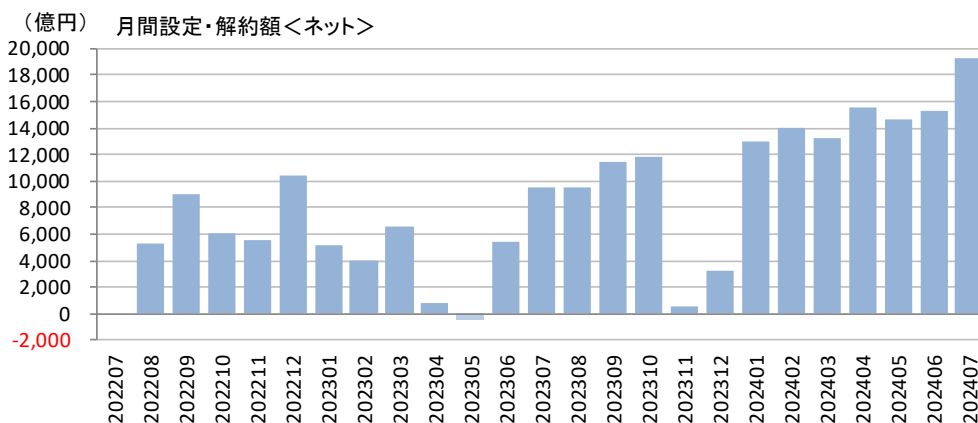
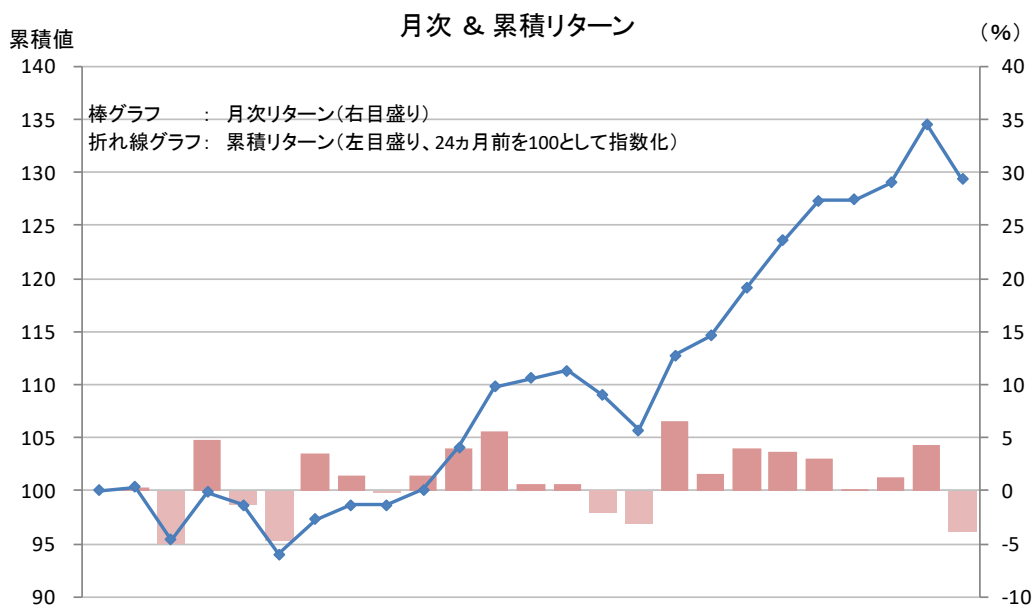


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

— Vol.2 ファンド分類 詳細編 —

2024年7月

「総合」 **-3.84%**
(前月 **+4.26%**)



MAB-FPI について

MAB-FPI とは日本の公募追加型株式投資信託全体の動向を表す指数で、弊社が独自に開発したものです。

(FPI は Fund Performance Index の略)

■主な特徴

- ・国内籍の公募追加型株式投資信託をユニバースとします（但し、ETF は除く）。
- ・月末に翌月の採用ファンドを選定します（月次リバランス）。
- ・総合および各カテゴリー別の日次収益率は、個々の投資信託の日次収益率を前日の純資産額によって加重した平均値として計算します。
- ・指数は算出開始時点（原則、1997年3月31日）を10,000（単位：ポイント）とし、各カテゴリーの日次収益率を乗じて算出します。
- ・カテゴリーは全体を表す「総合」のほかファンド分類別（大分類、中分類、小分類）、各種区分別（ヘッジ種別、アクティブ/パッシブ別、他）など、様々なサブ・カテゴリー指数を算出します。

詳細については『MAB 投信指数「MAB-FPI」算出要領』をご参照下さい。

■本レポートの内容

掲載対象カテゴリー：「総合」

|--- ファンド分類別「大分類」

|--- " " 「中分類」

|--- " " 「小分類」

なお、「中分類」と「小分類」の掲載対象は原則、直近5年以上指数算出が可能なカテゴリーからの抜粋

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン	・	・	・	・	・	P. 3
(2) 期間別リターン	・	・	・	・	・	P. 6
(3) リターン推移	・	・	・	・	・	P. 9
(4) 対「総合」寄与度分析	・	・	・	・	・	P. 20

<2> リスク・サマリー	・	・	・	・	・	P. 22
--------------	---	---	---	---	---	-------

<3> 設定・解約額 [ネット金額]	・	・	・	・	・	P. 35
--------------------	---	---	---	---	---	-------

<4> 純資産額、ファンド本数	・	・	・	・	・	P. 38
-----------------	---	---	---	---	---	-------

<5> 属性、指標等	・	・	・	・	・	P. 41
------------	---	---	---	---	---	-------

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別①

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		20,384	21,199	-815	-3.84
国内株式		28,051	28,395	-344	-1.21
一般		27,192	27,543	-350	-1.27
フリー		25,093	25,522	-429	-1.68
バリュー		36,906	37,042	-136	-0.37
小型		45,729	46,394	-665	-1.43
その他		28,800	29,116	-316	-1.09
日経225		27,322	27,663	-341	-1.23
TOPIX		28,702	28,864	-162	-0.56
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	27,474	27,547	-72	-0.26
国内債券		12,171	12,148	23	0.19
一般		12,171	12,148	23	0.19
外国株式(先進国)		29,580	31,538	-1,958	-6.21
グローバル		31,341	33,243	-1,902	-5.72
除く日本		51,256	54,236	-2,979	-5.49
含む日本		27,058	28,731	-1,673	-5.82
その他		25,479	27,409	-1,930	-7.04
北米		32,472	35,680	-3,208	-8.99
米国		39,747	42,772	-3,026	-7.07
カナダ	10,000 (2009.02.27)	24,191	24,864	-672	-2.70
欧州		31,021	31,966	-945	-2.96
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	15,966	16,518	-552	-3.34
イギリス	9,683 (2014.05.30)	11,826	11,740	86	0.73
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	46,194	48,863	-2,669	-5.46
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	23,920	24,929	-1,009	-4.05
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	50,384	52,533	-2,149	-4.09
複合地域	10,000 (2013.04.30)	17,354	18,134	-780	-4.30
エマージング株式		26,036	27,046	-1,010	-3.74
グローバル		23,708	25,170	-1,461	-5.81
BRICS	10,000 (2005.09.30)	27,406	29,041	-1,635	-5.63
その他		28,167	29,060	-892	-3.07
欧州		20,026	21,513	-1,487	-6.91
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,091	1,089	3	0.23
アジア・オセアニア		21,717	23,235	-1,518	-6.53
中国		33,895	37,170	-3,275	-8.81
インド	10,000 (2004.09.30)	79,368	81,304	-1,936	-2.38
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	16,853	17,099	-246	-1.44
タイ		22,810	22,728	82	0.36
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,400	8,509	-109	-1.28
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	27,628	29,287	-1,659	-5.67
韓国	10,000 (1997.06.30)	30,519	36,098	-5,580	-15.46
香港		21,936	23,966	-2,029	-8.47
中南米	7,427 (2006.04.28)	11,810	12,485	-676	-5.41
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,701	10,233	-532	-5.20
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	17,066	18,122	-1,056	-5.83
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	15,368	15,684	-316	-2.02
トルコ		56,439	60,212	-3,773	-6.27
複合地域	10,000 (2005.08.31)	28,946	30,203	-1,257	-4.16

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

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別②

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		20,384	21,199	-815	-3.84
外国債券(先進国)		19,987	20,418	-431	-2.11
グローバル		19,895	20,268	-373	-1.84
除く日本		22,352	23,004	-652	-2.84
含む日本		18,297	18,477	-180	-0.97
その他		20,641	21,349	-708	-3.32
北米	9,052 (2013.05.31)	11,428	11,793	-364	-3.09
米国		19,152	19,459	-307	-1.58
カナダ	10,000 (2003.05.30)	18,543	19,468	-925	-4.75
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,362	15,572	-210	-1.35
イギリス	10,069 (2014.07.31)	12,772	13,096	-324	-2.48
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	23,055	24,493	-1,438	-5.87
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	28,693	30,443	-1,751	-5.75
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	12,605	13,282	-678	-5.10
複合地域	10,000 (2001.11.30)	20,237	21,174	-937	-4.42
エマージング債券		22,127	22,989	-862	-3.75
グローバル		22,556	23,284	-728	-3.13
米ドル建て		23,179	23,897	-718	-3.00
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	15,942	16,502	-560	-3.39
その他	8,647 (2005.03.31)	17,427	18,264	-837	-4.58
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,912	2,033	-122	-5.99
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	17,614	18,087	-473	-2.61
中国	13,833 (2018.07.31)	19,976	20,532	-556	-2.71
インド	10,000 (2011.08.31)	23,443	24,459	-1,016	-4.15
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	20,027	20,632	-605	-2.93
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	15,935	16,998	-1,063	-6.26
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	20,153	21,424	-1,271	-5.93
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,496	2,607	-111	-4.25
複合地域	10,000 (2006.08.31)	13,197	13,699	-502	-3.67
ハイイールド債券		31,445	32,556	-1,110	-3.41
グローバル	10,000 (1997.06.30)	29,202	29,903	-701	-2.35
北米		31,956	33,162	-1,206	-3.64
その他	10,000 (2004.03.31)	27,733	28,568	-835	-2.92
欧州	10,000 (2006.04.28)	28,199	29,013	-814	-2.81
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	16,911	17,498	-587	-3.36
複合地域	10,000 (2004.03.31)	27,989	28,802	-813	-2.82
複合資産		21,906	22,315	-409	-1.83
安定	10,000 (1998.10.30)	17,238	17,463	-224	-1.29
安定成長		24,496	25,012	-516	-2.06
成長		32,285	33,040	-755	-2.28
国内バランス		12,504	12,485	19	0.15
安定		12,395	12,371	24	0.19
一般		19,023	19,076	-53	-0.28
その他	10,000 (2018.10.31)	13,987	14,092	-105	-0.75

※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		20,384	21,199	-815	-3.84
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	33,548	33,578	-30	-0.09
日本	10,000 (2003.10.31)	33,548	33,578	-30	-0.09
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	40,811	40,235	576	1.43
グローバル	10,000 (2004.01.30)	33,696	33,200	496	1.49
除く日本	10,000 (2004.04.30)	38,298	37,692	605	1.61
含む日本	10,000 (2004.01.30)	33,035	32,578	456	1.40
北米	10,000 (2003.09.30)	43,741	43,100	642	1.49
その他	10,000 (2004.04.30)	33,118	32,993	125	0.38
欧州	10,000 (2006.12.29)	6,172	6,146	26	0.43
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	23,586	23,356	230	0.98
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	20,336	20,715	-378	-1.83
複合地域	10,000 (2007.06.29)	8,893	9,041	-148	-1.64
複数国	10,000 (2004.04.30)	51,361	50,691	671	1.32
その他		7,624	7,840	-216	-2.76
絶対収益型		7,728	7,792	-65	-0.83
ロング・ショート		8,318	8,366	-48	-0.58
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,672	11,725	-53	-0.46
GTAA		11,805	12,005	-201	-1.67
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,266	7,327	-61	-0.84
CB		21,175	21,457	-282	-1.32
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	23,584	25,035	-1,451	-5.80
日本		22,002	21,980	22	0.10
グローバル		36,908	37,384	-476	-1.27
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	14,697	15,127	-430	-2.84
全業種	10,000 (2004.12.30)	12,301	13,623	-1,322	-9.70
貴金属	10,000 (2009.07.31)	25,529	25,592	-63	-0.25
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	11,252	12,645	-1,393	-11.02
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	18,055	19,430	-1,374	-7.07

※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	1.54	8.64	16.98	12.91
国内株式	1.75	9.43	19.34	17.13
一般	2.03	10.07	19.56	17.35
フリー	2.27	9.74	18.56	16.85
バリュー	1.49	10.80	22.28	18.50
小型	1.23	3.07	5.09	5.99
その他	1.33	9.25	21.01	18.27
日経225	1.83	8.45	19.49	17.58
TOPIX	1.99	10.69	22.78	19.31
JPX日経400	2.82	12.09	23.96	20.85
国内債券	-0.82	-1.72	-2.91	-2.35
一般	-0.82	-1.72	-2.91	-2.35
外国株式(先進国)	1.57	11.16	23.26	17.23
グローバル	1.10	10.64	20.95	15.68
除く日本	2.35	12.93	25.06	19.40
含む日本	0.56	9.66	19.25	14.11
その他	2.45	12.12	27.93	20.28
北米	2.09	12.87	28.38	21.55
米国	2.51	12.21	28.42	20.56
カナダ	-1.86	4.67	10.46	8.27
欧州	2.21	9.35	15.81	13.23
ドイツ	-1.07	10.38	16.52	14.07
イギリス	-3.13	1.41	5.66	3.43
アジア・オセアニア	0.32	11.75	10.86	13.79
オーストラリア	0.01	8.27	11.19	8.44
ニュージーランド	-1.83	1.35	4.42	2.04
複合地域	-6.82	13.73	15.15	17.70
エマージング株式	4.40	17.53	25.71	20.85
グローバル	-0.28	13.34	15.14	14.72
BRICS	-2.09	9.37	6.56	8.88
その他	6.01	18.95	30.25	23.11
欧州	-0.74	16.68	30.77	17.76
ロシア	0.20	0.90	0.94	1.45
アジア・オセアニア	0.45	12.27	9.45	12.51
中国	-10.81	5.67	-15.89	-2.12
インド	7.82	21.33	41.53	27.01
インドネシア	-4.27	-5.60	-6.92	-4.54
タイ	-1.11	1.10	-8.55	-2.09
フィリピン	-5.51	0.94	2.57	4.78
ベトナム	1.25	9.00	12.77	17.82
韓国	-8.26	-1.04	-15.30	-5.44
香港	-4.61	14.77	-5.51	9.55
中南米	-13.35	-9.51	-7.00	-11.30
ブラジル	-11.81	-10.49	-8.88	-13.50
メキシコ	-18.76	-11.16	-3.86	-7.01
中東・アフリカ	1.95	9.05	9.15	13.37
トルコ	2.38	26.20	46.19	44.57
複合地域	-1.74	4.63	11.33	5.97

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

＜1＞パフォーマンス・サマリー

(2) 期間別リターン

「総合」およびファンド分類別②

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	1.54	8.64	16.98	12.91
外国債券(先進国)	0.92	2.98	7.46	3.93
グローバル	0.80	2.80	6.99	3.86
除く日本	0.76	3.84	9.36	5.07
含む日本	0.85	1.94	5.09	2.88
その他	1.45	3.79	9.56	4.23
北米	2.09	2.42	8.08	4.14
米国	3.67	3.64	9.52	4.38
カナダ	-0.90	2.70	9.43	4.48
欧州	1.29	3.67	9.01	3.90
イギリス	1.81	6.17	16.51	7.95
アジア・オセアニア	-1.28	3.43	9.23	3.07
オーストラリア	-1.18	4.00	9.90	3.77
ニュージーランド	1.33	3.84	11.15	2.88
複合地域	0.11	3.46	6.96	5.31
エマージング債券	-1.61	3.52	9.92	6.22
グローバル	-0.23	5.28	12.28	7.33
米ドル建て	0.27	6.48	14.47	8.49
現地通貨建て	-1.41	2.38	6.96	4.52
その他	-3.43	1.20	6.89	4.73
ロシア	4.82	277.78	290.37	285.04
アジア・オセアニア	1.53	5.65	11.61	8.61
中国	-0.48	4.29	8.80	7.31
インド	-0.21	6.09	13.67	11.04
インドネシア	-0.17	1.48	2.27	4.02
ブラジル	-10.78	-8.86	-4.20	-6.92
メキシコ	-9.80	-4.94	-0.47	-2.75
トルコ	1.18	2.29	-6.88	1.40
複合地域	-1.92	3.27	8.37	5.28
ハイイールド債券	0.19	5.97	15.70	9.64
グローバル	0.87	5.49	14.23	8.54
北米	0.10	6.16	16.16	10.03
その他	-0.05	4.91	14.06	7.76
欧州	-0.40	4.16	13.68	6.49
アジア・オセアニア	1.11	7.58	15.24	12.39
複合地域	0.77	6.30	16.77	10.08
複合資産	0.95	5.41	10.17	7.82
安定	0.63	3.21	6.24	4.77
安定成長	0.90	5.86	10.92	8.40
成長	1.40	7.76	14.84	11.71
国内バランス	-1.04	-0.37	0.12	0.14
安定	-1.20	-1.27	-1.40	-1.21
一般	0.15	4.81	9.63	8.58
その他	4.94	7.49	13.56	6.07

※[色塗りの基準]期間別リターン> 総合

注：「エマージング債券・その他・ロシア」は外れ値が発生したため、3ヵ月を除き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	1.54	8.64	16.98	12.91
国内REIT	-3.94	-2.28	-4.40	-2.09
日本	-3.94	-2.28	-4.40	-2.09
外国REIT	8.14	11.57	17.31	10.49
グローバル	7.28	10.90	17.07	9.88
除く日本	8.09	11.73	18.75	10.87
含む日本	6.65	10.24	15.78	9.11
北米	9.52	12.84	18.63	11.76
その他	1.65	4.70	7.43	3.30
欧州	-0.22	6.77	17.37	6.21
アジア・オセアニア	1.21	2.48	3.53	0.79
オーストラリア	1.87	10.84	18.26	9.51
複合地域	-0.26	5.66	15.96	7.72
複数国	5.43	8.05	11.16	7.64
その他	1.10	7.26	11.98	9.66
絶対収益型	0.13	2.70	3.03	2.80
ロング・ショート	-0.60	0.64	1.94	1.78
マーケットニュートラル	0.90	3.09	3.05	2.99
GTAA	-0.80	2.49	5.01	4.00
その他スタイル	0.20	2.87	3.06	2.83
CB	-0.33	2.42	3.94	3.15
アジア・オセアニア	-2.38	8.51	9.33	10.14
日本	-0.15	3.17	8.15	6.06
グローバル	-0.30	2.35	3.84	3.05
コモディティ	-1.76	14.61	18.71	16.44
全業種	-8.43	3.88	4.43	7.71
貴金属	0.74	18.91	24.73	19.64
エネルギー	-8.15	4.46	12.23	15.74
その他コモディティ	-5.25	8.75	11.20	13.04

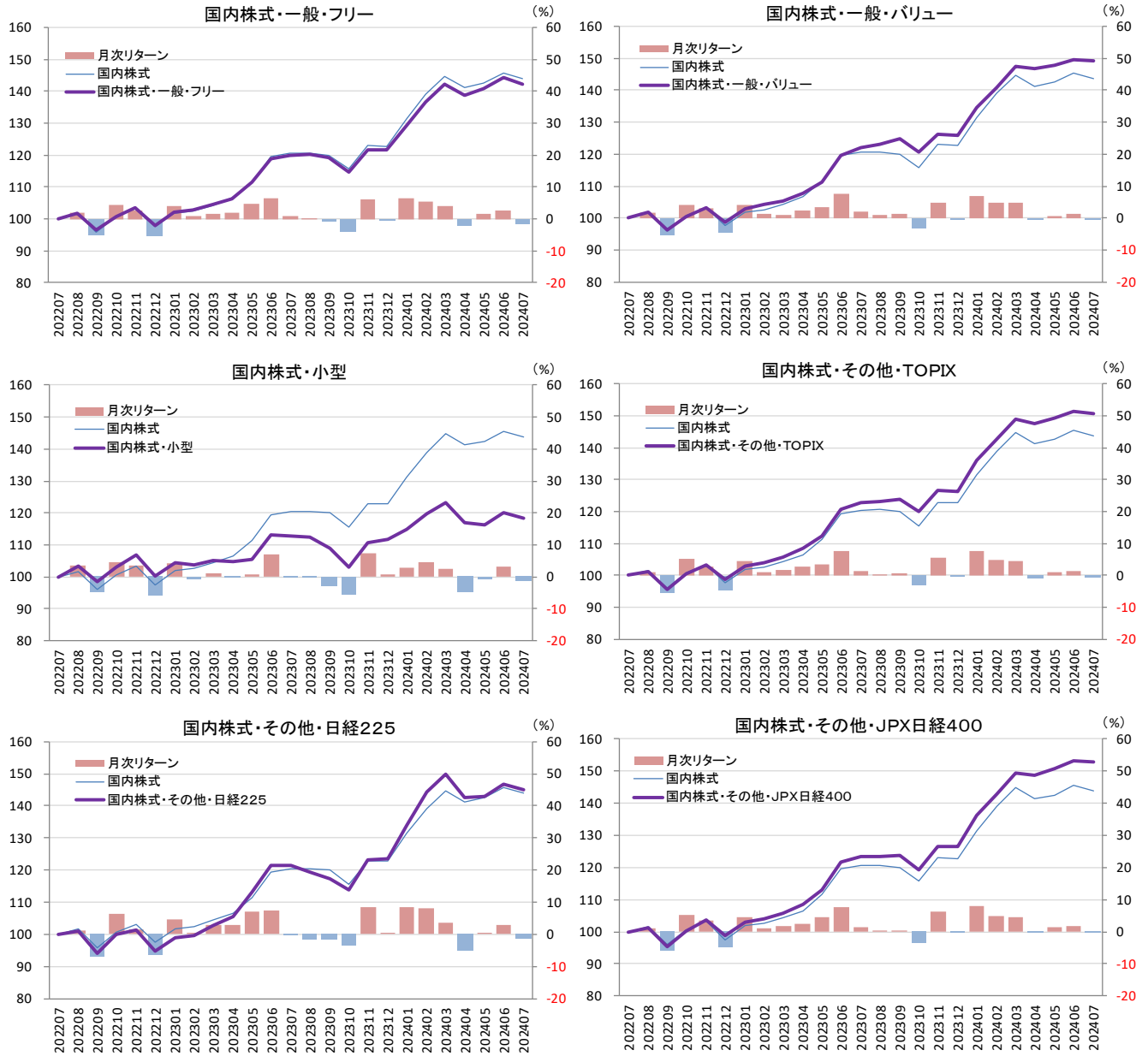
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

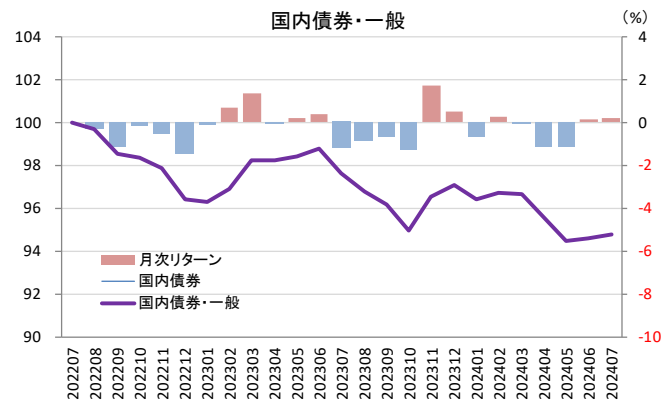
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

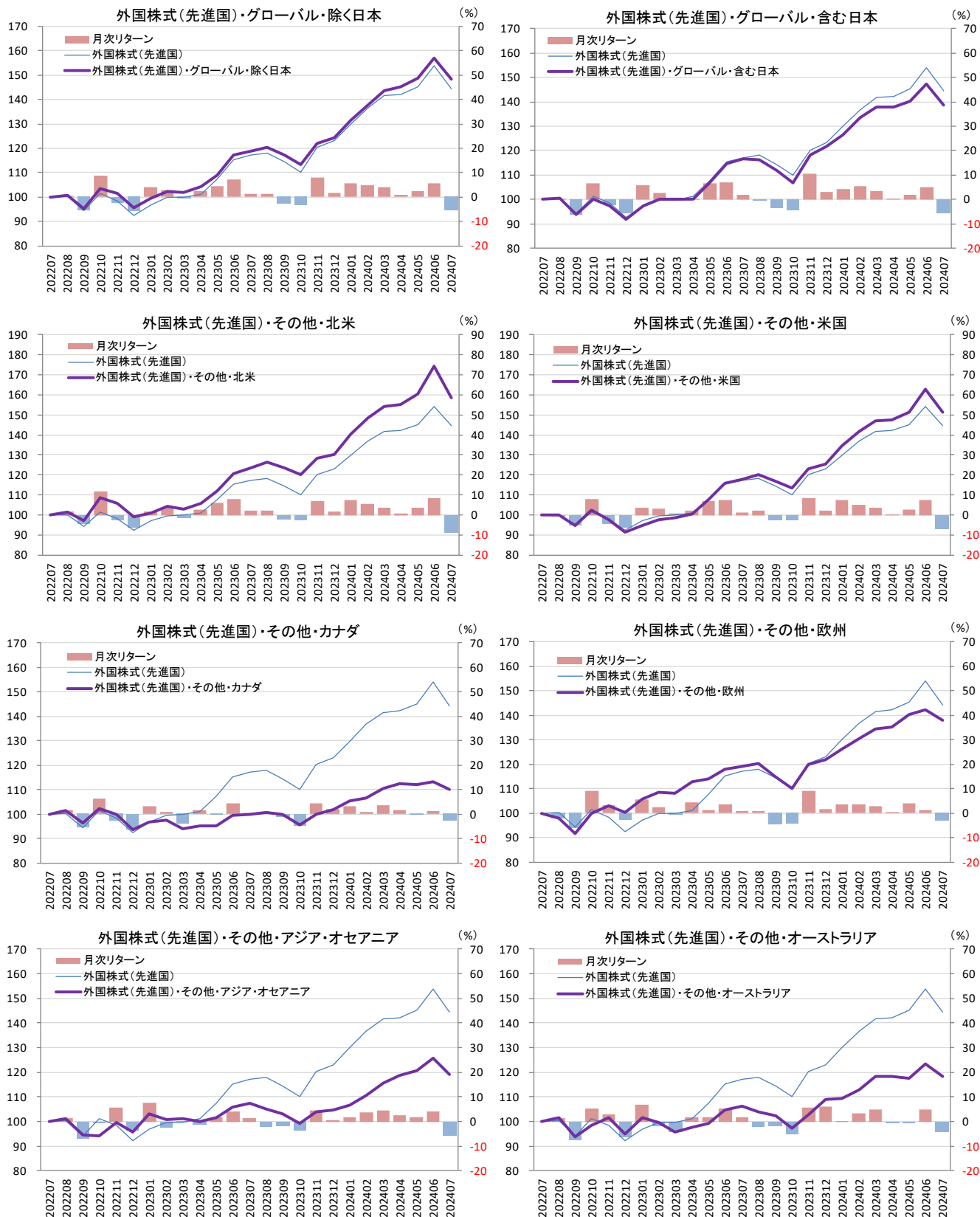


<1>パフォーマンス・サマリー

(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②

[外国株式 (先進国)]

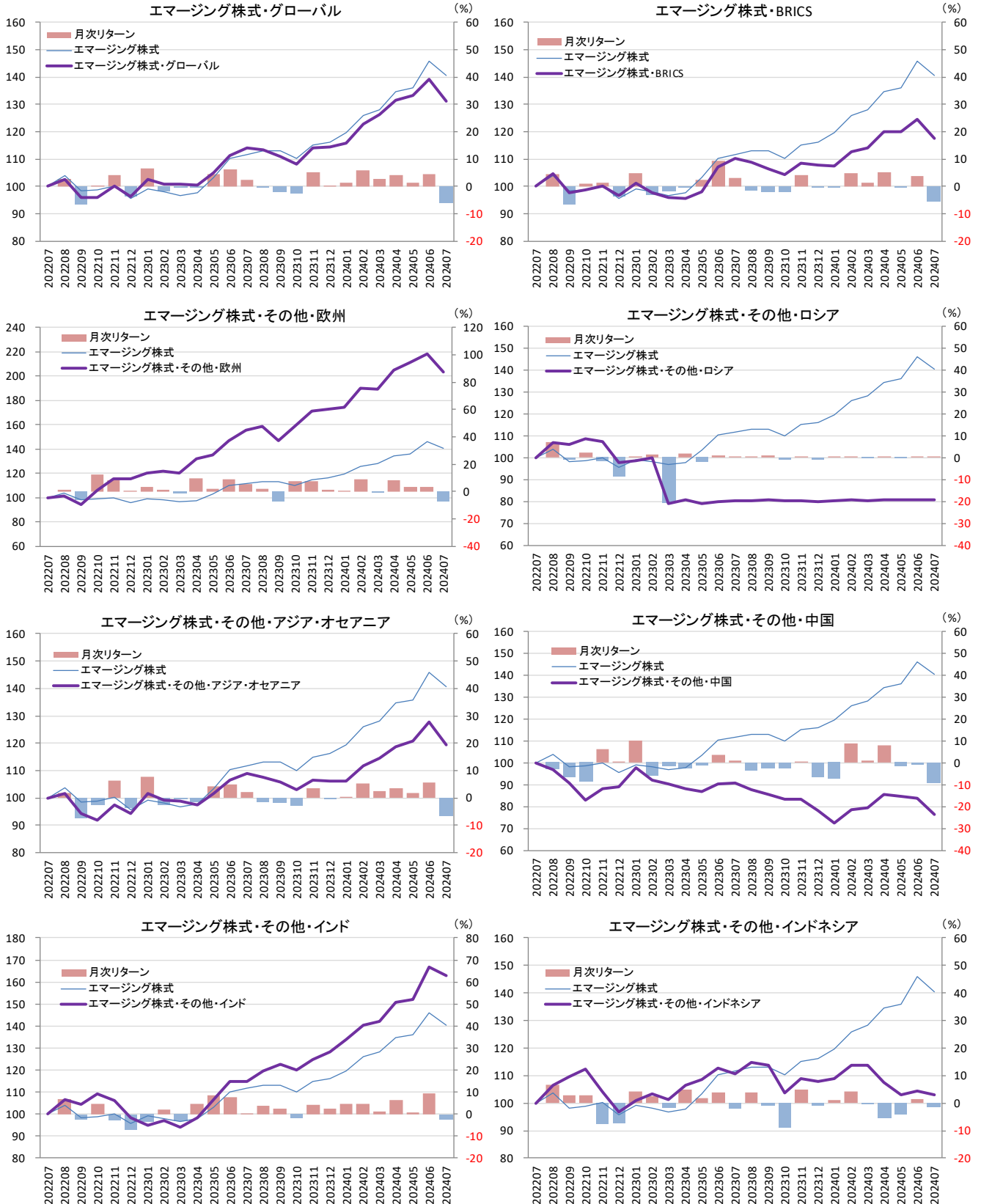


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマージング株式]

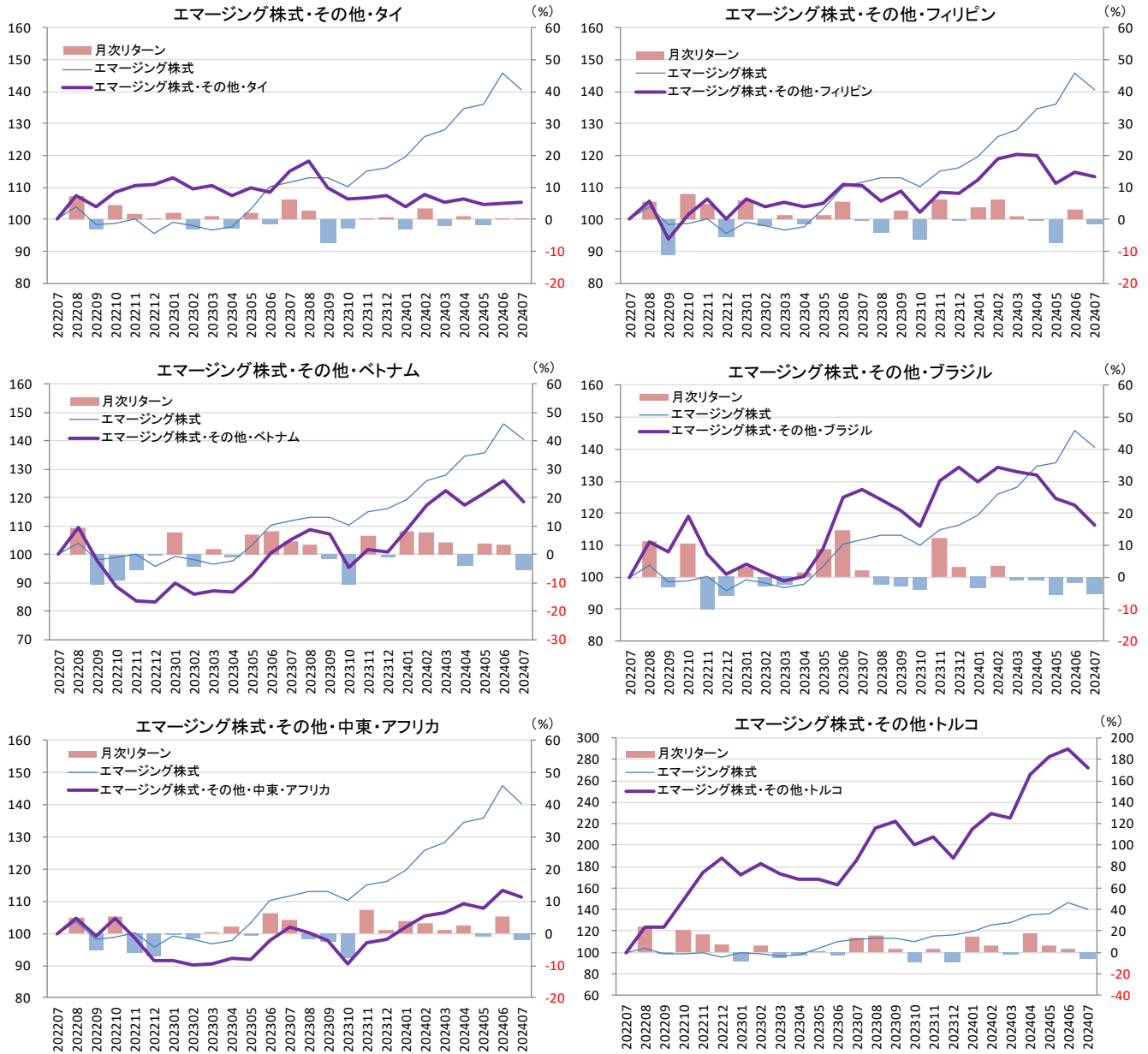


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

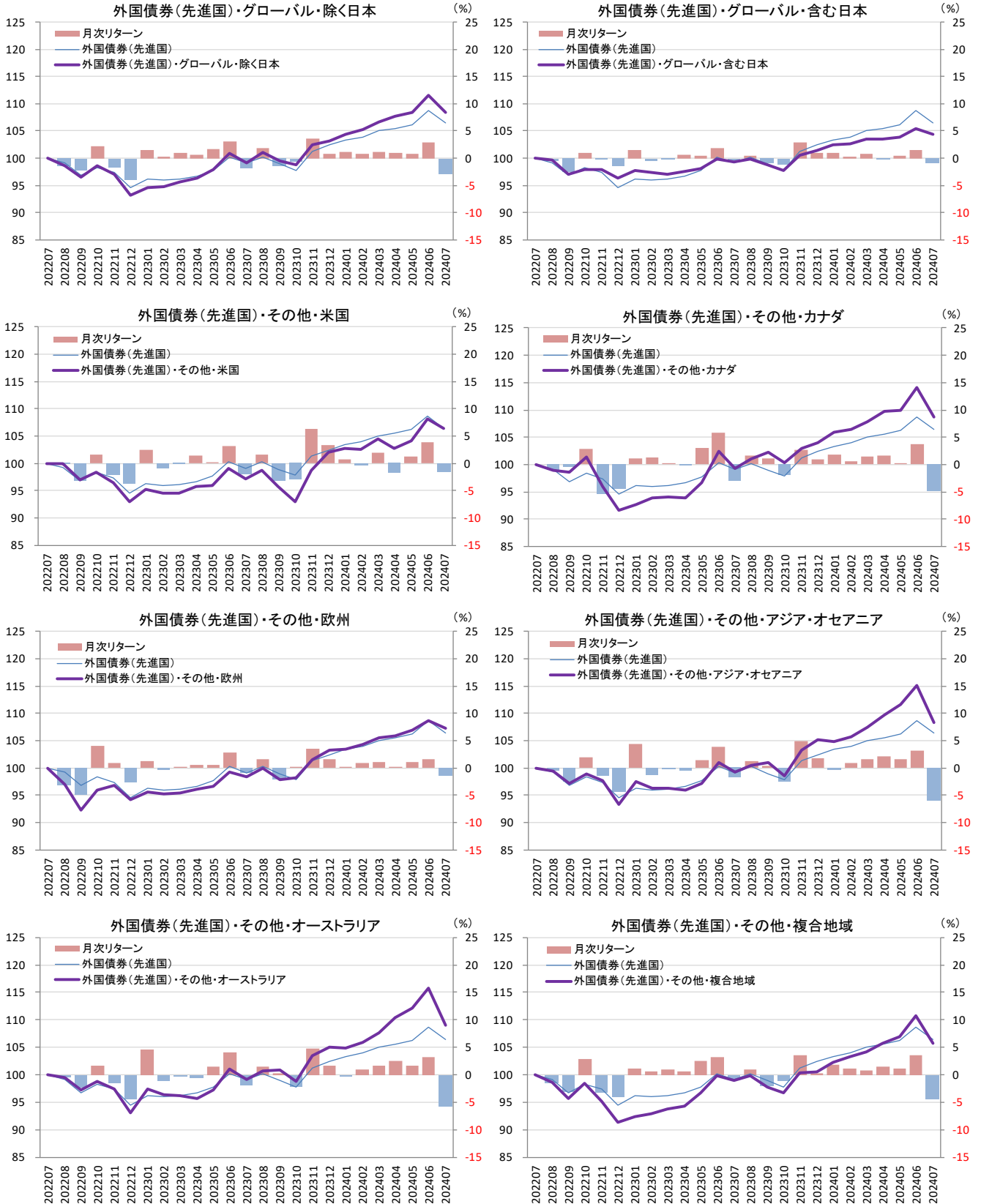


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

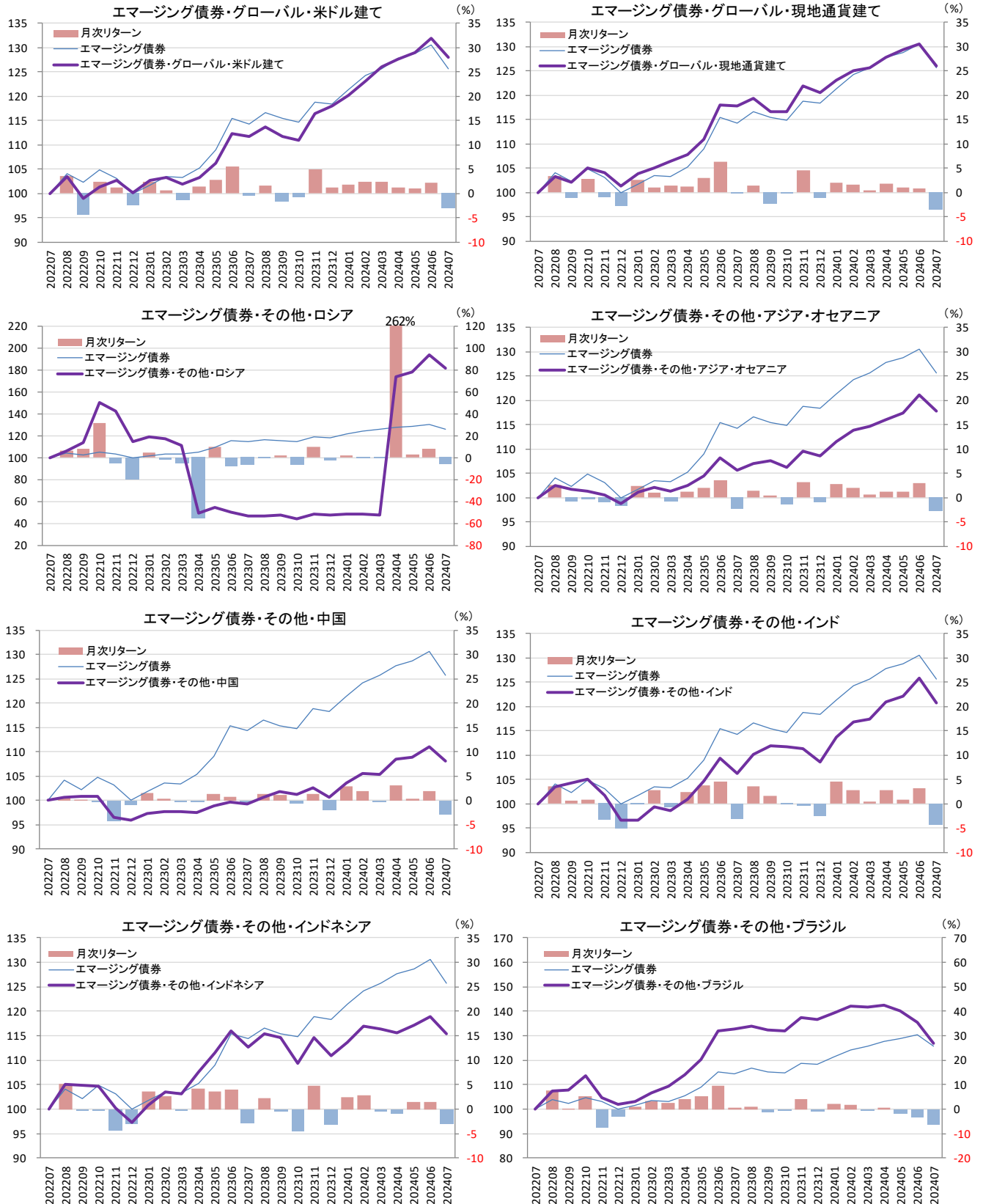


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマージング債券]

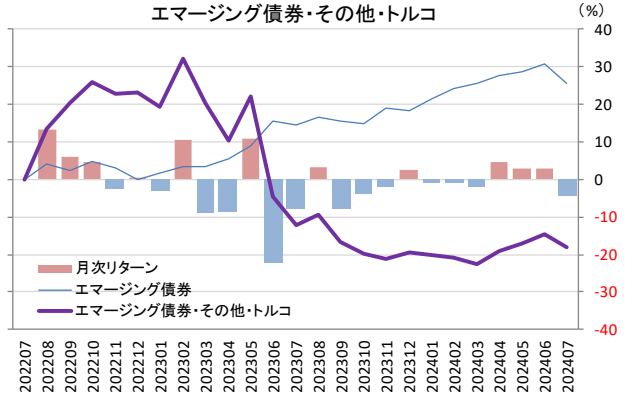
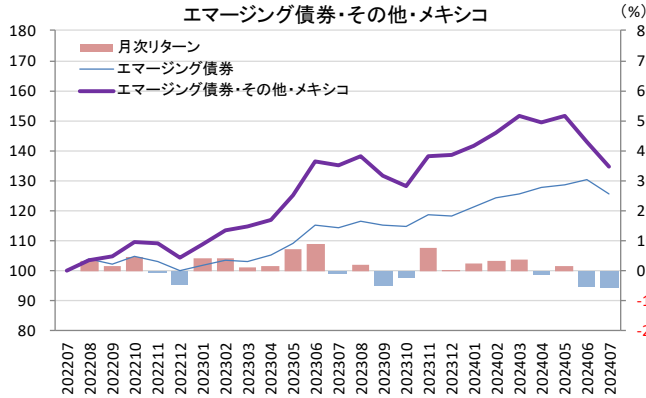


<1>パフォーマンス・サマリー

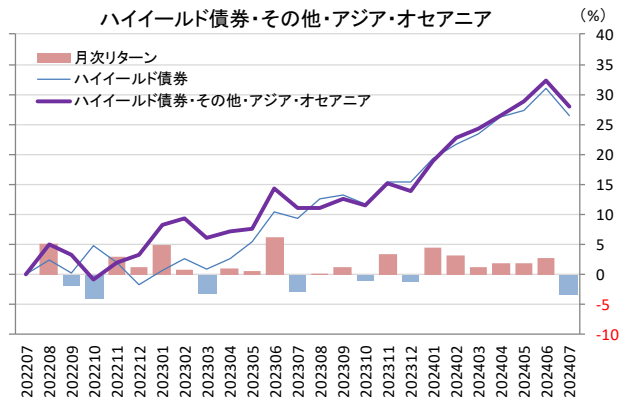
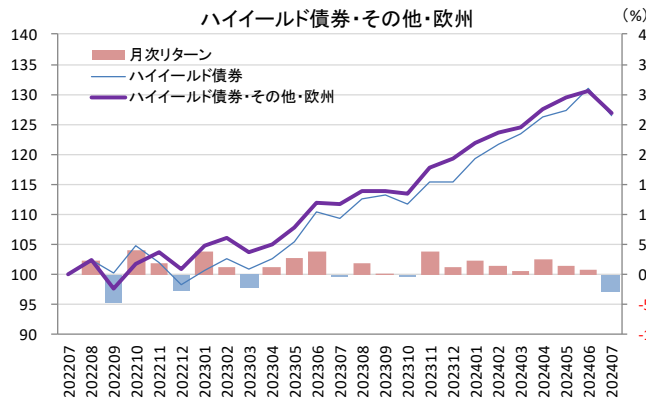
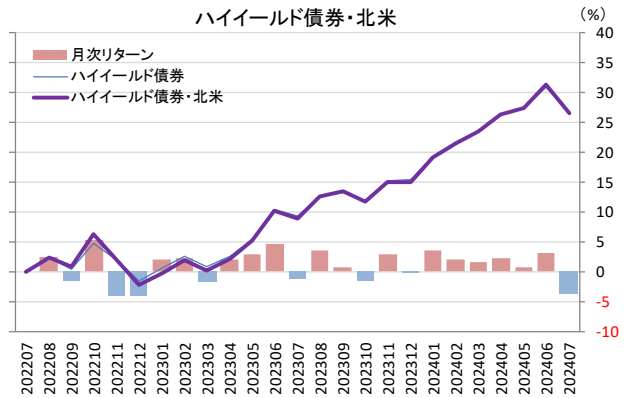
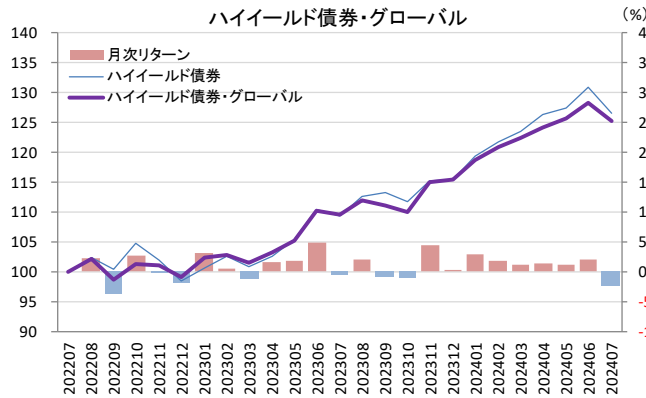
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

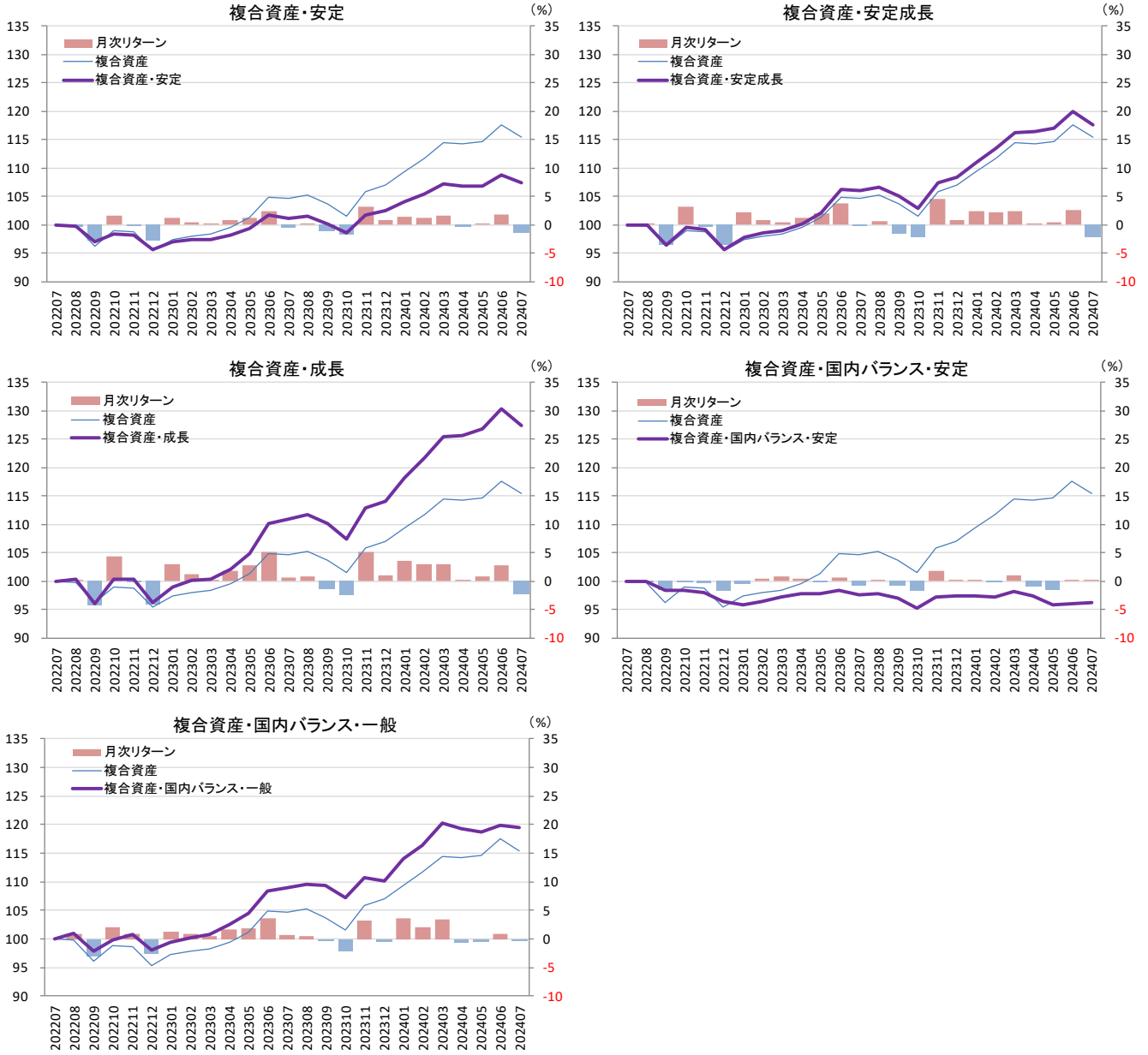


<1>パフォーマンス・サマリー

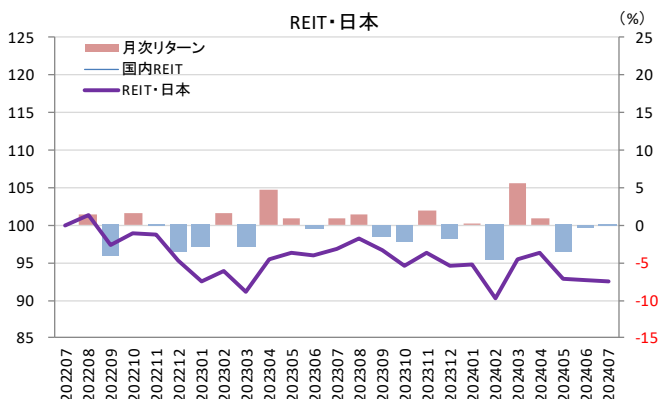
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

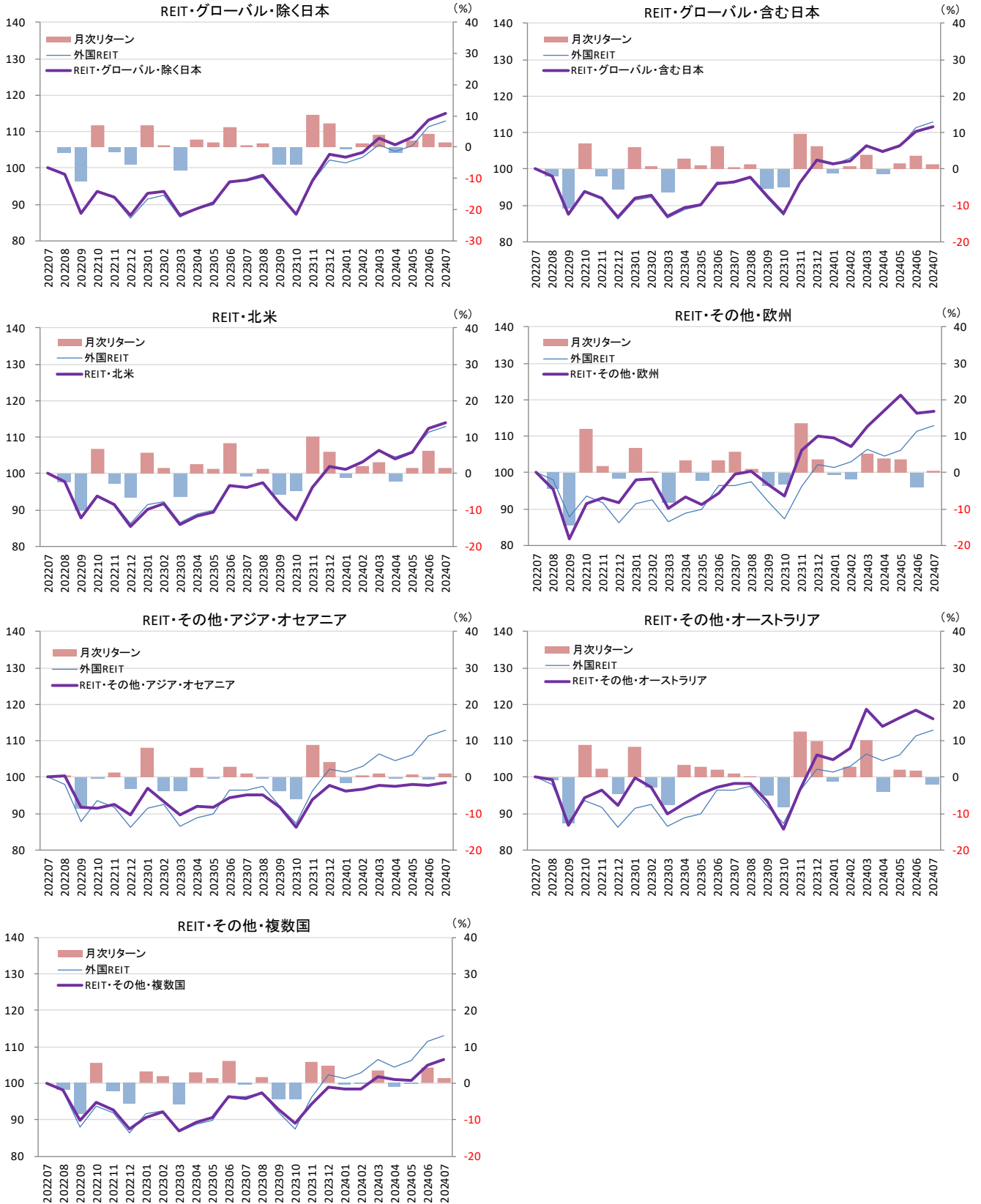


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

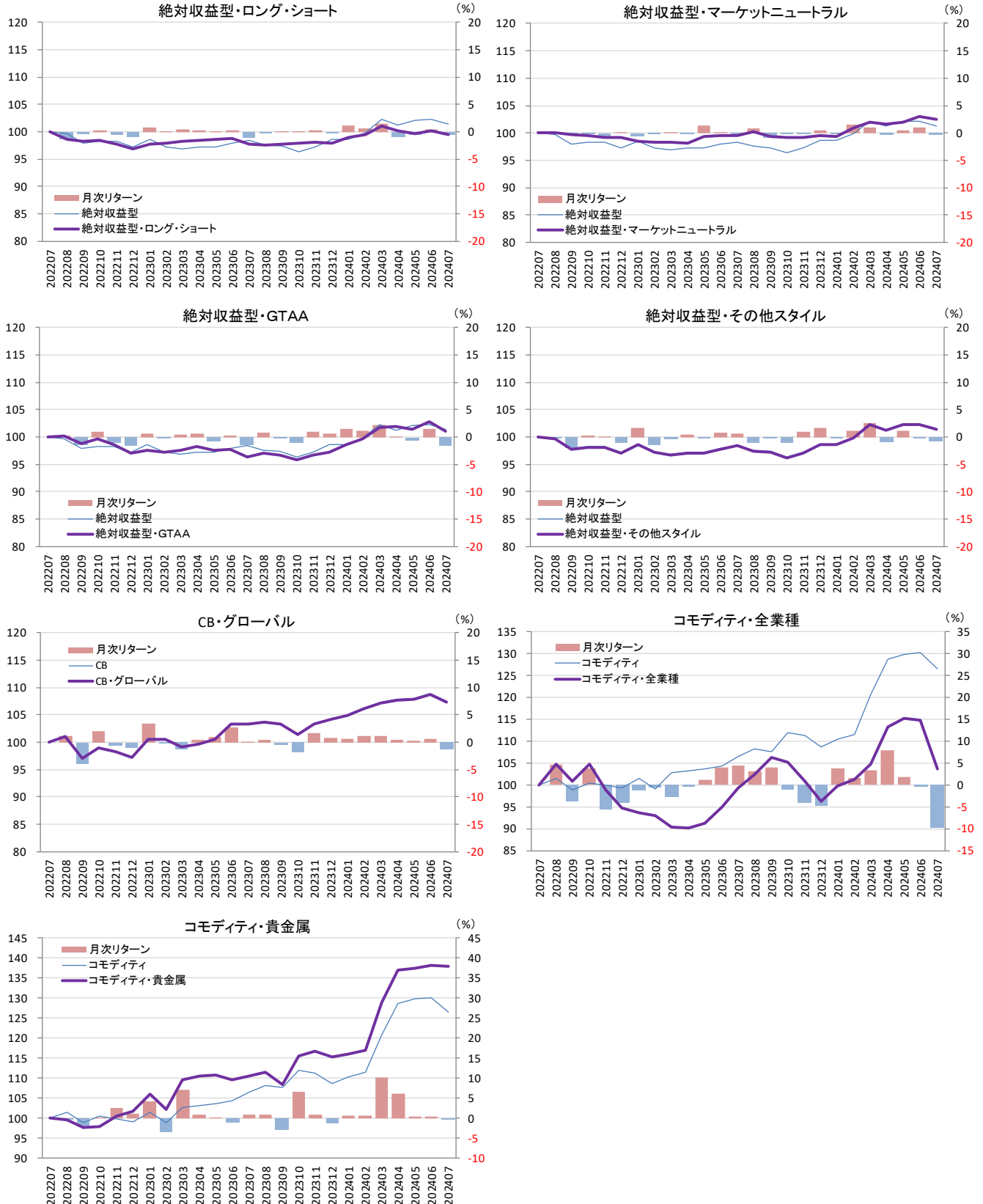


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	-3.84		
1	REIT・北米	1.49	1.92	0.03
2	REIT・グローバル	1.49	1.51	0.02
3	国内債券・一般	0.19	3.28	0.01
4	複合資産・国内バランス	0.15	0.43	0.00
5	REIT・その他	0.38	0.19	0.00
6	複合資産・その他	-0.75	0.24	-0.00
7	エマージング株式・BRICS	-5.63	0.04	-0.00
8	REIT・日本	-0.09	1.78	-0.00
9	国内株式・業種特化	-2.21	0.12	-0.00
10	CB	-1.32	0.21	-0.00
11	ハイイールド債券・その他	-2.92	0.14	-0.00
12	ハイイールド債券・グローバル	-2.35	0.22	-0.01
13	国内株式・小型	-1.43	0.59	-0.01
14	絶対収益型	-0.83	0.95	-0.01
15	エマージング債券・グローバル	-3.13	0.55	-0.02
16	エマージング債券・その他	-4.58	0.40	-0.02
17	コモディティ	-2.84	0.66	-0.02
18	複合資産・安定	-1.28	2.98	-0.04
19	外国債券(先進国)・その他	-3.32	1.41	-0.05
20	国内株式・その他	-1.08	5.10	-0.05
21	ハイイールド債券・北米	-3.64	1.34	-0.05
22	エマージング株式・グローバル	-5.81	1.14	-0.07
23	複合資産・成長	-2.28	3.08	-0.07
24	国内株式・一般	-1.27	7.23	-0.09
25	エマージング株式・その他	-3.07	3.60	-0.11
26	外国債券(先進国)・グローバル	-1.84	6.31	-0.12
27	複合資産・安定成長	-2.06	5.82	-0.12
28	外国株式(先進国)・その他	-7.04	17.68	-1.26
29	外国株式(先進国)・グローバル	-5.72	30.56	-1.76
	合計		100.00	-3.84

◆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	16.98		
1	外国株式(先進国)・グローバル	20.95	29.66	6.16
2	外国株式(先進国)・その他	27.93	15.56	4.13
3	国内株式・一般	19.56	7.37	1.43
4	国内株式・その他	21.01	5.06	1.08
5	エマージング株式・その他	30.25	2.91	0.80
6	複合資産・安定成長	10.92	6.12	0.68
7	外国債券(先進国)・グローバル	6.99	6.92	0.51
8	複合資産・成長	14.84	3.10	0.46
9	REIT・北米	18.63	2.15	0.37
10	REIT・グローバル	17.07	1.63	0.26
11	ハイイールド債券・北米	16.16	1.44	0.23
12	複合資産・安定	6.24	3.45	0.22
13	外国債券(先進国)・その他	9.56	1.55	0.15
14	エマージング株式・グローバル	15.14	1.07	0.15
15	コモディティ	18.71	0.61	0.10
16	エマージング債券・グローバル	12.28	0.61	0.08
17	エマージング債券・その他	6.89	0.47	0.04
18	複合資産・その他	13.56	0.28	0.04
19	ハイイールド債券・グローバル	14.23	0.24	0.03
20	国内株式・小型	5.09	0.68	0.03
21	絶対収益型	3.03	1.07	0.03
22	国内株式・業種特化	25.90	0.10	0.02
23	ハイイールド債券・その他	14.06	0.16	0.02
24	REIT・その他	7.43	0.24	0.02
25	CB	3.94	0.26	0.01
26	エマージング株式・BRICS	6.56	0.04	0.00
27	複合資産・国内バランス	0.12	0.56	0.00
28	REIT・日本	-4.40	2.29	-0.10
29	国内債券・一般	-2.91	3.83	-0.12
	合計		100.00	16.98

◆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で、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	26.39	57.82	84.69	11.63	11.95	10.88	0.70	0.80	0.58
国内株式	43.92	87.06	148.17	12.86	14.67	15.25	1.00	0.91	0.63
一般	42.86	85.63	137.84	12.36	14.22	15.23	1.02	0.93	0.60
フリー	38.63	81.93	132.76	12.98	14.58	15.59	0.89	0.87	0.57
バリュー	57.50	96.63	152.86	10.79	13.58	14.41	1.52	1.07	0.68
小型	5.56	42.65	132.35	15.09	17.88	16.60	0.12	0.41	0.53
その他	52.92	96.91	172.52	13.56	15.17	15.37	1.12	0.96	0.69
日経225	49.90	95.25	185.11	15.42	16.72	16.23	0.94	0.86	0.68
TOPIX	57.02	98.83	163.62	11.65	13.82	14.61	1.39	1.07	0.70
JPX日経400	59.57	102.52	156.67	12.08	14.20	14.58	1.40	1.07	0.68
国内債券	-8.49	-9.36	-2.46	2.48	2.35	2.04	-1.17	-0.82	-0.11
一般	-8.49	-9.36	-2.46	2.48	2.35	2.04	-1.17	-0.82	-0.11
外国株式(先進国)	35.12	103.78	152.53	17.21	17.53	16.38	0.61	0.87	0.59
グローバル	28.79	96.58	151.99	17.25	17.53	16.28	0.51	0.83	0.60
除く日本	57.54	128.25	214.19	15.22 ↑	16.99	16.64	1.08	1.06	0.73
含む日本	20.25	86.63	134.41	18.15	18.04	16.43	0.35	0.74	0.54
その他	50.91	119.11	153.54	17.33	17.90	16.87	0.85	0.95	0.58
北米	93.82	178.77	217.77	16.05 ↑	18.33	18.03	1.54	1.24	0.68
米国	50.83	131.04	189.37	17.53	17.47	17.21	0.84	1.05	0.65
カナダ	20.07	44.44	20.02	11.66	17.68	15.90	0.54	0.43	0.12
欧州	31.13	76.69	103.50	14.66	17.09	16.20	0.65	0.71	0.46
ドイツ	43.69	92.66	98.73	17.75	21.52	20.91	0.72	0.65	0.34
イギリス	28.57	37.59	21.63	10.21	15.82	15.41	0.86	0.42	0.13
アジア・オセアニア	16.63	41.99	76.24	11.52 ↑	14.46	14.67	0.46	0.50	0.40
オーストラリア	39.82	50.16	58.08	18.01	23.68	19.88	0.66	0.36	0.24
ニュージーランド	14.12	44.51	160.49	15.26	17.56	17.00	0.30	0.44	0.59
複合地域	125.62	103.97	40.71	24.77	32.54	26.92	1.26	0.47	0.13
エマージング株式	41.74	81.52	104.51	11.20	17.31	16.26	1.10	0.73	0.46
グローバル	25.82	67.29	80.08	12.13	16.66	16.46	0.66	0.65	0.37
BRICS	-4.01	17.23	56.16	13.47	19.75	18.89	-0.10	0.16	0.24
その他	49.85	89.64	116.99	11.36	17.87	16.52	1.27	0.77	0.49
欧州	-28.19	-21.32	-11.52	34.56	33.23	27.18	-0.30	-0.14	-0.04
ロシア	-91.72	-89.24	-84.66	54.71	47.50	37.82	-1.03	-0.76	-0.45
アジア・オセアニア	15.89	41.19	56.58	12.75	16.40	15.98	0.40	0.44	0.29
中国	-31.43	5.79	72.10	19.73	19.91	21.47	-0.60	0.06	0.26
インド	89.15	155.61	232.05	14.72	22.17	20.73	1.61	0.93	0.62
インドネシア	40.74	16.01	19.30	15.75	25.48	22.65	0.77	0.12	0.08
タイ	18.68	-5.51	17.91	12.30 ↓	20.11	17.46	0.48	-0.05	0.10
フィリピン	23.63	-2.11	1.82	15.56	20.62	18.07	0.47	-0.02	0.01
ベトナム	35.87	85.40	148.86	19.64 ↓	25.96	21.77	0.55	0.51	0.44
韓国	-19.55	60.45	17.31	26.18 ↑	26.20	21.79	-0.27	0.38	0.07
香港	-4.49	-6.09	13.15	21.69	21.37	20.13	-0.07	-0.06	0.06
中南米	32.07	36.34	30.69	23.49	29.61	26.39	0.41	0.22	0.10
ブラジル	8.52	-4.55	-10.95	26.14	32.15	31.66	0.11	-0.03	-0.04
メキシコ	67.07	97.09	36.30	22.62 ↑	27.52	24.20	0.83	0.53	0.13
中東・アフリカ	35.54	64.63	50.10	14.77	18.04	16.68	0.72	0.58	0.25
トルコ	182.27	158.34	37.42	33.09	33.83	31.67	1.25	0.62	0.10
複合地域	18.08	41.00	42.17	13.31 ↓	16.55	15.59	0.43	0.43	0.23

※[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 ヶ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	26.39	57.82	84.69	11.63	11.95	10.88	0.70	0.80	0.58
外国債券(先進国)	5.28	13.07	14.34	5.28 ↑	5.12	5.39	0.33	0.49	0.25
グローバル	3.47	10.38	14.78	4.71	4.44	4.81	0.25	0.45	0.29
除く日本	7.75	16.64	19.36	6.11	5.12 ↑	5.51	0.42	0.62	0.33
含む日本	-0.04	4.86	11.24	3.90	4.53	4.49	0.00	0.22	0.24
その他	12.80	23.61	18.52	8.24	8.13	7.75	0.50	0.54	0.22
北米	1.95	10.49	20.72	6.48 ↑	6.29 ↑	5.28	0.10	0.32	0.36
米国	12.43	22.66	37.22	8.11	8.32	7.19	0.49	0.50	0.45
カナダ	21.64	32.82	22.31	8.91 ↑	8.16	8.73	0.76	0.72	0.24
欧州	-2.31	0.06	0.11	6.65	5.77	6.53	-0.11	0.01	0.00
イギリス	21.03	41.12	26.84	10.94	9.78	10.09	0.60	0.73	0.24
アジア・オセアニア	14.63	26.19	16.62	10.07 ↑	10.11	9.40	0.46	0.47	0.17
オーストラリア	15.65	27.68	17.28	10.07 ↑	10.15	9.46	0.50	0.50	0.17
ニュージーランド	7.97	15.78	20.83	10.79	9.92	10.06	0.24	0.30	0.19
複合地域	8.32	23.14	21.32	8.22 ↑	6.79	7.07	0.33	0.63	0.28
エマーシング債券	28.28	26.40	32.01	7.67	10.58	10.57	1.13	0.46	0.27
グローバル	19.99	19.70	23.57	7.98	11.80	11.15	0.79	0.31	0.19
米ドル建て	18.66	18.73	24.27	8.55	12.43	11.56	0.69	0.28	0.19
現地通貨建て	24.89	23.92	18.05	7.33	10.19	10.21	1.05	0.43	0.17
その他	38.56	34.96	41.79	9.21	10.56	11.13	1.25	0.59	0.32
ロシア	-82.08	-82.45	-82.79	170.60 ↑	132.23 ↑	94.74	-0.26	-0.22	-0.17
アジア・オセアニア	19.60	24.65	42.10	6.09	7.15	6.93	1.01	0.63	0.52
中国	29.90	45.92	-	6.52	6.34	-	1.40	1.24	-
インド	37.06	45.70	87.04	8.92	9.38	9.61	1.24	0.84	0.67
インドネシア	36.54	50.53	74.39	9.84	13.48	13.63	1.11	0.63	0.42
ブラジル	49.21	18.01	27.94	15.46	17.83	18.37	0.92	0.19	0.14
メキシコ	57.66	73.23	48.90	13.72 ↑	16.74	15.71	1.20	0.70	0.26
トルコ	-43.69	-55.00	-78.43	28.35	26.57	27.88	-0.61	-0.55	-0.51
複合地域	25.19	21.65	12.34	10.52	11.80	11.59	0.74	0.34	0.10
ハイイールド債券	34.05	44.60	61.41	8.20	11.33	10.51	1.25	0.68	0.47
グローバル	24.57	31.59	45.10	7.21	11.11	10.37	1.06	0.51	0.37
北米	39.08	52.24	75.27	8.71	11.35	10.57	1.34	0.77	0.55
その他	20.57	25.04	30.85	8.48	12.36	11.29	0.76	0.37	0.24
欧州	21.83	26.52	30.71	9.19	13.03	12.00	0.74	0.37	0.23
アジア・オセアニア	15.26	17.74	31.76	9.53	12.07	10.32	0.51	0.28	0.27
複合地域	29.01	47.07	60.97	7.92	9.00	8.85	1.12	0.89	0.55
複合資産	14.14	28.40	48.26	6.84	7.23	7.21	0.66	0.71	0.56
安定	4.23	11.94	24.10	4.96	5.02	5.30	0.28	0.46	0.42
安定成長	17.77	34.39	56.30	7.17	7.68	7.61	0.78	0.80	0.60
成長	30.86	61.94	100.99	9.02	10.21	10.49	1.04	0.99	0.69
国内バランス	-4.11	-4.45	6.71	3.14	3.95	4.14 ↓	-0.44	-0.22	0.16
安定	-6.70	-7.82	4.84	3.00	3.82	3.13	-0.76	-0.42	0.16
一般	17.63	37.62	55.17	6.49	7.61	8.28	0.86	0.87	0.54
その他	-10.79	15.33	-	20.41	18.37	-	-0.18	0.16	-

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

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

<2> リスク・サマリー

(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	26.39	57.82	84.69	11.63	11.95	10.88	0.70	0.80	0.58
国内REIT	-10.74	2.40	45.53	10.16	15.01	12.30	-0.36	0.03	0.31
日本	-10.74	2.40	45.53	10.16	15.01	12.30	-0.36	0.03	0.31
外国REIT	30.81	54.47	109.90	17.91	19.08	16.68	0.52	0.48	0.46
グローバル	26.74	46.97	83.92	17.67	19.74	16.87	0.47	0.41	0.37
除く日本	29.83	55.64	110.10	18.31	20.47	17.33	0.50	0.45	0.45
含む日本	24.86	43.31	77.83	17.33	19.44	16.70	0.44	0.39	0.36
北米	36.38	66.76	138.45	18.74	18.89	17.04	0.58	0.57	0.53
その他	13.65	19.35	74.82	15.25	19.38	16.06	0.29	0.19	0.36
欧州	0.80	14.21	21.40	19.06	21.36	18.58	0.01	0.13	0.11
アジア・オセアニア	9.23	12.88	76.22	14.18	17.75	15.17	0.21	0.14	0.39
オーストラリア	31.26	33.32	67.92	23.74	30.16	23.43	0.40	0.20	0.23
複合地域	33.66	27.53	29.07	15.28	24.25	20.21	0.67	0.21	0.13
複数国	18.64	47.30	130.52	15.24	17.17	15.05	0.39	0.47	0.58
その他									
絶対収益型	-4.21	-1.41	-1.36	3.99	3.52	2.90	-0.35	-0.07	-0.04
ロング・ショート	-5.10	-9.24	-8.99	3.21	3.05	3.08	-0.53	-0.62	-0.30
マーケットニュートラル	-3.29	-2.71	16.05	3.94	4.07	5.17	-0.28	-0.13	0.29
GTAA	0.40	9.42	14.48	4.26	4.56	3.57	0.04	0.40	0.39
その他スタイル	-4.50	-0.84	-1.69	4.38	3.81	3.16	-0.34	-0.04	-0.05
CB	-3.97	13.82	18.73	6.41	8.53	7.60	-0.21	0.31	0.23
アジア・オセアニア	20.44	53.87	98.56	9.02	12.17	11.52	0.71	0.74	0.62
日本	10.31	11.48	28.19	4.86	5.30	5.39	0.69	0.42	0.47
グローバル	-4.91	13.07	17.22	6.63	8.76	7.69	-0.25	0.29	0.21
コモディティ	55.24	89.37	31.43	10.78	11.69	12.24	1.47	1.17	0.23
全業種	60.54	93.05	21.53	17.51 ↑	19.67	17.32	0.98	0.72	0.11
貴金属	43.09	76.69	67.70	11.21 ↓	12.85	11.48	1.13	0.94	0.46
エネルギー	103.36	140.88	22.19	26.67	35.43	32.10	1.00	0.54	0.06
その他コモディティ	60.57	79.06	35.25	16.06	18.96	17.00	1.07	0.65	0.18

※[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

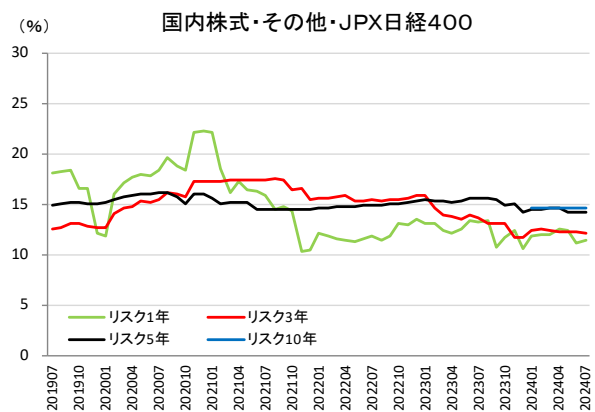
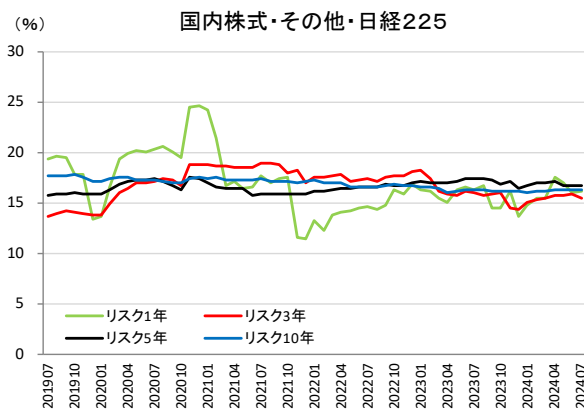
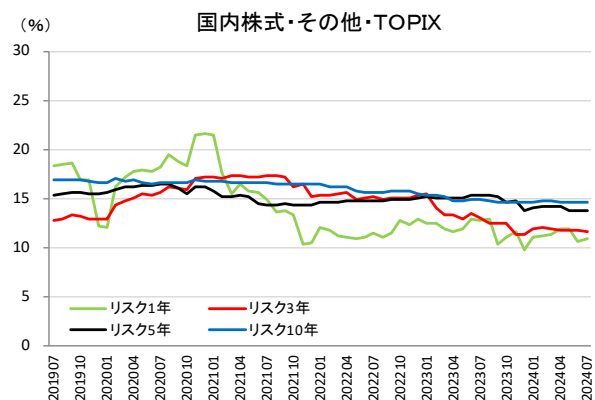
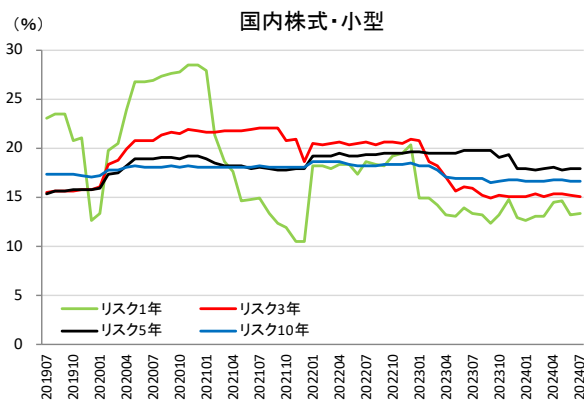
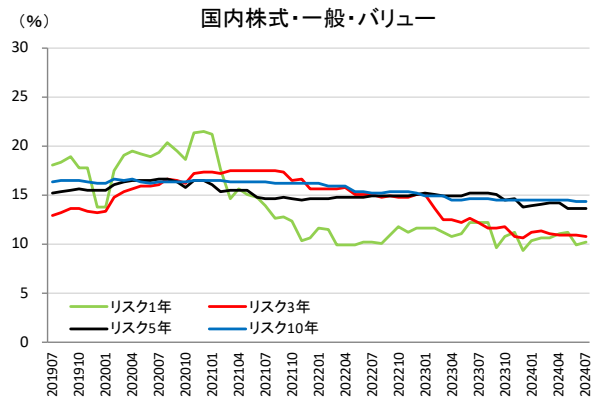
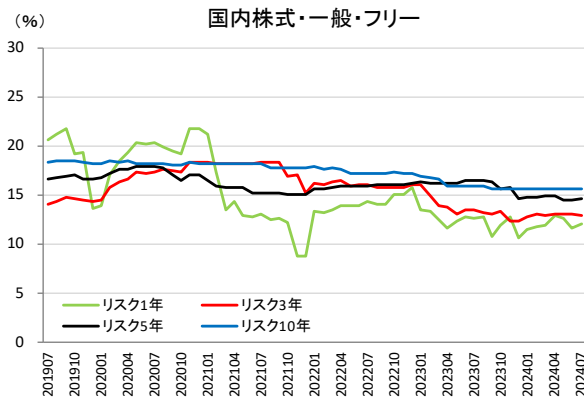
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

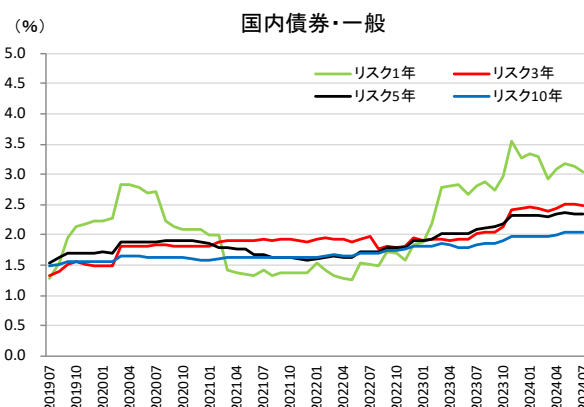
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

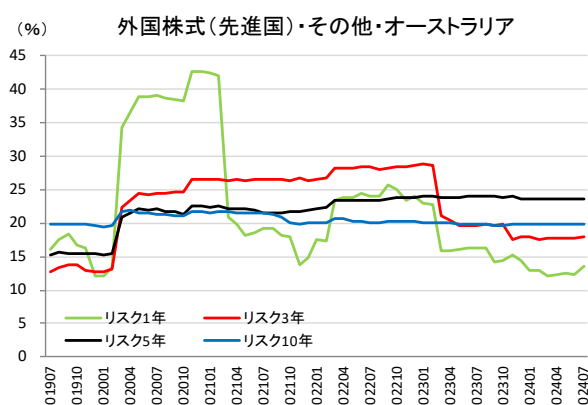
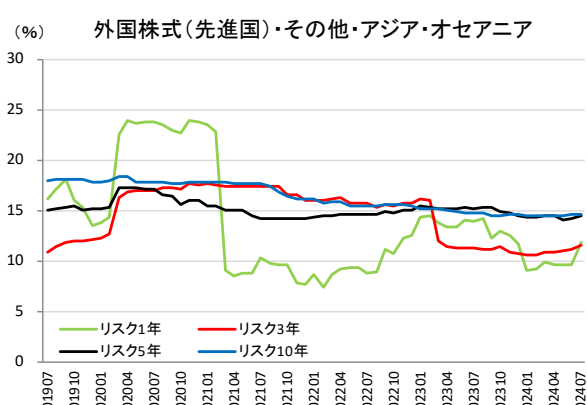
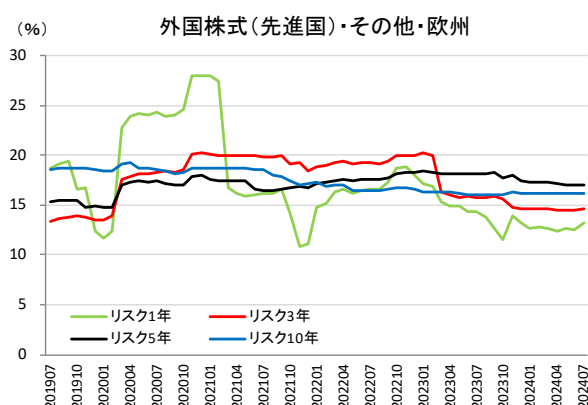
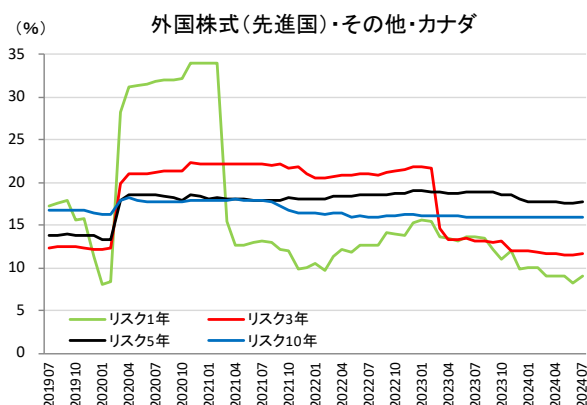
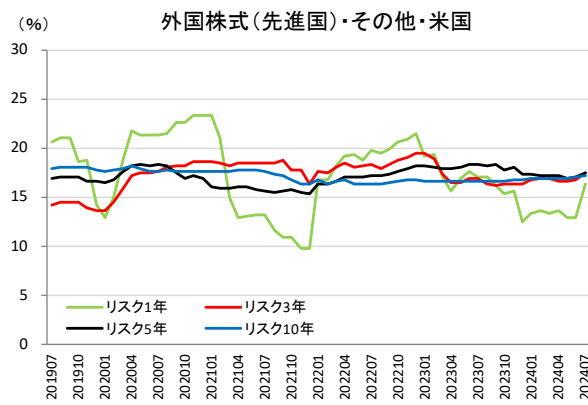
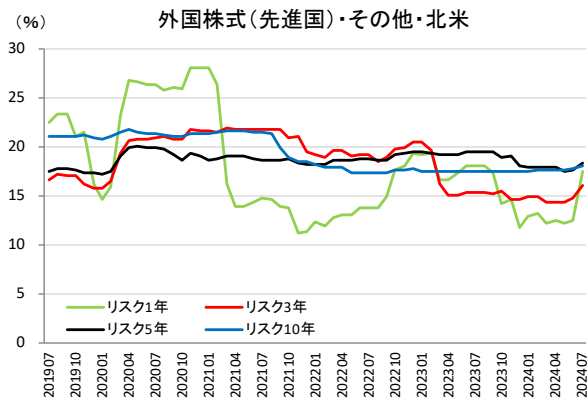
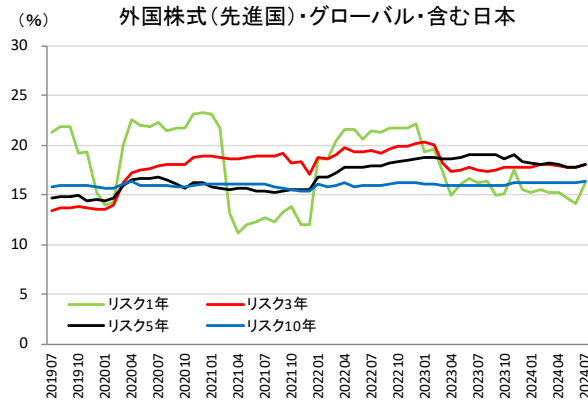
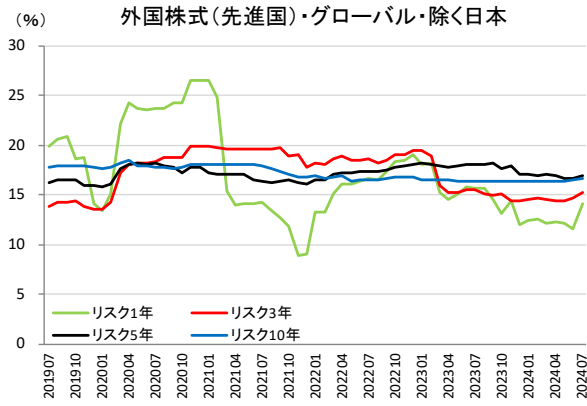


<2> リスク・サマリー

(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)]

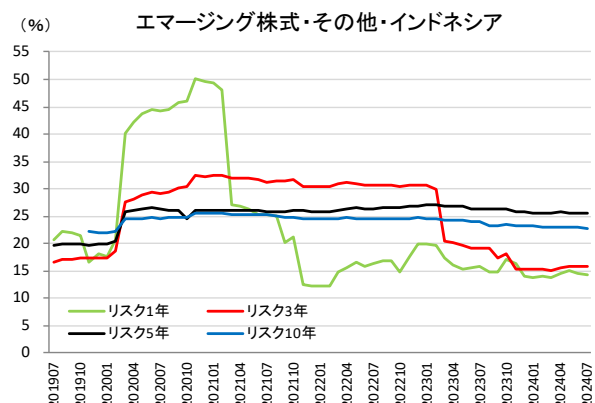
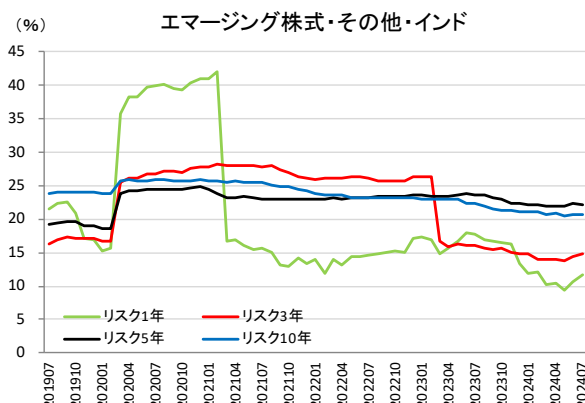
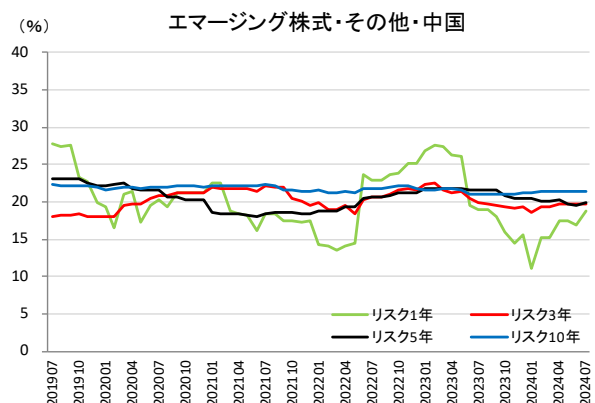
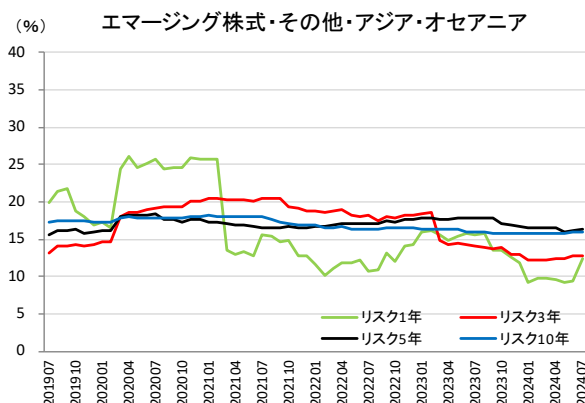
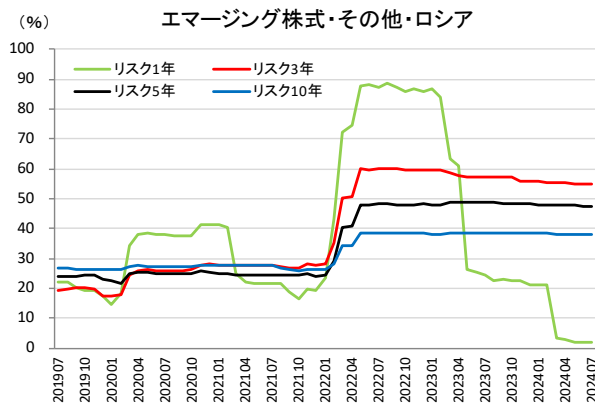
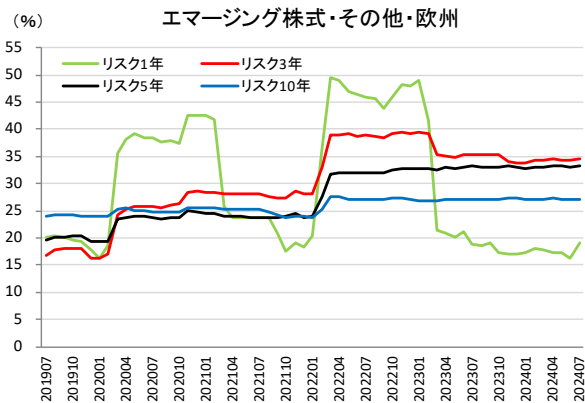
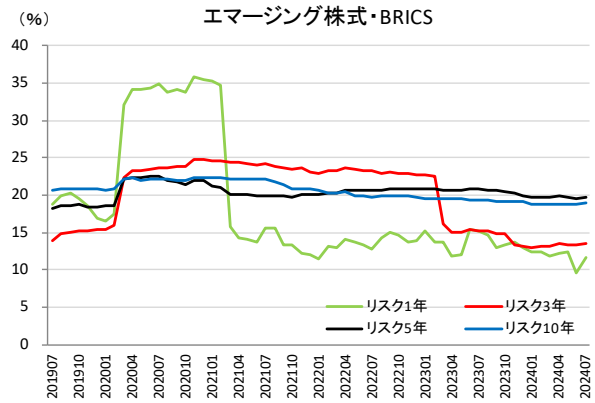
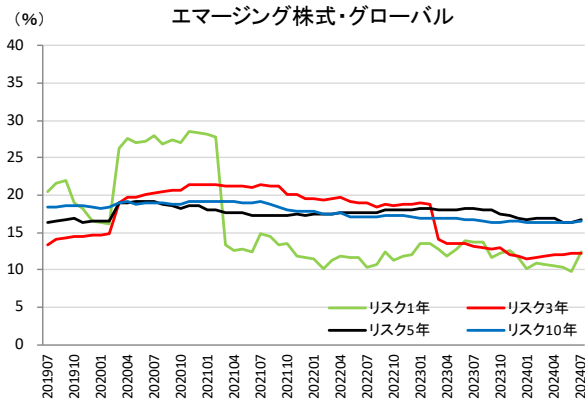


<2> リスク・サマリー

(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]

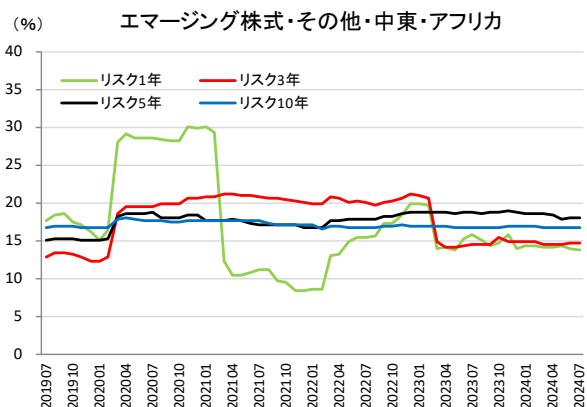
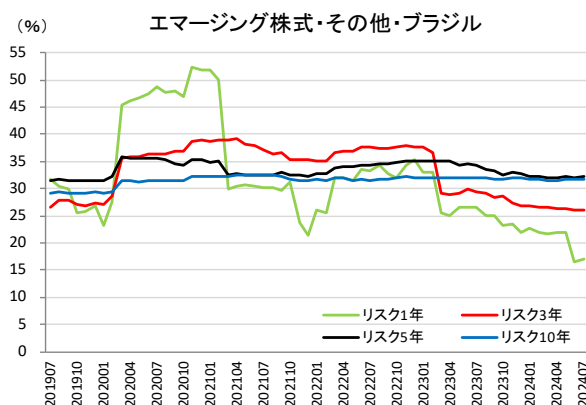
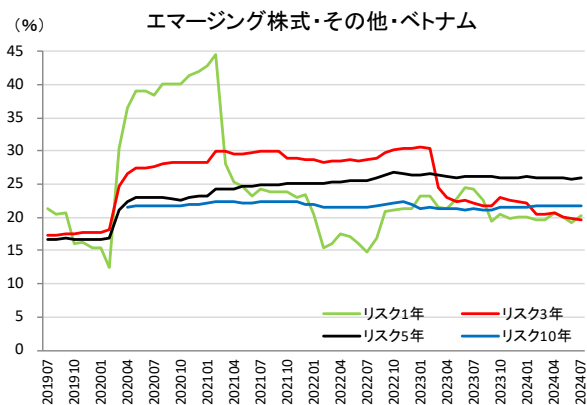
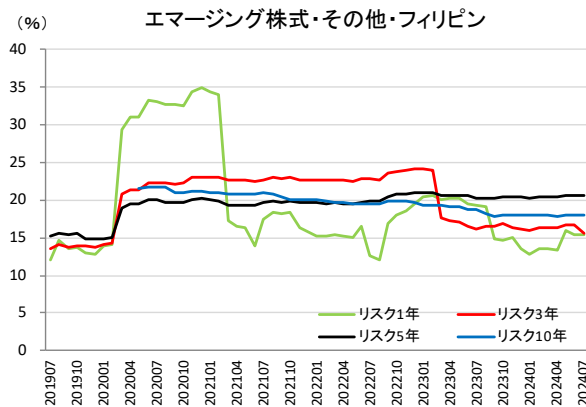
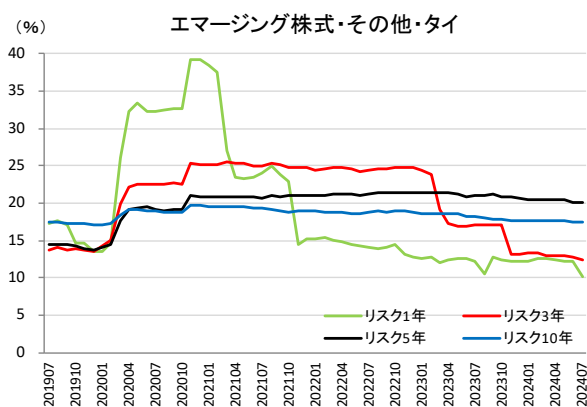


<2> リスク・サマリー

(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]

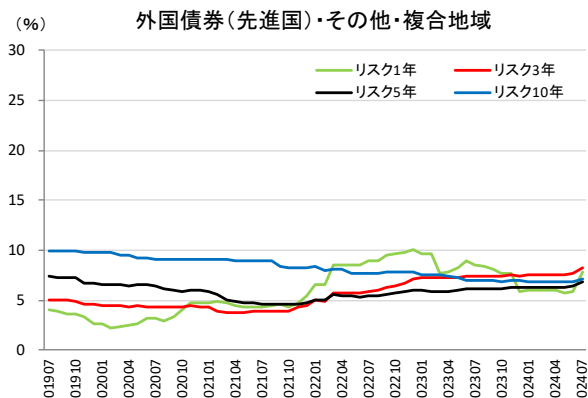
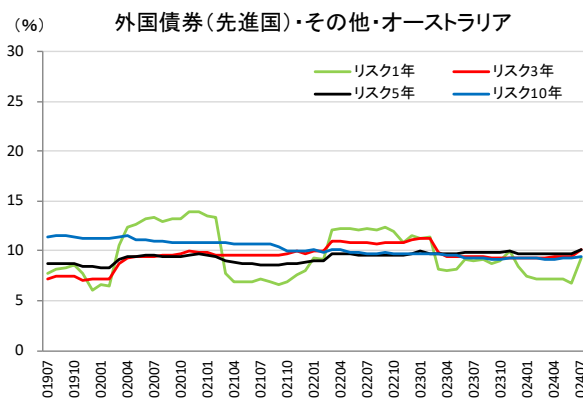
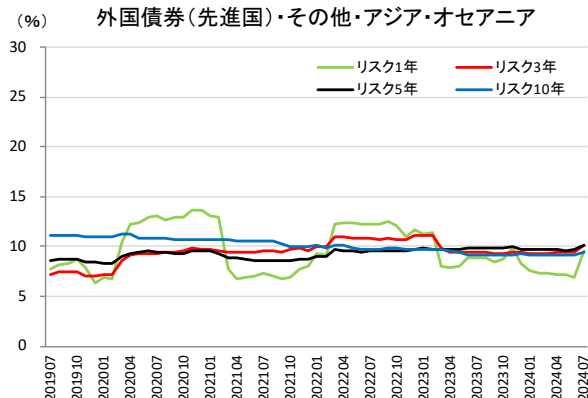
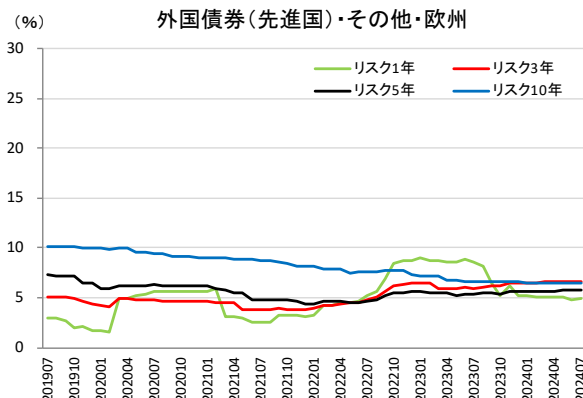
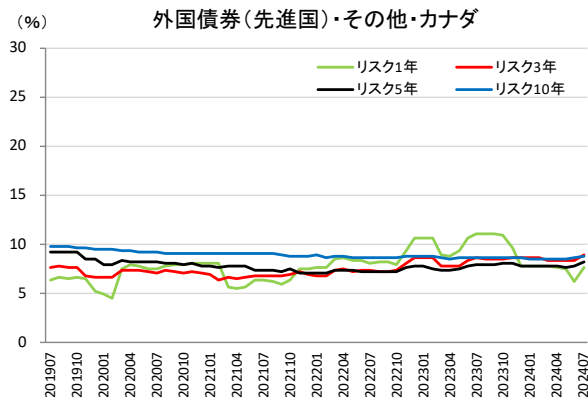
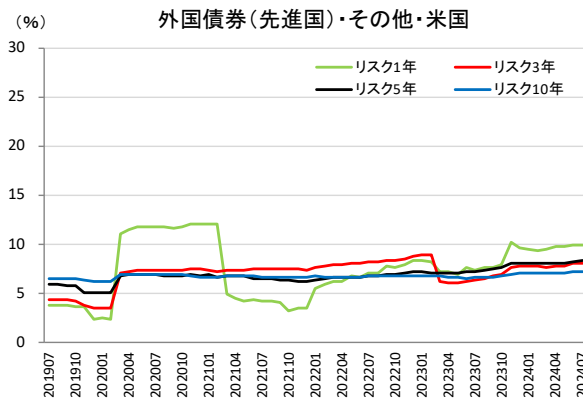
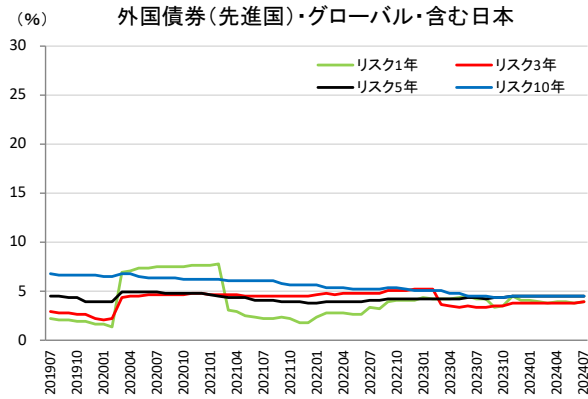
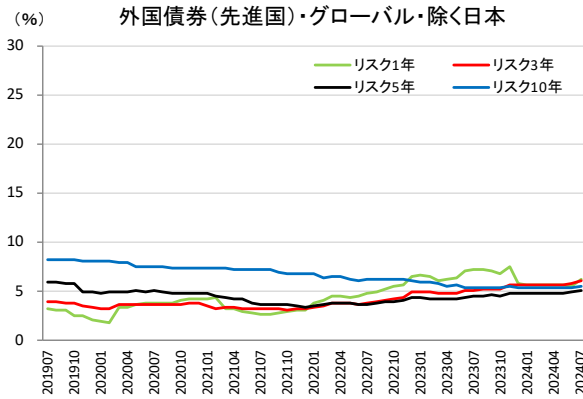


<2> リスク・サマリー

(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)]

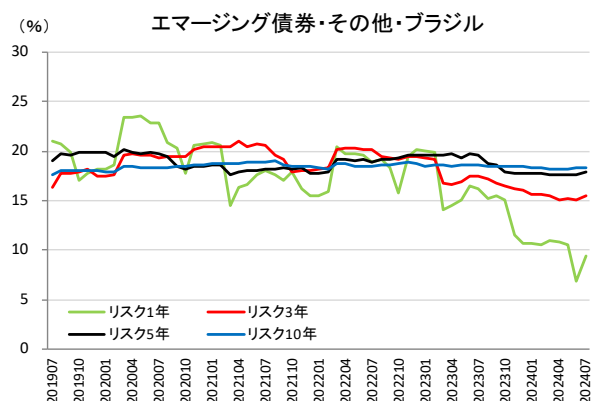
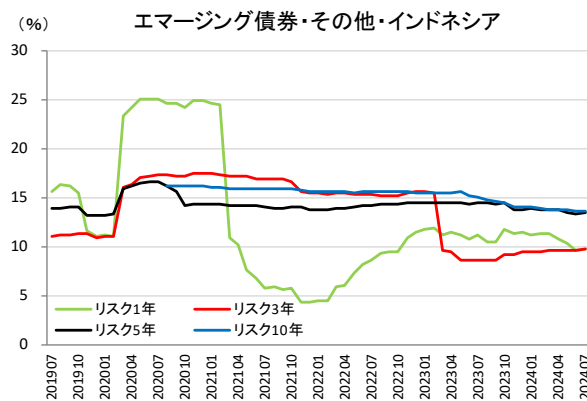
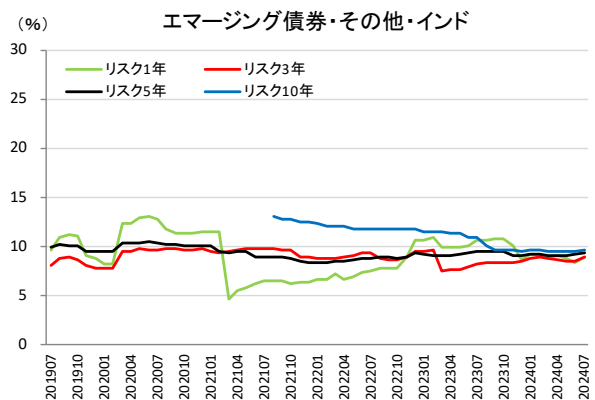
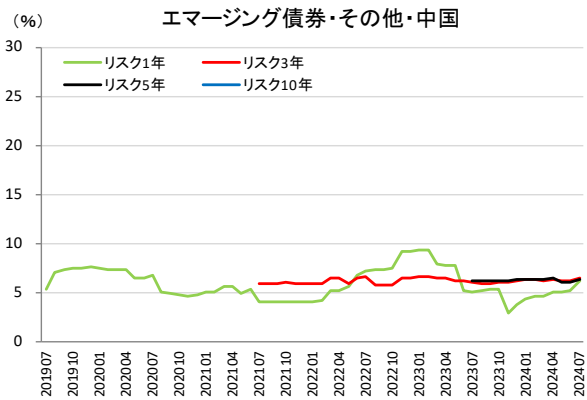
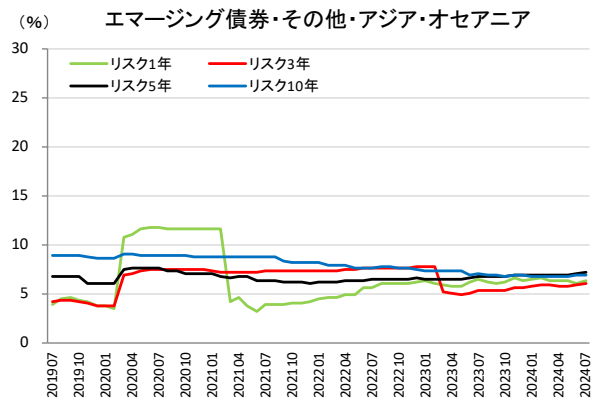
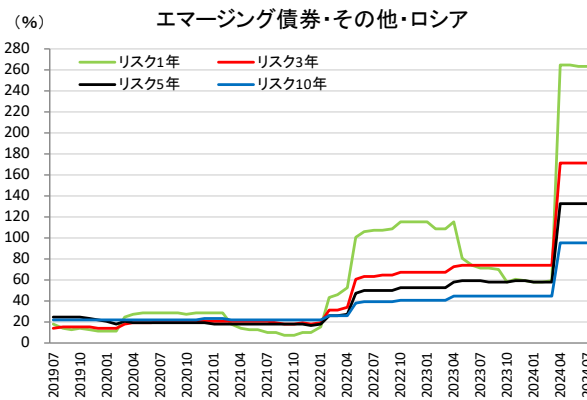
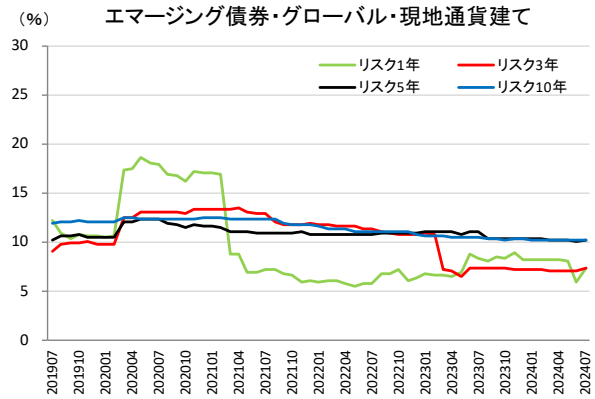
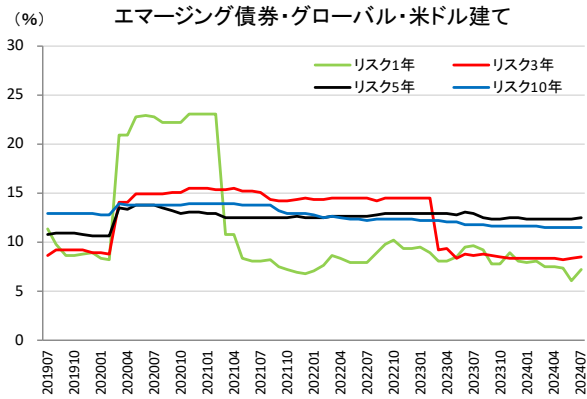


<2> リスク・サマリー

(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]

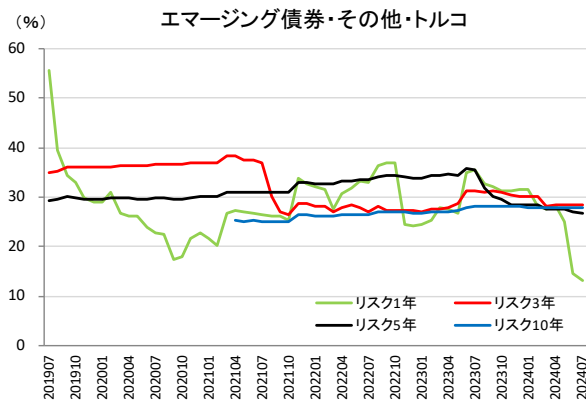
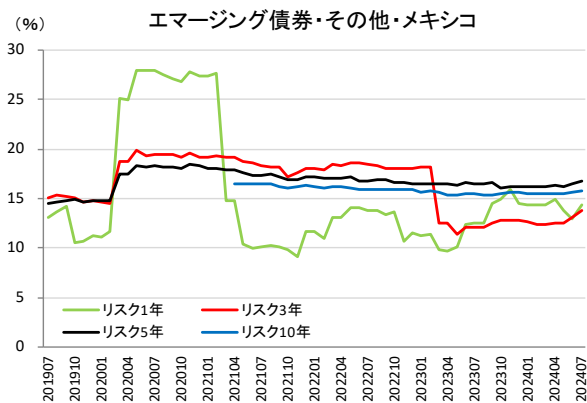


<2> リスク・サマリー

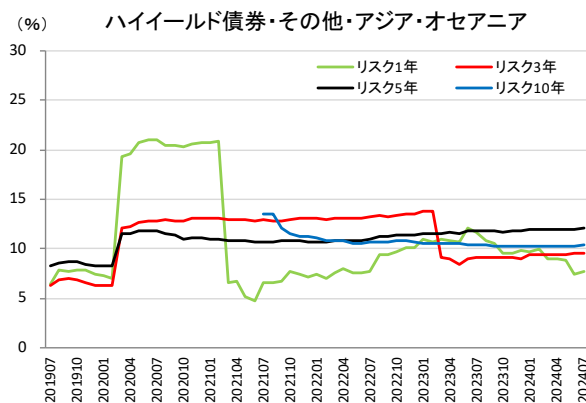
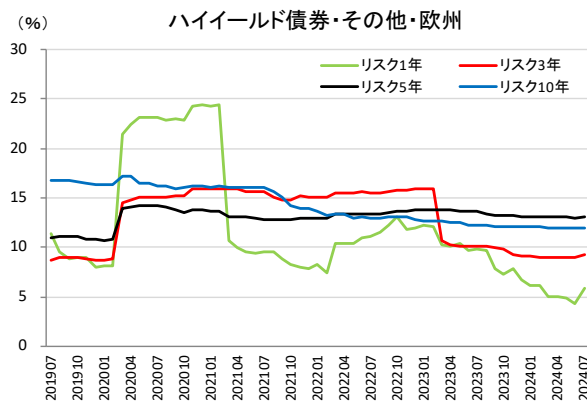
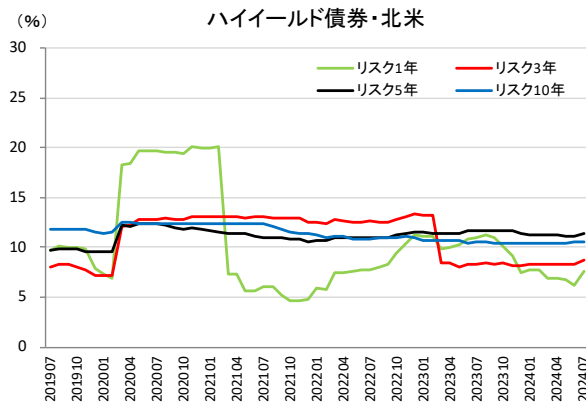
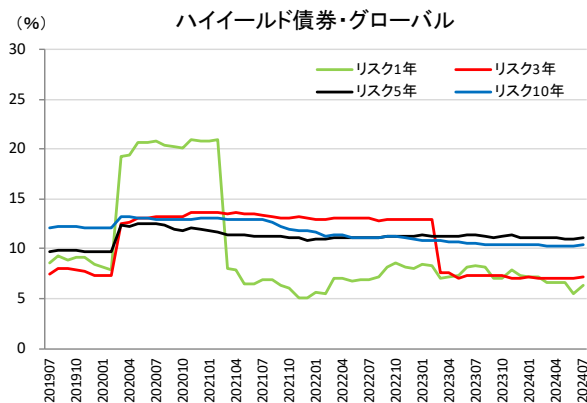
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

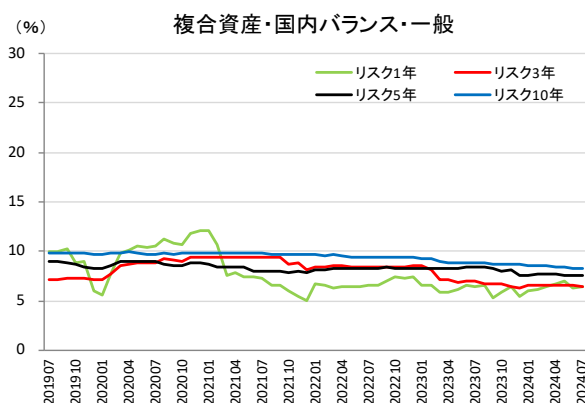
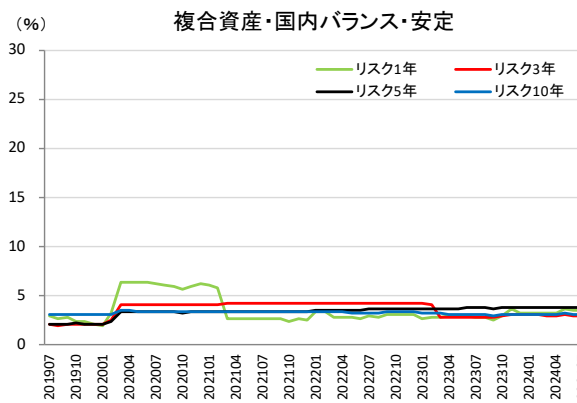
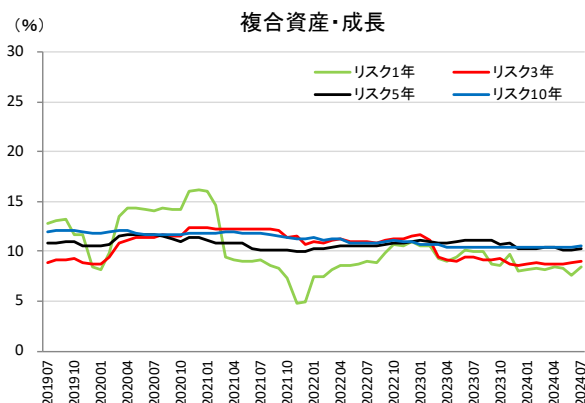
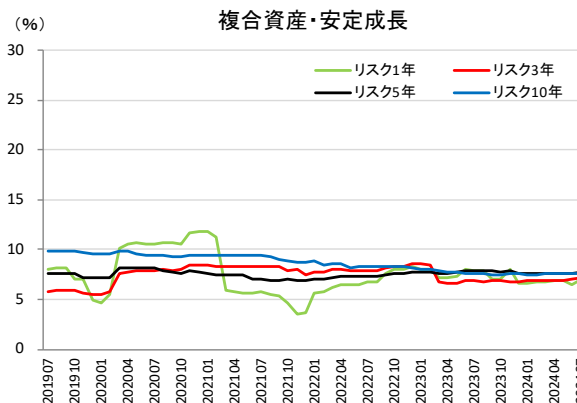
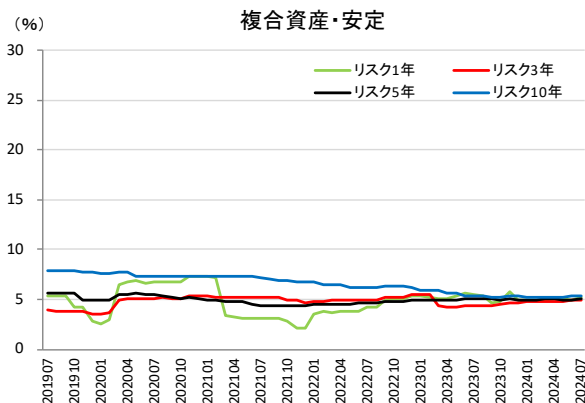


<2>リスク・サマリー

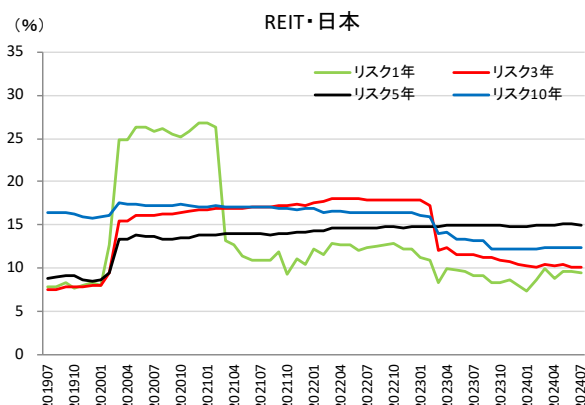
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

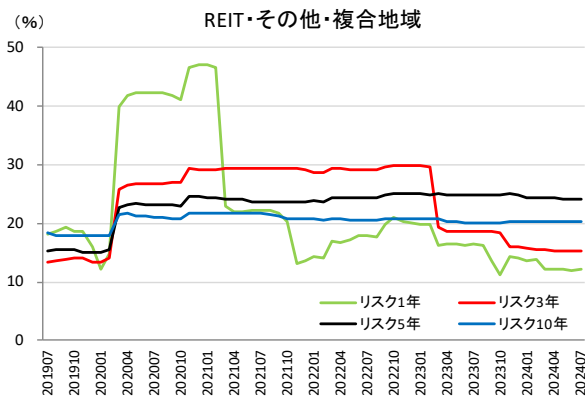
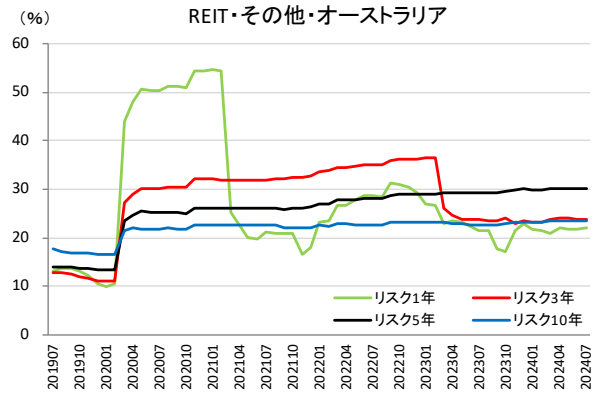
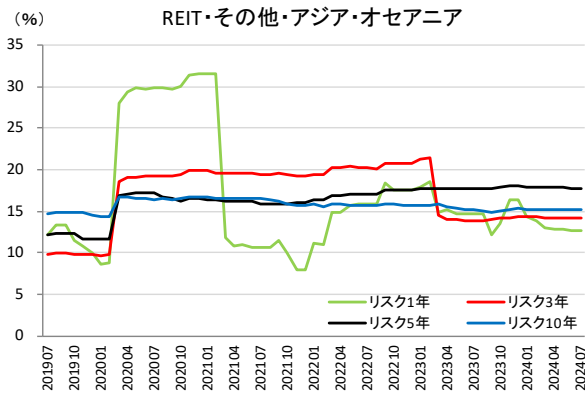
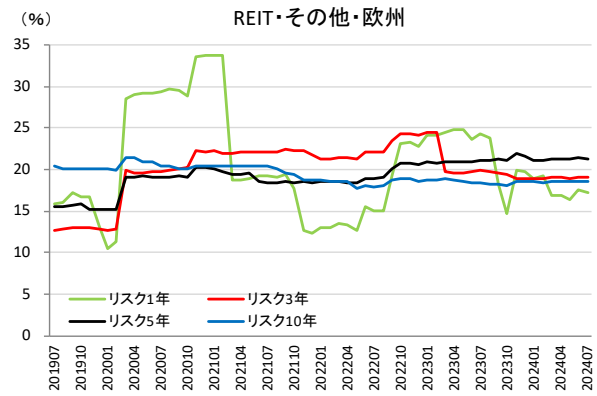
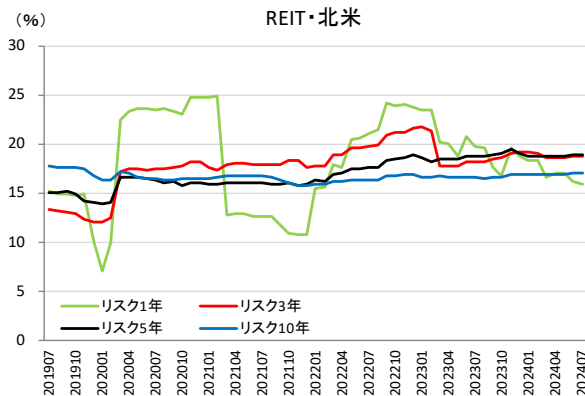
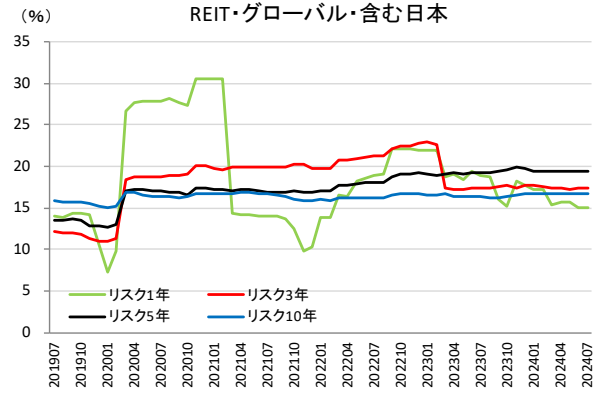
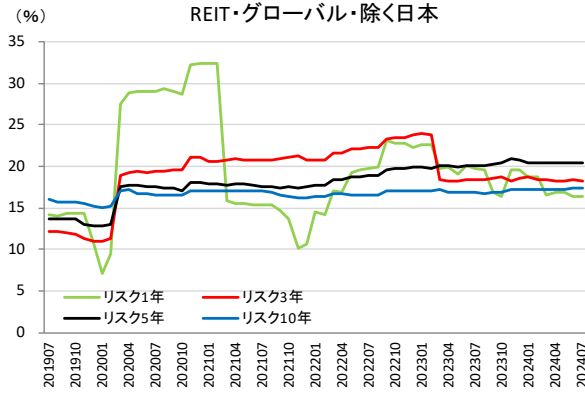


<2> リスク・サマリー

(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]

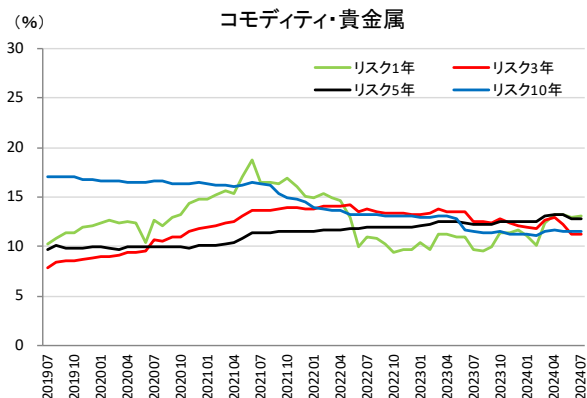
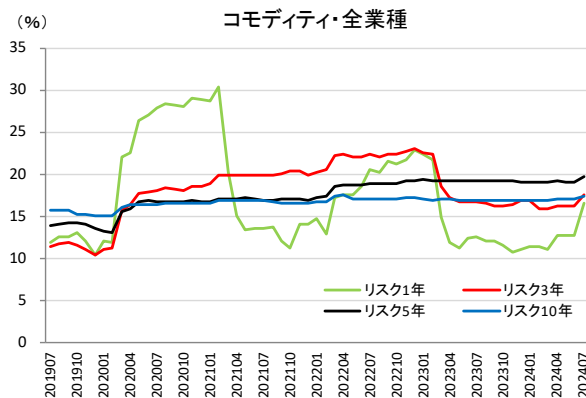
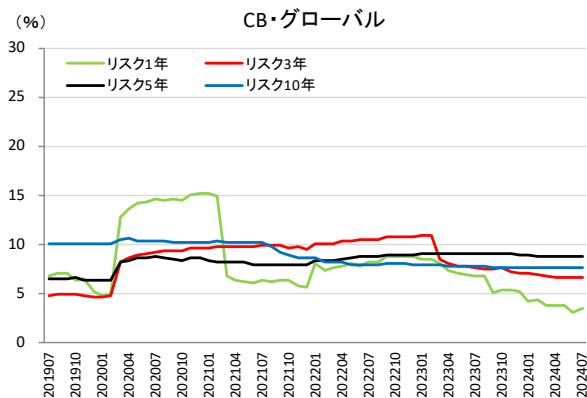
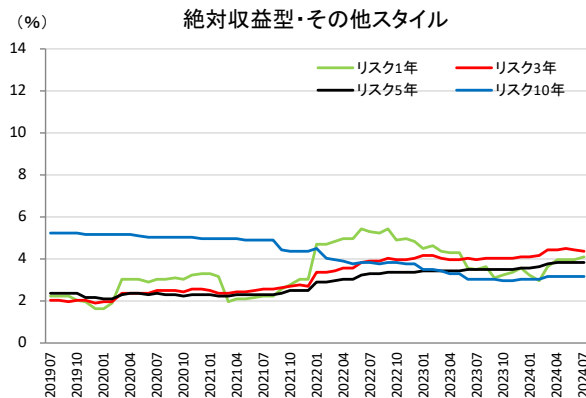
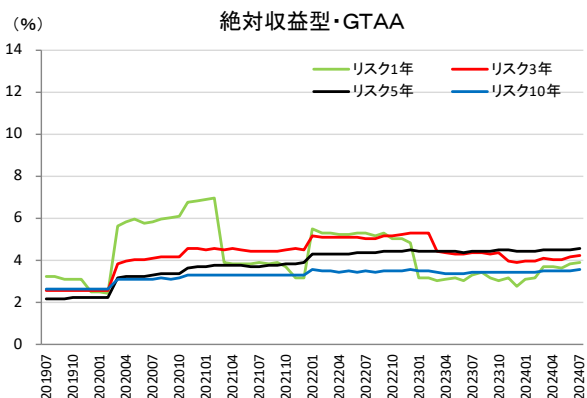
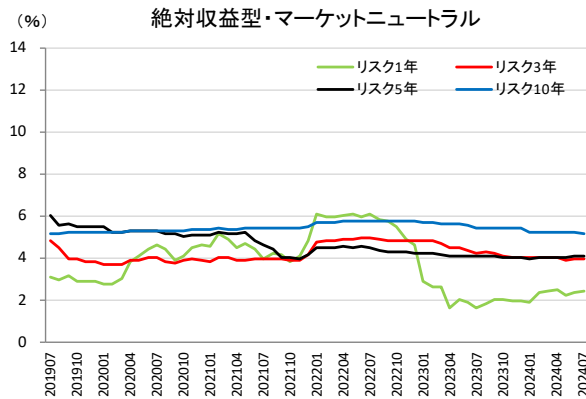
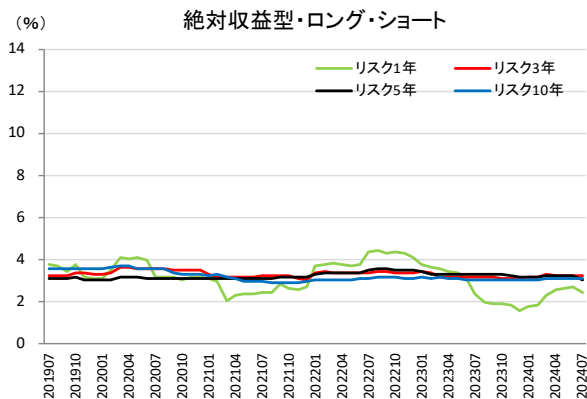


<2> リスク・サマリー

(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	19,227	49,159	91,845	141,360
国内株式	1,912	3,446	9,268	17,220
一般	521	1,582	2,915	8,200
フリー	70	323	-118	1,065
バリュー	451	1,259	3,031	7,128
小型	-64	-139	-114	-163
その他	1,415	1,856	6,120	8,643
日経225	633	223	2,858	3,238
TOPIX	491	878	1,800	3,261
JPX日経400	27	26	68	75
国内債券	234	404	1,348	3,093
一般	234	404	1,348	3,093
外国株式(先進国)	13,237	33,757	60,136	88,148
グローバル	5,411	14,137	25,232	38,452
除く日本	1,544	4,239	6,726	11,002
含む日本	3,867	9,898	18,507	27,450
その他	7,826	19,620	34,904	49,696
北米	361	951	1,899	2,813
米国	7,435	18,581	32,916	47,031
カナダ	-1	-3	-8	-21
欧州	48	131	217	178
ドイツ	0	1	1	0
イギリス	0	0	-1	-2
アジア・オセアニア	0	1	0	-2
オーストラリア	-16	-38	-116	-282
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	-1	-3	-4	-18
エマージング株式	2,051	6,791	11,561	18,204
グローバル	163	722	1,591	1,931
BRICS	-3	-11	-28	-53
その他	1,891	6,079	9,998	16,326
欧州	0	2	2	2
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	123	-25	-311	-583
中国	-33	-72	-161	-497
インド	1,799	6,190	10,579	17,529
インドネシア	7	27	25	39
タイ	0	0	-1	-5
フィリピン	0	-1	-2	-5
ベトナム	-2	-20	-76	-79
韓国	0	0	0	0
香港	-1	-3	-5	0
中南米	-1	-4	-6	-11
ブラジル	-4	-14	-38	-73
メキシコ	0	0	1	1
中東・アフリカ	-1	-5	-11	-25
トルコ	2	0	-5	-9
複合地域	4	4	7	43

<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	19,227	49,159	91,845	141,360
外国債券(先進国)	593	1,802	3,425	7,458
グローバル	597	1,833	3,009	6,931
除く日本	519	1,088	1,903	3,407
含む日本	78	744	1,106	3,524
その他	-4	-30	416	527
北米	7	14	48	105
米国	92	269	958	1,653
カナダ	-10	-29	-59	-138
欧州	8	10	32	15
イギリス	0	-2	-2	-2
アジア・オセアニア	-17	-60	-110	-199
オーストラリア	-72	-203	-389	-806
ニュージーランド	-4	-5	-12	-12
複合地域	-9	-24	-51	-90
エマージング債券	-243	-159	-135	-204
グローバル	-258	-175	-122	-252
米ドル建て	-192	-164	-213	-356
現地通貨建て	-66	-11	90	104
その他	15	15	-13	48
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-1	-5	-11	-23
中国	-2	-7	-14	-33
インド	20	71	115	346
インドネシア	15	12	10	22
ブラジル	-16	-48	-96	-220
メキシコ	-1	-6	-13	-36
トルコ	0	-1	-3	-3
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイイールド債券	136	323	432	1,056
グローバル	80	95	98	8
北米	88	307	459	1,301
その他	-32	-79	-126	-253
欧州	-21	-53	-97	-197
アジア・オセアニア	-10	-24	-27	-52
複合地域	-1	-2	-2	-4
複合資産	1,646	3,807	5,713	8,224
安定	-16	-87	-576	-1,531
安定成長	1,018	2,853	4,347	5,949
成長	814	1,503	2,799	5,440
国内バランス	-119	-281	-546	-1,135
安定	-144	-369	-712	-1,458
一般	-1	-6	-14	-33
その他	-51	-182	-311	-498

< 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	19,227	49,159	91,845	141,360
国内REIT	-190	-326	-217	-1,312
日本	-190	-326	-217	-1,312
外国REIT	-456	-801	-964	-1,665
グローバル	-184	-224	-223	-591
除く日本	-121	-24	160	329
含む日本	-63	-200	-394	-933
北米	-225	-461	-503	-591
その他	-47	-115	-237	-482
欧州	0	-1	-5	-9
アジア・オセアニア	-39	-95	-187	-377
オーストラリア	-5	-13	-35	-74
複合地域	0	0	-1	-3
複数国	-2	-5	-9	-19
その他	307	115	1,278	1,138
絶対収益型	77	105	479	369
ロング・ショート	1	16	24	73
マーケットニュートラル	-6	-20	-52	-123
GTAA	-3	-11	-28	-62
その他スタイル	84	112	521	461
CB	-65	-196	-246	-134
アジア・オセアニア	0	-1	-2	-3
日本	0	-1	-1	2
グローバル	-64	-195	-243	-133
コモディティ	248	729	1,241	1,586
全業種	9	103	178	218
貴金属	240	632	1,075	1,386
エネルギー	-1	-7	-16	-24
その他コモディティ	0	1	3	6

< 4 > 純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別①

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	1,275,768	100.00	5,317	100.00
国内株式	169,650	13.30	758	14.26
一般	93,213	7.31	459	8.63
フリー	63,975	5.01	358	6.73
バリュー	29,238	2.29	101	1.90
小型	7,650	0.60	86	1.62
その他	67,280	5.27	207	3.89
日経225	31,501	2.47	72	1.35
TOPIX	28,736	2.25	83	1.56
JPX日経400	1,046	0.08	12	0.23
国内債券	43,301	3.39	151	2.84
一般	43,301	3.39	151	2.84
外国株式(先進国)	604,041	47.35	1,210	22.76
グローバル	382,897	30.01	835	15.70
除く日本	117,864	9.24	190	3.57
含む日本	265,033	20.77	645	12.13
その他	221,145	17.33	375	7.05
北米	4,657	0.37	13	0.24
米国	211,632	16.59	296	5.57
カナダ	122	0.01	2	0.04
欧州	1,982	0.16	36	0.68
ドイツ	20	0.00	1	0.02
イギリス	1	0.00	1	0.02
アジア・オセアニア	37	0.00	1	0.02
オーストラリア	2,658	0.21	23	0.43
ニュージーランド	12	0.00	1	0.02
複合地域	24	0.00	1	0.02
エマージング株式	61,532	4.82	315	5.92
グローバル	14,216	1.11	95	1.79
BRICS	452	0.04	7	0.13
その他	46,864	3.67	213	4.01
欧州	106	0.01	6	0.11
ロシア	8	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	4,261	0.33	81	1.52
中国	1,021	0.08	32	0.60
インド	38,964	3.05	41	0.77
インドネシア	209	0.02	6	0.11
タイ	3	0.00	1	0.02
フィリピン	27	0.00	4	0.08
ベトナム	1,612	0.13	14	0.26
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	16	0.00	1	0.02
中南米	51	0.00	2	0.04
ブラジル	399	0.03	11	0.21
メキシコ	9	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	50	0.00	2	0.04
トルコ	63	0.00	2	0.04
複合地域	66	0.01	4	0.08

＜4＞純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別②

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	1,275,768	100.00	5,317	100.00
外国債券(先進国)	100,276	7.86	741	13.94
グローバル	82,229	6.45	529	9.95
除く日本	38,057	2.98	222	4.18
含む日本	44,172	3.46	307	5.77
その他	18,047	1.41	212	3.99
北米	204	0.02	8	0.15
米国	9,001	0.71	116	2.18
カナダ	596	0.05	3	0.06
欧州	1,085	0.09	23	0.43
イギリス	8	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	1,434	0.11	9	0.17
オーストラリア	4,618	0.36	32	0.60
ニュージーランド	73	0.01	9	0.17
複合地域	1,029	0.08	8	0.15
エマージング債券	11,810	0.93	218	4.10
グローバル	6,676	0.52	151	2.84
米ドル建て	4,686	0.37	115	2.16
現地通貨建て	1,990	0.16	36	0.68
その他	5,134	0.40	67	1.26
ロシア	13	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	224	0.02	6	0.11
中国	131	0.01	8	0.15
インド	2,897	0.23	16	0.30
インドネシア	334	0.03	7	0.13
ブラジル	1,248	0.10	20	0.38
メキシコ	227	0.02	3	0.06
トルコ	28	0.00	2	0.04
複合地域	32	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	21,738	1.70	224	4.21
グローバル	2,927	0.23	40	0.75
北米	17,080	1.34	122	2.29
その他	1,731	0.14	62	1.17
欧州	1,335	0.10	40	0.75
アジア・オセアニア	359	0.03	21	0.39
複合地域	37	0.00	1	0.02
複合資産	162,754	12.76	1,067	20.07
安定	38,690	3.03	283	5.32
安定成長	75,383	5.91	444	8.35
成長	40,073	3.14	300	5.64
国内バランス	5,562	0.44	26	0.49
安定	4,358	0.34	8	0.15
一般	271	0.02	14	0.26
その他	3,046	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	1,275,768	100.00	5,317	100.00
国内REIT	23,236	1.82	142	2.67
日本	23,236	1.82	142	2.67
外国REIT	47,027	3.69	268	5.04
グローバル	19,575	1.53	156	2.93
除く日本	8,760	0.69	66	1.24
含む日本	10,815	0.85	90	1.69
北米	24,979	1.96	66	1.24
その他	2,473	0.19	46	0.87
欧州	78	0.01	4	0.08
アジア・オセアニア	1,608	0.13	26	0.49
オーストラリア	479	0.04	12	0.23
複合地域	61	0.00	3	0.06
複数国	247	0.02	1	0.02
その他	30,403	2.38	223	4.19
絶対収益型	12,463	0.98	84	1.58
ロング・ショート	855	0.07	25	0.47
マーケットニュートラル	304	0.02	13	0.24
GTAA	305	0.02	9	0.17
その他スタイル	10,911	0.86	36	0.68
CB	2,755	0.22	43	0.81
アジア・オセアニア	33	0.00	1	0.02
日本	28	0.00	1	0.02
グローバル	2,693	0.21	41	0.77
コモディティ	8,506	0.67	38	0.71
全業種	2,063	0.16	12	0.23
貴金属	6,357	0.50	24	0.45
エネルギー	54	0.00	1	0.02
その他コモディティ	32	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	16,006	10.6	2.94	2.85	1.055
国内株式	23,693	14.8	1.68	1.55	0.982
一般	22,395	14.6	2.40	2.25	1.351
フリー	21,662	14.1	1.88	1.76	1.408
バリュー	24,992	16.2	3.63	3.35	1.226
小型	25,958	15.3	1.50	1.43	1.678
その他	25,756	14.7	0.49	0.41	0.377
日経225	27,264	16.3	0.43	0.37	0.429
TOPIX	27,465	15.6	0.11	0.09	0.227
JPX日経400	25,300	9.8	0.49	0.41	0.463
国内債券	10,109	12.5	0.11	0.11	0.475
一般	10,109	12.5	0.11	0.11	0.475
外国株式(先進国)	19,906	8.0	3.66	3.58	1.045
グローバル	20,470	8.2	2.90	2.82	1.143
除く日本	31,271	11.1	0.57	0.56	0.499
含む日本	17,288	7.3	3.94	3.82	1.429
その他	18,649	7.7	5.01	4.92	0.876
北米	18,740	6.1	0.50	0.49	0.771
米国	19,554	6.9	5.08	4.99	0.862
カナダ	6,002	13.3	8.94	8.93	1.988
欧州	17,105	12.9	3.20	3.02	1.291
ドイツ	19,333	10.3	0.00	0.00	0.770
イギリス	12,250	3.6	0.00	0.00	1.137
アジア・オセアニア	11,597	18.1	7.15	6.90	1.639
オーストラリア	11,325	9.5	8.36	8.31	1.823
ニュージーランド	18,305	12.0	2.78	2.73	1.672
複合地域	12,054	11.3	14.22	14.10	1.705
エマージング株式	15,436	11.1	4.19	3.48	1.671
グローバル	15,660	8.8	0.79	0.80	1.002
BRICS	16,686	18.2	0.82	0.80	2.052
その他	15,295	11.8	5.22	4.28	1.870
欧州	9,621	18.1	0.80	0.68	1.944
ロシア	980	15.2	0.00	0.00	1.186
アジア・オセアニア	15,968	13.4	2.63	2.59	1.718
中国	12,287	9.9	0.68	0.78	1.912
インド	20,873	10.2	5.82	4.69	1.887
インドネシア	11,758	9.7	1.16	1.30	1.779
タイ	15,798	13.6	2.29	2.53	1.815
フィリピン	11,966	12.0	0.51	0.49	1.704
ベトナム	18,048	6.5	2.38	2.44	1.863
韓国	13,728	5.6	0.00	0.00	1.804
香港	13,544	14.9	2.45	2.66	0.858
中南米	10,761	17.5	1.38	1.50	2.037
ブラジル	5,924	13.1	3.31	4.18	1.965
メキシコ	13,472	11.3	2.78	2.97	1.667
中東・アフリカ	15,204	16.4	0.40	0.38	2.228
トルコ	18,871	23.0	3.84	2.69	2.024
複合地域	17,837	8.3	1.68	1.49	0.955

(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	16,006	10.6	2.94	2.85	1.055
外国債券(先進国)	10,763	11.0	1.25	1.19	0.952
グローバル	11,237	11.0	1.09	1.03	0.902
除く日本	12,595	13.6	0.76	0.71	0.685
含む日本	10,256	9.2	1.40	1.34	1.090
その他	9,579	10.9	2.00	1.88	1.178
北米	10,736	8.0	1.75	1.65	1.129
米国	10,350	8.4	1.93	1.81	1.110
カナダ	8,646	14.7	1.55	1.43	1.378
欧州	7,833	16.6	1.35	1.30	1.004
イギリス	7,424	9.1	3.93	3.48	1.393
アジア・オセアニア	9,748	14.3	2.47	2.32	1.435
オーストラリア	8,872	15.0	2.19	2.05	1.242
ニュージーランド	10,117	10.1	1.60	1.47	1.368
複合地域	5,709	14.3	2.07	1.98	1.194
エマージング債券	10,530	12.5	3.48	3.36	1.371
グローバル	10,860	13.0	2.11	1.98	1.165
米ドル建て	10,690	13.5	2.42	2.22	1.325
現地通貨建て	11,401	11.2	1.39	1.40	0.789
その他	9,786	11.4	5.25	5.16	1.639
ロシア	2,219	11.5	0.00	0.00	1.599
アジア・オセアニア	10,136	13.6	6.78	6.45	1.627
中国	12,411	4.8	1.36	1.24	1.237
インド	10,798	9.9	6.07	5.73	1.707
インドネシア	9,766	11.7	4.96	5.15	1.667
ブラジル	10,558	14.1	3.89	4.28	1.581
メキシコ	9,043	11.8	4.29	4.53	1.368
トルコ	1,388	11.8	5.18	5.94	1.474
複合地域	4,464	17.9	1.44	1.34	1.210
ハイイールド債券	10,216	12.9	4.92	4.50	1.651
グローバル	8,774	11.3	2.89	2.59	1.421
北米	11,711	14.1	5.12	4.67	1.679
その他	8,203	11.8	6.38	6.05	1.767
欧州	8,612	11.3	5.72	5.36	1.739
アジア・オセアニア	7,573	12.3	8.93	8.75	1.868
複合地域	5,063	20.3	5.27	4.74	1.800
複合資産	14,624	9.9	1.19	1.17	0.911
安定	11,883	10.0	1.60	1.55	1.047
安定成長	14,142	10.3	1.31	1.28	0.920
成長	18,223	9.3	0.41	0.39	0.771
国内バランス	13,128	11.8	2.17	2.22	0.962
安定	10,687	12.7	1.70	1.78	0.914
一般	14,677	12.4	1.14	1.05	1.218
その他	10,985	4.3	1.48	1.38	0.682

(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	16,006	10.6	2.94	2.85	1.055
国内REIT	13,354	10.5	6.66	8.00	0.882
日本	13,354	10.5	6.66	8.00	0.882
外国REIT	13,865	10.0	7.64	7.29	1.430
グローバル	15,224	9.5	3.07	2.82	1.166
除く日本	17,155	8.1	1.92	1.82	0.933
含む日本	13,808	10.4	4.01	3.65	1.355
北米	13,060	11.0	11.32	10.83	1.605
その他	10,410	10.2	6.58	6.84	1.739
欧州	5,215	11.3	5.11	4.51	1.921
アジア・オセアニア	11,018	9.5	8.26	8.85	1.796
オーストラリア	11,169	9.8	4.23	3.78	1.688
複合地域	8,362	12.5	0.86	0.71	0.774
複数国	12,403	20.3	2.11	1.94	1.650
その他					
絶対収益型	10,874	7.2	0.05	0.05	1.929
ロング・ショート	10,630	6.3	0.18	0.18	1.695
マーケットニュートラル	10,130	6.7	0.93	0.94	1.246
GTAA	11,870	11.2	0.42	0.42	1.569
その他スタイル	11,013	7.0	0.00	0.00	1.981
CB	12,318	7.6	0.33	0.32	1.185
アジア・オセアニア	11,156	14.1	2.30	2.15	1.823
日本	14,954	24.7	0.36	0.33	0.770
グローバル	12,282	7.0	0.30	0.29	1.182
コモディティ	14,324	7.5	0.07	0.08	0.881
全業種	11,248	11.8	0.31	0.32	1.246
貴金属	15,319	5.0	0.00	0.00	0.763
エネルギー	21,727	15.4	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	19,944	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