.05	9.97	11.68
欧州	5.49	7.20	11.11	12.78
アジア・オセアニア	3.12	1.64	5.77	7.61
複合地域	6.88	9.99	11.92	14.15
複合資産	3.94	7.44	5.47	10.34
安定	2.07	4.24	1.77	6.01
安定成長	4.35	8.20	6.60	11.44
成長	6.55	11.53	11.36	16.18
国内バランス	0.60	2.26	-1.06	2.40
安定	-0.01	1.38	-2.15	1.35
一般	4.75	9.21	8.55	11.62
その他	2.95	7.95	-3.76	12.54

※[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	6.98	12.83	10.98	18.45
国内REIT	1.91	4.57	-3.19	3.05
日本	1.91	4.57	-3.19	3.05
外国REIT	8.46	5.52	-0.55	12.94
グローバル	8.33	5.08	-0.39	12.54
除く日本	8.44	4.60	-0.27	12.76
含む日本	8.27	5.32	-0.45	12.45
北米	9.12	6.28	-0.27	14.04
その他	4.18	2.18	-3.62	6.87
欧州	10.03	2.34	5.25	9.54
アジア・オセアニア	3.69	2.04	-5.26	6.24
オーストラリア	2.95	0.98	-0.93	6.58
複合地域	8.41	4.03	5.43	9.42
複数国	7.41	5.59	-0.89	11.16
その他	3.13	9.16	5.85	12.12
絶対収益型	0.33	0.24	-2.17	0.33
ロング・ショート	-0.98	-0.25	-1.04	0.71
マーケットニュートラル	0.83	1.91	0.13	1.06
GTAA	-0.45	-0.12	-3.12	0.12
その他スタイル	0.45	0.23	-2.32	0.31
CB	3.17	3.31	2.63	6.71
アジア・オセアニア	4.63	7.90	3.70	12.39
日本	2.15	3.32	2.73	4.06
グローバル	3.16	3.24	2.62	6.67
コモディティ	4.40	9.38	6.64	9.18
全業種	12.15	10.03	-2.18	7.98
貴金属	0.77	9.05	11.90	9.72
エネルギー	22.43	18.54	5.85	18.94
その他コモディティ	13.61	10.27	0.84	9.71

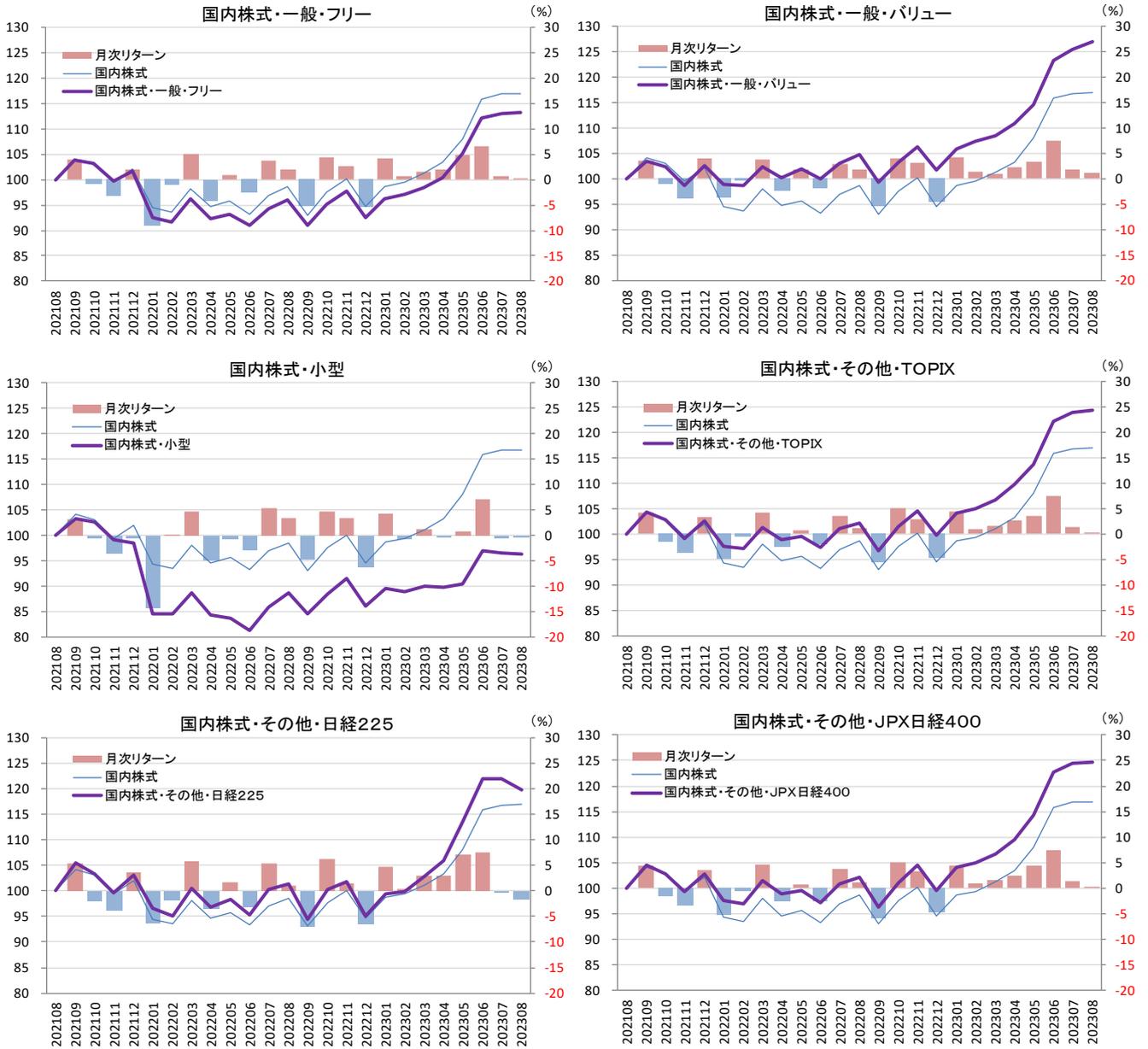
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

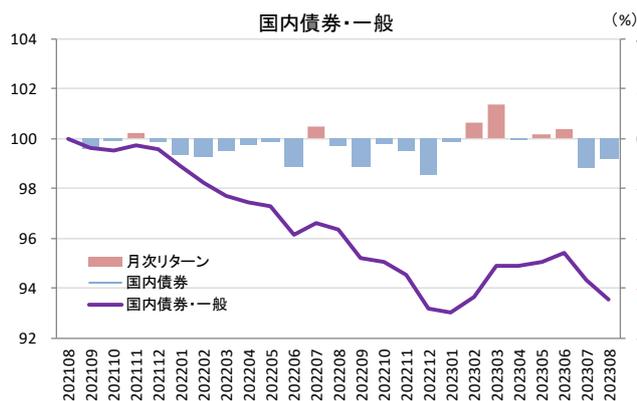
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

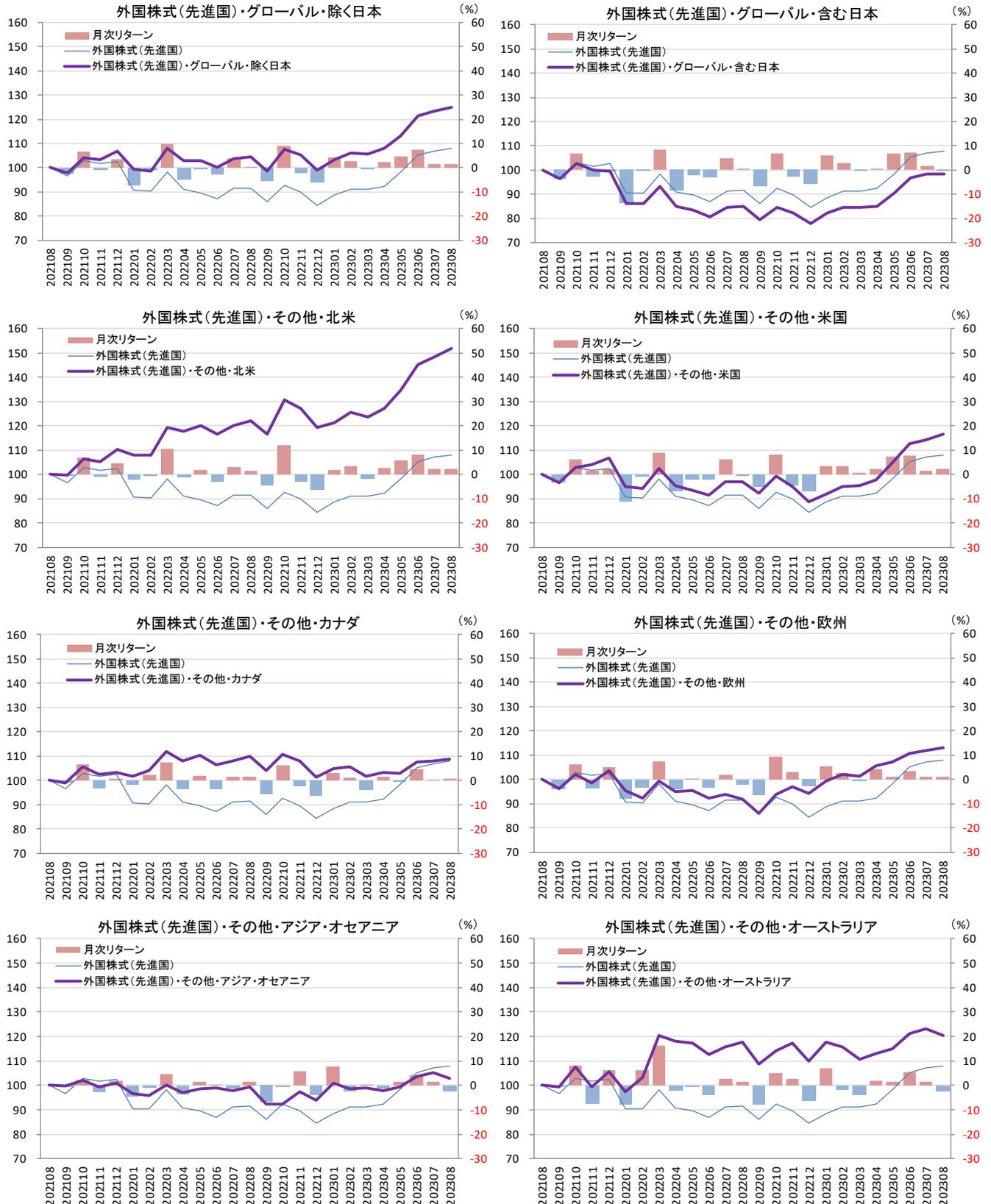


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

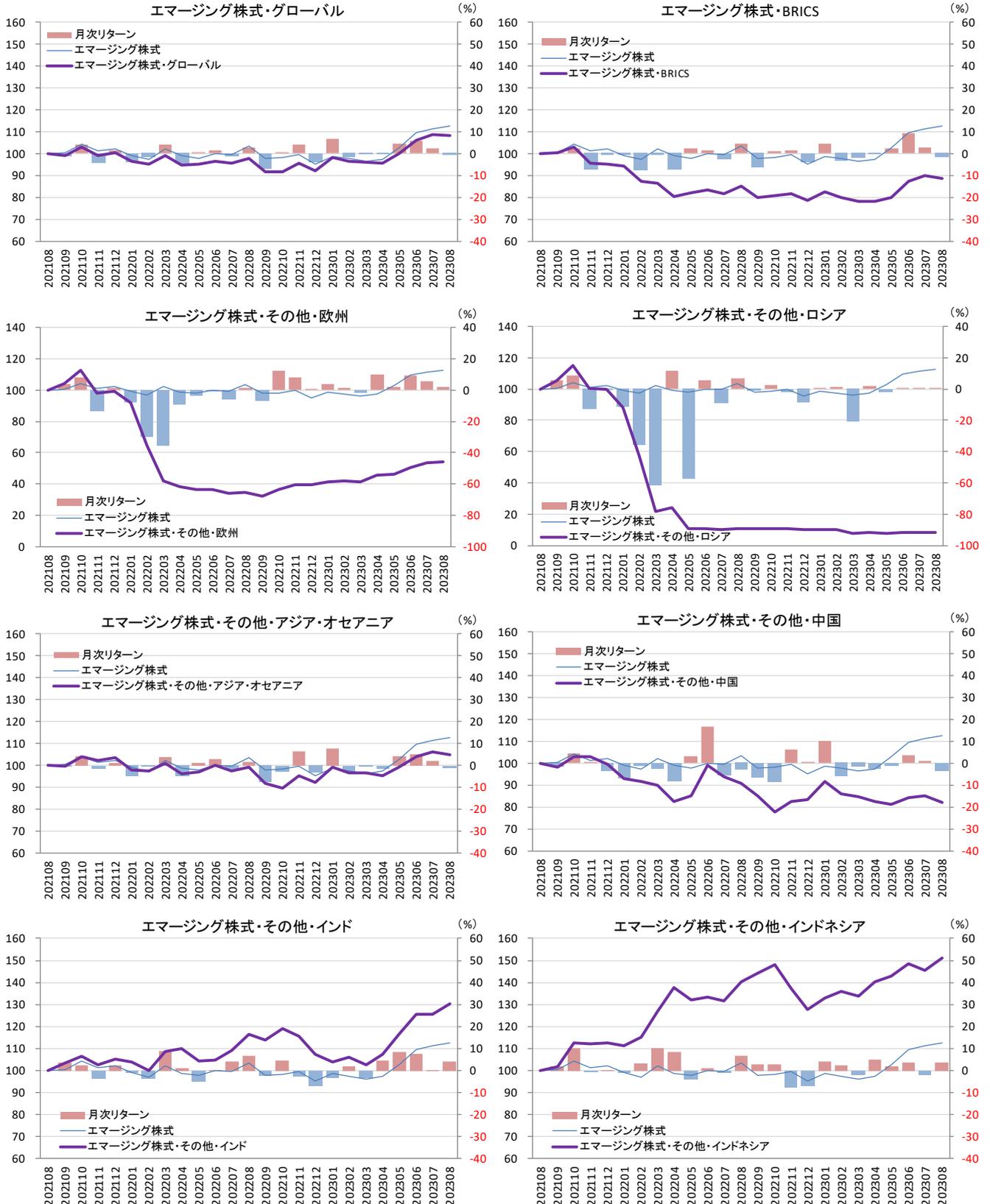


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

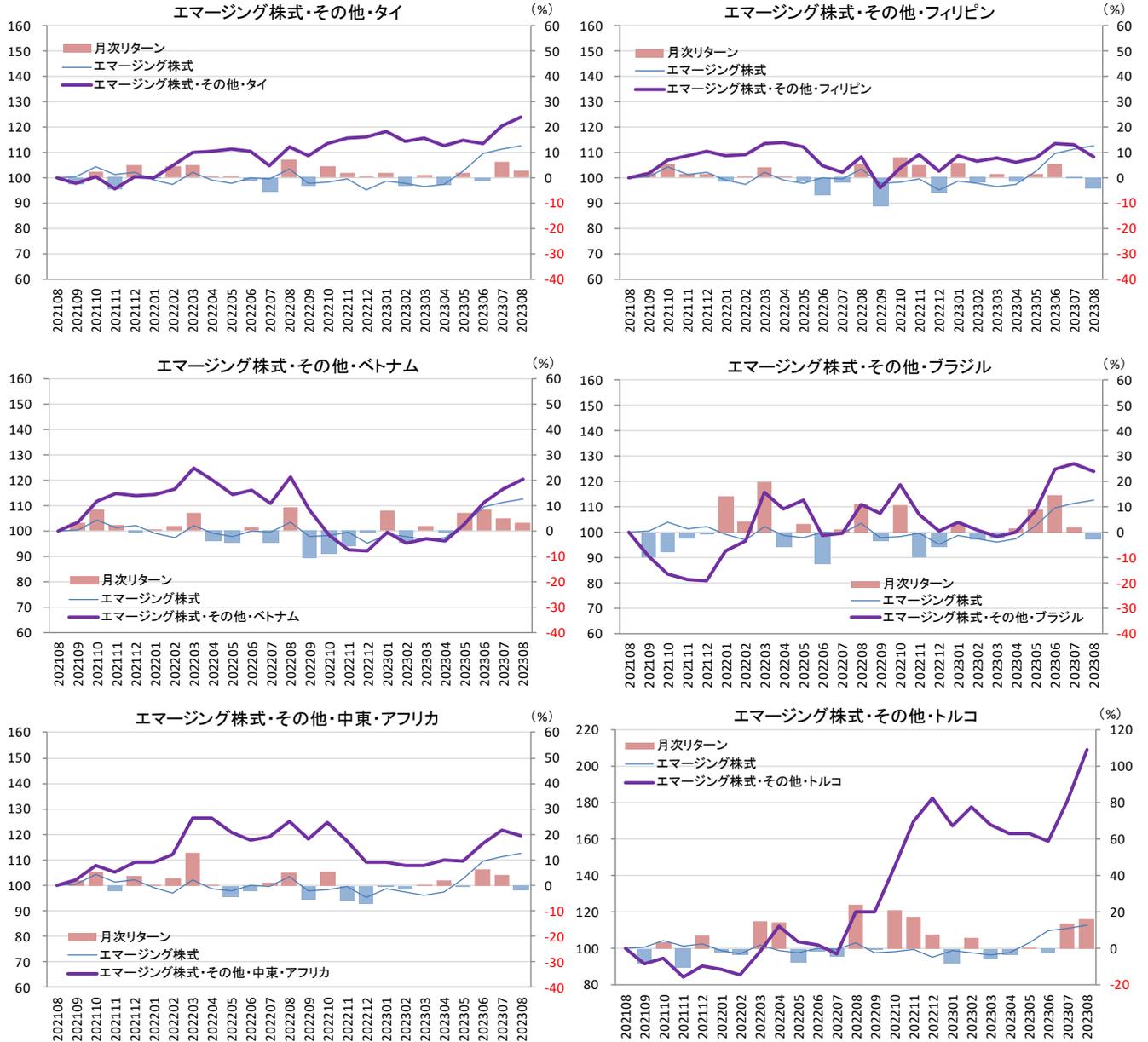


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

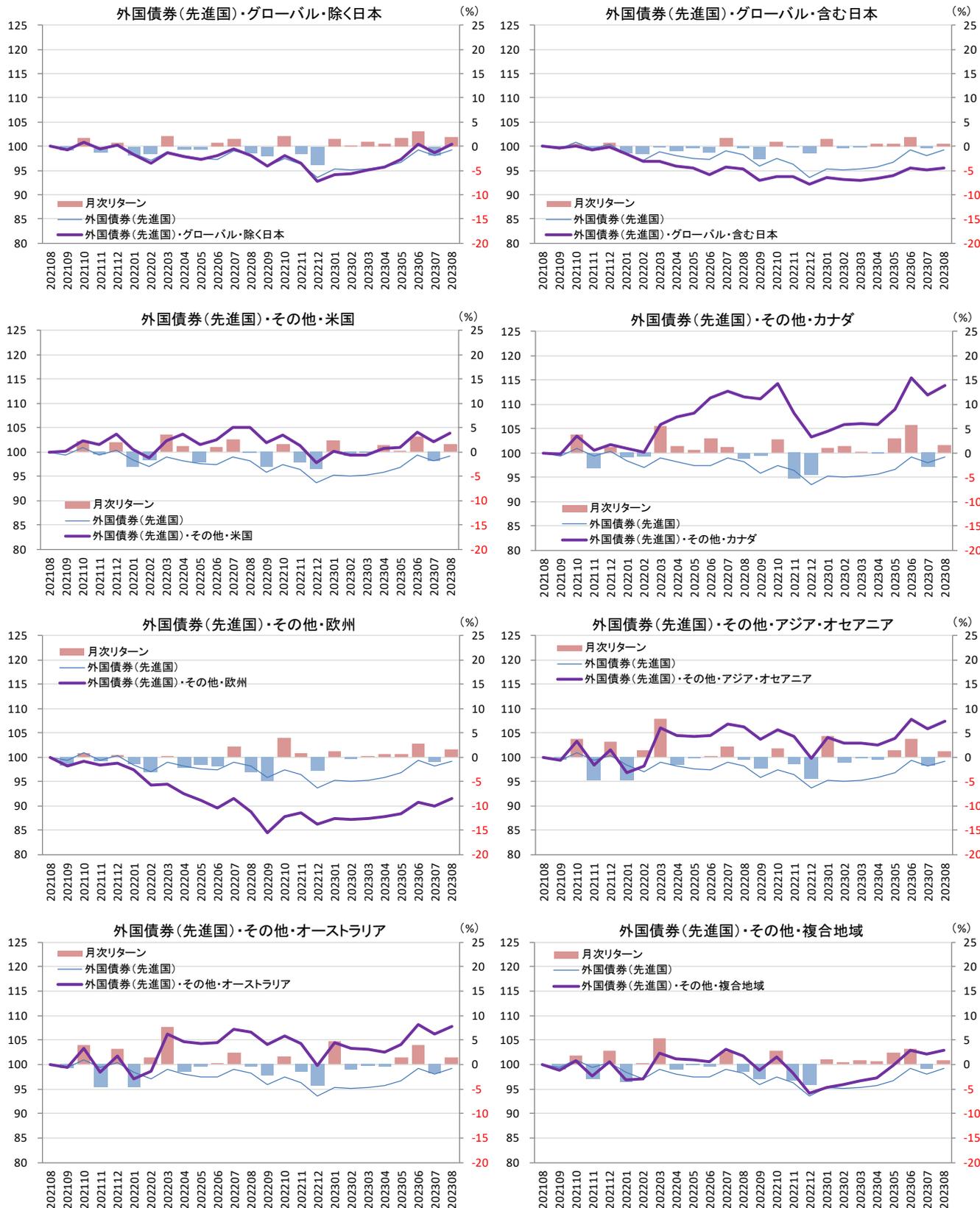


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

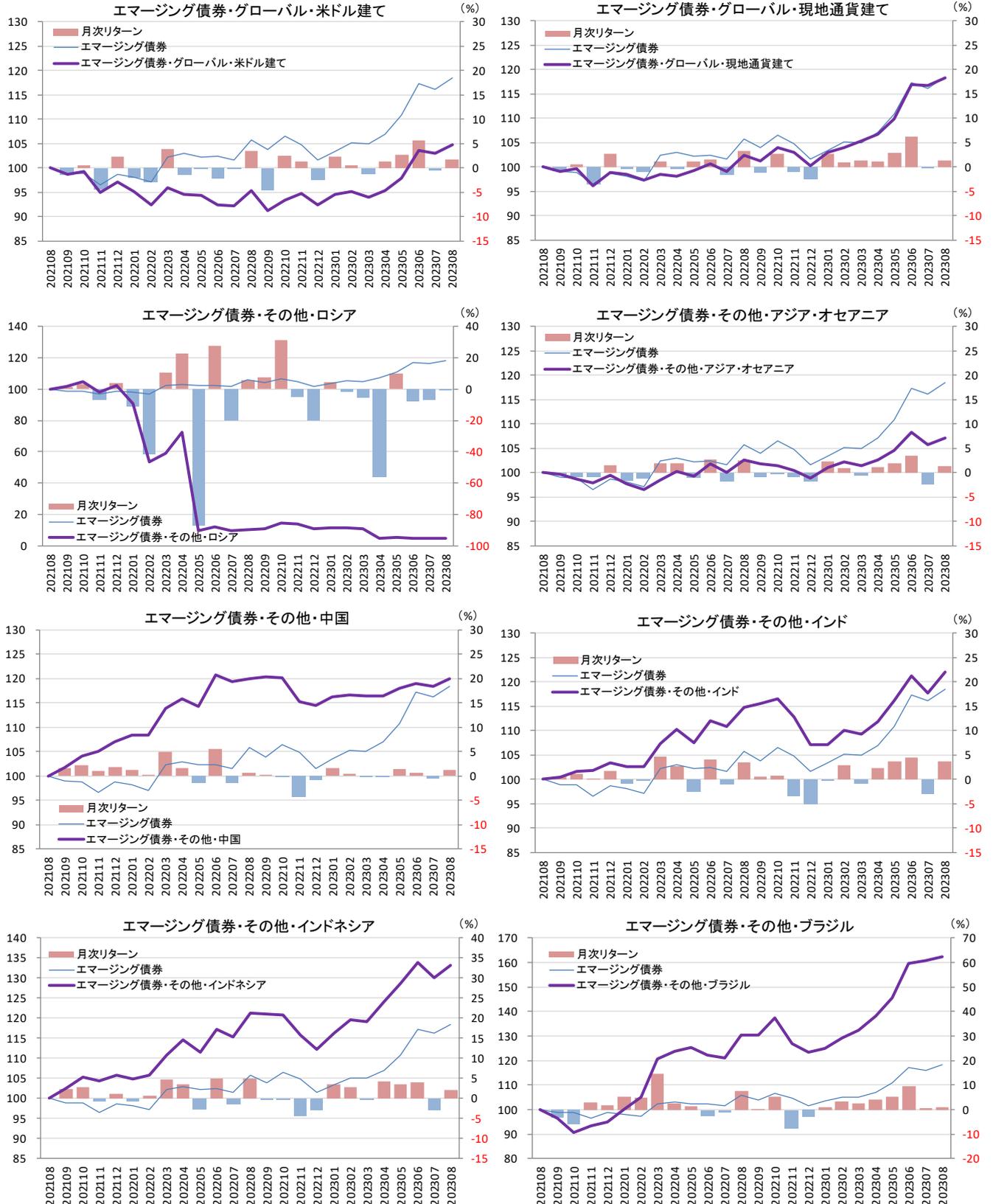


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

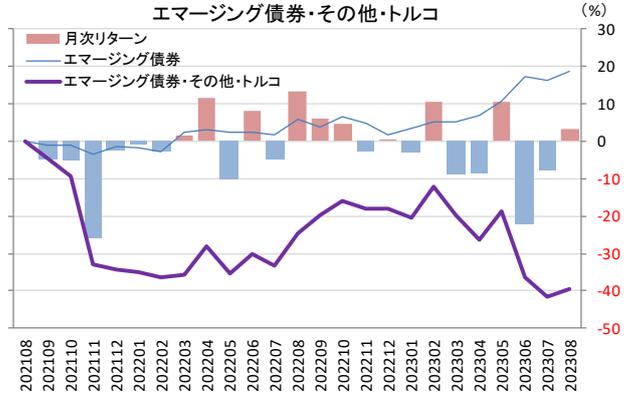
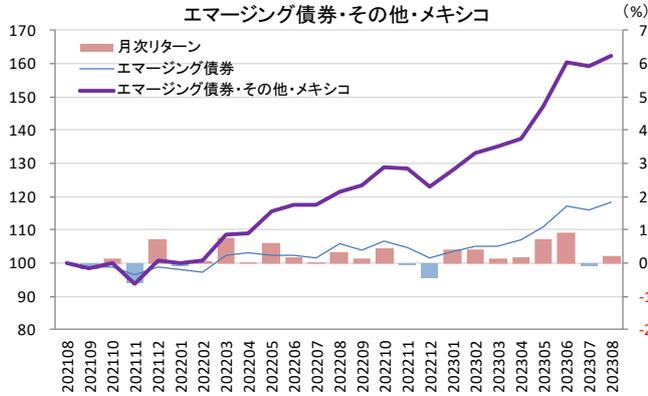


<1>パフォーマンス・サマリー

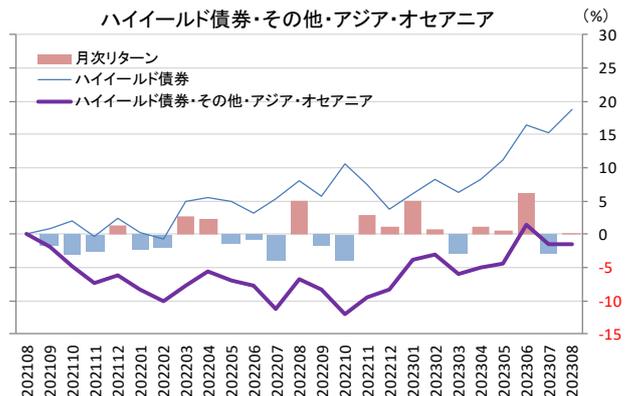
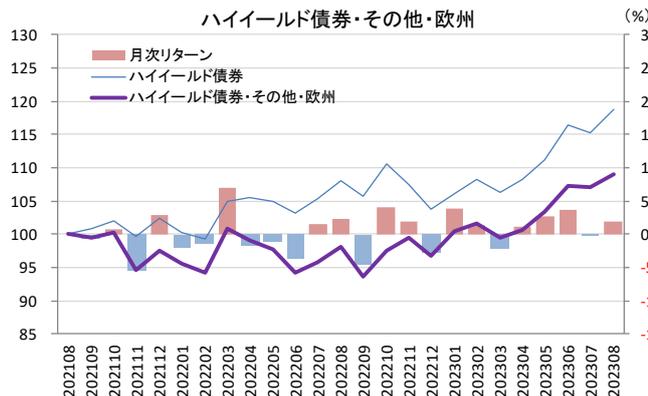
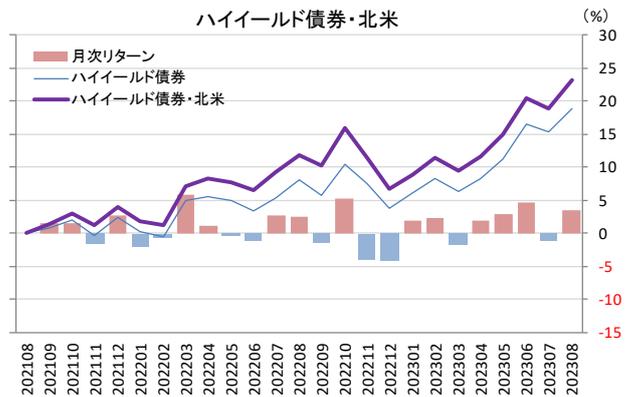
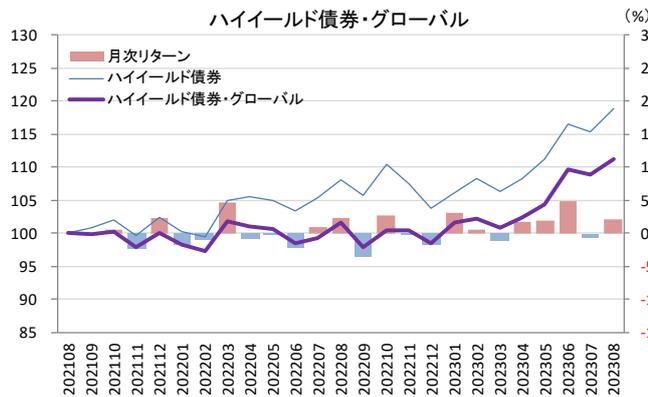
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

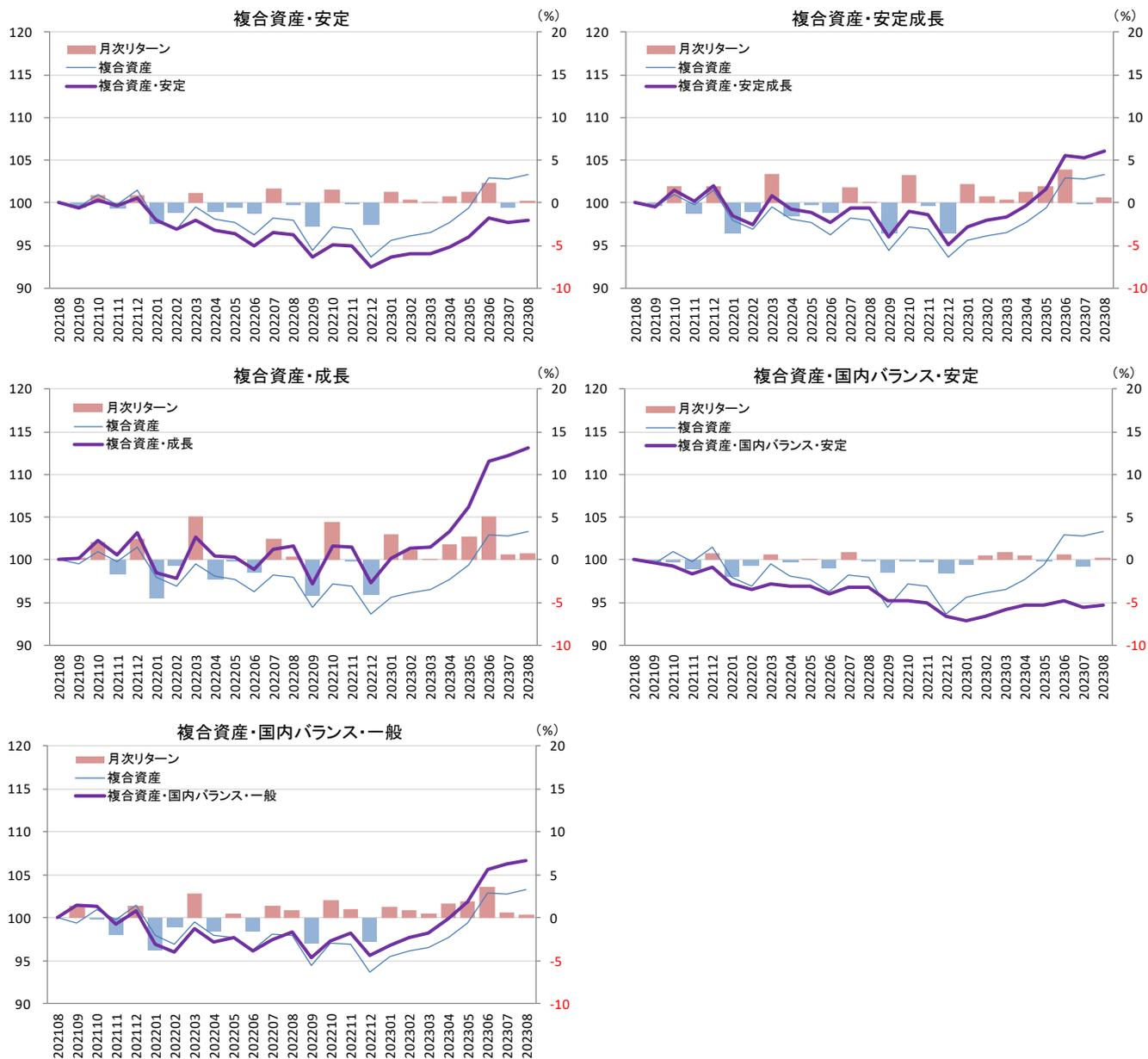


<1>パフォーマンス・サマリー

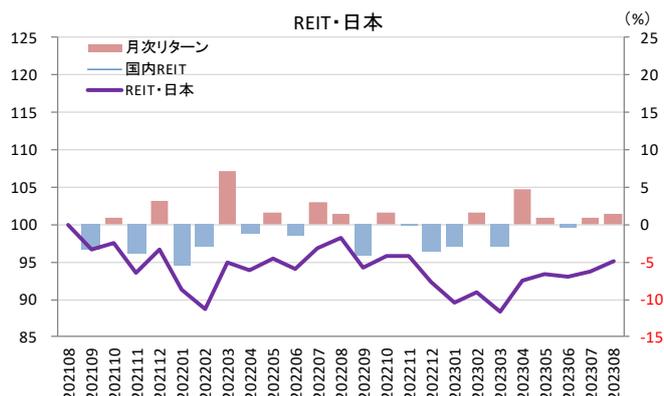
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

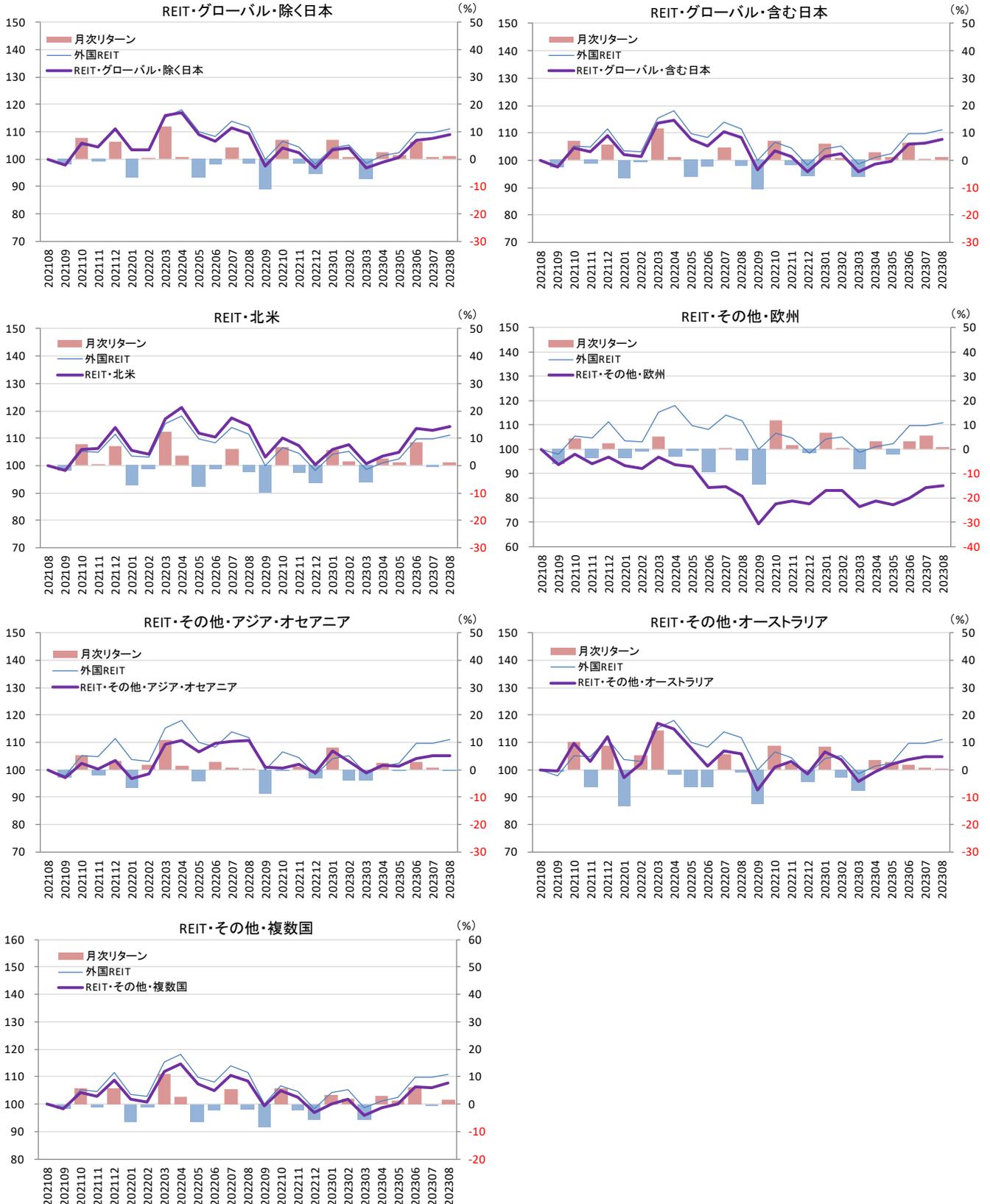


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

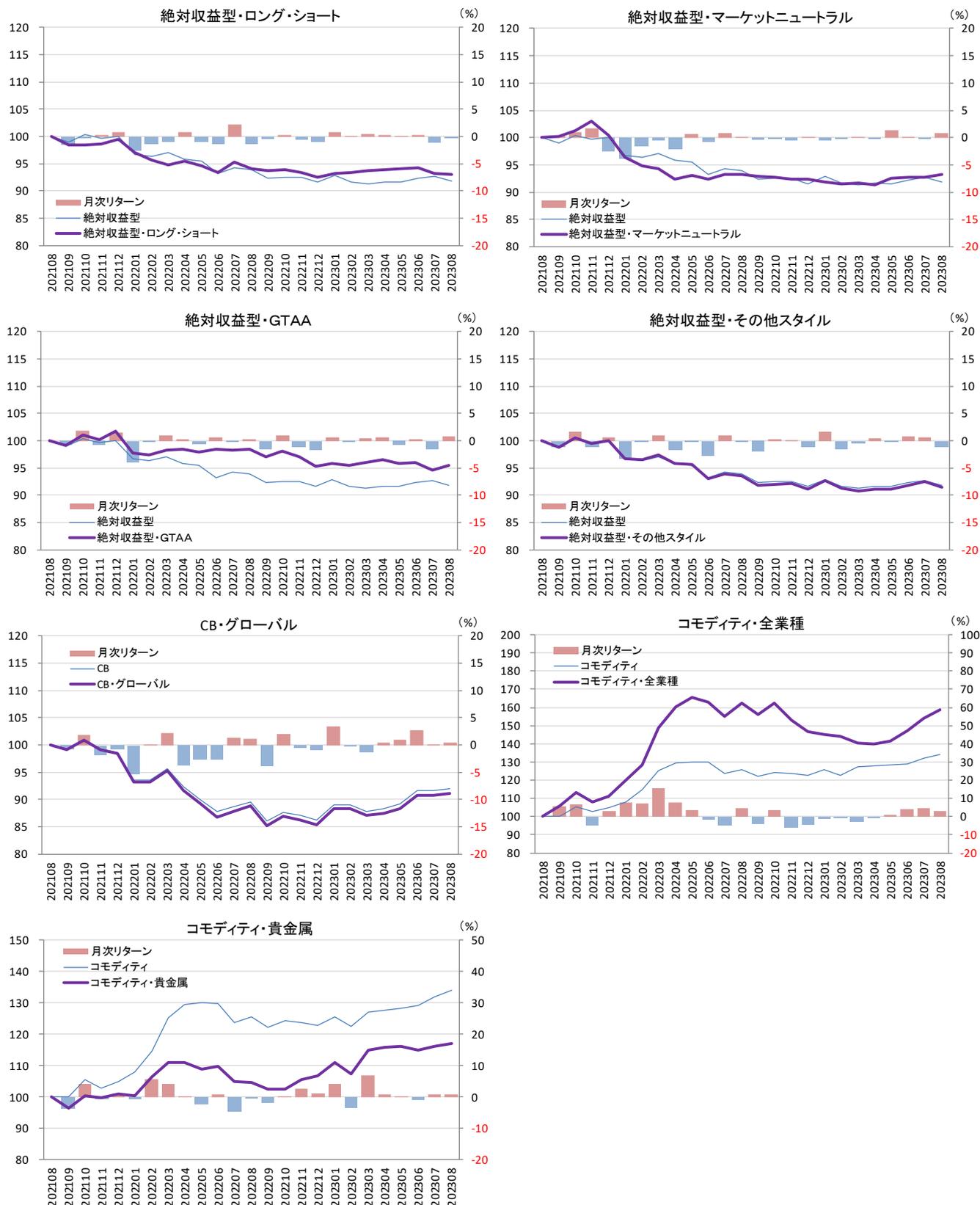


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



<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	0.69				
1	外国株式(先進国)・その他	1.99		14.08		0.28
2	外国債券(先進国)・グローバル	1.11		7.26		0.08
3	外国株式(先進国)・グローバル	0.22		29.04		0.05
4	エマージング株式・その他	2.15		2.39		0.05
5	ハイイールド債券・北米	3.51		1.49		0.05
6	複合資産・安定成長	0.64		6.40		0.04
7	REIT・日本	1.40		2.79		0.04
8	国内株式・一般	0.46		7.22		0.04
9	REIT・北米	1.32		2.43		0.03
10	外国債券(先進国)・その他	1.49		1.69		0.02
11	複合資産・成長	0.75		3.04		0.02
12	REIT・グローバル	1.25		1.79		0.02
13	エマージング債券・その他	2.50		0.51		0.01
14	複合資産・安定	0.30		3.87		0.01
15	エマージング債券・グローバル	1.63		0.67		0.01
16	コモディティ	1.65		0.59		0.01
17	ハイイールド債券・グローバル	2.03		0.27		0.01
18	ハイイールド債券・その他	1.52		0.19		0.00
19	複合資産・国内バランス	0.30		0.69		0.00
20	CB	0.39		0.28		0.00
21	REIT・その他	0.17		0.30		0.00
22	エマージング株式・BRICS	-1.42		0.05		-0.00
23	国内株式・業種特化	-1.26		0.08		-0.00
24	国内株式・小型	-0.26		0.76		-0.00
25	複合資産・その他	-0.97		0.31		-0.00
26	エマージング株式・グローバル	-0.50		1.07		-0.01
27	絶対収益型	-0.86		1.19		-0.01
28	国内株式・その他	-0.49		4.82		-0.02
29	国内債券・一般	-0.83		4.17		-0.04
	合計			100.00		0.69

◆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
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	10.98		
1	外国株式(先進国)・グローバル	16.78	28.24	4.77
2	外国株式(先進国)・その他	19.88	13.25	2.70
3	国内株式・一般	18.64	6.93	1.27
4	国内株式・その他	20.04	4.76	0.97
5	複合資産・安定成長	6.60	6.61	0.44
6	複合資産・成長	11.36	2.90	0.35
7	エマージング株式・その他	8.19	2.12	0.15
8	ハイイールド債券・北米	10.02	1.46	0.14
9	エマージング株式・グローバル	10.54	1.06	0.10
10	エマージング債券・グローバル	11.34	0.69	0.07
11	国内株式・小型	8.58	0.77	0.07
12	エマージング債券・その他	12.88	0.54	0.06
13	外国債券(先進国)・グローバル	1.20	7.51	0.06
14	複合資産・安定	1.77	4.27	0.05
15	コモディティ	6.64	0.57	0.04
16	ハイイールド債券・グローバル	9.45	0.29	0.02
17	ハイイールド債券・その他	9.97	0.21	0.02
18	国内株式・業種特化	18.35	0.08	0.01
19	CB	2.63	0.25	0.01
20	外国債券(先進国)・その他	0.44	1.78	0.00
21	エマージング株式・BRICS	3.94	0.05	0.00
22	複合資産・国内バランス	-1.06	0.82	-0.02
23	複合資産・その他	-3.76	0.34	-0.02
24	REIT・その他	-3.62	0.34	-0.02
25	絶対収益型	-2.17	1.30	-0.04
26	REIT・グローバル	-0.39	1.93	-0.04
27	REIT・北米	-0.27	2.62	-0.04
28	国内債券・一般	-2.91	4.70	-0.16
29	REIT・日本	-3.19	3.11	-0.17
	合計		100.00	10.98

◆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	29.63	37.34	88.54	10.77	12.08	10.57	0.84	0.55	0.62
国内株式	45.58	43.13	151.09	13.11 ↓	16.33	15.49	1.02	0.46	0.62
一般	45.38	41.34	142.35	12.68 ↓	16.06	15.53	1.05	0.45	0.60
フリー	41.44	39.68	139.41	13.14	16.42	15.90	0.93	0.42	0.57
バリュー	59.68	46.10	151.31	11.62 ↓	15.21	14.62	1.46	0.52	0.66
小型	20.20	20.62	175.02	15.24 ↓	19.74	16.89 ↓	0.42	0.20	0.63
その他	50.82	52.03	164.29	13.98 ↓	16.31	15.53	1.05	0.54	0.66
日経225	46.95	53.77	176.74	15.81	17.45	16.31	0.87	0.52	0.66
TOPIX	53.75	49.69	155.33	12.48 ↓	15.35	14.84	1.24	0.55	0.66
JPX日経400	52.89	51.46	-	13.05 ↓	15.57	-	1.17	0.56	-
国内債券	-5.72	-4.57	1.87	2.05	2.11	1.86	-0.93	-0.42	0.11
一般	-5.72	-4.57	1.87	2.05	2.11	1.86	-0.93	-0.42	0.11
外国株式(先進国)	41.82	67.48	156.65	16.29 ↓	18.46	15.88	0.76	0.59	0.62
グローバル	37.16	63.44	162.39	16.49 ↓	18.57	15.82	0.68	0.56	0.64
除く日本	68.23	85.73	220.25	15.14 ↓	18.09	16.34	1.25	0.73	0.76
含む日本	28.47	56.59	146.44	17.33 ↓	19.01	15.91	0.50	0.50	0.59
その他	54.08	76.60	144.37	16.20 ↓	18.46	16.29	0.96	0.65	0.57
北米	116.64	119.67	217.67	15.28	19.44	17.44	1.93	0.88	0.70
米国	53.30	87.56	182.93	16.32 ↓	18.26	16.66	0.94	0.74	0.66
カナダ	39.25	26.49	26.19	13.08 ↓	18.82	15.91	0.89	0.26	0.15
欧州	45.98	46.96	103.45	15.72 ↓	18.09	15.99	0.86	0.44	0.46
ドイツ	49.91	47.14	-	20.30 ↓	22.41	-	0.71	0.36	-
イギリス	53.97	21.84	-	13.93	17.40	-	1.11	0.23	-
アジア・オセアニア	21.22	22.97	90.58	11.14 ↓	15.30	14.73	0.60	0.28	0.45
オーストラリア	54.79	31.86	68.65	19.77	24.04	19.76	0.79	0.24	0.27
ニュージーランド	22.40	48.79	225.11	15.86	18.08	17.47	0.44	0.46	0.72
複合地域	196.94	49.02	60.26	29.13	33.71	26.64	1.50	0.25	0.18
エマージング株式	44.11	44.86	108.29	11.87 ↓	18.01	16.35	1.09	0.43	0.47
グローバル	32.70	49.34	88.14	12.99 ↓	18.03	16.52	0.76	0.47	0.40
BRICS	11.45	22.04	80.03	15.15	20.56	19.26	0.24	0.20	0.32
その他	50.51	44.51	119.01	11.82 ↓	18.47	16.59	1.24	0.42	0.49
欧州	-29.71	-28.46	-27.66	35.43	32.97	27.14	-0.31	-0.20	-0.12
ロシア	-88.87	-87.14	-84.61	57.16	48.56	38.59	-0.91	-0.69	-0.44
アジア・オセアニア	23.22	25.16	74.95	13.89 ↓	17.76	15.93	0.52	0.26	0.36
中国	-14.10	28.90	121.06	19.62 ↓	21.54	21.04	-0.25	0.24	0.39
インド	97.45	71.43	322.79	15.71 ↓	23.65	21.86	1.62	0.48	0.71
インドネシア	71.32	43.64	67.19	19.16 ↓	26.24	23.34	1.03	0.29	0.23
タイ	40.75	4.67	59.98	17.06	20.96	17.92	0.71	0.05	0.27
フィリピン	28.38	-3.97	19.64	16.47	20.31	18.17 ↓	0.53	-0.04	0.10
ベトナム	103.41	54.35	173.11	21.74 ↓	26.13	21.19	1.23	0.35	0.50
韓国	23.83	31.66	58.61	24.29	26.14	20.76	0.31	0.22	0.23
香港	5.06	-4.81	40.15	22.13	21.97	19.78	0.08	-0.04	0.17
中南米	93.15	72.94	65.45	26.23	29.77	26.41	0.94	0.39	0.20
ブラジル	49.92	45.97	14.14	29.26	33.48	31.90	0.50	0.24	0.04
メキシコ	163.60	71.43	76.64	22.24	27.85	23.58	1.72	0.41	0.25
中東・アフリカ	65.93	46.31	82.82	14.48	18.63	16.69	1.27	0.43	0.37
トルコ	164.38	167.11	38.33	33.62	34.58	31.93	1.14	0.63	0.10
複合地域	26.78	22.74	51.54	15.06 ↓	18.22	15.70	0.55	0.23	0.27

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

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

<2> リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別②

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	29.63	37.34	88.54	10.77	12.08	10.57	0.84	0.55	0.62
外国債券(先進国)	3.20	9.29	19.66	4.54	4.74	5.33 ↓	0.24	0.39	0.34
グローバル	1.13	7.92	19.91	4.02	4.05	4.75 ↓	0.10	0.39	0.39
除く日本	3.39	11.83	23.34	5.20 ↑	4.56 ↑	5.39	0.22	0.50	0.40
含む日本	-0.69	4.35	17.06	3.43	4.29	4.46 ↓	-0.06	0.21	0.36
その他	10.88	15.09	22.98	7.30	7.70	7.54	0.48	0.38	0.28
北米	-0.33	5.10	25.19	4.35	5.01	4.65	-0.02	0.21	0.49
米国	15.18	17.84	37.25	6.44	7.31	6.61	0.75	0.46	0.49
カナダ	21.31	24.11	18.38	8.55	7.98 ↑	8.64	0.78	0.56	0.20
欧州	-7.42	-6.03	5.57	6.06	5.43	6.65	-0.41	-0.22	0.08
イギリス	14.48	16.44	-	10.22	9.62	-	0.45	0.33	-
アジア・オセアニア	10.87	16.02	24.09	9.37 ↓	9.81	9.18 ↓	0.38	0.31	0.24
オーストラリア	11.71	16.28	23.19	9.38 ↓	9.88	9.26	0.40	0.31	0.23
ニュージーランド	-0.88	7.54	-	9.04 ↓	9.20	-	-0.03	0.16	-
複合地域	5.69	19.93	29.77	7.36	6.12	6.99 ↓	0.26	0.61	0.38
エマージング債券	28.45	33.83	45.36	7.70	10.51	10.81	1.14	0.57	0.35
グローバル	17.19	23.44	32.97	8.17	11.87	11.32	0.67	0.37	0.26
米ドル建て	14.37	20.73	32.62	8.73	12.46	11.72	0.53	0.31	0.25
現地通貨建て	25.63	31.28	23.47	7.31	10.40	10.35	1.09	0.54	0.21
その他	43.39	47.85	60.72	8.90	10.38	11.41	1.44	0.79	0.43
ロシア	-95.13	-94.67	-95.59	73.47	58.69	44.95 ↑	-0.86	-0.76	-0.60
アジア・オセアニア	10.81	19.84	47.64	5.33	6.79	6.92 ↓	0.66	0.55	0.58
中国	38.28	35.61	-	5.99 ↓	6.24	-	1.91	1.01	-
インド	34.66	46.38	124.56	8.31	9.48	10.10 ↓	1.26	0.84	0.84
インドネシア	52.66	67.22	84.32	8.65	14.42	14.74	1.75	0.75	0.43
ブラジル	69.68	54.36	61.72	17.13	18.76	18.49	1.13	0.49	0.27
メキシコ	82.09	87.88	76.57	12.12	16.41	15.33	1.83	0.82	0.38
トルコ	-43.40	-18.64	-72.68	31.08	31.74 ↓	28.02	-0.55	-0.13	-0.43
複合地域	22.41	21.36	21.50	10.01	11.97	11.84	0.70	0.33	0.17
ハイイールド債券	36.16	35.51	69.67	8.08	11.55	10.50	1.34	0.55	0.52
グローバル	25.10	24.80	53.61	7.38	11.24	10.46	1.05	0.41	0.42
北米	42.62	40.79	82.65	8.44	11.66	10.50	1.49	0.61	0.59
その他	18.99	21.43	40.75	9.14	12.51	11.47	0.66	0.32	0.30
欧州	22.12	24.38	42.48	10.15	13.30	12.23	0.68	0.34	0.30
アジア・オセアニア	7.40	10.41	38.22	9.07	11.77	10.32	0.27	0.17	0.32
複合地域	25.09	30.98	62.58	7.50	8.97	8.86	1.04	0.62	0.56
複合資産	15.34	18.76	55.04	6.35	7.31	7.19	0.77	0.48	0.63
安定	4.33	7.30	32.69	4.37	5.04	5.35 ↓	0.33	0.29	0.54
安定成長	19.50	24.10	63.23	6.77	7.83	7.58	0.91	0.57	0.66
成長	35.14	40.25	106.48	9.12	11.07	10.45	1.16	0.64	0.72
国内バランス	0.43	-1.88	10.77	2.98	3.91	5.04	0.06	-0.09	0.21
安定	-1.32	-3.47	12.15	2.85	3.73	3.06	-0.14	-0.18	0.38
一般	21.86	22.23	49.56	6.64 ↓	8.34	8.84	1.03	0.50	0.47

※[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	29.63	37.34	88.54	10.77	12.08	10.57	0.84	0.55	0.62
国内REIT	20.21	28.20	100.50	11.26 ↓	14.89	13.21 ↓	0.56	0.34	0.55
日本	20.21	28.20	100.50	11.26 ↓	14.89	13.21 ↓	0.56	0.34	0.55
外国REIT	50.73	42.22	126.08	17.51	18.82	16.13	0.84	0.39	0.53
グローバル	46.76	31.50	100.24	17.67	19.48	16.36	0.77	0.29	0.44
除く日本	50.47	38.45	124.23	18.37	20.12	16.74	0.80	0.34	0.50
含む日本	45.45	29.42	95.88	17.40	19.26	16.23	0.77	0.28	0.43
北米	58.16	54.10	152.46	18.20	18.71	16.45	0.91	0.49	0.59
その他	27.18	24.49	105.04	15.05 ↓	19.18	15.75	0.56	0.24	0.47
欧州	6.87	-10.93	39.78	19.79	21.14	18.25	0.11	-0.11	0.19
アジア・オセアニア	23.37	26.16	111.08	13.78 ↓	17.73	15.00	0.53	0.27	0.52
オーストラリア	38.58	21.06	79.05	23.35 ↓	29.13	22.71	0.49	0.14	0.26
複合地域	50.91	8.58	47.26	18.69	24.90	20.15	0.79	0.07	0.20
複数国	47.21	49.22	168.22	16.17	17.36	14.86	0.85	0.48	0.70
その他									
絶対収益型	-4.47	-5.08	-1.35	3.61	3.25	2.74	-0.41	-0.31	-0.04
ロング・ショート	-6.94	-7.73	-9.36	3.16	3.32	3.05	-0.74	-0.47	-0.32
マーケットニュートラル	-7.84	-8.38	25.13	4.27	4.11	5.46	-0.62	-0.41	0.42
GTAA	3.20	8.84	9.96	4.34	4.46	3.44	0.25	0.39	0.28
その他スタイル	-3.97	-4.97	-0.16	4.02	3.51	3.03 ↓	-0.33	-0.28	-0.00
CB	4.69	10.44	28.74	7.29 ↓	8.89	7.64	0.22	0.23	0.34
アジア・オセアニア	36.50	51.11	116.80	9.64 ↓	12.32	11.30	1.14	0.70	0.71
日本	2.80	-2.89	24.21	4.38	5.17	5.25 ↓	0.22	-0.11	0.42
グローバル	3.90	9.95	27.17	7.53 ↓	9.12	7.74	0.17	0.21	0.32
コモディティ	43.38	65.58	12.56	10.88 ↓	11.15	12.02	1.18	0.95	0.10
全業種	119.38	74.85	19.80	16.54 ↓	19.23	16.91	1.81	0.62	0.11
貴金属	7.52	64.00	34.97	12.46	12.19	11.37 ↓	0.20	0.86	0.27
エネルギー	208.45	88.08	22.21	28.41 ↓	37.13	31.48	1.61	0.36	0.06
その他コモディティ	90.52	57.41	32.82	16.00 ↓	19.12	16.99	1.50	0.50	0.17

※[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

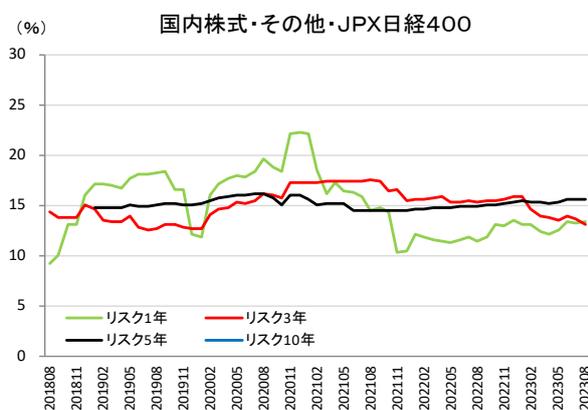
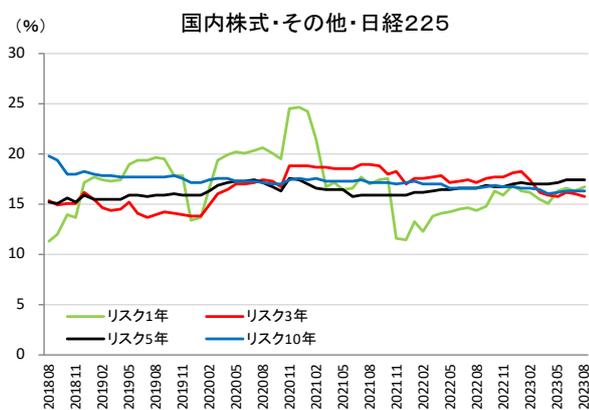
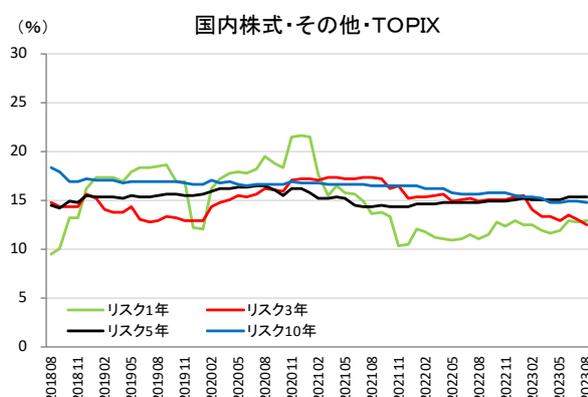
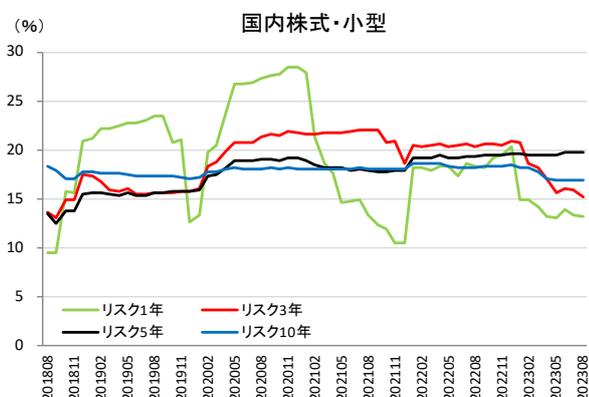
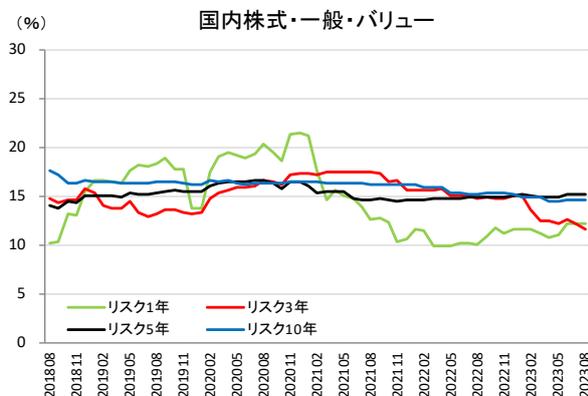
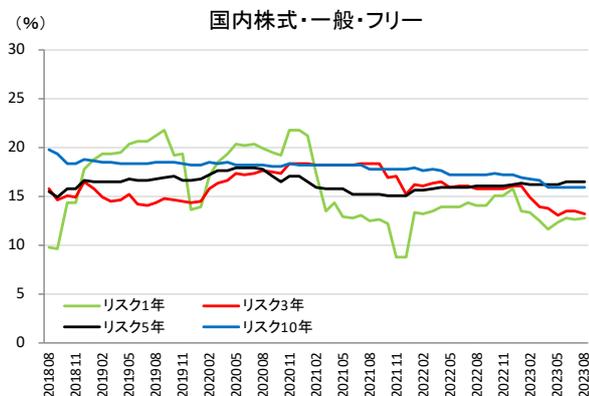
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

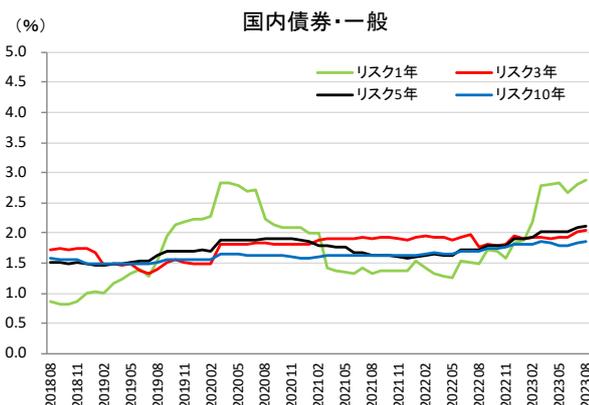
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

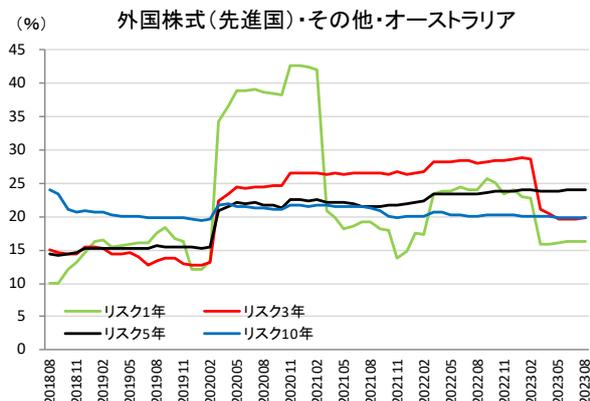
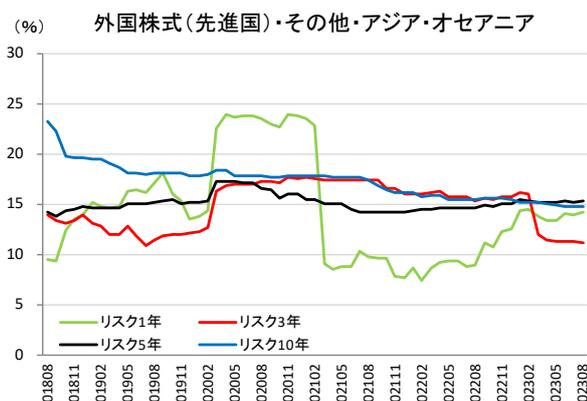
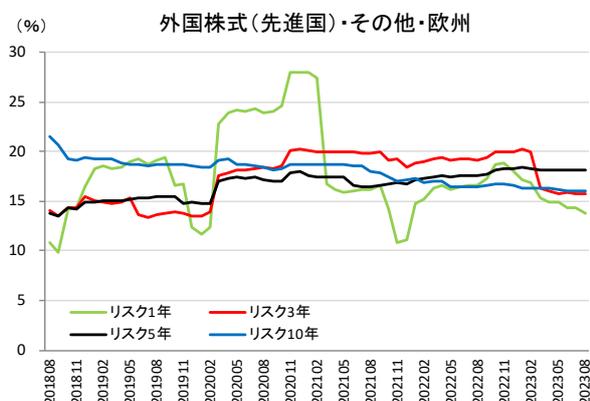
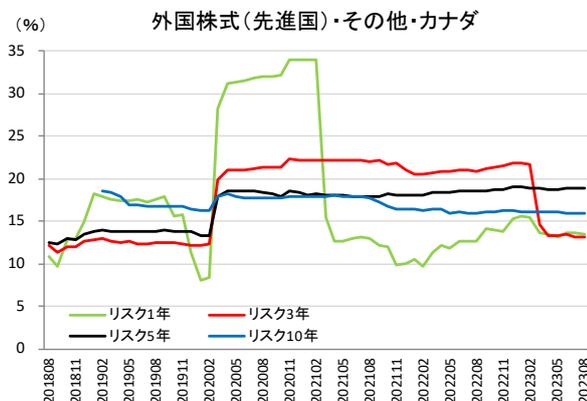
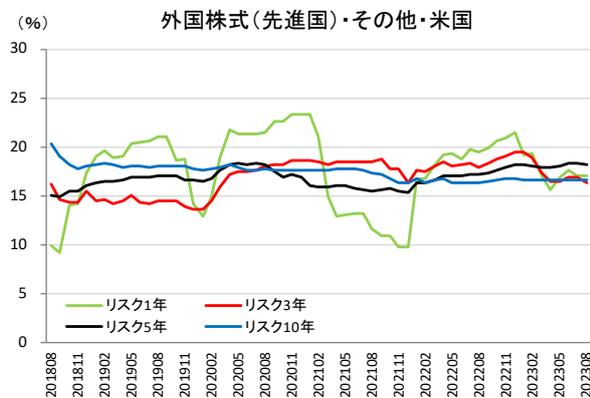
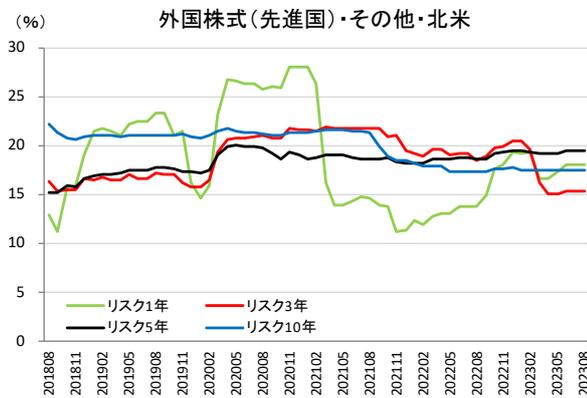
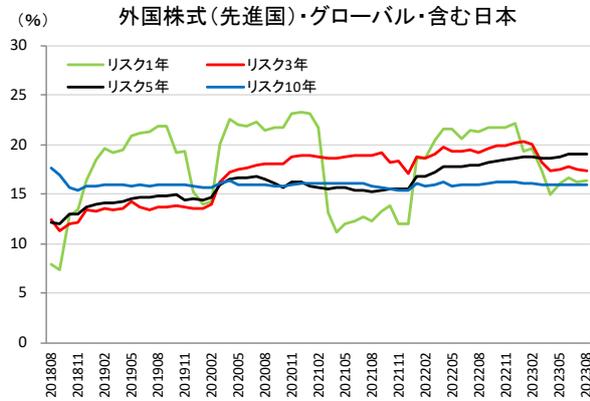
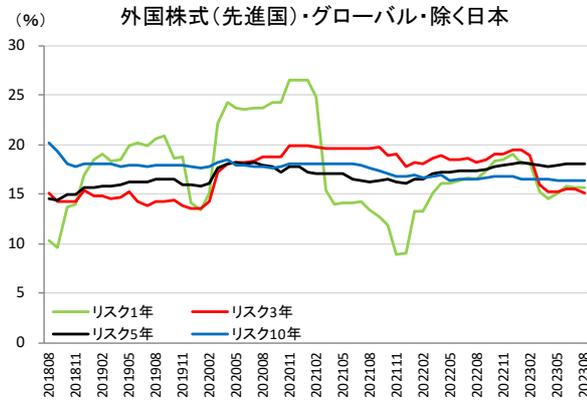


<2> リスク・サマリー

(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)]

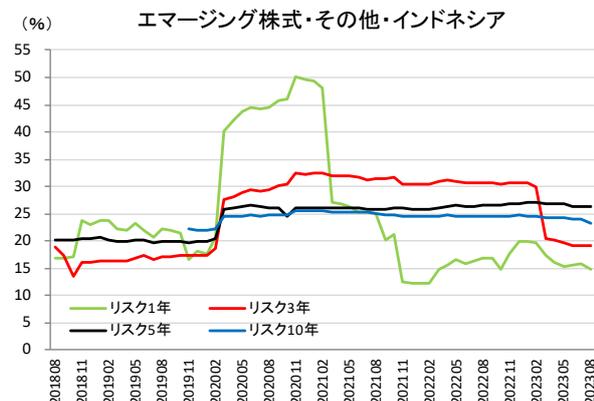
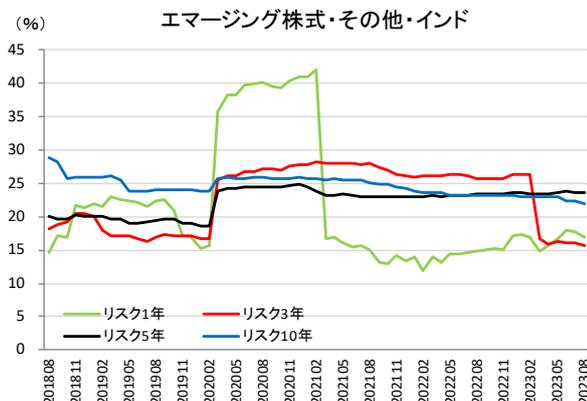
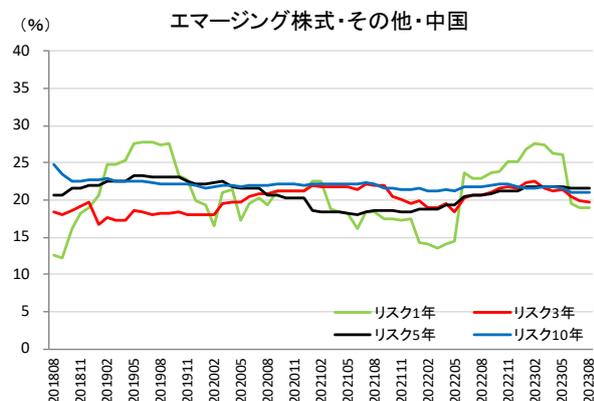
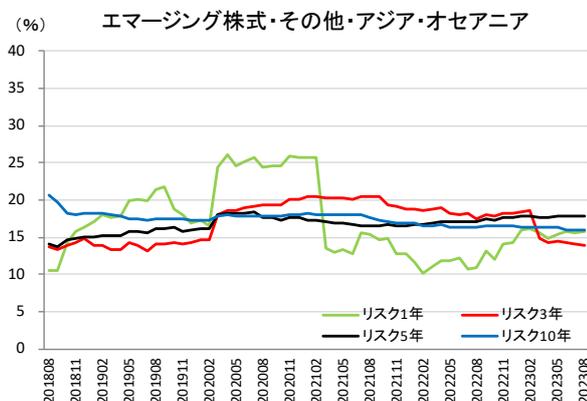
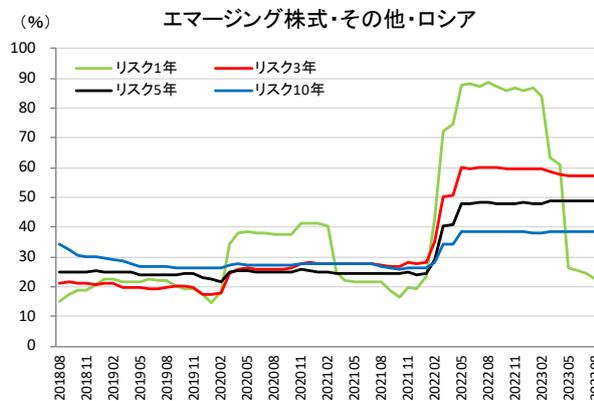
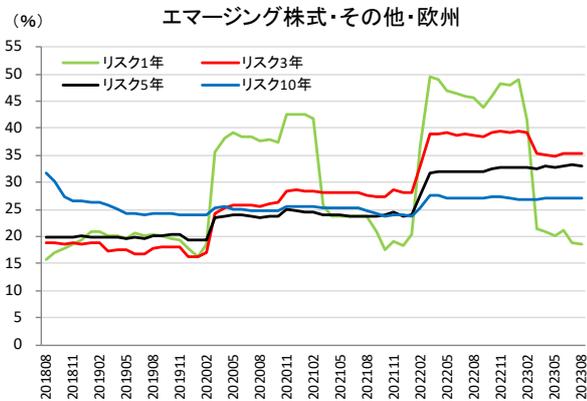
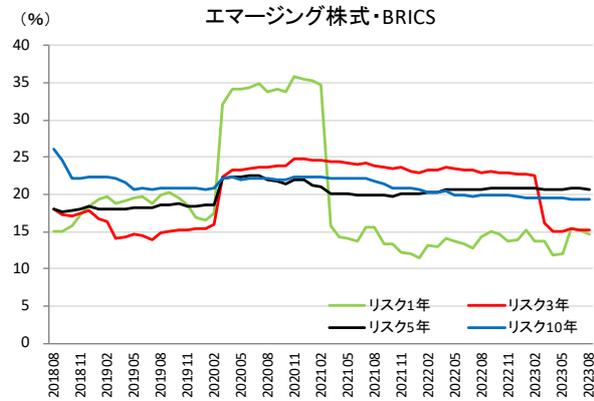
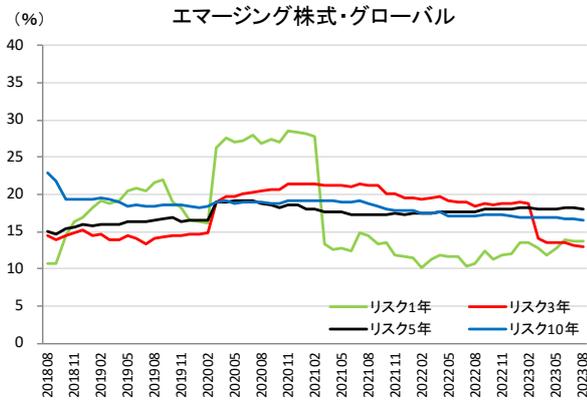


<2> リスク・サマリー

(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]

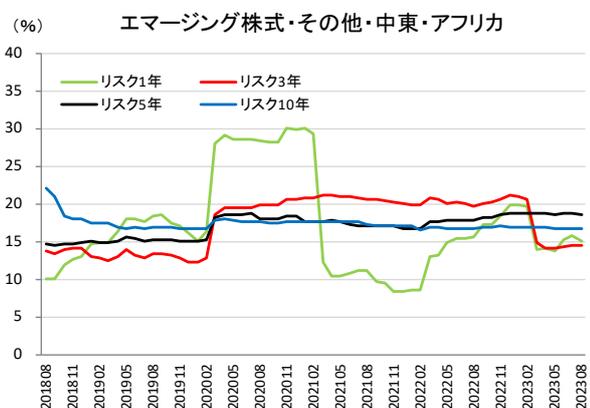
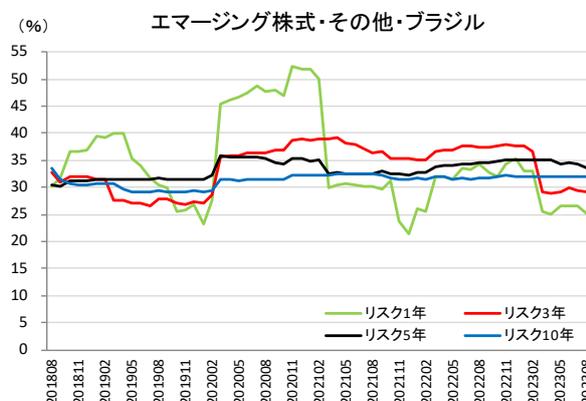
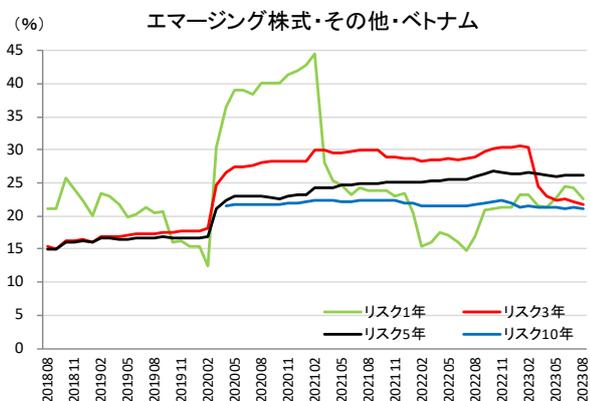
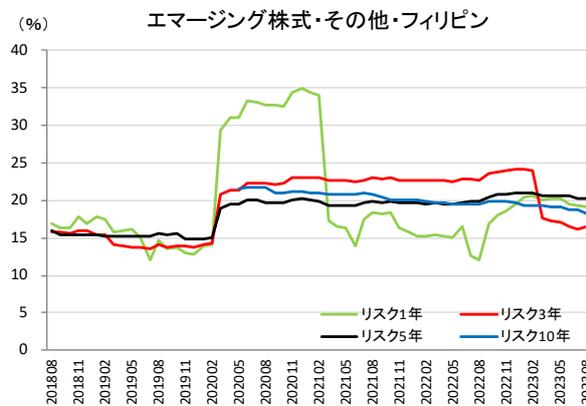
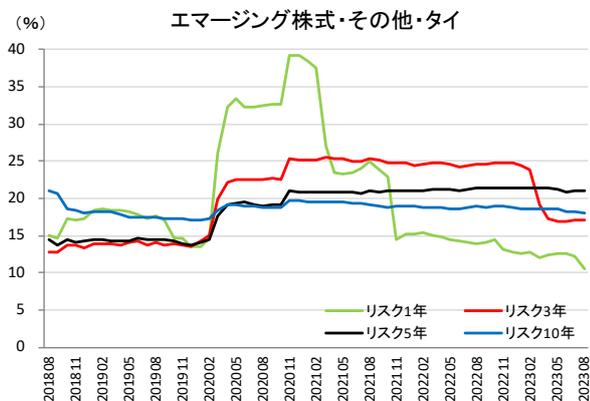


<2> リスク・サマリー

(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]

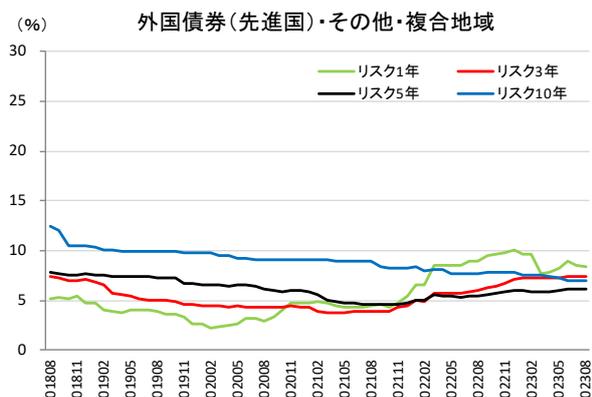
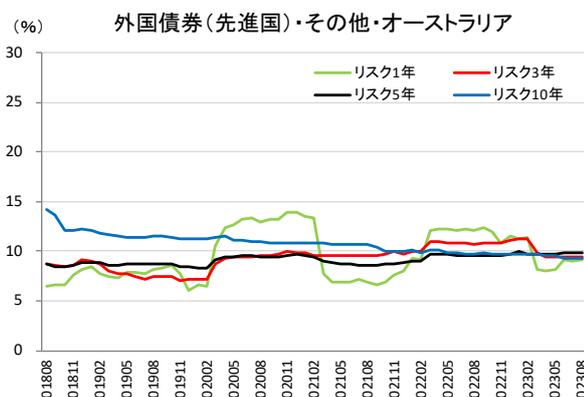
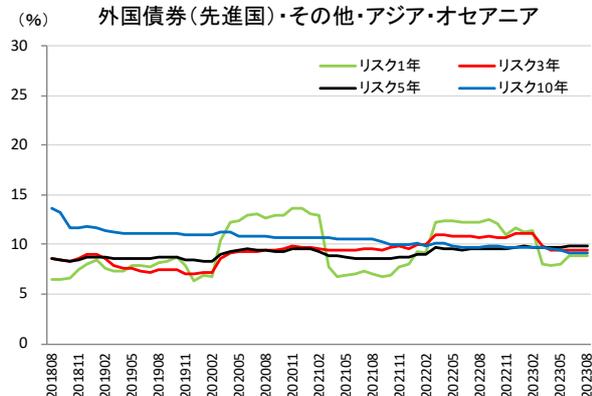
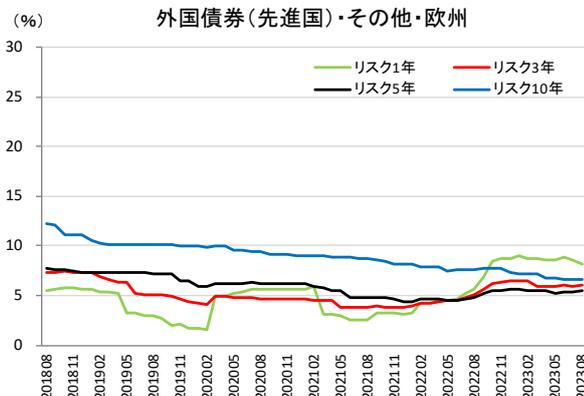
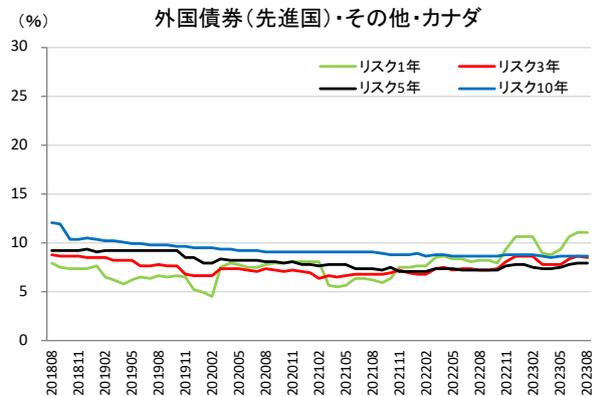
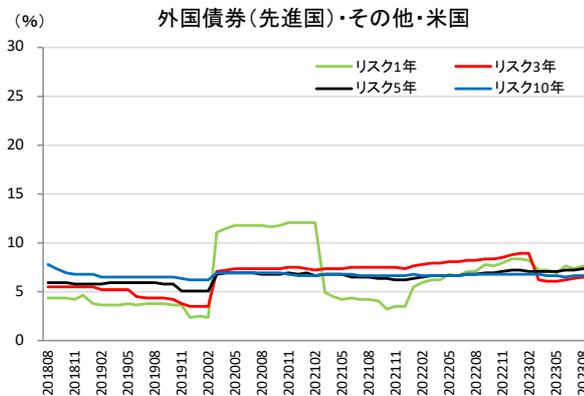
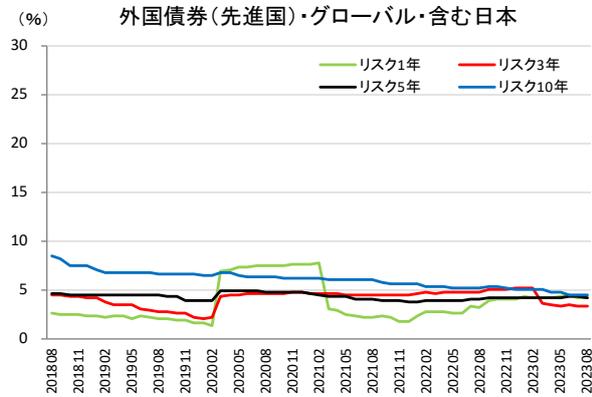
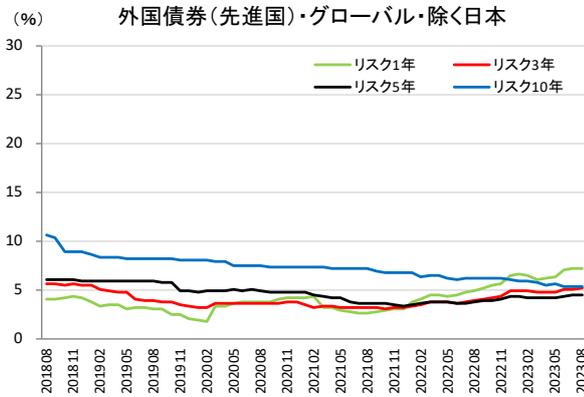


<2> リスク・サマリー

(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)]

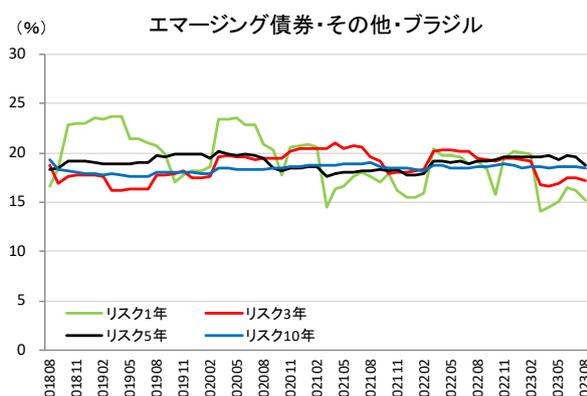
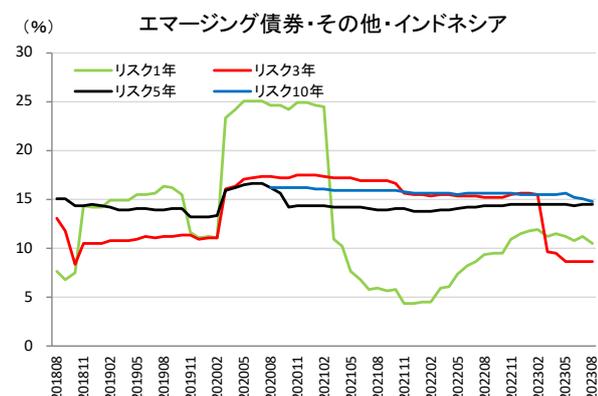
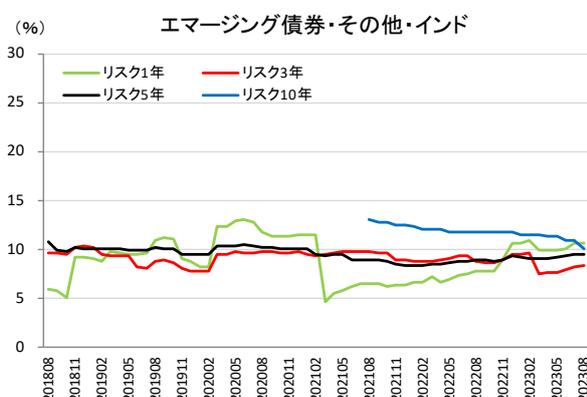
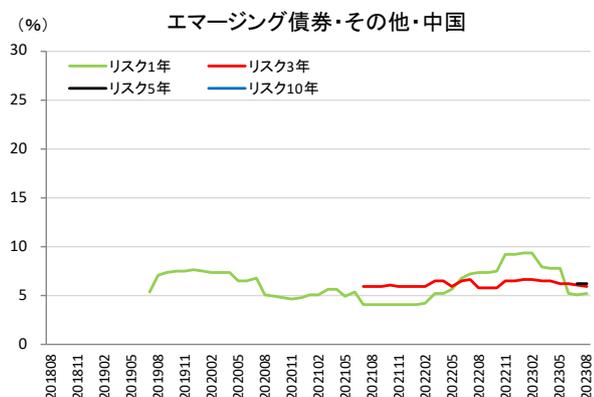
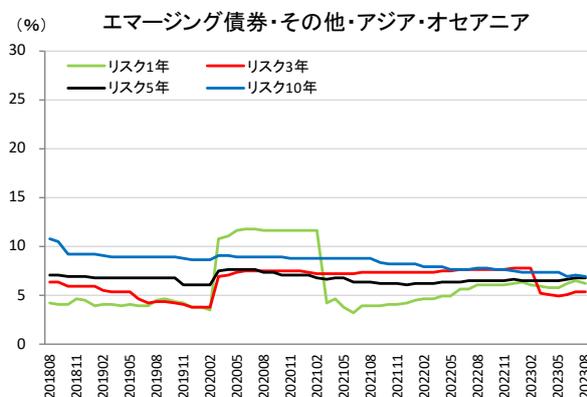
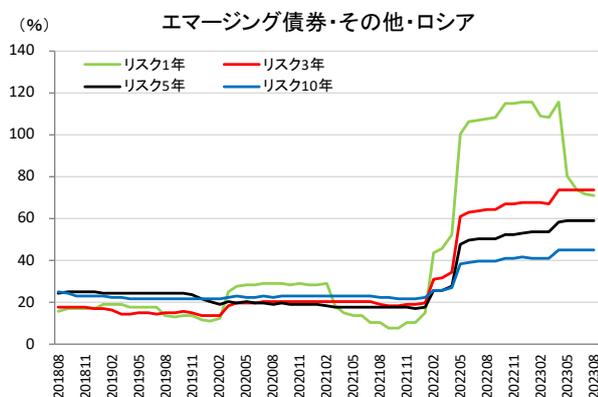
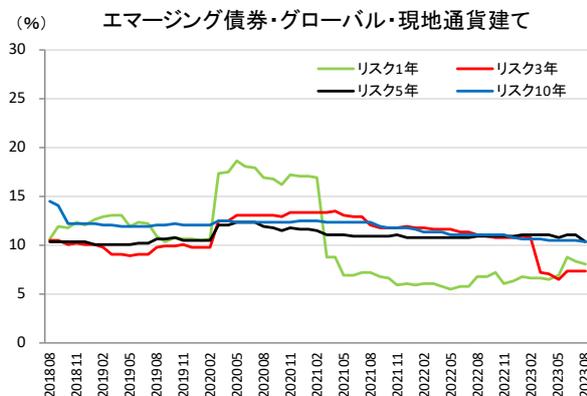
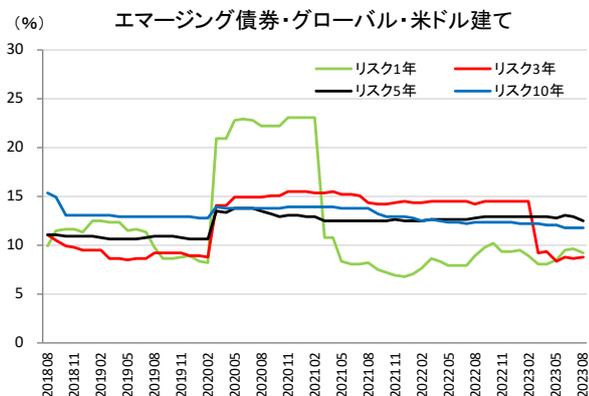


<2> リスク・サマリー

(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]

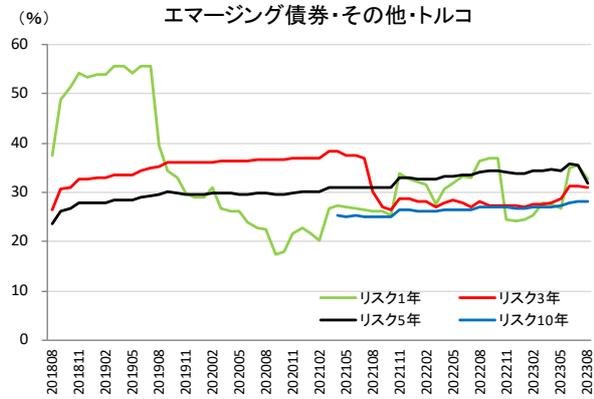
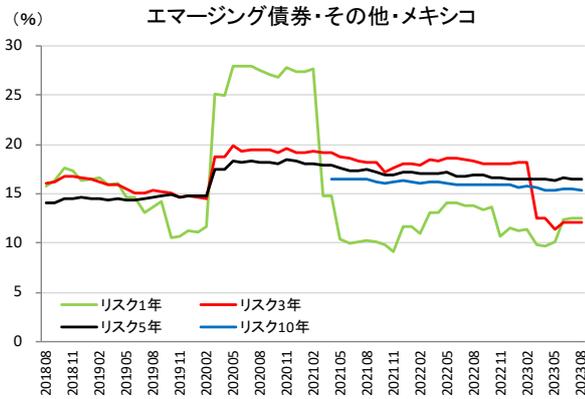


<2> リスク・サマリー

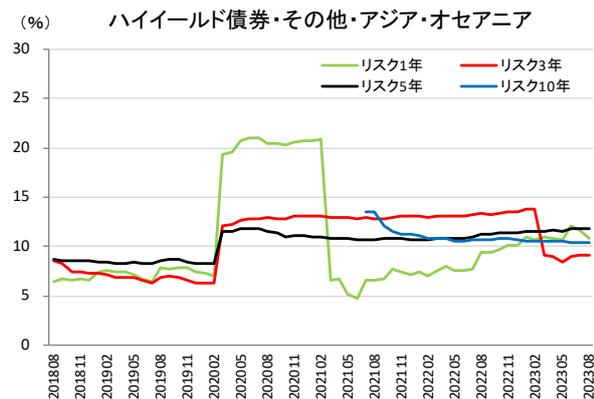
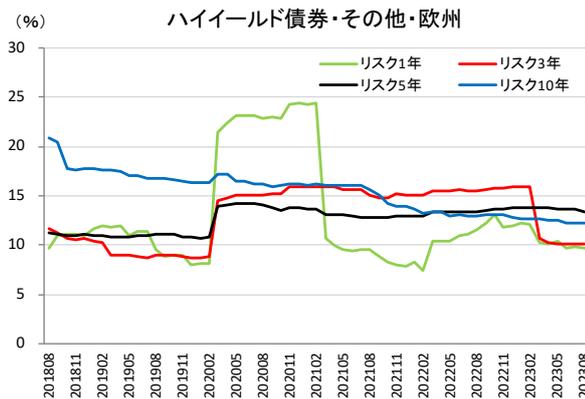
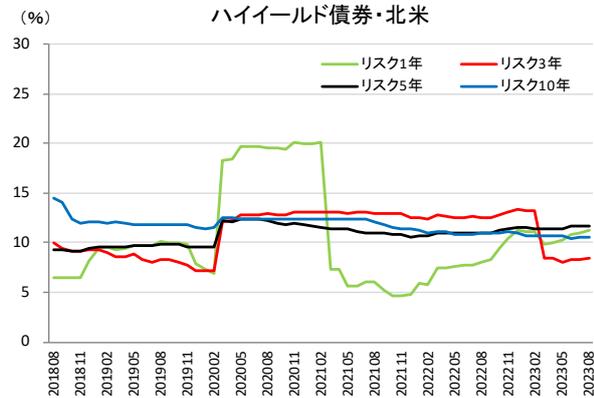
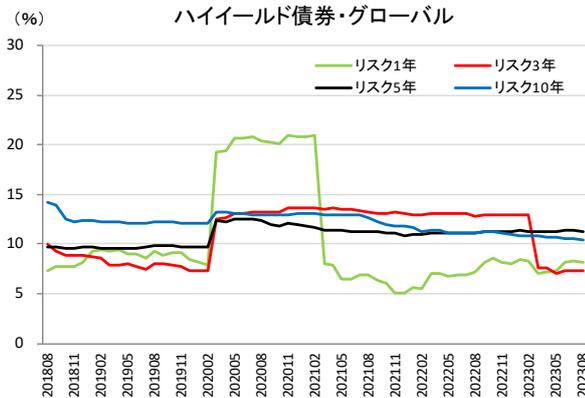
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

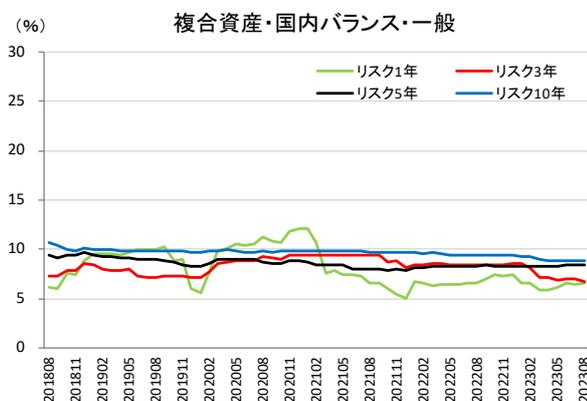
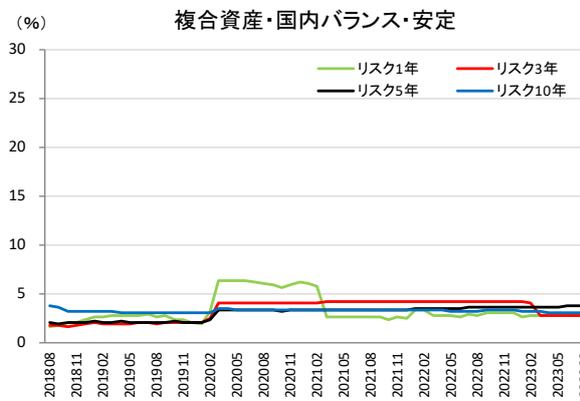
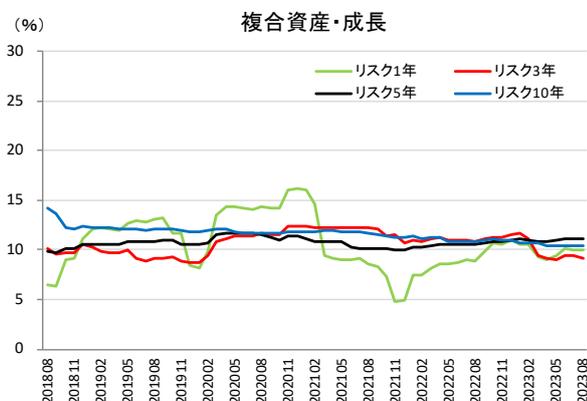
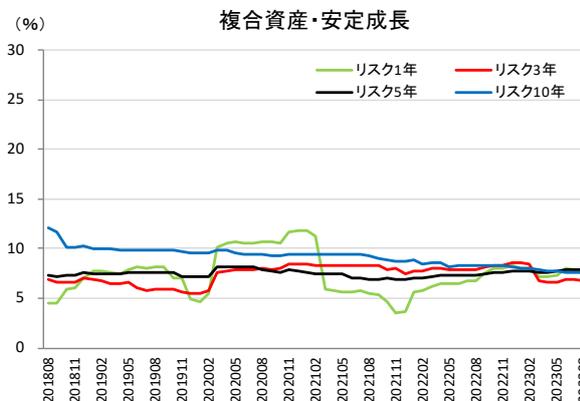
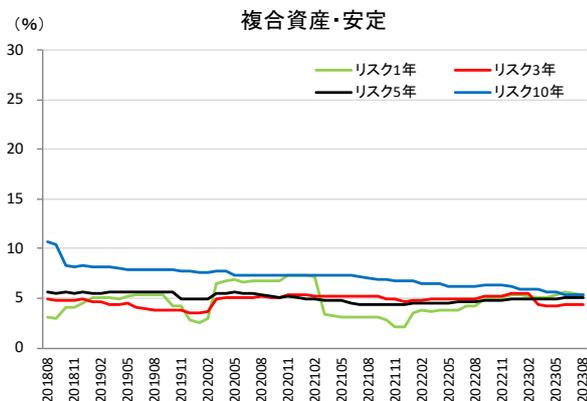


<2> リスク・サマリー

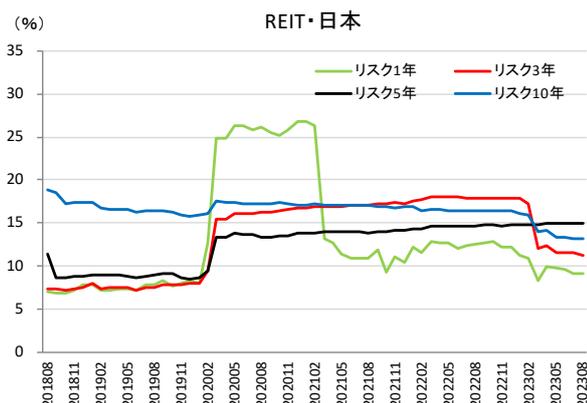
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

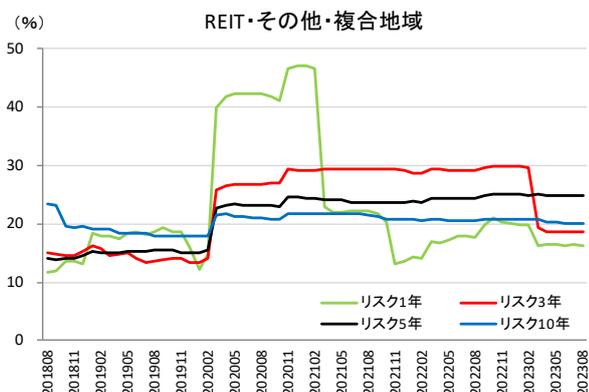
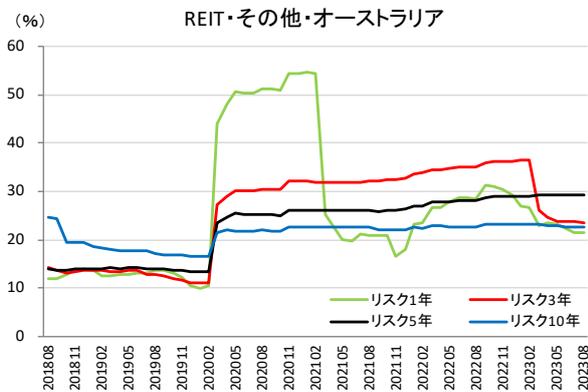
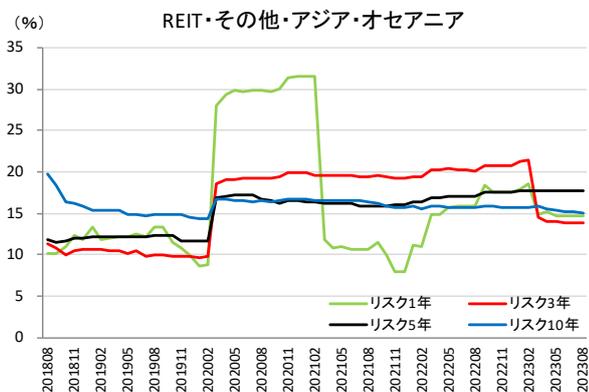
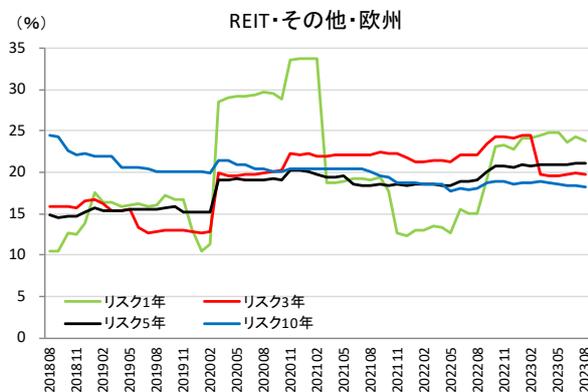
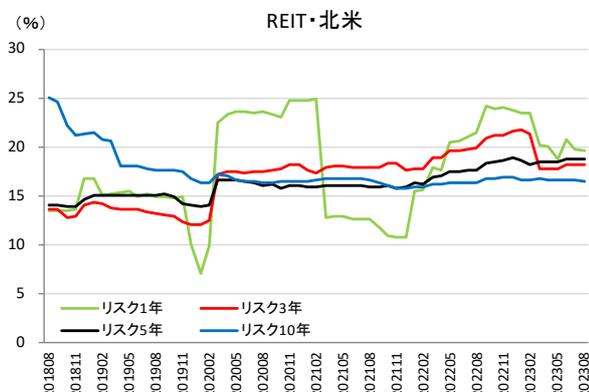
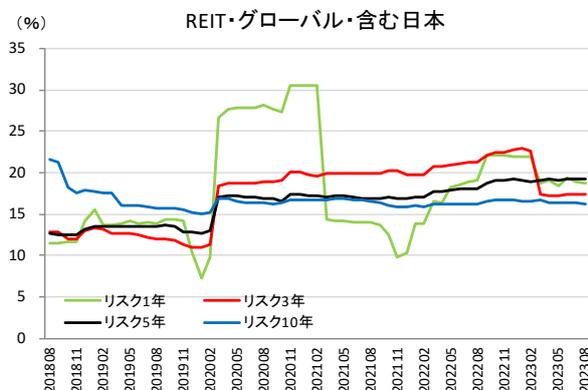
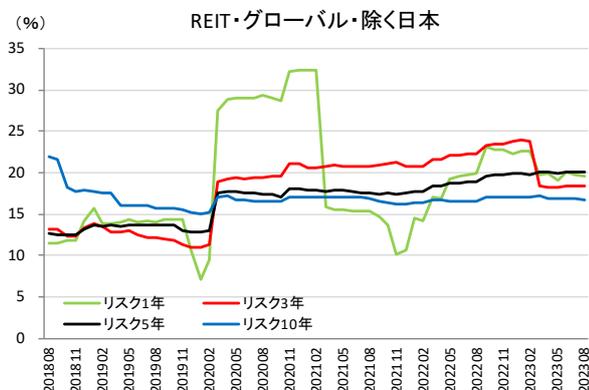


<2> リスク・サマリー

(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]

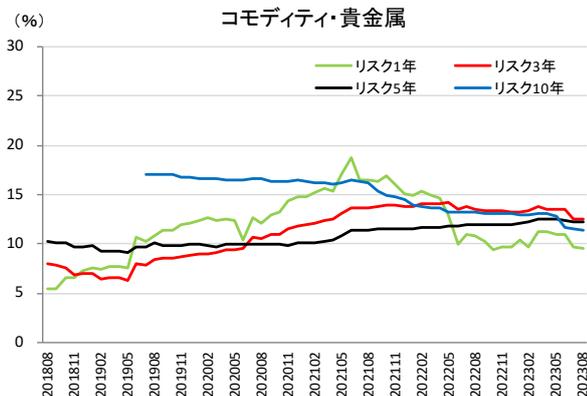
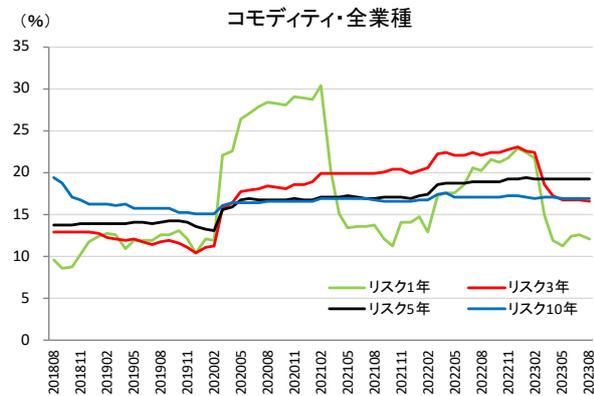
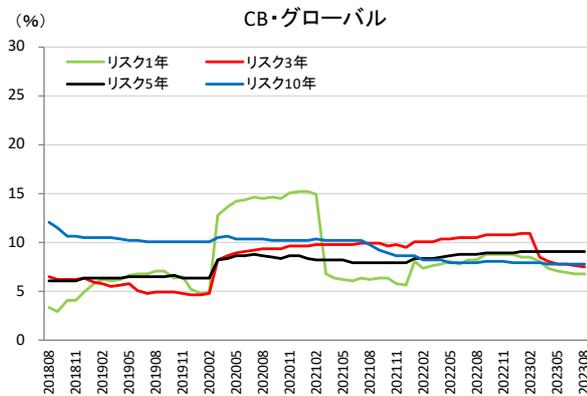
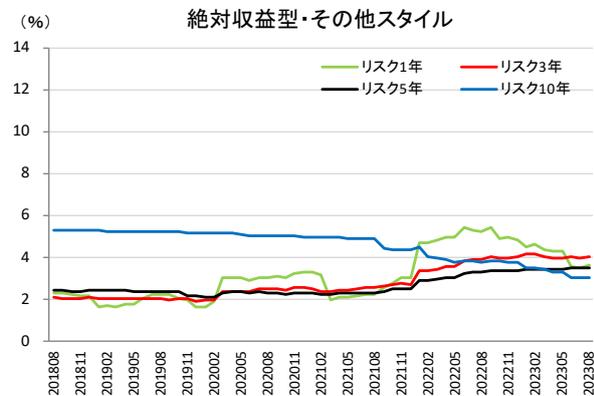
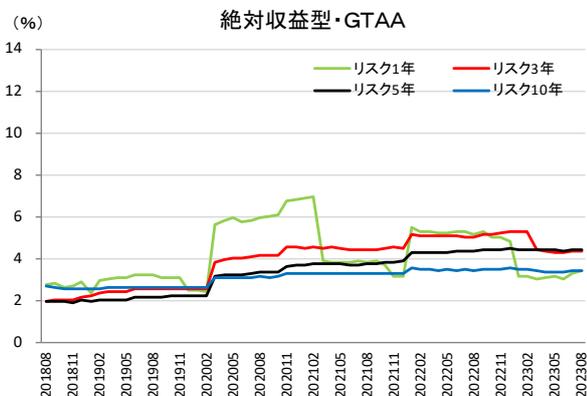
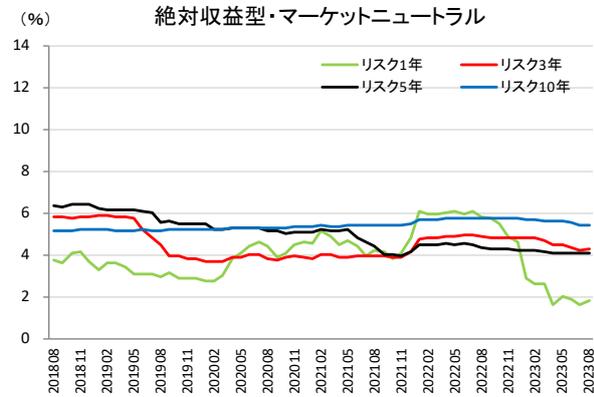
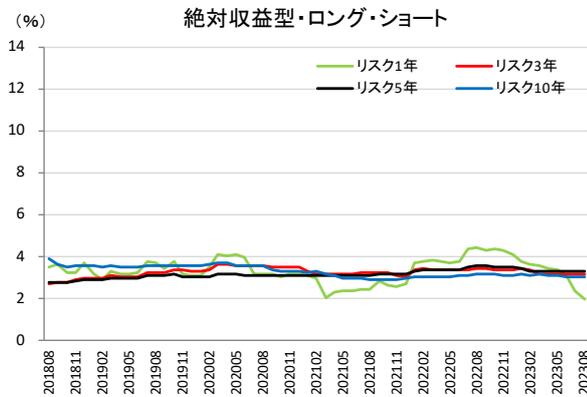


<2>リスク・サマリー

(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	9,517	24,401	31,299	71,494
国内株式	1,950	4,446	3,204	8,058
一般	906	2,323	3,861	5,848
フリー	609	805	1,051	2,411
バリュー	297	1,519	2,810	3,437
小型	65	350	333	425
その他	964	1,739	-1,022	1,727
日経225	538	1,078	-2,148	-148
TOPIX	386	731	1,179	1,657
JPX日経400	10	18	-46	-21
国内債券	209	1,457	-516	-258
一般	209	1,457	-516	-258
外国株式(先進国)	3,723	8,420	12,878	31,990
グローバル	2,246	5,462	8,395	17,000
除く日本	151	1,337	3,131	7,644
含む日本	2,095	4,125	5,264	9,356
その他	1,477	2,958	4,483	14,990
北米	47	183	281	967
米国	1,478	2,957	4,521	14,611
カナダ	-2	-8	-12	-23
欧州	-23	-59	-131	-218
ドイツ	0	0	-1	-2
イギリス	0	0	0	0
アジア・オセアニア	0	-1	-2	-4
オーストラリア	-18	-107	-167	-337
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	-5	-6	-5	-2
エマージング株式	1,140	3,135	4,200	5,578
グローバル	84	225	412	671
BRICS	-5	-13	-19	-38
その他	1,061	2,923	3,808	4,945
欧州	1	2	3	2
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-94	-221	-336	-441
中国	-69	-149	-190	-356
インド	1,228	3,322	4,338	5,534
インドネシア	6	17	20	41
タイ	-2	-3	-3	-6
フィリピン	0	0	1	1
ベトナム	-6	-1	27	283
韓国	0	0	0	-4
香港	0	0	0	2
中南米	-1	-6	-6	-10
ブラジル	2	-30	-34	-68
メキシコ	0	1	1	-2
中東・アフリカ	-2	-5	-7	-13
トルコ	-1	-4	-6	-15
複合地域	0	0	-1	-1

<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別②

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	9,517	24,401	31,299	71,494
外国債券(先進国)	1,056	3,000	4,346	8,324
グローバル	901	2,708	3,459	6,839
除く日本	438	862	1,023	1,182
含む日本	462	1,846	2,436	5,657
その他	156	291	887	1,485
北米	7	10	29	30
米国	204	537	1,174	2,247
カナダ	-9	-47	-66	-126
欧州	0	-12	105	88
イギリス	0	-1	-1	-2
アジア・オセアニア	4	-9	-13	-60
オーストラリア	-48	-177	-304	-617
ニュージーランド	2	9	6	3
複合地域	-4	-19	-43	-77
エマージング債券	23	205	184	-74
グローバル	-1	149	153	125
米ドル建て	-5	123	137	34
現地通貨建て	4	26	16	90
その他	24	56	31	-198
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-1	-4	-9	-20
中国	-1	-2	16	8
インド	47	174	218	192
インドネシア	5	17	19	12
ブラジル	-24	-122	-194	-344
メキシコ	-2	-6	-15	-39
トルコ	0	0	-1	-4
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイールド債券	125	508	854	2,058
グローバル	-18	-58	-104	-74
北米	161	626	1,082	2,329
その他	-18	-60	-124	-196
欧州	-15	-51	-108	-198
アジア・オセアニア	-2	-7	-15	4
複合地域	0	-1	-1	-2
複合資産	848	1,982	3,110	7,769
安定	-109	-323	-565	-251
安定成長	477	1,074	1,854	4,161
成長	549	1,450	2,305	4,689
国内バランス	-62	-216	-492	-911
安定	-99	-286	-600	-1,266
一般	-1	-8	-18	-27
その他	-7	-3	8	81

< 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	9,517	24,401	31,299	71,494
国内REIT	14	141	478	2,572
日本	14	141	478	2,572
外国REIT	99	213	1,198	2,543
グローバル	59	-33	200	129
除く日本	56	226	585	756
含む日本	4	-258	-385	-627
北米	62	311	1,057	2,475
その他	-23	-65	-59	-62
欧州	-1	-10	-12	-15
アジア・オセアニア	-16	-35	-13	21
オーストラリア	-4	-15	-24	-49
複合地域	0	-1	-2	-2
複数国	-1	-4	-8	-16
その他	330	895	1,364	2,933
絶対収益型	193	408	125	619
ロング・ショート	71	69	51	33
マーケットニュートラル	-6	-24	-88	-138
GTAA	-3	-13	-43	-63
その他スタイル	129	374	225	799
CB	-35	-18	587	883
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-2
日本	0	0	-1	-4
グローバル	-35	-17	588	889
コモディティ	96	345	577	930
全業種	9	31	97	92
貴金属	91	322	486	858
エネルギー	-6	-11	-11	-25
その他コモディティ	2	4	5	6

< 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	1,008,193	100.00	5,390	100.00
国内株式	130,644	12.96	810	15.03
一般	73,346	7.27	508	9.42
フリー	54,766	5.43	417	7.74
バリュー	18,580	1.84	91	1.69
小型	7,650	0.76	91	1.69
その他	48,828	4.84	205	3.80
日経225	23,605	2.34	71	1.32
TOPIX	20,954	2.08	82	1.52
JPX日経400	851	0.08	15	0.28
国内債券	41,362	4.10	145	2.69
一般	41,362	4.10	145	2.69
外国株式(先進国)	436,336	43.28	1,190	22.08
グローバル	293,489	29.11	832	15.44
除く日本	86,600	8.59	192	3.56
含む日本	206,890	20.52	640	11.87
その他	142,847	14.17	358	6.64
北米	1,375	0.14	13	0.24
米国	136,801	13.57	272	5.05
カナダ	140	0.01	2	0.04
欧州	1,630	0.16	41	0.76
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	37	0.00	1	0.02
オーストラリア	2,787	0.28	23	0.43
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	39	0.00	1	0.02
エマージング株式	35,725	3.54	309	5.73
グローバル	10,760	1.07	93	1.73
BRICS	468	0.05	7	0.13
その他	24,498	2.43	209	3.88
欧州	83	0.01	6	0.11
ロシア	8	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,483	0.44	85	1.58
中国	1,640	0.16	33	0.61
インド	15,702	1.56	33	0.61
インドネシア	200	0.02	5	0.09
タイ	9	0.00	2	0.04
フィリピン	30	0.00	4	0.07
ベトナム	1,577	0.16	13	0.24
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	15	0.00	1	0.02
中南米	65	0.01	2	0.04
ブラジル	520	0.05	12	0.22
メキシコ	9	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	79	0.01	3	0.06
トルコ	60	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	1,008,193	100.00	5,390	100.00
外国債券(先進国)	89,587	8.89	764	14.17
グローバル	72,656	7.21	527	9.78
除く日本	32,839	3.26	223	4.14
含む日本	39,818	3.95	304	5.64
その他	16,931	1.68	237	4.40
北米	99	0.01	8	0.15
米国	7,256	0.72	128	2.37
カナダ	685	0.07	4	0.07
欧州	1,096	0.11	30	0.56
イギリス	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,553	0.15	9	0.17
オーストラリア	5,082	0.50	36	0.67
ニュージーランド	79	0.01	9	0.17
複合地域	1,072	0.11	8	0.15
エマージング債券	11,795	1.17	251	4.66
グローバル	6,659	0.66	179	3.32
米ドル建て	4,829	0.48	139	2.58
現地通貨建て	1,830	0.18	40	0.74
その他	5,136	0.51	72	1.34
ロシア	4	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	238	0.02	6	0.11
中国	155	0.02	10	0.19
インド	2,497	0.25	16	0.30
インドネシア	332	0.03	7	0.13
ブラジル	1,563	0.16	22	0.41
メキシコ	277	0.03	3	0.06
トルコ	36	0.00	2	0.04
複合地域	34	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	19,507	1.93	250	4.64
グローバル	2,667	0.26	38	0.71
北米	14,986	1.49	150	2.78
その他	1,854	0.18	62	1.15
欧州	1,431	0.14	40	0.74
アジア・オセアニア	386	0.04	21	0.39
複合地域	37	0.00	1	0.02
複合資産	143,521	14.24	1,036	19.22
安定	38,521	3.82	282	5.23
安定成長	64,278	6.38	427	7.92
成長	30,766	3.05	285	5.29
国内バランス	6,804	0.67	28	0.52
安定	5,907	0.59	9	0.17
一般	291	0.03	15	0.28
その他	3,153	0.31	14	0.26

＜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	1,008,193	100.00	5,390	100.00
国内REIT	27,983	2.78	134	2.49
日本	27,983	2.78	134	2.49
外国REIT	45,420	4.51	279	5.18
グローバル	18,047	1.79	152	2.82
除く日本	6,612	0.66	65	1.21
含む日本	11,435	1.13	87	1.61
北米	24,420	2.42	75	1.39
その他	2,953	0.29	52	0.96
欧州	107	0.01	10	0.19
アジア・オセアニア	2,055	0.20	26	0.48
オーストラリア	486	0.05	12	0.22
複合地域	57	0.01	3	0.06
複数国	248	0.02	1	0.02
その他	26,310	2.61	222	4.12
絶対収益型	11,865	1.18	96	1.78
ロング・ショート	849	0.08	30	0.56
マーケットニュートラル	417	0.04	14	0.26
GTAA	359	0.04	11	0.20
その他スタイル	10,173	1.01	40	0.74
CB	2,772	0.27	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	2,713	0.27	33	0.61
コモディティ	5,968	0.59	37	0.69
全業種	1,846	0.18	13	0.24
貴金属	4,028	0.40	22	0.41
エネルギー	67	0.01	1	0.02
その他コモディティ	26	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	14,437	10.2	2.16	2.19	1.131
国内株式	20,708	14.1	1.04	0.90	1.033
一般	19,536	13.8	1.45	1.27	1.381
フリー	18,908	13.1	1.20	1.07	1.422
バリュー	22,417	17.2	2.21	1.91	1.259
小型	24,973	14.7	0.94	0.85	1.709
その他	21,792	14.4	0.41	0.34	0.395
日経225	22,683	15.6	0.41	0.36	0.457
TOPIX	22,889	15.2	0.16	0.13	0.244
JPX日経400	20,702	9.0	0.47	0.39	0.488
国内債券	10,363	12.1	0.14	0.14	0.454
一般	10,363	12.1	0.14	0.14	0.454
外国株式(先進国)	17,248	7.7	2.19	2.07	1.205
グローバル	17,681	7.6	1.98	1.92	1.293
除く日本	25,970	10.6	0.45	0.44	0.553
含む日本	15,195	6.7	2.63	2.54	1.602
その他	16,242	7.9	2.62	2.38	1.024
北米	15,789	5.2	0.92	0.88	1.428
米国	17,097	7.1	2.52	2.26	0.996
カナダ	6,206	12.4	6.34	6.86	1.989
欧州	15,259	13.0	2.29	2.03	1.495
ドイツ	16,465	9.4	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,390	7.1	8.98	9.41	1.783
アジア・オセアニア	10,938	17.2	3.21	3.20	1.639
オーストラリア	10,499	8.6	8.24	8.88	1.823
ニュージーランド	17,396	11.1	1.73	1.72	1.672
複合地域	12,650	10.3	8.74	8.70	1.705
エマージング株式	14,380	10.8	2.44	2.37	1.659
グローバル	14,056	8.2	0.28	0.25	1.022
BRICS	15,422	17.3	0.84	0.85	2.064
その他	14,488	11.8	3.43	3.34	1.931
欧州	7,885	17.2	0.83	0.50	1.947
ロシア	962	14.3	0.00	0.00	1.162
アジア・オセアニア	15,259	13.0	2.06	2.11	1.683
中国	13,821	8.8	1.34	1.40	1.931
インド	17,943	11.7	4.41	4.25	2.006
インドネシア	13,783	10.7	2.39	2.27	1.812
タイ	14,606	11.4	1.43	1.32	1.819
フィリピン	11,165	11.0	0.52	0.53	1.714
ベトナム	17,501	6.1	0.66	0.69	1.893
韓国	14,997	4.7	0.00	0.00	1.804
香港	13,711	14.0	2.55	2.63	0.858
中南米	11,697	16.6	0.00	0.00	2.038
ブラジル	6,607	12.3	3.48	3.57	1.952
メキシコ	14,592	10.4	2.04	1.37	1.667
中東・アフリカ	13,611	11.7	0.87	0.92	2.140
トルコ	15,059	22.1	0.43	0.24	2.026
複合地域	22,221	15.3	1.70	1.68	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	14,437	10.2	2.16	2.19	1.131
外国債券(先進国)	10,194	10.6	1.36	1.41	0.979
グローバル	10,667	10.6	1.10	1.12	0.915
除く日本	11,866	12.9	0.91	0.91	0.685
含む日本	9,787	8.9	1.27	1.32	1.105
その他	9,142	10.7	2.45	2.61	1.253
北米	10,170	7.1	2.04	2.13	1.543
米国	9,989	8.9	2.54	2.84	1.232
カナダ	7,458	12.6	1.53	1.53	1.378
欧州	7,447	13.7	1.52	1.52	1.118
イギリス	7,396	8.3	3.97	3.69	1.299
アジア・オセアニア	9,136	13.4	2.40	2.44	1.434
オーストラリア	8,569	14.7	2.71	2.80	1.244
ニュージーランド	8,991	9.2	1.51	1.55	1.367
複合地域	5,598	13.3	2.22	2.21	1.195
エマージング債券	9,503	11.6	3.84	3.67	1.417
グローバル	9,447	12.1	2.66	2.51	1.257
米ドル建て	9,196	12.6	2.93	2.78	1.386
現地通貨建て	10,318	10.3	1.95	1.81	0.918
その他	9,643	10.5	5.38	5.17	1.624
ロシア	692	10.5	0.00	0.00	1.559
アジア・オセアニア	9,756	12.7	6.45	6.76	1.626
中国	11,780	4.0	1.45	1.45	1.241
インド	10,244	9.0	6.09	6.19	1.705
インドネシア	10,011	10.8	5.27	5.11	1.670
ブラジル	11,127	13.3	4.56	3.86	1.579
メキシコ	9,457	10.9	5.35	4.23	1.369
トルコ	1,557	10.9	6.00	8.03	1.474
複合地域	4,261	17.0	1.68	1.41	1.210
ハイイールド債券	9,835	12.2	5.11	4.97	1.665
グローバル	8,037	11.0	3.33	3.13	1.466
北米	11,266	13.0	5.23	5.09	1.688
その他	7,476	10.9	6.75	6.67	1.766
欧州	7,898	10.4	6.07	5.81	1.738
アジア・オセアニア	6,804	11.4	9.42	10.01	1.868
複合地域	4,679	19.4	5.44	5.13	1.800
複合資産	13,538	9.6	1.01	1.03	0.940
安定	11,494	9.6	0.93	0.94	1.072
安定成長	13,210	10.1	1.31	1.34	0.948
成長	16,387	9.1	0.19	0.17	0.779
国内バランス	12,330	10.9	2.07	2.15	0.947
安定	10,636	12.1	1.89	1.99	0.916
一般	13,427	11.4	1.07	1.00	1.267
その他	9,131	3.4	1.36	1.50	0.718

(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	14,437	10.2	2.16	2.19	1.131
国内REIT	14,414	10.3	7.89	9.56	0.916
日本	14,414	10.3	7.89	9.56	0.916
外国REIT	12,262	9.3	7.80	8.89	1.466
グローバル	13,486	8.9	3.11	3.32	1.209
除く日本	14,993	7.2	1.83	2.04	0.869
含む日本	12,361	10.3	3.84	4.05	1.405
北米	11,620	10.0	11.44	13.22	1.621
その他	9,609	9.2	6.30	7.21	1.749
欧州	6,308	9.6	4.96	4.86	1.836
アジア・オセアニア	11,083	8.6	7.51	8.73	1.794
オーストラリア	9,534	8.9	4.34	4.63	1.700
複合地域	7,483	11.6	0.87	0.88	0.778
複数国	11,561	19.3	2.01	2.08	1.650
その他					
絶対収益型	10,366	6.5	0.02	0.02	1.936
ロング・ショート	10,317	5.9	0.27	0.28	1.486
マーケットニュートラル	9,902	5.5	0.00	0.00	1.279
GTAA	11,029	10.5	0.02	0.02	1.534
その他スタイル	10,333	6.2	0.00	0.00	2.019
CB	12,395	8.8	0.44	0.44	1.190
アジア・オセアニア	10,591	13.2	2.29	2.27	1.823
日本	13,836	23.8	0.37	0.36	0.770
グローバル	12,406	8.2	0.40	0.40	1.186
コモディティ	12,559	7.2	0.16	0.18	0.911
全業種	10,948	11.2	0.52	0.57	1.280
貴金属	12,882	4.6	0.00	0.00	0.742
エネルギー	20,441	14.5	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	18,519	6.9	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