

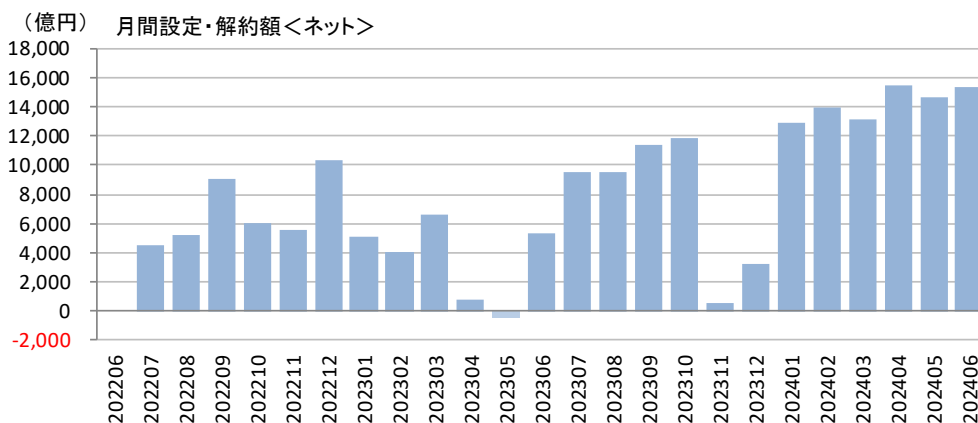
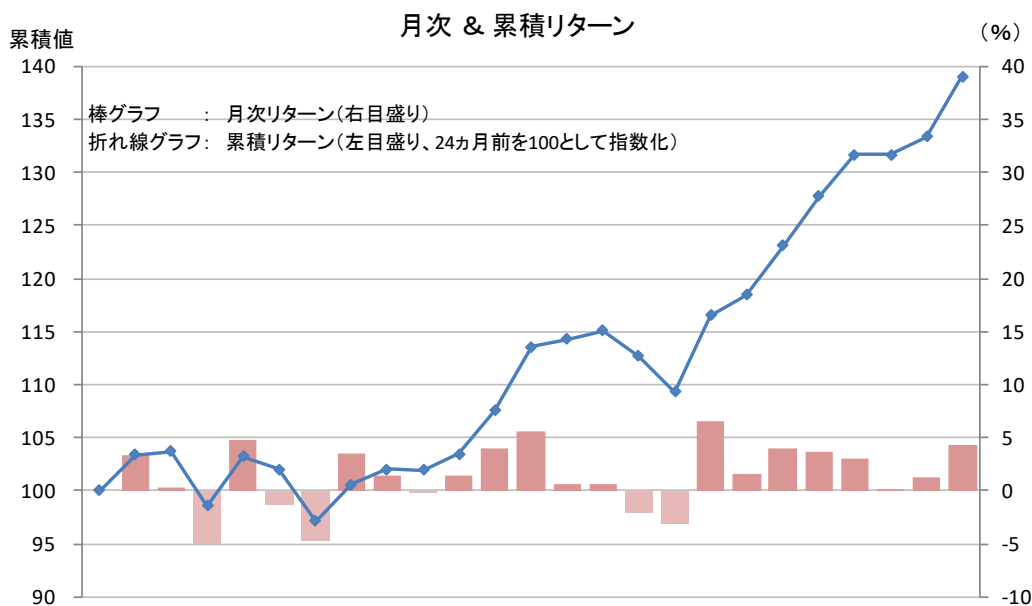
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

— Vol.2 ファンド分類 詳細編 —

2024年6月

「総合」 +4.26 %
(前月 +1.28 %)



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		21,199	20,332	867	4.26
国内株式		28,395	27,808	587	2.11
一般		27,543	26,971	571	2.12
フリー		25,522	24,894	628	2.52
バリュー		37,042	36,596	446	1.22
小型		46,394	44,918	1,475	3.28
その他		29,116	28,567	549	1.92
日経225		27,663	26,884	779	2.90
TOPIX		28,864	28,456	408	1.43
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	27,547	27,098	449	1.66
国内債券		12,148	12,130	18	0.15
一般		12,148	12,130	18	0.15
外国株式(先進国)		31,538	29,751	1,787	6.01
グローバル		33,243	31,596	1,647	5.21
除く日本		54,236	51,304	2,932	5.72
含む日本		28,731	27,364	1,366	4.99
その他		27,409	25,514	1,894	7.42
北米		35,680	32,905	2,775	8.43
米国		42,772	39,787	2,985	7.50
カナダ	10,000 (2009.02.27)	24,864	24,568	295	1.20
欧州		31,966	31,554	412	1.30
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	16,518	16,545	-27	-0.16
イギリス	9,683 (2014.05.30)	11,740	11,890	-150	-1.26
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	48,863	46,855	2,008	4.29
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	24,929	23,798	1,132	4.76
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	52,533	50,945	1,588	3.12
複合地域	10,000 (2013.04.30)	18,134	17,975	160	0.89
エマージング株式		27,046	25,186	1,860	7.39
グローバル		25,170	24,086	1,084	4.50
BRICS	10,000 (2005.09.30)	29,041	27,946	1,095	3.92
その他		29,060	26,808	2,252	8.40
欧州		21,513	20,801	712	3.42
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,089	1,086	3	0.23
アジア・オセアニア		23,235	22,025	1,210	5.49
中国		37,170	37,476	-306	-0.82
インド	10,000 (2004.09.30)	81,304	74,196	7,107	9.58
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	17,099	16,880	219	1.30
タイ		22,728	22,653	75	0.33
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,509	8,244	265	3.21
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	29,287	28,328	959	3.39
韓国	10,000 (1997.06.30)	36,098	33,871	2,228	6.58
香港		23,966	23,778	188	0.79
中南米	7,427 (2006.04.28)	12,485	13,093	-607	-4.64
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	10,233	10,408	-175	-1.68
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	18,122	20,149	-2,027	-10.06
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	15,684	14,907	777	5.22
トルコ		60,212	58,596	1,616	2.76
複合地域	10,000 (2005.08.31)	30,203	29,371	832	2.83

※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		21,199	20,332	867	4.26
外国債券(先進国)		20,418	19,942	476	2.39
グローバル		20,268	19,843	424	2.14
除く日本		23,004	22,342	662	2.96
含む日本		18,477	18,214	263	1.44
その他		21,349	20,627	722	3.50
北米	9,052 (2013.05.31)	11,793	11,309	483	4.27
米国		19,459	18,723	736	3.93
カナダ	10,000 (2003.05.30)	19,468	18,766	702	3.74
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,572	15,319	253	1.65
イギリス	10,069 (2014.07.31)	13,096	12,704	393	3.09
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	24,493	23,744	750	3.16
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	30,443	29,498	945	3.20
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	13,282	12,845	438	3.41
複合地域	10,000 (2001.11.30)	21,174	20,459	715	3.49
エマージング債券		22,989	22,661	327	1.44
グローバル		23,284	22,864	420	1.84
米ドル建て		23,897	23,380	517	2.21
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	16,502	16,351	150	0.92
その他	8,647 (2005.03.31)	18,264	18,098	166	0.92
ロシア	10,000 (2008.05.30)	2,033	1,875	158	8.44
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	18,087	17,550	536	3.05
中国	13,833 (2018.07.31)	20,532	20,130	402	2.00
インド	10,000 (2011.08.31)	24,459	23,714	745	3.14
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	20,632	20,343	289	1.42
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	16,998	17,553	-554	-3.16
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	21,424	22,663	-1,239	-5.47
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,607	2,537	70	2.76
複合地域	10,000 (2006.08.31)	13,699	13,679	21	0.15
ハイイールド債券		32,556	31,671	885	2.79
グローバル	10,000 (1997.06.30)	29,903	29,275	629	2.15
北米		33,162	32,178	984	3.06
その他	10,000 (2004.03.31)	28,568	28,193	375	1.33
欧州	10,000 (2006.04.28)	29,013	28,751	262	0.91
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	17,498	17,032	466	2.73
複合地域	10,000 (2004.03.31)	28,802	28,092	710	2.53
複合資産		22,315	21,783	532	2.44
安定	10,000 (1998.10.30)	17,463	17,145	318	1.85
安定成長		25,012	24,389	623	2.56
成長		33,040	32,122	918	2.86
国内バランス		12,485	12,460	24	0.19
安定		12,371	12,350	21	0.17
一般		19,076	18,893	183	0.97
その他	10,000 (2018.10.31)	14,092	13,293	799	6.01

※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

(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		21,199	20,332	867	4.26	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	33,578	33,677	-99	-0.29	
日本	10,000 (2003.10.31)	33,578	33,677	-99	-0.29	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	40,235	38,357	1,879	4.90	
グローバル	10,000 (2004.01.30)	33,200	31,946	1,254	3.93	
除く日本	10,000 (2004.04.30)	37,692	36,167	1,525	4.22	
含む日本	10,000 (2004.01.30)	32,578	31,418	1,160	3.69	
北米	10,000 (2003.09.30)	43,100	40,600	2,500	6.16	
その他	10,000 (2004.04.30)	32,993	32,891	102	0.31	
欧州	10,000 (2006.12.29)	6,146	6,404	-258	-4.03	
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	23,356	23,462	-106	-0.45	
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	20,715	20,373	342	1.68	
複合地域	10,000 (2007.06.29)	9,041	8,956	86	0.96	
複数国	10,000 (2004.04.30)	50,691	48,645	2,045	4.20	
その他		7,840	7,649	192	2.51	
絶対収益型		7,792	7,786	6	0.08	
ロング・ショート		8,366	8,324	42	0.50	
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,725	11,616	109	0.94	
GTAA		12,005	11,831	175	1.48	
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,327	7,329	-1	-0.02	
CB		21,457	21,305	153	0.72	
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	25,035	24,563	472	1.92	
日本		21,980	21,779	202	0.93	
グローバル		37,384	37,124	260	0.70	
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	15,127	15,077	50	0.33	
全業種	10,000 (2004.12.30)	13,623	13,677	-54	-0.40	
貴金属	10,000 (2009.07.31)	25,592	25,454	138	0.54	
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	12,645	11,855	790	6.66	
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	19,430	19,276	154	0.80	

※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	5.63	17.42	22.49	17.42
国内株式	0.59	18.56	21.84	18.56
一般	1.60	18.86	22.34	18.86
フリー	1.69	18.85	21.48	18.85
バリュー	1.41	18.93	25.08	18.93
小型	-2.44	7.53	6.17	7.53
その他	-0.55	19.57	23.31	19.57
日経225	-1.95	19.04	20.89	19.04
TOPIX	1.63	19.98	25.30	19.98
JPX日経400	2.58	21.17	25.91	21.17
国内債券	-2.14	-2.53	-4.23	-2.53
一般	-2.14	-2.53	-4.23	-2.53
外国株式(先進国)	8.73	24.99	33.44	24.99
グローバル	7.74	22.70	30.36	22.70
除く日本	9.45	26.35	34.22	26.35
含む日本	7.00	21.16	28.75	21.16
その他	10.50	29.39	39.56	29.39
北米	13.01	33.56	44.30	33.56
米国	10.59	29.74	40.13	29.74
カナダ	2.50	11.28	13.80	11.28
欧州	5.93	16.68	20.43	16.68
ドイツ	3.05	18.01	23.20	18.01
イギリス	-3.93	2.68	6.16	2.68
アジア・オセアニア	8.86	20.36	18.87	20.36
オーストラリア	4.09	13.01	17.84	13.01
ニュージーランド	3.30	6.39	8.67	6.39
複合地域	2.95	23.00	26.51	23.00
エマージング株式	13.89	25.54	32.47	25.54
グローバル	10.27	21.79	25.16	21.79
BRICS	9.21	15.38	16.27	15.38
その他	15.16	27.01	35.68	27.01
欧州	15.43	26.50	48.43	26.50
ロシア	0.38	1.22	1.21	1.22
アジア・オセアニア	11.29	20.37	19.71	20.37
中国	5.45	7.33	-7.02	7.33
インド	17.32	30.11	45.11	30.11
インドネシア	-8.19	-3.15	-7.32	-3.15
タイ	-0.54	-2.44	-3.27	-2.44
フィリピン	-4.63	6.13	3.49	6.13
ベトナム	2.86	24.89	25.29	24.89
韓国	8.56	11.85	6.28	11.85
香港	15.92	19.69	7.03	19.69
中南米	-8.27	-6.23	0.99	-6.23
ブラジル	-7.86	-8.75	-1.99	-8.75
メキシコ	-12.53	-1.25	5.22	-1.25
中東・アフリカ	6.52	15.70	16.19	15.70
トルコ	28.48	54.24	77.50	54.24
複合地域	4.58	10.57	11.99	10.57

※[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	5.63	17.42	22.49	17.42
外国債券(先進国)	3.48	6.17	8.46	6.17
グローバル	3.11	5.81	7.83	5.81
除く日本	4.70	8.14	10.58	8.14
含む日本	1.78	3.88	5.59	3.88
その他	5.15	7.80	11.34	7.80
北米	4.19	7.45	10.27	7.45
米国	3.58	6.05	9.20	6.05
カナダ	5.78	9.69	11.51	9.69
欧州	2.97	5.32	9.53	5.32
イギリス	5.48	10.69	19.95	10.69
アジア・オセアニア	7.15	9.50	13.98	9.50
オーストラリア	7.42	10.10	14.50	10.10
ニュージーランド	8.29	8.41	14.94	8.41
複合地域	6.23	10.18	10.89	10.18
エマージング債券	3.86	10.36	13.15	10.36
グローバル	4.43	10.79	15.50	10.79
米ドル建て	4.64	11.85	17.47	11.85
現地通貨建て	3.92	8.20	10.65	8.20
その他	3.11	9.76	10.18	9.76
ロシア	304.41	309.56	288.31	309.56
アジア・オセアニア	5.60	11.53	11.88	11.53
中国	5.41	10.29	11.35	10.29
インド	7.14	15.86	15.05	15.86
インドネシア	2.05	7.16	2.41	7.16
ブラジル	-4.37	-0.71	2.86	-0.71
メキシコ	-5.52	3.38	4.86	3.38
トルコ	10.38	5.91	-10.39	5.91
複合地域	2.97	9.29	12.41	9.29
ハイイールド債券	6.03	13.51	18.51	13.51
グローバル	4.81	11.14	16.30	11.14
北米	6.31	14.18	19.12	14.18
その他	5.35	11.01	16.55	11.01
欧州	5.00	9.57	16.70	9.57
アジア・オセアニア	6.54	16.29	15.77	16.29
複合地域	6.34	13.28	19.05	13.28
複合資産	2.75	9.84	12.07	9.84
安定	1.55	6.13	6.97	6.13
安定成長	3.24	10.68	13.05	10.68
成長	3.89	14.32	18.24	14.32
国内バランス	-1.92	-0.02	-0.65	-0.02
安定	-2.27	-1.40	-2.37	-1.40
一般	-0.30	8.88	10.63	8.88
その他	1.20	6.87	14.46	6.87

※[色塗りの基準]期間別リターン> 総合

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

<1>パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別③

	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	5.63	17.42	22.49	17.42
国内REIT	-2.91	-2.00	-3.48	-2.00
日本	-2.91	-2.00	-3.48	-2.00
外国REIT	4.64	8.93	15.56	8.93
グローバル	4.02	8.26	16.05	8.26
除く日本	4.46	9.11	17.65	9.11
含む日本	3.67	7.60	14.84	7.60
北米	5.59	10.12	16.06	10.12
その他	0.31	2.91	8.09	2.91
欧州	3.25	5.76	23.46	5.76
アジア・オセアニア	-0.16	-0.19	3.45	-0.19
オーストラリア	-0.32	11.55	21.57	11.55
複合地域	1.80	9.51	21.21	9.51
複数国	3.18	6.23	9.18	6.23
その他	3.21	12.77	17.40	12.77
絶対収益型	-0.01	3.66	4.35	3.66
ロング・ショート	-0.92	2.37	1.40	2.37
マーケットニュートラル	1.01	3.46	3.44	3.46
GTAA	0.99	5.77	5.22	5.77
その他スタイル	-0.01	3.70	4.61	3.70
CB	1.46	4.53	5.39	4.53
アジア・オセアニア	7.47	16.91	15.71	16.91
日本	-2.21	5.96	7.56	5.96
グローバル	1.43	4.38	5.24	4.38
コモディティ	7.84	19.85	24.78	19.85
全業種	9.53	19.29	20.82	19.29
貴金属	7.24	19.94	26.25	19.94
エネルギー	8.57	30.07	38.23	30.07
その他コモディティ	8.53	21.65	23.32	21.65

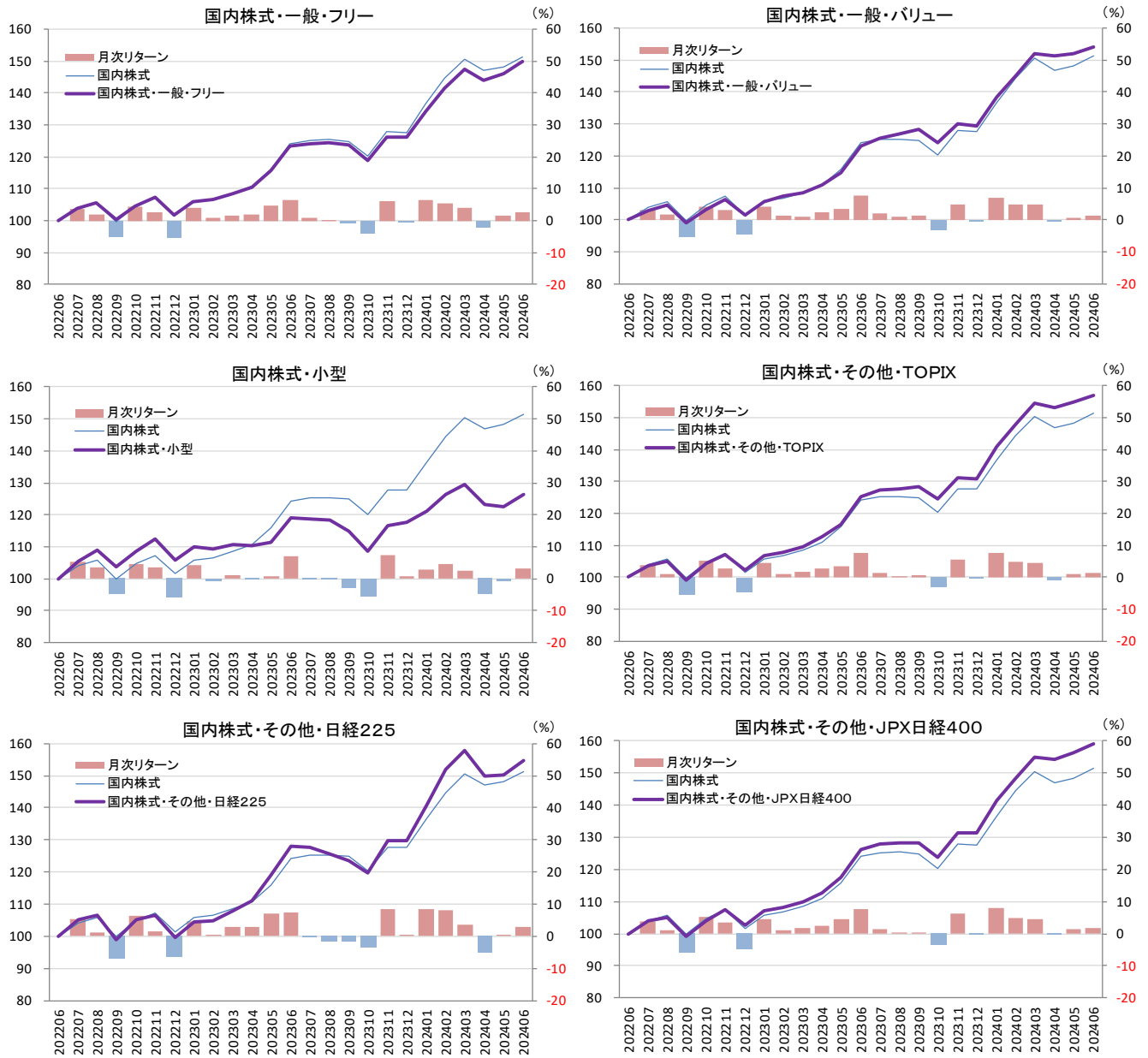
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

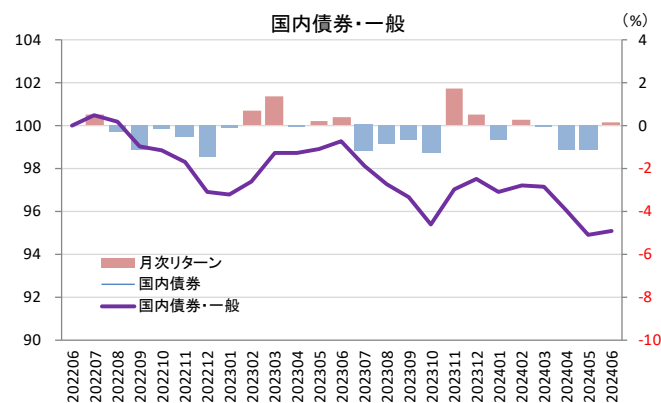
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

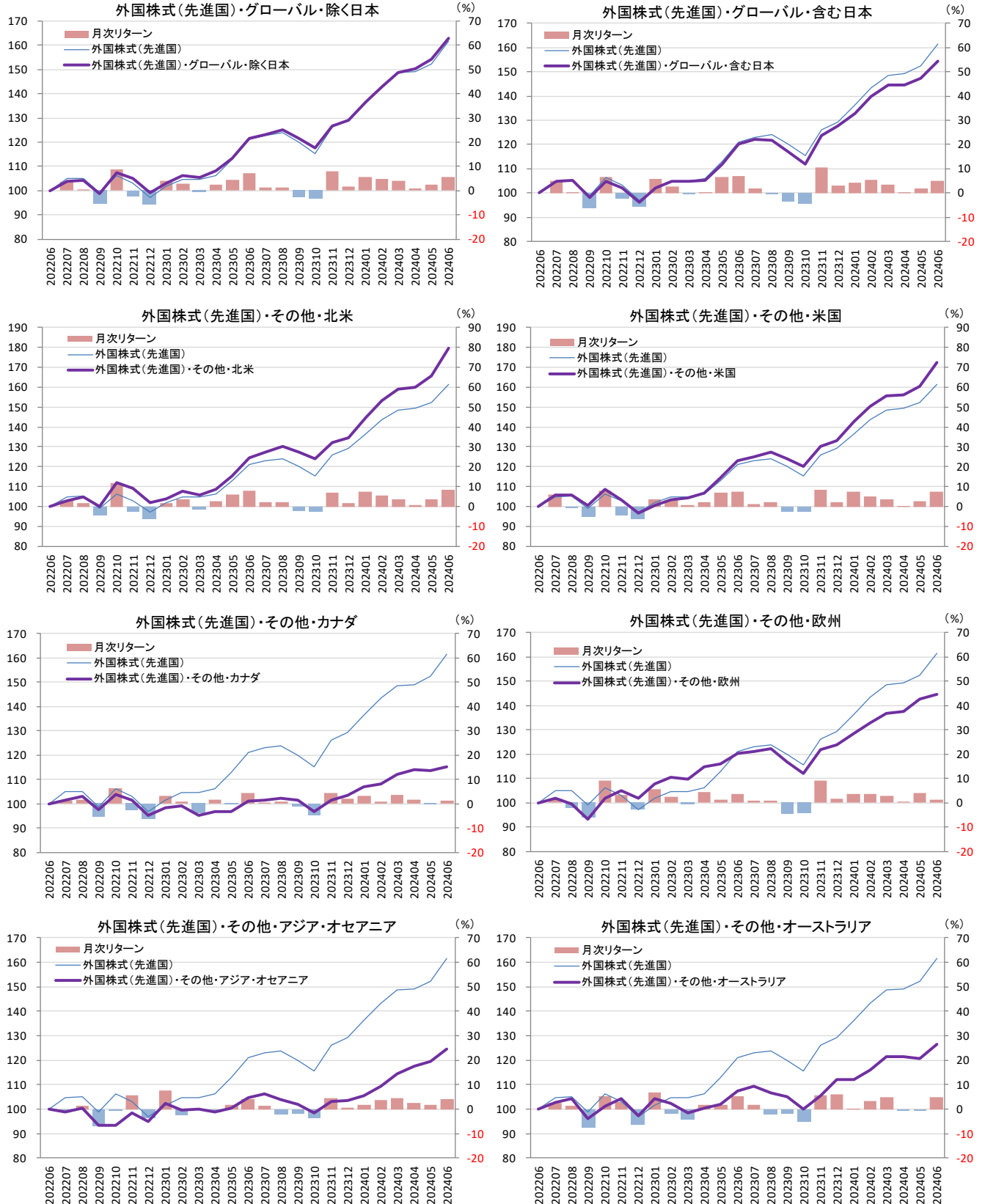


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

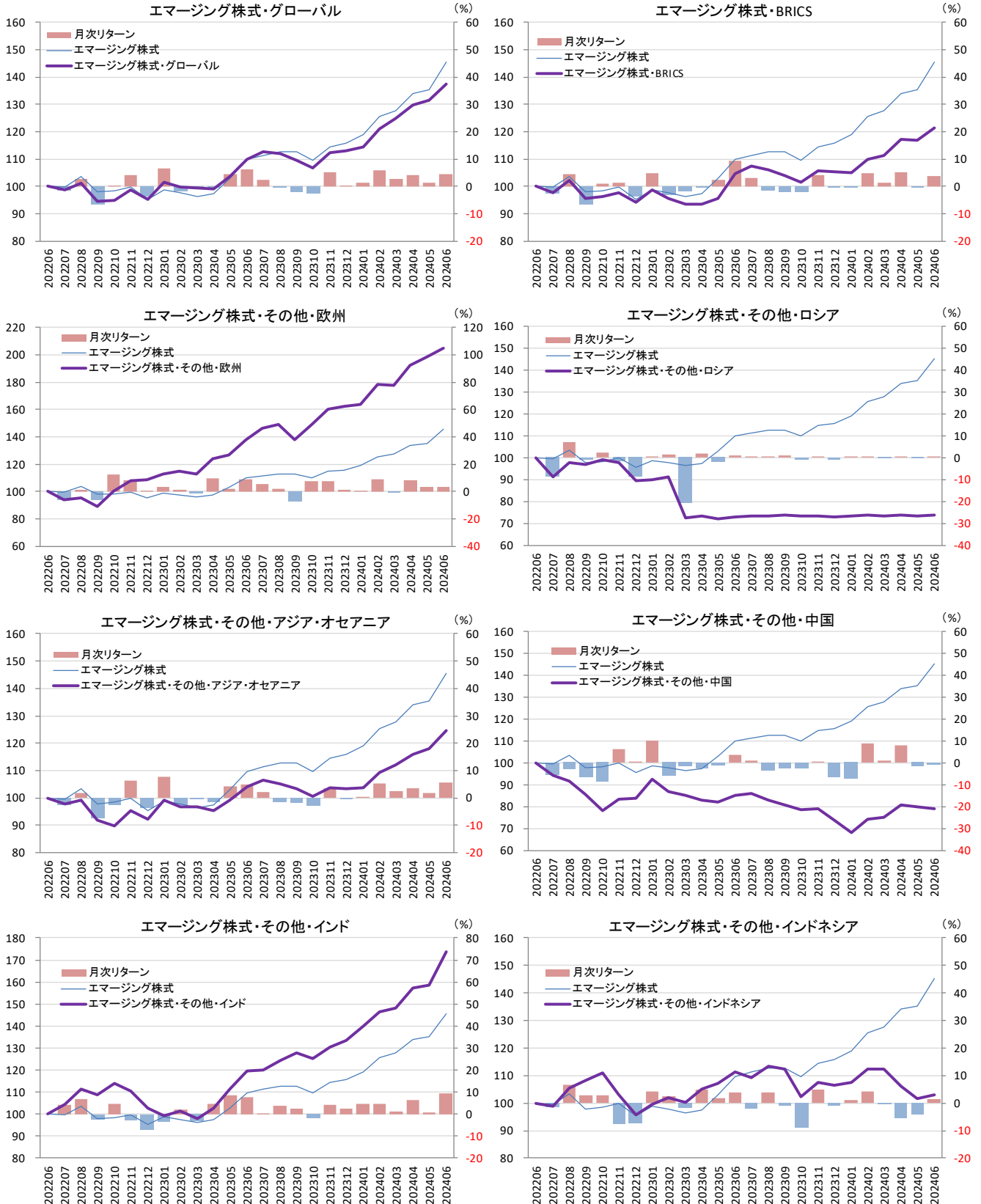


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

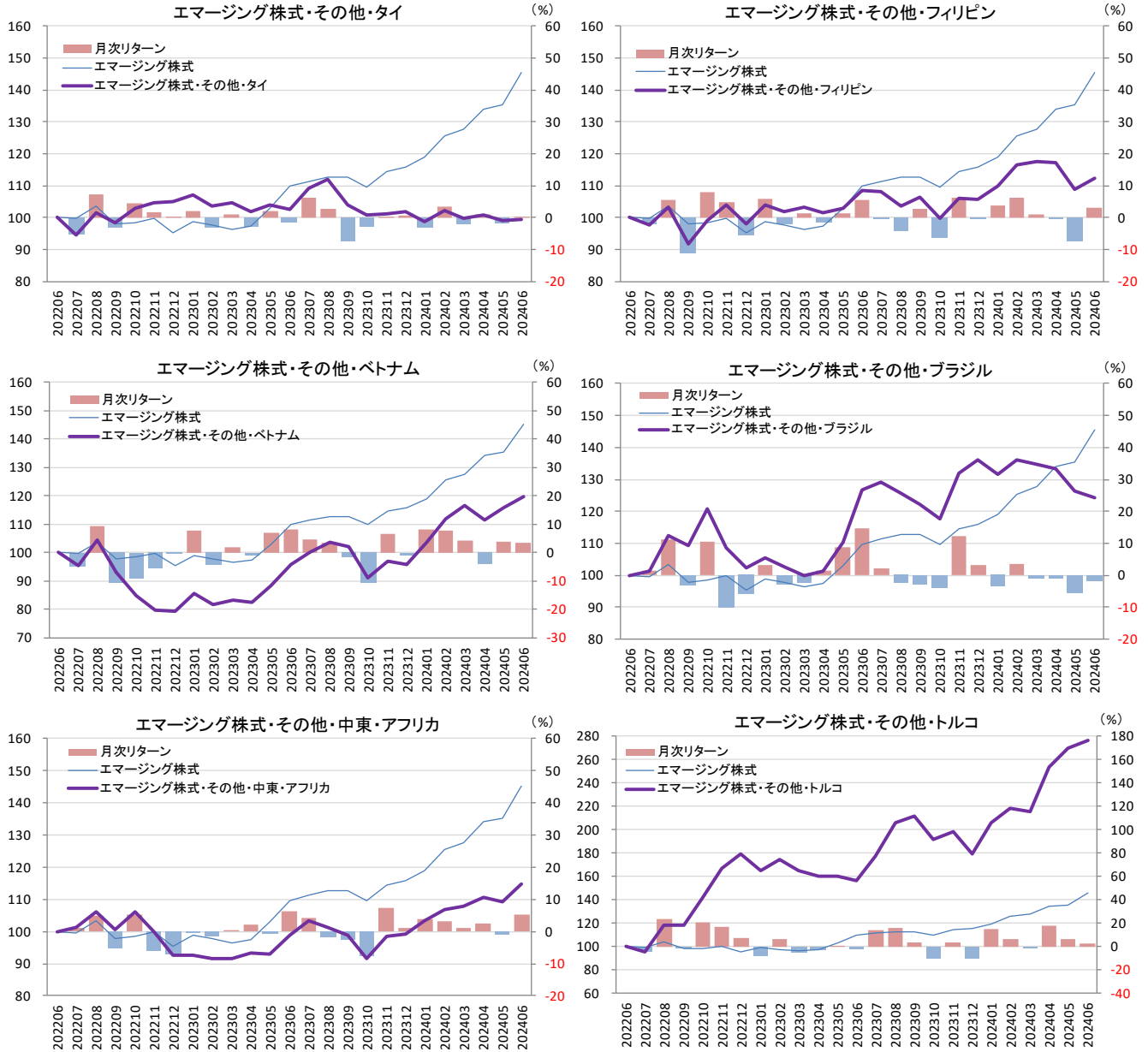


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

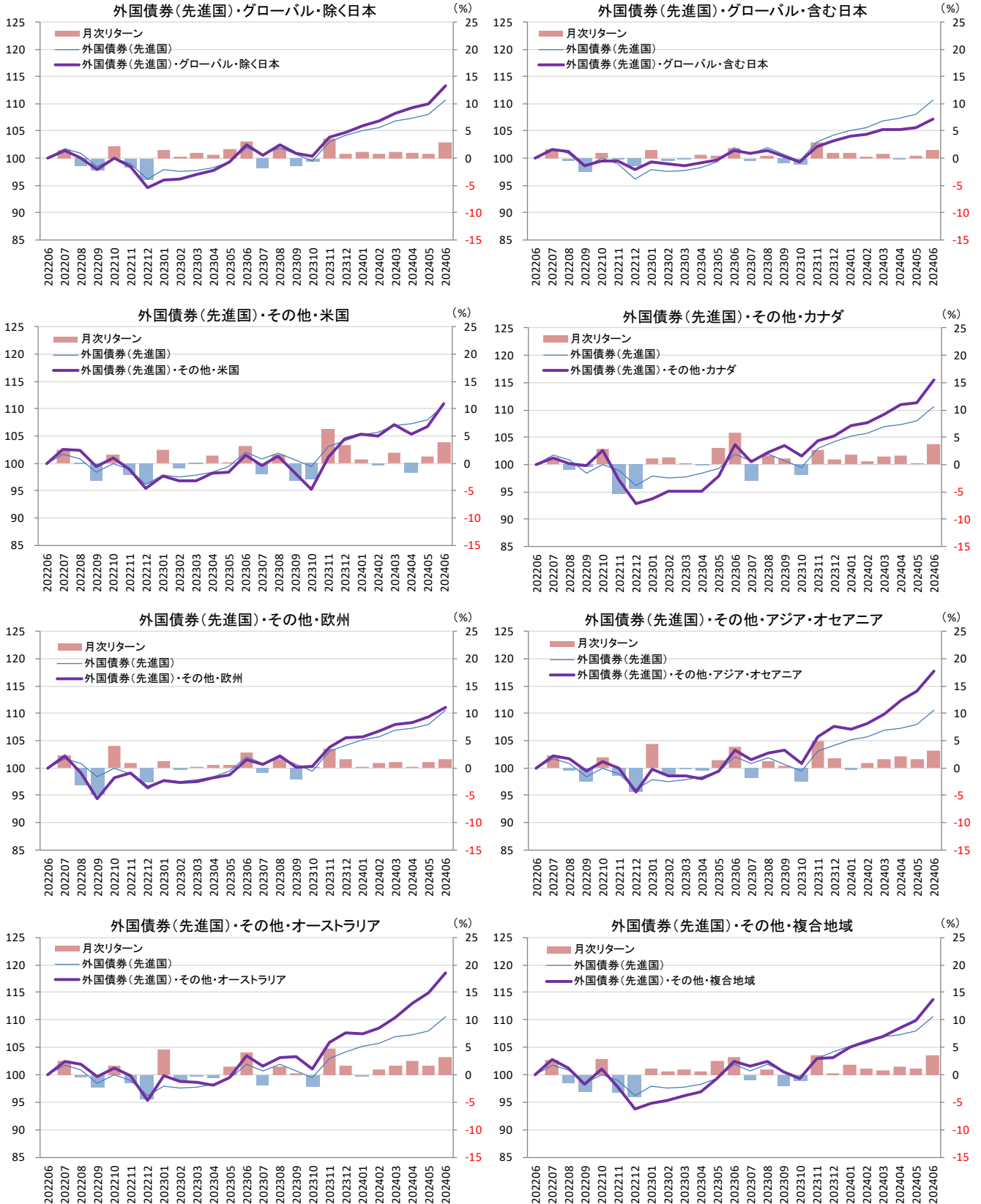


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

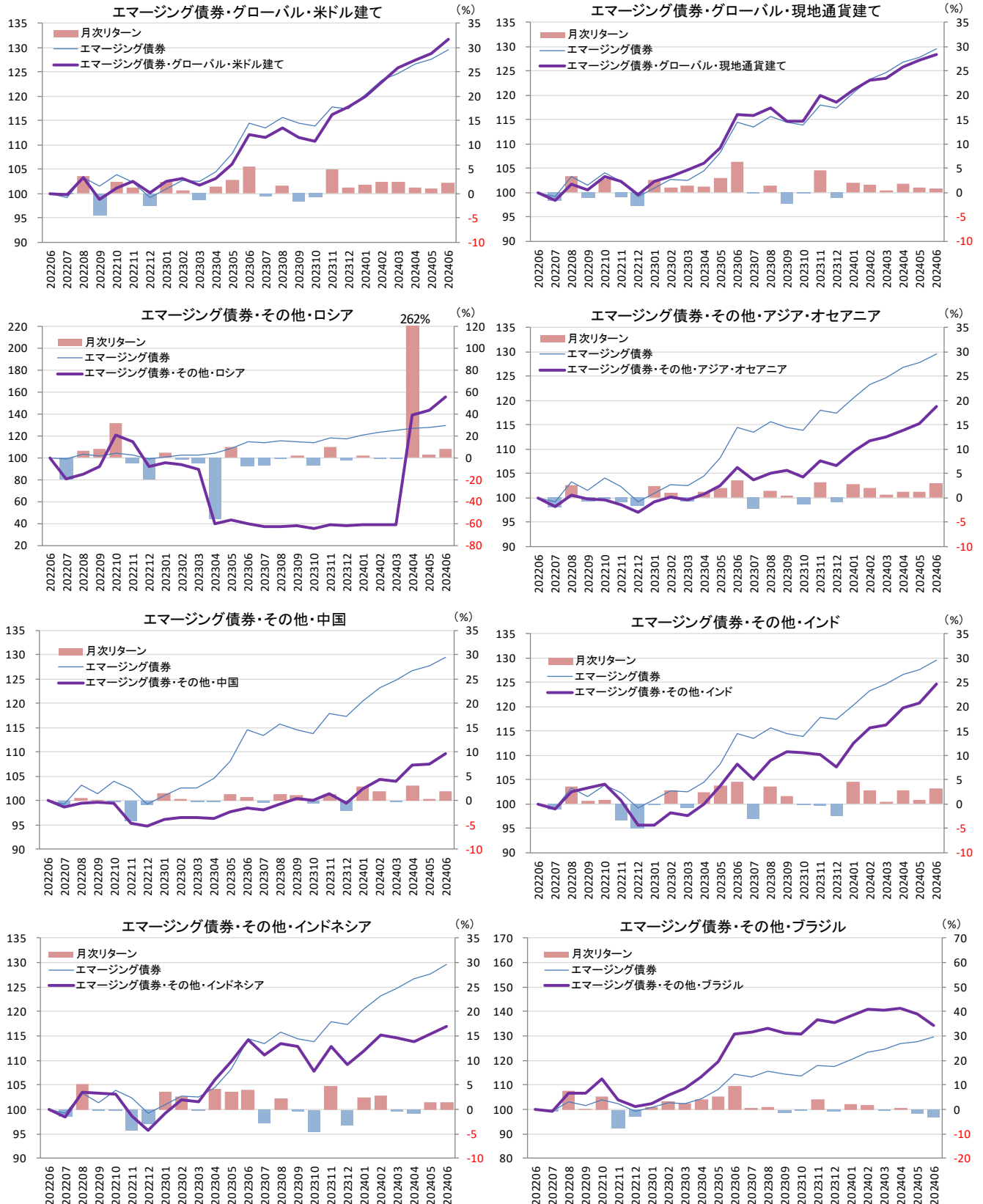


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

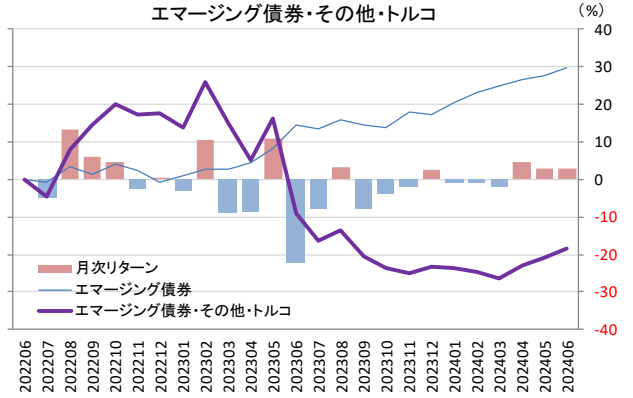
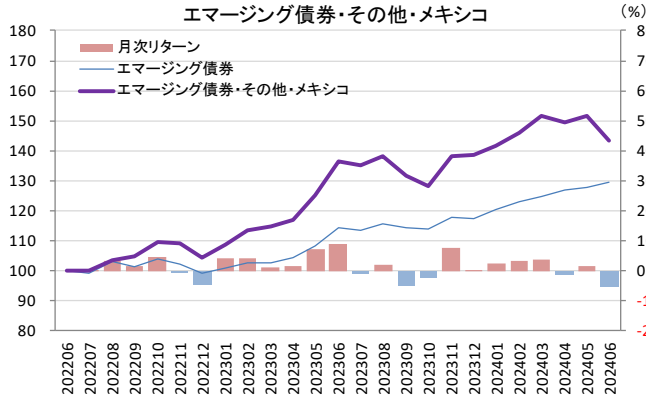


<1>パフォーマンス・サマリー

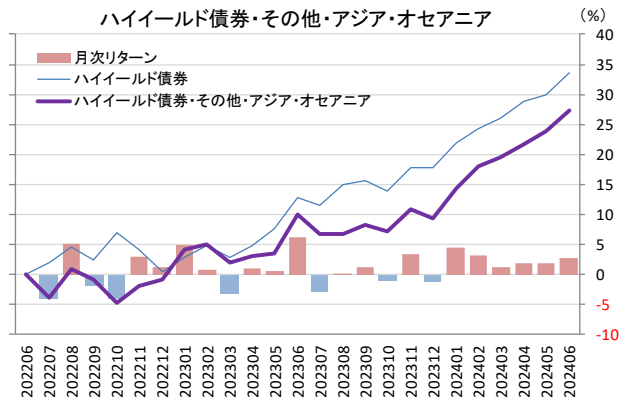
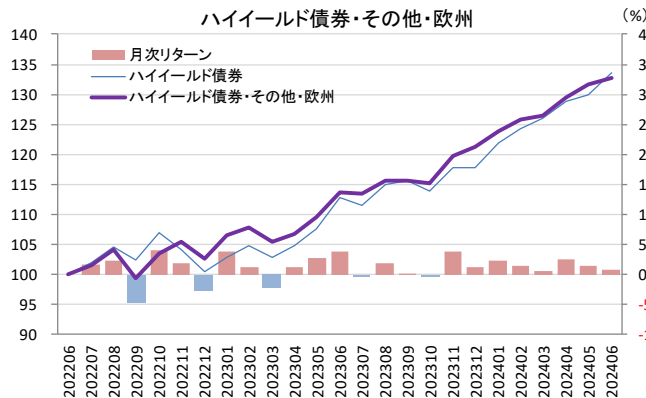
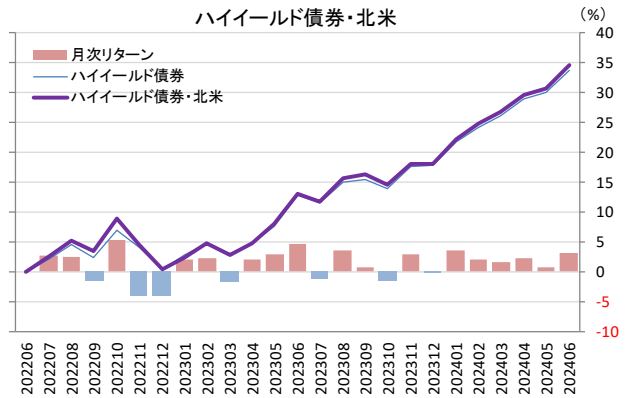
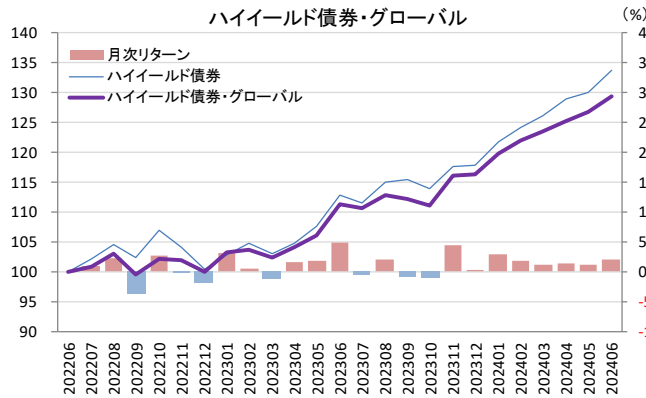
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

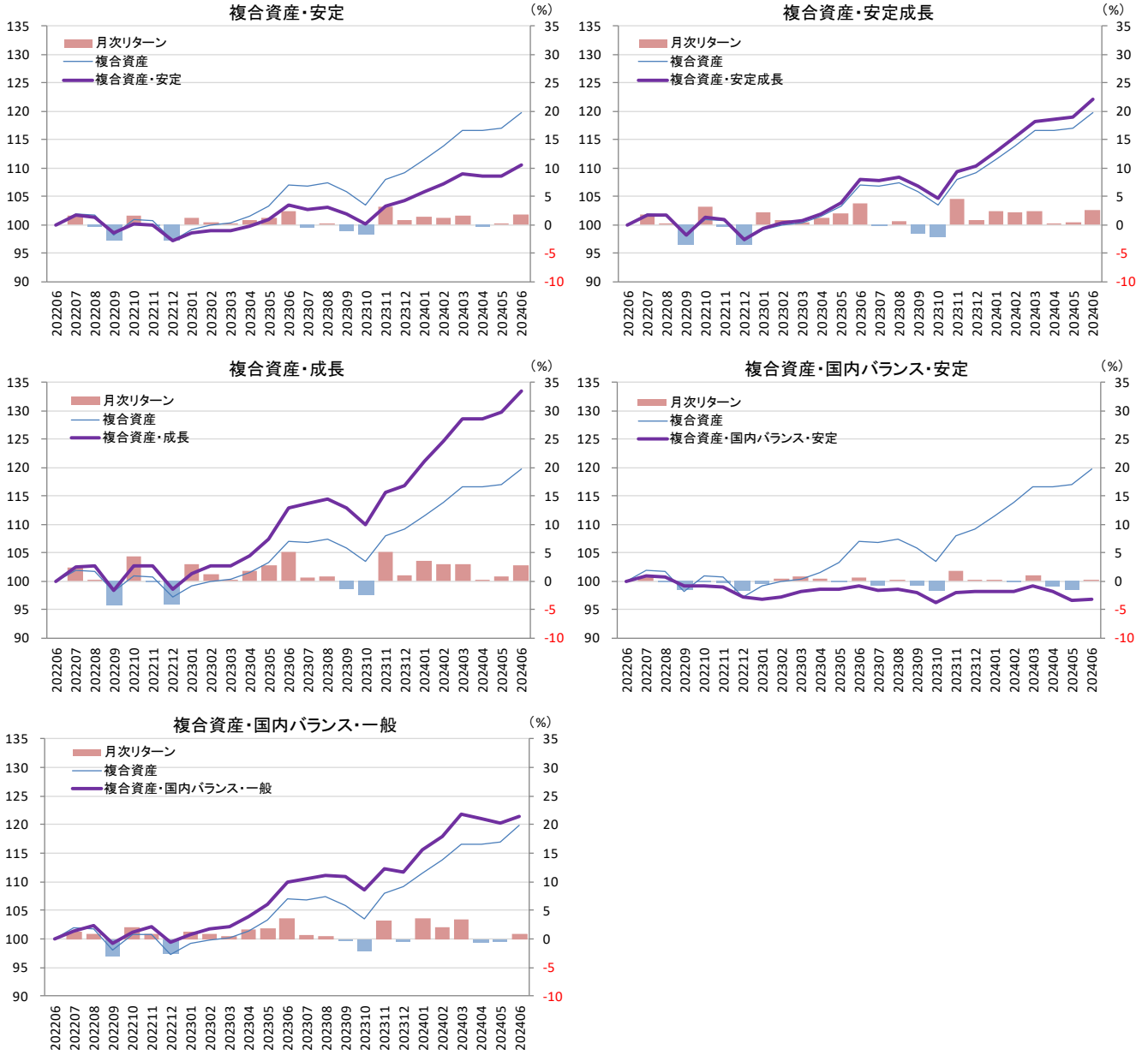


<1>パフォーマンス・サマリー

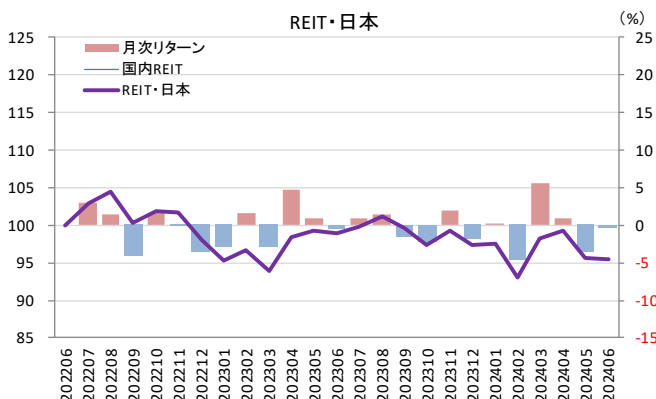
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

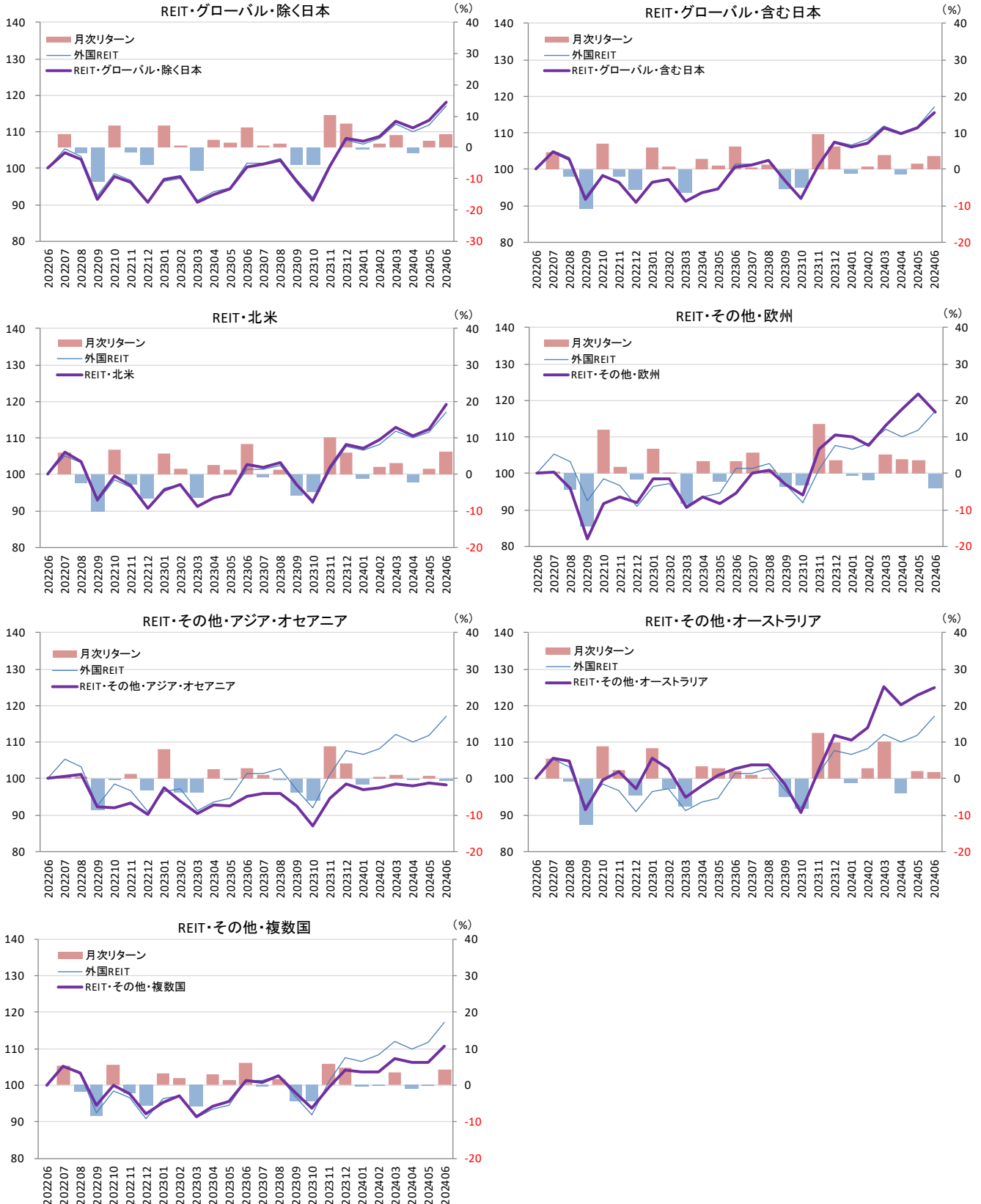


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

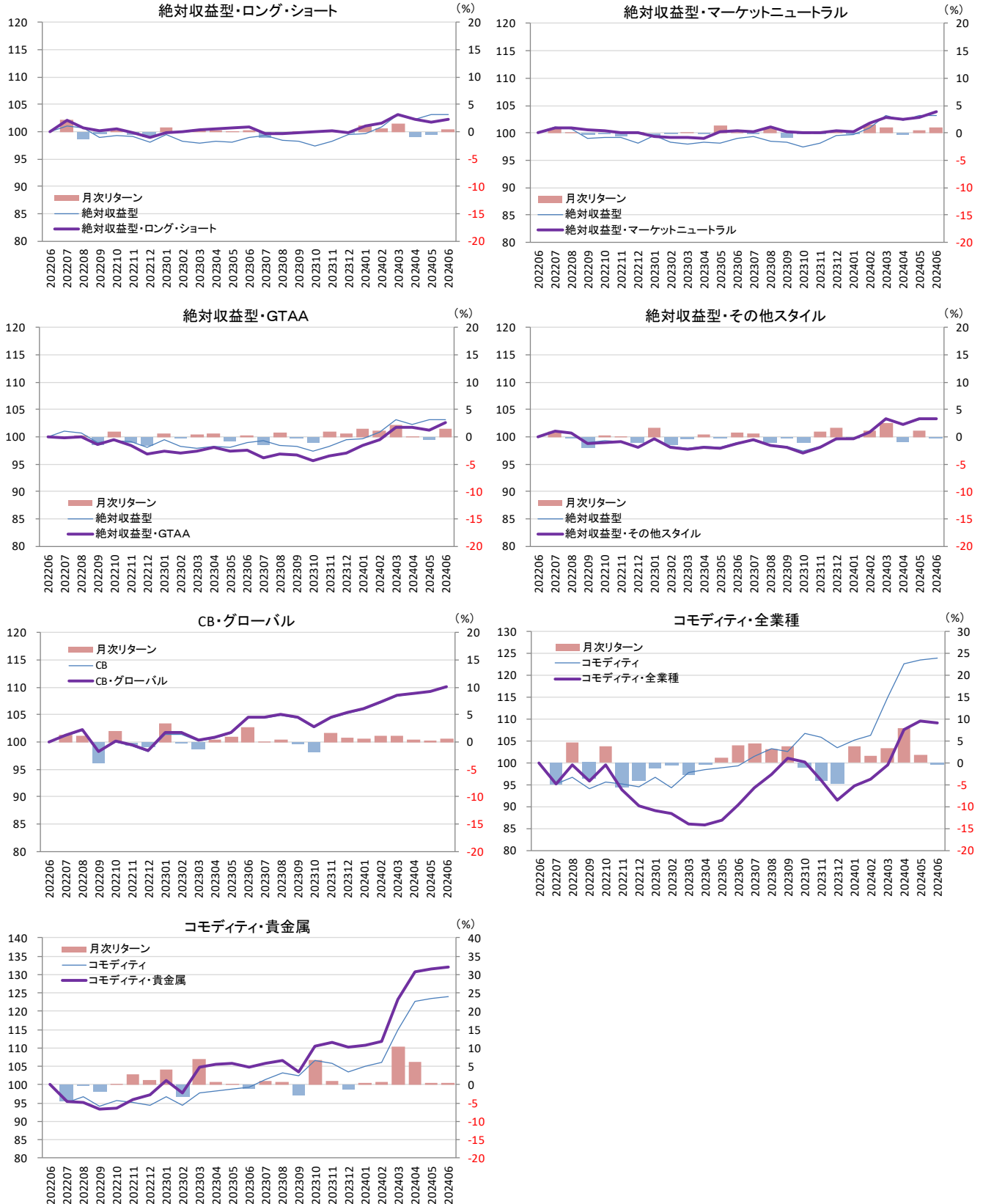


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	4.26		
1	外国株式(先進国)・グローバル	5.21	30.54	1.59
2	外国株式(先進国)・その他	7.42	17.28	1.27
3	エマージング株式・その他	8.40	3.41	0.28
4	国内株式・一般	2.12	7.23	0.15
5	複合資産・安定成長	2.56	5.84	0.15
6	外国債券(先進国)・グローバル	2.14	6.44	0.14
7	REIT・北米	6.16	1.92	0.12
8	国内株式・その他	1.92	5.14	0.10
9	複合資産・成長	2.86	3.07	0.09
10	REIT・グローバル	3.93	1.51	0.06
11	複合資産・安定	1.85	3.05	0.06
12	エマージング株式・グローバル	4.50	1.13	0.05
13	外国債券(先進国)・その他	3.50	1.44	0.05
14	ハイイールド債券・北米	3.06	1.36	0.04
15	国内株式・小型	3.28	0.60	0.02
16	複合資産・その他	6.01	0.24	0.01
17	エマージング債券・グローバル	1.84	0.57	0.01
18	国内債券・一般	0.15	3.38	0.01
19	ハイイールド債券・グローバル	2.15	0.23	0.00
20	国内株式・業種特化	4.14	0.11	0.00
21	エマージング債券・その他	0.92	0.42	0.00
22	コモディティ	0.33	0.65	0.00
23	ハイイールド債券・その他	1.33	0.14	0.00
24	CB	0.72	0.23	0.00
25	エマージング株式・BRICS	3.92	0.04	0.00
26	複合資産・国内バランス	0.19	0.45	0.00
27	絶対収益型	0.08	0.98	0.00
28	REIT・その他	0.31	0.20	0.00
29	REIT・日本	-0.29	1.86	-0.01
	合計		100.00	4.26

◆計算定義

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

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

<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	22.49		
1	外国株式(先進国)・グローバル	30.36	29.54	8.88
2	外国株式(先進国)・その他	39.56	15.23	5.83
3	国内株式・一般	22.34	7.37	1.65
4	国内株式・その他	23.31	5.04	1.20
5	エマージング株式・その他	35.68	2.80	0.96
6	複合資産・安定成長	13.05	6.17	0.81
7	複合資産・成長	18.24	3.09	0.57
8	外国債券(先進国)・グローバル	7.83	6.99	0.55
9	REIT・北米	16.06	2.20	0.33
10	ハイイールド債券・北米	19.12	1.46	0.27
11	REIT・グローバル	16.05	1.66	0.26
12	エマージング株式・グローバル	25.16	1.06	0.25
13	複合資産・安定	6.97	3.53	0.24
14	外国債券(先進国)・その他	11.34	1.58	0.17
15	コモディティ	24.78	0.60	0.14
16	エマージング債券・グローバル	15.50	0.62	0.09
17	エマージング債券・その他	10.18	0.48	0.05
18	絶対収益型	4.35	1.09	0.04
19	ハイイールド債券・グローバル	16.30	0.25	0.04
20	国内株式・小型	6.17	0.69	0.04
21	複合資産・その他	14.46	0.29	0.04
22	国内株式・業種特化	31.01	0.09	0.03
23	ハイイールド債券・その他	16.55	0.17	0.03
24	REIT・その他	8.09	0.25	0.02
25	CB	5.39	0.26	0.01
26	エマージング株式・BRICS	16.27	0.04	0.01
27	複合資産・国内バランス	-0.65	0.59	-0.00
28	REIT・日本	-3.48	2.38	-0.07
29	国内債券・一般	-4.23	3.91	-0.17
	合計		100.00	22.49

◆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	30.93	66.75	94.72	11.33	11.76	10.80	0.83	0.92	0.64
国内株式	41.74	91.90	158.58	12.98 ↑	14.64	15.25	0.95	0.95	0.65
一般	41.77	90.60	148.32	12.41	14.18	15.23	1.00	0.97	0.63
フリー	38.09	87.99	144.56	13.01	14.52	15.59	0.87	0.93	0.60
バリュー	55.06	98.27	159.82	10.91	13.56	14.41	1.44	1.08	0.70
小型	3.75	47.81	143.18	15.18	17.87	16.60	0.08	0.46	0.56
その他	48.85	101.07	182.51	13.80 ↑	15.13	15.36	1.03	0.99	0.71
日経225	43.75	99.85	197.21	15.82 ↑	16.69	16.23	0.81	0.89	0.71
TOPIX	54.44	101.71	170.66	11.78	13.80	14.61	1.33	1.09	0.72
JPX日経400	55.81	104.39	163.16	12.26	14.19	14.58	1.30	1.09	0.70
国内債券	-8.18	-9.38	-2.47	2.51	2.35	2.04	-1.11	-0.82	-0.11
一般	-8.18	-9.38	-2.47	2.51	2.35	2.04	-1.11	-0.82	-0.11
外国株式(先進国)	43.68	123.26	170.99	16.70	17.20	16.22	0.77	1.01	0.65
グローバル	35.40	114.05	169.51	16.84	17.25	16.14	0.63	0.95	0.65
除く日本	68.23	148.01	236.20	14.67	16.70	16.51	1.29	1.19	0.78
含む日本	25.92	103.41	150.79	17.78	17.77	16.30	0.45	0.86	0.59
その他	65.01	143.10	173.39	16.61	17.50	16.68	1.10	1.11	0.64
北米	114.11	217.70	248.68	14.71	17.67	17.75	1.97	1.47	0.75
米国	65.44	157.76	212.37	16.82	17.05	17.02	1.09	1.22	0.71
カナダ	23.02	50.24	22.72	11.51	17.61	15.87	0.62	0.48	0.13
欧州	36.21	82.64	106.57	14.48	17.00	16.18	0.75	0.75	0.47
ドイツ	46.38	95.05	99.93	17.62	21.48	20.90	0.77	0.67	0.34
イギリス	27.17	35.67	21.46	10.23	15.84	15.41	0.82	0.40	0.13
アジア・オセアニア	19.37	49.99	93.09	11.20	14.20	14.58	0.54	0.60	0.47
オーストラリア	42.48	59.77	70.46	17.86	23.58	19.84	0.70	0.42	0.28
ニュージーランド	19.09	54.92	164.21	15.03	17.44	16.97	0.40	0.53	0.60
複合地域	121.37	108.96	46.48	24.96	32.47	26.87	1.22	0.49	0.15
エマージング株式	41.22	87.18	122.53	11.26 ↑	17.19	16.24	1.09	0.78	0.51
グローバル	25.99	79.80	98.96	12.11	16.38	16.37	0.66	0.76	0.44
BRICS	-3.21	24.84	72.17	13.37	19.55	18.82	-0.08	0.23	0.30
その他	49.42	92.76	135.21	11.40 ↑	17.81	16.53	1.26	0.79	0.54
欧州	-23.58	-15.36	-9.52	34.35	33.08	27.14	-0.25	-0.10	-0.04
ロシア	-91.73	-89.31	-85.70	54.71	47.49	37.86	-1.03	-0.76	-0.47
アジア・オセアニア	15.90	51.83	77.22	12.75	16.07	15.91	0.40	0.54	0.37
中国	-30.94	18.34	105.25	19.65	19.49	21.41	-0.59	0.18	0.35
インド	97.56	149.30	251.61	14.50	22.29	20.71	1.76	0.90	0.65
インドネシア	43.97	19.86	34.73	15.69	25.47	22.90	0.82	0.15	0.13
タイ	11.33	-7.48	22.70	12.84	20.13	17.51	0.29	-0.08	0.12
フィリピン	12.36	1.30	5.35	16.77	20.63	18.08	0.24	0.01	0.03
ベトナム	33.97	107.86	170.52	19.81 ↓	25.83	21.67	0.52	0.61	0.48
韓国	-4.78	73.79	42.43	24.58	25.48	21.21	-0.07	0.46	0.17
香港	-6.03	1.90	32.52	21.91	21.02	20.06	-0.09	0.02	0.14
中南米	34.72	47.60	43.32	23.33	29.48	26.34	0.45	0.28	0.14
ブラジル	9.88	4.32	-2.99	26.06	32.08	31.63	0.12	0.03	-0.01
メキシコ	80.72	102.35	48.98	22.18	27.40	24.12	0.98	0.55	0.17
中東・アフリカ	38.05	69.23	64.40	14.69	17.99	16.80	0.77	0.62	0.30
トルコ	213.72	207.46	59.04	32.59	33.88	31.68	1.42	0.74	0.15
複合地域	16.55	48.97	52.73	13.48	16.40	15.54	0.39	0.51	0.28

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

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

＜2＞リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別②

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	30.93	66.75	94.72	11.33	11.76	10.80	0.83	0.92	0.64
外国債券(先進国)	7.81	15.91	17.44	5.11	5.01	5.35	0.50	0.60	0.31
グローバル	5.91	12.93	17.56	4.57	4.35	4.77	0.43	0.57	0.35
除く日本	11.49	20.48	23.44	5.83	4.92	5.43	0.64	0.78	0.40
含む日本	1.37	6.43	13.00	3.86	4.51	4.48	0.12	0.28	0.28
その他	16.09	28.02	23.28	7.97	7.95	7.68	0.64	0.64	0.28
北米	5.58	14.13	25.50	6.20	↑ 6.11	5.18	0.30	0.44	0.45
米国	15.01	26.09	40.68	8.03	8.28	7.17	0.60	0.58	0.49
カナダ	26.56	39.81	27.73	8.38	7.80	8.59	0.98	0.89	0.29
欧州	0.26	1.34	1.82	6.65	5.74	6.51	0.02	0.05	0.03
イギリス	24.13	41.25	-	10.79	9.78	-	0.69	0.73	-
アジア・オセアニア	19.92	33.59	24.91	9.44	9.70	9.21	0.66	0.62	0.25
オーストラリア	20.89	34.88	25.33	9.45	9.76	9.27	0.69	0.63	0.25
ニュージーランド	13.75	22.14	26.46	10.31	9.62	9.92	0.43	0.43	0.24
複合地域	13.06	29.63	27.55	7.75	6.43	6.92	0.54	0.83	0.36
エマージング債券	31.72	34.73	37.95	7.29	10.44	10.49	1.32	0.59	0.31
グローバル	22.95	26.66	28.19	7.72	11.73	11.10	0.93	0.41	0.23
米ドル建て	21.70	25.63	28.73	8.32	12.38	11.52	0.82	0.38	0.22
現地通貨建て	27.42	30.75	22.93	7.05	10.06	10.15	1.20	0.55	0.21
その他	42.80	45.22	49.75	8.76	10.34	11.02	1.44	0.75	0.38
ロシア	-81.11	-81.05	-83.09	170.52	↑ 132.18	↑ 94.75	-0.25	-0.21	-0.17
アジア・オセアニア	20.48	29.77	49.10	5.97	7.03	6.90	1.08	0.76	0.59
中国	34.21	51.41	-	6.19	6.15	-	1.67	1.41	-
インド	41.88	56.05	98.16	8.46	9.16	9.50	1.46	1.02	0.75
インドネシア	40.86	59.36	91.02	9.58	13.40	13.70	1.26	0.73	0.49
ブラジル	53.17	29.64	36.67	15.11	17.61	18.25	1.01	0.30	0.17
メキシコ	65.32	88.64	58.81	13.13	↑ 16.44	15.58	1.39	0.82	0.31
トルコ	-39.46	-47.93	-76.99	28.39	27.05	27.87	-0.54	-0.45	-0.49
複合地域	27.87	27.97	17.46	10.29	11.66	11.52	0.83	0.44	0.14
ハイイールド債券	37.47	52.09	67.36	7.88	11.18	10.43	1.42	0.78	0.51
グローバル	25.93	36.63	48.75	7.09	11.04	10.33	1.13	0.59	0.39
北米	43.15	60.39	82.06	8.35	11.17	10.49	1.52	0.89	0.59
その他	22.71	31.39	35.19	8.29	12.29	11.24	0.85	0.46	0.27
欧州	24.62	33.13	34.60	9.00	12.97	11.96	0.85	0.46	0.25
アジア・オセアニア	15.15	23.19	38.72	9.54	↑ 11.96	10.27	0.51	0.36	0.33
複合地域	31.87	52.18	65.54	7.68	8.86	8.79	1.26	0.99	0.59
複合資産	16.55	32.11	52.73	6.72	7.16	7.18	0.78	0.80	0.60
安定	5.99	14.24	26.76	4.89	4.98	5.29	0.40	0.55	0.46
安定成長	20.35	38.69	61.35	7.02	7.59	7.58	0.91	0.89	0.65
成長	33.57	67.85	108.68	8.85	10.12	10.45	1.15	1.08	0.73
国内バランス	-4.13	-3.86	8.95	3.14	3.96	4.20	-0.44	-0.19	0.21
安定	-6.71	-7.31	5.30	3.00	3.83	3.14	-0.76	-0.39	0.17
一般	16.78	39.32	59.74	6.53	7.61	8.31	0.82	0.90	0.58
その他	-7.28	19.96	-	20.50	18.41	-	-0.12	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	30.93	66.75	94.72	11.33	11.76	10.80	0.83	0.92	0.64
国内REIT	-10.13	6.89	47.74	10.17	15.12	12.30	-0.34	0.09	0.33
日本	-10.13	6.89	47.74	10.17	15.12	12.30	-0.34	0.09	0.33
外国REIT	31.99	56.38	111.71	17.93	19.10	16.69	0.54	0.49	0.47
グローバル	27.76	48.34	84.93	17.69	19.75	16.88	0.48	0.42	0.38
除く日本	30.80	56.94	111.58	18.33	20.48	17.34	0.51	0.46	0.45
含む日本	25.95	44.78	78.94	17.35	19.45	16.70	0.46	0.40	0.36
北米	38.23	69.82	140.78	18.77	18.92	17.05	0.61	0.59	0.54
その他	12.66	19.51	79.01	15.26	19.38	16.07	0.27	0.19	0.37
欧州	3.22	15.31	21.18	19.12	21.37	18.58	0.06	0.14	0.11
アジア・オセアニア	8.20	11.91	81.12	14.18	17.75	15.21	0.19	0.13	0.40
オーストラリア	27.62	37.11	78.12	23.90	30.14	23.44	0.36	0.22	0.25
複合地域	34.95	29.89	34.10	15.24	24.22	20.20	0.69	0.22	0.15
複数国	20.01	50.27	132.77	15.27	17.21	15.05	0.41	0.49	0.59
その他									
絶対収益型	-2.39	0.29	0.54	4.02	3.52	2.91	-0.19	0.02	0.02
ロング・ショート	-3.65	-6.76	-7.73	3.26	3.21	3.09	-0.37	-0.42	-0.25
マーケットニュートラル	-3.08	-2.49	18.70	3.94	4.07	5.20	-0.26	-0.12	0.34
GTAA	1.97	12.29	16.63	4.14	4.50	3.52	0.16	0.53	0.45
その他スタイル	-2.45	0.87	0.35	4.43	3.82	3.18	-0.18	0.05	0.02
CB	-3.73	16.29	20.79	6.40	8.50	7.58	-0.19	0.36	0.25
アジア・オセアニア	22.08	65.59	118.37	8.73	11.80	11.37	0.79	0.90	0.72
日本	8.69	11.00	28.07	4.95	5.30 ↑	5.39	0.57	0.40	0.47
グローバル	-4.63	15.52	19.07	6.62	8.74	7.68	-0.23	0.34	0.23
コモディティ	64.19	95.60	30.42	10.53	11.56	12.26	1.71	1.24	0.22
全業種	80.87	111.73	29.58	16.21	19.06	17.07	1.35	0.85	0.15
貴金属	48.37	79.86	66.42	11.26 ↓	12.84	11.49	1.25	0.97	0.46
エネルギー	130.48	167.76	33.42	25.49	34.96	31.91	1.26	0.62	0.09
その他コモディティ	76.54	93.79	36.93	15.25	18.59	16.95	1.37	0.76	0.19

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

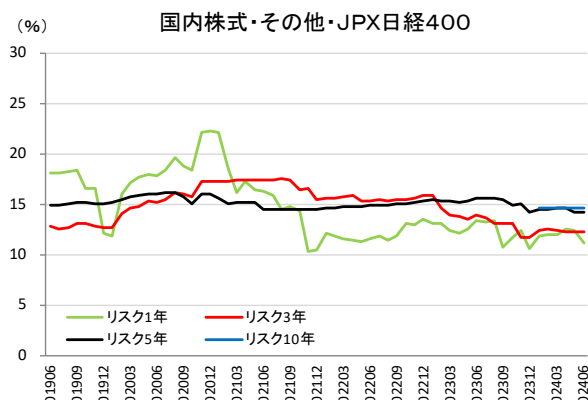
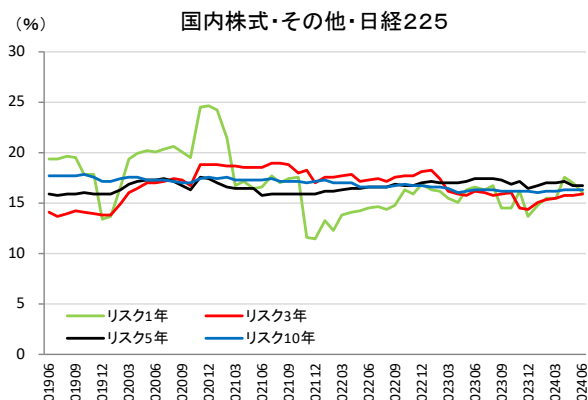
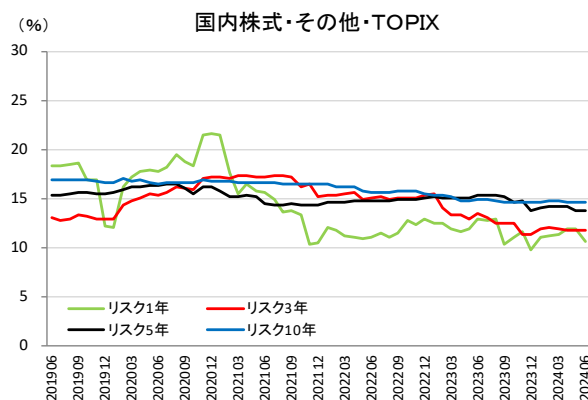
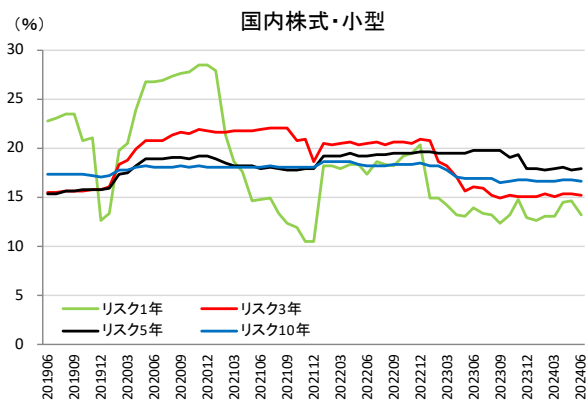
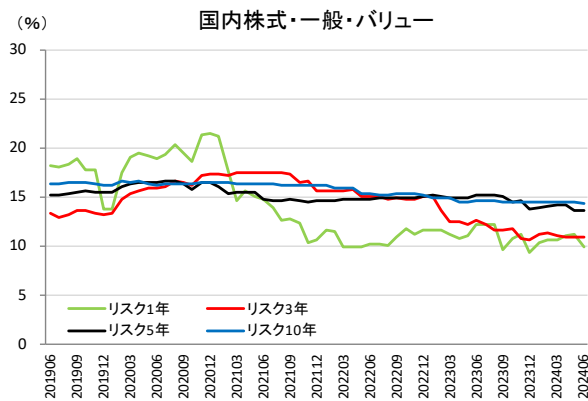
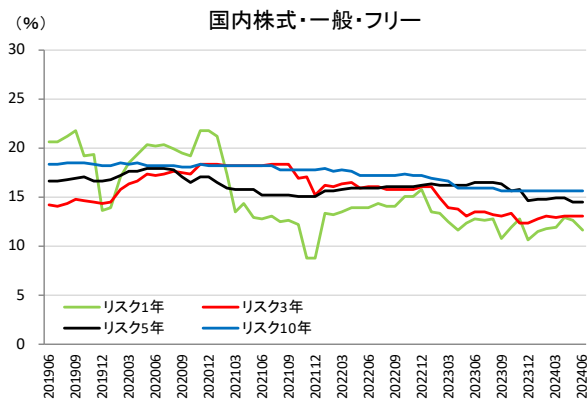
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

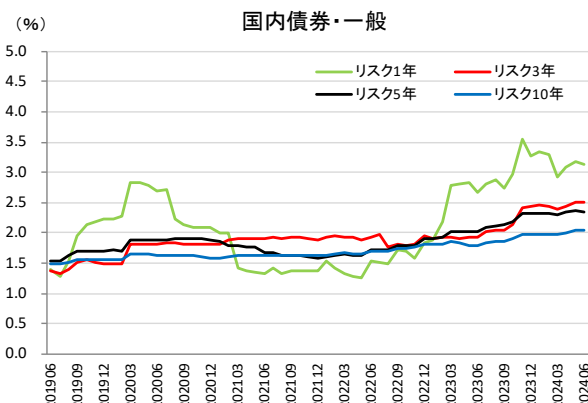
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

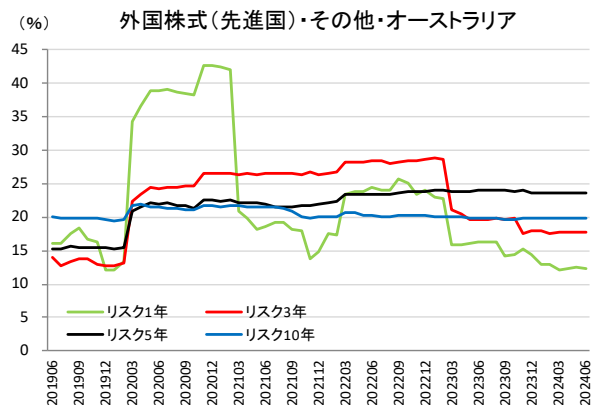
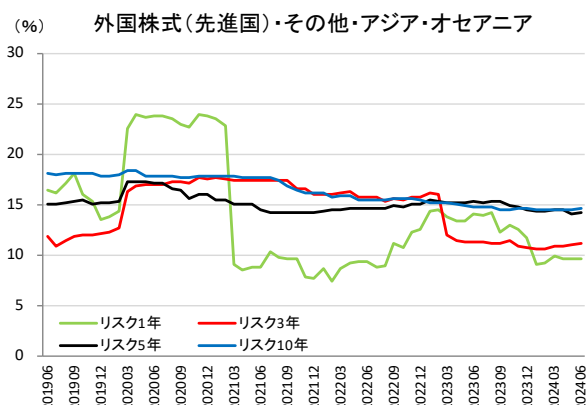
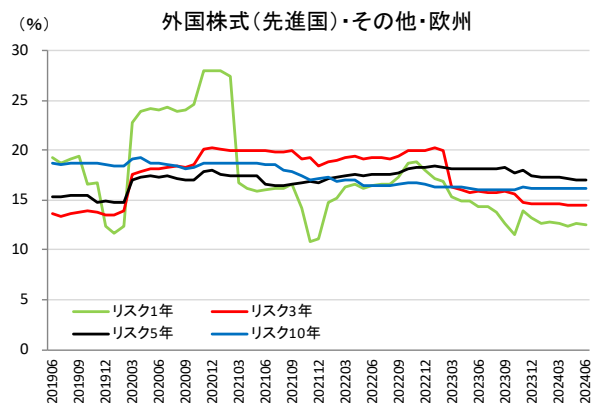
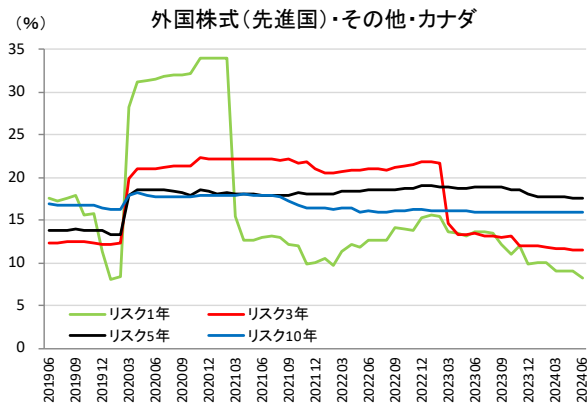
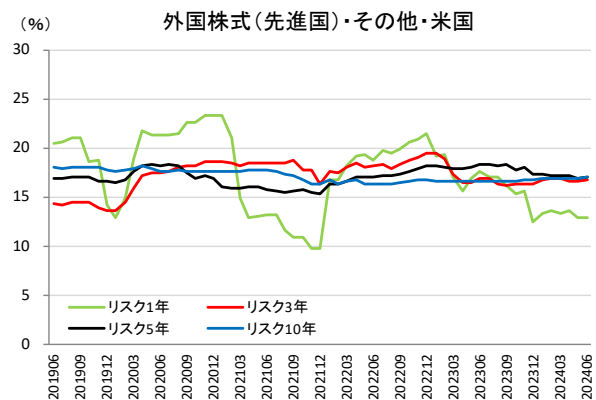
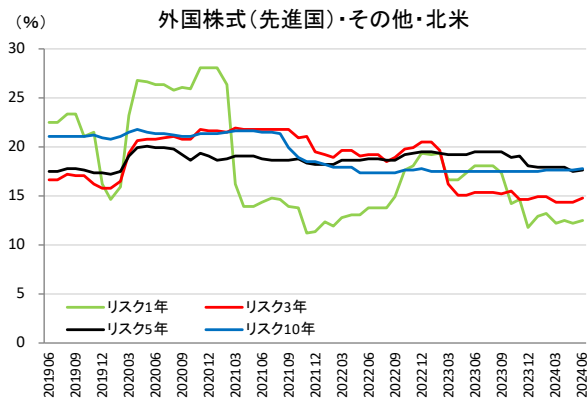
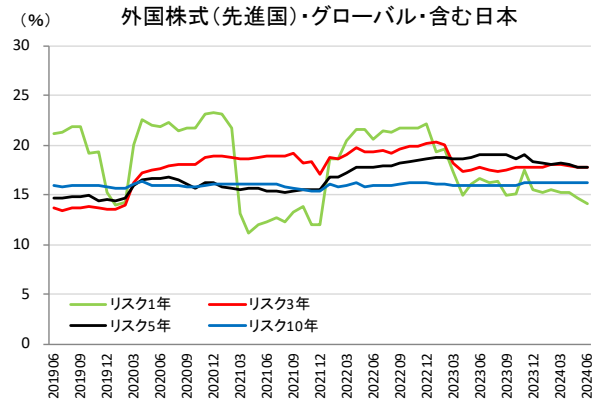
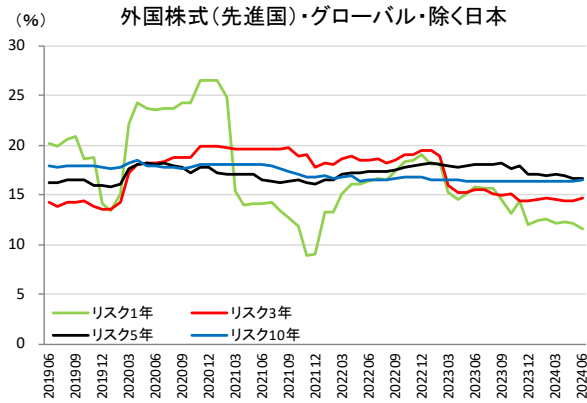


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

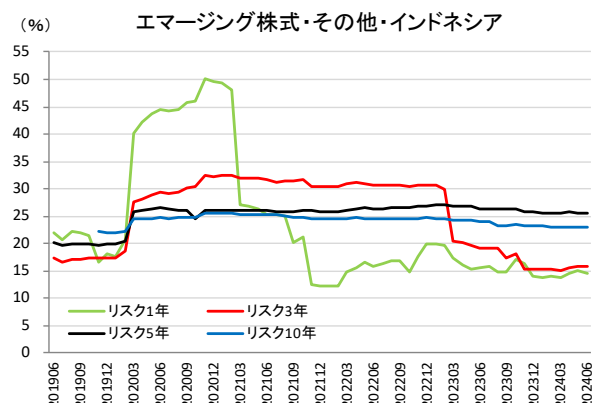
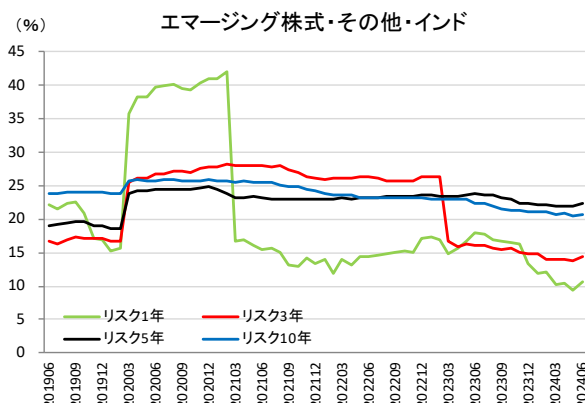
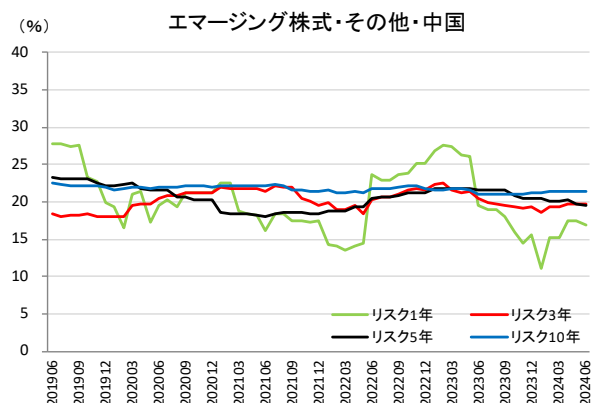
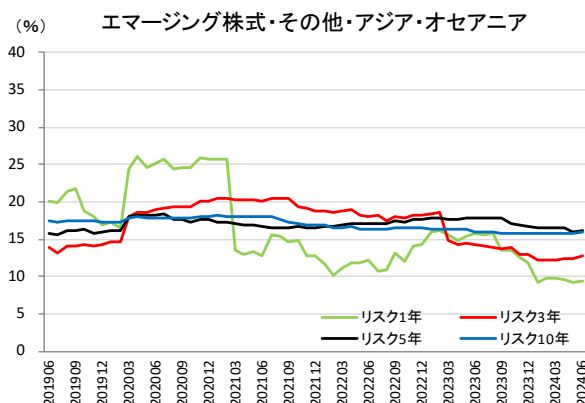
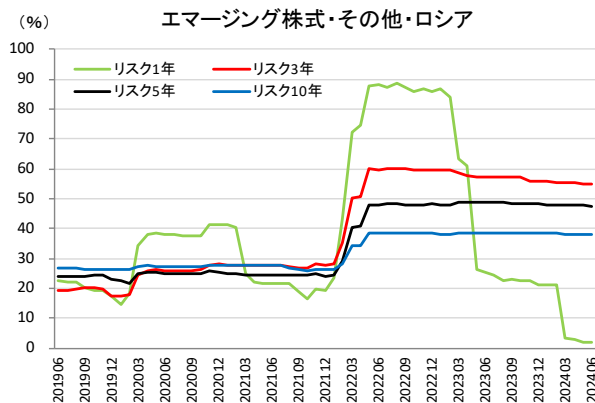
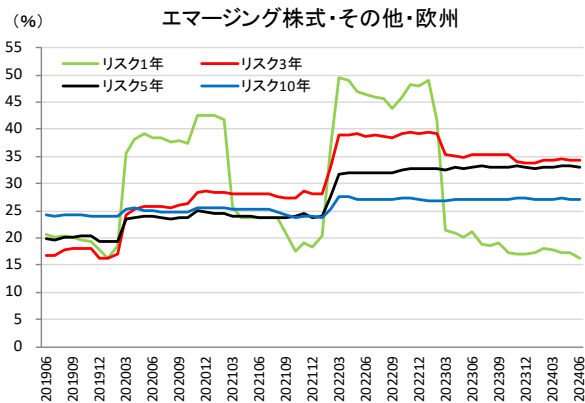
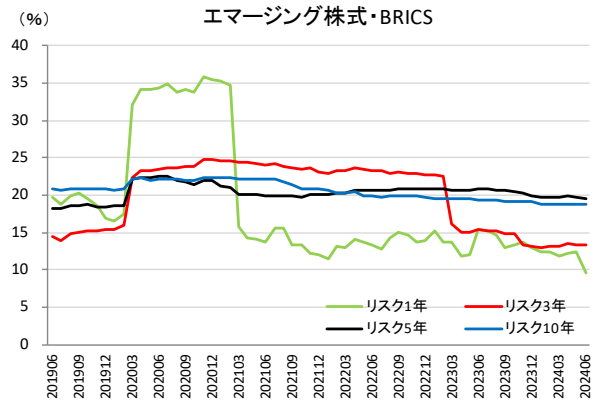
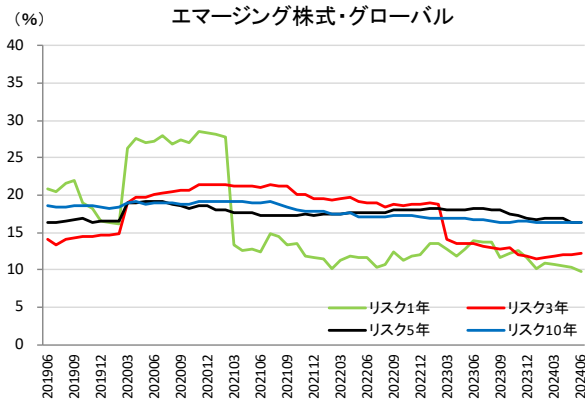


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別③

[エマージング株式]

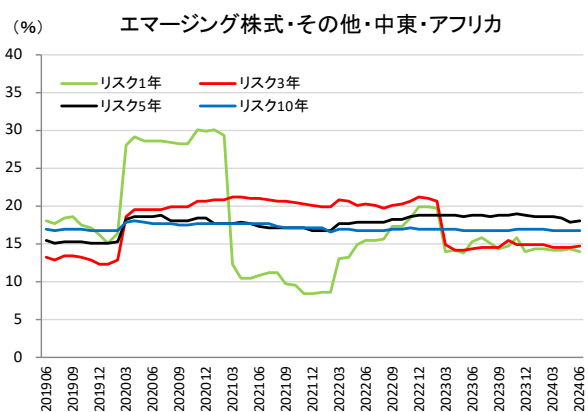
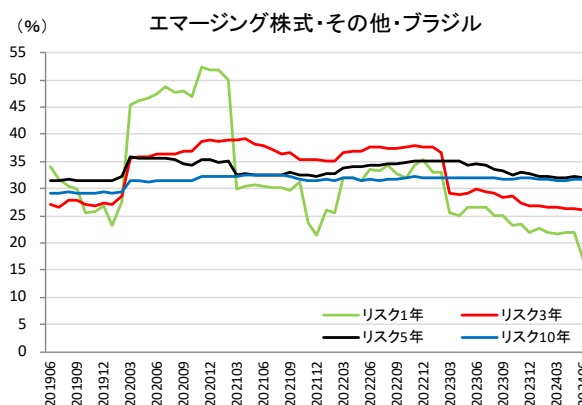
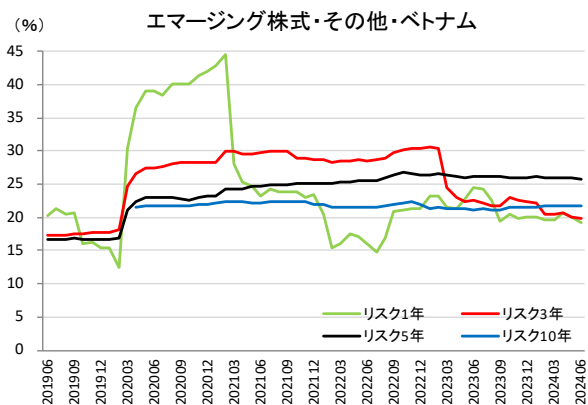
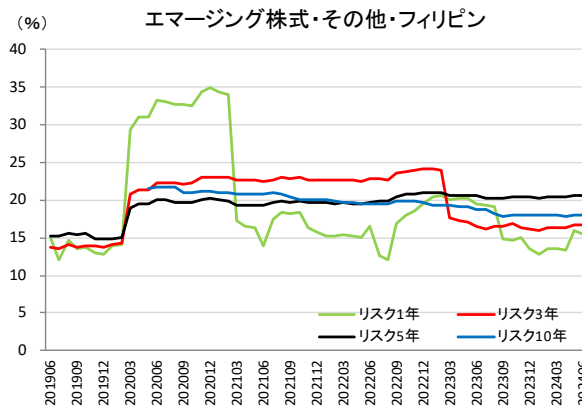
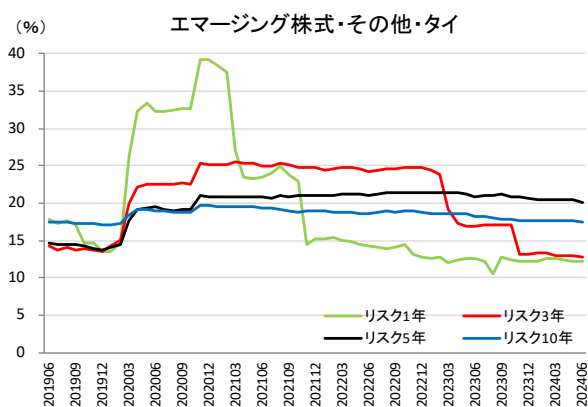


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別④

[エマージング株式]

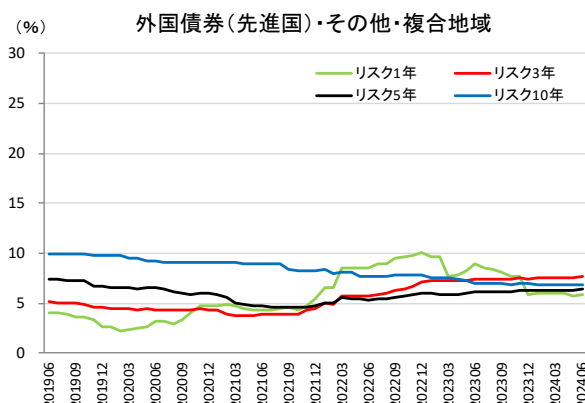
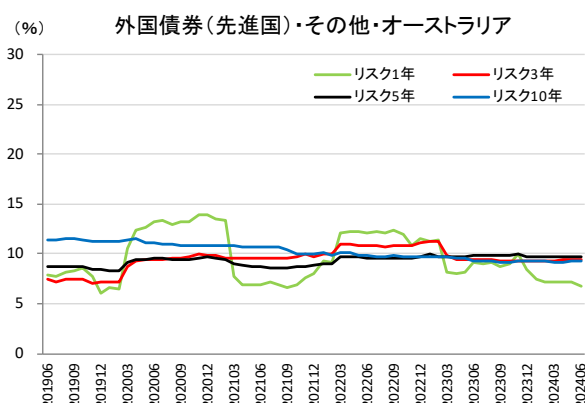
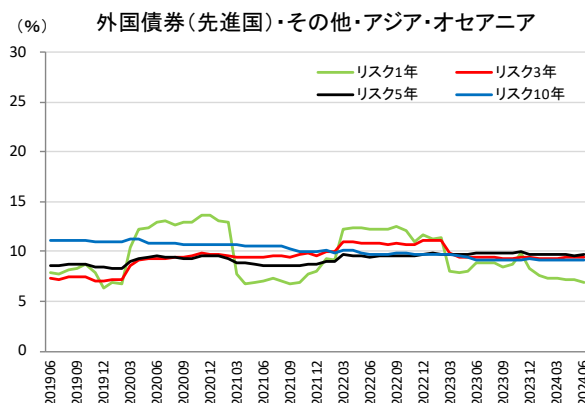
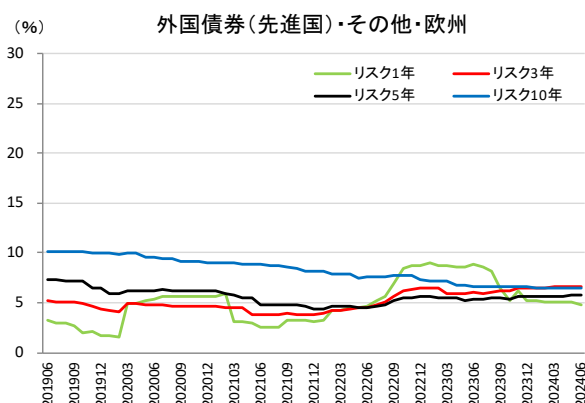
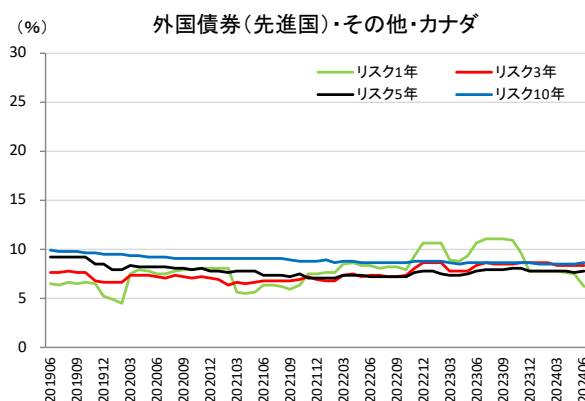
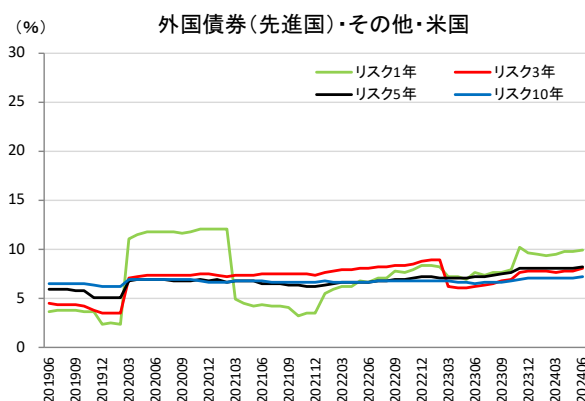
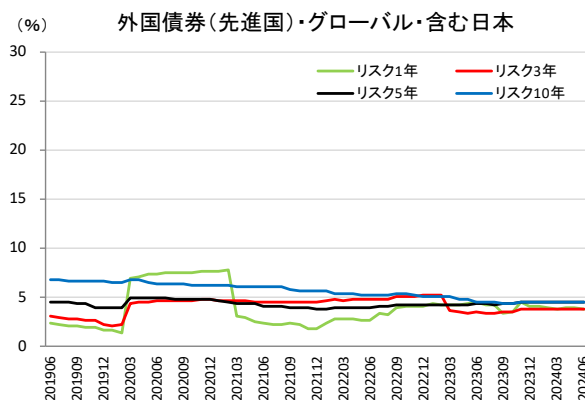
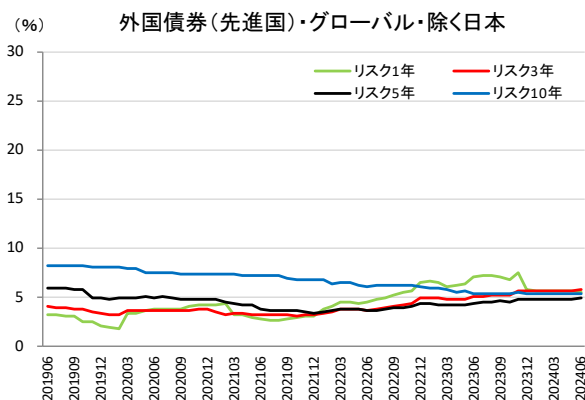


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

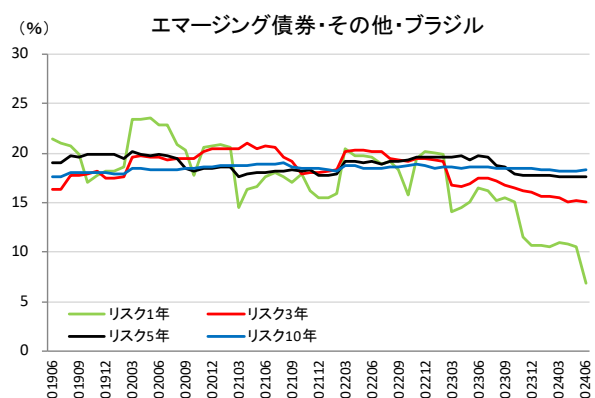
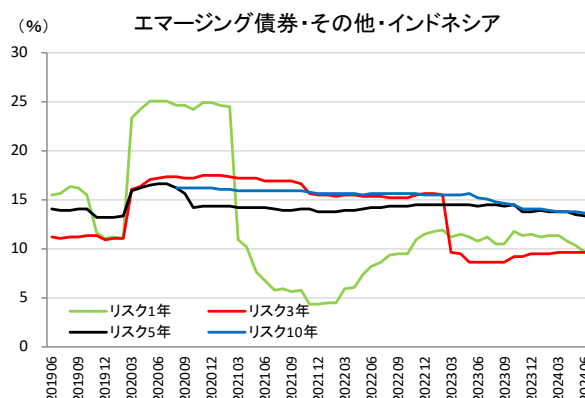
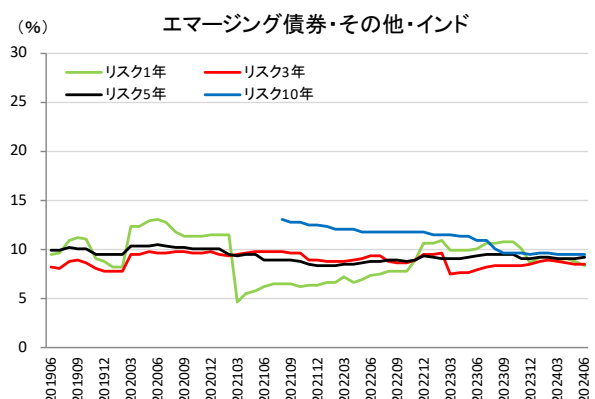
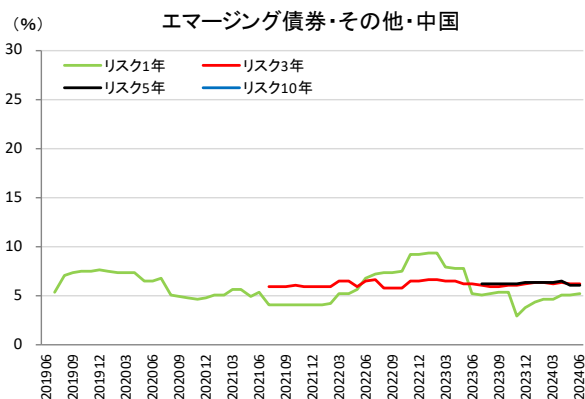
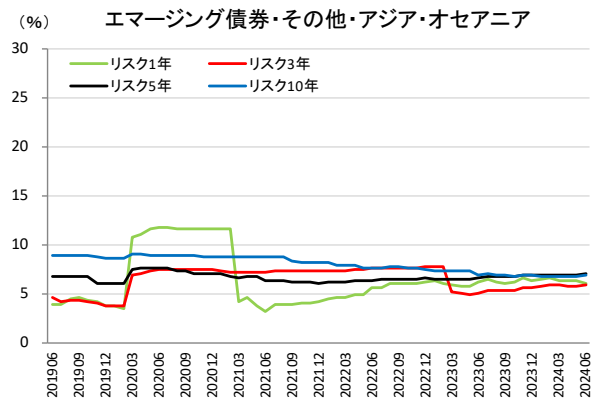
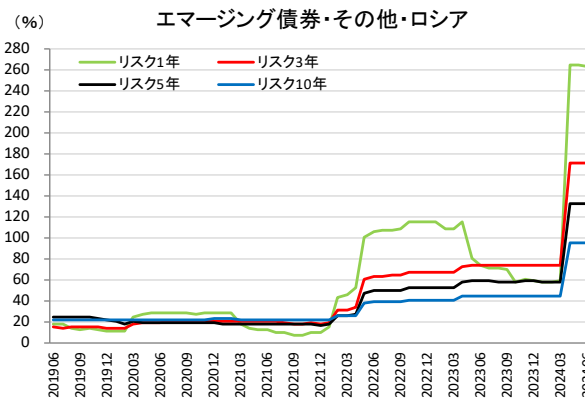
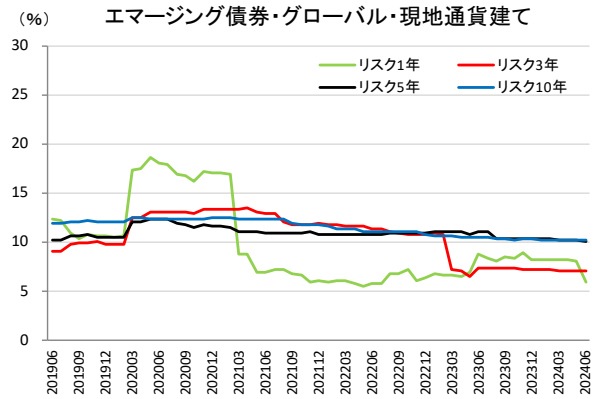
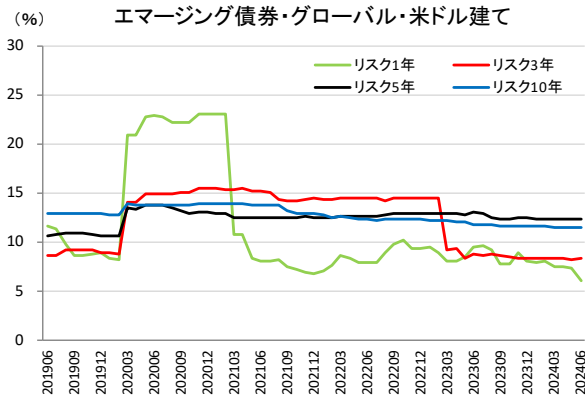


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

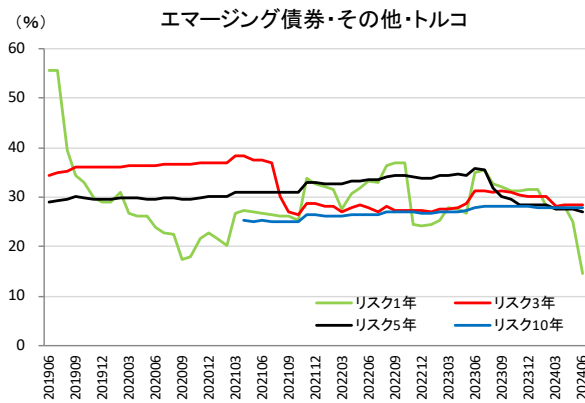
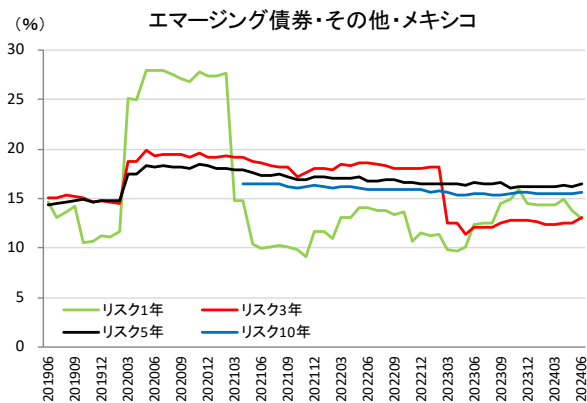


<2> リスク・サマリー

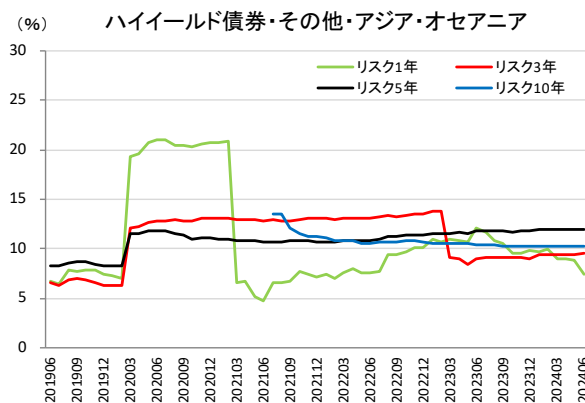
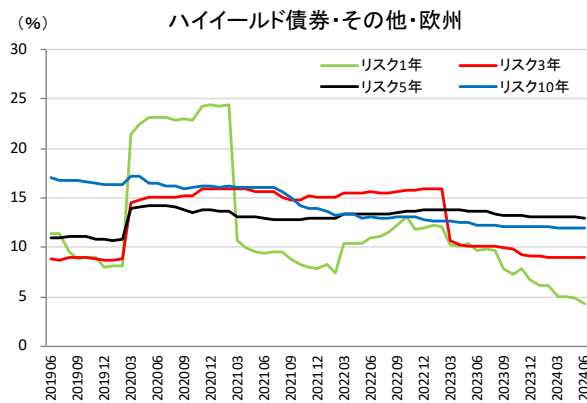
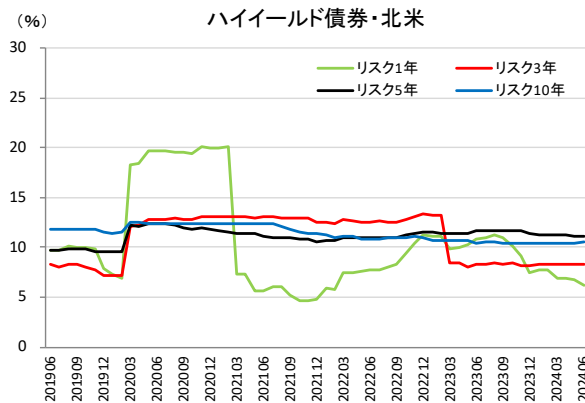
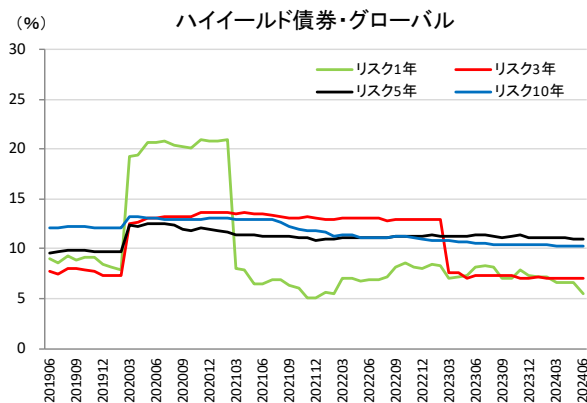
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

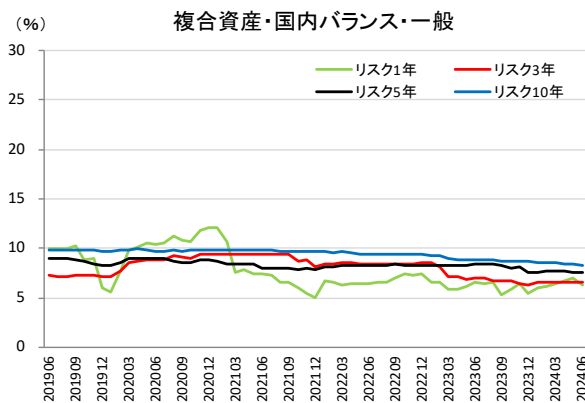
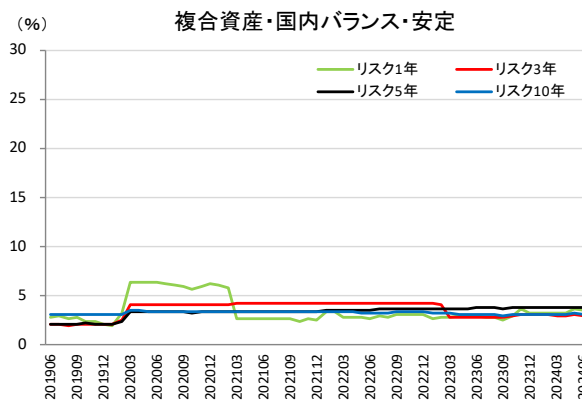
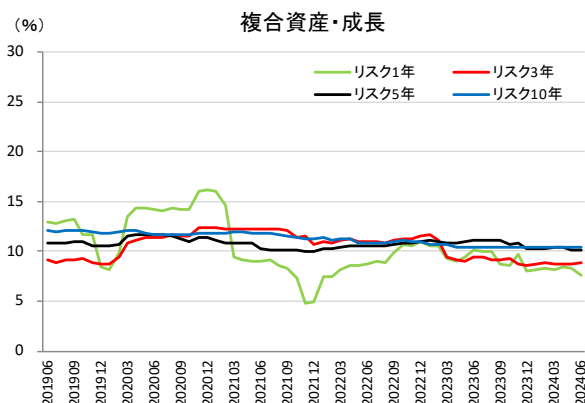
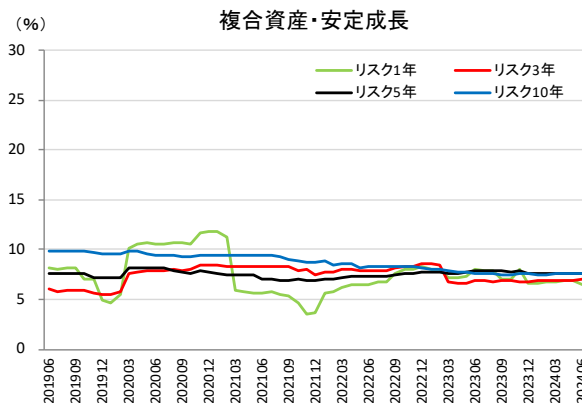
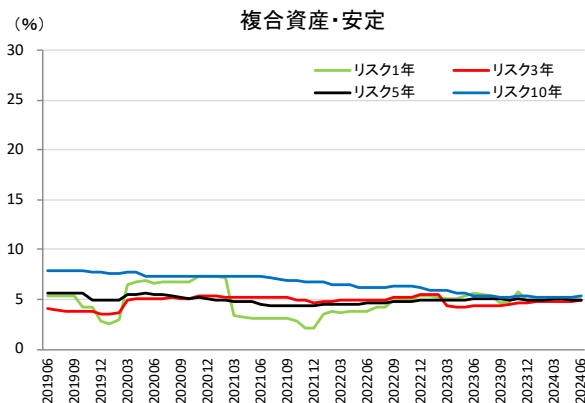


<2> リスク・サマリー

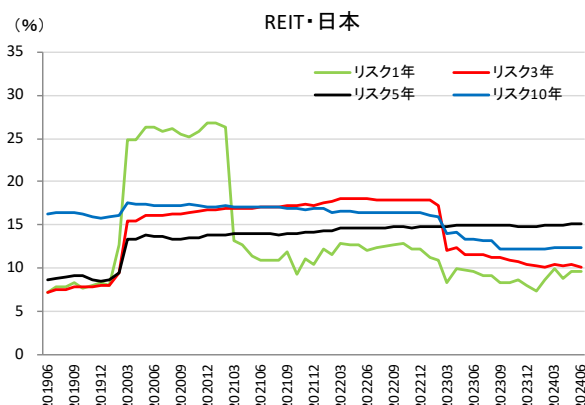
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

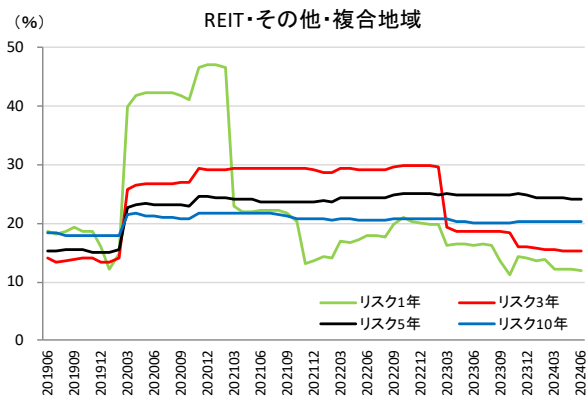
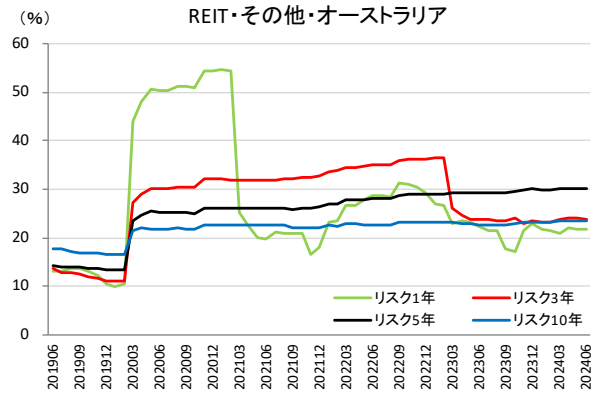
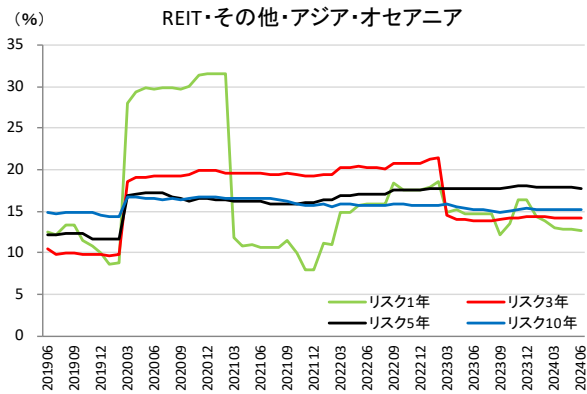
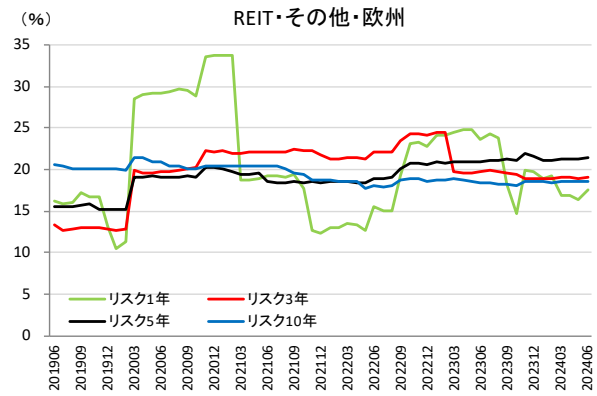
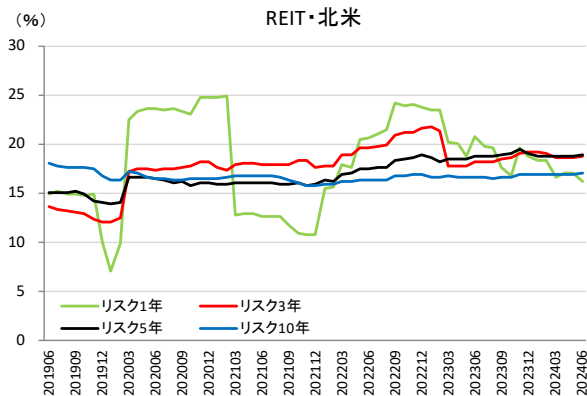
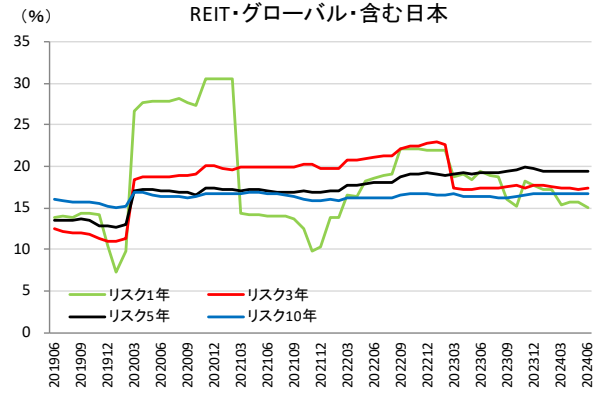
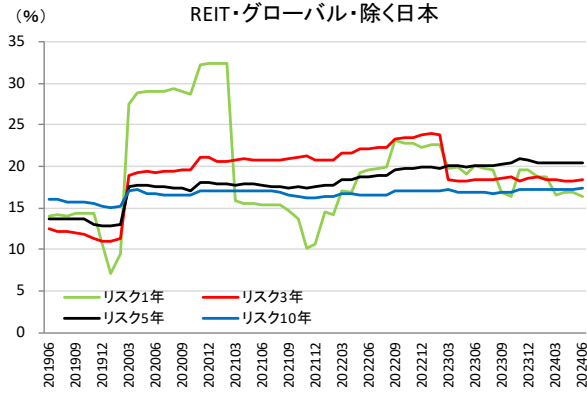


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

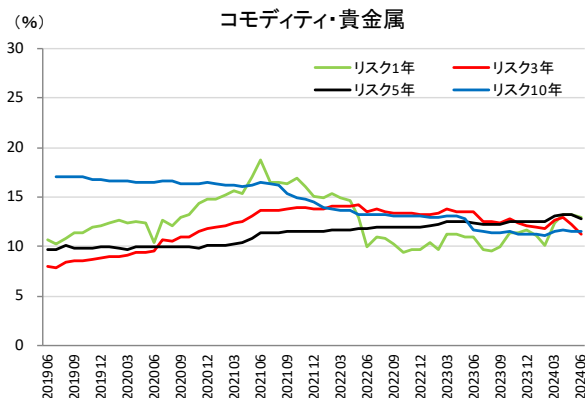
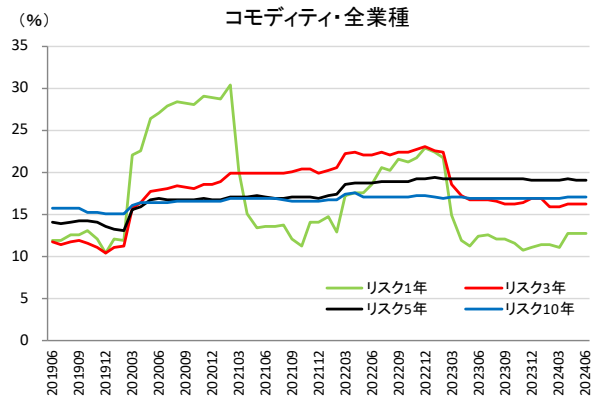
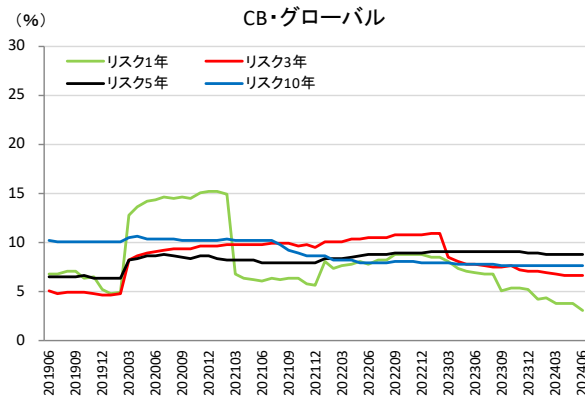
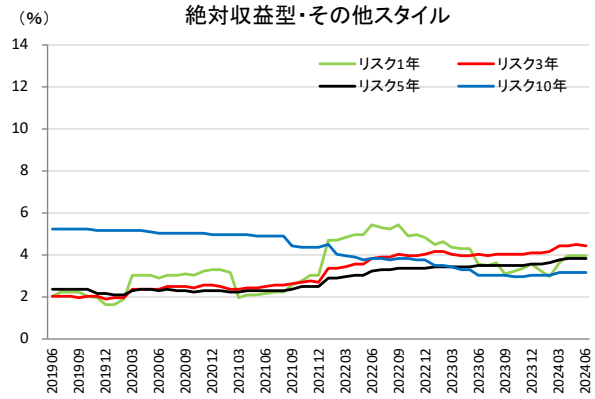
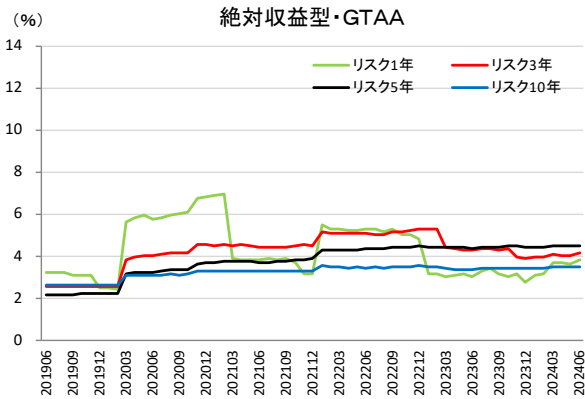
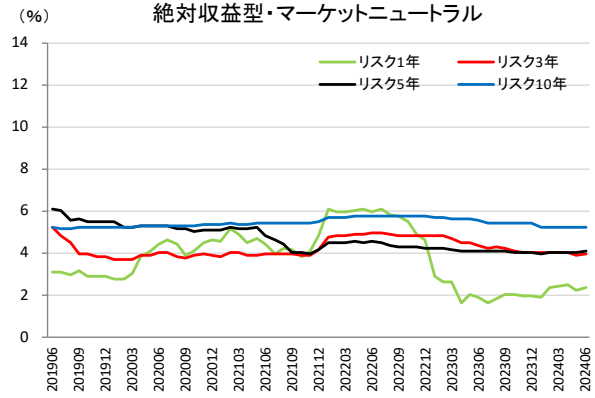
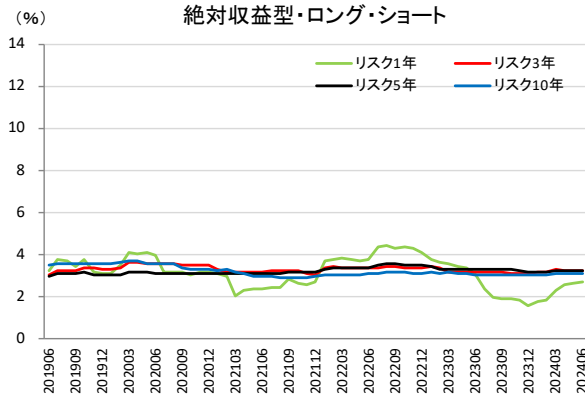


<2> リスク・サマリー

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑩

[その他]



< 3 > 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別①

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	15,350	45,450	85,604	131,654
国内株式	75	4,752	8,673	16,999
一般	337	1,310	3,502	8,507
フリー	-11	92	-309	1,220
バリュー	348	1,218	3,809	7,280
小型	-57	-8	-126	42
その他	-249	3,275	4,970	7,940
日経225	-598	1,766	2,234	3,110
TOPIX	123	715	1,511	2,959
JPX日経400	-6	37	27	61
国内債券	134	808	874	4,008
一般	134	808	874	4,008
外国株式(先進国)	11,284	28,061	57,019	78,241
グローバル	4,915	11,918	24,705	35,139
除く日本	1,432	3,585	6,135	9,931
含む日本	3,483	8,333	18,570	25,208
その他	6,368	16,142	32,314	43,102
北米	324	820	2,074	2,520
米国	6,013	15,306	30,225	40,826
カナダ	-1	-3	-8	-22
欧州	36	67	173	107
ドイツ	0	1	1	0
イギリス	0	-1	-2	-2
アジア・オセアニア	1	1	0	-3
オーストラリア	-5	-46	-146	-305
ニュージーランド	0	-1	-1	-1
複合地域	0	-2	-3	-18
エマージング株式	2,527	6,692	10,953	17,368
グローバル	171	1,433	1,448	1,858
BRICS	-3	-12	-30	-53
その他	2,359	5,271	9,536	15,563
欧州	0	3	0	3
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-57	-244	-476	-755
中国	-21	-67	-166	-506
インド	2,445	5,624	10,292	16,963
インドネシア	5	17	19	40
タイ	0	0	-1	-6
フィリピン	0	-1	-3	-5
ベトナム	-6	-32	-74	-85
韓国	0	0	0	0
香港	-1	-3	-2	1
中南米	-2	-3	-5	-12
ブラジル	-4	-15	-39	-77
メキシコ	1	1	1	1
中東・アフリカ	-1	-6	-12	-25
トルコ	1	-3	-7	-13
複合地域	-1	0	9	39

<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別②

(単位: 億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	15,350	45,450	85,604	131,654
外国債券(先進国)	396	1,533	2,992	7,419
グローバル	343	1,263	2,565	6,794
除く日本	346	763	1,502	3,113
含む日本	-3	500	1,063	3,681
その他	53	271	427	625
北米	5	14	59	100
米国	140	531	953	1,738
カナダ	-8	-27	-60	-140
欧州	3	22	28	1
イギリス	-1	-1	-2	-2
アジア・オセアニア	-20	-57	-111	-186
オーストラリア	-58	-183	-383	-792
ニュージーランド	-1	-4	-10	-6
複合地域	-7	-25	-48	-88
エマージング債券	35	59	80	232
グローバル	35	62	131	167
米ドル建て	25	7	-23	-23
現地通貨建て	10	55	154	190
その他	0	-4	-51	65
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-2	-6	-12	-24
中国	-2	-8	-14	-30
インド	26	66	101	392
インドネシア	-1	-5	-7	16
ブラジル	-17	-45	-97	-245
メキシコ	-4	-3	-16	-37
トルコ	0	-1	-3	-2
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイイールド債券	83	173	344	1,119
グローバル	6	13	18	-87
北米	104	219	440	1,441
その他	-28	-59	-115	-235
欧州	-18	-47	-91	-190
アジア・オセアニア	-9	-10	-22	-42
複合地域	0	-1	-2	-3
複合資産	1,255	2,781	4,662	7,266
安定	-61	-226	-701	-1,578
安定成長	867	2,295	3,668	5,288
成長	595	1,116	2,528	5,091
国内バランス	-84	-236	-524	-1,089
安定	-114	-320	-688	-1,405
一般	-2	-7	-17	-34
その他	-62	-168	-309	-446

<3> 設定・解約額 [ネット金額]

「総合」およびファンド分類別③

(単位:億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	15,350	45,450	85,604	131,654
国内REIT	-84	33	-230	-1,058
日本	-84	33	-230	-1,058
外国REIT	-162	-249	-702	-1,207
グローバル	-22	19	-188	-392
除く日本	50	182	249	599
含む日本	-72	-166	-449	-1,004
北米	-108	-163	-281	-357
その他	-32	-105	-233	-457
欧州	0	-2	-5	-17
アジア・オセアニア	-25	-85	-180	-345
オーストラリア	-4	-13	-37	-74
複合地域	0	0	-1	-3
複数国	-2	-5	-10	-18
その他	-193	808	939	1,269
絶対収益型	89	282	442	503
ロング・ショート	3	12	19	70
マーケットニュートラル	-3	-26	-59	-127
GTAA	-2	-12	-31	-61
その他スタイル	85	300	500	600
CB	-55	-162	-220	-81
アジア・オセアニア	0	-1	-2	-3
日本	0	0	-1	3
グローバル	-55	-160	-217	-81
コモディティ	213	700	1,117	1,479
全業種	26	125	188	226
貴金属	190	583	939	1,275
エネルギー	-4	-9	-15	-28
その他コモディティ	0	2	4	7

< 4 > 純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別①

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	1,311,636	100.00	5,324	100.00
国内株式	170,232	12.98	760	14.27
一般	94,315	7.19	461	8.66
フリー	65,178	4.97	360	6.76
バリュー	29,137	2.22	101	1.90
小型	7,844	0.60	86	1.62
その他	66,573	5.08	207	3.89
日経225	31,198	2.38	72	1.35
TOPIX	28,407	2.17	83	1.56
JPX日経400	1,042	0.08	13	0.24
国内債券	42,990	3.28	150	2.82
一般	42,990	3.28	150	2.82
外国株式(先進国)	633,374	48.29	1,213	22.78
グローバル	402,122	30.66	836	15.70
除く日本	123,186	9.39	191	3.59
含む日本	278,936	21.27	645	12.11
その他	231,252	17.63	377	7.08
北米	4,756	0.36	13	0.24
米国	221,466	16.88	298	5.60
カナダ	127	0.01	2	0.04
欧州	1,999	0.15	36	0.68
ドイツ	21	0.00	1	0.02
イギリス	1	0.00	1	0.02
アジア・オセアニア	40	0.00	1	0.02
オーストラリア	2,805	0.21	23	0.43
ニュージーランド	13	0.00	1	0.02
複合地域	26	0.00	1	0.02
エマージング株式	61,968	4.72	315	5.92
グローバル	14,929	1.14	95	1.78
BRICS	483	0.04	7	0.13
その他	46,556	3.55	213	4.00
欧州	115	0.01	6	0.11
ロシア	8	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	4,455	0.34	82	1.54
中国	1,153	0.09	32	0.60
インド	38,185	2.91	41	0.77
インドネシア	205	0.02	6	0.11
タイ	3	0.00	1	0.02
フィリピン	28	0.00	4	0.08
ベトナム	1,711	0.13	14	0.26
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	18	0.00	1	0.02
中南米	56	0.00	2	0.04
ブラジル	427	0.03	11	0.21
メキシコ	10	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	52	0.00	2	0.04
トルコ	66	0.01	2	0.04
複合地域	65	0.00	3	0.06

＜4＞純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別②

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	1,311,636	100.00	5,324	100.00
外国債券(先進国)	101,933	7.77	741	13.92
グローバル	83,221	6.34	527	9.90
除く日本	38,652	2.95	222	4.17
含む日本	44,570	3.40	305	5.73
その他	18,712	1.43	214	4.02
北米	204	0.02	8	0.15
米国	9,069	0.69	116	2.18
カナダ	637	0.05	3	0.06
欧州	1,103	0.08	24	0.45
イギリス	8	0.00	5	0.09
アジア・オセアニア	1,543	0.12	9	0.17
オーストラリア	4,980	0.38	32	0.60
ニュージーランド	81	0.01	9	0.17
複合地域	1,087	0.08	8	0.15
エマージング債券	12,766	0.97	227	4.26
グローバル	7,379	0.56	160	3.01
米ドル建て	5,250	0.40	124	2.33
現地通貨建て	2,129	0.16	36	0.68
その他	5,387	0.41	67	1.26
ロシア	14	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	232	0.02	6	0.11
中国	137	0.01	8	0.15
インド	3,017	0.23	16	0.30
インドネシア	330	0.03	7	0.13
ブラジル	1,352	0.10	20	0.38
メキシコ	243	0.02	3	0.06
トルコ	29	0.00	2	0.04
複合地域	34	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	22,450	1.71	222	4.17
グローバル	2,923	0.22	38	0.71
北米	17,703	1.35	122	2.29
その他	1,824	0.14	62	1.16
欧州	1,400	0.11	40	0.75
アジア・オセアニア	384	0.03	21	0.39
複合地域	39	0.00	1	0.02
複合資産	164,307	12.53	1,063	19.97
安定	39,268	2.99	283	5.32
安定成長	76,032	5.80	443	8.32
成長	40,201	3.06	297	5.58
国内バランス	5,679	0.43	26	0.49
安定	4,499	0.34	8	0.15
一般	274	0.02	14	0.26
その他	3,127	0.24	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	1,311,636	100.00	5,324	100.00
国内REIT	23,591	1.80	142	2.67
日本	23,591	1.80	142	2.67
外国REIT	47,070	3.59	268	5.03
グローバル	19,511	1.49	156	2.93
除く日本	8,751	0.67	66	1.24
含む日本	10,760	0.82	90	1.69
北米	25,036	1.91	66	1.24
その他	2,523	0.19	46	0.86
欧州	78	0.01	4	0.08
アジア・オセアニア	1,642	0.13	26	0.49
オーストラリア	494	0.04	12	0.23
複合地域	62	0.00	3	0.06
複数国	246	0.02	1	0.02
その他	30,955	2.36	223	4.19
絶対収益型	12,500	0.95	86	1.62
ロング・ショート	868	0.07	27	0.51
マーケットニュートラル	311	0.02	13	0.24
GTAA	313	0.02	9	0.17
その他スタイル	10,919	0.83	36	0.68
CB	2,858	0.22	43	0.81
アジア・オセアニア	35	0.00	1	0.02
日本	29	0.00	1	0.02
グローバル	2,794	0.21	41	0.77
コモディティ	8,507	0.65	38	0.71
全業種	2,274	0.17	12	0.23
貴金属	6,137	0.47	24	0.45
エネルギー	62	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	16,464	10.5	2.91	2.65	1.065
国内株式	24,032	14.7	1.67	1.50	0.990
一般	22,745	14.5	2.33	2.14	1.353
フリー	22,067	14.0	1.85	1.71	1.410
バリュー	25,162	16.1	3.47	3.14	1.226
小型	26,274	15.2	1.71	1.62	1.680
その他	26,081	14.7	0.51	0.41	0.380
日経225	27,606	16.3	0.44	0.37	0.432
TOPIX	27,626	15.6	0.14	0.11	0.230
JPX日経400	25,420	9.8	0.50	0.40	0.469
国内債券	10,119	12.5	0.11	0.12	0.466
一般	10,119	12.5	0.11	0.12	0.466
外国株式(先進国)	20,880	8.0	3.57	3.18	1.062
グローバル	21,525	8.1	2.82	2.56	1.158
除く日本	32,993	11.0	0.62	0.55	0.502
含む日本	18,129	7.3	3.81	3.46	1.448
その他	19,449	7.6	4.90	4.28	0.896
北米	19,554	6.0	0.50	0.48	0.783
米国	20,413	6.8	4.96	4.32	0.882
カナダ	6,402	13.3	8.87	8.64	1.988
欧州	17,758	12.8	3.08	2.83	1.298
ドイツ	20,002	10.3	0.00	0.00	0.770
イギリス	12,161	3.5	0.00	0.00	1.137
アジア・オセアニア	12,267	18.0	7.25	6.52	1.639
オーストラリア	11,581	9.5	8.50	7.99	1.823
ニュージーランド	19,383	11.9	2.19	2.06	1.672
複合地域	12,596	11.2	14.95	13.50	1.705
エマージング株式	16,390	11.1	4.11	3.29	1.667
グローバル	16,617	8.7	0.83	0.77	1.012
BRICS	17,730	18.1	0.80	0.71	2.052
その他	16,244	11.9	5.15	4.08	1.874
欧州	10,490	18.0	0.66	0.49	1.943
ロシア	974	15.1	0.00	0.00	1.172
アジア・オセアニア	17,158	13.5	2.59	2.35	1.706
中国	13,462	9.9	0.70	0.70	1.914
インド	21,416	10.1	5.81	4.53	1.893
インドネシア	11,932	9.6	1.22	1.38	1.779
タイ	15,741	13.5	2.44	2.54	1.815
フィリピン	11,994	11.9	0.49	0.48	1.704
ベトナム	19,108	6.5	2.50	2.30	1.871
韓国	16,238	5.5	0.00	0.00	1.804
香港	14,797	14.8	2.54	2.43	0.858
中南米	11,395	17.5	1.40	1.41	2.037
ブラジル	6,285	13.0	3.30	3.93	1.965
メキシコ	14,306	11.3	2.86	2.80	1.667
中東・アフリカ	15,529	16.3	0.44	0.38	2.228
トルコ	20,748	22.9	3.12	1.82	2.026
複合地域	21,599	10.9	1.61	1.41	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	16,464	10.5	2.91	2.65	1.065
外国債券(先進国)	11,024	10.9	1.26	1.18	0.959
グローバル	11,496	11.0	1.10	1.03	0.908
除く日本	12,984	13.5	0.78	0.72	0.692
含む日本	10,413	9.2	1.40	1.32	1.096
その他	9,863	10.8	1.98	1.85	1.183
北米	10,983	7.9	1.63	1.51	1.153
米国	10,594	8.3	1.91	1.83	1.113
カナダ	9,079	14.6	1.50	1.36	1.378
欧州	7,968	16.0	1.37	1.30	1.009
イギリス	8,099	9.1	3.88	3.34	1.381
アジア・オセアニア	10,341	14.2	2.42	2.18	1.436
オーストラリア	9,392	14.9	2.19	1.96	1.242
ニュージーランド	10,382	10.0	1.56	1.38	1.371
複合地域	5,974	14.2	2.05	1.89	1.195
エマージング債券	10,718	12.5	3.40	3.21	1.357
グローバル	10,908	12.9	2.14	1.96	1.151
米ドル建て	10,645	13.5	2.46	2.21	1.302
現地通貨建て	11,811	11.1	1.36	1.33	0.780
その他	10,265	11.4	5.12	4.93	1.638
ロシア	2,259	11.5	0.00	0.00	1.600
アジア・オセアニア	10,495	13.5	6.52	6.26	1.627
中国	12,710	4.7	1.37	1.21	1.238
インド	11,344	9.8	5.89	5.49	1.707
インドネシア	10,120	11.6	5.08	5.26	1.668
ブラジル	11,265	14.1	3.89	3.98	1.581
メキシコ	9,626	11.7	4.22	4.23	1.368
トルコ	1,451	11.7	4.99	5.99	1.474
複合地域	4,639	17.8	1.43	1.29	1.210
ハイールド債券	10,503	13.0	4.87	4.36	1.655
グローバル	8,891	11.8	2.92	2.57	1.426
北米	12,065	14.0	5.04	4.50	1.681
その他	8,417	11.7	6.33	5.89	1.768
欧州	8,849	11.2	5.70	5.19	1.739
アジア・オセアニア	7,744	12.2	8.76	8.57	1.867
複合地域	5,230	20.3	5.20	4.59	1.800
複合資産	14,946	9.9	1.18	1.14	0.911
安定	12,046	10.0	1.58	1.51	1.050
安定成長	14,458	10.2	1.30	1.26	0.920
成長	18,779	9.4	0.39	0.36	0.769
国内バランス	13,177	11.7	2.13	2.18	0.961
安定	10,725	12.6	1.69	1.78	0.914
一般	14,743	12.3	1.11	1.01	1.220
その他	11,020	4.2	1.45	1.34	0.681

(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	16,464	10.5	2.91	2.65	1.065
国内REIT	13,462	10.5	6.87	8.19	0.885
日本	13,462	10.5	6.87	8.19	0.885
外国REIT	13,640	9.9	7.61	7.41	1.429
グローバル	14,940	9.4	3.11	2.87	1.165
除く日本	16,831	8.0	1.93	1.83	0.927
含む日本	13,554	10.3	4.07	3.73	1.358
北米	12,798	10.9	11.20	10.98	1.603
その他	10,440	10.1	6.63	6.88	1.738
欧州	5,244	11.3	5.31	4.51	1.920
アジア・オセアニア	10,948	9.5	8.29	8.90	1.794
オーストラリア	11,405	9.7	4.30	3.74	1.688
複合地域	8,508	12.4	0.90	0.70	0.775
複数国	12,261	20.2	2.09	1.96	1.650
その他					
絶対収益型	11,158	7.2	0.05	0.05	1.932
ロング・ショート	10,858	6.5	0.17	0.18	1.704
マーケットニュートラル	10,150	6.6	0.92	0.93	1.251
GTAA	12,089	11.1	0.41	0.41	1.575
その他スタイル	11,468	6.9	0.00	0.00	1.984
CB	12,594	7.5	0.33	0.31	1.185
アジア・オセアニア	11,863	14.0	2.29	2.02	1.823
日本	14,939	24.6	0.36	0.33	0.770
グローバル	12,555	6.9	0.30	0.28	1.181
コモディティ	14,784	7.4	0.09	0.08	0.896
全業種	12,417	11.7	0.35	0.31	1.246
貴金属	15,288	5.0	0.00	0.00	0.767
エネルギー	24,417	15.3	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	21,462	7.8	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