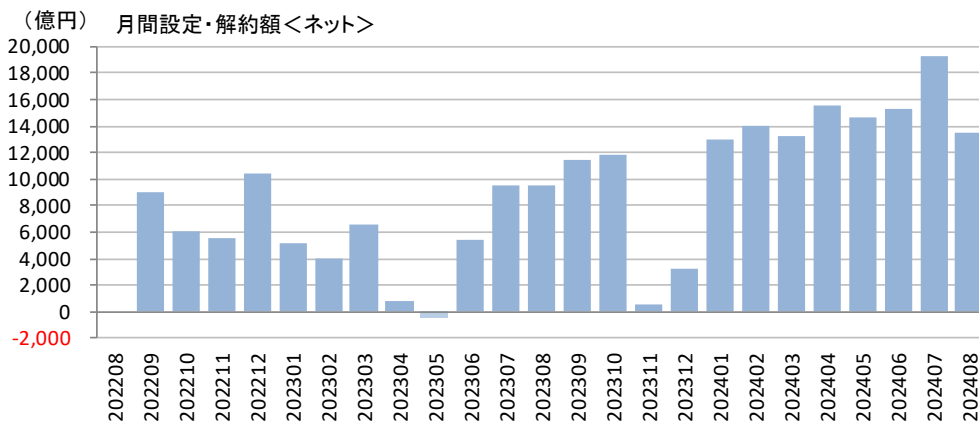
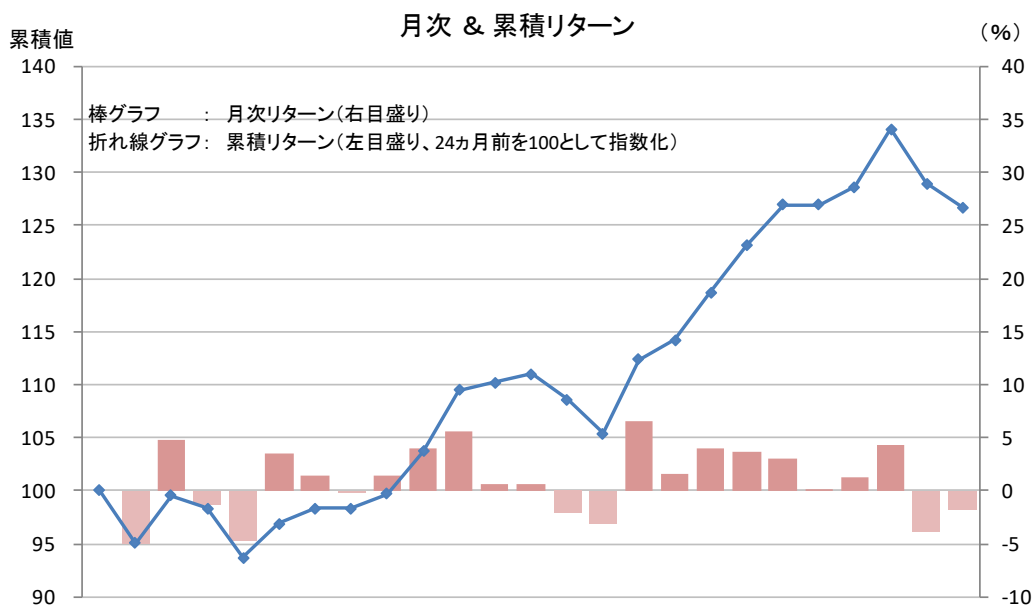


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2024年8月

「総合」 **-1.70%**
(前月 **-3.84%**)



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		20,039	20,384	-346	-1.70
国内株式		27,339	28,051	-711	-2.54
一般		26,432	27,192	-760	-2.80
フリー		24,486	25,093	-608	-2.42
バリュー		35,574	36,906	-1,331	-3.61
小型		45,086	45,729	-643	-1.41
その他		28,148	28,800	-652	-2.26
日経225		27,016	27,322	-306	-1.12
TOPIX		27,868	28,702	-834	-2.91
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	26,694	27,474	-781	-2.84
国内債券		12,278	12,171	107	0.88
一般		12,278	12,171	107	0.88
外国株式(先進国)		29,028	29,580	-553	-1.87
グローバル		30,804	31,341	-536	-1.71
除く日本		50,362	51,256	-894	-1.74
含む日本		26,598	27,058	-460	-1.70
その他		24,935	25,479	-544	-2.14
北米		31,802	32,472	-670	-2.06
米国		38,883	39,747	-864	-2.17
カナダ	10,000 (2009.02.27)	23,876	24,191	-316	-1.30
欧州		30,561	31,021	-460	-1.48
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	15,943	15,966	-22	-0.14
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	44,879	46,194	-1,314	-2.85
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	24,012	23,920	92	0.38
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	49,848	50,384	-537	-1.07
複合地域	10,000 (2013.04.30)	16,348	17,354	-1,006	-5.80
エマージング株式		24,996	26,036	-1,040	-3.99
グローバル		23,090	23,708	-618	-2.61
BRICS	10,000 (2005.09.30)	26,985	27,406	-421	-1.54
その他		26,917	28,167	-1,250	-4.44
欧州		19,231	20,026	-796	-3.97
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,080	1,091	-11	-1.03
アジア・オセアニア		21,248	21,717	-469	-2.16
中国		32,212	33,895	-1,683	-4.97
インド	10,000 (2004.09.30)	75,445	79,368	-3,922	-4.94
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	17,365	16,853	512	3.04
タイ		22,784	22,810	-26	-0.11
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	8,615	8,400	215	2.56
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	27,425	27,628	-203	-0.74
韓国	10,000 (1997.06.30)	29,803	30,519	-716	-2.35
香港		21,851	21,936	-85	-0.39
中南米	7,427 (2006.04.28)	11,715	11,810	-95	-0.80
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,890	9,701	189	1.95
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	15,585	17,066	-1,481	-8.68
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	15,208	15,368	-160	-1.04
トルコ		49,722	56,439	-6,716	-11.90
複合地域	10,000 (2005.08.31)	28,193	28,946	-753	-2.60

※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		20,039	20,384	-346	-1.70
外国債券(先進国)		19,720	19,987	-267	-1.34
グローバル		19,601	19,895	-294	-1.48
除く日本		21,905	22,352	-447	-2.00
含む日本		18,111	18,297	-187	-1.02
その他		20,499	20,641	-142	-0.69
北米	9,052 (2013.05.31)	11,293	11,428	-135	-1.18
米国		18,936	19,152	-216	-1.13
カナダ	10,000 (2003.05.30)	18,231	18,543	-312	-1.68
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,132	15,362	-230	-1.50
イギリス	10,069 (2014.07.31)	12,530	12,772	-242	-1.89
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	23,223	23,055	167	0.73
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	28,773	28,693	81	0.28
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	12,857	12,605	253	2.00
複合地域	10,000 (2001.11.30)	19,883	20,237	-354	-1.75
エマージング債券		21,450	22,127	-677	-3.06
グローバル		22,041	22,556	-515	-2.28
米ドル建て		22,600	23,179	-580	-2.50
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	15,661	15,942	-280	-1.76
その他	8,647 (2005.03.31)	16,716	17,427	-711	-4.08
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,718	1,912	-194	-10.13
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	17,288	17,614	-326	-1.85
中国	13,833 (2018.07.31)	19,555	19,976	-421	-2.11
インド	10,000 (2011.08.31)	22,378	23,443	-1,065	-4.54
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	20,292	20,027	265	1.32
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	15,282	15,935	-653	-4.10
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	18,355	20,153	-1,798	-8.92
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,345	2,496	-151	-6.05
複合地域	10,000 (2006.08.31)	12,807	13,197	-390	-2.96
ハイイールド債券		30,455	31,445	-991	-3.15
グローバル	10,000 (1997.06.30)	28,454	29,202	-748	-2.56
北米		30,885	31,956	-1,071	-3.35
その他	10,000 (2004.03.31)	27,133	27,733	-599	-2.16
欧州	10,000 (2006.04.28)	27,673	28,199	-525	-1.86
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	16,373	16,911	-537	-3.18
複合地域	10,000 (2004.03.31)	27,143	27,989	-846	-3.02
複合資産		21,687	21,906	-219	-1.00
安定	10,000 (1998.10.30)	17,087	17,238	-152	-0.88
安定成長		24,234	24,496	-262	-1.07
成長		31,853	32,285	-432	-1.34
国内バランス		12,539	12,504	35	0.28
安定		12,475	12,395	80	0.65
一般		18,668	19,023	-355	-1.86
その他	10,000 (2018.10.31)	14,178	13,987	191	1.37

※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		20,039	20,384	-346	-1.70
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	34,400	33,548	853	2.54
日本	10,000 (2003.10.31)	34,400	33,548	853	2.54
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	40,612	40,811	-199	-0.49
グローバル	10,000 (2004.01.30)	33,538	33,696	-158	-0.47
除く日本	10,000 (2004.04.30)	38,115	38,298	-183	-0.48
含む日本	10,000 (2004.01.30)	32,882	33,035	-152	-0.46
北米	10,000 (2003.09.30)	43,441	43,741	-301	-0.69
その他	10,000 (2004.04.30)	33,577	33,118	460	1.39
欧州	10,000 (2006.12.29)	6,021	6,172	-151	-2.45
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	24,019	23,586	433	1.83
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	20,638	20,336	301	1.48
複合地域	10,000 (2007.06.29)	8,777	8,893	-116	-1.31
複数国	10,000 (2004.04.30)	51,474	51,361	113	0.22
その他		7,514	7,624	-110	-1.44
絶対収益型		7,676	7,728	-52	-0.67
ロング・ショート		8,313	8,318	-5	-0.06
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,820	11,672	148	1.27
GTAA		11,708	11,805	-96	-0.82
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,211	7,266	-55	-0.76
CB		20,940	21,175	-235	-1.11
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	22,717	23,584	-867	-3.68
日本		21,548	22,002	-455	-2.07
グローバル		36,514	36,908	-394	-1.07
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	14,605	14,697	-92	-0.63
全業種	10,000 (2004.12.30)	11,837	12,301	-464	-3.77
貴金属	10,000 (2009.07.31)	25,636	25,529	108	0.42
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	10,828	11,252	-423	-3.76
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	17,546	18,055	-510	-2.82

※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	-1.45	2.93	14.21	11.00
国内株式	-1.68	0.84	16.25	14.16
一般	-2.00	1.62	15.69	14.07
フリー	-1.64	1.50	15.39	14.02
バリュー	-2.79	1.94	16.64	14.22
小型	0.37	-2.69	3.89	4.50
その他	-1.47	0.14	18.85	15.60
日経225	0.49	-0.69	20.13	16.26
TOPIX	-2.07	2.45	18.73	15.84
JPX日経400	-1.49	3.94	20.25	17.42
国内債券	1.22	-1.13	-1.23	-1.50
一般	1.22	-1.13	-1.23	-1.50
外国株式(先進国)	-2.43	3.67	20.00	15.04
グローバル	-2.51	3.37	18.63	13.70
除く日本	-1.83	5.80	21.06	17.32
含む日本	-2.80	2.33	17.59	12.17
その他	-2.27	4.25	22.76	17.71
北米	-3.35	4.52	22.82	19.04
米国	-2.27	4.24	23.05	17.94
カナダ	-2.82	2.18	8.09	6.86
欧州	-3.15	4.06	12.98	11.55
ドイツ	-3.64	4.37	17.25	13.91
アジア・オセアニア	-4.22	4.49	10.18	10.55
オーストラリア	0.90	5.27	14.14	8.85
ニュージーランド	-2.15	-0.22	6.88	0.95
複合地域	-9.05	2.08	2.54	10.88
エマージング株式	-0.75	7.10	19.17	16.03
グローバル	-4.13	4.11	12.70	11.73
BRICS	-3.44	2.77	6.44	7.21
その他	0.41	8.11	21.85	17.64
欧州	-7.55	2.67	22.96	13.08
ロシア	-0.58	-0.70	-0.23	0.41
アジア・オセアニア	-3.53	4.32	8.43	10.08
中国	-14.05	-7.76	-17.27	-6.98
インド	1.68	10.04	29.41	20.73
インドネシア	2.87	-6.83	-7.64	-1.64
タイ	0.58	-2.43	-11.18	-2.20
フィリピン	4.50	-2.42	9.73	7.45
ベトナム	-3.19	0.34	8.30	16.95
韓国	-12.01	-4.09	-10.61	-7.66
香港	-8.10	6.57	-1.60	9.13
中南米	-10.52	-11.95	-6.88	-12.01
ブラジル	-4.98	-11.82	-4.64	-11.81
メキシコ	-22.65	-18.92	-13.35	-15.08
中東・アフリカ	2.02	4.51	9.92	12.19
トルコ	-15.14	4.53	11.15	27.37
複合地域	-4.01	-1.62	8.79	3.21

※[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	-1.45	2.93	14.21	11.00
外国債券(先進国)	-1.11	1.08	4.79	2.54
グローバル	-1.22	0.73	4.26	2.33
除く日本	-1.96	0.92	5.23	2.97
含む日本	-0.57	0.60	3.50	1.82
その他	-0.62	2.66	7.22	3.51
北米	-0.14	1.56	5.48	2.90
米国	1.14	2.71	6.55	3.20
カナダ	-2.85	0.45	5.82	2.72
欧州	-1.22	1.23	5.70	2.34
イギリス	-1.36	2.98	12.29	5.90
アジア・オセアニア	-2.19	3.18	8.59	3.82
オーストラリア	-2.46	3.26	8.65	4.06
ニュージーランド	0.10	4.73	13.64	4.94
複合地域	-2.81	0.56	4.13	3.47
エマージング債券	-5.35	-1.93	4.46	2.97
グローバル	-3.60	0.64	7.96	4.88
米ドル建て	-3.34	1.32	9.70	5.77
現地通貨建て	-4.22	-1.00	3.69	2.69
その他	-7.63	-5.26	0.03	0.45
ロシア	-8.38	239.77	252.86	246.04
アジア・オセアニア	-1.50	1.68	8.07	6.60
中国	-2.85	0.12	5.13	5.04
インド	-5.63	-1.45	4.62	6.00
インドネシア	-0.25	-0.06	1.35	5.40
ブラジル	-12.94	-14.21	-9.10	-10.73
メキシコ	-19.01	-16.07	-11.25	-11.42
トルコ	-7.56	-2.84	-15.27	-4.73
複合地域	-6.37	-2.03	2.94	2.17
ハイイールド債券	-3.84	0.63	8.68	6.18
グローバル	-2.80	0.97	9.10	5.76
北米	-4.02	0.56	8.47	6.34
その他	-3.76	0.76	9.93	5.44
欧州	-3.75	0.72	9.49	4.51
アジア・オセアニア	-3.87	0.86	11.50	8.82
複合地域	-3.38	1.09	9.77	6.75
複合資産	-0.44	2.28	8.51	6.75
安定	-0.34	0.96	4.99	3.84
安定成長	-0.64	2.51	9.04	7.24
成長	-0.84	3.22	12.46	10.21
国内バランス	0.63	-0.11	0.10	0.42
安定	1.01	-0.47	-0.94	-0.57
一般	-1.19	0.84	7.11	6.55
その他	6.66	8.18	16.24	7.52

※[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	-1.45	2.93	14.21	11.00
国内REIT	2.15	5.08	-3.33	0.40
日本	2.15	5.08	-3.33	0.40
外国REIT	5.88	9.23	15.34	9.95
グローバル	4.98	9.21	15.08	9.36
除く日本	5.39	9.77	16.73	10.34
含む日本	4.66	8.77	13.82	8.61
北米	7.00	9.69	16.28	10.99
その他	2.09	5.24	8.74	4.73
欧州	-5.98	6.25	13.46	3.61
アジア・オセアニア	2.37	3.79	5.49	2.64
オーストラリア	1.30	9.28	19.96	11.14
複合地域	-1.99	1.79	12.64	6.31
複数国	5.82	8.35	9.59	7.87
その他	-1.76	3.09	11.39	8.07
絶対収益型	-1.42	0.83	3.23	2.11
ロング・ショート	-0.14	-0.03	1.95	1.72
マーケットニュートラル	1.75	2.76	3.60	4.29
GTAA	-1.03	0.58	3.31	3.15
その他スタイル	-1.61	0.86	3.36	2.05
CB	-1.71	0.11	2.40	2.01
アジア・オセアニア	-7.51	0.27	3.52	6.09
日本	-1.06	-1.88	6.23	3.87
グローバル	-1.64	0.13	2.35	1.95
コモディティ	-3.13	12.72	16.04	15.71
全業種	-13.45	-1.58	-2.61	3.65
貴金属	0.72	18.47	24.16	20.15
エネルギー	-8.66	-1.11	2.29	11.39
その他コモディティ	-8.98	4.62	4.65	9.85

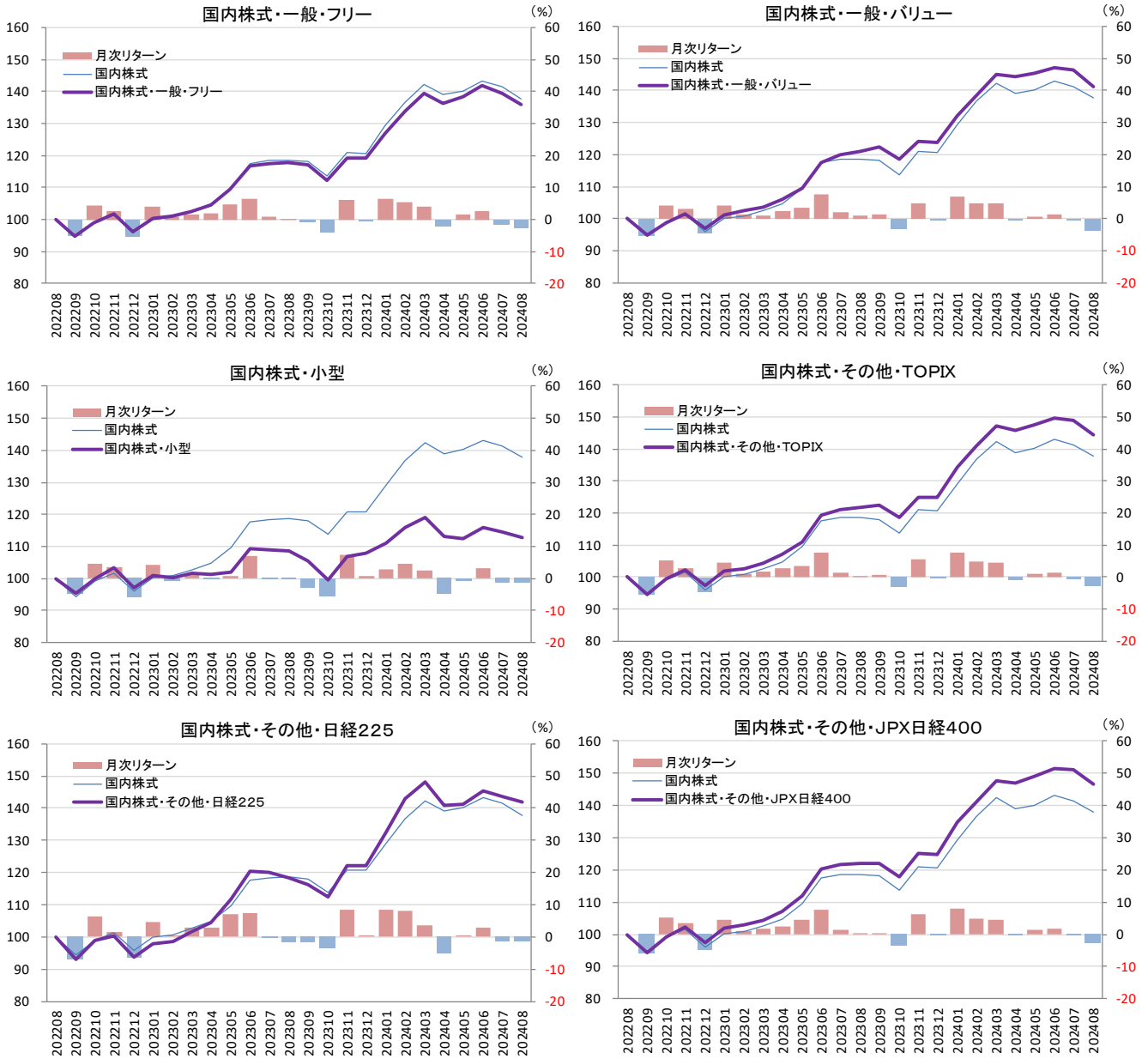
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

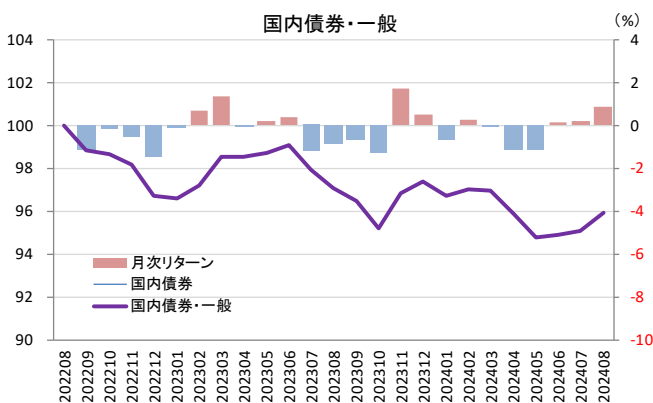
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

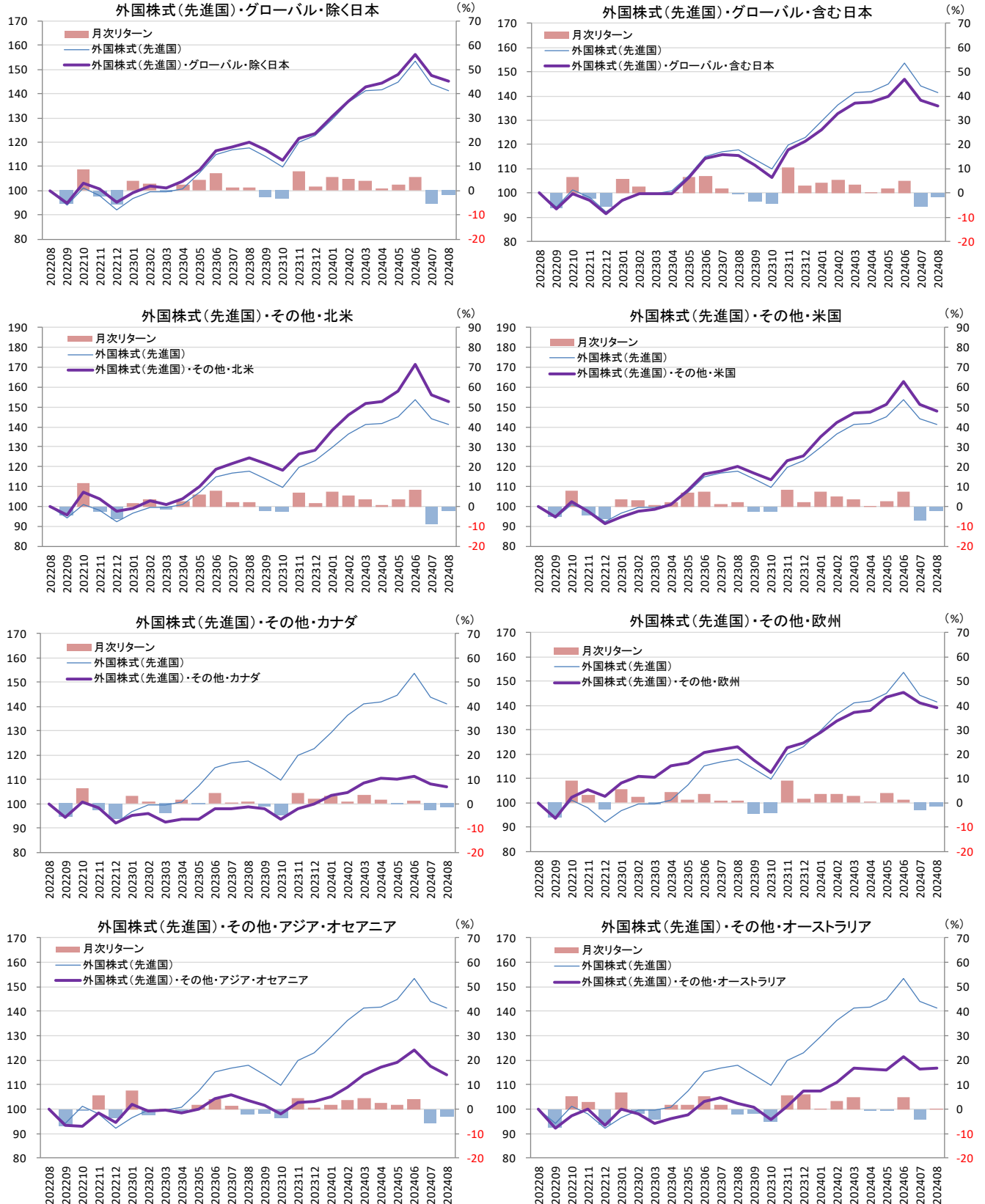


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

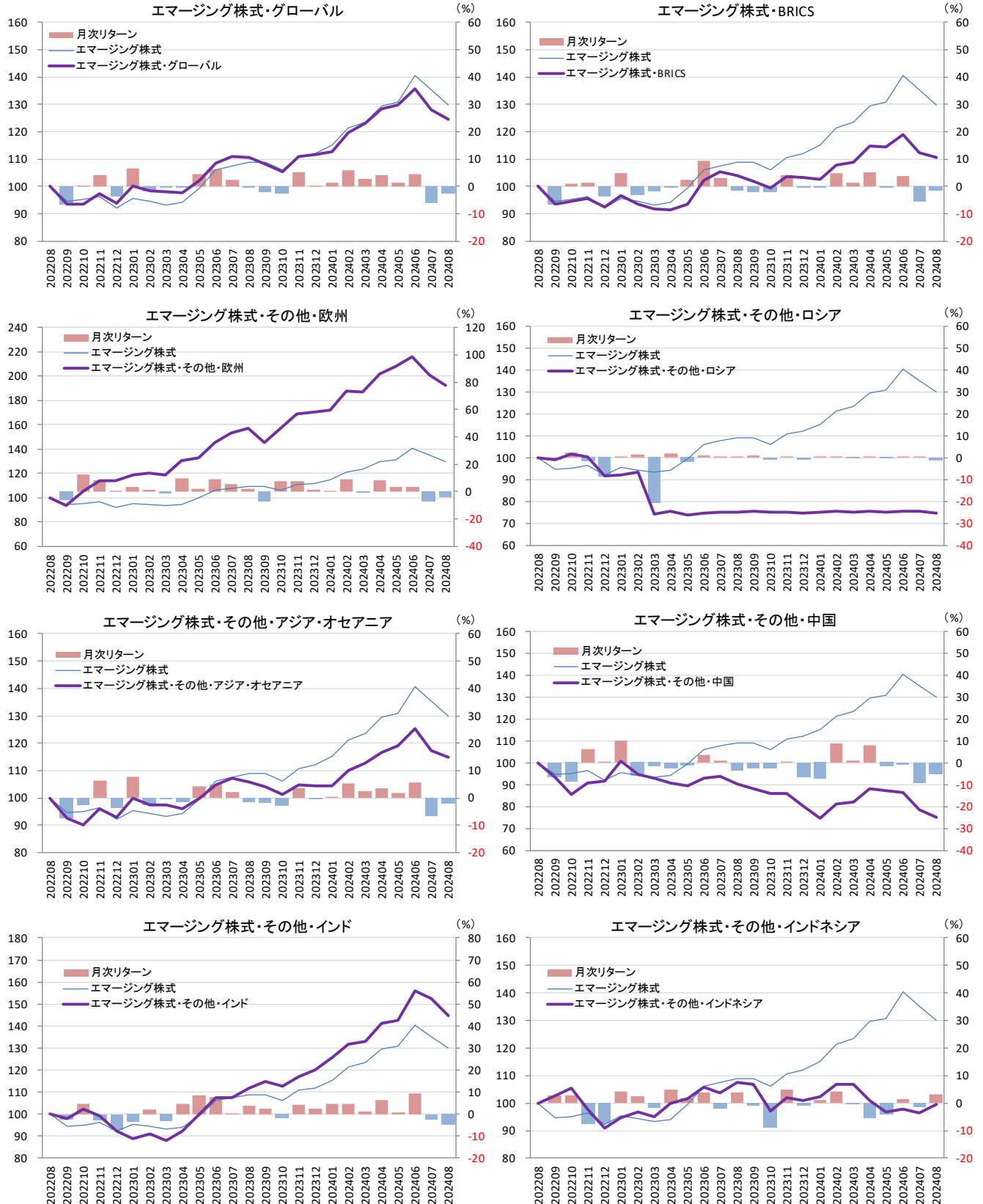


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

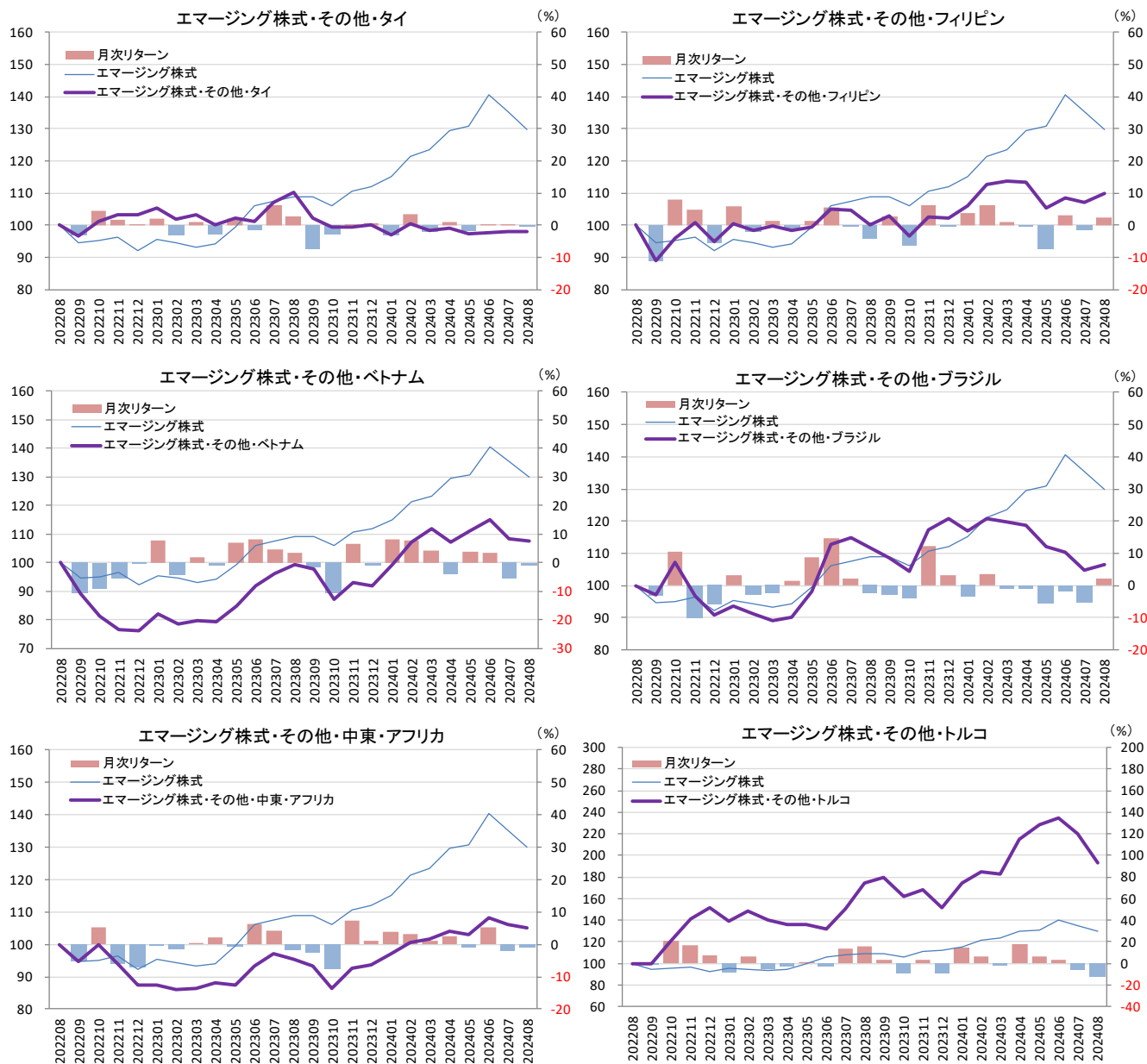


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

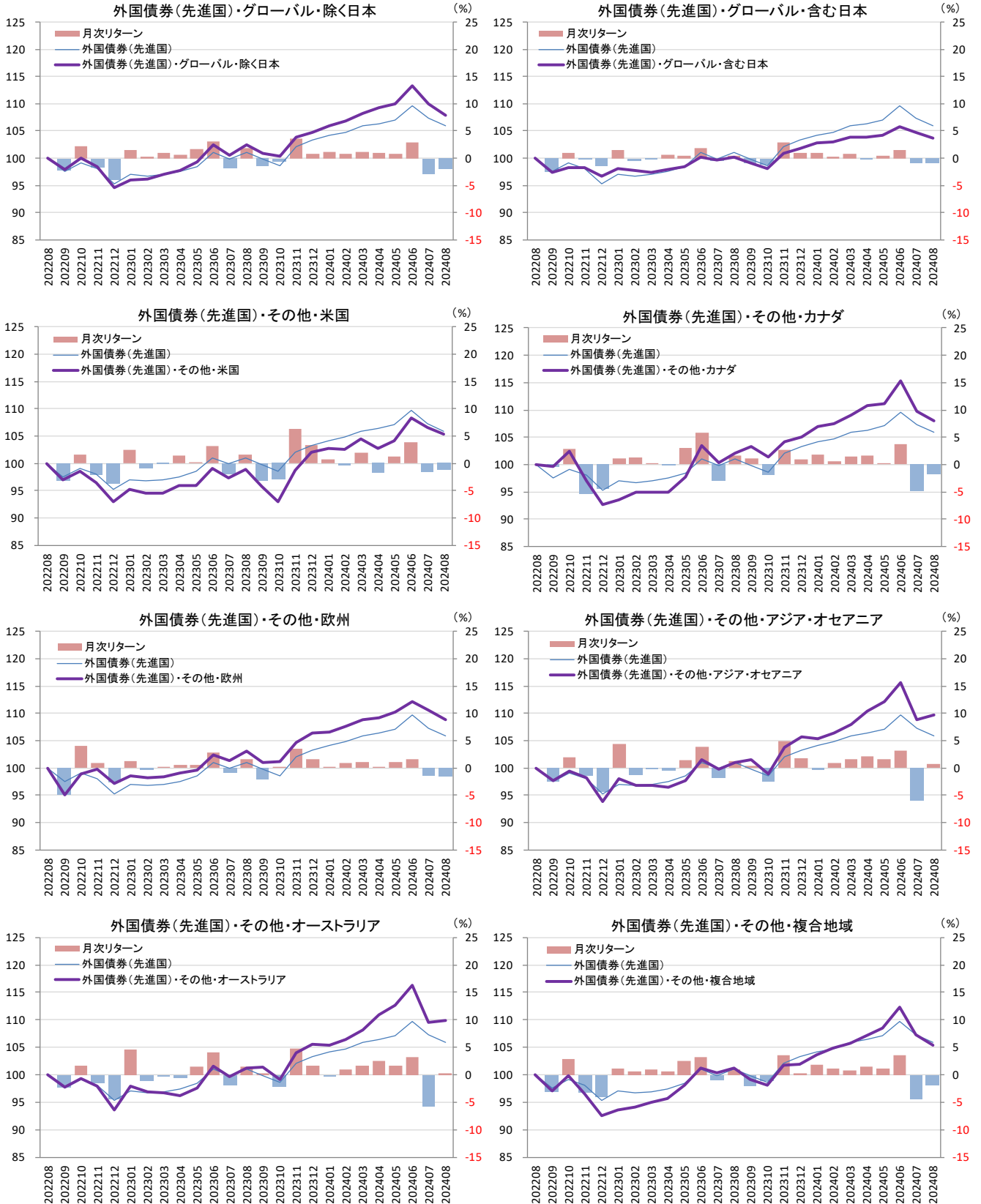


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

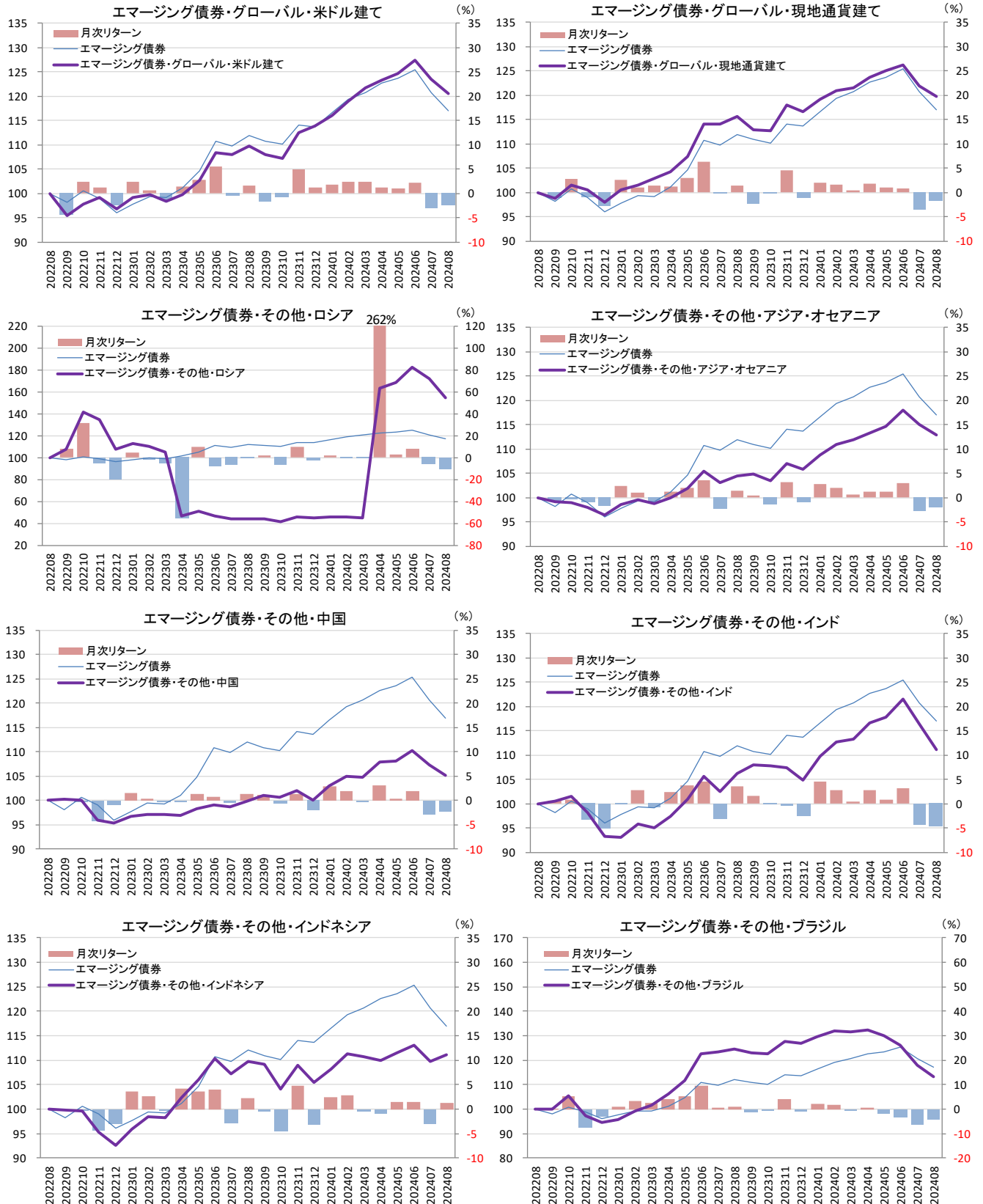


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

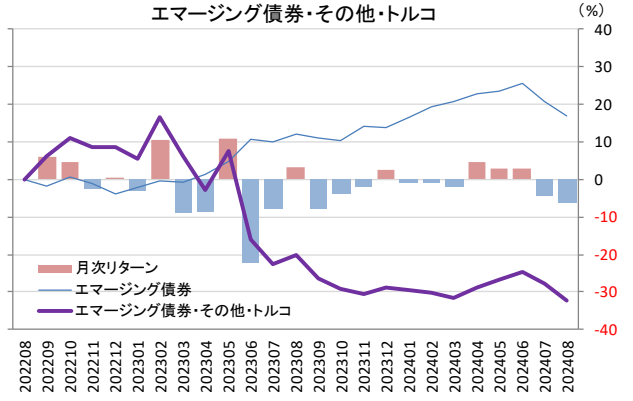
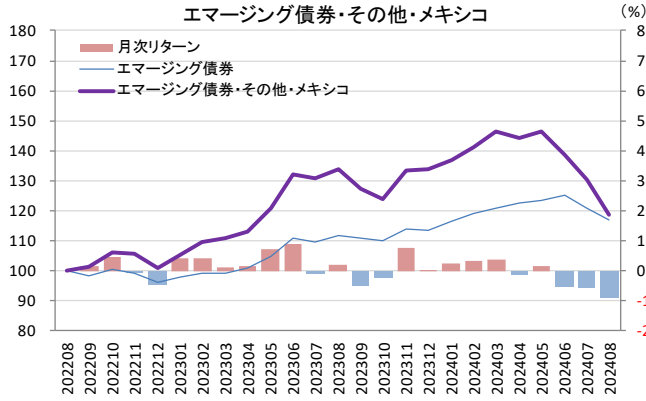


<1>パフォーマンス・サマリー

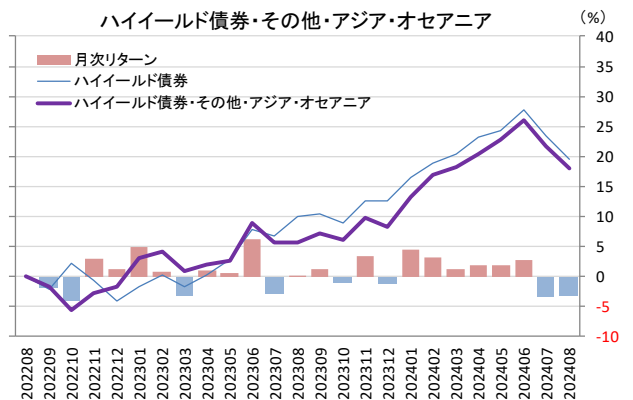
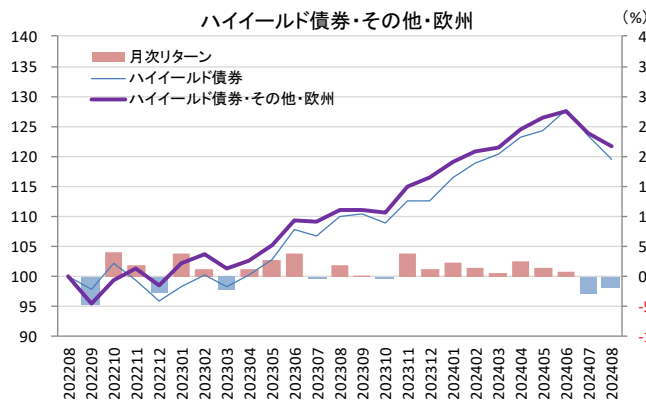
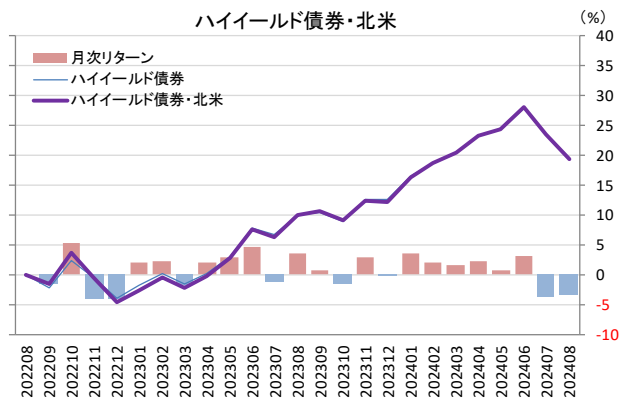
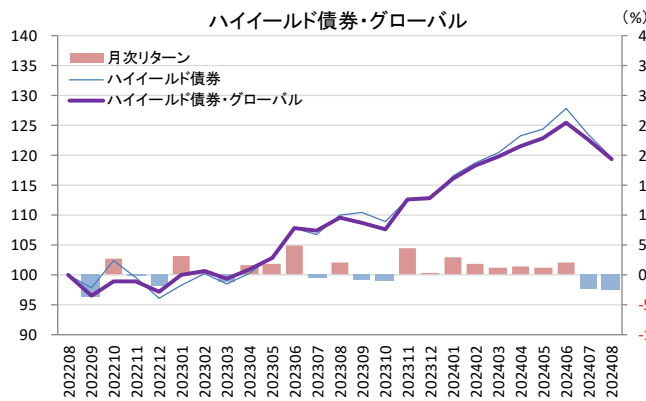
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

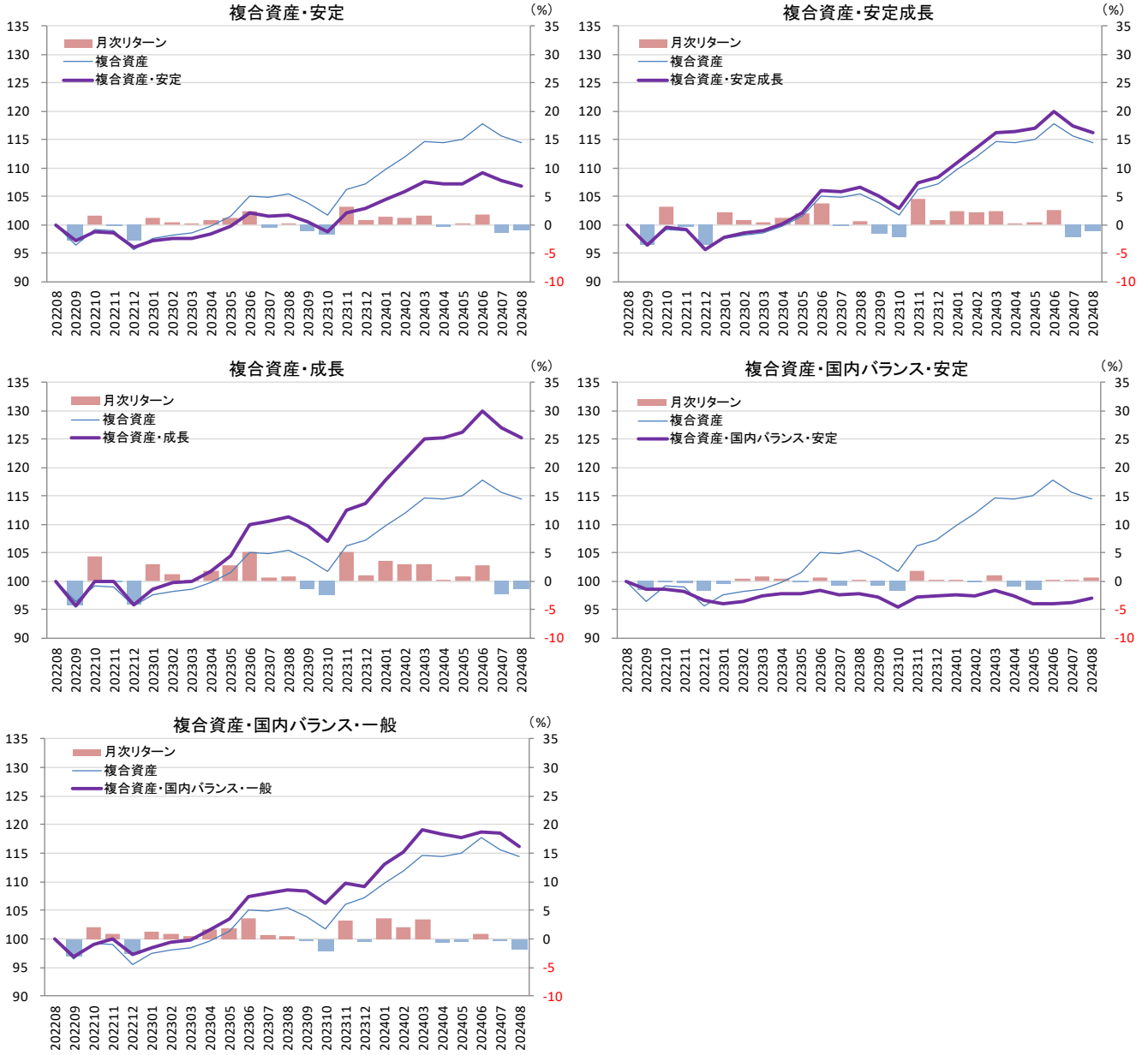


<1>パフォーマンス・サマリー

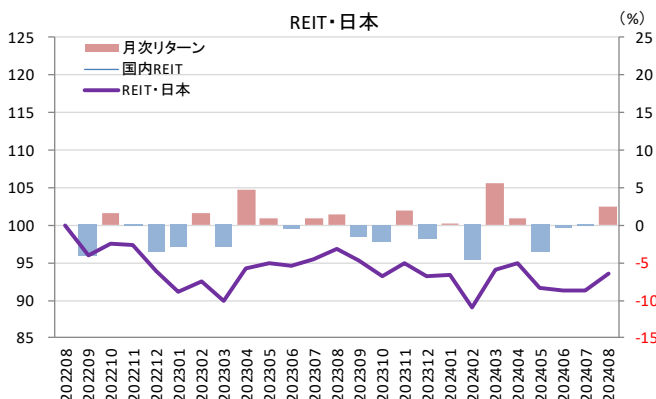
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

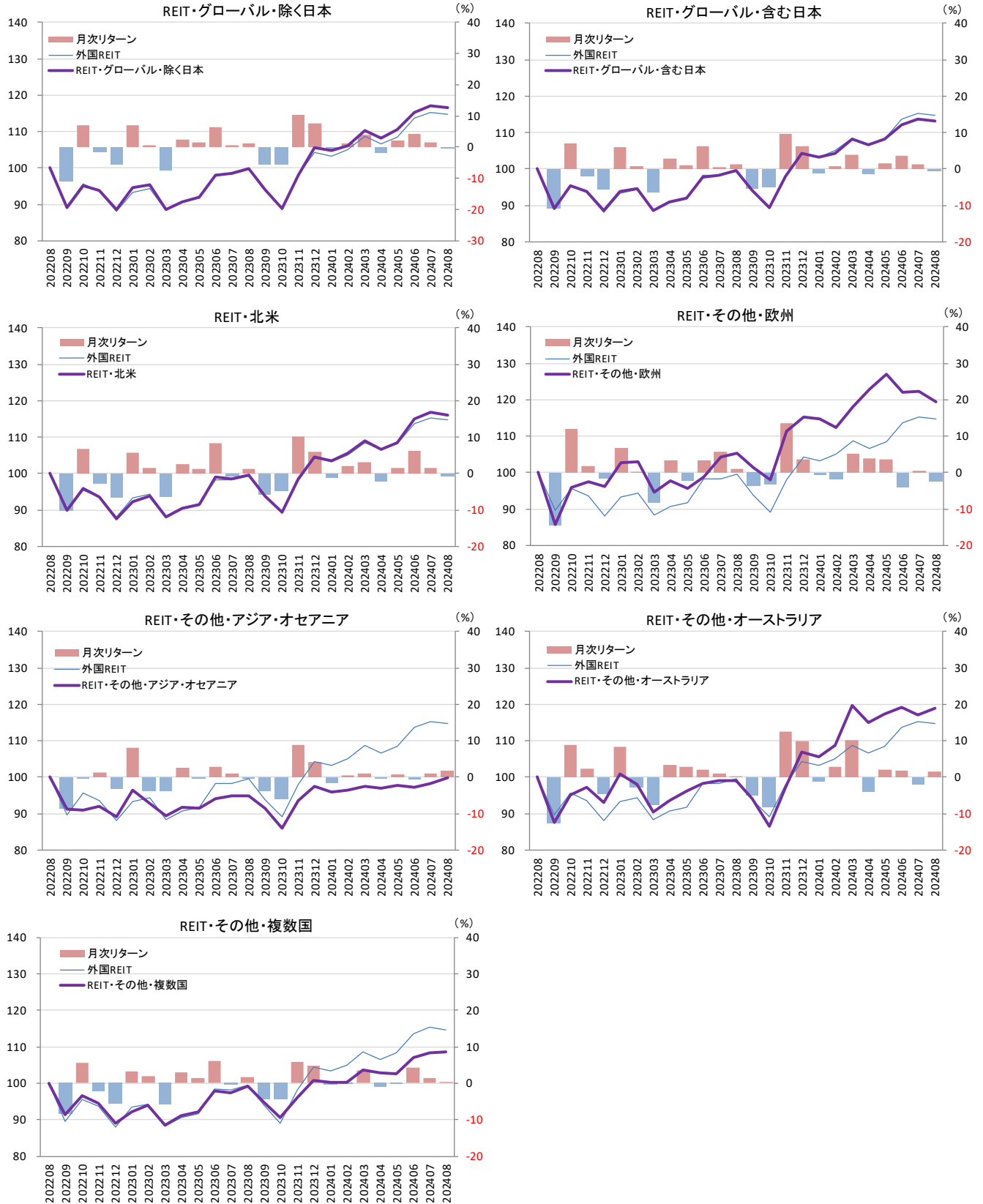


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

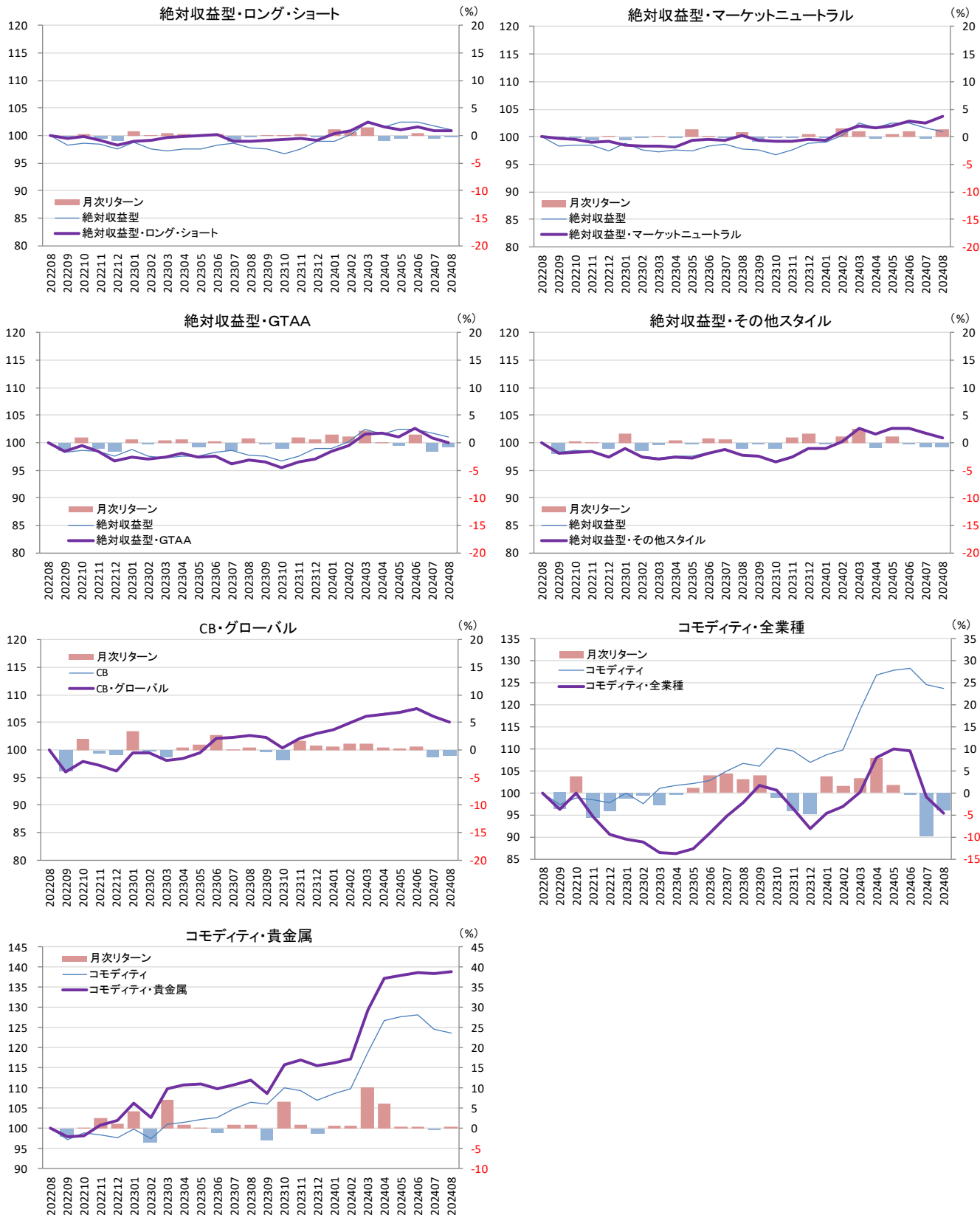


<1>パフォーマンス・サマリー

(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	-1.70		
1	REIT・日本	2.54	1.86	0.05
2	国内債券・一般	0.88	3.52	0.03
3	複合資産・その他	1.37	0.24	0.00
4	REIT・その他	1.39	0.19	0.00
5	複合資産・国内バランス	0.28	0.44	0.00
6	エマージング株式・BRICS	-1.54	0.04	-0.00
7	CB	-1.11	0.22	-0.00
8	ハイイールド債券・その他	-2.16	0.13	-0.00
9	コモディティ	-0.63	0.69	-0.00
10	国内株式・業種特化	-4.74	0.11	-0.00
11	ハイイールド債券・グローバル	-2.56	0.23	-0.01
12	国内株式・小型	-1.41	0.57	-0.01
13	REIT・グローバル	-0.47	1.54	-0.01
14	絶対収益型	-0.67	1.00	-0.01
15	外国債券(先進国)・その他	-0.69	1.43	-0.01
16	エマージング債券・グローバル	-2.28	0.53	-0.01
17	REIT・北米	-0.69	1.96	-0.01
18	エマージング債券・その他	-4.08	0.40	-0.02
19	複合資産・安定	-0.88	3.07	-0.03
20	エマージング株式・グローバル	-2.61	1.11	-0.03
21	複合資産・成長	-1.34	3.15	-0.04
22	ハイイールド債券・北米	-3.35	1.33	-0.05
23	複合資産・安定成長	-1.07	5.97	-0.06
24	国内株式・その他	-2.26	5.20	-0.08
25	外国債券(先進国)・グローバル	-1.48	6.51	-0.10
26	エマージング株式・その他	-4.44	3.59	-0.18
27	国内株式・一般	-2.80	7.03	-0.19
28	外国株式(先進国)・その他	-2.14	17.43	-0.38
29	外国株式(先進国)・グローバル	-1.71	29.98	-0.55
	合計		100.00	-1.70

◆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	14.21		
1	外国株式(先進国)・グローバル	18.63	29.75	5.40
2	外国株式(先進国)・その他	22.76	15.85	3.33
3	国内株式・一般	15.69	7.35	1.23
4	国内株式・その他	18.85	5.10	1.03
5	複合資産・安定成長	9.04	6.08	0.56
6	エマージング株式・その他	21.85	3.02	0.55
7	複合資産・成長	12.46	3.11	0.40
8	外国債券(先進国)・グローバル	4.26	6.85	0.31
9	REIT・北米	16.28	2.11	0.31
10	REIT・グローバル	15.08	1.61	0.22
11	複合資産・安定	4.99	3.38	0.18
12	ハイイールド債券・北米	8.47	1.43	0.13
13	エマージング株式・グローバル	12.70	1.07	0.12
14	外国債券(先進国)・その他	7.22	1.53	0.11
15	コモディティ	16.04	0.62	0.08
16	エマージング債券・グローバル	7.96	0.60	0.05
17	複合資産・その他	16.24	0.27	0.04
18	絶対収益型	3.23	1.06	0.03
19	国内株式・小型	3.89	0.66	0.03
20	ハイイールド債券・グローバル	9.10	0.24	0.02
21	国内株式・業種特化	21.46	0.10	0.02
22	REIT・その他	8.74	0.23	0.02
23	ハイイールド債券・その他	9.93	0.16	0.02
24	エマージング債券・その他	0.03	0.46	0.01
25	CB	2.40	0.25	0.01
26	エマージング株式・BRICS	6.44	0.04	0.00
27	複合資産・国内バランス	0.10	0.54	0.00
28	国内債券・一般	-1.23	3.77	-0.05
29	REIT・日本	-3.33	2.21	-0.10
	合計		100.00	14.21

◆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	22.27	59.48	79.22	11.69	11.89	10.91	0.59	0.82	0.55
国内株式	35.89	91.28	142.49	12.97	14.53	15.28	0.83	0.95	0.61
一般	34.36	90.20	131.21	12.47	14.04	15.27	0.83	0.98	0.57
フリー	30.61	87.47	126.86	13.03	14.37	15.62	0.72	0.93	0.55
バリュー	47.99	98.33	144.63	11.13	13.51	14.47	1.26	1.09	0.65
小型	0.07	48.57	126.27	14.95	17.70	16.61	0.00	0.47	0.51
その他	45.26	99.57	169.65	13.67	15.09	15.39	0.97	0.98	0.68
日経225	43.97	100.57	185.48	15.44	16.61	16.23	0.84	0.90	0.68
TOPIX	47.82	99.85	158.28	11.85	13.79	14.65	1.18	1.08	0.68
JPX日経400	49.81	103.04	152.34	12.25	14.18	14.61	1.18	1.07	0.67
国内債券	-7.63	-9.76	-1.85	2.56	2.30	2.05	-1.02	-0.87	-0.08
一般	-7.63	-9.76	-1.85	2.56	2.30	2.05	-1.02	-0.87	-0.08
外国株式(先進国)	29.43	111.10	142.51	17.26	17.33	16.39	0.52	0.93	0.57
グローバル	23.66	103.92	142.56	17.28	17.33	16.30	0.43	0.88	0.57
除く日本	51.40	137.10	204.10	15.31	↑	16.77	0.97	1.13	0.71
含む日本	15.43	93.53	125.34	18.16	17.86	16.45	0.27	0.79	0.52
その他	43.79	126.61	142.42	17.41	↑	17.71	0.74	1.00	0.55
北米	86.70	192.19	201.66	16.22	↑	18.02	1.43	1.33	0.65
米国	43.54	137.86	174.49	17.62	↑	17.30	0.73	1.10	0.62
カナダ	17.73	47.66	15.64	11.71	17.60	15.89	0.48	0.46	0.09
欧州	27.59	81.88	100.41	14.71	16.96	16.22	0.58	0.75	0.45
ドイツ	41.83	103.52	103.00	17.76	21.31	20.89	0.70	0.72	0.35
アジア・オセアニア	13.19	46.02	67.06	11.68	↑	14.28	0.36	0.55	0.36
オーストラリア	37.53	62.45	56.60	18.00	23.39	19.87	0.62	0.44	0.23
ニュージーランド	9.85	57.28	155.35	15.23	17.00	17.02	0.21	0.56	0.58
複合地域	111.87	104.83	30.58	25.20	32.52	26.99	1.13	0.47	0.10
エマージング株式	34.25	87.05	92.47	11.57	↑	17.09	0.89	0.78	0.42
グローバル	22.01	75.59	71.71	12.28	16.33	16.48	0.56	0.73	0.34
BRICS	-5.61	26.05	50.72	13.50	19.36	18.90	-0.14	0.25	0.22
その他	40.64	94.11	103.38	11.81	↑	17.70	1.02	0.80	0.44
欧州	-33.06	-17.37	-15.37	34.57	33.05	27.22	-0.36	-0.11	-0.06
ロシア	-91.92	-88.63	-85.18	54.64	47.47	37.81	-1.04	-0.74	-0.46
アジア・オセアニア	13.86	50.04	51.54	12.83	15.98	16.00	0.35	0.53	0.27
中国	-31.97	4.22	63.05	19.78	19.97	21.55	-0.61	0.04	0.23
インド	68.86	159.01	207.48	14.96	↑	22.08	1.28	0.95	0.57
インドネシア	39.72	28.40	21.03	15.72	25.27	22.66	0.75	0.20	0.09
タイ	9.99	-1.28	12.50	11.52	↓	20.01	0.28	-0.01	0.07
フィリピン	18.93	8.79	1.26	15.20	↓	20.34	0.39	0.08	0.01
ベトナム	30.47	89.81	136.19	19.61	25.90	21.75	0.47	0.53	0.41
韓国	-18.09	64.77	10.62	26.11	26.11	21.78	-0.25	0.40	0.05
香港	-2.31	4.66	12.31	21.63	20.81	20.13	-0.04	0.04	0.06
中南米	35.54	53.30	22.81	23.37	29.06	26.35	0.46	0.31	0.08
ブラジル	18.21	11.03	-14.72	25.82	31.63	31.61	0.22	0.07	-0.05
メキシコ	51.59	91.01	20.14	23.38	↑	27.70	0.64	0.50	0.08
中東・アフリカ	31.22	75.28	41.97	14.80	17.69	16.63	0.64	0.67	0.22
トルコ	132.58	160.21	26.77	34.15	33.78	31.88	0.95	0.62	0.08
複合地域	13.25	49.54	36.06	13.42	16.12	15.61	0.32	0.52	0.20

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

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

＜2＞リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別②

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	22.27	59.48	79.22	11.69	11.89	10.91	0.59	0.82	0.55
外国債券(先進国)	4.01	12.19	11.25	5.35 ↑	5.15	5.40	0.25	0.46	0.20
グローバル	1.98	8.83	11.63	4.79 ↑	4.50	4.82	0.14	0.38	0.23
除く日本	5.72	14.11	15.37	6.24 ↑	5.22 ↑	5.54	0.30	0.52	0.26
含む日本	-1.09	4.16	8.81	3.94	4.56	4.49	-0.09	0.18	0.19
その他	12.56	25.11	15.91	8.25	8.08	7.75	0.49	0.57	0.19
北米	0.47	8.07	17.50	6.52 ↑	6.31 ↑	5.28	0.03	0.25	0.31
米国	10.65	21.39	34.07	8.15	8.35	7.20	0.42	0.48	0.42
カナダ	20.54	33.24	18.04	8.97 ↑	8.14	8.74	0.72	0.73	0.19
欧州	-3.34	-1.06	-2.36	6.70	5.81	6.54	-0.17	-0.03	-0.03
イギリス	19.94	40.12	25.08	10.99	9.81	10.11	0.57	0.71	0.23
アジア・オセアニア	16.56	31.33	15.51	10.04	9.97	9.39	0.52	0.56	0.16
オーストラリア	17.14	32.09	15.69	10.03	10.02	9.44	0.54	0.57	0.16
ニュージーランド	11.05	23.42	22.91	10.81	9.73	10.08	0.33	0.44	0.21
複合地域	7.27	21.65	17.94	8.28 ↑	6.84 ↑	7.09	0.29	0.59	0.24
エマージング債券	23.81	30.52	25.88	7.97 ↑	10.27	10.61	0.93	0.53	0.22
グローバル	16.75	23.50	19.13	8.15	11.59	11.18	0.65	0.37	0.16
米ドル建て	15.04	22.04	19.38	8.72	12.25	11.59	0.55	0.33	0.16
現地通貨建て	22.69	29.35	15.33	7.46	9.83	10.23	0.95	0.54	0.14
その他	32.30	38.93	32.87	9.66 ↑	10.24	11.20	1.01	0.67	0.26
ロシア	-84.05	-83.35	-84.47	170.78 ↑	132.31 ↑	94.81 ↑	-0.27	-0.23	-0.18
アジア・オセアニア	15.76	24.42	37.89	6.21	7.16	6.96	0.81	0.63	0.47
中国	26.18	50.00	-	6.72	5.98	-	1.20	1.42	-
インド	27.73	46.77	76.28	9.41 ↑	9.30	9.74	0.90	0.86	0.60
インドネシア	34.91	58.99	77.29	9.79	13.30	13.63	1.07	0.73	0.43
ブラジル	47.63	27.42	18.97	15.57	17.17	18.41	0.89	0.29	0.10
メキシコ	44.30	65.42	33.30	14.92 ↑	17.14	15.98	0.87	0.62	0.18
トルコ	-48.79	-54.48	-79.35	28.35	26.53	27.92	-0.70	-0.55	-0.52
複合地域	19.75	23.42	6.57	10.71	11.70	11.61	0.58	0.37	0.06
ハイイールド債券	29.15	44.98	53.81	8.52 ↑	11.31	10.56	1.05	0.68	0.42
グローバル	21.29	34.34	39.16	7.44	10.96	10.40	0.89	0.56	0.32
北米	33.55	51.74	66.41	9.06 ↑	11.37	10.63	1.12	0.77	0.49
その他	17.46	27.13	26.39	8.62	12.27	11.31	0.64	0.40	0.21
欧州	19.40	28.84	26.68	9.30	12.94	12.02	0.66	0.40	0.20
アジア・オセアニア	9.93	19.72	25.63	9.73	11.96	10.37	0.33	0.31	0.22
複合地域	24.76	45.60	54.99	8.21 ↑	9.07	8.92	0.93	0.86	0.50
複合資産	12.12	28.15	45.53	6.88	7.24	7.22	0.57	0.71	0.53
安定	2.84	11.08	21.88	4.99	5.04	5.31	0.19	0.42	0.38
安定成長	15.59	34.46	53.19	7.22	7.67	7.63	0.69	0.80	0.57
成長	27.19	64.34	96.75	9.09	10.13	10.51	0.92	1.03	0.67
国内バランス	-4.04	-4.85	7.74	3.14	3.93	4.14 ↓	-0.43	-0.25	0.19
安定	-6.26	-7.99	5.16	3.03	3.81	3.13	-0.70	-0.43	0.17
一般	14.32	36.50	53.73	6.62	7.66	8.30	0.69	0.84	0.53
その他	-10.74	15.17	-	20.42	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	22.27	59.48	79.22	11.69	11.89	10.91	0.59	0.82	0.55
国内REIT	-8.06	1.59	45.64	10.29	14.98	12.30	-0.27	0.02	0.31
日本	-8.06	1.59	45.64	10.29	14.98	12.30	-0.27	0.02	0.31
外国REIT	28.00	54.27	105.80	17.92	19.08	16.68	0.48	0.48	0.45
グローバル	24.39	47.99	80.46	17.68	19.73	16.87	0.43	0.41	0.36
除く日本	27.23	55.93	105.81	18.32	20.46	17.34	0.46	0.45	0.43
含む日本	22.62	44.49	74.52	17.34	19.43	16.70	0.41	0.39	0.34
北米	32.85	64.01	133.26	18.75	18.91	17.05	0.53	0.55	0.52
その他	13.50	25.72	74.28	15.24	19.29	16.05	0.28	0.24	0.36
欧州	-3.58	14.95	17.40	19.08	21.34	18.60	-0.06	0.13	0.09
アジア・オセアニア	10.73	20.12	76.06	14.21	17.64	15.17	0.24	0.21	0.38
オーストラリア	25.84	39.94	66.93	23.57	30.10	23.42	0.34	0.23	0.23
複合地域	27.13	32.30	25.51	15.24	24.13	20.21	0.55	0.24	0.11
複数国	17.88	46.04	126.79	15.24	17.18	15.04	0.37	0.46	0.57
その他									
絶対収益型	-5.17	-1.90	-2.68	4.00	3.53	2.90	-0.44	-0.10	-0.09
ロング・ショート	-5.09	-9.34	-9.06	3.21	3.05	3.08	-0.53	-0.63	-0.30
マーケットニュートラル	-3.32	-0.22	11.09	3.94	4.07	4.86	-0.28	-0.01	0.22
GTAA	-1.41	8.68	13.22	4.24	4.58	3.58	-0.11	0.37	0.35
その他スタイル	-5.46	-1.65	-2.86	4.39	3.83	3.17	-0.42	-0.08	-0.09
CB	-5.82	14.90	17.15	6.41	8.49	7.61	-0.31	0.33	0.21
アジア・オセアニア	16.74	58.45	89.54	9.32 ↑	11.89	11.60	0.57	0.81	0.57
日本	7.50	10.53	26.09	5.04	5.36	5.43	0.49	0.38	0.44
グローバル	-6.75	14.09	15.73	6.63	8.73	7.70	-0.35	0.31	0.19
コモディティ	55.58	86.30	31.92	10.77	11.72	12.24	1.47	1.13	0.23
全業種	54.58	95.02	18.52	17.75 ↑	19.62	17.36	0.88	0.73	0.10
貴金属	45.37	67.14	67.92	11.14 ↓	12.64	11.48	1.19	0.86	0.46
エネルギー	102.62	145.45	22.24	26.69	35.36	32.10	0.99	0.56	0.06
その他コモディティ	56.75	82.31	31.80	16.21 ↑	18.87	17.03	1.00	0.68	0.17

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

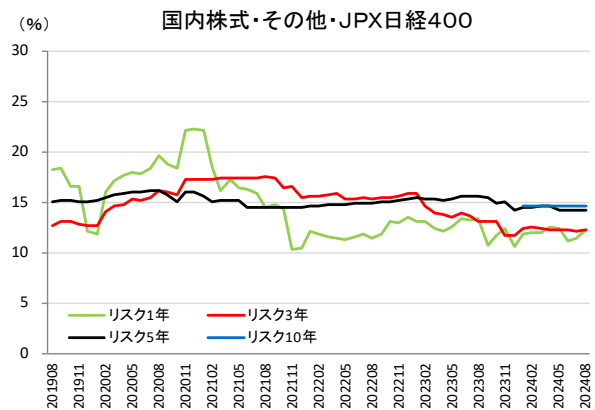
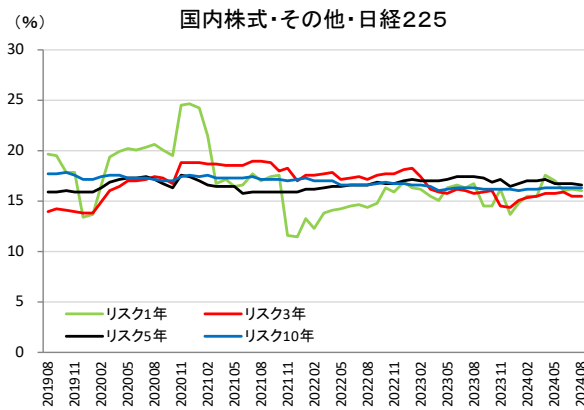
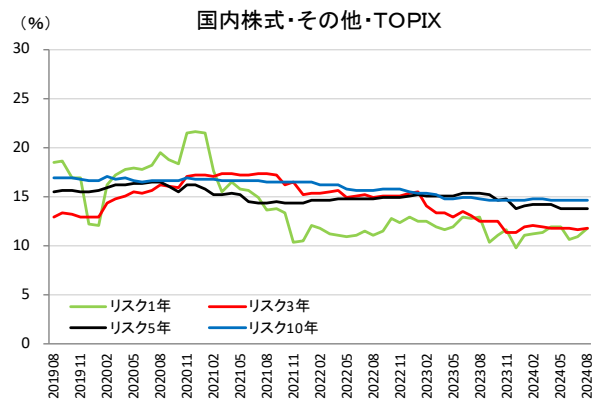
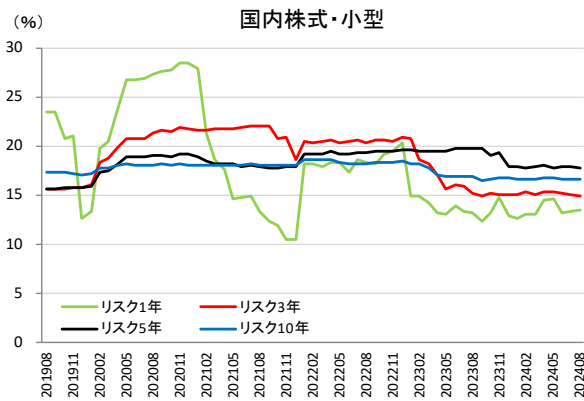
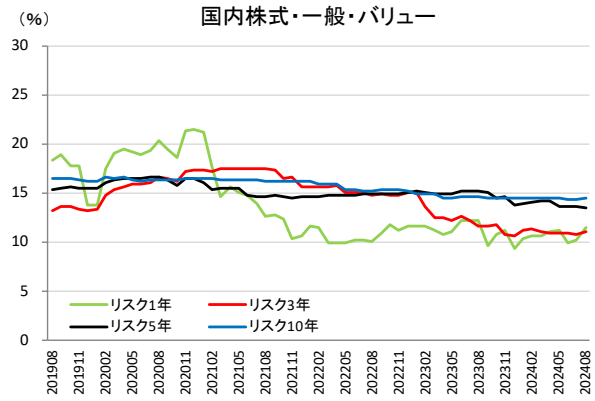
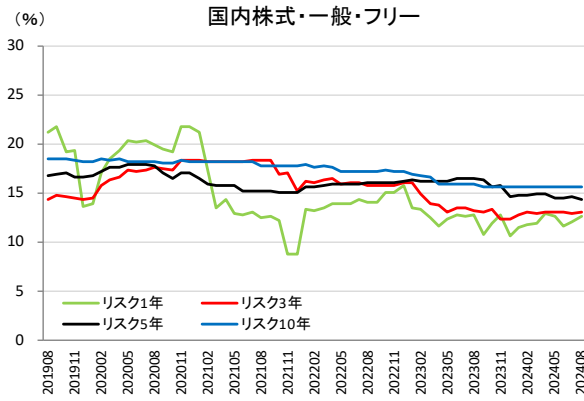
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2>リスク・サマリー

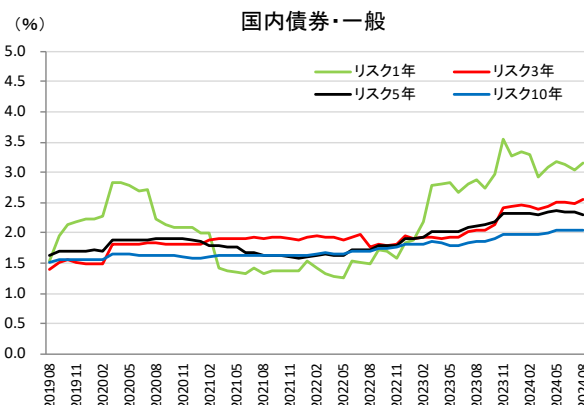
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

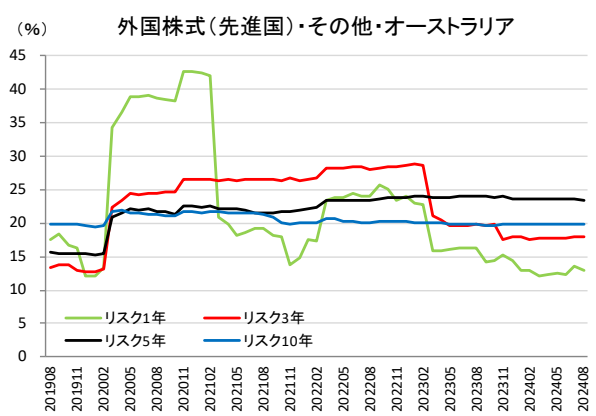
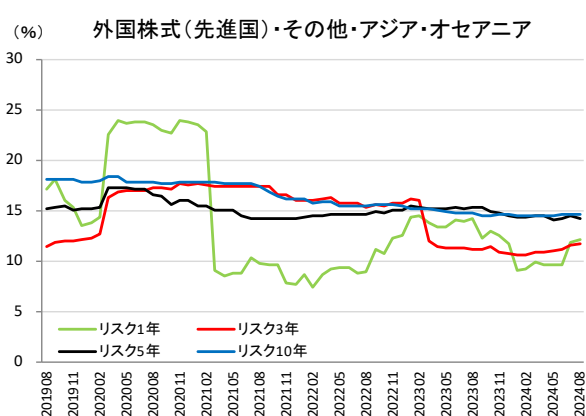
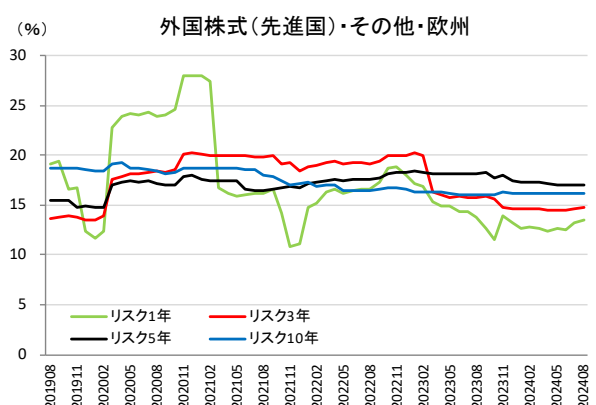
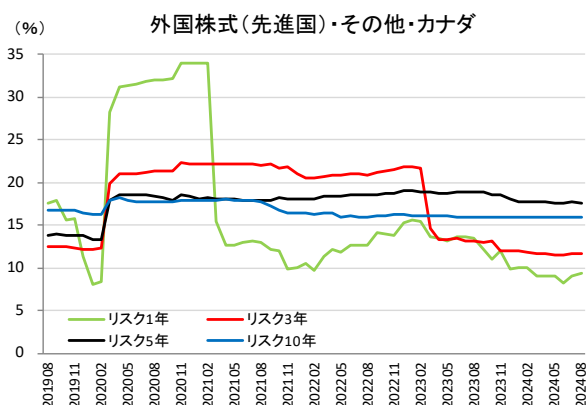
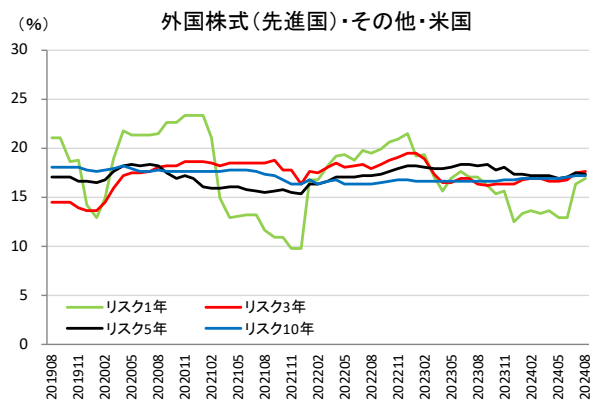
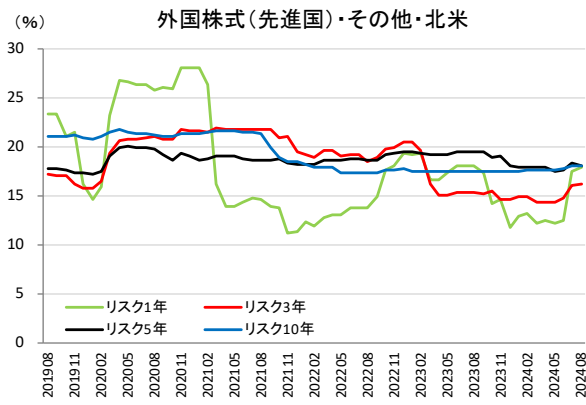
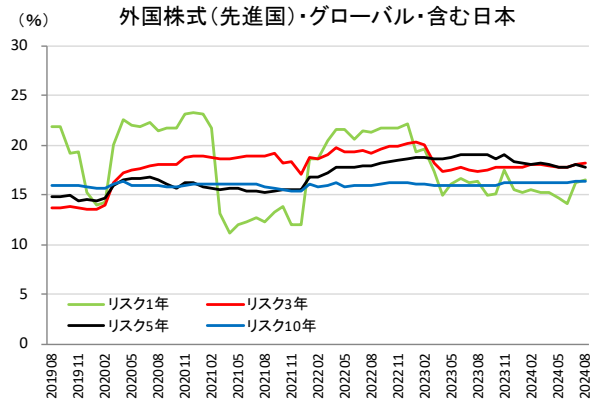
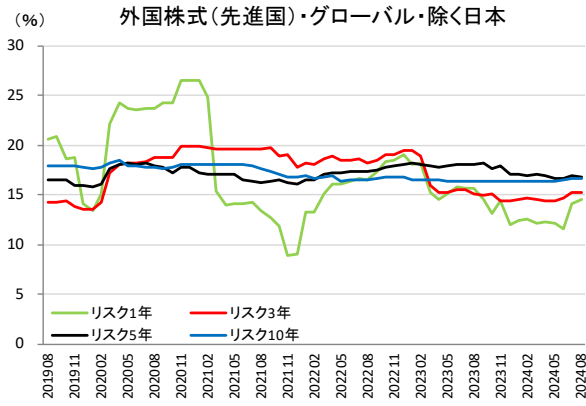


<2> リスク・サマリー

(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)]

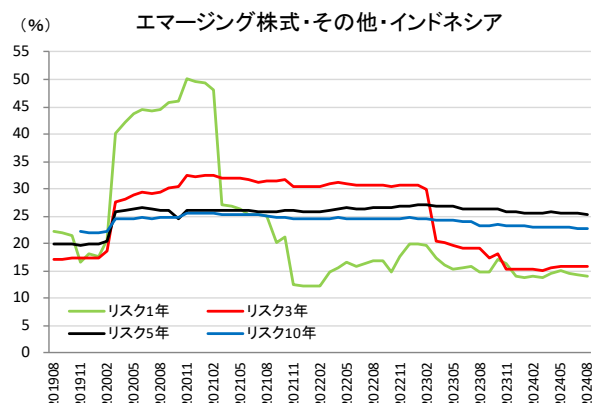
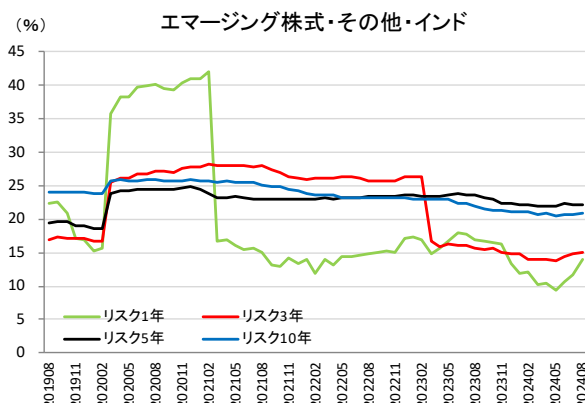
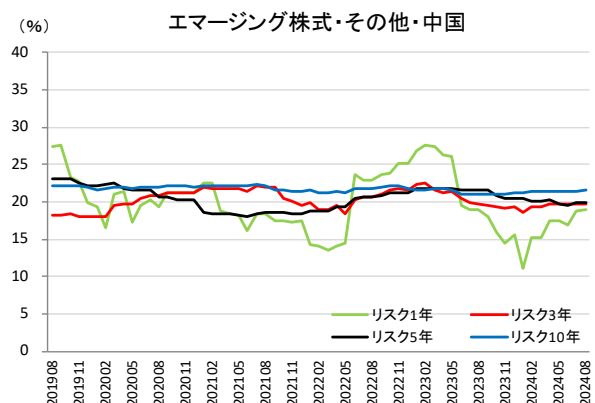
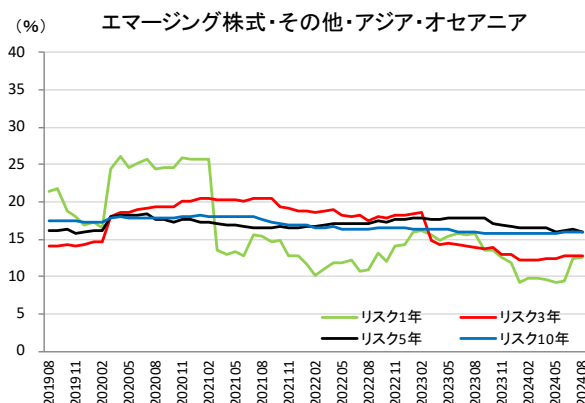
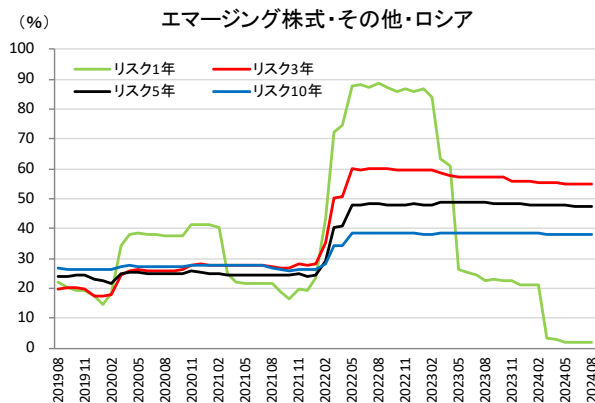
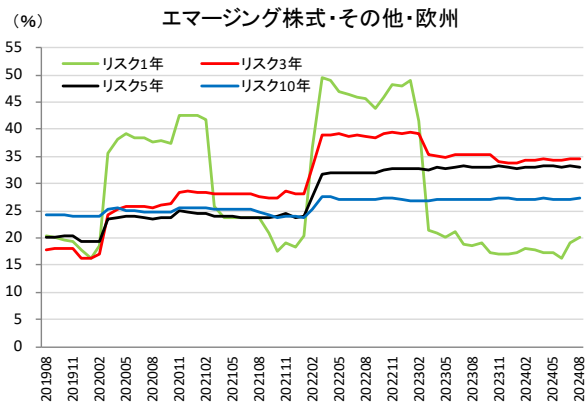
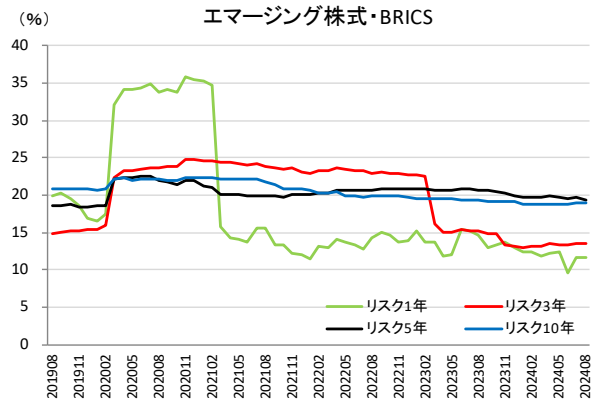
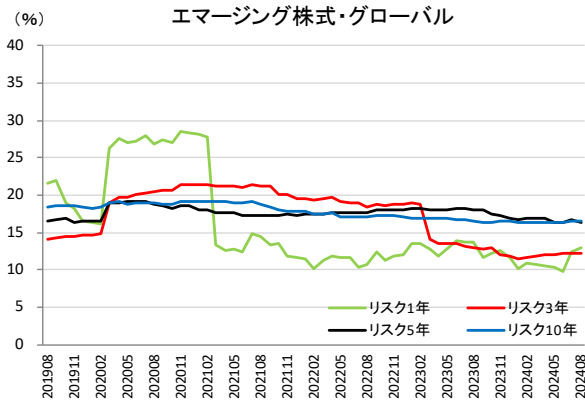


<2> リスク・サマリー

(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]

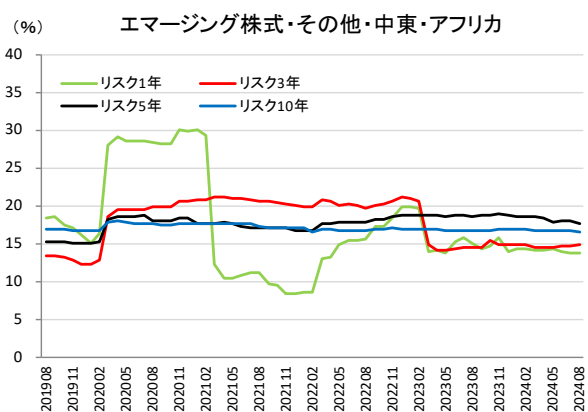
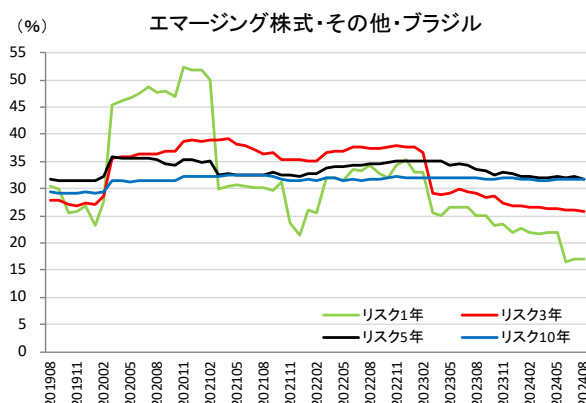
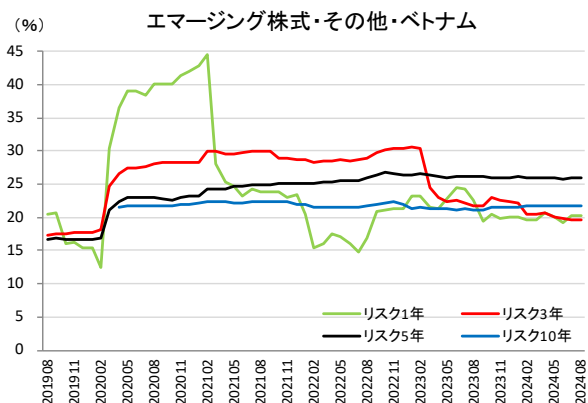
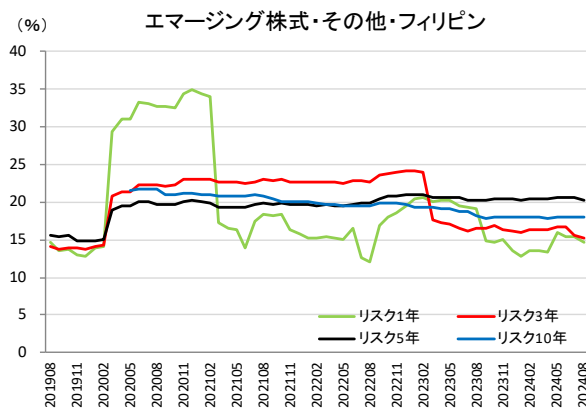
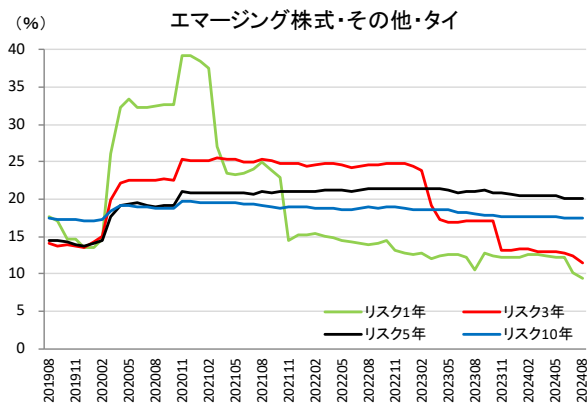


<2> リスク・サマリー

(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]

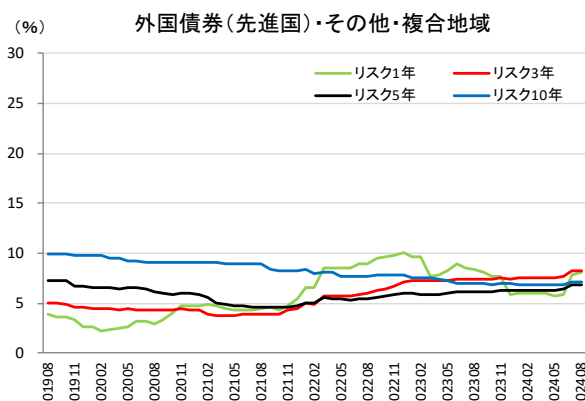
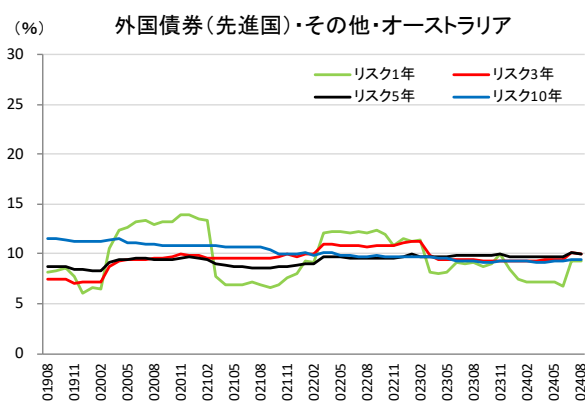
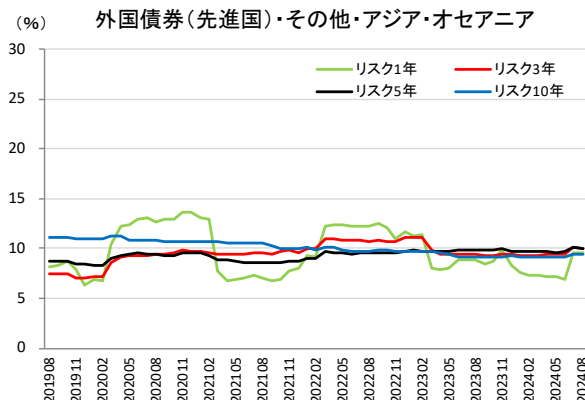
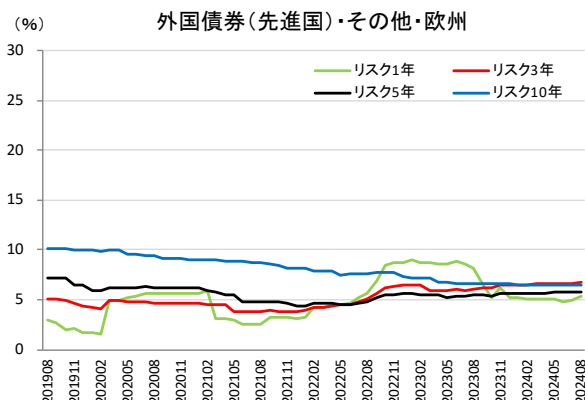
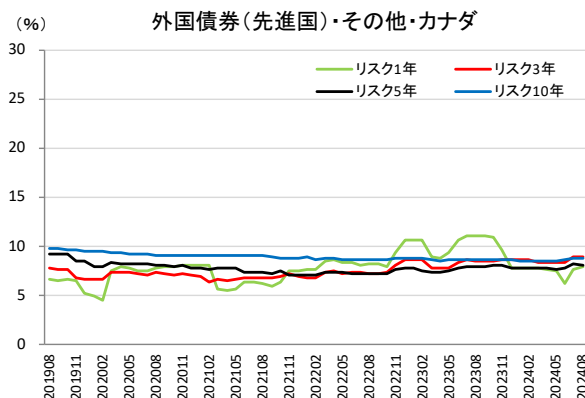
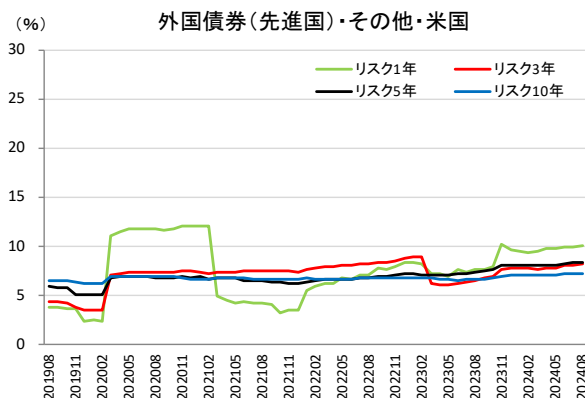
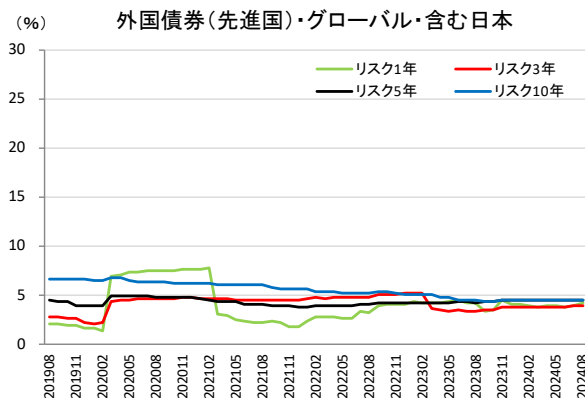
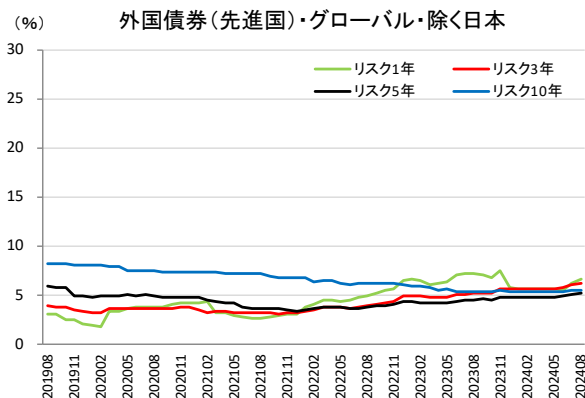


<2> リスク・サマリー

(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)]

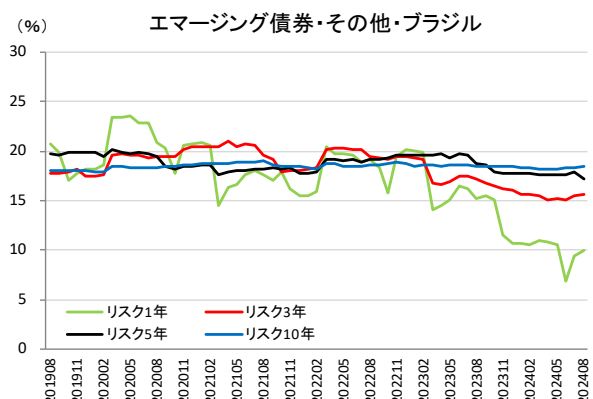
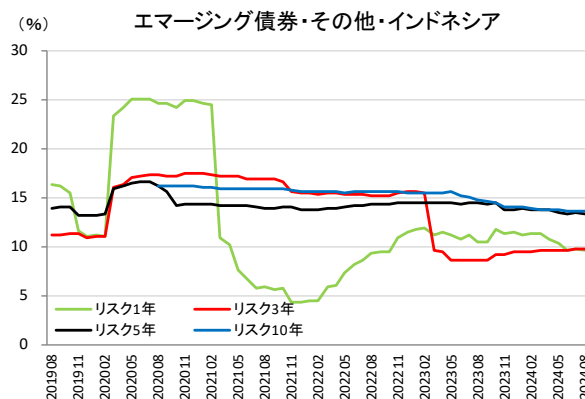
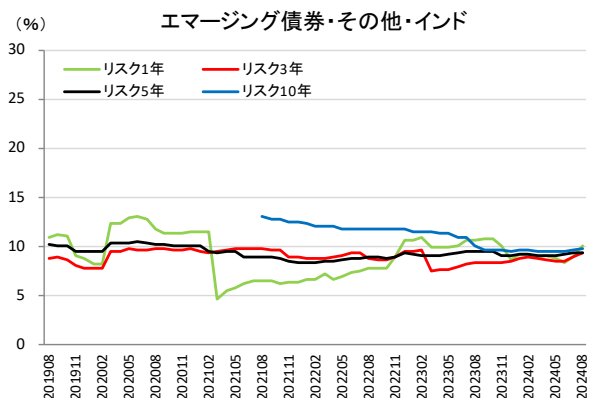
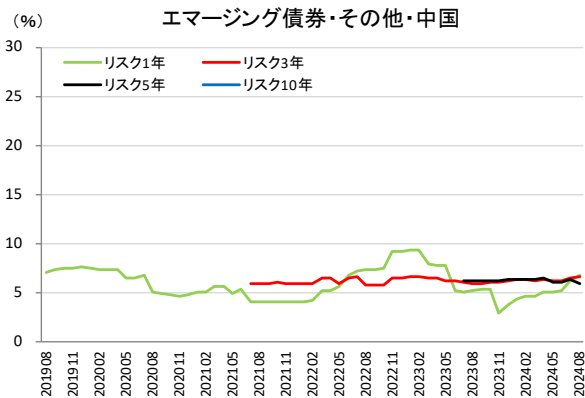
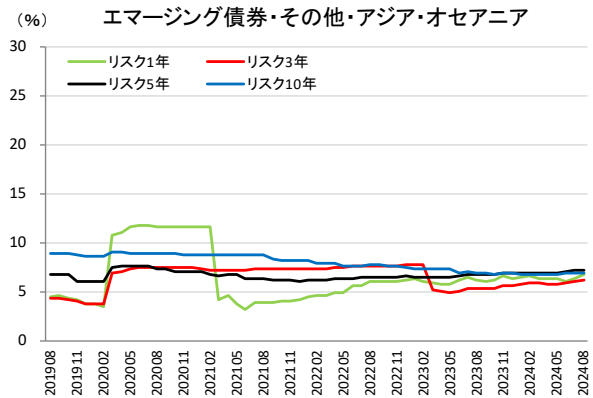
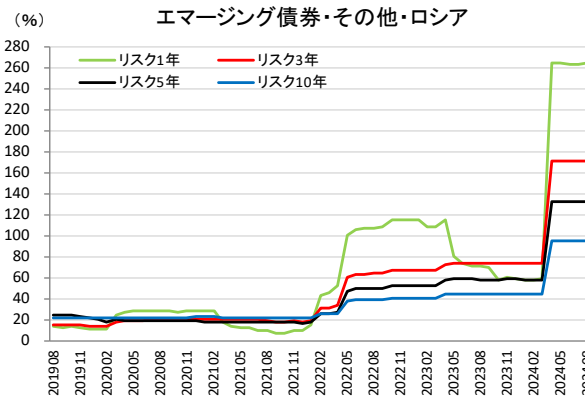
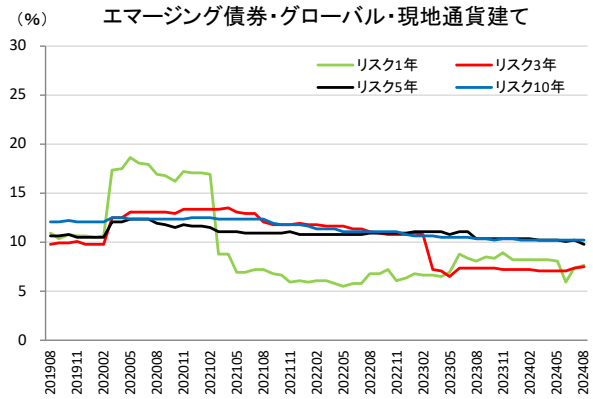
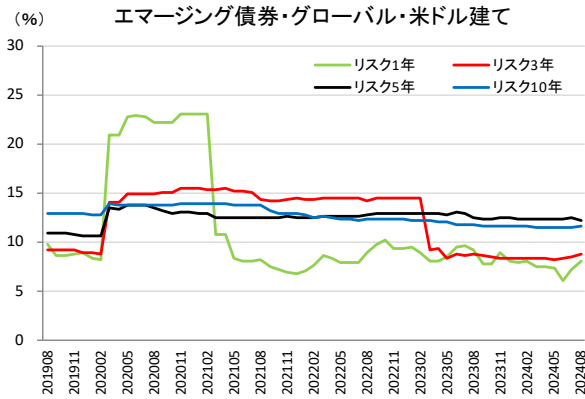


<2> リスク・サマリー

(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]

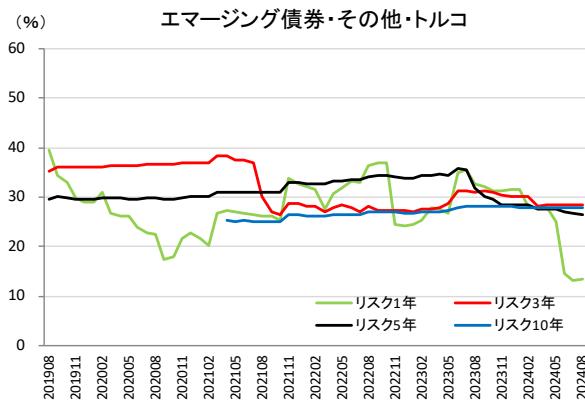
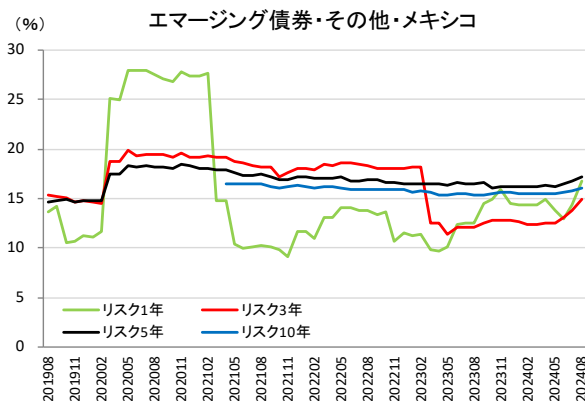


<2> リスク・サマリー

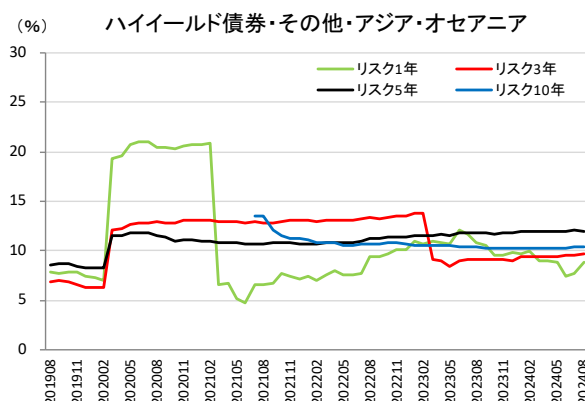
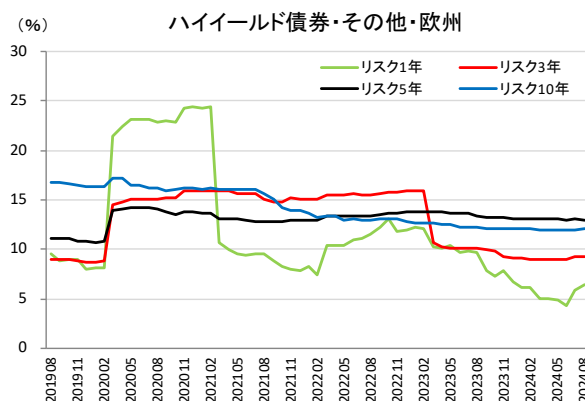
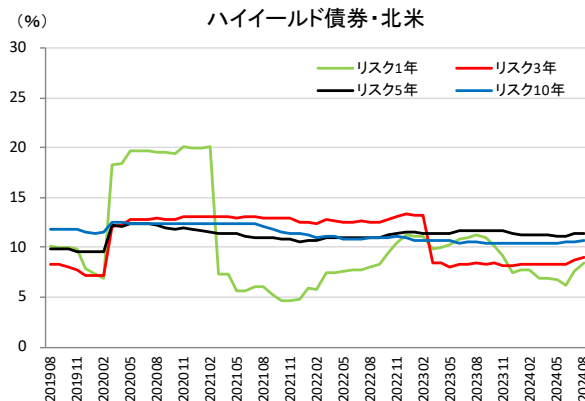
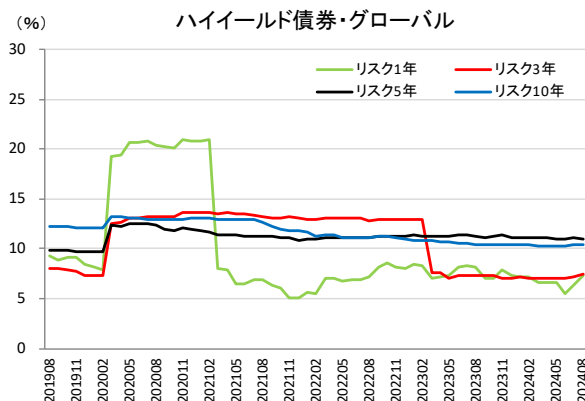
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

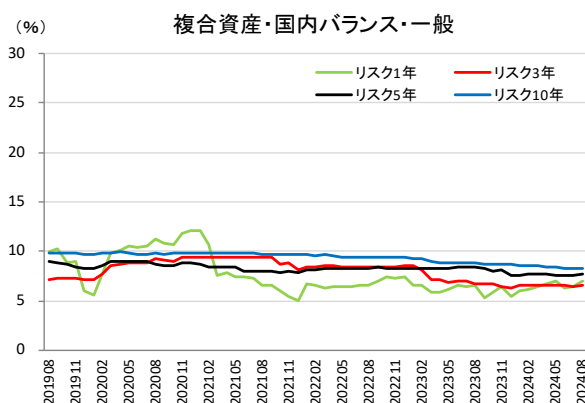
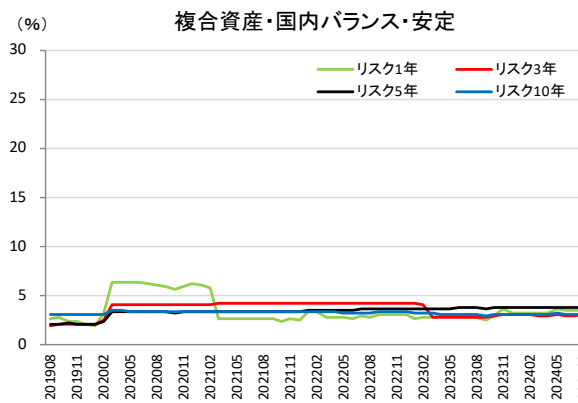
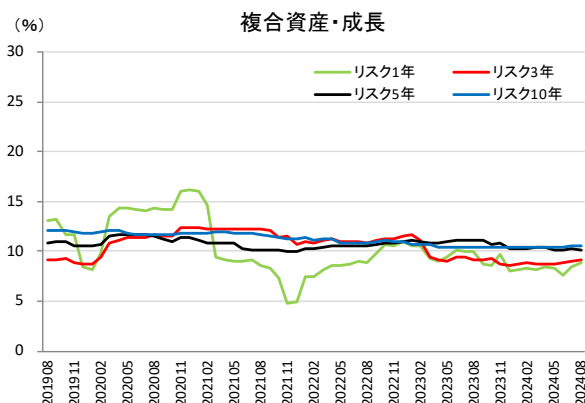
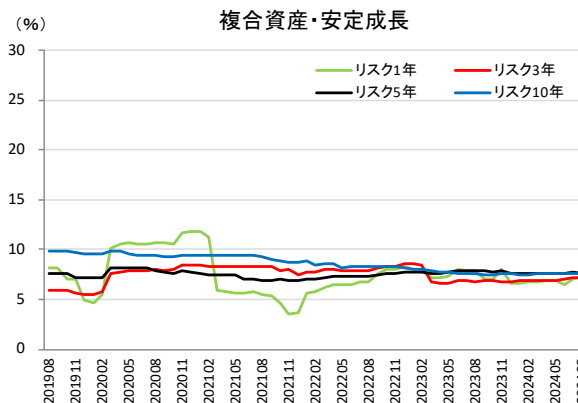
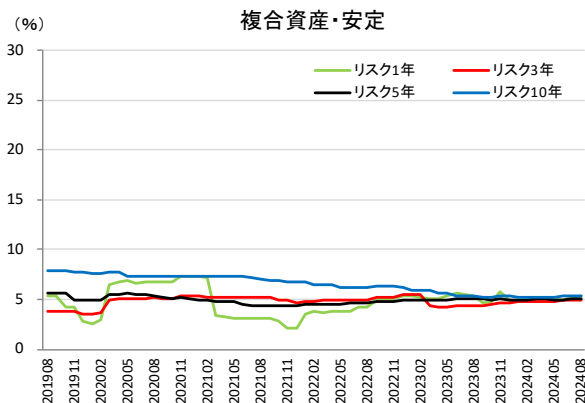


<2> リスク・サマリー

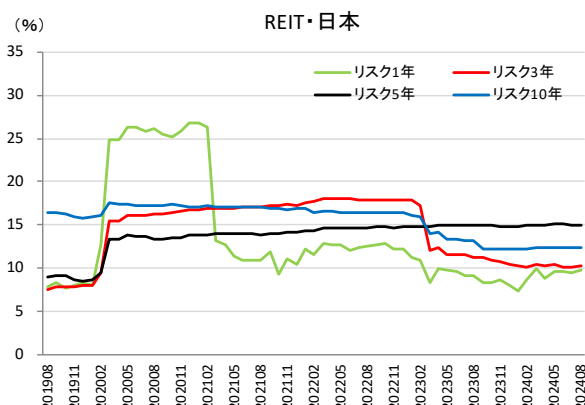
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

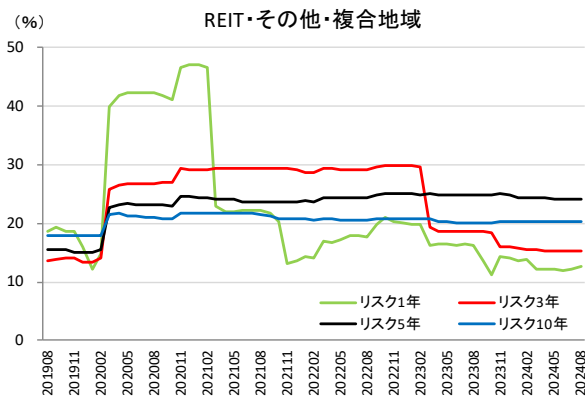
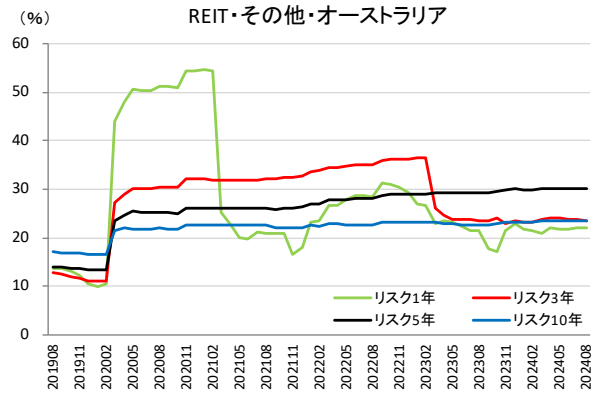
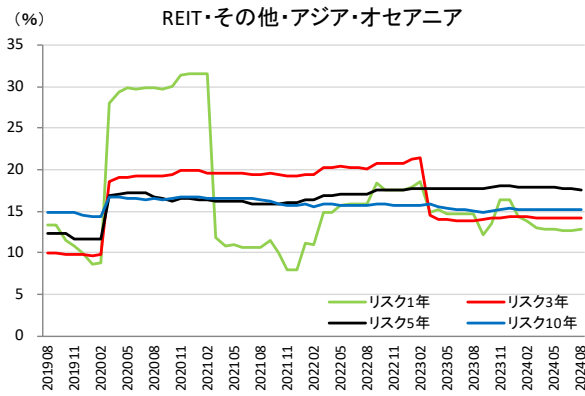
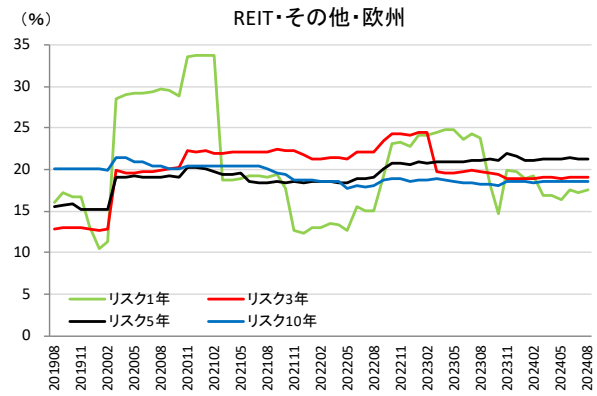
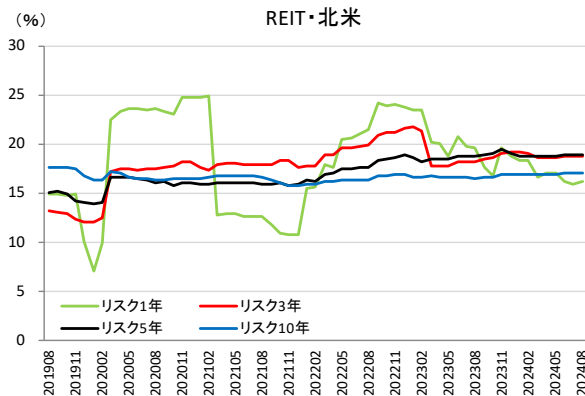
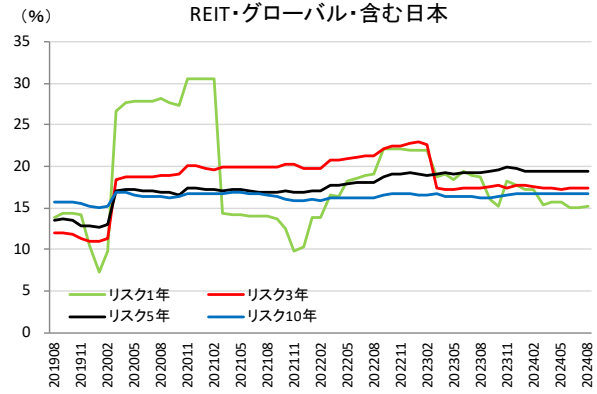
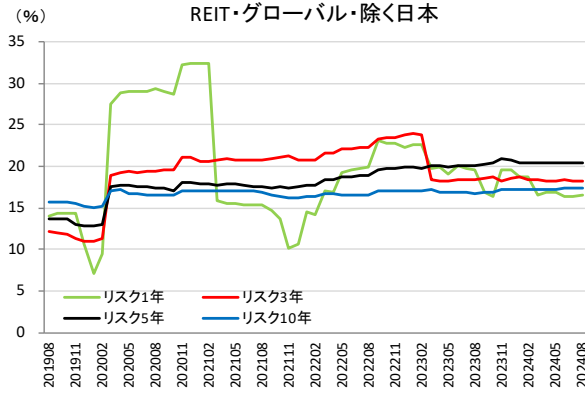


<2> リスク・サマリー

(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]

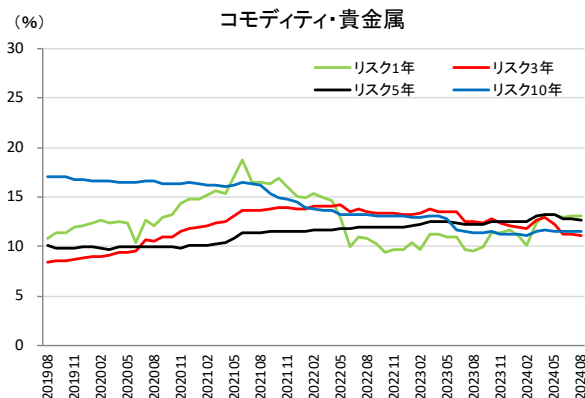
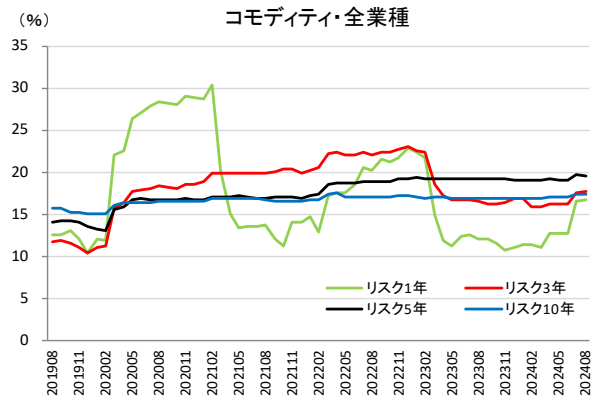
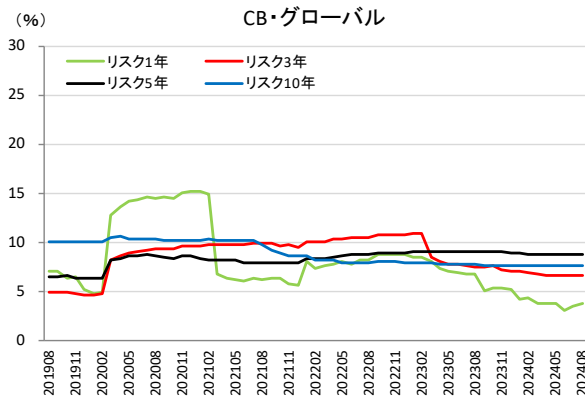
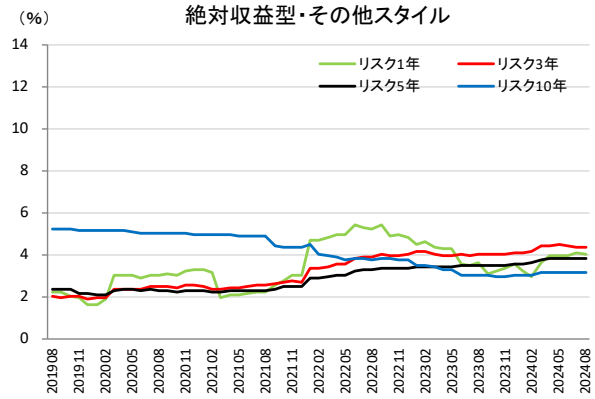
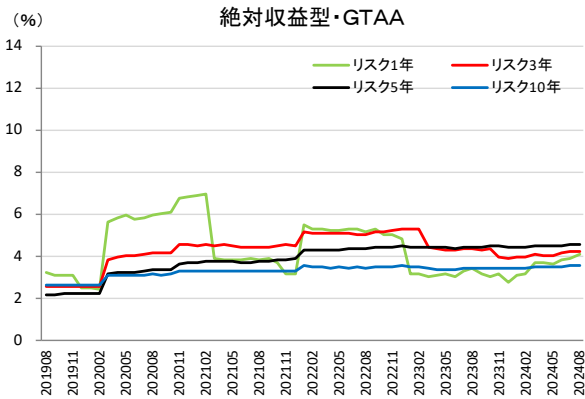
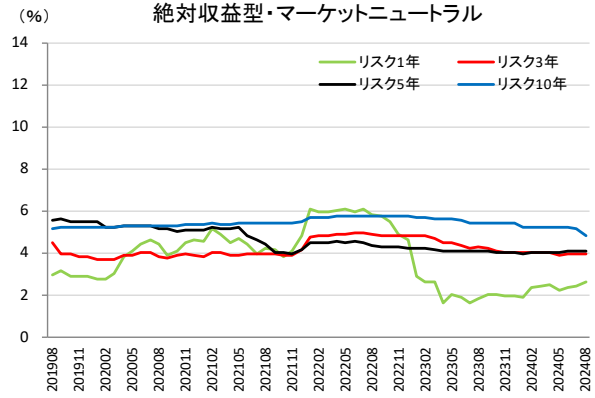
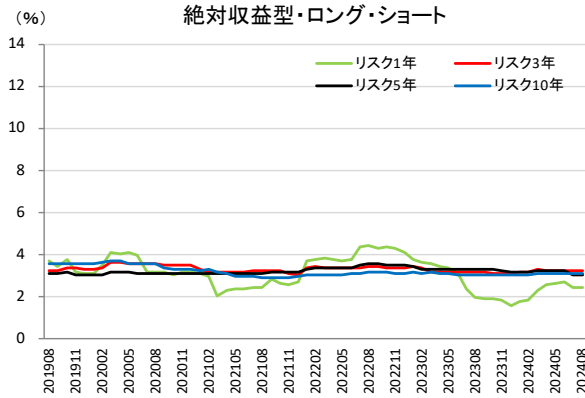


<2> リスク・サマリー

(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	13,453	48,101	91,391	145,421
国内株式	2,875	4,869	10,708	18,160
一般	816	1,676	3,015	8,114
フリー	464	525	389	923
バリュー	352	1,151	2,624	7,183
小型	-4	-125	-66	-232
その他	2,012	3,182	7,411	9,701
日経225	1,218	1,257	3,975	3,929
TOPIX	525	1,138	1,909	3,399
JPX日経400	32	53	102	96
国内債券	66	435	1,296	2,951
一般	66	435	1,296	2,951
外国株式(先進国)	8,031	32,604	58,314	92,529
グローバル	3,670	14,023	24,790	39,916
除く日本	850	3,839	6,827	11,726
含む日本	2,820	10,184	17,963	28,190
その他	4,362	18,582	33,524	52,613
北米	183	868	1,693	2,951
米国	4,149	17,622	31,744	49,733
カナダ	23	22	18	4
欧州	20	104	170	221
ドイツ	0	0	1	0
アジア・オセアニア	0	1	0	-2
オーストラリア	-13	-33	-96	-276
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	-1	-2	-4	-14
エマージング株式	492	5,073	10,586	17,566
グローバル	66	400	1,637	1,913
BRICS	-3	-9	-23	-50
その他	430	4,682	8,971	15,703
欧州	0	0	3	2
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	22	88	-246	-467
中国	-13	-67	-144	-441
インド	449	4,696	9,468	16,758
インドネシア	0	12	20	32
タイ	0	0	-1	-3
フィリピン	0	-1	-2	-6
ベトナム	-22	-30	-77	-95
韓国	0	0	0	0
香港	0	-1	-4	0
中南米	0	-3	-6	-10
ブラジル	-2	-10	-28	-77
メキシコ	0	0	1	1
中東・アフリカ	-1	-3	-10	-23
トルコ	-1	1	-5	-9
複合地域	-1	2	4	42

<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	13,453	48,101	91,391	145,421
外国債券(先進国)	602	1,593	3,387	7,009
グローバル	622	1,566	3,036	6,657
除く日本	414	1,280	1,914	3,385
含む日本	222	299	1,135	3,285
その他	-20	27	351	352
北米	3	16	34	102
米国	36	269	859	1,487
カナダ	-6	-25	-54	-135
欧州	9	20	39	24
イギリス	0	-1	-2	-3
アジア・オセアニア	-13	-50	-105	-216
オーストラリア	-44	-174	-362	-802
ニュージーランド	0	-5	-10	-15
複合地域	-5	-21	-47	-91
エマージング債券	17	-193	-185	-210
グローバル	27	-197	-171	-225
米ドル建て	4	-164	-204	-348
現地通貨建て	23	-33	33	123
その他	-10	4	-14	14
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-1	-3	-9	-23
中国	-3	-7	-15	-35
インド	4	50	100	303
インドネシア	0	14	9	17
ブラジル	-9	-42	-85	-205
メキシコ	-1	-6	-9	-35
トルコ	0	0	-2	-3
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイイールド債券	-4	215	389	929
グローバル	17	103	108	42
北米	-4	189	409	1,139
その他	-17	-77	-127	-252
欧州	-13	-53	-98	-195
アジア・オセアニア	-3	-23	-27	-53
複合地域	0	-1	-2	-3
複合資産	1,150	4,050	6,228	8,532
安定	42	-36	-375	-1,378
安定成長	670	2,556	4,596	6,145
成長	527	1,936	2,819	5,418
国内バランス	-68	-271	-524	-1,141
安定	-101	-359	-698	-1,461
一般	-1	-4	-12	-33
その他	-22	-135	-289	-513

<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	13,453	48,101	91,391	145,421
国内REIT	-250	-523	-277	-1,577
日本	-250	-523	-277	-1,577
外国REIT	-125	-740	-929	-1,890
グローバル	-45	-254	-181	-697
除く日本	10	-63	151	282
含む日本	-55	-191	-339	-992
北米	-52	-379	-522	-705
その他	-29	-107	-226	-488
欧州	-1	-1	-4	-9
アジア・オセアニア	-24	-88	-183	-384
オーストラリア	-3	-12	-28	-73
複合地域	0	-1	-1	-3
複数国	-1	-5	-9	-18
その他	598	716	1,874	1,423
絶対収益型	132	298	551	309
ロング・ショート	0	4	9	3
マーケットニュートラル	-3	-12	-42	-121
GTAA	-3	-8	-24	-63
その他スタイル	137	306	594	470
CB	-45	-164	-244	-144
アジア・オセアニア	-1	-1	-3	-4
日本	0	-1	-1	2
グローバル	-44	-162	-241	-142
コモディティ	327	788	1,446	1,817
全業種	38	75	202	248
貴金属	287	717	1,254	1,582
エネルギー	1	-4	-13	-18
その他コモディティ	0	1	3	5

< 4 > 純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別①

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	1,264,642	100.00	5,282	100.00
国内株式	168,388	13.32	757	14.33
一般	91,356	7.22	458	8.67
フリー	62,811	4.97	355	6.72
バリュー	28,546	2.26	103	1.95
小型	7,540	0.60	86	1.63
その他	68,004	5.38	207	3.92
日経225	32,560	2.57	72	1.36
TOPIX	28,453	2.25	83	1.57
JPX日経400	1,052	0.08	12	0.23
国内債券	43,742	3.46	150	2.84
一般	43,742	3.46	150	2.84
外国株式(先進国)	599,507	47.41	1,215	23.00
グローバル	379,341	30.00	842	15.94
除く日本	116,588	9.22	191	3.62
含む日本	262,754	20.78	651	12.32
その他	220,165	17.41	373	7.06
北米	4,735	0.37	12	0.23
米国	210,591	16.65	296	5.60
カナダ	143	0.01	3	0.06
欧州	1,971	0.16	35	0.66
ドイツ	20	0.00	1	0.02
アジア・オセアニア	36	0.00	1	0.02
オーストラリア	2,637	0.21	23	0.44
ニュージーランド	12	0.00	1	0.02
複合地域	22	0.00	1	0.02
エマージング株式	59,333	4.69	309	5.85
グローバル	13,903	1.10	93	1.76
BRICS	442	0.03	7	0.13
その他	44,987	3.56	209	3.96
欧州	102	0.01	6	0.11
ロシア	8	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	4,179	0.33	77	1.46
中国	958	0.08	32	0.61
インド	37,279	2.95	41	0.78
インドネシア	214	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	1,572	0.12	14	0.27
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	15	0.00	1	0.02
中南米	51	0.00	2	0.04
ブラジル	404	0.03	11	0.21
メキシコ	8	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	49	0.00	2	0.04
トルコ	54	0.00	2	0.04
複合地域	63	0.00	4	0.08

＜4＞純資産額、ファンド本数

「総合」およびファンド分類別②

	純資産額 (億円)	構成比(%)	本数	構成比(%)
総合	1,264,642	100.00	5,282	100.00
外国債券(先進国)	98,837	7.82	726	13.74
グローバル	80,975	6.40	520	9.84
除く日本	37,750	2.99	224	4.24
含む日本	43,225	3.42	296	5.60
その他	17,862	1.41	206	3.90
北米	205	0.02	8	0.15
米国	8,922	0.71	116	2.20
カナダ	579	0.05	3	0.06
欧州	1,076	0.09	23	0.44
イギリス	7	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	1,428	0.11	9	0.17
オーストラリア	4,579	0.36	32	0.61
ニュージーランド	61	0.00	3	0.06
複合地域	1,004	0.08	8	0.15
エマージング債券	11,431	0.90	217	4.11
グローバル	6,539	0.52	150	2.84
米ドル建て	4,564	0.36	114	2.16
現地通貨建て	1,975	0.16	36	0.68
その他	4,892	0.39	67	1.27
ロシア	12	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	218	0.02	6	0.11
中国	125	0.01	8	0.15
インド	2,756	0.22	16	0.30
インドネシア	336	0.03	7	0.13
ブラジル	1,183	0.09	20	0.38
メキシコ	205	0.02	3	0.06
トルコ	26	0.00	2	0.04
複合地域	31	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	20,806	1.65	214	4.05
グローバル	2,905	0.23	42	0.80
北米	16,232	1.28	110	2.08
その他	1,668	0.13	62	1.17
欧州	1,291	0.10	40	0.76
アジア・オセアニア	341	0.03	21	0.40
複合地域	36	0.00	1	0.02
複合資産	162,198	12.83	1,064	20.14
安定	38,374	3.03	284	5.38
安定成長	75,192	5.95	441	8.35
成長	40,066	3.17	300	5.68
国内バランス	5,503	0.44	26	0.49
安定	4,278	0.34	8	0.15
一般	265	0.02	14	0.27
その他	3,064	0.24	13	0.25

＜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	1,264,642	100.00	5,282	100.00
国内REIT	23,436	1.85	142	2.69
日本	23,436	1.85	142	2.69
外国REIT	46,392	3.67	263	4.98
グローバル	19,388	1.53	153	2.90
除く日本	8,714	0.69	64	1.21
含む日本	10,674	0.84	89	1.68
北米	24,543	1.94	66	1.25
その他	2,460	0.19	44	0.83
欧州	75	0.01	4	0.08
アジア・オセアニア	1,597	0.13	24	0.45
オーストラリア	482	0.04	12	0.23
複合地域	60	0.00	3	0.06
複数国	247	0.02	1	0.02
その他	30,572	2.42	225	4.26
絶対収益型	12,510	0.99	85	1.61
ロング・ショート	855	0.07	25	0.47
マーケットニュートラル	305	0.02	13	0.25
GTAA	299	0.02	9	0.17
その他スタイル	10,964	0.87	37	0.70
CB	2,679	0.21	43	0.81
アジア・オセアニア	31	0.00	1	0.02
日本	28	0.00	1	0.02
グローバル	2,620	0.21	41	0.78
コモディティ	8,782	0.69	39	0.74
全業種	2,023	0.16	12	0.23
貴金属	6,674	0.53	25	0.47
エネルギー	53	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	15,726	10.6	2.88	2.88	1.048
国内株式	23,017	14.8	1.63	1.57	0.973
一般	21,603	14.7	2.34	2.28	1.348
フリー	20,962	14.3	1.82	1.76	1.405
バリュー	23,811	15.9	3.59	3.46	1.224
小型	25,705	15.4	1.47	1.46	1.675
その他	25,149	14.8	0.49	0.42	0.376
日経225	26,958	16.4	0.44	0.37	0.428
TOPIX	26,666	15.7	0.11	0.10	0.226
JPX日経400	24,581	9.9	0.49	0.42	0.462
国内債券	10,200	12.6	0.10	0.11	0.471
一般	10,200	12.6	0.10	0.11	0.471
外国株式(先進国)	19,518	8.1	3.62	3.66	1.039
グローバル	20,072	8.2	2.86	2.84	1.136
除く日本	30,701	11.1	0.59	0.59	0.497
含む日本	16,954	7.3	3.87	3.84	1.420
その他	18,269	7.8	4.94	5.08	0.872
北米	18,827	6.4	0.46	0.47	0.760
米国	19,083	6.9	5.01	5.16	0.857
カナダ	7,286	8.9	8.96	9.14	1.895
欧州	16,989	13.2	3.15	3.03	1.282
ドイツ	19,306	10.4	0.00	0.00	0.770
アジア・オセアニア	11,267	18.2	8.56	8.32	1.823
オーストラリア	11,439	9.6	2.87	2.76	1.672
ニュージーランド	18,110	12.1	13.44	14.97	1.705
複合地域	11,355	11.3	3.92	3.51	1.662
エマージング株式	15,045	11.3	0.78	0.79	0.991
グローバル	15,283	9.0	0.83	0.81	2.052
BRICS	16,379	18.3	4.88	4.35	1.865
その他	14,894	12.0	0.80	0.71	1.939
欧州	9,316	18.2	0.00	0.00	1.187
ロシア	968	15.3	2.66	2.62	1.722
アジア・オセアニア	15,810	13.8	0.72	0.83	1.913
中国	11,708	10.0	5.42	4.76	1.881
インド	19,835	10.3	1.13	1.26	1.777
インドネシア	12,132	9.8	2.22	2.53	1.815
タイ	15,780	13.7	0.49	0.45	1.703
フィリピン	12,201	12.0	2.37	2.53	1.861
ベトナム	17,879	6.6	0.00	0.00	1.804
韓国	13,406	5.7	2.92	3.06	0.858
香港	13,084	15.0	1.39	1.51	2.037
中南米	10,698	17.6	3.35	4.14	1.967
ブラジル	6,040	13.2	2.74	3.25	1.667
メキシコ	12,303	11.4	0.44	0.38	2.227
中東・アフリカ	14,966	16.5	3.34	3.03	2.026
トルコ	17,330	23.1	1.68	1.55	0.955
複合地域	17,229	8.4	-	-	-

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

実績分配金利回り(%)、予想分配金利回り(%)、運用管理費用(%)は純資産額加重平均値

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目録見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

実績分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数+実績決算回数))÷1年前もしくは設定日の基準価額×100

予想分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数+実績決算回数))÷当月末の基準価額×100

< 5 > 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別②

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	15,726	10.6	2.88	2.88	1.048
外国債券(先進国)	10,581	11.1	1.21	1.18	0.949
グローバル	11,041	11.1	1.04	1.03	0.899
除く日本	12,324	13.5	0.71	0.69	0.685
含む日本	10,070	9.3	1.35	1.34	1.085
その他	9,418	11.0	1.95	1.86	1.178
北米	10,571	8.1	1.71	1.67	1.121
米国	10,130	8.4	1.87	1.80	1.109
カナダ	8,497	14.8	1.52	1.46	1.378
欧州	7,699	16.7	1.33	1.31	1.001
イギリス	7,319	9.2	3.87	3.56	1.393
アジア・オセアニア	9,808	14.4	2.44	2.31	1.435
オーストラリア	8,909	15.0	2.12	2.01	1.243
ニュージーランド	10,260	10.5	1.58	1.42	1.405
複合地域	5,565	14.3	2.04	2.01	1.193
エマージング債券	10,287	12.6	3.37	3.46	1.362
グローバル	10,660	13.1	2.05	2.01	1.154
米ドル建て	10,491	13.7	2.36	2.27	1.319
現地通貨建て	11,194	11.2	1.35	1.41	0.773
その他	9,453	11.5	5.13	5.41	1.639
ロシア	2,156	11.6	0.00	0.00	1.596
アジア・オセアニア	10,071	13.7	6.64	6.61	1.626
中国	12,023	4.9	1.27	1.21	1.235
インド	10,300	10.0	5.88	6.03	1.707
インドネシア	9,886	11.8	4.89	5.13	1.667
ブラジル	10,126	14.2	3.88	4.49	1.581
メキシコ	8,221	11.9	4.21	4.99	1.368
トルコ	1,303	11.9	4.78	6.02	1.474
複合地域	4,327	18.0	1.41	1.39	1.210
ハイイールド債券	9,429	12.8	4.77	4.67	1.645
グローバル	8,562	11.4	2.92	2.78	1.412
北米	10,593	13.8	4.94	4.85	1.674
その他	7,953	11.9	6.29	6.21	1.767
欧州	8,375	11.4	5.61	5.48	1.739
アジア・オセアニア	7,295	12.4	8.97	9.09	1.868
複合地域	4,890	20.4	5.13	4.91	1.800
複合資産	14,480	10.0	1.15	1.16	0.909
安定	11,817	10.1	1.54	1.57	1.041
安定成長	14,006	10.4	1.26	1.26	0.919
成長	17,965	9.4	0.38	0.38	0.772
国内バランス	13,027	11.8	2.15	2.23	0.962
安定	10,731	12.8	1.70	1.77	0.913
一般	14,505	12.5	1.13	1.07	1.208
その他	11,211	4.4	1.49	1.37	0.677

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

実績分配金利回り(%)、予想分配金利回り(%)、運用管理費用(%)は純資産額加重平均値

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

実績分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数÷実績決算回数))÷1年前もしくは設定日の基準価額×100

予想分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数÷実績決算回数))÷当月末の基準価額×100

<5> 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別③

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	15,726	10.6	2.88	2.88	1.048
国内REIT	13,579	10.6	6.49	7.71	0.880
日本	13,579	10.6	6.49	7.71	0.880
外国REIT	13,868	10.1	7.55	7.32	1.430
グローバル	15,269	9.6	3.03	2.83	1.164
除く日本	17,232	8.3	1.89	1.82	0.931
含む日本	13,858	10.6	3.97	3.66	1.354
北米	12,874	11.1	11.20	10.91	1.609
その他	10,489	10.3	6.60	6.76	1.739
欧州	5,080	11.4	5.05	4.63	1.920
アジア・オセアニア	11,178	9.7	8.32	8.76	1.796
オーストラリア	11,314	9.9	4.18	3.70	1.689
複合地域	8,244	12.6	0.85	0.72	0.773
複数国	12,409	20.3	2.08	1.93	1.650
その他					
絶対収益型	10,716	7.2	0.04	0.04	1.922
ロング・ショート	10,557	6.4	0.11	0.11	1.704
マーケットニュートラル	10,223	6.8	0.93	0.94	1.246
GTAA	11,753	11.3	0.43	0.43	1.563
その他スタイル	10,698	6.9	0.00	0.00	1.972
CB	12,034	7.7	0.32	0.33	1.184
アジア・オセアニア	10,726	14.2	2.27	2.24	1.823
日本	14,645	24.8	0.36	0.34	0.770
グローバル	12,003	7.1	0.30	0.30	1.181
コモディティ	14,214	7.4	0.07	0.07	0.871
全業種	10,919	11.9	0.29	0.32	1.245
貴金属	15,322	4.9	0.00	0.00	0.758
エネルギー	20,910	15.5	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	19,381	7.9	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、川眞田

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