

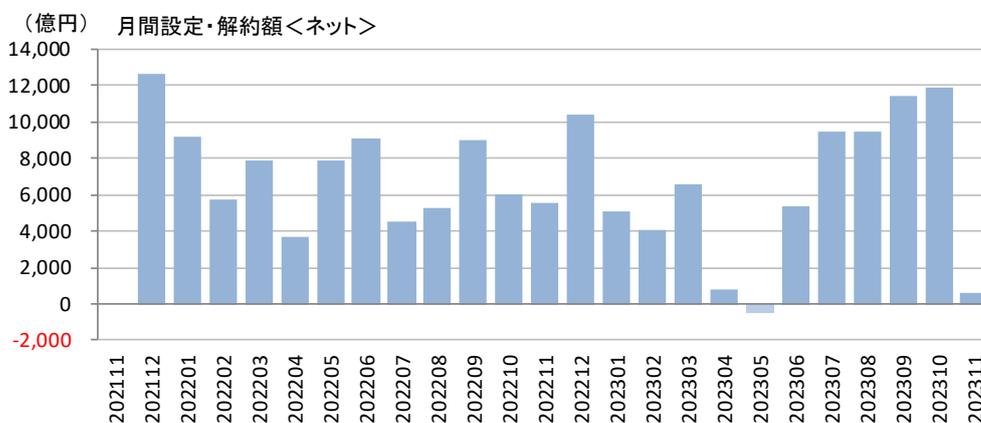
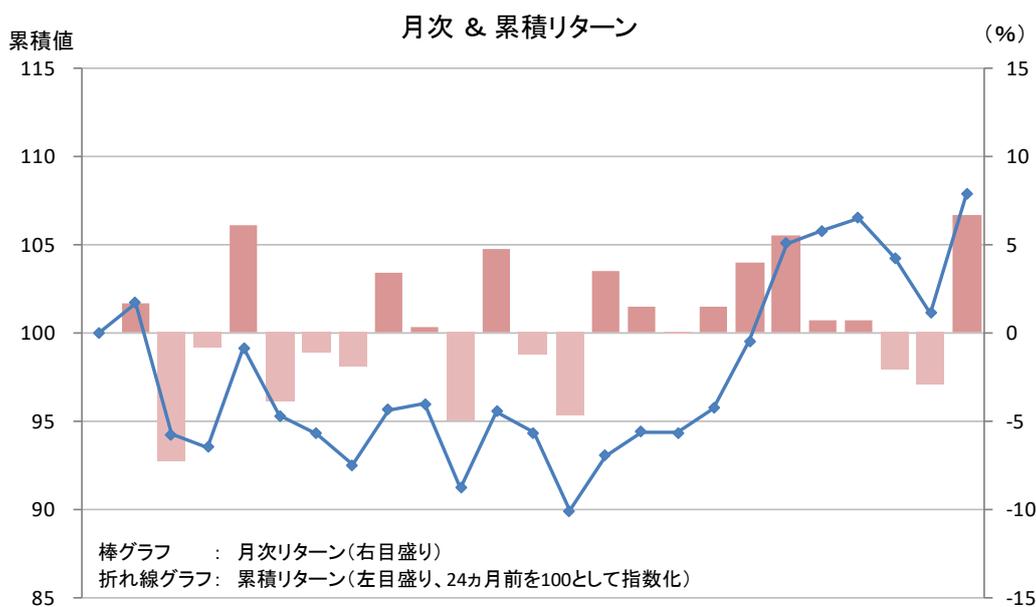
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2023年11月

「総合」 +6.64 %
(前月 -2.98 %)



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		17,767	16,660	1,106	6.64	
国内株式		23,983	22,557	1,426	6.32	
一般		23,202	21,935	1,267	5.78	
フリー		21,481	20,231	1,250	6.18	
バリュー		31,264	29,863	1,401	4.69	
小型		42,764	39,837	2,927	7.35	
その他		24,427	22,843	1,584	6.93	
日経225		23,227	21,409	1,817	8.49	
TOPIX		24,113	22,880	1,233	5.39	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	22,761	21,444	1,317	6.14	
国内債券		12,400	12,191	209	1.72	
一般		12,400	12,191	209	1.72	
外国株式(先進国)		24,625	22,544	2,081	9.23	
グローバル		26,393	24,049	2,344	9.75	
除く日本		42,172	39,106	3,065	7.84	
含む日本		23,017	20,816	2,201	10.57	
その他		20,749	19,174	1,574	8.21	
北米		26,323	24,647	1,676	6.80	
米国		32,310	29,842	2,468	8.27	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	21,909	20,949	961	4.59	
欧州		26,946	24,728	2,218	8.97	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	13,940	12,481	1,458	11.68	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	11,415	10,955	460	4.20	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	40,373	38,593	1,780	4.61	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	20,801	19,668	1,132	5.76	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	47,263	43,893	3,370	7.68	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	15,211	15,778	-567	-3.59	
エマージング株式		21,316	20,413	903	4.42	
グローバル		20,584	19,542	1,042	5.33	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	25,282	24,289	993	4.09	
その他		22,572	21,690	882	4.07	
欧州		16,837	15,646	1,191	7.62	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,085	1,084	1	0.05	
アジア・オセアニア		19,376	18,729	647	3.45	
中国		37,031	36,903	128	0.35	
インド	10,000 (2004.09.30)	60,966	58,610	2,356	4.02	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	17,819	16,976	843	4.97	
タイ		23,133	23,095	39	0.17	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,038	7,572	466	6.15	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	23,688	22,232	1,457	6.55	
韓国	10,000 (1997.06.30)	31,374	28,678	2,697	9.40	
香港		20,738	21,548	-810	-3.76	
中南米	7,427 (2006.04.28)	12,676	11,482	1,194	10.40	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	10,874	9,688	1,186	12.24	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	17,030	15,712	1,318	8.39	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	13,423	12,510	913	7.30	
トルコ		43,106	41,687	1,419	3.40	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	27,102	25,613	1,489	5.81	

※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		17,767	16,660	1,106	6.64	
外国債券(先進国)		19,018	18,365	653	3.56	
グローバル		18,989	18,401	588	3.20	
除く日本		21,115	20,370	745	3.66	
含む日本		17,614	17,130	484	2.82	
その他		19,371	18,413	959	5.21	
北米	9,052 (2013.05.31)	10,792	10,255	537	5.24	
米国		17,765	16,717	1,048	6.27	
カナダ	10,000 (2003.05.30)	17,576	17,119	457	2.67	
欧州	10,000 (1998.07.31)	14,550	14,063	486	3.46	
イギリス	10,069 (2014.07.31)	11,641	10,850	790	7.28	
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	21,985	20,955	1,030	4.92	
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	27,220	25,973	1,247	4.80	
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	11,927	11,068	859	7.76	
複合地域	10,000 (2001.11.30)	19,183	18,509	673	3.64	
エマージング債券		20,922	20,204	717	3.55	
グローバル		20,892	19,925	967	4.85	
米ドル建て		21,105	20,105	1,000	4.97	
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	15,413	14,743	669	4.54	
その他	8,647 (2005.03.31)	16,938	16,618	320	1.93	
ロシア	10,000 (2008.05.30)	509	464	46	9.83	
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	16,378	15,861	516	3.26	
中国	13,833 (2018.07.31)	18,990	18,722	268	1.43	
インド	10,000 (2011.08.31)	21,638	21,709	-71	-0.33	
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	19,904	18,997	907	4.77	
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	17,254	16,562	692	4.18	
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	20,654	19,200	1,455	7.58	
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,402	2,449	-47	-1.90	
複合地域	10,000 (2006.08.31)	12,652	12,126	527	4.34	
ハイイールド債券		28,676	27,763	913	3.29	
グローバル	10,000 (1997.06.30)	26,821	25,665	1,156	4.50	
北米		29,073	28,219	854	3.03	
その他	10,000 (2004.03.31)	25,573	24,639	934	3.79	
欧州	10,000 (2006.04.28)	26,179	25,195	984	3.91	
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	15,230	14,737	493	3.35	
複合地域	10,000 (2004.03.31)	25,522	24,536	986	4.02	
複合資産		20,115	19,279	836	4.34	
安定	10,000 (1998.10.30)	16,318	15,804	514	3.25	
安定成長		22,402	21,443	959	4.47	
成長		28,629	27,229	1,401	5.14	
国内バランス		12,472	12,241	232	1.89	
安定		12,516	12,287	229	1.86	
一般		17,612	17,053	559	3.28	
その他	10,000 (2018.10.31)	12,199	10,816	1,383	12.79	

※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		17,767	16,660	1,106	6.64	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	34,929	34,275	654	1.91	
日本	10,000 (2003.10.31)	34,929	34,275	654	1.91	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	34,723	31,560	3,163	10.02	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	28,690	26,092	2,598	9.96	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	32,111	29,097	3,014	10.36	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	28,458	25,948	2,510	9.67	
北米	10,000 (2003.09.30)	36,883	33,482	3,401	10.16	
その他	10,000 (2004.04.30)	30,463	27,878	2,585	9.27	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,610	4,942	668	13.51	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	22,451	20,640	1,810	8.77	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	16,888	15,020	1,868	12.44	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	7,846	7,213	633	8.78	
複数国	10,000 (2004.04.30)	45,514	42,969	2,545	5.92	
その他		6,843	6,555	288	4.39	
絶対収益型		7,412	7,352	61	0.83	
ロング・ショート		8,197	8,180	17	0.21	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,289	11,303	-14	-0.12	
GTAA		11,287	11,178	109	0.97	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	6,952	6,889	64	0.93	
CB		20,364	20,015	349	1.74	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	21,991	21,854	137	0.63	
日本		20,609	20,009	600	3.00	
グローバル		35,517	34,907	609	1.75	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	12,923	13,008	-84	-0.65	
全業種	10,000 (2004.12.30)	11,981	12,496	-515	-4.12	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	21,596	21,382	215	1.00	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	10,751	11,160	-409	-3.67	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	16,479	16,867	-387	-2.30	

※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か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	1.26	8.33	14.29	19.95
国内株式	1.98	10.31	19.08	26.02
一般	1.55	10.05	18.51	24.99
フリー	1.23	8.96	17.33	24.00
バリュー	2.50	13.43	22.25	27.97
小型	-1.46	4.84	3.69	10.38
その他	3.14	11.55	22.54	30.15
日経225	3.28	9.15	21.71	30.29
TOPIX	2.73	12.56	22.37	28.25
JPX日経400	2.53	11.86	22.23	28.23
国内債券	-0.25	-1.87	-1.31	0.14
一般	-0.25	-1.87	-1.31	0.14
外国株式(先進国)	1.80	11.75	22.30	30.06
グローバル	1.64	10.89	21.04	28.37
除く日本	1.37	12.00	20.49	27.85
含む日本	1.76	10.44	21.25	28.57
その他	2.15	13.56	24.93	33.64
北米	1.66	14.93	21.55	29.71
米国	2.25	13.88	25.72	34.57
カナダ	-0.82	4.93	-0.09	6.54
欧州	-0.38	5.15	16.22	19.55
ドイツ	2.52	9.38	25.44	29.61
イギリス	1.76	4.93	4.42	6.34
アジア・オセアニア	-0.89	2.42	4.37	8.44
オーストラリア	-1.13	3.59	1.40	8.36
ニュージーランド	1.34	1.17	3.48	3.21
複合地域	-4.59	15.77	-0.13	9.90
エマージング株式	1.62	11.36	14.89	20.14
グローバル	0.47	8.59	13.98	18.24
BRICS	-0.28	10.72	8.24	12.25
その他	2.18	12.63	15.29	21.08
欧州	7.65	26.73	48.45	47.54
ロシア	0.22	1.77	-24.91	-17.83
アジア・オセアニア	-1.13	4.77	9.03	12.77
中国	-4.90	-3.85	-5.32	-5.97
インド	4.57	17.07	17.86	26.88
インドネシア	-5.22	0.31	4.42	12.38
タイ	-9.82	-2.78	-3.53	-3.66
フィリピン	2.39	3.05	1.85	8.08
ベトナム	-6.46	9.79	21.47	22.12
韓国	-5.89	1.03	15.58	23.09
香港	-6.62	-1.64	0.67	-2.82
中南米	0.75	15.58	23.91	30.78
ブラジル	4.84	19.55	21.34	29.12
メキシコ	-5.31	7.29	23.85	32.77
中東・アフリカ	-2.99	5.86	-1.36	6.03
トルコ	-3.64	23.63	18.82	10.47
複合地域	4.58	5.79	11.23	15.85

※[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	1.26	8.33	14.29	19.95
外国債券(先進国)	1.06	3.69	4.08	7.15
グローバル	1.00	3.46	4.00	6.78
除く日本	1.43	4.67	5.66	9.90
含む日本	0.66	2.48	2.69	4.28
その他	1.32	4.67	4.44	8.75
北米	0.80	2.85	4.19	6.23
米国	-0.04	2.91	2.41	6.17
カナダ	2.01	6.53	7.37	12.43
欧州	1.63	5.15	4.87	7.70
イギリス	4.32	11.98	13.38	19.82
アジア・オセアニア	2.80	6.27	5.77	10.62
オーストラリア	2.78	6.49	6.18	11.08
ニュージーランド	5.42	6.35	4.95	9.60
複合地域	0.46	3.74	5.30	9.84
エマージング債券	1.89	8.99	15.22	18.85
グローバル	2.33	9.69	14.41	17.30
米ドル建て	2.45	9.63	13.39	16.19
現地通貨建て	2.04	9.86	17.22	20.37
その他	1.36	8.15	16.34	20.95
ロシア	4.60	-10.51	-66.06	-57.61
アジア・オセアニア	2.38	4.88	9.07	10.99
中国	2.10	3.76	6.32	7.10
インド	1.16	6.39	9.47	15.28
インドネシア	-0.59	2.76	14.34	17.82
ブラジル	2.63	14.31	31.28	34.99
メキシコ	-0.13	10.35	26.34	32.02
トルコ	-13.22	-35.53	-35.96	-36.14
複合地域	1.70	10.10	20.58	23.43
ハイイールド債券	2.33	9.32	13.13	17.25
グローバル	2.83	9.47	13.90	15.97
北米	2.10	9.37	12.88	17.72
その他	3.61	8.80	13.41	15.71
欧州	3.58	9.27	13.61	16.82
アジア・オセアニア	3.72	6.95	12.92	11.61
複合地域	3.22	10.32	14.51	17.82
複合資産	0.65	4.61	7.26	11.05
安定	0.27	2.34	3.50	6.29
安定成長	0.80	5.18	8.36	12.33
成長	1.08	7.70	12.63	17.44
国内バランス	-0.43	0.16	0.24	1.96
安定	-0.62	-0.63	-0.93	0.72
一般	1.05	5.85	9.76	12.79
その他	0.01	2.96	1.50	12.55

※[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	1.26	8.33	14.29	19.95
国内REIT	-1.84	0.03	-2.49	1.15
日本	-1.84	0.03	-2.49	1.15
外国REIT	-1.39	6.96	4.73	11.37
グローバル	-1.55	6.64	4.59	10.80
除く日本	-1.66	6.64	4.70	10.89
含む日本	-1.50	6.64	4.55	10.77
北米	-1.27	7.73	5.22	12.59
その他	-1.35	2.78	1.70	5.43
欧州	5.71	16.31	14.05	15.79
アジア・オセアニア	-1.40	2.24	1.45	4.75
オーストラリア	-1.84	1.06	-0.07	4.62
複合地域	0.69	9.16	5.76	10.17
複数国	-3.10	4.08	1.65	7.71
その他	1.44	4.61	10.26	13.73
絶対収益型	-0.31	0.02	-1.02	0.02
ロング・ショート	0.53	-0.46	0.30	1.24
マーケットニュートラル	-1.05	-0.23	0.01	-0.01
GTAA	-0.41	-0.86	-2.01	-0.29
その他スタイル	-0.34	0.10	-1.11	-0.04
CB	-0.42	2.74	5.19	6.26
アジア・オセアニア	0.22	4.86	12.76	12.63
日本	1.60	3.78	4.15	5.73
グローバル	-0.45	2.70	5.11	6.20
コモディティ	2.68	7.20	11.29	12.11
全業種	-1.43	10.54	2.11	6.44
貴金属	4.60	5.40	16.10	14.76
エネルギー	1.56	24.34	15.56	20.80
その他コモディティ	-1.71	11.67	1.15	7.84

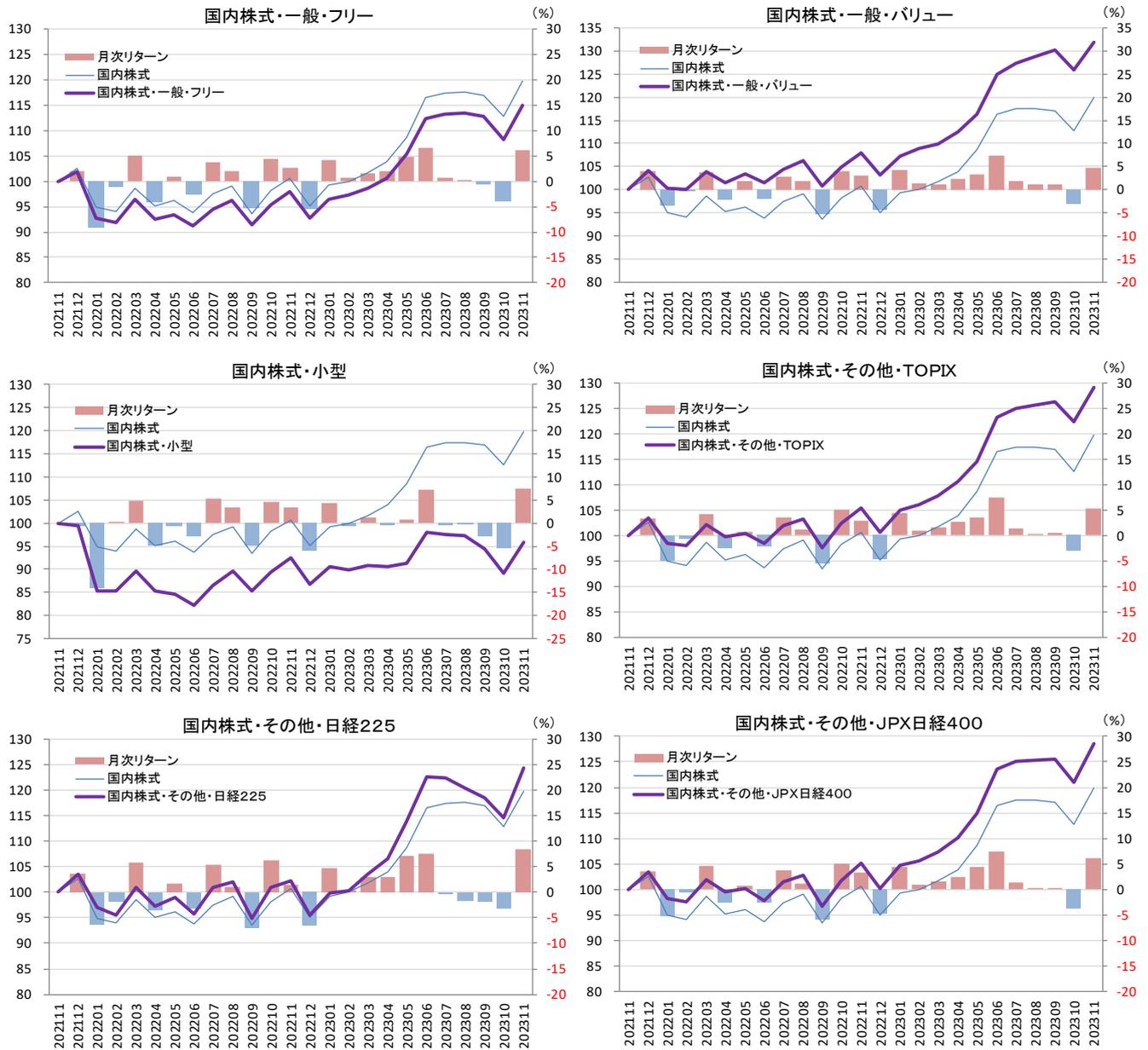
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

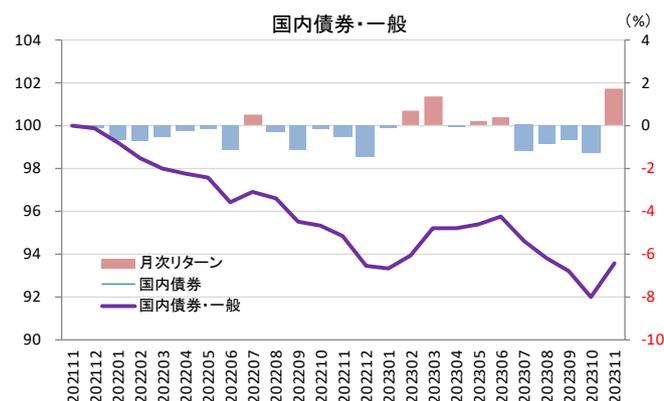
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

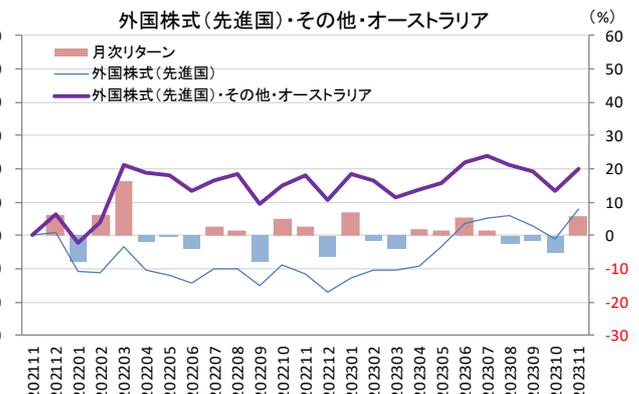
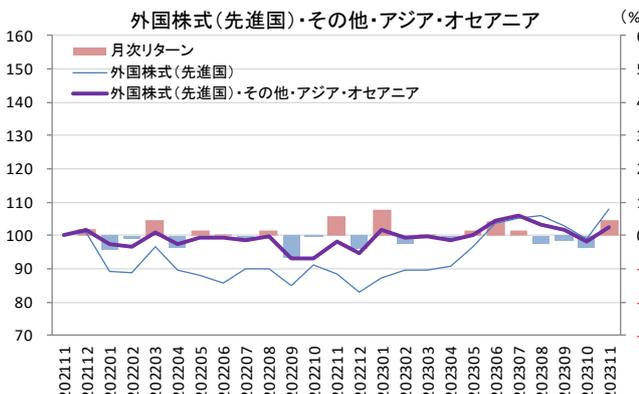
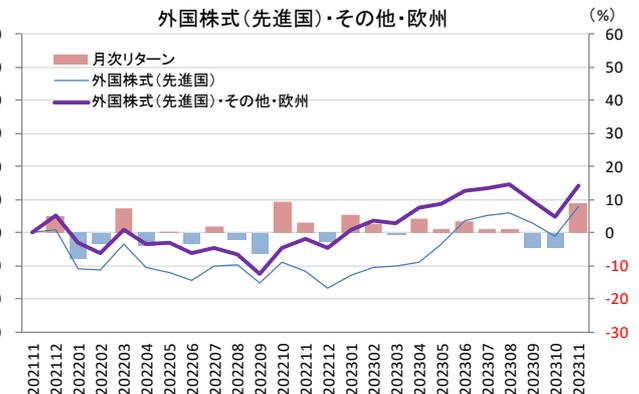
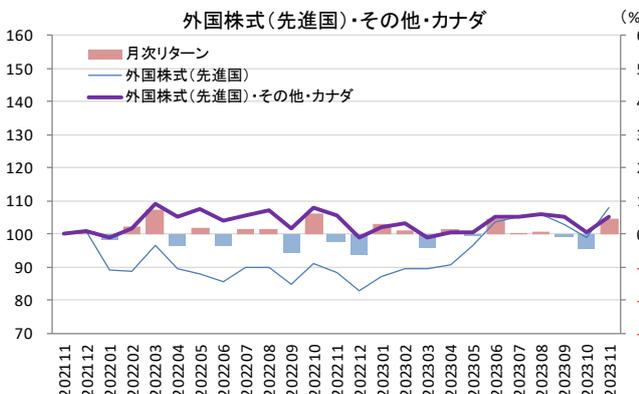
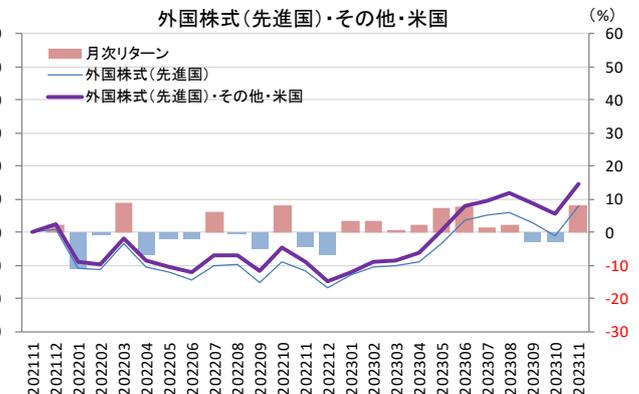
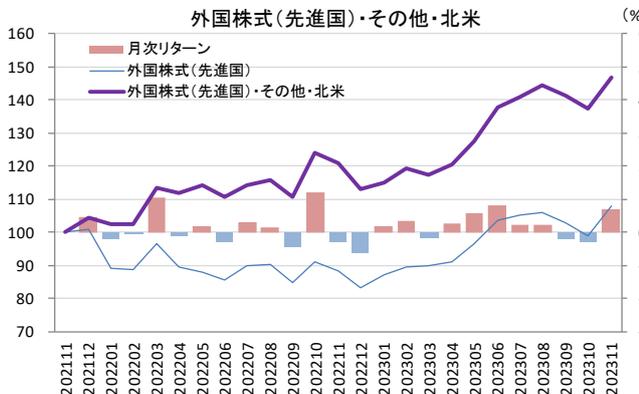
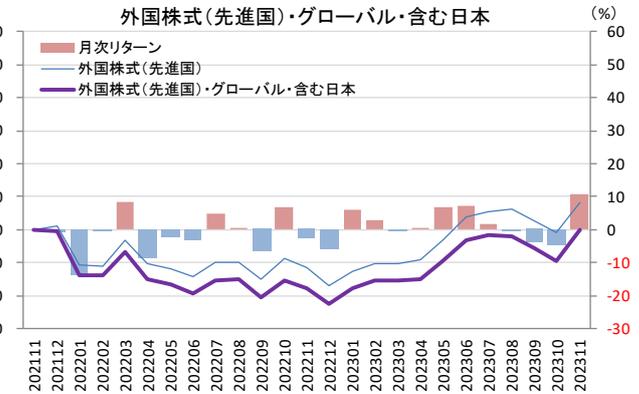
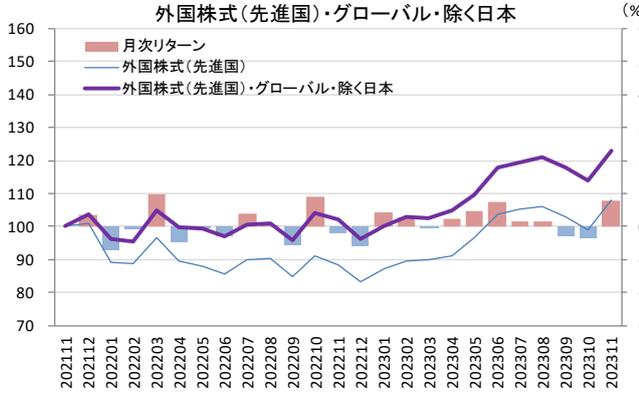


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

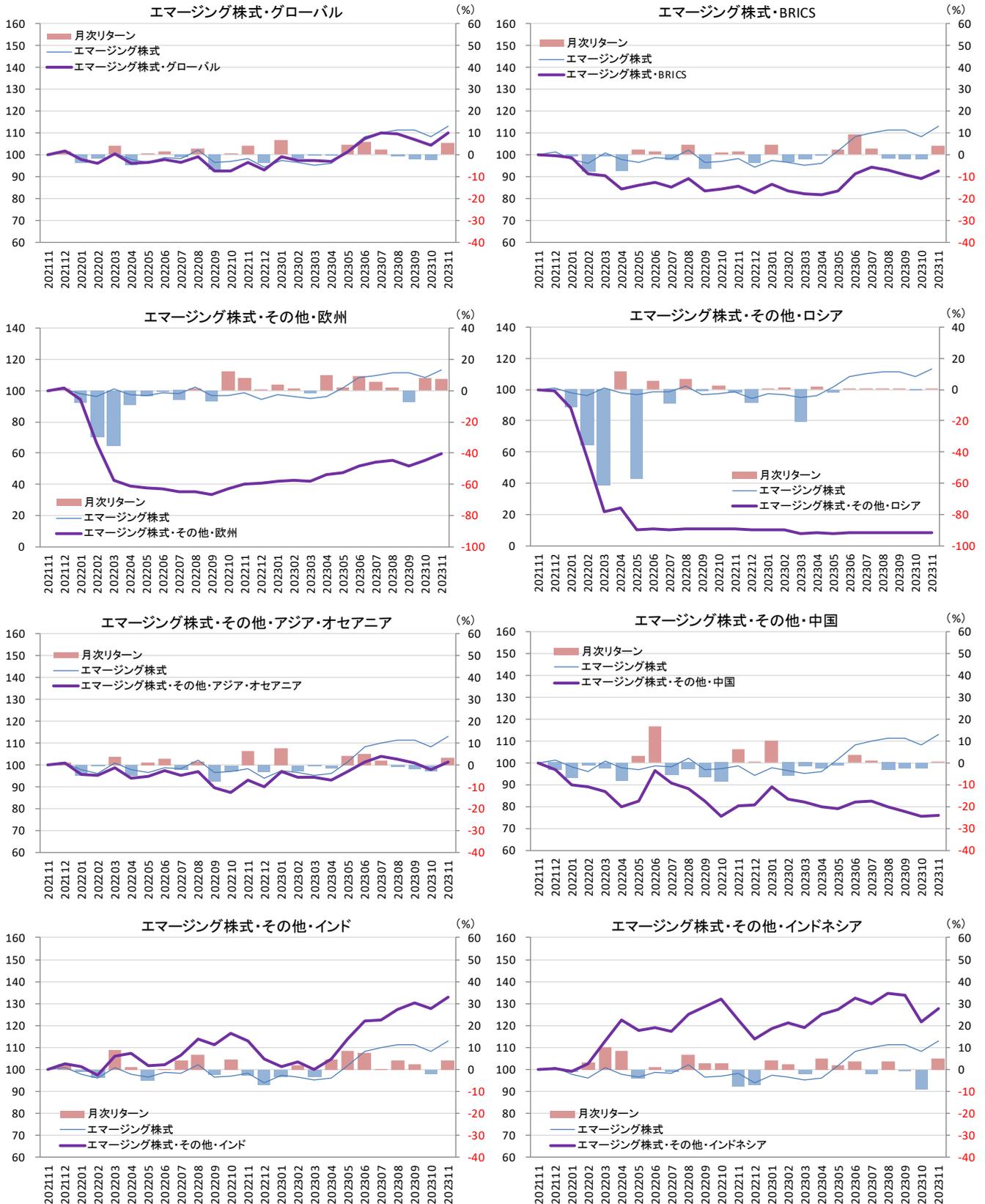


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

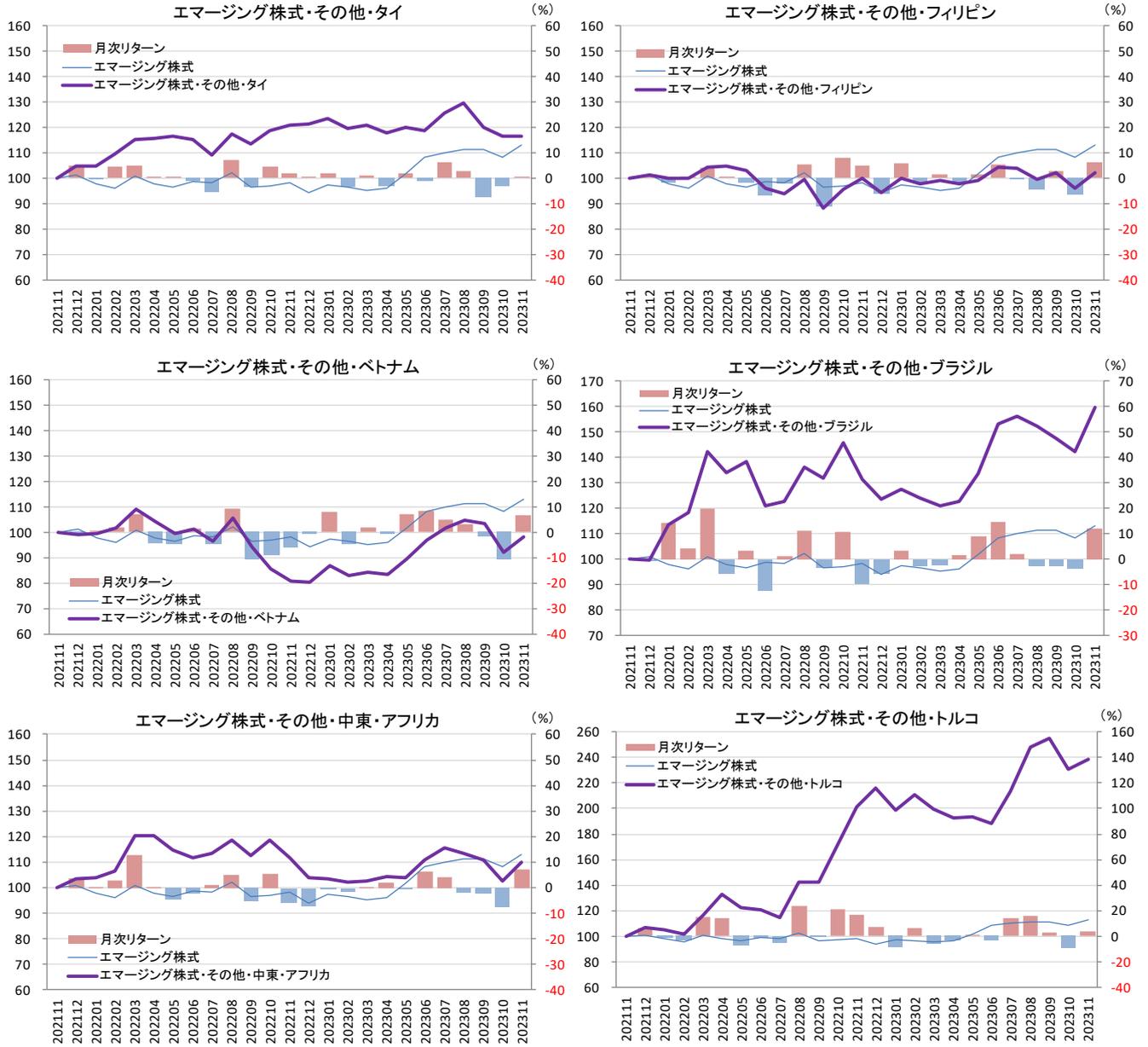


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

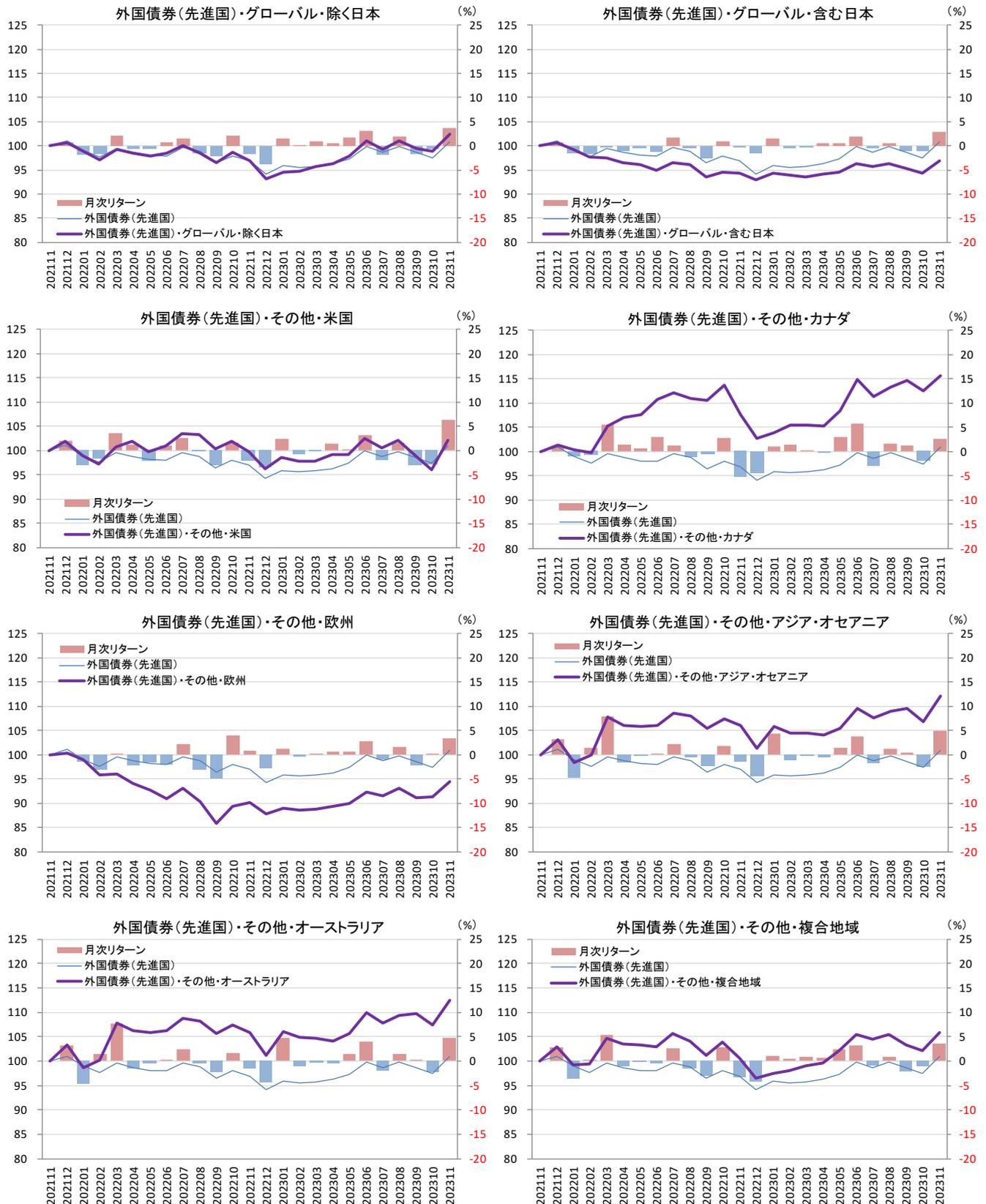


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

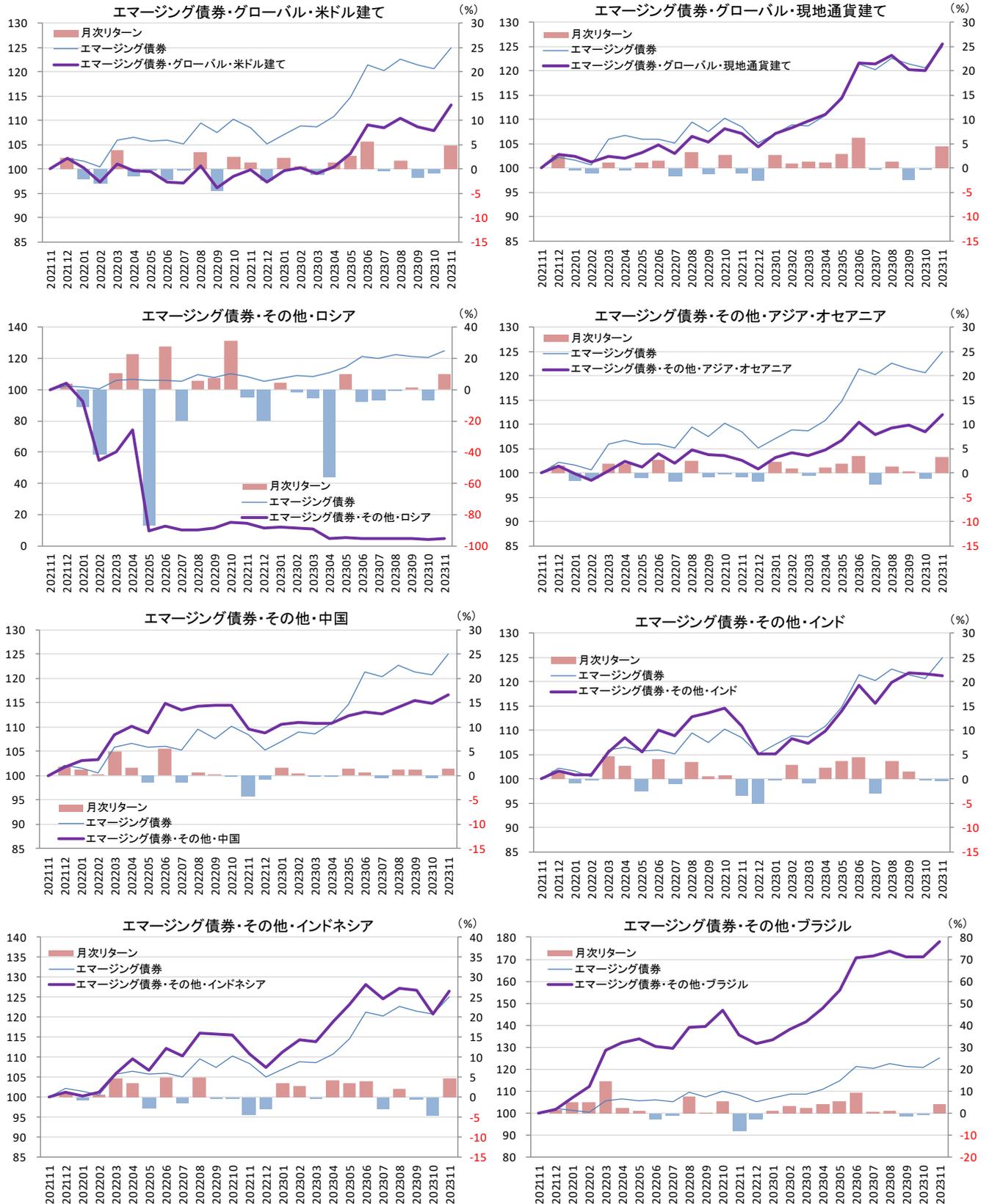


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

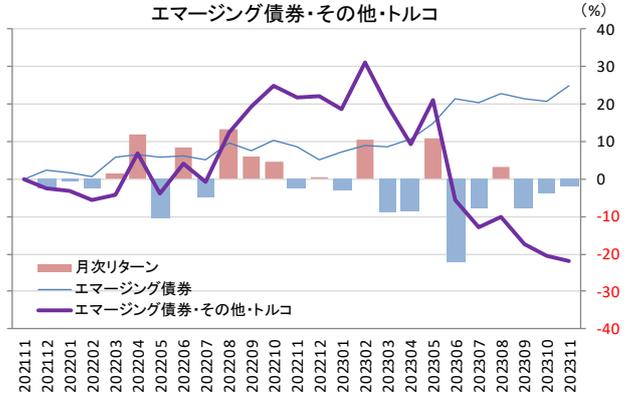
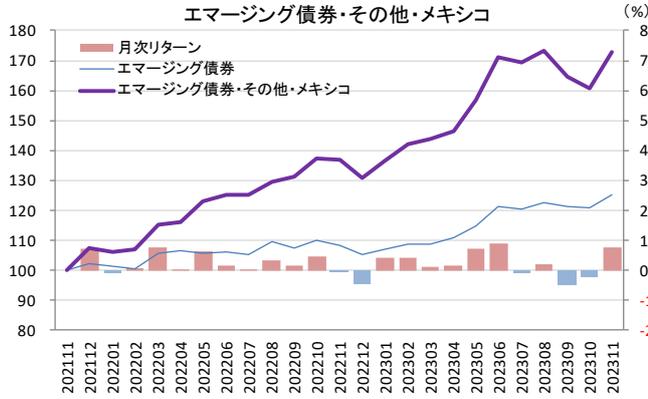


<1>パフォーマンス・サマリー

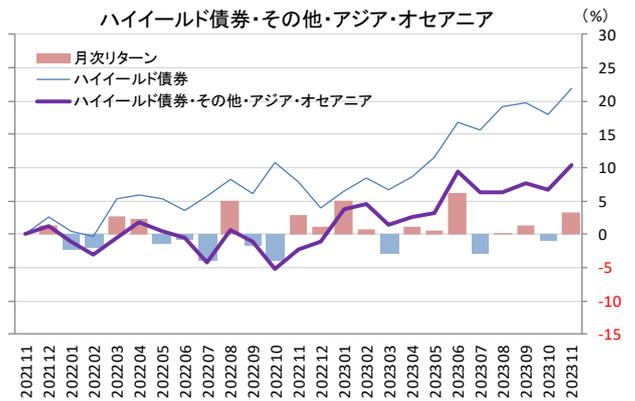
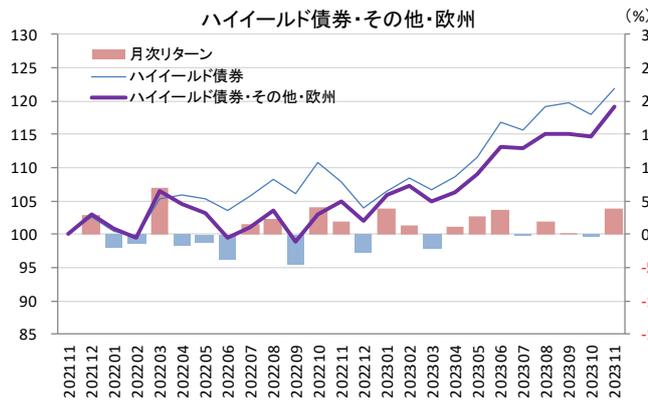
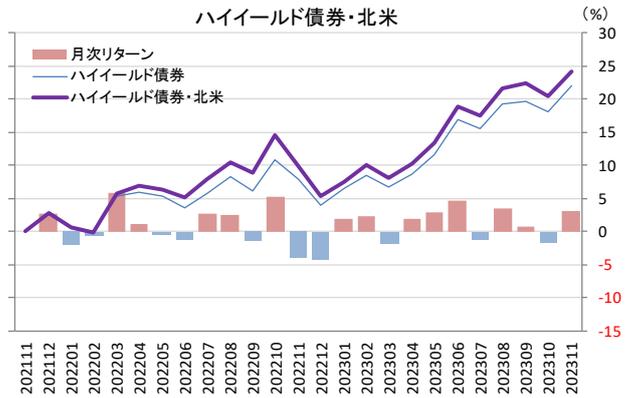
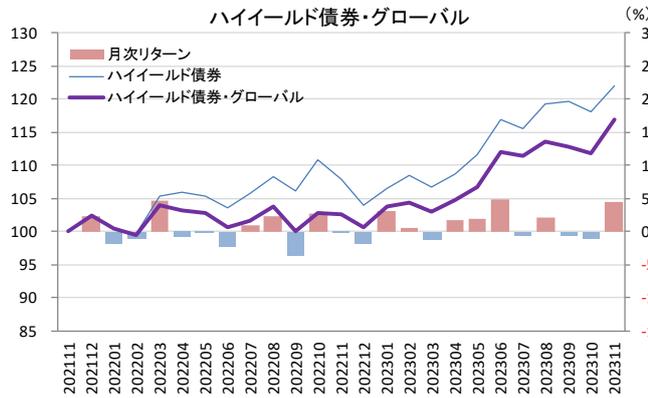
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

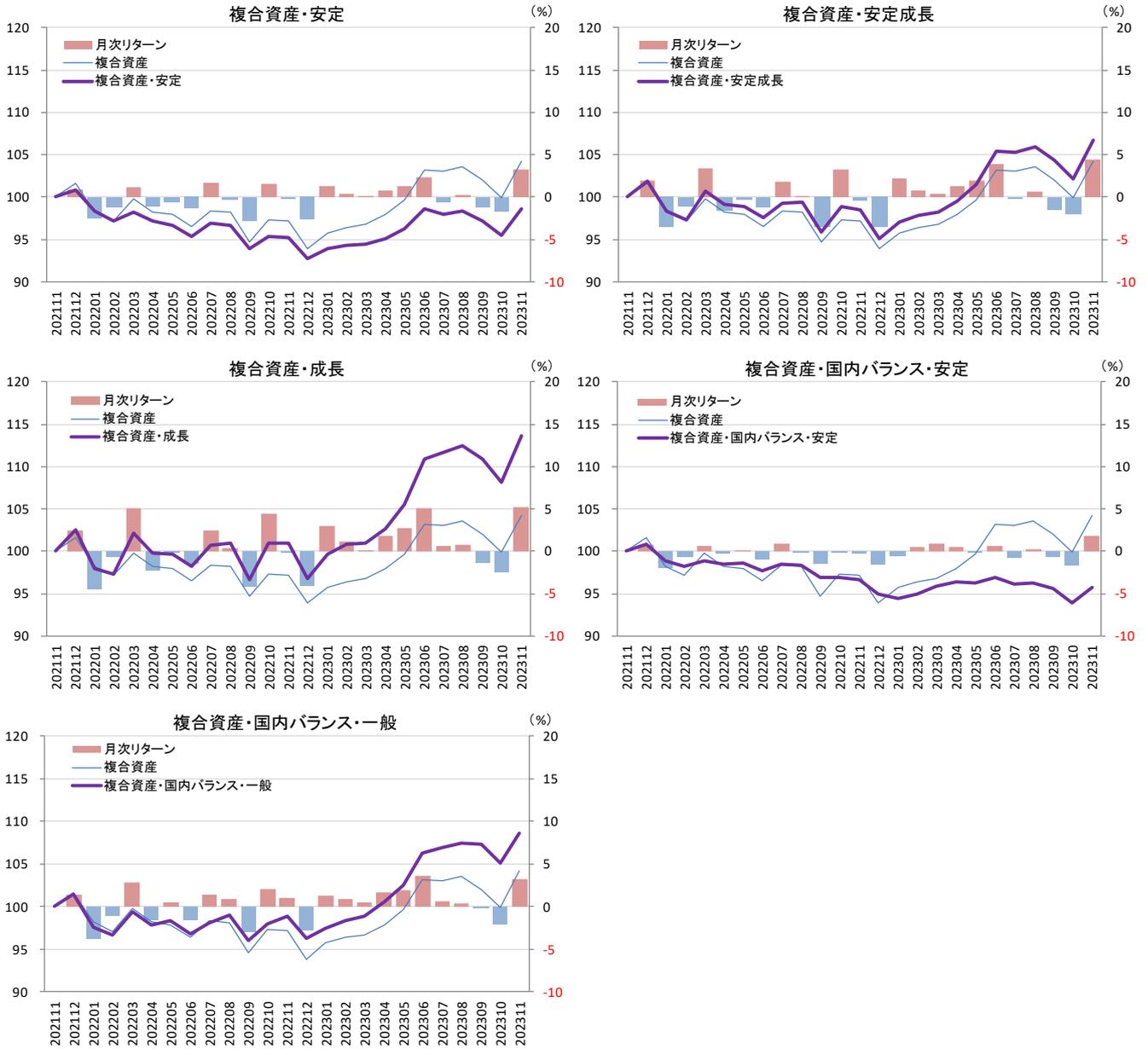


<1>パフォーマンス・サマリー

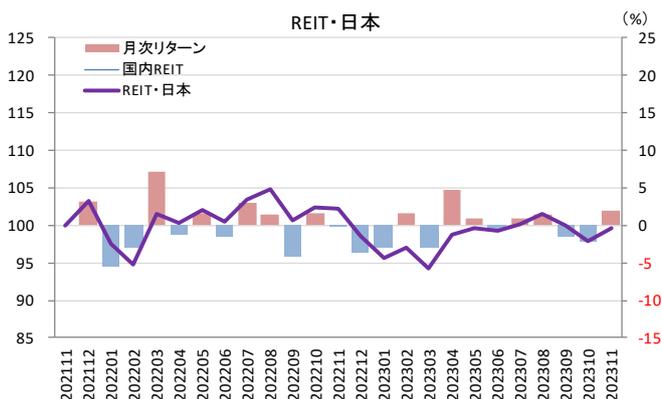
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

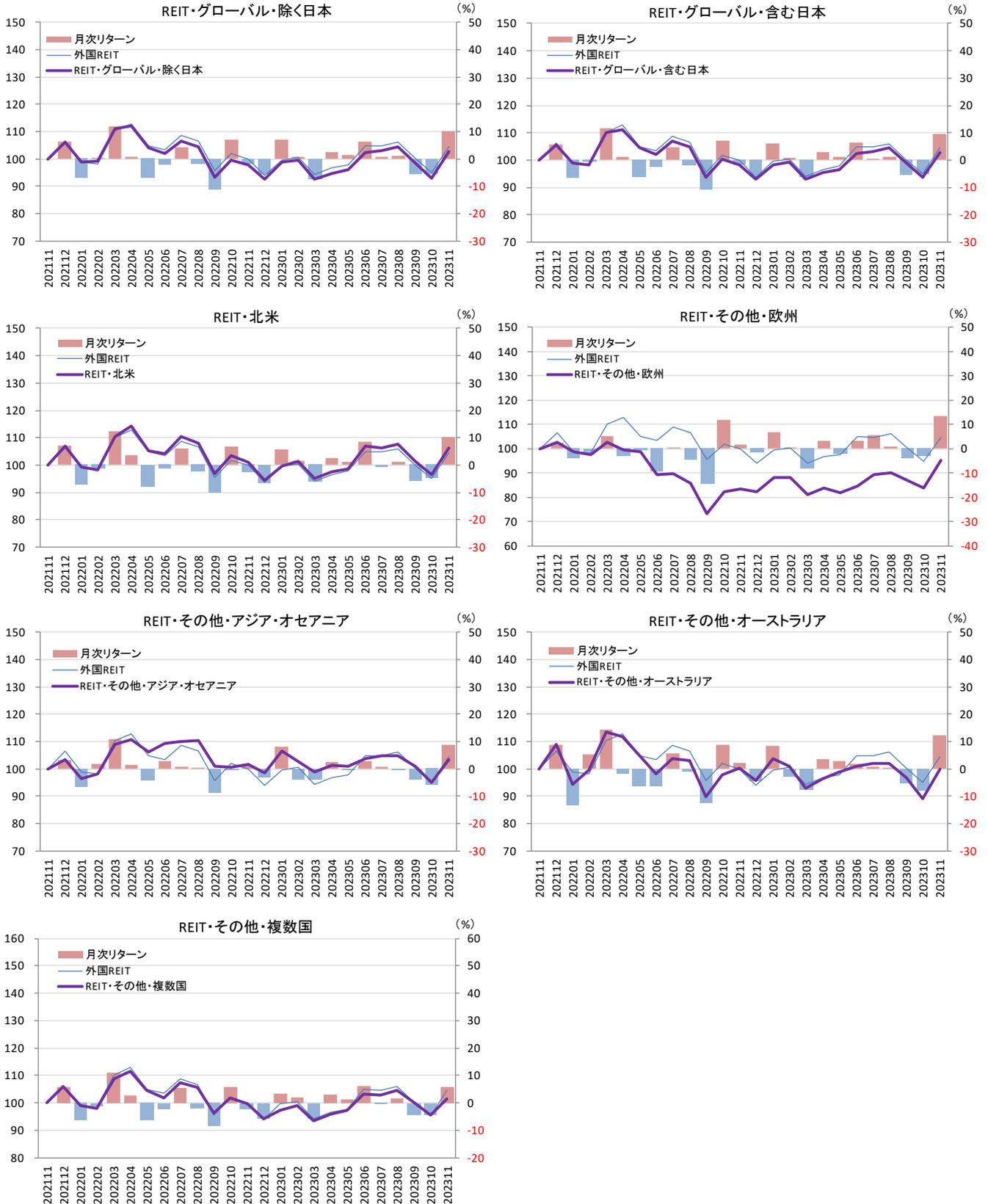


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

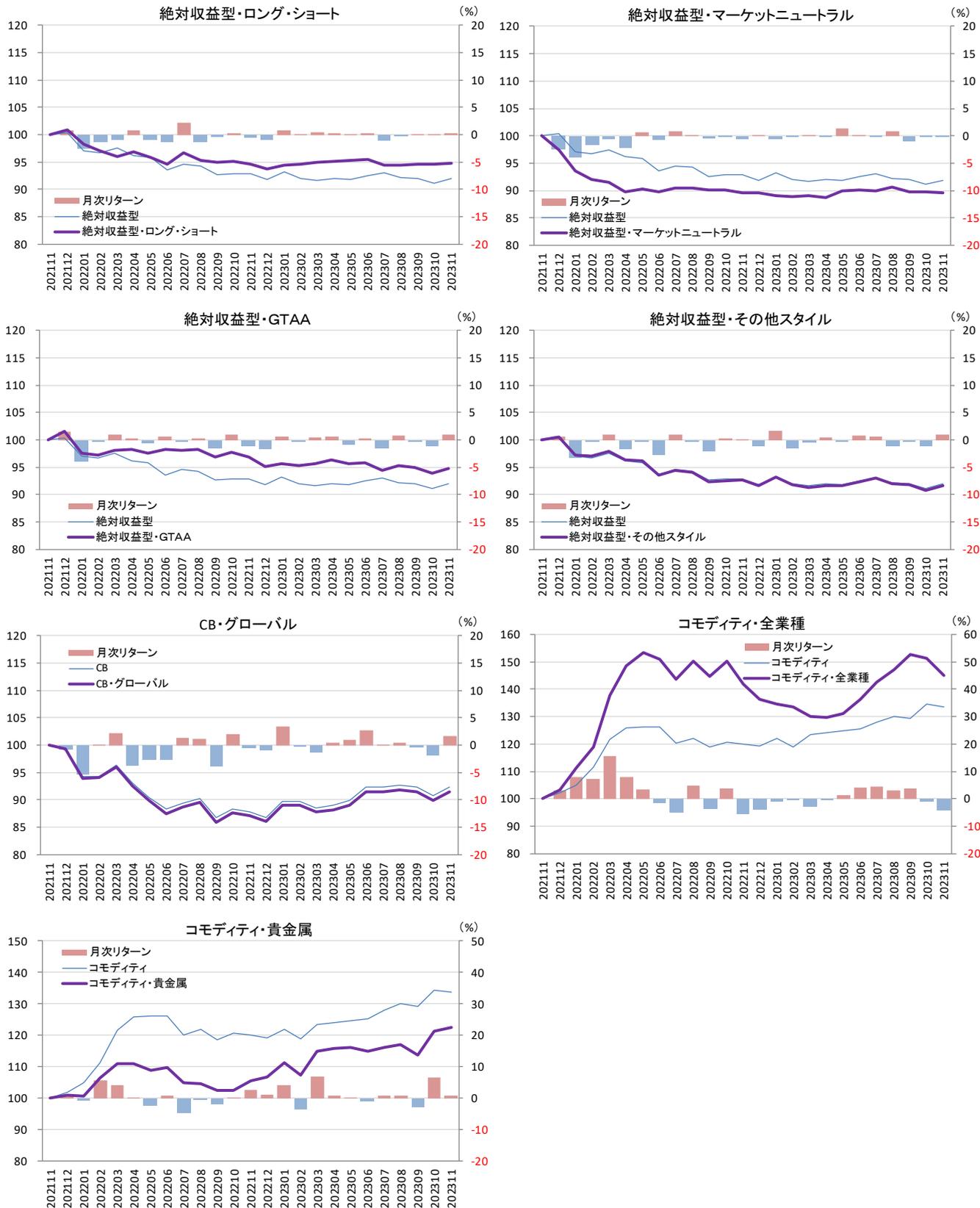


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	6.64		
1	外国株式(先進国)・グローバル	9.75	28.95	2.76
2	外国株式(先進国)・その他	8.21	14.50	1.17
3	国内株式・一般	5.78	7.39	0.43
4	国内株式・その他	6.93	5.02	0.35
5	複合資産・安定成長	4.47	6.32	0.29
6	外国債券(先進国)・グローバル	3.20	7.29	0.24
7	REIT・北米	10.16	2.25	0.22
8	REIT・グローバル	9.96	1.69	0.16
9	複合資産・成長	5.14	3.11	0.16
10	複合資産・安定	3.25	3.69	0.12
11	エマージング株式・その他	4.07	2.66	0.11
12	外国債券(先進国)・その他	5.21	1.62	0.08
13	国内債券・一般	1.72	4.16	0.07
14	エマージング株式・グローバル	5.33	1.07	0.06
15	国内株式・小型	7.35	0.72	0.05
16	REIT・日本	1.91	2.58	0.05
17	ハイイールド債券・北米	3.03	1.52	0.05
18	複合資産・その他	12.79	0.29	0.04
19	エマージング債券・グローバル	4.85	0.65	0.03
20	REIT・その他	9.27	0.26	0.02
21	複合資産・国内バランス	1.89	0.63	0.01
22	ハイイールド債券・グローバル	4.50	0.26	0.01
23	エマージング債券・その他	1.93	0.51	0.01
24	絶対収益型	0.83	1.12	0.01
25	ハイイールド債券・その他	3.79	0.18	0.01
26	国内株式・業種特化	8.17	0.09	0.01
27	CB	1.74	0.27	0.00
28	エマージング株式・BRICS	4.09	0.04	0.00
29	コモディティ	-0.65	0.59	-0.00
	合計		100.00	6.64

◆計算定義

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

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

<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	14.29		
1	外国株式(先進国)・グローバル	21.04	28.49	5.92
2	外国株式(先進国)・その他	24.93	13.62	3.30
3	国内株式・一般	18.51	7.09	1.29
4	国内株式・その他	22.54	4.85	1.09
5	複合資産・安定成長	8.36	6.54	0.56
6	複合資産・成長	12.63	2.98	0.38
7	エマージング株式・その他	15.29	2.25	0.32
8	外国債券(先進国)・グローバル	4.00	7.44	0.30
9	ハイイールド債券・北米	12.88	1.47	0.18
10	エマージング株式・グローバル	13.98	1.06	0.15
11	複合資産・安定	3.50	4.10	0.14
12	REIT・北米	5.22	2.49	0.13
13	エマージング債券・グローバル	14.41	0.67	0.09
14	REIT・グローバル	4.59	1.84	0.08
15	エマージング債券・その他	16.34	0.52	0.08
16	外国債券(先進国)・その他	4.44	1.73	0.08
17	コモディティ	11.29	0.58	0.06
18	ハイイールド債券・グローバル	13.90	0.28	0.04
19	国内株式・小型	3.69	0.76	0.03
20	ハイイールド債券・その他	13.41	0.20	0.03
21	国内株式・業種特化	19.24	0.08	0.02
22	CB	5.19	0.27	0.01
23	複合資産・その他	1.50	0.33	0.01
24	REIT・その他	1.70	0.32	0.00
25	エマージング株式・BRICS	8.24	0.05	0.00
26	複合資産・国内バランス	0.24	0.76	-0.00
27	絶対収益型	-1.02	1.26	-0.02
28	国内債券・一般	-1.31	4.49	-0.06
29	REIT・日本	-2.49	2.95	-0.12
	合計		100.00	14.29

◆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	25.36	42.00	74.27	10.94	12.21	10.71	0.72	0.60	0.54
国内株式	32.35	52.92	120.82	12.24 ↓	15.73	15.30	0.80	0.57	0.54
一般	31.84	51.42	112.44	11.84 ↓	15.39	15.32	0.82	0.56	0.51
フリー	26.96	49.60	108.35	12.33 ↓	15.75	15.68	0.67	0.53	0.49
バリュー	50.16	56.16	125.04	10.74 ↓	14.65	14.45	1.35	0.64	0.59
小型	4.13	26.01	133.38	15.03	19.32	16.75	0.09	0.25	0.53
その他	39.03	60.63	134.59	12.80 ↓	15.85	15.36	0.91	0.63	0.58
日経225	32.17	61.38	143.14	14.44 ↓	17.19	16.15	0.68	0.59	0.58
TOPIX	44.47	58.83	129.06	11.33 ↓	14.73	14.68	1.15	0.66	0.59
JPX日経400	42.51	60.24	-	11.78 ↓	15.04	-	1.07	0.66	-
国内債券	-6.27	-5.03	0.56	2.41 ↑	2.33 ↑	1.98	-0.87	-0.43	0.04
一般	-6.27	-5.03	0.56	2.41 ↑	2.33 ↑	1.98	-0.87	-0.43	0.04
外国株式(先進国)	35.33	81.62	132.88	16.43	18.37	16.12	0.65	0.69	0.55
グローバル	29.14	77.17	137.39	16.73	18.53	16.10	0.53	0.66	0.56
除く日本	63.30	98.50	183.47	14.44	17.92	16.47	1.23	0.82	0.67
含む日本	19.99	70.45	124.23	17.83	19.06	16.26	0.35	0.59	0.52
その他	52.84	91.36	123.39	16.09	18.32	16.46	0.95	0.76	0.51
北米	101.96	139.22	188.22	14.58	19.05	17.53	1.81	1.00	0.64
米国	53.28	103.68	156.83	16.35	18.07	16.82	0.94	0.85	0.59
カナダ	31.49	35.00	16.32	11.96 ↓	18.61	15.99	0.80	0.33	0.10
欧州	40.67	59.63	80.47	14.71 ↓	18.08	16.25	0.82	0.54	0.38
ドイツ	51.89	67.68	-	18.08 ↓	22.44	-	0.83	0.49	-
イギリス	49.48	26.36	-	10.81 ↓	17.22	-	1.33	0.28	-
アジア・オセアニア	12.40	24.94	66.94	10.84	14.84	14.60	0.37	0.31	0.36
オーストラリア	39.57	36.22	52.46	17.64 ↓	23.96	19.78	0.67	0.27	0.22
ニュージーランド	15.00	50.77	166.73	15.36 ↓	17.98	17.24	0.31	0.48	0.60
複合地域	168.27	63.31	39.53	25.75 ↓	33.23	26.68	1.51	0.31	0.13
エマージング株式	36.27	53.18	86.58	10.87 ↓	17.26	16.21	1.00	0.52	0.40
グローバル	23.70	56.65	69.25	11.98 ↓	17.31	16.44	0.62	0.54	0.33
BRICS	2.71	17.44	54.75	13.33 ↓	20.27	19.09	0.07	0.16	0.23
その他	43.32	53.76	96.40	10.95 ↓	17.68	16.44	1.17	0.51	0.43
欧州	-24.67	-27.63	-32.55	34.11	33.19	27.26	-0.26	-0.19	-0.14
ロシア	-89.12	-87.82	-86.23	55.99	48.20	38.46	-0.93	-0.71	-0.47
アジア・オセアニア	11.82	30.20	54.16	12.97 ↓	16.95	15.85	0.29	0.32	0.28
中国	-19.57	32.46	87.07	19.21 ↓	20.52	20.99	-0.36	0.28	0.31
インド	93.78	89.16	247.77	15.11 ↓	22.42	21.31	1.64	0.61	0.62
インドネシア	47.05	27.15	61.14	15.25 ↓	25.70	23.15	0.90	0.19	0.21
タイ	19.51	-0.54	34.32	13.20 ↓	20.78	17.71	0.47	-0.00	0.17
フィリピン	15.32	1.06	11.02	16.32	20.36	17.99	0.30	0.01	0.06
ベトナム	62.69	56.42	126.40	22.57	26.02	21.53	0.78	0.36	0.40
韓国	7.29	34.31	28.17	24.92	25.78	21.07	0.10	0.24	0.12
香港	-6.11	-8.02	15.84	21.12	21.11	19.70	-0.10	-0.08	0.08
中南米	73.30	56.56	50.13	23.72 ↓	30.07	26.55	0.85	0.31	0.16
ブラジル	46.76	18.85	6.59	27.25 ↓	32.94	31.92	0.50	0.11	0.02
メキシコ	112.18	96.04	48.56	21.13	27.02	23.84	1.35	0.53	0.17
中東・アフリカ	49.25	44.99	58.55	14.94	18.93	16.94	0.96	0.41	0.28
トルコ	127.41	95.31	13.74	31.97	33.74	31.84	0.99	0.43	0.04
複合地域	25.28	38.46	41.60	14.60	17.24	15.64	0.54	0.39	0.23

※[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	25.36	42.00	74.27	10.94	12.21	10.71	0.72	0.60	0.54
外国債券(先進国)	3.62	9.60	14.12	4.91 ↑	5.00 ↑	5.37	0.25	0.38	0.25
グローバル	1.36	8.75	14.37	4.40 ↑	4.30 ↑	4.78	0.11	0.40	0.29
除く日本	4.54	12.88	17.85	5.61 ↑	4.82 ↑	5.44	0.27	0.52	0.31
含む日本	-1.31	5.11	11.60	3.74 ↑	4.51	4.48	-0.11	0.23	0.25
その他	12.02	14.12	17.44	7.73 ↑	8.06 ↑	7.67	0.50	0.34	0.21
北米	-0.88	7.28	20.11	5.46 ↑	5.68 ↑	4.95 ↑	-0.05	0.26	0.38
米国	14.88	16.72	31.31	7.64 ↑	8.05 ↑	6.98	0.62	0.39	0.40
カナダ	24.56	26.78	15.41	8.59 ↑	8.05 ↑	8.65	0.89	0.61	0.17
欧州	-6.75	-4.05	-1.28	6.48 ↑	5.65	6.59	-0.35	-0.14	-0.02
イギリス	20.27	21.60	-	10.85 ↑	10.07 ↑	-	0.59	0.40	-
アジア・オセアニア	13.78	15.46	20.25	9.38	9.96	9.21	0.47	0.30	0.20
オーストラリア	14.47	15.94	19.05	9.34	10.01	9.28	0.50	0.30	0.19
ニュージーランド	2.81	7.48	-	10.04 ↑	9.70 ↑	-	0.10	0.15	-
複合地域	5.63	17.47	22.28	7.52	6.34	6.99	0.25	0.52	0.29
エマージング債券	29.20	27.36	38.42	7.35	10.51	10.70	1.22	0.47	0.31
グローバル	17.83	19.69	26.96	7.86	11.90	11.28	0.72	0.31	0.22
米ドル建て	15.35	17.46	26.69	8.38	12.49	11.67	0.59	0.26	0.21
現地通貨建て	25.12	25.67	18.32	7.19	10.39	10.37	1.08	0.45	0.17
その他	44.21	38.26	52.74	8.61	10.29	11.24	1.51	0.65	0.39
ロシア	-94.81	-94.79	-95.71	73.75	58.83	45.08	-0.85	-0.76	-0.60
アジア・オセアニア	12.72	21.06	41.07	5.62 ↑	6.88	6.88	0.73	0.57	0.51
中国	37.52	36.00	-	6.05	6.25	-	1.86	1.02	-
インド	35.66	40.87	94.57	8.32 ↑	9.06	9.58 ↓	1.29	0.79	0.72
インドネシア	42.65	58.40	91.91	9.15	13.81	14.06 ↓	1.38	0.70	0.48
ブラジル	76.40	35.84	55.09	16.15	17.82 ↓	18.41	1.29	0.36	0.24
メキシコ	66.67	102.74	63.40	12.72	16.20	15.57	1.46	0.94	0.32
トルコ	-49.27	-56.16	-78.38	30.30	28.52 ↓	28.03	-0.67	-0.53	-0.51
複合地域	20.61	21.55	14.67	10.26 ↑	11.83	11.82	0.63	0.34	0.12
ハイイールド債券	36.29	36.46	59.40	7.73	11.57	10.45	1.41	0.56	0.46
グローバル	25.30	25.59	45.21	7.08	11.33	10.43	1.11	0.41	0.37
北米	42.59	42.91	71.46	8.21	11.66	10.46	1.53	0.64	0.53
その他	20.47	20.18	32.62	8.36 ↓	12.51	11.37	0.77	0.30	0.25
欧州	23.38	21.94	33.23	9.19 ↓	13.27	12.11	0.79	0.31	0.24
アジア・オセアニア	9.77	12.47	31.99	9.04	11.80	10.24	0.35	0.20	0.28
複合地域	26.87	36.26	52.98	7.41	8.98	8.80	1.12	0.71	0.50
複合資産	13.33	21.23	43.21	6.47	7.40	7.21	0.66	0.54	0.51
安定	3.09	9.41	23.44	4.65 ↑	5.13	5.33	0.23	0.36	0.40
安定成長	17.58	26.58	50.77	6.81	7.91	7.60	0.82	0.62	0.55
成長	30.56	45.50	88.35	8.66	10.89	10.47	1.08	0.72	0.63
国内バランス	-0.36	-2.82	3.64	3.23 ↑	3.99	4.89	-0.03	-0.13	0.08
安定	-2.12	-4.86	8.05	3.13 ↑	3.84	3.11	-0.22	-0.25	0.25
一般	18.37	26.79	39.44	6.36	8.06	8.71	0.91	0.61	0.39
その他	-8.67	17.14	-	19.49 ↑	18.30	-	-0.15	0.18	-

※[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	25.36	42.00	74.27	10.94	12.21	10.71	0.72	0.60	0.54
国内REIT	21.39	20.67	72.10	10.82 ↓	14.87	12.17	0.62	0.26	0.46
日本	21.39	20.67	72.10	10.82 ↓	14.87	12.17	0.62	0.26	0.46
外国REIT	45.37	39.92	108.69	18.04	19.61	16.55	0.74	0.36	0.46
グローバル	39.01	30.29	81.77	17.68	20.23	16.75	0.66	0.27	0.37
除く日本	41.07	37.55	103.99	18.27	20.91	17.17	0.67	0.32	0.43
含む日本	38.25	28.21	77.85	17.41	19.97	16.60	0.66	0.26	0.36
北米	55.50	50.78	136.32	19.02 ↑	19.53 ↑	16.88	0.83	0.44	0.53
その他	19.64	22.74	85.27	15.22	19.64	16.05	0.41	0.21	0.40
欧州	9.36	1.07	25.32	18.99	21.88	18.55	0.16	0.01	0.12
アジア・オセアニア	17.64	23.98	89.90	14.23	18.11	15.28	0.39	0.24	0.43
オーストラリア	20.63	16.89	64.34	22.91	29.81	23.14	0.28	0.11	0.22
複合地域	40.72	13.16	31.70	15.91 ↓	25.10	20.25	0.76	0.10	0.14
複数国	41.90	41.64	139.60	15.94	17.75	14.98	0.78	0.41	0.61
その他									
絶対収益型	-5.11	-3.10	-3.60	3.62	3.24	2.74	-0.47	-0.18	-0.13
ロング・ショート	-5.64	-3.92	-9.65	3.08	3.21	3.03	-0.61	-0.24	-0.33
マーケットニュートラル	-9.93	-6.37	20.61	4.03 ↓	4.03	5.42	-0.84	-0.32	0.35
GTAA	1.26	9.08	7.44	4.00 ↓	4.48	3.45	0.11	0.40	0.21
その他スタイル	-4.59	-3.38	-3.60	4.02	3.52	3.00	-0.38	-0.18	-0.12
CB	-0.30	12.26	21.06	6.95 ↓	8.83	7.62	-0.01	0.27	0.26
アジア・オセアニア	32.93	48.81	102.92	9.28 ↓	12.04	11.26	1.08	0.69	0.65
日本	1.98	0.40	18.99	4.25	5.00	5.19	0.16	0.02	0.34
グローバル	-1.17	11.91	19.63	7.19 ↓	9.07	7.71	-0.05	0.26	0.24
コモディティ	57.51	72.75	18.88	10.45	11.12	12.05	1.57	1.04	0.15
全業種	113.74	79.08	21.20	16.47	19.17	16.95	1.75	0.65	0.12
貴金属	25.50	68.33	51.96	12.37 ↓	12.51	11.28 ↓	0.64	0.88	0.38
エネルギー	216.85	138.46	33.28	26.07 ↓	35.91	31.63	1.80	0.53	0.09
その他コモディティ	88.77	54.81	25.54	15.17	19.04	17.02	1.56	0.48	0.14

※[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

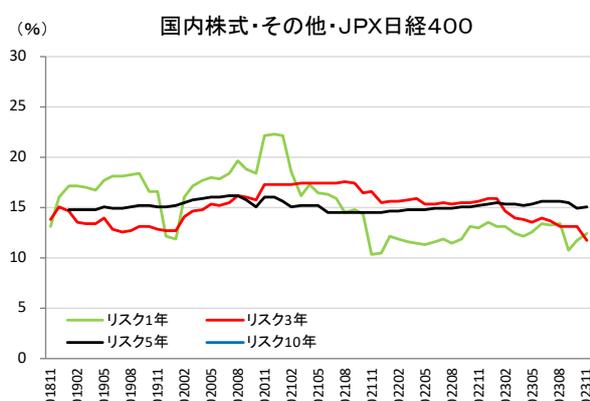
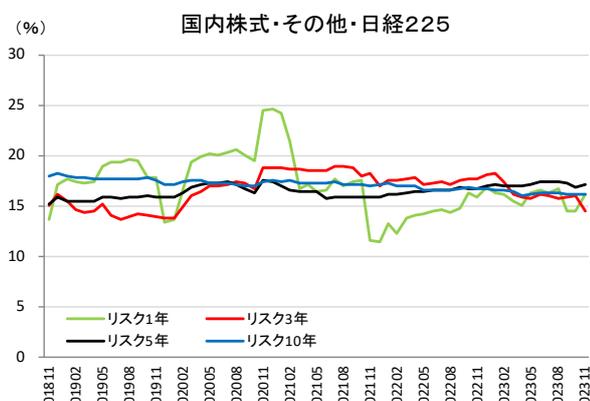
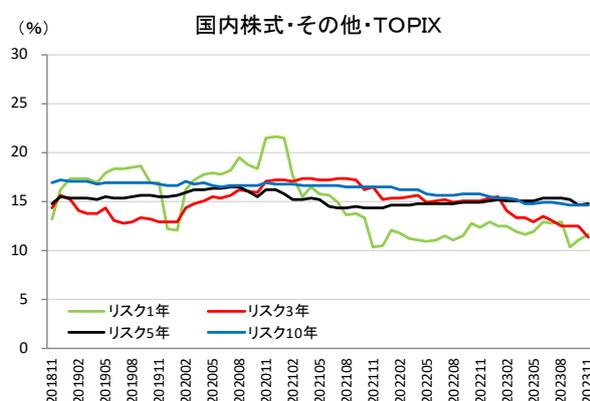
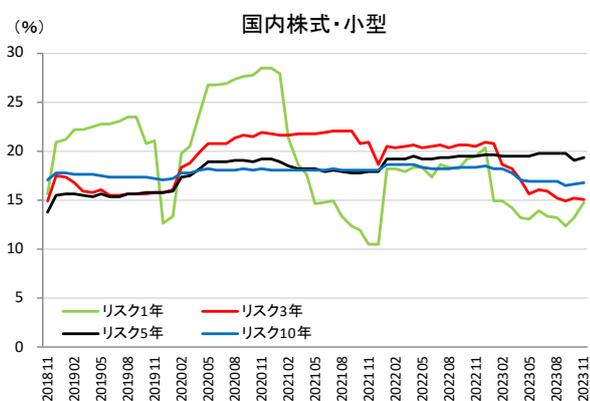
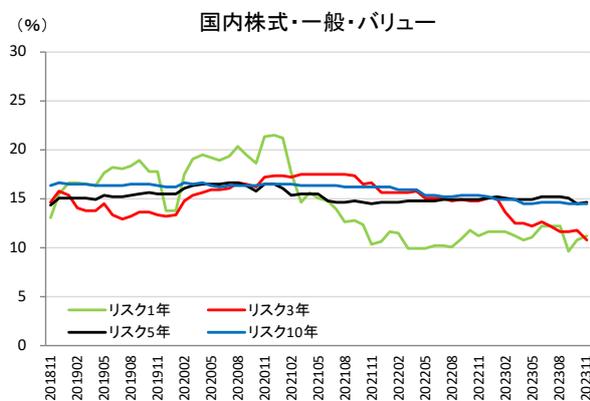
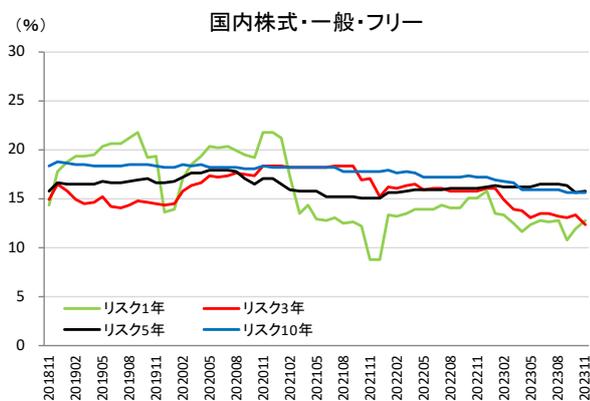
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

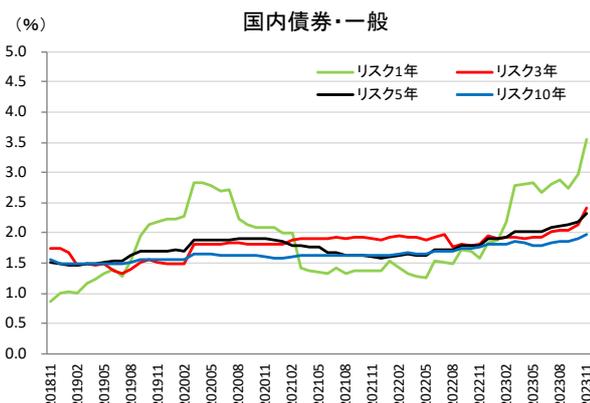
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

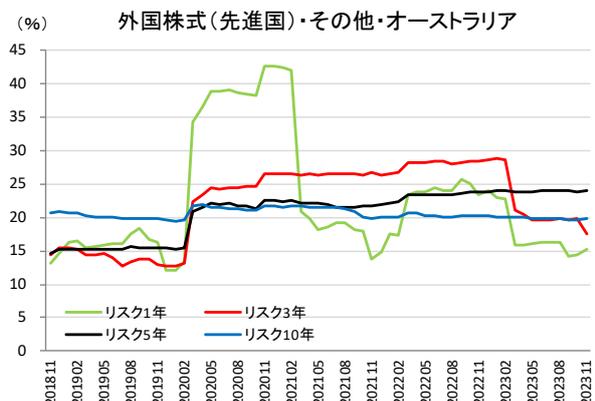
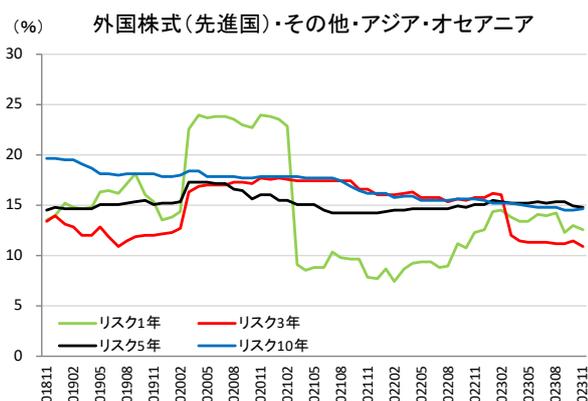
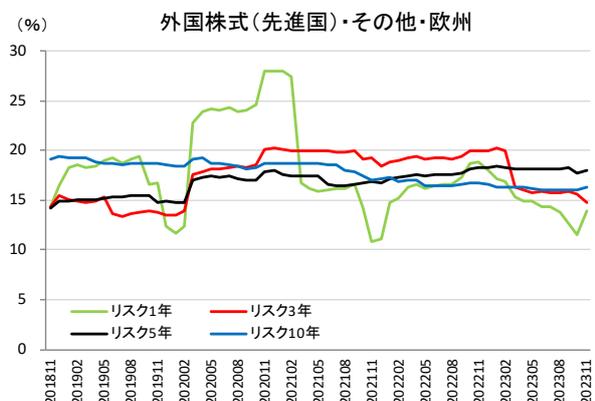
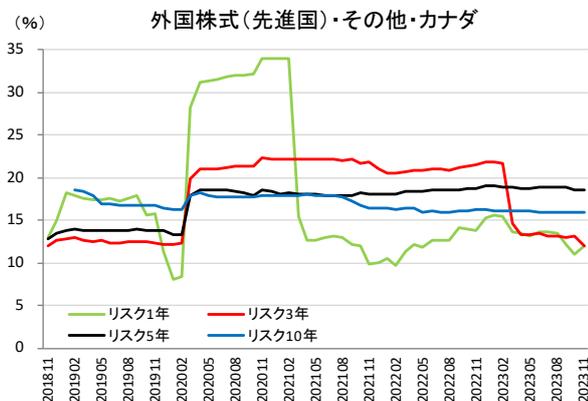
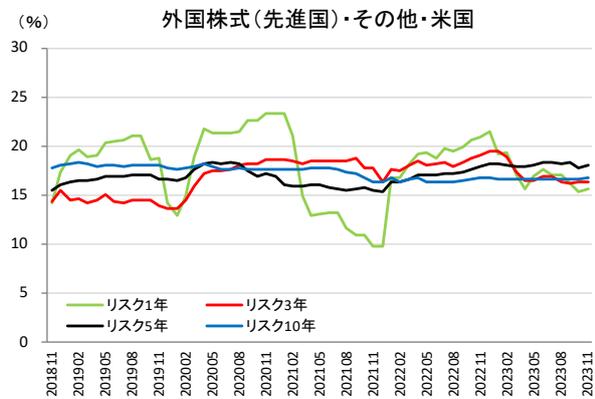
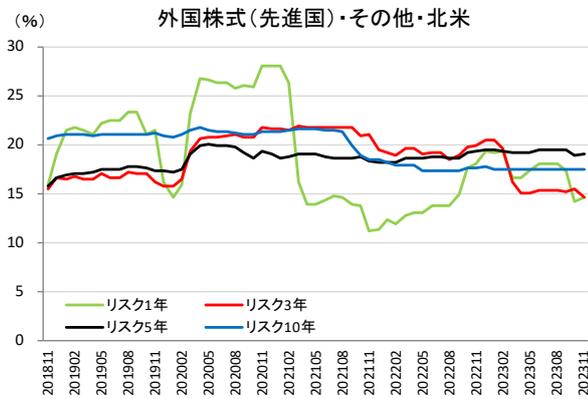
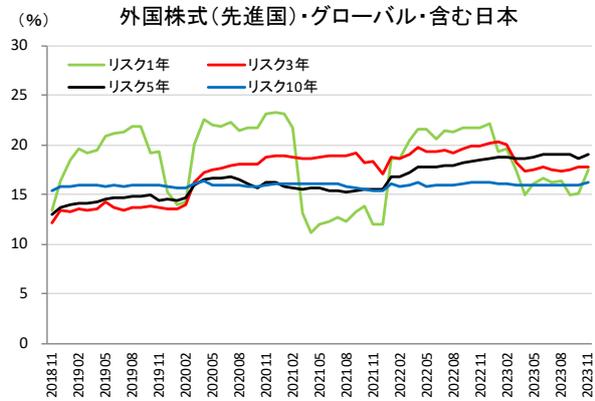
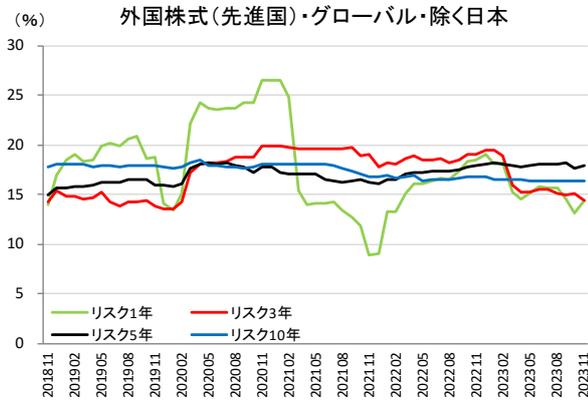


<2> リスク・サマリー

(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)]

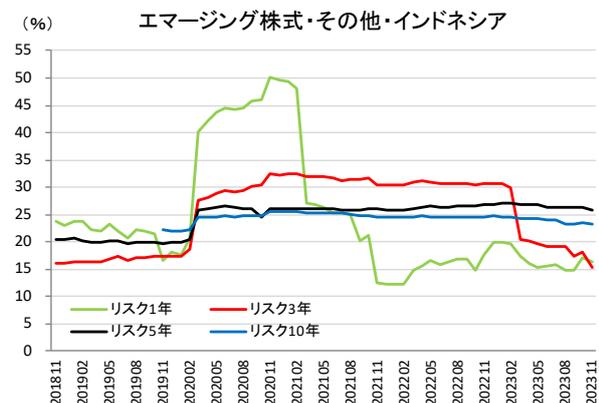
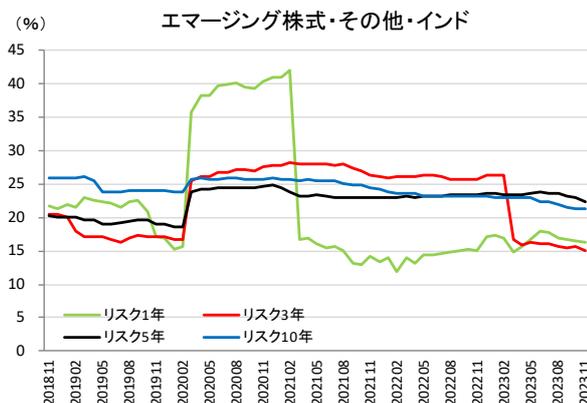
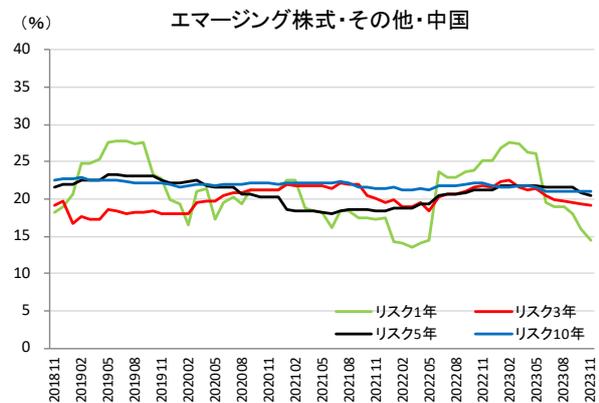
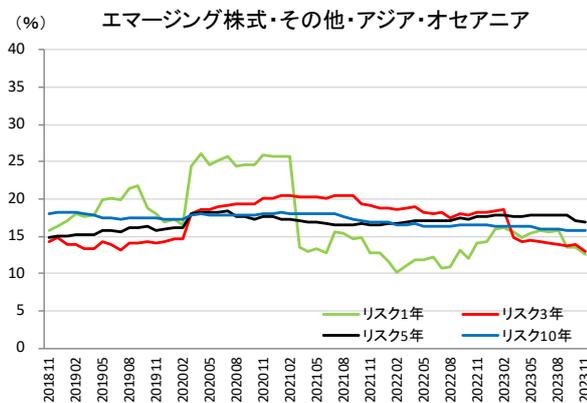
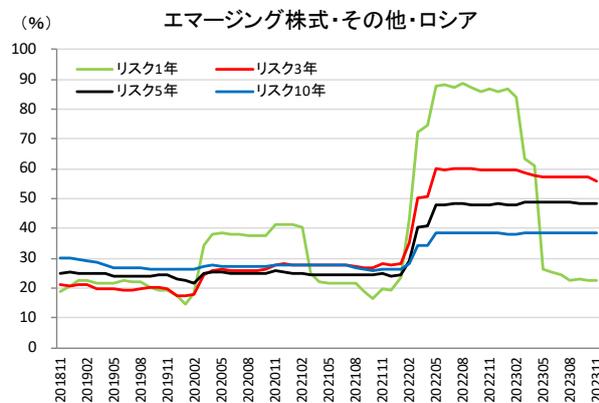
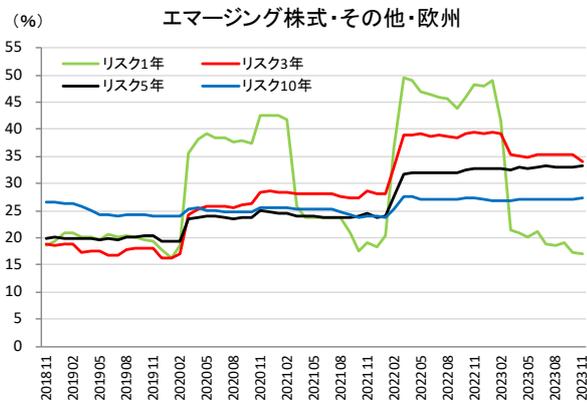
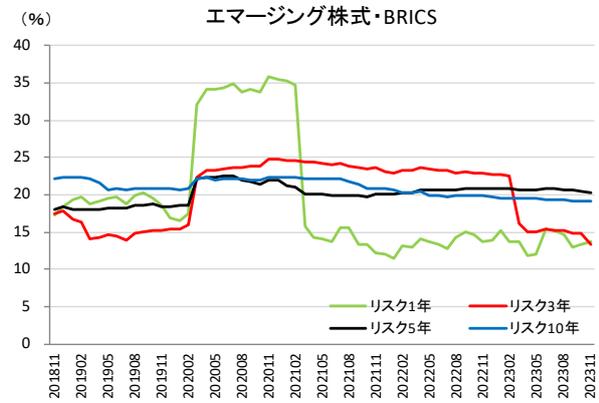
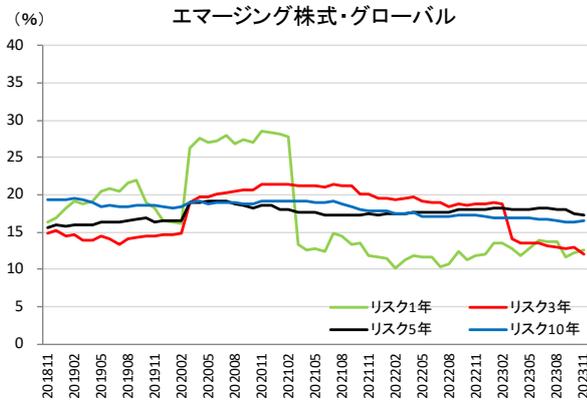


<2> リスク・サマリー

(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]

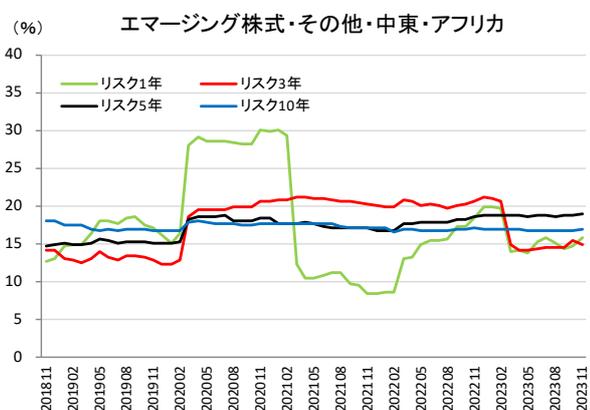
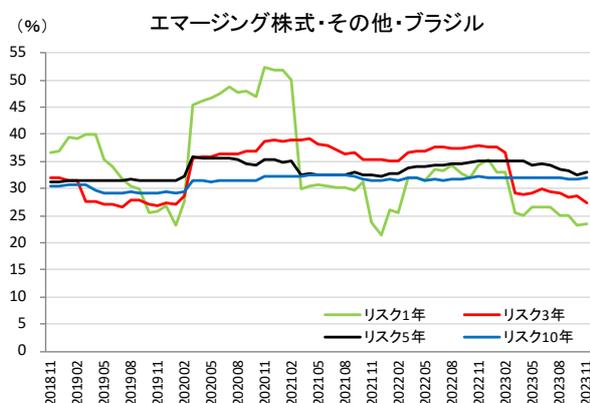
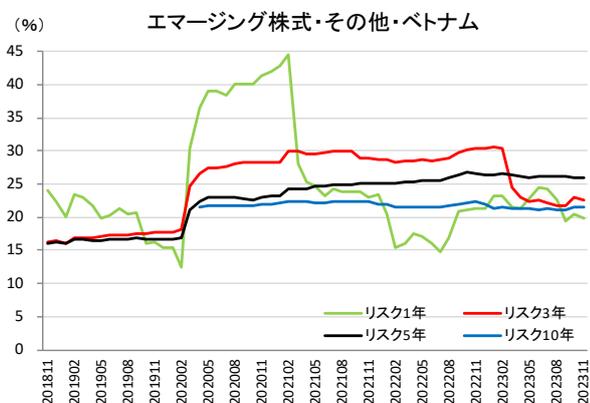
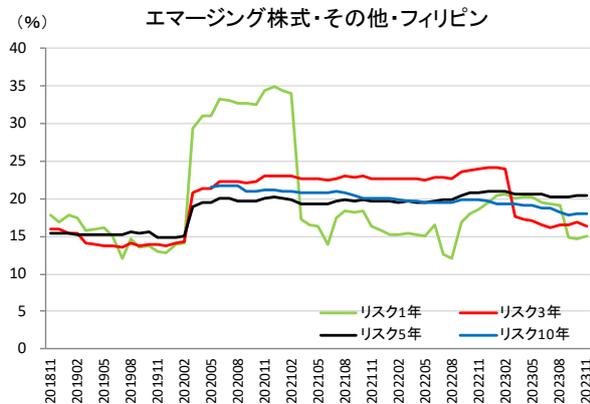
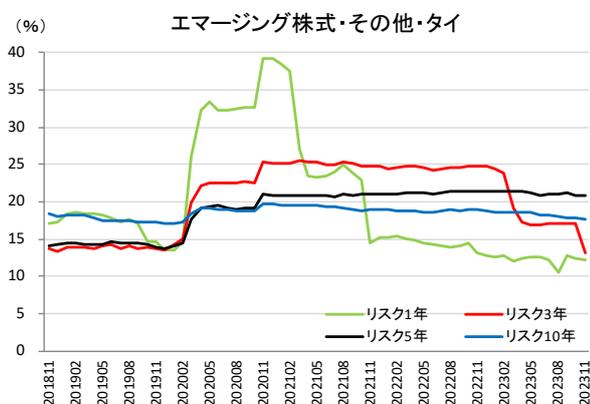


<2> リスク・サマリー

(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]

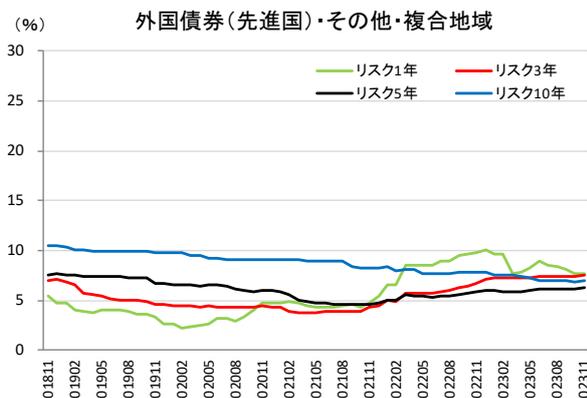
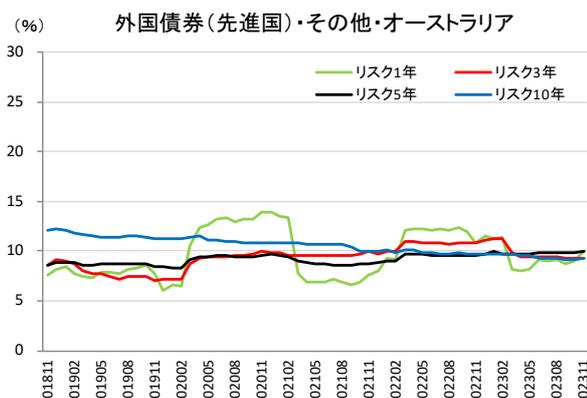
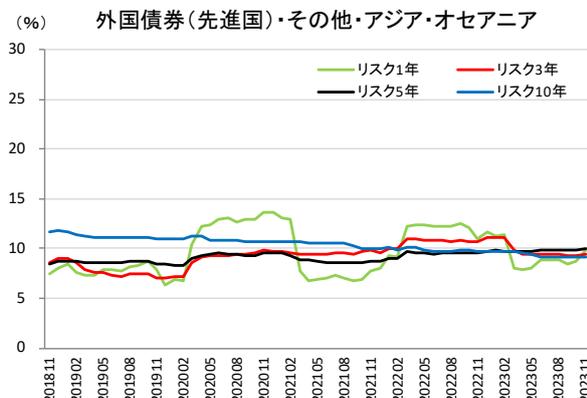
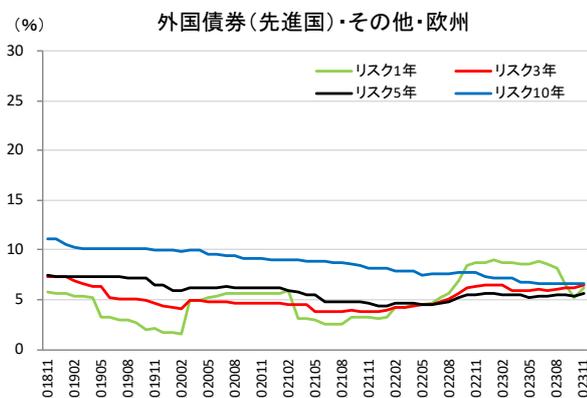
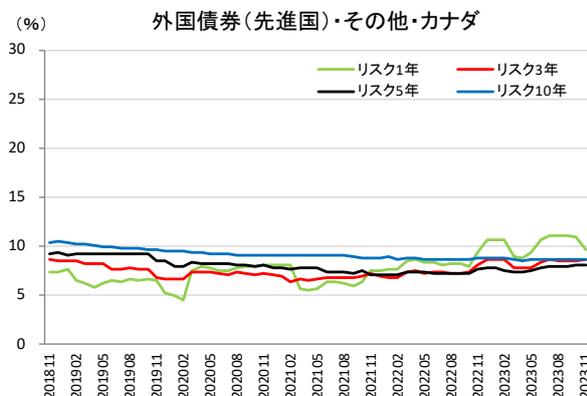
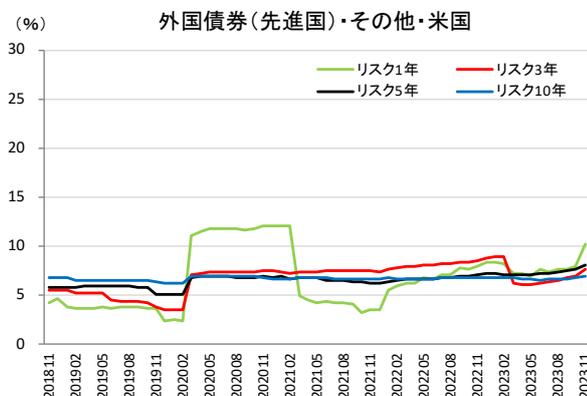
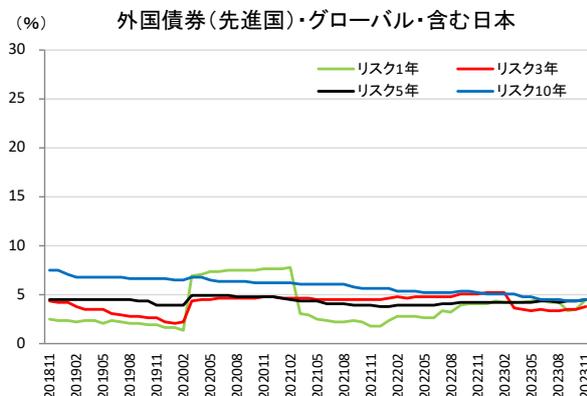
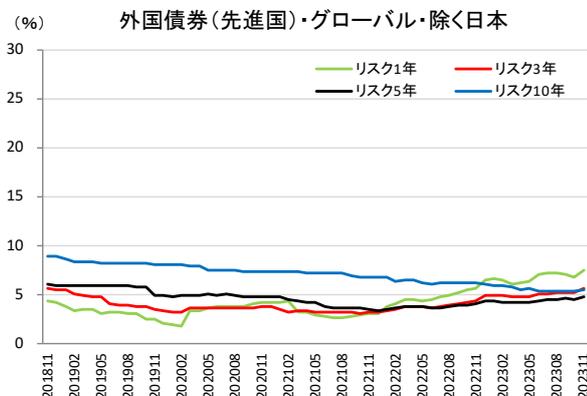


<2> リスク・サマリー

(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)]

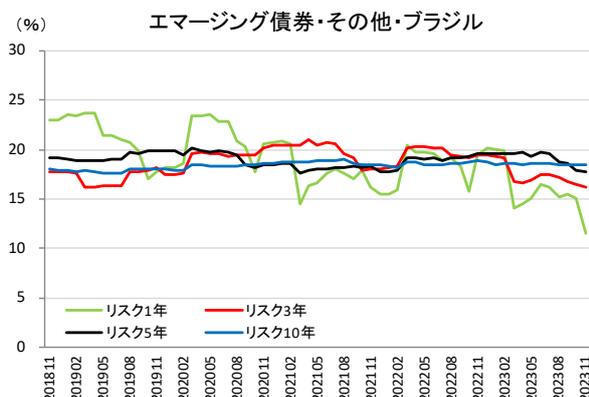
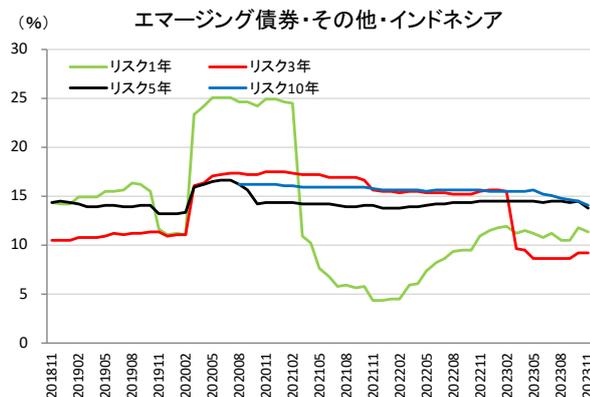
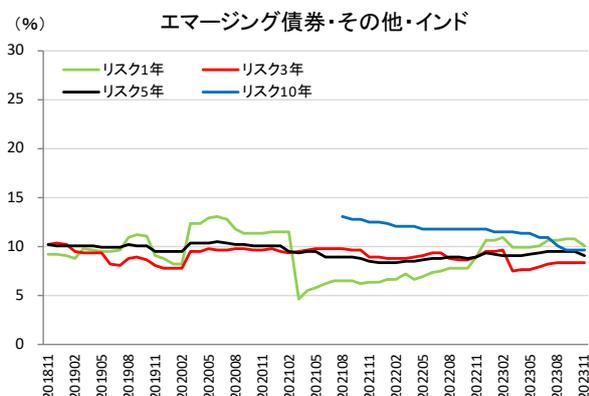
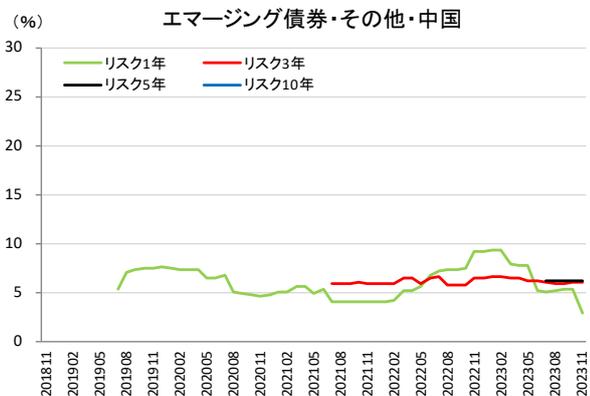
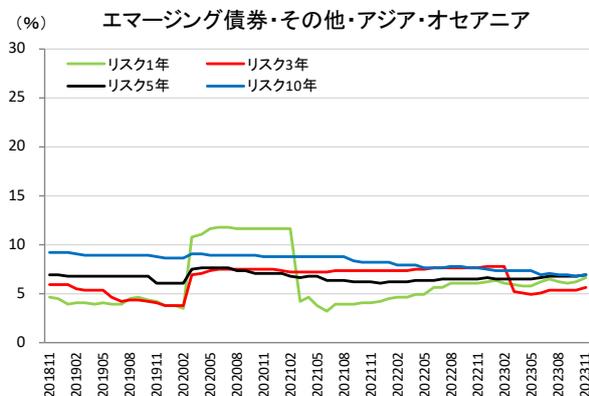
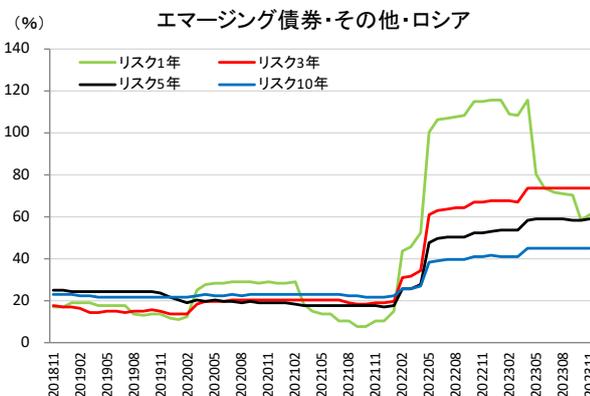
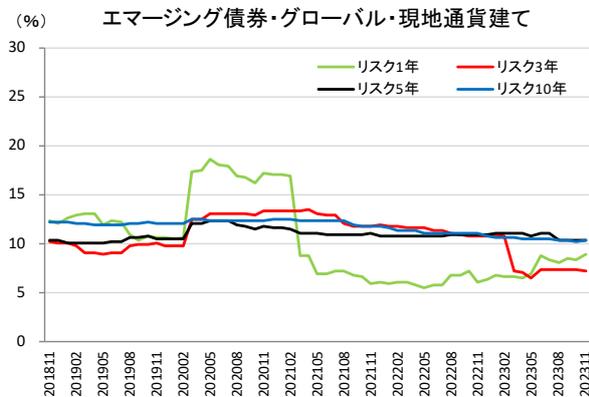
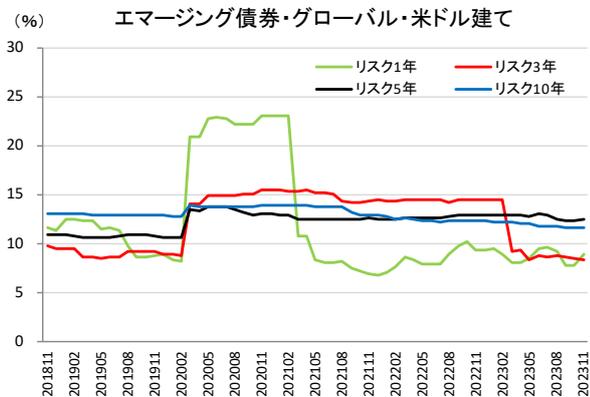


<2> リスク・サマリー

(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]

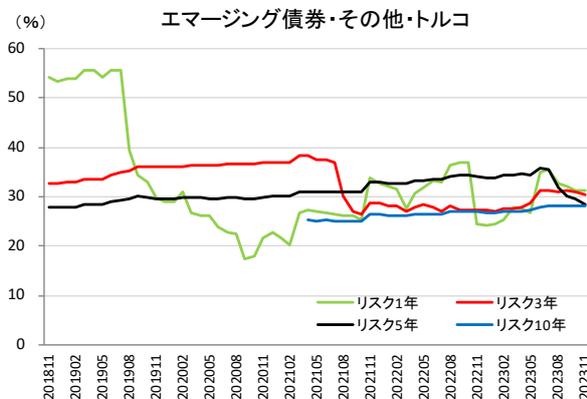
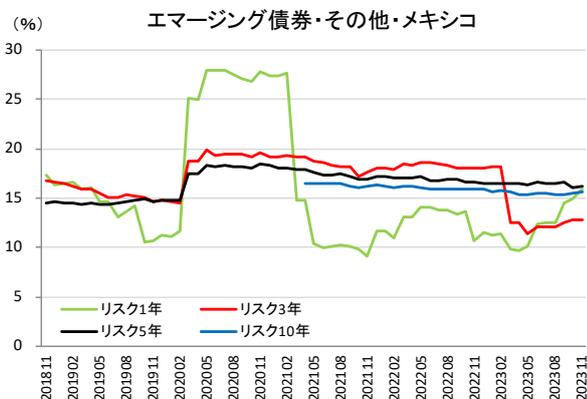


<2>リスク・サマリー

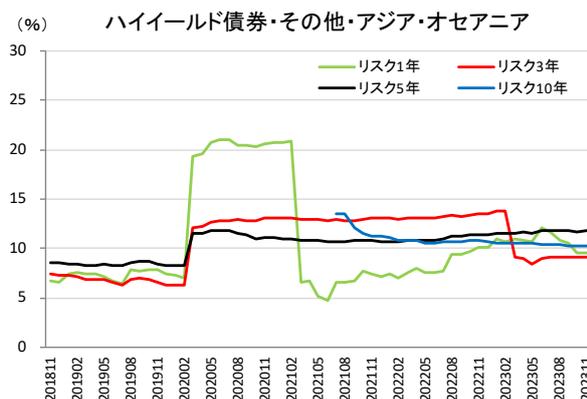
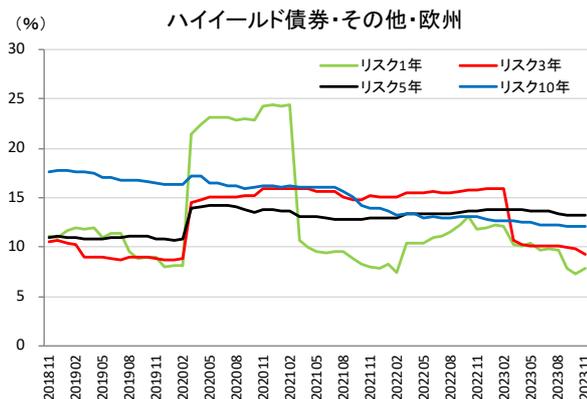
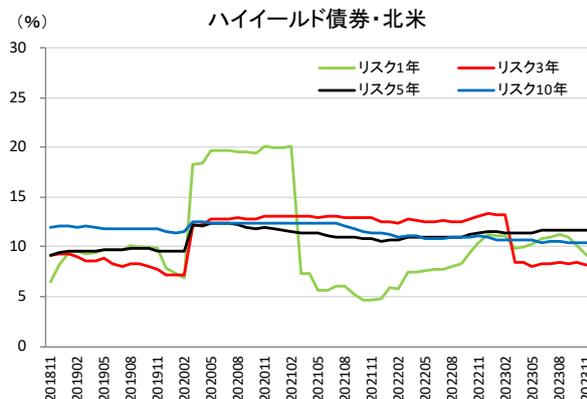
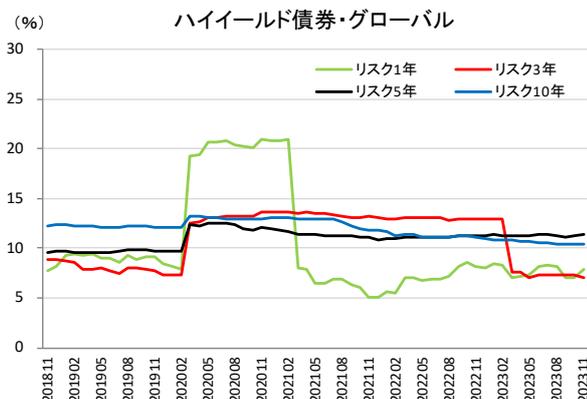
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

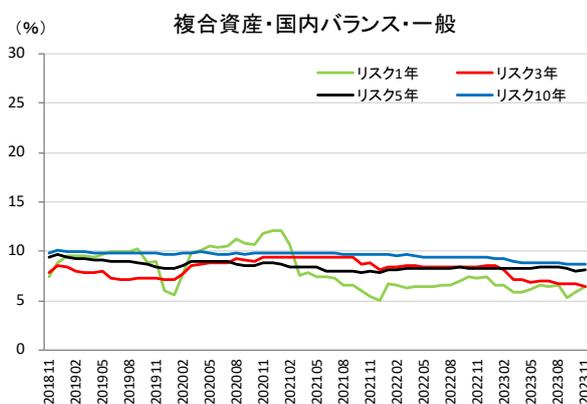
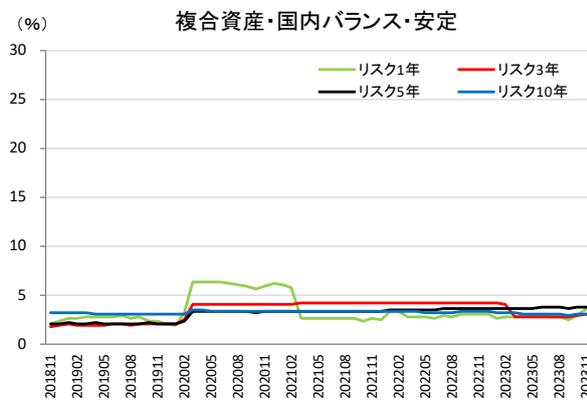
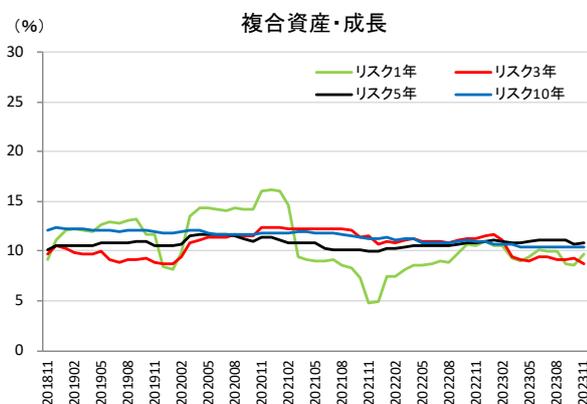
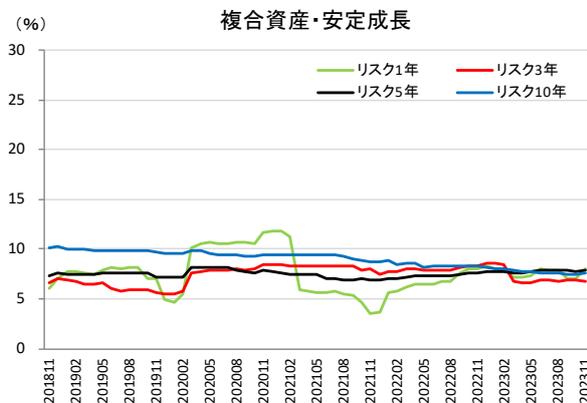
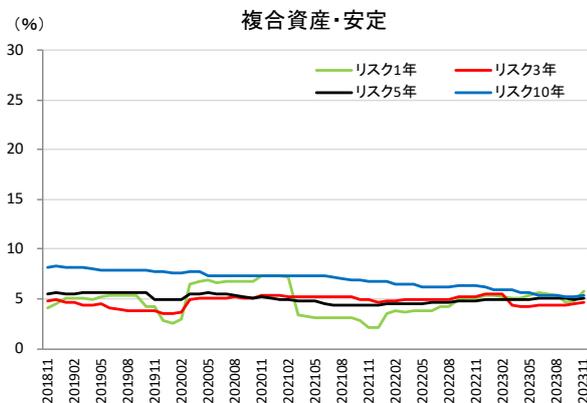


<2>リスク・サマリー

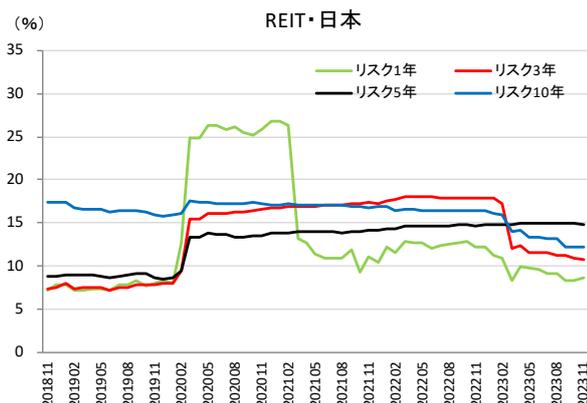
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

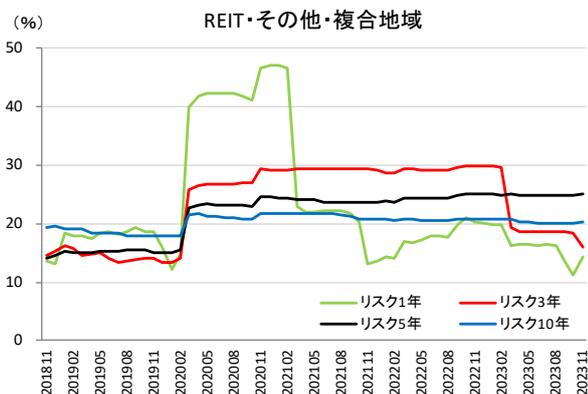
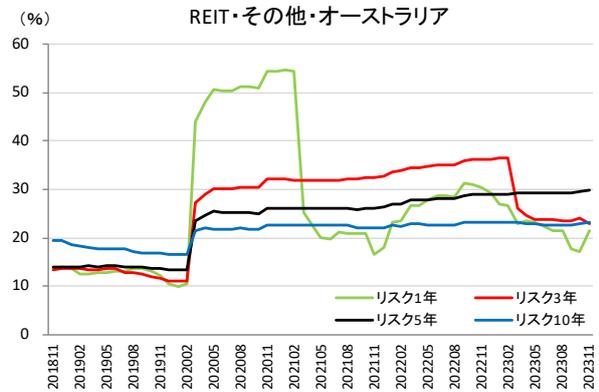
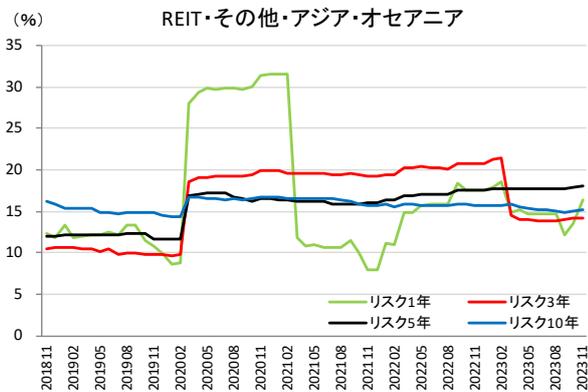
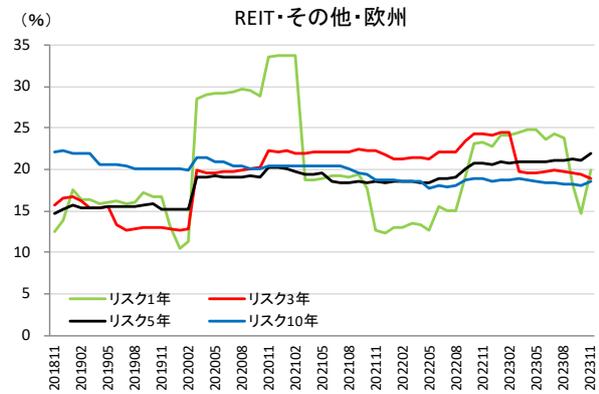
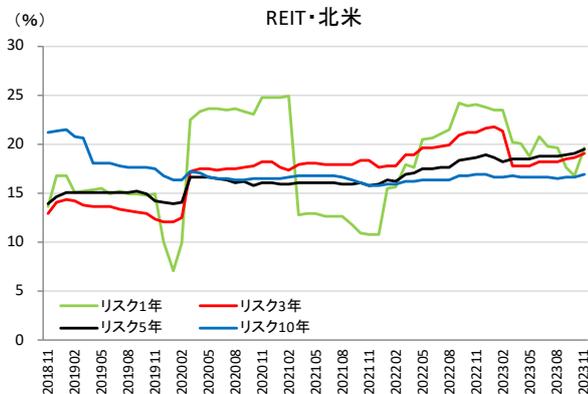
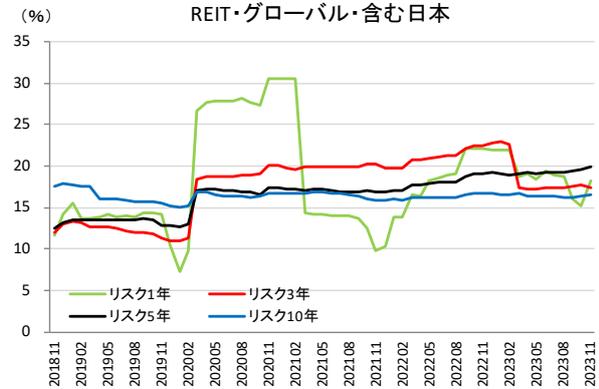
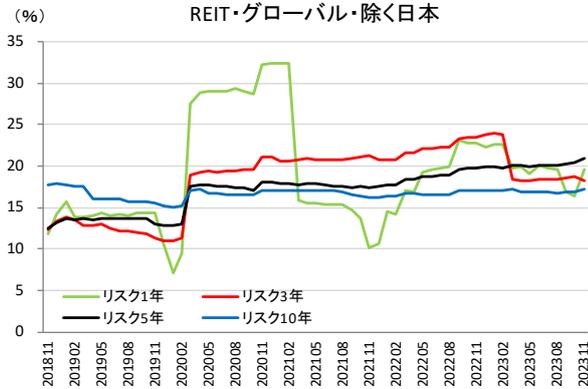


<2> リスク・サマリー

(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]

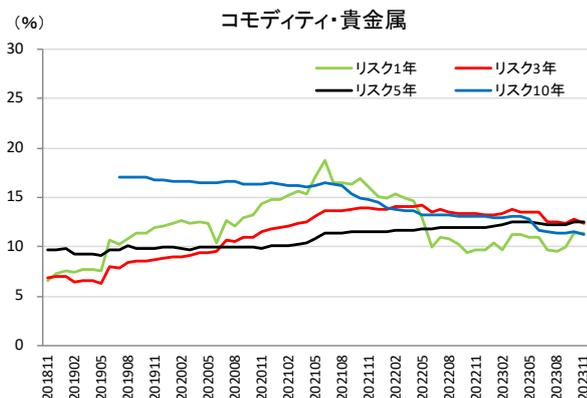
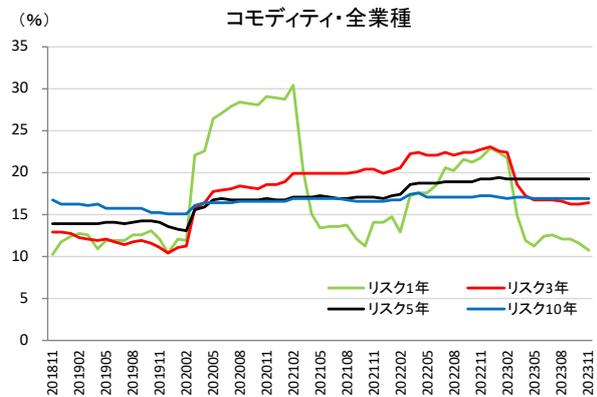
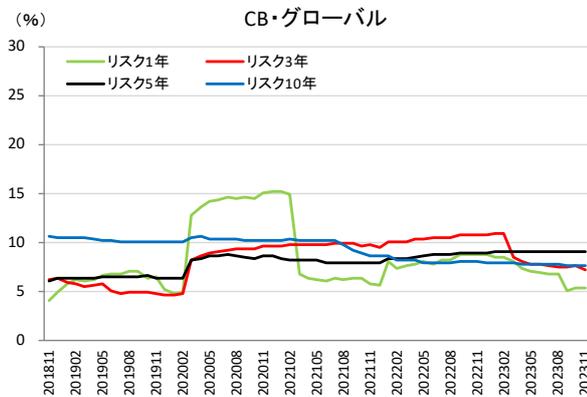
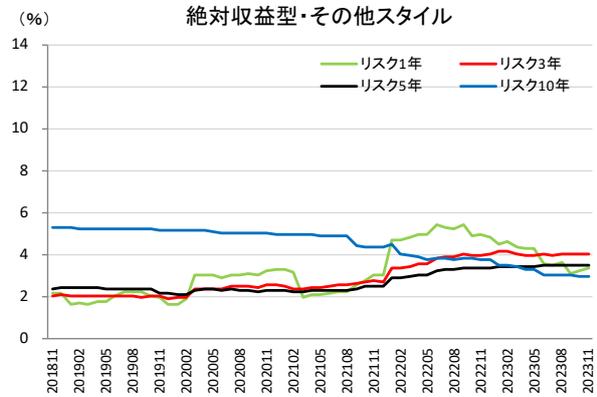
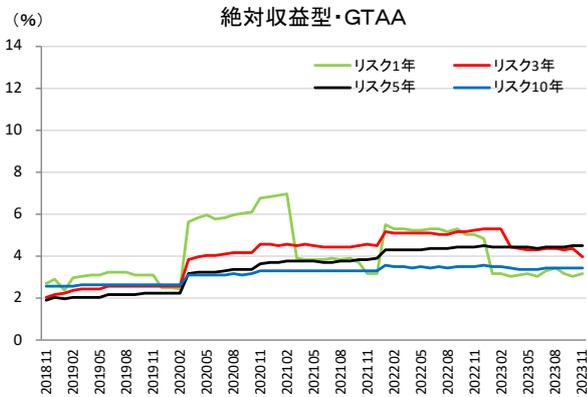
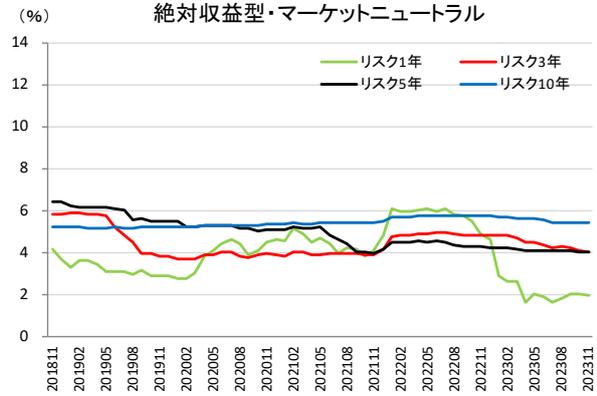
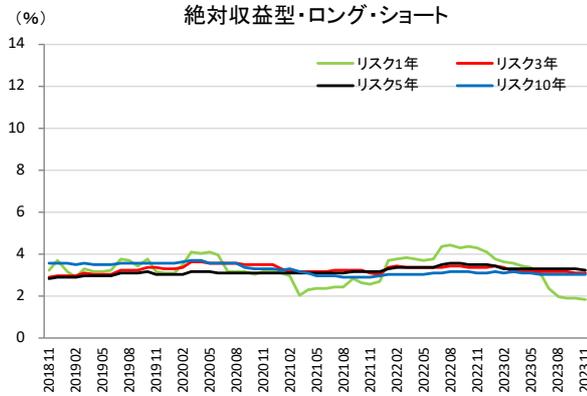


<2> リスク・サマリー

(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	599	23,854	48,226	74,692
国内株式	-1,065	4,031	8,472	9,889
一般	622	2,720	5,041	7,558
フリー	90	823	1,626	2,434
バリュー	532	1,892	3,410	5,120
小型	-43	16	366	435
その他	-1,706	1,166	2,904	1,706
日経225	-1,738	6	1,083	-953
TOPIX	-19	710	1,441	2,094
JPX日経400	-28	24	43	1
国内債券	123	1,825	3,280	700
一般	123	1,825	3,280	700
外国株式(先進国)	1,821	11,812	20,222	32,704
グローバル	460	5,929	11,377	18,077
除く日本	607	2,643	3,968	7,813
含む日本	-147	3,286	7,409	10,263
その他	1,361	5,883	8,845	14,627
北米	71	179	361	703
米国	1,317	5,794	8,755	14,485
カナダ	-2	-5	-13	-22
欧州	-4	-18	-76	-196
ドイツ	0	0	-1	-2
イギリス	0	0	0	0
アジア・オセアニア	0	-2	-3	-6
オーストラリア	-18	-55	-163	-321
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	-2	-9	-15	-13
エマージング株式	796	3,115	6,248	8,598
グローバル	44	188	413	798
BRICS	-4	-9	-22	-37
その他	756	2,936	5,857	7,838
欧州	1	1	2	3
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	2	-47	-268	-356
中国	-48	-165	-314	-403
インド	786	3,130	6,451	8,375
インドネシア	1	8	25	45
タイ	0	0	-3	-5
フィリピン	0	-1	-2	0
ベトナム	14	9	9	245
韓国	0	0	0	-4
香港	0	1	1	0
中南米	-1	-2	-7	-9
ブラジル	-11	-16	-45	-49
メキシコ	0	0	0	0
中東・アフリカ	-2	-8	-13	-19
トルコ	-1	-1	-5	-13
複合地域	13	27	27	27

<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	599	23,854	48,226	74,692
外国債券(先進国)	-208	2,211	5,208	10,286
グローバル	-152	2,264	4,971	8,896
除く日本	22	812	1,672	2,652
含む日本	-174	1,453	3,299	6,244
その他	-56	-53	237	1,390
北米	4	9	19	39
米国	74	238	774	2,151
カナダ	-16	-35	-82	-119
欧州	-7	-12	-25	80
イギリス	0	0	-1	-2
アジア・オセアニア	-19	-40	-49	-60
オーストラリア	-81	-193	-370	-626
ニュージーランド	-2	1	10	6
複合地域	-8	-20	-39	-78
エマージング債券	14	-7	198	173
グローバル	4	-75	74	108
米ドル建て	-15	-93	30	-2
現地通貨建て	19	18	44	110
その他	10	69	124	65
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-4	-8	-12	-20
中国	-7	-15	-17	3
インド	49	149	323	384
インドネシア	2	12	28	28
ブラジル	-23	-58	-180	-285
メキシコ	-6	-11	-17	-37
トルコ	0	0	0	-3
複合地域	0	-1	-3	-4
ハイイールド債券	140	386	892	1,861
グローバル	-19	-61	-119	-190
北米	184	508	1,133	2,261
その他	-25	-61	-121	-211
欧州	-19	-47	-98	-200
アジア・オセアニア	-6	-14	-21	-9
複合地域	0	-1	-1	-2
複合資産	-90	1,305	3,284	6,136
安定	-189	-435	-759	-1,151
安定成長	6	838	1,911	3,680
成長	238	1,234	2,684	4,664
国内バランス	-124	-285	-501	-1,083
安定	-143	-359	-645	-1,352
一般	-4	-8	-16	-29
その他	-21	-47	-50	27

< 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	599	23,854	48,226	74,692
国内REIT	-315	-474	-332	760
日本	-315	-474	-332	760
外国REIT	-227	-112	102	1,662
グローバル	-89	-48	-81	52
除く日本	7	190	415	919
含む日本	-96	-238	-497	-866
北米	-85	56	367	1,775
その他	-52	-119	-184	-164
欧州	-1	-2	-11	-16
アジア・オセアニア	-41	-98	-133	-76
オーストラリア	-7	-14	-29	-53
複合地域	-1	-1	-2	-3
複数国	-2	-4	-8	-17
その他	-390	-238	651	1,923
絶対収益型	-110	-319	88	18
ロング・ショート	-16	-14	55	24
マーケットニュートラル	-7	-42	-67	-167
GTAA	-6	-20	-33	-76
その他スタイル	-82	-246	127	249
CB	208	235	217	1,112
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-2
日本	1	2	2	-1
グローバル	207	234	217	1,116
コモディティ	15	-6	339	718
全業種	1	4	35	129
貴金属	14	-8	314	599
エネルギー	1	-3	-14	-16
その他コモディティ	-1	0	4	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	1,038,533	100.00	5,352	100.00
国内株式	136,919	13.18	774	14.46
一般	76,962	7.41	475	8.88
フリー	56,027	5.39	379	7.08
バリュー	20,906	2.01	94	1.76
小型	7,507	0.72	88	1.64
その他	51,518	4.96	205	3.83
日経225	24,433	2.35	71	1.33
TOPIX	22,257	2.14	82	1.53
JPX日経400	865	0.08	14	0.26
国内債券	43,079	4.15	147	2.75
一般	43,079	4.15	147	2.75
外国株式(先進国)	453,251	43.64	1,206	22.53
グローバル	302,935	29.17	839	15.68
除く日本	90,434	8.71	195	3.64
含む日本	212,501	20.46	644	12.03
その他	150,316	14.47	367	6.86
北米	1,578	0.15	13	0.24
米国	144,287	13.89	283	5.29
カナダ	131	0.01	2	0.04
欧州	1,581	0.15	39	0.73
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	35	0.00	1	0.02
オーストラリア	2,639	0.25	23	0.43
ニュージーランド	12	0.00	1	0.02
複合地域	27	0.00	1	0.02
エマージング株式	39,180	3.77	313	5.85
グローバル	10,978	1.06	94	1.76
BRICS	456	0.04	7	0.13
その他	27,747	2.67	212	3.96
欧州	89	0.01	6	0.11
ロシア	8	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,328	0.42	86	1.61
中国	1,397	0.13	33	0.62
インド	19,440	1.87	34	0.64
インドネシア	195	0.02	5	0.09
タイ	8	0.00	2	0.04
フィリピン	30	0.00	4	0.07
ベトナム	1,471	0.14	13	0.24
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	15	0.00	1	0.02
中南米	63	0.01	2	0.04
ブラジル	521	0.05	12	0.22
メキシコ	8	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	68	0.01	3	0.06
トルコ	56	0.01	2	0.04
複合地域	46	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	1,038,533	100.00	5,352	100.00
外国債券(先進国)	92,258	8.88	740	13.83
グローバル	75,437	7.26	530	9.90
除く日本	34,061	3.28	223	4.17
含む日本	41,376	3.98	307	5.74
その他	16,821	1.62	210	3.92
北米	108	0.01	8	0.15
米国	7,301	0.70	108	2.02
カナダ	661	0.06	4	0.07
欧州	1,079	0.10	28	0.52
イギリス	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,546	0.15	9	0.17
オーストラリア	4,981	0.48	31	0.58
ニュージーランド	84	0.01	9	0.17
複合地域	1,051	0.10	8	0.15
エマージング債券	11,896	1.15	246	4.60
グローバル	6,694	0.64	179	3.34
米ドル建て	4,817	0.46	139	2.60
現地通貨建て	1,876	0.18	40	0.75
その他	5,203	0.50	67	1.25
ロシア	3	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	232	0.02	6	0.11
中国	142	0.01	8	0.15
インド	2,636	0.25	16	0.30
インドネシア	337	0.03	7	0.13
ブラジル	1,525	0.15	20	0.37
メキシコ	262	0.03	3	0.06
トルコ	31	0.00	2	0.04
複合地域	34	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	20,087	1.93	242	4.52
グローバル	2,659	0.26	38	0.71
北米	15,600	1.50	142	2.65
その他	1,828	0.18	62	1.16
欧州	1,414	0.14	40	0.75
アジア・オセアニア	377	0.04	21	0.39
複合地域	38	0.00	1	0.02
複合資産	145,270	13.99	1,035	19.34
安定	37,993	3.66	281	5.25
安定成長	65,400	6.30	428	8.00
成長	32,326	3.11	284	5.31
国内バランス	6,462	0.62	28	0.52
安定	5,485	0.53	9	0.17
一般	286	0.03	15	0.28
その他	3,089	0.30	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	1,038,533	100.00	5,352	100.00
国内REIT	26,431	2.55	141	2.63
日本	26,431	2.55	141	2.63
外国REIT	43,727	4.21	275	5.14
グローバル	17,579	1.69	154	2.88
除く日本	7,368	0.71	67	1.25
含む日本	10,211	0.98	87	1.63
北米	23,422	2.26	73	1.36
その他	2,725	0.26	48	0.90
欧州	94	0.01	6	0.11
アジア・オセアニア	1,882	0.18	26	0.49
オーストラリア	457	0.04	12	0.22
複合地域	56	0.01	3	0.06
複数国	235	0.02	1	0.02
その他	26,434	2.55	233	4.35
絶対収益型	11,504	1.11	94	1.76
ロング・ショート	836	0.08	29	0.54
マーケットニュートラル	371	0.04	13	0.24
GTAA	337	0.03	11	0.21
その他スタイル	9,891	0.95	40	0.75
CB	2,981	0.29	40	0.75
アジア・オセアニア	34	0.00	1	0.02
日本	26	0.00	1	0.02
グローバル	2,921	0.28	38	0.71
コモディティ	6,122	0.59	37	0.69
全業種	1,824	0.18	13	0.24
貴金属	4,207	0.41	22	0.41
エネルギー	65	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	14,426	10.3	2.35	2.30	1.115
国内株式	20,868	14.4	1.29	1.13	1.026
一般	19,535	14.1	1.75	1.55	1.377
フリー	18,836	13.5	1.40	1.25	1.420
バリュー	22,502	16.9	2.76	2.39	1.262
小型	24,808	14.9	1.03	0.97	1.706
その他	22,353	14.6	0.54	0.44	0.392
日経225	23,383	15.9	0.52	0.44	0.452
TOPIX	23,509	15.4	0.15	0.13	0.241
JPX日経400	21,213	9.2	0.51	0.43	0.480
国内債券	10,339	12.2	0.13	0.13	0.456
一般	10,339	12.2	0.13	0.13	0.456
外国株式(先進国)	17,177	7.7	2.53	2.35	1.174
グローバル	17,647	7.7	2.21	2.14	1.265
除く日本	26,000	10.5	0.46	0.45	0.539
含む日本	15,118	6.8	2.96	2.87	1.574
その他	16,102	7.7	3.19	2.76	0.991
北米	15,710	5.5	0.44	0.44	1.320
米国	16,909	6.9	3.13	2.67	0.965
カナダ	6,233	12.7	6.54	7.03	1.989
欧州	15,250	12.6	2.64	2.48	1.464
ドイツ	16,880	9.7	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,290	7.3	8.98	9.54	1.773
アジア・オセアニア	10,841	17.4	3.27	3.23	1.639
オーストラリア	10,178	8.9	8.41	9.18	1.823
ニュージーランド	17,629	11.3	1.73	1.70	1.672
複合地域	11,401	10.6	8.05	8.77	1.705
エマージング株式	14,090	10.8	2.69	2.49	1.662
グローバル	13,974	8.3	0.42	0.39	1.009
BRICS	15,334	17.5	0.89	0.86	2.064
その他	14,101	11.7	3.64	3.36	1.914
欧州	8,559	17.4	0.88	0.55	1.941
ロシア	967	14.5	0.00	0.00	1.168
アジア・オセアニア	14,694	12.7	2.30	2.31	1.672
中国	13,023	9.0	1.55	1.61	1.928
インド	18,240	11.6	4.32	3.94	1.970
インドネシア	12,898	11.0	1.07	1.01	1.790
タイ	12,994	11.7	1.58	1.70	1.819
フィリピン	11,357	11.3	0.40	0.41	1.709
ベトナム	16,275	6.4	1.71	1.54	1.884
韓国	14,113	4.9	0.00	0.00	1.804
香港	12,804	14.3	2.76	2.81	0.858
中南米	11,737	16.9	1.67	1.41	2.036
ブラジル	6,939	12.5	3.66	3.53	1.954
メキシコ	13,615	10.7	3.58	2.94	1.667
中東・アフリカ	13,202	11.9	0.81	0.84	2.155
トルコ	14,719	22.3	0.33	0.27	2.030
複合地域	18,934	10.4	1.77	1.62	1.110

(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	14,426	10.3	2.35	2.30	1.115
外国債券(先進国)	10,274	10.7	1.38	1.37	0.978
グローバル	10,763	10.7	1.13	1.12	0.918
除く日本	11,990	13.1	0.89	0.86	0.706
含む日本	9,871	8.9	1.35	1.34	1.092
その他	9,040	10.7	2.42	2.45	1.248
北米	10,182	7.4	2.22	2.15	1.501
米国	9,811	8.7	2.51	2.65	1.223
カナダ	7,577	12.8	1.59	1.50	1.378
欧州	7,613	13.8	1.51	1.50	1.113
イギリス	7,611	8.6	3.80	3.46	1.294
アジア・オセアニア	9,354	13.7	2.46	2.39	1.436
オーストラリア	8,444	14.7	2.65	2.60	1.244
ニュージーランド	9,426	9.4	1.55	1.51	1.371
複合地域	5,647	13.6	2.23	2.14	1.195
エマージング債券	9,698	11.9	3.89	3.60	1.409
グローバル	9,640	12.4	2.61	2.39	1.238
米ドル建て	9,390	12.9	2.91	2.67	1.374
現地通貨建て	10,510	10.6	1.84	1.69	0.890
その他	9,852	10.8	5.53	5.14	1.628
ロシア	1,783	10.9	0.00	0.00	1.531
アジア・オセアニア	9,849	12.9	6.71	6.69	1.626
中国	11,863	4.1	1.47	1.38	1.238
インド	10,246	9.3	6.16	6.07	1.706
インドネシア	9,895	11.0	5.61	5.21	1.669
ブラジル	11,529	13.5	4.77	3.81	1.579
メキシコ	9,390	11.1	5.15	4.30	1.369
トルコ	1,347	11.1	5.04	8.43	1.474
複合地域	4,318	17.3	1.65	1.39	1.210
ハイイールド債券	9,886	12.5	5.16	4.89	1.663
グローバル	8,164	11.2	3.37	3.03	1.467
北米	11,313	13.5	5.29	5.04	1.684
その他	7,673	11.1	6.71	6.37	1.766
欧州	8,108	10.6	6.02	5.62	1.738
アジア・オセアニア	6,983	11.6	9.42	9.34	1.868
複合地域	4,768	19.7	5.46	5.03	1.800
複合資産	13,588	9.7	1.04	1.04	0.931
安定	11,443	9.7	1.10	1.09	1.062
安定成長	13,258	10.2	1.32	1.32	0.938
成長	16,543	9.2	0.19	0.18	0.779
国内バランス	12,407	11.2	2.02	2.06	0.951
安定	10,601	12.3	1.73	1.79	0.915
一般	13,564	11.6	1.08	0.99	1.258
その他	9,141	3.7	1.41	1.47	0.708

(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	14,426	10.3	2.35	2.30	1.115
国内REIT	13,933	10.0	7.71	9.21	0.914
日本	13,933	10.0	7.71	9.21	0.914
外国REIT	12,068	9.4	8.28	8.97	1.456
グローバル	13,210	9.1	3.23	3.31	1.191
除く日本	14,448	7.5	1.96	2.10	0.927
含む日本	12,256	10.3	4.14	4.18	1.381
北米	11,200	10.1	12.24	13.41	1.620
その他	9,726	9.5	6.85	7.38	1.748
欧州	6,673	10.3	5.31	4.92	1.875
アジア・オセアニア	10,825	8.9	8.26	8.99	1.795
オーストラリア	9,313	9.1	4.52	4.76	1.699
複合地域	7,495	11.8	0.93	0.87	0.778
複数国	11,142	19.6	2.14	2.15	1.650
その他					
絶対収益型	10,363	6.7	0.03	0.03	1.924
ロング・ショート	10,426	5.8	0.25	0.27	1.519
マーケットニュートラル	9,976	6.0	0.00	0.00	1.277
GTAA	10,908	10.8	0.20	0.20	1.545
その他スタイル	10,247	6.5	0.00	0.00	1.999
CB	11,921	7.5	0.44	0.42	1.169
アジア・オセアニア	10,554	13.4	2.50	2.27	1.823
日本	14,007	24.0	0.37	0.36	0.770
グローバル	11,902	6.9	0.40	0.38	1.165
コモディティ	12,844	7.5	0.00	0.00	0.921
全業種	10,769	11.4	0.00	0.00	1.276
貴金属	13,467	4.8	0.00	0.00	0.767
エネルギー	20,760	14.8	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	18,203	7.2	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