

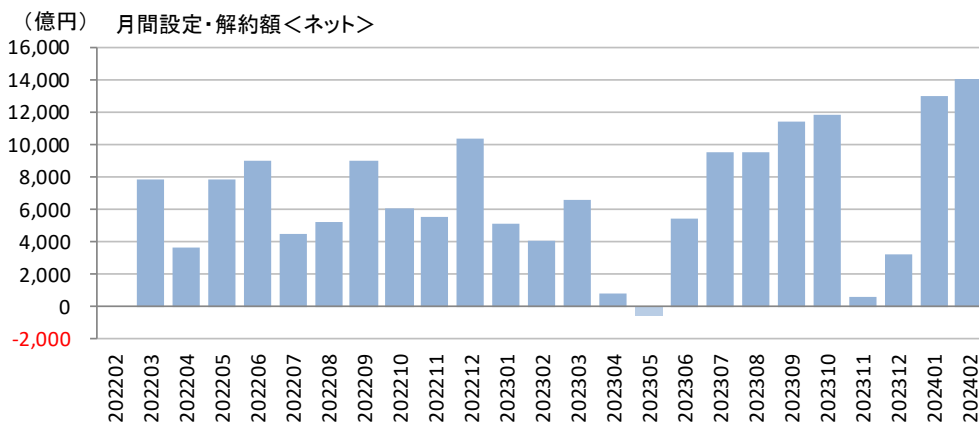
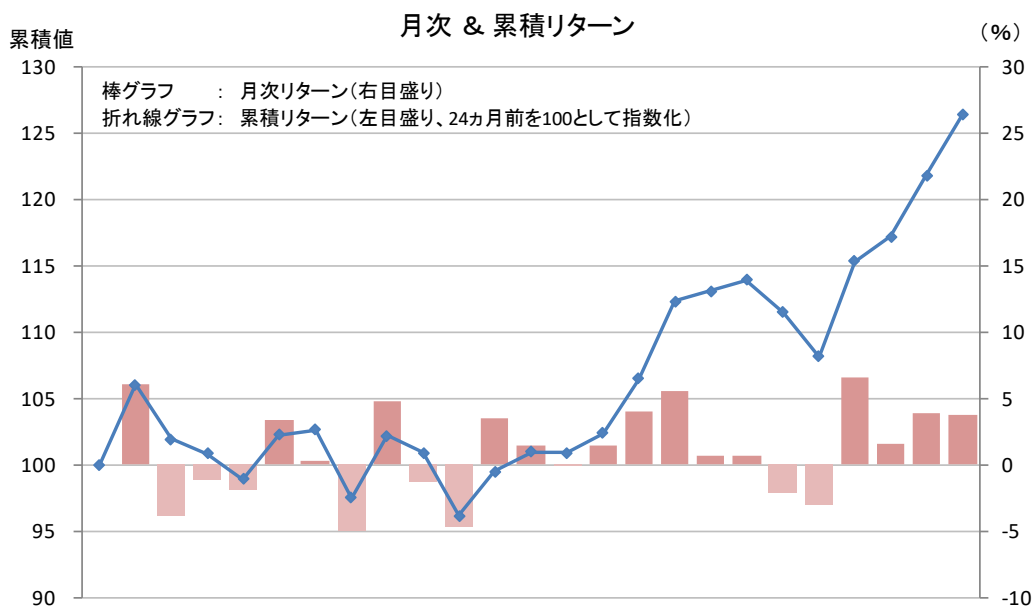
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

— Vol.2 ファンド分類 詳細編 —

2024年2月

「総合」 +3.75 %
(前月 +3.93 %)



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		19,468	18,763	704	3.75	
国内株式		27,111	25,633	1,478	5.77	
一般		26,010	24,705	1,305	5.28	
フリー		24,123	22,867	1,256	5.49	
バリュー		34,897	33,309	1,589	4.77	
小型		46,331	44,365	1,967	4.43	
その他		28,109	26,363	1,747	6.63	
日経225		27,203	25,192	2,010	7.98	
TOPIX		27,201	25,930	1,271	4.90	
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	25,681	24,512	1,170	4.77	
国内債券		12,418	12,384	35	0.28	
一般		12,418	12,384	35	0.28	
外国株式(先進国)		28,001	26,612	1,389	5.22	
グローバル		29,801	28,328	1,474	5.20	
除く日本		47,600	45,389	2,211	4.87	
含む日本		25,993	24,675	1,319	5.34	
その他		23,919	22,725	1,194	5.26	
北米		30,426	28,770	1,655	5.75	
米国		37,301	35,423	1,878	5.30	
カナダ	10,000 (2009.02.27)	23,367	23,111	256	1.11	
欧州		29,369	28,368	1,001	3.53	
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	15,276	14,464	812	5.61	
イギリス	9,683 (2014.05.30)	11,711	11,662	50	0.43	
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	42,953	41,336	1,617	3.91	
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	22,809	22,094	715	3.24	
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	49,956	49,714	241	0.49	
複合地域	10,000 (2013.04.30)	16,014	15,259	755	4.95	
エマージング株式		23,340	22,152	1,188	5.36	
グローバル		22,179	20,918	1,261	6.03	
BRICS	10,000 (2005.09.30)	26,258	25,057	1,201	4.79	
その他		24,897	23,680	1,217	5.14	
欧州		18,731	17,164	1,568	9.13	
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,088	1,082	6	0.57	
アジア・オセアニア		20,369	19,344	1,025	5.30	
中国		34,922	32,077	2,845	8.87	
インド	10,000 (2004.09.30)	68,564	65,412	3,152	4.82	
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	18,637	17,852	786	4.40	
タイ		23,351	22,562	789	3.50	
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,829	8,322	507	6.09	
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	27,331	25,346	1,986	7.84	
韓国	10,000 (1997.06.30)	31,074	30,839	236	0.76	
香港		20,505	19,113	1,391	7.28	
中南米	7,427 (2006.04.28)	13,305	13,051	255	1.95	
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	11,215	10,838	378	3.48	
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	19,223	19,210	13	0.07	
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	14,552	14,092	460	3.26	
トルコ		47,567	44,720	2,847	6.37	
複合地域	10,000 (2005.08.31)	28,657	27,666	991	3.58	

※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		19,468	18,763	704	3.75
外国債券(先進国)		19,510	19,409	101	0.52
グローバル		19,459	19,353	106	0.55
除く日本		21,705	21,524	181	0.84
含む日本		18,003	17,949	54	0.30
その他		19,968	19,888	80	0.40
北米	9,052 (2013.05.31)	11,119	11,158	-39	-0.35
米国		18,436	18,480	-44	-0.24
カナダ	10,000 (2003.05.30)	18,149	18,056	93	0.51
欧州	10,000 (1998.07.31)	14,948	14,818	130	0.87
イギリス	10,069 (2014.07.31)	12,168	12,029	138	1.15
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	22,508	22,292	216	0.97
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	27,864	27,588	276	1.00
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	12,277	12,138	138	1.14
複合地域	10,000 (2001.11.30)	19,772	19,561	211	1.08
エマージング債券		21,872	21,375	496	2.32
グローバル		21,901	21,425	475	2.22
米ドル建て		22,306	21,769	537	2.47
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	15,819	15,571	248	1.59
その他	8,647 (2005.03.31)	17,644	17,221	423	2.46
ロシア	10,000 (2008.05.30)	506	506	-0	-0.07
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	17,003	16,672	331	1.98
中国	13,833 (2018.07.31)	19,533	19,156	377	1.97
インド	10,000 (2011.08.31)	22,708	22,096	611	2.77
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	20,304	19,736	568	2.88
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	17,813	17,484	329	1.88
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	21,868	21,201	667	3.15
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,414	2,440	-27	-1.09
複合地域	10,000 (2006.08.31)	13,072	12,779	294	2.30
ハイイールド債券		30,264	29,675	588	1.98
グローバル	10,000 (1997.06.30)	28,180	27,683	497	1.80
北米		30,712	30,102	610	2.03
その他	10,000 (2004.03.31)	26,928	26,435	493	1.86
欧州	10,000 (2006.04.28)	27,476	27,074	403	1.49
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	16,234	15,719	515	3.27
複合地域	10,000 (2004.03.31)	26,851	26,331	520	1.97
複合資産		21,203	20,782	421	2.03
安定	10,000 (1998.10.30)	16,924	16,702	222	1.33
安定成長		23,641	23,140	501	2.17
成長		30,859	29,962	898	3.00
国内バランス		12,553	12,550	3	0.03
安定		12,534	12,554	-20	-0.16
一般		18,512	18,150	362	1.99
その他	10,000 (2018.10.31)	13,106	13,013	93	0.72

※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		19,468	18,763	704	3.75	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	32,736	34,332	-1,596	-4.65	
日本	10,000 (2003.10.31)	32,736	34,332	-1,596	-4.65	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	37,180	36,580	600	1.64	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	30,709	30,385	324	1.07	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	34,724	34,277	447	1.30	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	30,232	29,966	266	0.89	
北米	10,000 (2003.09.30)	39,603	38,765	838	2.16	
その他	10,000 (2004.04.30)	31,905	31,631	274	0.87	
欧州	10,000 (2006.12.29)	5,667	5,781	-114	-1.98	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	23,142	23,015	127	0.55	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	18,885	18,348	537	2.93	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	8,623	8,417	206	2.45	
複数国	10,000 (2004.04.30)	47,505	47,533	-28	-0.06	
その他		7,289	7,108	181	2.55	
絶対収益型		7,613	7,524	88	1.17	
ロング・ショート		8,315	8,265	50	0.61	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,503	11,323	180	1.59	
GTAA		11,641	11,518	123	1.07	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,149	7,064	86	1.21	
CB		20,918	20,674	244	1.18	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	22,657	21,734	923	4.25	
日本		21,961	21,327	634	2.97	
グローバル		36,468	36,061	407	1.13	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	12,957	12,824	132	1.03	
全業種	10,000 (2004.12.30)	12,027	11,841	186	1.57	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	21,640	21,468	172	0.80	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	10,950	10,771	179	1.66	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	16,771	16,602	168	1.01	

※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	9.57	10.96	25.20	7.83
国内株式	13.04	15.28	35.53	13.20
一般	12.10	13.84	33.28	12.24
フリー	12.30	13.68	32.63	12.33
バリュー	11.62	14.42	35.28	12.05
小型	8.34	6.76	15.54	7.38
その他	15.08	18.69	42.23	15.43
日経225	17.12	20.96	45.12	17.06
TOPIX	12.81	15.89	37.31	13.07
JPX日経400	12.83	15.69	37.25	12.96
国内債券	0.15	-0.10	-0.22	-0.37
一般	0.15	-0.10	-0.22	-0.37
外国株式(先進国)	13.71	15.76	37.03	10.97
グローバル	12.92	14.76	33.74	10.00
除く日本	12.87	14.42	34.67	10.89
含む日本	12.93	14.91	33.36	9.62
その他	15.28	17.76	44.05	12.91
北米	15.59	17.50	42.24	13.89
米国	15.45	18.05	45.20	13.14
カナダ	6.65	5.79	8.98	4.58
欧州	8.99	8.57	20.25	7.20
ドイツ	9.59	12.35	27.43	9.14
イギリス	2.60	4.41	5.00	2.43
アジア・オセアニア	6.39	5.45	9.91	5.81
オーストラリア	9.66	8.42	13.01	3.40
ニュージーランド	5.70	7.11	7.10	1.17
複合地域	5.28	0.45	12.78	8.61
エマーGING株式	9.50	11.27	28.42	8.34
グローバル	7.75	8.25	21.59	7.32
BRICS	3.86	3.57	15.12	4.32
その他	10.30	12.70	31.88	8.82
欧州	11.25	19.76	55.67	10.15
ロシア	0.25	0.47	-19.34	1.12
アジア・オセアニア	5.12	3.94	12.88	5.52
中国	-5.69	-10.31	-14.26	0.84
インド	12.46	17.60	44.72	9.72
インドネシア	4.59	-0.87	10.22	5.57
タイ	0.94	-8.97	-1.57	0.24
フィリピン	9.84	12.46	14.49	10.12
ベトナム	15.38	7.93	36.81	16.56
韓国	-0.96	-6.79	17.91	-3.72
香港	-1.12	-7.67	-6.53	2.40
中南米	4.96	5.76	30.42	-0.07
ブラジル	3.14	8.14	32.68	0.00
メキシコ	12.88	6.88	30.49	4.74
中東・アフリカ	8.41	5.18	16.66	7.35
トルコ	10.35	6.33	25.11	21.85
複合地域	5.74	10.58	14.91	4.91

※[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か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	9.57	10.96	25.20	7.83
外国債券(先進国)	2.59	3.67	8.28	1.45
グローバル	2.48	3.50	8.02	1.59
除く日本	2.80	4.27	11.13	2.03
含む日本	2.21	2.88	5.52	1.22
その他	3.08	4.44	9.46	0.83
北米	3.04	3.86	7.59	1.32
米国	3.78	3.74	8.47	0.48
カナダ	3.26	5.34	13.25	2.26
欧州	2.74	4.41	9.60	1.10
イギリス	4.53	9.04	20.31	2.84
アジア・オセアニア	2.38	5.25	9.79	0.62
オーストラリア	2.37	5.21	9.83	0.77
ニュージーランド	2.93	8.51	12.52	0.20
複合地域	3.07	3.55	11.33	2.89
エマージング債券	4.54	6.52	20.00	5.00
グローバル	4.83	7.27	19.18	4.21
米ドル建て	5.69	8.28	19.25	4.40
現地通貨建て	2.64	4.73	19.12	3.72
その他	4.17	5.58	21.13	6.03
ロシア	-0.72	3.85	-58.88	1.85
アジア・オセアニア	3.82	6.29	11.48	4.85
中国	2.86	5.01	8.01	4.92
インド	4.94	6.16	17.67	7.56
インドネシア	2.01	1.40	12.90	5.46
ブラジル	3.24	5.96	33.08	4.05
メキシコ	5.88	5.74	28.95	5.53
トルコ	0.49	-12.79	-40.10	-1.95
複合地域	3.32	5.07	21.76	4.29
ハイイールド債券	5.54	8.00	18.58	5.52
グローバル	5.07	8.04	17.58	4.74
北米	5.64	7.86	19.17	5.75
その他	5.30	9.09	15.69	4.64
欧州	4.95	8.72	16.54	3.77
アジア・オセアニア	6.59	10.55	12.37	7.89
複合地域	5.20	8.59	19.43	5.60
複合資産	5.41	6.09	13.98	4.36
安定	3.72	3.99	8.40	2.85
安定成長	5.53	6.38	15.10	4.62
成長	7.79	8.95	21.51	6.77
国内バランス	0.65	0.22	2.48	0.53
安定	0.15	-0.47	0.90	-0.10
一般	5.11	6.22	16.01	5.66
その他	7.44	7.45	15.99	-0.61

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

＜1＞パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別③

	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	9.57	10.96	25.20	7.83
国内REIT	-6.28	-8.01	-3.80	-4.46
日本	-6.28	-8.01	-3.80	-4.46
外国REIT	7.08	5.59	11.42	0.66
グローバル	7.04	5.38	10.73	0.14
除く日本	8.14	6.35	11.24	0.52
含む日本	6.24	4.64	10.22	-0.15
北米	7.37	6.01	12.67	1.19
その他	4.73	3.32	5.58	-0.48
欧州	1.02	6.78	9.28	-2.49
アジア・オセアニア	3.08	1.64	3.71	-1.10
オーストラリア	11.83	9.77	10.85	1.70
複合地域	9.91	10.67	15.13	4.45
複数国	4.38	1.14	6.79	-0.44
その他	6.52	8.05	17.94	4.84
絶対収益型	2.70	2.38	2.62	1.27
ロング・ショート	1.45	1.98	1.72	1.75
マーケットニュートラル	1.89	0.82	2.74	1.49
GTAA	3.14	2.72	2.60	2.55
その他スタイル	2.83	2.48	2.72	1.17
CB	2.72	2.29	5.67	1.90
アジア・オセアニア	3.03	3.25	11.41	5.81
日本	6.56	8.26	11.85	5.87
グローバル	2.68	2.22	5.53	1.82
コモディティ	0.26	2.95	12.61	2.65
全業種	0.39	-1.05	8.88	5.31
貴金属	0.20	4.81	14.29	1.42
エネルギー	1.85	3.44	22.62	12.64
その他コモディティ	1.77	0.03	10.31	5.00

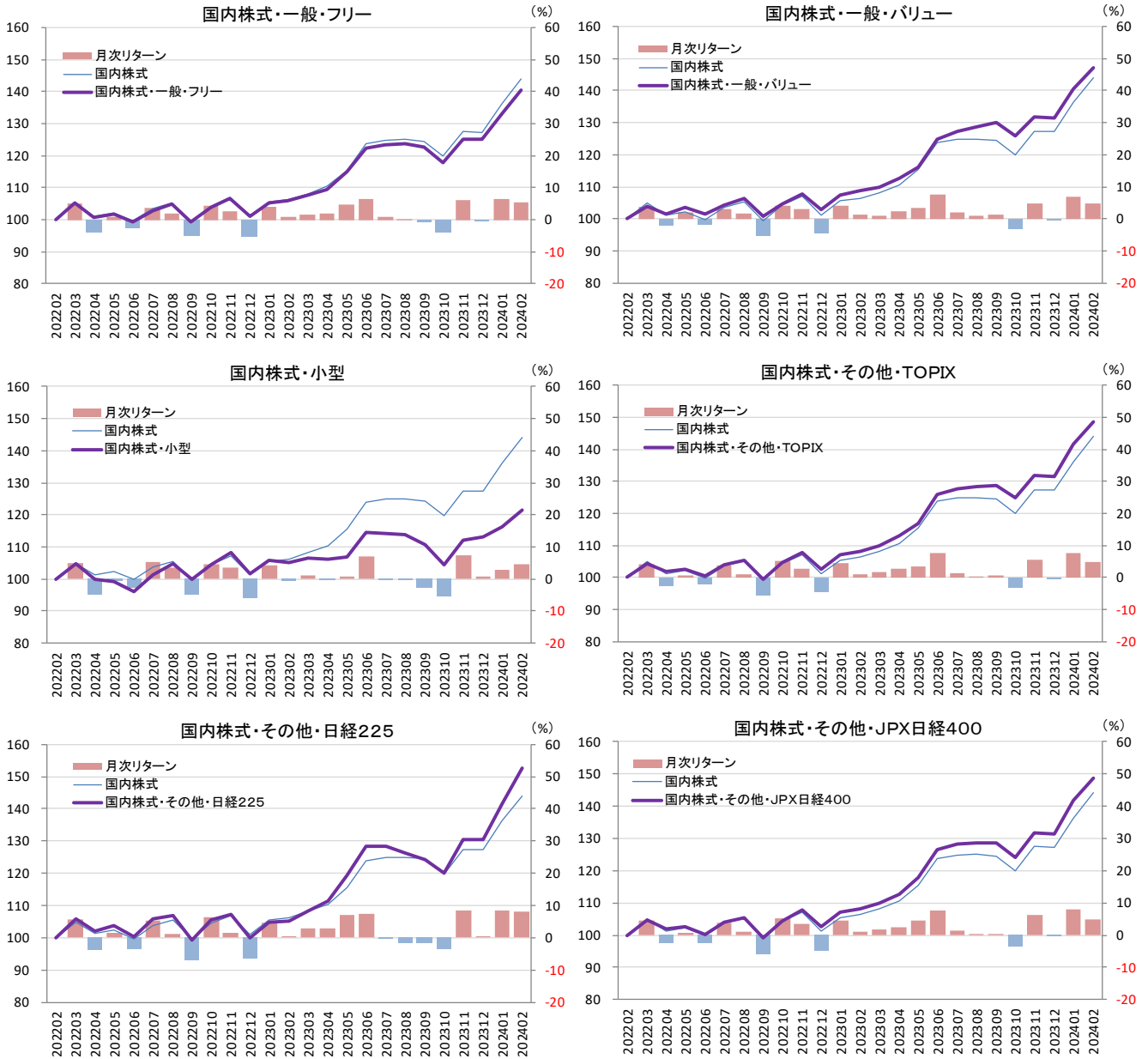
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

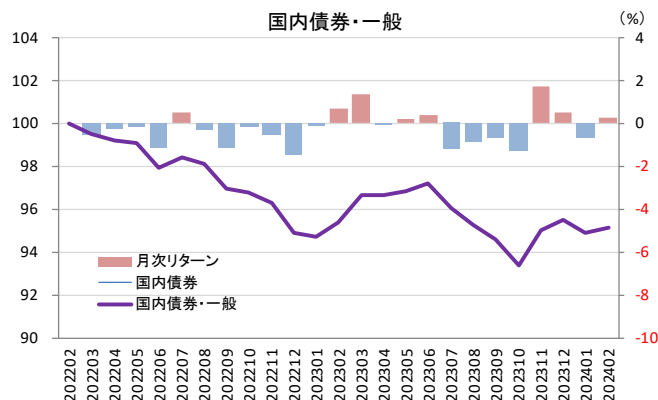
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

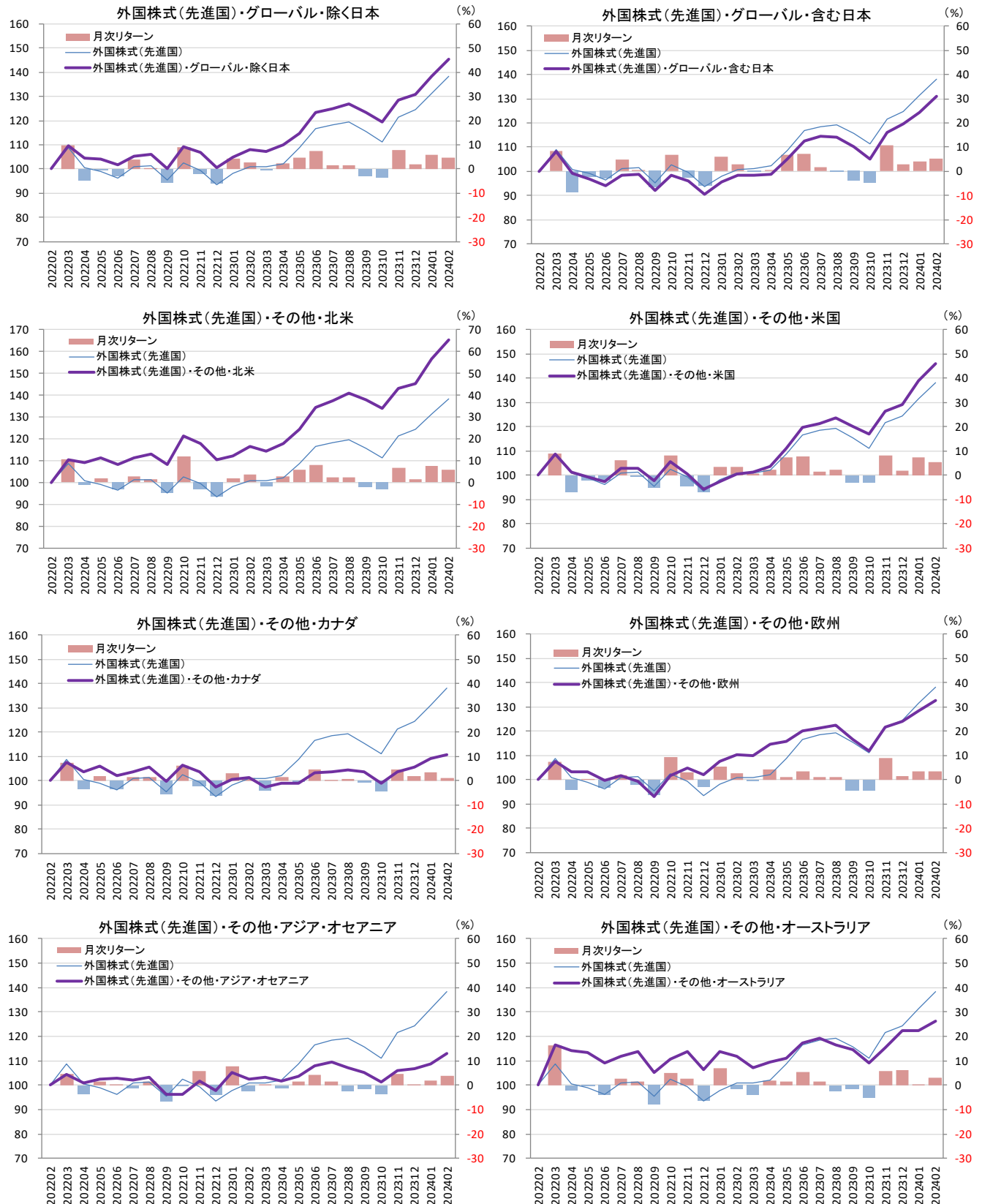


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

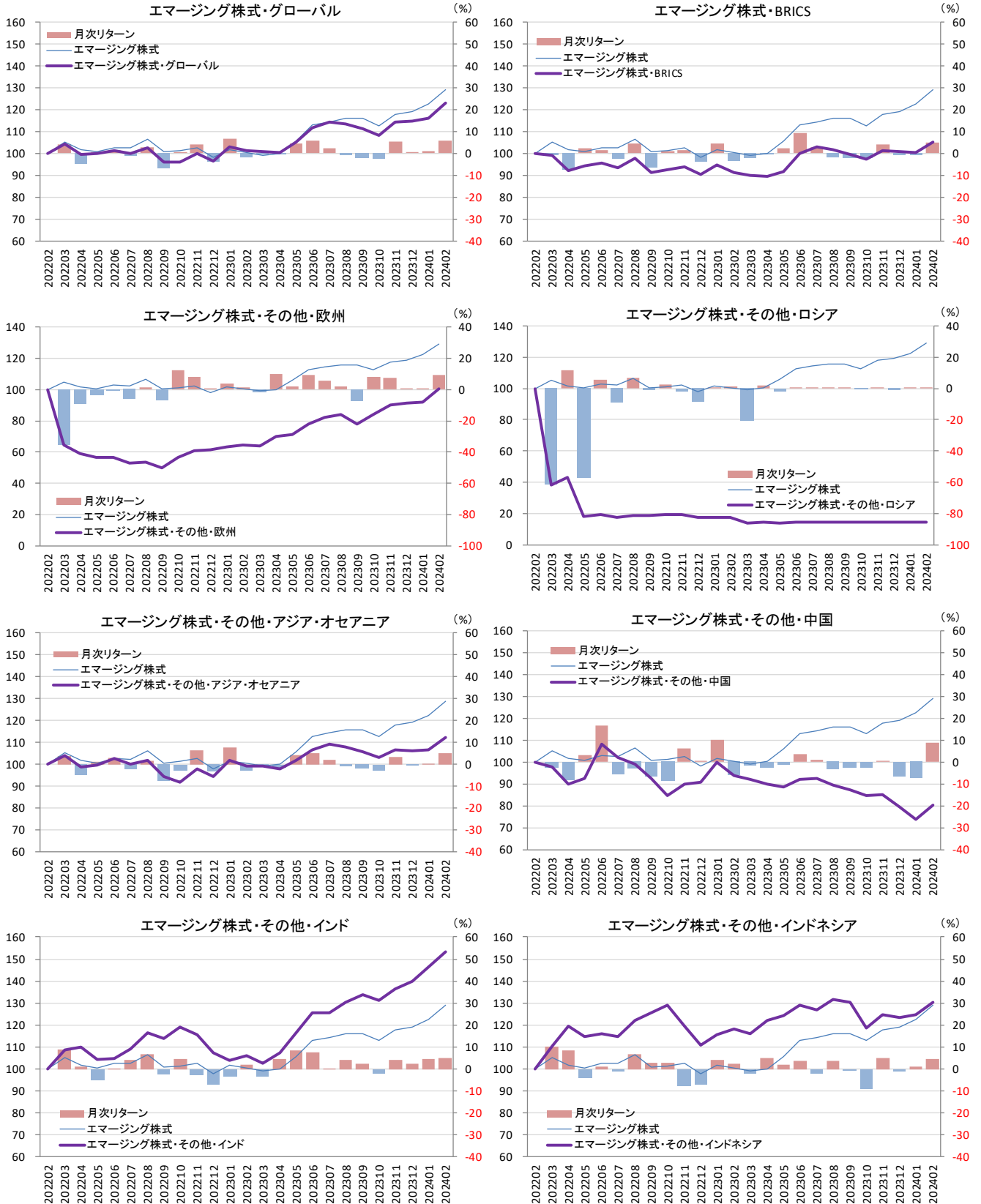


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマージング株式]

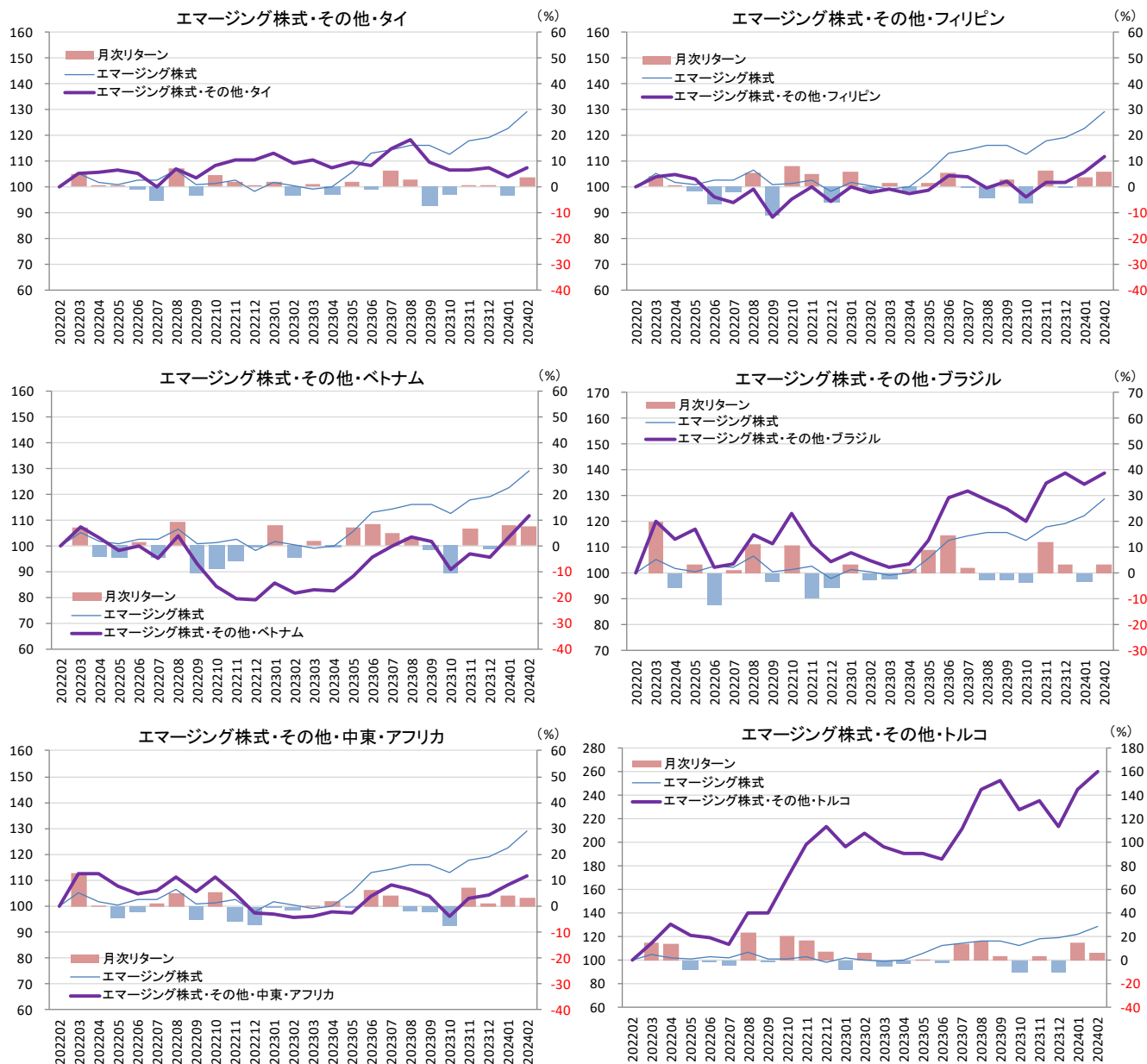


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

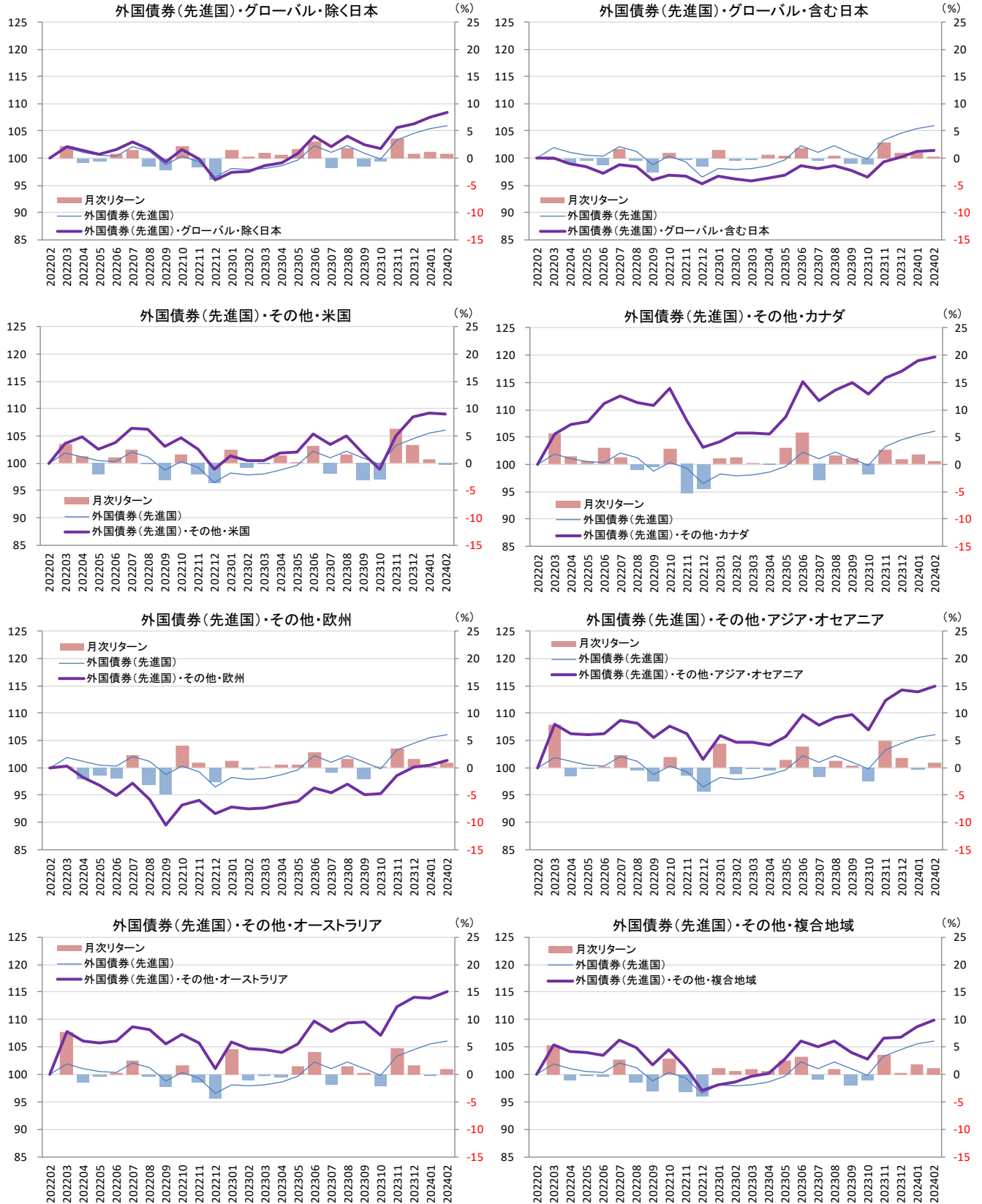


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

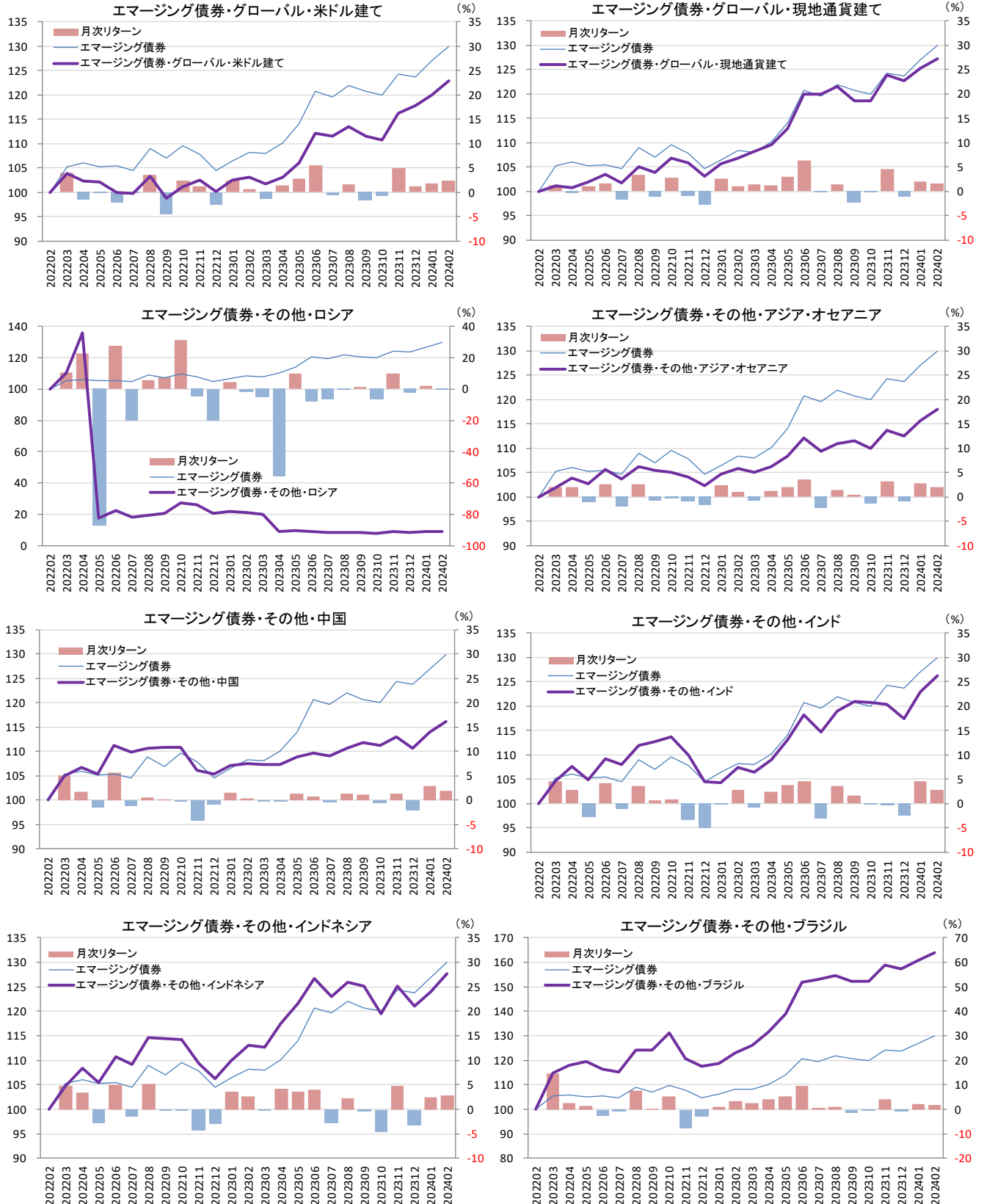


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマーシング債券]

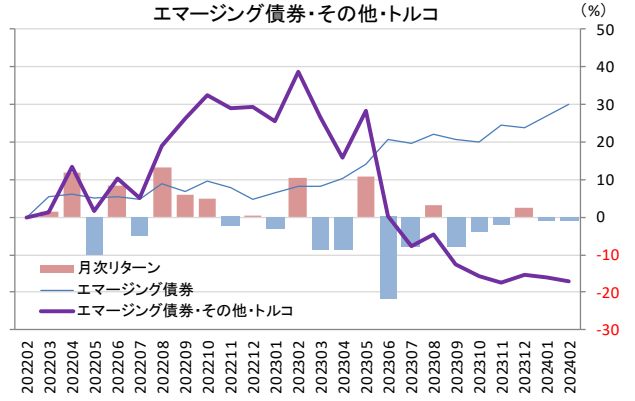
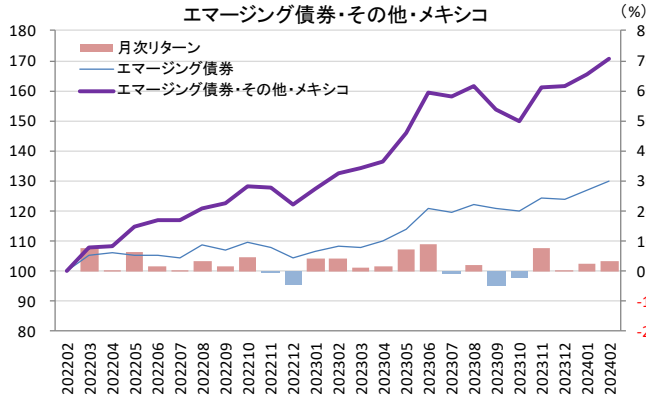


<1>パフォーマンス・サマリー

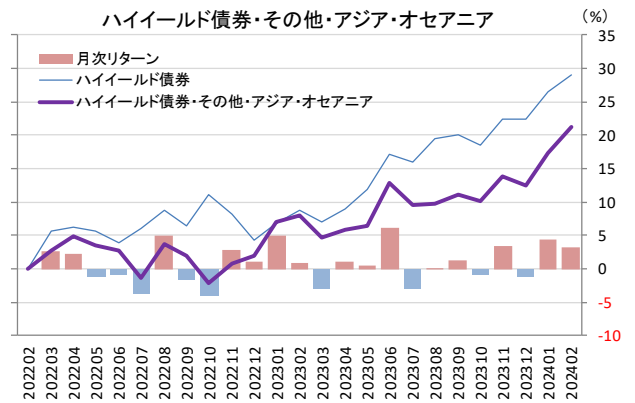
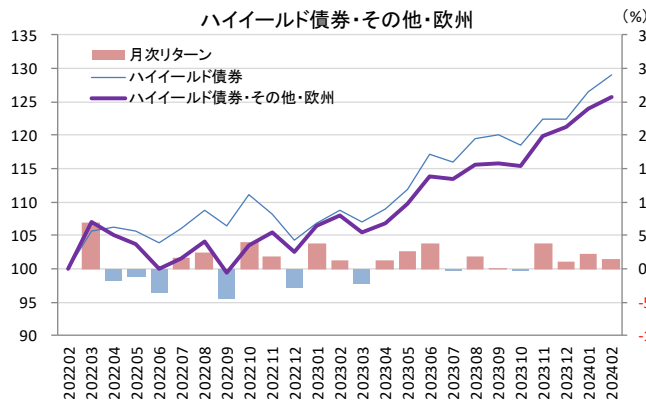
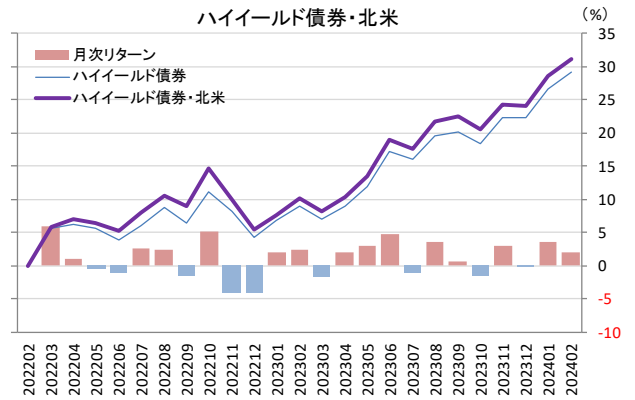
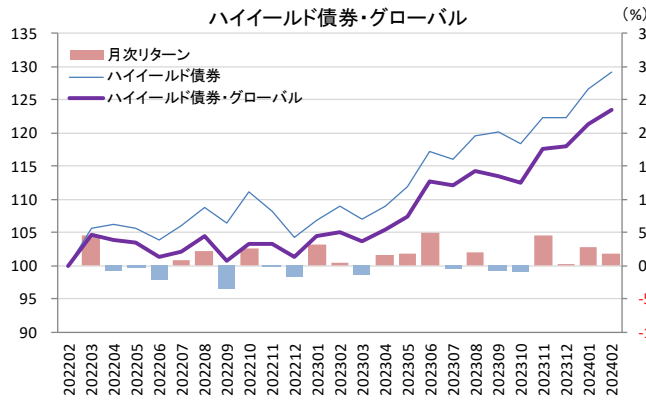
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

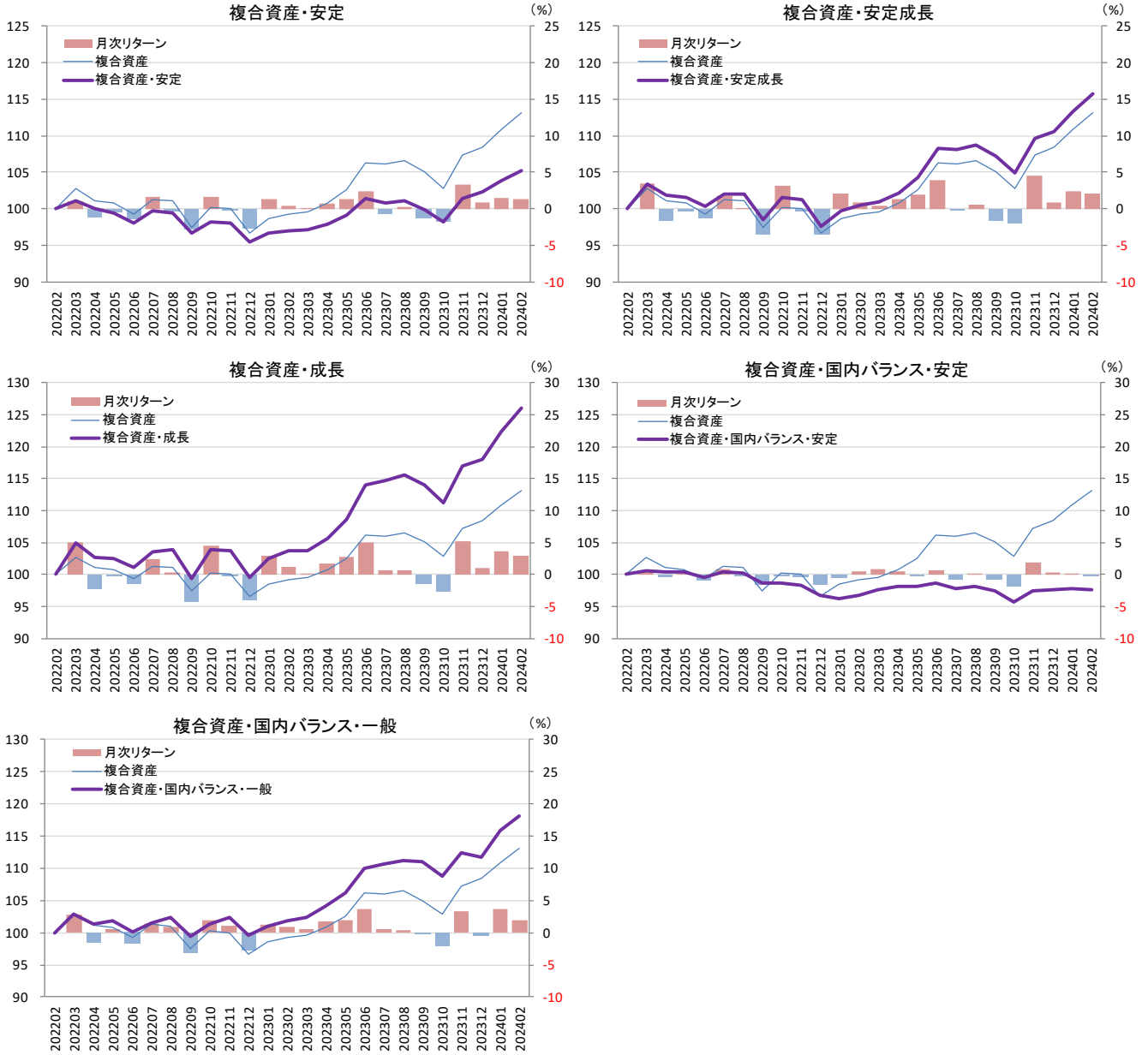


<1>パフォーマンス・サマリー

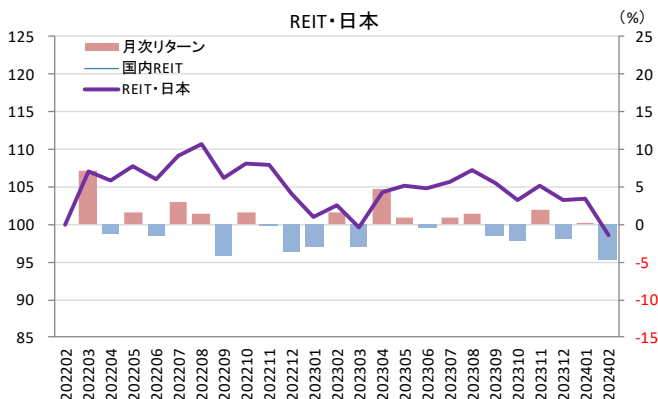
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

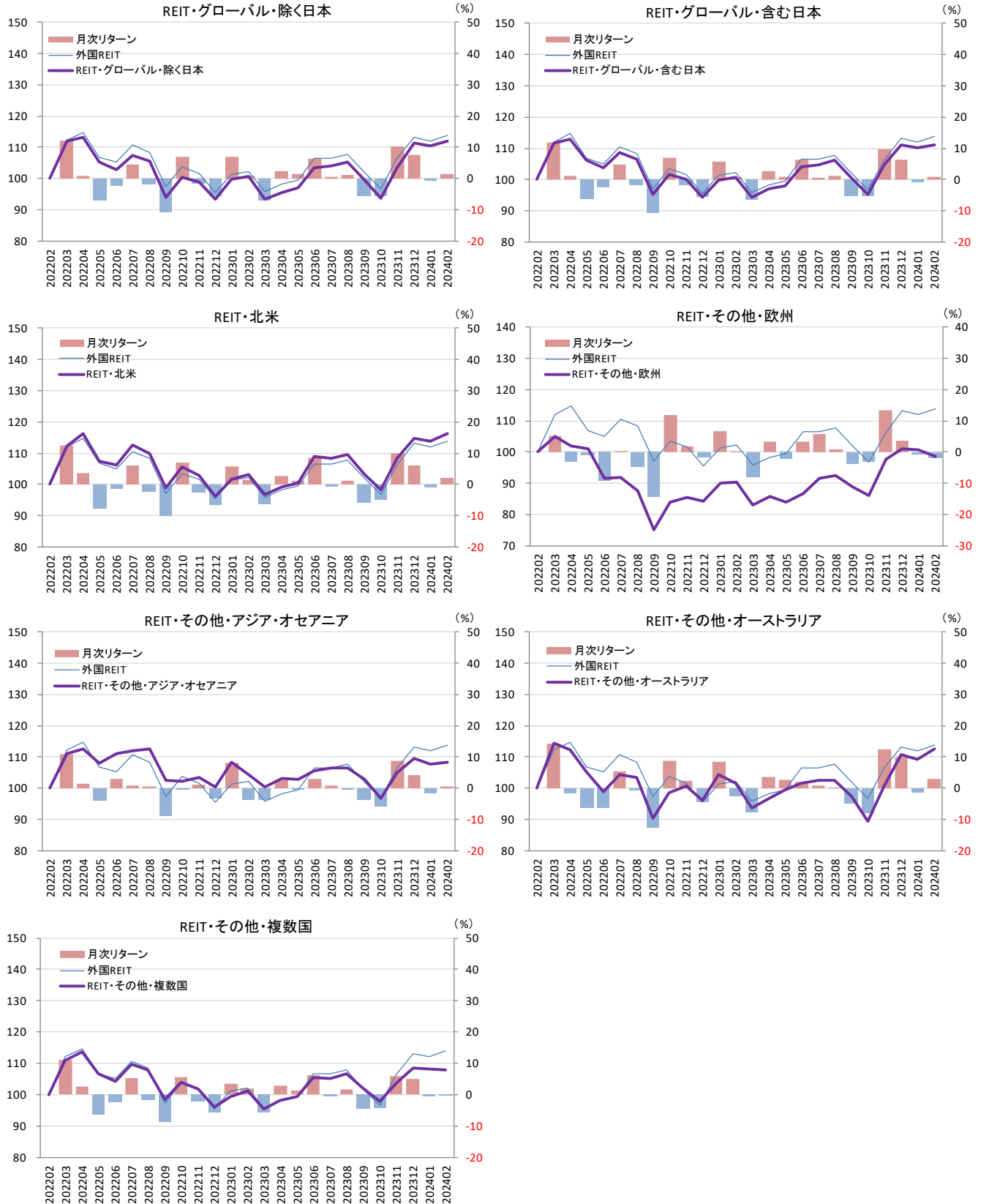


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

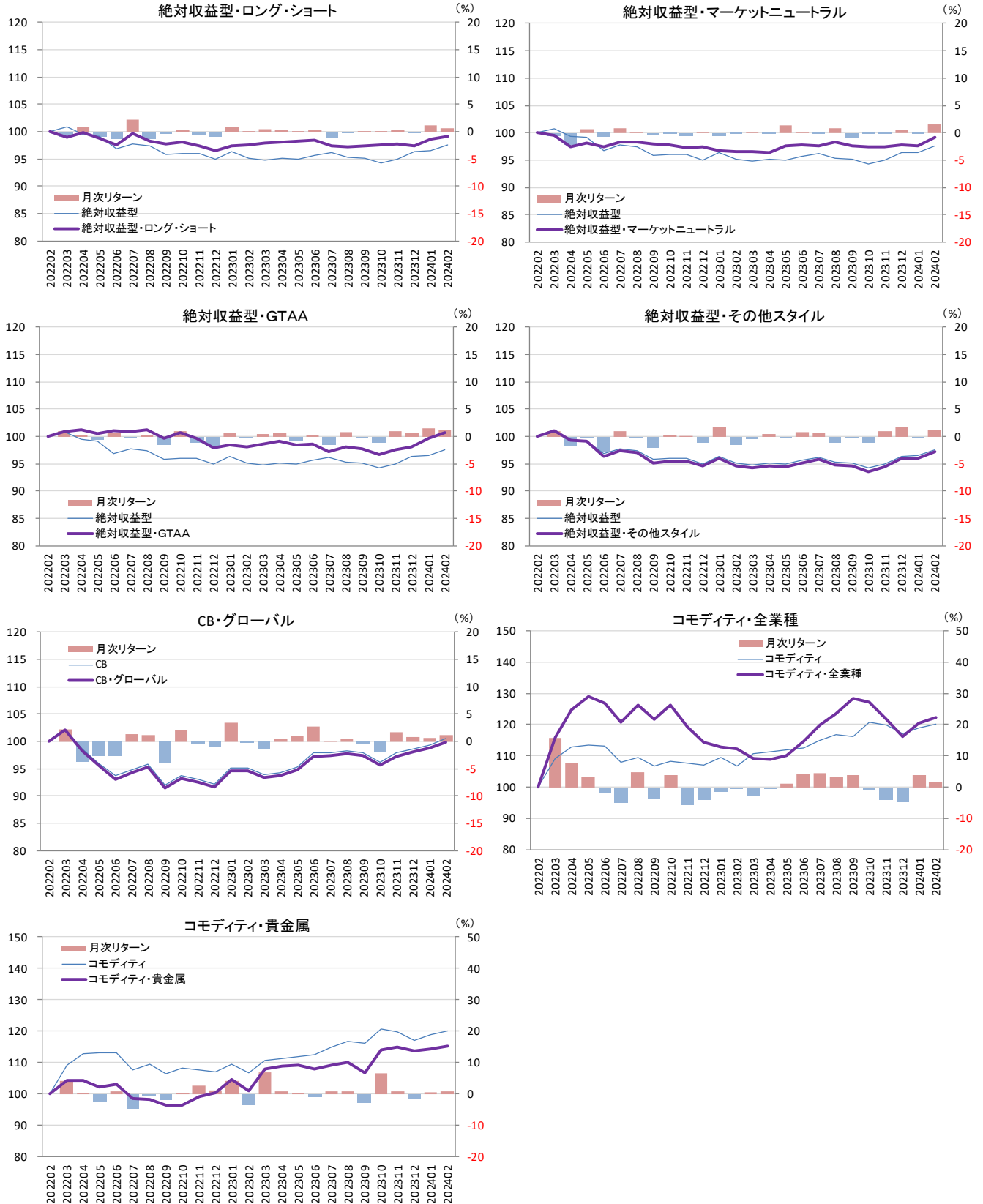


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	3.75		
1	外国株式(先進国)・グローバル	5.20	29.86	1.55
2	外国株式(先進国)・その他	5.26	15.76	0.82
3	国内株式・一般	5.28	7.53	0.39
4	国内株式・その他	6.63	5.11	0.33
5	エマージング株式・その他	5.14	2.90	0.15
6	複合資産・安定成長	2.17	6.04	0.13
7	複合資産・成長	3.00	3.11	0.09
8	エマージング株式・グローバル	6.03	1.02	0.06
9	REIT・北米	2.16	2.12	0.05
10	複合資産・安定	1.33	3.40	0.05
11	外国債券(先進国)・グローバル	0.55	6.89	0.04
12	国内株式・小型	4.43	0.68	0.03
13	ハイイールド債券・北米	2.03	1.44	0.03
14	REIT・グローバル	1.07	1.60	0.02
15	エマージング債券・グローバル	2.22	0.60	0.01
16	絶対収益型	1.17	1.04	0.01
17	エマージング債券・その他	2.46	0.47	0.01
18	国内債券・一般	0.28	3.79	0.01
19	国内株式・業種特化	8.04	0.10	0.01
20	外国債券(先進国)・その他	0.40	1.52	0.01
21	コモディティ	1.03	0.56	0.01
22	ハイイールド債券・グローバル	1.80	0.24	0.00
23	CB	1.18	0.26	0.00
24	ハイイールド債券・その他	1.86	0.16	0.00
25	REIT・その他	0.87	0.24	0.00
26	複合資産・その他	0.72	0.28	0.00
27	エマージング株式・BRICS	4.79	0.04	0.00
28	複合資産・国内バランス	0.03	0.55	0.00
29	REIT・日本	-4.65	2.13	-0.10
	合計		100.00	3.75

◆計算定義

日次寄与度(%) = 日次リターン(%) × 前日の純資産額構成比

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

<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	25.20		
1	外国株式(先進国)・グローバル	33.74	28.90	9.61
2	外国株式(先進国)・その他	44.05	14.16	5.89
3	国内株式・一般	33.28	7.24	2.31
4	国内株式・その他	42.23	4.90	1.95
5	複合資産・安定成長	15.10	6.41	1.00
6	エマージング株式・その他	31.88	2.43	0.72
7	複合資産・成長	21.51	3.04	0.66
8	外国債券(先進国)・グローバル	8.02	7.31	0.62
9	複合資産・安定	8.40	3.88	0.34
10	REIT・北米	12.67	2.38	0.30
11	ハイイールド債券・北米	19.17	1.48	0.28
12	エマージング株式・グローバル	21.59	1.05	0.22
13	REIT・グローバル	10.73	1.77	0.18
14	外国債券(先進国)・その他	9.46	1.68	0.17
15	エマージング債券・グローバル	19.18	0.65	0.12
16	国内株式・小型	15.54	0.74	0.12
17	エマージング債券・その他	21.13	0.51	0.11
18	コモディティ	12.61	0.58	0.07
19	複合資産・その他	15.99	0.31	0.05
20	ハイイールド債券・グローバル	17.58	0.27	0.05
21	国内株式・業種特化	38.74	0.08	0.03
22	ハイイールド債券・その他	15.69	0.19	0.03
23	絶対収益型	2.62	1.18	0.03
24	複合資産・国内バランス	2.48	0.69	0.02
25	CB	5.67	0.28	0.02
26	REIT・その他	5.58	0.29	0.01
27	エマージング株式・BRICS	15.12	0.05	0.01
28	国内債券・一般	-0.22	4.25	0.00
29	REIT・日本	-3.80	2.73	-0.06
	合計		100.00	25.20

◆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	29.60	54.65	89.68	11.18	11.80	10.72	0.81	0.77	0.62
国内株式	41.74	80.40	158.80	13.00	14.95	15.31	0.95	0.84	0.65
一般	41.08	76.80	146.77	12.53	14.51	15.30	0.97	0.83	0.62
フリー	36.99	74.90	143.25	13.03	14.81	15.64	0.85	0.80	0.60
バリュー	56.20	81.88	157.56	11.38	14.06	14.49	1.41	0.91	0.69
小型	11.87	45.00	156.41	15.28	17.83 ↓	16.67	0.25	0.43	0.59
その他	47.90	92.28	182.85	13.68	15.49	15.39	1.02	0.90	0.71
日経225	41.17	97.20	200.38	15.39	16.97	16.17	0.79	0.86	0.72
TOPIX	53.21	85.60	168.35	12.09	14.15	14.70	1.27	0.93	0.71
JPX日経400	51.98	86.58	158.31	12.54	14.53	14.65	1.20	0.92	0.68
国内債券	-5.18	-5.96	0.27	2.43	2.33	1.98	-0.71	-0.51	0.02
一般	-5.18	-5.96	0.27	2.43	2.33	1.98	-0.71	-0.51	0.02
外国株式(先進国)	41.86	100.58	157.32	16.74	17.49	16.12	0.74	0.86	0.62
グローバル	33.55	93.66	159.51	16.95	17.61	16.07	0.60	0.80	0.62
除く日本	69.27	120.71	210.28	14.69	17.02 ↓	16.41	1.31	1.01	0.73
含む日本	24.00	85.50	145.05	18.02	18.14	16.24	0.41	0.73	0.58
その他	65.63	116.64	152.62	16.59	17.59	16.52	1.11	0.95	0.59
北米	109.87	171.12	225.66	14.91	17.87 ↓	17.59	1.88	1.24	0.71
米国	67.02	129.24	188.00	16.87	17.24 ↓	16.88	1.11	1.05	0.66
カナダ	29.78	40.75	26.84	11.75 ↓	17.66 ↓	15.89	0.77	0.40	0.15
欧州	42.26	71.95	92.38	14.67	17.24	16.14	0.85	0.67	0.42
ドイツ	54.61	85.57	-	18.05	21.87	-	0.87	0.60	-
イギリス	37.88	26.21	-	10.24 ↓	16.27 ↓	-	1.11	0.30	-
アジア・オセアニア	8.81	30.23	77.45	10.65	14.41	14.47	0.27	0.38	0.41
オーストラリア	38.57	50.44	66.72	17.64 ↓	23.52	19.76	0.65	0.36	0.27
ニュージーランド	17.55	55.55	166.72	15.13	17.73	17.25	0.37	0.52	0.60
複合地域	131.64	78.07	41.36	24.42 ↓	32.53	26.65	1.32	0.38	0.13
エマージング株式	28.74	65.56	112.30	10.37 ↓	17.09	16.11	0.85	0.62	0.49
グローバル	16.77	60.66	94.32	11.69	16.79	16.34	0.46	0.59	0.42
BRICS	-4.58	17.79	73.26	13.08	19.72	18.81	-0.12	0.17	0.30
その他	35.36	69.88	122.48	10.36 ↓	17.57	16.35	1.03	0.64	0.51
欧州	-24.10	-20.87	-16.81	34.24	33.00	27.15	-0.26	-0.14	-0.07
ロシア	-90.22	-88.02	-84.64	55.49	47.76	38.23	-0.97	-0.72	-0.45
アジア・オセアニア	1.97	31.23	65.25	12.24	16.53 ↓	15.80	0.06	0.34	0.33
中国	-34.38	12.59	88.91	19.37	20.15	21.32	-0.68	0.12	0.31
インド	79.94	127.45	283.04	13.97 ↓	22.18	21.04	1.55	0.81	0.68
インドネシア	46.19	26.89	49.87	15.26	25.65	23.03	0.89	0.19	0.18
タイ	15.83	-2.85	42.10	13.34	20.51	17.66	0.38	-0.03	0.20
フィリピン	26.41	4.64	20.00	16.36	20.47	17.97	0.50	0.05	0.10
ベトナム	60.41	74.59	140.48	20.50 ↓	25.92	21.71	0.83	0.46	0.42
韓国	-8.72	36.13	29.23	24.19	25.72	21.03	-0.12	0.25	0.12
香港	-18.60	-14.14	17.93	20.77	20.98	19.79	-0.32	-0.14	0.08
中南米	74.73	53.47	73.55	23.25 ↓	29.58	26.33	0.88	0.30	0.22
ブラジル	53.01	11.91	22.75	26.58 ↓	32.22	31.66	0.57	0.07	0.07
メキシコ	130.00	107.59	78.62	21.09	27.13	23.81	1.52	0.58	0.25
中東・アフリカ	45.71	54.67	60.54	14.87	18.62	16.86	0.90	0.49	0.29
トルコ	112.54	107.12	65.66	32.86	34.07	31.71	0.87	0.46	0.16
複合地域	12.86	39.98	53.89	13.58 ↓	16.91 ↓	15.54	0.31	0.41	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 カ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑: 上昇傾向、↓: 低下傾向

<2> リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別②

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ				
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年		
総合	29.60	54.65	89.68	11.18	11.80	10.72	0.81	0.77	0.62		
外国債券(先進国)	5.47	12.01	16.77	4.95	4.94	5.33	0.37	0.47	0.30		
グローバル	4.02	10.35	16.25	4.42	4.29	4.74	0.31	0.47	0.32		
除く日本	7.69	15.41	20.44	5.62	4.80	5.37	0.45	0.61	0.35		
含む日本	0.93	5.85	12.84	3.78	4.50	4.46	0.09	0.26	0.28		
その他	11.44	19.05	21.76	7.75	7.86	7.65	0.48	0.46	0.26		
北米	2.49	9.79	21.35	5.60	5.76	4.98	0.15	0.33	0.40		
米国	16.87	20.59	34.91	7.82	↑	8.06	7.02	0.69	0.48	0.44	
カナダ	25.03	30.05	24.20	8.60	7.79	8.52	0.90	0.70	0.26		
欧州	-3.65	-1.54	-0.32	6.51	5.68	6.51	-0.18	-0.05	-0.00		
イギリス	19.08	24.30	-	10.80	9.90	-	0.56	0.45	-		
アジア・オセアニア	10.15	20.83	22.81	9.30	9.68	9.21	0.36	0.40	0.23		
オーストラリア	11.08	21.63	22.37	9.26	9.71	9.26	0.39	0.41	0.22		
ニュージーランド	4.88	10.98	22.77	10.18	↑	9.62	9.92	0.16	0.22	0.21	
複合地域	6.71	21.10	26.69	7.55	6.29	6.91	0.29	0.63	0.35		
エマージング債券	32.60	29.65	43.88	7.37	10.50	10.57	1.34	0.51	0.35		
グローバル	21.25	20.23	32.67	7.82	11.79	11.18	0.85	0.32	0.26		
米ドル建て	19.76	18.53	32.87	8.37	12.39	11.59	0.74	0.28	0.25		
現地通貨建て	25.81	25.66	25.35	7.17	10.29	10.18	1.11	0.46	0.23		
その他	47.47	42.17	57.29	8.81	10.39	11.08	1.57	0.70	0.42		
ロシア	-94.97	-94.96	-95.41	73.66	58.69	44.97	-0.86	-0.77	-0.59		
アジア・オセアニア	14.55	23.33	45.43	5.92	↑	6.96	6.86	0.79	0.62	0.56	
中国	35.54	36.55	-	6.38	6.42	-	1.68	1.01	-		
インド	36.75	50.73	97.50	8.89	↑	9.20	9.63	1.24	0.93	0.73	
インドネシア	42.94	58.23	87.16	9.55	↑	13.77	13.94	↓	1.33	0.70	0.47
ブラジル	85.14	34.68	57.26	15.56	↓	17.73	18.25	1.47	0.35	0.25	
メキシコ	80.16	97.07	73.40	12.30	16.18	15.49	1.77	0.90	0.37		
トルコ	-53.30	-56.50	-75.79	30.01	28.29	↓	27.93	-0.75	-0.54	-0.47	
複合地域	24.95	21.92	19.59	10.26	11.76	11.57	0.75	0.35	0.16		
ハイイールド債券	36.10	41.26	64.69	7.82	11.26	10.42	1.39	0.64	0.49		
グローバル	25.95	29.00	49.91	7.09	11.12	10.35	1.13	0.47	0.40		
北米	42.46	48.23	76.70	8.33	11.26	10.45	1.51	0.73	0.56		
その他	19.01	24.02	37.87	8.25	↓	12.37	11.29	0.73	0.36	0.29	
欧州	21.07	25.85	38.27	9.01	↓	13.10	12.03	0.73	0.36	0.28	
アジア・オセアニア	11.02	15.81	38.55	9.42	11.92	10.26	0.38	0.25	0.32		
複合地域	28.09	42.46	57.04	7.58	8.92	8.75	1.14	0.83	0.53		
複合資産	16.24	27.00	50.66	6.61	7.17	7.14	0.78	0.69	0.59		
安定	5.84	12.56	26.78	4.77	↑	4.98	5.26	0.41	0.49	0.46	
安定成長	19.96	32.60	58.80	6.93	7.62	7.53	0.91	0.77	0.63		
成長	33.61	57.07	102.92	8.84	10.31	↓	10.42	1.15	0.92	0.71	
国内バランス	-0.94	-2.71	11.43	3.17	3.88	4.51	↓	-0.09	-0.13	0.25	
安定	-2.96	-5.41	8.28	3.06	3.76	3.10	-0.32	-0.29	0.26		
一般	18.38	34.83	57.80	6.52	7.64	8.48	0.89	0.81	0.55		
その他	-4.38	20.49	-	19.96	18.16	-	-0.07	0.21	-		

※[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	29.60	54.65	89.68	11.18	11.80	10.72	0.81	0.77	0.62
国内REIT	-1.55	9.58	54.81	10.18 ↓	14.90	12.24	-0.05	0.13	0.37
日本	-1.55	9.58	54.81	10.18 ↓	14.90	12.24	-0.05	0.13	0.37
外国REIT	43.63	47.28	111.90	18.17	19.03	16.62	0.71	0.42	0.47
グローバル	37.45	37.48	86.27	17.88	19.71	16.83	0.63	0.34	0.38
除く日本	40.52	45.65	111.22	18.48	20.43	17.28	0.65	0.38	0.45
含む日本	35.82	34.45	80.90	17.58	19.43	16.66	0.61	0.32	0.37
北米	53.06	59.59	138.56	19.06	18.80	16.95	0.80	0.52	0.54
その他	19.22	23.15	88.98	15.38	19.49	16.09	0.39	0.22	0.41
欧州	5.54	2.76	19.69	18.93	21.19	18.46	0.10	0.03	0.10
アジア・オセアニア	15.20	19.98	97.68	14.35	17.94	15.27	0.34	0.21	0.46
オーストラリア	31.54	30.98	83.35	23.33	29.96	23.28	0.41	0.19	0.27
複合地域	45.20	22.06	40.60	15.64 ↓	24.43	20.25	0.85	0.17	0.17
複数国	33.57	45.17	136.12	15.81	17.18	15.01	0.64	0.45	0.60
その他									
絶対収益型	-3.14	-0.62	-0.59	3.78	3.32	2.80	-0.27	-0.03	-0.01
ロング・ショート	-2.90	-4.96	-6.99	3.14	3.18	3.05	-0.30	-0.31	-0.23
マーケットニュートラル	-5.94	-3.47	18.96	4.01	4.04	5.23	-0.50	-0.17	0.34
GTAA	1.52	11.76	12.38	3.94 ↓	4.44	3.46	0.14	0.51	0.34
その他スタイル	-3.05	-0.43	-0.93	4.19	3.61	3.06	-0.24	-0.01	-0.02
CB	-3.75	13.95	21.03	6.64 ↓	8.61	7.58	-0.19	0.31	0.26
アジア・オセアニア	18.26	47.33	101.98	8.54 ↓	11.99	11.32	0.68	0.67	0.65
日本	7.21	9.04	28.28	4.81 ↑	5.13	5.31	0.49	0.35	0.48
グローバル	-4.58	13.46	19.50	6.88 ↓	8.85	7.68	-0.22	0.29	0.24
コモディティ	47.03	69.08	13.75	10.45	11.05	11.88	1.31	1.00	0.11
全業種	77.98	80.74	16.02	15.97	19.02	16.90	1.33	0.66	0.09
貴金属	25.77	59.03	43.93	11.73	12.49	11.05	0.68	0.78	0.34
エネルギー	140.97	126.54	26.59	25.40 ↓	35.31	31.77	1.34	0.50	0.08
その他コモディティ	67.47	60.85	24.51	15.00	18.65	16.85	1.25	0.54	0.13

※[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

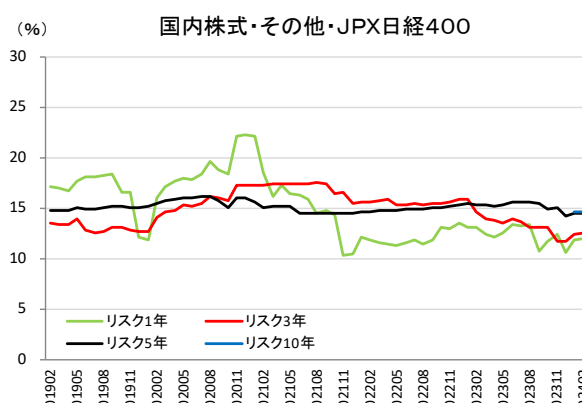
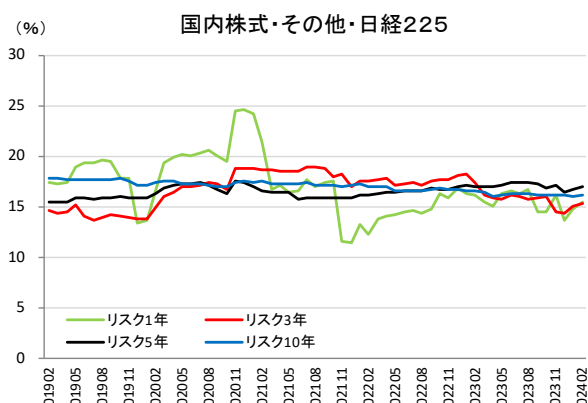
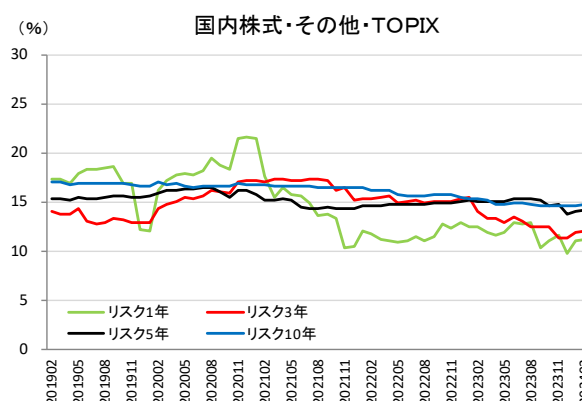
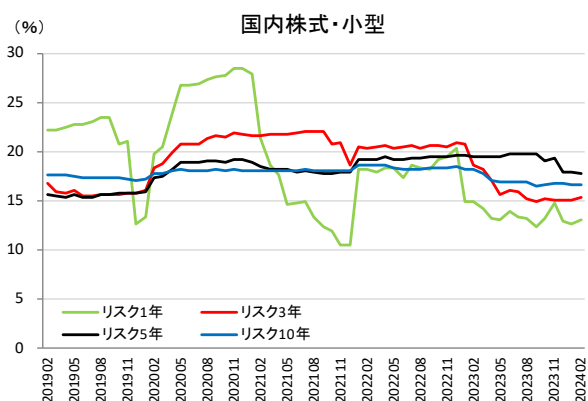
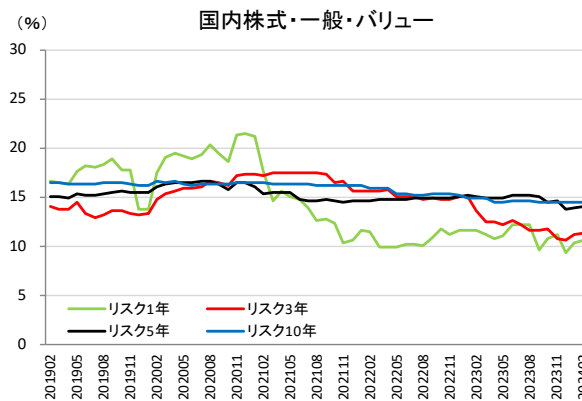
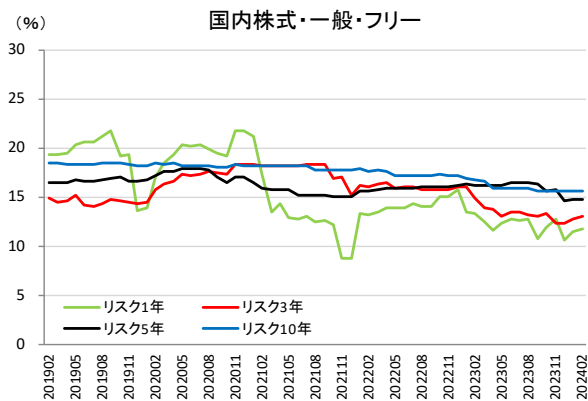
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

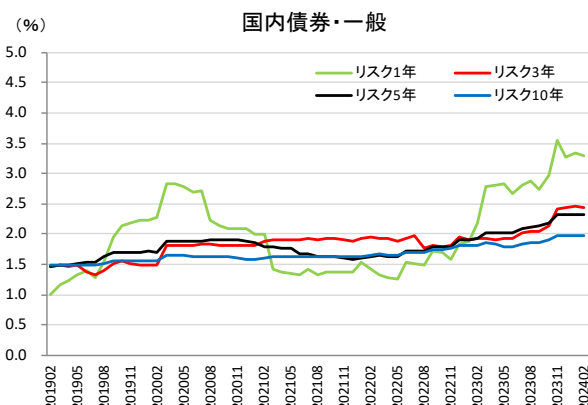
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

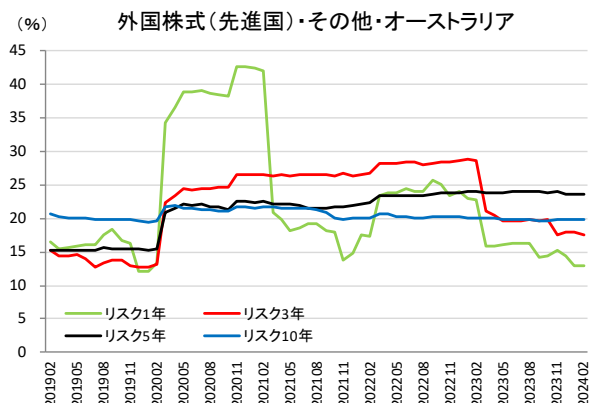
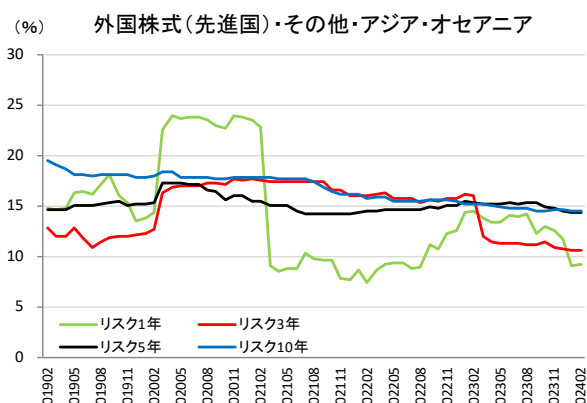
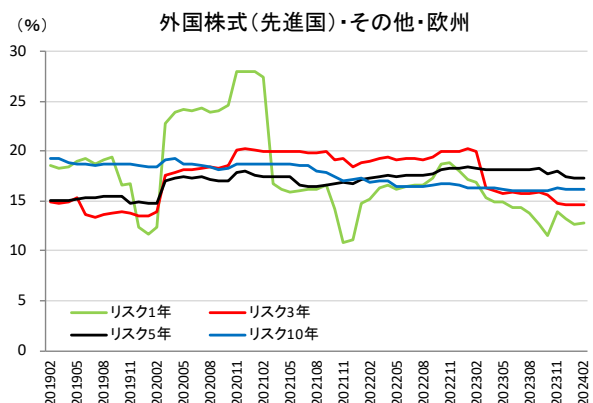
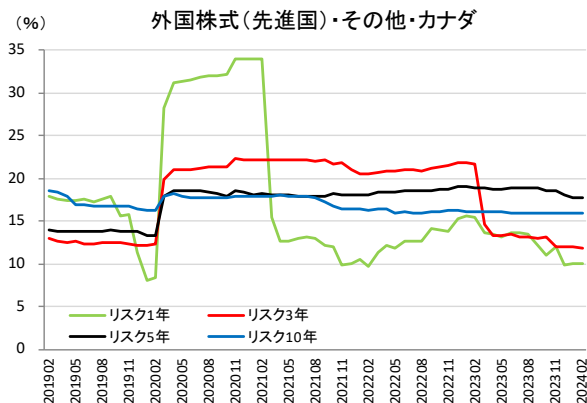
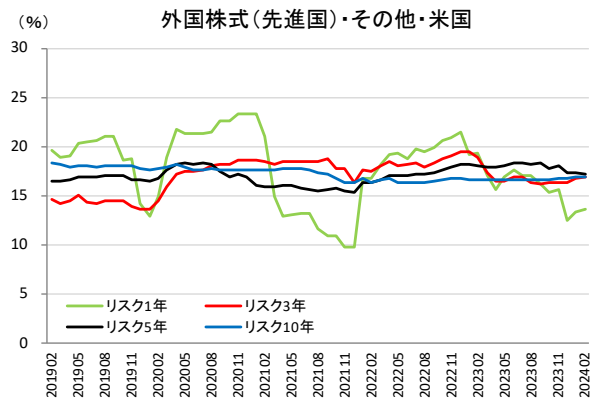
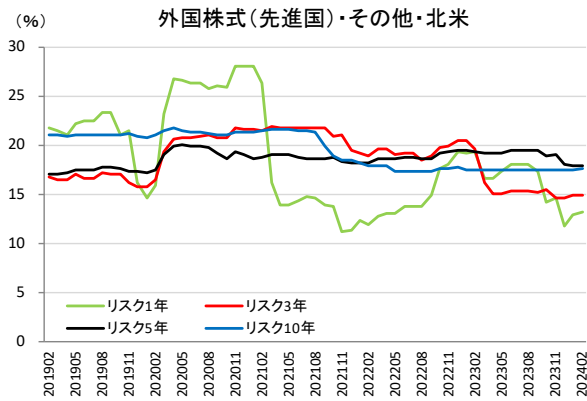
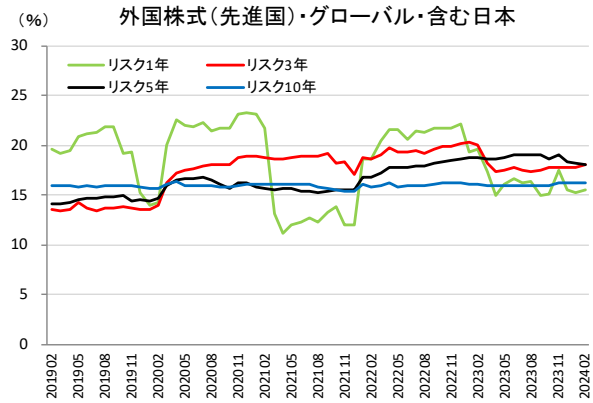
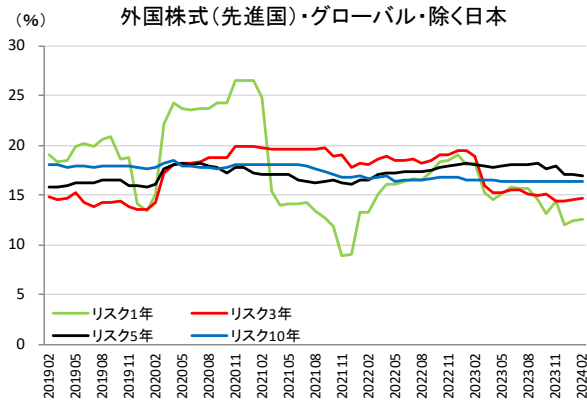


<2> リスク・サマリー

(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)]

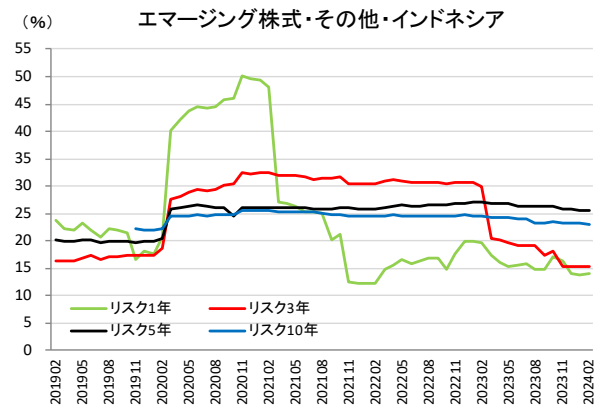
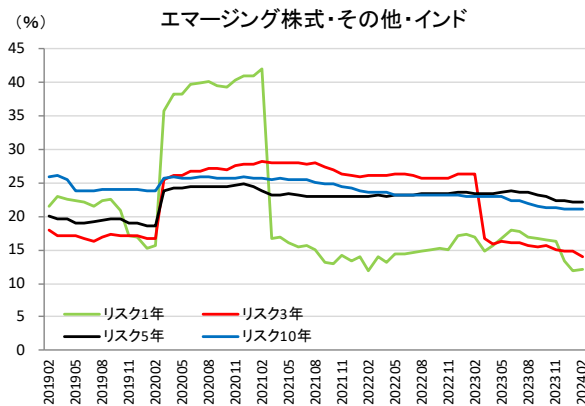
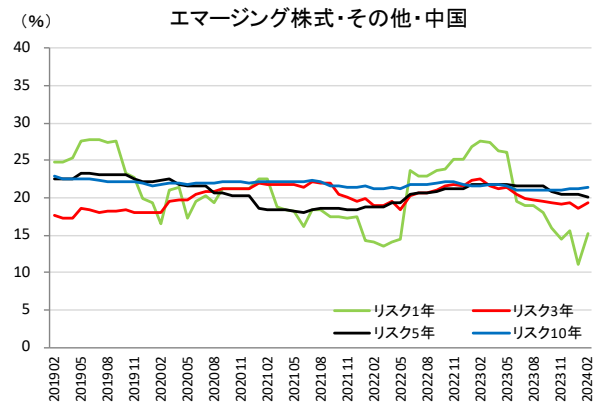
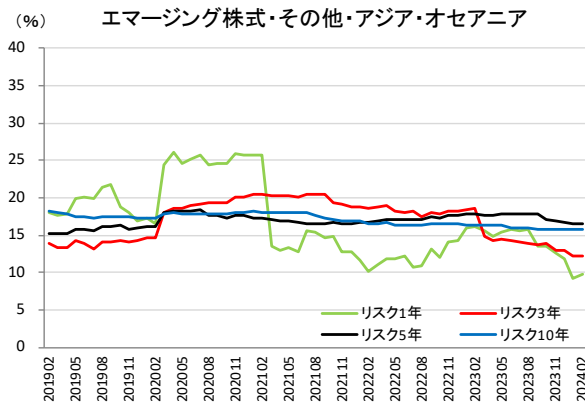
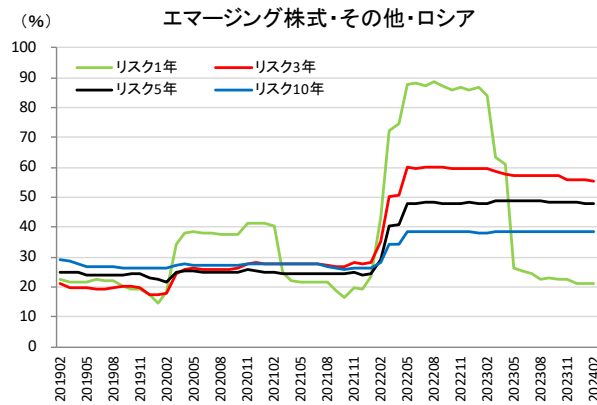
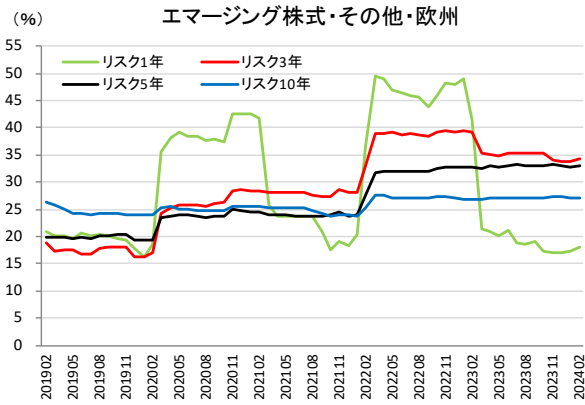
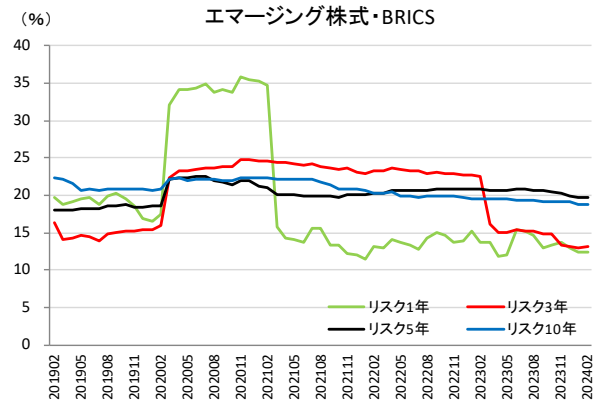
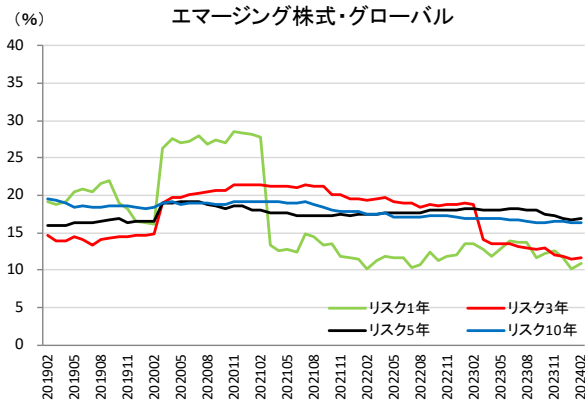


<2> リスク・サマリー

(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]

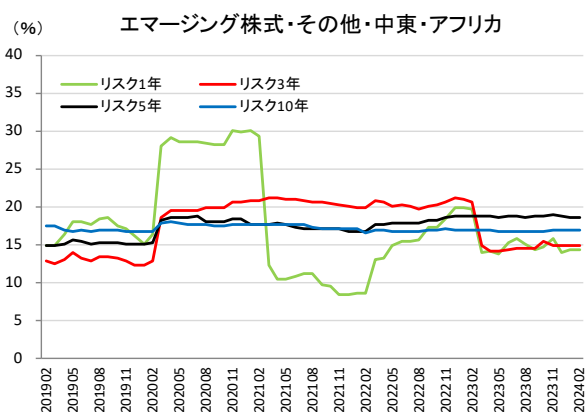
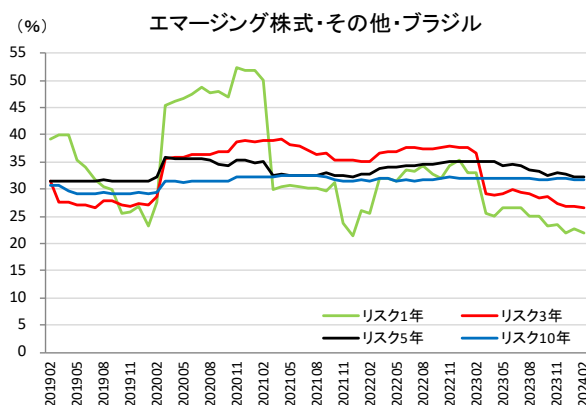
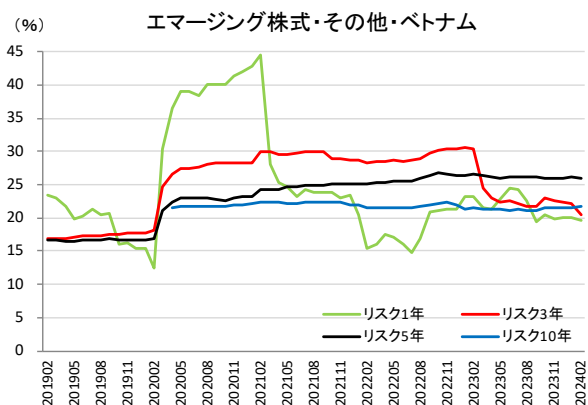
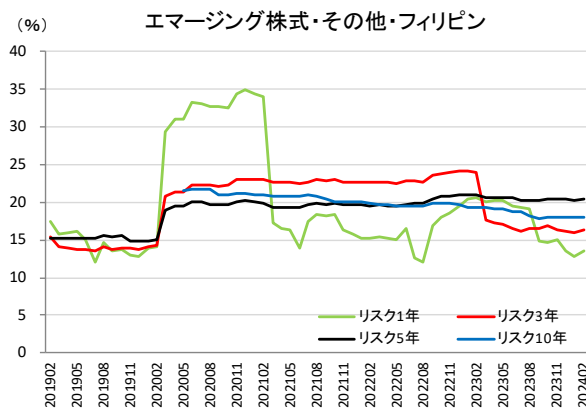
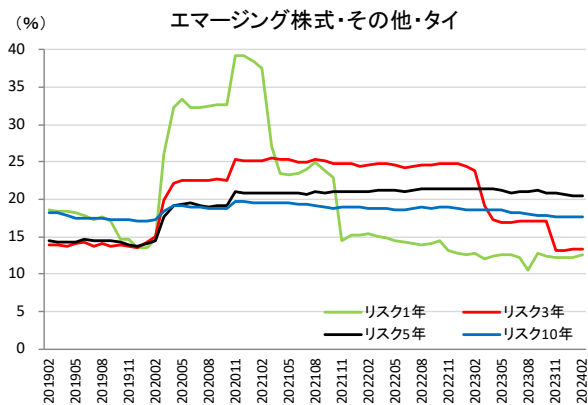


<2> リスク・サマリー

(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]

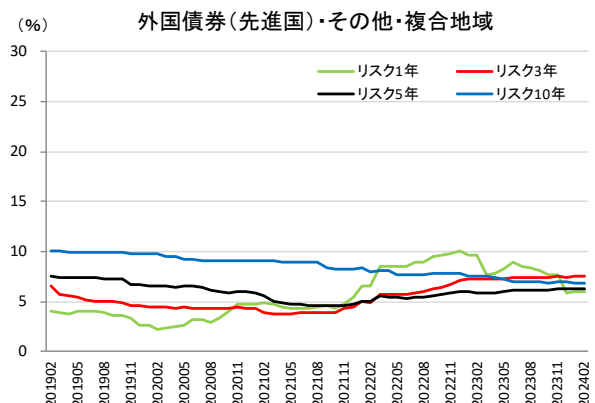
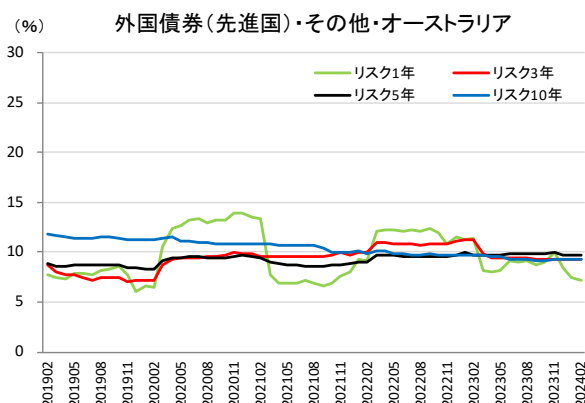
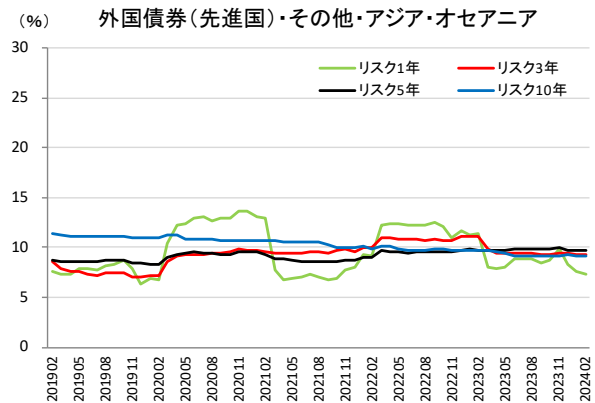
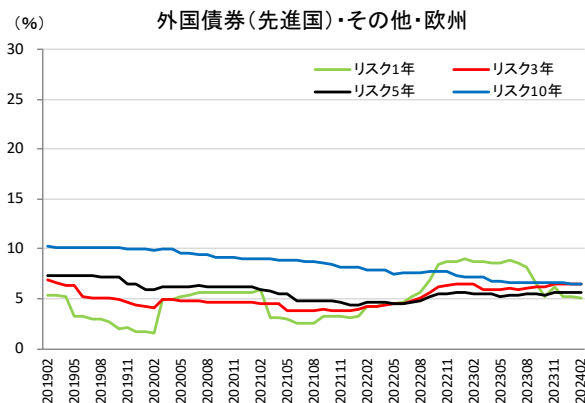
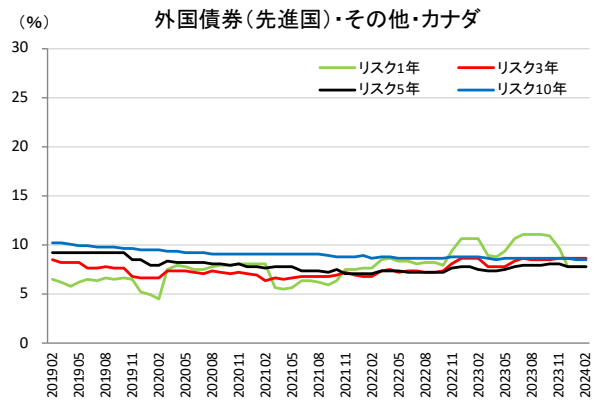
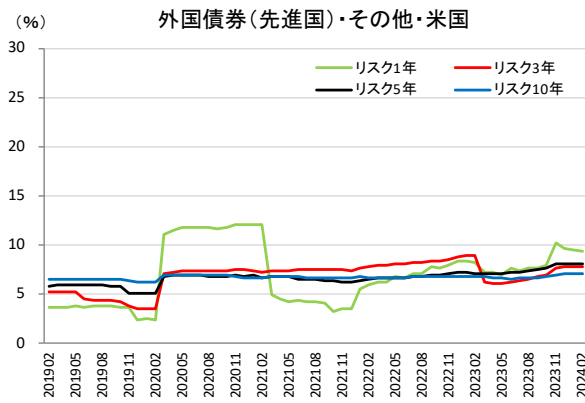
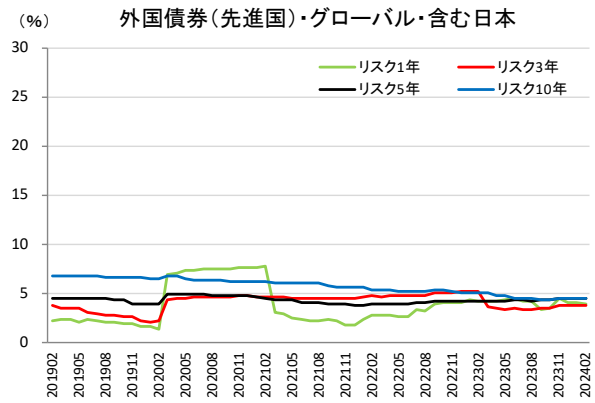
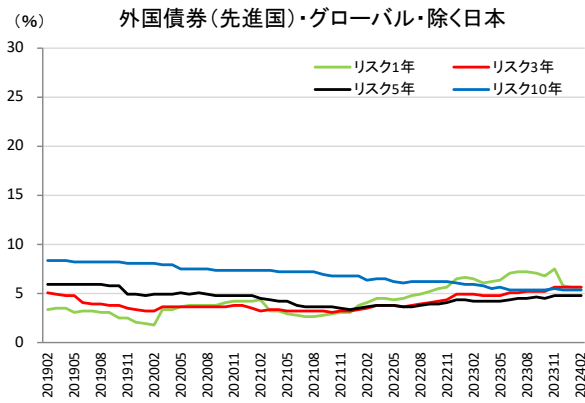


<2> リスク・サマリー

(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)]

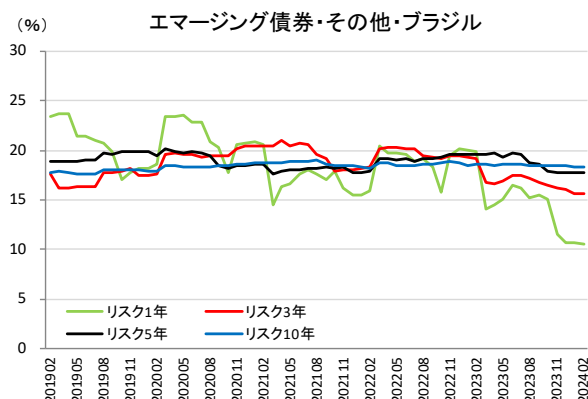
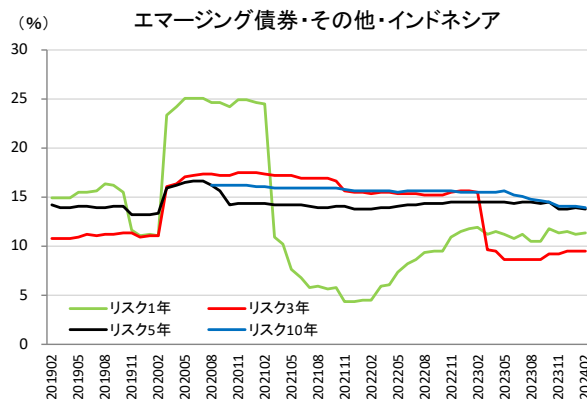
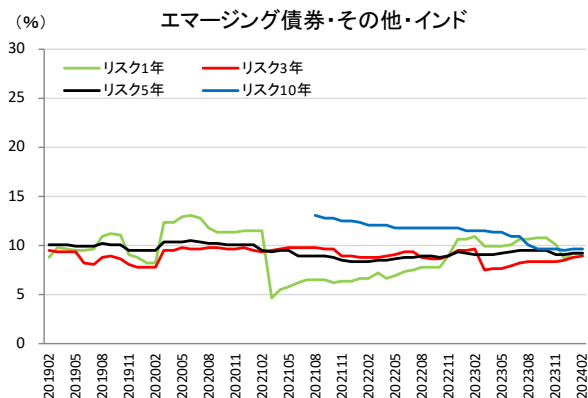
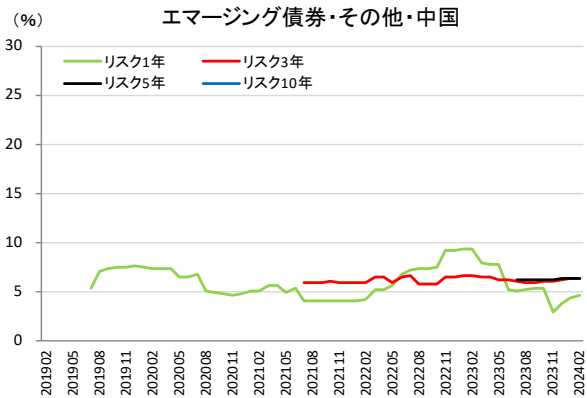
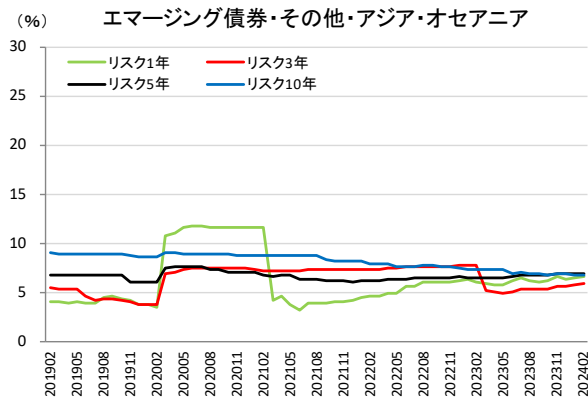
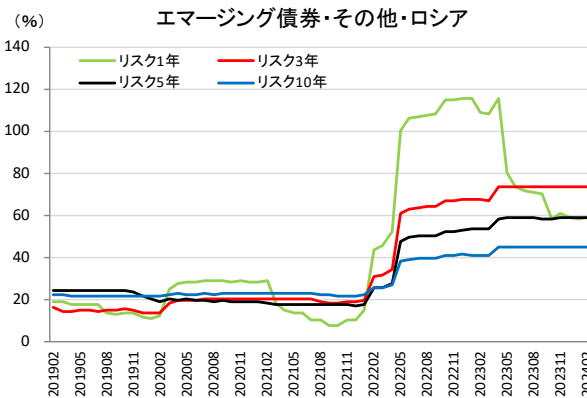
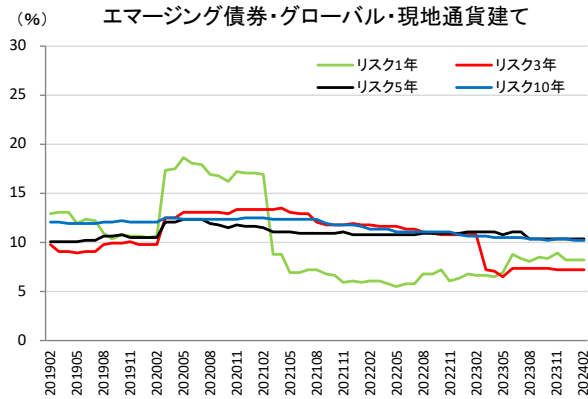
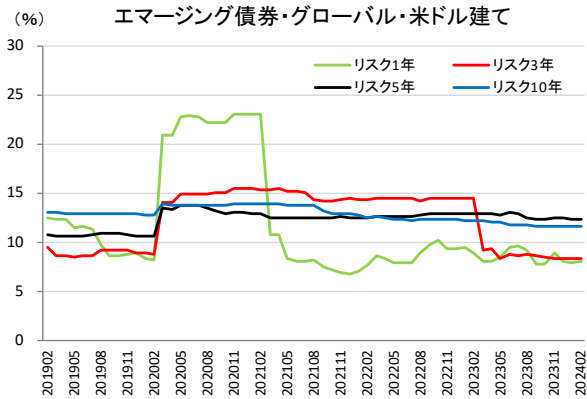


<2> リスク・サマリー

(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]

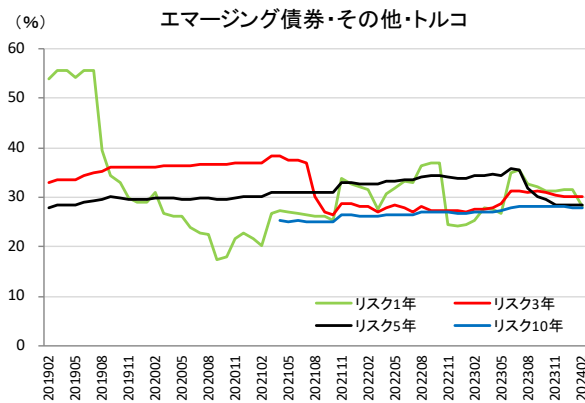
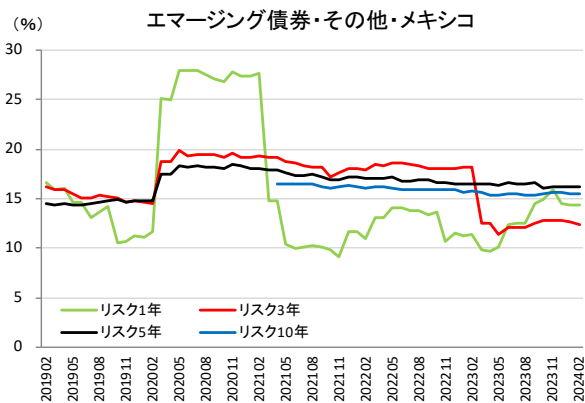


<2> リスク・サマリー

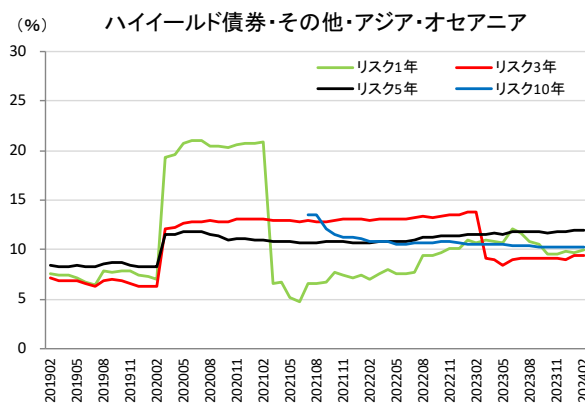
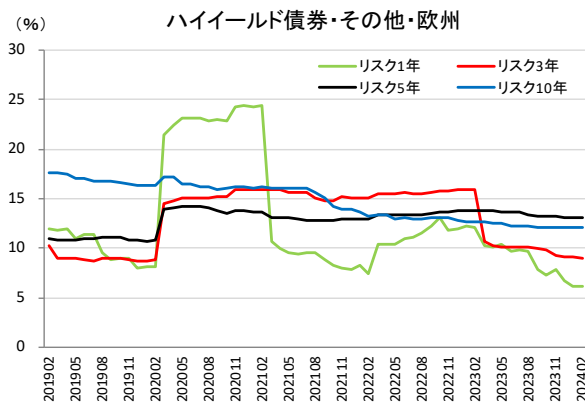
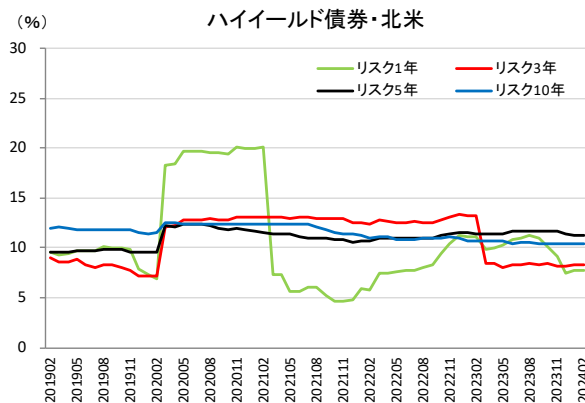
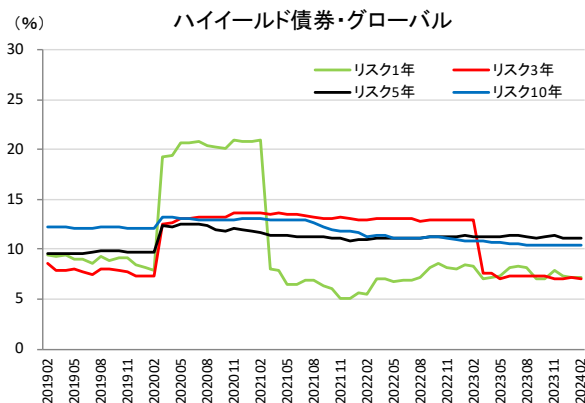
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

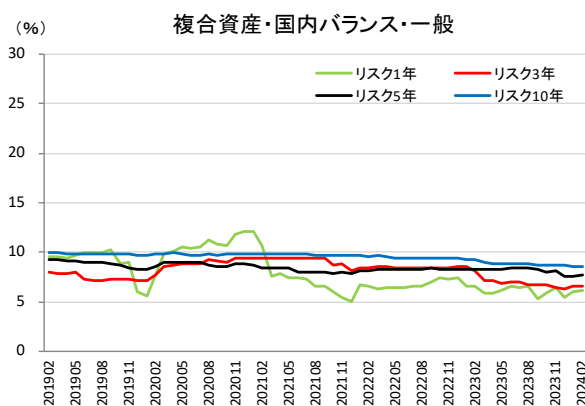
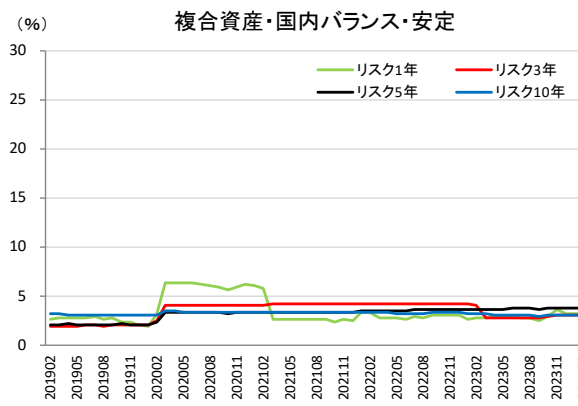
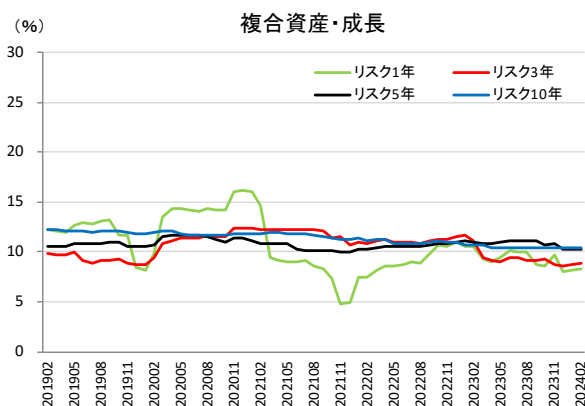
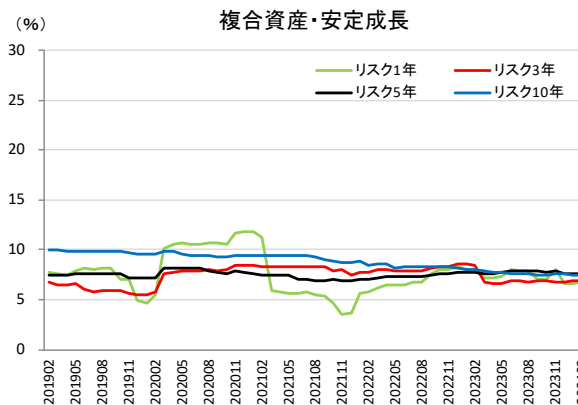
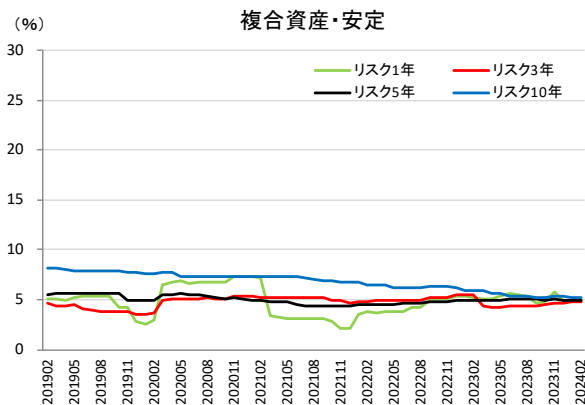


<2> リスク・サマリー

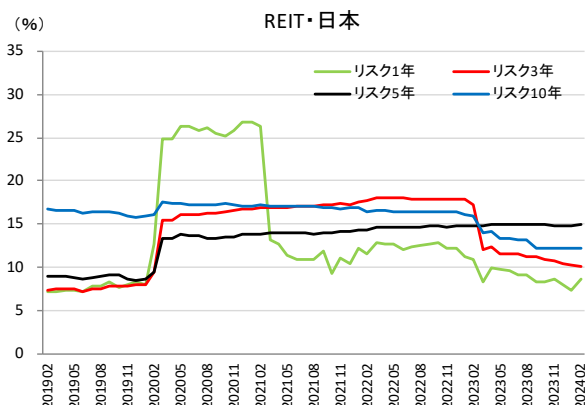
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

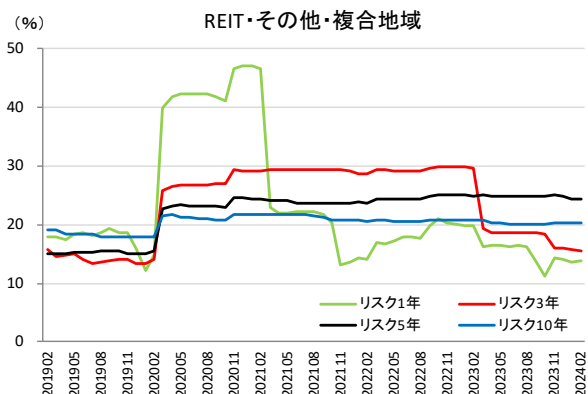
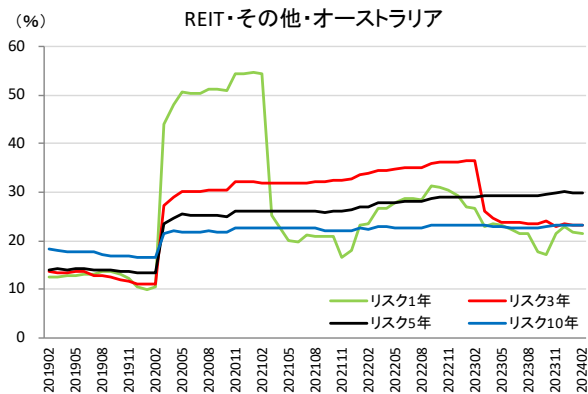
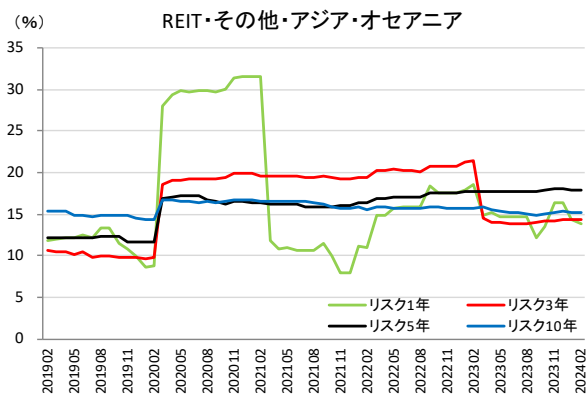
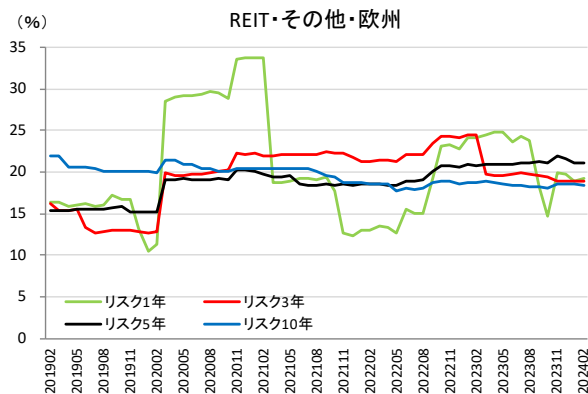
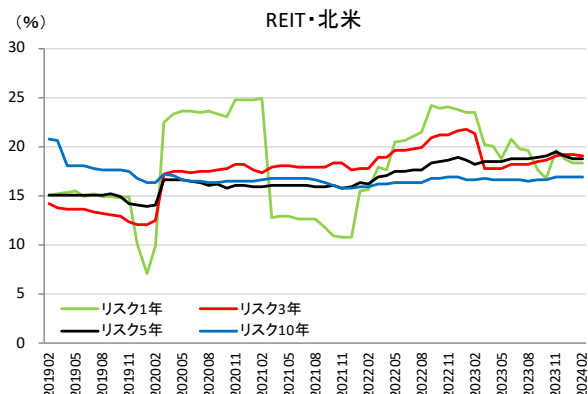
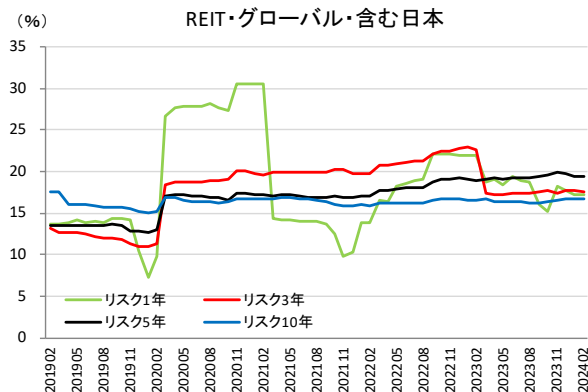
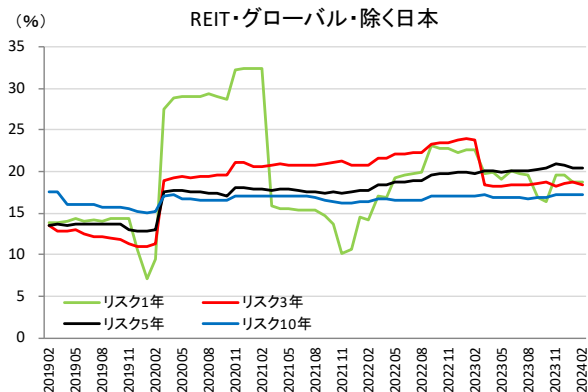


<2> リスク・サマリー

(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]

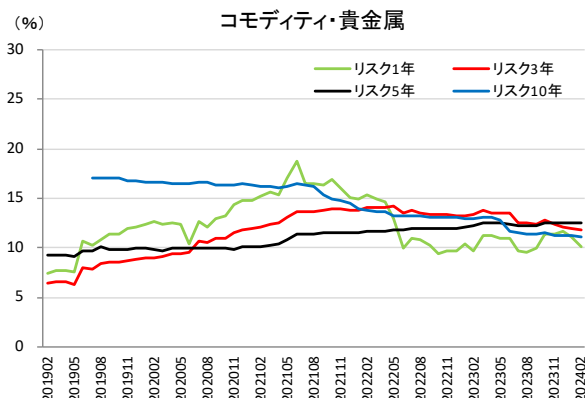
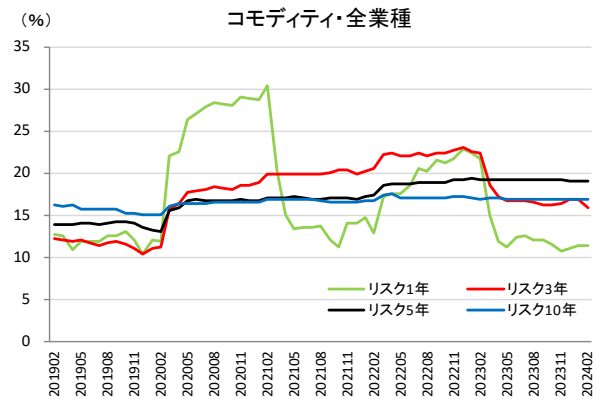
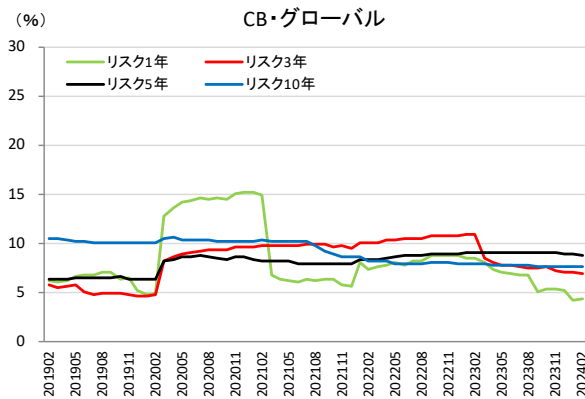
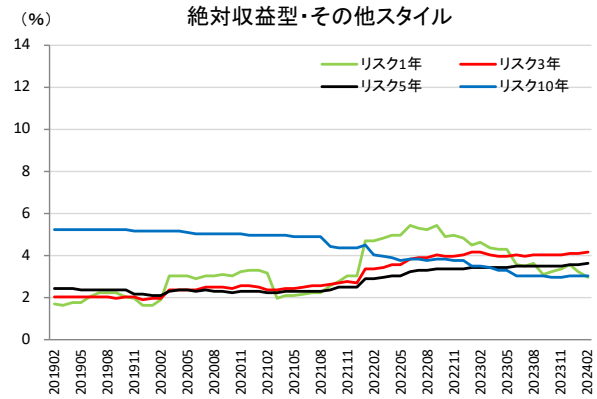
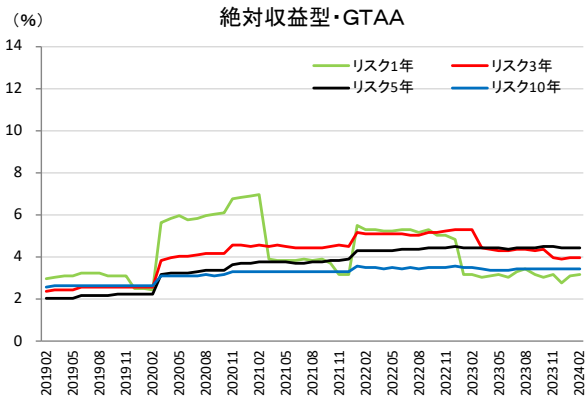
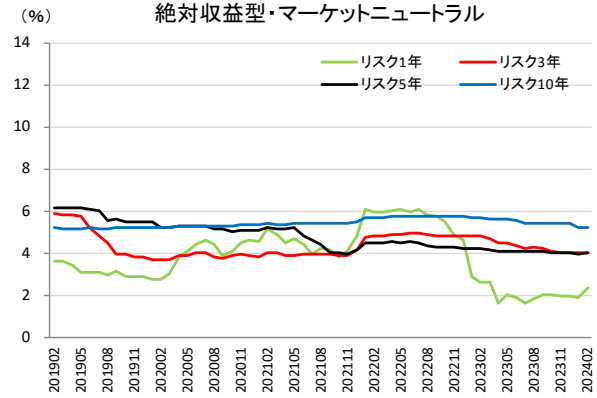
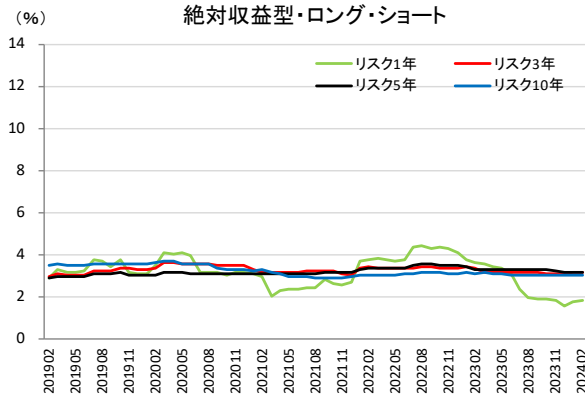


<2> リスク・サマリー

(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	14,042	30,221	54,070	85,340
国内株式	1,450	3,428	7,456	10,656
一般	719	2,381	5,100	8,959
フリー	-41	-289	534	1,584
バリュー	760	2,669	4,560	7,369
小型	-52	-183	-166	167
その他	732	1,128	2,292	1,268
日経225	111	-49	-44	-2,193
TOPIX	416	781	1,491	2,671
JPX日経400	-3	-30	-6	-51
国内債券	119	-169	1,656	1,138
一般	119	-169	1,656	1,138
外国株式(先進国)	9,952	22,445	34,250	47,118
グローバル	4,144	9,199	15,131	23,512
除く日本	757	2,248	4,893	8,012
含む日本	3,387	6,950	10,238	15,500
その他	5,808	13,247	19,119	23,606
北米	392	1,080	1,259	1,539
米国	5,385	12,234	18,018	22,544
カナダ	-3	-9	-14	-26
欧州	67	69	51	-80
ドイツ	0	0	-1	-2
イギリス	0	-1	-1	-1
アジア・オセアニア	0	-1	-2	-5
オーストラリア	-32	-125	-180	-347
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	0	-1	-10	-15
エマージング株式	1,476	3,867	6,981	11,180
グローバル	20	88	276	688
BRICS	-8	-19	-28	-47
その他	1,464	3,798	6,733	10,540
欧州	-1	-2	-1	1
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-43	-174	-221	-556
中国	-30	-132	-297	-486
インド	1,568	4,162	7,292	11,628
インドネシア	5	4	12	32
タイ	0	-2	-2	-5
フィリピン	0	-2	-3	-2
ベトナム	-21	-27	-18	9
韓国	0	0	0	0
香港	-1	4	4	5
中南米	-1	-3	-4	-11
ブラジル	-12	-33	-49	-83
メキシコ	1	0	0	1
中東・アフリカ	-2	-5	-13	-20
トルコ	-1	-4	-5	-10
複合地域	2	11	38	38

<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	14,042	30,221	54,070	85,340
外国債券(先進国)	644	1,408	3,624	7,967
グローバル	599	1,353	3,622	7,080
除く日本	404	656	1,471	2,492
含む日本	196	697	2,151	4,588
その他	45	55	1	887
北米	18	59	68	96
米国	136	391	628	1,801
カナダ	-11	-45	-81	-147
欧州	1	-2	-15	91
イギリス	0	0	-1	-1
アジア・オセアニア	-18	-71	-111	-124
オーストラリア	-71	-247	-439	-744
ニュージーランド	-2	-5	-4	2
複合地域	-9	-24	-44	-87
エマージング債券	65	-19	-26	157
グローバル	75	21	-54	99
米ドル建て	-5	-50	-143	-6
現地通貨建て	80	72	90	105
その他	-10	-41	28	58
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-2	-6	-14	-23
中国	-2	-5	-20	-4
インド	20	54	204	421
インドネシア	1	-3	9	27
ブラジル	-21	-63	-120	-315
メキシコ	-4	-15	-26	-41
トルコ	-1	-1	-1	-3
複合地域	0	-1	-2	-5
ハイイールド債券	40	155	541	1,394
グローバル	7	-4	-65	-169
北米	49	223	731	1,812
その他	-16	-64	-125	-249
欧州	-12	-50	-97	-205
アジア・オセアニア	-4	-13	-27	-42
複合地域	0	-1	-1	-2
複合資産	641	1,004	2,307	5,414
安定	-159	-568	-1,003	-1,569
安定成長	424	713	1,550	3,402
成長	508	1,367	2,600	4,904
国内バランス	-89	-332	-617	-1,108
安定	-116	-404	-762	-1,363
一般	-3	-13	-21	-39
その他	-43	-176	-223	-216

<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	14,042	30,221	54,070	85,340
国内REIT	-191	-826	-1,300	-821
日本	-191	-826	-1,300	-821
外国REIT	-163	-853	-963	236
グローバル	-89	-468	-516	-316
除く日本	17	-59	131	715
含む日本	-111	-415	-653	-1,038
北米	-34	-242	-185	873
その他	-40	-143	-262	-321
欧州	-1	-3	-5	-16
アジア・オセアニア	-27	-103	-201	-214
オーストラリア	-10	-30	-45	-69
複合地域	0	-1	-2	-4
複数国	-1	-5	-10	-18
その他	9	-220	-455	903
絶対収益型	60	77	-242	-117
ロング・ショート	16	8	-6	45
マーケットニュートラル	-13	-36	-78	-167
GTAA	-7	-19	-39	-82
その他スタイル	63	121	-125	99
CB	-47	-135	100	687
アジア・オセアニア	0	-1	-1	-2
日本	0	1	3	3
グローバル	-47	-136	98	687
コモディティ	122	378	371	948
全業種	15	42	46	143
貴金属	108	336	328	814
エネルギー	-2	-2	-5	-16
その他コモディティ	1	2	2	6

＜4＞純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別①

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	1,160,706	100.00	5,380	100.00
国内株式	157,586	13.58	772	14.35
一般	88,145	7.59	471	8.75
フリー	62,242	5.36	371	6.90
バリュー	25,870	2.23	98	1.82
小型	7,861	0.68	87	1.62
その他	60,405	5.20	208	3.87
日経225	28,534	2.46	72	1.34
TOPIX	25,909	2.23	83	1.54
JPX日経400	931	0.08	13	0.24
国内債券	42,960	3.70	148	2.75
一般	42,960	3.70	148	2.75
外国株式(先進国)	534,497	46.05	1,221	22.70
グローバル	348,949	30.06	839	15.59
除く日本	104,290	8.99	197	3.66
含む日本	244,658	21.08	642	11.93
その他	185,549	15.99	382	7.10
北米	2,982	0.26	13	0.24
米国	177,858	15.32	298	5.54
カナダ	128	0.01	2	0.04
欧州	1,776	0.15	39	0.72
ドイツ	18	0.00	1	0.02
イギリス	8	0.00	3	0.06
アジア・オセアニア	36	0.00	1	0.02
オーストラリア	2,703	0.23	23	0.43
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	27	0.00	1	0.02
エマージング株式	46,583	4.01	312	5.80
グローバル	11,912	1.03	94	1.75
BRICS	453	0.04	7	0.13
その他	34,217	2.95	211	3.92
欧州	98	0.01	6	0.11
ロシア	8	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	4,337	0.37	84	1.56
中国	1,181	0.10	32	0.59
インド	25,911	2.23	37	0.69
インドネシア	209	0.02	5	0.09
タイ	6	0.00	2	0.04
フィリピン	30	0.00	4	0.07
ベトナム	1,664	0.14	13	0.24
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	19	0.00	1	0.02
中南米	64	0.01	2	0.04
ブラジル	496	0.04	11	0.20
メキシコ	10	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	68	0.01	3	0.06
トルコ	57	0.00	2	0.04
複合地域	60	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	1,160,706	100.00	5,380	100.00
外国債券(先進国)	95,719	8.25	751	13.96
グローバル	78,455	6.76	534	9.93
除く日本	35,600	3.07	225	4.18
含む日本	42,855	3.69	309	5.74
その他	17,265	1.49	217	4.03
北米	171	0.01	8	0.15
米国	7,925	0.68	115	2.14
カナダ	634	0.05	4	0.07
欧州	1,066	0.09	27	0.50
イギリス	9	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,501	0.13	9	0.17
オーストラリア	4,824	0.42	32	0.59
ニュージーランド	81	0.01	9	0.17
複合地域	1,054	0.09	8	0.15
エマージング債券	12,276	1.06	239	4.44
グローバル	6,967	0.60	172	3.20
米ドル建て	4,983	0.43	134	2.49
現地通貨建て	1,984	0.17	38	0.71
その他	5,309	0.46	67	1.25
ロシア	3	0.00	4	0.07
アジア・オセアニア	230	0.02	6	0.11
中国	140	0.01	8	0.15
インド	2,781	0.24	16	0.30
インドネシア	337	0.03	7	0.13
ブラジル	1,496	0.13	20	0.37
メキシコ	259	0.02	3	0.06
トルコ	30	0.00	2	0.04
複合地域	33	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	21,103	1.82	239	4.44
グローバル	2,768	0.24	38	0.71
北米	16,505	1.42	139	2.58
その他	1,831	0.16	62	1.15
欧州	1,412	0.12	40	0.74
アジア・オセアニア	380	0.03	21	0.39
複合地域	38	0.00	1	0.02
複合資産	153,637	13.24	1,062	19.74
安定	38,699	3.33	285	5.30
安定成長	69,484	5.99	441	8.20
成長	36,179	3.12	294	5.46
国内バランス	6,143	0.53	28	0.52
安定	5,067	0.44	9	0.17
一般	287	0.02	15	0.28
その他	3,131	0.27	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	1,160,706	100.00	5,380	100.00
国内REIT	23,461	2.02	142	2.64
日本	23,461	2.02	142	2.64
外国REIT	45,015	3.88	270	5.02
グローバル	18,187	1.57	153	2.84
除く日本	7,868	0.68	67	1.25
含む日本	10,313	0.89	85	1.58
北米	24,166	2.08	69	1.28
その他	2,661	0.23	48	0.89
欧州	92	0.01	6	0.11
アジア・オセアニア	1,796	0.15	26	0.48
オーストラリア	475	0.04	12	0.22
複合地域	60	0.01	3	0.06
複数国	238	0.02	1	0.02
その他	27,869	2.40	224	4.16
絶対収益型	11,890	1.02	91	1.69
ロング・ショート	856	0.07	28	0.52
マーケットニュートラル	341	0.03	13	0.24
GTAA	328	0.03	11	0.20
その他スタイル	10,291	0.89	38	0.71
CB	2,922	0.25	40	0.74
アジア・オセアニア	34	0.00	1	0.02
日本	29	0.00	1	0.02
グローバル	2,859	0.25	38	0.71
コモディティ	6,523	0.56	37	0.69
全業種	1,874	0.16	13	0.24
貴金属	4,556	0.39	22	0.41
エネルギー	65	0.01	1	0.02
その他コモディティ	28	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	15,504	10.3	2.69	2.39	1.092
国内株式	23,200	14.4	1.59	1.27	1.004
一般	21,710	14.2	2.20	1.80	1.359
フリー	21,137	13.6	1.72	1.41	1.413
バリュー	24,040	16.2	3.44	2.81	1.229
小型	26,955	15.2	1.60	1.38	1.699
その他	25,096	14.4	0.57	0.40	0.384
日経225	27,162	15.9	0.55	0.39	0.440
TOPIX	26,070	15.2	0.16	0.12	0.234
JPX日経400	23,761	9.4	0.51	0.38	0.473
国内債券	10,335	12.3	0.12	0.12	0.454
一般	10,335	12.3	0.12	0.12	0.454
外国株式(先進国)	19,071	7.8	3.14	2.65	1.125
グローバル	19,663	7.9	2.56	2.32	1.217
除く日本	28,967	10.6	0.44	0.42	0.518
含む日本	16,809	7.0	3.48	3.14	1.516
その他	17,769	7.5	4.23	3.27	0.950
北米	17,663	5.7	0.53	0.47	0.951
米国	18,709	6.7	4.23	3.24	0.932
カナダ	6,428	12.9	7.56	7.46	1.989
欧州	16,299	12.2	2.73	2.52	1.362
ドイツ	18,498	9.9	0.00	0.00	0.770
イギリス	7,488	7.6	9.90	10.50	1.831
アジア・オセアニア	11,371	17.7	3.28	3.08	1.639
オーストラリア	10,934	9.1	8.76	8.57	1.823
ニュージーランド	18,432	11.6	2.27	2.17	1.672
複合地域	12,003	10.8	8.63	8.33	1.705
エマージング株式	14,850	11.0	3.61	2.81	1.658
グローバル	14,825	8.5	0.41	0.37	0.992
BRICS	16,049	17.8	0.92	0.84	2.064
その他	14,821	11.9	4.80	3.73	1.885
欧州	9,321	17.7	0.78	0.50	1.947
ロシア	972	14.8	0.00	0.00	1.174
アジア・オセアニア	15,286	13.1	2.24	2.18	1.653
中国	12,497	9.5	1.39	1.65	1.921
インド	19,469	10.9	5.72	4.32	1.924
インドネシア	13,589	11.2	1.14	1.00	1.772
タイ	13,139	11.9	1.30	1.33	1.821
フィリピン	12,528	11.5	0.39	0.35	1.707
ベトナム	18,608	6.6	1.90	1.52	1.876
韓国	13,978	5.2	0.00	0.00	1.804
香港	12,660	14.5	2.59	2.84	0.858
中南米	12,228	17.1	1.67	1.33	2.037
ブラジル	6,834	12.7	3.93	3.50	1.964
メキシコ	15,368	10.9	3.29	2.60	1.667
中東・アフリカ	14,379	12.2	1.60	1.40	2.159
トルコ	16,328	22.6	2.72	2.26	2.033
複合地域	19,783	10.6	1.73	1.56	0.990

(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	15,504	10.3	2.69	2.39	1.092
外国債券(先進国)	10,516	10.7	1.38	1.30	0.967
グローバル	11,012	10.8	1.16	1.09	0.912
除く日本	12,283	13.1	0.91	0.84	0.695
含む日本	10,086	9.1	1.39	1.33	1.092
その他	9,295	10.5	2.33	2.23	1.217
北米	10,491	7.6	2.22	2.18	1.228
米国	10,060	8.2	2.37	2.32	1.166
カナダ	7,788	13.1	1.63	1.46	1.378
欧州	7,766	14.4	1.49	1.43	1.082
イギリス	7,821	8.8	3.87	3.32	1.293
アジア・オセアニア	9,559	13.9	2.51	2.35	1.437
オーストラリア	8,678	14.5	2.51	2.37	1.244
ニュージーランド	9,647	9.7	1.61	1.47	1.372
複合地域	5,706	13.8	2.22	2.03	1.193
エマージング債券	10,072	12.2	3.85	3.41	1.387
グローバル	10,048	12.7	2.49	2.19	1.201
米ドル建て	9,784	13.2	2.81	2.46	1.349
現地通貨建て	10,979	10.9	1.67	1.51	0.829
その他	10,135	11.0	5.65	5.01	1.632
ロシア	1,778	11.1	0.00	0.00	1.536
アジア・オセアニア	10,036	13.2	6.72	6.53	1.627
中国	12,109	4.4	1.41	1.29	1.237
インド	10,654	9.5	6.39	5.84	1.707
インドネシア	10,020	11.3	5.53	5.20	1.668
ブラジル	11,873	13.7	4.76	3.73	1.579
メキシコ	9,892	11.4	5.03	4.11	1.369
トルコ	1,350	11.4	4.15	7.47	1.474
複合地域	4,446	17.5	1.62	1.35	1.210
ハイイールド債券	10,191	12.7	5.17	4.65	1.660
グローバル	8,506	11.5	3.22	2.81	1.451
北米	11,609	13.6	5.34	4.80	1.683
その他	8,045	11.4	6.59	6.16	1.766
欧州	8,506	10.9	5.97	5.42	1.738
アジア・オセアニア	7,315	11.9	8.98	9.03	1.868
複合地域	4,954	19.9	5.49	4.84	1.800
複合資産	14,259	9.7	1.12	1.05	0.920
安定	11,774	9.7	1.23	1.15	1.056
安定成長	13,839	10.1	1.32	1.25	0.925
成長	17,639	9.2	0.40	0.36	0.778
国内バランス	12,894	11.4	2.15	2.13	0.956
安定	10,723	12.6	1.70	1.73	0.914
一般	14,315	11.9	1.08	0.95	1.255
その他	9,844	3.9	1.53	1.39	0.702

(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	15,504	10.3	2.69	2.39	1.092
国内REIT	13,114	10.2	7.62	9.17	0.905
日本	13,114	10.2	7.62	9.17	0.905
外国REIT	12,862	9.7	8.22	8.33	1.445
グローバル	14,120	9.3	3.18	3.08	1.171
除く日本	15,605	7.7	1.87	1.89	0.912
含む日本	12,996	10.6	4.17	3.98	1.369
北米	11,956	10.5	12.16	12.42	1.618
その他	10,155	9.8	6.78	7.09	1.745
欧州	6,641	10.5	4.82	4.61	1.879
アジア・オセアニア	11,018	9.1	8.30	8.84	1.796
オーストラリア	10,394	9.4	4.46	4.24	1.696
複合地域	8,272	12.1	0.85	0.77	0.771
複数国	11,569	19.8	2.17	2.07	1.650
その他					
絶対収益型	10,748	7.0	0.02	0.02	1.925
ロング・ショート	10,773	6.2	0.18	0.18	1.523
マーケットニュートラル	10,026	6.3	0.00	0.00	1.271
GTAA	11,242	11.0	0.21	0.20	1.548
その他スタイル	10,791	6.6	0.00	0.00	1.996
CB	12,285	7.7	0.44	0.41	1.175
アジア・オセアニア	10,812	13.7	2.42	2.22	1.823
日本	14,926	24.3	0.37	0.33	0.770
グローバル	12,255	7.1	0.40	0.38	1.172
コモディティ	12,820	7.7	0.00	0.00	0.909
全業種	10,670	11.7	0.00	0.00	1.255
貴金属	13,453	5.1	0.00	0.00	0.766
エネルギー	21,145	15.0	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	18,525	7.4	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