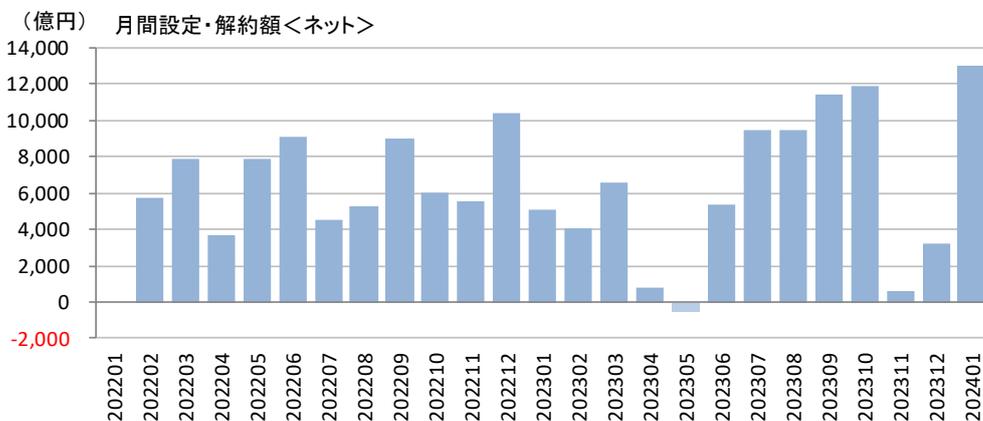
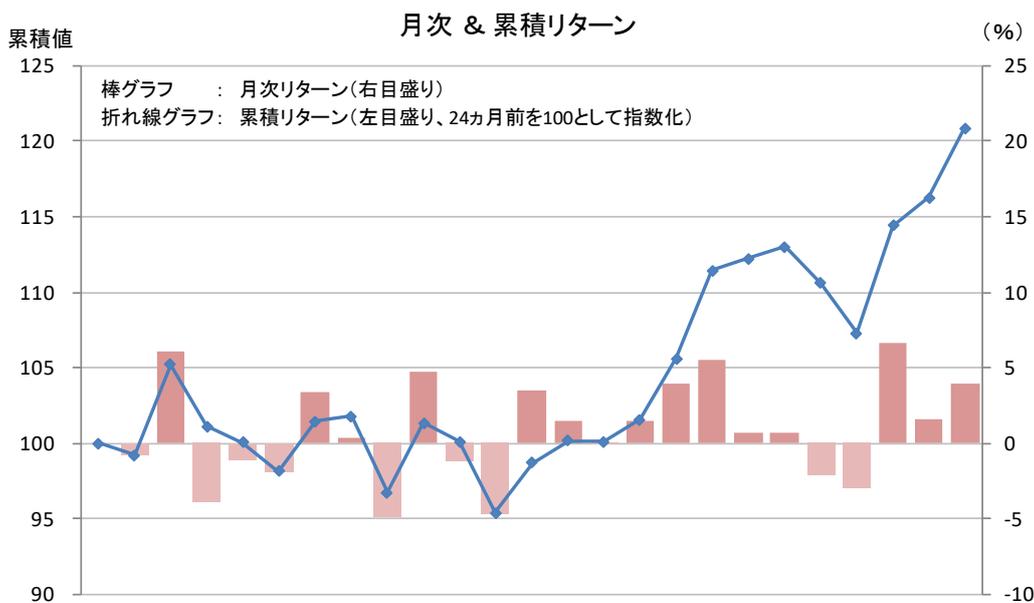


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

— Vol.2 ファンド分類 詳細編 —

2024年1月

「総合」 +3.93 %
(前月 +1.61 %)



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		18,763	18,053	710	3.93	
国内株式		25,633	23,949	1,684	7.03	
一般		24,705	23,172	1,533	6.61	
フリー		22,867	21,475	1,392	6.48	
バリュー		33,309	31,144	2,165	6.95	
小型		44,365	43,146	1,219	2.83	
その他		26,363	24,351	2,012	8.26	
日経225		25,192	23,238	1,955	8.41	
TOPIX		25,930	24,057	1,874	7.79	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	24,512	22,734	1,778	7.82	
国内債券		12,384	12,464	-80	-0.65	
一般		12,384	12,464	-80	-0.65	
外国株式(先進国)		26,612	25,232	1,379	5.47	
グローバル		28,328	27,093	1,235	4.56	
除く日本		45,389	42,927	2,463	5.74	
含む日本		24,675	23,712	962	4.06	
その他		22,725	21,183	1,541	7.28	
北米		28,770	26,715	2,055	7.69	
米国		35,423	32,968	2,455	7.45	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	23,111	22,343	768	3.44	
欧州		28,368	27,397	971	3.55	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	14,464	13,997	467	3.34	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	11,662	11,433	228	2.00	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	41,336	40,596	740	1.82	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	22,094	22,060	34	0.16	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	49,714	49,378	336	0.68	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	15,259	14,744	515	3.49	
エマージング株式		22,152	21,544	609	2.83	
グローバル		20,918	20,666	252	1.22	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	25,057	25,170	-113	-0.45	
その他		23,680	22,880	800	3.50	
欧州		17,164	17,006	158	0.93	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,082	1,076	6	0.55	
アジア・オセアニア		19,344	19,303	41	0.21	
中国		32,077	34,631	-2,554	-7.37	
インド	10,000 (2004.09.30)	65,412	62,489	2,924	4.68	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	17,852	17,654	198	1.12	
タイ		22,562	23,296	-734	-3.15	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,322	8,017	305	3.80	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	25,346	23,449	1,896	8.09	
韓国	10,000 (1997.06.30)	30,839	32,275	-1,436	-4.45	
香港		19,113	20,024	-910	-4.55	
中南米	7,427 (2006.04.28)	13,051	13,315	-264	-1.98	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	10,838	11,215	-377	-3.36	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	19,210	18,352	858	4.68	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	14,092	13,556	536	3.96	
トルコ		44,720	39,038	5,682	14.56	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	27,666	27,316	350	1.28	

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000
[色塗りの基準]月次リターン> 総合

＜1＞パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別②

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		18,763	18,053	710	3.93
外国債券(先進国)		19,409	19,232	178	0.92
グローバル		19,353	19,155	198	1.04
除く日本		21,524	21,273	251	1.18
含む日本		17,949	17,786	163	0.92
その他		19,888	19,804	84	0.42
北米	9,052 (2013.05.31)	11,158	10,975	184	1.67
米国		18,480	18,348	132	0.72
カナダ	10,000 (2003.05.30)	18,056	17,748	309	1.74
欧州	10,000 (1998.07.31)	14,818	14,786	33	0.22
イギリス	10,069 (2014.07.31)	12,029	11,832	197	1.67
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	22,292	22,369	-77	-0.34
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	27,588	27,651	-62	-0.23
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	12,138	12,252	-114	-0.93
複合地域	10,000 (2001.11.30)	19,561	19,217	344	1.79
エマージング債券		21,375	20,831	544	2.61
グローバル		21,425	21,016	409	1.95
米ドル建て		21,769	21,366	404	1.89
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	15,571	15,252	320	2.10
その他	8,647 (2005.03.31)	17,221	16,640	580	3.49
ロシア	10,000 (2008.05.30)	506	496	10	1.92
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	16,672	16,217	455	2.81
中国	13,833 (2018.07.31)	19,156	18,616	539	2.90
インド	10,000 (2011.08.31)	22,096	21,111	985	4.67
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	19,736	19,253	483	2.51
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	17,484	17,120	365	2.13
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	21,201	20,722	479	2.31
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,440	2,462	-21	-0.87
複合地域	10,000 (2006.08.31)	12,779	12,535	244	1.94
ハイイールド債券		29,675	28,681	994	3.47
グローバル	10,000 (1997.06.30)	27,683	26,905	778	2.89
北米		30,102	29,043	1,059	3.65
その他	10,000 (2004.03.31)	26,435	25,735	701	2.72
欧州	10,000 (2006.04.28)	27,074	26,479	594	2.24
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	15,719	15,046	673	4.47
複合地域	10,000 (2004.03.31)	26,331	25,427	904	3.56
複合資産		20,782	20,317	465	2.29
安定	10,000 (1998.10.30)	16,702	16,454	248	1.51
安定成長		23,140	22,598	542	2.40
成長		29,962	28,901	1,060	3.67
国内バランス		12,550	12,487	63	0.51
安定		12,554	12,547	7	0.06
一般		18,150	17,520	630	3.60
その他	10,000 (2018.10.31)	13,013	13,186	-174	-1.32

※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		18,763	18,053	710	3.93
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	34,332	34,264	68	0.20
日本	10,000 (2003.10.31)	34,332	34,264	68	0.20
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	36,580	36,936	-356	-0.96
グローバル	10,000 (2004.01.30)	30,385	30,667	-281	-0.92
除く日本	10,000 (2004.04.30)	34,277	34,544	-267	-0.77
含む日本	10,000 (2004.01.30)	29,966	30,277	-311	-1.03
北米	10,000 (2003.09.30)	38,765	39,139	-374	-0.95
その他	10,000 (2004.04.30)	31,631	32,060	-429	-1.34
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,781	5,811	-30	-0.52
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	23,015	23,400	-385	-1.65
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	18,348	18,570	-222	-1.20
複合地域	10,000 (2007.06.29)	8,417	8,256	161	1.95
複数国	10,000 (2004.04.30)	47,533	47,717	-185	-0.39
その他		7,108	6,953	155	2.23
絶対収益型		7,524	7,517	7	0.10
ロング・ショート		8,265	8,172	93	1.14
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,323	11,333	-11	-0.09
GTAA		11,518	11,351	167	1.47
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,064	7,066	-2	-0.04
CB		20,674	20,528	146	0.71
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	21,734	21,413	321	1.50
日本		21,327	20,744	583	2.81
グローバル		36,061	35,817	245	0.68
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	12,824	12,622	202	1.60
全業種	10,000 (2004.12.30)	11,841	11,420	421	3.69
貴金属	10,000 (2009.07.31)	21,468	21,337	131	0.61
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	10,771	9,721	1,050	10.80
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	16,602	15,972	630	3.94

※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	12.62	7.68	22.42	3.93
国内株式	13.63	9.05	29.07	7.03
一般	12.63	8.62	27.76	6.61
フリー	13.03	8.04	26.70	6.48
バリュー	11.54	10.37	30.93	6.95
小型	11.36	1.96	9.86	2.83
その他	15.41	10.77	34.29	8.26
日経225	17.67	10.17	35.00	8.41
TOPIX	13.33	10.92	32.11	7.79
JPX日経400	14.31	10.60	32.22	7.82
国内債券	1.58	-1.21	0.15	-0.65
一般	1.58	-1.21	0.15	-0.65
外国株式(先進国)	18.04	10.89	33.98	5.47
グローバル	17.79	9.32	30.65	4.56
除く日本	16.07	10.74	32.11	5.74
含む日本	18.53	8.74	30.06	4.06
その他	18.52	14.11	41.09	7.28
北米	16.73	13.74	39.23	7.69
米国	18.70	14.45	42.37	7.45
カナダ	10.32	5.53	8.83	3.44
欧州	14.72	5.91	19.19	3.55
ドイツ	15.89	5.56	25.13	3.34
イギリス	6.45	4.19	6.78	2.00
アジア・オセアニア	7.11	-0.80	3.09	1.82
オーストラリア	12.33	2.69	7.56	0.16
ニュージーランド	13.26	3.04	4.86	0.68
複合地域	-3.29	1.25	9.31	3.49
エマージング株式	8.52	6.96	20.56	2.83
グローバル	7.04	1.59	12.74	1.22
BRICS	3.16	-2.57	6.20	-0.45
その他	9.17	9.50	24.54	3.50
欧州	9.70	12.08	45.04	0.93
ロシア	-0.27	0.03	-18.71	0.55
アジア・オセアニア	3.28	-2.51	4.44	0.21
中国	-13.08	-20.40	-26.06	-7.37
インド	11.61	16.64	40.97	4.68
インドネシア	5.16	-1.40	8.10	1.12
タイ	-2.31	-9.54	-7.93	-3.15
フィリピン	9.90	1.61	5.63	3.80
ベトナム	14.01	3.45	21.16	8.09
韓国	7.53	-14.41	11.72	-4.45
香港	-11.30	-17.67	-17.96	-4.55
中南米	13.66	2.77	27.58	-1.98
ブラジル	11.87	1.80	24.68	-3.36
メキシコ	22.27	8.23	32.97	4.68
中東・アフリカ	12.65	0.09	11.49	3.96
トルコ	7.28	15.83	24.77	14.56
複合地域	8.02	6.41	10.81	1.28

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

＜1＞パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別②

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	12.62	7.68	22.42	3.93
外国債券(先進国)	5.69	4.35	7.44	0.92
グローバル	5.18	4.08	7.26	1.03
除く日本	5.67	5.31	10.42	1.18
含む日本	4.78	3.09	4.73	0.92
その他	8.01	5.56	8.21	0.42
北米	8.81	5.52	7.64	1.67
米国	10.55	5.67	7.84	0.72
カナダ	5.48	6.56	14.22	1.74
欧州	5.37	5.16	8.27	0.22
イギリス	10.87	9.74	18.51	1.67
アジア・オセアニア	6.38	5.61	7.44	-0.34
オーストラリア	6.22	5.67	7.55	-0.23
ニュージーランド	9.67	7.04	7.95	-0.93
複合地域	5.68	3.39	10.76	1.79
エマージング債券	5.80	6.19	19.28	2.61
グローバル	7.53	6.65	17.44	1.95
米ドル建て	8.28	7.51	17.09	1.89
現地通貨建て	5.62	4.47	18.47	2.10
その他	3.63	5.63	21.81	3.49
ロシア	9.12	3.33	-59.61	1.92
アジア・オセアニア	5.11	5.64	10.40	2.81
中国	2.32	4.33	6.35	2.90
インド	1.78	7.14	17.77	4.67
インドネシア	3.89	0.78	12.74	2.51
ブラジル	5.57	5.11	35.23	2.13
メキシコ	10.42	4.71	30.07	2.31
トルコ	-0.34	-8.96	-33.10	-0.87
複合地域	5.39	4.93	20.59	1.94
ハイイールド債券	6.89	9.19	18.50	3.47
グローバル	7.86	8.29	16.09	2.89
北米	6.67	9.42	19.51	3.65
その他	7.29	8.73	14.97	2.72
欧州	7.46	9.14	16.33	2.24
アジア・オセアニア	6.67	7.12	9.75	4.47
複合地域	7.32	9.86	19.73	3.56
複合資産	7.80	4.52	12.44	2.29
安定	5.68	2.93	7.40	1.51
安定成長	7.91	4.78	13.59	2.40
成長	10.04	6.57	19.38	3.67
国内バランス	2.52	0.49	3.03	0.51
安定	2.18	-0.13	1.60	0.06
一般	6.44	4.61	14.77	3.60
その他	20.31	5.65	10.82	-1.32

※[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	12.62	7.68	22.42	3.93
国内REIT	0.17	-2.17	2.44	0.20
日本	0.17	-2.17	2.44	0.20
外国REIT	15.91	5.15	10.65	-0.96
グローバル	16.45	5.57	10.42	-0.92
除く日本	17.80	6.28	10.62	-0.77
含む日本	15.49	5.03	10.13	-1.03
北米	15.78	5.13	12.01	-0.95
その他	13.46	2.61	1.66	-1.34
欧州	16.99	9.93	11.70	-0.52
アジア・オセアニア	11.51	1.03	-0.71	-1.65
オーストラリア	22.15	6.69	4.88	-1.20
複合地域	16.70	9.75	13.11	1.95
複数国	10.62	2.88	8.86	-0.39
その他	8.44	4.40	13.78	2.23
絶対収益型	2.35	0.32	0.13	0.10
ロング・ショート	1.04	1.30	1.28	1.14
マーケットニュートラル	0.17	-0.03	0.90	-0.09
GTAA	3.04	2.46	1.18	1.47
その他スタイル	2.54	0.19	-0.03	-0.04
CB	3.29	1.49	4.44	0.71
アジア・オセアニア	-0.55	0.76	7.55	1.50
日本	6.59	4.83	8.98	2.81
グローバル	3.31	1.46	4.34	0.68
コモディティ	-1.41	3.58	8.73	1.60
全業種	-5.24	0.53	6.59	3.69
貴金属	0.40	4.89	9.47	0.61
エネルギー	-3.48	7.44	23.04	10.80
その他コモディティ	-1.57	2.25	10.36	3.94

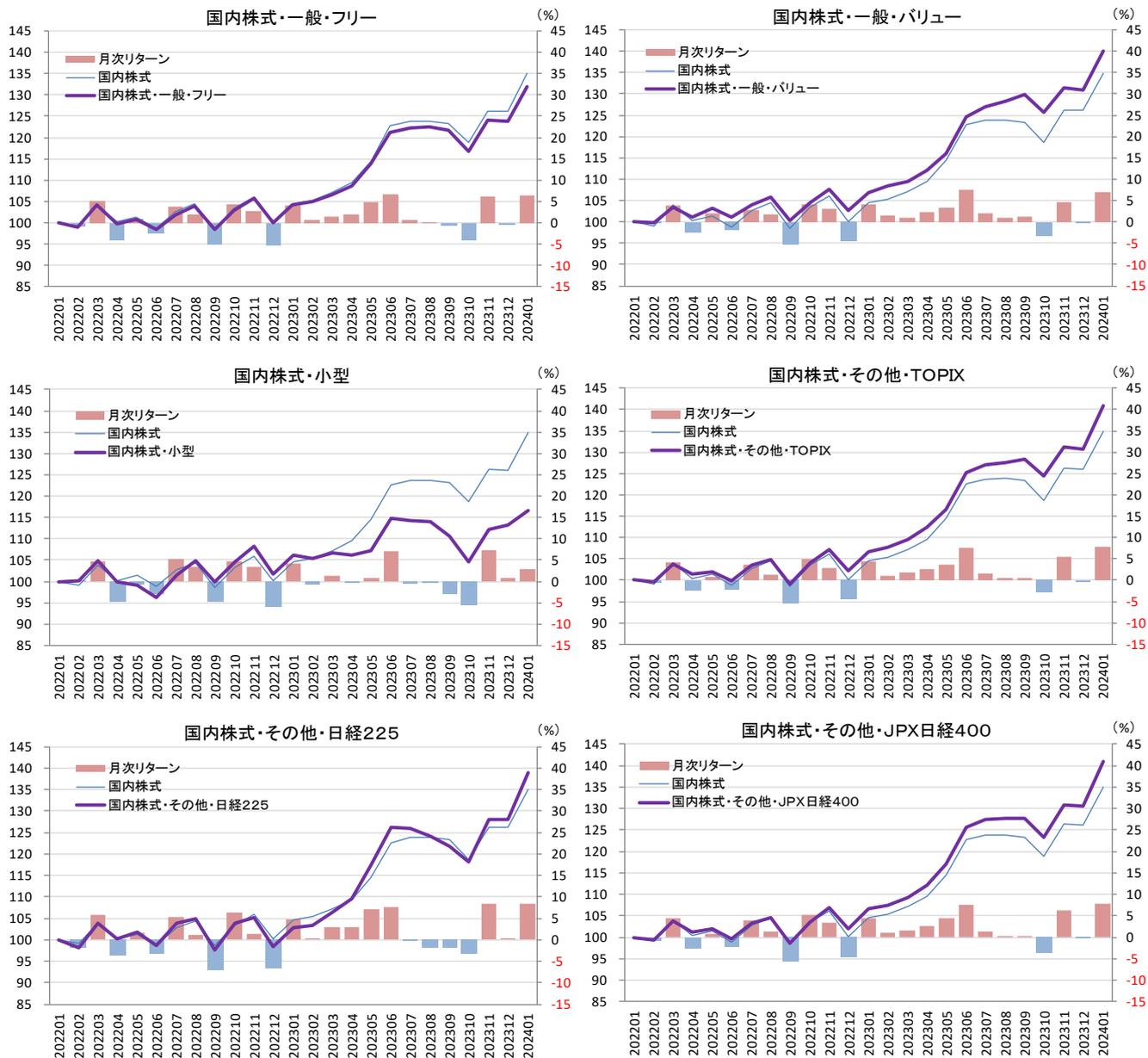
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

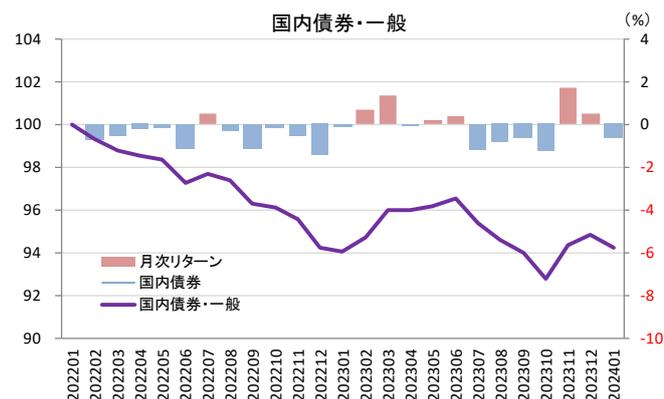
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

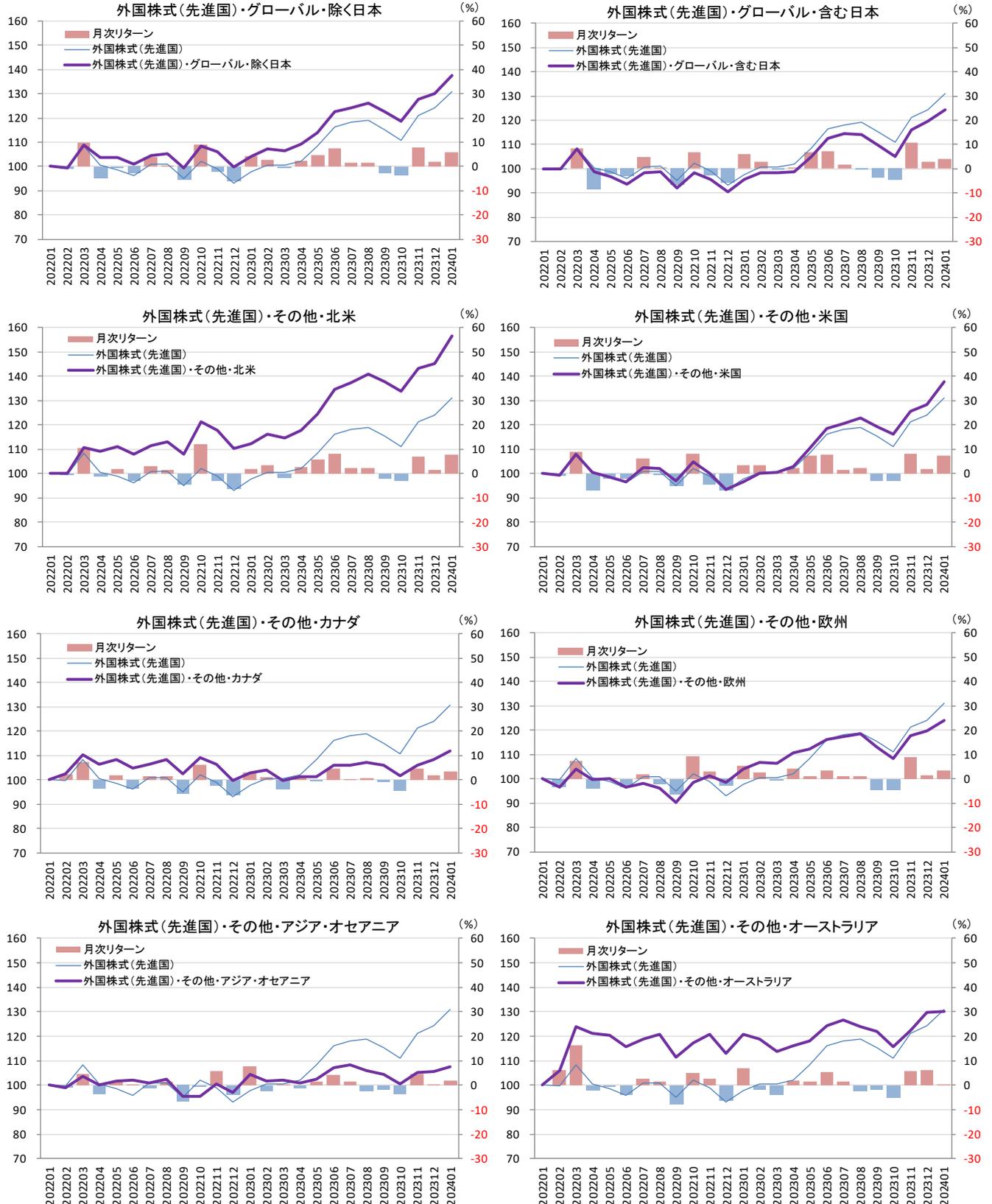


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

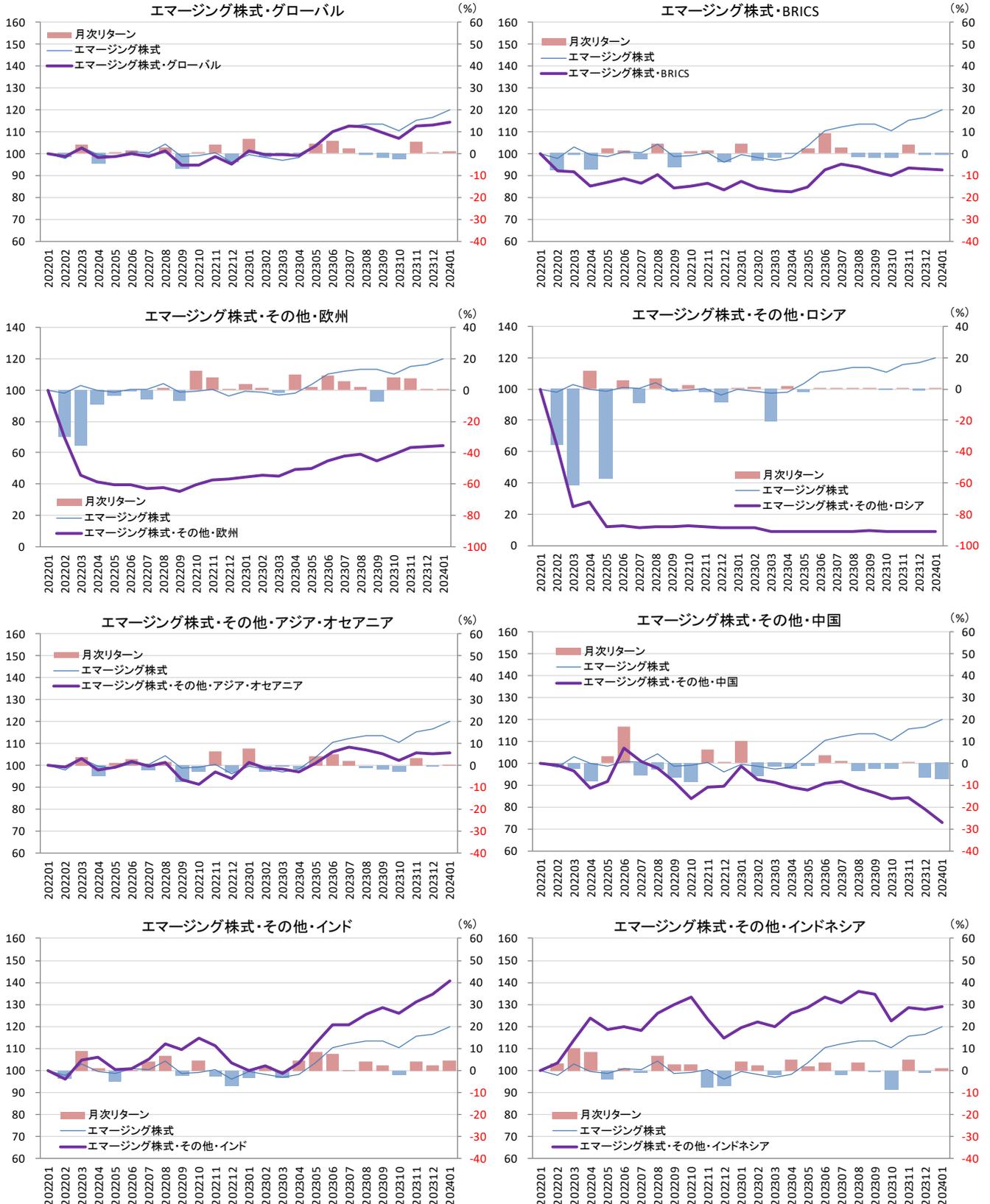


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマージング株式]

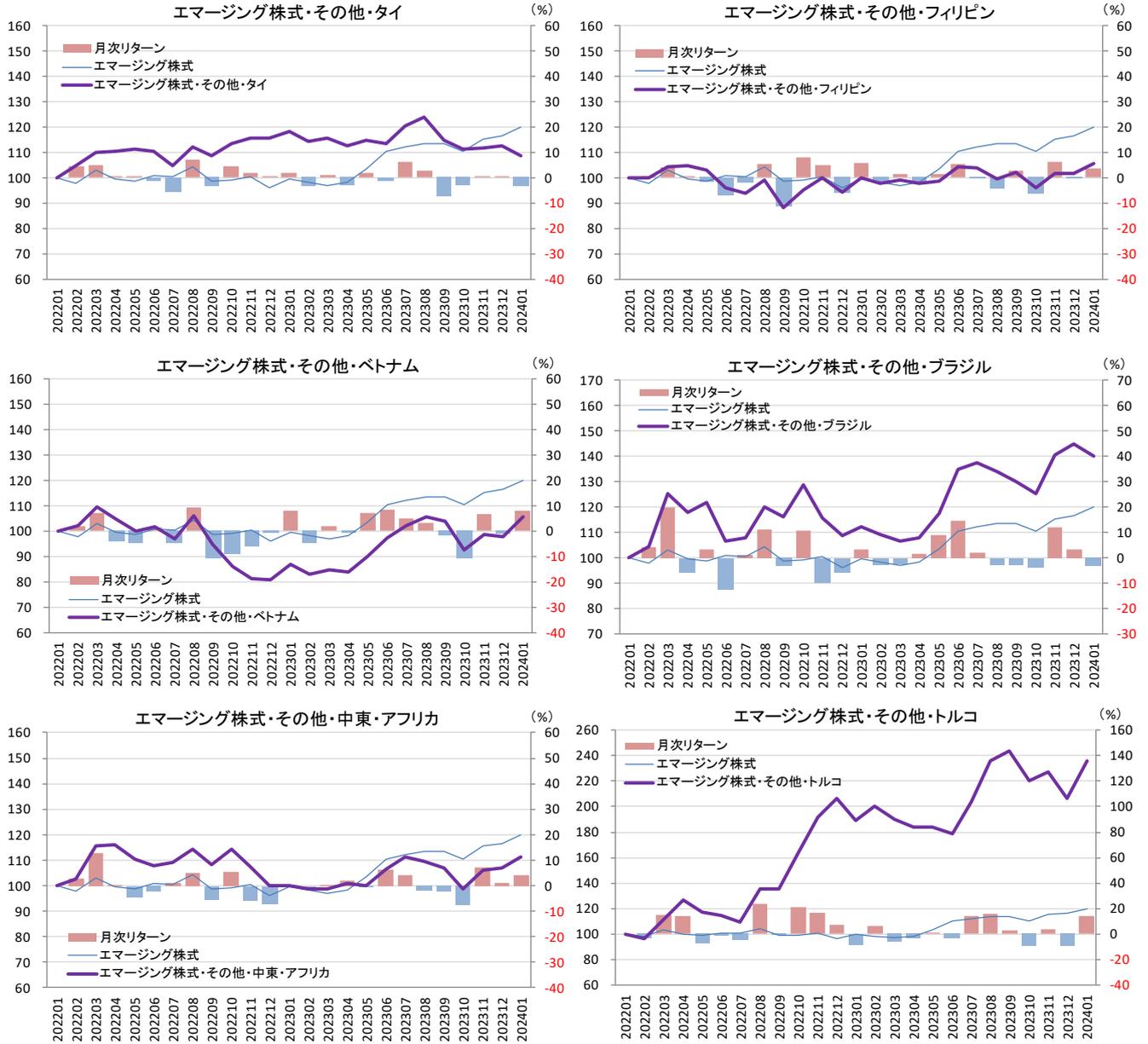


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

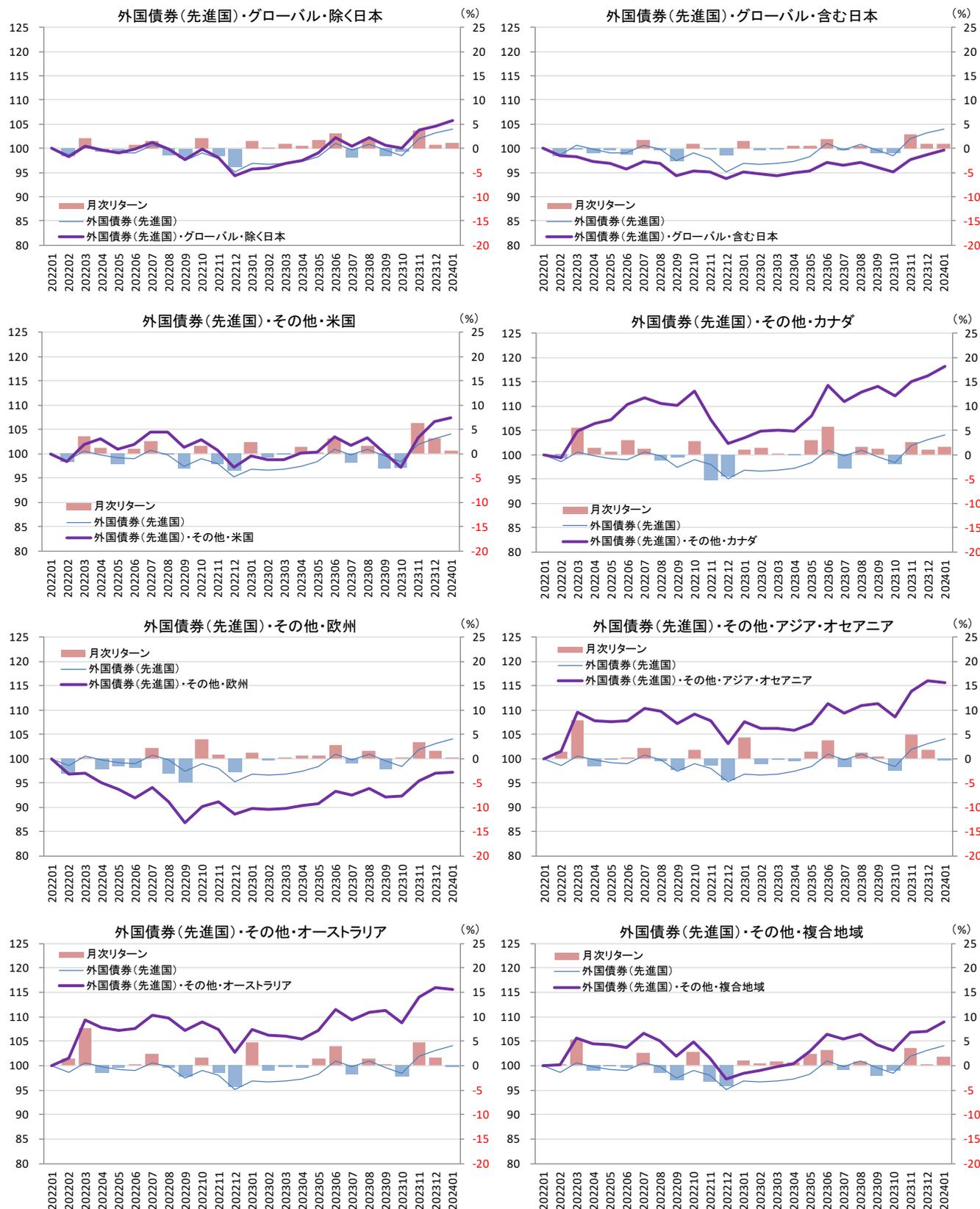


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

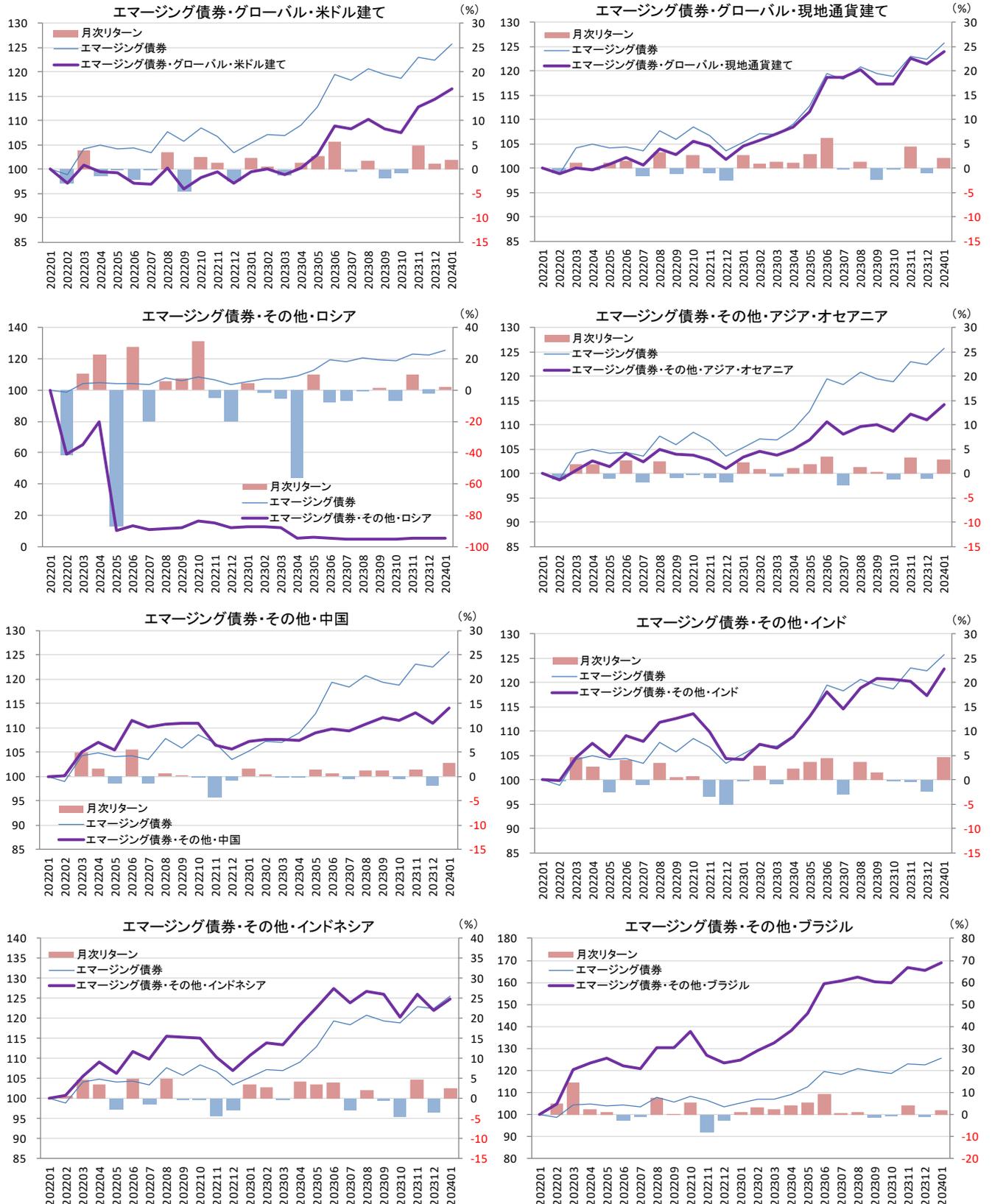


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

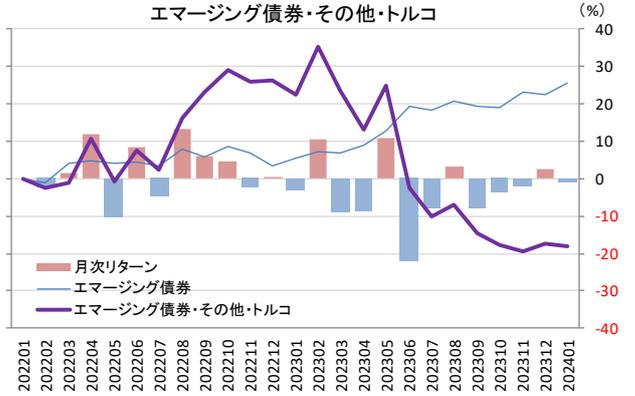
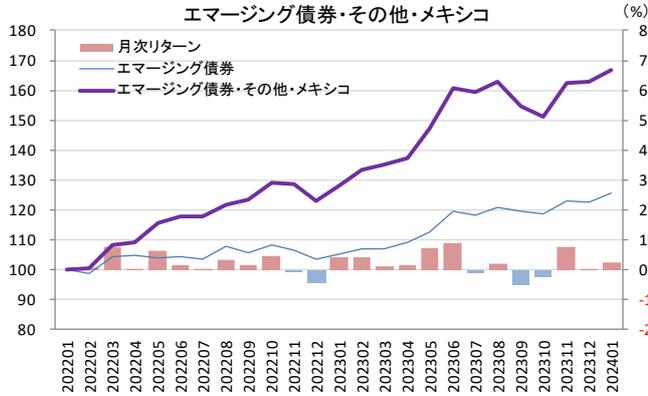


<1>パフォーマンス・サマリー

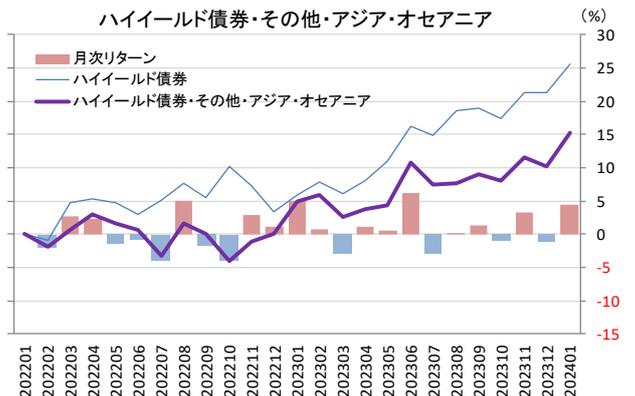
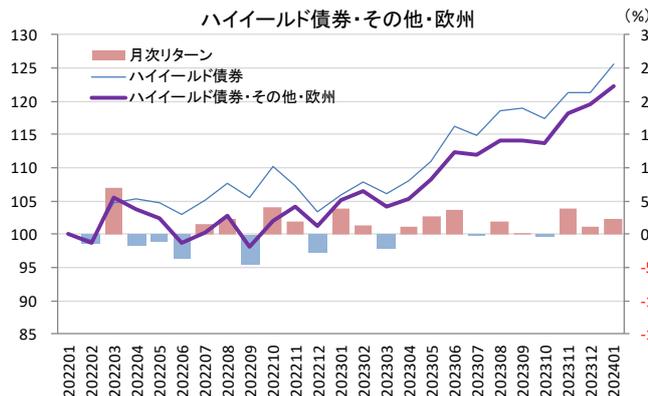
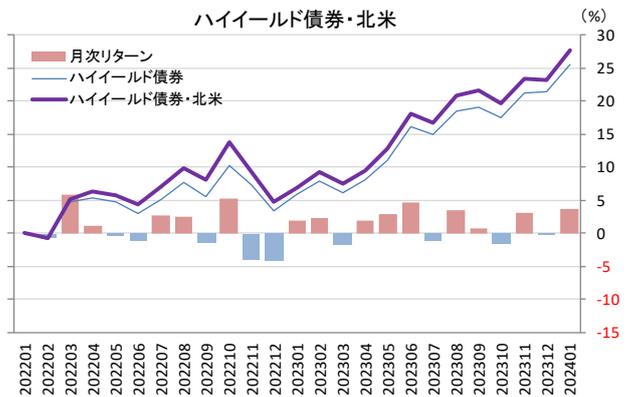
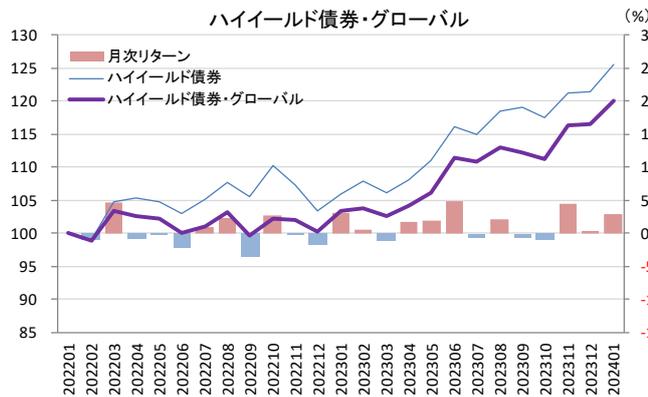
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

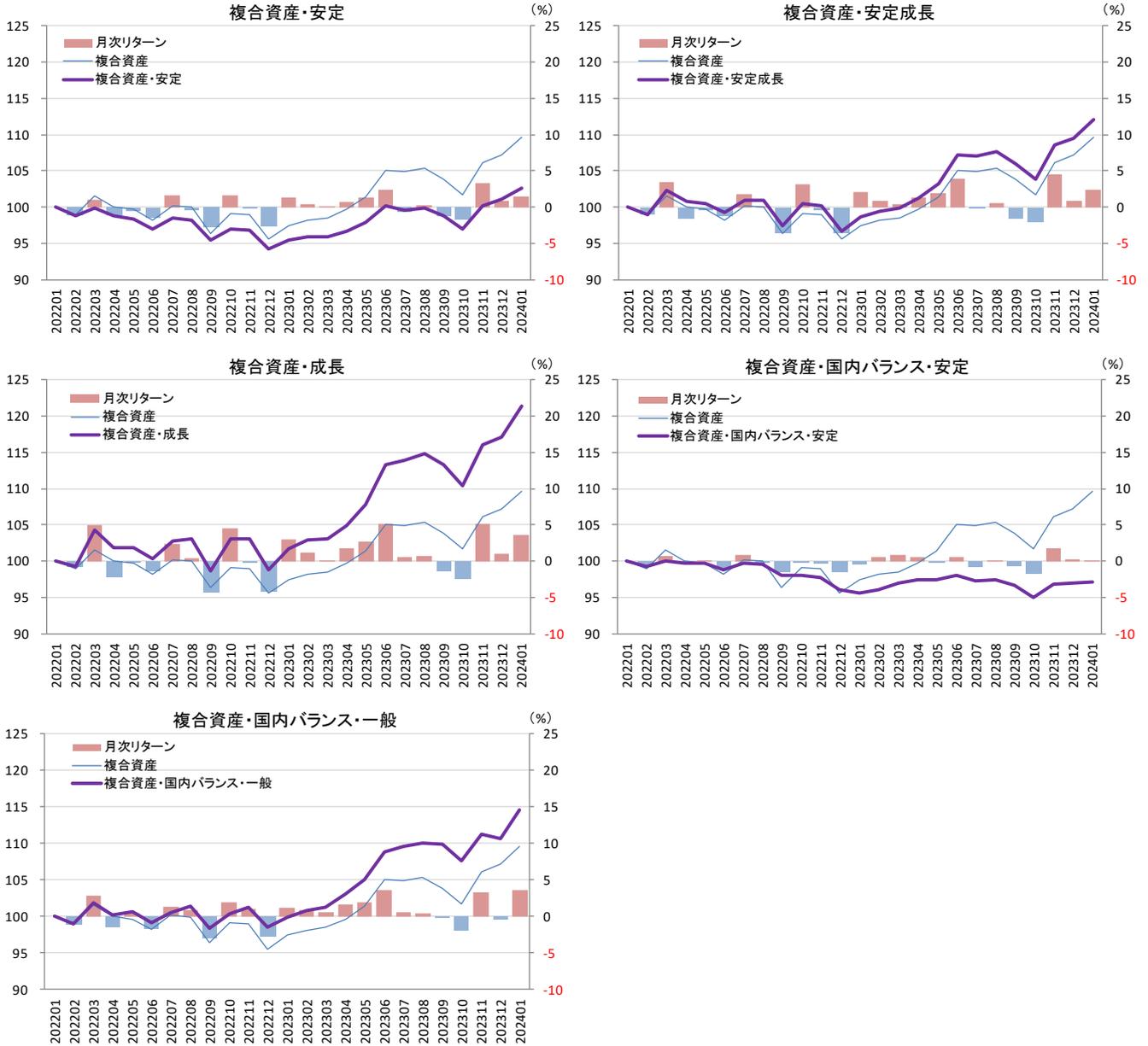


<1>パフォーマンス・サマリー

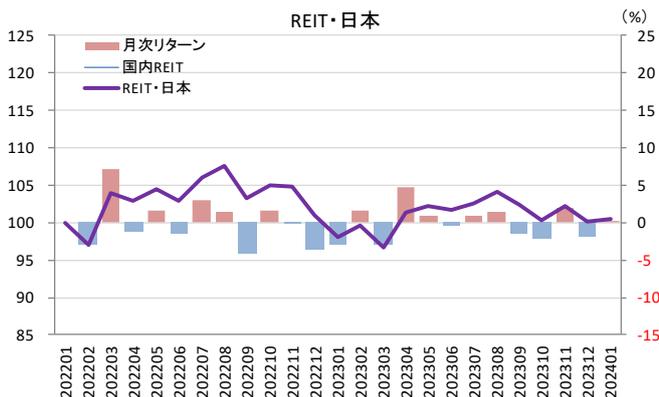
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

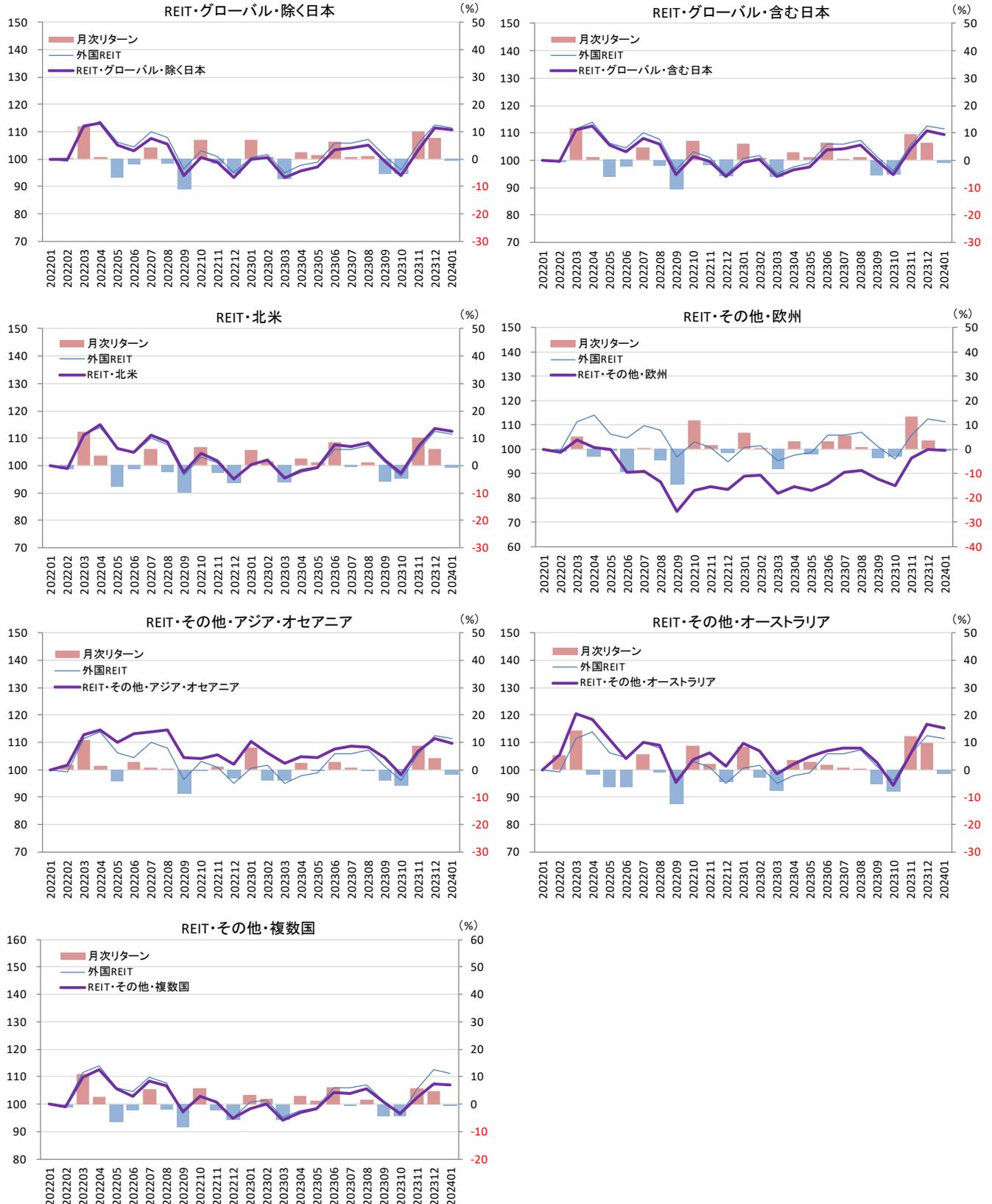


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

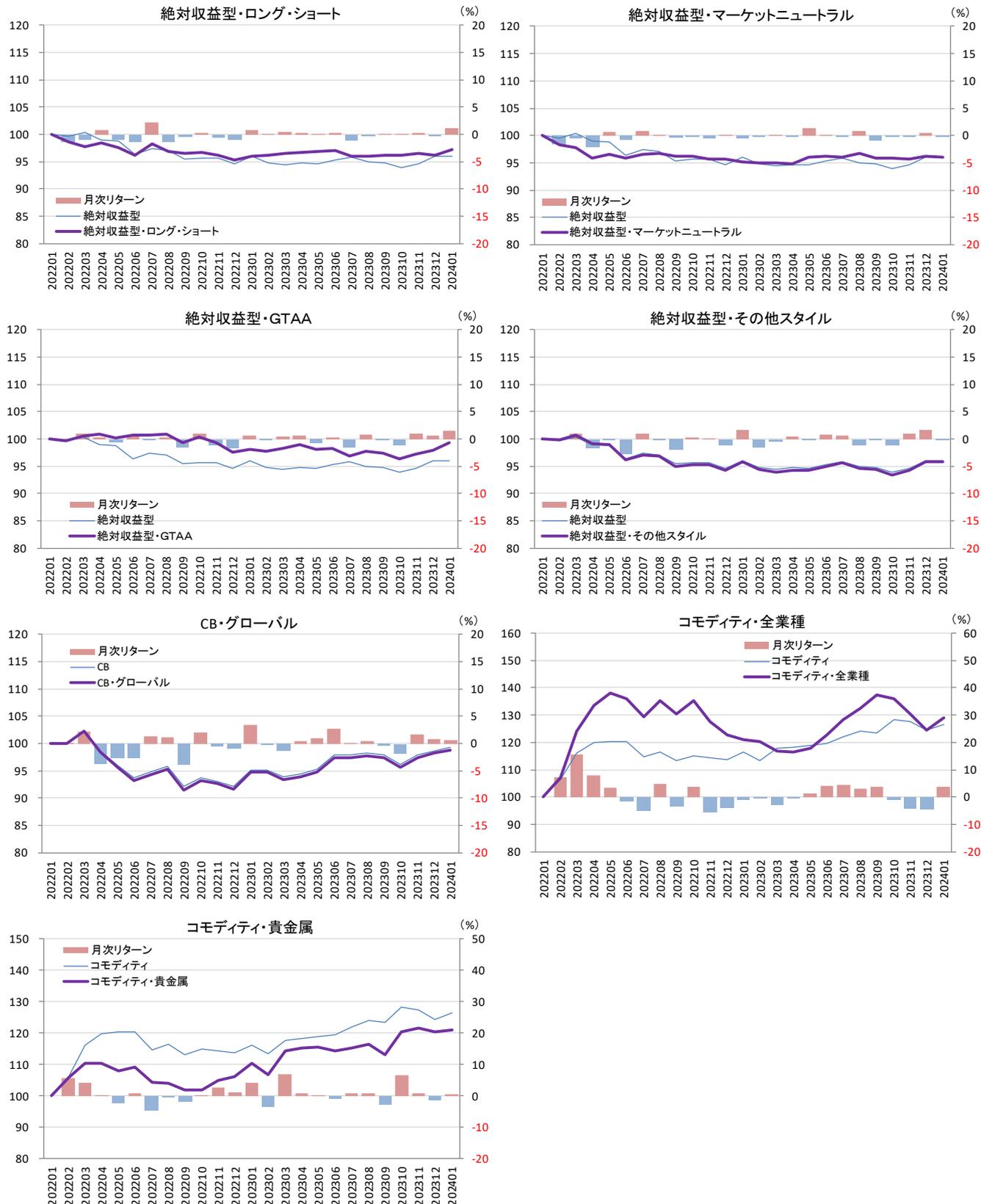


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	3.93		
1	外国株式(先進国)・グローバル	4.56	29.42	1.34
2	外国株式(先進国)・その他	7.28	15.08	1.08
3	国内株式・一般	6.61	7.44	0.48
4	国内株式・その他	8.26	5.00	0.40
5	複合資産・安定成長	2.40	6.17	0.15
6	複合資産・成長	3.67	3.12	0.11
7	エマージング株式・その他	3.50	2.80	0.10
8	外国債券(先進国)・グローバル	1.03	7.13	0.07
9	複合資産・安定	1.51	3.54	0.05
10	ハイイールド債券・北米	3.65	1.48	0.05
11	国内株式・小型	2.83	0.69	0.02
12	エマージング債券・その他	3.49	0.48	0.02
13	エマージング株式・グローバル	1.22	1.03	0.01
14	エマージング債券・グローバル	1.95	0.62	0.01
15	コモディティ	1.60	0.57	0.01
16	ハイイールド債券・グローバル	2.89	0.25	0.01
17	REIT・日本	0.20	2.34	0.01
18	国内株式・業種特化	7.35	0.09	0.01
19	外国債券(先進国)・その他	0.42	1.59	0.01
20	ハイイールド債券・その他	2.72	0.17	0.00
21	複合資産・国内バランス	0.51	0.58	0.00
22	CB	0.71	0.27	0.00
23	絶対収益型	0.10	1.07	0.00
24	エマージング株式・BRICS	-0.45	0.04	-0.00
25	REIT・その他	-1.34	0.25	-0.00
26	複合資産・その他	-1.32	0.29	-0.00
27	REIT・グローバル	-0.92	1.69	-0.02
28	REIT・北米	-0.95	2.24	-0.02
29	国内債券・一般	-0.65	3.98	-0.02
	合計		100.00	3.93

◆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	22.42		
1	外国株式(先進国)・グローバル	30.65	28.78	8.66
2	外国株式(先進国)・その他	41.09	13.95	5.35
3	国内株式・一般	27.76	7.19	1.93
4	国内株式・その他	34.29	4.87	1.61
5	複合資産・安定成長	13.59	6.46	0.90
6	複合資産・成長	19.38	3.02	0.59
7	外国債券(先進国)・グローバル	7.26	7.37	0.56
8	エマージング株式・その他	24.54	2.36	0.54
9	複合資産・安定	7.40	3.95	0.31
10	REIT・北米	12.01	2.43	0.29
11	ハイイールド債券・北米	19.51	1.48	0.28
12	REIT・グローバル	10.42	1.80	0.18
13	外国債券(先進国)・その他	8.21	1.70	0.14
14	エマージング株式・グローバル	12.74	1.06	0.13
15	エマージング債券・グローバル	17.44	0.66	0.11
16	エマージング債券・その他	21.81	0.51	0.11
17	REIT・日本	2.44	2.81	0.10
18	国内株式・小型	9.86	0.75	0.08
19	コモディティ	8.73	0.58	0.05
20	ハイイールド債券・グローバル	16.09	0.27	0.04
21	複合資産・その他	10.82	0.32	0.04
22	ハイイールド債券・その他	14.97	0.19	0.03
23	複合資産・国内バランス	3.03	0.71	0.03
24	国内株式・業種特化	29.13	0.08	0.02
25	国内債券・一般	0.15	4.33	0.02
26	CB	4.44	0.28	0.01
27	エマージング株式・BRICS	6.20	0.05	0.00
28	REIT・その他	1.66	0.30	0.00
29	絶対収益型	0.13	1.21	-0.00
	合計		100.00	22.42

◆計算定義

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

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

<2>リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別①

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	27.35	53.85	86.16	11.06	11.78	10.68	0.76	0.77	0.60
国内株式	37.13	76.50	142.24	12.72	14.84	15.24	0.87	0.81	0.61
一般	36.46	73.99	132.30	12.29	14.43	15.24	0.89	0.81	0.58
フリー	31.87	72.63	128.58	12.75	14.74	15.58	0.76	0.79	0.55
バリュー	53.30	76.24	143.46	11.23	13.96	14.45	1.37	0.86	0.65
小型	6.54	45.98	137.95	15.10	17.86 ↓	16.68	0.14	0.44	0.54
その他	44.22	85.17	163.74	13.40	15.31	15.29	0.97	0.86	0.67
日経225	36.93	88.01	176.93	15.00	16.71	16.03	0.74	0.81	0.67
TOPIX	50.60	81.48	153.97	11.95	14.07	14.65	1.23	0.90	0.67
JPX日経400	49.14	82.33	145.12	12.40	14.44	14.60	1.15	0.89	0.64
国内債券	-6.29	-6.02	0.24	2.46 ↑	2.33	1.98	-0.86	-0.51	0.02
一般	-6.29	-6.02	0.24	2.46 ↑	2.33	1.98	-0.86	-0.51	0.02
外国株式(先進国)	37.74	102.76	153.98	16.57	17.55	16.09	0.68	0.87	0.61
グローバル	29.64	96.19	156.64	16.77	17.68	16.05	0.54	0.82	0.62
除く日本	67.81	122.94	206.69	14.63	17.07 ↓	16.39	1.29	1.02	0.72
含む日本	19.64	87.96	142.24	17.82	18.22	16.21	0.35	0.74	0.57
その他	61.06	117.45	148.15	16.45	17.61	16.48	1.05	0.96	0.58
北米	110.65	174.12	216.01	14.94	17.93 ↓	17.53	1.89	1.25	0.70
米国	61.67	131.24	182.28	16.72	17.29	16.84	1.04	1.06	0.65
カナダ	35.28	44.41	28.28	12.05	17.71 ↓	15.90	0.88	0.43	0.16
欧州	41.88	73.95	93.92	14.65	17.28	16.15	0.85	0.68	0.42
ドイツ	51.61	81.62	-	17.92 ↓	21.80	-	0.83	0.58	-
イギリス	46.35	28.39	-	10.74	16.28 ↓	-	1.26	0.32	-
アジア・オセアニア	8.99	30.00	76.51	10.67 ↓	14.40	14.45	0.28	0.38	0.41
オーストラリア	42.96	51.53	69.23	17.88	23.53	19.79	0.71	0.37	0.27
ニュージーランド	14.10	62.95	172.44	15.23	17.84	17.26	0.30	0.58	0.61
複合地域	157.75	73.57	39.32	25.73 ↓	32.49	26.63	1.44	0.36	0.13
エマージング株式	29.79	64.51	105.71	10.52 ↓	17.06	16.05	0.87	0.62	0.47
グローバル	15.67	59.83	85.98	11.54 ↓	16.76 ↓	16.25	0.43	0.59	0.39
BRICS	-5.49	16.41	67.80	12.97 ↓	19.67	18.76	-0.14	0.16	0.28
その他	37.50	68.72	116.59	10.63 ↓	17.54	16.30	1.06	0.63	0.49
欧州	-28.30	-27.52	-24.55	33.85	32.74	27.01	-0.31	-0.19	-0.10
ロシア	-89.80	-88.12	-85.29	55.68	47.76	38.24	-0.96	-0.73	-0.46
アジア・オセアニア	1.65	31.66	60.89	12.19 ↓	16.55 ↓	15.74	0.05	0.34	0.31
中国	-39.16	15.81	70.86	18.50 ↓	20.46	21.17	-0.82	0.15	0.26
インド	90.75	121.99	276.43	14.89	22.13	21.02	1.62	0.78	0.68
インドネシア	45.11	24.27	55.45	15.21 ↓	25.61	23.12	0.87	0.17	0.20
タイ	16.19	-4.35	41.16	13.37	20.46	17.65	0.39	-0.04	0.20
フィリピン	18.53	1.08	20.50	16.06	20.33	17.98	0.36	0.01	0.11
ベトナム	73.82	78.36	124.69	22.06	26.06	21.60	0.92	0.47	0.39
韓国	-6.49	39.87	31.87	24.26	25.75	21.05	-0.09	0.27	0.13
香港	-18.83	-15.16	14.15	20.73	20.90	19.70	-0.32	-0.15	0.07
中南米	68.00	52.29	72.83	23.35 ↓	29.57	26.33	0.81	0.30	0.21
ブラジル	39.77	8.43	22.82	26.84 ↓	32.20	31.66	0.44	0.05	0.07
メキシコ	133.23	110.11	71.65	21.05 ↓	27.12	23.86	1.55	0.59	0.23
中東・アフリカ	46.29	51.87	63.05	14.90	18.59	16.90	0.91	0.47	0.30
トルコ	99.78	96.07	56.07	32.81	34.00	31.66	0.79	0.42	0.14
複合地域	17.22	41.62	52.15	14.08 ↓	16.96 ↓	15.52	0.39	0.43	0.28

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

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

<2>リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別②

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	27.35	53.85	86.16	11.06	11.78	10.68	0.76	0.77	0.60
外国債券(先進国)	4.63	12.83	17.20	4.95 ↑	4.96	5.34	0.31	0.50	0.30
グローバル	2.67	11.04	16.72	4.44 ↑	4.31	4.74	0.21	0.50	0.33
除く日本	5.92	15.89	20.65	5.64 ↑	4.81 ↑	5.38	0.35	0.63	0.36
含む日本	-0.06	6.65	13.46	3.80 ↑	4.52	4.47	0.00	0.29	0.29
その他	12.25	20.32	22.25	7.77	7.88	7.65	0.51	0.48	0.27
北米	1.95	10.95	22.96	5.62 ↑	5.76 ↑	4.98 ↑	0.12	0.37	0.42
米国	18.05	23.14	35.27	7.81	8.08	7.02	0.73	0.53	0.44
カナダ	26.15	32.09	23.27	8.61	7.83	8.52	0.94	0.74	0.25
欧州	-5.90	-1.40	-0.11	6.53 ↑	5.68	6.51	-0.30	-0.04	0.00
イギリス	20.56	26.75	-	10.85	9.97	-	0.60	0.49	-
アジア・オセアニア	11.38	21.23	22.83	9.35	9.69	9.21	0.39	0.41	0.23
オーストラリア	12.00	21.90	22.50	9.29	9.72	9.26	0.42	0.42	0.22
ニュージーランド	3.39	11.42	-	10.17 ↑	9.63	-	0.11	0.23	-
複合地域	5.65	21.76	26.89	7.53	6.31	6.91	0.25	0.64	0.35
エマージング債券	29.80	29.43	45.88	7.33	10.49	10.61	1.24	0.51	0.36
グローバル	18.68	20.42	34.06	7.76	11.80	11.20	0.76	0.32	0.27
米ドル建て	16.84	18.49	34.20	8.30	12.39	11.61	0.65	0.28	0.26
現地通貨建て	24.20	26.39	25.64	7.15	10.31	10.18	1.05	0.47	0.23
その他	44.36	41.47	60.86	8.78	10.38	11.14	1.49	0.70	0.44
ロシア	-94.83	-94.86	-95.54	73.72	58.71	44.98	-0.85	-0.76	-0.59
アジア・オセアニア	13.21	23.63	44.41	5.85 ↑	6.97	6.85	0.73	0.63	0.55
中国	34.46	36.32	-	6.35	6.41	-	1.64	1.00	-
インド	35.05	49.92	95.25	8.82 ↑	9.18	9.61	1.20	0.92	0.72
インドネシア	39.81	61.31	94.32	9.49 ↑	13.86	14.06	1.25	0.73	0.49
ブラジル	79.37	33.54	62.59	15.66 ↓	17.72 ↓	18.31	1.38	0.34	0.27
メキシコ	68.00	96.21	71.74	12.67	16.17	15.47	1.49	0.89	0.36
トルコ	-51.79	-55.54	-75.07	30.09	28.30 ↓	27.95	-0.72	-0.53	-0.46
複合地域	19.88	20.91	21.67	10.31	11.74	11.62	0.61	0.33	0.17
ハイイールド債券	36.98	42.77	66.00	7.86	11.30	10.43	1.41	0.66	0.50
グローバル	26.53	29.84	51.90	7.12	11.14	10.38	1.15	0.48	0.41
北米	43.30	50.15	77.61	8.36	11.31	10.46	1.53	0.75	0.57
その他	20.44	24.99	39.75	8.34	12.39	11.32	0.77	0.37	0.30
欧州	23.27	27.37	40.94	9.13	13.13	12.06	0.79	0.38	0.29
アジア・オセアニア	9.91	14.89	37.73	9.33	11.89	10.25	0.35	0.24	0.32
複合地域	28.41	43.26	55.87	7.59	8.94	8.74	1.15	0.84	0.52
複合資産	14.75	26.88	49.36	6.55	7.16	7.13	0.72	0.69	0.58
安定	4.42	12.68	26.74	4.72 ↑	4.98	5.25	0.31	0.49	0.46
安定成長	18.86	32.60	57.37	6.88	7.62	7.52	0.87	0.77	0.62
成長	32.58	57.34	99.69	8.79	10.32 ↓	10.40	1.12	0.92	0.69
国内バランス	-1.15	-2.25	8.11	3.17	3.89	4.61	-0.11	-0.11	0.17
安定	-3.10	-4.85	8.39	3.06	3.77	3.10	-0.33	-0.25	0.27
一般	18.01	34.17	49.37	6.50	7.62	8.56	0.88	0.80	0.48
その他	-6.86	23.69	-	19.99	18.20	-	-0.12	0.24	-

※[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	27.35	53.85	86.16	11.06	11.78	10.68	0.76	0.77	0.60
国内REIT	8.96	15.65	64.33	10.29 ↓	14.73	12.14 ↓	0.29	0.20	0.42
日本	8.96	15.65	64.33	10.29 ↓	14.73	12.14 ↓	0.29	0.20	0.42
外国REIT	48.92	48.74	116.15	18.33	19.04	16.64	0.78	0.44	0.48
グローバル	43.02	38.72	91.43	18.04	19.72	16.86	0.70	0.34	0.40
除く日本	46.88	46.86	116.34	18.69	20.44	17.30	0.73	0.39	0.46
含む日本	41.23	35.85	86.25	17.72	19.44	16.69	0.69	0.33	0.39
北米	58.93	61.16	141.85	19.25 ↑	18.82	16.96	0.87	0.53	0.55
その他	21.34	25.11	92.71	15.42	19.51	16.10	0.43	0.24	0.42
欧州	10.71	4.53	30.20	18.94 ↓	21.16	18.55	0.18	0.04	0.15
アジア・オセアニア	17.10	23.44	101.32	14.38	17.99	15.28	0.38	0.24	0.48
オーストラリア	31.71	27.32	85.96	23.33	29.95	23.30	0.41	0.17	0.28
複合地域	47.63	18.35	44.25	15.73 ↓	24.42	20.29	0.88	0.14	0.18
複数国	41.60	48.38	142.82	16.07	17.19	15.02	0.77	0.48	0.62
その他									
絶対収益型	-4.40	-1.09	-1.80	3.71	3.30	2.77	-0.39	-0.06	-0.06
ロング・ショート	-4.57	-4.96	-7.73	3.17	3.18	3.04	-0.48	-0.31	-0.26
マーケットニュートラル	-9.42	-4.18	14.67	4.03	3.99	5.26	-0.80	-0.20	0.27
GTAA	2.09	12.26	10.83	4.00	4.46	3.45	0.18	0.53	0.30
その他スタイル	-4.05	-1.04	-1.75	4.12	3.58	3.04	-0.33	-0.05	-0.05
CB	-2.11	15.09	22.26	6.82 ↓	8.65	7.60	-0.10	0.33	0.27
アジア・オセアニア	20.70	47.85	98.51	8.94 ↓	12.01	11.28	0.73	0.68	0.63
日本	5.15	6.57	23.41	4.55	4.98	5.25	0.38	0.26	0.41
グローバル	-2.92	14.67	20.84	7.07 ↓	8.88	7.70	-0.14	0.32	0.25
コモディティ	48.13	70.69	17.78	10.46	11.06	11.96	1.34	1.02	0.14
全業種	94.58	83.68	18.50	16.86	19.04	16.93	1.48	0.68	0.10
貴金属	20.14	58.42	53.41	12.00 ↓	12.49	11.27	0.53	0.77	0.39
エネルギー	185.99	138.97	32.84	27.41	35.39	31.82	1.53	0.54	0.09
その他コモディティ	78.93	63.87	31.84	15.44	18.67	16.98	1.39	0.56	0.17

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

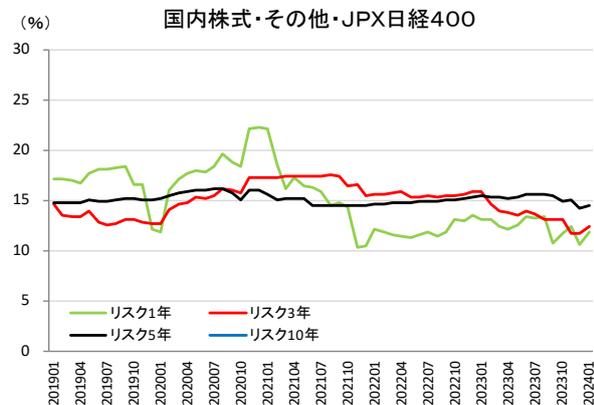
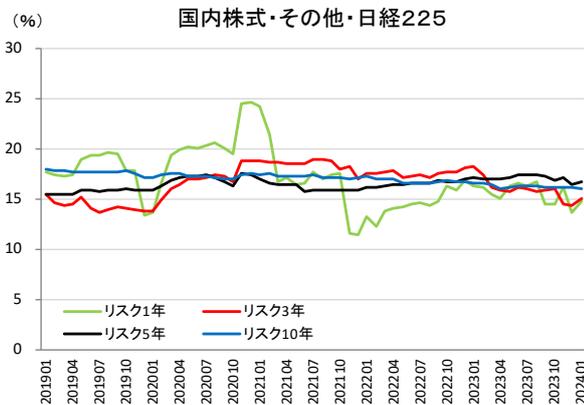
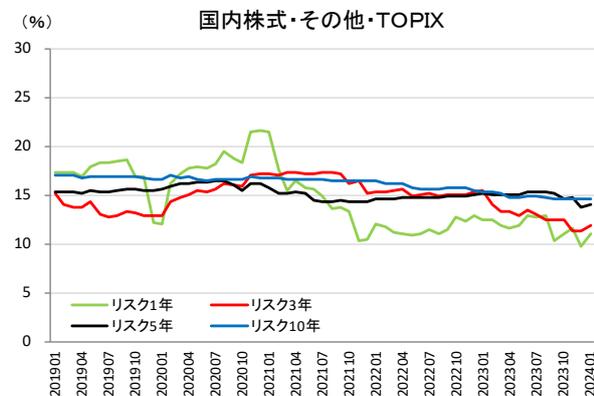
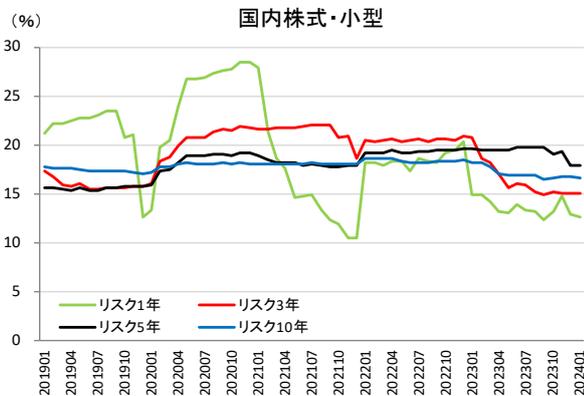
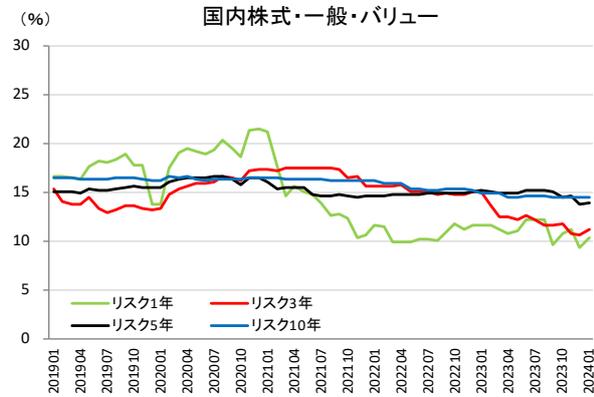
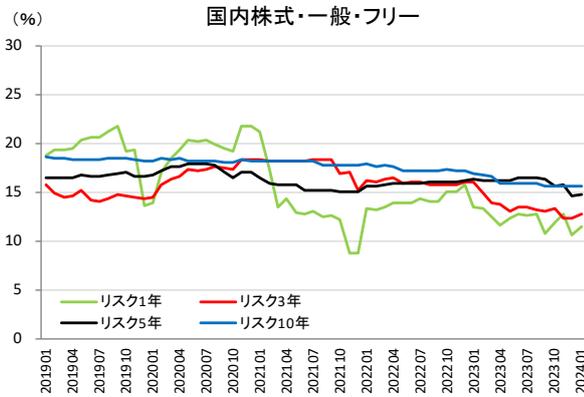
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

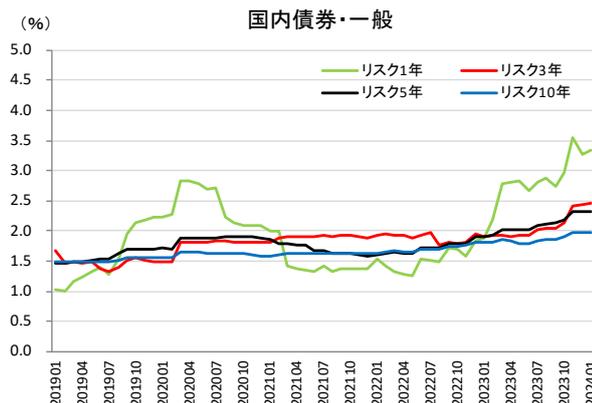
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

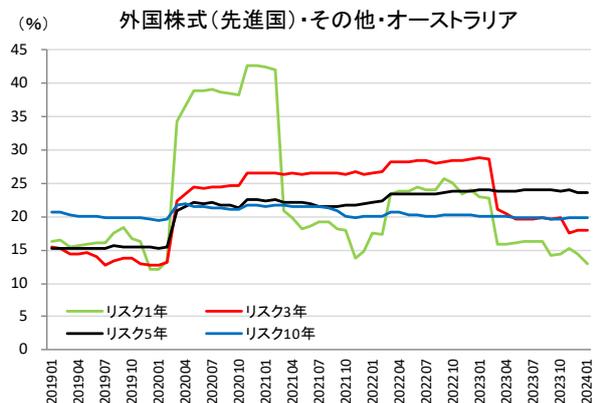
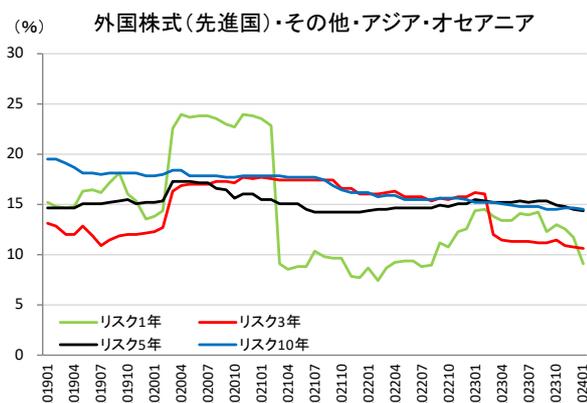
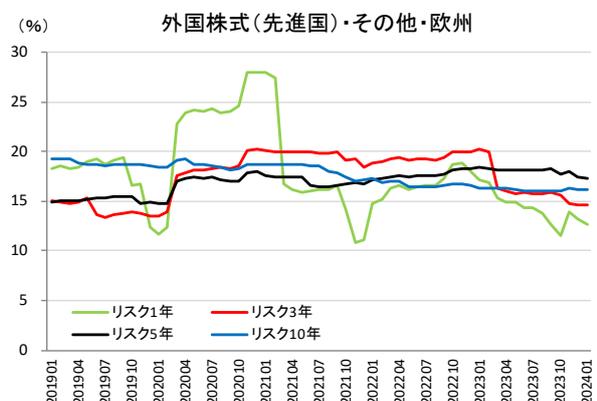
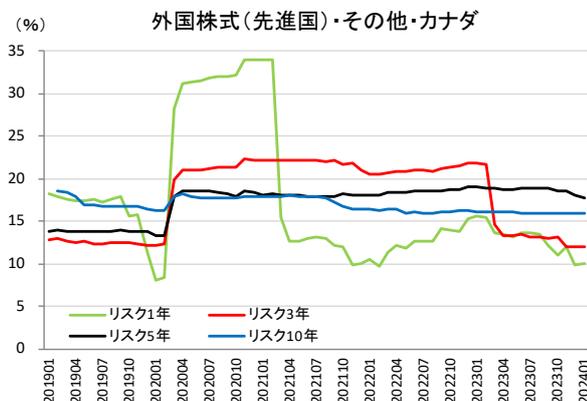
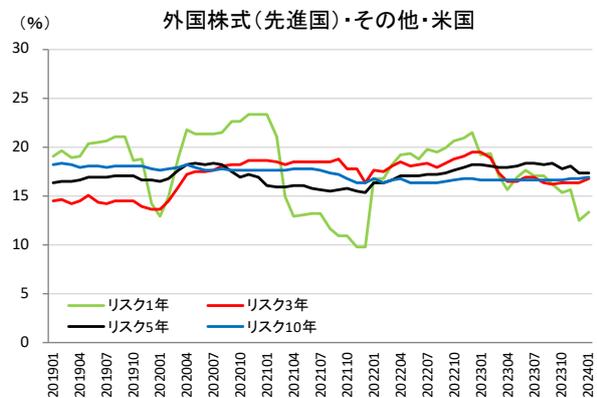
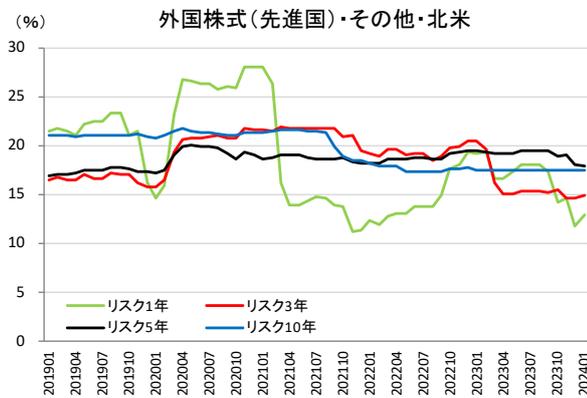
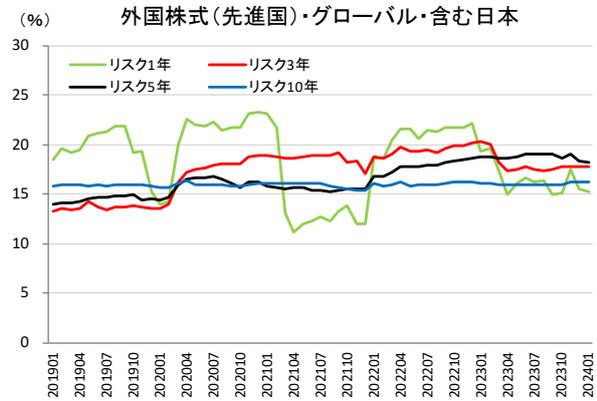
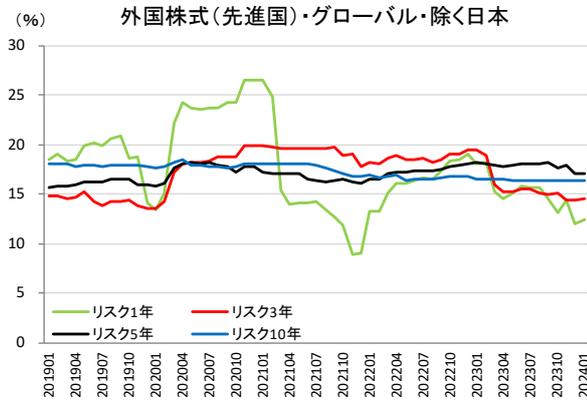


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

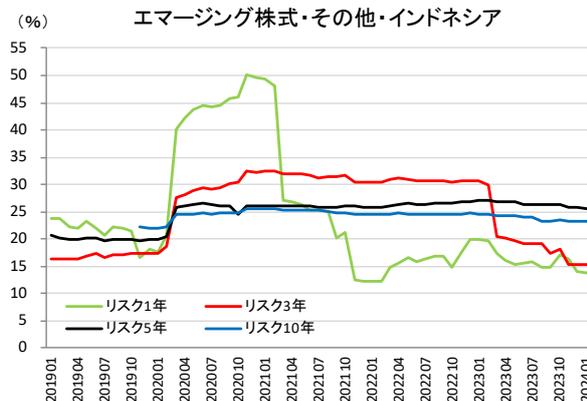
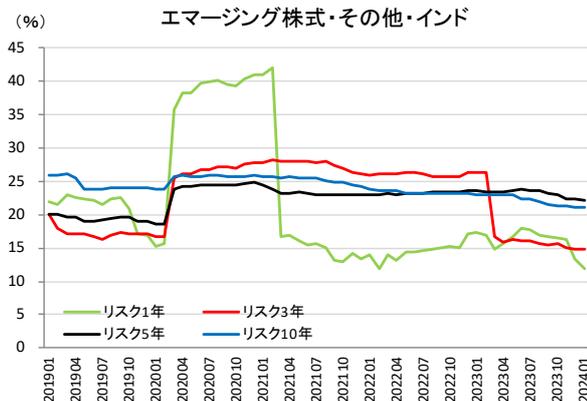
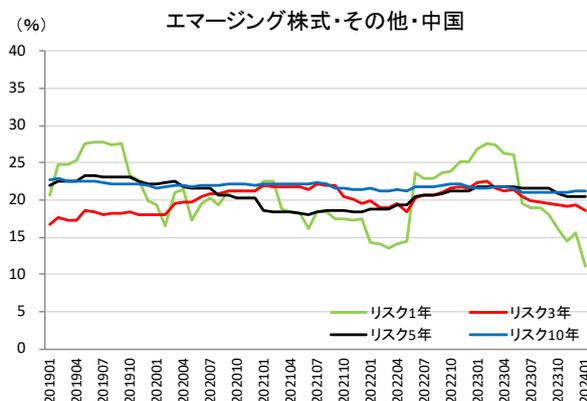
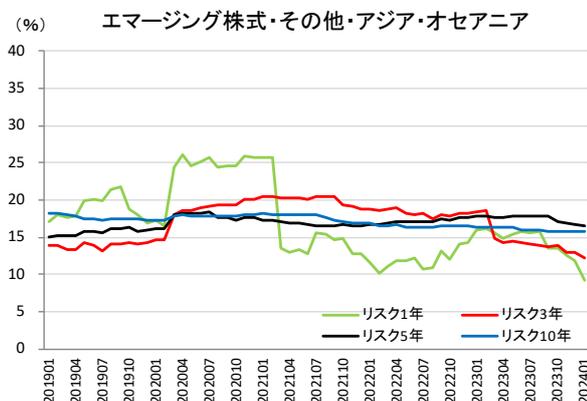
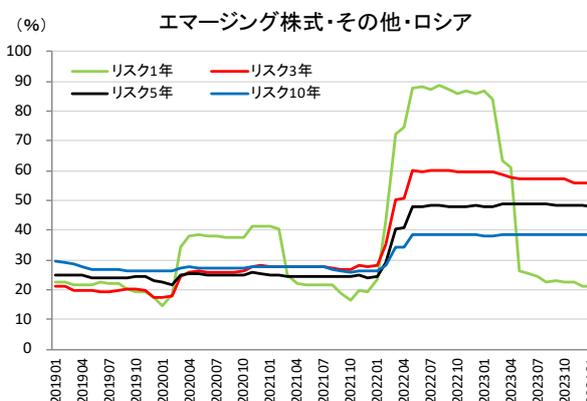
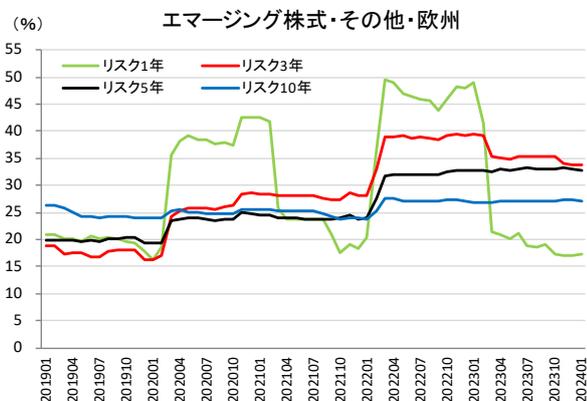
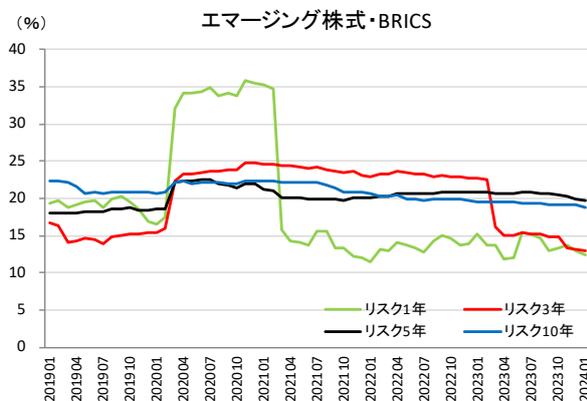
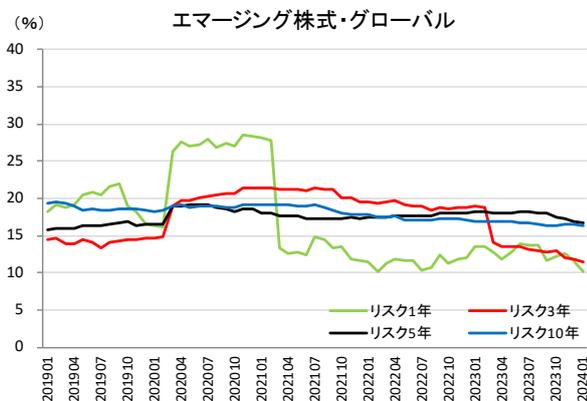


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

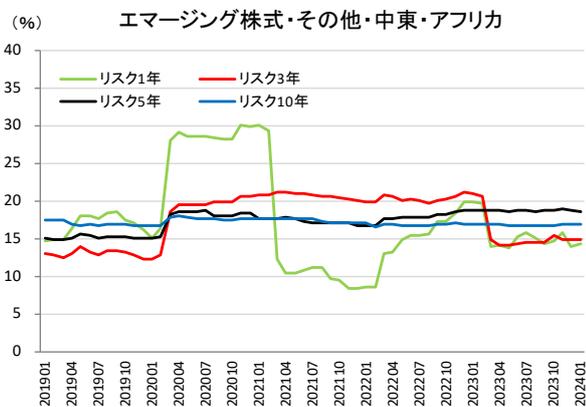
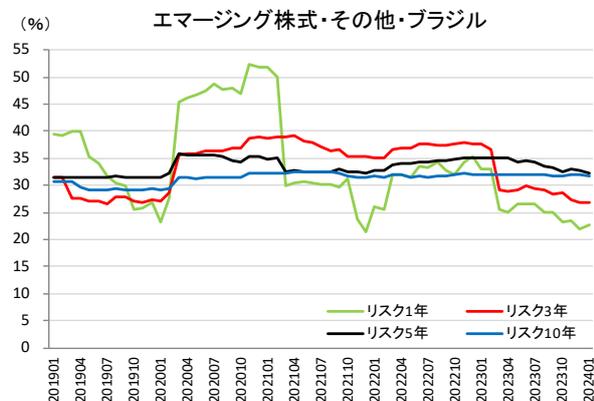
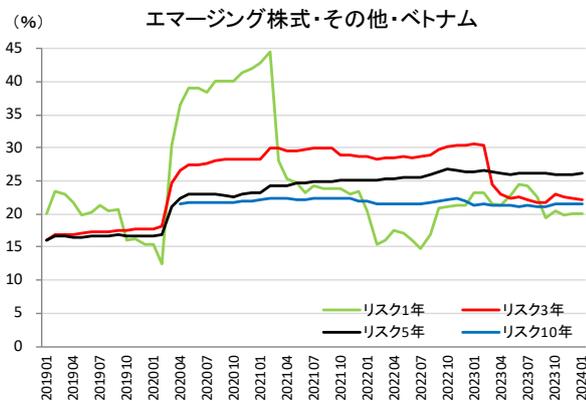
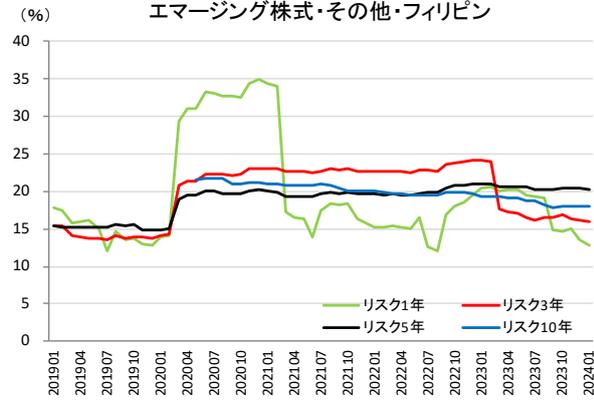
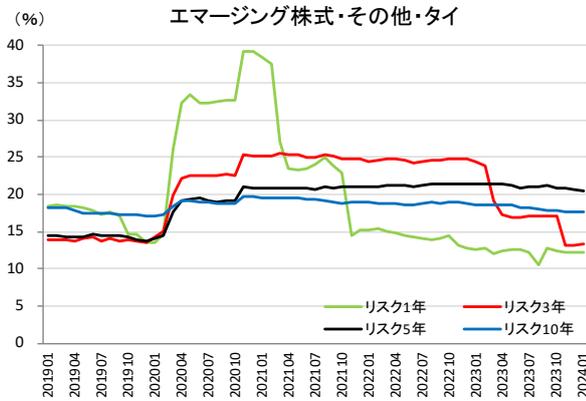


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

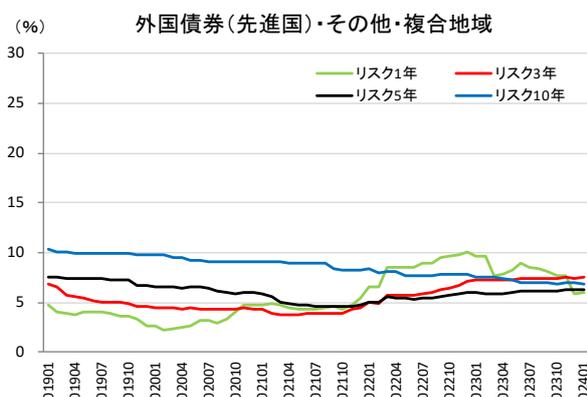
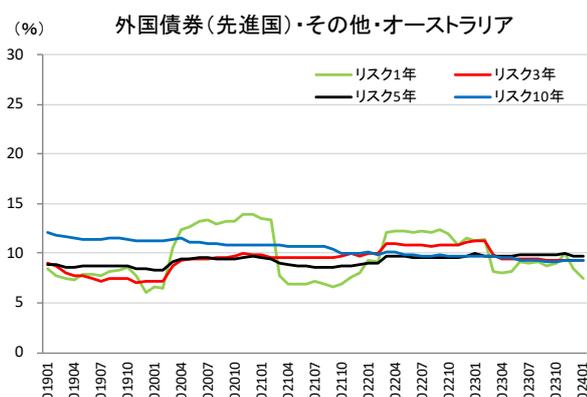
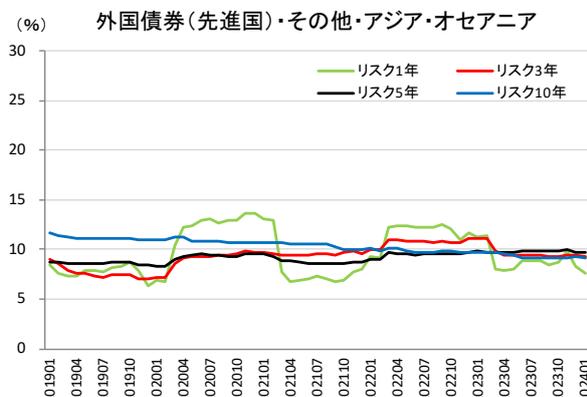
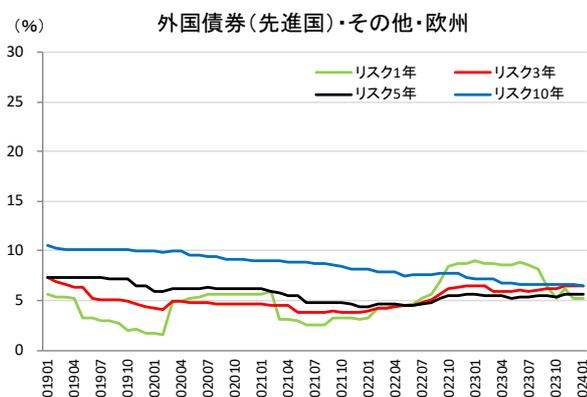
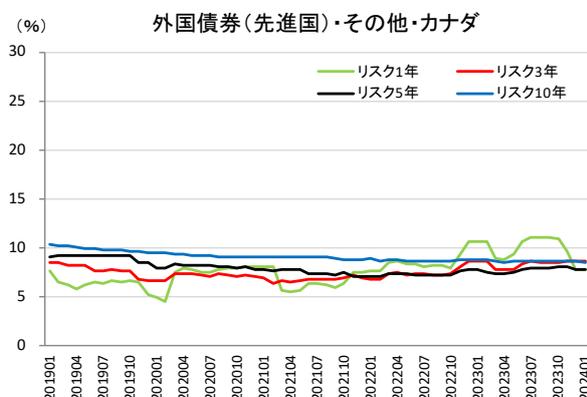
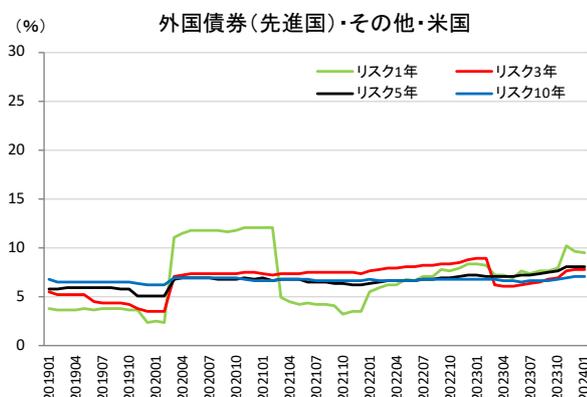
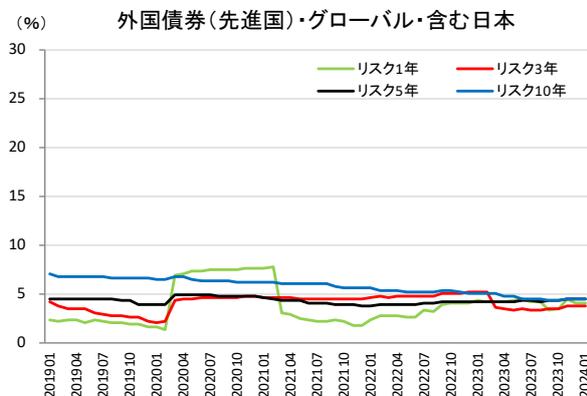
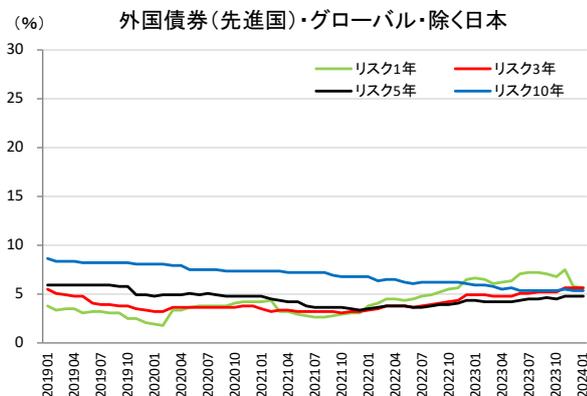


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

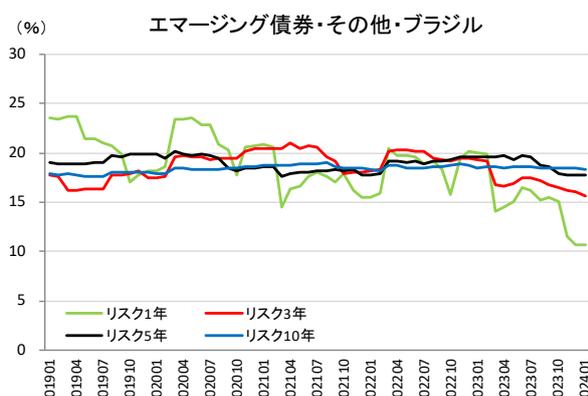
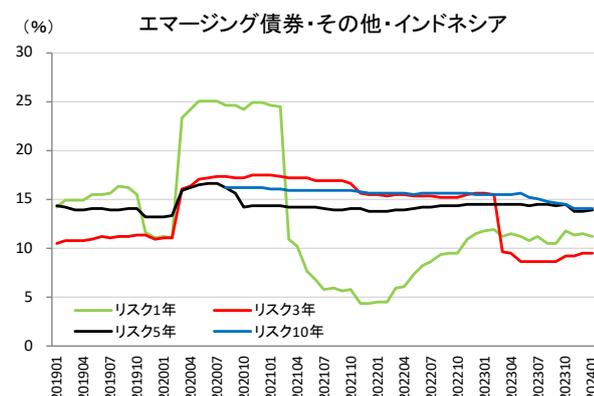
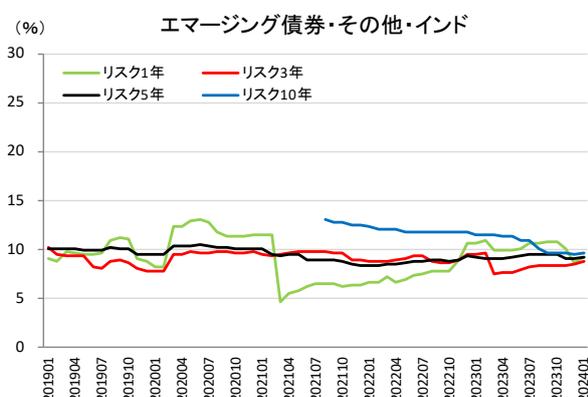
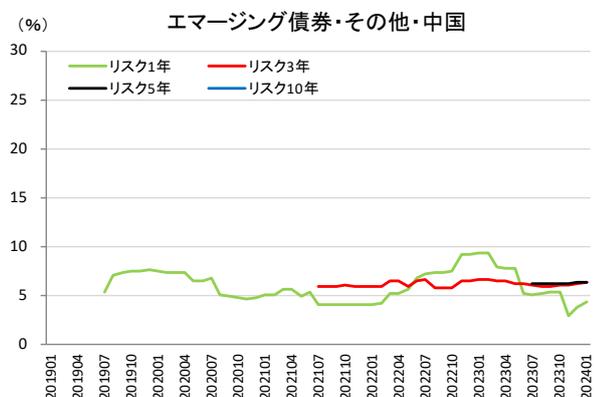
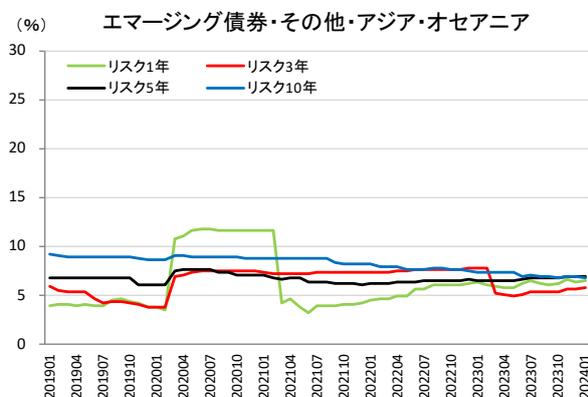
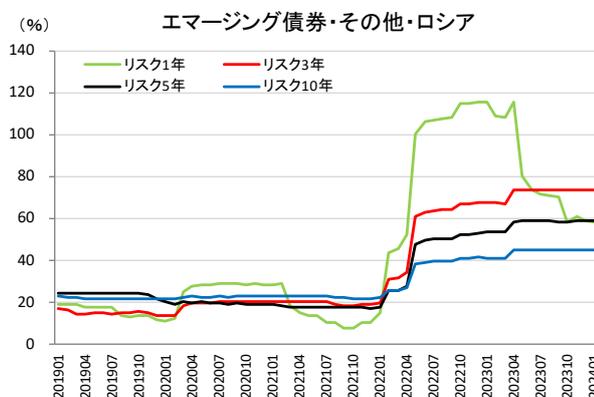
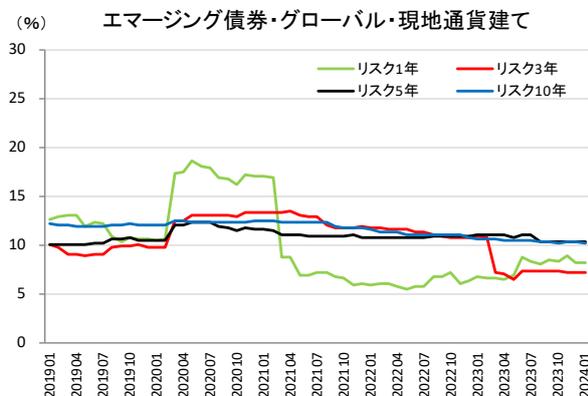
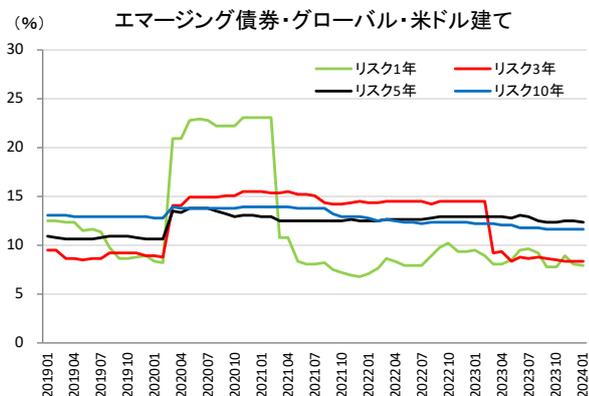


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

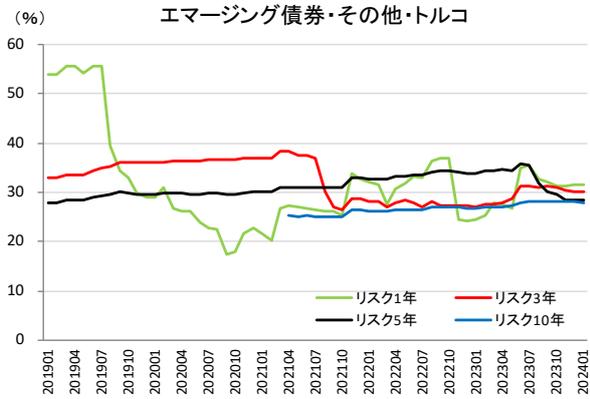
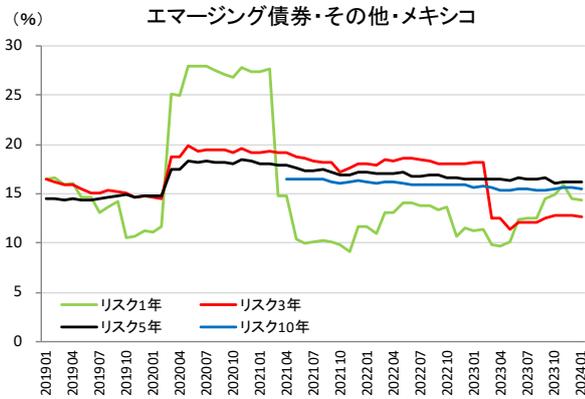


<2> リスク・サマリー

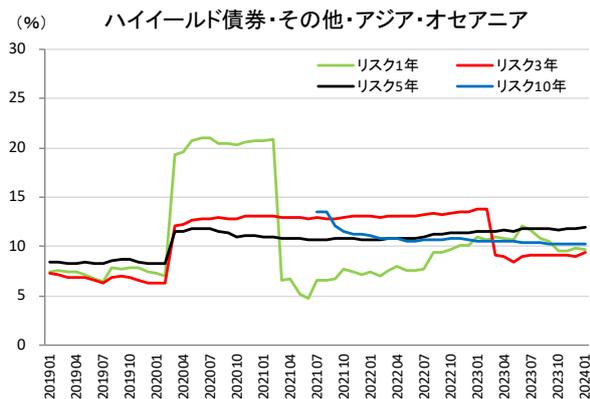
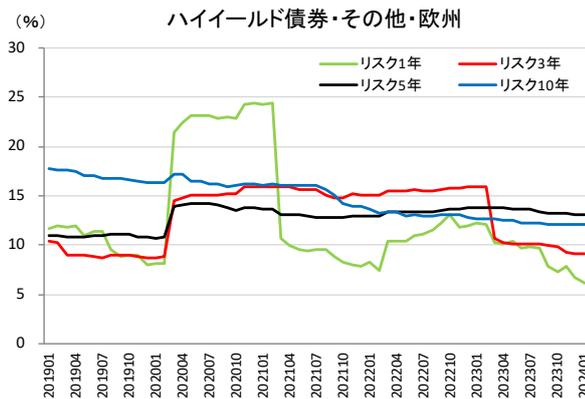
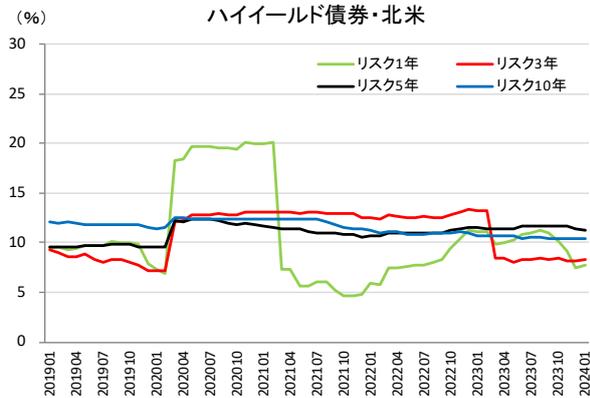
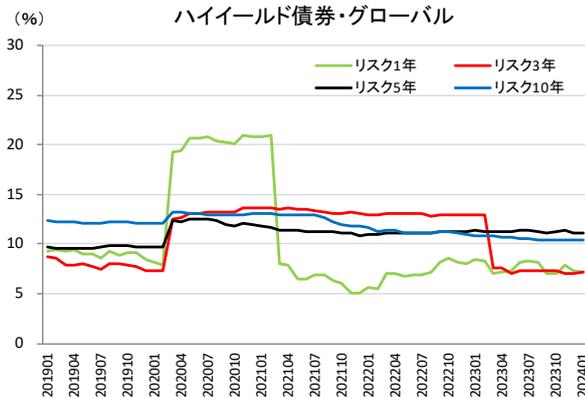
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

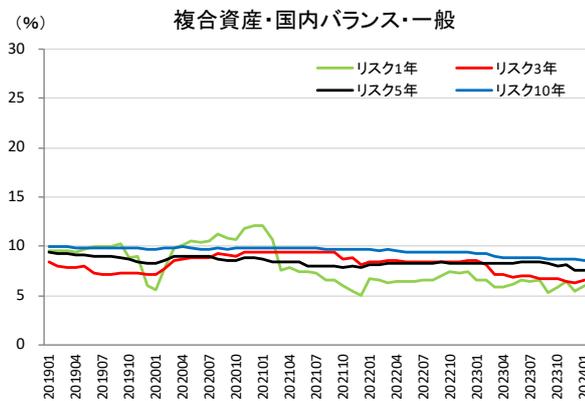
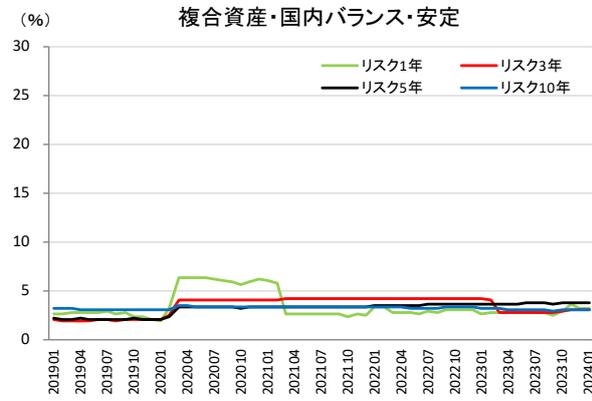
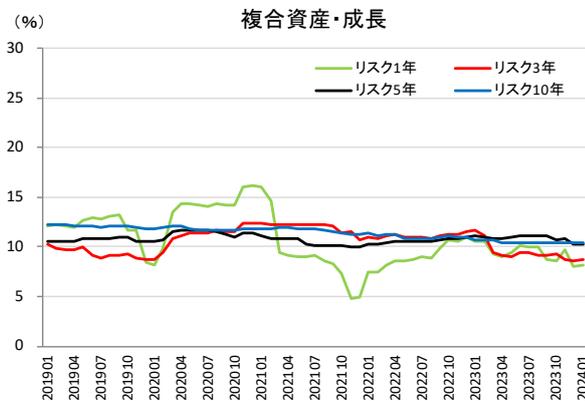
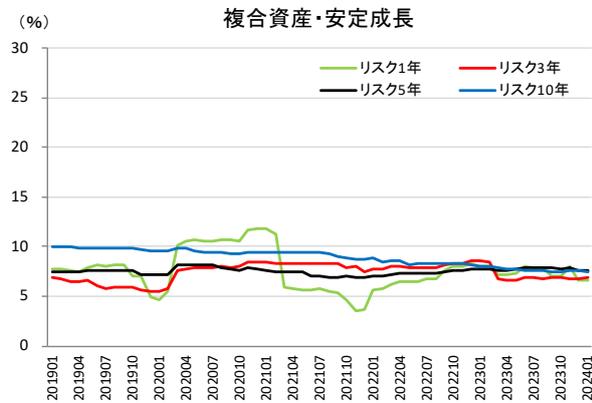
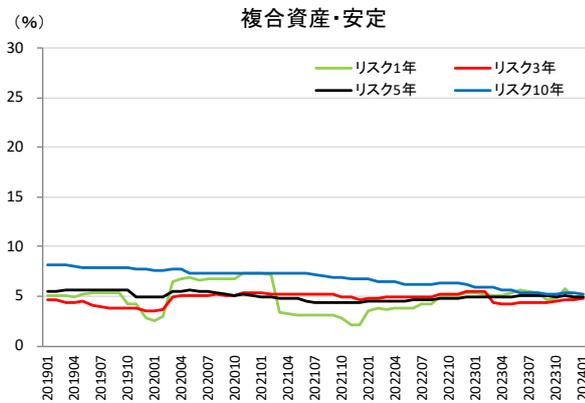


<2> リスク・サマリー

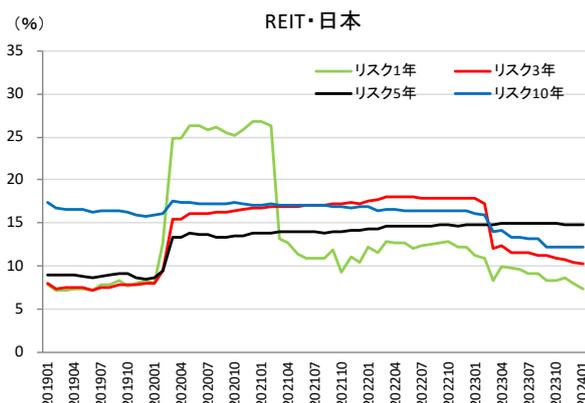
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

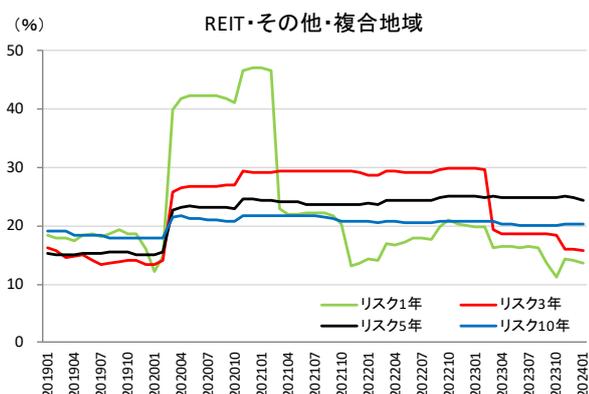
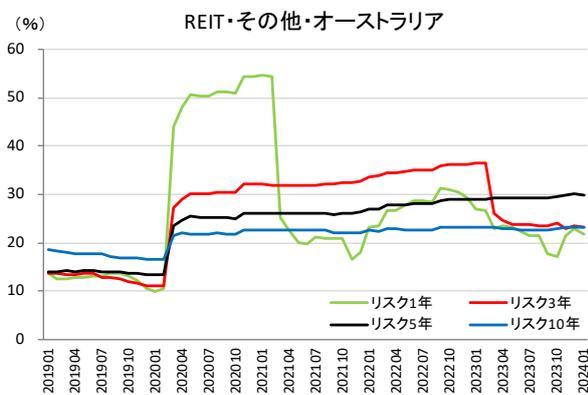
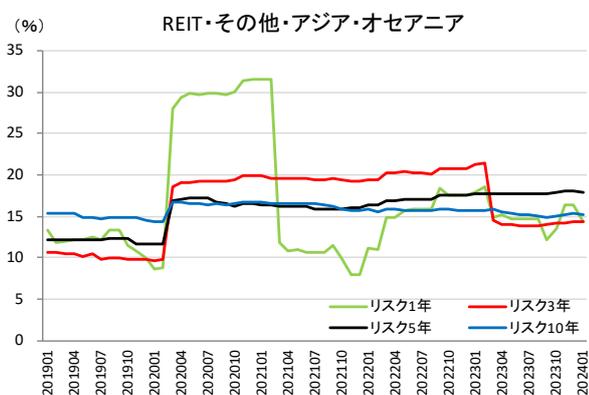
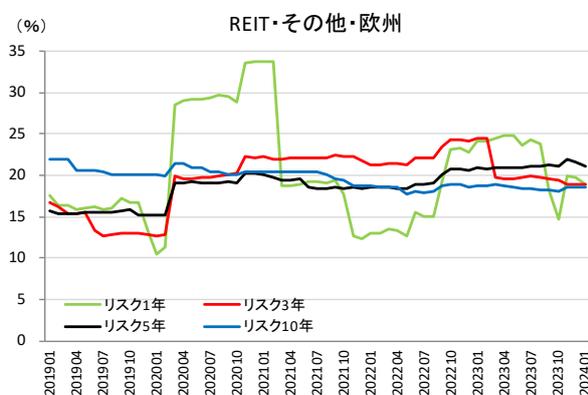
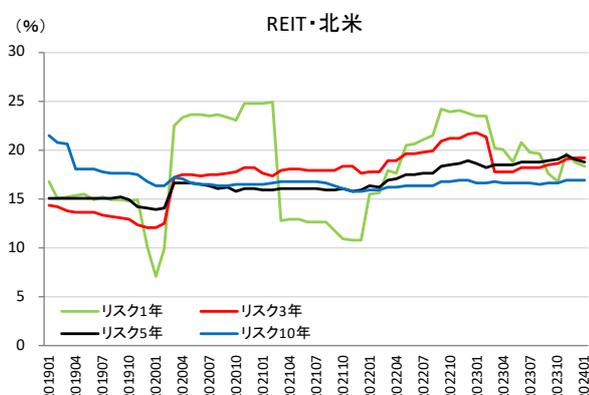
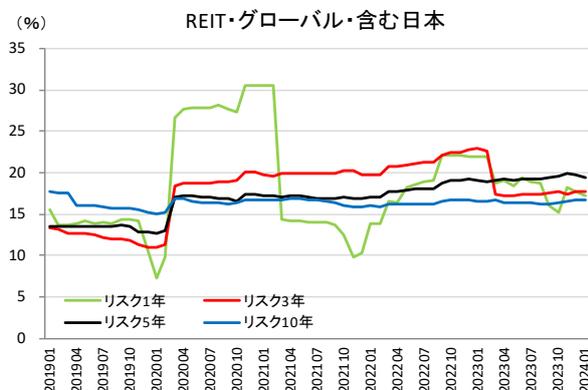
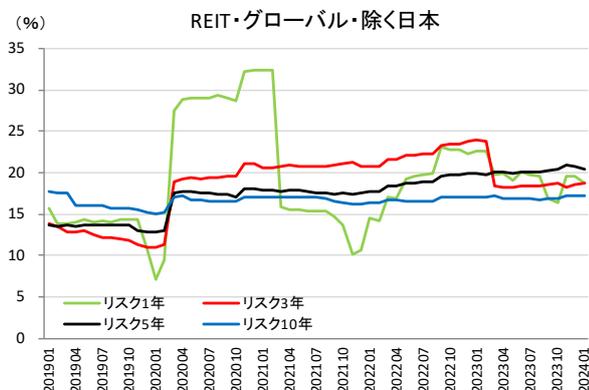


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

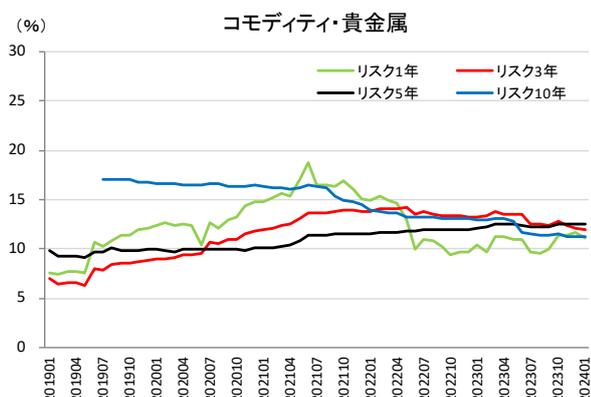
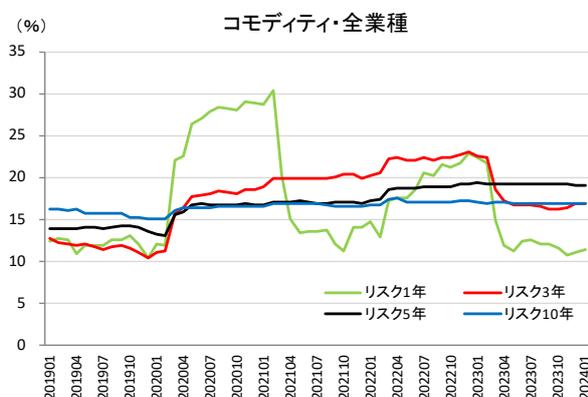
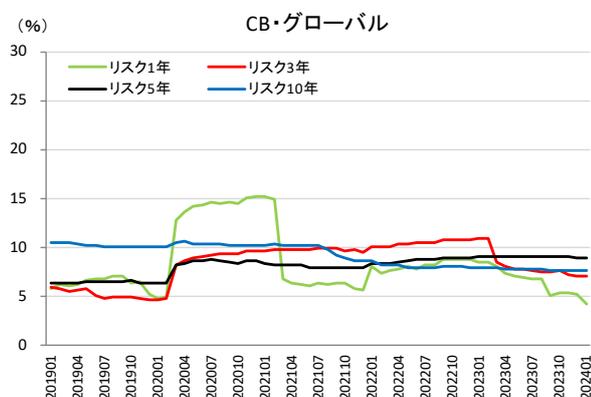
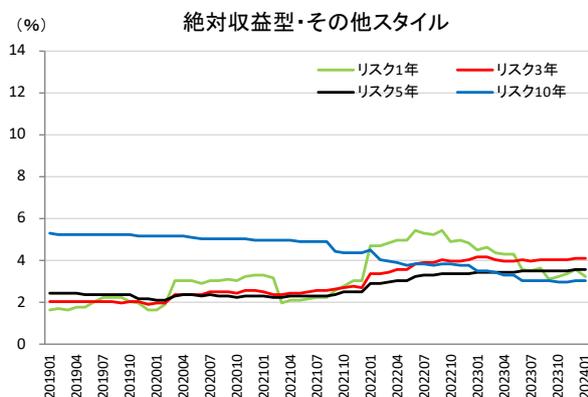
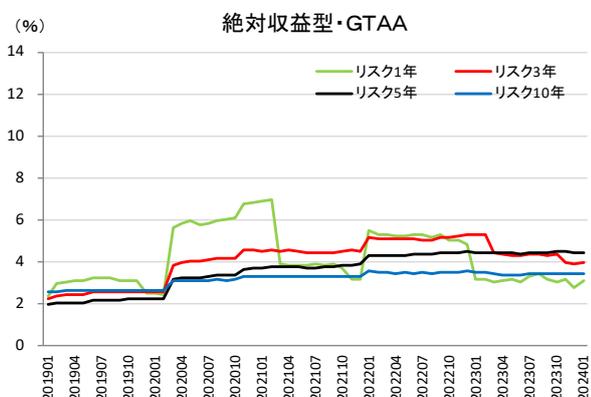
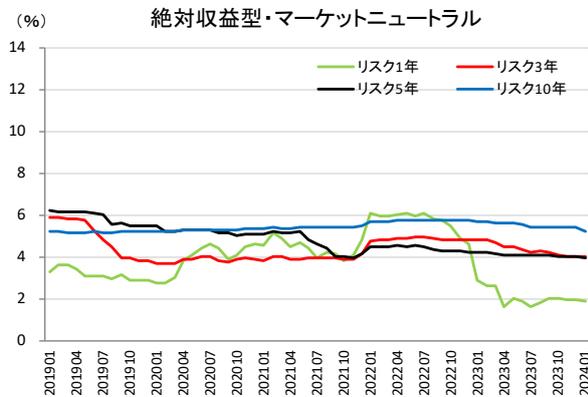
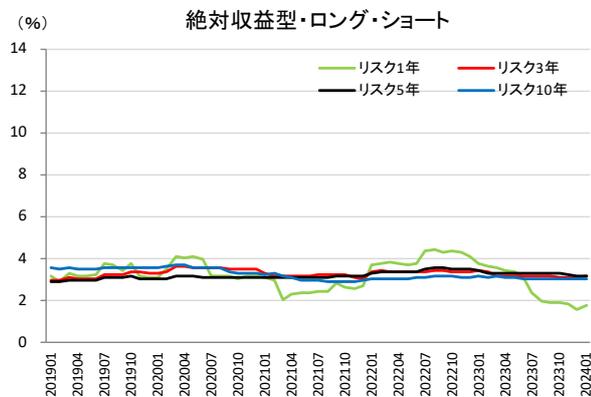


<2>リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



< 3 > 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	12,962	16,773	49,515	75,375
国内株式	1,305	902	7,944	9,311
一般	1,110	2,285	5,287	8,532
フリー	-122	-158	1,182	1,786
バリュー	1,232	2,443	4,099	6,741
小型	-77	-174	-49	248
その他	249	-1,323	2,511	304
日経225	-6	-1,911	370	-2,546
TOPIX	203	346	1,461	2,219
JPX日経400	-14	-56	7	-54
国内債券	-240	-166	1,743	560
一般	-240	-166	1,743	560
外国株式(先進国)	10,152	14,351	28,055	38,581
グローバル	4,901	5,534	13,236	20,062
除く日本	954	2,103	4,278	7,613
含む日本	3,947	3,431	8,958	12,449
その他	5,251	8,816	14,819	18,520
北米	538	762	917	1,197
米国	4,757	8,180	14,139	17,901
カナダ	0	-8	-13	-25
欧州	4	-3	-40	-166
ドイツ	0	-1	-1	-2
イギリス	-1	-1	-1	-1
アジア・オセアニア	0	-1	-2	-4
オーストラリア	-46	-110	-166	-364
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	0	-2	-15	-15
エマージング株式	1,440	3,187	6,645	10,180
グローバル	19	111	339	722
BRICS	-6	-15	-25	-42
その他	1,427	3,091	6,330	9,500
欧州	-2	0	0	2
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-43	-128	-272	-512
中国	-38	-149	-336	-458
インド	1,509	3,381	6,952	10,422
インドネシア	1	1	14	35
タイ	0	-2	-5	-5
フィリピン	-1	-2	-3	-2
ベトナム	0	7	-4	95
韓国	0	0	0	-4
香港	2	4	5	5
中南米	-1	-3	-5	-10
ブラジル	-5	-32	-35	-72
メキシコ	0	0	-1	0
中東・アフリカ	-1	-5	-13	-19
トルコ	0	-3	-4	-13
複合地域	6	23	36	36

<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	12,962	16,773	49,515	75,375
外国債券(先進国)	160	560	4,033	8,708
グローバル	154	607	3,922	7,606
除く日本	119	279	1,504	2,586
含む日本	35	328	2,418	5,019
その他	6	-47	111	1,102
北米	18	45	57	79
米国	87	328	695	1,984
カナダ	-11	-51	-79	-141
欧州	4	-11	-16	83
イギリス	0	-1	-1	-1
アジア・オセアニア	-18	-72	-88	-108
オーストラリア	-66	-256	-417	-713
ニュージーランド	-2	-5	0	3
複合地域	-6	-23	-39	-83
エマージング債券	-28	-69	-68	98
グローバル	-5	-49	-130	29
米ドル建て	-2	-60	-143	-57
現地通貨建て	-3	10	14	86
その他	-22	-20	62	69
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-2	-8	-13	-21
中国	-2	-10	-19	3
インド	5	83	231	411
インドネシア	-1	-2	13	27
ブラジル	-17	-65	-124	-304
メキシコ	-5	-17	-24	-39
トルコ	0	0	0	-3
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイイールド債券	47	254	624	1,574
グローバル	-1	-31	-90	-182
北米	68	357	841	1,998
その他	-20	-72	-127	-241
欧州	-15	-57	-100	-209
アジア・オセアニア	-5	-15	-25	-30
複合地域	0	-1	-1	-2
複合資産	593	273	2,514	5,160
安定	-140	-597	-953	-1,483
安定成長	337	294	1,602	3,198
成長	543	1,097	2,642	4,743
国内バランス	-97	-367	-590	-1,143
安定	-120	-431	-746	-1,399
一般	-4	-13	-19	-37
その他	-49	-154	-187	-156

< 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	12,962	16,773	49,515	75,375
国内REIT	-201	-950	-1,095	-448
日本	-201	-950	-1,095	-448
外国REIT	-192	-916	-702	543
グローバル	-149	-468	-368	-294
除く日本	-33	-70	168	769
含む日本	-118	-400	-538	-1,065
北米	1	-292	-88	1,111
その他	-43	-156	-245	-275
欧州	-1	-3	-5	-16
アジア・オセアニア	-32	-117	-190	-173
オーストラリア	-8	-27	-39	-64
複合地域	0	-2	-2	-4
複数国	-2	-6	-10	-18
その他	-76	-653	-178	1,108
絶対収益型	40	-93	-109	-122
ロング・ショート	-5	-24	49	22
マーケットニュートラル	-13	-30	-71	-164
GTAA	-6	-18	-35	-75
その他スタイル	63	-23	-59	109
CB	-39	120	112	881
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-2
日本	0	3	3	3
グローバル	-38	118	110	880
コモディティ	123	270	344	909
全業種	19	27	39	143
貴金属	104	242	311	775
エネルギー	0	1	-9	-15
その他コモディティ	0	0	3	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	1,107,793	100.00	5,376	100.00
国内株式	147,752	13.34	776	14.43
一般	83,096	7.50	473	8.80
フリー	59,116	5.34	372	6.92
バリュー	23,950	2.16	99	1.84
小型	7,612	0.69	87	1.62
その他	55,990	5.05	210	3.91
日経225	26,327	2.38	72	1.34
TOPIX	24,311	2.19	83	1.54
JPX日経400	902	0.08	14	0.26
国内債券	42,724	3.86	147	2.73
一般	42,724	3.86	147	2.73
外国株式(先進国)	500,015	45.14	1,216	22.62
グローバル	328,658	29.67	839	15.61
除く日本	98,753	8.91	197	3.66
含む日本	229,905	20.75	642	11.94
その他	171,357	15.47	377	7.01
北米	2,446	0.22	13	0.24
米国	164,362	14.84	294	5.47
カナダ	130	0.01	2	0.04
欧州	1,651	0.15	38	0.71
ドイツ	17	0.00	1	0.02
イギリス	8	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	2,669	0.24	23	0.43
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	26	0.00	1	0.02
エマージング株式	42,931	3.88	310	5.77
グローバル	11,219	1.01	93	1.73
BRICS	440	0.04	7	0.13
その他	31,272	2.82	210	3.91
欧州	90	0.01	6	0.11
ロシア	8	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,167	0.38	84	1.56
中国	1,113	0.10	32	0.60
インド	23,336	2.11	36	0.67
インドネシア	195	0.02	5	0.09
タイ	6	0.00	2	0.04
フィリピン	29	0.00	4	0.07
ベトナム	1,567	0.14	13	0.24
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	18	0.00	1	0.02
中南米	63	0.01	2	0.04
ブラジル	491	0.04	11	0.20
メキシコ	9	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	68	0.01	3	0.06
トルコ	55	0.00	2	0.04
複合地域	56	0.01	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	1,107,793	100.00	5,376	100.00
外国債券(先進国)	94,693	8.55	745	13.86
グローバル	77,513	7.00	534	9.93
除く日本	34,927	3.15	225	4.19
含む日本	42,586	3.84	309	5.75
その他	17,180	1.55	211	3.92
北米	153	0.01	8	0.15
米国	7,820	0.71	109	2.03
カナダ	642	0.06	4	0.07
欧州	1,057	0.10	27	0.50
イギリス	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,508	0.14	9	0.17
オーストラリア	4,855	0.44	32	0.60
ニュージーランド	82	0.01	9	0.17
複合地域	1,054	0.10	8	0.15
エマージング債券	11,969	1.08	239	4.45
グローバル	6,754	0.61	172	3.20
米ドル建て	4,878	0.44	134	2.49
現地通貨建て	1,876	0.17	38	0.71
その他	5,214	0.47	67	1.25
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	140	0.01	8	0.15
インド	2,700	0.24	16	0.30
インドネシア	328	0.03	7	0.13
ブラジル	1,493	0.13	20	0.37
メキシコ	256	0.02	3	0.06
トルコ	31	0.00	2	0.04
複合地域	33	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	20,733	1.87	238	4.43
グローバル	2,719	0.25	38	0.71
北米	16,192	1.46	138	2.57
その他	1,822	0.16	62	1.15
欧州	1,410	0.13	40	0.74
アジア・オセアニア	374	0.03	21	0.39
複合地域	38	0.00	1	0.02
複合資産	150,079	13.55	1,065	19.81
安定	38,395	3.47	287	5.34
安定成長	67,659	6.11	442	8.22
成長	34,635	3.13	294	5.47
国内バランス	6,238	0.56	28	0.52
安定	5,198	0.47	9	0.17
一般	284	0.03	15	0.28
その他	3,152	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	1,107,793	100.00	5,376	100.00
国内REIT	24,979	2.25	142	2.64
日本	24,979	2.25	142	2.64
外国REIT	44,752	4.04	275	5.12
グローバル	18,132	1.64	154	2.86
除く日本	7,762	0.70	67	1.25
含む日本	10,368	0.94	86	1.60
北米	23,927	2.16	73	1.36
その他	2,693	0.24	48	0.89
欧州	94	0.01	6	0.11
アジア・オセアニア	1,826	0.16	26	0.48
オーストラリア	472	0.04	12	0.22
複合地域	59	0.01	3	0.06
複数国	240	0.02	1	0.02
その他	27,167	2.45	223	4.15
絶対収益型	11,692	1.06	92	1.71
ロング・ショート	835	0.08	29	0.54
マーケットニュートラル	349	0.03	13	0.24
GTAA	332	0.03	11	0.20
その他スタイル	10,105	0.91	38	0.71
CB	2,935	0.26	40	0.74
アジア・オセアニア	33	0.00	1	0.02
日本	29	0.00	1	0.02
グローバル	2,874	0.26	38	0.71
コモディティ	6,334	0.57	37	0.69
全業種	1,830	0.17	13	0.24
貴金属	4,412	0.40	22	0.41
エネルギー	66	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	15,028	10.3	2.61	2.36	1.100
国内株式	22,018	14.4	1.55	1.28	1.012
一般	20,601	14.1	2.16	1.81	1.363
フリー	19,974	13.5	1.65	1.39	1.415
バリュー	23,102	16.2	3.51	2.89	1.236
小型	25,796	15.1	1.36	1.21	1.701
その他	23,733	14.4	0.56	0.42	0.387
日経225	25,162	15.8	0.55	0.42	0.444
TOPIX	25,096	15.4	0.15	0.12	0.238
JPX日経400	22,853	9.4	0.50	0.39	0.476
国内債券	10,312	12.3	0.12	0.13	0.454
一般	10,312	12.3	0.12	0.13	0.454
外国株式(先進国)	18,318	7.7	2.97	2.53	1.141
グローバル	18,838	7.8	2.50	2.27	1.231
除く日本	27,759	10.6	0.46	0.44	0.525
含む日本	16,101	7.0	3.39	3.06	1.535
その他	17,159	7.5	3.89	3.04	0.967
北米	16,987	5.6	0.38	0.35	1.035
米国	18,038	6.7	3.87	2.98	0.947
カナダ	6,321	12.8	7.60	7.51	1.989
欧州	15,886	12.5	2.91	2.65	1.418
ドイツ	17,515	9.8	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,498	7.5	9.75	10.15	1.809
アジア・オセアニア	10,943	17.6	3.19	3.20	1.639
オーストラリア	10,791	9.0	8.56	8.81	1.823
ニュージーランド	18,343	11.5	2.24	2.18	1.672
複合地域	11,437	10.8	8.78	8.74	1.705
エマージング株式	14,080	11.0	3.21	2.58	1.666
グローバル	14,102	8.5	0.41	0.39	1.006
BRICS	15,242	17.7	0.86	0.88	2.064
その他	14,032	11.8	4.28	3.43	1.897
欧州	8,579	17.6	0.82	0.55	1.951
ロシア	964	14.7	0.00	0.00	1.171
アジア・オセアニア	14,433	13.0	2.23	2.34	1.664
中国	11,537	9.4	1.35	1.83	1.928
インド	18,901	11.1	5.08	3.90	1.939
インドネシア	12,980	11.1	1.18	1.04	1.776
タイ	12,682	11.8	1.27	1.45	1.820
フィリピン	11,779	11.5	0.39	0.38	1.708
ベトナム	17,329	6.5	1.62	1.46	1.879
韓国	13,872	5.1	0.00	0.00	1.804
香港	11,801	14.4	2.44	3.05	0.858
中南米	11,997	17.0	1.67	1.36	2.037
ブラジル	6,616	12.6	3.81	3.58	1.965
メキシコ	15,358	10.8	3.40	2.60	1.667
中東・アフリカ	13,813	12.1	1.59	1.50	2.158
トルコ	15,205	22.5	2.89	2.40	2.032
複合地域	19,048	10.5	1.73	1.62	1.006

(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	15,028	10.3	2.61	2.36	1.100
外国債券(先進国)	10,460	10.7	1.38	1.32	0.973
グローバル	10,951	10.7	1.16	1.10	0.918
除く日本	12,187	13.0	0.91	0.84	0.703
含む日本	10,051	9.0	1.39	1.33	1.094
その他	9,217	10.7	2.35	2.29	1.222
北米	10,501	7.5	2.23	2.17	1.285
米国	10,004	8.6	2.40	2.40	1.174
カナダ	7,758	13.0	1.65	1.46	1.378
欧州	7,725	14.3	1.52	1.47	1.088
イギリス	7,793	8.7	3.83	3.34	1.293
アジア・オセアニア	9,469	13.8	2.47	2.36	1.437
オーストラリア	8,606	14.5	2.53	2.45	1.244
ニュージーランド	9,543	9.6	1.57	1.49	1.372
複合地域	5,652	13.8	2.25	2.07	1.193
エマージング債券	9,871	12.1	3.96	3.51	1.398
グローバル	9,847	12.6	2.55	2.28	1.219
米ドル建て	9,575	13.1	2.85	2.54	1.356
現地通貨建て	10,808	10.8	1.77	1.61	0.863
その他	9,933	10.9	5.78	5.11	1.630
ロシア	1,779	11.0	0.00	0.00	1.532
アジア・オセアニア	9,879	13.1	6.79	6.62	1.627
中国	11,922	4.3	1.47	1.36	1.238
インド	10,389	9.4	6.55	5.99	1.707
インドネシア	9,783	11.2	5.63	5.31	1.669
ブラジル	11,658	13.6	4.91	3.79	1.578
メキシコ	9,605	11.3	5.21	4.22	1.369
トルコ	1,367	11.3	4.80	7.71	1.474
複合地域	4,351	17.4	1.64	1.38	1.210
ハイイールド債券	10,058	12.6	5.28	4.74	1.661
グローバル	8,392	11.4	3.27	2.89	1.457
北米	11,484	13.6	5.47	4.88	1.684
その他	7,903	11.3	6.63	6.25	1.766
欧州	8,378	10.8	6.03	5.48	1.738
アジア・オセアニア	7,144	11.8	8.98	9.28	1.868
複合地域	4,878	19.8	5.59	4.92	1.800
複合資産	13,946	9.6	1.12	1.06	0.924
安定	11,641	9.6	1.17	1.10	1.058
安定成長	13,563	10.0	1.35	1.28	0.930
成長	17,088	9.1	0.39	0.35	0.778
国内バランス	12,702	11.3	2.14	2.10	0.954
安定	10,673	12.5	1.71	1.72	0.914
一般	14,009	11.8	1.09	0.97	1.255
その他	9,791	3.8	1.46	1.39	0.704

(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	15,028	10.3	2.61	2.36	1.100
国内REIT	13,696	10.1	7.92	8.95	0.908
日本	13,696	10.1	7.92	8.95	0.908
外国REIT	12,715	9.5	8.32	8.48	1.447
グローバル	13,976	9.1	3.22	3.11	1.177
除く日本	15,404	7.6	1.92	1.93	0.917
含む日本	12,908	10.4	4.20	4.00	1.371
北米	11,776	10.3	12.37	12.70	1.619
その他	10,095	9.7	6.55	7.13	1.746
欧州	6,938	10.4	4.85	4.56	1.875
アジア・オセアニア	11,006	9.0	7.96	8.84	1.796
オーストラリア	10,090	9.3	4.37	4.41	1.699
複合地域	8,040	12.0	0.87	0.80	0.776
複数国	11,596	19.8	2.21	2.07	1.650
その他					
絶対収益型	10,528	6.8	0.03	0.03	1.921
ロング・ショート	10,565	6.0	0.26	0.27	1.520
マーケットニュートラル	9,955	6.2	0.00	0.00	1.271
GTAA	11,154	11.0	0.21	0.20	1.548
その他スタイル	10,469	6.6	0.00	0.00	1.993
CB	12,100	7.7	0.44	0.41	1.173
アジア・オセアニア	10,391	13.6	2.43	2.31	1.823
日本	14,495	24.2	0.38	0.34	0.770
グローバル	12,082	7.1	0.40	0.38	1.170
コモディティ	12,731	7.6	0.00	0.00	0.910
全業種	10,621	11.6	0.00	0.00	1.256
貴金属	13,355	5.0	0.00	0.00	0.767
エネルギー	20,800	14.9	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	18,339	7.3	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