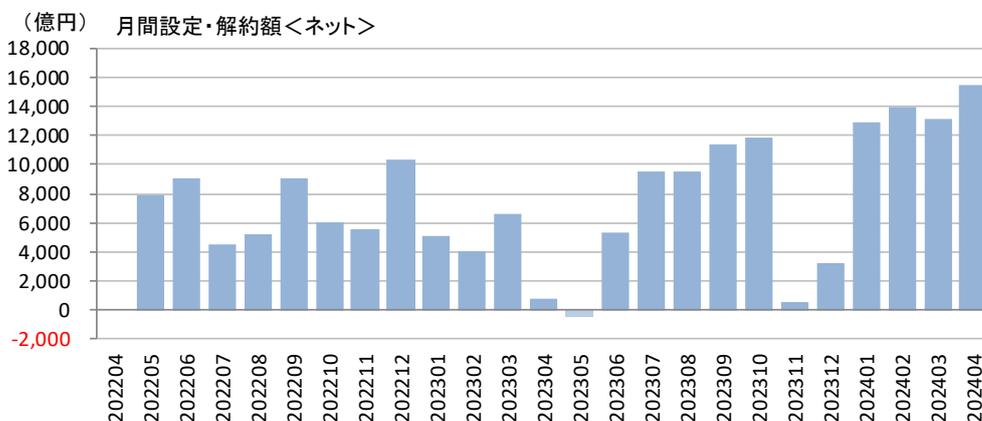
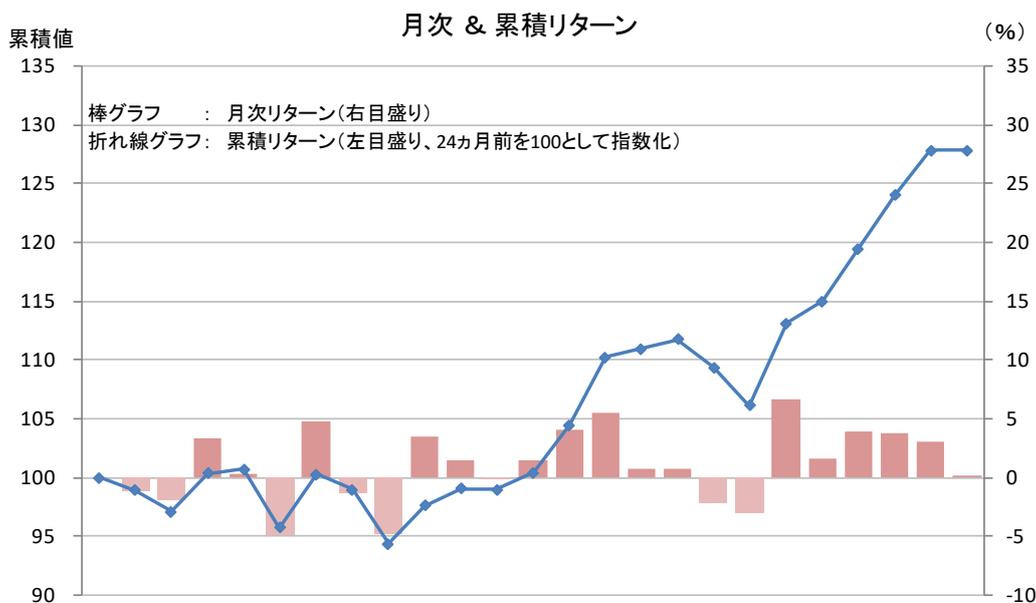


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2024年4月

「総合」 +0.03 %
(前月 +3.09 %)



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		20,075	20,069	6	0.03
国内株式		27,568	28,228	-660	-2.34
一般		26,650	27,109	-459	-1.69
フリー		24,536	25,097	-561	-2.23
バリュー		36,365	36,526	-161	-0.44
小型		45,173	47,552	-2,379	-5.00
その他		28,424	29,277	-853	-2.92
日経225		26,830	28,214	-1,384	-4.90
TOPIX		28,142	28,401	-259	-0.91
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	26,720	26,854	-134	-0.50
国内債券		12,272	12,414	-142	-1.14
一般		12,272	12,414	-142	-1.14
外国株式(先進国)		29,122	29,007	115	0.40
グローバル		31,000	30,856	144	0.47
除く日本		50,082	49,555	527	1.06
含む日本		26,908	26,850	57	0.21
その他		24,869	24,803	66	0.26
北米		31,807	31,571	235	0.75
米国		38,774	38,676	99	0.26
カナダ	10,000 (2009.02.27)	24,649	24,256	393	1.62
欧州		30,351	30,177	174	0.58
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	16,138	16,029	109	0.68
イギリス	9,683 (2014.05.30)	12,208	12,220	-12	-0.10
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	46,046	44,887	1,160	2.58
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	23,917	23,950	-33	-0.14
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	51,324	50,855	469	0.92
複合地域	10,000 (2013.04.30)	18,624	17,615	1,009	5.73
エマージング株式		24,938	23,749	1,190	5.01
グローバル		23,774	22,825	949	4.16
BRICS	10,000 (2005.09.30)	27,992	26,592	1,400	5.26
その他		26,571	25,235	1,336	5.29
欧州		20,176	18,638	1,538	8.25
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,089	1,085	4	0.40
アジア・オセアニア		21,619	20,877	742	3.55
中国		38,005	35,251	2,754	7.81
インド	10,000 (2004.09.30)	73,613	69,301	4,311	6.22
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	17,605	18,624	-1,019	-5.47
タイ		23,066	22,850	215	0.94
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,890	8,922	-32	-0.36
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	27,288	28,471	-1,183	-4.16
韓国	10,000 (1997.06.30)	33,266	33,253	13	0.04
香港		22,997	20,675	2,323	11.23
中南米	7,427 (2006.04.28)	13,629	13,611	18	0.13
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	11,001	11,107	-106	-0.96
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	21,007	20,719	288	1.39
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	15,075	14,724	351	2.38
トルコ		55,126	46,865	8,260	17.63
複合地域	10,000 (2005.08.31)	29,458	28,881	577	2.00

※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		20,075	20,069	6	0.03
外国債券(先進国)		19,805	19,731	74	0.37
グローバル		19,737	19,656	80	0.41
除く日本		22,183	21,971	212	0.96
含む日本		18,143	18,154	-10	-0.06
その他		20,347	20,303	44	0.22
北米	9,052 (2013.05.31)	11,194	11,318	-123	-1.09
米国		18,475	18,786	-312	-1.66
カナダ	10,000 (2003.05.30)	18,711	18,405	306	1.66
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,167	15,123	44	0.29
イギリス	10,069 (2014.07.31)	12,546	12,416	129	1.04
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	23,355	22,859	495	2.17
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	29,034	28,340	694	2.45
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	12,440	12,265	174	1.42
複合地域	10,000 (2001.11.30)	20,214	19,931	283	1.42
エマージング債券		22,489	22,133	355	1.61
グローバル		22,608	22,297	312	1.40
米ドル建て		23,117	22,838	280	1.22
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	16,170	15,879	291	1.83
その他	8,647 (2005.03.31)	18,047	17,713	333	1.88
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,824	503	1,321	262.73
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	17,349	17,128	221	1.29
中国	13,833 (2018.07.31)	20,072	19,478	594	3.05
インド	10,000 (2011.08.31)	23,493	22,828	665	2.91
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	20,062	20,217	-155	-0.77
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	17,860	17,775	84	0.47
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	22,343	22,677	-334	-1.47
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,467	2,362	105	4.45
複合地域	10,000 (2006.08.31)	13,455	13,305	150	1.13
ハイイールド債券		31,386	30,704	682	2.22
グローバル	10,000 (1997.06.30)	28,949	28,532	417	1.46
北米		31,923	31,195	729	2.34
その他	10,000 (2004.03.31)	27,748	27,116	631	2.33
欧州	10,000 (2006.04.28)	28,311	27,632	679	2.46
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	16,724	16,424	300	1.83
複合地域	10,000 (2004.03.31)	27,774	27,086	688	2.54
複合資産		21,699	21,719	-19	-0.09
安定	10,000 (1998.10.30)	17,131	17,197	-66	-0.39
安定成長		24,277	24,227	50	0.21
成長		31,841	31,802	39	0.12
国内バランス		12,635	12,729	-94	-0.74
安定		12,546	12,659	-113	-0.89
一般		18,994	19,134	-139	-0.73
その他	10,000 (2018.10.31)	13,328	13,926	-598	-4.29

※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

注：「エマージング債券・その他・ロシア」は外れ値が発生したため、データバーを表示していません。

<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		20,075	20,069	6	0.03
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	34,923	34,585	338	0.98
日本	10,000 (2003.10.31)	34,923	34,585	338	0.98
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	37,739	38,452	-713	-1.85
グローバル	10,000 (2004.01.30)	31,408	31,917	-509	-1.60
除く日本	10,000 (2004.04.30)	35,433	36,085	-652	-1.81
含む日本	10,000 (2004.01.30)	30,975	31,425	-450	-1.43
北米	10,000 (2003.09.30)	39,941	40,819	-878	-2.15
その他	10,000 (2004.04.30)	32,581	32,889	-308	-0.94
欧州	10,000 (2006.12.29)	6,186	5,953	233	3.92
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	23,305	23,395	-90	-0.38
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	19,963	20,782	-819	-3.94
複合地域	10,000 (2007.06.29)	8,917	8,881	36	0.40
複数国	10,000 (2004.04.30)	48,715	49,129	-414	-0.84
その他		7,541	7,596	-55	-0.73
絶対収益型		7,718	7,793	-75	-0.97
ロング・ショート		8,368	8,444	-76	-0.90
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,568	11,609	-41	-0.35
GTAA		11,900	11,887	13	0.11
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,252	7,328	-76	-1.04
CB		21,244	21,149	96	0.45
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	24,159	23,295	864	3.71
日本		22,035	22,476	-441	-1.96
グローバル		37,020	36,858	162	0.44
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	14,961	14,028	933	6.65
全業種	10,000 (2004.12.30)	13,434	12,438	996	8.01
貴金属	10,000 (2009.07.31)	25,342	23,865	1,477	6.19
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	12,250	11,646	604	5.18
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	19,056	17,902	1,153	6.44

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

[色塗りの基準]月次リターン> 総合

＜1＞パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別①

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	6.99	20.50	27.31	11.20
国内株式	7.55	22.21	32.61	15.11
一般	7.87	21.50	32.08	15.01
フリー	7.30	21.28	30.47	14.26
バリュー	9.17	21.77	36.36	16.76
小型	1.82	13.39	11.67	4.70
その他	7.82	24.43	36.66	16.73
日経225	6.50	25.32	34.97	15.46
TOPIX	8.53	23.00	36.07	16.98
JPX日経400	9.01	24.61	37.04	17.54
国内債券	-0.90	0.67	-2.71	-1.54
一般	-0.90	0.67	-2.71	-1.54
外国株式(先進国)	9.43	29.18	40.54	15.42
グローバル	9.44	28.90	38.13	14.42
除く日本	10.34	28.07	39.12	16.67
含む日本	9.05	29.26	37.70	13.48
その他	9.44	29.70	45.57	17.40
北米	10.55	29.05	47.04	19.06
米国	9.46	29.93	46.49	17.61
カナダ	6.65	17.66	17.73	10.32
欧州	6.99	22.74	19.84	10.78
ドイツ	11.57	29.30	28.26	15.30
イギリス	4.69	11.44	10.07	6.78
アジア・オセアニア	11.40	19.31	18.79	13.43
オーストラリア	8.25	21.60	21.13	8.42
ニュージーランド	3.24	16.93	12.25	3.94
複合地域	22.05	18.04	39.51	26.32
エマージング株式	12.58	22.17	37.59	15.76
グローバル	13.66	21.66	31.16	15.04
BRICS	11.71	15.24	25.50	11.21
その他	12.21	22.50	40.81	16.13
欧州	17.55	28.95	54.94	18.64
ロシア	0.70	0.43	0.23	1.25
アジア・オセアニア	11.76	15.43	21.72	12.00
中国	18.48	2.99	-2.65	9.74
インド	12.54	25.60	53.30	17.80
インドネシア	-1.38	3.70	0.93	-0.28
タイ	2.23	-0.13	-1.08	-0.99
フィリピン	6.83	17.41	15.46	10.89
ベトナム	7.66	22.74	35.31	16.37
韓国	7.87	16.00	22.22	3.07
香港	20.32	6.73	7.20	14.85
中南米	4.43	18.70	35.32	2.36
ブラジル	1.50	13.55	31.64	-1.91
メキシコ	9.35	33.70	36.75	14.46
中東・アフリカ	6.97	20.50	18.28	11.21
トルコ	23.27	32.24	58.33	41.21
複合地域	6.48	15.01	19.62	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

(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	6.99	20.50	27.31	11.20
外国債券(先進国)	2.04	7.84	9.09	2.98
グローバル	1.98	7.26	8.65	3.03
除く日本	3.06	8.90	11.82	4.28
含む日本	1.08	5.91	6.09	2.01
その他	2.31	10.51	11.05	2.74
北米	0.32	9.16	8.08	2.00
米国	-0.03	10.52	7.15	0.69
カナダ	3.62	9.30	16.78	5.43
欧州	2.35	7.85	10.22	2.58
イギリス	4.29	15.63	21.13	6.03
アジア・オセアニア	4.77	11.45	14.44	4.41
オーストラリア	5.24	11.79	15.31	5.00
ニュージーランド	2.48	12.39	12.29	1.53
複合地域	3.34	9.21	12.07	5.19
エマージング債券	5.21	11.31	21.27	7.96
グローバル	5.52	13.47	22.08	7.57
米ドル建て	6.19	14.98	23.44	8.20
現地通貨建て	3.85	9.68	18.71	6.02
その他	4.80	8.60	20.28	8.45
ロシア	260.42	293.29	252.13	267.34
アジア・オセアニア	4.06	9.38	13.24	6.98
中国	4.78	7.21	11.25	7.82
インド	6.32	8.22	19.82	11.28
インドネシア	1.65	5.61	7.33	4.20
ブラジル	2.15	7.84	24.78	4.32
メキシコ	5.38	16.37	27.85	7.82
トルコ	1.10	0.76	-26.71	0.22
複合地域	5.29	10.96	20.97	7.34
ハイイールド債券	5.76	13.05	22.92	9.43
グローバル	4.57	12.80	20.38	7.60
北米	6.05	13.13	23.66	9.92
その他	4.96	12.62	20.66	7.82
欧州	4.57	12.37	21.34	6.92
アジア・オセアニア	6.40	13.49	18.05	11.15
複合地域	5.48	13.20	22.97	9.23
複合資産	4.41	12.56	14.86	6.81
安定	2.57	8.40	8.78	4.11
安定成長	4.91	13.21	16.22	7.43
成長	6.27	16.94	23.08	10.17
国内バランス	0.68	3.22	1.64	1.19
安定	-0.07	2.11	-0.42	-0.01
一般	4.65	11.38	16.39	8.42
その他	2.42	23.22	12.26	1.07

※[色塗りの基準]期間別リターン> 総合

注：「エマージング債券・その他・ロシア」は外れ値が発生したため、データバーを表示していません。

<1>パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別③

	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	6.99	20.50	27.31	11.20
国内REIT	1.72	1.89	0.87	1.92
日本	1.72	1.89	0.87	1.92
外国REIT	3.17	19.58	17.57	2.18
グローバル	3.37	20.37	18.16	2.42
除く日本	3.37	21.77	19.51	2.57
含む日本	3.37	19.37	17.26	2.30
北米	3.03	19.29	18.04	2.05
その他	3.00	16.87	10.24	1.63
欧州	7.00	25.18	25.61	6.45
アジア・オセアニア	1.26	12.91	5.85	-0.41
オーストラリア	8.80	32.91	22.81	7.50
複合地域	5.94	23.63	23.32	8.00
複数国	2.49	13.37	12.93	2.09
その他	6.10	15.05	18.15	8.47
絶対収益型	2.57	4.98	4.07	2.67
ロング・ショート	1.25	2.30	1.77	2.40
マーケットニュートラル	2.17	2.34	3.54	2.07
GTAA	3.32	6.46	3.74	4.84
その他スタイル	2.66	5.27	4.28	2.63
CB	2.76	6.14	8.23	3.49
アジア・オセアニア	11.16	10.55	17.76	12.82
日本	3.32	10.12	12.15	6.22
グローバル	2.66	6.05	8.08	3.36
コモディティ	16.66	15.02	24.73	18.53
全業種	13.45	7.51	25.46	17.64
貴金属	18.04	18.52	23.95	18.77
エネルギー	13.73	9.77	40.59	26.01
その他コモディティ	14.78	12.98	27.62	19.31

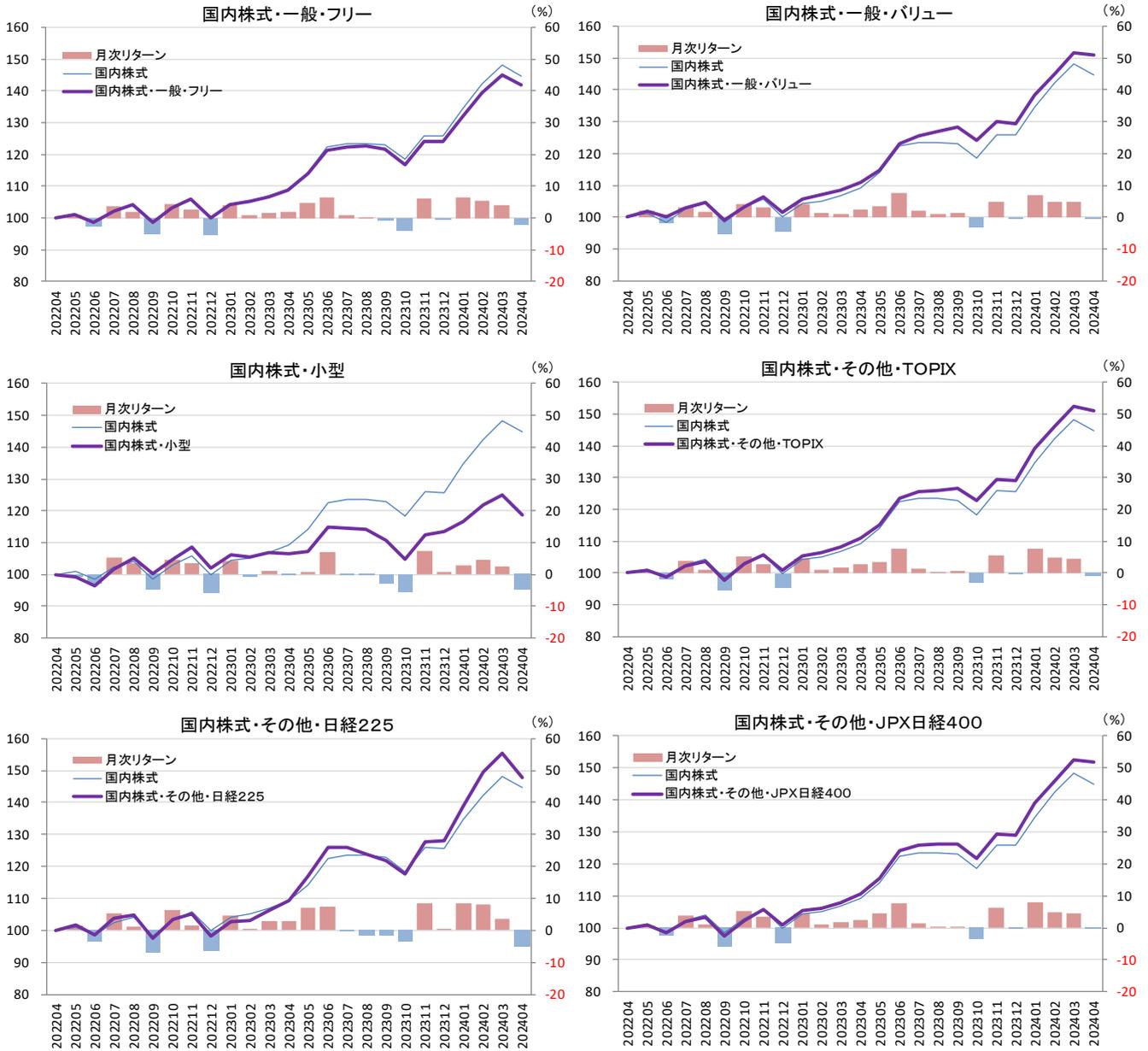
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

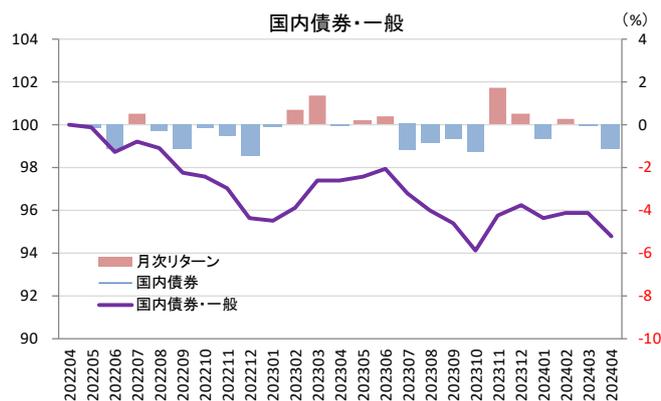
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

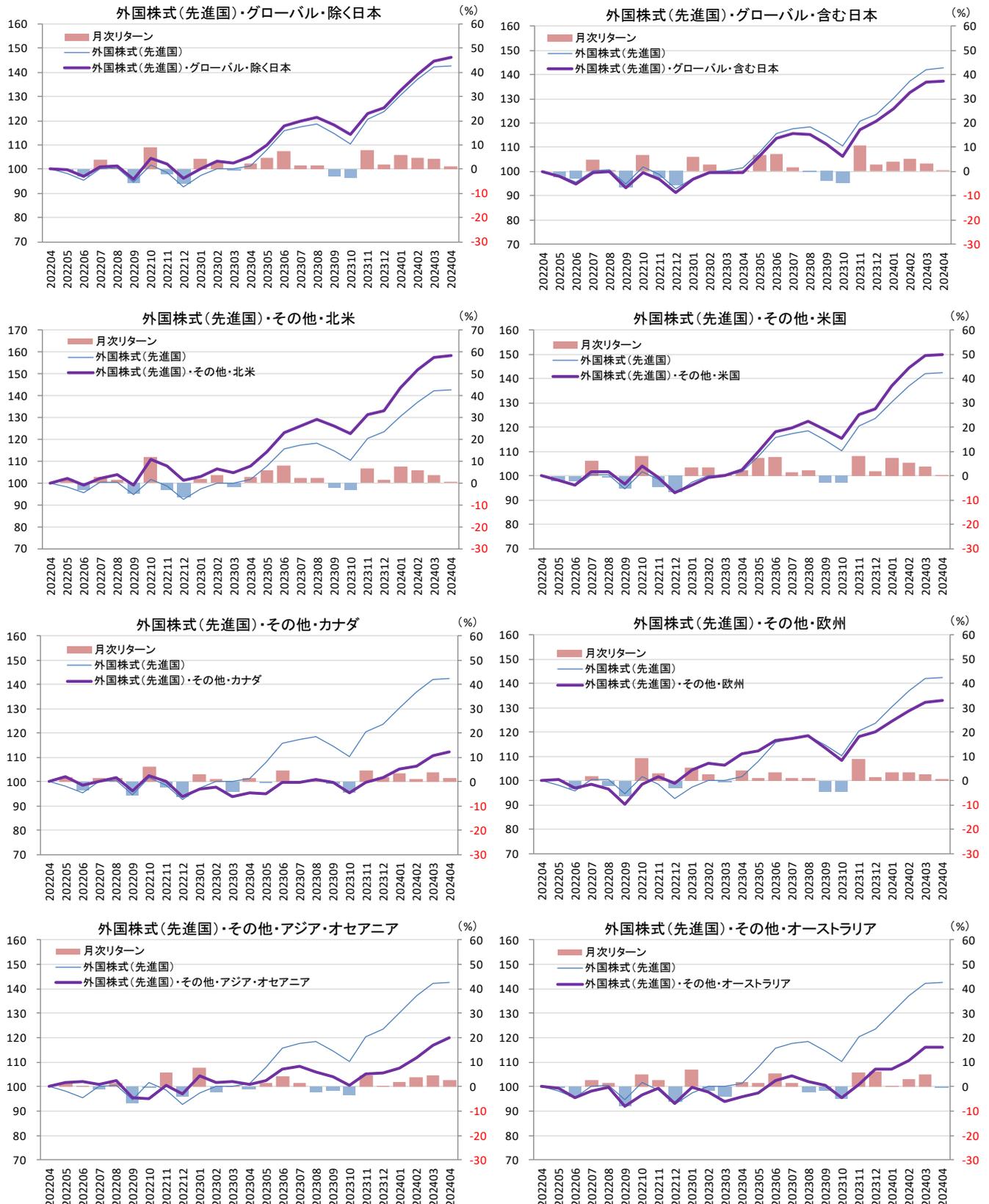


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

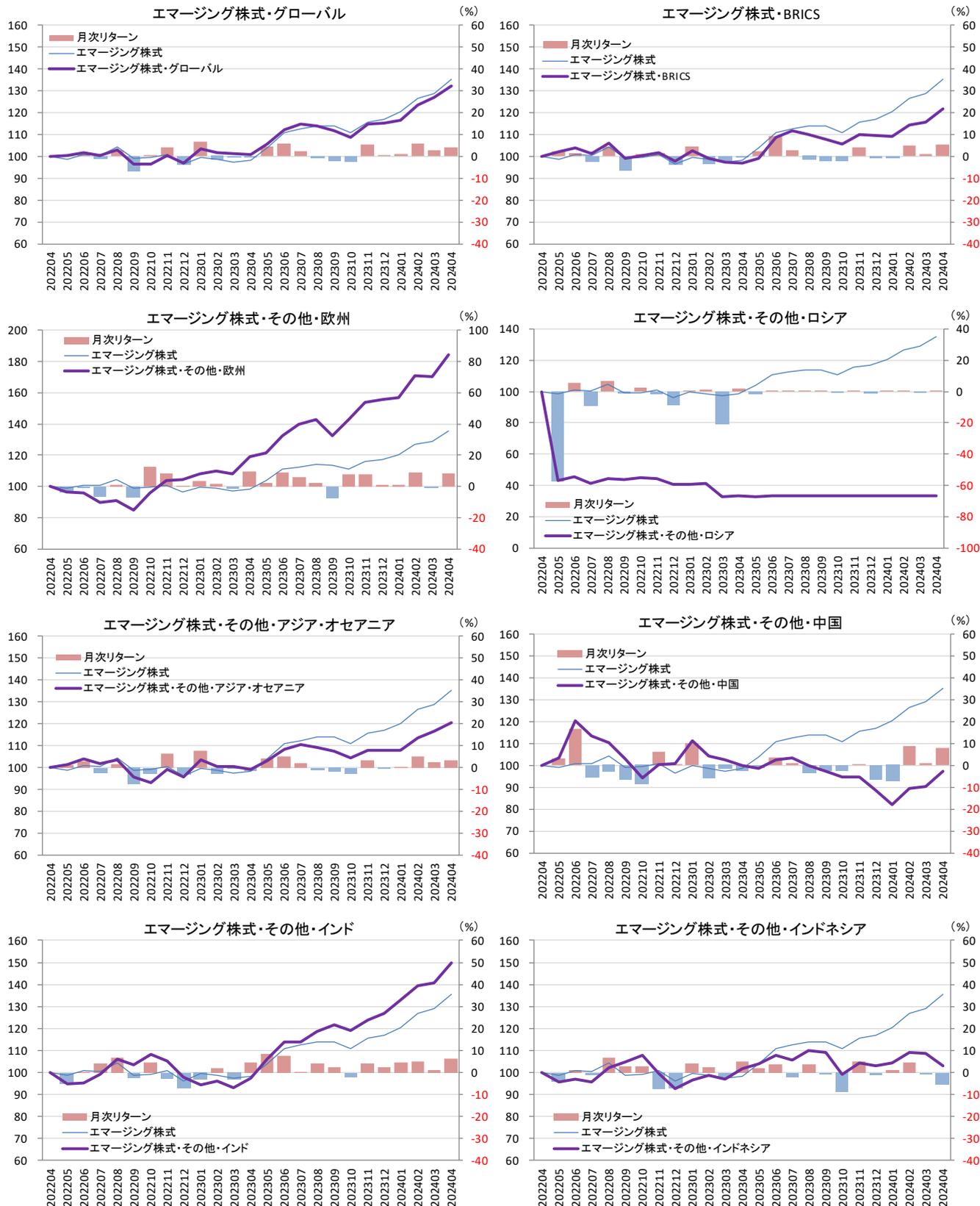


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマージング株式]

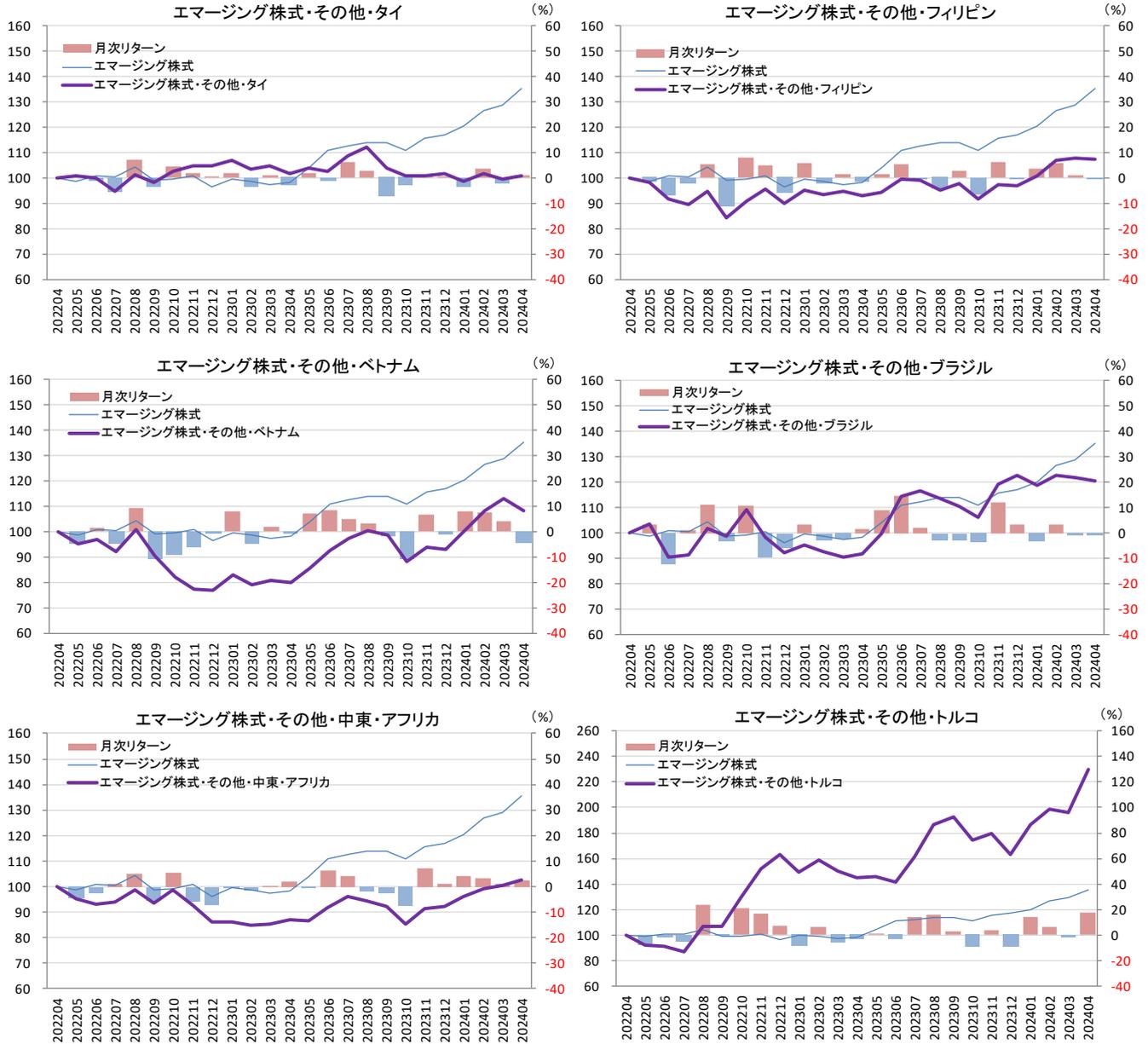


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

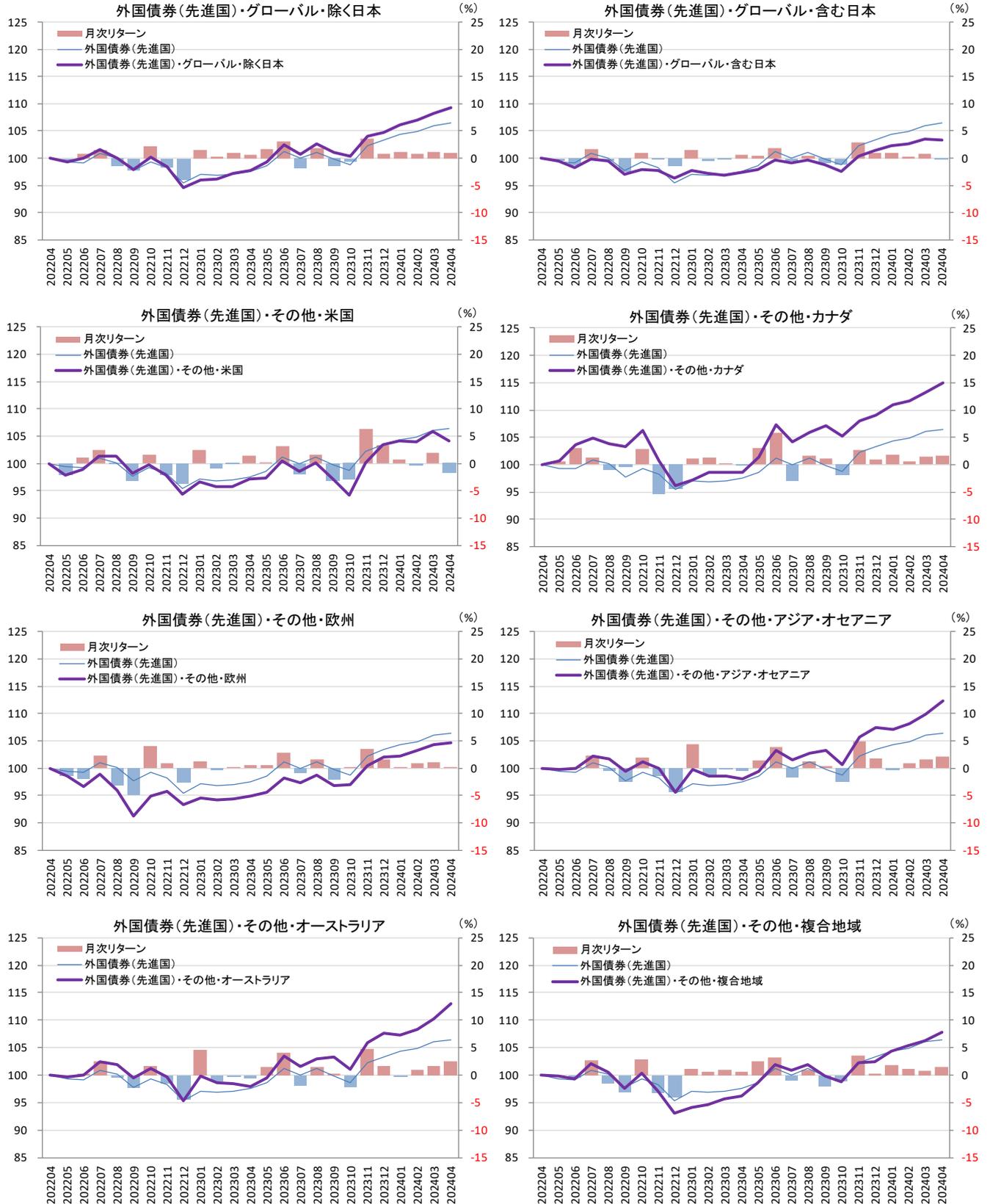


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

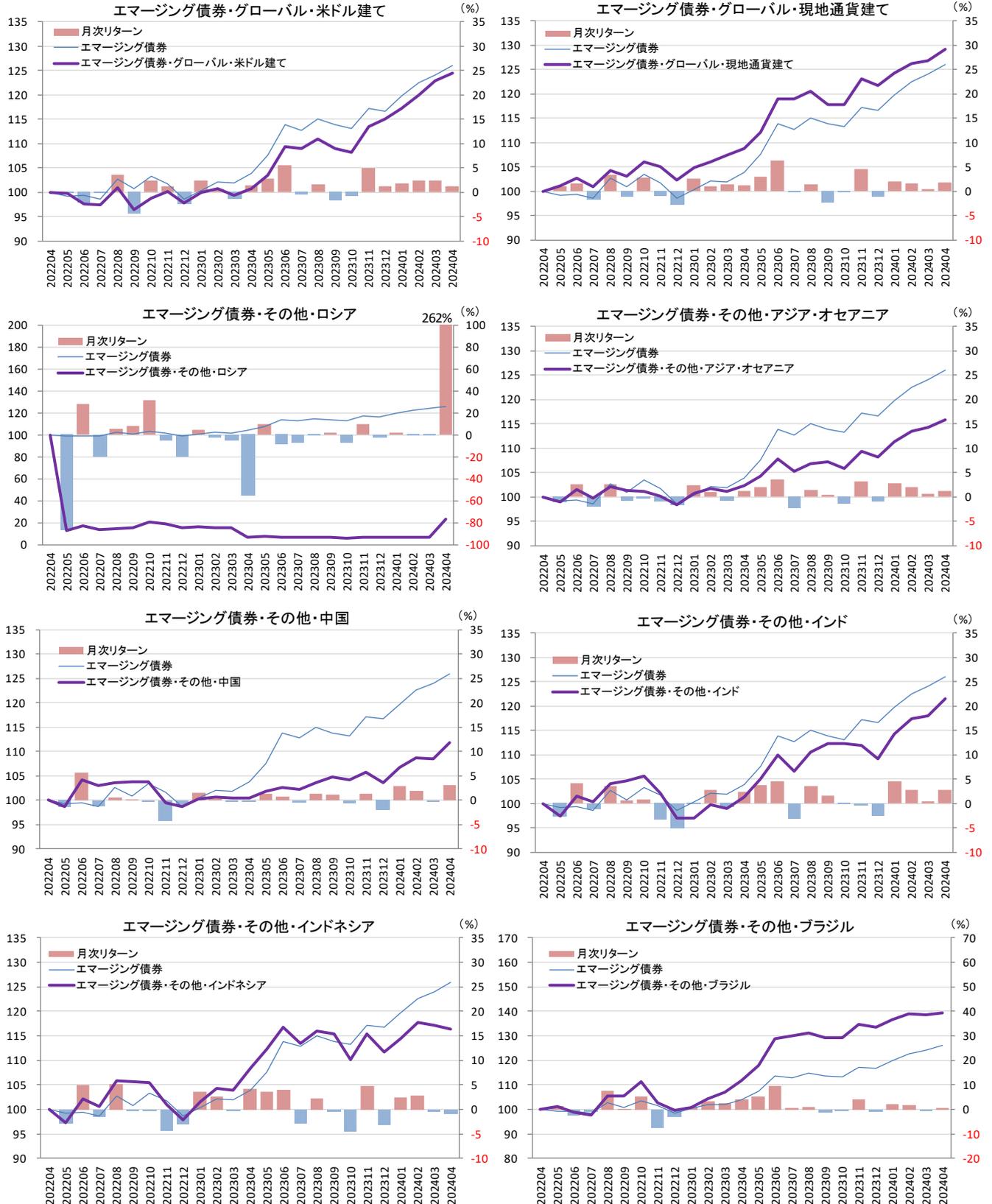


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

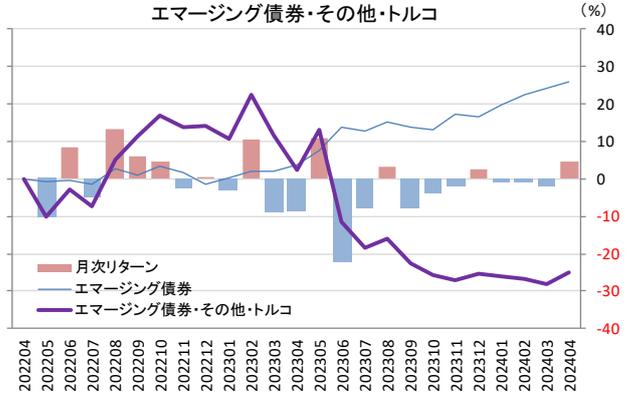
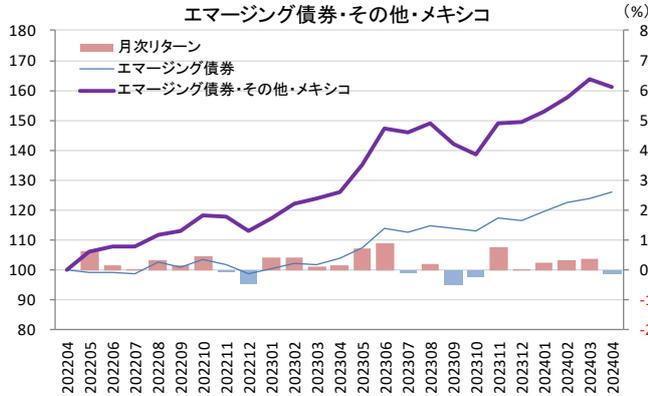


<1>パフォーマンス・サマリー

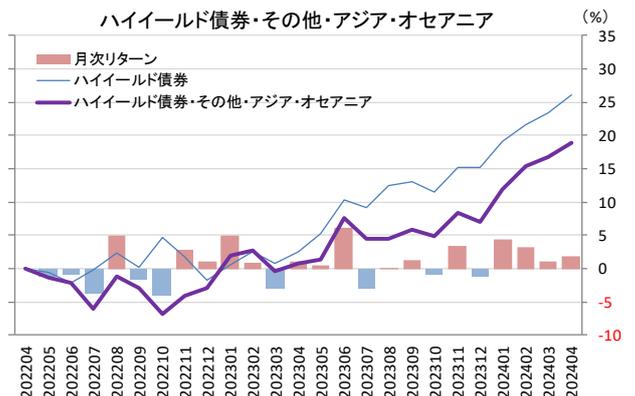
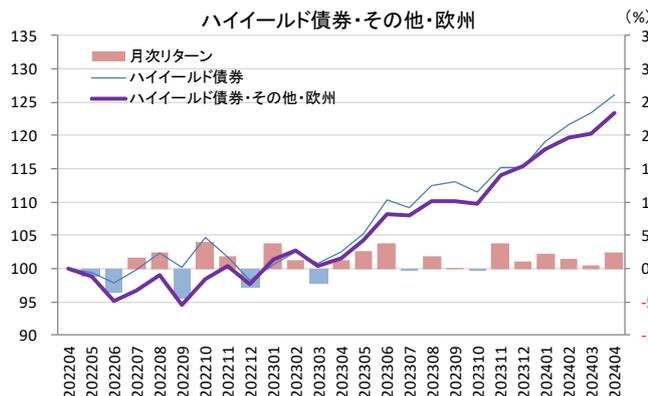
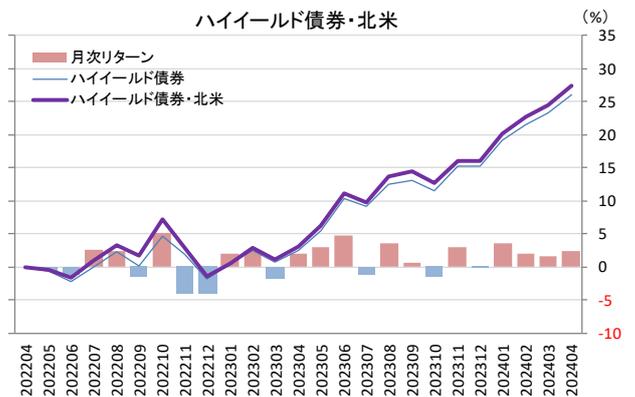
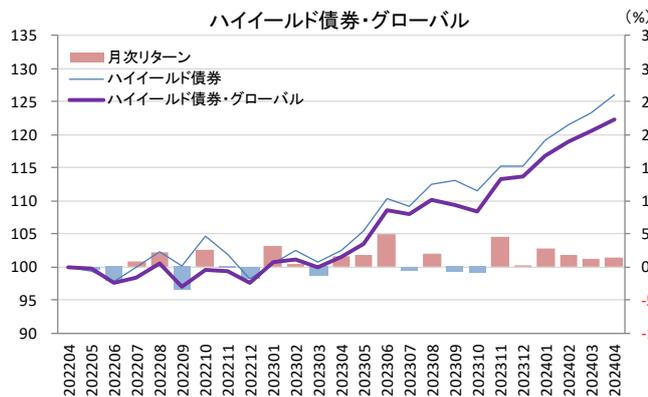
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

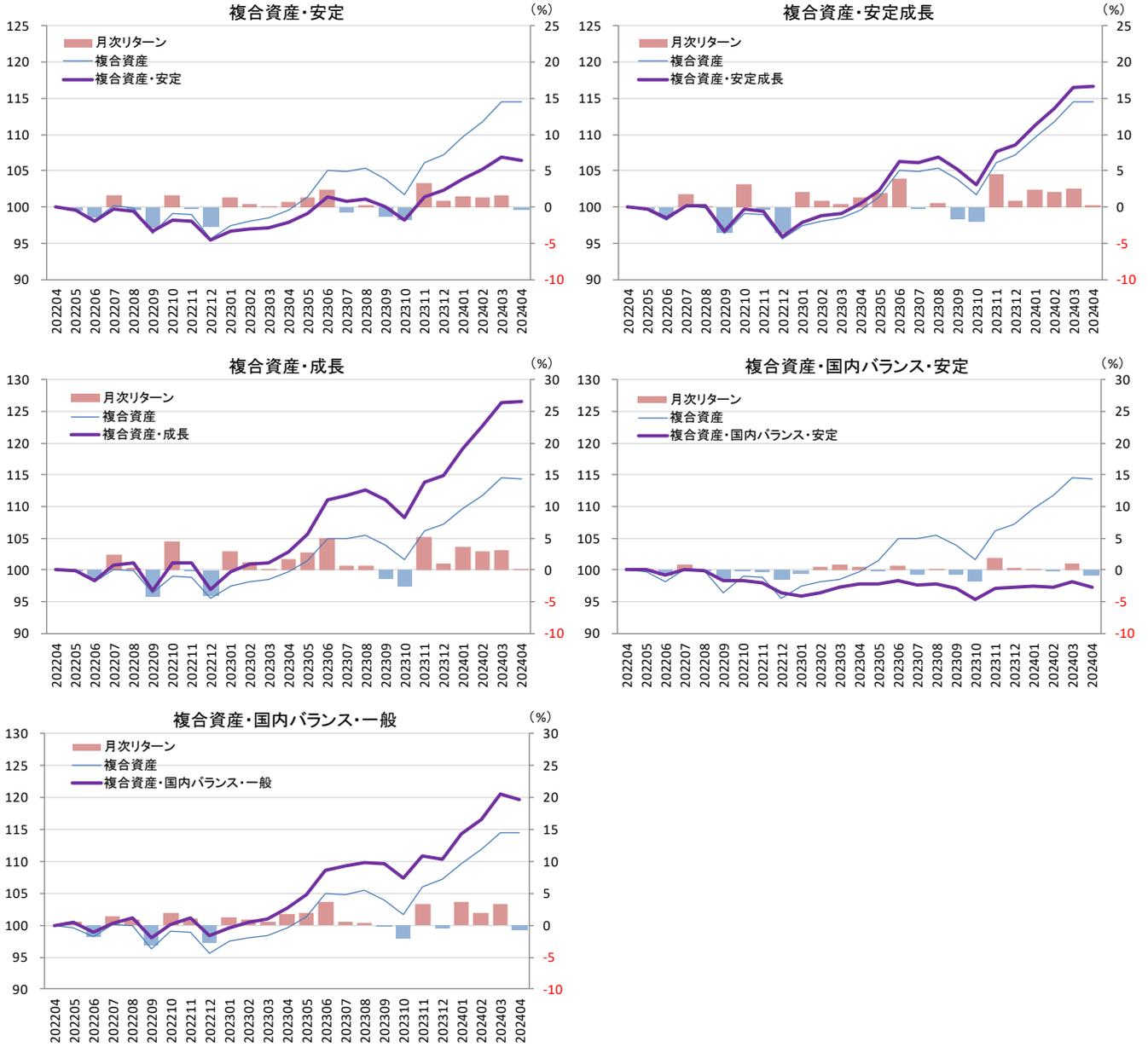


<1>パフォーマンス・サマリー

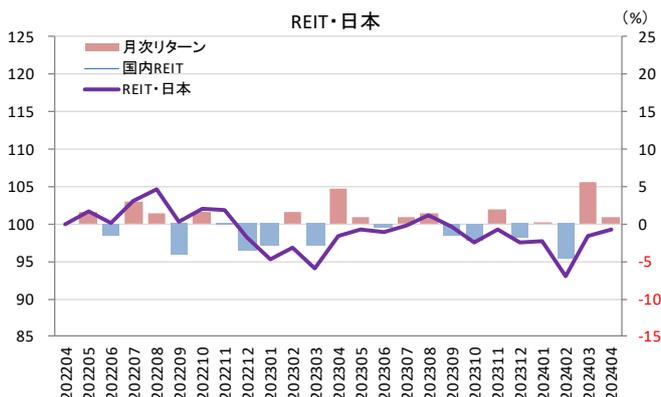
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

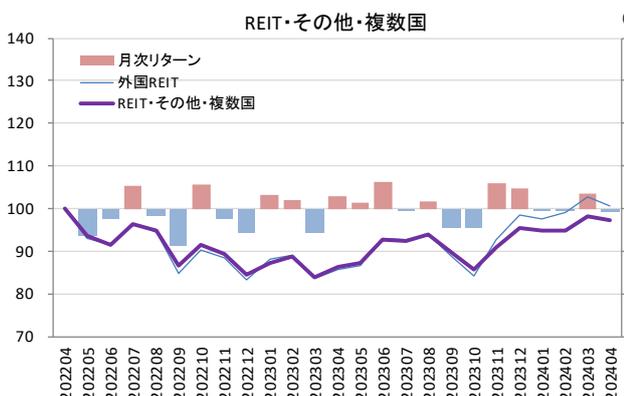
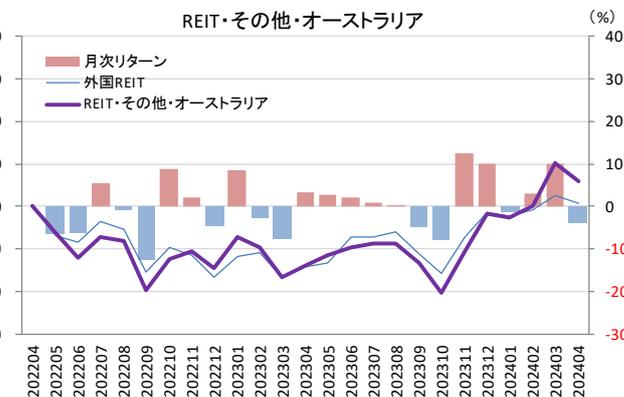
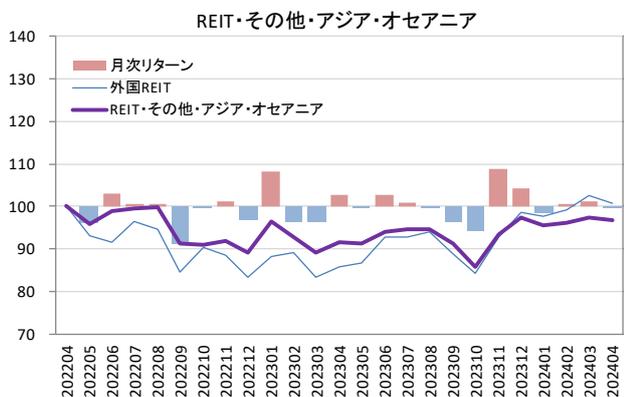
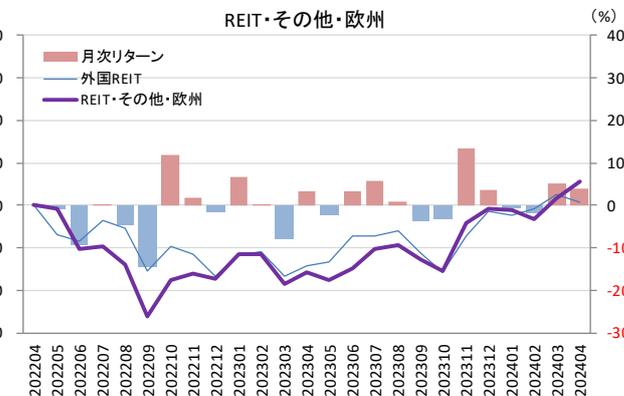
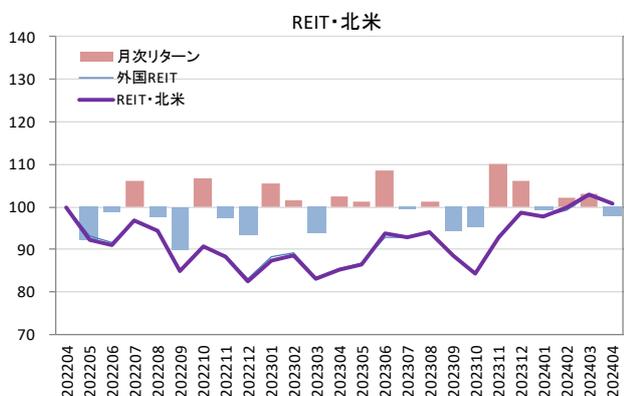
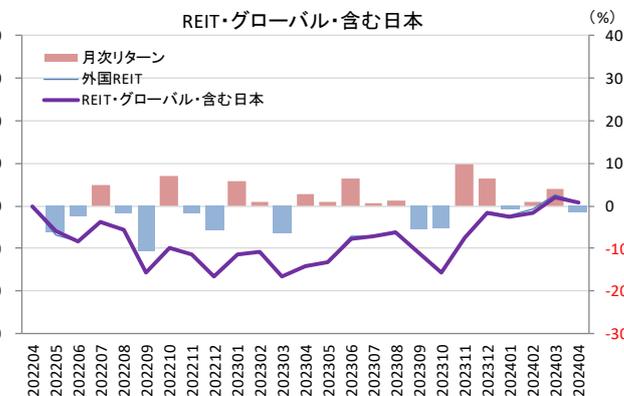
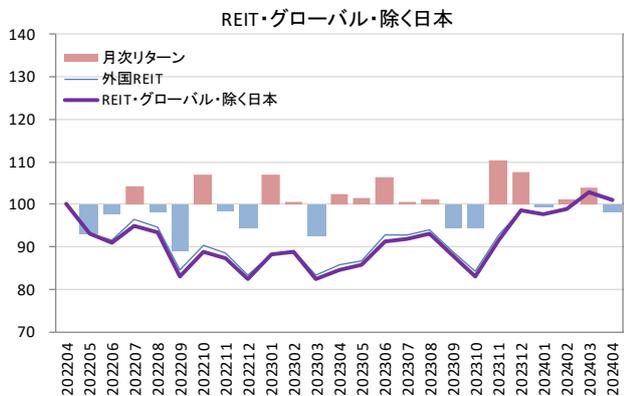


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

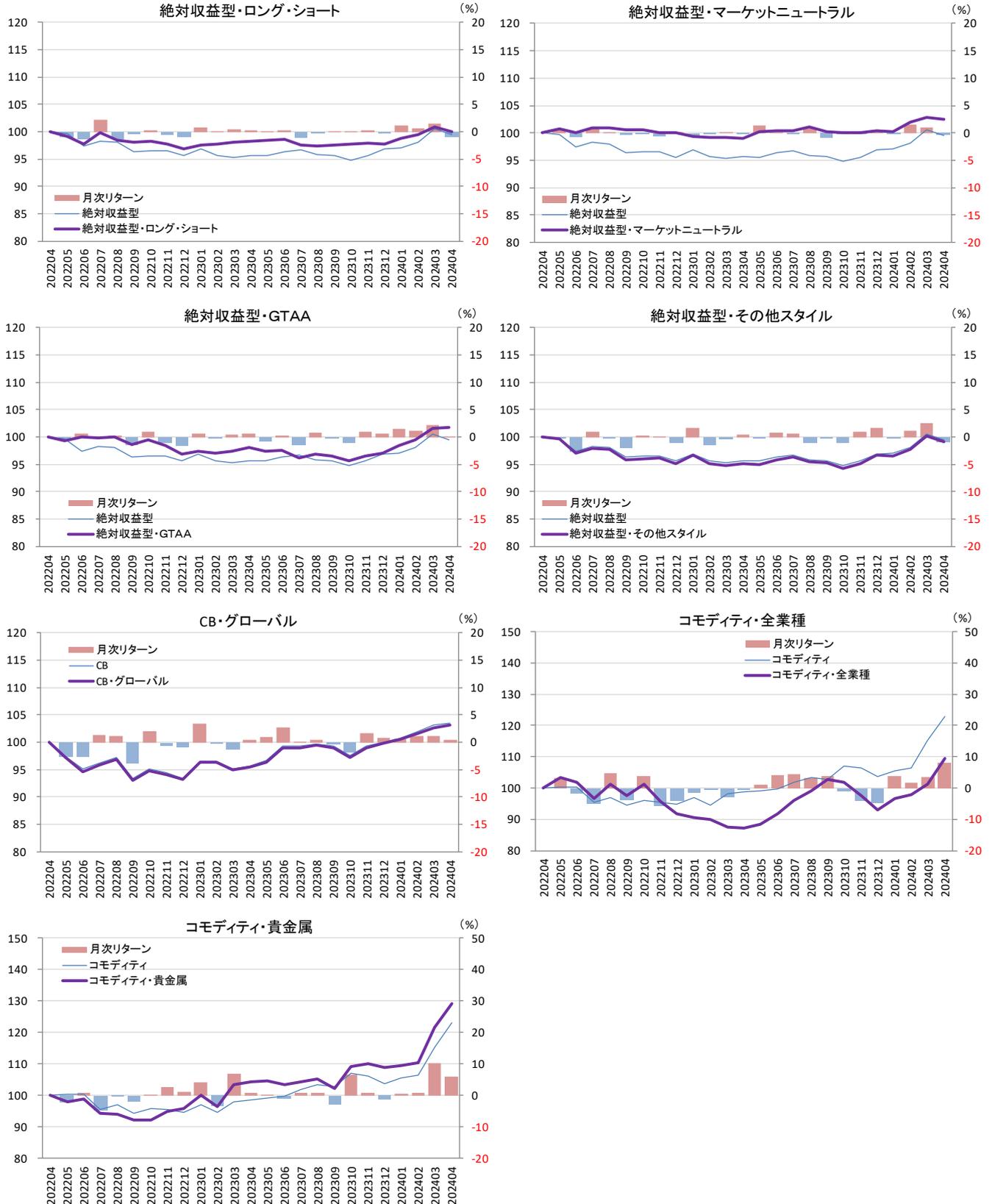


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	0.03		
1	エマージング株式・その他	5.29	3.09	0.16
2	外国株式(先進国)・グローバル	0.47	30.12	0.14
3	外国株式(先進国)・その他	0.26	16.37	0.05
4	エマージング株式・グローバル	4.16	1.03	0.04
5	コモディティ	6.65	0.65	0.04
6	ハイイールド債券・北米	2.34	1.40	0.03
7	外国債券(先進国)・グローバル	0.41	6.63	0.03
8	REIT・日本	0.98	2.06	0.02
9	複合資産・安定成長	0.21	5.95	0.01
10	エマージング債券・その他	1.88	0.44	0.01
11	エマージング債券・グローバル	1.40	0.59	0.01
12	複合資産・成長	0.12	3.12	0.00
13	外国債券(先進国)・その他	0.22	1.48	0.00
14	ハイイールド債券・その他	2.33	0.15	0.00
15	ハイイールド債券・グローバル	1.46	0.23	0.00
16	エマージング株式・BRICS	5.26	0.04	0.00
17	CB	0.45	0.25	0.00
18	REIT・その他	-0.94	0.22	-0.00
19	国内株式・業種特化	-2.87	0.11	-0.00
20	複合資産・国内バランス	-0.74	0.50	-0.00
21	絶対収益型	-0.97	1.03	-0.01
22	複合資産・その他	-4.29	0.26	-0.01
23	複合資産・安定	-0.39	3.23	-0.01
24	REIT・グローバル	-1.60	1.53	-0.03
25	国内株式・小型	-5.00	0.65	-0.03
26	国内債券・一般	-1.14	3.60	-0.04
27	REIT・北米	-2.15	1.98	-0.04
28	国内株式・一般	-1.69	7.48	-0.13
29	国内株式・その他	-2.92	5.26	-0.15
	合計		100.00	0.03

◆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	27.31		
1	外国株式(先進国)・グローバル	38.13	29.24	10.84
2	外国株式(先進国)・その他	45.57	14.67	6.21
3	国内株式・一般	32.08	7.35	2.28
4	国内株式・その他	36.66	4.97	1.76
5	複合資産・安定成長	16.22	6.29	1.05
6	エマージング株式・その他	40.81	2.59	0.94
7	複合資産・成長	23.08	3.07	0.70
8	外国債券(先進国)・グローバル	8.65	7.15	0.66
9	REIT・北米	18.04	2.29	0.45
10	複合資産・安定	8.78	3.71	0.34
11	ハイイールド債券・北米	23.66	1.47	0.34
12	REIT・グローバル	18.16	1.71	0.33
13	エマージング株式・グローバル	31.16	1.05	0.30
14	外国債券(先進国)・その他	11.05	1.63	0.19
15	エマージング債券・グローバル	22.08	0.64	0.14
16	コモディティ	24.73	0.59	0.14
17	エマージング債券・その他	20.28	0.49	0.10
18	国内株式・小型	11.67	0.72	0.09
19	ハイイールド債券・グローバル	20.38	0.26	0.05
20	絶対収益型	4.07	1.13	0.04
21	複合資産・その他	12.26	0.30	0.04
22	ハイイールド債券・その他	20.66	0.18	0.04
23	国内株式・業種特化	38.16	0.09	0.03
24	REIT・その他	10.24	0.27	0.03
25	CB	8.23	0.27	0.02
26	REIT・日本	0.87	2.56	0.02
27	複合資産・国内バランス	1.64	0.64	0.01
28	エマージング株式・BRICS	25.50	0.04	0.01
29	国内債券・一般	-2.71	4.07	-0.10
	合計		100.00	27.31

◆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	27.65	55.47	91.23	11.20	11.85	10.75	0.76	0.78	0.63
国内株式	40.82	78.23	172.09	12.98	15.05	15.32	0.93	0.82	0.69
一般	40.72	76.45	160.98	12.41	14.60	15.31	0.97	0.83	0.66
フリー	36.18	72.89	155.47	12.99	14.91	15.66	0.84	0.78	0.63
バリュー	56.22	86.33	176.74	10.90 ↓	14.14	14.49	1.47	0.94	0.74
小型	5.00	37.28	161.97	15.30	18.02	16.71	0.11	0.36	0.61
その他	47.55	88.01	195.37	13.79	15.61	15.41	1.01	0.86	0.74
日経225	39.32	85.52	205.54	15.80	17.14	16.24	0.74	0.77	0.73
TOPIX	54.39	88.83	186.82	11.78	14.25	14.68	1.32	0.95	0.76
JPX日経400	54.83	90.67	176.49	12.26 ↓	14.62	14.65	1.28	0.94	0.73
国内債券	-7.03	-7.37	-0.90	2.45	2.35	2.01	-0.97	-0.63	-0.04
一般	-7.03	-7.37	-0.90	2.45	2.35	2.01	-0.97	-0.63	-0.04
外国株式(先進国)	37.76	100.12	160.03	16.61	17.48	16.14	0.68	0.85	0.62
グローバル	31.06	93.51	161.65	16.84	17.59	16.09	0.56	0.80	0.63
除く日本	61.14	121.78	218.63	14.45	17.00	16.44	1.19	1.02	0.75
含む日本	22.45	84.74	145.43	17.88	18.12	16.25	0.39	0.72	0.58
その他	55.66	115.04	156.66	16.34	17.58	16.55	0.97	0.94	0.60
北米	94.16	173.76	227.14	14.29	17.85 ↓	17.60	1.73	1.25	0.72
米国	56.25	126.51	196.54	16.59	17.21	16.90	0.97	1.03	0.68
カナダ	26.61	48.39	26.04	11.59 ↓	17.67	15.89	0.71	0.47	0.15
欧州	35.28	70.66	94.90	14.46 ↓	17.19	16.15	0.73	0.66	0.43
ドイツ	46.91	86.17	93.61	17.66 ↓	21.72	20.90	0.78	0.61	0.33
イギリス	36.27	29.59	-	10.30	16.33	-	1.06	0.33	-
アジア・オセアニア	13.55	35.79	85.19	10.95	14.52	14.53	0.40	0.44	0.44
オーストラリア	37.37	52.16	66.64	17.74 ↓	23.58	19.80	0.63	0.37	0.27
ニュージーランド	14.69	51.29	163.60	14.98	17.67	16.96	0.31	0.49	0.60
複合地域	145.58	96.59	56.47	24.72	32.79	26.85	1.41	0.44	0.17
エマージング株式	36.06	68.51	115.11	10.66	17.16	16.14	1.02	0.64	0.49
グローバル	22.36	65.26	96.66	11.92	16.82	16.35	0.59	0.63	0.43
BRICS	-0.83	20.24	78.28	13.42	19.79	18.85	-0.02	0.19	0.32
その他	43.69	72.17	125.29	10.65	17.64	16.38	1.21	0.65	0.52
欧州	-20.88	-17.05	-5.89	34.56	33.17	27.24	-0.22	-0.11	-0.02
ロシア	-90.87	-88.53	-83.01	55.18	47.69	38.18	-1.00	-0.74	-0.43
アジア・オセアニア	8.13	35.10	69.01	12.41	16.56	15.83	0.21	0.38	0.34
中国	-27.16	13.95	114.48	19.75 ↑	20.30	21.40	-0.51	0.13	0.37
インド	93.60	124.50	265.41	13.98	22.05	20.85	1.76	0.80	0.66
インドネシア	43.65	22.21	31.85	15.54	25.78	22.99	0.83	0.16	0.12
タイ	9.21	-3.42	27.33	12.90 ↓	20.47	17.55	0.23	-0.03	0.14
フィリピン	27.23	4.88	14.44	16.31	20.43	17.91	0.51	0.05	0.08
ベトナム	47.00	79.18	137.46	20.66	26.01	21.74	0.66	0.48	0.42
韓国	-9.11	49.95	34.51	24.34	25.80	21.13	-0.13	0.33	0.14
香港	-8.70	-7.12	34.54	21.81	21.53	20.07	-0.14	-0.07	0.15
中南米	63.10	63.74	61.37	23.11 ↓	29.41	26.26	0.77	0.35	0.19
ブラジル	34.60	16.82	8.23	26.23 ↓	32.04	31.58	0.40	0.10	0.03
メキシコ	118.79	117.25	83.41	20.69	27.11	23.87	1.44	0.62	0.26
中東・アフリカ	36.25	51.71	54.70	14.44	18.39	16.81	0.75	0.47	0.27
トルコ	176.83	184.83	56.59	32.85	34.07	31.82	1.23	0.68	0.14
複合地域	13.46	40.45	52.49	13.44 ↓	16.86	15.53	0.32	0.42	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	27.65	55.47	91.23	11.20	11.85	10.75	0.76	0.78	0.63
外国債券(先進国)	5.34	12.63	15.28	4.94	4.95	5.30	0.36	0.49	0.27
グローバル	4.11	10.75	15.54	4.43	4.29	4.72	0.31	0.49	0.31
除く日本	8.35	16.85	20.15	5.63	4.81	5.36	0.49	0.66	0.35
含む日本	0.64	5.41	11.98	3.79	4.50	4.46	0.06	0.24	0.26
その他	10.72	20.49	19.34	7.75	7.89	7.60	0.45	0.49	0.24
北米	2.13	9.45	20.49	5.72 ↑	5.82 ↑	5.02 ↑	0.13	0.32	0.38
米国	12.63	18.73	33.89	7.80	8.13 ↑	7.06	0.52	0.43	0.42
カナダ	22.53	34.66	25.39	8.38	7.80	8.53	0.84	0.79	0.27
欧州	-2.71	-0.58	-1.02	6.55	5.70	6.50	-0.14	-0.02	-0.01
イギリス	20.10	29.86	-	10.79	9.90	-	0.59	0.54	-
アジア・オセアニア	12.17	25.02	21.38	9.37	9.73	9.15	0.42	0.47	0.22
オーストラリア	13.64	26.20	21.53	9.36	9.77	9.21	0.47	0.49	0.22
ニュージーランド	3.50	13.46	20.75	10.11	9.59	9.85	0.12	0.27	0.20
複合地域	6.80	22.93	24.24	7.55	6.31	6.84	0.30	0.67	0.32
エマージング債券	33.71	33.65	39.92	7.35	10.50	10.51	1.39	0.57	0.33
グローバル	23.20	25.53	29.46	7.74	11.79	11.12	0.93	0.40	0.24
米ドル建て	21.84	24.08	29.75	8.32	12.40	11.54	0.82	0.36	0.23
現地通貨建て	27.63	30.62	23.82	7.10	10.26	10.16	1.20	0.54	0.21
その他	47.35	44.73	52.36	8.83	10.40	11.03	1.57	0.74	0.39
ロシア	-82.16	-82.59	-83.22	170.51 ↑	132.17 ↑	94.74 ↑	-0.26	-0.22	-0.17
アジア・オセアニア	16.54	23.63	44.50	5.79	6.96	6.84	0.91	0.63	0.55
中国	33.76	41.70	-	6.36	6.49	-	1.61	1.12	-
インド	39.53	49.91	94.50	8.65	9.11	9.55	1.36	0.93	0.72
インドネシア	40.00	54.74	75.55	9.63	13.79	13.79	1.24	0.66	0.42
ブラジル	76.34	40.63	49.00	15.05 ↓	17.60	18.22	1.39	0.40	0.22
メキシコ	77.45	95.43	71.55	12.48	16.26	15.49	1.69	0.88	0.36
トルコ	-43.10	-45.00	-77.53	28.27	27.56	27.86	-0.61	-0.41	-0.50
複合地域	27.07	24.83	18.36	10.28	11.77	11.54	0.81	0.39	0.15
ハイイールド債券	36.86	44.67	64.42	7.83	11.25	10.41	1.41	0.68	0.49
グローバル	26.03	31.76	47.78	7.08	11.10	10.32	1.14	0.51	0.39
北米	42.85	51.49	78.30	8.30	11.25	10.46	1.52	0.77	0.57
その他	20.92	27.38	33.73	8.26	12.37	11.24	0.79	0.40	0.26
欧州	23.15	29.97	33.54	8.98	13.07	11.97	0.80	0.41	0.25
アジア・オセアニア	12.42	16.39	36.53	9.45	11.93	10.24	0.42	0.26	0.31
複合地域	28.88	45.00	59.39	7.62	8.95	8.78	1.16	0.87	0.55
複合資産	15.29	28.02	53.04	6.62	7.22	7.17	0.74	0.71	0.61
安定	5.21	12.38	27.16	4.80	5.01	5.28	0.36	0.48	0.46
安定成長	18.89	33.97	61.25	6.92	7.67	7.56	0.86	0.79	0.65
成長	31.69	58.48	109.26	8.78	10.35	10.44	1.10	0.93	0.74
国内バランス	-2.19	-2.27	17.45	3.09	3.93	4.41 ↓	-0.23	-0.11	0.37
安定	-4.67	-5.43	9.13	2.94	3.79	3.13	-0.53	-0.29	0.29
一般	18.04	36.51	70.76	6.51	7.76	8.43	0.88	0.83	0.65
その他	-8.06	16.73	-	20.31 ↑	18.36	-	-0.13	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

(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	27.65	55.47	91.23	11.20	11.85	10.75	0.76	0.78	0.63
国内REIT	-2.04	14.17	64.96	10.28	15.04	12.32	-0.06	0.18	0.42
日本	-2.04	14.17	64.96	10.28	15.04	12.32	-0.06	0.18	0.42
外国REIT	30.23	44.39	104.62	17.84	19.05	16.64	0.52	0.40	0.45
グローバル	26.75	36.69	81.02	17.64	19.76	16.85	0.47	0.33	0.36
除く日本	29.06	44.15	105.29	18.26	20.48	17.30	0.49	0.37	0.43
含む日本	25.53	33.98	76.07	17.32	19.47	16.68	0.46	0.31	0.35
北米	35.66	54.71	129.08	18.61	18.81	16.97	0.58	0.49	0.51
その他	14.10	21.40	84.18	15.28	19.46	16.09	0.30	0.20	0.39
欧州	7.05	9.22	26.53	19.03	21.35	18.52	0.12	0.08	0.13
アジア・オセアニア	10.13	16.83	87.47	14.20	17.86	15.23	0.23	0.18	0.43
オーストラリア	27.02	32.31	78.89	23.91	30.22	23.45	0.35	0.19	0.26
複合地域	34.90	23.06	37.06	15.25 ↓	24.44	20.22	0.69	0.17	0.16
複数国	22.46	43.02	134.52	15.32	17.16	15.03	0.46	0.43	0.59
その他									
絶対収益型	-2.45	-0.07	1.02	4.02	3.51	2.91	-0.20	0.00	0.04
ロング・ショート	-2.80	-5.92	-6.63	3.26	3.22	3.09	-0.28	-0.37	-0.21
マーケットニュートラル	-5.39	-3.93	19.79	4.02	4.05	5.24	-0.45	-0.19	0.35
GTAA	1.72	12.24	16.81	4.05	4.50	3.49	0.15	0.53	0.45
その他スタイル	-2.32	0.55	0.84	4.43	3.81 ↑	3.18	-0.17	0.04	0.03
CB	-3.17	14.31	21.17	6.46 ↓	8.60	7.58	-0.16	0.32	0.26
アジア・オセアニア	21.30	54.66	111.34	8.74	12.10	11.37	0.76	0.76	0.68
日本	9.38	10.55	30.89	4.90	5.28 ↑	5.37	0.62	0.39	0.51
グローバル	-4.05	13.65	19.55	6.68 ↓	8.83	7.68	-0.20	0.30	0.24
コモディティ	66.07	95.52	27.24	11.30 ↑	11.77	12.30	1.63	1.22	0.20
全業種	88.69	96.90	25.61	16.19	19.29	17.10	1.46	0.75	0.14
貴金属	46.80	92.45	67.88	12.93 ↑	13.27 ↑	11.63	1.06	1.06	0.46
エネルギー	151.35	130.38	37.75	25.46	35.28	31.85	1.41	0.52	0.10
その他コモディティ	78.93	81.99	30.80	15.44	18.97	16.98	1.39	0.67	0.16

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

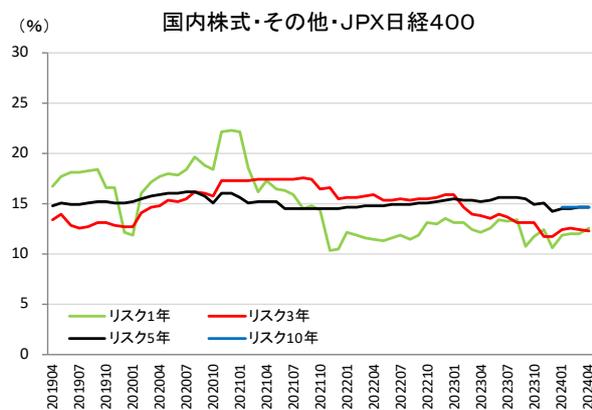
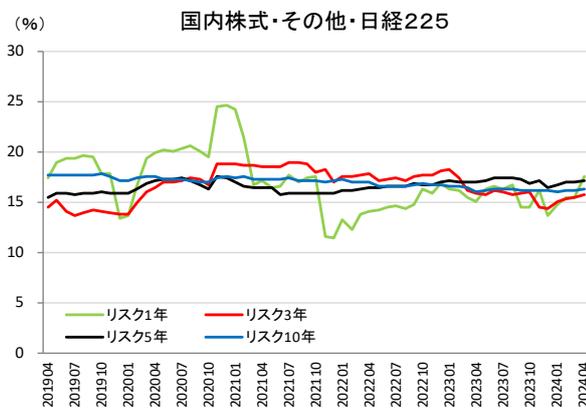
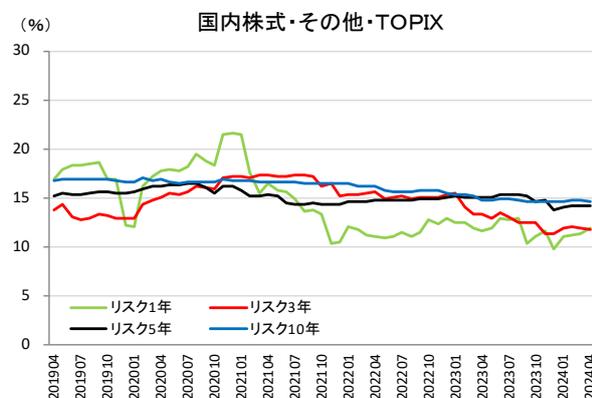
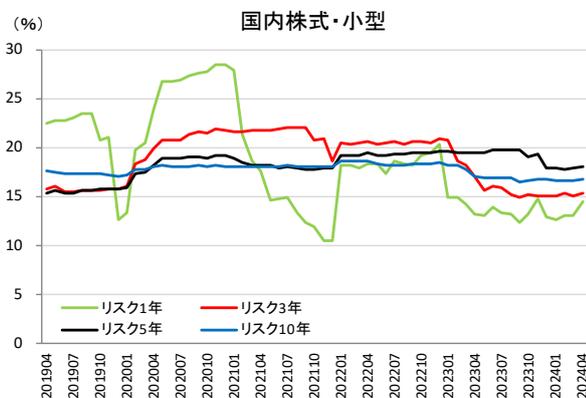
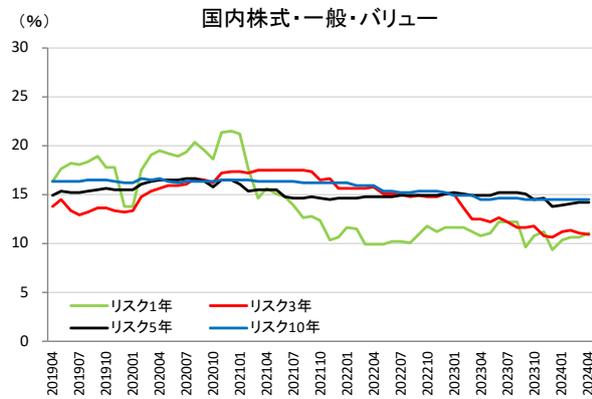
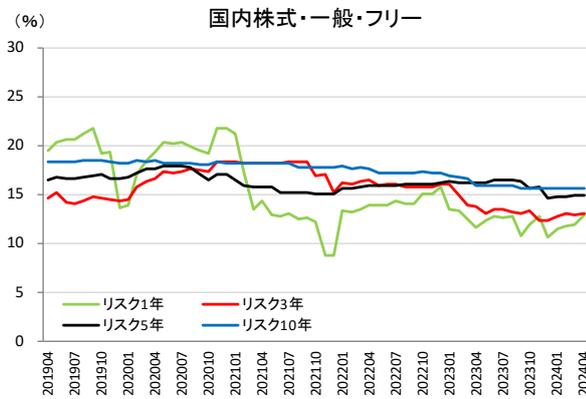
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

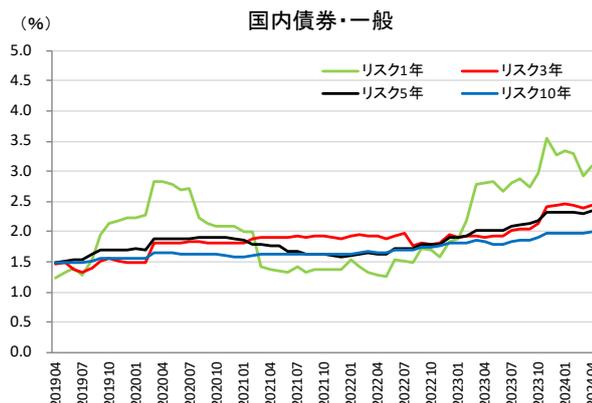
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

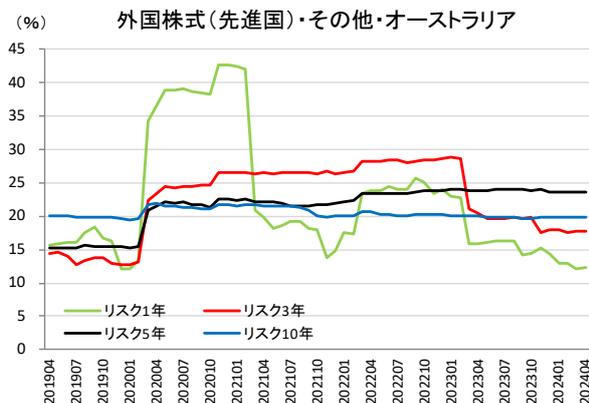
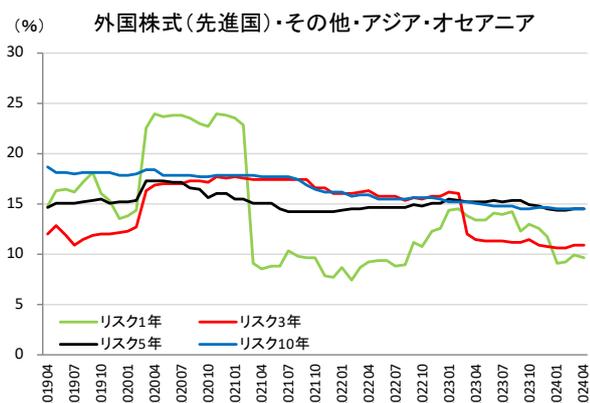
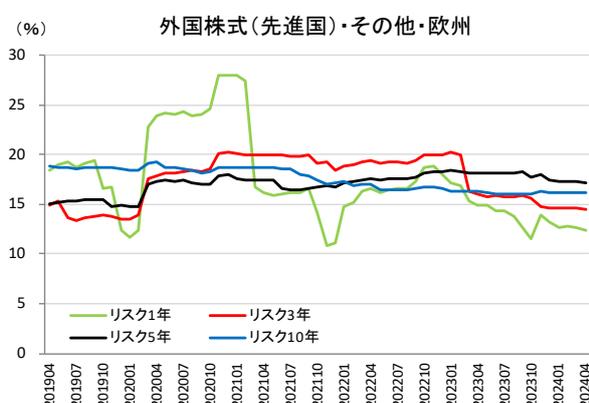
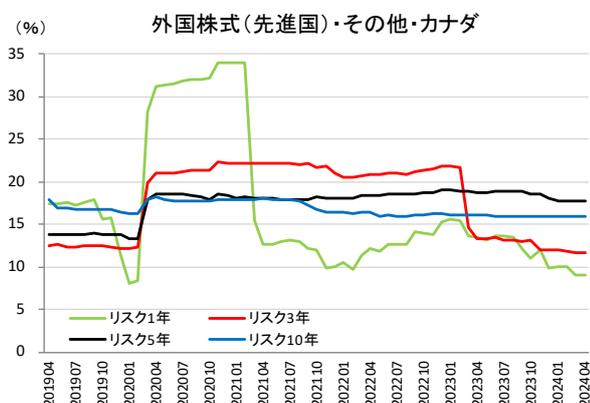
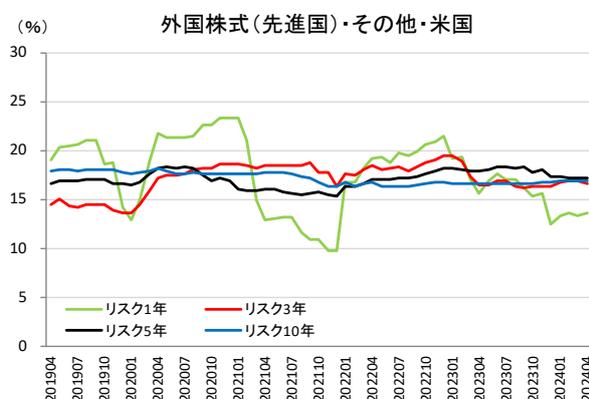
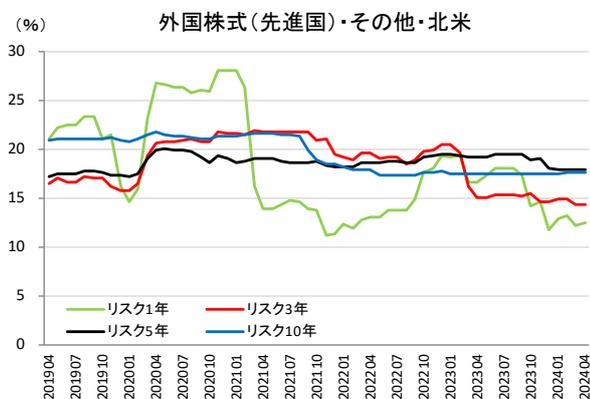
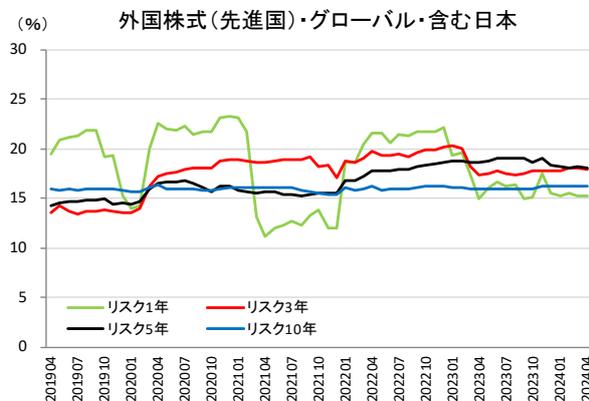
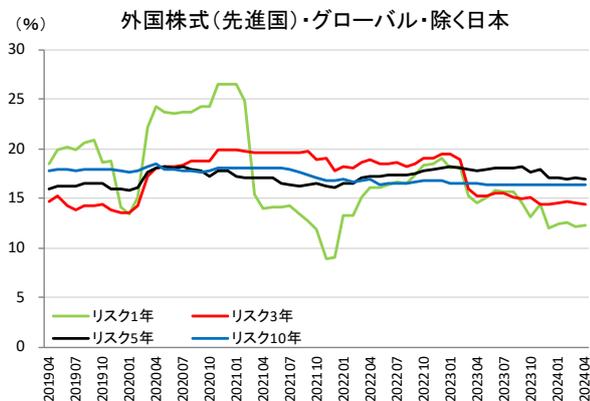


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

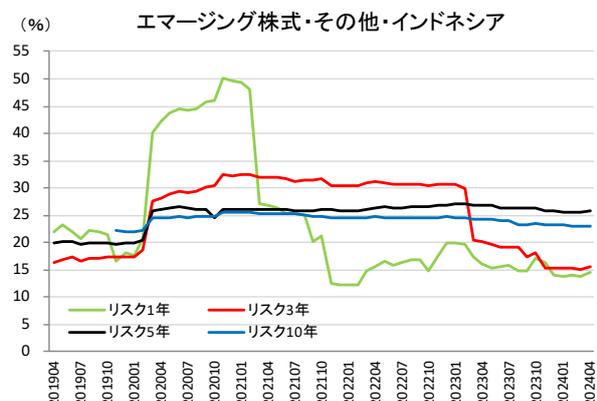
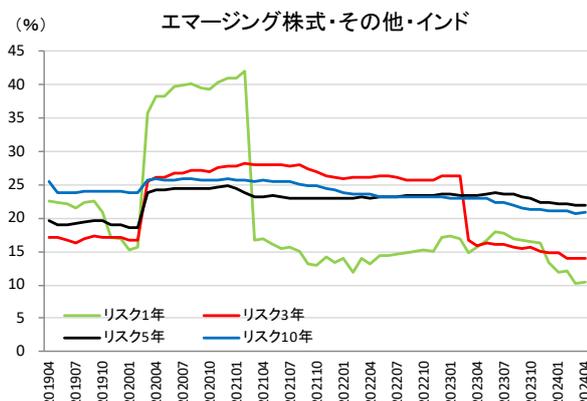
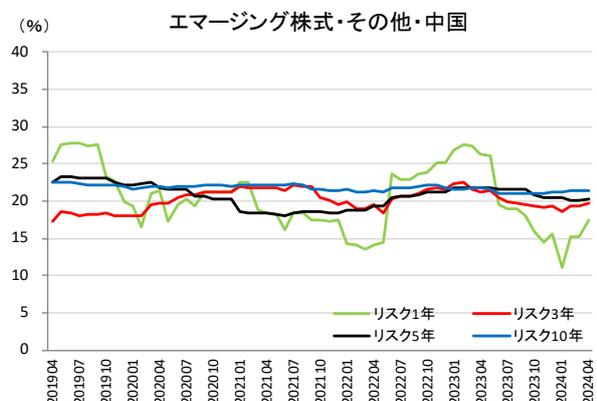
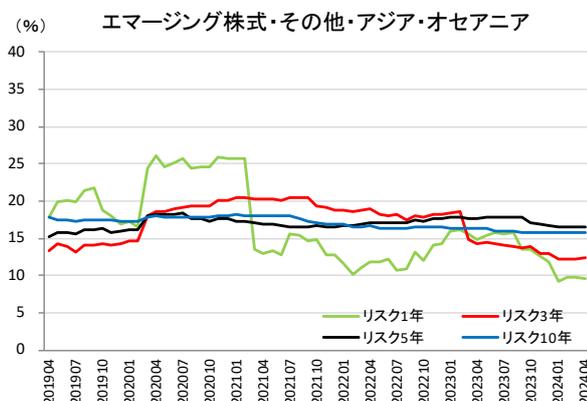
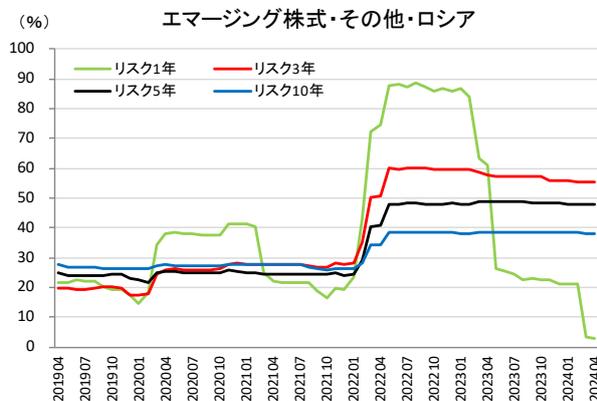
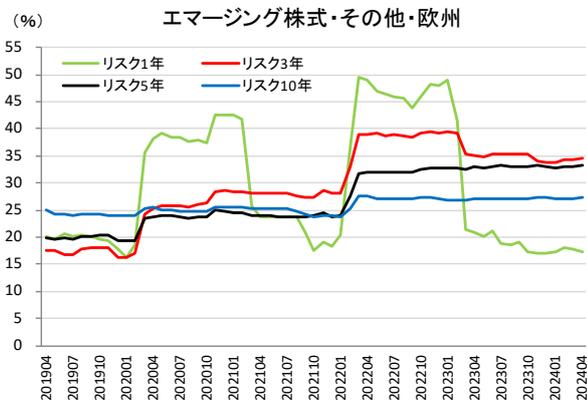
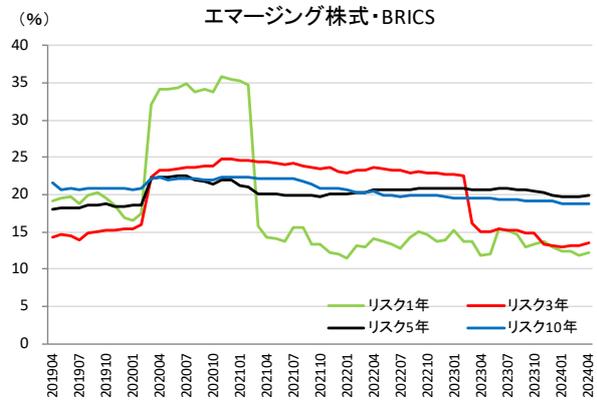
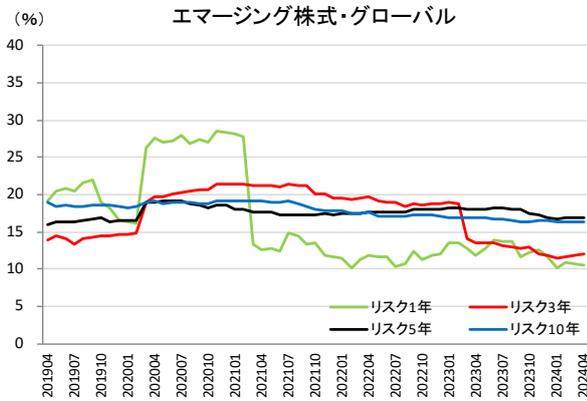


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

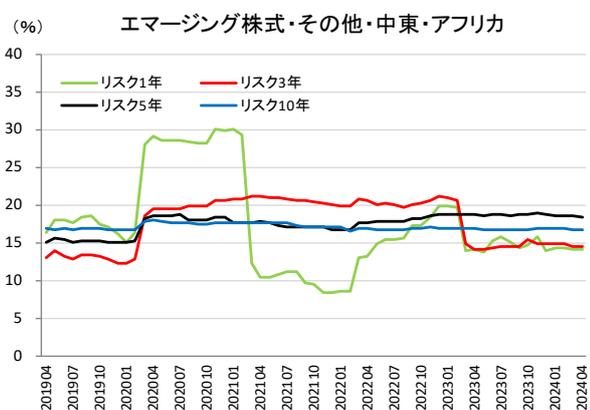
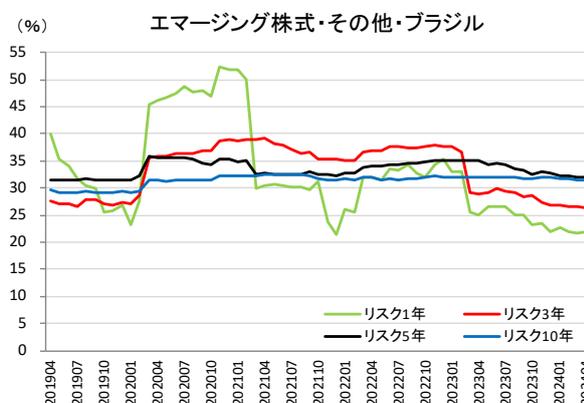
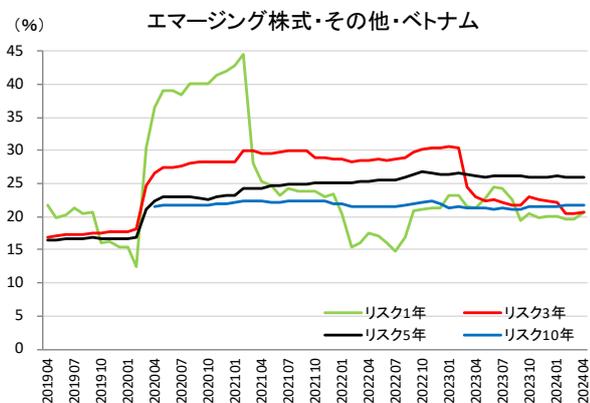
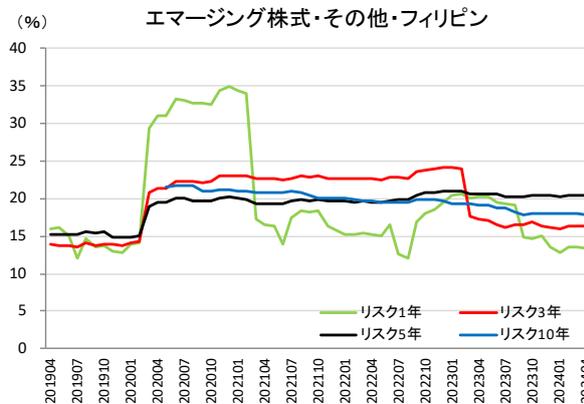
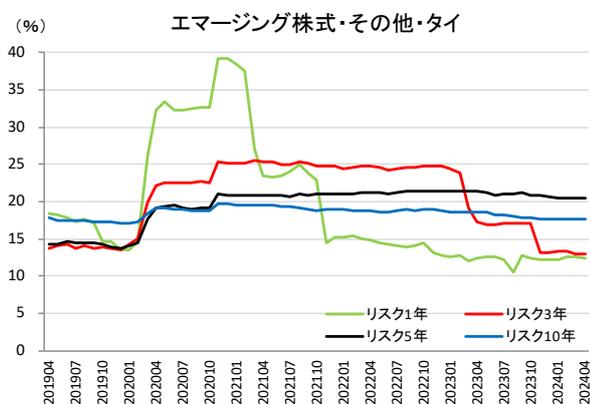


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

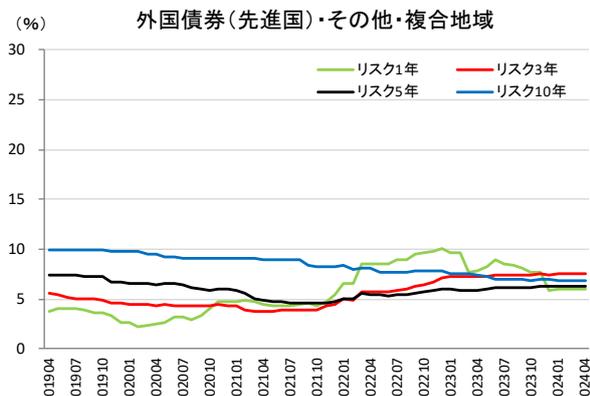
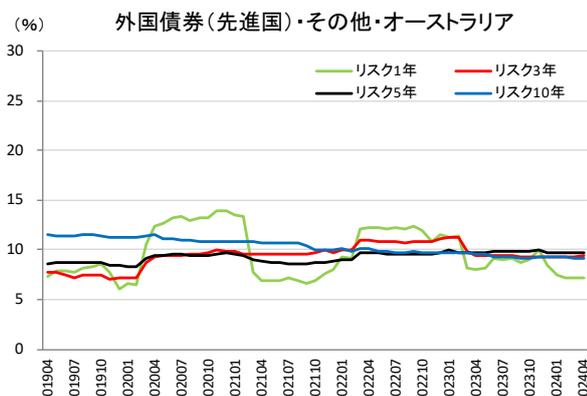
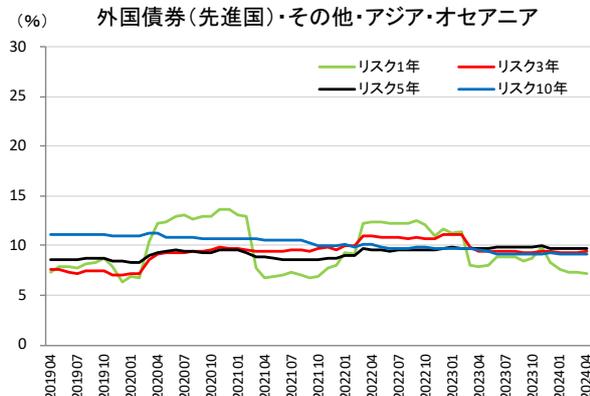
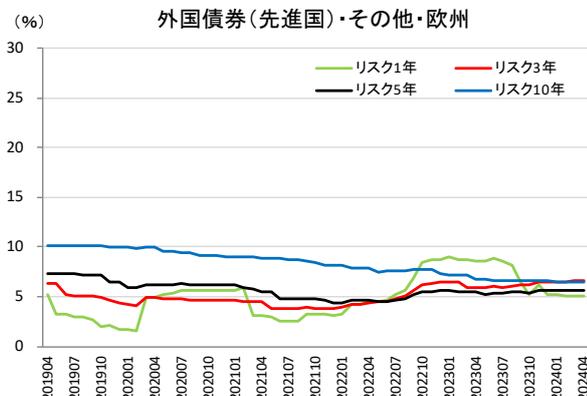
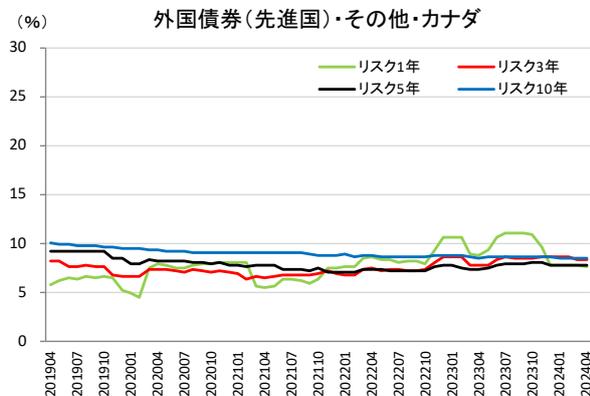
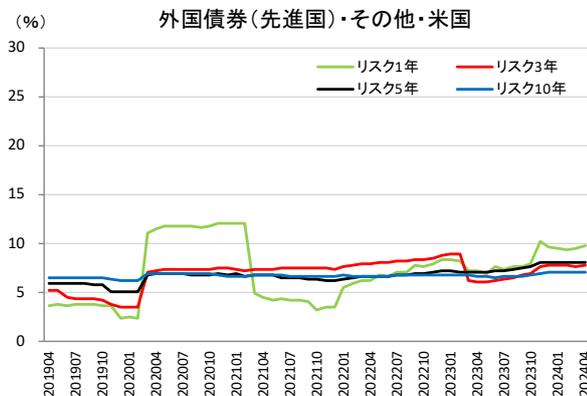
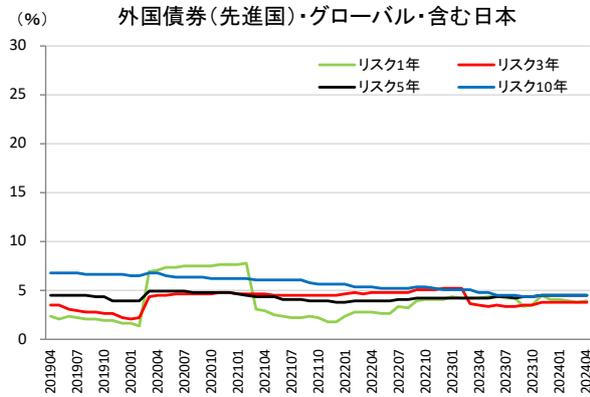
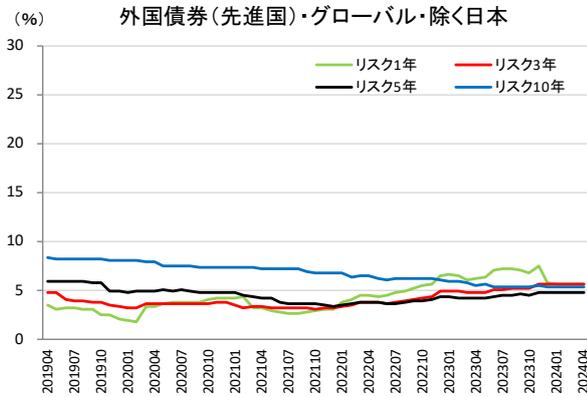


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

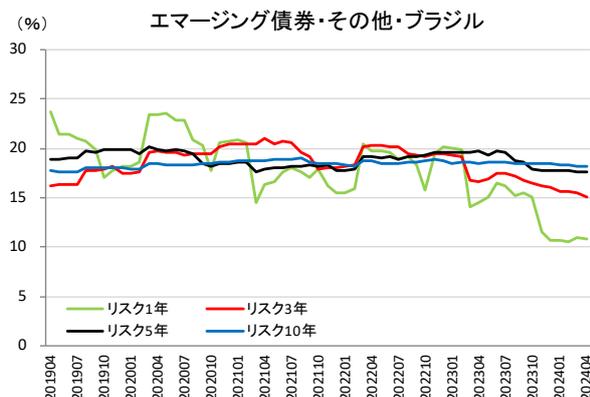
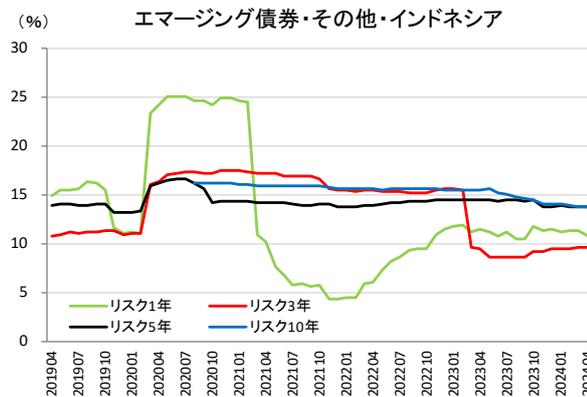
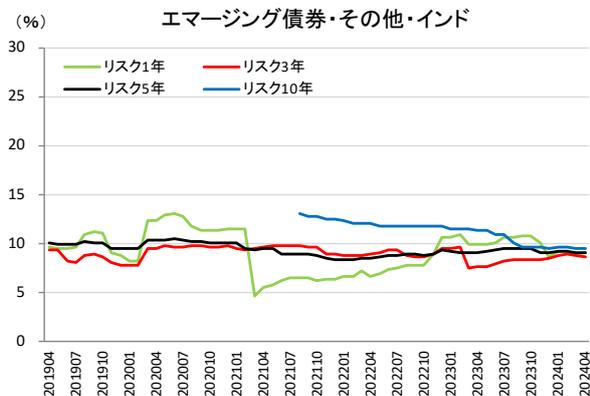
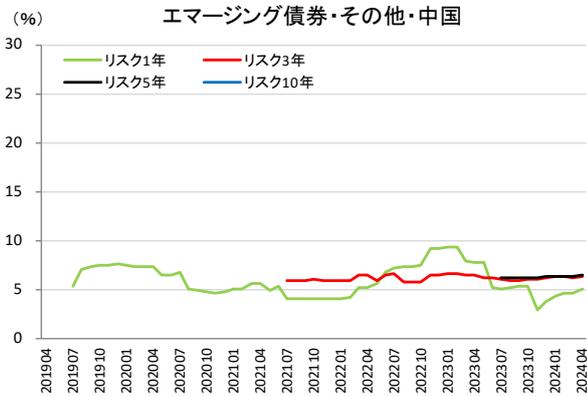
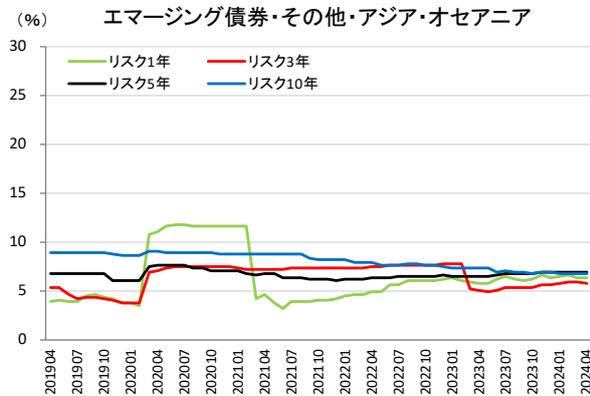
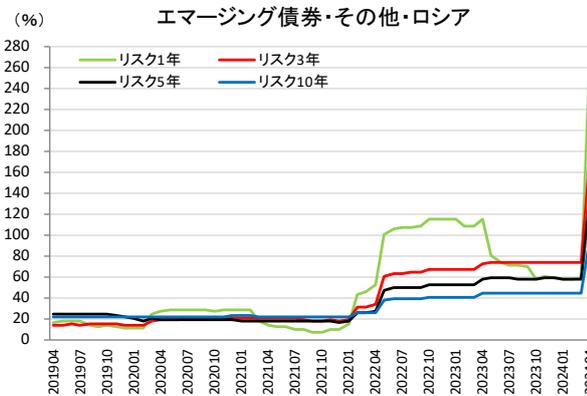
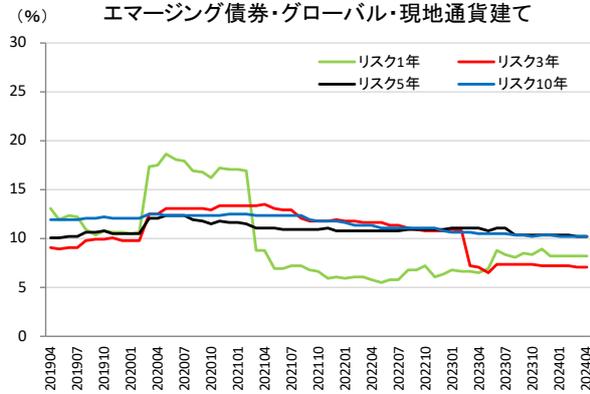
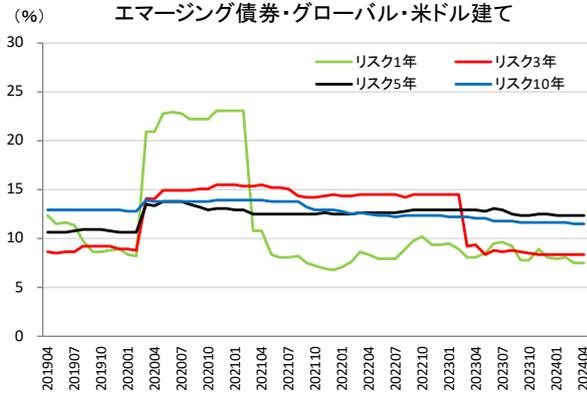


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

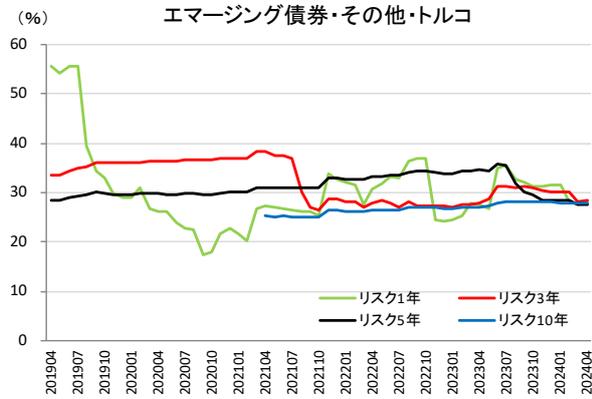
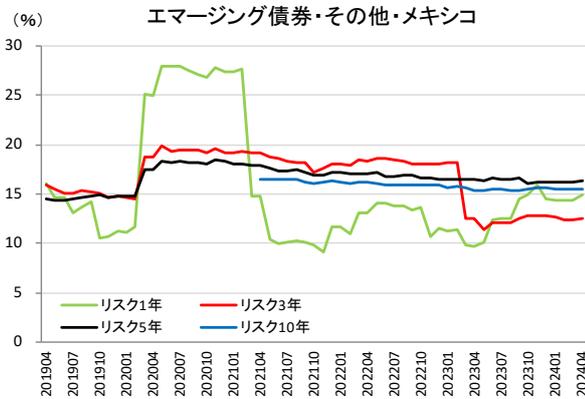


<2> リスク・サマリー

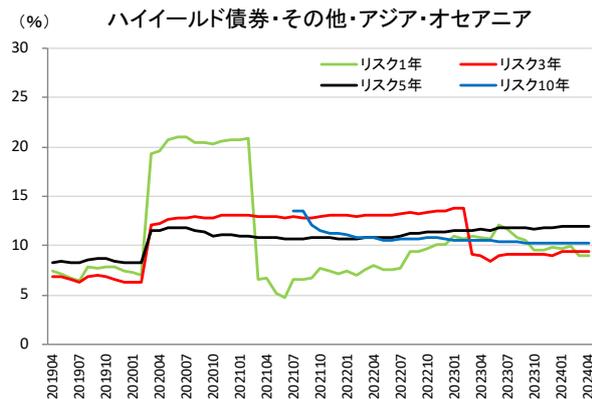
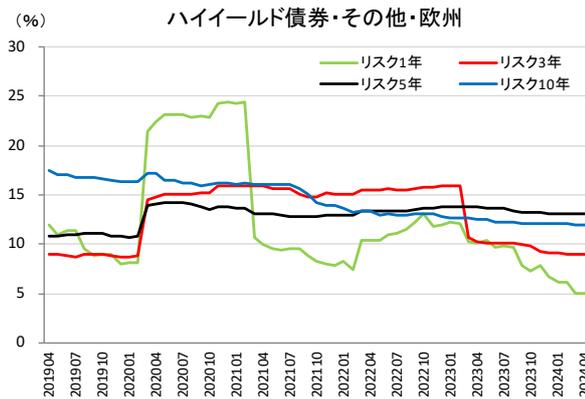
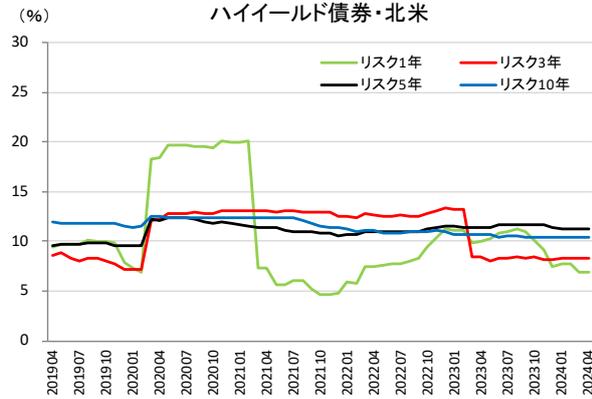
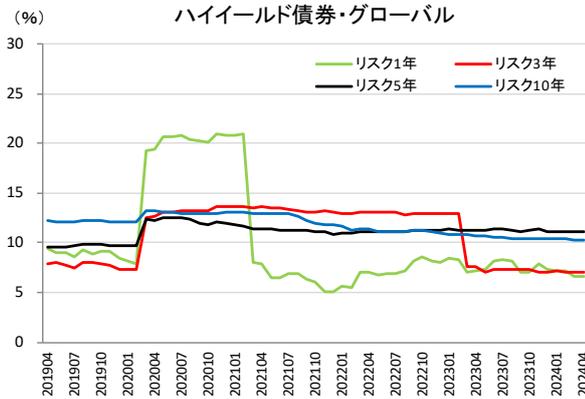
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

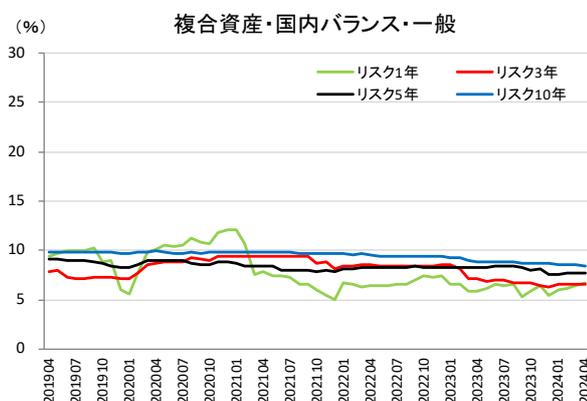
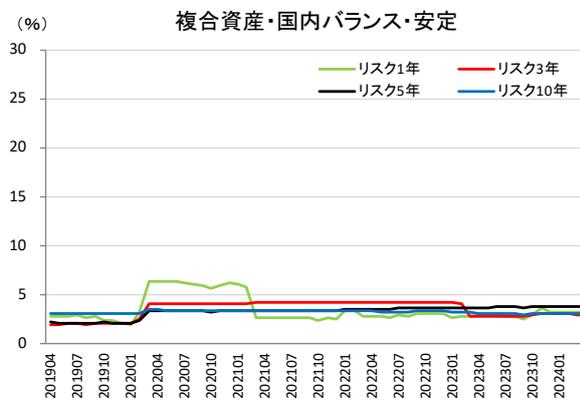
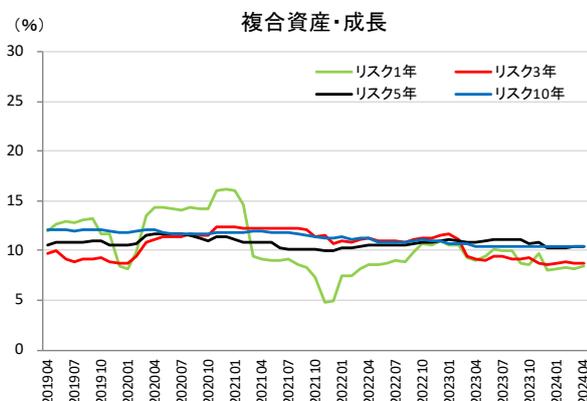
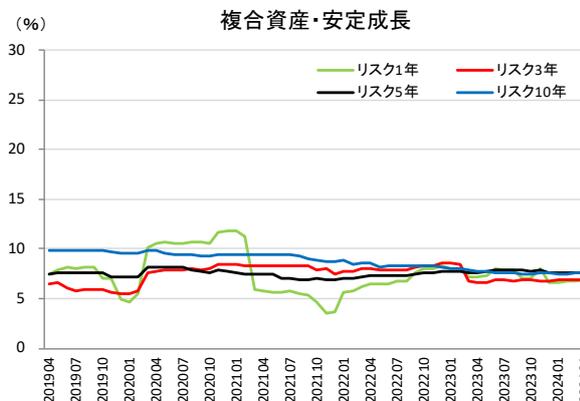
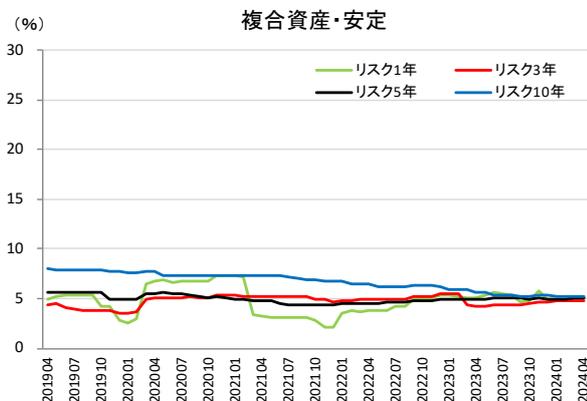


<2> リスク・サマリー

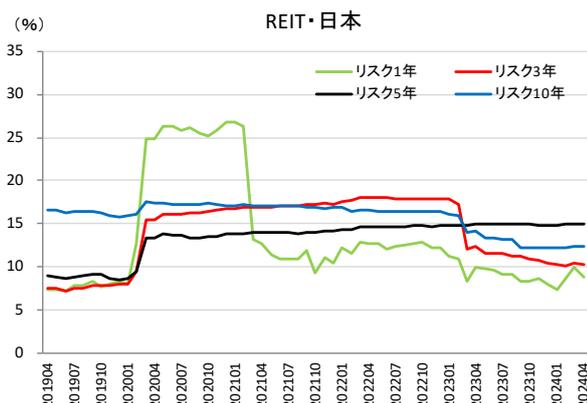
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

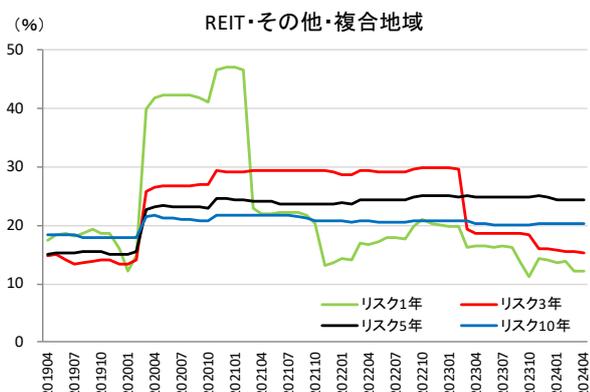
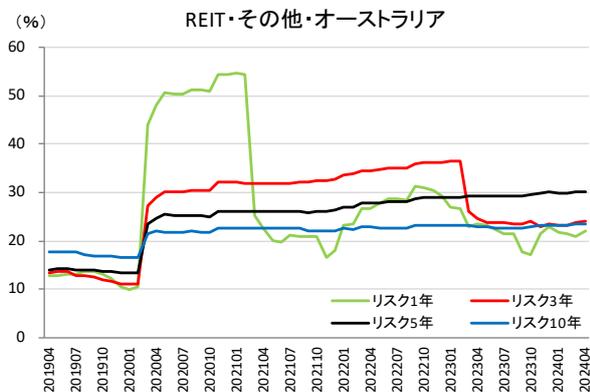
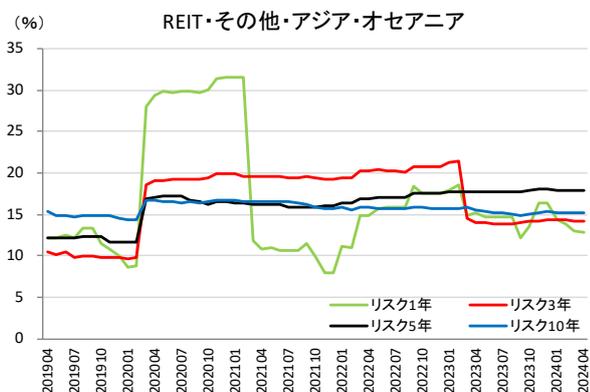
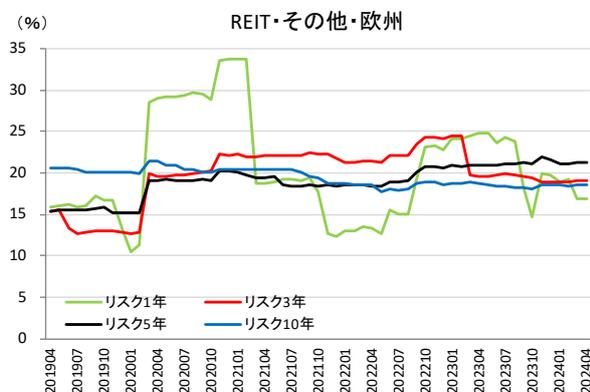
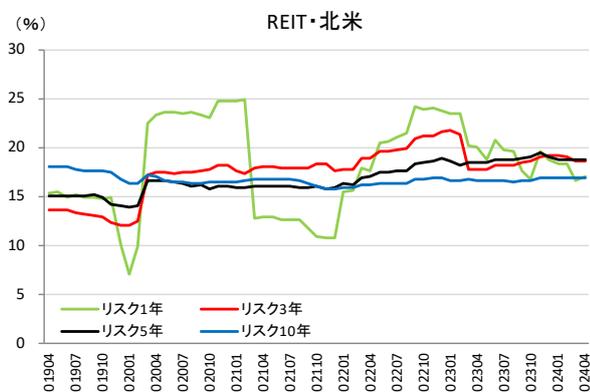
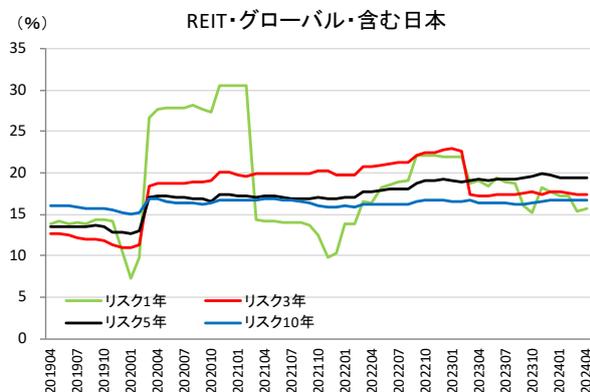
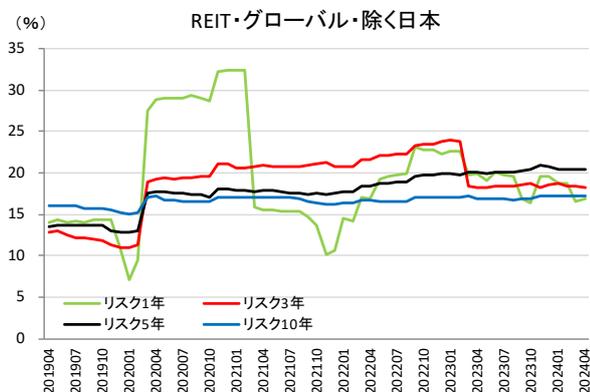


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

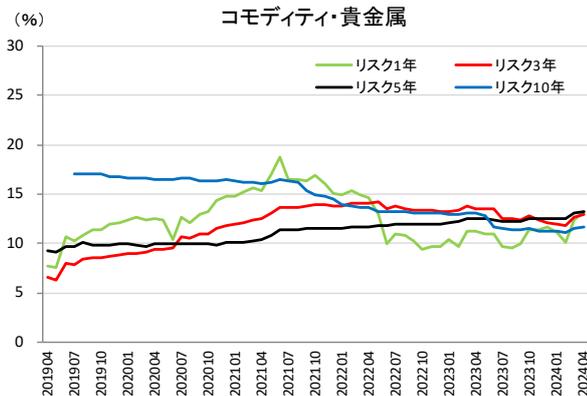
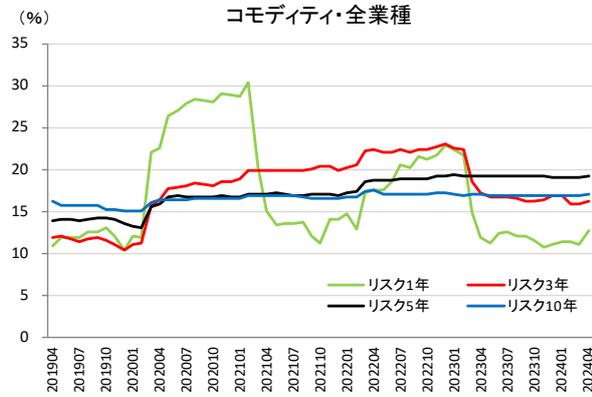
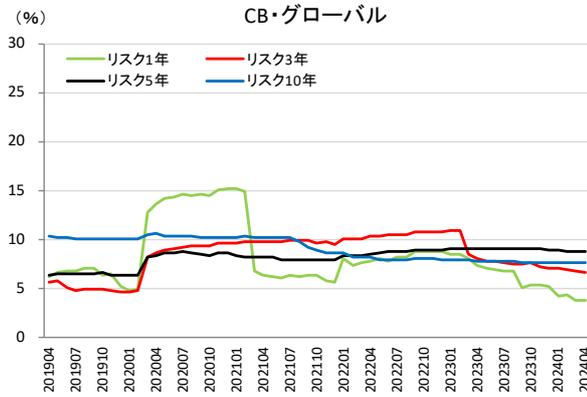
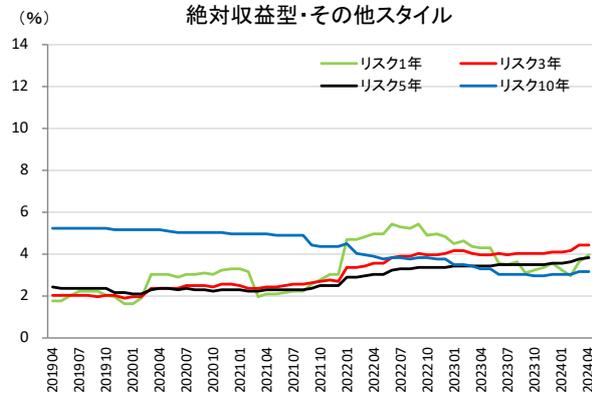
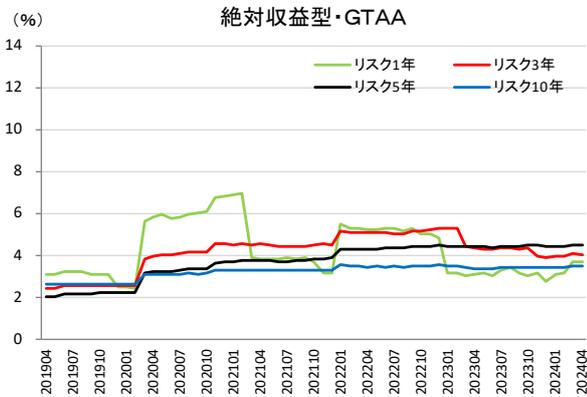
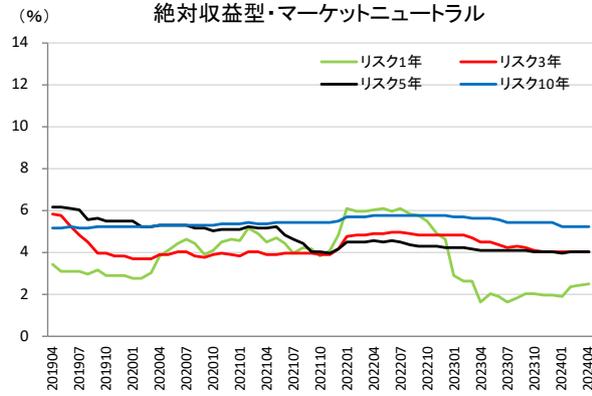
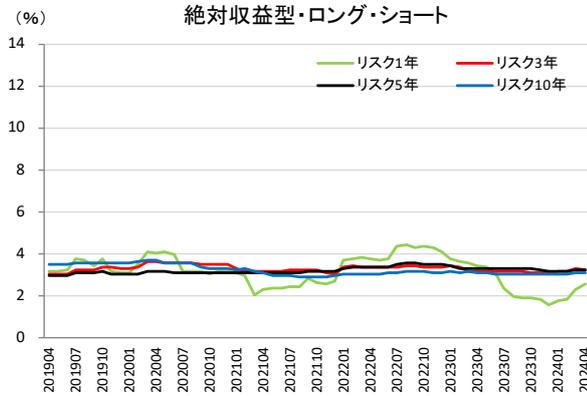


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



< 3 > 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	15,516	42,707	59,481	106,614
国内株式	3,223	5,830	6,741	15,122
一般	252	1,336	3,619	8,900
フリー	-158	-438	-596	953
バリュー	409	1,772	4,212	7,940
小型	67	25	-148	237
その他	2,835	4,270	2,957	5,589
日経225	2,176	2,639	739	1,663
TOPIX	329	923	1,269	2,745
JPX日経400	38	42	-13	19
国内債券	640	944	779	3,876
一般	640	944	779	3,876
外国株式(先進国)	7,533	26,382	40,689	59,034
グローバル	3,198	11,101	16,618	27,704
除く日本	890	2,488	4,588	8,314
含む日本	2,308	8,613	12,030	19,389
その他	4,335	15,281	24,071	31,330
北米	230	948	1,707	2,022
米国	4,146	14,332	22,489	29,744
カナダ	0	-5	-12	-26
欧州	-17	85	82	-21
ドイツ	0	0	-1	-2
イギリス	-1	-1	-2	-2
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-5
オーストラリア	-24	-77	-188	-362
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	0	0	-3	-17
エマージング株式	1,951	4,773	7,958	13,769
グローバル	873	869	980	1,378
BRICS	-4	-17	-32	-53
その他	1,081	3,921	7,010	12,445
欧州	1	0	0	2
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-96	-286	-414	-761
中国	-28	-89	-238	-521
インド	1,232	4,391	7,770	13,867
インドネシア	-3	-2	-1	22
タイ	0	-1	-3	-6
フィリピン	0	-1	-3	-3
ベトナム	-14	-56	-49	-55
韓国	0	0	0	0
香港	-1	-2	2	3
中南米	-1	-2	-5	-12
ブラジル	-5	-24	-56	-94
メキシコ	1	2	1	1
中東・アフリカ	-3	-7	-12	-24
トルコ	-2	-5	-8	-13
複合地域	0	3	26	39

<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	15,516	42,707	59,481	106,614
外国債券(先進国)	323	1,621	2,181	7,839
グローバル	26	1,175	1,781	7,050
除く日本	193	814	1,092	2,809
含む日本	-168	360	689	4,241
その他	297	447	400	789
北米	7	34	79	99
米国	355	690	1,018	1,882
カナダ	-8	-29	-80	-154
欧州	21	22	11	-7
イギリス	0	0	-1	-1
アジア・オセアニア	-14	-50	-123	-155
オーストラリア	-52	-186	-442	-781
ニュージーランド	-3	-7	-12	-2
複合地域	-9	-26	-50	-90
エマージング債券	-26	24	-46	94
グローバル	-22	53	3	51
米ドル建て	-22	-49	-109	-86
現地通貨建て	0	102	112	137
その他	-4	-29	-49	43
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-2	-6	-13	-24
中国	-3	-7	-17	-27
インド	15	45	128	423
インドネシア	-2	-2	-4	24
ブラジル	-13	-48	-113	-307
メキシコ	1	-7	-24	-39
トルコ	0	-2	-2	-4
複合地域	0	-1	-2	-5
ハイイールド債券	-13	110	365	1,204
グローバル	-2	4	-26	-148
北米	1	154	511	1,595
その他	-12	-47	-120	-243
欧州	-15	-44	-101	-198
アジア・オセアニア	3	-3	-18	-42
複合地域	0	0	-1	-3
複合資産	618	1,907	2,178	5,613
安定	-156	-490	-1,088	-1,793
安定成長	460	1,495	1,789	3,804
成長	426	1,296	2,392	5,025
国内バランス	-74	-265	-632	-1,107
安定	-94	-343	-774	-1,379
一般	-2	-8	-21	-38
その他	-38	-129	-283	-315

<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	15,516	42,707	59,481	106,614
国内REIT	170	109	-842	-812
日本	170	109	-842	-812
外国REIT	103	-159	-1,074	-654
グローバル	59	1	-466	-521
除く日本	85	184	115	533
含む日本	-29	-194	-594	-1,067
北米	80	-39	-331	281
その他	-37	-122	-277	-414
欧州	-1	-3	-7	-17
アジア・オセアニア	-29	-92	-209	-301
オーストラリア	-5	-22	-49	-75
複合地域	0	-1	-3	-4
複数国	-1	-4	-10	-18
その他	996	1,165	550	1,529
絶対収益型	253	374	281	379
ロング・ショート	-4	8	-16	51
マーケットニュートラル	-11	-32	-62	-142
GTAA	-5	-17	-35	-83
その他スタイル	272	409	386	565
CB	-31	-51	70	68
アジア・オセアニア	-1	-1	-2	-3
日本	0	0	2	3
グローバル	-30	-49	70	69
コモディティ	220	513	783	1,218
全業種	32	75	103	153
貴金属	192	444	686	1,079
エネルギー	-3	-9	-8	-21
その他コモディティ	1	2	2	7

< 4 > 純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別①

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	1,219,808	100.00	5,366	100.00
国内株式	164,054	13.45	761	14.18
一般	90,424	7.41	461	8.59
フリー	62,528	5.13	359	6.69
バリュー	27,860	2.28	100	1.86
小型	7,718	0.63	87	1.62
その他	64,591	5.30	207	3.86
日経225	30,676	2.51	72	1.34
TOPIX	27,316	2.24	83	1.55
JPX日経400	1,013	0.08	13	0.24
国内債券	43,266	3.55	150	2.80
一般	43,266	3.55	150	2.80
外国株式(先進国)	568,985	46.65	1,218	22.70
グローバル	368,280	30.19	839	15.64
除く日本	111,281	9.12	195	3.63
含む日本	256,999	21.07	644	12.00
その他	200,704	16.45	379	7.06
北米	3,687	0.30	13	0.24
米国	192,196	15.76	298	5.55
カナダ	130	0.01	2	0.04
欧州	1,835	0.15	36	0.67
ドイツ	19	0.00	1	0.02
イギリス	7	0.00	3	0.06
アジア・オセアニア	38	0.00	1	0.02
オーストラリア	2,750	0.23	23	0.43
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	29	0.00	1	0.02
エマージング株式	53,077	4.35	314	5.85
グローバル	13,592	1.11	95	1.77
BRICS	473	0.04	7	0.13
その他	39,012	3.20	212	3.95
欧州	106	0.01	6	0.11
ロシア	8	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,325	0.35	83	1.55
中国	1,222	0.10	32	0.60
インド	30,746	2.52	40	0.75
インドネシア	191	0.02	5	0.09
タイ	3	0.00	1	0.02
フィリピン	30	0.00	4	0.07
ベトナム	1,626	0.13	13	0.24
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	19	0.00	1	0.02
中南米	63	0.01	2	0.04
ブラジル	472	0.04	11	0.20
メキシコ	11	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	66	0.01	3	0.06
トルコ	62	0.01	2	0.04
複合地域	63	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	1,219,808	100.00	5,366	100.00
外国債券(先進国)	97,957	8.03	749	13.96
グローバル	80,024	6.56	533	9.93
除く日本	36,758	3.01	224	4.17
含む日本	43,267	3.55	309	5.76
その他	17,933	1.47	216	4.03
北米	187	0.02	8	0.15
米国	8,462	0.69	115	2.14
カナダ	633	0.05	4	0.07
欧州	1,096	0.09	26	0.48
イギリス	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,519	0.12	9	0.17
オーストラリア	4,893	0.40	32	0.60
ニュージーランド	77	0.01	9	0.17
複合地域	1,056	0.09	8	0.15
エマージング債券	12,492	1.02	233	4.34
グローバル	7,124	0.58	166	3.09
米ドル建て	5,079	0.42	128	2.39
現地通貨建て	2,045	0.17	38	0.71
その他	5,367	0.44	67	1.25
ロシア	12	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	229	0.02	6	0.11
中国	139	0.01	8	0.15
インド	2,875	0.24	16	0.30
インドネシア	327	0.03	7	0.13
ブラジル	1,463	0.12	20	0.37
メキシコ	260	0.02	3	0.06
トルコ	29	0.00	2	0.04
複合地域	34	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	21,782	1.79	237	4.42
グローバル	2,827	0.23	38	0.71
北米	17,120	1.40	137	2.55
その他	1,836	0.15	62	1.16
欧州	1,410	0.12	40	0.75
アジア・オセアニア	387	0.03	21	0.39
複合地域	39	0.00	1	0.02
複合資産	158,179	12.97	1,064	19.83
安定	38,771	3.18	284	5.29
安定成長	72,208	5.92	439	8.18
成長	38,118	3.12	299	5.57
国内バランス	5,991	0.49	28	0.52
安定	4,831	0.40	9	0.17
一般	290	0.02	15	0.28
その他	3,091	0.25	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	1,219,808	100.00	5,366	100.00
国内REIT	24,980	2.05	142	2.65
日本	24,980	2.05	142	2.65
外国REIT	45,062	3.69	272	5.07
グローバル	18,593	1.52	157	2.93
除く日本	8,166	0.67	67	1.25
含む日本	10,413	0.85	89	1.66
北米	23,865	1.96	67	1.25
その他	2,604	0.21	48	0.89
欧州	97	0.01	6	0.11
アジア・オセアニア	1,718	0.14	26	0.48
オーストラリア	487	0.04	12	0.22
複合地域	62	0.01	3	0.06
複数国	241	0.02	1	0.02
その他	29,974	2.46	226	4.21
絶対収益型	12,360	1.01	87	1.62
ロング・ショート	853	0.07	26	0.48
マーケットニュートラル	322	0.03	13	0.24
GTAA	325	0.03	10	0.19
その他スタイル	10,780	0.88	37	0.69
CB	2,962	0.24	43	0.80
アジア・オセアニア	35	0.00	1	0.02
日本	29	0.00	1	0.02
グローバル	2,898	0.24	41	0.76
コモディティ	7,934	0.65	39	0.73
全業種	2,151	0.18	13	0.24
貴金属	5,685	0.47	24	0.45
エネルギー	66	0.01	1	0.02
その他コモディティ	33	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	15,849	10.4	2.95	2.58	1.076
国内株式	23,388	14.5	1.75	1.43	0.991
一般	22,038	14.4	2.50	2.08	1.357
フリー	21,312	13.9	1.97	1.64	1.414
バリュー	24,795	16.1	3.83	3.19	1.227
小型	25,897	15.1	1.64	1.46	1.686
その他	25,462	14.5	0.57	0.40	0.384
日経225	26,780	16.1	0.49	0.37	0.437
TOPIX	26,955	15.4	0.15	0.11	0.232
JPX日経400	24,688	9.6	0.57	0.42	0.471
国内債券	10,226	12.3	0.11	0.12	0.456
一般	10,226	12.3	0.11	0.12	0.456
外国株式(先進国)	19,674	7.9	3.61	3.05	1.092
グローバル	20,297	8.0	2.92	2.53	1.187
除く日本	30,381	10.8	0.63	0.54	0.509
含む日本	17,243	7.2	3.93	3.41	1.481
その他	18,295	7.5	4.88	4.01	0.918
北米	18,381	5.9	0.49	0.42	0.862
米国	19,175	6.7	4.92	4.03	0.901
カナダ	6,317	13.1	9.14	8.56	1.989
欧州	17,269	12.6	2.90	2.71	1.328
ドイツ	19,542	10.1	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,864	7.7	10.63	10.78	1.858
アジア・オセアニア	12,190	17.8	3.31	2.87	1.639
オーストラリア	11,279	9.3	9.05	8.28	1.823
ニュージーランド	18,937	11.8	2.32	2.11	1.672
複合地域	12,936	11.0	16.05	13.14	1.705
エマージング株式	15,699	11.0	3.85	2.86	1.657
グローバル	15,744	8.6	0.73	0.62	1.015
BRICS	17,030	17.9	0.94	0.78	2.052
その他	15,636	11.9	4.94	3.65	1.877
欧州	9,897	17.9	0.63	0.43	1.950
ロシア	974	14.9	0.00	0.00	1.173
アジア・オセアニア	16,362	13.3	2.49	2.23	1.691
中国	13,696	9.7	1.29	1.45	1.916
インド	19,887	10.2	5.70	4.11	1.902
インドネシア	12,723	11.4	1.31	1.32	1.769
タイ	15,975	13.3	2.45	2.50	1.815
フィリピン	12,552	11.7	0.55	0.48	1.707
ベトナム	18,636	6.8	1.98	1.59	1.874
韓国	14,964	5.3	0.00	0.00	1.804
香港	14,199	14.7	2.65	2.54	0.858
中南米	12,476	17.3	1.70	1.30	2.037
ブラジル	6,775	12.9	3.97	3.64	1.965
メキシコ	16,583	11.1	3.21	2.41	1.667
中東・アフリカ	14,723	12.4	1.45	1.24	2.169
トルコ	19,006	22.8	2.96	1.94	2.035
複合地域	20,076	10.8	1.76	1.54	0.967

(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	15,849	10.4	2.95	2.58	1.076
外国債券(先進国)	10,673	10.8	1.37	1.26	0.964
グローバル	11,155	10.8	1.18	1.08	0.913
除く日本	12,535	13.3	0.88	0.80	0.694
含む日本	10,154	9.0	1.45	1.35	1.099
その他	9,485	10.6	2.19	2.04	1.191
北米	10,520	7.8	1.52	1.41	1.186
米国	10,232	8.2	2.15	2.08	1.117
カナダ	7,990	13.3	1.63	1.42	1.378
欧州	7,885	14.9	1.46	1.37	1.070
イギリス	7,975	9.0	3.80	3.24	1.291
アジア・オセアニア	9,885	14.1	2.53	2.27	1.437
オーストラリア	8,986	14.7	2.41	2.16	1.243
ニュージーランド	9,756	9.8	1.62	1.47	1.370
複合地域	5,855	14.0	2.17	1.97	1.193
エマージング債券	10,420	12.3	3.77	3.31	1.377
グローバル	10,479	12.8	2.43	2.08	1.184
米ドル建て	10,258	13.3	2.78	2.34	1.334
現地通貨建て	11,220	11.0	1.57	1.43	0.812
その他	10,274	11.2	5.54	4.94	1.634
ロシア	2,194	11.3	0.00	0.00	1.597
アジア・オセアニア	10,111	13.4	6.83	6.46	1.627
中国	12,414	4.5	1.41	1.24	1.238
インド	10,971	9.7	6.35	5.70	1.707
インドネシア	9,892	11.4	5.36	5.31	1.668
ブラジル	11,866	13.9	4.46	3.74	1.580
メキシコ	10,070	11.5	4.89	4.02	1.369
トルコ	1,377	11.5	4.56	6.72	1.474
複合地域	4,566	17.7	1.57	1.31	1.210
ハイールド債券	10,504	12.9	5.23	4.51	1.658
グローバル	8,657	11.7	3.19	2.70	1.440
北米	12,037	13.8	5.40	4.64	1.682
その他	8,248	11.5	6.77	6.06	1.767
欧州	8,735	11.0	6.08	5.29	1.739
アジア・オセアニア	7,471	12.1	9.38	9.02	1.866
複合地域	5,083	20.1	5.52	4.72	1.800
複合資産	14,532	9.8	1.15	1.07	0.916
安定	11,858	9.8	1.30	1.18	1.054
安定成長	14,114	10.2	1.36	1.26	0.923
成長	18,016	9.2	0.41	0.36	0.775
国内バランス	13,115	11.6	2.22	2.19	0.960
安定	10,694	12.7	1.68	1.74	0.914
一般	14,616	12.0	1.07	0.93	1.248
その他	10,281	4.1	1.49	1.39	0.690

(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	15,849	10.4	2.95	2.58	1.076
国内REIT	14,017	10.4	7.13	8.15	0.890
日本	14,017	10.4	7.13	8.15	0.890
外国REIT	12,983	9.7	8.46	8.13	1.441
グローバル	14,207	9.2	3.33	3.01	1.178
除く日本	15,829	7.9	2.02	1.88	0.938
含む日本	13,022	10.3	4.36	3.90	1.366
北米	11,994	10.7	12.62	12.24	1.613
その他	10,358	9.9	6.83	6.92	1.741
欧州	7,083	10.7	4.87	4.06	1.882
アジア・オセアニア	10,989	9.3	8.44	8.84	1.795
オーストラリア	10,986	9.6	4.58	3.95	1.692
複合地域	8,448	12.2	0.91	0.73	0.774
複数国	11,823	20.0	2.24	2.03	1.650
その他					
絶対収益型	11,030	7.1	0.05	0.05	1.932
ロング・ショート	10,904	6.6	0.18	0.17	1.705
マーケットニュートラル	10,062	6.4	0.92	0.91	1.259
GTAA	11,642	10.7	0.41	0.40	1.553
その他スタイル	11,247	6.9	0.00	0.00	1.985
CB	12,383	7.4	0.33	0.30	1.177
アジア・オセアニア	11,487	13.8	2.41	2.09	1.823
日本	14,976	24.4	0.37	0.33	0.770
グローバル	12,341	6.8	0.30	0.27	1.174
コモディティ	14,461	7.5	0.11	0.10	0.902
全業種	11,867	11.9	0.42	0.35	1.255
貴金属	15,208	4.8	0.00	0.00	0.768
エネルギー	23,655	15.2	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	21,049	7.6	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