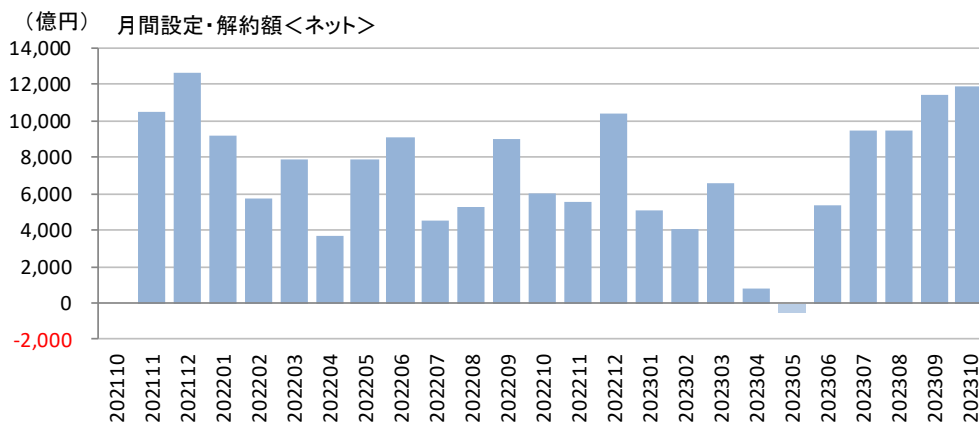
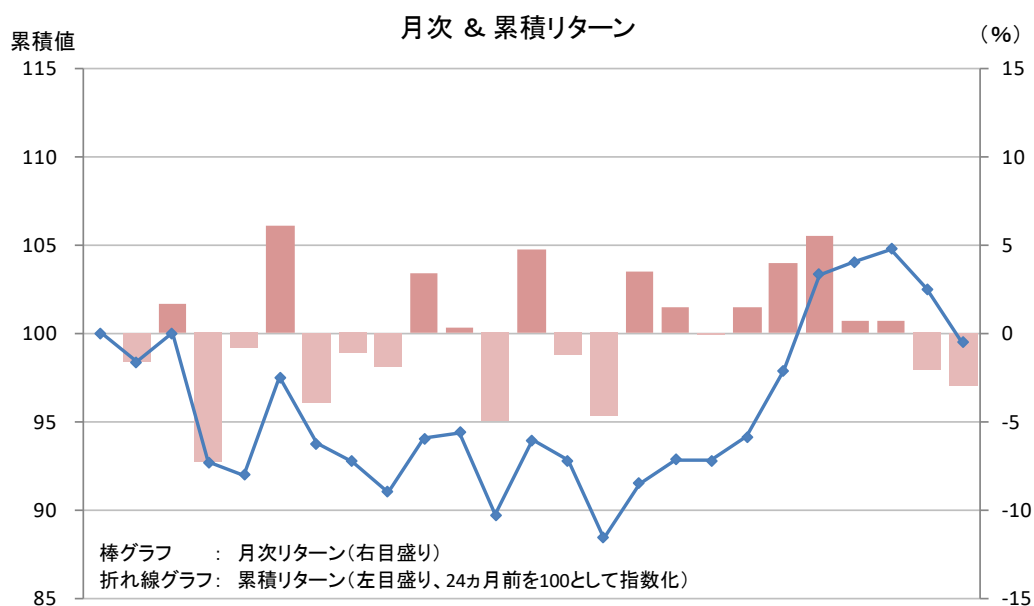


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2023年10月

「総合」 －2.98 %
 (前月 －2.12 %)



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		16,660	17,172	-512	-2.98	
国内株式		22,557	23,418	-861	-3.68	
一般		21,935	22,801	-867	-3.80	
フリー		20,231	21,073	-843	-4.00	
バリュー		29,863	30,869	-1,006	-3.26	
小型		39,837	42,144	-2,306	-5.47	
その他		22,843	23,602	-759	-3.22	
日経225		21,409	22,111	-702	-3.17	
TOPIX		22,880	23,590	-710	-3.01	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	21,444	22,223	-780	-3.51	
国内債券		12,191	12,350	-159	-1.29	
一般		12,191	12,350	-159	-1.29	
外国株式(先進国)		22,544	23,421	-877	-3.74	
グローバル		24,049	25,095	-1,046	-4.17	
除く日本		39,106	40,498	-1,392	-3.44	
含む日本		20,816	21,793	-976	-4.48	
その他		19,174	19,743	-569	-2.88	
北米		24,647	25,346	-699	-2.76	
米国		29,842	30,709	-867	-2.82	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	20,949	21,906	-957	-4.37	
欧州		24,728	25,826	-1,097	-4.25	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	12,481	12,948	-467	-3.60	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	10,955	11,261	-306	-2.72	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	38,593	40,041	-1,449	-3.62	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	19,668	20,710	-1,042	-5.03	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	43,893	46,695	-2,802	-6.00	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	15,778	16,572	-794	-4.79	
エマージング株式		20,413	20,972	-559	-2.67	
グローバル		19,542	20,061	-519	-2.59	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	24,289	24,823	-534	-2.15	
その他		21,690	22,293	-603	-2.71	
欧州		15,646	14,498	1,148	7.92	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,084	1,091	-7	-0.64	
アジア・オセアニア		18,729	19,251	-522	-2.71	
中国		36,903	37,909	-1,007	-2.66	
インド	10,000 (2004.09.30)	58,610	59,745	-1,136	-1.90	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	16,976	18,649	-1,673	-8.97	
タイ		23,095	23,796	-701	-2.95	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	7,572	8,070	-498	-6.17	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	22,232	24,926	-2,694	-10.81	
韓国	10,000 (1997.06.30)	28,678	30,776	-2,099	-6.82	
香港		21,548	21,501	47	0.22	
中南米	7,427 (2006.04.28)	11,482	11,985	-502	-4.19	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,688	10,069	-381	-3.79	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	15,712	16,625	-913	-5.49	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	12,510	13,508	-998	-7.39	
トルコ		41,687	46,089	-4,403	-9.55	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	25,613	25,598	15	0.06	

※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		16,660	17,172	-512	-2.98
外国債券(先進国)		18,365	18,579	-214	-1.15
グローバル		18,401	18,568	-167	-0.90
除く日本		20,370	20,495	-126	-0.61
含む日本		17,130	17,325	-195	-1.12
その他		18,413	18,846	-433	-2.30
北米	9,052 (2013.05.31)	10,255	10,499	-245	-2.33
米国		16,717	17,227	-510	-2.96
カナダ	10,000 (2003.05.30)	17,119	17,431	-312	-1.79
欧州	10,000 (1998.07.31)	14,063	14,029	34	0.24
イギリス	10,069 (2014.07.31)	10,850	10,940	-89	-0.82
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	20,955	21,473	-518	-2.41
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	25,973	26,548	-575	-2.17
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,068	11,402	-335	-2.93
複合地域	10,000 (2001.11.30)	18,509	18,714	-204	-1.09
エマージング債券		20,204	20,321	-117	-0.57
グローバル		19,925	20,033	-108	-0.54
米ドル建て		20,105	20,253	-148	-0.73
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	14,743	14,747	-4	-0.03
その他	8,647 (2005.03.31)	16,618	16,720	-102	-0.61
ロシア	10,000 (2008.05.30)	464	495	-31	-6.30
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	15,861	16,069	-207	-1.29
中国	13,833 (2018.07.31)	18,722	18,819	-97	-0.52
インド	10,000 (2011.08.31)	21,709	21,735	-26	-0.12
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	18,997	19,913	-916	-4.60
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	16,562	16,574	-13	-0.08
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	19,200	19,677	-477	-2.43
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,449	2,546	-97	-3.82
複合地域	10,000 (2006.08.31)	12,126	12,111	15	0.12
ハイイールド債券		27,763	28,144	-381	-1.35
グローバル	10,000 (1997.06.30)	25,665	25,905	-240	-0.93
北米		28,219	28,658	-439	-1.53
その他	10,000 (2004.03.31)	24,639	24,758	-119	-0.48
欧州	10,000 (2006.04.28)	25,195	25,284	-89	-0.35
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	14,737	14,877	-141	-0.95
複合地域	10,000 (2004.03.31)	24,536	24,685	-149	-0.60
複合資産		19,279	19,695	-416	-2.11
安定	10,000 (1998.10.30)	15,804	16,081	-277	-1.72
安定成長		21,443	21,891	-448	-2.05
成長		27,229	27,939	-711	-2.54
国内バランス		12,241	12,459	-218	-1.75
安定		12,287	12,508	-221	-1.76
一般		17,053	17,404	-351	-2.02
その他	10,000 (2018.10.31)	10,816	11,364	-548	-4.83

※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		16,660	17,172	-512	-2.98	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	34,275	35,029	-754	-2.15	
日本	10,000 (2003.10.31)	34,275	35,029	-754	-2.15	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	31,560	33,256	-1,697	-5.10	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	26,092	27,551	-1,459	-5.30	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	29,097	30,816	-1,719	-5.58	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	25,948	27,341	-1,393	-5.10	
北米	10,000 (2003.09.30)	33,482	35,186	-1,704	-4.84	
その他	10,000 (2004.04.30)	27,878	29,671	-1,792	-6.04	
欧州	10,000 (2006.12.29)	4,942	5,106	-164	-3.21	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	20,640	21,950	-1,309	-5.96	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	15,020	16,338	-1,317	-8.06	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,213	7,511	-298	-3.97	
複数国	10,000 (2004.04.30)	42,969	44,884	-1,915	-4.27	
その他		6,555	6,619	-65	-0.98	
絶対収益型		7,352	7,422	-70	-0.95	
ロング・ショート		8,180	8,168	11	0.14	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,303	11,310	-8	-0.07	
GTAA		11,178	11,296	-118	-1.05	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	6,889	6,963	-75	-1.07	
CB		20,015	20,375	-360	-1.77	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	21,854	21,950	-96	-0.44	
日本		20,009	20,251	-242	-1.19	
グローバル		34,907	35,544	-636	-1.79	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	13,008	12,507	501	4.00	
全業種	10,000 (2004.12.30)	12,496	12,626	-130	-1.03	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	21,382	20,051	1,331	6.64	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	11,160	11,612	-452	-3.89	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	16,867	17,115	-248	-1.45	

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

[色塗りの基準]月次リターン> 総合

<1>パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別①

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	-4.39	5.65	5.85	12.48
国内株式	-4.03	8.50	14.84	18.53
一般	-3.56	8.71	15.17	18.16
フリー	-4.41	7.58	13.52	16.78
バリュー	-1.05	11.98	20.29	22.24
小型	-8.45	-1.52	-0.06	2.83
その他	-4.02	9.83	16.88	21.72
日経225	-6.37	7.70	13.72	20.10
TOPIX	-2.13	10.63	19.51	21.69
JPX日経400	-3.25	9.98	18.98	20.81
国内債券	-2.75	-3.35	-3.50	-1.55
一般	-2.75	-3.35	-3.50	-1.55
外国株式(先進国)	-6.06	8.79	8.57	19.06
グローバル	-7.19	7.16	7.58	16.97
除く日本	-4.59	8.63	9.37	18.55
含む日本	-8.26	6.53	6.81	16.28
その他	-3.72	12.24	10.55	23.50
北米	-2.56	13.94	10.64	21.45
米国	-3.58	12.74	10.80	24.29
カナダ	-4.35	0.05	-6.81	1.87
欧州	-7.68	-2.36	9.94	9.71
ドイツ	-8.91	-0.80	18.34	16.05
イギリス	-2.12	-1.23	3.00	2.06
アジア・オセアニア	-7.38	-0.44	5.42	3.66
オーストラリア	-8.58	-0.39	-1.41	2.46
ニュージーランド	-9.03	-4.00	-2.11	-4.15
複合地域	4.69	18.19	-0.45	14.00
エマージング株式	-1.44	12.62	11.52	15.05
グローバル	-5.09	7.81	12.70	12.26
BRICS	-5.56	8.90	5.37	7.84
その他	0.30	14.94	10.77	16.35
欧州	2.17	20.15	49.17	37.10
ロシア	0.30	-0.19	-26.01	-17.87
アジア・オセアニア	-5.61	5.45	12.05	9.00
中国	-8.43	-5.47	0.34	-6.30
インド	4.51	22.05	10.04	21.97
インドネシア	-6.24	-2.67	-7.89	7.06
タイ	-7.41	-0.95	-1.92	-3.82
フィリピン	-7.54	-1.66	0.67	1.81
ベトナム	-9.26	10.24	7.46	14.61
韓国	-20.41	5.37	14.72	12.51
香港	-7.19	0.44	20.69	0.98
中南米	-9.58	14.01	3.23	18.46
ブラジル	-9.00	15.93	-2.64	15.04
メキシコ	-11.48	2.28	14.03	22.49
中東・アフリカ	-11.15	-1.85	-13.54	-1.18
トルコ	7.98	19.73	34.58	6.83
複合地域	-1.49	4.00	15.29	9.48

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別②

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	-4.39	5.65	5.85	12.48
外国債券(先進国)	-1.27	1.16	-0.53	3.46
グローバル	-1.05	1.30	-0.08	3.47
除く日本	-0.34	2.68	0.23	6.02
含む日本	-1.62	0.17	-0.25	1.42
その他	-2.27	0.49	-2.51	3.36
北米	-3.03	-0.99	-1.39	0.95
米国	-4.41	-3.04	-5.61	-0.09
カナダ	1.03	6.85	-0.96	9.50
欧州	-0.20	2.20	2.26	4.10
イギリス	-1.02	4.76	6.46	11.69
アジア・オセアニア	-0.72	2.68	-0.51	5.44
オーストラリア	-0.52	3.15	-0.12	5.99
ニュージーランド	-2.40	-0.09	-1.33	1.70
複合地域	-2.17	2.62	-1.69	5.99
エマージング債券	0.37	8.95	9.48	14.77
グローバル	-0.81	7.59	9.95	11.87
米ドル建て	-0.71	7.35	9.49	10.69
現地通貨建て	-1.08	8.23	11.09	15.14
その他	1.93	10.76	9.03	18.67
ロシア	-5.31	-10.47	-70.61	-61.40
アジア・オセアニア	0.50	3.53	4.68	7.49
中国	1.97	3.76	0.48	5.59
インド	5.26	10.73	6.26	15.65
インドネシア	-2.99	1.64	4.46	12.45
ブラジル	-0.43	15.71	16.26	29.57
メキシコ	-5.18	9.86	17.01	22.72
トルコ	-8.65	-27.26	-36.32	-34.90
複合地域	-0.43	9.02	16.14	18.30
ハイイールド債券	2.15	8.73	6.52	13.52
グローバル	0.40	6.73	8.82	10.97
北米	2.58	9.31	5.18	14.26
その他	1.34	7.15	11.54	11.48
欧州	1.57	7.98	11.49	12.43
アジア・オセアニア	0.42	4.01	12.47	7.99
複合地域	2.37	8.63	7.83	13.27
複合資産	-3.04	2.04	2.62	6.43
安定	-2.60	0.36	0.07	2.94
安定成長	-2.90	2.66	3.31	7.52
成長	-3.15	5.25	7.06	11.69
国内バランス	-1.99	-1.53	-1.88	0.07
安定	-2.26	-2.47	-3.08	-1.12
一般	-1.72	4.49	7.33	9.21
その他	-12.19	-8.90	-7.11	-0.21

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別③

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来 (%)
総合	-4.39	5.65	5.85	12.48
国内REIT	-2.33	-1.00	-4.45	-0.74
日本	-2.33	-1.00	-4.45	-0.74
外国REIT	-9.28	-1.69	-6.71	1.23
グローバル	-9.34	-1.84	-6.52	0.76
除く日本	-9.78	-1.86	-6.68	0.49
含む日本	-9.05	-1.77	-6.36	1.00
北米	-9.20	-1.05	-6.95	2.20
その他	-9.56	-5.67	-5.86	-3.52
欧州	-6.03	0.35	2.29	2.00
アジア・オセアニア	-9.40	-6.25	-5.57	-3.69
オーストラリア	-12.66	-7.60	-9.12	-6.95
複合地域	-5.95	-0.25	-1.55	1.28
複数国	-7.00	-0.39	-6.09	1.69
その他	-3.72	2.70	5.46	8.95
絶対収益型	-1.98	-0.87	-1.86	-0.80
ロング・ショート	0.25	-0.52	-0.50	1.03
マーケットニュートラル	-0.20	1.17	-0.37	0.12
GTAA	-0.56	-2.55	-3.96	-1.25
その他スタイル	-2.30	-0.95	-1.90	-0.95
CB	-1.75	1.97	2.64	4.44
アジア・オセアニア	1.31	6.52	7.55	11.93
日本	-1.64	1.84	1.77	2.65
グローバル	-1.79	1.92	2.61	4.38
コモディティ	5.06	8.44	11.43	12.84
全業種	6.08	16.70	0.55	11.02
貴金属	4.47	4.58	18.08	13.62
エネルギー	11.31	28.08	8.41	25.39
その他コモディティ	3.88	12.96	0.99	10.37

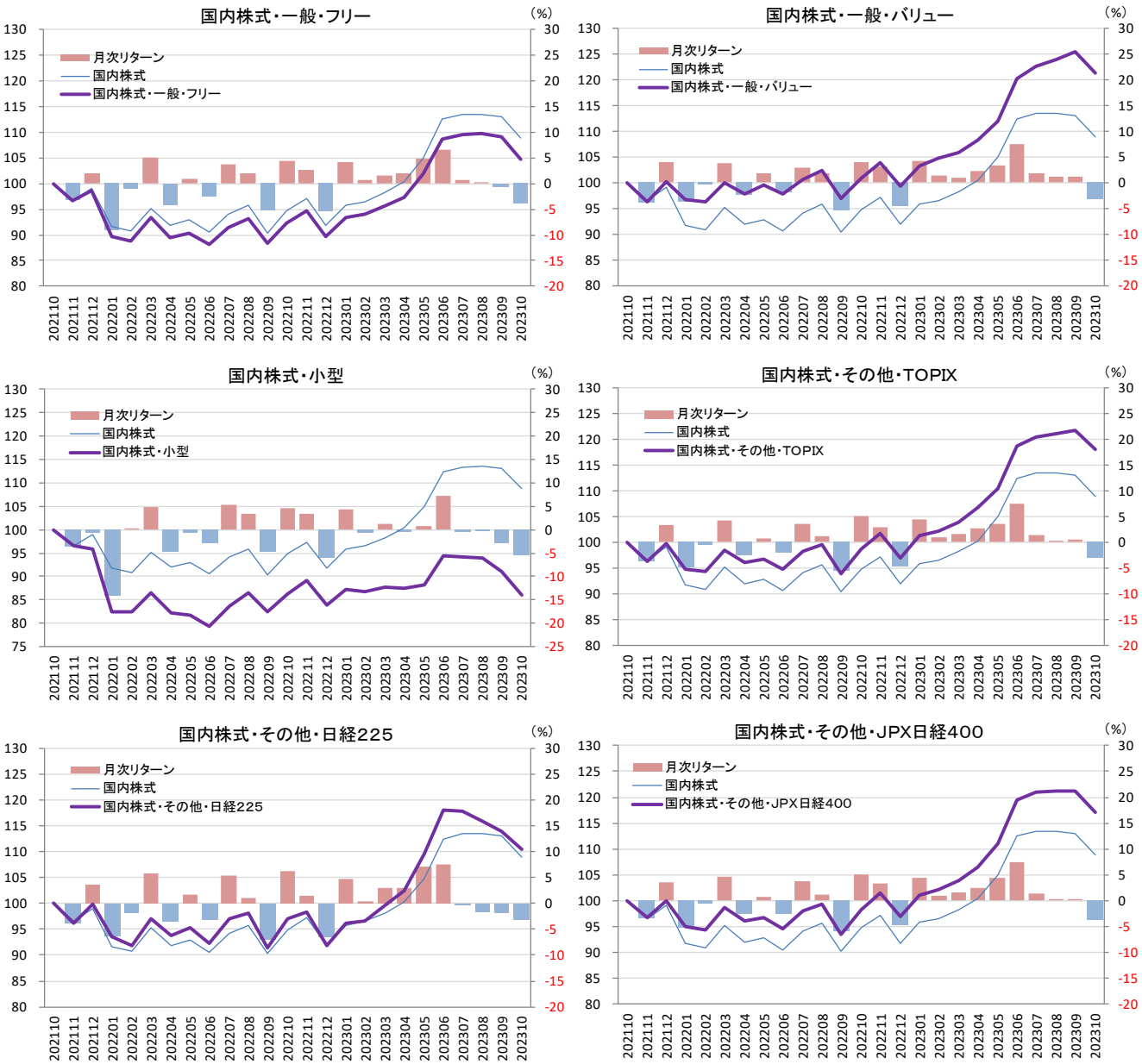
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

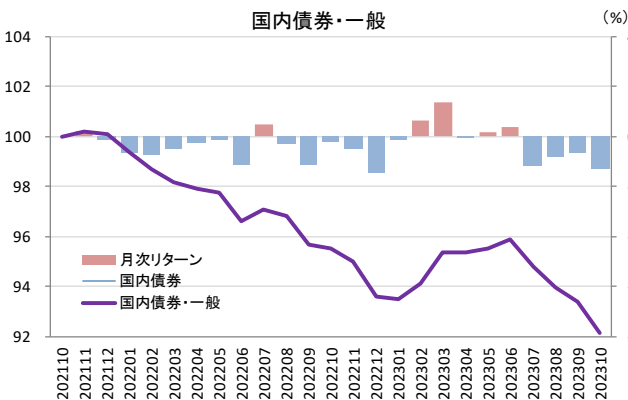
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

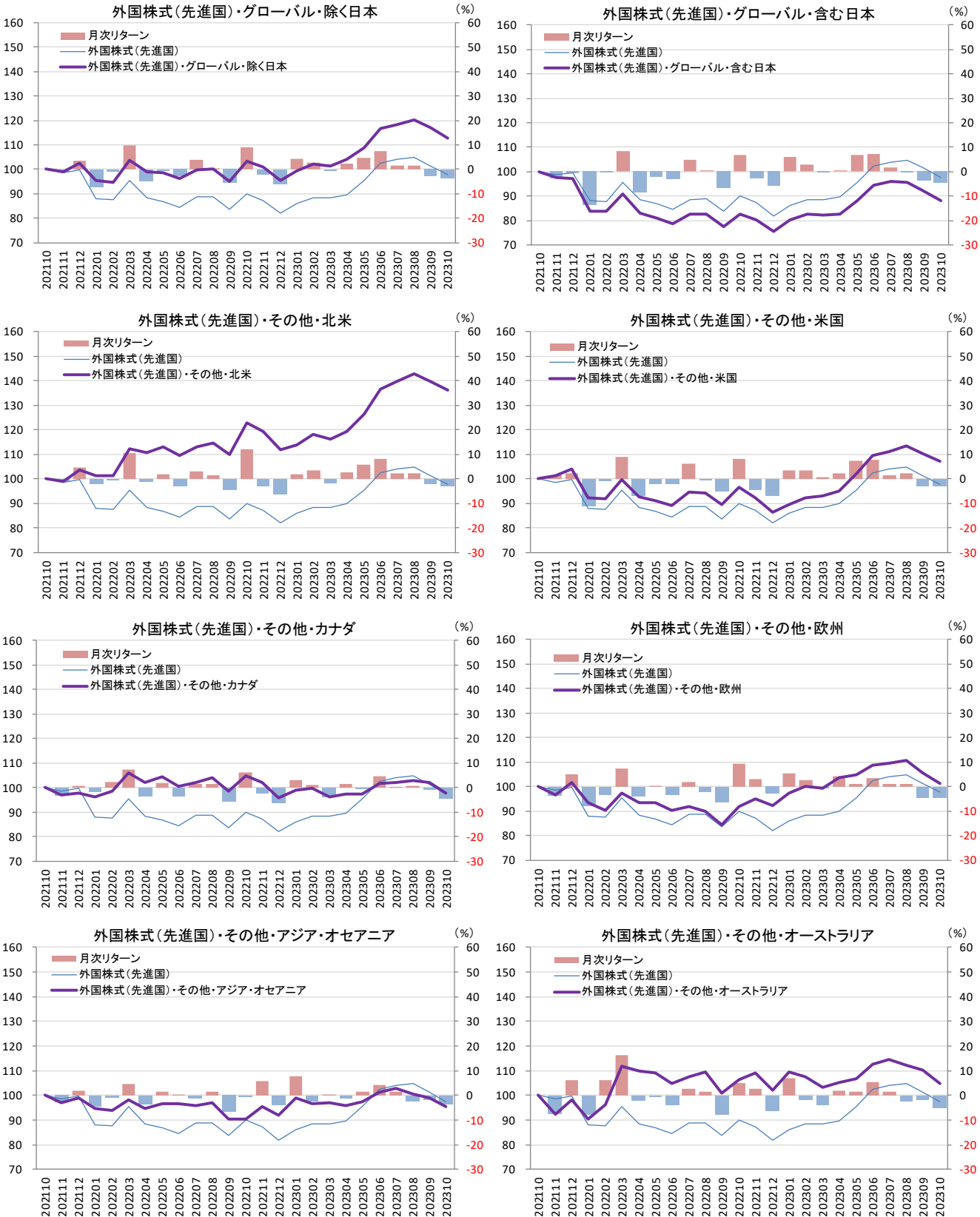


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

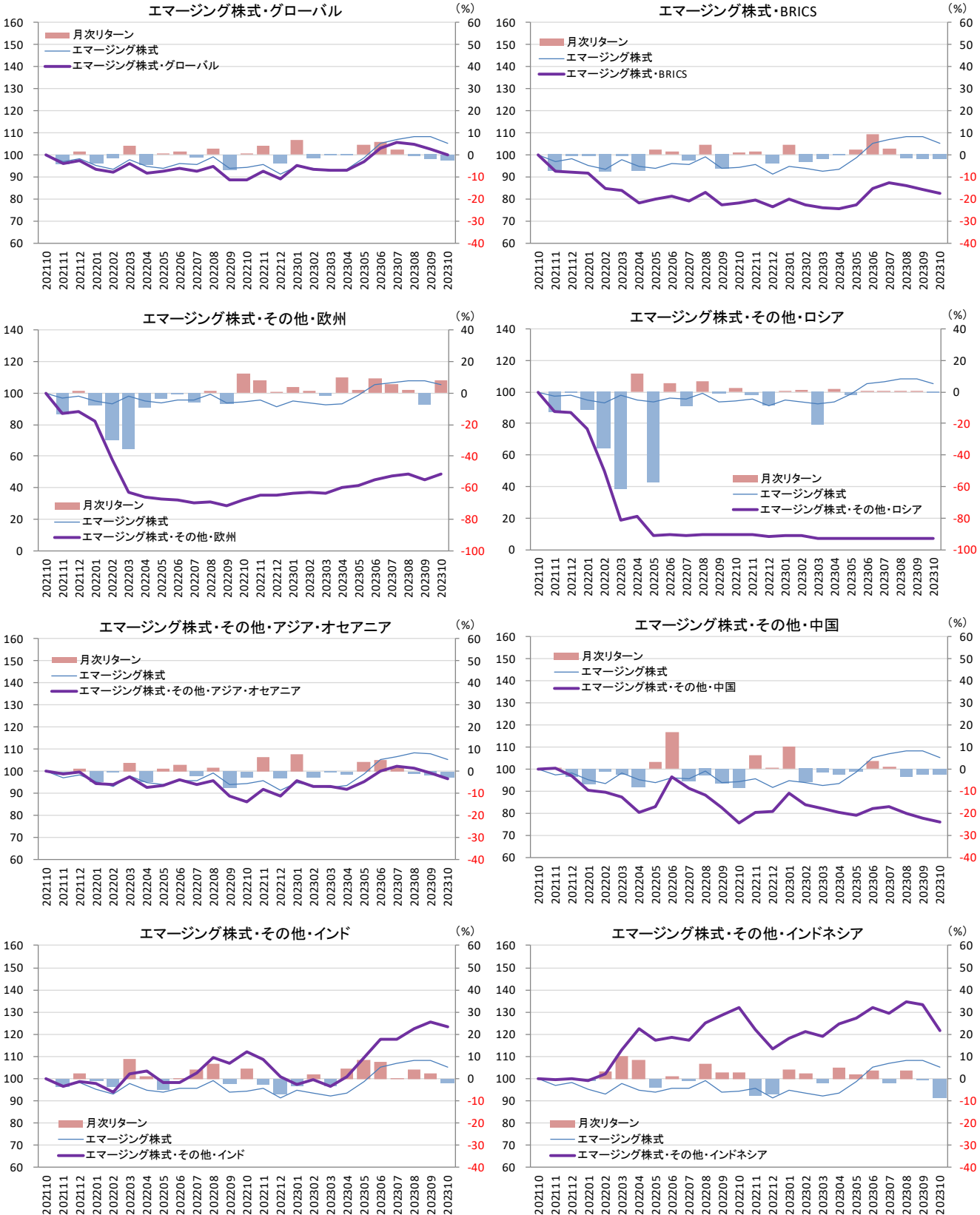


＜1＞パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマージング株式]

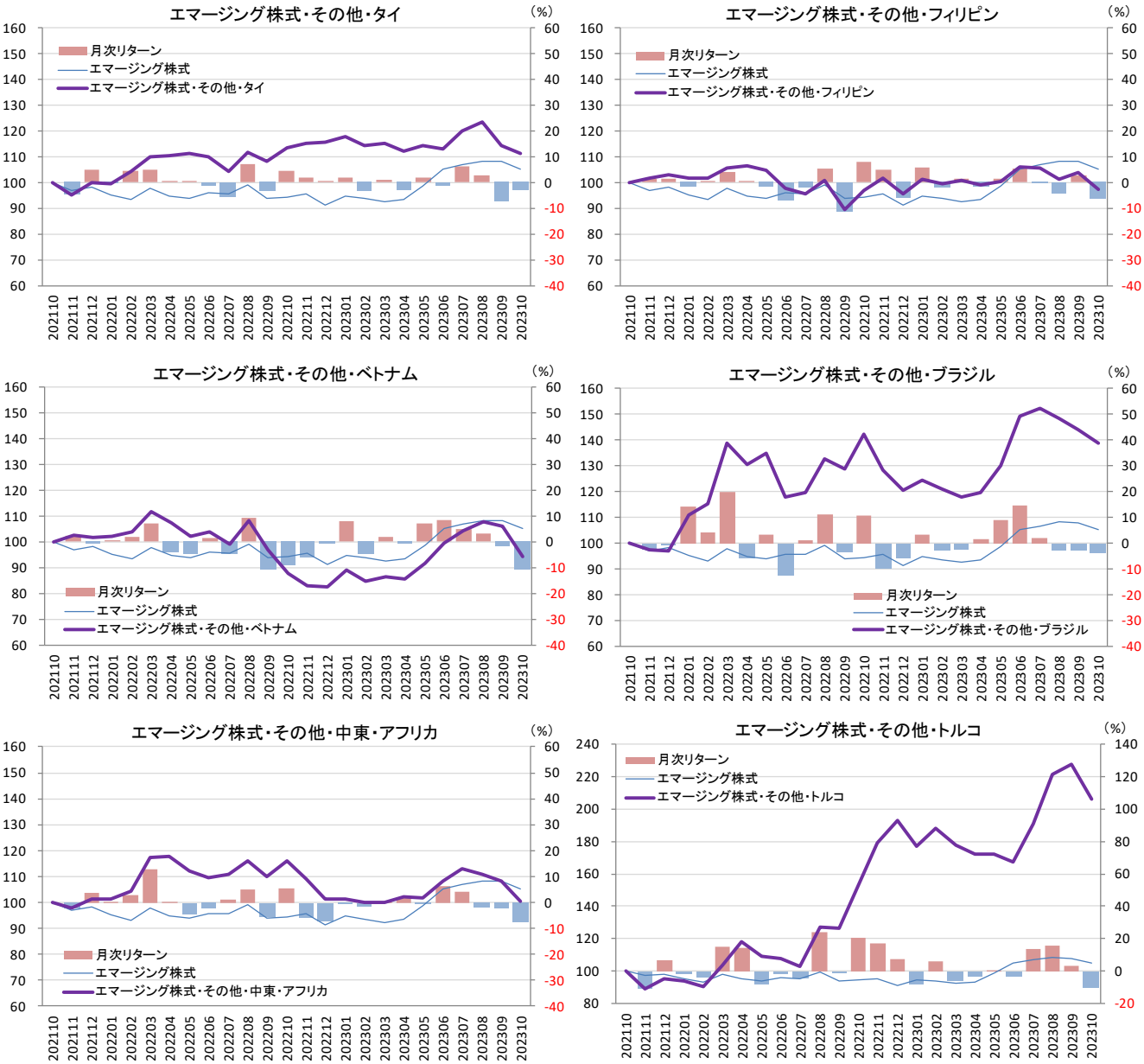


< 1 > パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

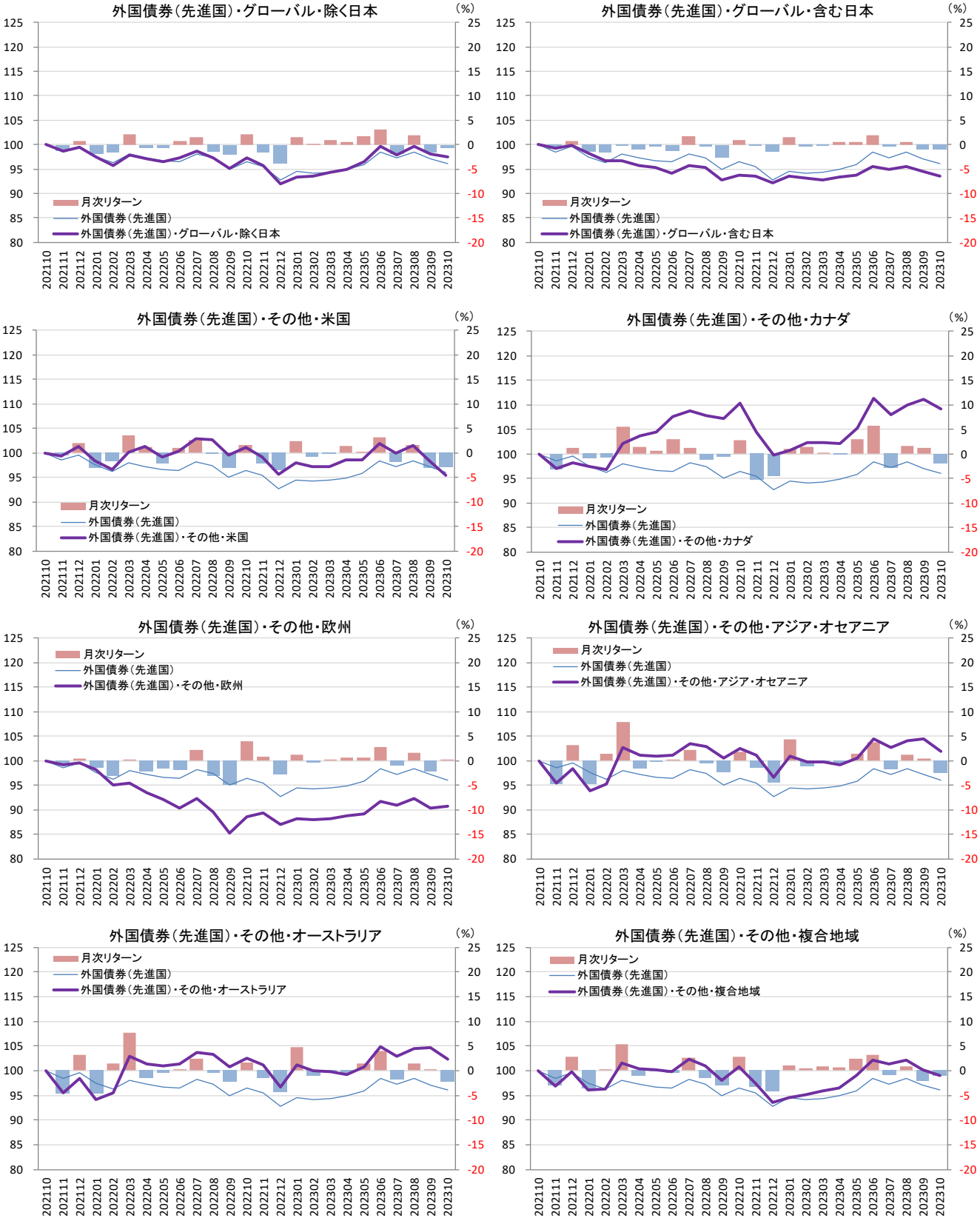


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

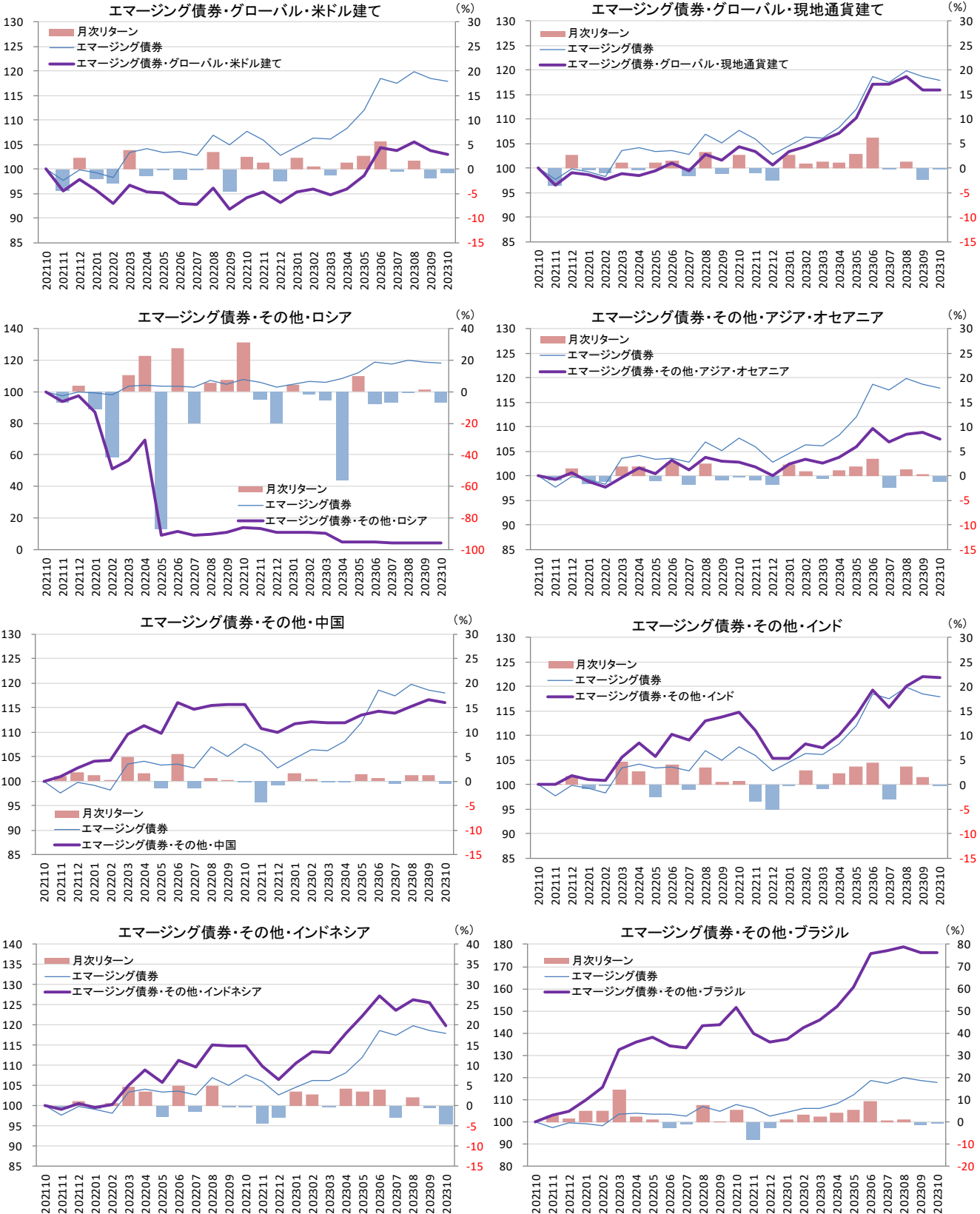


＜1＞パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

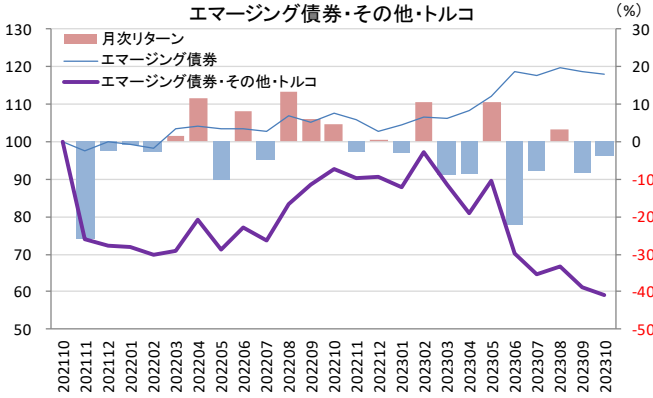
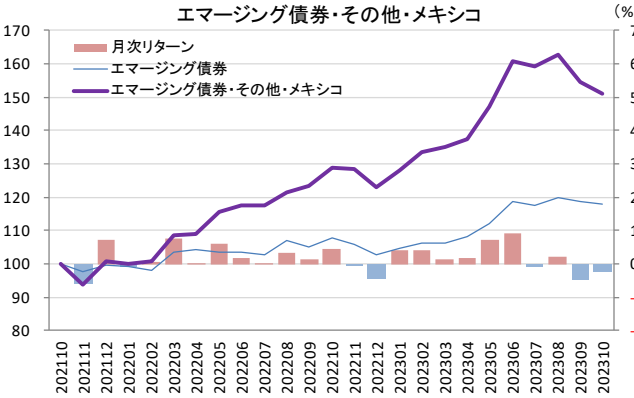


＜1＞パフォーマンス・サマリー

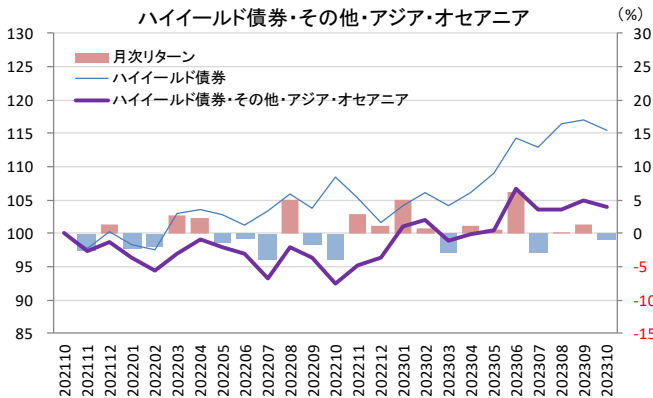
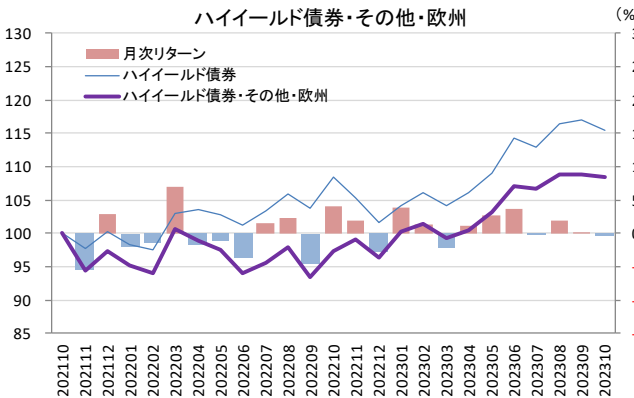
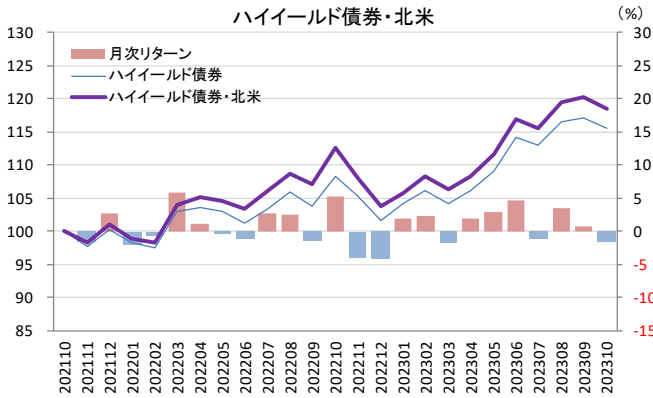
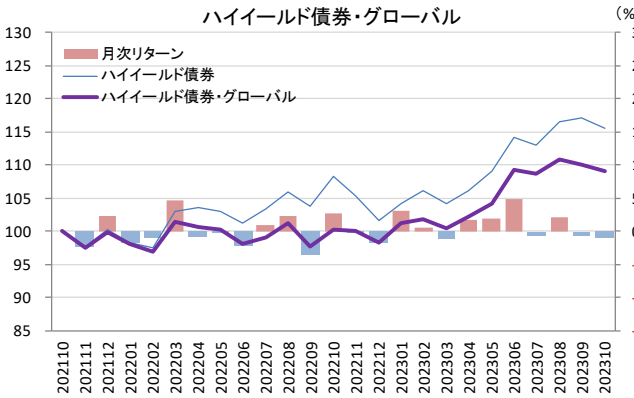
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

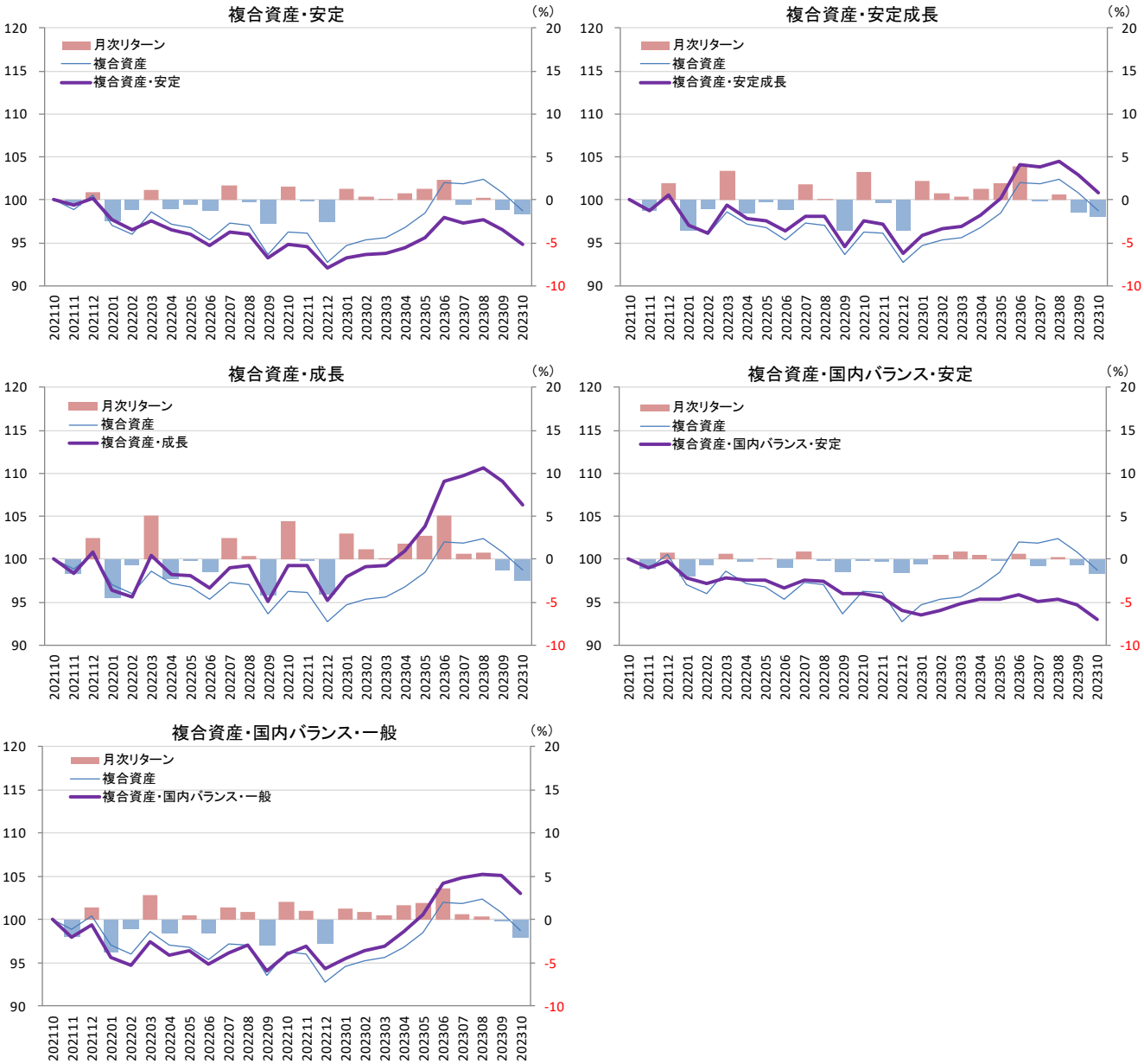


＜1＞パフォーマンス・サマリー

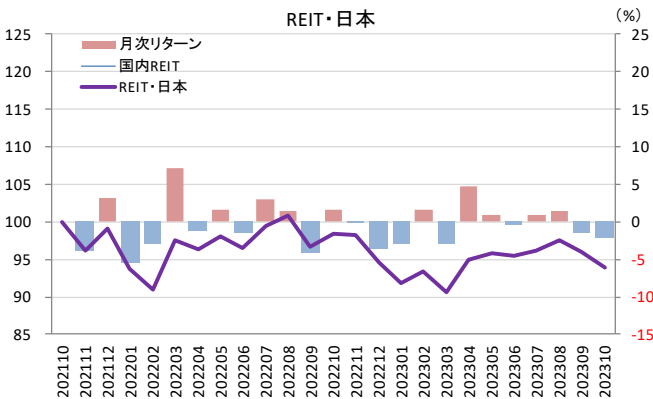
(3) リターン推移 (24 カ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

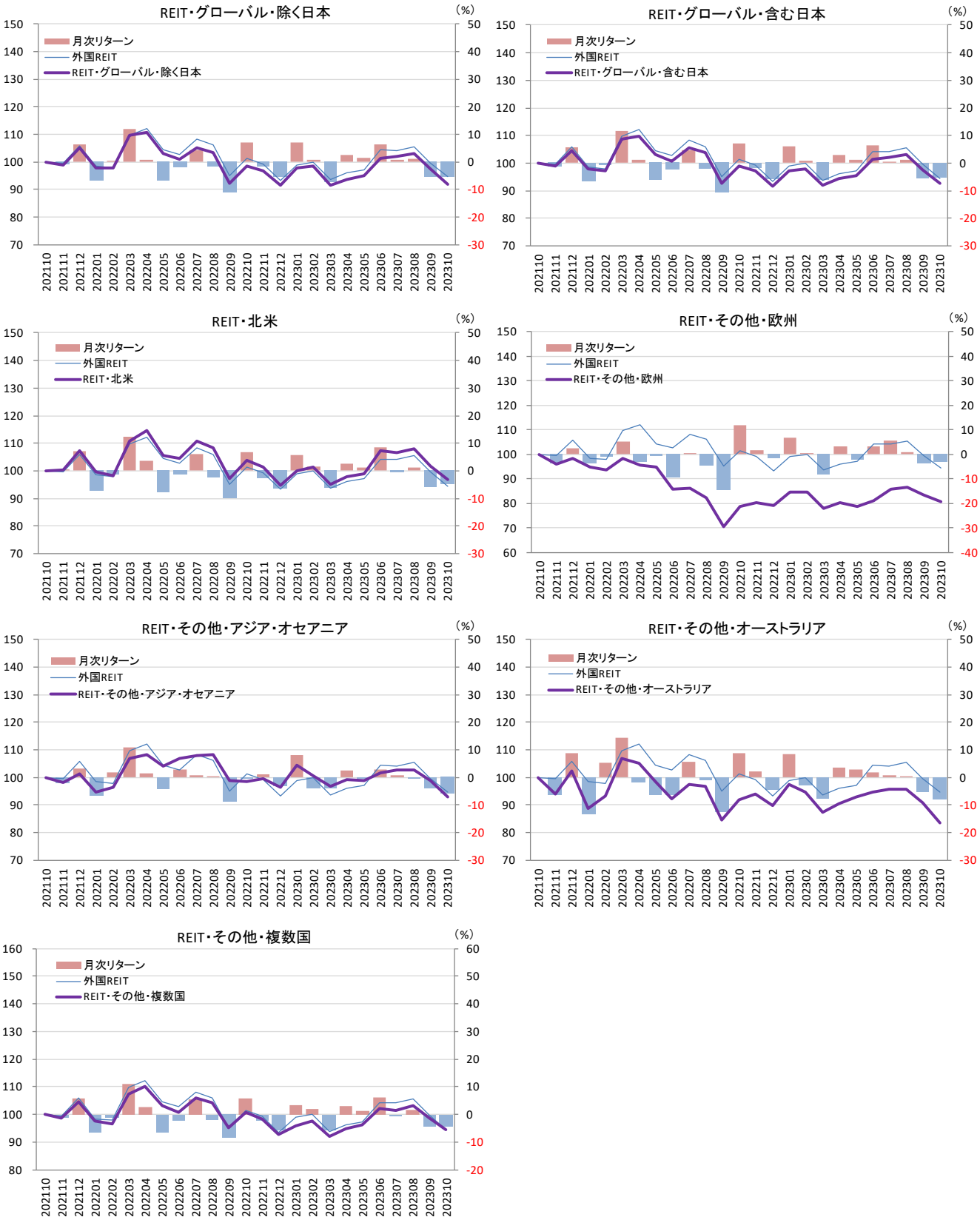


＜1＞パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

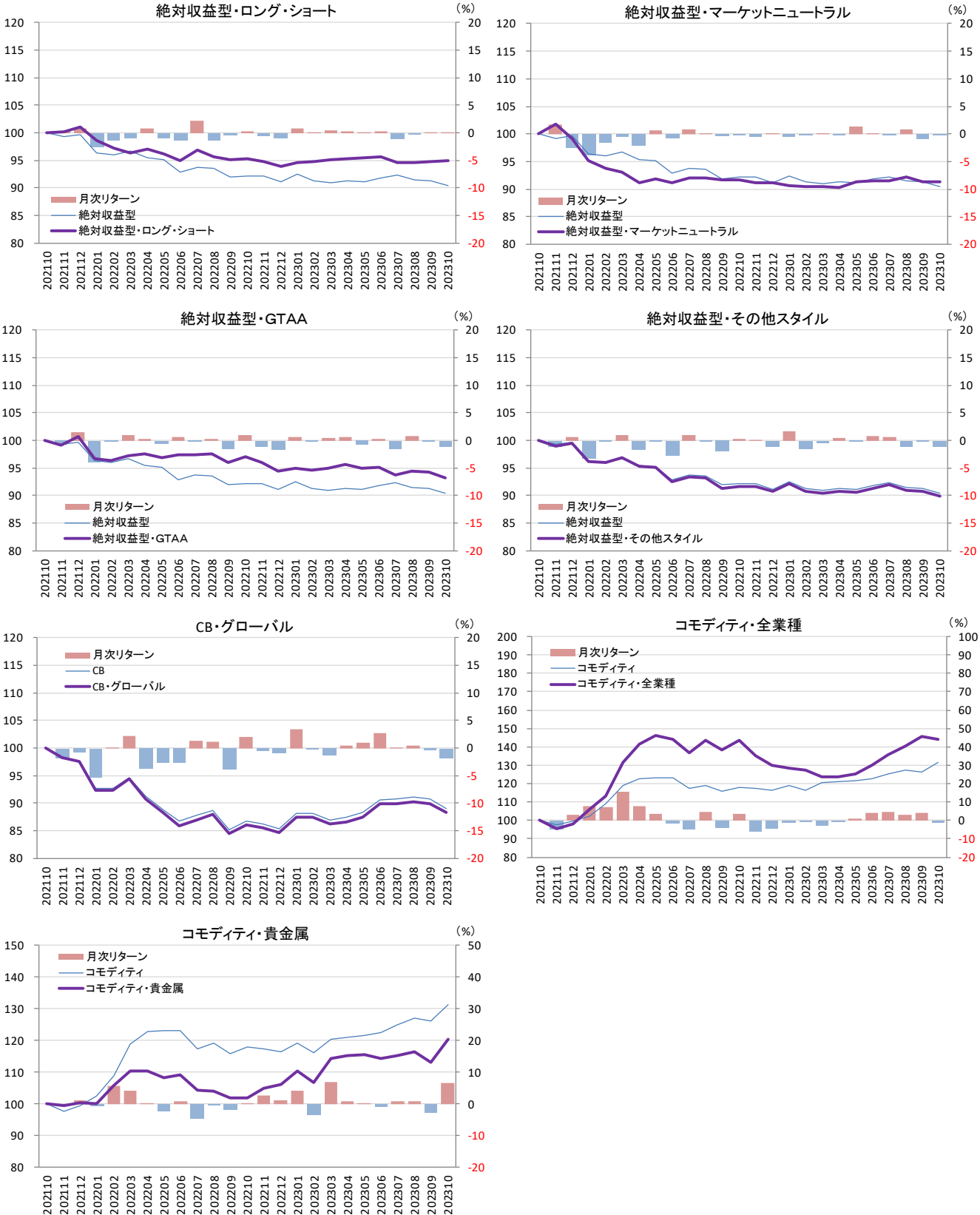


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	-2.98		
1	コモディティ	4.00	0.60	0.02
2	ハイイールド債券・その他	-0.48	0.18	-0.00
3	エマージング株式・BRICS	-2.15	0.05	-0.00
4	ハイイールド債券・グローバル	-0.93	0.26	-0.00
5	エマージング債券・その他	-0.61	0.52	-0.00
6	国内株式・業種特化	-4.38	0.08	-0.00
7	エマージング債券・グローバル	-0.54	0.65	-0.00
8	CB	-1.77	0.28	-0.01
9	絶対収益型	-0.95	1.17	-0.01
10	複合資産・国内バランス	-1.75	0.67	-0.01
11	複合資産・その他	-4.83	0.29	-0.01
12	REIT・その他	-6.04	0.27	-0.02
13	ハイイールド債券・北米	-1.53	1.53	-0.02
14	エマージング株式・グローバル	-2.59	1.06	-0.03
15	外国債券(先進国)・その他	-2.30	1.65	-0.04
16	国内株式・小型	-5.47	0.72	-0.04
17	国内債券・一般	-1.29	4.25	-0.06
18	REIT・日本	-2.15	2.70	-0.06
19	複合資産・安定	-1.72	3.79	-0.07
20	外国債券(先進国)・グローバル	-0.90	7.41	-0.07
21	エマージング株式・その他	-2.71	2.65	-0.07
22	複合資産・成長	-2.54	3.10	-0.08
23	REIT・グローバル	-5.30	1.69	-0.09
24	REIT・北米	-4.84	2.26	-0.11
25	複合資産・安定成長	-2.05	6.38	-0.13
26	国内株式・その他	-3.22	5.01	-0.15
27	国内株式・一般	-3.80	7.33	-0.28
28	外国株式(先進国)・その他	-2.88	14.23	-0.41
29	外国株式(先進国)・グローバル	-4.17	28.67	-1.20
	合計		100.00	-2.98

◆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
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	5.85				
1	外国株式(先進国)・グローバル	7.58		28.41		2.22
2	外国株式(先進国)・その他	10.55		13.49		1.41
3	国内株式・一般	15.17		7.05		1.00
4	国内株式・その他	16.88		4.82		0.79
5	複合資産・安定成長	3.31		6.56		0.23
6	複合資産・成長	7.06		2.95		0.21
7	エマージング株式・その他	10.77		2.20		0.20
8	エマージング株式・グローバル	12.70		1.06		0.12
9	エマージング債券・グローバル	9.95		0.68		0.06
10	コモディティ	11.43		0.58		0.06
11	ハイイールド債券・北米	5.18		1.47		0.06
12	エマージング債券・その他	9.03		0.52		0.04
13	ハイイールド債券・グローバル	8.82		0.28		0.02
14	ハイイールド債券・その他	11.54		0.21		0.02
15	国内株式・業種特化	14.34		0.08		0.01
16	複合資産・安定	0.07		4.16		0.01
17	CB	2.64		0.26		0.01
18	国内株式・小型	-0.06		0.77		0.01
19	エマージング株式・BRICS	5.37		0.05		0.00
20	外国債券(先進国)・グローバル	-0.08		7.46		-0.01
21	REIT・その他	-5.86		0.32		-0.02
22	複合資産・国内バランス	-1.88		0.78		-0.02
23	複合資産・その他	-7.11		0.33		-0.02
24	絶対収益型	-1.86		1.27		-0.03
25	外国債券(先進国)・その他	-2.51		1.75		-0.04
26	REIT・グローバル	-6.52		1.87		-0.12
27	国内債券・一般	-3.50		4.56		-0.17
28	REIT・北米	-6.95		2.53		-0.17
29	REIT・日本	-4.45		3.01		-0.17
	合計			100.00		5.85

◆計算定義

日次寄与度(%) = 日次リターン(%) × 前日の純資産額構成比

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

<2> リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別①

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	25.79	36.04	65.79	11.01	11.93	10.53	0.72	0.54	0.49
国内株式	38.45	46.58	119.06	13.27	15.54	15.27	0.87	0.51	0.54
一般	37.93	45.77	110.47	12.84	15.23	15.29	0.88	0.52	0.51
フリー	32.51	43.97	105.20	13.29	15.57	15.64	0.74	0.49	0.48
バリュー	57.91	49.73	126.76	11.75	14.54	14.47	1.40	0.58	0.59
小型	5.32	21.18	125.10	15.25	19.11	16.64	0.12	0.21	0.51
その他	46.73	52.72	136.08	14.13	15.61	15.39	0.97	0.57	0.58
日経225	40.17	51.61	144.98	16.04	16.85	16.19	0.74	0.52	0.58
TOPIX	52.36	52.66	129.04	12.51	14.58	14.68	1.21	0.61	0.59
JPX日経400	50.74	52.59	-	13.14	14.85	-	1.12	0.60	-
国内債券	-7.74	-6.33	-1.12	2.14	2.19	1.90	-1.22	-0.58	-0.05
一般	-7.74	-6.33	-1.12	2.14	2.19	1.90	-1.22	-0.58	-0.05
外国株式(先進国)	36.22	71.47	118.93	16.55	18.03	15.91	0.66	0.63	0.51
グローバル	29.86	66.66	121.69	16.85	18.14	15.86	0.54	0.59	0.52
除く日本	68.69	88.74	174.53	15.11	17.68	16.36	1.26	0.77	0.65
含む日本	19.44	59.42	106.91	17.74	18.59	15.97	0.35	0.53	0.47
その他	53.60	81.79	113.15	16.17	18.06	16.31	0.95	0.71	0.48
北米	111.88	128.71	182.22	15.45	18.90	17.47	1.84	0.95	0.63
米国	52.57	92.75	146.75	16.28	17.80	16.69	0.93	0.79	0.57
カナダ	39.41	30.82	14.68	13.14	18.53	15.96	0.89	0.30	0.09
欧州	46.05	48.11	72.19	15.64	17.70	16.06	0.86	0.46	0.35
ドイツ	59.11	51.05	-	19.34 ↓	21.91	-	0.87	0.39	-
イギリス	64.71	24.86	-	13.28	17.17	-	1.37	0.27	-
アジア・オセアニア	15.97	25.64	61.27	11.43	14.87	14.55	0.45	0.32	0.34
オーストラリア	54.72	34.66	42.08	19.80	23.91	19.72	0.79	0.26	0.18
ニュージーランド	17.98	49.91	154.82	15.88	17.93	17.11	0.36	0.47	0.57
複合地域	243.31	64.92	44.45	27.98	33.21	26.65	1.82	0.32	0.14
エマージング株式	42.58	58.44	79.12	11.73	17.48	16.17	1.07	0.55	0.37
グローバル	29.32	58.51	59.92	12.90	17.39	16.37	0.70	0.56	0.29
BRICS	10.43	20.47	50.38	14.80	20.41	19.05	0.23	0.19	0.22
その他	49.84	60.46	89.60	11.71	17.96	16.41	1.24	0.55	0.40
欧州	-17.36	-29.37	-37.10	35.44	33.09	27.15	-0.17	-0.20	-0.17
ロシア	-87.32	-87.54	-86.30	57.21	48.23	38.46	-0.87	-0.71	-0.47
アジア・オセアニア	17.89	33.29	50.73	13.80	17.07	15.83	0.41	0.35	0.27
中国	-18.34	41.58	98.50	19.25 ↓	20.73	21.07	-0.34	0.35	0.34
インド	102.51	104.14	237.36	15.56	22.92	21.29 ↓	1.71	0.67	0.61
インドネシア	66.38	39.51	36.32	18.22	26.44	23.41	1.02	0.26	0.14
タイ	42.16	-0.21	27.05	17.00	20.78	17.80	0.73	-0.00	0.14
フィリピン	19.01	0.84	-0.14	16.83	20.35	17.95	0.36	0.01	0.00
ベトナム	68.87	49.90	123.40	22.99	25.91	21.50	0.83	0.33	0.39
韓国	8.19	28.08	21.71	25.03	25.53	20.90	0.11	0.20	0.10
香港	6.02	3.34	23.87	21.58	21.34	19.67	0.09	0.03	0.11
中南米	91.49	40.28	33.72	26.00	29.78	26.38	0.93	0.24	0.11
ブラジル	56.74	6.30	-9.08	28.62	32.53	31.73	0.57	0.04	-0.03
メキシコ	134.25	74.43	43.67	23.15	26.93 ↓	23.75	1.42	0.44	0.16
中東・アフリカ	52.85	41.14	52.57	15.37 ↑	18.77	16.82	0.99	0.38	0.26
トルコ	168.41	107.50	7.50	33.86	33.93	31.84	1.15	0.46	0.02
複合地域	27.75	40.24	35.62	14.89	17.33	15.55	0.57	0.41	0.20

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

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

<2> リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別②

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	25.79	36.04	65.79	11.01	11.93	10.53	0.72	0.54	0.49
外国債券(先進国)	2.11	6.75	11.34	4.62	4.77	5.27	0.16	0.28	0.21
グローバル	-0.19	5.80	12.61	4.09	4.08	4.70	-0.01	0.29	0.26
除く日本	2.28	9.75	15.55	5.26	4.57	5.34	0.15	0.42	0.28
含む日本	-2.23	2.19	10.25	3.52	4.33	4.42 ↓	-0.20	0.11	0.23
その他	9.98	10.71	11.84	7.38	7.78	7.50	0.44	0.27	0.15
北米	-3.89	1.81	16.05	4.66 ↑	5.18 ↑	4.71	-0.28	0.08	0.32
米国	10.58	9.90	27.05	6.91 ↑	7.58	6.76	0.50	0.26	0.36
カナダ	23.51	22.47	15.46	8.54	8.01 ↑	8.65	0.86	0.52	0.17
欧州	-8.97	-7.08	-1.38	6.16	5.42	6.58	-0.50	-0.26	-0.02
イギリス	14.94	13.65	-	10.16	9.57	-	0.47	0.27	-
アジア・オセアニア	13.20	13.90	13.64	9.30	9.85	9.10	0.46	0.27	0.14
オーストラリア	14.12	14.43	12.81	9.29	9.91	9.17	0.49	0.28	0.13
ニュージーランド	-1.34	4.23	-	9.19	9.28	-	-0.05	0.09	-
複合地域	4.90	15.26	18.14	7.41	6.19	6.90	0.22	0.47	0.25
エマージング債券	30.67	25.02	31.24	7.53	10.43	10.67	1.24	0.44	0.26
グローバル	18.83	14.75	19.25	8.04 ↓	11.73	11.20	0.74	0.24	0.16
米ドル建て	16.38	11.90	18.71	8.57 ↓	12.31	11.59	0.61	0.19	0.15
現地通貨建て	25.88	23.74	12.67	7.31	10.29 ↓	10.28	1.09	0.43	0.12
その他	46.67	39.18	46.13	8.73	10.31	11.26	1.56	0.67	0.34
ロシア	-95.04	-95.30	-96.07	73.50	58.59	44.95	-0.86	-0.78	-0.61
アジア・オセアニア	10.59	19.25	37.43	5.38	6.78	6.82	0.64	0.53	0.48
中国	37.26	36.19	-	6.04	6.25	-	1.85	1.03	-
インド	37.17	50.80	99.12	8.29	9.45	9.59 ↓	1.34	0.91	0.75
インドネシア	43.53	67.73	63.60	9.25	14.43	14.44 ↓	1.39	0.76	0.35
ブラジル	82.84	26.39	44.86	16.49	17.82 ↓	18.40	1.35	0.27	0.21
メキシコ	66.71	84.31	54.41	12.72	16.01	15.41	1.46	0.81	0.29
トルコ	-42.97	-48.42	-77.79	31.05	29.45 ↓	28.03	-0.55	-0.42	-0.50
複合地域	19.56	19.48	9.37	10.15 ↑	11.73	11.74	0.61	0.31	0.08
ハイイールド債券	38.57	31.57	56.59	7.97	11.51	10.42	1.44	0.49	0.44
グローバル	26.48	19.73	39.93	7.28	11.19	10.35	1.12	0.33	0.33
北米	44.64	37.82	69.58	8.38	11.63	10.44	1.57	0.57	0.52
その他	23.82	16.18	28.79	8.90	12.41	11.32	0.83	0.25	0.23
欧州	27.70	17.68	29.26	9.86	13.18	12.06	0.86	0.25	0.22
アジア・オセアニア	9.91	9.54	28.33	9.05	11.72	10.19	0.36	0.16	0.25
複合地域	26.83	30.76	53.35	7.41	8.84	8.81	1.12	0.63	0.50
複合資産	13.45	17.54	40.52	6.50	7.19	7.12	0.67	0.46	0.49
安定	2.49	6.75	22.27	4.52	4.94	5.28	0.19	0.27	0.39
安定成長	18.00	22.78	47.54	6.89	7.70	7.51	0.83	0.55	0.53
成長	33.78	40.68	84.90	9.22	10.70	10.41	1.11	0.66	0.61
国内バランス	-1.10	-3.67	3.53	3.11	3.92	4.88	-0.11	-0.18	0.07
安定	-2.99	-5.63	6.90	2.98	3.78	3.07	-0.33	-0.30	0.22
一般	20.29	23.53	38.29	6.68	7.96	8.69	0.96	0.55	0.38
その他	-12.42	8.16	-	18.61	17.50	-	-0.23	0.09	-

※[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 カ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	25.79	36.04	65.79	11.01	11.93	10.53	0.72	0.54	0.49
国内REIT	23.10	22.88	68.11	10.91 ↓	14.93	12.16	0.66	0.28	0.44
日本	23.10	22.88	68.11	10.91 ↓	14.93	12.16	0.66	0.28	0.44
外国REIT	44.55	30.63	87.56	17.94	19.17	16.29	0.73	0.29	0.40
グローバル	41.45	21.33	64.26	18.05	19.80	16.49	0.68	0.20	0.31
除く日本	44.48	27.31	83.88	18.79	20.46	16.90	0.70	0.24	0.37
含む日本	40.57	19.76	61.13	17.75	19.56	16.35	0.68	0.19	0.30
北米	51.43	40.34	111.27	18.64	19.08	16.63	0.80	0.37	0.47
その他	20.87	18.11	68.35	15.45	19.36	15.81	0.42	0.18	0.34
欧州	11.21	-10.44	13.83	19.47	21.04	18.09	0.19	-0.10	0.07
アジア・オセアニア	17.15	20.62	74.13	14.14	17.88	15.06	0.39	0.22	0.38
オーストラリア	26.26	9.78	41.63	24.00	29.42	22.86	0.34	0.07	0.16
複合地域	53.94	6.44	21.04	18.49	24.83	20.07	0.84	0.05	0.10
複数国	45.50	38.37	123.86	16.29	17.64	14.90	0.82	0.38	0.56
その他									
絶対収益型	-4.95	-4.53	-4.25	3.64	3.23	2.73	-0.45	-0.27	-0.15
ロング・ショート	-5.12	-5.67	-10.31	3.12	3.28	3.03	-0.55	-0.34	-0.35
マーケットニュートラル	-10.95	-7.16	20.57	4.07 ↓	4.05	5.42	-0.92	-0.35	0.35
GTAA	3.37	8.68	7.80	4.34	4.47	3.46	0.26	0.38	0.22
その他スタイル	-4.32	-4.71	-3.89	4.05	3.50	2.99 ↓	-0.35	-0.26	-0.13
CB	2.46	10.80	20.26	7.37	8.81	7.61	0.11	0.24	0.25
アジア・オセアニア	37.70	55.67	104.27	9.48	12.20	11.26	1.19	0.76	0.66
日本	2.37	-2.18	17.11	4.35	4.82	5.12	0.19	-0.08	0.31
グローバル	1.61	10.31	18.81	7.61	9.04	7.70	0.07	0.22	0.23
コモディティ	57.62	68.28	19.36	10.45 ↓	11.25	12.04	1.57	0.98	0.15
全業種	136.71	77.22	28.35	16.18 ↓	19.23	16.90	2.06	0.63	0.15
貴金属	17.95	66.41	39.34	12.81	12.52	11.54	0.44	0.86	0.29
エネルギー	289.48	97.69	33.39	27.08 ↓	37.18	31.63	2.12	0.39	0.09
その他コモディティ	107.50	59.54	28.93	15.29	18.98	17.00	1.80	0.52	0.15

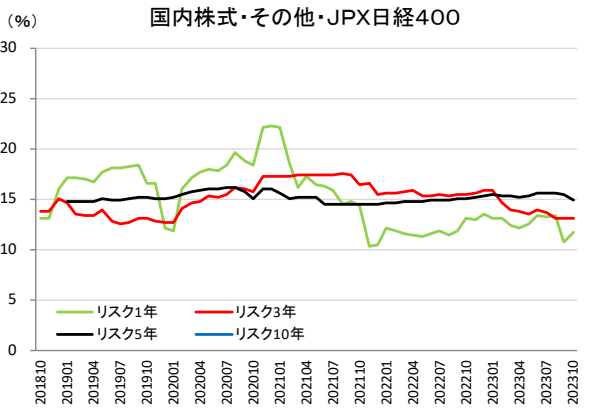
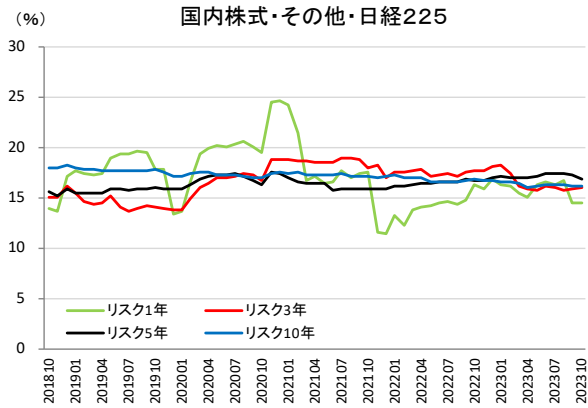
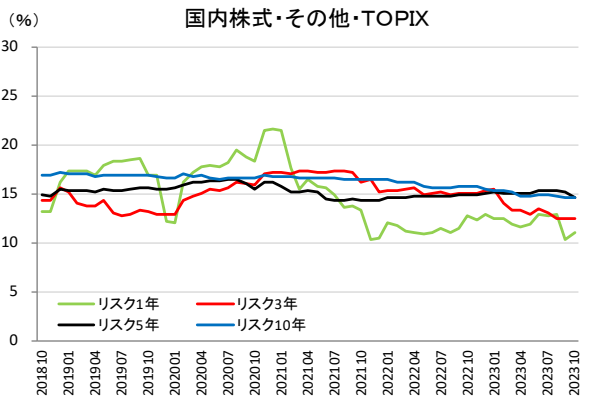
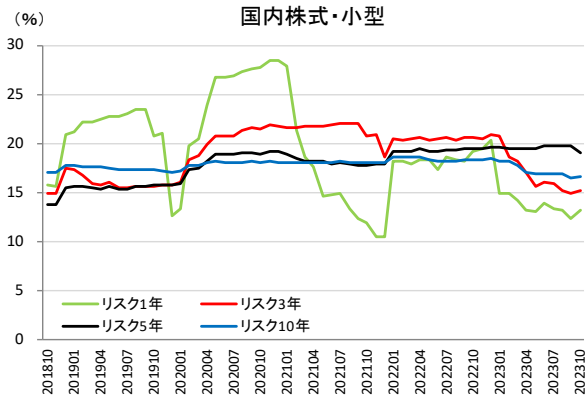
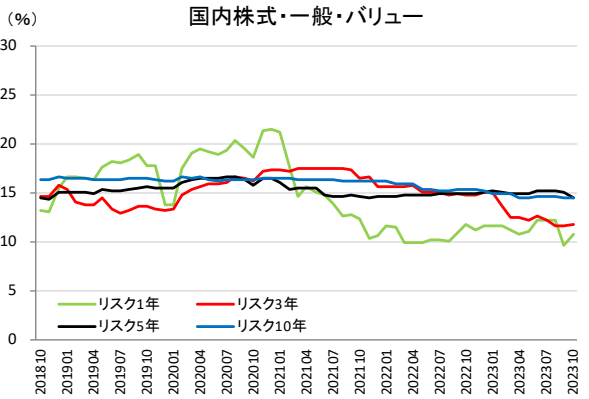
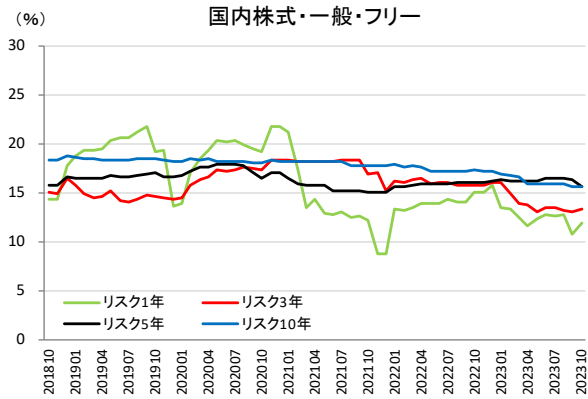
※[色塗りの基準] 累積リターン> 総合、リスク<総合、シャープ・レシオ>=0.5
[リスクの矢印] 直近 6 ヶ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

＜2＞リスク・サマリー

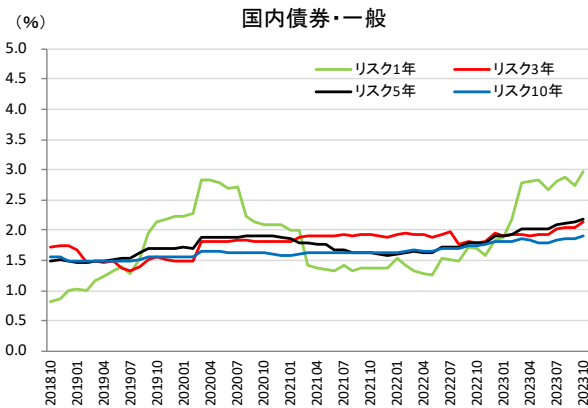
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

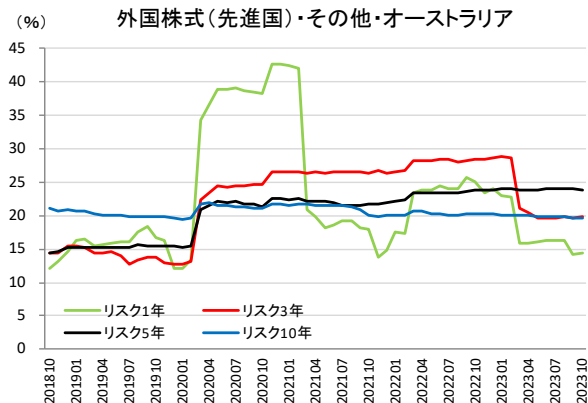
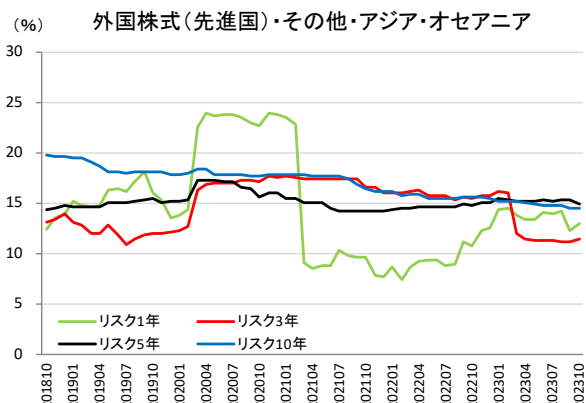
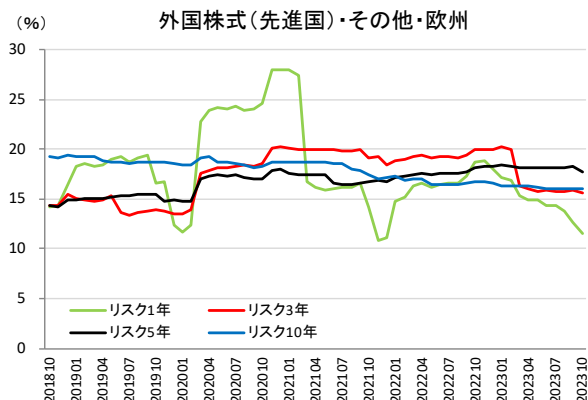
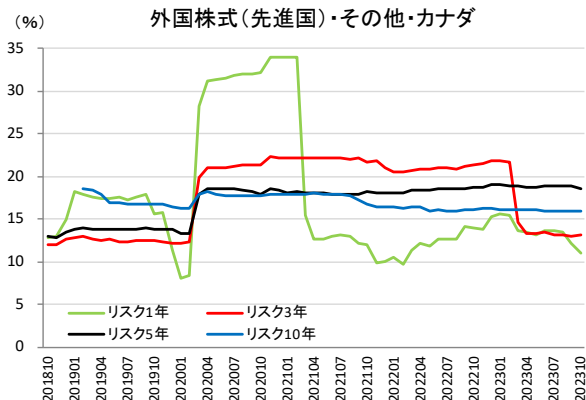
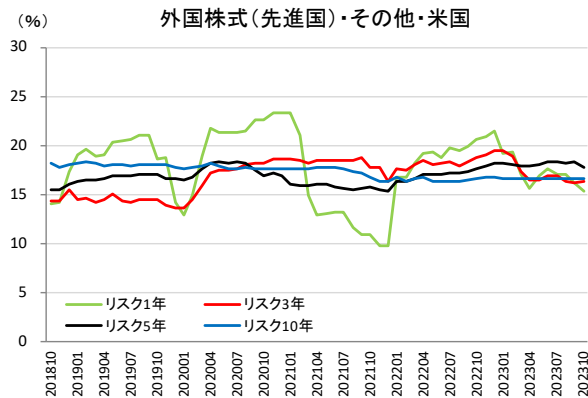
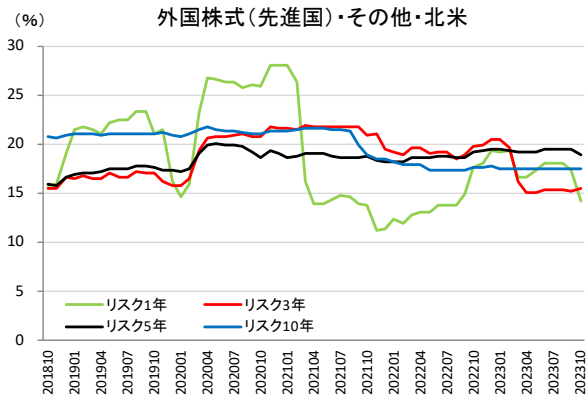
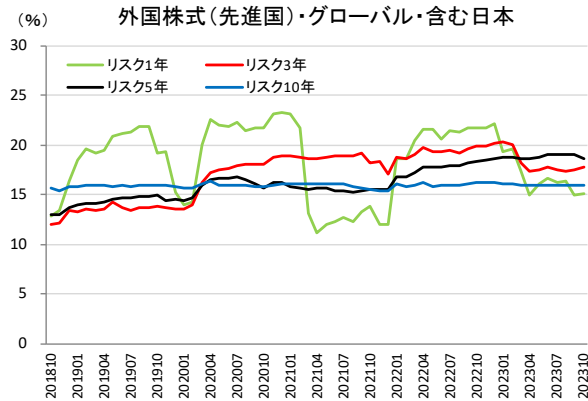
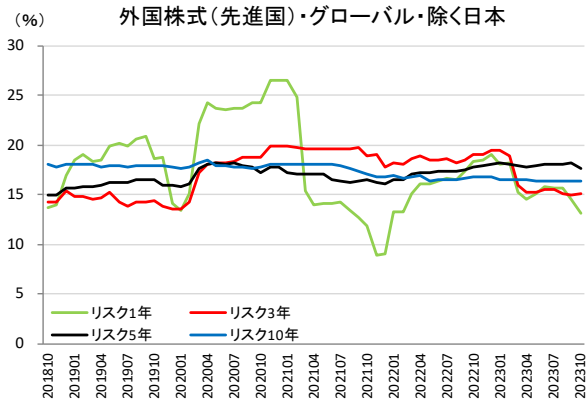


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

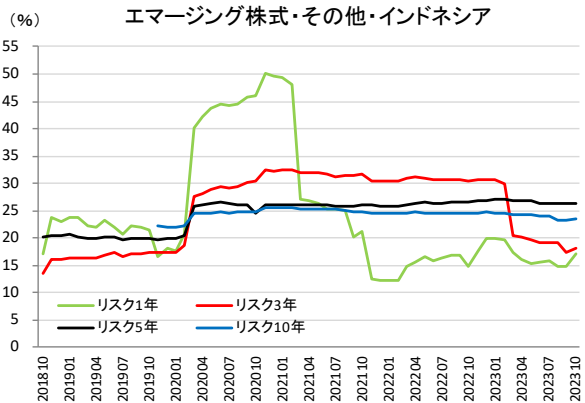
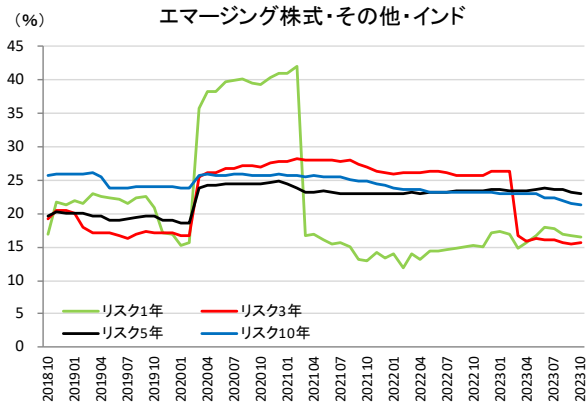
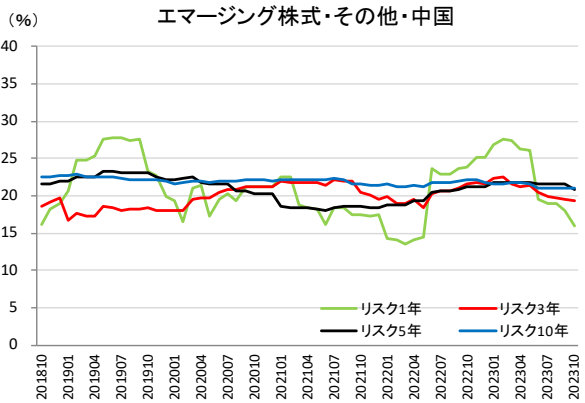
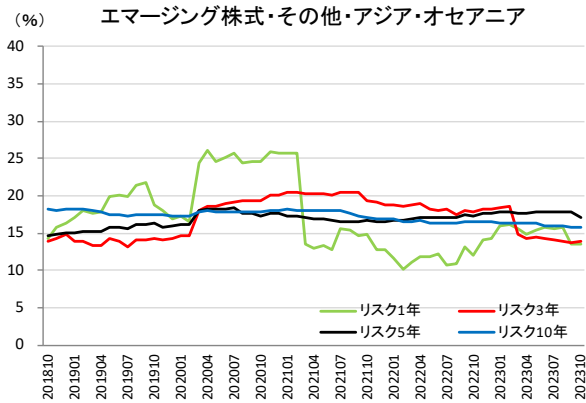
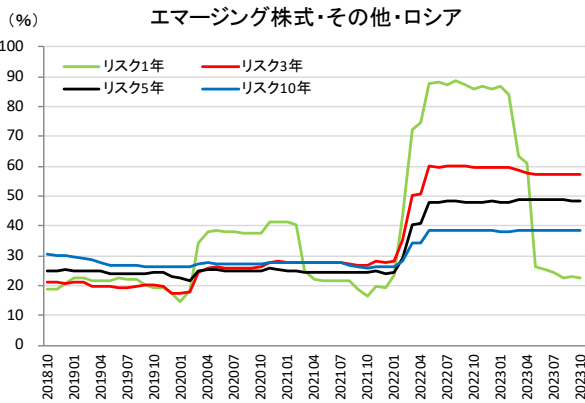
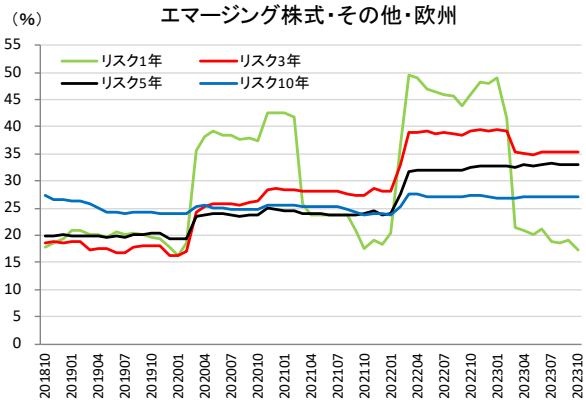
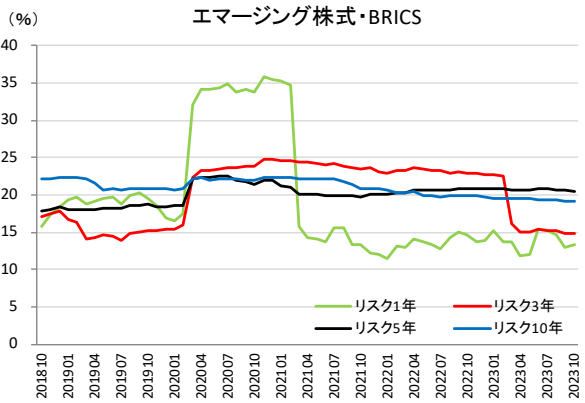
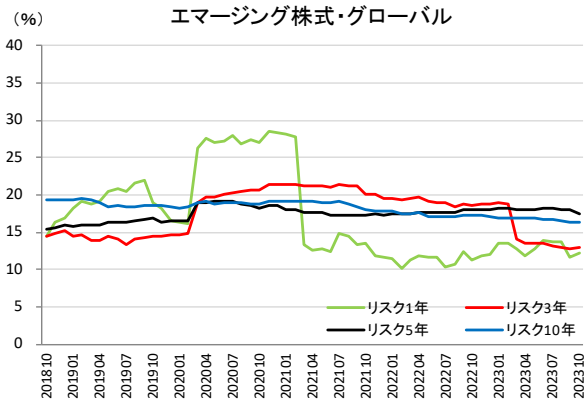


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

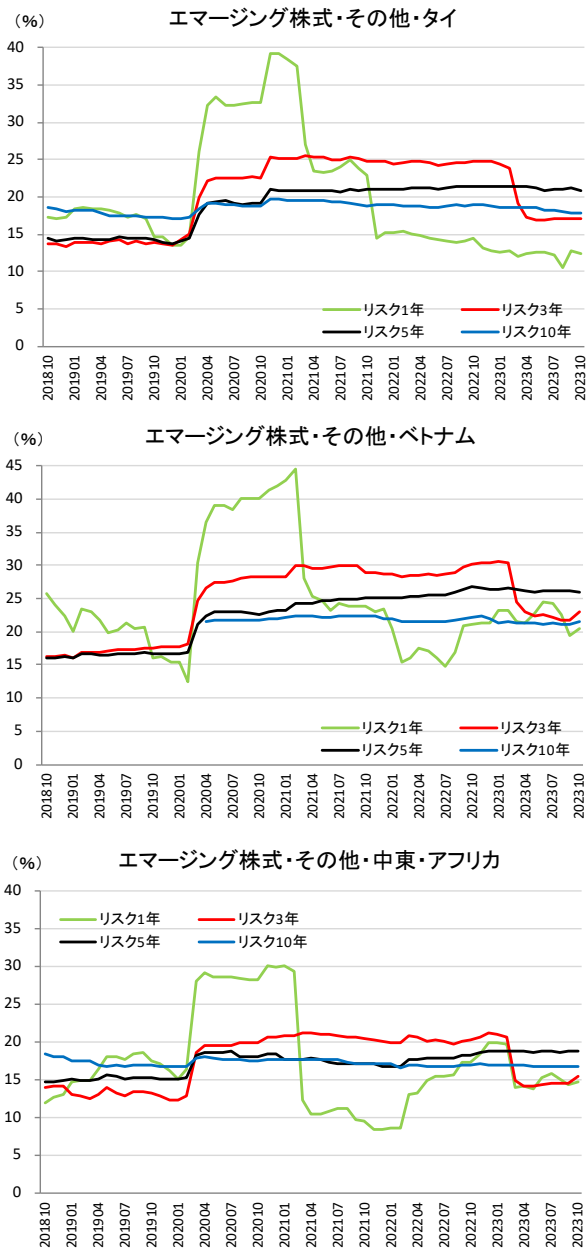


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

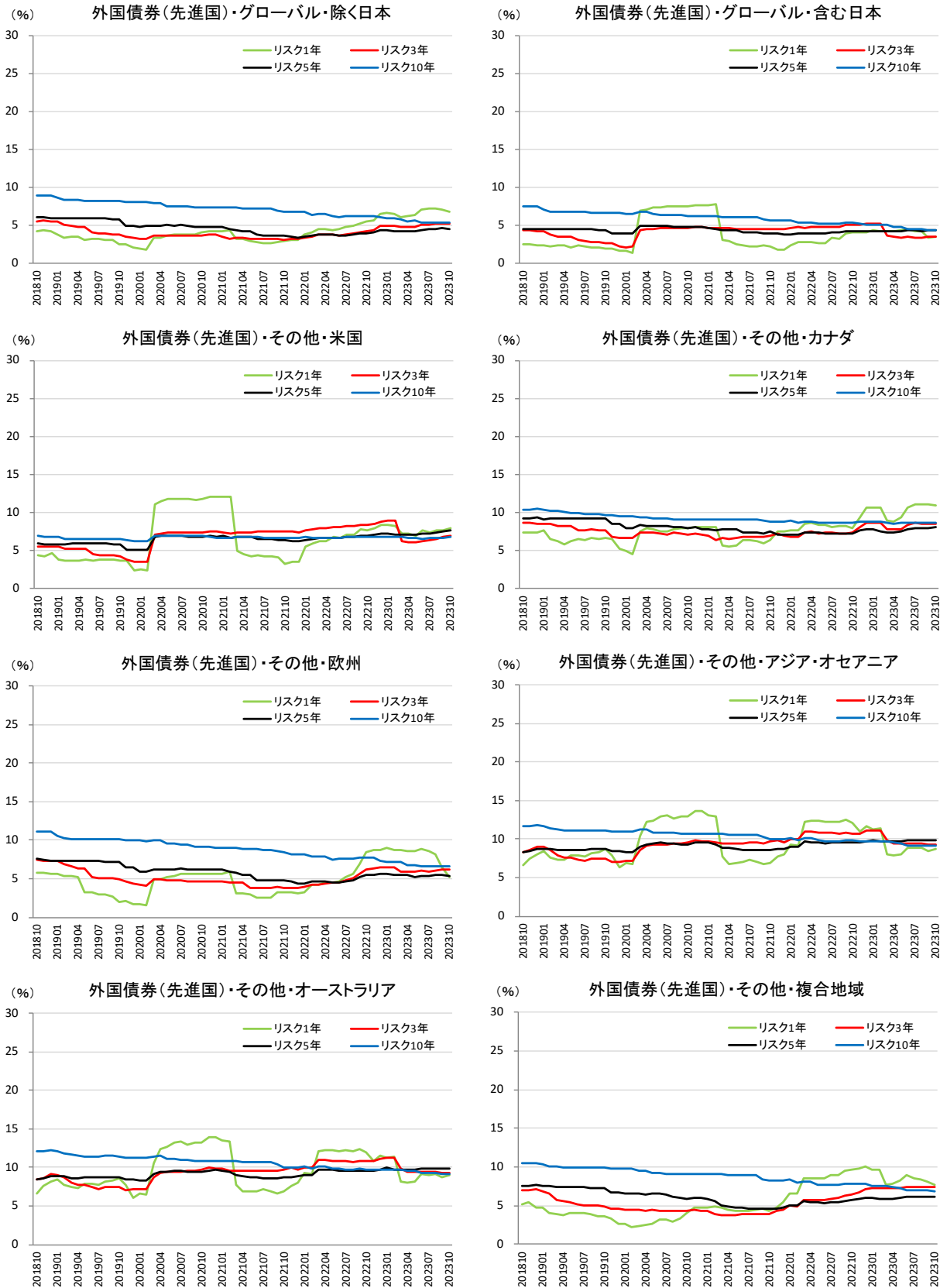


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

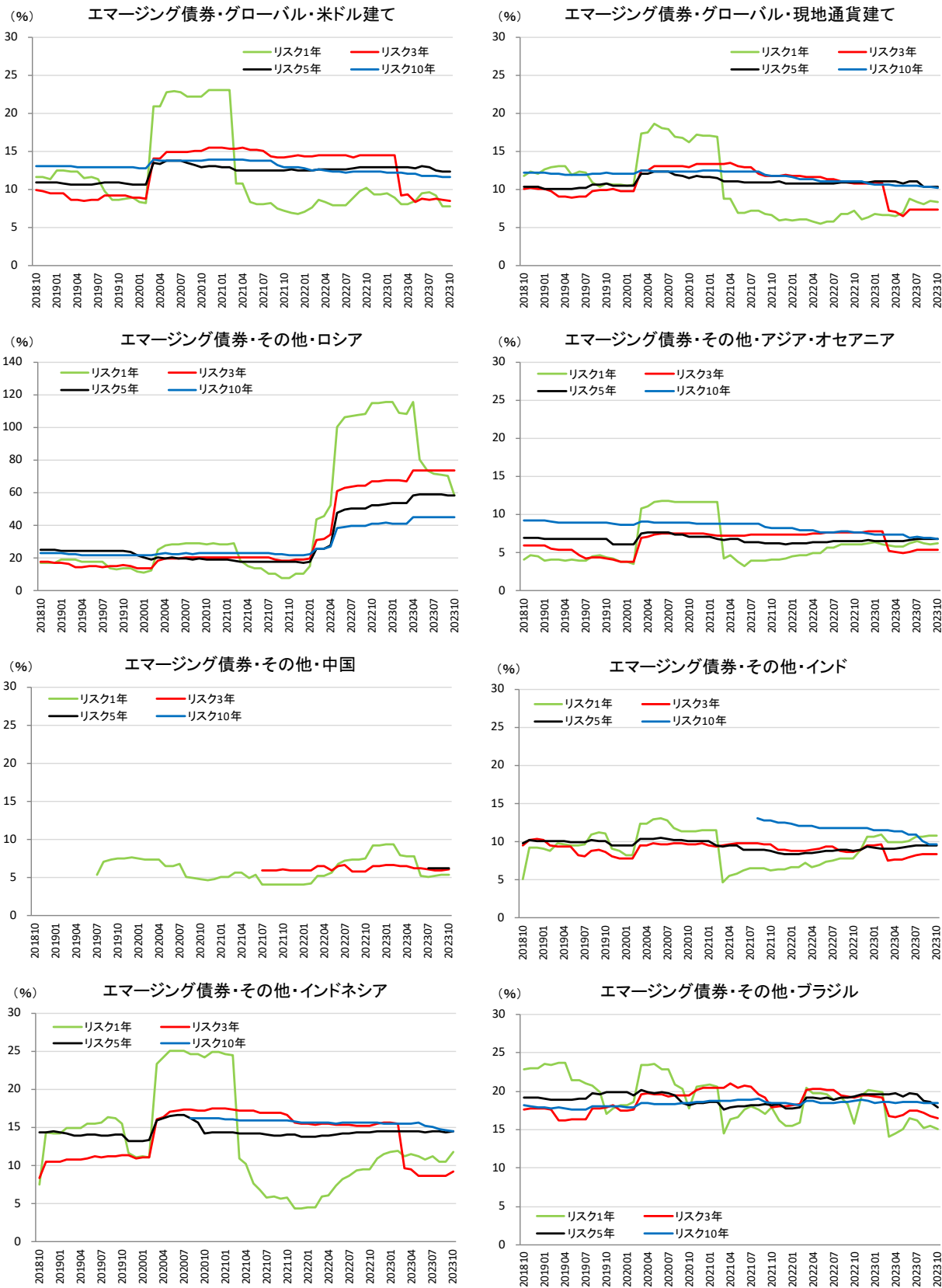


＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

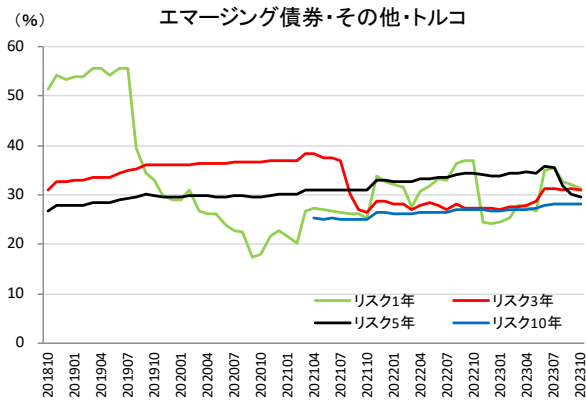
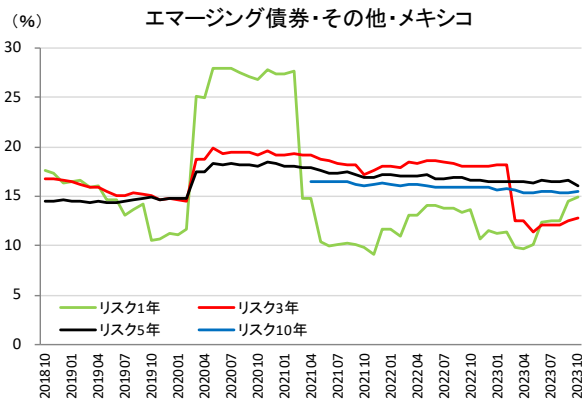


<2> リスク・サマリー

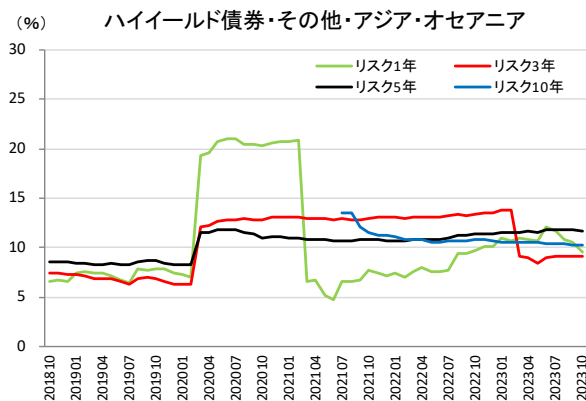
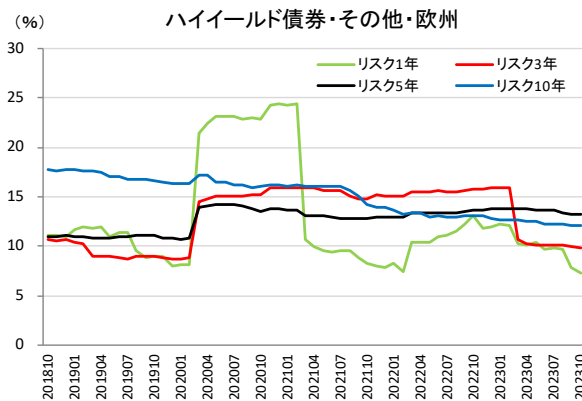
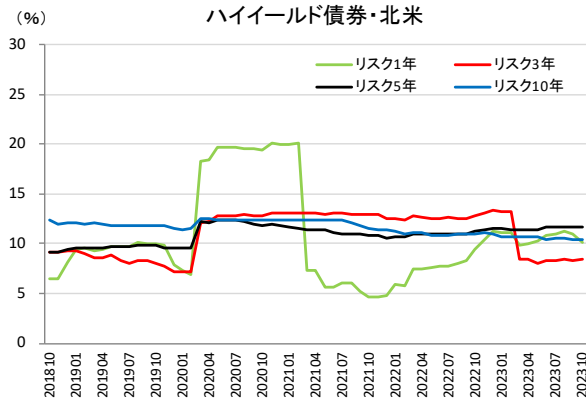
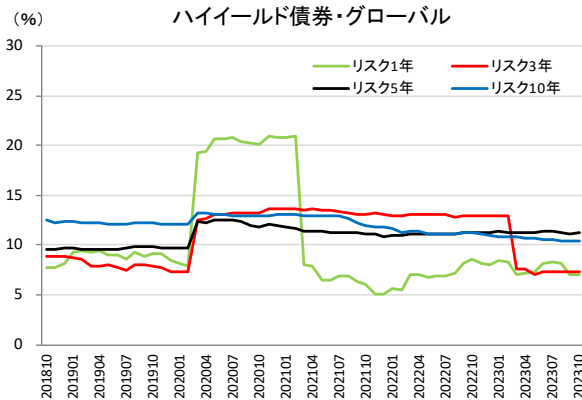
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

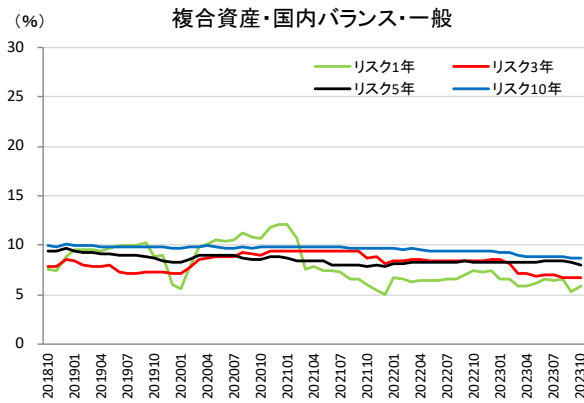
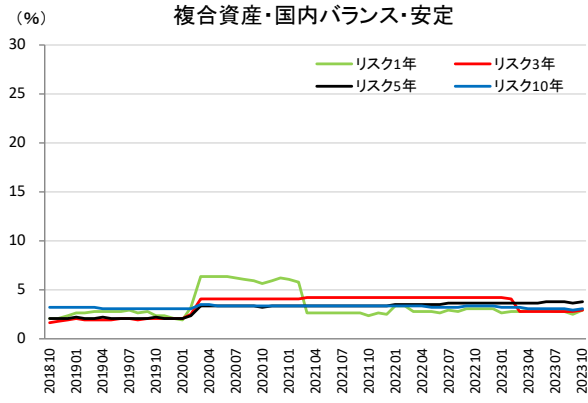
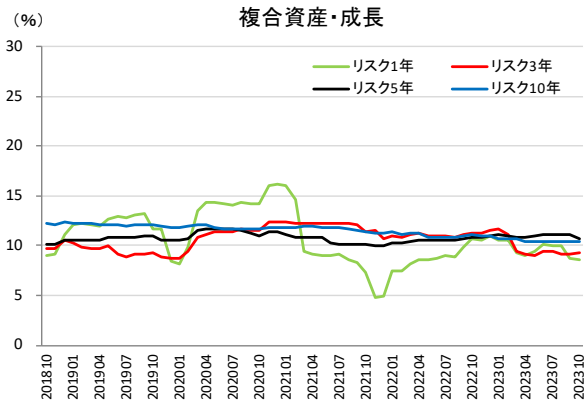
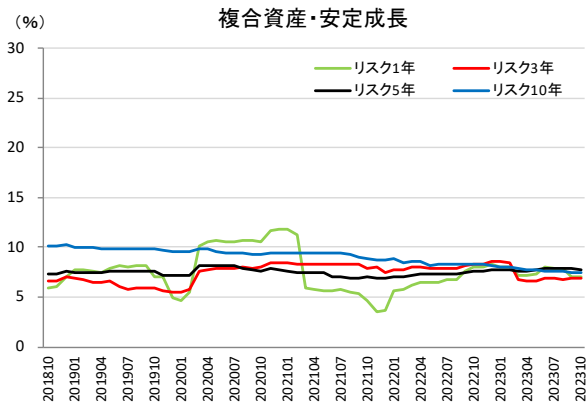
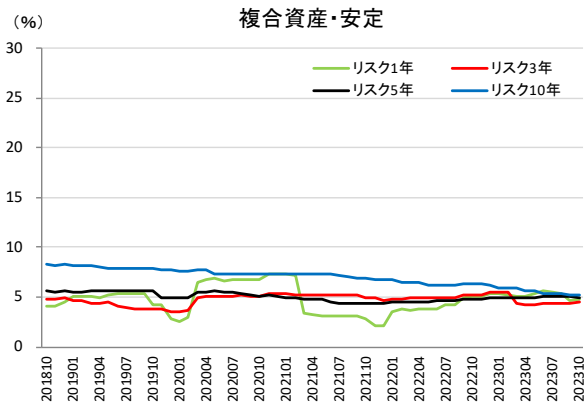


＜2＞リスク・サマリー

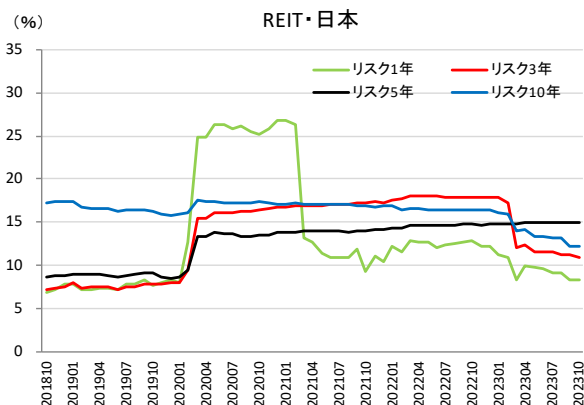
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]



＜2＞リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

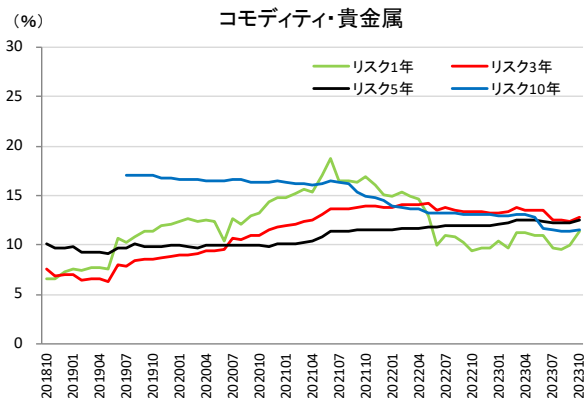
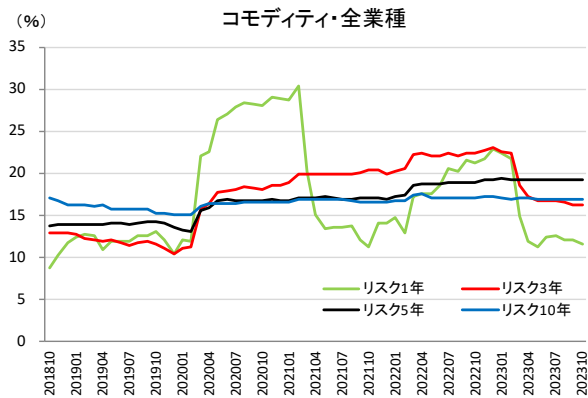
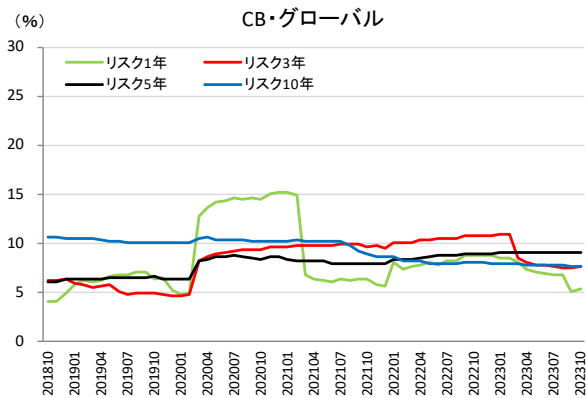
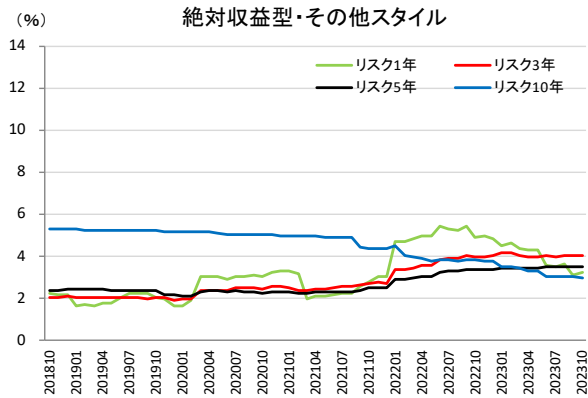
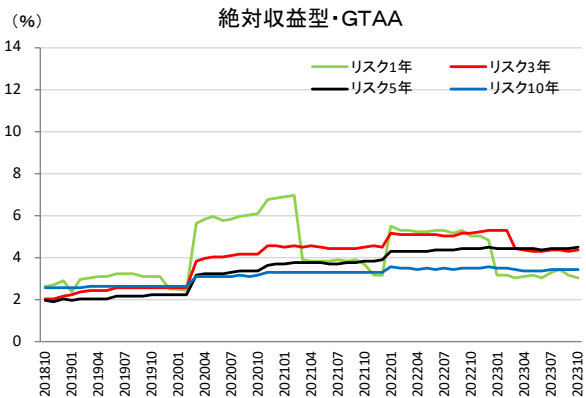
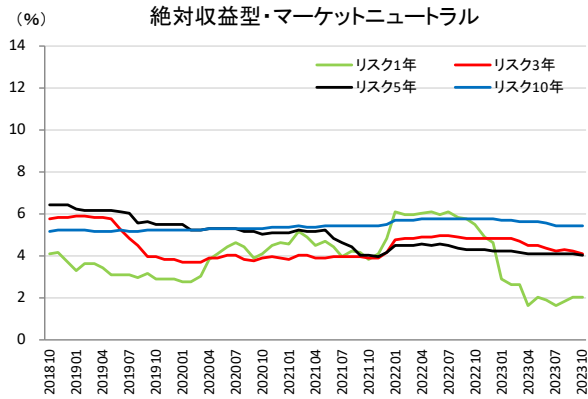
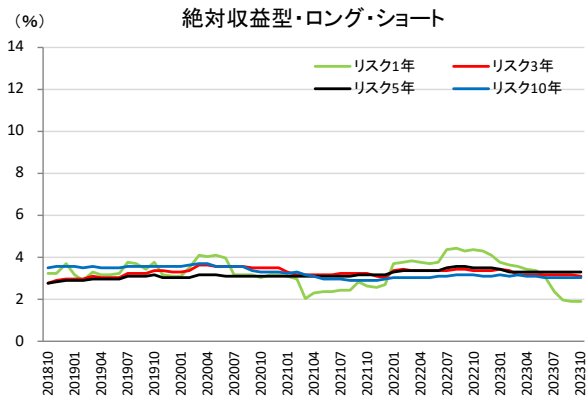


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	11,866	32,744	47,136	79,655
国内株式	3,181	7,045	8,384	10,546
一般	1,252	3,002	5,281	7,052
フリー	525	1,342	1,549	2,421
バリュー	722	1,656	3,727	4,626
小型	58	124	385	469
その他	1,838	3,838	2,635	2,899
日経225	1,201	2,283	926	301
TOPIX	412	1,116	1,476	2,084
JPX日経400	31	63	32	9
国内債券	1,472	1,912	3,099	741
一般	1,472	1,912	3,099	741
外国株式(先進国)	5,084	13,695	18,335	34,232
グローバル	2,625	7,699	11,083	18,797
除く日本	1,072	2,173	3,724	7,943
含む日本	1,552	5,526	7,359	10,854
その他	2,459	5,996	7,252	15,435
北米	60	155	314	1,056
米国	2,443	5,952	7,248	14,975
カナダ	-2	-5	-14	-23
欧州	-17	-36	-103	-218
ドイツ	0	0	-1	-2
イギリス	0	0	-1	0
アジア・オセアニア	-1	-1	-3	-5
オーストラリア	-20	-55	-174	-334
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	-3	-12	-14	-12
エマージング株式	907	3,455	5,809	8,008
グローバル	97	228	397	784
BRICS	-1	-10	-21	-37
その他	811	3,238	5,433	7,260
欧州	0	0	2	2
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	35	-143	-347	-397
中国	-40	-187	-283	-398
インド	817	3,569	6,096	7,800
インドネシア	2	13	23	54
タイ	0	-2	-3	-6
フィリピン	-1	-1	0	0
ベトナム	-5	-11	-6	274
韓国	0	0	0	-4
香港	0	1	1	0
中南米	0	-2	-7	-8
ブラジル	-3	-3	-38	-39
メキシコ	0	0	0	-1
中東・アフリカ	-4	-8	-12	-17
トルコ	-3	-1	-5	-12
複合地域	14	14	13	13

<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	11,866	32,744	47,136	79,655
外国債券(先進国)	403	3,476	5,661	10,854
グローバル	474	3,318	5,271	9,368
除く日本	425	1,228	1,720	2,694
含む日本	49	2,090	3,552	6,675
その他	-70	158	390	1,486
北米	0	12	20	35
米国	13	367	864	2,200
カナダ	-10	-28	-74	-114
欧州	-1	-5	-18	85
イギリス	0	0	-1	-1
アジア・オセアニア	-11	-16	-32	-50
オーストラリア	-56	-160	-338	-598
ニュージーランド	1	5	10	7
複合地域	-5	-16	-41	-76
エマージング債券	-77	2	140	117
グローバル	-96	-80	48	98
米ドル建て	-88	-83	24	9
現地通貨建て	-8	3	25	89
その他	19	82	92	18
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-2	-5	-11	-19
中国	-7	-9	-10	6
インド	46	147	296	330
インドネシア	4	15	29	25
ブラジル	-16	-59	-194	-283
メキシコ	-4	-7	-15	-34
トルコ	0	1	-1	-3
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイイールド債券	86	369	838	1,983
グローバル	-8	-60	-122	-176
北米	113	483	1,083	2,359
その他	-19	-55	-123	-200
欧州	-14	-43	-98	-195
アジア・オセアニア	-5	-11	-24	-3
複合地域	0	-1	-1	-2
複合資産	564	2,242	3,436	6,917
安定	-156	-356	-704	-982
安定成長	363	1,307	2,013	4,003
成長	465	1,546	2,633	4,788
国内バランス	-100	-222	-475	-958
安定	-122	-315	-604	-1,296
一般	-1	-6	-17	-28
その他	-7	-33	-32	65

<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	11,866	32,744	47,136	79,655
国内REIT	-59	-145	30	1,525
日本	-59	-145	30	1,525
外国REIT	93	217	424	2,152
グローバル	62	102	-52	192
除く日本	114	239	419	966
含む日本	-53	-137	-471	-774
北米	67	205	613	2,073
その他	-36	-90	-137	-113
欧州	0	-1	-11	-15
アジア・オセアニア	-31	-73	-91	-30
オーストラリア	-4	-12	-26	-50
複合地域	0	0	-1	-2
複数国	-1	-3	-8	-15
その他	212	477	981	2,581
絶対収益型	-51	-17	98	250
ロング・ショート	1	72	67	41
マーケットニュートラル	-15	-41	-80	-165
GTAA	-6	-17	-48	-65
その他スタイル	-32	-36	179	450
CB	-2	-8	-2	901
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-2
日本	0	1	1	-2
グローバル	-2	-9	-2	906
コモディティ	8	73	433	828
全業種	8	12	50	124
貴金属	1	68	391	715
エネルギー	-1	-10	-13	-18
その他コモディティ	0	3	5	7

< 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	975,694	100.00	5,367	100.00
国内株式	129,963	13.32	784	14.61
一般	72,229	7.40	484	9.02
フリー	52,738	5.41	388	7.23
バリュー	19,464	1.99	94	1.75
小型	7,034	0.72	88	1.64
その他	49,876	5.11	206	3.84
日経225	24,170	2.48	71	1.32
TOPIX	21,137	2.17	82	1.53
JPX日経400	873	0.09	15	0.28
国内債券	42,236	4.33	146	2.72
一般	42,236	4.33	146	2.72
外国株式(先進国)	414,324	42.46	1,201	22.38
グローバル	276,029	28.29	837	15.60
除く日本	83,310	8.54	195	3.63
含む日本	192,718	19.75	642	11.96
その他	138,295	14.17	364	6.78
北米	1,411	0.14	13	0.24
米国	132,667	13.60	280	5.22
カナダ	128	0.01	2	0.04
欧州	1,459	0.15	39	0.73
ドイツ	16	0.00	1	0.02
イギリス	8	0.00	3	0.06
アジア・オセアニア	34	0.00	1	0.02
オーストラリア	2,532	0.26	23	0.43
ニュージーランド	12	0.00	1	0.02
複合地域	29	0.00	1	0.02
エマージング株式	36,860	3.78	312	5.81
グローバル	10,388	1.06	93	1.73
BRICS	441	0.05	7	0.13
その他	26,030	2.67	212	3.95
欧州	82	0.01	6	0.11
ロシア	8	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,192	0.43	86	1.60
中国	1,440	0.15	33	0.61
インド	17,995	1.84	34	0.63
インドネシア	185	0.02	5	0.09
タイ	8	0.00	2	0.04
フィリピン	28	0.00	4	0.07
ベトナム	1,380	0.14	13	0.24
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	16	0.00	1	0.02
中南米	58	0.01	2	0.04
ブラジル	478	0.05	12	0.22
メキシコ	8	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	66	0.01	3	0.06
トルコ	55	0.01	2	0.04
複合地域	31	0.00	3	0.06

<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	975,694	100.00	5,367	100.00
外国債券(先進国)	89,479	9.17	747	13.92
グローバル	73,386	7.52	531	9.89
除く日本	32,869	3.37	223	4.16
含む日本	40,517	4.15	308	5.74
その他	16,093	1.65	216	4.02
北米	99	0.01	8	0.15
米国	6,826	0.70	113	2.11
カナダ	660	0.07	4	0.07
欧州	1,061	0.11	29	0.54
イギリス	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,495	0.15	9	0.17
オーストラリア	4,839	0.50	31	0.58
ニュージーランド	80	0.01	9	0.17
複合地域	1,024	0.10	8	0.15
エマージング債券	11,510	1.18	248	4.62
グローバル	6,393	0.66	179	3.34
米ドル建て	4,613	0.47	139	2.59
現地通貨建て	1,780	0.18	40	0.75
その他	5,117	0.52	69	1.29
ロシア	3	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	229	0.02	6	0.11
中国	148	0.02	10	0.19
インド	2,610	0.27	16	0.30
インドネシア	322	0.03	7	0.13
ブラジル	1,490	0.15	20	0.37
メキシコ	250	0.03	3	0.06
トルコ	32	0.00	2	0.04
複合地域	33	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	19,406	1.99	244	4.55
グローバル	2,569	0.26	38	0.71
北米	15,042	1.54	144	2.68
その他	1,795	0.18	62	1.16
欧州	1,385	0.14	40	0.75
アジア・オセアニア	373	0.04	21	0.39
複合地域	36	0.00	1	0.02
複合資産	139,552	14.30	1,038	19.34
安定	37,114	3.80	280	5.22
安定成長	62,675	6.42	431	8.03
成長	30,526	3.13	285	5.31
国内バランス	6,473	0.66	28	0.52
安定	5,534	0.57	9	0.17
一般	280	0.03	15	0.28
その他	2,765	0.28	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	975,694	100.00	5,367	100.00
国内REIT	26,425	2.71	140	2.61
日本	26,425	2.71	140	2.61
外国REIT	40,231	4.12	275	5.12
グローバル	16,112	1.65	154	2.87
除く日本	6,681	0.68	67	1.25
含む日本	9,431	0.97	87	1.62
北米	21,562	2.21	73	1.36
その他	2,557	0.26	48	0.89
欧州	85	0.01	6	0.11
アジア・オセアニア	1,782	0.18	26	0.48
オーストラリア	414	0.04	12	0.22
複合地域	53	0.01	3	0.06
複数国	224	0.02	1	0.02
その他	25,707	2.63	232	4.32
絶対収益型	11,521	1.18	95	1.77
ロング・ショート	851	0.09	29	0.54
マーケットニュートラル	378	0.04	14	0.26
GTAA	340	0.03	11	0.20
その他スタイル	9,882	1.01	40	0.75
CB	2,727	0.28	38	0.71
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	2,669	0.27	36	0.67
コモディティ	6,148	0.63	37	0.69
全業種	1,901	0.19	13	0.24
貴金属	4,152	0.43	22	0.41
エネルギー	67	0.01	1	0.02
その他コモディティ	27	0.00	1	0.02

< 5 > 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別①

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	13,682	10.2	2.27	2.41	1.113
国内株式	19,789	14.3	1.23	1.10	1.020
一般	18,707	14.1	1.72	1.55	1.378
フリー	18,039	13.4	1.36	1.26	1.420
バリュー	21,609	16.8	2.73	2.37	1.263
小型	23,164	14.8	1.06	1.05	1.707
その他	20,989	14.5	0.49	0.41	0.396
日経225	21,579	15.8	0.50	0.45	0.457
TOPIX	22,308	15.3	0.16	0.13	0.242
JPX日経400	19,984	9.2	0.50	0.43	0.487
国内債券	10,157	12.2	0.13	0.14	0.458
一般	10,157	12.2	0.13	0.14	0.458
外国株式(先進国)	15,906	7.7	2.42	2.47	1.176
グローバル	16,292	7.7	2.19	2.29	1.265
除く日本	24,138	10.5	0.46	0.49	0.543
含む日本	13,909	6.8	2.94	3.08	1.577
その他	15,019	7.7	2.89	2.84	0.997
北米	14,665	5.4	0.79	0.88	1.368
米国	15,794	7.0	2.80	2.72	0.971
カナダ	5,856	12.6	6.35	7.32	1.989
欧州	14,041	12.5	2.72	2.72	1.470
ドイツ	15,114	9.6	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,102	7.2	9.16	9.90	1.794
アジア・オセアニア	10,363	17.3	3.46	3.38	1.639
オーストラリア	9,548	8.8	8.63	9.66	1.823
ニュージーランド	16,372	11.3	1.76	1.83	1.672
複合地域	11,826	10.5	7.73	8.46	1.705
エマージング株式	13,642	10.8	2.71	2.66	1.665
グローバル	13,405	8.4	0.45	0.41	1.011
BRICS	14,668	17.4	0.93	0.90	2.064
その他	13,713	11.6	3.66	3.60	1.919
欧州	7,912	17.4	0.86	0.55	1.949
ロシア	965	14.4	0.00	0.00	1.164
アジア・オセアニア	14,408	12.6	2.36	2.27	1.691
中国	13,127	9.0	1.55	1.50	1.930
インド	17,622	11.5	4.44	4.37	1.975
インドネシア	12,279	10.9	2.37	2.64	1.794
タイ	12,961	11.6	1.60	1.69	1.819
フィリピン	10,665	11.2	0.43	0.44	1.710
ベトナム	15,414	6.3	0.81	0.77	1.885
韓国	12,900	4.8	0.00	0.00	1.804
香港	13,304	14.2	3.18	2.71	0.858
中南米	10,569	16.8	1.54	1.56	2.037
ブラジル	6,242	12.5	3.39	3.90	1.951
メキシコ	12,561	10.6	3.53	3.18	1.667
中東・アフリカ	12,290	11.9	0.79	0.95	2.158
トルコ	14,239	22.3	0.39	0.28	2.030
複合地域	17,938	10.3	1.93	1.70	1.331

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目録見書等に記載の実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

< 5 > 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別②

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	13,682	10.2	2.27	2.41	1.113
外国債券(先進国)	9,940	10.6	1.35	1.43	0.972
グローバル	10,414	10.6	1.11	1.15	0.913
除く日本	11,586	13.0	0.88	0.90	0.699
含む日本	9,565	8.9	1.31	1.37	1.086
その他	8,776	10.7	2.40	2.64	1.242
北米	9,682	7.3	2.18	2.15	1.546
米国	9,636	8.6	2.48	2.91	1.205
カナダ	7,367	12.8	1.50	1.54	1.378
欧州	7,287	14.1	1.54	1.56	1.120
イギリス	7,214	8.5	3.87	3.77	1.297
アジア・オセアニア	8,918	13.6	2.42	2.50	1.436
オーストラリア	8,046	14.7	2.66	2.79	1.242
ニュージーランド	8,740	9.3	1.56	1.61	1.371
複合地域	5,500	13.5	2.18	2.24	1.195
エマージング債券	9,307	11.8	3.84	3.74	1.421
グローバル	9,180	12.3	2.67	2.55	1.255
米ドル建て	8,926	12.8	2.98	2.83	1.390
現地通貨建て	10,062	10.5	1.87	1.82	0.905
その他	9,639	10.5	5.29	5.22	1.628
ロシア	766	10.8	0.00	0.00	1.583
アジア・オセアニア	9,509	12.9	6.64	6.86	1.626
中国	11,860	4.1	1.41	1.42	1.240
インド	10,347	9.2	6.00	6.07	1.706
インドネシア	9,501	10.9	5.34	5.43	1.669
ブラジル	11,060	13.4	4.35	3.95	1.579
メキシコ	8,740	11.0	5.10	4.60	1.369
トルコ	1,375	11.0	5.07	8.54	1.474
複合地域	4,143	17.2	1.66	1.45	1.210
ハイイールド債券	9,532	12.4	5.00	5.05	1.665
グローバル	7,838	11.2	3.39	3.18	1.471
北米	10,902	13.3	5.06	5.18	1.687
その他	7,391	11.0	6.85	6.62	1.766
欧州	7,793	10.5	6.09	5.82	1.738
アジア・オセアニア	6,759	11.6	9.85	9.75	1.868
複合地域	4,603	19.6	5.33	5.21	1.800
複合資産	13,003	9.7	1.02	1.06	0.936
安定	11,082	9.7	0.96	0.99	1.067
安定成長	12,684	10.1	1.32	1.38	0.942
成長	15,711	9.2	0.19	0.19	0.779
国内バランス	12,040	11.1	2.05	2.14	0.950
安定	10,387	12.2	1.79	1.90	0.915
一般	13,071	11.5	1.09	1.02	1.260
その他	8,052	3.6	1.45	1.66	0.725

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

< 5 > 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別③

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	13,682	10.2	2.27	2.41	1.113
国内REIT	13,694	10.0	7.82	9.55	0.913
日本	13,694	10.0	7.82	9.55	0.913
外国REIT	10,985	9.3	8.10	9.89	1.459
グローバル	11,994	9.0	3.18	3.64	1.196
除く日本	13,080	7.4	1.96	2.33	0.930
含む日本	11,158	10.2	4.05	4.57	1.385
北米	10,251	10.0	11.91	14.77	1.620
その他	8,864	9.4	6.95	8.05	1.748
欧州	5,723	10.2	5.48	5.58	1.874
アジア・オセアニア	10,004	8.8	8.35	9.74	1.794
オーストラリア	8,294	9.1	4.62	5.34	1.700
複合地域	6,993	11.7	0.88	0.94	0.770
複数国	10,538	19.5	2.09	2.28	1.650
その他					
絶対収益型	10,307	6.6	0.03	0.03	1.923
ロング・ショート	10,332	5.9	0.25	0.27	1.522
マーケットニュートラル	9,837	5.7	0.00	0.00	1.279
GTAA	10,783	10.7	0.20	0.20	1.548
その他スタイル	10,272	6.4	0.00	0.00	1.999
CB	11,772	7.8	0.46	0.45	1.185
アジア・オセアニア	10,508	13.3	2.40	2.28	1.823
日本	13,648	23.9	0.37	0.37	0.770
グローバル	11,755	7.2	0.42	0.42	1.180
コモディティ	12,897	7.4	0.00	0.00	0.926
全業種	11,095	11.4	0.00	0.00	1.277
貴金属	13,308	4.7	0.00	0.00	0.765
エネルギー	21,550	14.7	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	18,631	7.1	0.00	0.00	0.506

(注1) 平均値

基準価額（円）と設定来年数（年）は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り（%）

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

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

- 本レポートに関する著作権、知的財産権等一切の権利は三菱アセット・ブレインズ株式会社（以下、MAB）に帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。
- 本レポートは、MAB が信頼できると判断した情報源から入手した本レポート作成基準日現在における情報をもとに作成しておりますが、当該情報の正確性を保証するものではありません。
- MAB は、本レポートの利用に関連して発生した一切の損害について何らの責任も負いません。
- 本レポート中のグラフ・数値等は、あくまでも本レポート作成基準日までの過去の実績を示すものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。
- 本レポートは、情報提供を目的としたものであり、投資信託の勧誘のために作成されたものではありません。
- MAB 投信指数「MAB-FPI」（以下、本指数）に関する著作権、知的財産権等一切の権利は MAB に帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。また、本指数を商業的に利用する場合には MAB の利用許諾が必要です。

【照会先】

三菱アセット・ブレインズ株式会社

システムグループ 青木、川眞田

電話番号 : 03-6721-1033

Eメール : mab-index@mab.co.jp

〒107-0062 東京都港区南青山 1 丁目 1 番 1 号 新青山ビル西館 8 階

URL : <https://www.mab.jp/business/information/mab-fpi/>

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第 1085 号 助言・代理業、投資運用業

加入協会名 一般社団法人 日本投資顧問業協会