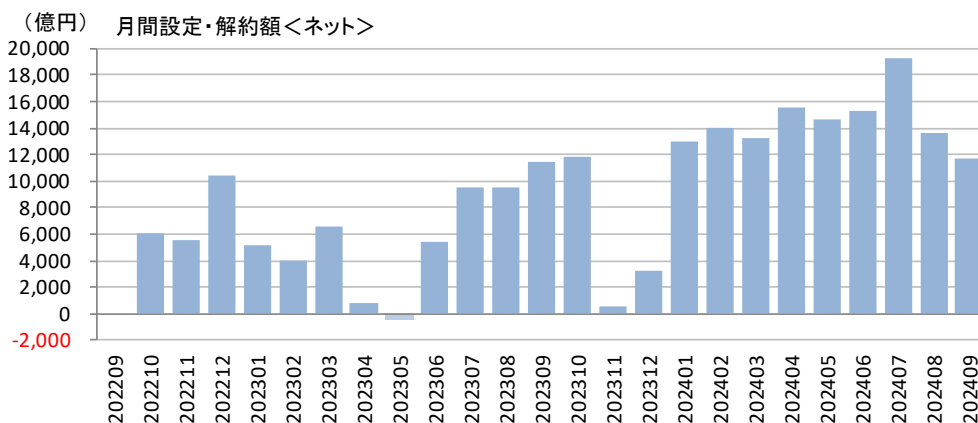
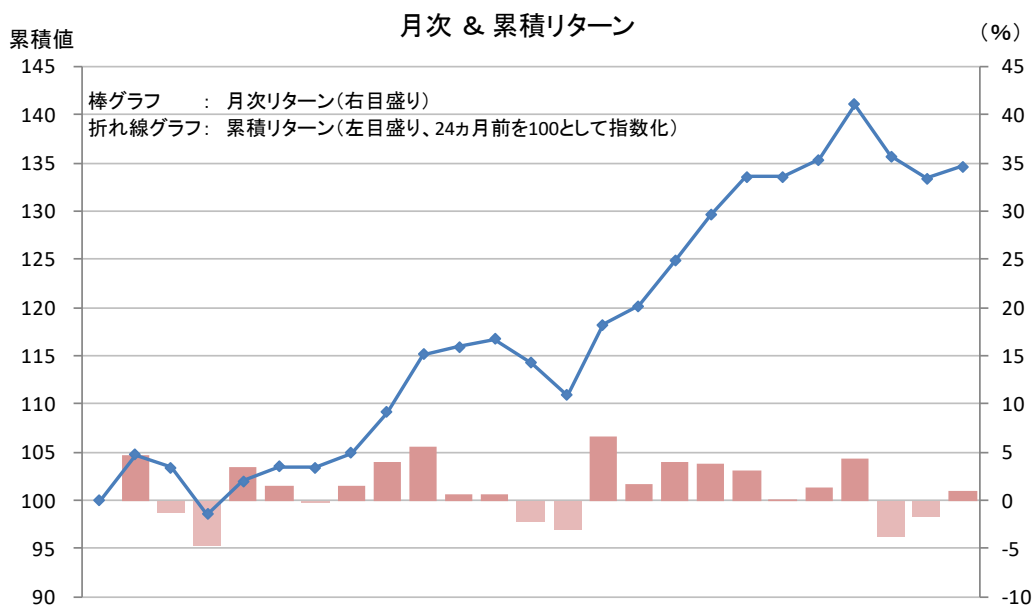


# 投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

## 2024年9月

「総合」 +0.94 %  
(前月 -1.70 %)



# 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

## &lt;1&gt;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		20,228	20,039	189	0.94
国内株式		27,122	27,339	-218	-0.80
一般		26,344	26,432	-88	-0.33
フリー		24,439	24,486	-47	-0.19
バリュー		35,344	35,574	-230	-0.65
小型		45,291	45,086	205	0.45
その他		27,711	28,148	-438	-1.55
日経225		26,663	27,016	-353	-1.31
TOPIX		27,435	27,868	-433	-1.55
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	26,208	26,694	-486	-1.82
国内債券		12,316	12,278	39	0.32
一般		12,316	12,278	39	0.32
外国株式(先進国)		29,442	29,028	415	1.43
グローバル		31,269	30,804	465	1.51
除く日本		51,049	50,362	687	1.36
含む日本		27,016	26,598	418	1.57
その他		25,257	24,935	323	1.29
北米		32,228	31,802	426	1.34
米国		39,378	38,883	495	1.27
カナダ	10,000 (2009.02.27)	24,124	23,876	248	1.04
欧州		30,776	30,561	215	0.70
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	16,295	15,943	352	2.21
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	46,696	44,879	1,816	4.05
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	24,817	24,012	805	3.35
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	49,129	49,848	-718	-1.44
複合地域	10,000 (2013.04.30)	15,579	16,348	-769	-4.70
エマージング株式		25,780	24,996	784	3.14
グローバル		24,277	23,090	1,186	5.14
BRICS	10,000 (2005.09.30)	28,586	26,985	1,601	5.93
その他		27,588	26,917	671	2.49
欧州		19,891	19,231	660	3.43
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,190	1,080	110	10.16
アジア・オセアニア		22,455	21,248	1,207	5.68
中国		36,860	32,212	4,648	14.43
インド	10,000 (2004.09.30)	76,912	75,445	1,466	1.94
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	18,052	17,365	687	3.96
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	9,169	8,615	555	6.44
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	27,607	27,425	183	0.67
韓国	10,000 (1997.06.30)	30,430	29,803	627	2.10
香港		25,245	21,851	3,394	15.53
中南米	7,427 (2006.04.28)	11,588	11,715	-128	-1.09
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,815	9,890	-76	-0.76
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	15,610	15,585	25	0.16
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	15,736	15,208	528	3.47
トルコ		48,991	49,722	-731	-1.47
複合地域	10,000 (2005.08.31)	29,093	28,193	900	3.19

※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

## &lt;1&gt;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		20,228	20,039	189	0.94
外国債券(先進国)		19,793	19,720	72	0.37
グローバル		19,664	19,601	63	0.32
除く日本		21,987	21,905	82	0.37
含む日本		18,161	18,111	50	0.28
その他		20,616	20,499	117	0.57
北米	9,052 (2013.05.31)	11,358	11,293	65	0.58
米国		19,053	18,936	117	0.62
カナダ	10,000 (2003.05.30)	18,171	18,231	-60	-0.33
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,305	15,132	173	1.14
イギリス	10,069 (2014.07.31)	12,576	12,530	46	0.37
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	23,365	23,223	142	0.61
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	28,941	28,773	168	0.58
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	12,925	12,857	68	0.53
複合地域	10,000 (2001.11.30)	19,889	19,883	6	0.03
エマージング債券		21,646	21,450	196	0.91
グローバル		22,336	22,041	294	1.34
米ドル建て		22,846	22,600	247	1.09
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	15,959	15,661	297	1.90
その他	8,647 (2005.03.31)	16,775	16,716	58	0.35
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,636	1,718	-82	-4.77
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	17,392	17,288	104	0.60
中国	13,833 (2018.07.31)	19,722	19,555	167	0.85
インド	10,000 (2011.08.31)	22,251	22,378	-128	-0.57
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	20,641	20,292	349	1.72
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	15,541	15,282	259	1.70
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	18,765	18,355	410	2.23
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,337	2,345	-9	-0.37
複合地域	10,000 (2006.08.31)	13,070	12,807	263	2.06
ハイイールド債券		30,645	30,455	191	0.63
グローバル	10,000 (1997.06.30)	28,648	28,454	194	0.68
北米		31,063	30,885	178	0.58
その他	10,000 (2004.03.31)	27,408	27,133	275	1.01
欧州	10,000 (2006.04.28)	27,979	27,673	306	1.11
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	16,502	16,373	129	0.79
複合地域	10,000 (2004.03.31)	27,096	27,143	-48	-0.18
複合資産		21,806	21,687	119	0.55
安定	10,000 (1998.10.30)	17,168	17,087	81	0.48
安定成長		24,376	24,234	142	0.59
成長		32,010	31,853	157	0.49
国内バランス		12,529	12,539	-10	-0.08
安定		12,485	12,475	10	0.08
一般		18,474	18,668	-194	-1.04
その他	10,000 (2018.10.31)	14,510	14,178	331	2.34

※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

## &lt;1&gt;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		20,228	20,039	189	0.94
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	33,849	34,400	-551	-1.60
日本	10,000 (2003.10.31)	33,849	34,400	-551	-1.60
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	41,484	40,612	872	2.15
グローバル	10,000 (2004.01.30)	34,456	33,538	917	2.74
除く日本	10,000 (2004.04.30)	39,311	38,115	1,196	3.14
含む日本	10,000 (2004.01.30)	33,674	32,882	791	2.41
北米	10,000 (2003.09.30)	44,061	43,441	621	1.43
その他	10,000 (2004.04.30)	35,159	33,577	1,582	4.71
欧州	10,000 (2006.12.29)	6,179	6,021	158	2.63
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	25,194	24,019	1,175	4.89
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	21,950	20,638	1,312	6.36
複合地域	10,000 (2007.06.29)	9,264	8,777	487	5.55
複数国	10,000 (2004.04.30)	51,886	51,474	412	0.80
その他		7,645	7,514	131	1.75
絶対収益型		7,757	7,676	81	1.06
ロング・ショート		8,329	8,313	16	0.19
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,891	11,820	71	0.60
GTAA		11,720	11,708	12	0.10
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,295	7,211	84	1.17
CB		21,072	20,940	132	0.63
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	23,758	22,717	1,040	4.58
日本		21,586	21,548	38	0.18
グローバル		36,728	36,514	214	0.59
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	15,085	14,605	480	3.29
全業種	10,000 (2004.12.30)	12,020	11,837	183	1.55
貴金属	10,000 (2009.07.31)	26,639	25,636	1,002	3.91
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	10,024	10,828	-804	-7.43
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	17,877	17,546	331	1.89

※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か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	-4.58	0.79	17.79	12.04
国内株式	-4.48	-3.92	15.81	13.25
一般	-4.35	-2.82	15.54	13.69
フリー	-4.24	-2.62	15.97	13.80
バリュー	-4.58	-3.23	14.50	13.48
小型	-2.38	-4.76	7.47	4.97
その他	-4.83	-5.35	17.41	13.80
日経225	-3.61	-5.50	20.59	14.74
TOPIX	-4.95	-3.40	16.30	14.04
JPX日経400	-4.86	-2.41	17.93	15.28
国内債券	1.38	-0.79	-0.27	-1.19
一般	1.38	-0.79	-0.27	-1.19
外国株式(先進国)	-6.65	1.50	25.71	16.69
グローバル	-5.94	1.34	24.60	15.42
除く日本	-5.88	3.02	26.05	18.92
含む日本	-5.97	0.62	23.97	13.93
その他	-7.85	1.83	27.93	19.23
北米	-9.67	2.08	27.15	20.64
米国	-7.94	1.82	28.23	19.44
カナダ	-2.97	-0.55	10.12	7.97
欧州	-3.72	1.99	19.17	12.33
ドイツ	-1.35	1.66	25.85	16.42
アジア・オセアニア	-4.43	4.03	16.62	15.03
オーストラリア	-0.45	3.62	19.83	12.50
ニュージーランド	-6.48	-3.39	5.21	-0.50
複合地域	-14.09	-11.56	-5.99	5.66
エマージング株式	-4.68	8.55	22.93	19.66
グローバル	-3.55	6.36	21.01	17.47
BRICS	-1.57	7.50	15.16	13.57
その他	-5.07	9.32	23.75	20.58
欧州	-7.54	6.72	37.20	16.96
ロシア	9.27	9.68	9.01	10.60
アジア・オセアニア	-3.36	7.56	16.65	16.33
中国	-0.83	4.56	-2.77	6.44
インド	-5.40	10.98	28.73	23.08
インドネシア	5.58	-3.07	-3.20	2.26
フィリピン	7.76	2.77	13.63	14.37
ベトナム	-5.73	-3.03	10.76	17.73
韓国	-15.70	-8.49	-1.13	-5.72
香港	5.34	22.11	17.41	26.08
中南米	-7.19	-14.87	-3.31	-12.97
ブラジル	-4.09	-11.63	-2.53	-12.49
メキシコ	-13.86	-24.66	-6.10	-14.94
中東・アフリカ	0.33	6.87	16.49	16.08
トルコ	-18.64	4.54	6.30	25.50
複合地域	-3.68	0.73	13.65	6.51

※[色塗りの基準]期間別リターン&gt;総合

## &lt;1&gt;パフォーマンス・サマリー

## (2) 期間別リターン

## 「総合」およびファンド分類別②

	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	-4.58	0.79	17.79	12.04
外国債券(先進国)	-3.06	0.31	6.53	2.92
グローバル	-2.98	0.04	5.91	2.66
除く日本	-4.42	0.07	7.28	3.35
含む日本	-1.71	0.04	4.82	2.11
その他	-3.43	1.54	9.39	4.10
北米	-3.68	0.36	8.18	3.50
米国	-2.08	1.42	10.60	3.84
カナダ	-6.66	-1.27	4.24	2.38
欧州	-1.72	1.20	9.09	3.51
イギリス	-3.97	1.29	14.96	6.29
アジア・オセアニア	-4.61	2.21	8.81	4.45
オーストラリア	-4.93	2.12	9.01	4.67
ニュージーランド	-2.69	5.38	13.36	5.49
複合地域	-6.07	-0.21	6.28	3.50
エマージング債券	-5.84	-2.20	6.52	3.91
グローバル	-4.07	0.17	11.49	6.28
米ドル建て	-4.40	0.04	12.81	6.93
現地通貨建て	-3.29	0.50	8.22	4.64
その他	-8.15	-5.30	0.33	0.81
ロシア	-19.54	225.40	230.57	229.54
アジア・オセアニア	-3.84	1.54	8.24	7.25
中国	-3.94	1.25	4.80	5.94
インド	-9.03	-2.53	2.37	5.40
インドネシア	0.04	2.10	3.66	7.21
ブラジル	-8.57	-12.57	-6.23	-9.22
メキシコ	-12.41	-17.25	-4.64	-9.45
トルコ	-10.38	-1.08	-8.22	-5.08
複合地域	-4.59	-1.76	7.92	4.27
ハイイールド債券	-5.87	-0.19	8.89	6.85
グローバル	-4.20	0.41	10.59	6.48
北米	-6.33	-0.42	8.39	6.96
その他	-4.06	1.08	10.70	6.50
欧州	-3.56	1.26	10.66	5.66
アジア・オセアニア	-5.69	0.48	10.92	9.68
複合地域	-5.92	0.04	9.76	6.56
複合資産	-2.28	0.40	10.72	7.33
安定	-1.69	-0.17	6.76	4.34
安定成長	-2.55	0.62	11.35	7.87
成長	-3.12	0.65	14.57	10.76
国内バランス	0.35	-1.57	0.56	0.34
安定	0.92	-1.37	-0.18	-0.49
一般	-3.16	-3.45	6.14	5.44
その他	2.96	4.19	27.68	10.03

※[色塗りの基準]期間別リターン&gt; 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カ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	-4.58	0.79	17.79	12.04
国内REIT	0.81	-2.13	-3.37	-1.21
日本	0.81	-2.13	-3.37	-1.21
外国REIT	3.10	7.89	24.74	12.32
グローバル	3.78	7.95	25.06	12.36
除く日本	4.29	8.94	27.57	13.80
含む日本	3.36	7.16	23.16	11.22
北米	2.23	7.94	25.22	12.58
その他	6.57	6.90	18.50	9.67
欧州	0.53	3.80	21.02	6.33
アジア・オセアニア	7.87	7.69	14.78	7.66
オーストラリア	5.96	5.62	34.35	18.20
複合地域	2.46	4.31	23.34	12.21
複数国	2.36	5.61	15.60	8.74
その他	-2.49	0.64	15.50	9.96
絶対収益型	-0.45	-0.46	4.51	3.19
ロング・ショート	-0.44	-1.36	1.97	1.92
マーケットニュートラル	1.41	2.43	5.13	4.92
GTAA	-2.38	-1.40	3.75	3.25
その他スタイル	-0.44	-0.45	4.76	3.24
CB	-1.80	-0.36	3.42	2.65
アジア・オセアニア	-5.10	1.99	8.24	10.95
日本	-1.79	-3.96	6.59	4.06
グローバル	-1.75	-0.35	3.33	2.54
コモディティ	-0.28	7.54	20.62	19.52
全業種	-11.76	-3.36	-4.80	5.26
貴金属	4.09	11.62	32.85	24.85
エネルギー	-20.72	-13.93	-13.67	3.12
その他コモディティ	-7.99	-0.14	4.45	11.93

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

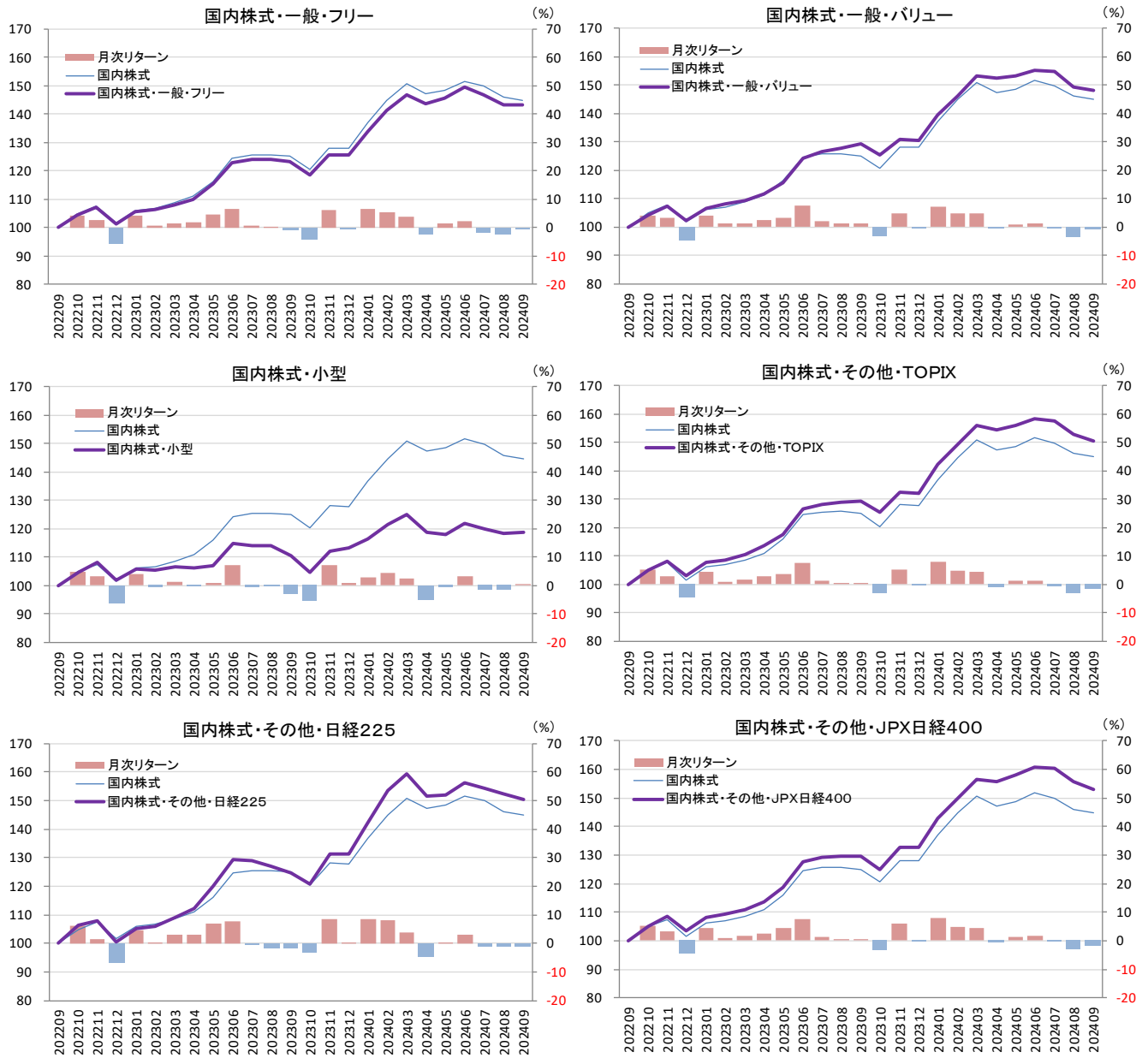


<1>パフォーマンス・サマリー

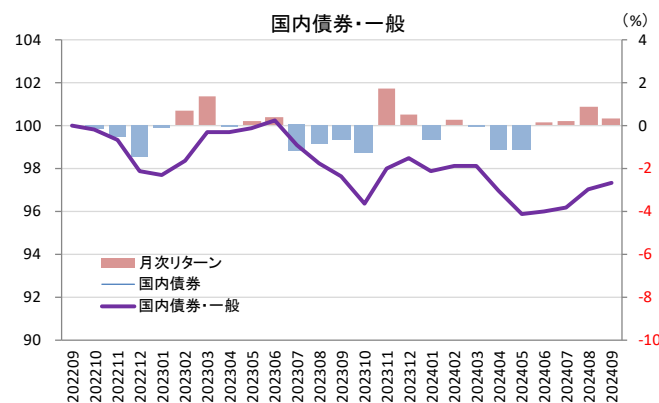
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

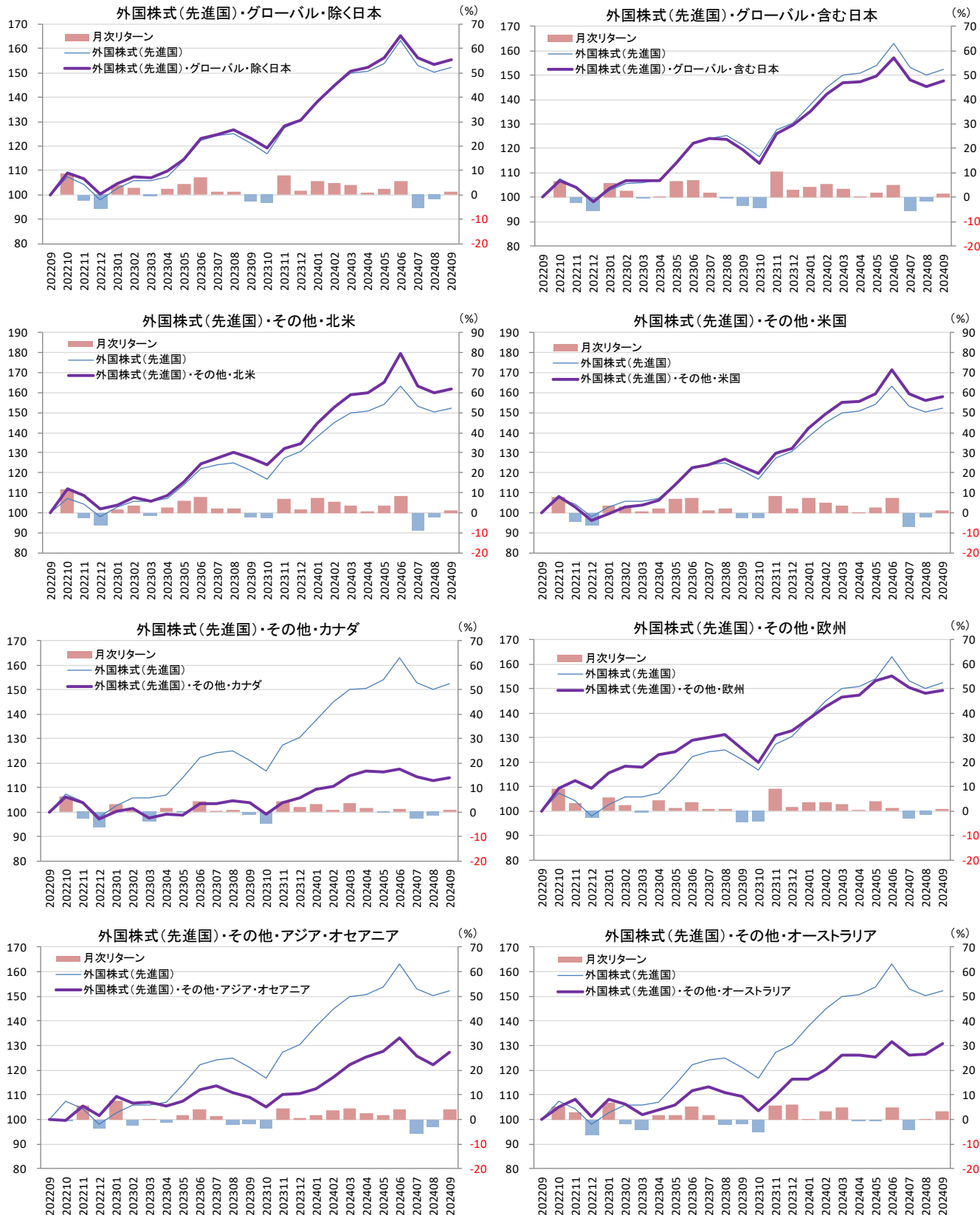


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

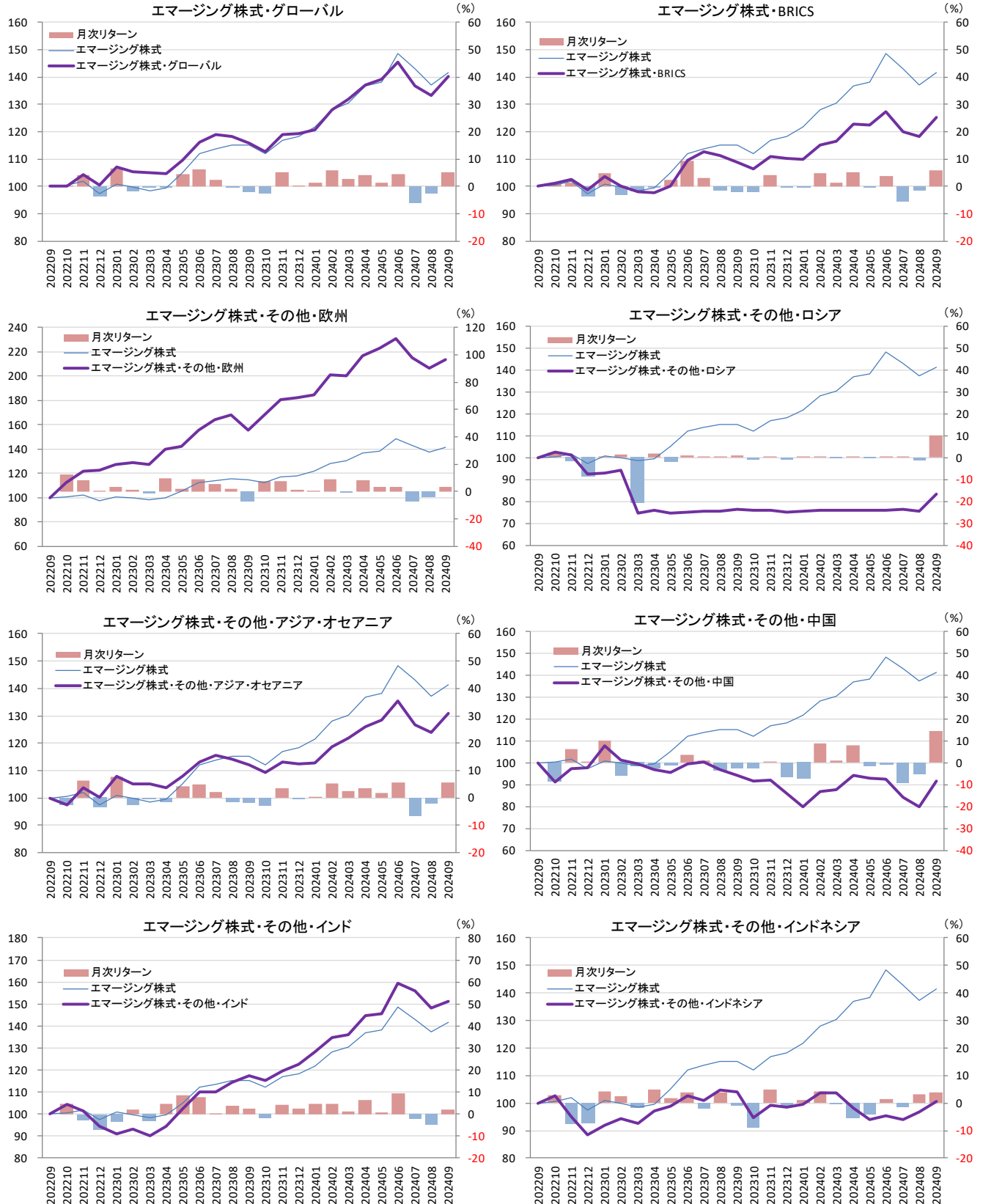


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

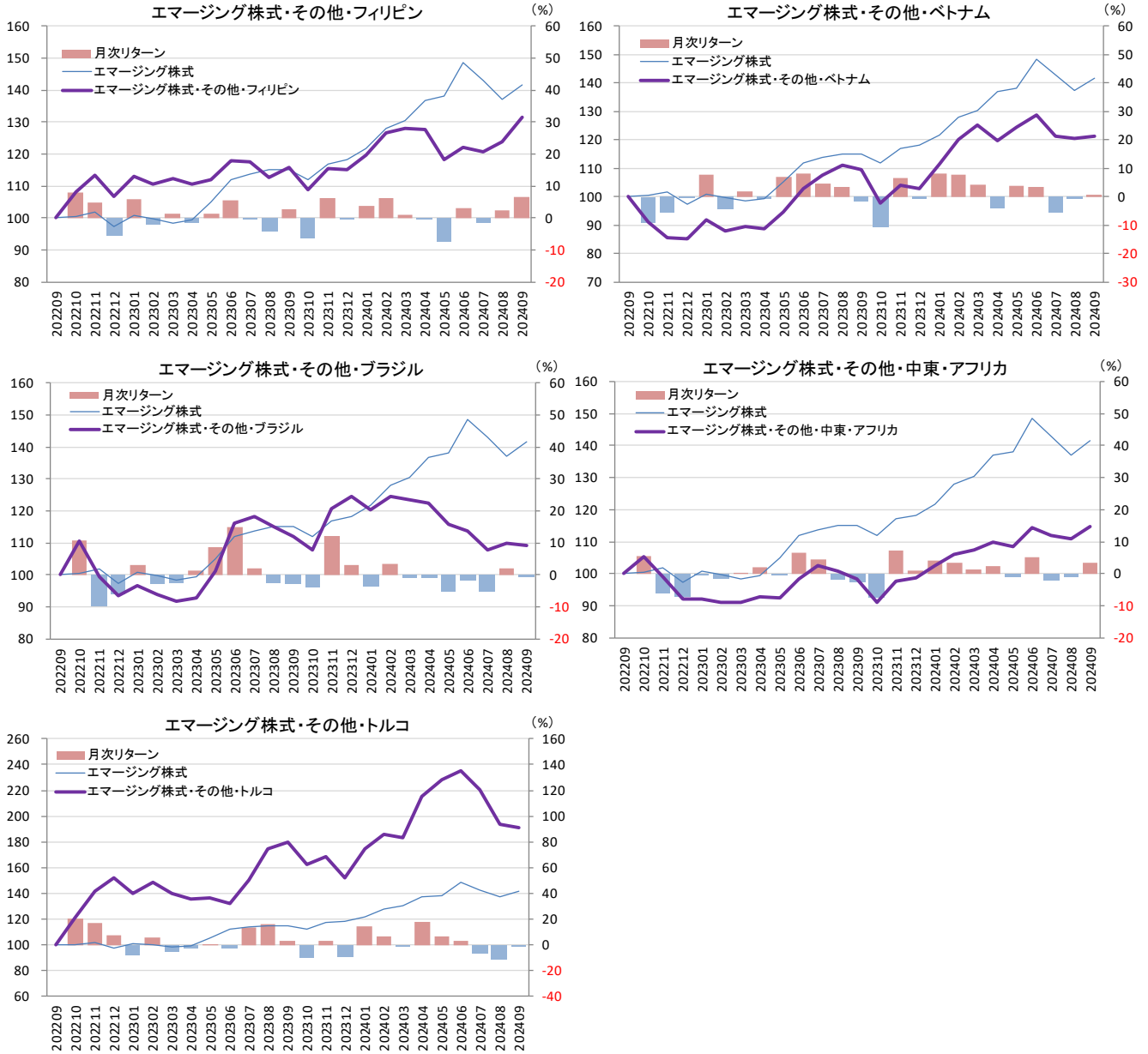


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

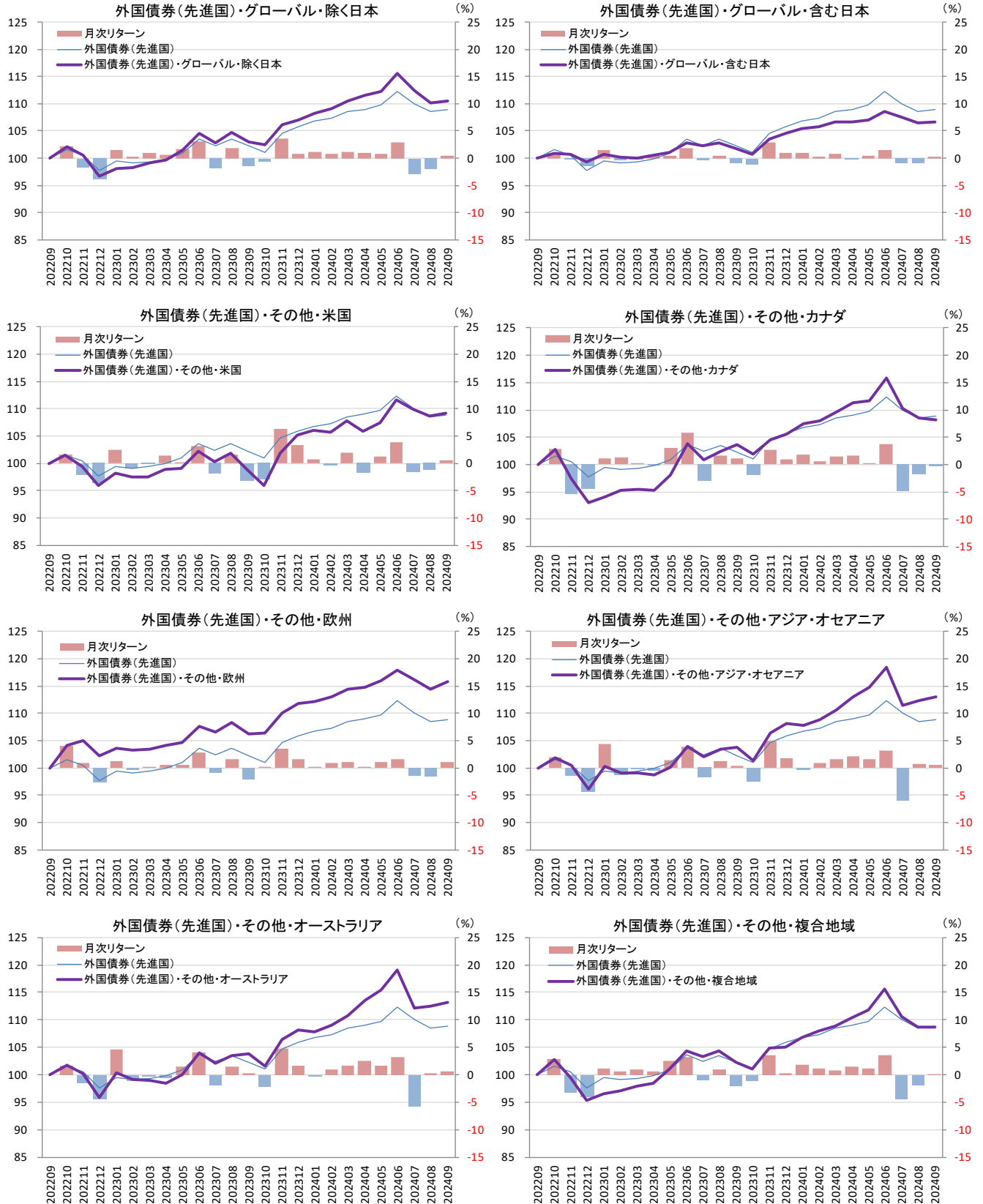


<1>パフォーマンス・サマリー

(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)]

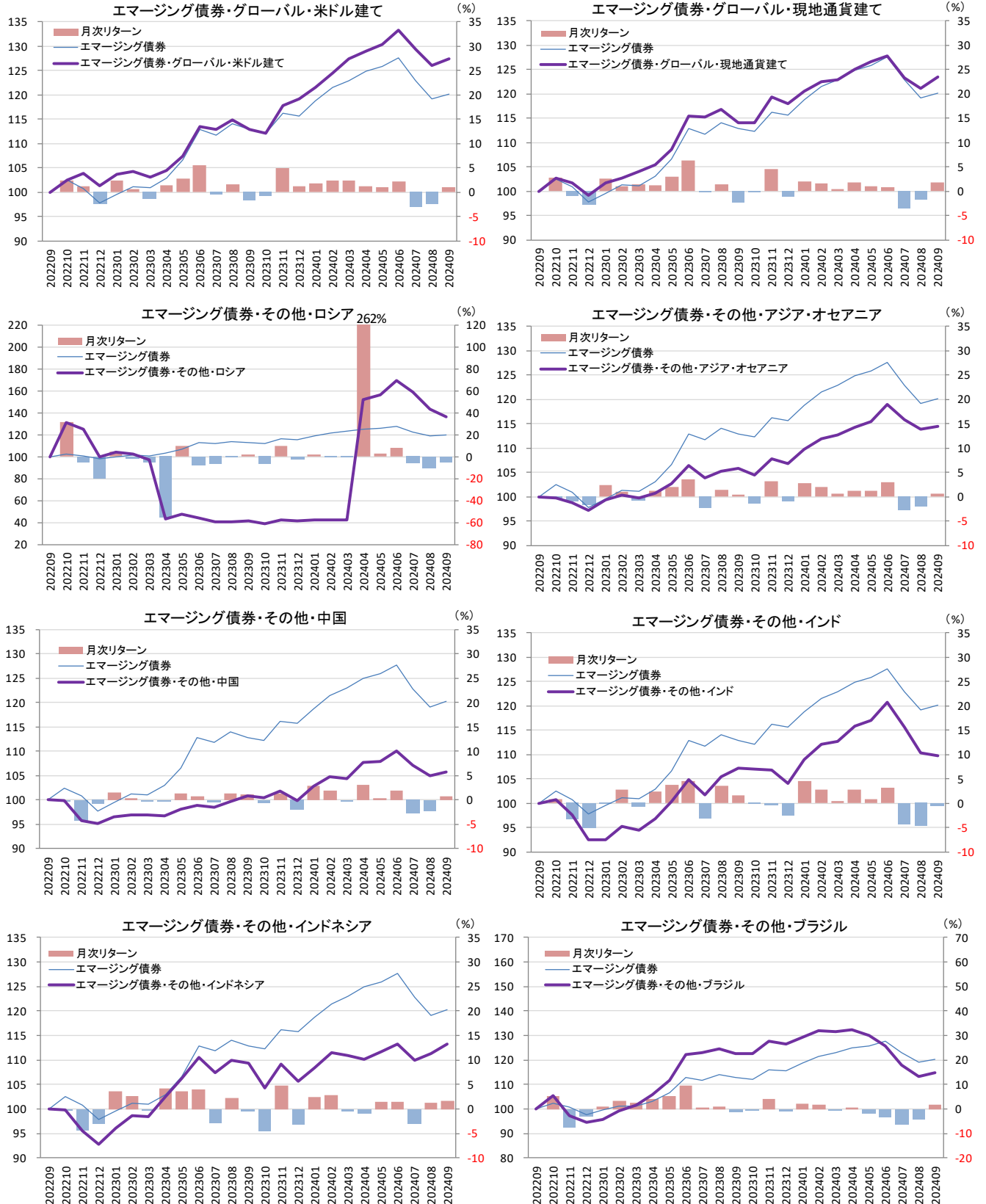


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]

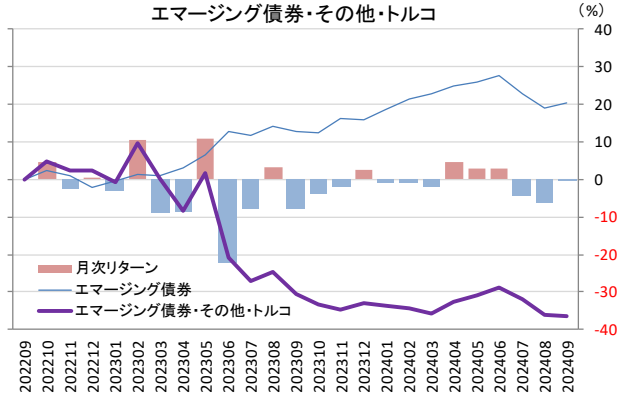
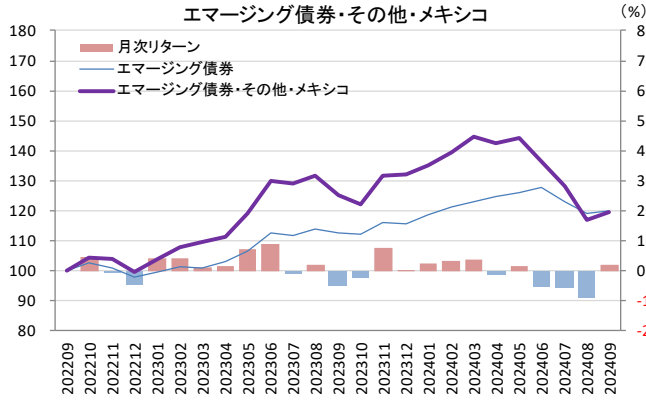


<1>パフォーマンス・サマリー

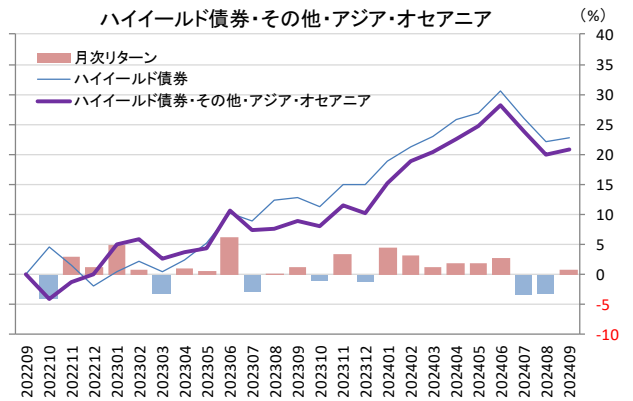
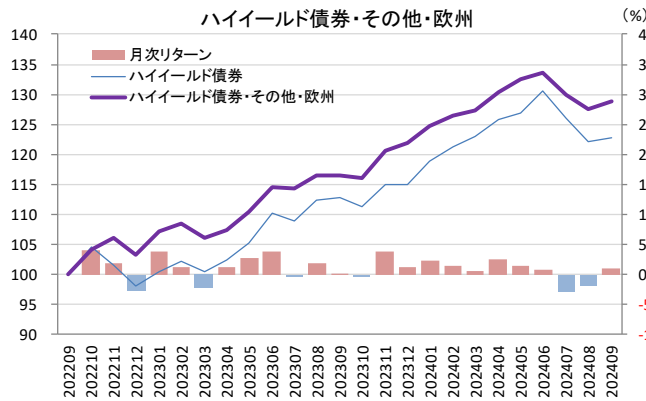
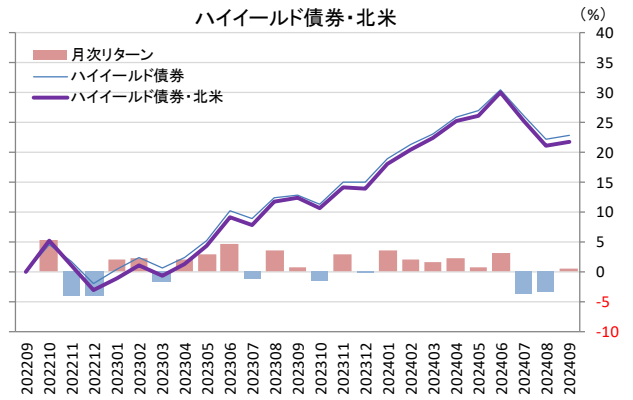
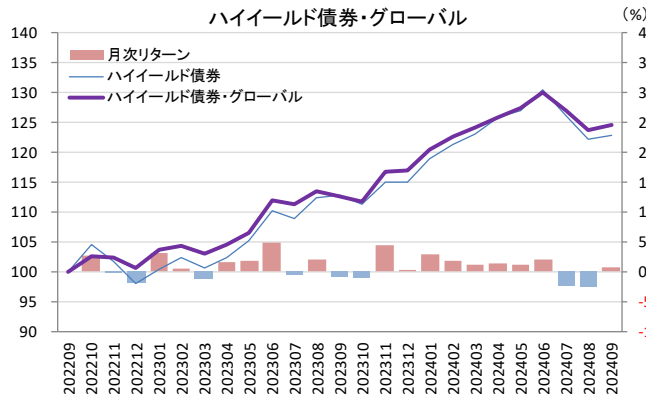
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

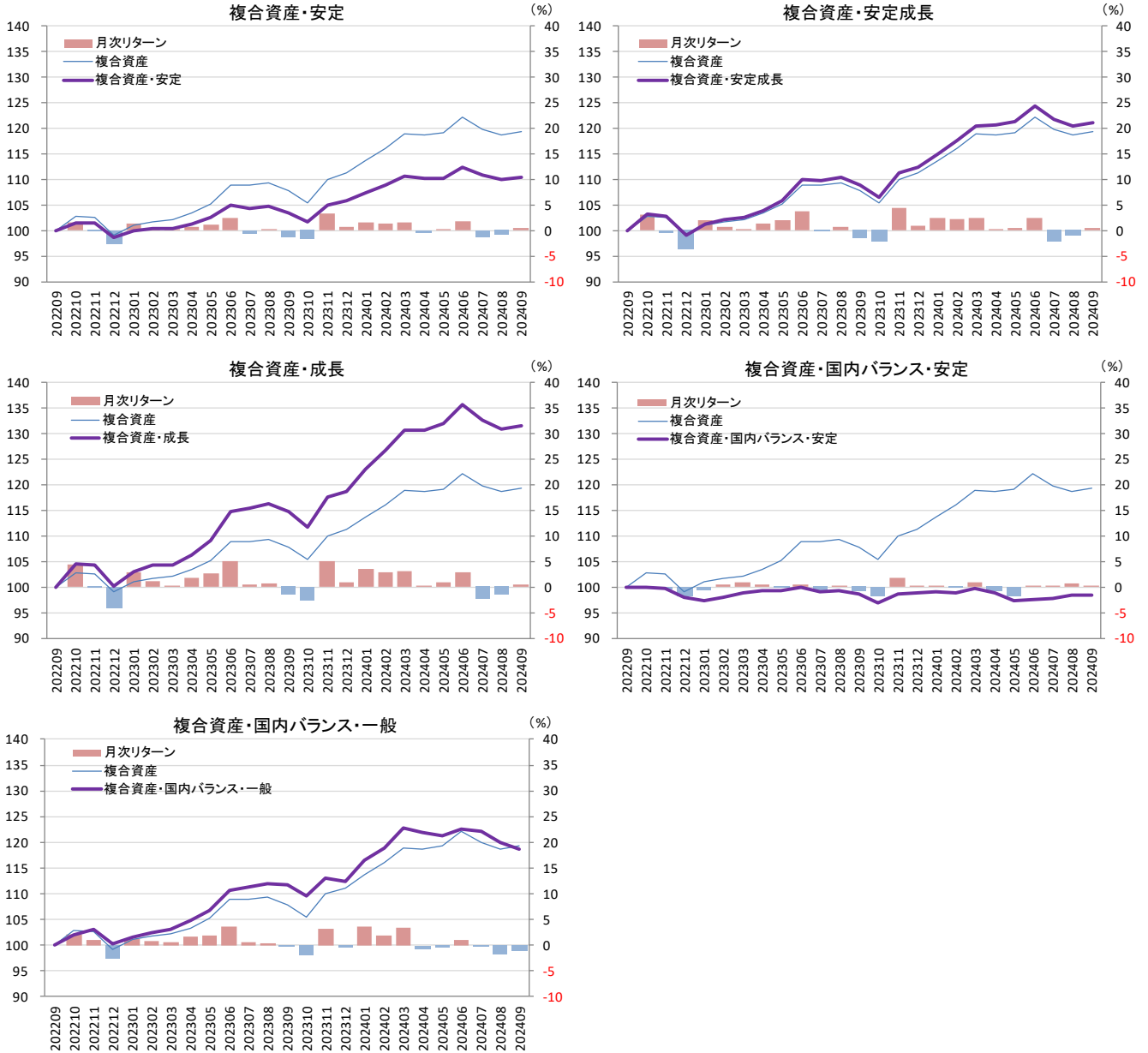


<1>パフォーマンス・サマリー

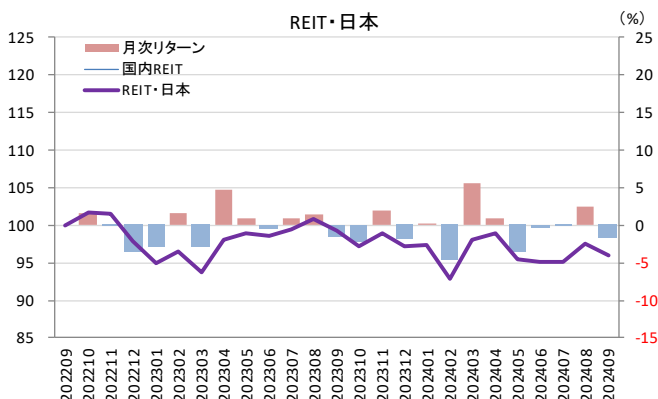
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]



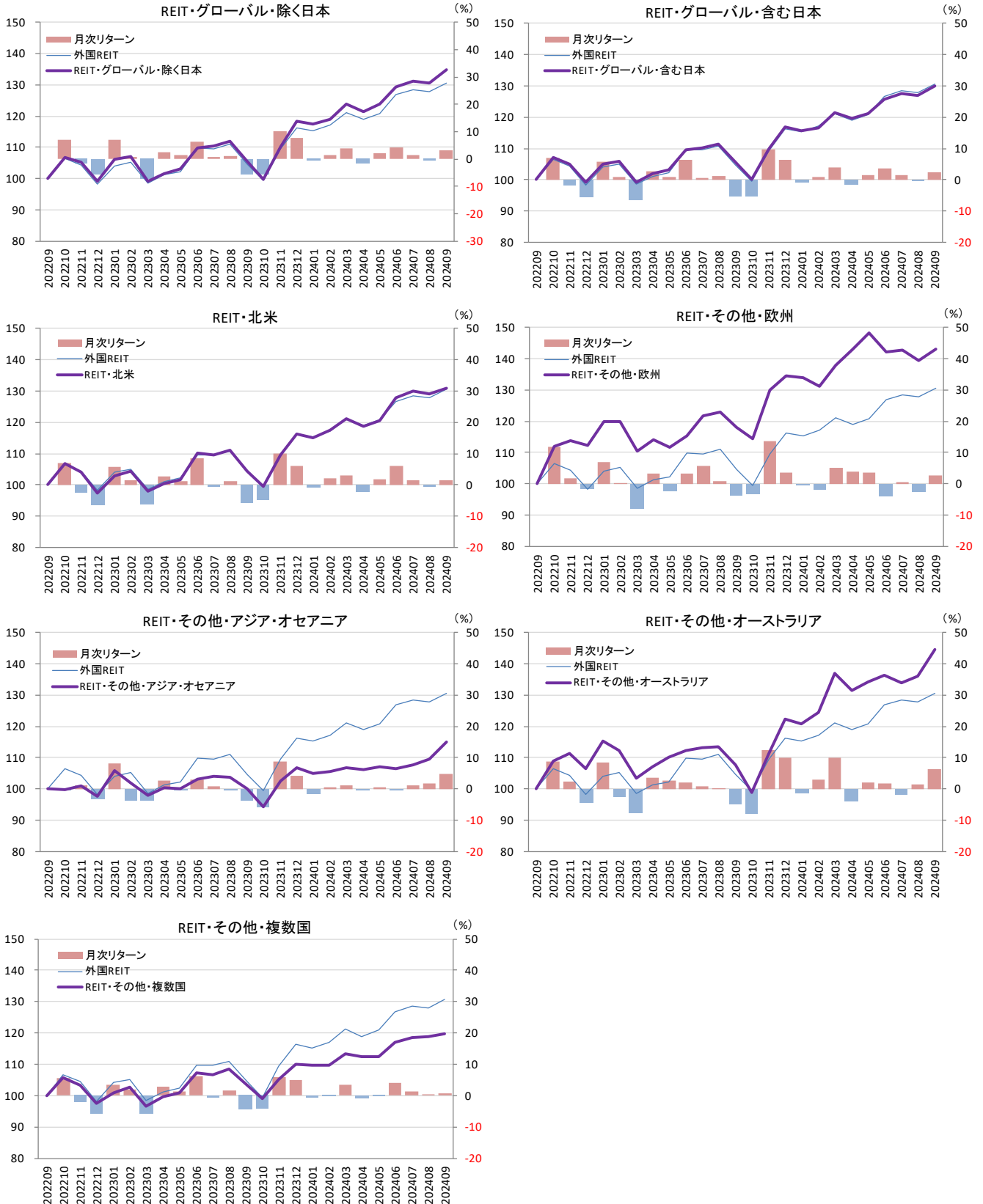


<1>パフォーマンス・サマリー

(3) リターン推移 (24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]

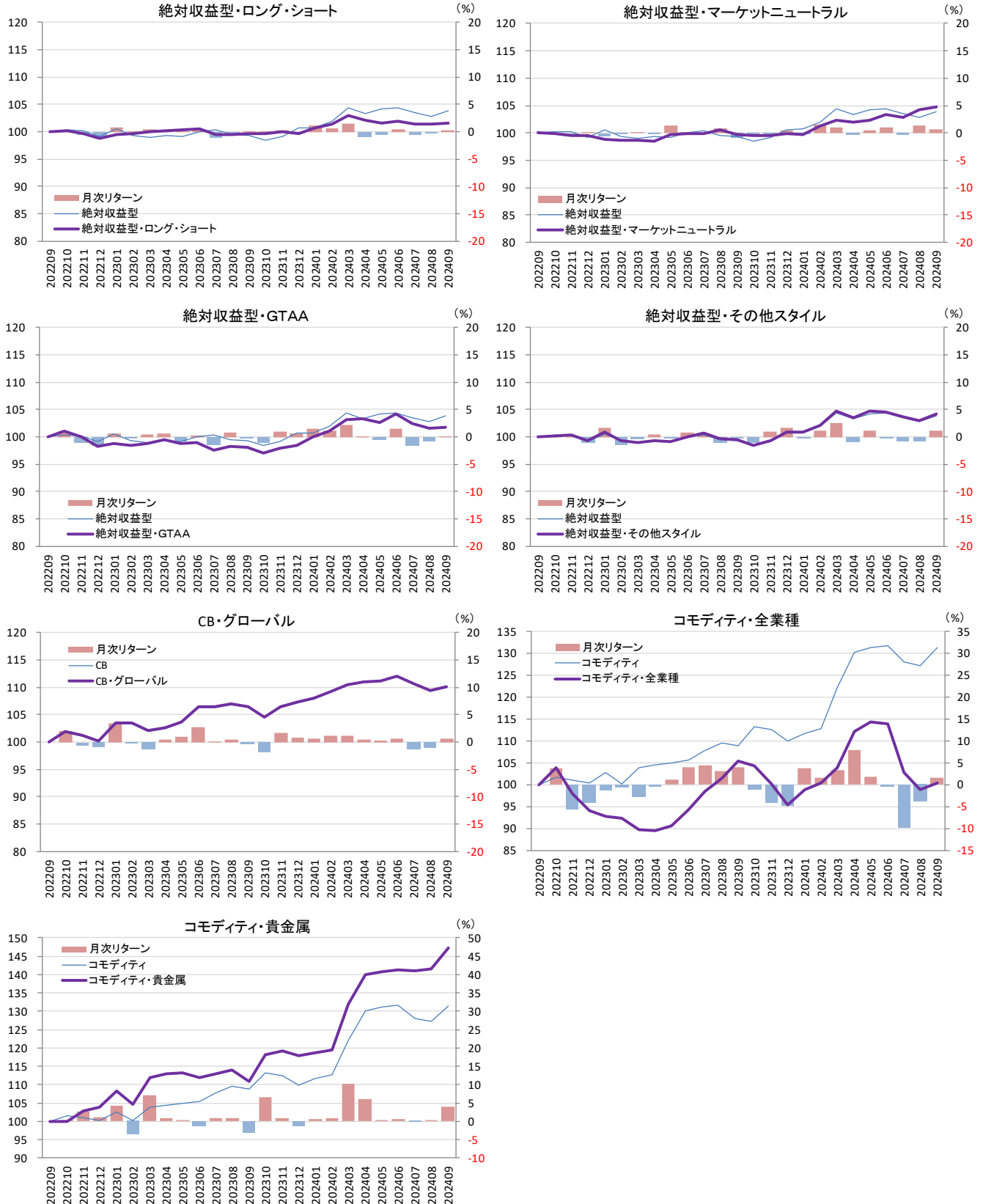


<1>パフォーマンス・サマリー

(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]





## &lt;1&gt;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	0.94		
1	外国株式(先進国)・グローバル	1.51	29.95	0.45
2	外国株式(先進国)・その他	1.29	17.53	0.24
3	エマージング株式・その他	2.49	3.59	0.09
4	エマージング株式・グローバル	5.14	1.10	0.05
5	REIT・グローバル	2.74	1.57	0.04
6	複合資産・安定成長	0.59	5.96	0.04
7	REIT・北米	1.43	1.99	0.03
8	コモディティ	3.29	0.71	0.02
9	外国債券(先進国)・グローバル	0.32	6.44	0.02
10	複合資産・成長	0.49	3.17	0.02
11	複合資産・安定	0.48	3.04	0.01
12	国内債券・一般	0.32	3.49	0.01
13	絶対収益型	1.06	0.98	0.01
14	REIT・その他	4.71	0.20	0.01
15	外国債券(先進国)・その他	0.57	1.42	0.01
16	ハイイールド債券・北米	0.58	1.29	0.01
17	エマージング債券・グローバル	1.34	0.52	0.01
18	複合資産・その他	2.34	0.24	0.01
19	国内株式・小型	0.45	0.59	0.00
20	エマージング株式・BRICS	5.93	0.04	0.00
21	ハイイールド債券・グローバル	0.68	0.23	0.00
22	エマージング債券・その他	0.35	0.39	0.00
23	CB	0.63	0.21	0.00
24	ハイイールド債券・その他	1.01	0.13	0.00
25	複合資産・国内バランス	-0.08	0.43	-0.00
26	国内株式・業種特化	-1.10	0.11	-0.00
27	REIT・日本	-1.60	1.83	-0.03
28	国内株式・一般	-0.33	7.07	-0.03
29	国内株式・その他	-1.55	5.28	-0.09
	合計		100.00	0.94

## ◆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	17.79		
1	外国株式(先進国)・グローバル	24.60	29.83	7.07
2	外国株式(先進国)・その他	27.93	16.12	4.07
3	国内株式・一般	15.54	7.33	1.23
4	国内株式・その他	17.41	5.12	0.99
5	複合資産・安定成長	11.35	6.05	0.71
6	エマージング株式・その他	23.75	3.10	0.63
7	REIT・北米	25.22	2.08	0.49
8	複合資産・成長	14.57	3.11	0.46
9	外国債券(先進国)・グローバル	5.91	6.79	0.44
10	REIT・グローバル	25.06	1.59	0.37
11	複合資産・安定	6.76	3.32	0.24
12	エマージング株式・グローバル	21.01	1.07	0.20
13	外国債券(先進国)・その他	9.39	1.51	0.15
14	ハイイールド債券・北米	8.39	1.41	0.13
15	コモディティ	20.62	0.62	0.11
16	エマージング債券・グローバル	11.49	0.59	0.07
17	複合資産・その他	27.68	0.27	0.07
18	国内株式・小型	7.47	0.65	0.06
19	絶対収益型	4.51	1.04	0.04
20	REIT・その他	18.50	0.23	0.04
21	ハイイールド債券・グローバル	10.59	0.24	0.03
22	国内株式・業種特化	21.37	0.10	0.02
23	ハイイールド債券・その他	10.70	0.16	0.02
24	エマージング債券・その他	0.33	0.45	0.01
25	CB	3.42	0.25	0.01
26	エマージング株式・BRICS	15.16	0.04	0.01
27	複合資産・国内バランス	0.56	0.52	0.00
28	国内債券・一般	-0.27	3.72	-0.01
29	REIT・日本	-3.37	2.13	-0.08
	合計		100.00	17.79

#### ◆計算定義

日次寄与度(%) = 日次リターン(%) × 前日の純資産額構成比

当月および直近1年間の寄与度は日次寄与度について累積計算したものの

また、上表の「構成比(%)」は期間中の平均値

## <2>リスク・サマリー

### (1) 期間別リスク・リターン

#### 「総合」およびファンド分類別①

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	24.96	56.84	79.61	11.64	11.87	10.91	0.66	0.80	0.55
国内株式	29.47	79.27	130.23	12.86	14.40	15.25	0.70	0.86	0.57
一般	28.98	78.66	120.51	12.37	13.88	15.23	0.72	0.89	0.54
フリー	25.46	76.41	116.57	12.91	14.21	15.58	0.61	0.85	0.52
バリュー	42.00	85.37	132.93	11.08	13.34 ↓	14.44	1.12	0.99	0.61
小型	-2.58	43.39	122.83	14.84	17.63	16.61	-0.06	0.42	0.50
その他	36.46	85.52	152.46	13.58	14.99	15.35	0.80	0.88	0.63
日経225	34.75	87.14	167.41	15.29	16.52	16.18	0.68	0.81	0.64
TOPIX	39.48	85.60	143.41	11.79	13.68	14.62	0.99	0.96	0.64
JPX日経400	40.86	87.73	136.83	12.21	14.07	14.59	0.99	0.95	0.62
国内債券	-6.98	-8.60	-1.51	2.58	2.28	2.06	-0.92	-0.77	-0.07
一般	-6.98	-8.60	-1.51	2.58	2.28	2.06	-0.92	-0.77	-0.07
外国株式(先進国)	35.91	109.73	142.80	17.08	17.33	16.39	0.63	0.92	0.57
グローバル	30.04	102.70	141.86	17.11	17.33	16.29	0.54	0.88	0.57
除く日本	57.21	132.84	202.42	15.16	16.75	16.67	1.07	1.10	0.70
含む日本	21.85	93.05	124.89	17.99	17.86	16.45	0.38	0.79	0.51
その他	50.51	125.05	145.19	17.22	17.71	16.89	0.85	1.00	0.56
北米	89.99	194.97	202.99	16.17	18.00	18.05	1.48	1.34	0.65
米国	50.46	138.19	173.97	17.41	17.30	17.23	0.84	1.10	0.62
カナダ	20.11	44.74	19.47	11.68	17.57	15.88	0.54	0.44	0.11
欧州	33.65	77.20	100.28	14.46	16.93	16.22	0.70	0.72	0.44
ドイツ	49.87	98.45	105.52	17.58	21.26	20.90	0.82	0.69	0.36
アジア・オセアニア	18.24	43.93	76.36	11.86 ↑	14.19	14.73	0.48	0.53	0.40
オーストラリア	42.79	59.80	73.48	18.03	23.35	19.76	0.70	0.42	0.29
ニュージーランド	8.59	50.99	156.63	15.26	17.01	17.01	0.18	0.51	0.58
複合地域	81.20	89.10	23.35	24.93	32.64	27.04	0.88	0.42	0.08
エマージング株式	37.93	82.66	99.97	11.64 ↑	17.00	16.33	0.97	0.75	0.44
グローバル	29.59	77.26	83.35	12.51	16.37	16.53	0.72	0.74	0.38
BRICS	-0.57	27.02	64.28	13.94 ↑	19.40	18.95	-0.01	0.25	0.27
その他	42.70	87.42	109.01	11.84 ↑	17.57	16.61	1.06	0.76	0.46
欧州	-33.45	-19.55	-10.89	34.54	32.97	27.23	-0.37	-0.13	-0.04
ロシア	-91.56	-88.06	-83.40	55.01	47.68	37.96	-1.02	-0.73	-0.43
アジア・オセアニア	20.95	52.50	60.90	13.17 ↑	16.07	16.08	0.50	0.55	0.30
中国	-20.78	15.60	78.90	21.66 ↑	20.92 ↑	21.96	-0.34	0.14	0.27
インド	66.01	143.33	201.54	14.91	21.87	20.80	1.23	0.89	0.56
インドネシア	42.44	33.93	26.39	15.80	25.31	22.69	0.79	0.24	0.11
フィリピン	24.37	14.92	1.78	15.56	20.52	18.08	0.48	0.14	0.01
ベトナム	27.18	82.16	133.11	19.56	25.85	21.75	0.43	0.49	0.41
韓国	-14.45	61.93	13.53	26.12 ↑	26.08	21.79	-0.19	0.39	0.06
香港	14.52	17.71	37.07	23.36 ↑	21.88	20.62	0.20	0.15	0.16
中南米	46.96	44.02	31.80	22.67	29.01	26.22	0.60	0.26	0.11
ブラジル	29.84	4.51	-3.67	25.10	31.56	31.36	0.36	0.03	-0.01
メキシコ	54.92	77.28	19.76	23.31	27.55	24.35	0.67	0.44	0.08
中東・アフリカ	32.89	77.82	42.86	14.86	17.72	16.64	0.67	0.69	0.22
トルコ	149.87	127.11	34.98	33.62	33.45	31.78	1.06	0.53	0.10
複合地域	15.68	50.21	40.47	13.51	16.14	15.63	0.37	0.53	0.22

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

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

## ＜2＞リスク・サマリー

### (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	24.96	56.84	79.61	11.64	11.87	10.91	0.66	0.80	0.55
外国債券(先進国)	4.98	11.95	11.38	5.33	5.15	5.40	0.31	0.45	0.20
グローバル	2.89	8.84	10.94	4.78	4.50	4.81	0.20	0.38	0.22
除く日本	6.96	14.06	14.67	6.21	5.22	5.54	0.37	0.51	0.25
含む日本	-0.46	4.24	8.14	3.94	4.56	4.48	-0.04	0.19	0.18
その他	13.79	24.20	17.42	8.23	8.06	7.74	0.53	0.55	0.21
北米	1.31	8.75	16.07	6.52 ↑	6.31 ↑	5.25	0.07	0.27	0.29
米国	11.24	20.69	30.78	8.15	8.34	7.14	0.44	0.46	0.38
カナダ	20.33	31.51	15.05	8.98 ↑	8.14	8.71	0.71	0.69	0.16
欧州	-0.49	0.13	-2.31	6.66	5.83	6.54	-0.02	0.01	-0.03
イギリス	21.90	37.92	21.77	10.94	9.79	10.07	0.62	0.68	0.20
アジア・オセアニア	17.91	30.15	18.88	10.02	9.96	9.36	0.56	0.54	0.19
オーストラリア	18.63	30.66	18.75	10.01	10.01	9.42	0.59	0.55	0.19
ニュージーランド	13.16	23.25	26.09	10.77	9.73	10.05	0.39	0.44	0.23
複合地域	8.49	20.50	19.53	8.25	6.84	7.08	0.33	0.56	0.26
エマージング債券	26.22	28.12	29.92	7.91	10.22	10.59	1.02	0.50	0.25
グローバル	19.80	22.44	22.96	8.10	11.56	11.16	0.77	0.36	0.19
米ドル建て	17.90	20.96	23.33	8.67	12.23	11.57	0.65	0.32	0.18
現地通貨建て	26.11	27.80	17.26	7.44	9.78	10.24	1.08	0.52	0.16
その他	33.74	34.93	37.65	9.62	10.17	11.14	1.06	0.61	0.29
ロシア	-85.04	-84.90	-85.03	170.84 ↑	132.34 ↑	94.82 ↑	-0.27	-0.24	-0.18
アジア・オセアニア	16.95	23.42	35.75	6.19	7.15	6.94	0.87	0.60	0.45
中国	25.12	49.26	-	6.70	5.97	-	1.16	1.40	-
インド	26.36	41.63	67.67	9.44 ↑	9.25	9.66	0.86	0.78	0.55
インドネシア	33.90	58.04	79.21	9.76	13.29	13.63	1.05	0.72	0.44
ブラジル	55.42	25.10	26.91	15.33	17.12	18.34	1.03	0.27	0.13
メキシコ	49.87	60.30	35.94	14.85	17.03	15.99	0.97	0.58	0.20
トルコ	-46.51	-59.92	-79.00	28.30	25.74	27.92	-0.67	-0.65	-0.52
複合地域	23.24	22.32	9.59	10.71	11.66	11.62	0.67	0.35	0.08
ハイールド債券	28.85	43.17	55.72	8.52	11.30	10.56	1.04	0.66	0.43
グローバル	22.33	32.71	41.00	7.43	10.94	10.40	0.94	0.53	0.34
北米	32.38	49.84	67.44	9.05	11.36	10.63	1.08	0.74	0.50
その他	19.58	25.84	29.99	8.59	12.25	11.29	0.72	0.39	0.24
欧州	21.37	27.67	30.71	9.28	12.93	12.00	0.72	0.39	0.23
アジア・オセアニア	12.83	17.93	27.18	9.65	11.92	10.37	0.43	0.28	0.24
複合地域	23.30	43.93	52.61	8.22 ↑	9.08	8.92	0.88	0.83	0.49
複合資産	13.33	26.80	43.97	6.87	7.22	7.21	0.62	0.68	0.52
安定	3.91	10.82	20.69	4.98	5.04	5.29	0.26	0.41	0.36
安定成長	16.78	32.85	51.94	7.20	7.65	7.62	0.74	0.77	0.56
成長	27.58	60.24	93.34	9.08	10.08	10.49	0.93	0.98	0.65
国内バランス	-3.85	-6.09	3.66	3.14	3.89	3.96 ↓	-0.41	-0.32	0.10
安定	-5.85	-8.90	4.57	3.03	3.77	3.13	-0.65	-0.49	0.15
一般	11.52	30.93	45.16	6.64	7.60	8.19	0.56	0.73	0.47
その他	-4.35	14.37	-	20.30	18.35	-	-0.07	0.15	-

※[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	24.96	56.84	79.61	11.64	11.87	10.91	0.66	0.80	0.55
国内REIT	-6.40	-4.53	41.41	10.15	14.85	12.31	-0.21	-0.06	0.29
日本	-6.40	-4.53	41.41	10.15	14.85	12.31	-0.21	-0.06	0.29
外国REIT	33.63	52.32	111.38	17.85	19.06	16.69	0.57	0.46	0.47
グローバル	31.01	46.07	87.30	17.61	19.69	16.88	0.54	0.40	0.38
除く日本	33.94	54.76	115.66	18.29	20.44	17.34	0.56	0.45	0.46
含む日本	28.96	42.11	80.48	17.26	19.38	16.70	0.51	0.38	0.37
北米	37.33	61.17	136.88	18.68	18.88	17.05	0.60	0.53	0.53
その他	21.77	28.70	84.76	15.34	19.37	16.10	0.44	0.27	0.39
欧州	5.50	12.21	22.69	18.77	21.26	18.61	0.10	0.11	0.11
アジア・オセアニア	19.39	23.25	87.98	14.32	17.73	15.21	0.43	0.24	0.43
オーストラリア	34.46	47.49	88.40	23.76	30.20	23.40	0.44	0.27	0.28
複合地域	38.90	32.89	36.42	15.27	24.15	20.25	0.76	0.24	0.16
複数国	20.78	41.68	126.77	15.18	17.12	15.04	0.43	0.42	0.57
その他									
絶対収益型	-3.13	-0.30	-2.16	4.02	3.55	2.92	-0.26	-0.01	-0.07
ロング・ショート	-3.47	-8.70	-9.01	3.11	3.05	3.08	-0.38	-0.59	-0.30
マーケットニュートラル	-2.97	1.89	11.67	3.95	4.03	4.86	-0.25	0.10	0.23
GTAA	-0.52	8.90	13.01	4.22	4.58	3.58	-0.04	0.38	0.35
その他スタイル	-3.25	-0.11	-2.51	4.41	3.86	3.18	-0.25	-0.00	-0.08
CB	-4.53	14.98	18.26	6.42	8.49	7.61	-0.24	0.34	0.22
アジア・オセアニア	21.41	60.64	91.92	9.62	↑ 11.96	11.63	0.69	0.83	0.58
日本	5.28	8.61	25.82	4.89	5.30	5.43	0.35	0.32	0.43
グローバル	-5.40	14.27	17.01	6.63	8.73	7.70	-0.28	0.31	0.21
コモディティ	60.45	92.11	37.45	10.81	11.75	12.27	1.58	1.19	0.26
全業種	48.18	91.64	20.25	17.54	19.59	17.37	0.80	0.71	0.11
貴金属	56.55	77.89	83.78	10.91	↓ 12.62	11.39	1.48	0.97	0.55
エネルギー	70.37	125.90	11.25	26.85	35.61	32.20	0.72	0.50	0.03
その他コモディティ	55.11	81.10	40.19	16.19	18.86	16.97	0.97	0.67	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

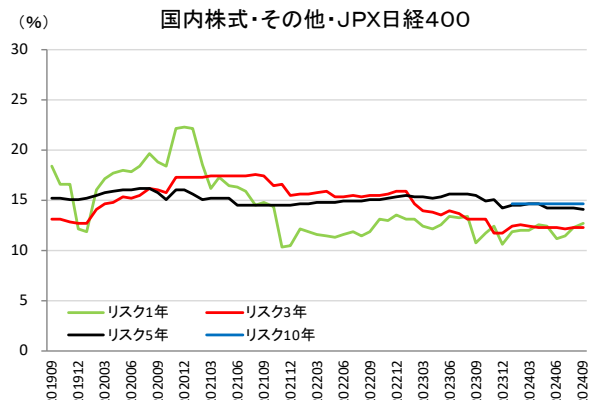
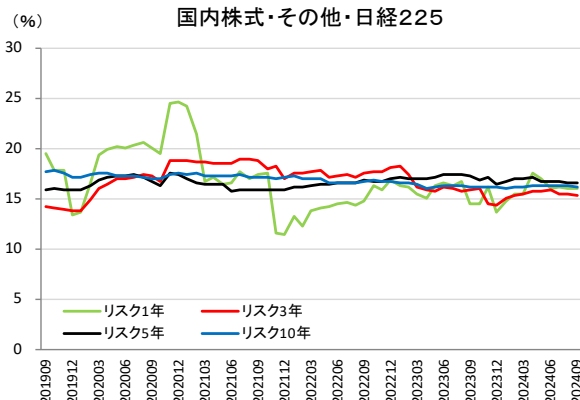
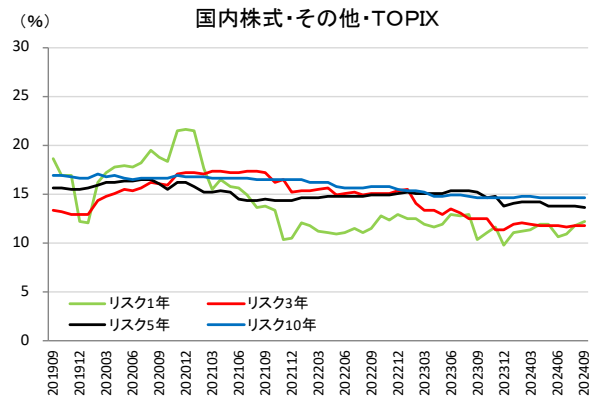
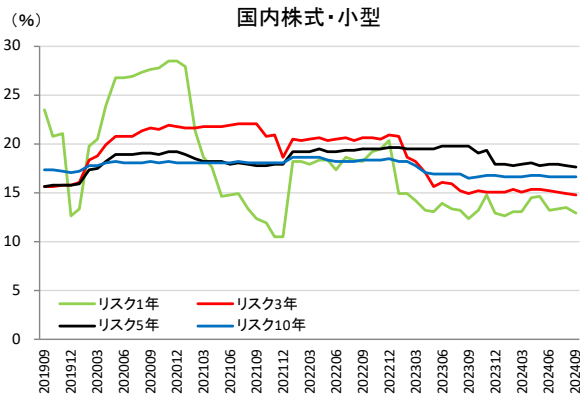
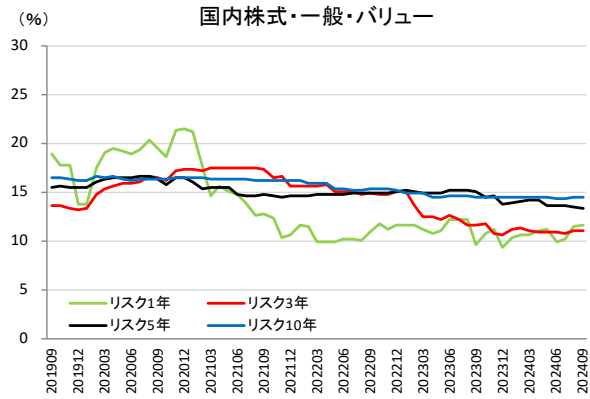
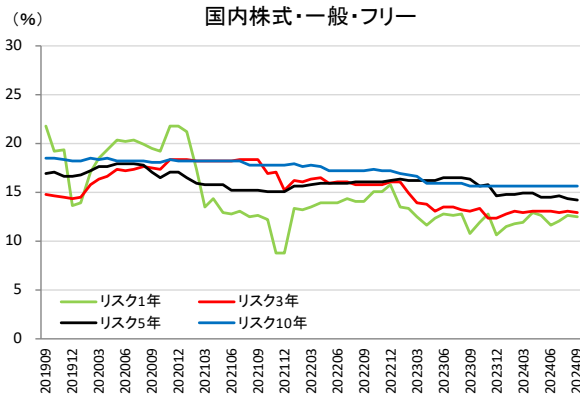


<2> リスク・サマリー

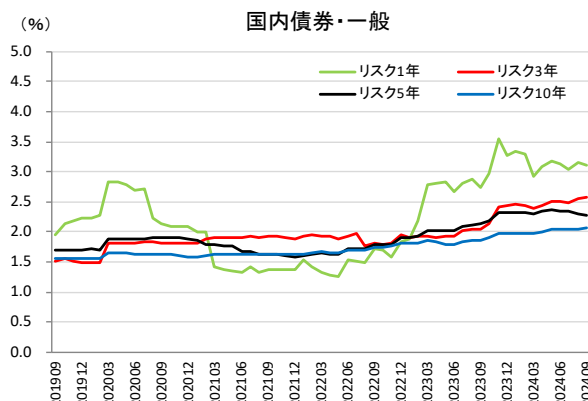
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

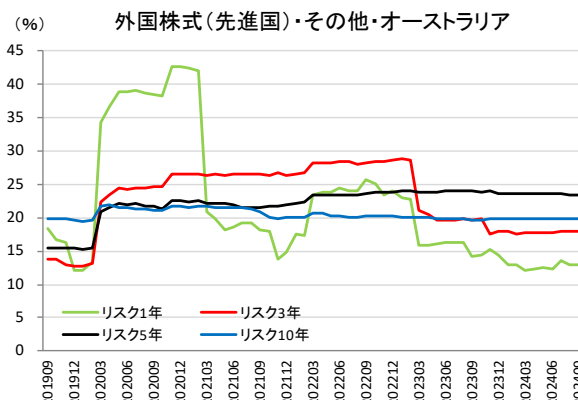
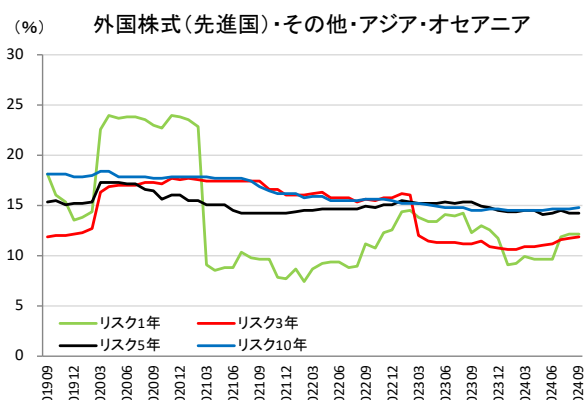
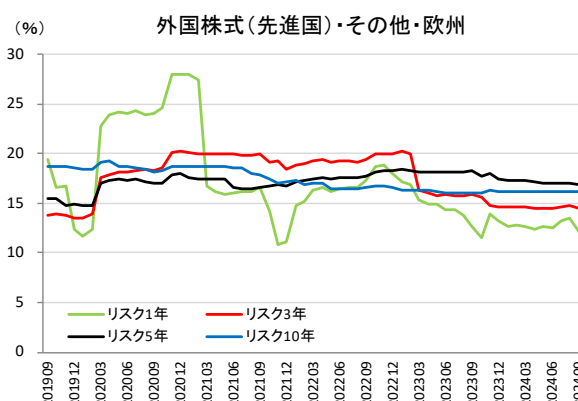
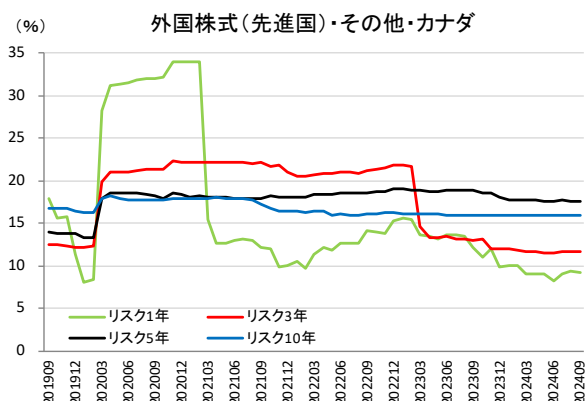
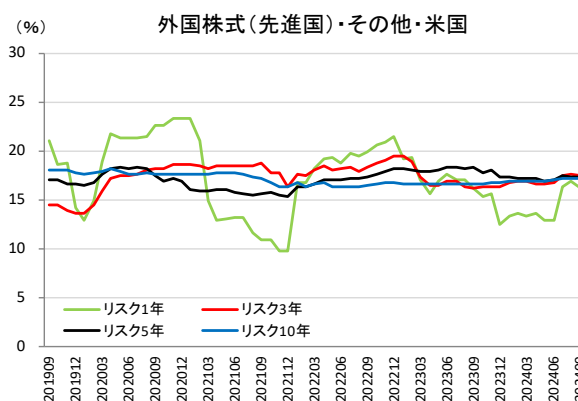
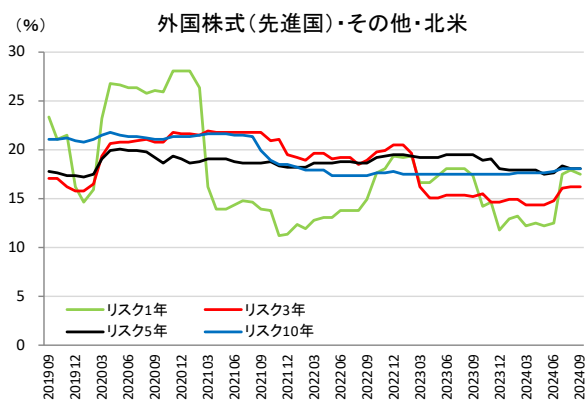
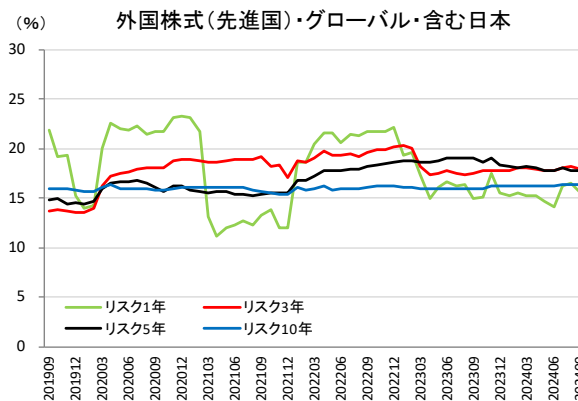
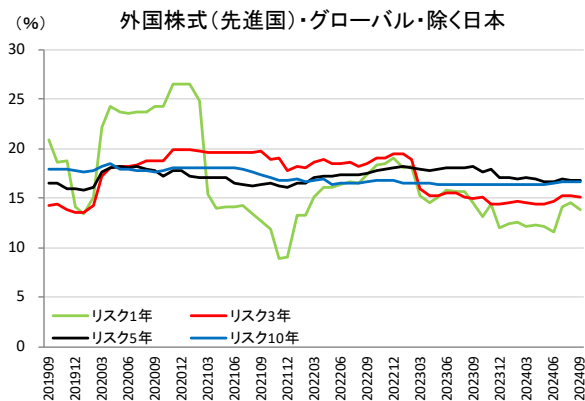


<2> リスク・サマリー

(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)]

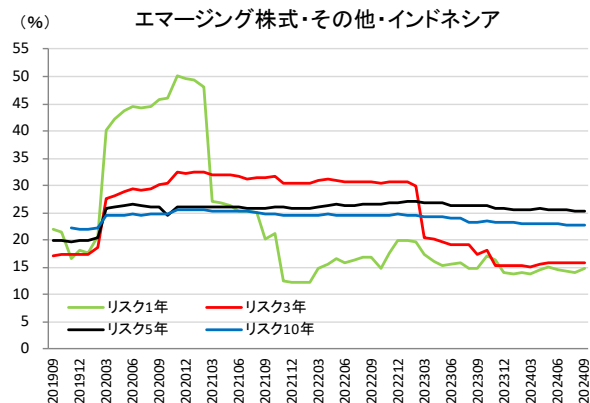
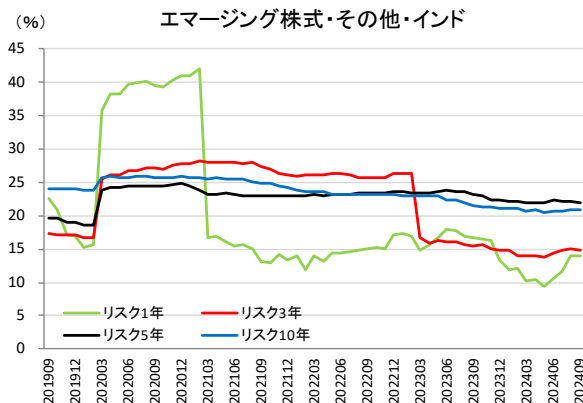
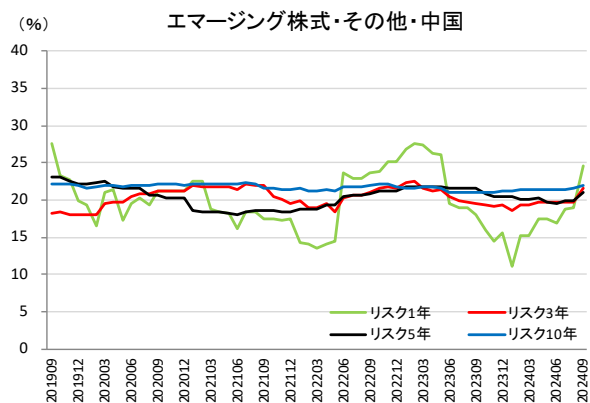
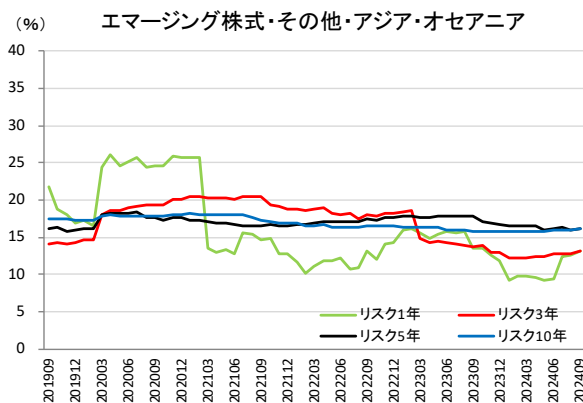
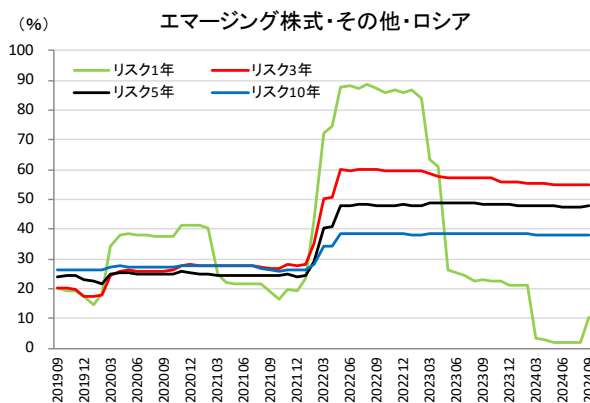
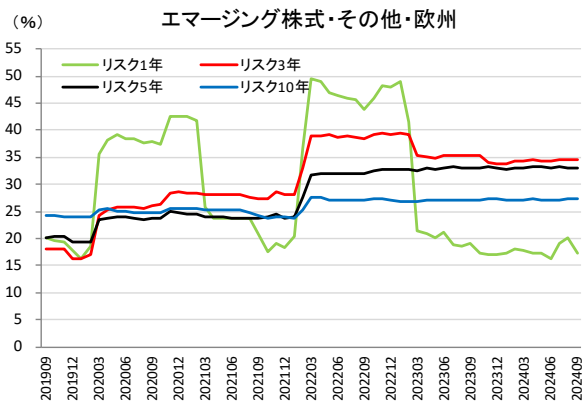
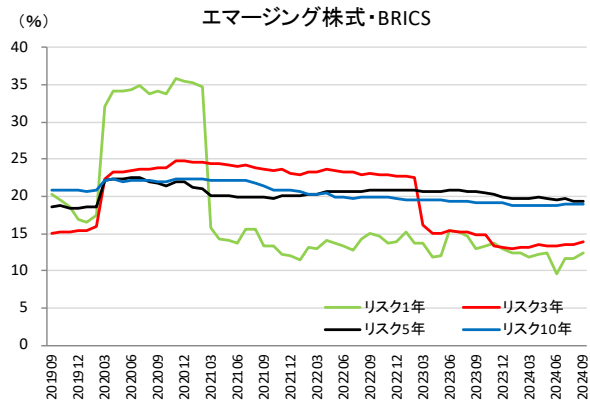
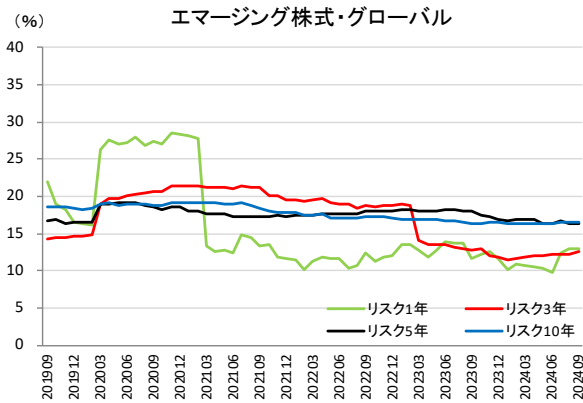


<2> リスク・サマリー

(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]

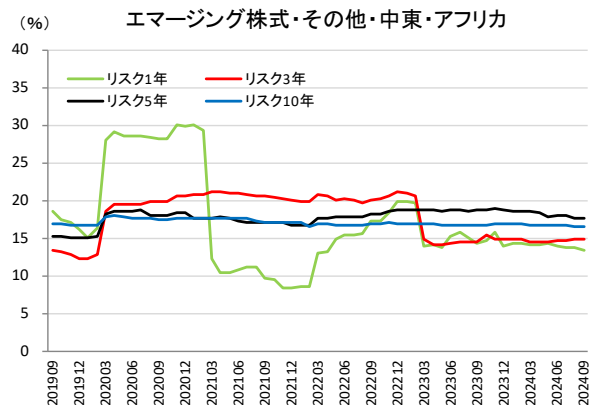
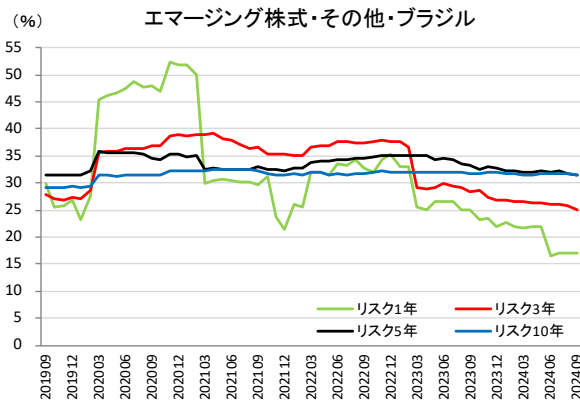
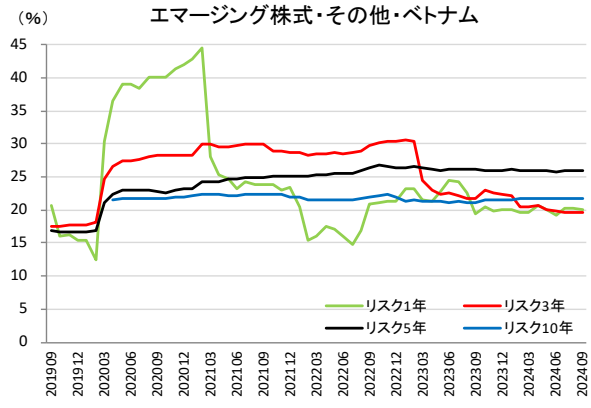
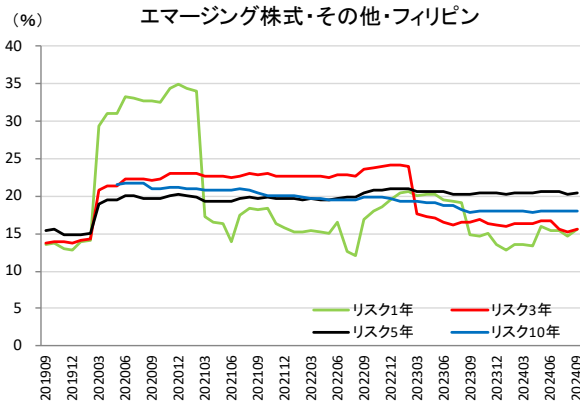


<2> リスク・サマリー

(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]

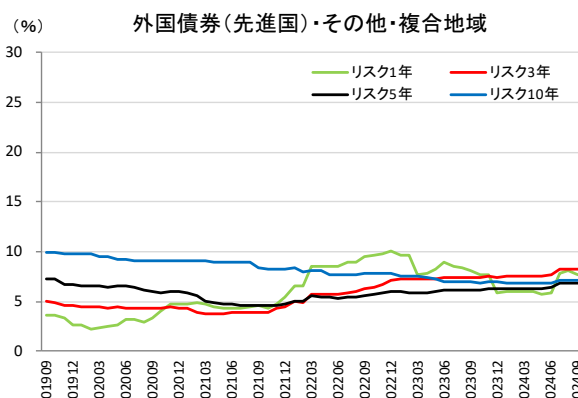
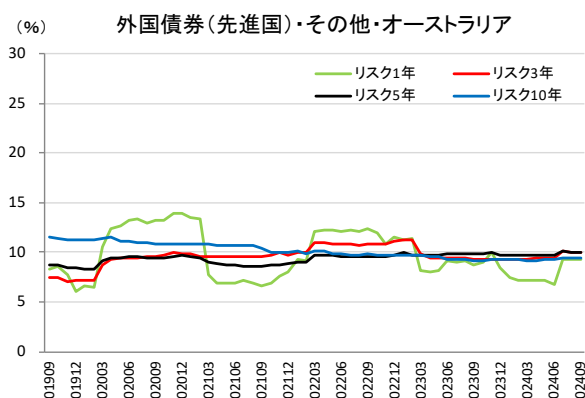
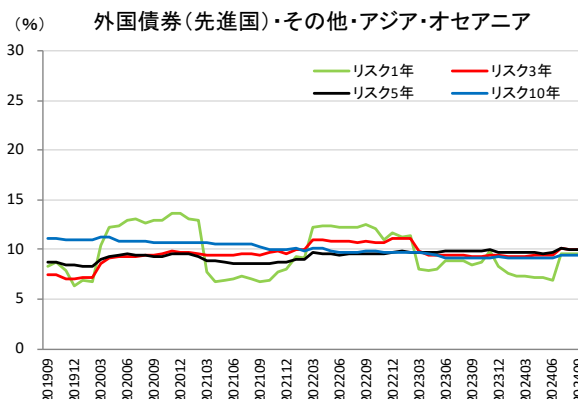
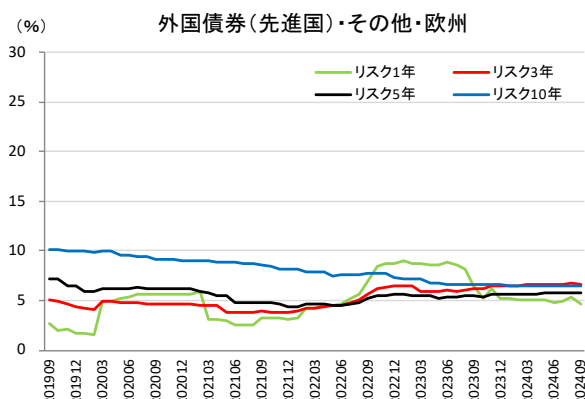
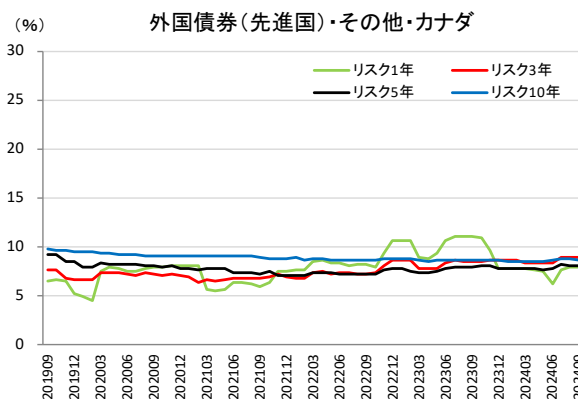
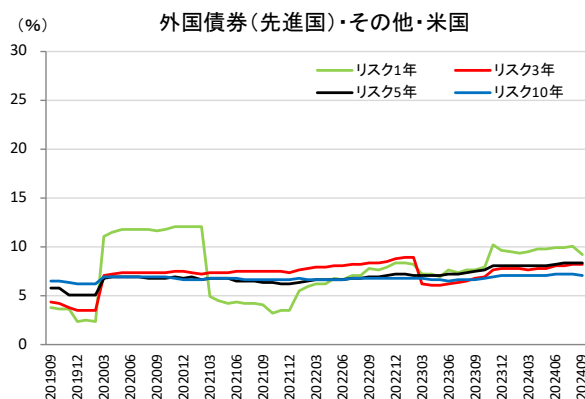
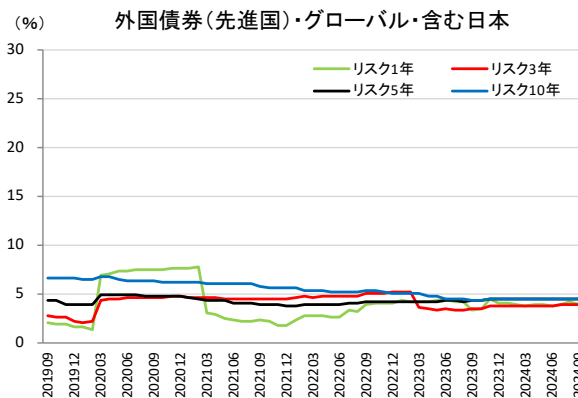
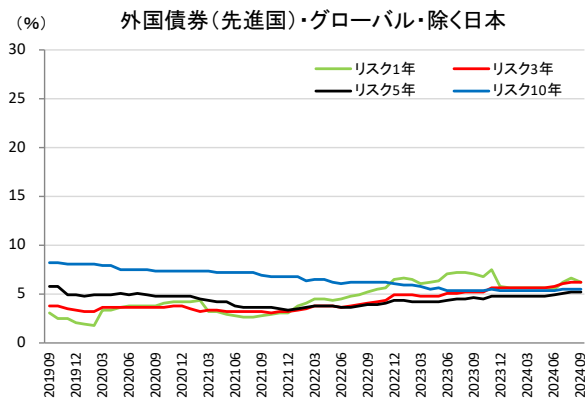


<2> リスク・サマリー

(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)]

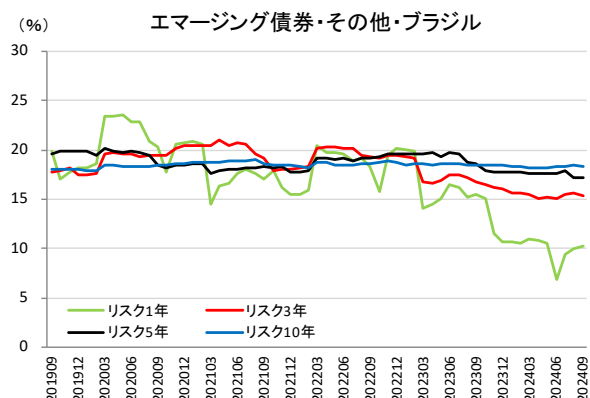
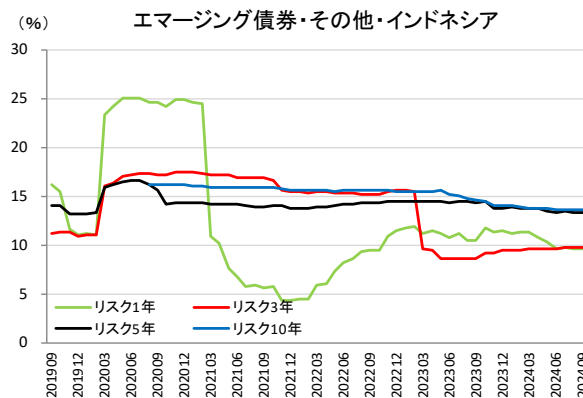
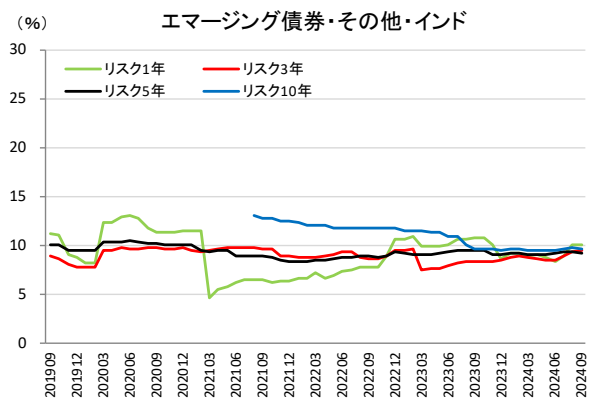
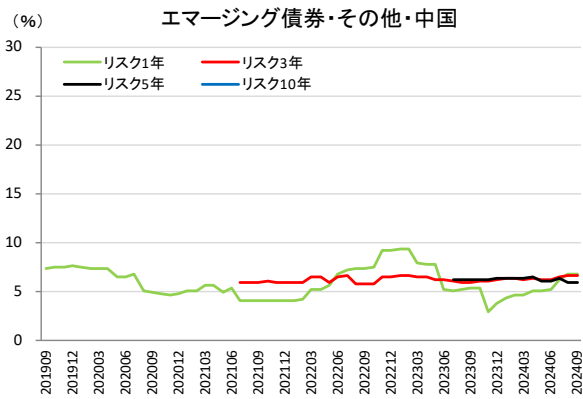
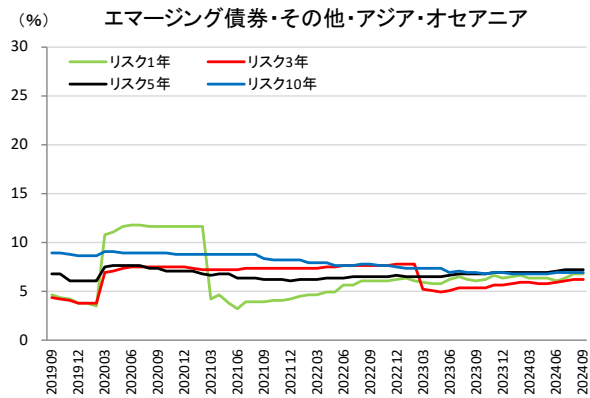
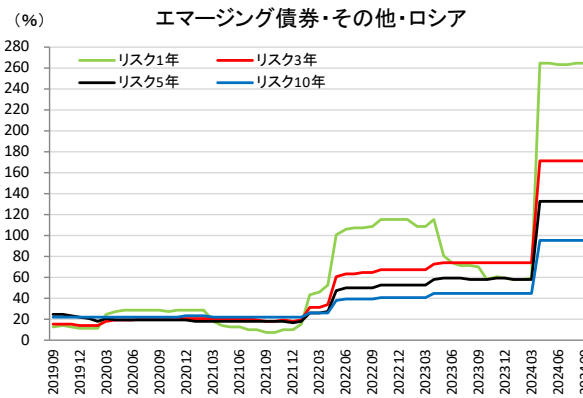
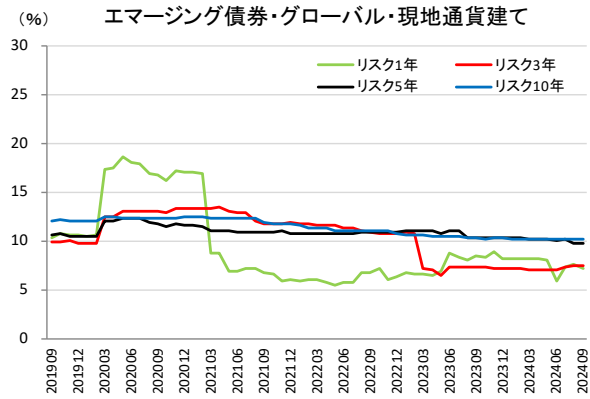
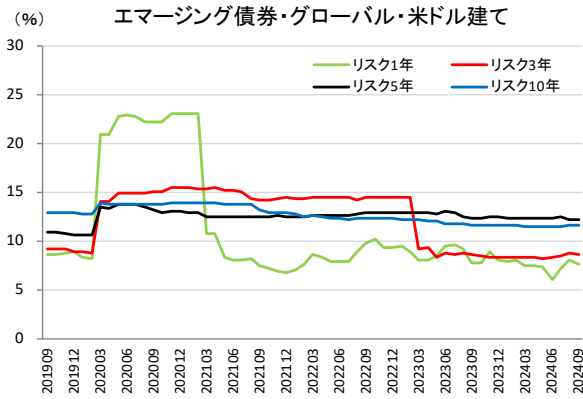


<2> リスク・サマリー

(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]

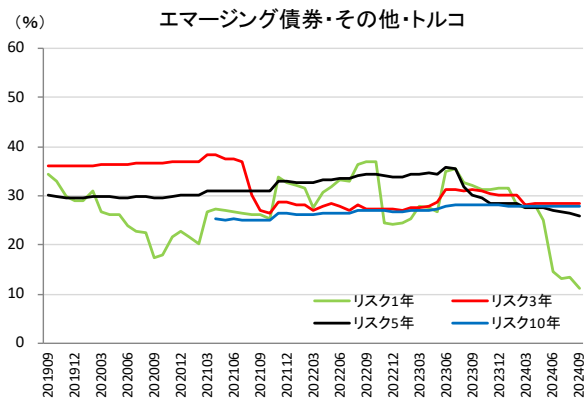
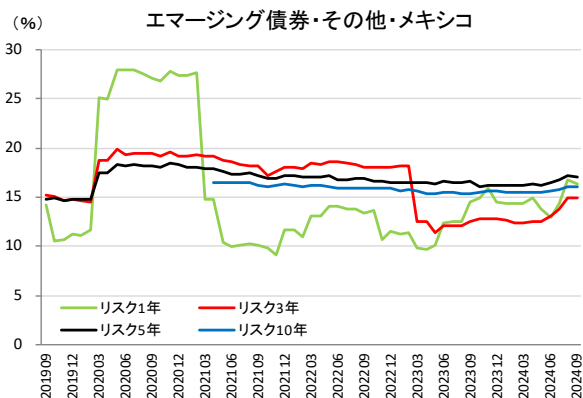


<2> リスク・サマリー

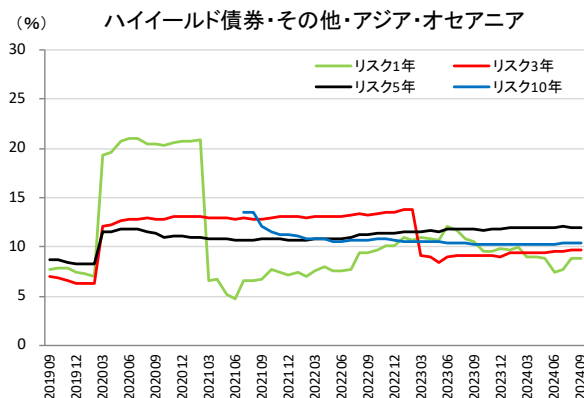
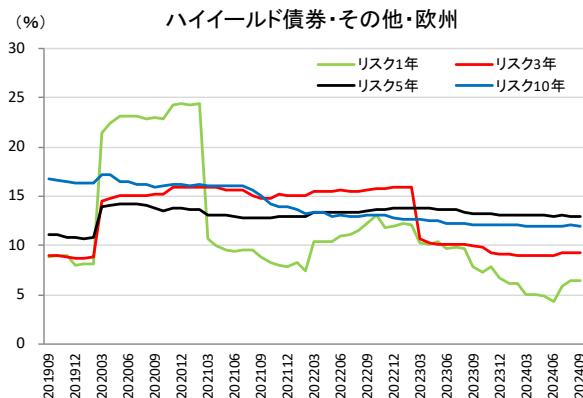
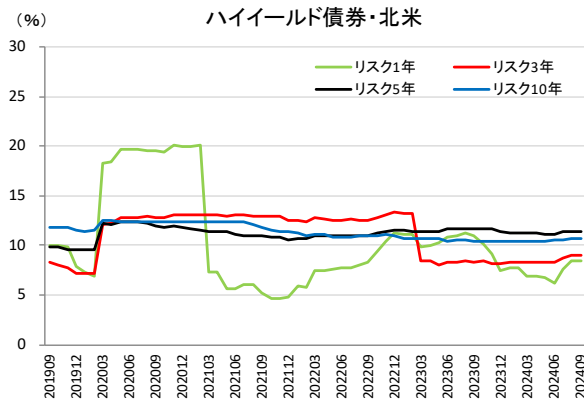
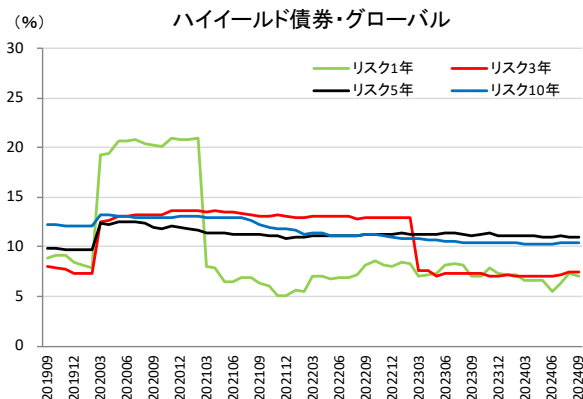
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

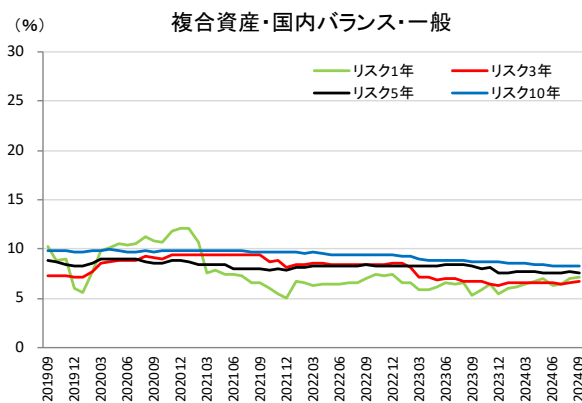
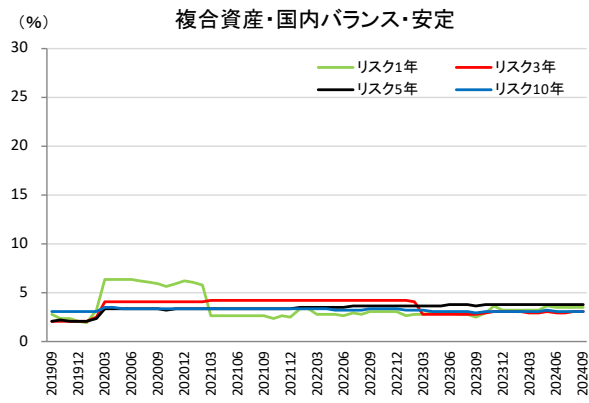
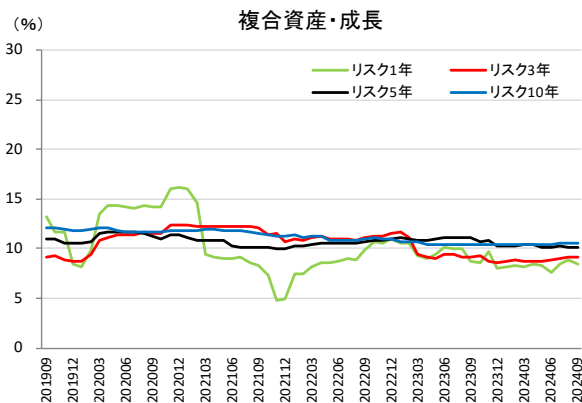
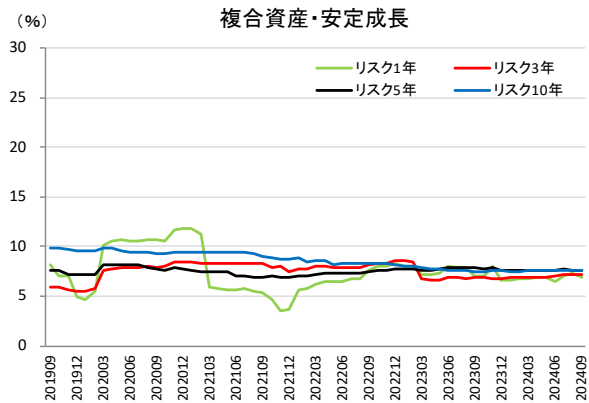
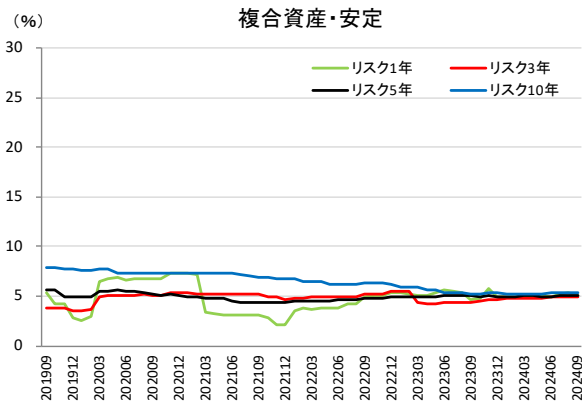


<2> リスク・サマリー

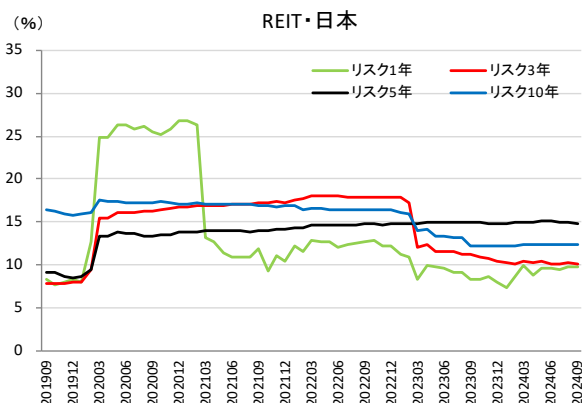
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]



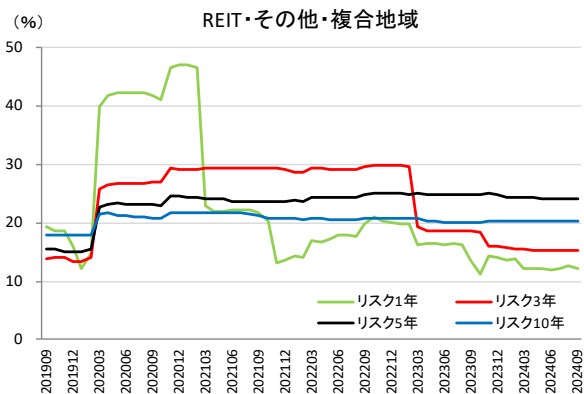
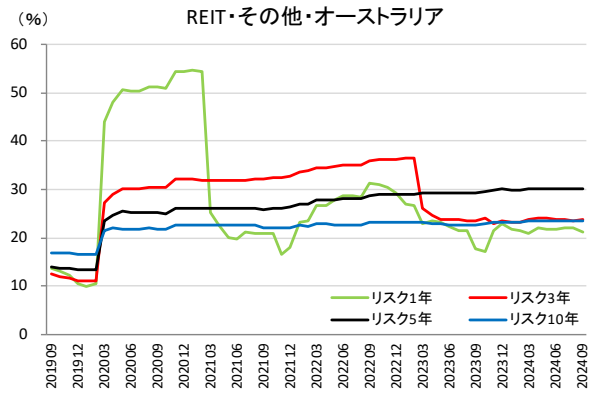
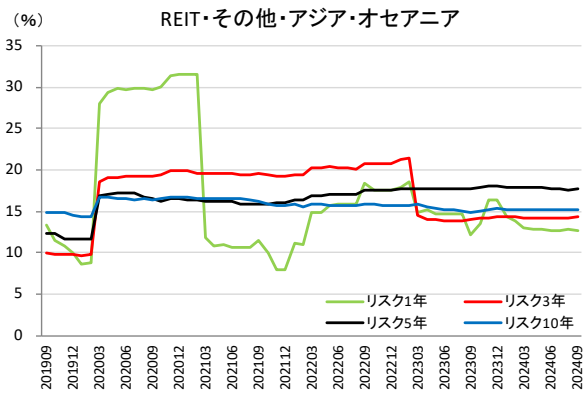
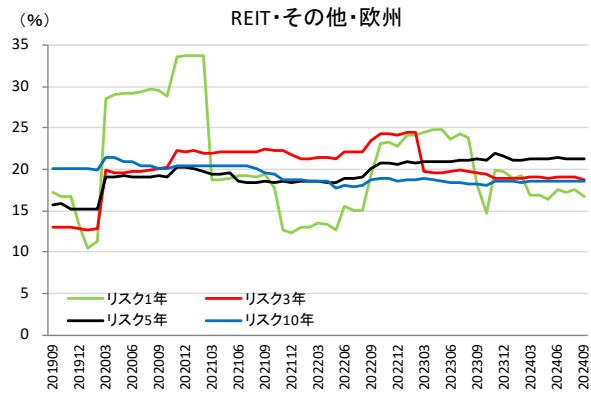
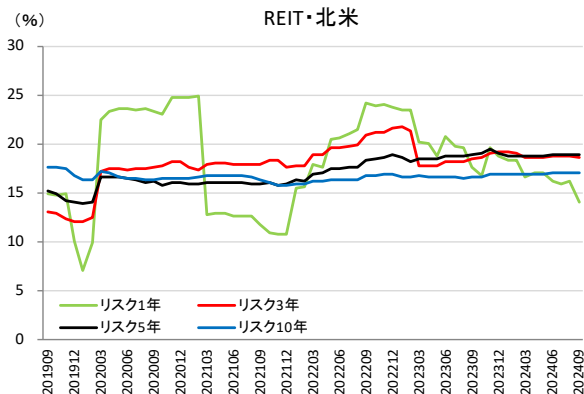
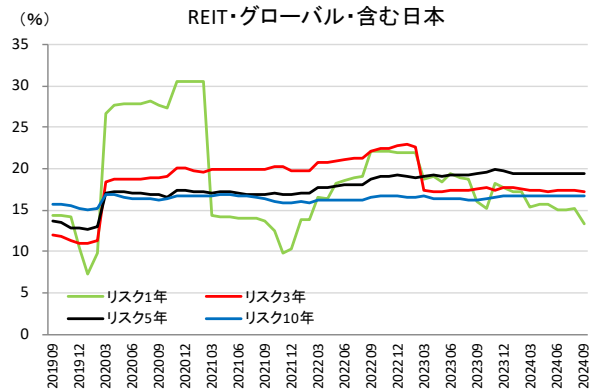
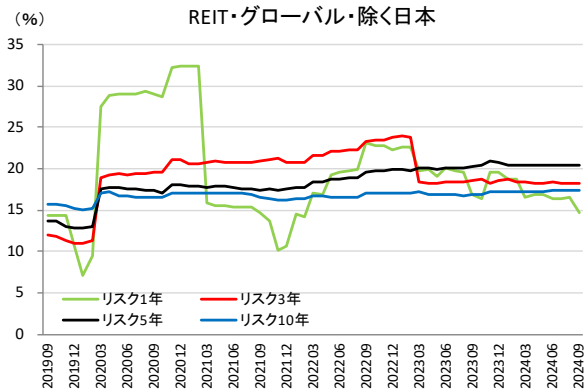


<2> リスク・サマリー

(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]

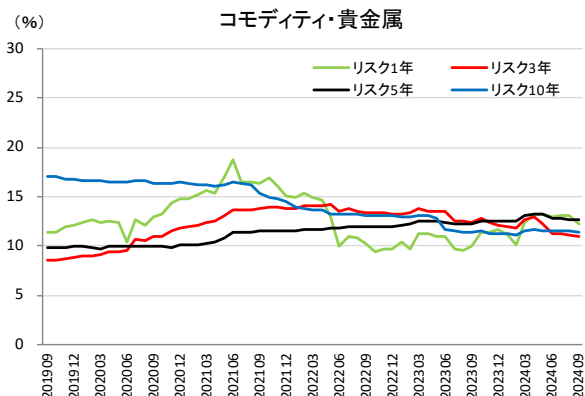
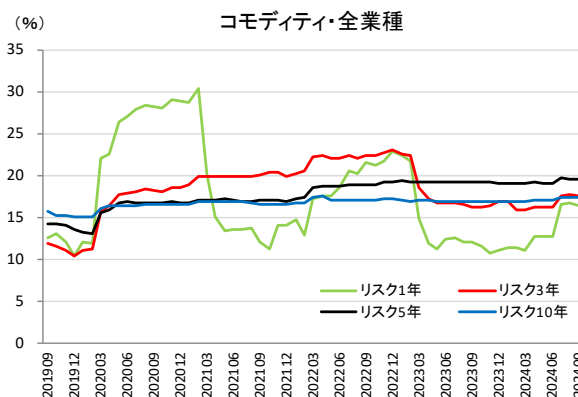
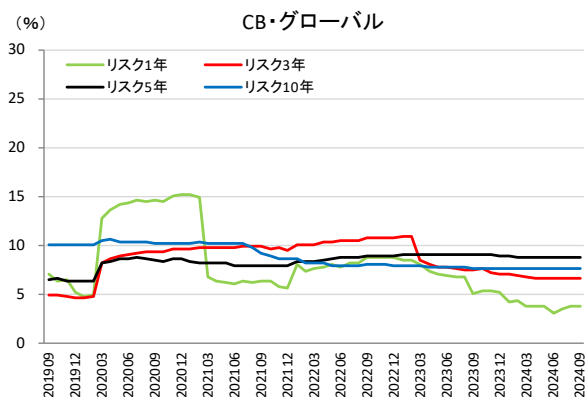
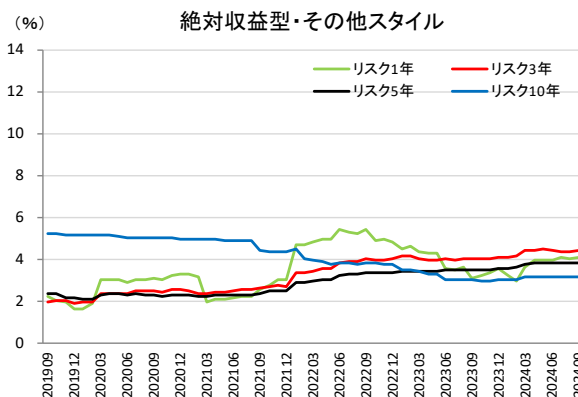
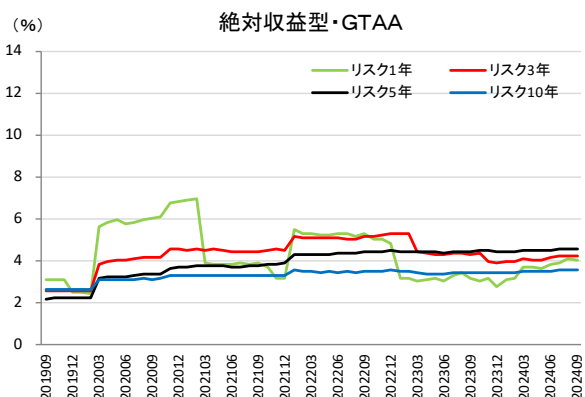
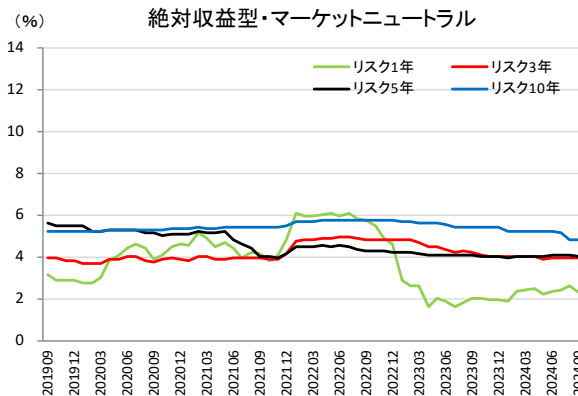
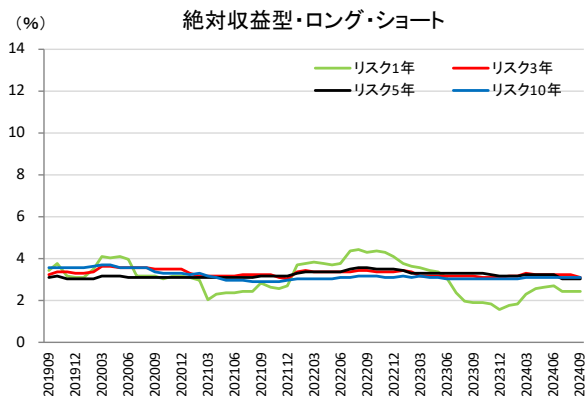


<2> リスク・サマリー

(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]



## &lt; 3 &gt; 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	11,649	44,602	90,028	145,857
国内株式	893	5,726	10,474	17,170
一般	245	1,578	2,888	7,506
フリー	132	660	751	838
バリュー	113	918	2,136	6,661
小型	437	369	361	204
その他	199	3,675	6,945	8,902
日経225	-174	1,724	3,485	3,247
TOPIX	228	1,243	1,958	3,309
JPX日経400	6	66	103	82
国内債券	243	543	1,353	2,961
一般	243	543	1,353	2,961
外国株式(先進国)	8,197	29,609	57,659	95,908
グローバル	4,369	13,518	25,437	41,484
除く日本	971	3,384	6,968	11,740
含む日本	3,394	10,130	18,466	29,740
その他	3,828	16,091	32,222	54,424
北米	139	686	1,506	3,044
米国	3,677	15,334	30,628	51,421
カナダ	1	23	21	6
欧州	22	90	157	238
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	-11	-39	-85	-270
ニュージーランド	0	0	-1	-1
複合地域	0	-2	-4	-10
エマージング株式	554	3,113	9,801	16,718
グローバル	59	289	1,721	1,926
BRICS	-2	-7	-19	-48
その他	496	2,832	8,099	14,841
欧州	1	1	4	3
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-7	139	-105	-388
中国	-7	-53	-120	-371
インド	516	2,778	8,398	15,754
インドネシア	4	11	27	31
フィリピン	0	-1	-2	-6
ベトナム	-6	-29	-61	-100
韓国	0	0	0	0
香港	0	0	-4	0
中南米	0	-2	-5	-10
ブラジル	-4	-10	-25	-79
メキシコ	0	0	1	1
中東・アフリカ	0	-2	-8	-21
トルコ	-1	0	-4	-13
複合地域	1	4	4	44

## &lt;3&gt; 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	11,649	44,602	90,028	145,857
外国債券(先進国)	638	1,834	3,368	5,627
グローバル	572	1,793	3,057	5,284
除く日本	359	1,291	2,055	3,376
含む日本	213	516	1,015	1,921
その他	66	41	311	344
北米	7	18	32	104
米国	128	257	788	1,463
カナダ	-6	-22	-49	-132
欧州	-8	9	31	20
イギリス	0	0	-2	-2
アジア・オセアニア	-19	-49	-105	-226
オーストラリア	-32	-149	-331	-779
ニュージーランド	-1	-5	-9	-17
複合地域	-4	-18	-43	-88
エマージング債券	-3	-231	-173	-271
グローバル	7	-225	-164	-236
米ドル建て	4	-185	-179	-354
現地通貨建て	3	-40	15	119
その他	-10	-6	-10	-36
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	1	-1	-7	-20
中国	-2	-7	-15	-36
インド	2	26	92	250
インドネシア	-1	14	9	10
ブラジル	-9	-34	-80	-196
メキシコ	-2	-4	-7	-36
トルコ	0	0	-1	-3
複合地域	0	-1	-2	-4
ハイイールド債券	144	278	450	915
グローバル	129	226	238	206
北米	37	123	341	966
その他	-22	-71	-130	-256
欧州	-13	-47	-95	-194
アジア・オセアニア	-9	-23	-33	-59
複合地域	0	-1	-2	-3
複合資産	1,043	3,845	6,622	8,746
安定	11	37	-190	-1,279
安定成長	590	2,282	4,575	6,269
成長	494	1,837	2,952	5,382
国内バランス	-46	-233	-469	-1,127
安定	-81	-326	-646	-1,449
一般	-1	-3	-10	-31
その他	-5	-78	-246	-499

## &lt; 3 &gt; 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	11,649	44,602	90,028	145,857
国内REIT	-261	-703	-668	-1,738
日本	-261	-703	-668	-1,738
外国REIT	267	-322	-568	-1,655
グローバル	42	-192	-173	-640
除く日本	27	-87	95	238
含む日本	15	-104	-271	-890
北米	258	-21	-180	-525
その他	-33	-109	-214	-491
欧州	0	-1	-4	-9
アジア・オセアニア	-28	-91	-175	-387
オーストラリア	-4	-12	-25	-73
複合地域	0	0	-1	-3
複数国	-1	-4	-9	-19
その他	-65	908	1,710	1,474
絶対収益型	-127	82	363	340
ロング・ショート	3	4	16	4
マーケットニュートラル	-3	-12	-38	-103
GTAA	-3	-10	-22	-58
その他スタイル	-124	97	396	479
CB	-51	-160	-322	-223
アジア・オセアニア	0	-1	-3	-4
日本	0	-1	-1	1
グローバル	-51	-159	-319	-220
コモディティ	193	768	1,468	2,040
全業種	-2	46	171	250
貴金属	193	719	1,302	1,799
エネルギー	2	2	-7	-13
その他コモディティ	0	0	2	4

## &lt; 4 &gt; 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	1,285,989	100.00	5,265	100.00
国内株式	167,877	13.05	759	14.42
一般	91,200	7.09	459	8.72
フリー	62,740	4.88	356	6.76
バリュー	28,460	2.21	103	1.96
小型	7,975	0.62	86	1.63
その他	67,219	5.23	208	3.95
日経225	31,990	2.49	72	1.37
TOPIX	28,330	2.20	84	1.60
JPX日経400	1,039	0.08	12	0.23
国内債券	44,120	3.43	151	2.87
一般	44,120	3.43	151	2.87
外国株式(先進国)	617,113	47.99	1,220	23.17
グローバル	390,817	30.39	843	16.01
除く日本	121,045	9.41	192	3.65
含む日本	269,772	20.98	651	12.36
その他	226,296	17.60	377	7.16
北米	4,941	0.38	12	0.23
米国	216,434	16.83	300	5.70
カナダ	145	0.01	3	0.06
欧州	1,991	0.15	36	0.68
ドイツ	21	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	2,695	0.21	22	0.42
ニュージーランド	12	0.00	1	0.02
複合地域	21	0.00	1	0.02
エマージング株式	59,639	4.64	302	5.74
グローバル	12,774	0.99	93	1.77
BRICS	466	0.04	7	0.13
その他	46,400	3.61	202	3.84
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	4,383	0.34	74	1.41
中国	1,083	0.08	31	0.59
インド	38,361	2.98	41	0.78
インドネシア	226	0.02	6	0.11
フィリピン	24	0.00	3	0.06
ベトナム	1,577	0.12	14	0.27
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	18	0.00	1	0.02
中南米	50	0.00	2	0.04
ブラジル	386	0.03	10	0.19
メキシコ	8	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	50	0.00	2	0.04
トルコ	52	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	1,285,989	100.00	5,265	100.00
外国債券(先進国)	99,749	7.76	726	13.79
グローバル	81,746	6.36	520	9.88
除く日本	38,232	2.97	224	4.25
含む日本	43,514	3.38	296	5.62
その他	18,003	1.40	206	3.91
北米	213	0.02	8	0.15
米国	9,094	0.71	116	2.20
カナダ	571	0.04	3	0.06
欧州	1,079	0.08	23	0.44
イギリス	7	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	1,416	0.11	9	0.17
オーストラリア	4,565	0.35	32	0.61
ニュージーランド	61	0.00	3	0.06
複合地域	999	0.08	8	0.15
エマージング債券	11,499	0.89	219	4.16
グローバル	6,622	0.51	150	2.85
米ドル建て	4,609	0.36	114	2.17
現地通貨建て	2,013	0.16	36	0.68
その他	4,877	0.38	69	1.31
ロシア	11	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	219	0.02	8	0.15
中国	124	0.01	8	0.15
インド	2,728	0.21	16	0.30
インドネシア	340	0.03	7	0.13
ブラジル	1,190	0.09	20	0.38
メキシコ	207	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	20,967	1.63	212	4.03
グローバル	3,049	0.24	43	0.82
北米	16,268	1.27	109	2.07
その他	1,651	0.13	60	1.14
欧州	1,283	0.10	38	0.72
アジア・オセアニア	332	0.03	21	0.40
複合地域	35	0.00	1	0.02
複合資産	164,005	12.75	1,063	20.19
安定	38,540	3.00	285	5.41
安定成長	76,150	5.92	439	8.34
成長	40,750	3.17	300	5.70
国内バランス	5,442	0.42	26	0.49
安定	4,194	0.33	8	0.15
一般	262	0.02	14	0.27
その他	3,122	0.24	13	0.25

## &lt; 4 &gt; 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	1,285,989	100.00	5,265	100.00
国内REIT	22,673	1.76	142	2.70
日本	22,673	1.76	142	2.70
外国REIT	47,325	3.68	248	4.71
グローバル	19,898	1.55	152	2.89
除く日本	9,001	0.70	64	1.22
含む日本	10,897	0.85	88	1.67
北米	24,899	1.94	52	0.99
その他	2,528	0.20	44	0.84
欧州	76	0.01	4	0.08
アジア・オセアニア	1,635	0.13	24	0.46
オーストラリア	507	0.04	12	0.23
複合地域	64	0.00	3	0.06
複数国	247	0.02	1	0.02
その他	31,021	2.41	223	4.24
絶対収益型	12,511	0.97	85	1.61
ロング・ショート	859	0.07	25	0.47
マーケットニュートラル	304	0.02	13	0.25
GTAA	296	0.02	9	0.17
その他スタイル	10,963	0.85	37	0.70
CB	2,628	0.20	39	0.74
アジア・オセアニア	32	0.00	1	0.02
日本	28	0.00	1	0.02
グローバル	2,568	0.20	37	0.70
コモディティ	9,268	0.72	40	0.76
全業種	2,052	0.16	13	0.25
貴金属	7,132	0.55	25	0.47
エネルギー	51	0.00	1	0.02
その他コモディティ	33	0.00	1	0.02



## &lt; 5 &gt; 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	15,836	10.7	2.92	2.83	1.045
国内株式	22,821	14.8	1.58	1.54	0.976
一般	21,498	14.7	2.27	2.23	1.346
フリー	20,876	14.3	1.77	1.71	1.402
バリュー	23,647	16.0	3.48	3.39	1.221
小型	25,685	15.1	1.43	1.38	1.702
その他	24,675	14.9	0.47	0.43	0.374
日経225	26,595	16.5	0.43	0.36	0.425
TOPIX	26,078	16.1	0.11	0.10	0.227
JPX日経400	24,114	10.0	0.50	0.43	0.461
国内債券	10,220	12.6	0.10	0.10	0.472
一般	10,220	12.6	0.10	0.10	0.472
外国株式(先進国)	19,704	8.1	3.69	3.57	1.034
グローバル	20,311	8.2	2.91	2.76	1.133
除く日本	31,064	11.2	0.61	0.58	0.517
含む日本	17,140	7.3	3.94	3.75	1.409
その他	18,347	7.7	5.04	4.96	0.865
北米	19,014	6.5	0.46	0.46	0.744
米国	19,184	6.9	5.11	5.03	0.851
カナダ	7,321	9.0	9.09	9.12	1.891
欧州	16,806	12.9	3.56	3.39	1.269
ドイツ	19,732	10.5	0.00	0.00	0.770
アジア・オセアニア	11,723	18.3	8.71	8.08	1.823
オーストラリア	11,183	9.5	2.87	2.80	1.672
ニュージーランド	17,849	12.2	12.93	15.71	1.705
複合地域	10,821	11.4	3.92	3.49	1.649
エマージング株式	15,799	11.3	0.76	0.72	0.863
グローバル	15,893	8.9	0.86	0.77	2.052
BRICS	17,202	18.4	4.76	4.23	1.861
その他	15,707	12.1	0.82	0.64	1.943
欧州	9,514	18.3	0.00	0.00	1.273
ロシア	1,115	15.4	2.68	2.45	1.721
アジア・オセアニア	16,972	14.0	0.72	0.72	1.909
中国	13,412	10.2	5.28	4.65	1.876
インド	20,133	10.4	0.92	0.94	1.778
インドネシア	12,503	9.9	0.20	0.18	1.681
フィリピン	10,590	11.6	2.42	2.53	1.858
ベトナム	17,975	6.7	0.00	0.00	1.804
韓国	13,688	5.8	3.01	2.65	0.858
香港	15,116	15.1	0.73	0.76	2.037
中南米	10,571	17.7	3.52	4.30	1.970
ブラジル	5,612	13.1	1.50	1.62	1.667
メキシコ	12,323	11.5	0.47	0.37	2.226
中東・アフリカ	15,438	16.6	3.19	3.04	2.023
トルコ	17,204	23.2	1.71	1.47	0.958
複合地域	18,014	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

## &lt;5&gt; 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	15,836	10.7	2.92	2.83	1.045
外国債券(先進国)	10,619	11.1	1.20	1.15	0.946
グローバル	11,094	11.1	1.03	1.00	0.896
除く日本	12,355	13.6	0.69	0.67	0.685
含む日本	10,139	9.3	1.34	1.31	1.082
その他	9,421	11.1	1.97	1.83	1.170
北米	10,552	8.2	1.76	1.66	1.107
米国	10,118	8.5	1.95	1.76	1.099
カナダ	8,477	14.8	1.51	1.47	1.378
欧州	7,731	16.8	1.29	1.26	0.987
イギリス	7,324	9.2	3.96	3.55	1.393
アジア・オセアニア	9,846	14.5	2.44	2.30	1.433
オーストラリア	8,930	15.1	2.08	1.96	1.243
ニュージーランド	10,307	10.6	1.56	1.41	1.405
複合地域	5,605	14.4	2.09	2.01	1.192
エマージング債券	10,392	12.6	3.37	3.44	1.353
グローバル	10,788	13.2	2.08	1.97	1.142
米ドル建て	10,597	13.8	2.39	2.23	1.313
現地通貨建て	11,392	11.3	1.37	1.37	0.751
その他	9,532	11.3	5.12	5.43	1.639
ロシア	2,130	11.7	0.00	0.00	1.595
アジア・オセアニア	10,132	10.3	6.58	6.61	1.621
中国	12,129	5.0	1.24	1.20	1.235
インド	10,203	10.1	5.82	6.10	1.707
インドネシア	10,040	11.9	4.96	5.09	1.667
ブラジル	10,270	14.3	3.95	4.44	1.581
メキシコ	8,388	11.9	4.46	4.91	1.368
トルコ	1,297	12.0	5.23	6.07	1.474
複合地域	4,411	18.1	1.45	1.36	1.210
ハイールド債券	9,472	12.8	4.75	4.66	1.641
グローバル	8,654	11.2	2.91	2.75	1.390
北米	10,687	13.8	4.92	4.85	1.675
その他	7,852	12.1	6.29	6.17	1.766
欧州	8,215	11.7	5.65	5.46	1.739
アジア・オセアニア	7,337	12.5	8.91	9.05	1.867
複合地域	4,861	20.5	5.16	4.94	1.800
複合資産	14,553	10.1	1.14	1.12	0.909
安定	11,866	10.2	1.53	1.54	1.041
安定成長	14,093	10.5	1.23	1.20	0.919
成長	18,049	9.5	0.39	0.37	0.776
国内バランス	12,915	11.9	2.16	2.25	0.962
安定	10,713	12.9	1.72	1.77	0.913
一般	14,348	12.6	1.12	1.08	1.205
その他	11,615	4.4	1.62	1.35	0.674

(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

## &lt; 5 &gt; 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	15,836	10.7	2.92	2.83	1.045
国内REIT	13,357	10.7	6.52	7.79	0.882
日本	13,357	10.7	6.52	7.79	0.882
外国REIT	14,072	10.1	7.94	7.14	1.424
グローバル	15,716	9.7	3.19	2.76	1.161
除く日本	17,695	8.4	2.01	1.77	0.929
含む日本	14,277	10.7	4.18	3.57	1.353
北米	11,843	10.7	11.82	10.69	1.603
その他	11,025	10.4	6.88	6.47	1.739
欧州	5,282	11.5	5.31	4.62	1.918
アジア・オセアニア	11,713	9.7	8.67	8.40	1.797
オーストラリア	12,026	10.0	4.36	3.46	1.686
複合地域	8,680	12.6	0.92	0.67	0.774
複数国	12,488	20.4	2.18	1.92	1.650
その他					
絶対収益型	10,857	7.2	0.04	0.04	1.920
ロング・ショート	10,521	6.5	0.12	0.11	1.693
マーケットニュートラル	10,299	6.9	0.94	0.95	1.246
GTAA	11,775	11.3	0.22	0.22	1.561
その他スタイル	11,011	6.8	0.00	0.00	1.971
CB	12,370	7.6	0.33	0.32	1.184
アジア・オセアニア	11,196	14.3	2.27	2.14	1.823
日本	14,671	24.8	0.36	0.34	0.770
グローバル	12,339	7.0	0.30	0.29	1.181
コモディティ	14,522	7.3	0.06	0.07	0.866
全業種	10,997	11.0	0.27	0.32	1.236
貴金属	15,953	5.0	0.00	0.00	0.759
エネルギー	19,357	15.6	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	19,747	8.0	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