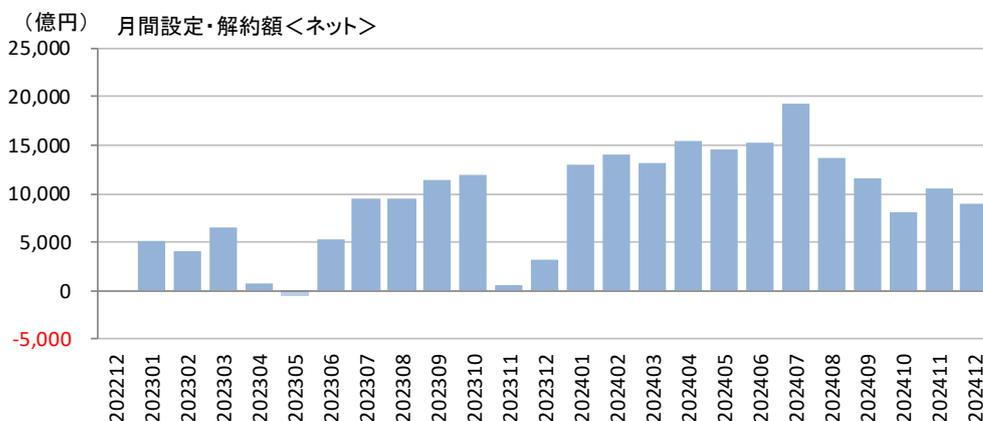
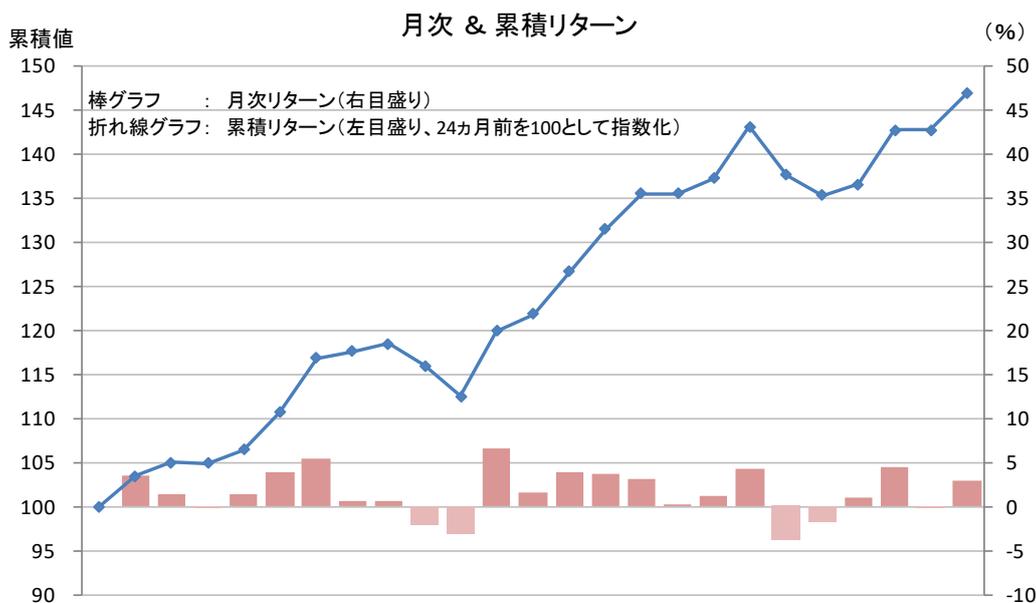


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

— Vol.2 ファンド分類 詳細編 —

2024年12月

「総合」 +2.92 %
(前月 -0.04 %)



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		21,753	21,136	617	2.92	
国内株式		28,402	27,290	1,112	4.07	
一般		27,473	26,458	1,014	3.83	
フリー		25,458	24,513	945	3.86	
バリュー		36,947	35,598	1,349	3.79	
小型		46,208	45,229	980	2.17	
その他		29,236	27,944	1,292	4.62	
日経225		28,051	26,846	1,205	4.49	
TOPIX		28,910	27,797	1,113	4.00	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	27,305	26,395	910	3.45	
国内債券		12,168	12,179	-11	-0.09	
一般		12,168	12,179	-11	-0.09	
外国株式(先進国)		33,145	31,915	1,230	3.86	
グローバル		34,700	33,551	1,149	3.43	
除く日本		56,887	54,828	2,059	3.75	
含む日本		29,925	28,975	950	3.28	
その他		29,124	27,855	1,269	4.56	
北米		37,402	35,235	2,167	6.15	
米国		45,542	43,538	2,005	4.60	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	26,512	25,964	548	2.11	
欧州		30,334	29,573	761	2.57	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	17,248	16,208	1,040	6.41	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	48,977	46,628	2,349	5.04	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	24,384	24,838	-454	-1.83	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	51,180	50,338	842	1.67	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	18,093	18,652	-559	-3.00	
エマージング株式		26,128	25,128	999	3.98	
グローバル		24,855	23,694	1,161	4.90	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	28,300	27,464	836	3.04	
その他		27,888	26,885	1,003	3.73	
欧州		20,952	19,809	1,143	5.77	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,612	1,606	6	0.39	
アジア・オセアニア		23,158	21,882	1,276	5.83	
中国		40,250	37,599	2,651	7.05	
インド	10,000 (2004.09.30)	77,350	74,869	2,482	3.31	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	16,336	16,565	-230	-1.39	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,737	8,385	351	4.19	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	29,427	27,177	2,250	8.28	
香港		27,184	24,953	2,231	8.94	
中南米	7,427 (2006.04.28)	10,756	10,975	-218	-1.99	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	8,545	8,893	-348	-3.91	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	15,724	15,077	647	4.29	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	16,502	15,737	765	4.86	
トルコ		53,641	50,529	3,112	6.16	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	29,274	28,253	1,021	3.61	

※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		21,753	21,136	617	2.92	
外国債券(先進国)		20,218	19,942	275	1.38	
グローバル		20,136	19,843	293	1.48	
除く日本		22,706	22,238	469	2.11	
含む日本		18,456	18,288	167	0.92	
その他		20,822	20,629	193	0.93	
北米	9,052 (2013.05.31)	11,555	11,496	58	0.51	
米国		19,440	19,283	157	0.82	
カナダ	10,000 (2003.05.30)	18,814	18,378	436	2.37	
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,523	15,282	241	1.58	
イギリス	10,069 (2014.07.31)	12,845	12,527	318	2.54	
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	23,195	22,965	231	1.00	
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	28,764	28,525	239	0.84	
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	12,693	12,593	100	0.80	
複合地域	10,000 (2001.11.30)	19,761	19,575	186	0.95	
エマージング債券		22,504	21,959	545	2.48	
グローバル		23,294	22,707	587	2.59	
米ドル建て		23,994	23,453	540	2.30	
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	16,384	15,873	511	3.22	
その他	8,647 (2005.03.31)	17,370	16,971	400	2.35	
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,636	1,525	111	7.30	
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	18,230	17,741	489	2.75	
中国	13,833 (2018.07.31)	20,837	19,866	971	4.89	
インド	10,000 (2011.08.31)	24,135	23,290	846	3.63	
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	20,841	20,509	332	1.62	
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	14,353	14,581	-228	-1.56	
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	19,555	18,689	867	4.64	
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,649	2,517	132	5.25	
複合地域	10,000 (2006.08.31)	13,177	12,951	226	1.74	
ハイイールド債券		33,061	32,032	1,029	3.21	
グローバル	10,000 (1997.06.30)	30,027	29,397	631	2.15	
北米		33,809	32,666	1,143	3.50	
その他	10,000 (2004.03.31)	28,567	27,914	653	2.34	
欧州	10,000 (2006.04.28)	29,064	28,426	638	2.25	
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	17,373	16,945	429	2.53	
複合地域	10,000 (2004.03.31)	29,022	27,918	1,104	3.95	
複合資産		22,515	22,149	367	1.66	
安定	10,000 (1998.10.30)	17,502	17,340	161	0.93	
安定成長		25,247	24,786	461	1.86	
成長		33,582	32,826	757	2.30	
国内バランス		12,469	12,407	63	0.51	
安定		12,352	12,330	22	0.18	
一般		18,878	18,506	372	2.01	
その他	10,000 (2018.10.31)	13,940	14,158	-218	-1.54	

※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		21,753	21,136	617	2.92	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	32,823	32,806	18	0.05	
日本	10,000 (2003.10.31)	32,823	32,806	18	0.05	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	42,110	43,745	-1,635	-3.74	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	34,482	35,732	-1,250	-3.50	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	39,415	40,910	-1,495	-3.65	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	33,646	34,819	-1,173	-3.37	
北米	10,000 (2003.09.30)	45,485	47,454	-1,969	-4.15	
その他	10,000 (2004.04.30)	33,658	34,049	-391	-1.15	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,894	5,975	-81	-1.36	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	23,905	23,914	-9	-0.04	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	20,788	21,615	-827	-3.83	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	9,272	9,142	130	1.42	
複数国	10,000 (2004.04.30)	53,115	54,753	-1,638	-2.99	
その他		7,954	7,749	205	2.64	
絶対収益型		7,625	7,633	-8	-0.10	
ロング・ショート		8,248	8,243	5	0.06	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	12,011	12,072	-61	-0.50	
GTAA		12,002	11,927	75	0.63	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,153	7,162	-9	-0.12	
CB		21,688	21,445	243	1.13	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	25,254	24,265	988	4.07	
日本		21,359	21,137	222	1.05	
グローバル		37,802	37,393	410	1.10	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	16,053	15,616	437	2.80	
全業種	10,000 (2004.12.30)	13,206	12,520	686	5.48	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	28,084	27,520	564	2.05	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	11,522	10,760	762	7.08	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	18,985	18,547	438	2.36	

※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	7.54	2.61	20.49	20.49
国内株式	4.72	0.03	18.60	18.60
一般	4.29	-0.25	18.56	18.56
フリー	4.17	-0.25	18.55	18.55
バリュー	4.54	-0.25	18.63	18.63
小型	2.03	-0.40	7.10	7.10
その他	5.51	0.41	20.06	20.06
日経225	5.20	1.40	20.71	20.71
TOPIX	5.38	0.16	20.18	20.18
JPX日経400	4.19	-0.88	20.11	20.11
国内債券	-1.20	0.16	-2.38	-2.38
一般	-1.20	0.16	-2.38	-2.38
外国株式(先進国)	12.58	5.10	31.36	31.36
グローバル	10.97	4.38	28.08	28.08
除く日本	11.44	4.89	32.52	32.52
含む日本	10.77	4.16	26.20	26.20
その他	15.31	6.26	37.49	37.49
北米	16.05	4.83	40.00	40.00
米国	15.65	6.48	38.14	38.14
カナダ	9.90	6.63	18.66	18.66
欧州	-1.44	-5.11	10.72	10.72
ドイツ	5.85	4.42	23.23	23.23
アジア・オセアニア	4.88	0.23	20.65	20.65
オーストラリア	-1.74	-2.19	10.54	10.54
ニュージーランド	4.17	-2.58	3.65	3.65
複合地域	16.14	-0.23	22.71	22.71
エマーシング株式	1.35	-3.40	21.28	21.28
グローバル	2.38	-1.25	20.27	20.27
BRICS	-1.00	-2.55	12.43	12.43
その他	1.09	-4.03	21.89	21.89
欧州	5.33	-2.61	23.20	23.20
ロシア	35.49	48.05	49.86	49.86
アジア・オセアニア	3.13	-0.33	19.97	19.97
中国	9.20	8.28	16.23	16.23
インド	0.57	-4.86	23.78	23.78
インドネシア	-9.51	-4.46	-7.47	-7.47
フィリピン	-4.72	2.68	8.98	8.98
ベトナム	6.59	0.48	25.49	25.49
香港	7.68	13.43	35.76	35.76
中南米	-7.17	-13.85	-19.21	-19.21
ブラジル	-12.93	-16.50	-23.81	-23.81
メキシコ	0.73	-13.23	-14.32	-14.32
中東・アフリカ	4.87	5.21	21.73	21.73
トルコ	9.49	-10.91	37.41	37.41
複合地域	0.62	-3.08	7.17	7.17

※[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	7.54	2.61	20.49	20.49
外国債券(先進国)	2.15	-0.98	5.13	5.13
グローバル	2.40	-0.65	5.12	5.12
除く日本	3.27	-1.29	6.74	6.74
含む日本	1.62	-0.12	3.77	3.77
その他	1.00	-2.47	5.14	5.14
北米	1.73	-2.02	5.28	5.28
米国	2.03	-0.10	5.95	5.95
カナダ	3.54	-3.36	6.01	6.01
欧州	1.43	-0.31	4.99	4.99
イギリス	2.14	-1.92	8.56	8.56
アジア・オセアニア	-0.73	-5.30	3.69	3.69
オーストラリア	-0.61	-5.52	4.03	4.03
ニュージーランド	-1.80	-4.44	3.60	3.60
複合地域	-0.65	-6.67	2.83	2.83
エマージング債券	3.96	-2.11	8.03	8.03
グローバル	4.29	0.04	10.84	10.84
米ドル建て	5.02	0.40	12.30	12.30
現地通貨建て	2.66	-0.72	7.42	7.42
その他	3.55	-4.89	4.39	4.39
ロシア	0.02	-19.52	229.61	229.61
アジア・オセアニア	4.82	0.79	12.41	12.41
中国	5.65	1.49	11.93	11.93
インド	8.47	-1.32	14.32	14.32
インドネシア	0.97	1.01	8.25	8.25
ブラジル	-7.65	-15.56	-16.16	-16.16
メキシコ	4.21	-8.72	-5.63	-5.63
トルコ	13.36	1.59	7.60	7.60
複合地域	0.82	-3.82	5.12	5.12
ハイイールド債券	7.88	1.55	15.27	15.27
グローバル	4.81	0.41	11.60	11.60
北米	8.84	1.95	16.41	16.41
その他	4.23	0.00	11.01	11.01
欧州	3.88	0.18	9.76	9.76
アジア・オセアニア	5.28	-0.71	15.47	15.47
複合地域	7.11	0.77	14.14	14.14
複合資産	3.25	0.90	10.82	10.82
安定	1.94	0.22	6.37	6.37
安定成長	3.57	0.94	11.72	11.72
成長	4.91	1.64	16.20	16.20
国内バランス	-0.47	-0.12	-0.14	-0.14
安定	-1.07	-0.15	-1.56	-1.56
一般	2.19	-1.04	7.75	7.75
その他	-3.93	-1.08	5.71	5.71

※[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」の1年と年初来は、外れ値として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	7.54	2.61	20.49	20.49
国内REIT	-3.03	-2.25	-4.20	-4.20
日本	-3.03	-2.25	-4.20	-4.20
外国REIT	1.51	4.66	14.01	14.01
グローバル	0.08	3.86	12.44	12.44
除く日本	0.27	4.57	14.10	14.10
含む日本	-0.08	3.28	11.13	11.13
北米	3.23	5.53	16.22	16.22
その他	-4.27	2.02	4.98	4.98
欧州	-4.62	-4.11	1.42	1.42
アジア・オセアニア	-5.11	2.35	2.16	2.16
オーストラリア	-5.29	0.35	11.94	11.94
複合地域	0.09	2.55	12.31	12.31
複数国	2.37	4.78	11.31	11.31
その他	4.04	1.45	14.40	14.40
絶対収益型	-1.70	-2.14	1.44	1.44
ロング・ショート	-0.97	-1.41	0.93	0.93
マーケットニュートラル	1.01	2.44	5.98	5.98
GTAA	2.41	-0.03	5.74	5.74
その他スタイル	-1.94	-2.38	1.23	1.23
CB	2.92	1.08	5.65	5.65
アジア・オセアニア	6.30	0.87	17.93	17.93
日本	-1.05	-2.82	2.97	2.97
グローバル	2.92	1.12	5.54	5.54
コモディティ	6.41	6.12	27.18	27.18
全業種	9.87	-3.06	15.64	15.64
貴金属	5.43	9.74	31.62	31.62
エネルギー	14.94	-8.88	18.52	18.52
その他コモディティ	6.20	-2.29	18.86	18.86

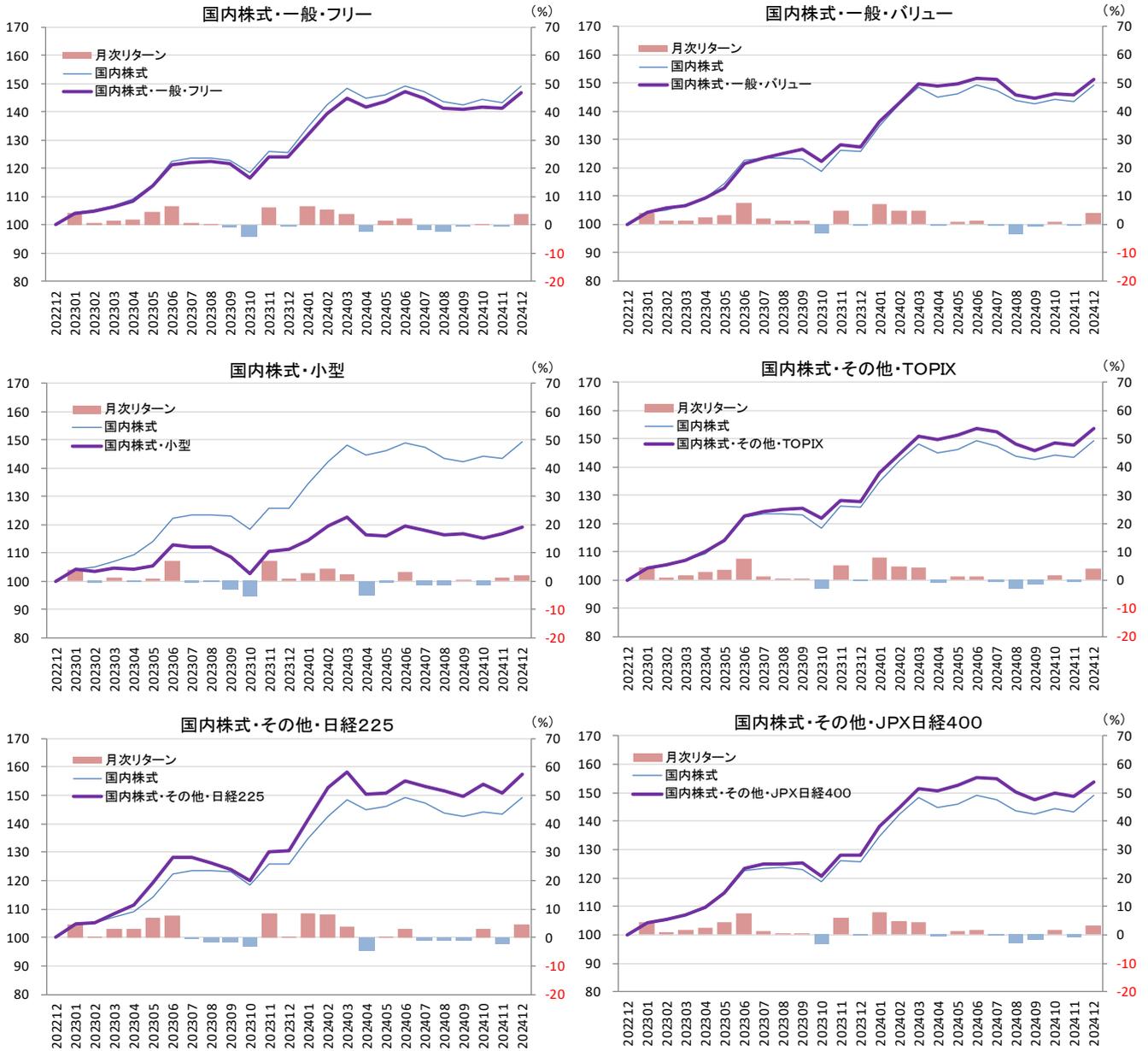
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

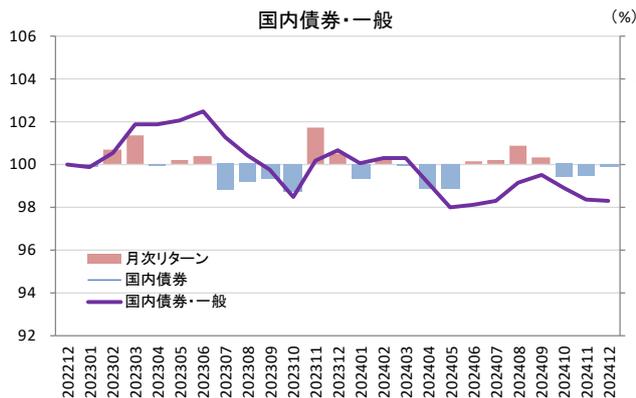
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

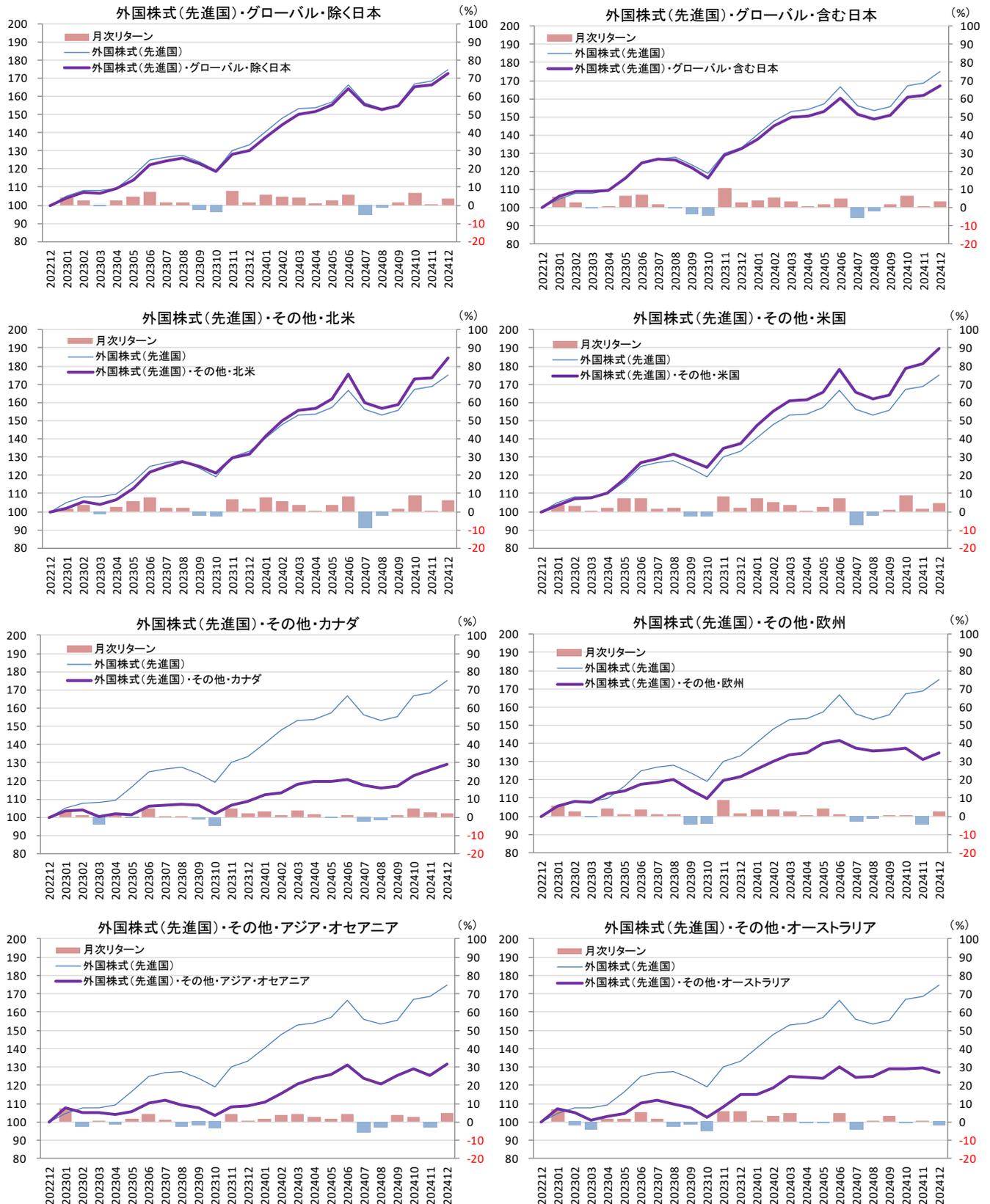


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

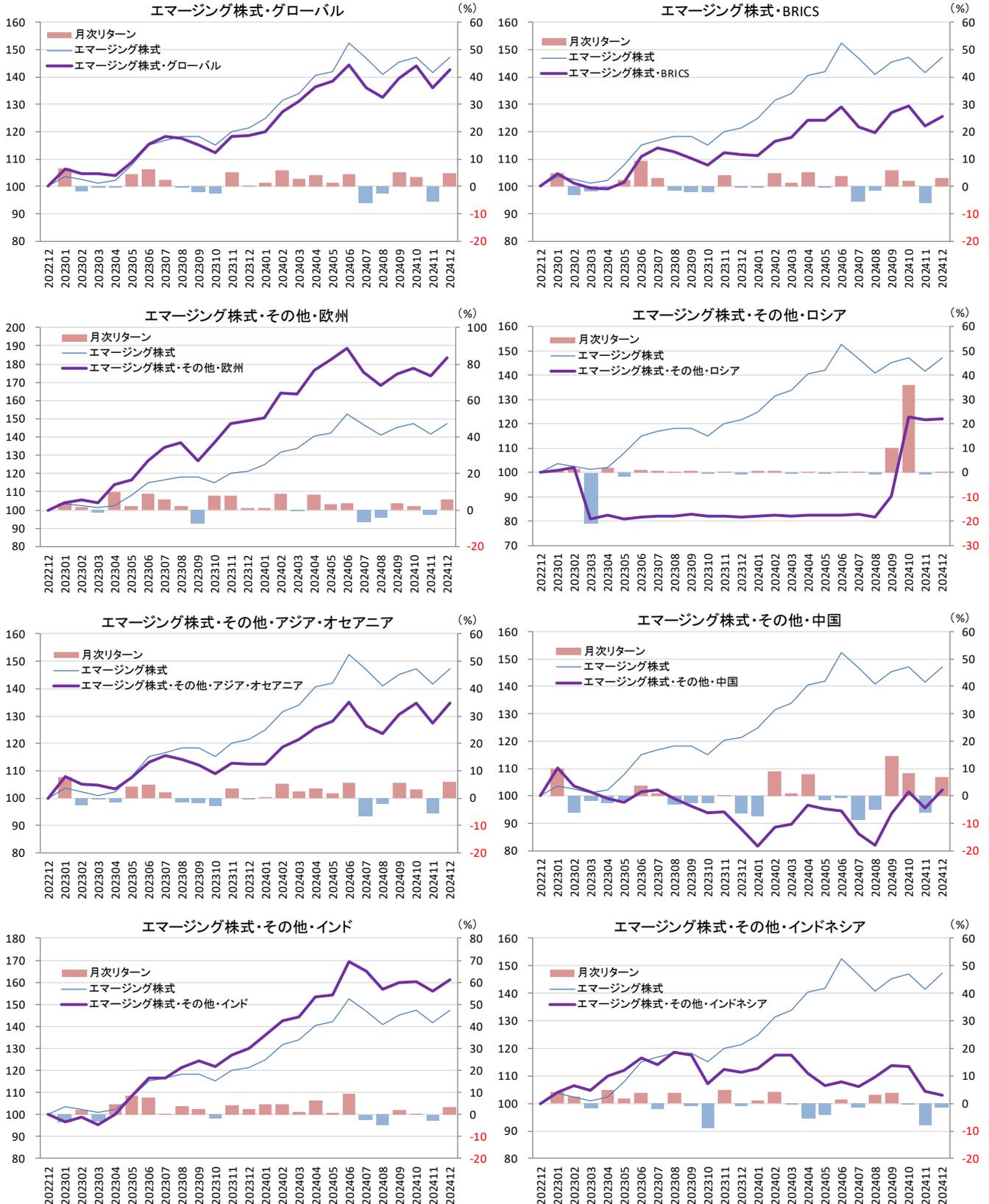


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

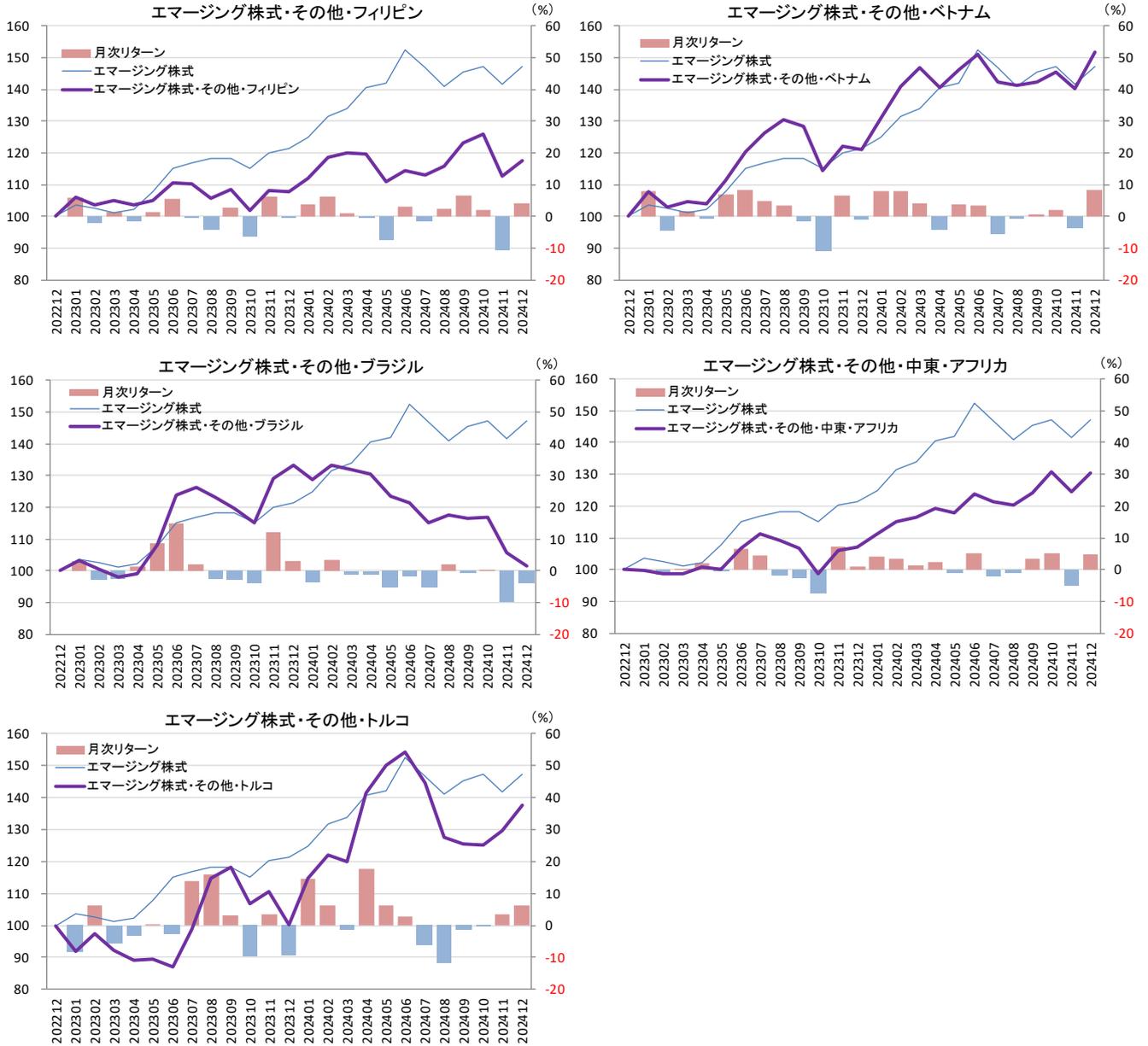


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

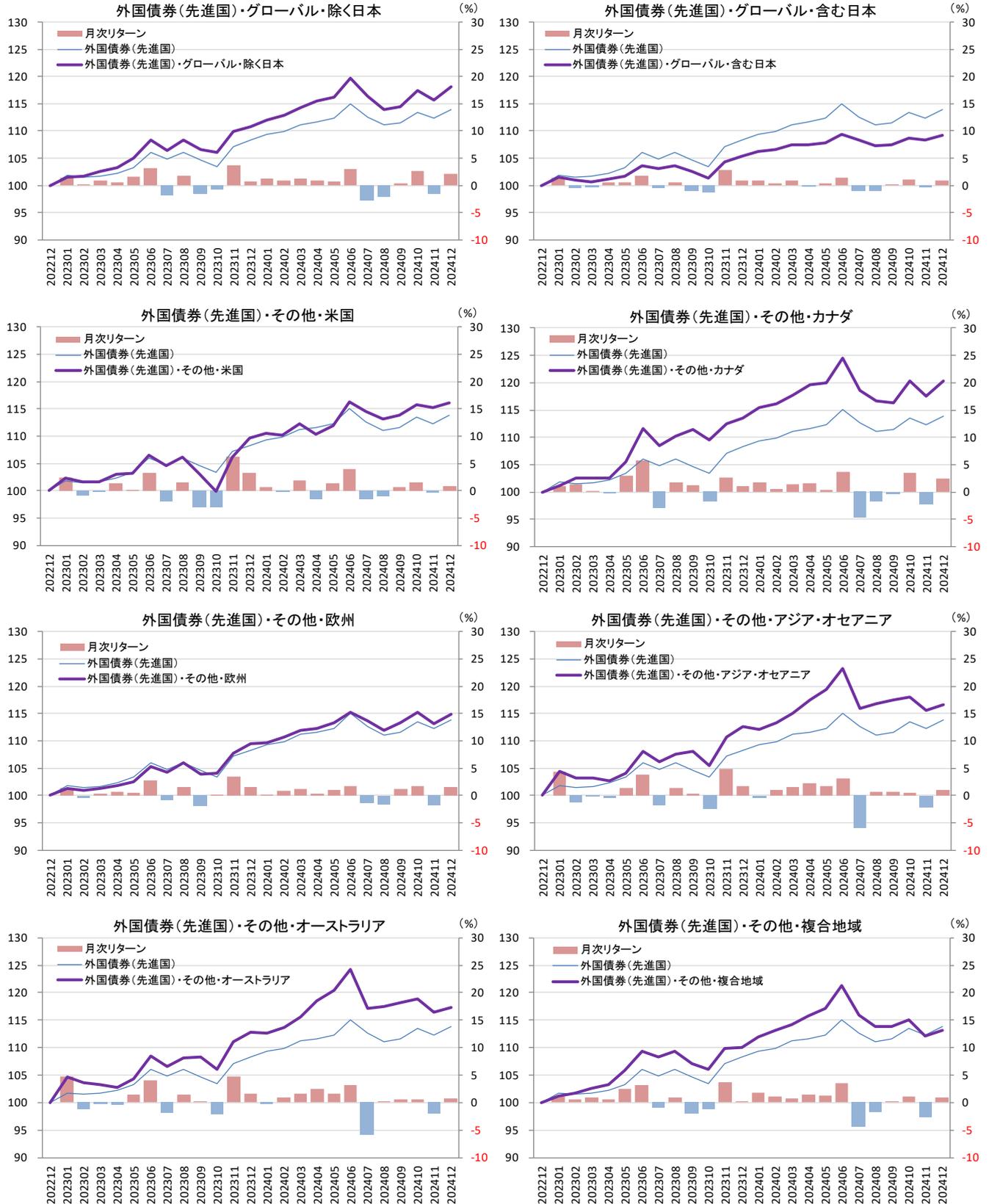


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

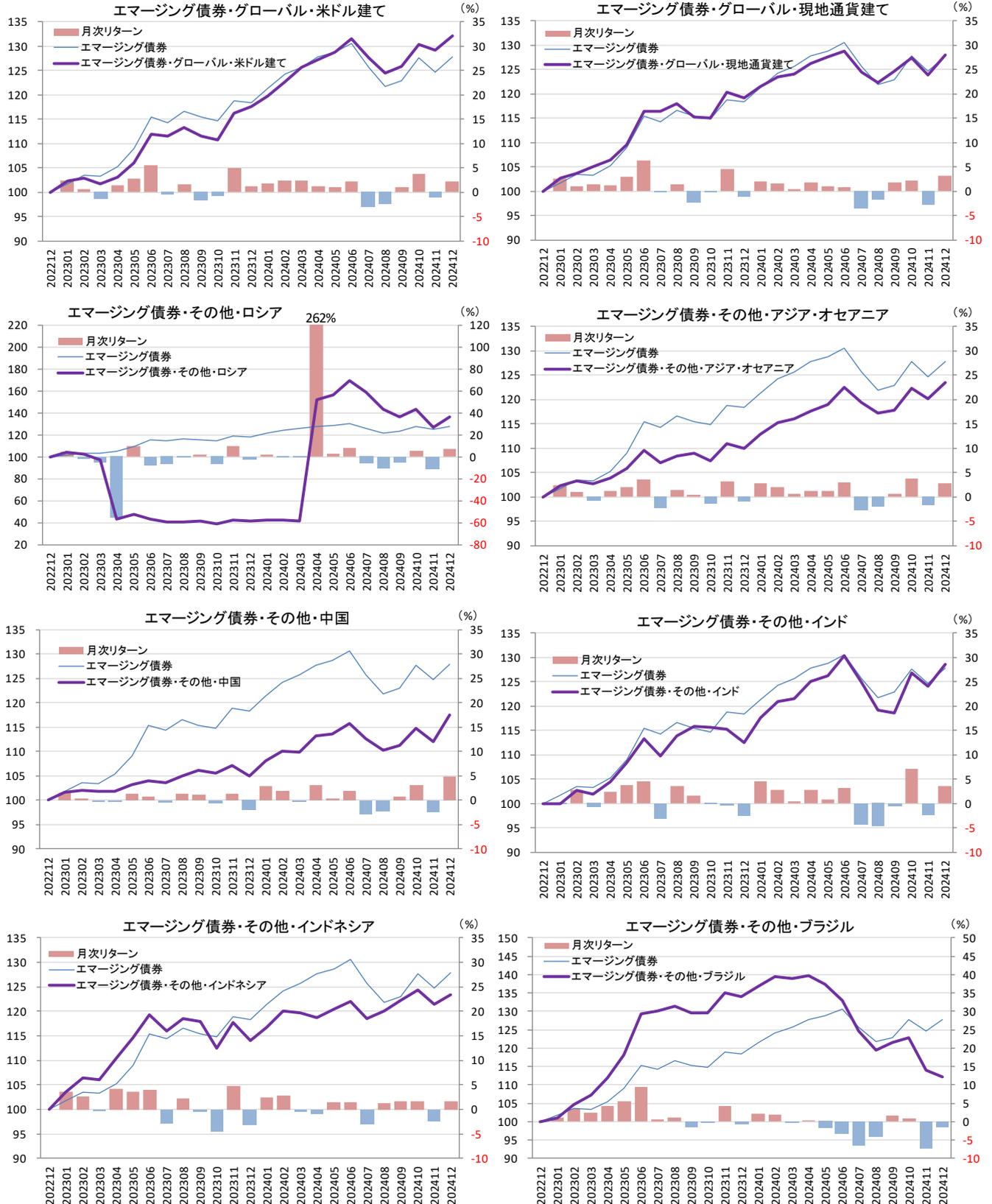


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

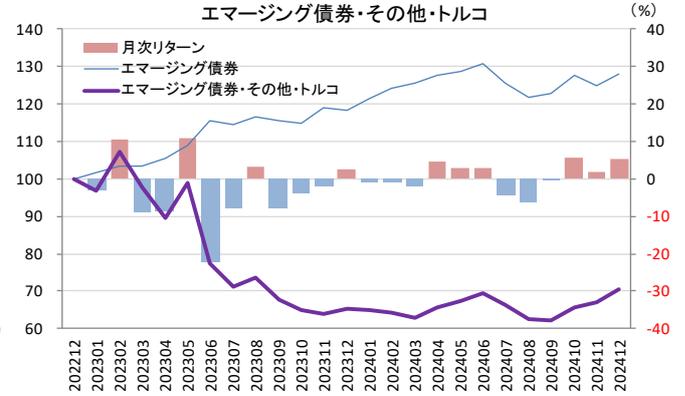
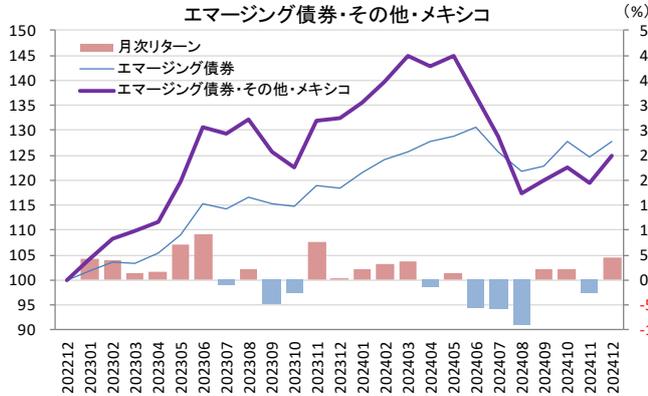


<1>パフォーマンス・サマリー

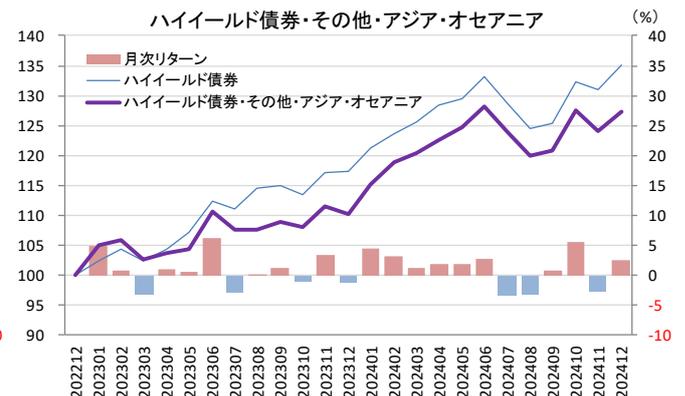
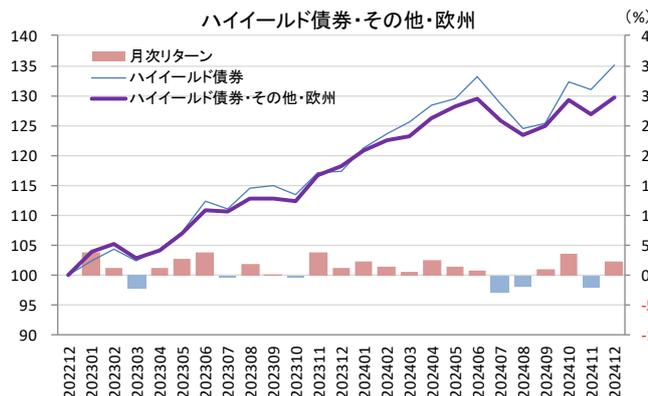
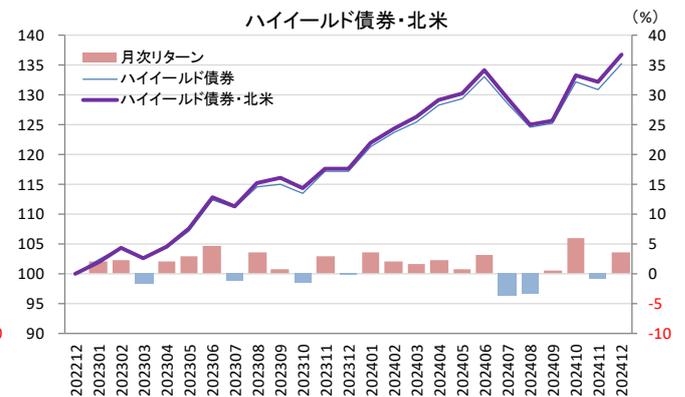
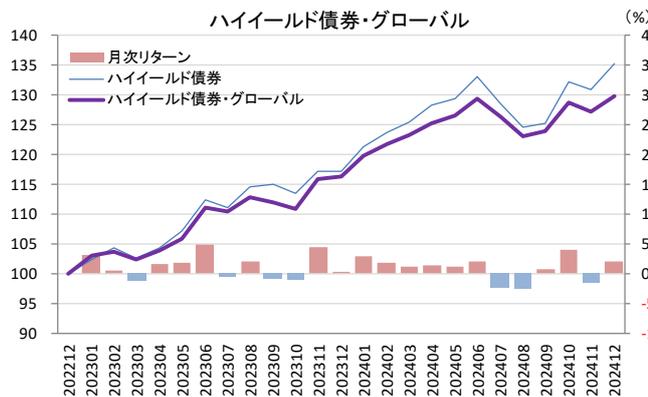
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

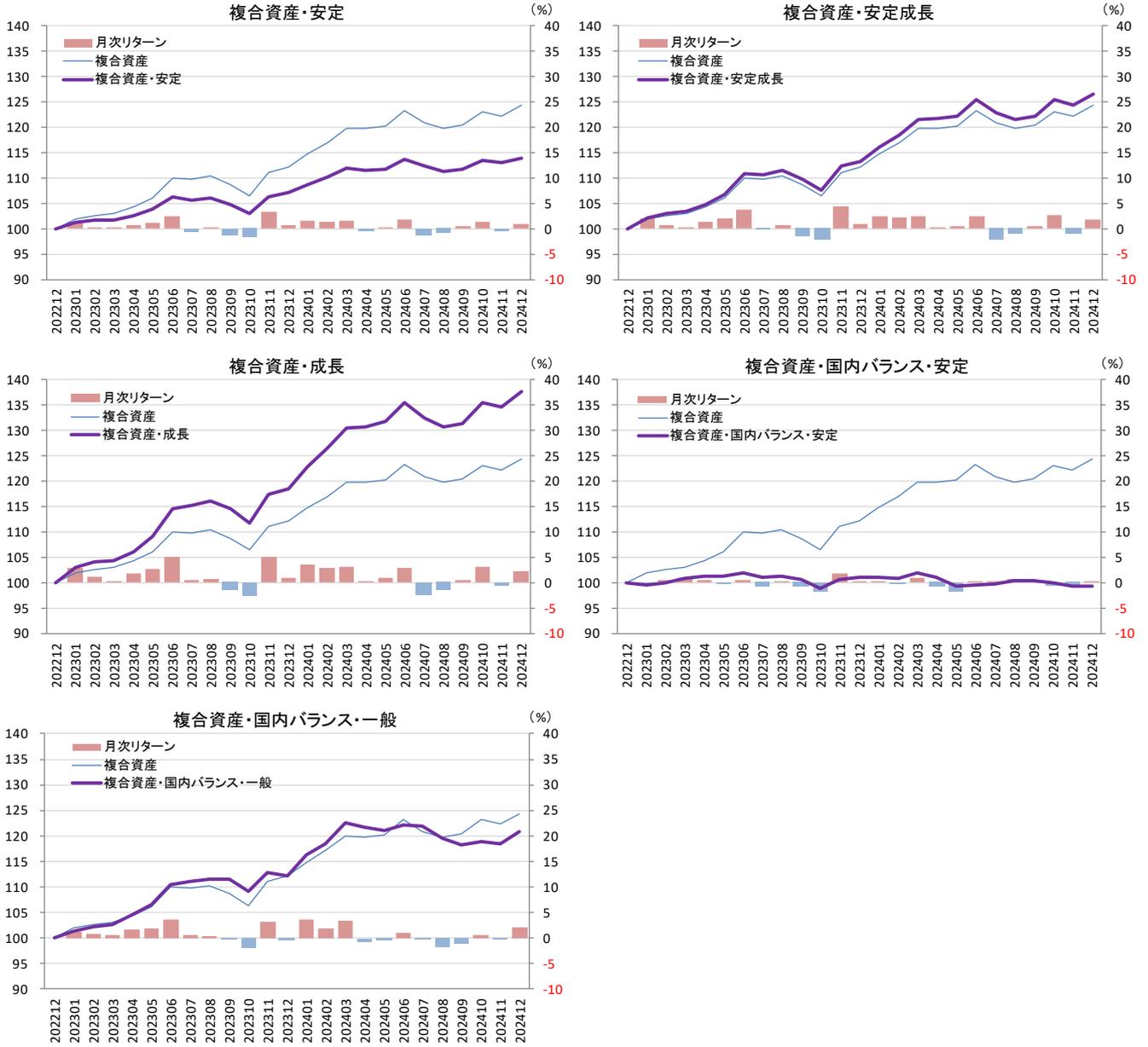


<1>パフォーマンス・サマリー

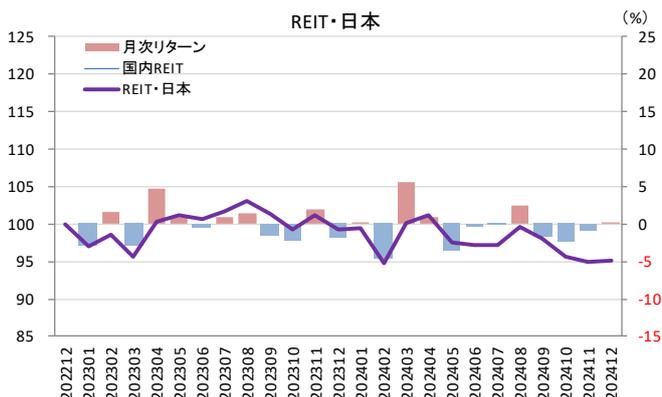
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

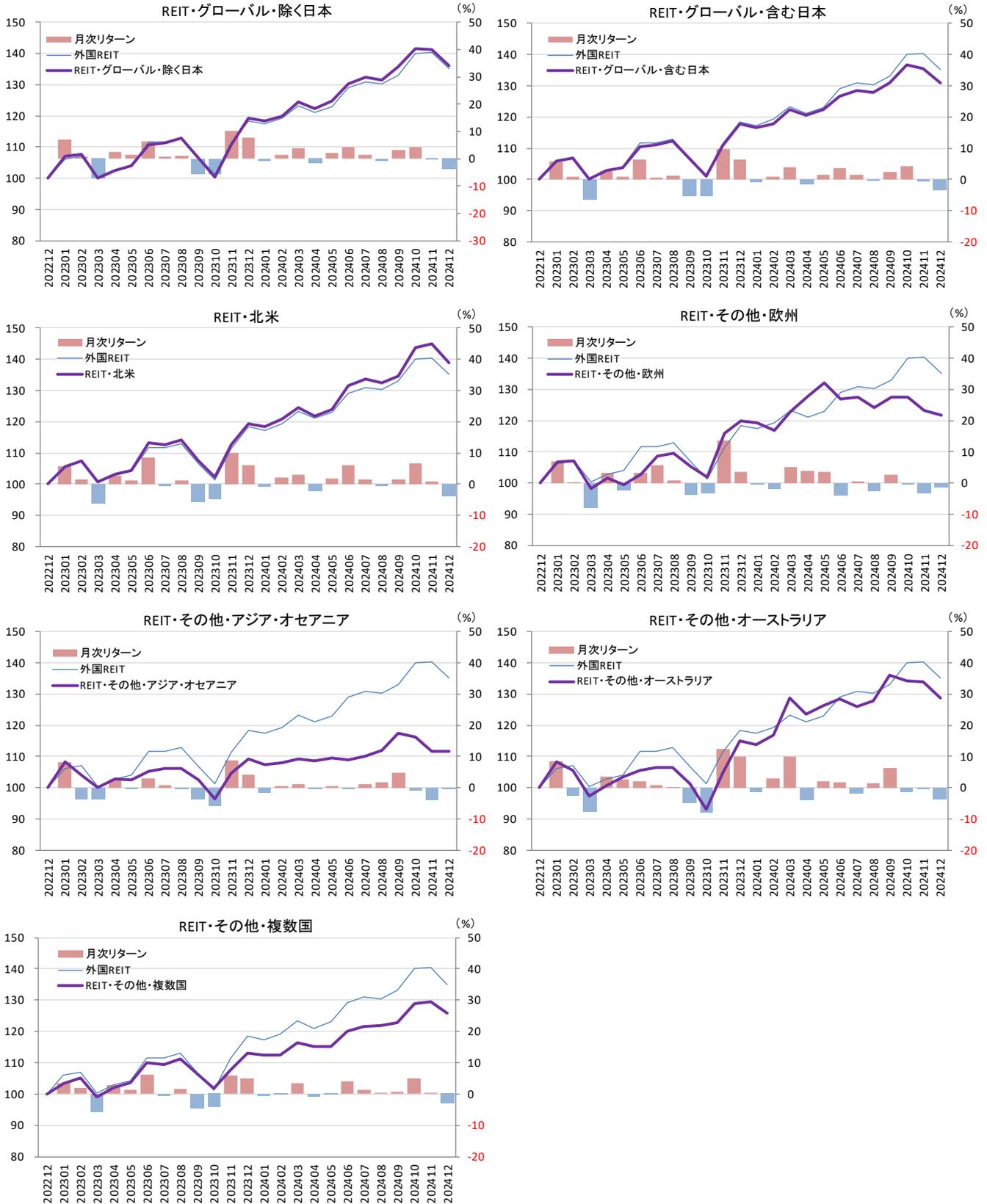


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

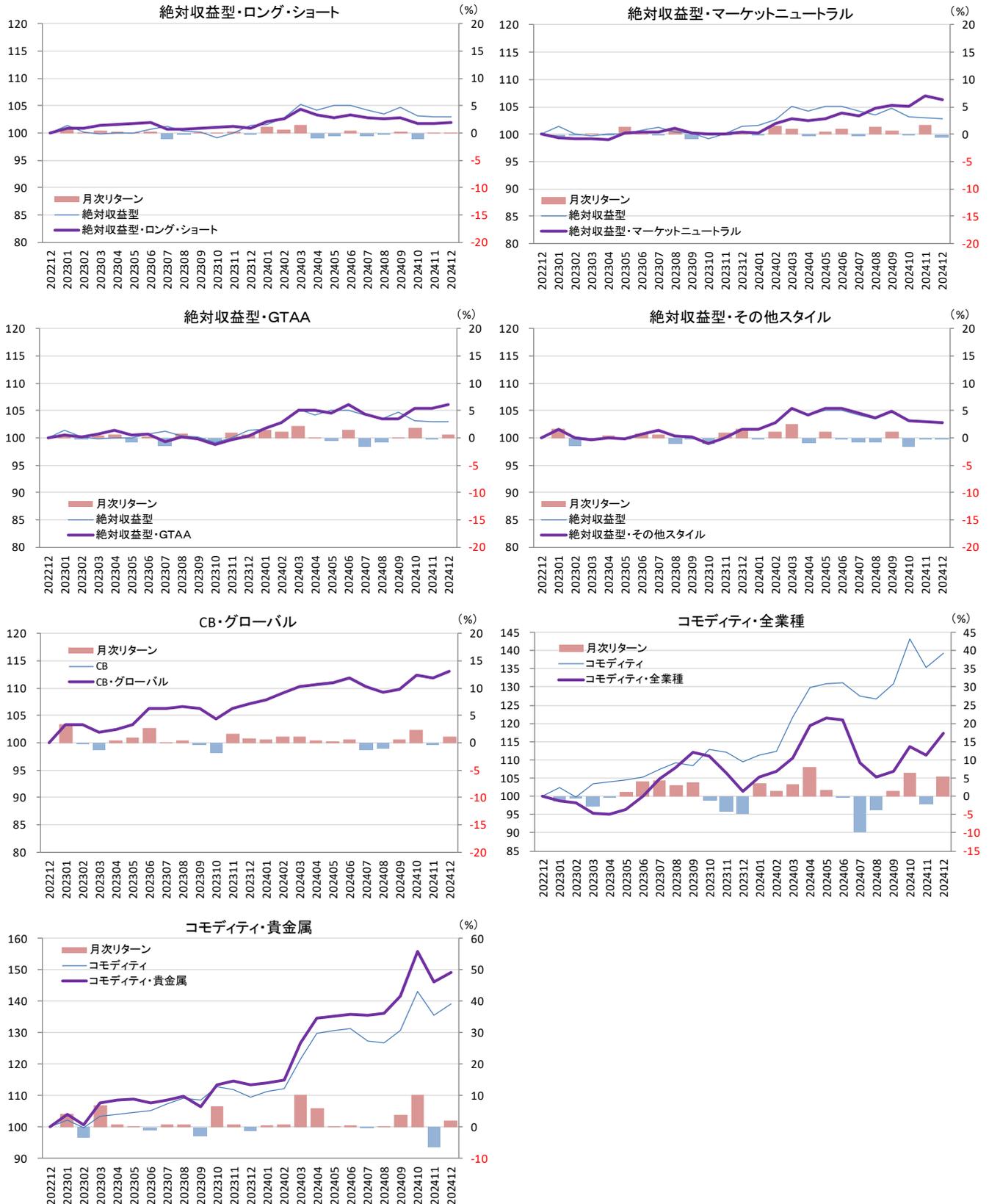


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	2.92		
1	外国株式(先進国)・グローバル	3.43	31.39	1.07
2	外国株式(先進国)・その他	4.56	19.36	0.88
3	国内株式・一般	3.83	6.67	0.25
4	国内株式・その他	4.62	5.04	0.23
5	エマージング株式・その他	3.73	3.35	0.12
6	複合資産・安定成長	1.86	5.76	0.11
7	外国債券(先進国)・グローバル	1.48	6.02	0.09
8	複合資産・成長	2.30	3.14	0.07
9	エマージング株式・グローバル	4.90	0.93	0.04
10	ハイイールド債券・北米	3.50	1.24	0.04
11	複合資産・安定	0.93	2.81	0.03
12	コモディティ	2.80	0.75	0.02
13	エマージング債券・グローバル	2.59	0.47	0.01
14	国内株式・小型	2.17	0.56	0.01
15	外国債券(先進国)・その他	0.93	1.28	0.01
16	エマージング債券・その他	2.35	0.35	0.01
17	ハイイールド債券・グローバル	2.15	0.23	0.01
18	国内株式・業種特化	3.38	0.12	0.00
19	ハイイールド債券・その他	2.34	0.12	0.00
20	CB	1.13	0.18	0.00
21	複合資産・国内バランス	0.51	0.38	0.00
22	エマージング株式・BRICS	3.04	0.03	0.00
23	REIT・日本	0.05	1.51	-0.00
24	絶対収益型	-0.10	0.88	-0.00
25	REIT・その他	-1.15	0.16	-0.00
26	国内債券・一般	-0.09	3.22	-0.00
27	複合資産・その他	-1.54	0.22	-0.00
28	REIT・グローバル	-3.50	1.44	-0.05
29	REIT・北米	-4.15	1.86	-0.08
	合計		100.00	2.92

◆計算定義

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

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

<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	20.49		
1	外国株式(先進国)・グローバル	28.08	30.37	8.27
2	外国株式(先進国)・その他	37.49	17.23	5.86
3	国内株式・一般	18.56	7.18	1.40
4	国内株式・その他	20.06	5.15	1.10
5	複合資産・安定成長	11.72	5.91	0.72
6	エマージング株式・その他	21.89	3.29	0.61
7	複合資産・成長	16.20	3.12	0.51
8	外国債券(先進国)・グローバル	5.12	6.48	0.35
9	REIT・北米	16.22	1.99	0.31
10	ハイイールド債券・北米	16.41	1.35	0.22
11	複合資産・安定	6.37	3.11	0.22
12	エマージング株式・グローバル	20.27	1.05	0.20
13	REIT・グローバル	12.44	1.54	0.19
14	コモディティ	27.18	0.66	0.16
15	外国債券(先進国)・その他	5.14	1.43	0.08
16	エマージング債券・グローバル	10.84	0.55	0.06
17	国内株式・小型	7.10	0.61	0.05
18	国内株式・業種特化	29.67	0.11	0.03
19	ハイイールド債券・グローバル	11.60	0.23	0.03
20	エマージング債券・その他	4.39	0.41	0.03
21	複合資産・その他	5.71	0.25	0.02
22	ハイイールド債券・その他	11.01	0.14	0.02
23	絶対収益型	1.44	0.98	0.01
24	CB	5.65	0.22	0.01
25	REIT・その他	4.98	0.20	0.01
26	エマージング株式・BRICS	12.43	0.04	0.01
27	複合資産・国内バランス	-0.14	0.46	0.00
28	REIT・日本	-4.20	1.88	-0.07
29	国内債券・一般	-2.38	3.49	-0.08
	合計		100.00	20.49

◆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と
また、上表の「構成比(%)」は期間中の平均値

＜2＞リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別①

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	29.84	59.79	77.89	11.73	11.99	10.80	0.77	0.82	0.55
国内株式	38.33	71.24	126.35	12.69	14.35	15.14	0.90	0.79	0.56
一般	37.11	69.71	116.15	12.19	13.80	15.07	0.91	0.81	0.53
フリー	33.58	67.22	111.71	12.78	14.13	15.39	0.79	0.77	0.51
バリュー	49.85	77.21	130.02	10.64	13.25	14.37	1.35	0.92	0.61
小型	4.15	31.42	117.29	14.77	17.49	16.57	0.09	0.32	0.49
その他	46.47	80.18	148.09	13.40	15.02	15.32	1.01	0.83	0.62
日経225	44.96	81.03	160.90	15.15	16.57	16.18	0.87	0.76	0.62
TOPIX	49.59	80.25	141.56	11.46	13.64	14.58	1.25	0.92	0.63
JPX日経400	48.97	80.55	133.33	11.89	14.03	14.55	1.19	0.89	0.61
国内債券	-8.07	-8.67	-4.14	2.58	2.29	2.05	-1.08	-0.78	-0.20
一般	-8.07	-8.67	-4.14	2.58	2.29	2.05	-1.08	-0.78	-0.20
外国株式(先進国)	44.00	112.50	152.23	17.19	17.49	16.30	0.75	0.93	0.60
グローバル	37.65	101.51	144.90	17.07	17.41	16.14	0.66	0.86	0.58
除く日本	59.95	134.19	202.97	15.16	16.90	16.45	1.12	1.10	0.71
含む日本	30.44	91.16	128.15	17.90	17.92	16.30	0.52	0.77	0.53
その他	57.55	137.46	167.40	17.58	18.01	16.90	0.93	1.05	0.61
北米	99.35	212.83	238.65	16.48 ↑	18.32	18.06	1.57	1.40	0.72
米国	57.58	149.49	196.52	17.82	17.60	17.19	0.92	1.14	0.67
カナダ	26.53	51.83	35.56	11.27	17.66	15.87	0.72	0.49	0.20
欧州	22.27	57.06	85.04	14.03	17.00	15.94	0.49	0.56	0.40
ドイツ	53.29	88.03	96.47	17.36	21.35	20.34	0.88	0.63	0.34
アジア・オセアニア	22.22	37.46	71.27	12.16 ↑	14.30	14.67	0.57	0.46	0.38
オーストラリア	32.32	50.28	60.18	16.64 ↓	23.37	19.73	0.59	0.36	0.25
ニュージーランド	11.59	39.23	120.09	14.19 ↓	16.78	16.66	0.26	0.41	0.49
複合地域	93.94	106.60	48.74	25.17	32.96	27.07	0.98	0.47	0.15
エマージング株式	37.17	70.54	89.33	11.76	17.10	16.19	0.94	0.66	0.41
グローバル	30.70	60.78	80.71	12.87 ↑	16.53	16.48	0.72	0.60	0.37
BRICS	4.17	10.89	56.42	13.77	19.33	18.80	0.10	0.11	0.24
その他	40.96	77.26	94.48	11.97	17.67	16.45	1.01	0.69	0.42
欧州	-26.77	-24.81	8.11	33.61	32.85	26.87	-0.29	-0.17	0.03
ロシア	-87.92	-85.87	-71.44	59.21	50.34	39.29	-0.85	-0.64	-0.30
アジア・オセアニア	19.99	42.58	51.41	13.82 ↑	16.33	16.10	0.45	0.45	0.26
中国	-14.71	12.21	55.20	22.64 ↑	21.42 ↑	21.72	-0.23	0.11	0.21
インド	64.68	134.67	172.98	14.85	21.97	20.54	1.22	0.85	0.52
インドネシア	16.66	13.77	4.99	15.72	25.17	22.60	0.33	0.10	0.02
フィリピン	9.19	5.76	-12.81	16.76	21.05	18.14	0.18	0.05	-0.07
ベトナム	22.88	104.37	156.90	19.69	26.01	21.81	0.36	0.59	0.45
香港	28.40	13.98	40.97	23.84 ↑	22.43	20.94	0.36	0.12	0.17
中南米	42.00	16.36	28.97	22.90	28.83	26.01	0.54	0.11	0.10
ブラジル	26.08	-20.84	-10.10	25.44	31.36	31.27	0.31	-0.15	-0.03
メキシコ	46.22	61.95	24.63	21.77 ↓	27.48	24.25	0.62	0.37	0.09
中東・アフリカ	30.60	73.82	49.63	15.19	18.05	16.72	0.61	0.65	0.25
トルコ	178.15	136.50	21.21	32.67	33.23	31.38	1.24	0.57	0.06
複合地域	10.43	36.86	35.64	13.40	16.26	15.57	0.25	0.40	0.20

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

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

＜2＞リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別②

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	29.84	59.79	77.89	11.73	11.99	10.80	0.77	0.82	0.55
外国債券(先進国)	6.16	12.63	7.03	5.34	5.24	5.13	0.37	0.46	0.14
グローバル	4.72	10.21	6.67	4.90 ↑	4.62	4.51	0.31	0.42	0.15
除く日本	9.39	16.39	10.26	6.43 ↑	5.45 ↑	5.24	0.47	0.57	0.19
含む日本	0.89	4.87	4.31	3.97	4.59	4.26	0.07	0.21	0.10
その他	12.13	22.21	11.91	7.85	8.08	7.55	0.49	0.51	0.15
北米	2.60	10.62	11.17	6.63	6.38	5.10	0.13	0.32	0.21
米国	9.58	21.29	23.98	8.06	8.37	6.90	0.38	0.47	0.32
カナダ	22.17	33.05	11.50	8.92	8.38 ↑	8.52	0.77	0.70	0.13
欧州	0.44	1.39	-7.46	6.83	5.97	6.22	0.02	0.05	-0.12
イギリス	21.49	31.85	15.04	10.98	9.89	10.06	0.61	0.57	0.14
アジア・オセアニア	14.71	24.33	11.59	9.37	9.95	9.23	0.50	0.45	0.12
オーストラリア	15.10	25.29	12.26	9.31	9.99	9.30	0.51	0.46	0.13
ニュージーランド	11.18	14.39	9.81	10.45	9.70	9.70	0.34	0.28	0.10
複合地域	6.09	17.32	11.73	8.02	6.97 ↑	6.85	0.25	0.47	0.16
エマージング債券	31.56	28.05	31.20	8.13 ↑	10.32	10.48	1.17	0.49	0.26
グローバル	26.54	22.46	25.01	7.87	11.60	11.04	1.04	0.36	0.21
米ドル建て	25.79	22.19	26.31	8.43	12.27	11.45	0.94	0.33	0.21
現地通貨建て	29.88	24.29	17.14	7.38	9.78	10.11	1.23	0.45	0.16
その他	37.14	34.64	37.34	10.14 ↑	10.37	11.07	1.09	0.59	0.29
ロシア	-85.12	-86.36	-77.53	170.98	132.49	94.56	-0.28	-0.25	-0.15
アジア・オセアニア	22.75	25.83	32.05	6.60 ↑	7.42	6.78	1.07	0.63	0.42
中国	25.70	51.30	-	7.41 ↑	6.48 ↑	-	1.07	1.33	-
インド	33.09	51.38	67.15	10.40 ↑	9.86 ↑	9.68	0.96	0.88	0.55
インドネシア	30.92	51.24	61.32	9.85	13.28	13.26	0.95	0.65	0.37
ブラジル	45.76	9.45	15.87	15.57	16.91	18.36	0.86	0.11	0.08
メキシコ	52.37	54.99	36.93	14.09	16.93	15.90	1.07	0.54	0.20
トルコ	-11.79	-56.34	-79.66	24.61	26.00	27.67	-0.17	-0.59	-0.53
複合地域	21.86	15.37	3.50	10.62	11.59	11.36	0.64	0.25	0.03
ハイイールド債券	37.00	48.03	59.18	8.88 ↑	11.53	10.56	1.24	0.71	0.45
グローバル	27.83	32.61	42.71	7.54	11.00	10.33	1.13	0.53	0.35
北米	40.47	56.47	71.48	9.52 ↑	11.64	10.66	1.26	0.80	0.52
その他	27.73	25.76	28.89	8.34	12.39	11.23	1.02	0.38	0.23
欧州	28.60	27.03	28.75	8.80	13.03	11.92	0.99	0.38	0.22
アジア・オセアニア	24.26	19.28	30.61	9.93	12.21	10.39	0.75	0.29	0.26
複合地域	30.66	48.36	53.12	8.86 ↑	9.54 ↑	8.93	1.05	0.86	0.49
複合資産	14.74	27.10	39.39	6.90	7.29	7.00	0.68	0.67	0.48
安定	4.80	11.05	16.18	5.01	5.08	5.00	0.31	0.42	0.30
安定成長	18.02	32.92	46.98	7.24	7.74	7.43	0.78	0.76	0.53
成長	30.04	58.11	88.28	9.06	10.12	10.31	1.01	0.95	0.63
国内バランス	-3.75	-6.98	3.00	3.07	3.87	3.59 ↓	-0.42	-0.37	0.09
安定	-6.33	-10.10	-0.05	2.97	3.75	3.07	-0.73	-0.56	0.00
一般	14.70	28.69	49.85	6.54	7.58	7.91	0.71	0.68	0.52
その他	-12.19	7.24	-	20.20	18.38	-	-0.21	0.08	-

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

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

<2> リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別③

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	29.84	59.79	77.89	11.73	11.99	10.80	0.77	0.82	0.55
国内REIT	-9.26	-7.00	19.59	9.78	14.77	12.04	-0.33	-0.10	0.15
日本	-9.26	-7.00	19.59	9.78	14.77	12.04	-0.33	-0.10	0.15
外国REIT	19.16	52.81	75.74	17.48	19.23	16.40	0.34	0.46	0.35
グローバル	16.61	43.02	57.47	17.18	19.81	16.63	0.30	0.37	0.28
除く日本	18.37	50.78	80.66	17.79	20.55	17.10	0.32	0.42	0.36
含む日本	15.03	39.16	51.56	16.85	19.50	16.44	0.28	0.35	0.26
北米	22.28	66.33	95.65	18.42	19.15	16.75	0.38	0.56	0.42
その他	8.24	19.60	51.55	14.84	19.41	15.84	0.18	0.19	0.27
欧州	-2.35	-2.86	4.49	18.51	21.15	18.33	-0.04	-0.03	0.02
アジア・オセアニア	6.45	14.54	55.51	14.15	17.84	15.03	0.15	0.15	0.30
オーストラリア	13.11	32.79	52.93	22.49	30.26	23.32	0.19	0.19	0.19
複合地域	29.79	22.50	19.88	14.63	24.16	20.08	0.62	0.17	0.09
複数国	11.71	44.35	85.77	14.86	17.22	14.61	0.25	0.44	0.44
その他									
絶対収益型	-5.82	-2.09	-5.03	3.96	3.60	2.89	-0.51	-0.12	-0.17
ロング・ショート	-5.35	-8.48	-11.08	3.11	3.02	3.03	-0.59	-0.58	-0.38
マーケットニュートラル	-2.14	1.06	12.85	3.63 ↓	4.07	4.83	-0.20	0.05	0.25
GTAA	-0.65	10.49	15.69	4.11	4.62	3.62	-0.06	0.44	0.41
その他スタイル	-6.19	-1.96	-6.03	4.32	3.92	3.14	-0.49	-0.10	-0.19
CB	-1.13	13.99	18.52	6.44	8.52	7.53	-0.06	0.31	0.23
アジア・オセアニア	24.94	61.93	90.14	10.05 ↑	12.21	11.49	0.77	0.83	0.58
日本	5.47	5.41	19.94	4.89	5.32	5.31	0.36	0.20	0.35
グローバル	-1.93	13.24	17.72	6.63	8.75	7.64	-0.10	0.29	0.22
コモディティ	62.72	98.10	53.16	12.03 ↑	12.60	12.40	1.46	1.16	0.35
全業種	55.08	98.76	41.29	17.41	19.85	17.25	0.90	0.74	0.20
貴金属	57.46	86.14	88.07	12.72 ↑	13.53	11.95	1.28	0.98	0.55
エネルギー	81.71	131.23	70.45	25.89	35.77	31.65	0.85	0.51	0.17
その他コモディティ	57.80	80.61	43.97	15.88	19.02	16.95	1.03	0.66	0.22

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

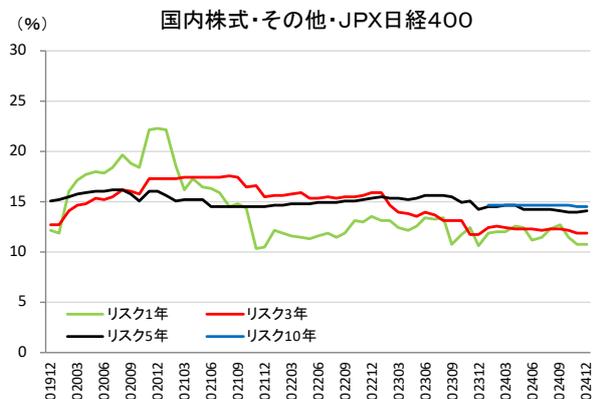
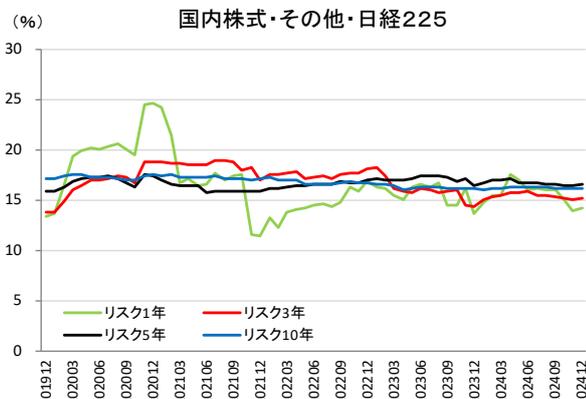
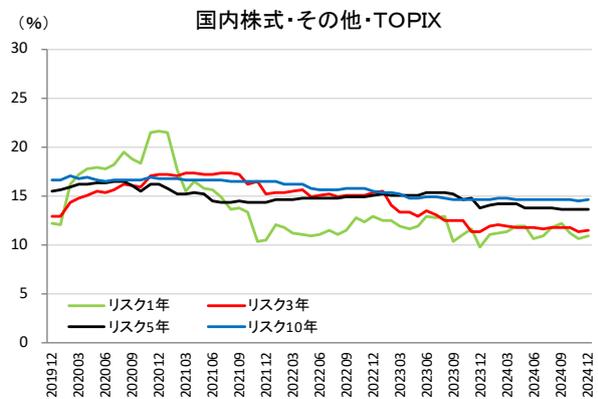
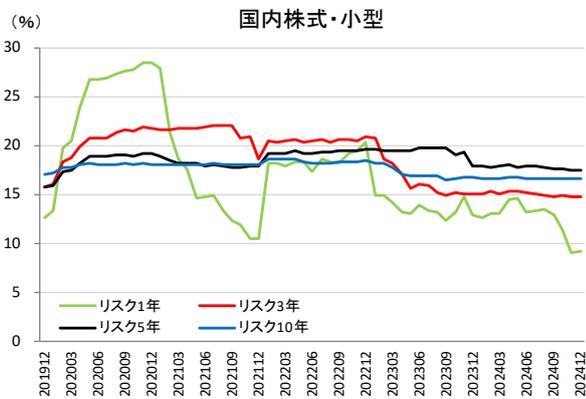
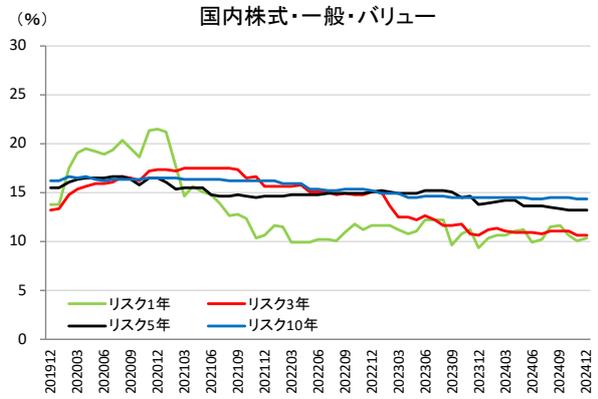
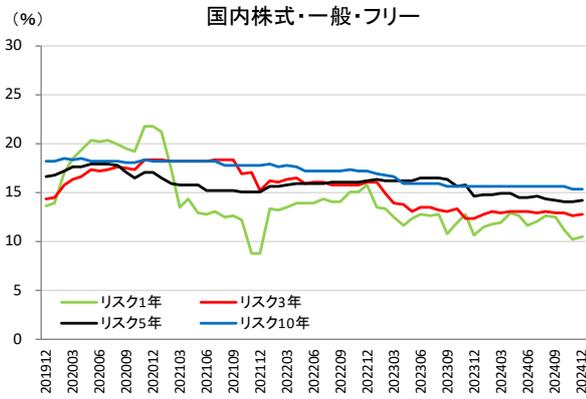
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

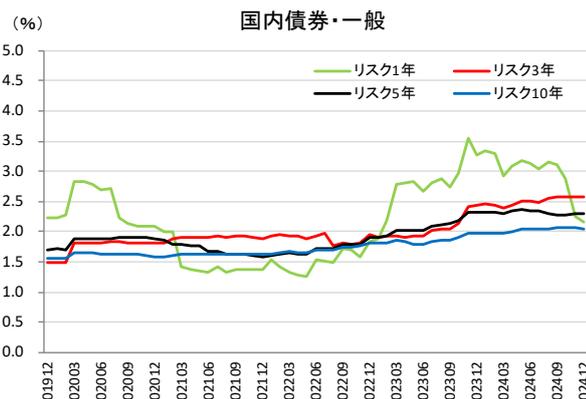
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

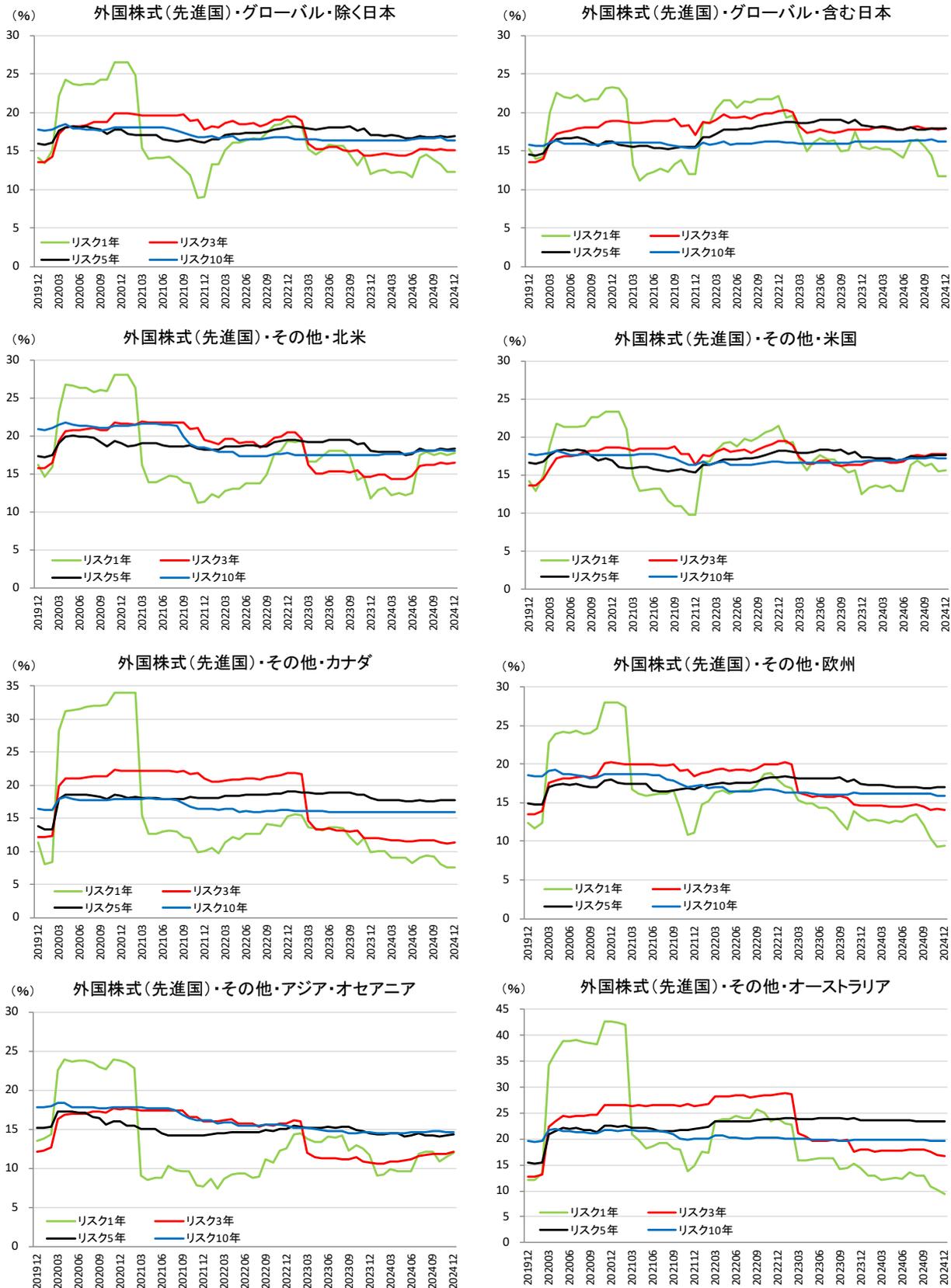


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

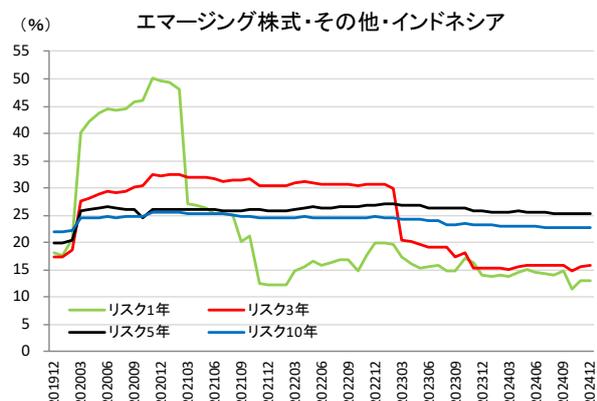
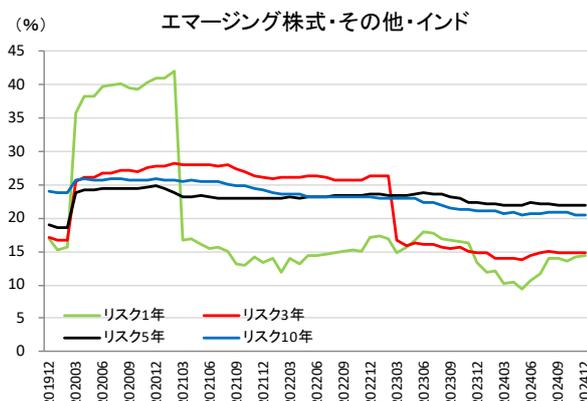
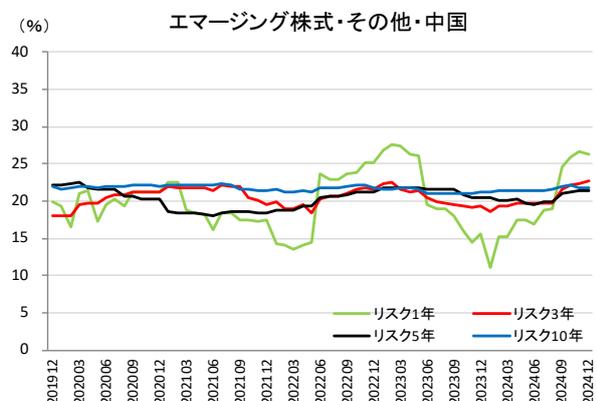
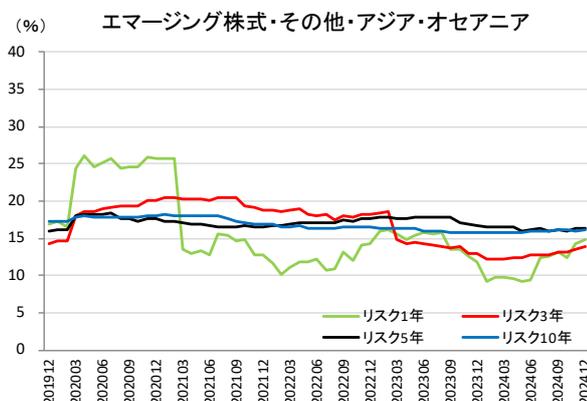
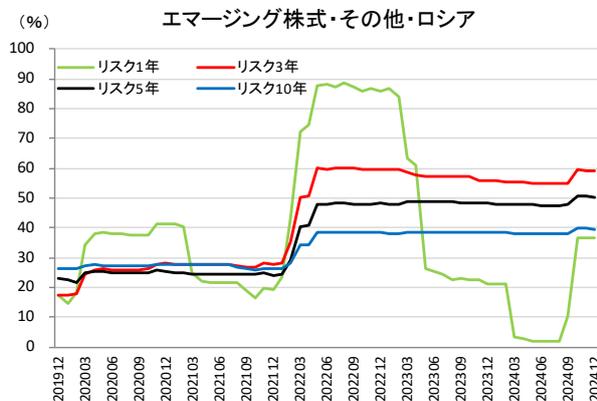
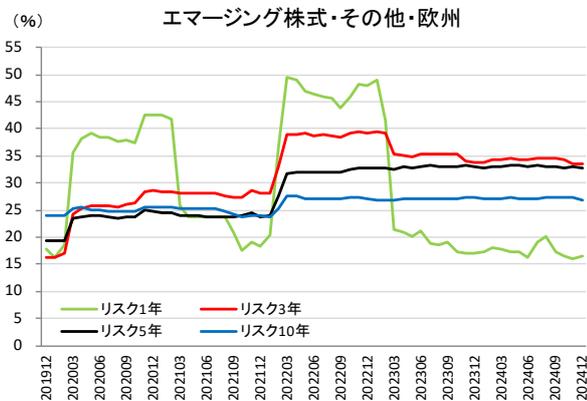
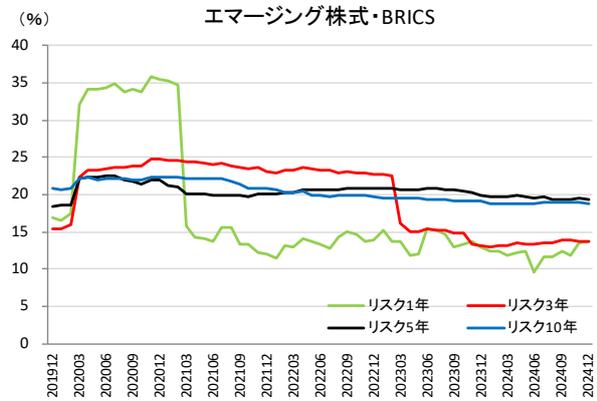
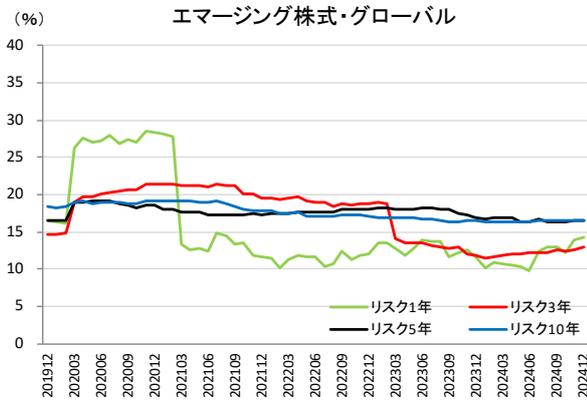


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

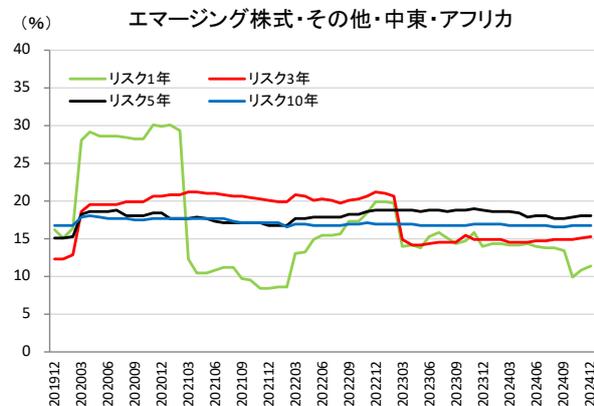
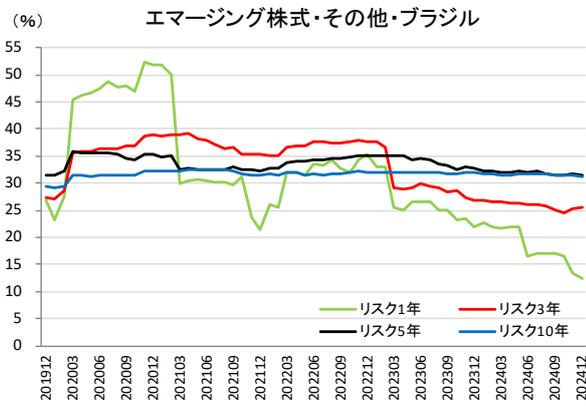
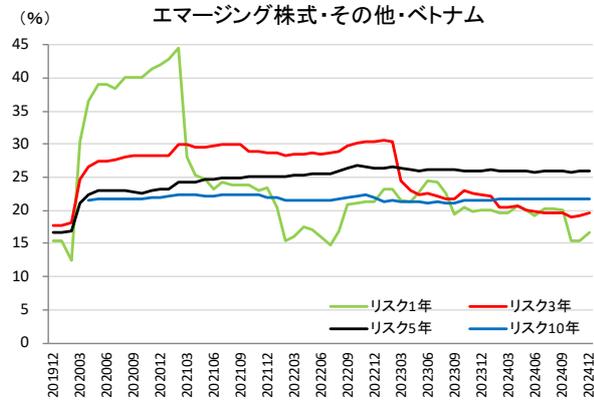
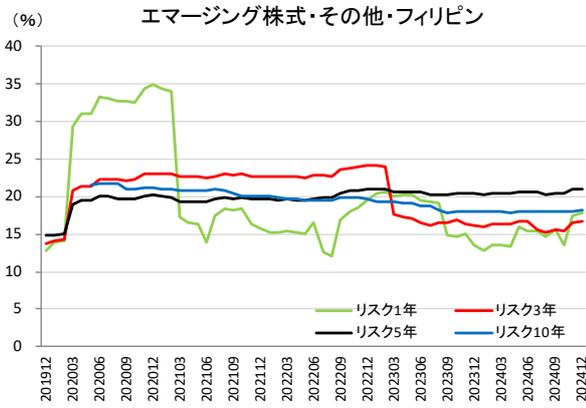


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

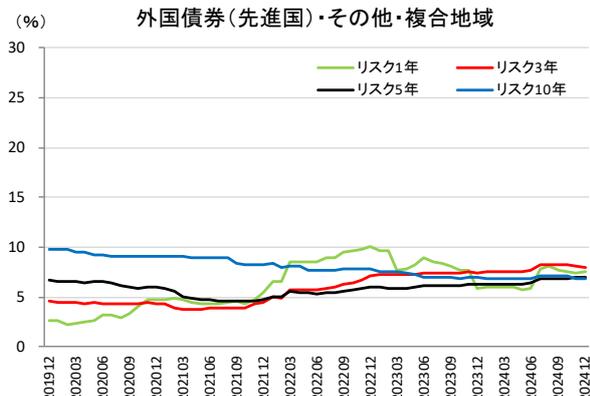
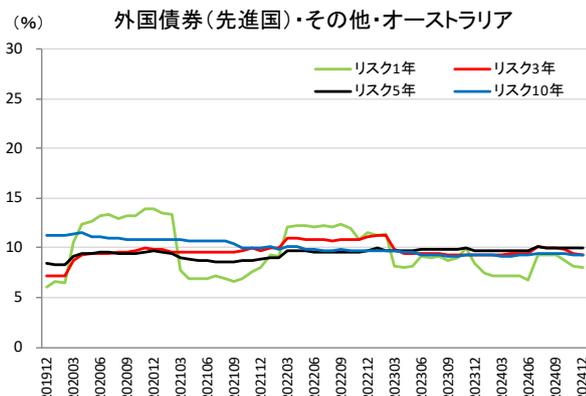
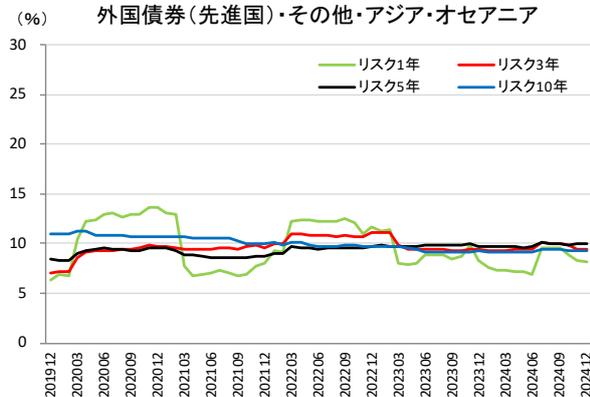
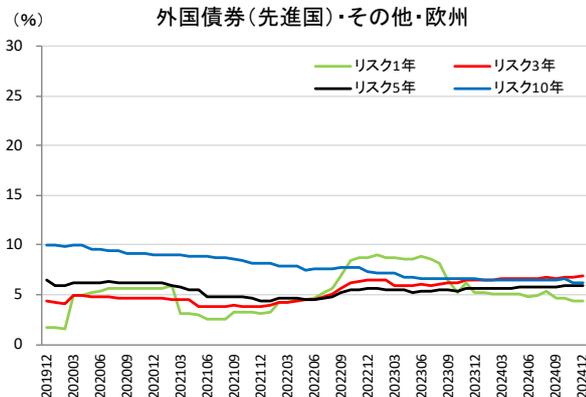
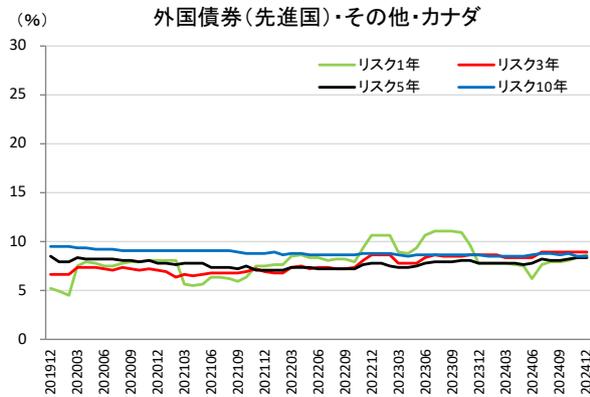
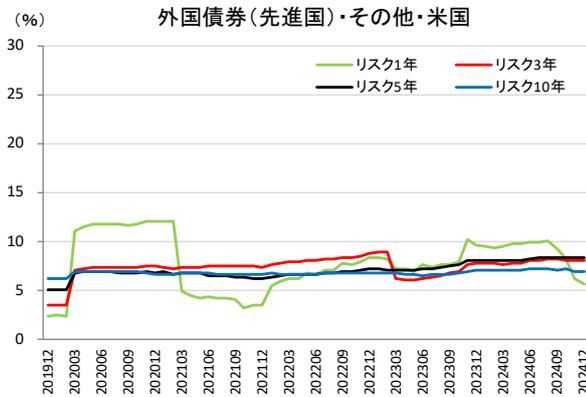
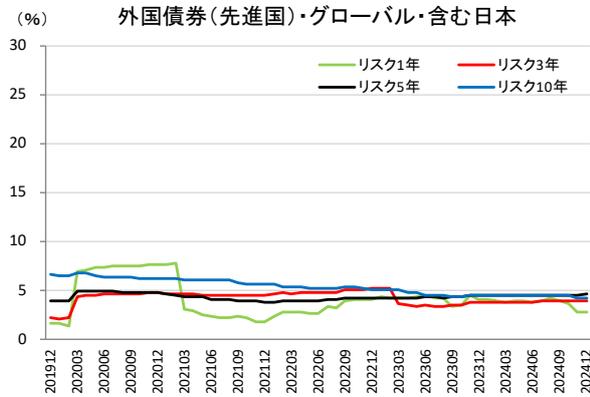
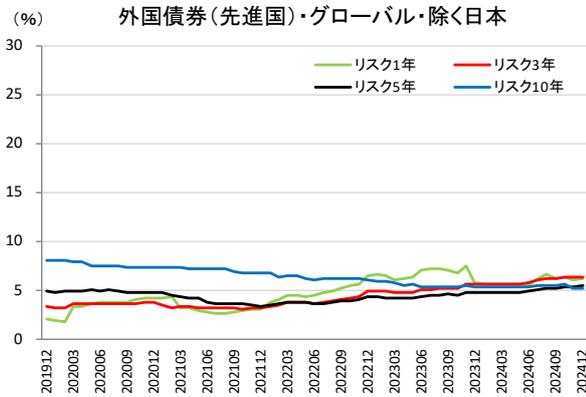


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

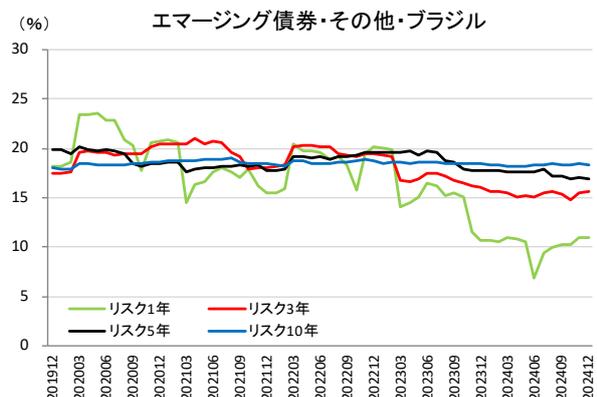
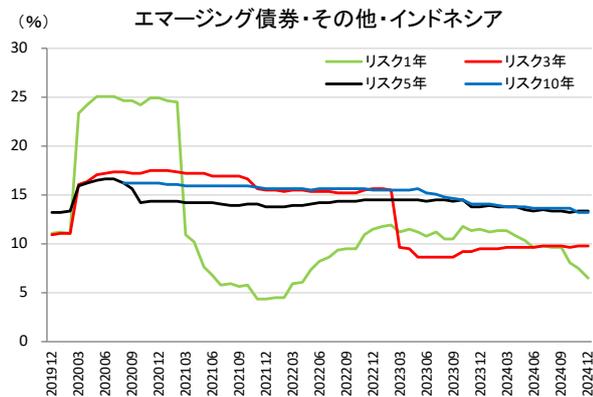
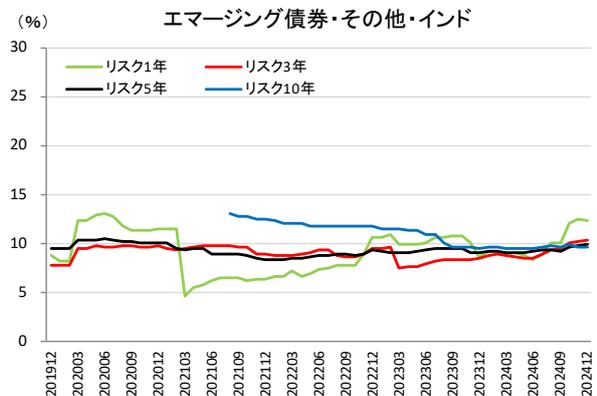
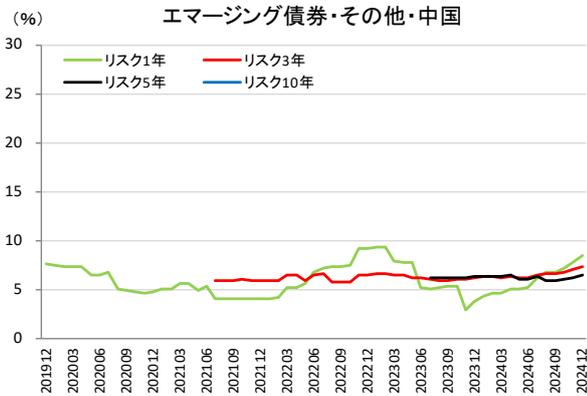
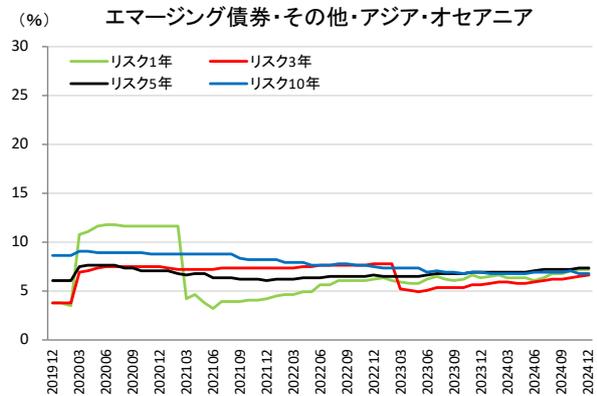
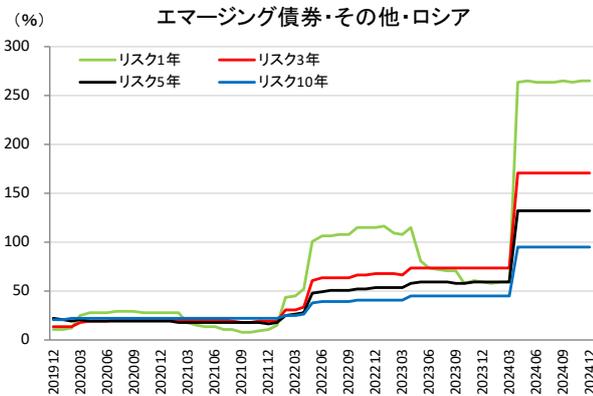
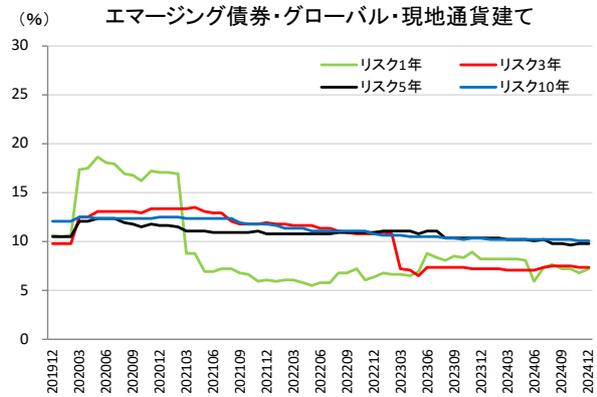
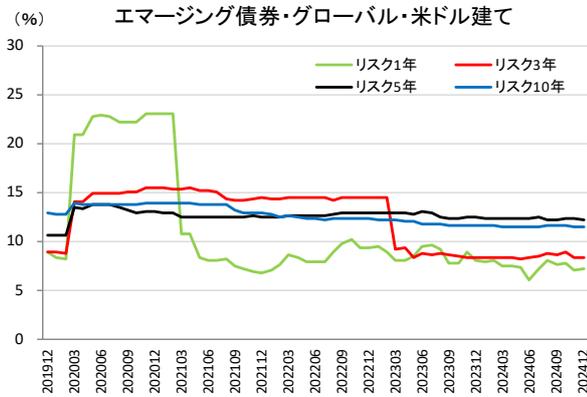


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

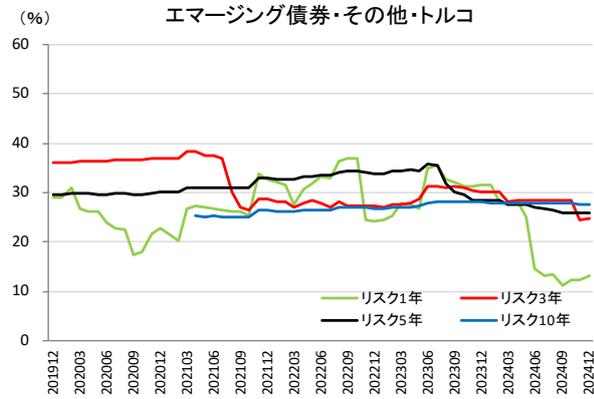
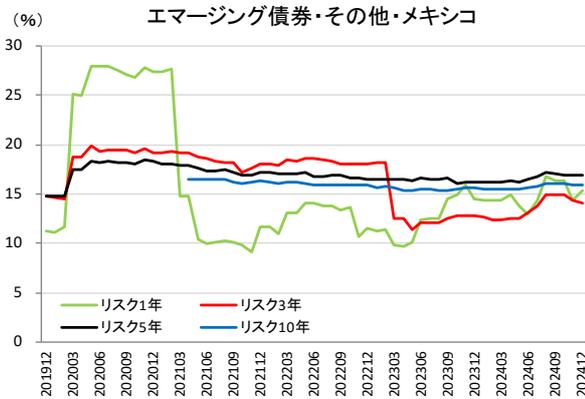


<2> リスク・サマリー

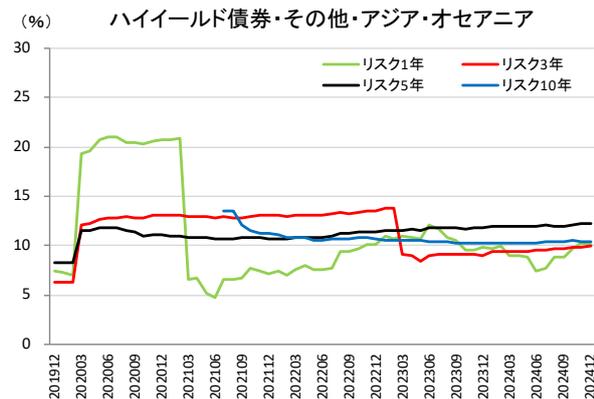
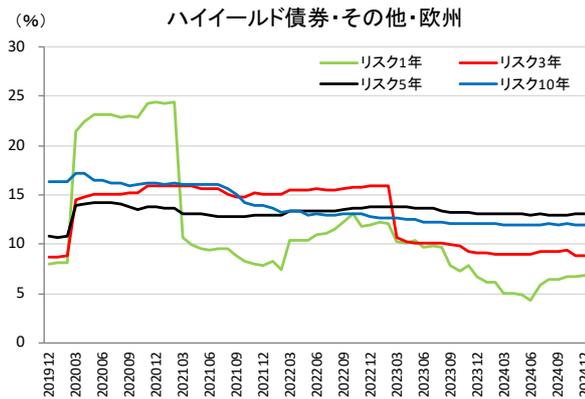
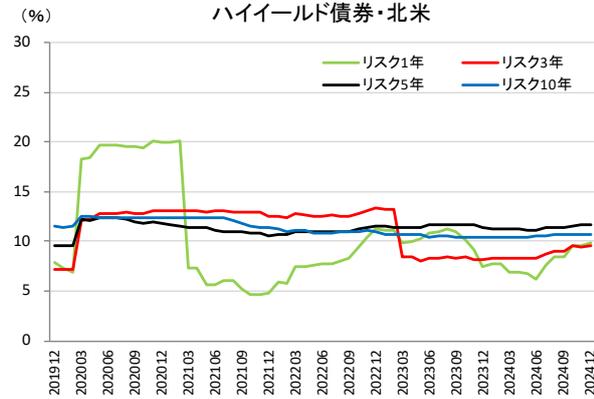
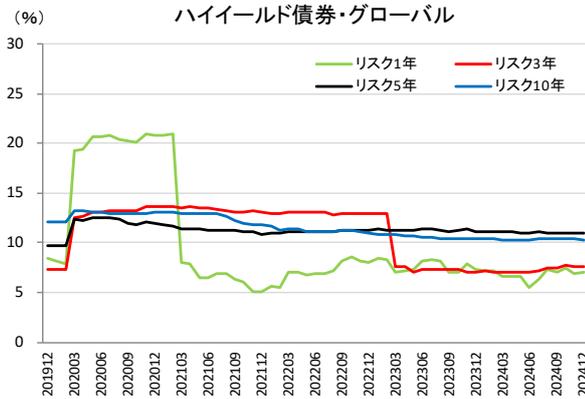
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

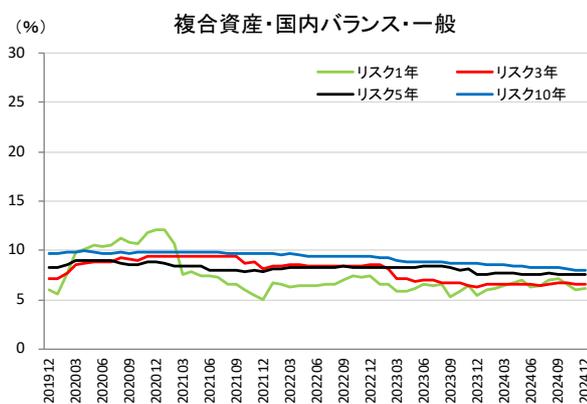
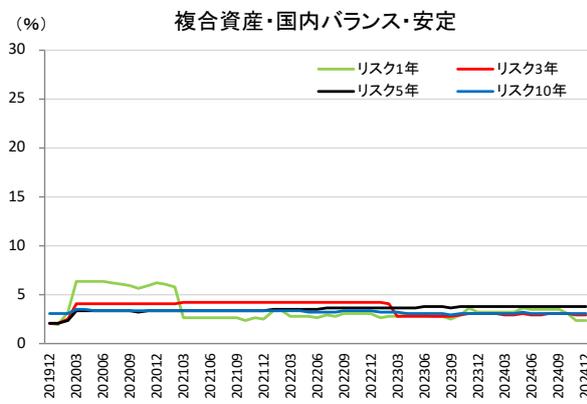
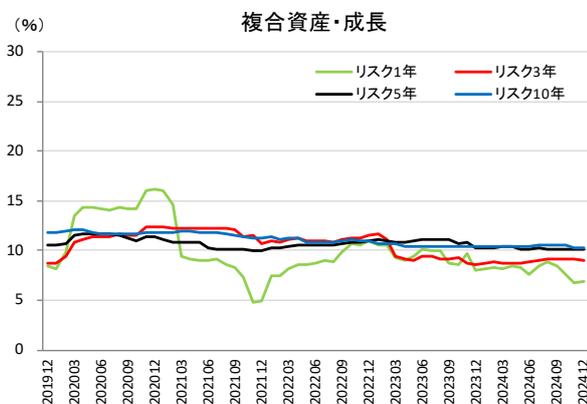
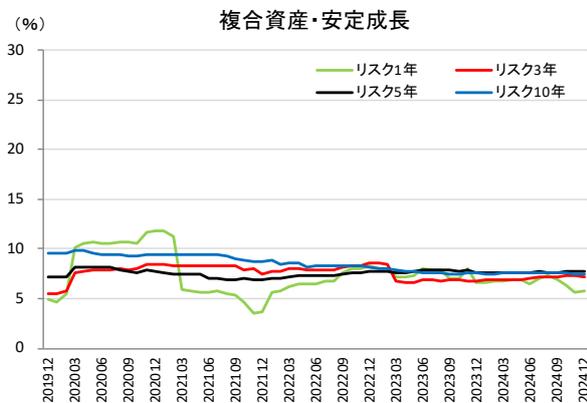
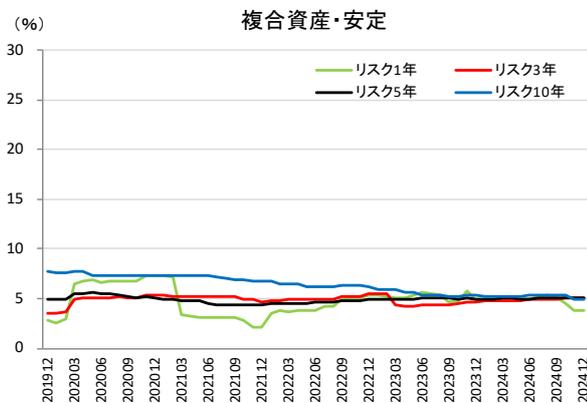


<2> リスク・サマリー

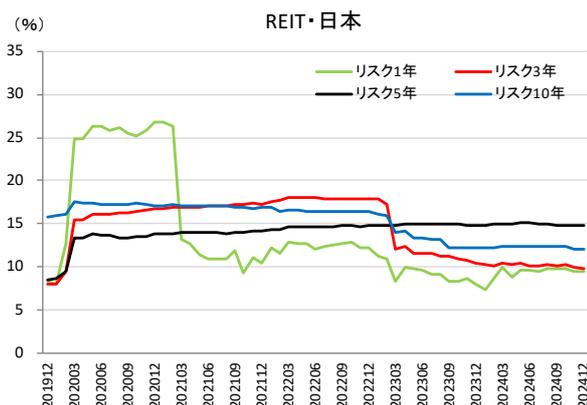
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

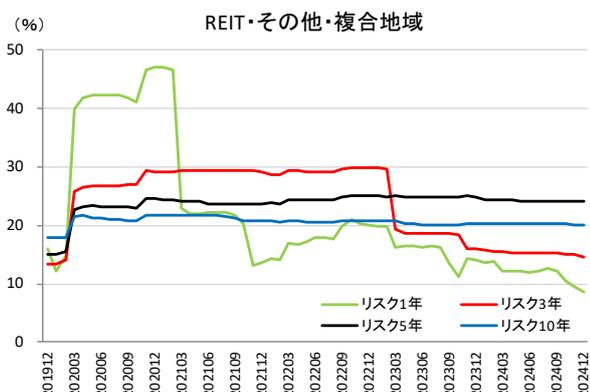
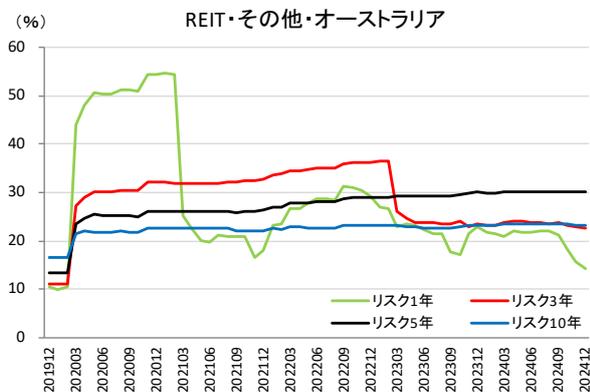
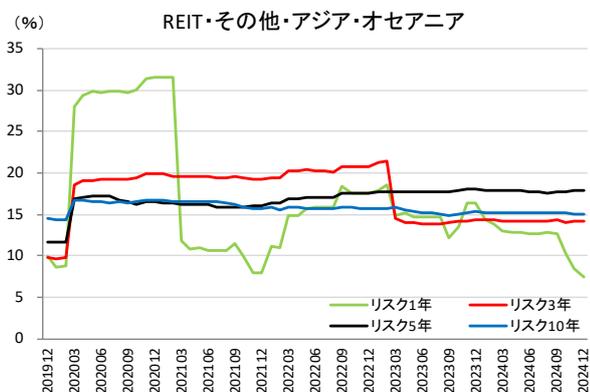
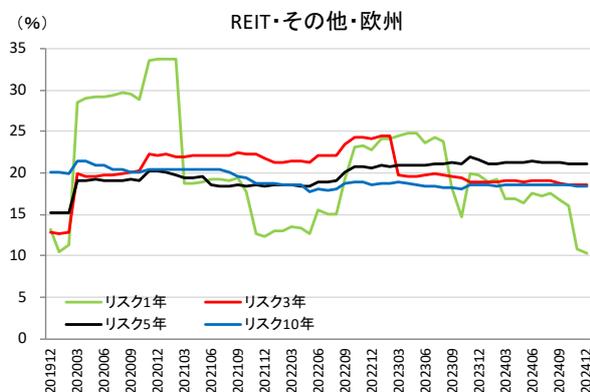
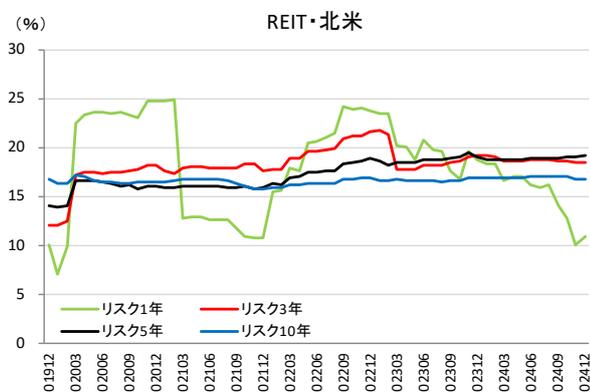
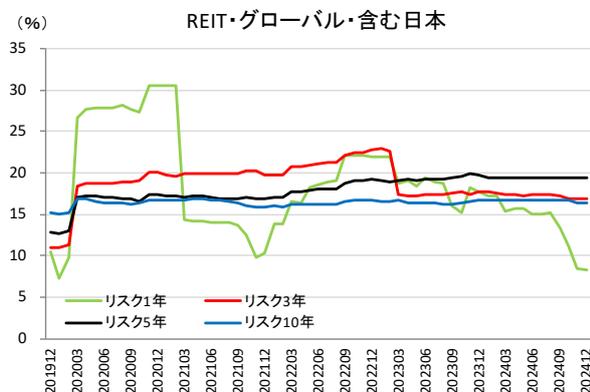
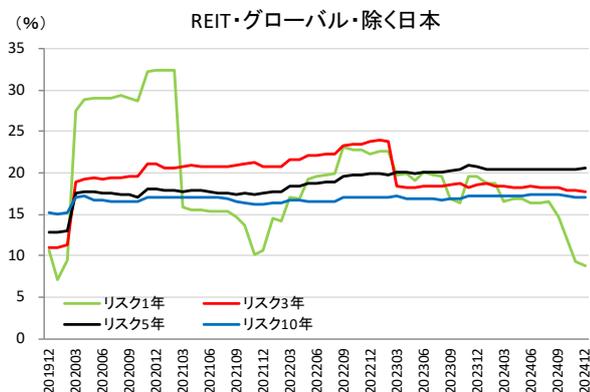


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

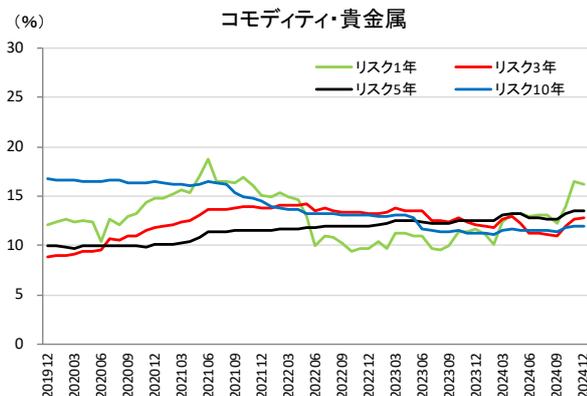
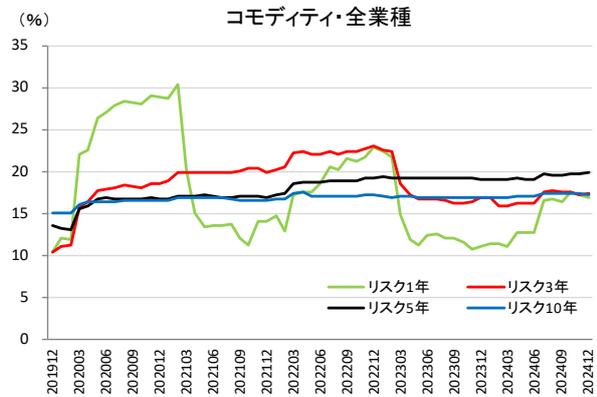
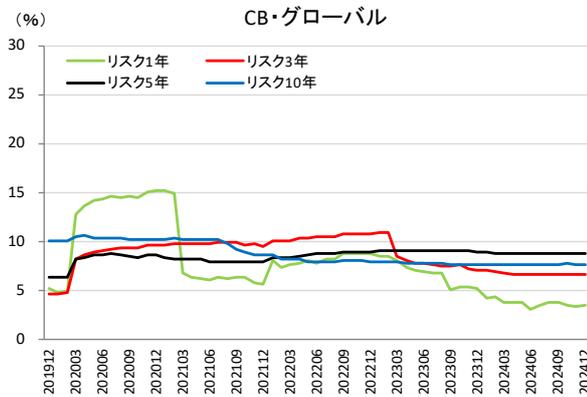
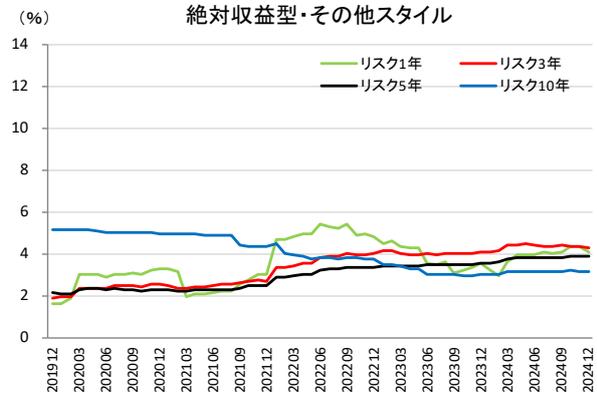
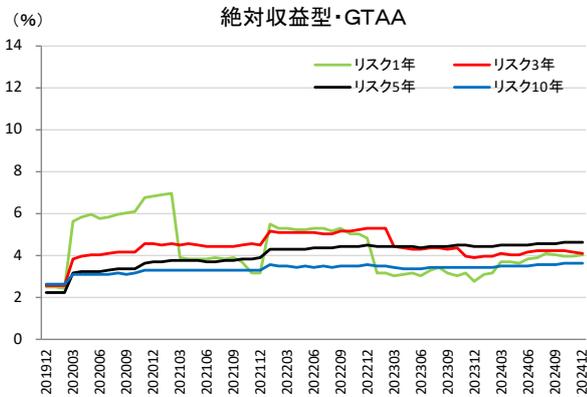
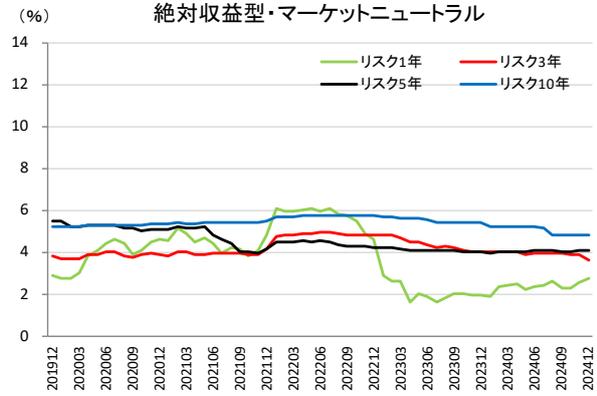
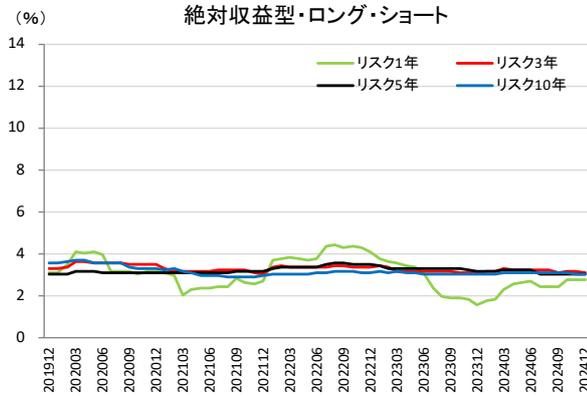


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



< 3 > 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	9,057	27,539	72,166	157,746
国内株式	-1,868	-1,775	3,943	12,612
一般	-608	-1,132	443	3,945
フリー	-403	-608	49	-260
バリュー	-204	-524	393	4,203
小型	-122	-297	73	-54
その他	-1,180	-426	3,244	8,210
日経225	-1,162	-860	861	3,090
TOPIX	21	368	1,610	3,121
JPX日経400	-25	-30	36	63
国内債券	41	875	1,419	2,294
一般	41	875	1,419	2,294
外国株式(先進国)	11,222	26,867	56,494	113,502
グローバル	3,274	9,189	22,720	47,426
除く日本	1,044	3,082	6,472	12,605
含む日本	2,231	6,107	16,245	34,817
その他	7,947	17,679	33,774	66,076
北米	202	494	1,180	3,254
米国	7,800	17,295	32,632	62,846
カナダ	-1	-2	21	14
欧州	-21	-16	73	246
ドイツ	0	-1	-1	0
アジア・オセアニア	1	1	0	0
オーストラリア	-33	-90	-129	-275
ニュージーランド	0	0	0	-1
複合地域	0	-1	-3	-6
エマージング株式	-186	-186	2,928	13,877
グローバル	-81	-86	203	1,651
BRICS	-3	-10	-17	-48
その他	-102	-90	2,742	12,273
欧州	0	0	0	1
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	2	-118	20	-457
中国	-30	-114	-167	-333
インド	-42	211	2,989	13,276
インドネシア	-2	1	11	30
フィリピン	0	-1	-2	-5
ベトナム	-25	-46	-76	-149
香港	0	-1	-2	-4
中南米	0	-1	-3	-9
ブラジル	-4	-14	-25	-64
メキシコ	0	0	-1	1
中東・アフリカ	-1	-4	-6	-18
トルコ	0	-1	-1	-8
複合地域	0	0	4	13

<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別②

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	9,057	27,539	72,166	157,746
外国債券(先進国)	-150	-147	1,690	4,682
グローバル	-32	171	1,967	4,533
除く日本	45	161	1,454	2,956
含む日本	-77	10	527	1,590
その他	-118	-318	-278	149
北米	0	6	24	83
米国	-33	-83	174	1,127
カナダ	-12	-30	-53	-113
欧州	-2	-2	7	35
イギリス	0	0	0	-2
アジア・オセアニア	-12	-42	-91	-202
オーストラリア	-48	-146	-295	-678
ニュージーランド	0	-2	-7	-17
複合地域	-10	-19	-37	-85
エマージング債券	-31	-171	-402	-323
グローバル	27	-20	-245	-115
米ドル建て	-10	-15	-200	-223
現地通貨建て	37	-5	-45	109
その他	-58	-151	-157	-208
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-2	-16	-17	-29
中国	-2	-5	-12	-26
インド	-29	-62	-36	64
インドネシア	-1	-7	7	0
ブラジル	-16	-40	-74	-172
メキシコ	-7	-16	-20	-37
トルコ	-1	-2	-2	-5
複合地域	-1	-2	-2	-4
ハイイールド債券	39	48	324	668
グローバル	7	95	321	339
北米	52	18	140	579
その他	-20	-65	-136	-250
欧州	-16	-50	-98	-189
アジア・オセアニア	-4	-14	-37	-58
複合地域	0	0	-2	-3
複合資産	534	2,708	6,557	11,214
安定	-168	-248	-211	-913
安定成長	368	1,759	4,042	7,708
成長	469	1,353	3,192	5,718
国内バランス	-71	-173	-406	-930
安定	-117	-305	-631	-1,319
一般	-4	-9	-12	-29
その他	-64	17	-61	-369

<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別③

(単位:億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	9,057	27,539	72,166	157,746
国内REIT	-292	-712	-1,414	-1,643
日本	-292	-712	-1,414	-1,643
外国REIT	32	275	-43	-741
グローバル	-36	49	-143	-331
除く日本	0	96	8	256
含む日本	-36	-46	-151	-600
北米	110	346	329	52
その他	-42	-120	-229	-463
欧州	0	-1	-3	-8
アジア・オセアニア	-32	-94	-184	-364
オーストラリア	-6	-19	-31	-68
複合地域	-1	-2	-2	-4
複数国	-2	-5	-9	-19
その他	-285	-246	670	1,603
絶対収益型	-27	-262	-181	261
ロング・ショート	-5	-13	-9	9
マーケットニュートラル	-8	-15	-27	-87
GTAA	-5	-13	-23	-54
その他スタイル	-11	-222	-125	374
CB	-77	-207	-367	-587
アジア・オセアニア	0	-1	-2	-4
日本	0	-1	-1	-2
グローバル	-77	-205	-364	-580
コモディティ	304	794	1,561	2,678
全業種	14	39	84	273
貴金属	292	758	1,477	2,417
エネルギー	-2	-4	-2	-16
その他コモディティ	0	1	1	5

＜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	1,401,473	100.00	5,229	100.00
国内株式	173,185	12.36	757	14.48
一般	93,319	6.66	453	8.66
フリー	64,298	4.59	349	6.67
バリュー	29,021	2.07	104	1.99
小型	7,799	0.56	86	1.64
その他	70,420	5.02	212	4.05
日経225	32,806	2.34	72	1.38
TOPIX	30,238	2.16	85	1.63
JPX日経400	1,054	0.08	12	0.23
国内債券	44,449	3.17	154	2.95
一般	44,449	3.17	154	2.95
外国株式(先進国)	716,994	51.16	1,227	23.47
グローバル	440,669	31.44	849	16.24
除く日本	137,882	9.84	196	3.75
含む日本	302,788	21.60	653	12.49
その他	276,325	19.72	378	7.23
北米	6,246	0.45	12	0.23
米国	265,391	18.94	302	5.78
カナダ	155	0.01	3	0.06
欧州	1,932	0.14	35	0.67
ドイツ	21	0.00	1	0.02
アジア・オセアニア	38	0.00	1	0.02
オーストラリア	2,509	0.18	22	0.42
ニュージーランド	12	0.00	1	0.02
複合地域	22	0.00	1	0.02
エマージング株式	59,865	4.27	304	5.81
グローバル	12,981	0.93	93	1.78
BRICS	451	0.03	7	0.13
その他	46,433	3.31	204	3.90
欧州	112	0.01	6	0.11
ロシア	11	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	4,355	0.31	72	1.38
中国	1,068	0.08	31	0.59
インド	38,506	2.75	48	0.92
インドネシア	205	0.01	6	0.11
フィリピン	22	0.00	3	0.06
ベトナム	1,624	0.12	14	0.27
香港	18	0.00	1	0.02
中南米	45	0.00	2	0.04
ブラジル	298	0.02	9	0.17
メキシコ	8	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	49	0.00	2	0.04
トルコ	46	0.00	1	0.02
複合地域	66	0.00	4	0.08

＜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	1,401,473	100.00	5,229	100.00
外国債券(先進国)	101,317	7.23	720	13.77
グローバル	83,580	5.96	522	9.98
除く日本	39,596	2.83	226	4.32
含む日本	43,985	3.14	296	5.66
その他	17,737	1.27	198	3.79
北米	222	0.02	8	0.15
米国	9,155	0.65	112	2.14
カナダ	558	0.04	3	0.06
欧州	1,087	0.08	22	0.42
イギリス	7	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	1,339	0.10	8	0.15
オーストラリア	4,349	0.31	31	0.59
ニュージーランド	58	0.00	3	0.06
複合地域	961	0.07	7	0.13
エマージング債券	11,267	0.80	189	3.61
グローバル	6,464	0.46	121	2.31
米ドル建て	4,408	0.31	85	1.63
現地通貨建て	2,056	0.15	36	0.69
その他	4,803	0.34	68	1.30
ロシア	11	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	210	0.01	8	0.15
中国	97	0.01	6	0.11
インド	2,853	0.20	16	0.31
インドネシア	329	0.02	6	0.11
ブラジル	1,049	0.07	20	0.38
メキシコ	197	0.01	5	0.10
トルコ	27	0.00	2	0.04
複合地域	30	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	22,329	1.59	210	4.02
グローバル	3,272	0.23	45	0.86
北米	17,427	1.24	105	2.01
その他	1,630	0.12	60	1.15
欧州	1,264	0.09	38	0.73
アジア・オセアニア	329	0.02	21	0.40
複合地域	37	0.00	1	0.02
複合資産	171,644	12.25	1,070	20.46
安定	38,866	2.77	285	5.45
安定成長	80,427	5.74	439	8.40
成長	44,117	3.15	306	5.85
国内バランス	5,225	0.37	26	0.50
安定	3,827	0.27	8	0.15
一般	258	0.02	14	0.27
その他	3,009	0.21	14	0.27

< 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	1,401,473	100.00	5,229	100.00
国内REIT	20,883	1.49	141	2.70
日本	20,883	1.49	141	2.70
外国REIT	47,494	3.39	243	4.65
グローバル	19,797	1.41	147	2.81
除く日本	9,082	0.65	64	1.22
含む日本	10,715	0.76	83	1.59
北米	25,431	1.81	52	0.99
その他	2,266	0.16	44	0.84
欧州	70	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	1,430	0.10	24	0.46
オーストラリア	458	0.03	12	0.23
複合地域	62	0.00	3	0.06
複数国	247	0.02	1	0.02
その他	32,046	2.29	214	4.09
絶対収益型	12,032	0.86	76	1.45
ロング・ショート	835	0.06	22	0.42
マーケットニュートラル	287	0.02	11	0.21
GTAA	290	0.02	9	0.17
その他スタイル	10,530	0.75	33	0.63
CB	2,494	0.18	39	0.75
アジア・オセアニア	33	0.00	1	0.02
日本	27	0.00	1	0.02
グローバル	2,434	0.17	37	0.71
コモディティ	10,666	0.76	40	0.76
全業種	2,296	0.16	13	0.25
貴金属	8,280	0.59	25	0.48
エネルギー	55	0.00	1	0.02
その他コモディティ	35	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	16,562	10.7	2.92	2.76	1.021
国内株式	23,717	14.8	1.61	1.48	0.963
一般	22,401	14.7	2.28	2.12	1.339
フリー	21,886	14.5	1.79	1.65	1.397
バリュー	24,129	15.3	3.42	3.19	1.212
小型	26,161	15.1	1.30	1.21	1.695
その他	25,651	14.8	0.49	0.42	0.368
日経225	27,945	16.8	0.43	0.36	0.418
TOPIX	27,273	16.1	0.11	0.09	0.226
JPX日経400	25,123	10.3	0.48	0.41	0.456
国内債券	10,107	12.6	0.09	0.09	0.466
一般	10,107	12.6	0.09	0.09	0.466
外国株式(先進国)	21,350	8.2	3.74	3.50	1.000
グローバル	21,874	8.3	2.89	2.72	1.102
除く日本	33,799	11.2	0.76	0.69	0.510
含む日本	18,294	7.5	3.87	3.65	1.371
その他	20,174	7.8	5.09	4.75	0.839
北米	20,749	6.7	0.52	0.52	0.703
米国	21,435	7.0	5.18	4.82	0.829
カナダ	7,861	9.3	8.97	8.37	1.881
欧州	16,566	13.3	3.26	3.35	1.250
ドイツ	20,886	10.8	0.00	0.00	0.770
アジア・オセアニア	11,785	18.5	10.70	9.76	1.639
オーストラリア	10,763	9.7	8.31	8.28	1.823
ニュージーランド	18,594	12.4	2.71	2.69	1.672
複合地域	12,032	11.7	13.57	12.47	1.705
エマージング株式	16,022	11.1	3.49	3.14	1.629
グローバル	16,213	9.1	0.69	0.64	0.819
BRICS	17,172	18.6	0.88	0.77	2.052
その他	15,895	11.8	4.24	3.81	1.851
欧州	9,705	18.5	0.53	0.50	1.953
ロシア	1,418	15.6	0.00	0.00	1.224
アジア・オセアニア	17,543	14.2	2.92	2.59	1.700
中国	14,598	10.5	0.84	0.71	1.906
インド	18,463	8.8	4.62	4.14	1.867
インドネシア	11,378	10.1	0.94	1.03	1.775
フィリピン	10,063	11.8	0.39	0.37	1.680
ベトナム	18,978	7.0	2.21	1.97	1.849
香港	16,277	15.3	3.24	2.46	0.858
中南米	9,682	18.0	0.00	0.00	2.039
ブラジル	5,000	13.2	2.74	4.24	1.980
メキシコ	12,413	11.8	1.36	1.61	1.667
中東・アフリカ	16,177	16.8	0.96	0.79	2.229
トルコ	12,858	18.6	3.04	2.33	1.980
複合地域	18,614	8.7	0.48	0.41	0.972

(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	16,562	10.7	2.92	2.76	1.021
外国債券(先進国)	10,893	11.2	1.08	1.05	0.941
グローバル	11,352	11.1	0.93	0.90	0.897
除く日本	12,725	13.7	0.59	0.57	0.680
含む日本	10,303	9.1	1.24	1.21	1.092
その他	9,685	11.4	1.82	1.76	1.150
北米	10,767	8.4	1.76	1.72	1.082
米国	10,488	8.9	1.78	1.68	1.072
カナダ	8,786	15.1	1.48	1.42	1.378
欧州	7,846	17.6	1.22	1.19	0.971
イギリス	7,324	9.5	3.73	3.54	1.395
アジア・オセアニア	10,384	15.3	2.29	2.26	1.425
オーストラリア	8,798	15.5	1.93	1.90	1.238
ニュージーランド	10,101	10.8	1.46	1.45	1.405
複合地域	6,053	14.7	2.00	1.98	1.194
エマージング債券	10,618	12.5	3.36	3.31	1.322
グローバル	11,196	13.1	1.88	1.78	1.081
米ドル建て	10,988	13.8	2.16	2.00	1.246
現地通貨建て	11,687	11.6	1.27	1.30	0.727
その他	9,590	11.5	5.35	5.37	1.647
ロシア	2,128	12.0	0.00	0.00	1.595
アジア・オセアニア	10,406	10.6	6.87	6.56	1.632
中国	13,541	6.1	1.64	1.44	1.268
インド	11,015	10.3	6.07	5.71	1.707
インドネシア	10,220	12.2	5.27	5.19	1.667
ブラジル	9,406	14.6	3.83	4.91	1.586
メキシコ	9,213	7.4	4.29	4.78	1.364
トルコ	1,466	12.2	5.46	5.42	1.474
複合地域	4,432	18.3	1.40	1.35	1.210
ハイイールド債券	10,108	12.8	4.68	4.27	1.635
グローバル	9,016	11.0	2.67	2.45	1.365
北米	11,690	13.9	4.92	4.45	1.673
その他	8,158	12.4	6.15	5.96	1.767
欧州	8,552	12.0	5.51	5.32	1.740
アジア・オセアニア	7,589	12.7	8.76	8.55	1.868
複合地域	5,145	20.8	5.07	4.66	1.800
複合資産	14,961	10.3	1.08	1.06	0.901
安定	11,993	10.4	1.57	1.53	1.033
安定成長	14,476	10.7	1.15	1.12	0.910
成長	18,760	9.5	0.36	0.34	0.777
国内バランス	13,066	12.2	2.10	2.16	0.966
安定	10,653	13.1	1.72	1.79	0.912
一般	14,623	12.8	1.12	1.05	1.199
その他	11,081	4.4	1.34	1.36	0.628

(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	16,562	10.7	2.92	2.76	1.021
国内REIT	12,991	11.0	6.34	7.59	0.873
日本	12,991	11.0	6.34	7.59	0.873
外国REIT	13,727	10.2	7.20	6.96	1.420
グローバル	15,377	9.8	2.84	2.71	1.146
除く日本	17,670	8.6	1.78	1.75	0.912
含む日本	13,608	10.8	3.74	3.53	1.344
北米	11,864	11.0	10.64	10.28	1.605
その他	10,420	10.7	6.28	6.62	1.733
欧州	4,816	11.8	5.24	5.28	1.924
アジア・オセアニア	10,985	10.0	8.10	8.73	1.796
オーストラリア	11,378	10.2	3.79	3.58	1.682
複合地域	8,773	12.9	0.70	0.66	0.762
複数国	12,724	20.7	2.06	1.89	1.650
その他					
絶対収益型	10,988	7.5	0.04	0.04	1.903
ロング・ショート	10,438	6.6	0.12	0.11	1.733
マーケットニュートラル	10,573	7.5	0.99	0.98	1.233
GTAA	11,974	11.6	0.22	0.22	1.567
その他スタイル	11,181	7.1	0.00	0.00	1.948
CB	12,936	7.8	0.32	0.30	1.194
アジア・オセアニア	11,840	14.5	2.34	2.03	1.823
日本	14,416	25.1	0.71	0.69	0.770
グローバル	12,925	7.2	0.29	0.27	1.190
コモディティ	15,308	7.6	0.06	0.06	0.843
全業種	11,993	11.3	0.29	0.27	1.236
貴金属	16,528	5.3	0.00	0.00	0.734
エネルギー	22,249	15.8	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	20,971	8.3	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