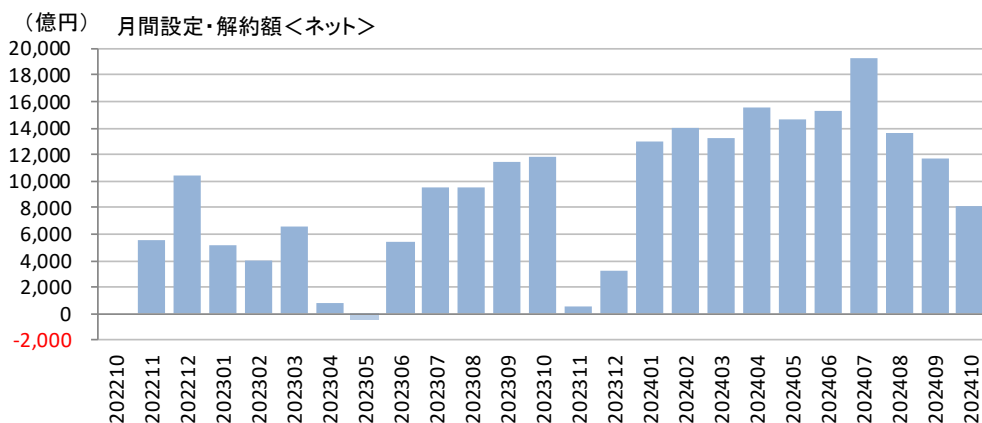
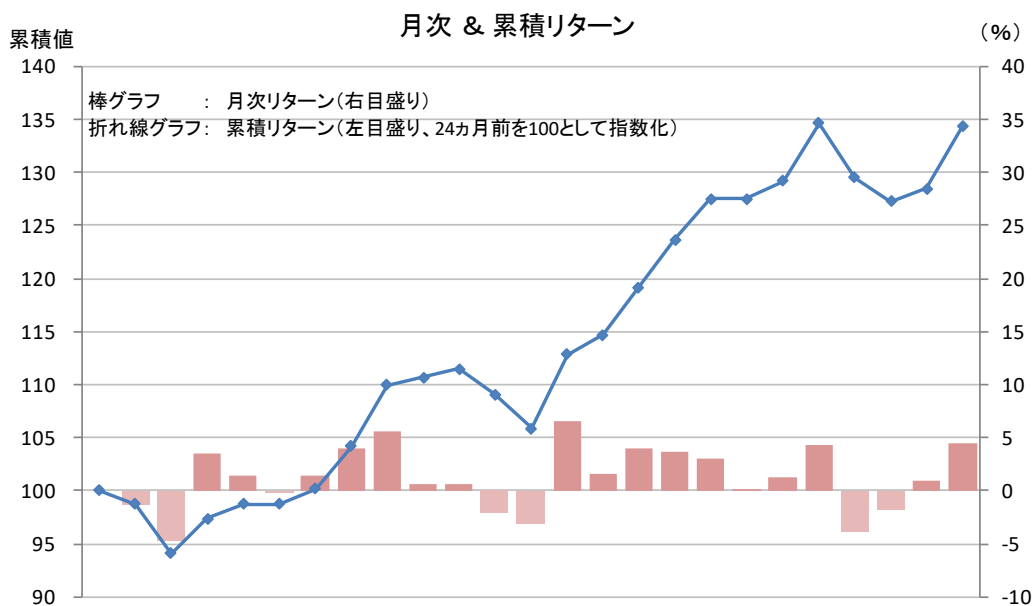


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.2 ファンド分類 詳細編 －

2024年10月

「総合」 +4.54 %
(前月 +0.94 %)



MAB-FPI について

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

(FPI は Fund Performance Index の略)

■主な特徴

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

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

■本レポートの内容

掲載対象カテゴリー：「総合」

|--- ファンド分類別「大分類」
|--- " " 「中分類」
|--- " " 「小分類」

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

<1>パフォーマンス・サマリー

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

<2>リスク・サマリー

・ ・ ・ ・ ・ P. 22

<3>設定・解約額 [ネット金額]

・ ・ ・ ・ ・ P. 35

<4>純資産額、ファンド本数

・ ・ ・ ・ ・ P. 38

<5>属性、指標等

・ ・ ・ ・ ・ P. 41

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別①

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		21,146	20,228	918	4.54
国内株式		27,471	27,122	349	1.29
一般		26,513	26,344	169	0.64
フリー		24,571	24,439	132	0.54
バリュー		35,651	35,344	306	0.87
小型		44,664	45,291	-627	-1.38
その他		28,385	27,711	674	2.43
日経225		27,464	26,663	801	3.00
TOPIX		27,946	27,435	511	1.86
JPX日経400	10,000 (2014.01.31)	26,624	26,208	416	1.59
国内債券		12,246	12,316	-70	-0.57
一般		12,246	12,316	-70	-0.57
外国株式(先進国)		31,612	29,442	2,169	7.37
グローバル		33,332	31,269	2,063	6.60
除く日本		54,588	51,049	3,539	6.93
含む日本		28,758	27,016	1,741	6.45
その他		27,454	25,257	2,196	8.70
北米		35,115	32,228	2,886	8.96
米国		42,873	39,378	3,495	8.88
カナダ	10,000 (2009.02.27)	25,308	24,124	1,184	4.91
欧州		30,998	30,776	222	0.72
ドイツ	8,368 (2014.03.31)	16,839	16,295	544	3.34
アジア・オセアニア	10,000 (1998.05.29)	48,050	46,696	1,354	2.90
オーストラリア	12,755 (2008.06.30)	24,775	24,817	-42	-0.17
ニュージーランド	10,000 (2012.07.31)	50,453	49,129	1,324	2.69
複合地域	10,000 (2013.04.30)	17,184	15,579	1,605	10.31
エマージング株式		26,104	25,780	324	1.26
グローバル		25,075	24,277	798	3.29
BRICS	10,000 (2005.09.30)	29,159	28,586	573	2.00
その他		27,778	27,588	190	0.69
欧州		20,297	19,891	406	2.04
ロシア	10,000 (2007.03.30)	1,619	1,190	430	36.10
アジア・オセアニア		23,135	22,455	680	3.03
中国		39,939	36,860	3,079	8.35
インド	10,000 (2004.09.30)	77,015	76,912	103	0.13
インドネシア	7,365 (2009.11.30)	17,987	18,052	-65	-0.36
フィリピン	3,213 (2010.05.31)	9,367	9,169	198	2.16
ベトナム	10,000 (2010.04.30)	28,197	27,607	589	2.14
韓国	10,000 (1997.06.30)	30,378	30,430	-51	-0.17
香港		26,786	25,245	1,541	6.11
中南米	7,427 (2006.04.28)	11,875	11,588	287	2.48
ブラジル	10,000 (2006.03.31)	9,848	9,815	33	0.34
メキシコ	10,511 (2013.02.28)	15,750	15,610	139	0.89
中東・アフリカ	10,000 (2007.08.31)	16,544	15,736	808	5.13
トルコ		48,772	48,991	-219	-0.45
複合地域	10,000 (2005.08.31)	29,729	29,093	637	2.19

※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

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別②

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		21,146	20,228	918	4.54
外国債券(先進国)		20,137	19,793	345	1.74
グローバル		20,025	19,664	361	1.83
除く日本		22,579	21,987	592	2.69
含む日本		18,356	18,161	196	1.08
その他		20,887	20,616	271	1.32
北米	9,052 (2013.05.31)	11,596	11,358	237	2.09
米国		19,364	19,053	312	1.64
カナダ	10,000 (2003.05.30)	18,809	18,171	639	3.51
欧州	10,000 (1998.07.31)	15,558	15,305	254	1.66
イギリス	10,069 (2014.07.31)	12,999	12,576	423	3.36
アジア・オセアニア	10,000 (2003.06.30)	23,467	23,365	102	0.44
オーストラリア	10,000 (2002.10.31)	29,119	28,941	179	0.62
ニュージーランド	10,000 (2014.02.28)	12,930	12,925	4	0.03
複合地域	10,000 (2001.11.30)	20,102	19,889	213	1.07
エマージング債券		22,487	21,646	841	3.88
グローバル		23,064	22,336	729	3.26
米ドル建て		23,700	22,846	853	3.73
現地通貨建て	10,000 (2006.06.30)	16,312	15,959	354	2.22
その他	8,647 (2005.03.31)	17,566	16,775	792	4.72
ロシア	10,000 (2008.05.30)	1,721	1,636	85	5.18
アジア・オセアニア	8,647 (2005.03.31)	18,038	17,392	646	3.72
中国	13,833 (2018.07.31)	20,351	19,722	629	3.19
インド	10,000 (2011.08.31)	23,826	22,251	1,575	7.08
インドネシア	10,000 (2010.08.31)	21,006	20,641	365	1.77
ブラジル	10,000 (2007.12.28)	15,694	15,541	153	0.98
メキシコ	10,000 (2011.04.28)	19,178	18,765	413	2.20
トルコ	10,000 (2011.04.28)	2,472	2,337	135	5.77
複合地域	10,000 (2006.08.31)	13,254	13,070	184	1.41
ハイイールド債券		32,341	30,645	1,695	5.53
グローバル	10,000 (1997.06.30)	29,794	28,648	1,146	4.00
北米		32,920	31,063	1,857	5.98
その他	10,000 (2004.03.31)	28,507	27,408	1,099	4.01
欧州	10,000 (2006.04.28)	28,980	27,979	1,001	3.58
アジア・オセアニア	10,000 (2011.07.29)	17,410	16,502	908	5.50
複合地域	10,000 (2004.03.31)	28,631	27,096	1,536	5.67
複合資産		22,311	21,806	505	2.32
安定	10,000 (1998.10.30)	17,420	17,168	252	1.47
安定成長		25,029	24,376	654	2.68
成長		33,004	32,010	994	3.11
国内バランス		12,472	12,529	-57	-0.45
安定		12,415	12,485	-70	-0.56
一般		18,565	18,474	92	0.50
その他	10,000 (2018.10.31)	14,265	14,510	-245	-1.69

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

<1>パフォーマンス・サマリー

(1) 当月リターン

「総合」およびファンド分類別③

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		21,146	20,228	918	4.54
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	33,046	33,849	-803	-2.37
日本	10,000 (2003.10.31)	33,046	33,849	-803	-2.37
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	43,694	41,484	2,210	5.33
グローバル	10,000 (2004.01.30)	35,906	34,456	1,451	4.21
除く日本	10,000 (2004.04.30)	40,959	39,311	1,649	4.19
含む日本	10,000 (2004.01.30)	35,096	33,674	1,422	4.22
北米	10,000 (2003.09.30)	47,052	44,061	2,991	6.79
その他	10,000 (2004.04.30)	35,035	35,159	-124	-0.35
欧州	10,000 (2006.12.29)	6,175	6,179	-4	-0.06
アジア・オセアニア	10,000 (2007.07.31)	24,937	25,194	-257	-1.02
オーストラリア	10,000 (2004.11.30)	21,675	21,950	-275	-1.25
複合地域	10,000 (2007.06.29)	9,509	9,264	245	2.64
複数国	10,000 (2004.04.30)	54,469	51,886	2,583	4.98
その他		7,901	7,645	255	3.34
絶対収益型		7,640	7,757	-117	-1.51
ロング・ショート		8,237	8,329	-92	-1.11
マーケットニュートラル	10,000 (2000.04.28)	11,874	11,891	-17	-0.14
GTAA		11,930	11,720	210	1.79
その他スタイル	10,000 (1999.02.26)	7,173	7,295	-122	-1.67
CB		21,553	21,072	481	2.28
アジア・オセアニア	13,820 (2007.10.31)	24,808	23,758	1,050	4.42
日本		21,465	21,586	-121	-0.56
グローバル		37,567	36,728	839	2.29
コモディティ	10,000 (2004.12.30)	16,496	15,085	1,411	9.35
全業種	10,000 (2004.12.30)	12,793	12,020	773	6.43
貴金属	10,000 (2009.07.31)	29,354	26,639	2,715	10.19
エネルギー	10,000 (2006.11.30)	10,899	10,024	875	8.73
その他コモディティ	10,000 (2005.09.30)	18,978	17,877	1,101	6.16

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

[色塗りの基準]月次リターン> 総合

＜1＞パフォーマンス・サマリー

(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	3.74	5.33	26.92	17.13
国内株式	-2.07	-0.35	21.78	14.71
一般	-2.50	-0.51	20.87	14.42
フリー	-2.08	0.14	21.45	14.42
バリュー	-3.40	-1.96	19.38	14.47
小型	-2.33	-1.13	12.12	3.52
その他	-1.44	-0.14	24.26	16.57
日経225	0.52	2.36	28.28	18.19
TOPIX	-2.64	-0.70	22.14	16.17
JPX日経400	-3.09	-0.36	24.16	17.11
国内債券	0.62	-0.21	0.46	-1.75
一般	0.62	-0.21	0.46	-1.75
外国株式(先進国)	6.87	8.55	40.22	25.28
グローバル	6.35	7.52	38.60	23.03
除く日本	6.50	9.00	39.59	27.16
含む日本	6.28	6.88	38.15	21.28
その他	7.75	10.39	43.18	29.60
北米	8.14	10.40	42.47	31.44
米国	7.86	10.57	43.67	30.04
カナダ	4.61	2.67	20.81	13.27
欧州	-0.07	2.13	25.36	13.15
ドイツ	5.47	4.34	34.91	20.31
アジア・オセアニア	4.02	4.35	24.51	18.36
オーストラリア	3.57	3.58	25.96	12.31
ニュージーランド	0.14	-1.70	14.95	2.18
複合地域	-0.98	-7.73	8.91	16.55
エマーシング株式	0.26	4.67	27.88	21.17
グローバル	5.76	5.47	28.31	21.34
BRICS	6.40	4.17	20.05	15.85
その他	-1.38	4.54	28.07	21.41
欧州	1.35	0.60	29.73	19.35
ロシア	48.37	48.68	49.31	50.53
アジア・オセアニア	6.53	7.01	23.52	19.85
中国	17.83	5.09	8.23	15.33
インド	-2.96	4.62	31.40	23.25
インドネシア	6.73	2.17	5.95	1.89
フィリピン	11.51	5.37	23.71	16.84
ベトナム	2.06	3.33	26.83	20.25
韓国	-0.46	-8.68	5.93	-5.88
香港	22.11	16.48	24.31	33.77
中南米	0.55	-12.87	3.42	-10.81
ブラジル	1.51	-10.48	1.65	-12.19
メキシコ	-7.71	-25.03	0.24	-14.18
中東・アフリカ	7.65	9.74	32.24	22.04
トルコ	-13.58	-11.53	17.00	24.94
複合地域	2.71	0.92	16.07	8.84

※[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	3.74	5.33	26.92	17.13
外国債券(先進国)	0.75	1.68	9.65	4.71
グローバル	0.65	1.46	8.83	4.54
除く日本	1.02	1.79	10.85	6.14
含む日本	0.32	1.17	7.16	3.21
その他	1.19	2.65	13.44	5.47
北米	1.46	3.58	13.08	5.66
米国	1.11	4.82	15.84	5.54
カナダ	1.44	0.53	9.88	5.98
欧州	1.28	2.58	10.63	5.23
イギリス	1.78	3.62	19.81	9.86
アジア・オセアニア	1.78	0.48	11.99	4.91
オーストラリア	1.49	0.29	12.11	5.31
ニュージーランド	2.58	3.94	16.82	5.53
複合地域	-0.66	-0.55	8.61	4.61
エマージング債券	1.62	-0.01	11.30	7.95
グローバル	2.25	2.02	15.76	9.74
米ドル建て	2.24	2.52	17.88	10.92
現地通貨建て	2.33	0.88	10.64	6.96
その他	0.80	-2.66	5.71	5.56
ロシア	-9.98	-5.64	271.09	246.61
アジア・オセアニア	2.41	3.98	13.72	11.23
中国	1.88	1.39	8.70	9.32
インド	1.63	1.42	9.75	12.86
インドネシア	4.89	4.70	10.57	9.10
ブラジル	-1.51	-12.13	-5.24	-8.33
メキシコ	-4.84	-14.16	-0.11	-7.45
トルコ	-0.99	0.18	0.93	0.40
複合地域	0.43	-1.49	9.31	5.73
ハイイールド債券	2.85	3.04	16.49	12.76
グローバル	2.03	2.92	16.09	10.74
北米	3.02	3.12	16.66	13.35
その他	2.79	2.74	15.70	10.77
欧州	2.77	2.37	15.02	9.45
アジア・オセアニア	2.95	4.10	18.14	15.71
複合地域	2.29	3.09	16.69	12.60
複合資産	1.85	2.82	15.73	9.82
安定	1.05	1.69	10.23	5.87
安定成長	2.18	3.10	16.72	10.76
成長	2.23	3.65	21.21	14.20
国内バランス	-0.26	-1.29	1.89	-0.12
安定	0.16	-1.04	1.04	-1.05
一般	-2.41	-2.26	8.87	5.97
その他	1.99	7.03	31.89	8.18

※[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	3.74	5.33	26.92	17.13
国内REIT	-1.49	-5.37	-3.58	-3.55
日本	-1.49	-5.37	-3.58	-3.55
外国REIT	7.07	15.78	38.45	18.30
グローバル	6.56	14.32	37.62	17.09
除く日本	6.95	15.60	40.77	18.57
含む日本	6.24	13.30	35.26	15.92
北米	7.57	17.80	40.53	20.22
その他	5.79	7.53	25.67	9.28
欧州	0.04	-0.18	24.96	6.26
アジア・オセアニア	5.73	7.00	20.82	6.57
オーストラリア	6.58	8.58	44.30	16.72
複合地域	6.92	6.63	31.83	15.17
複数国	6.05	11.81	26.76	14.15
その他	3.63	4.77	20.53	13.64
絶対収益型	-1.13	-1.01	3.92	1.64
ロング・ショート	-0.97	-1.57	0.70	0.79
マーケットニュートラル	1.73	2.64	5.05	4.77
GTAA	1.06	0.25	6.73	5.10
その他スタイル	-1.28	-1.09	4.13	1.51
CB	1.78	1.45	7.68	4.99
アジア・オセアニア	5.19	2.69	13.52	15.85
日本	-2.44	-2.58	7.28	3.48
グローバル	1.79	1.48	7.62	4.89
コモディティ	12.24	10.26	26.82	30.69
全業種	4.00	-4.77	2.38	12.03
貴金属	14.98	15.83	37.28	37.57
エネルギー	-3.13	-11.03	-2.33	12.12
その他コモディティ	5.11	-0.41	12.52	18.82

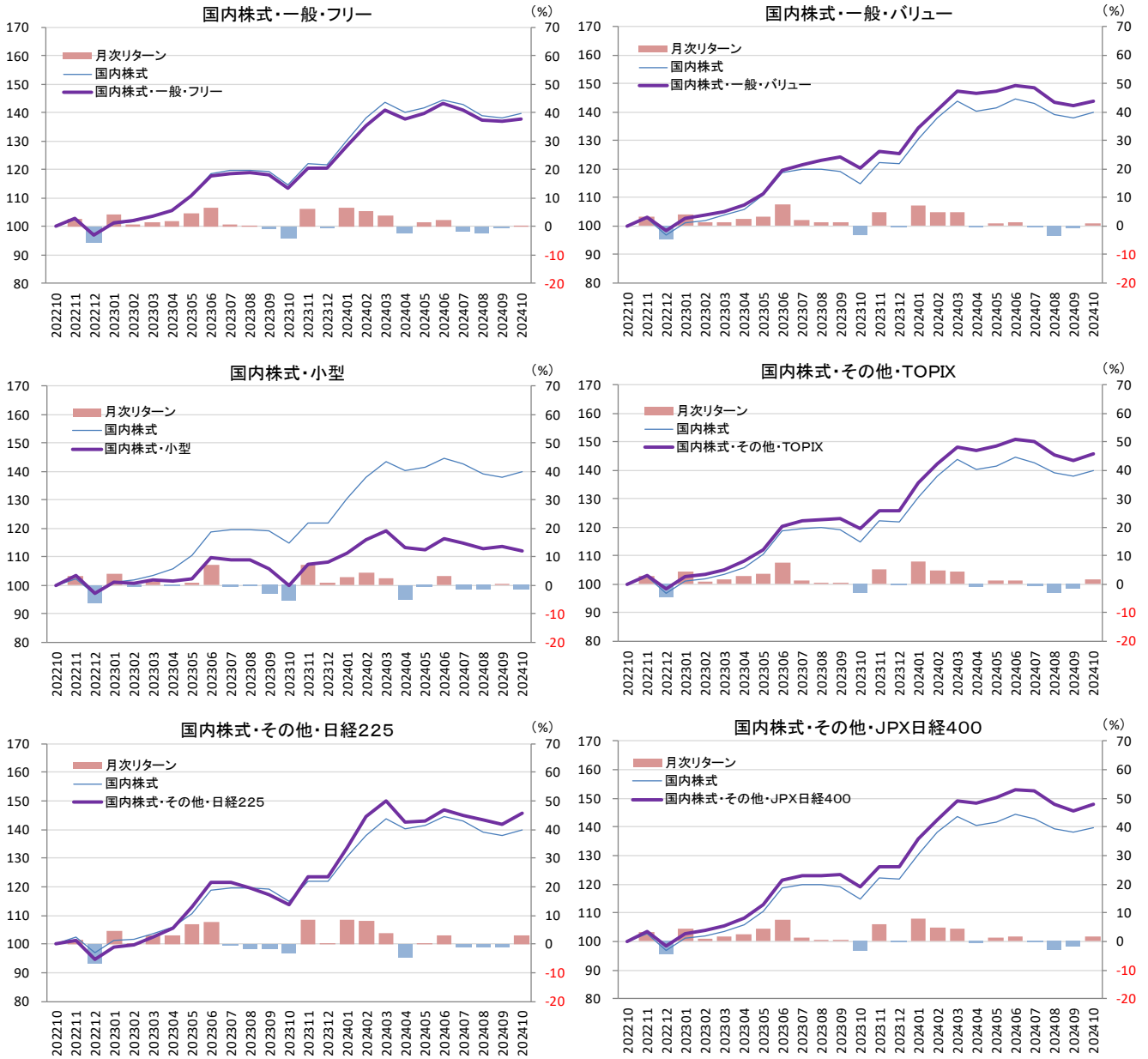
※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

<1>パフォーマンス・サマリー

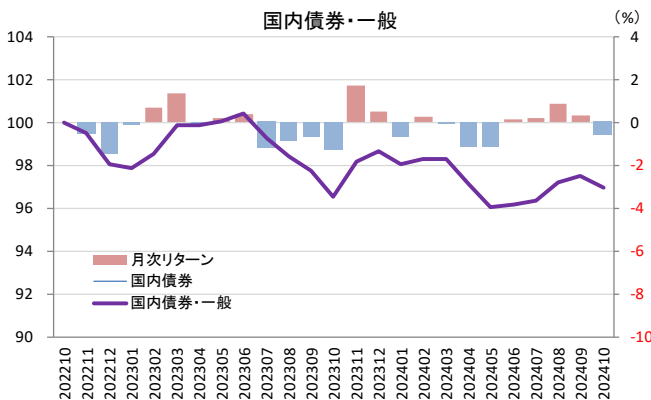
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

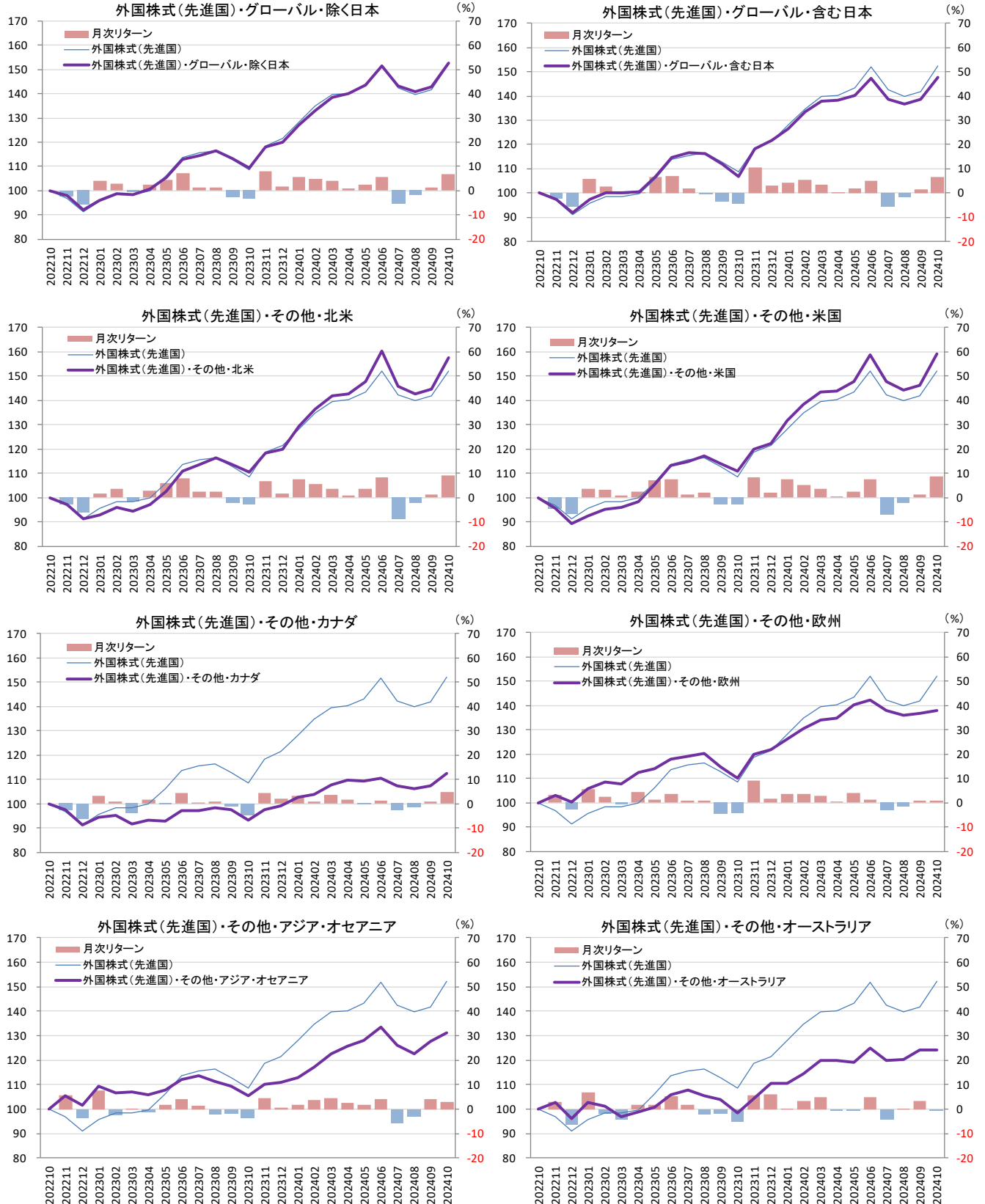


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別②

[外国株式 (先進国)]

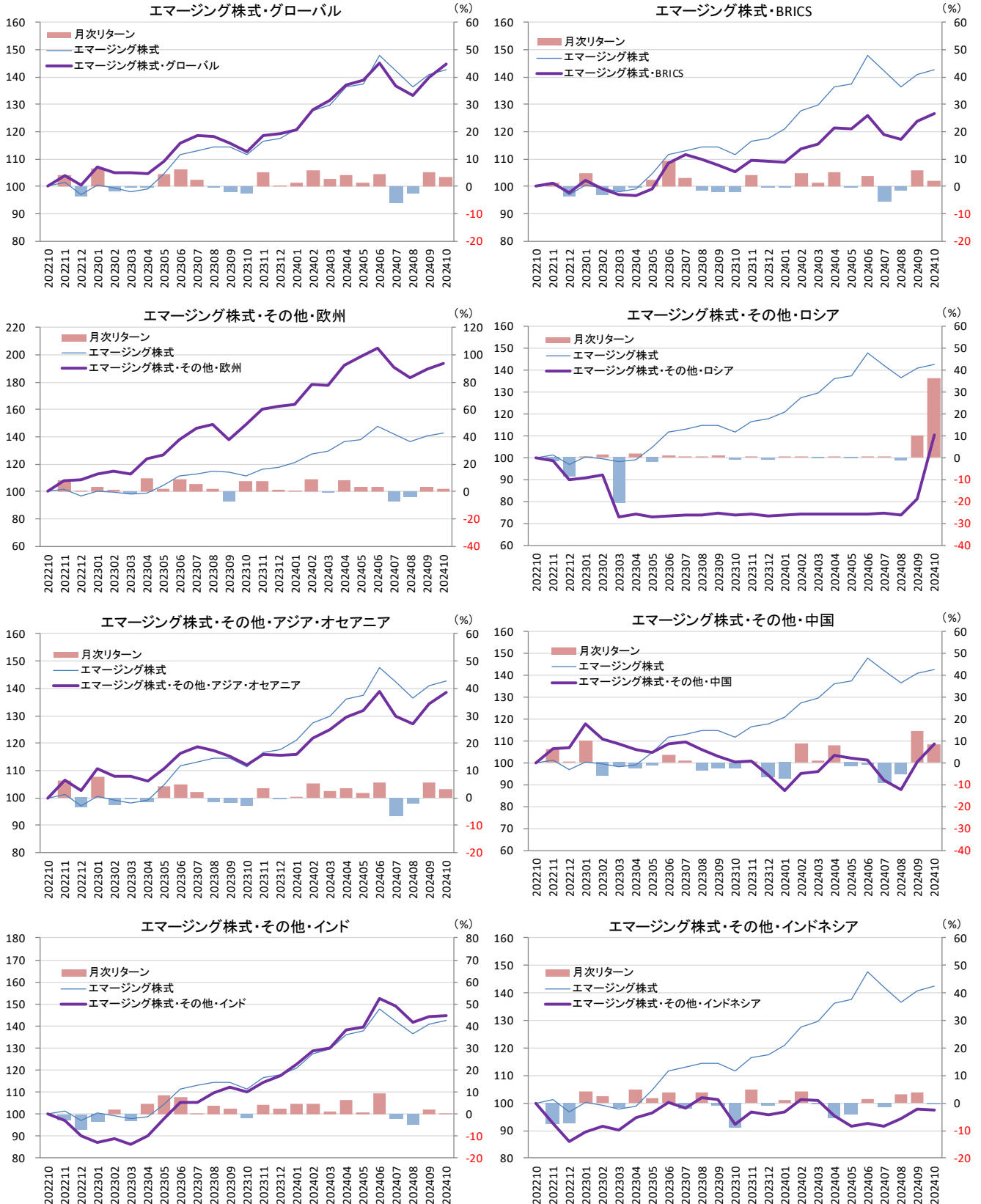


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別③

[エマージング株式]

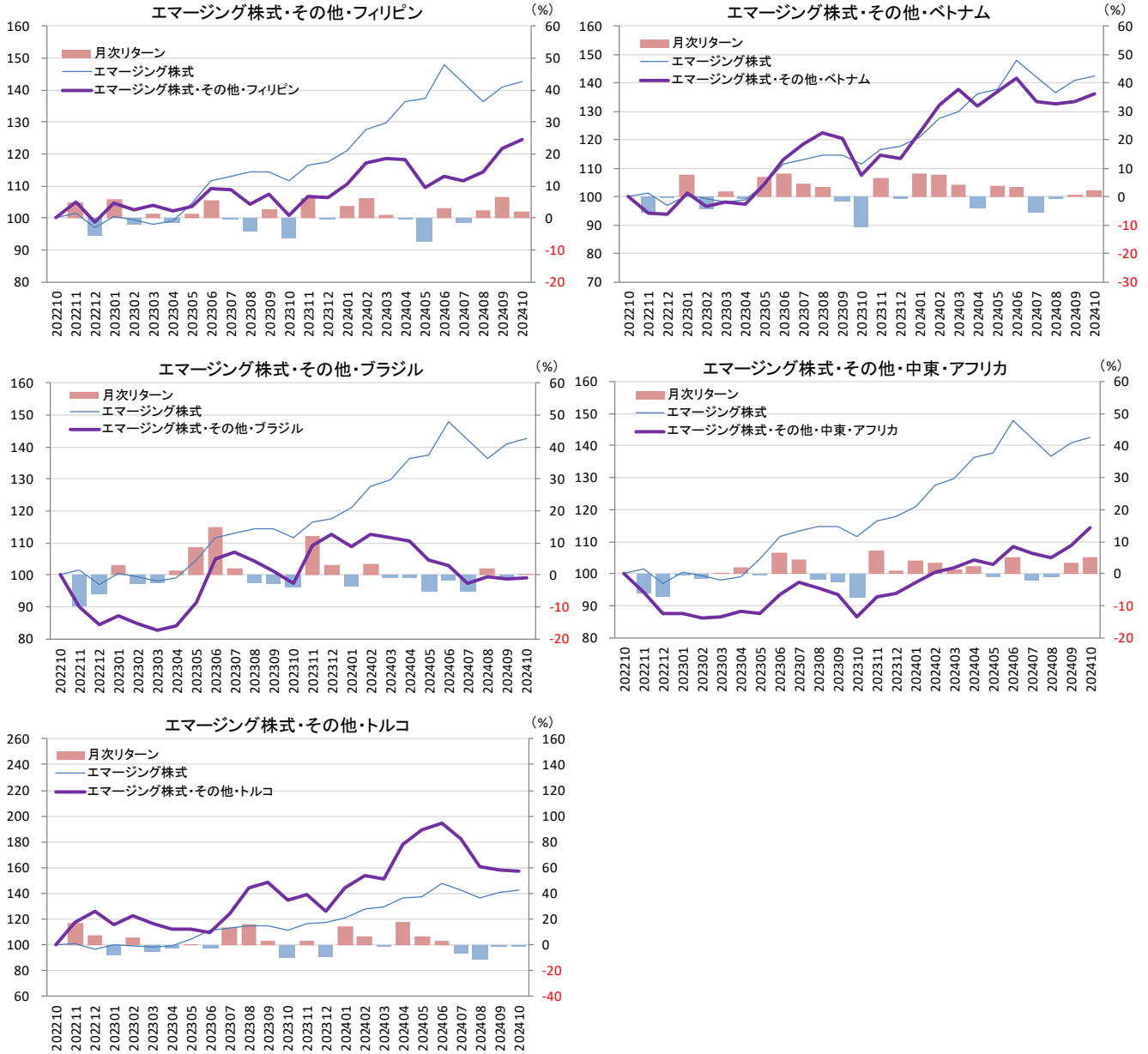


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別④

[エマージング株式]

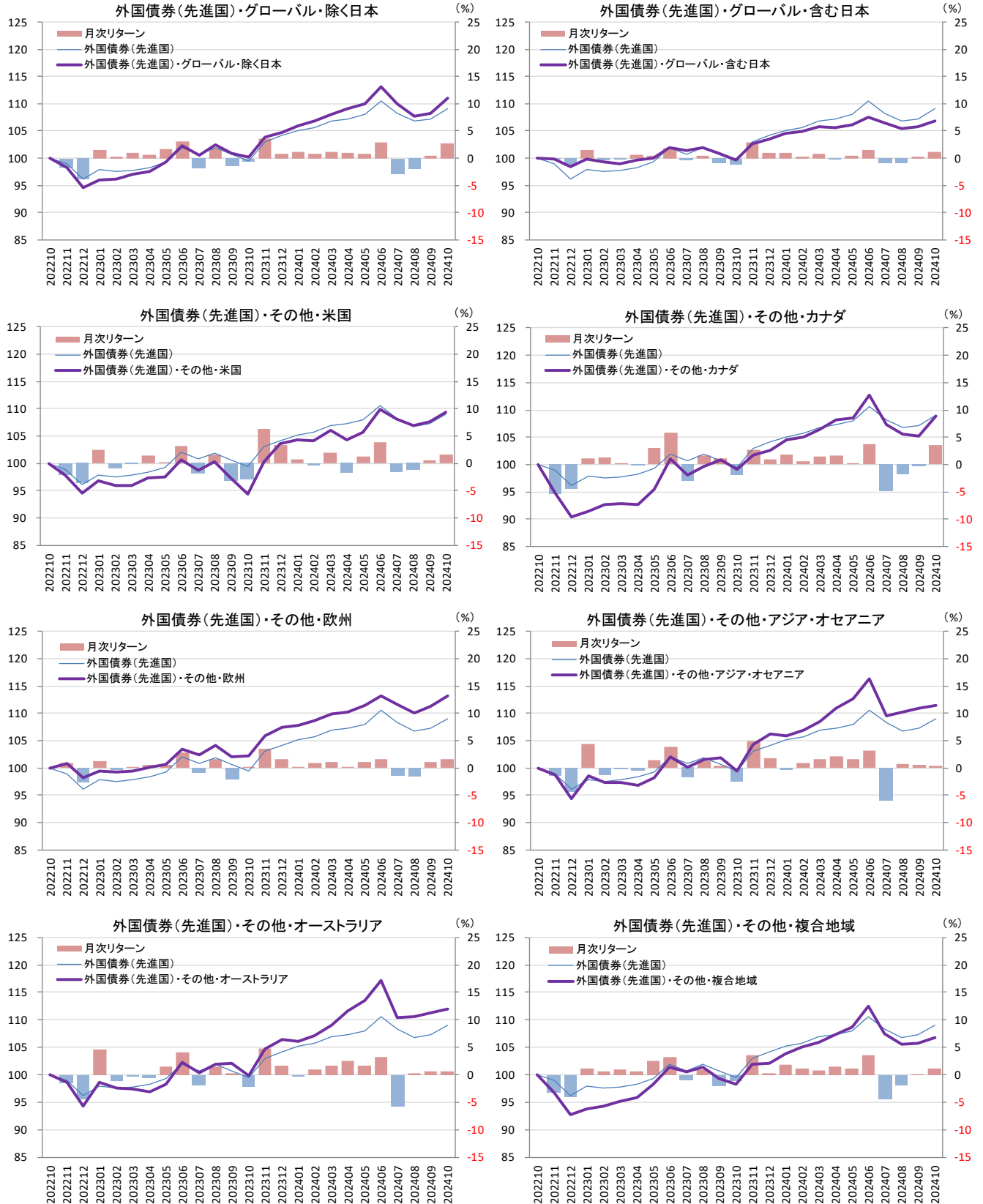


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑤

[外国債券 (先進国)]

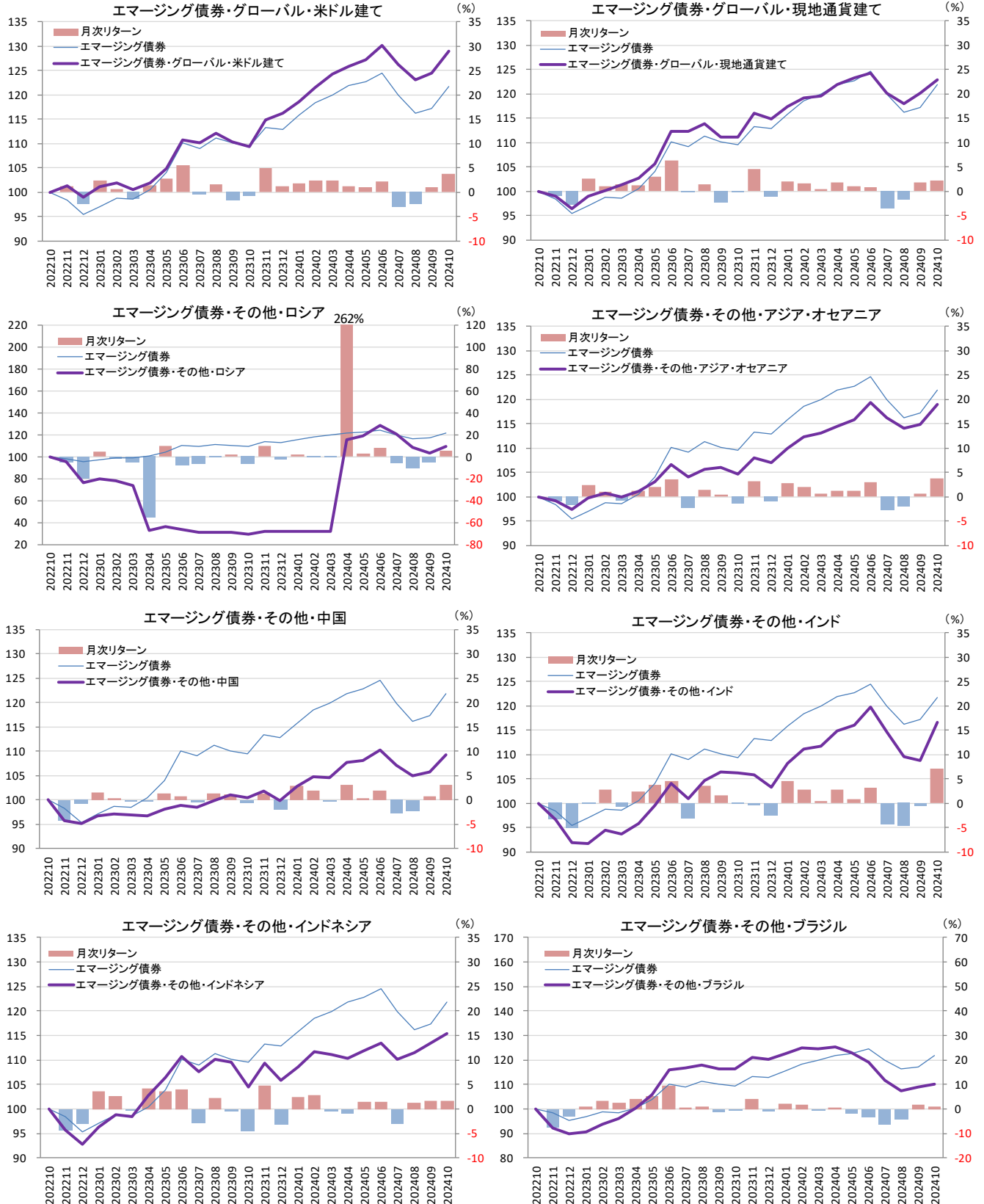


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑥

[エマーシング債券]

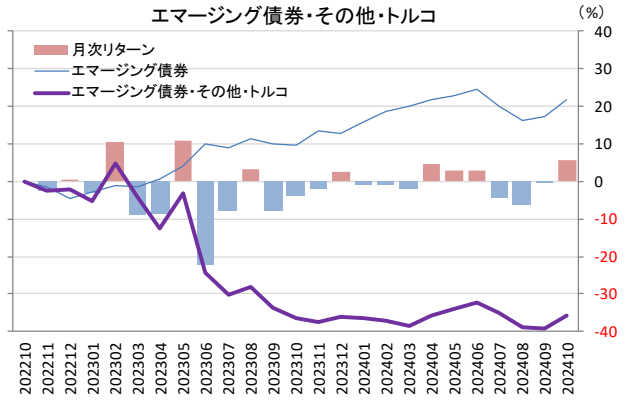
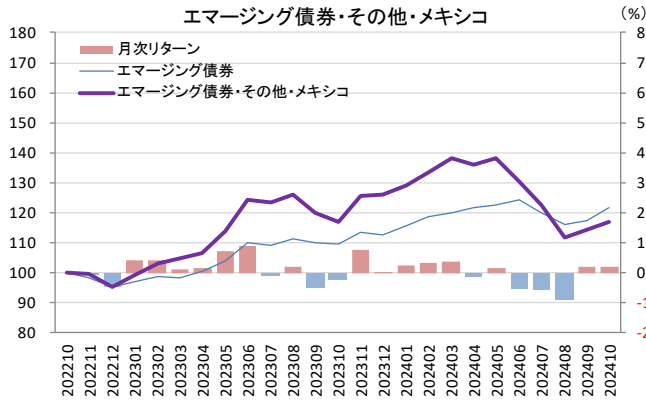


<1>パフォーマンス・サマリー

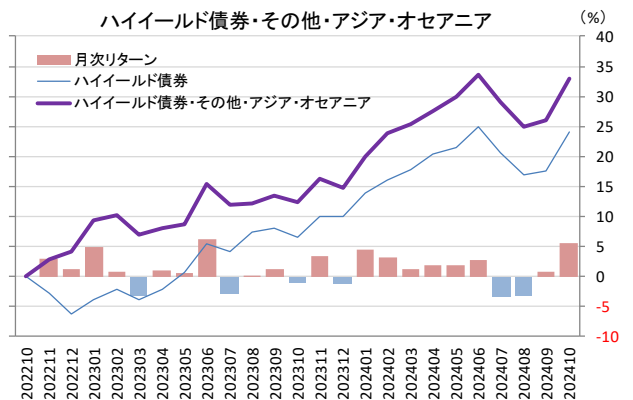
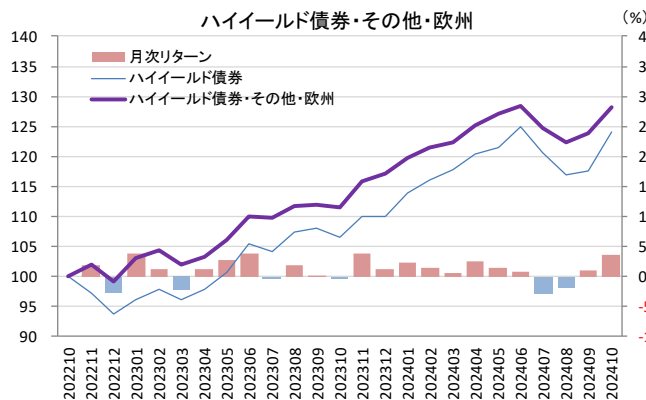
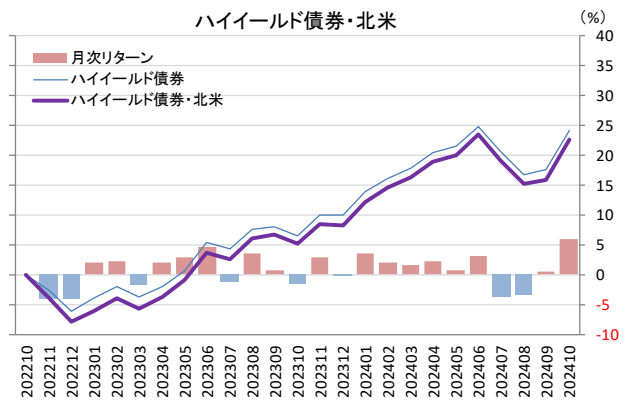
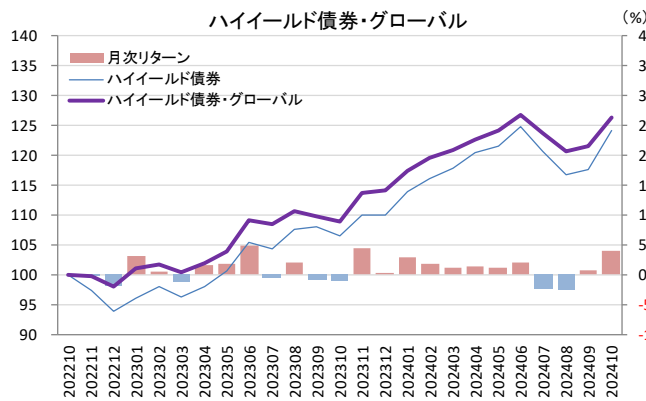
(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

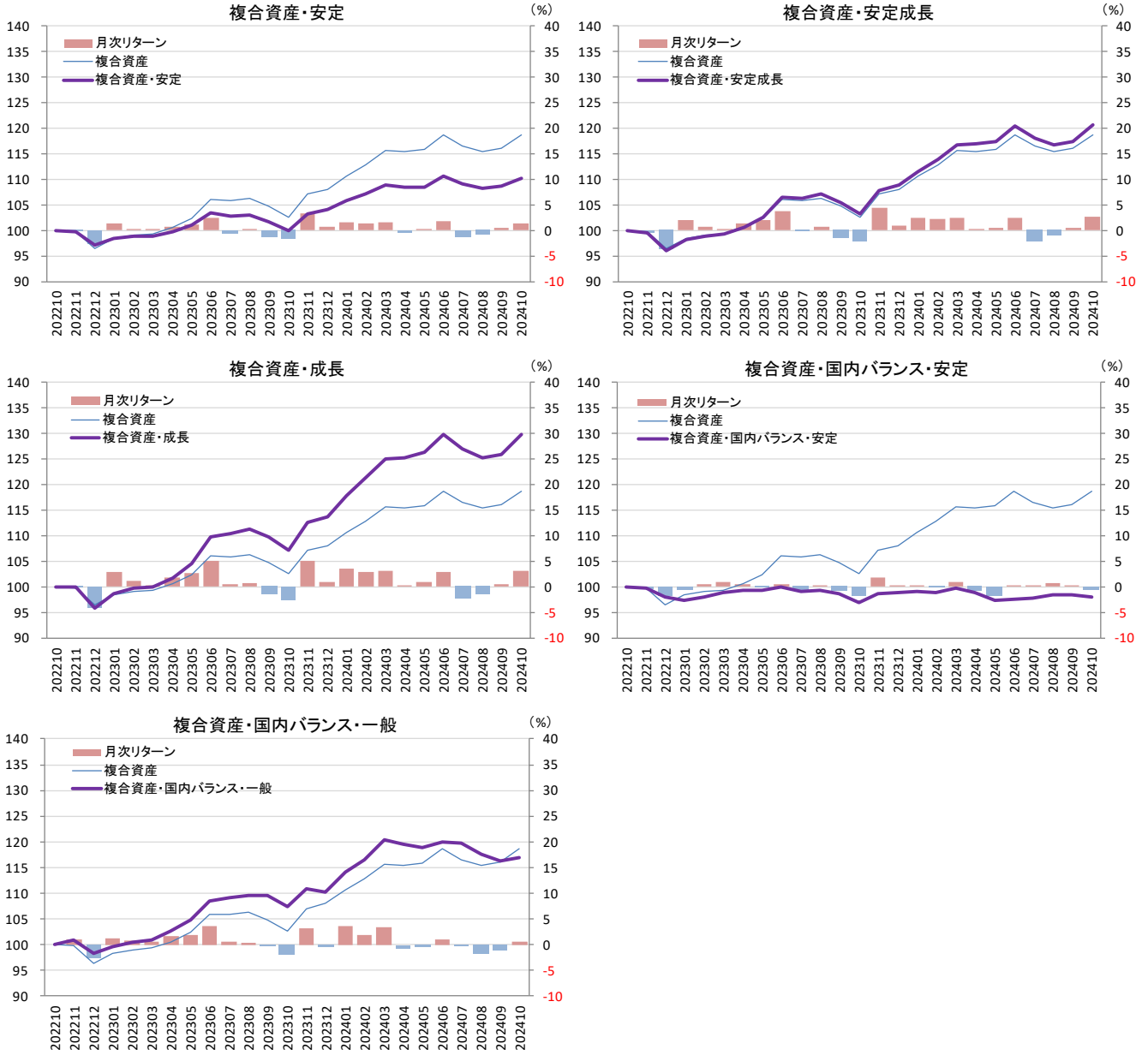


<1>パフォーマンス・サマリー

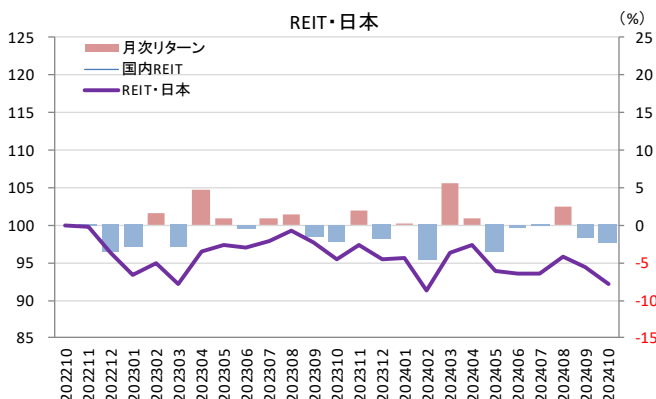
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内REIT]

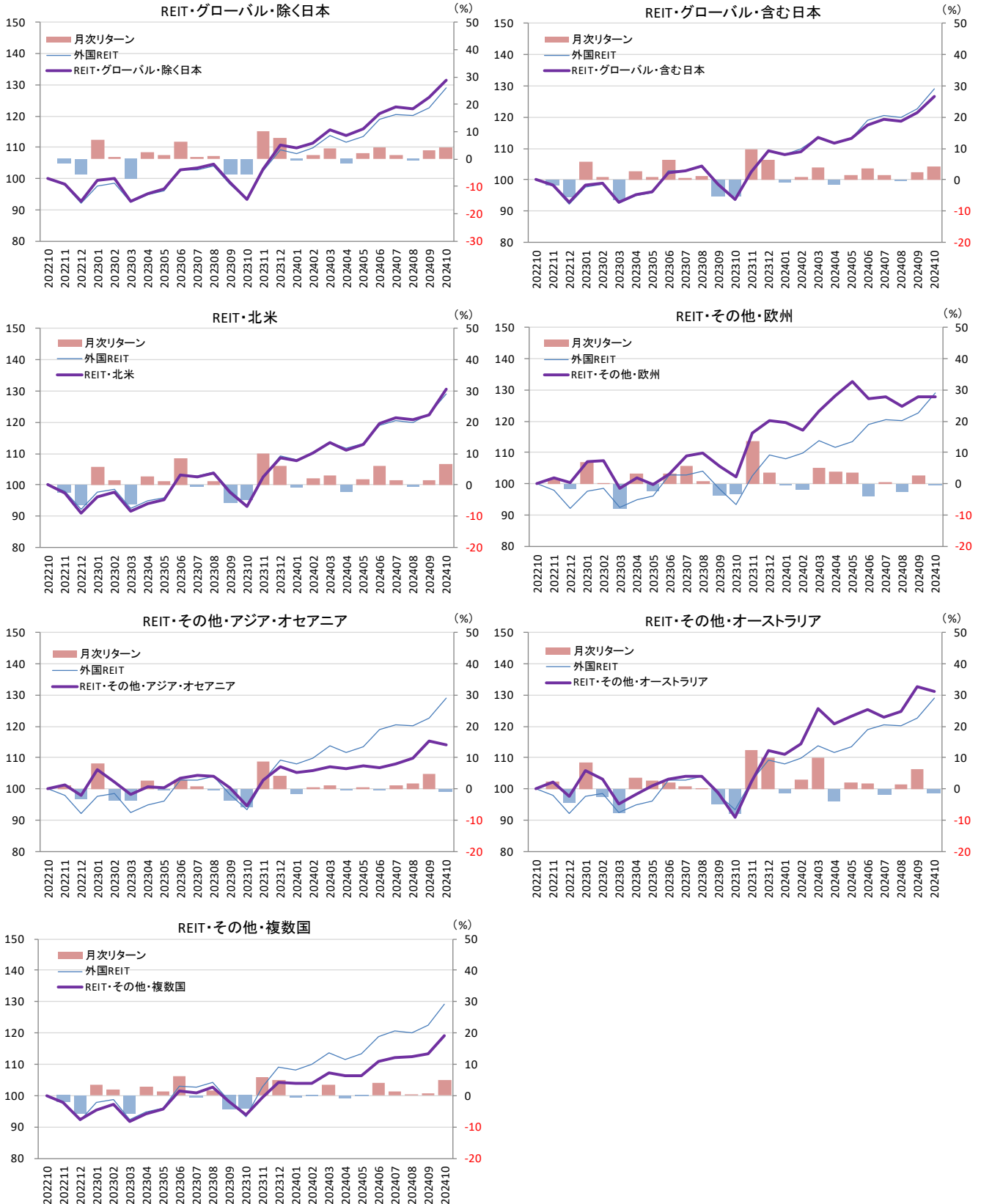


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑨

[外国 REIT]

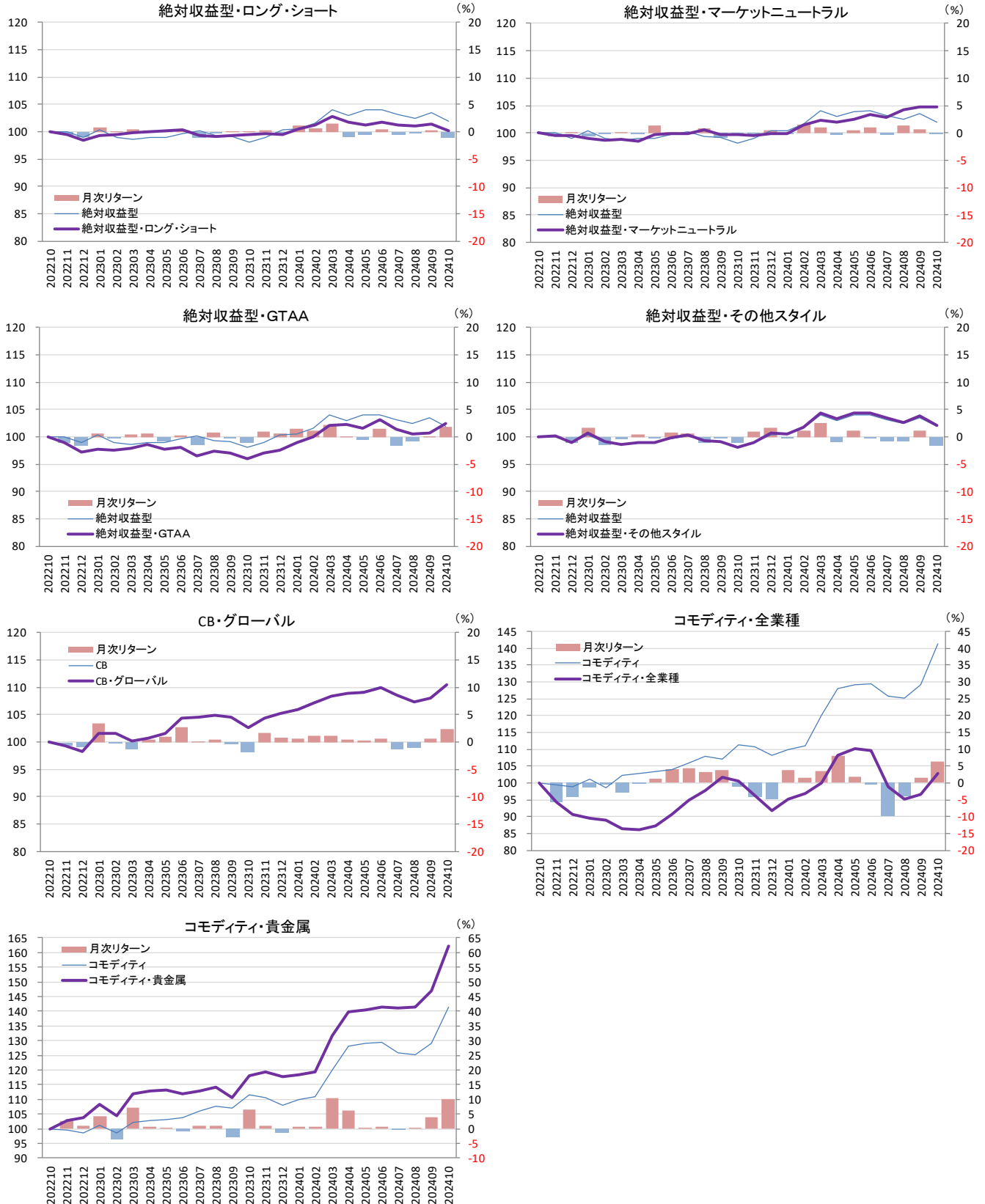


<1>パフォーマンス・サマリー

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

ファンド分類別⑩

[その他]



<1>パフォーマンス・サマリー

(4) 対「総合」寄与度分析

ファンド中分類別

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	4.54		
1	外国株式(先進国)・グローバル	6.60	30.75	2.00
2	外国株式(先進国)・その他	8.70	18.14	1.54
3	複合資産・安定成長	2.68	5.86	0.16
4	国内株式・その他	2.43	5.17	0.13
5	REIT・北米	6.79	1.95	0.13
6	外国債券(先進国)・グローバル	1.83	6.24	0.12
7	複合資産・成長	3.11	3.15	0.10
8	ハイイールド債券・北米	5.98	1.27	0.07
9	コモディティ	9.35	0.74	0.07
10	REIT・グローバル	4.21	1.53	0.06
11	国内株式・一般	0.64	6.90	0.05
12	複合資産・安定	1.47	2.93	0.04
13	エマージング株式・グローバル	3.29	0.99	0.03
14	エマージング株式・その他	0.69	3.54	0.03
15	外国債券(先進国)・その他	1.32	1.37	0.02
16	エマージング債券・その他	4.72	0.38	0.02
17	エマージング債券・グローバル	3.26	0.50	0.02
18	ハイイールド債券・グローバル	4.00	0.24	0.01
19	ハイイールド債券・その他	4.01	0.13	0.01
20	CB	2.28	0.20	0.00
21	国内株式・業種特化	3.44	0.11	0.00
22	エマージング株式・BRICS	2.00	0.04	0.00
23	REIT・その他	-0.35	0.19	-0.00
24	複合資産・国内バランス	-0.45	0.41	-0.00
25	複合資産・その他	-1.69	0.24	-0.00
26	国内株式・小型	-1.38	0.59	-0.01
27	絶対収益型	-1.51	0.93	-0.01
28	国内債券・一般	-0.57	3.35	-0.02
29	REIT・日本	-2.37	1.67	-0.04
	合計		100.00	4.54

◆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	26.92		
1	外国株式(先進国)・グローバル	38.60	30.01	11.04
2	外国株式(先進国)・その他	43.18	16.47	6.35
3	国内株式・一般	20.87	7.29	1.64
4	国内株式・その他	24.26	5.14	1.34
5	複合資産・安定成長	16.72	6.00	1.05
6	REIT・北米	40.53	2.05	0.77
7	エマージング株式・その他	28.07	3.18	0.77
8	複合資産・成長	21.21	3.12	0.67
9	外国債券(先進国)・グローバル	8.83	6.69	0.65
10	REIT・グローバル	37.62	1.58	0.55
11	複合資産・安定	10.23	3.24	0.37
12	エマージング株式・グローバル	28.31	1.07	0.28
13	ハイイールド債券・北米	16.66	1.39	0.24
14	外国債券(先進国)・その他	13.44	1.48	0.22
15	コモディティ	26.82	0.64	0.16
16	国内株式・小型	12.12	0.64	0.10
17	エマージング債券・グローバル	15.76	0.58	0.10
18	複合資産・その他	31.89	0.26	0.09
19	REIT・その他	25.67	0.22	0.06
20	絶対収益型	3.92	1.02	0.04
21	ハイイールド債券・グローバル	16.09	0.24	0.04
22	国内債券・一般	0.46	3.64	0.04
23	エマージング債券・その他	5.71	0.44	0.03
24	国内株式・業種特化	31.29	0.10	0.03
25	ハイイールド債券・その他	15.70	0.15	0.03
26	CB	7.68	0.24	0.02
27	複合資産・国内バランス	1.89	0.50	0.02
28	エマージング株式・BRICS	20.05	0.04	0.01
29	REIT・日本	-3.58	2.04	-0.06
	合計		100.00	26.92

◆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	26.25	59.54	85.46	11.75	11.95	10.98	0.69	0.82	0.58
国内株式	32.55	72.67	135.18	12.82	14.28	15.24	0.77	0.81	0.59
一般	30.89	70.89	125.45	12.33	13.75 ↓	15.21	0.76	0.82	0.56
フリー	27.11	68.70	121.81	12.88	14.09 ↓	15.56	0.65	0.78	0.53
バリュー	44.79	77.16	136.68	11.01	13.19 ↓	14.43	1.19	0.92	0.62
小型	-3.44	35.44	122.51	14.86	17.58	16.61	-0.08	0.36	0.50
その他	42.02	80.57	156.14	13.52	14.89	15.36	0.92	0.84	0.64
日経225	41.55	83.02	171.51	15.24	16.43	16.20	0.81	0.78	0.65
TOPIX	44.15	80.10	146.59	11.72	13.57	14.63	1.11	0.92	0.65
JPX日経400	45.26	81.67	138.42	12.13	13.96	14.59	1.09	0.91	0.62
国内債券	-7.42	-8.61	-2.44	2.58	2.28	2.06	-0.98	-0.78	-0.11
一般	-7.42	-8.61	-2.44	2.58	2.28	2.06	-0.98	-0.78	-0.11
外国株式(先進国)	36.88	116.92	162.64	17.17	17.50	16.51	0.64	0.96	0.61
グローバル	29.95	107.91	159.35	17.10	17.45	16.39	0.53	0.90	0.61
除く日本	57.64	140.04	226.44	15.20	16.90	16.76	1.08	1.13	0.75
含む日本	21.59	97.64	140.61	17.96	17.97	16.54	0.37	0.81	0.56
その他	53.74	136.57	169.41	17.50 ↑	17.98	17.06	0.88	1.05	0.61
北米	93.76	213.94	240.49	16.43 ↑	18.27	18.17	1.50	1.41	0.72
米国	54.05	150.48	200.68	17.73 ↑	17.58	17.40	0.87	1.15	0.67
カナダ	18.00	51.38	30.18	11.39	17.66	15.89	0.50	0.49	0.17
欧州	26.82	71.47	107.95	14.12	16.87	16.17	0.58	0.68	0.47
ドイツ	48.41	91.27	121.67	17.53	21.11	20.85	0.80	0.66	0.40
アジア・オセアニア	18.68	42.01	80.91	11.88 ↑	14.13	14.75	0.49	0.51	0.42
オーストラリア	32.01	55.00	66.10	17.58	23.34	19.73	0.55	0.39	0.26
ニュージーランド	6.04	51.07	152.66	15.05	17.01	16.98	0.13	0.51	0.57
複合地域	81.17	112.27	47.79	24.93	32.83	27.09	0.88	0.50	0.15
エマージング株式	34.58	77.85	102.26	11.52	16.95	16.33	0.90	0.72	0.45
グローバル	28.41	74.37	91.67	12.44	16.31	16.54	0.70	0.72	0.41
BRICS	-1.00	23.06	66.82	13.91	19.29	18.95	-0.02	0.22	0.28
その他	38.69	82.15	109.06	11.74	17.54	16.61	0.98	0.73	0.46
欧州	-37.20	-22.86	-6.88	34.19	32.86	27.22	-0.42	-0.15	-0.03
ロシア	-89.46	-84.68	-76.82	59.38 ↑	50.53	39.69	-0.89	-0.62	-0.34
アジア・オセアニア	19.43	50.79	64.38	13.07	16.02	16.10	0.47	0.53	0.32
中国	-18.00	19.42	91.53	22.06 ↑	21.13 ↑	22.09	-0.29	0.17	0.30
インド	62.00	136.31	195.76	14.92 ↑	21.88	20.80	1.17	0.86	0.55
インドネシア	28.77	26.93	27.34	14.85	25.24	22.68	0.59	0.19	0.11
フィリピン	20.67	11.68	5.36	15.35	20.42	18.09	0.42	0.11	0.03
ベトナム	19.91	87.00	145.37	19.07 ↓	25.84	21.71	0.33	0.52	0.43
韓国	-14.91	53.68	18.52	26.11	26.02	21.74	-0.20	0.35	0.08
香港	15.33	20.38	42.61	23.42 ↑	21.98	20.70	0.21	0.17	0.18
中南米	54.05	38.43	37.02	22.59	28.91	26.22	0.69	0.23	0.12
ブラジル	41.01	-2.19	-1.16	24.58	31.41	31.35	0.49	-0.01	-0.00
メキシコ	51.81	68.04	20.64	23.29	27.45	24.35	0.64	0.40	0.08
中東・アフリカ	32.61	84.10	54.13	14.83	17.81	16.68	0.66	0.73	0.27
トルコ	141.08	139.55	21.89	33.68	33.30	31.63	1.01	0.57	0.06
複合地域	11.04	47.35	42.81	13.08	16.08	15.64	0.27	0.50	0.23

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

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

＜2＞リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別②

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	26.25	59.54	85.46	11.75	11.95	10.98	0.69	0.82	0.58
外国債券(先進国)	5.28	13.00	12.37	5.36 ↑	5.19	5.42	0.32	0.48	0.22
グローバル	3.72	10.29	12.38	4.86 ↑	4.56	4.84	0.25	0.44	0.25
除く日本	8.09	16.43	17.07	6.33 ↑	5.33 ↑	5.59	0.41	0.58	0.29
含む日本	0.14	5.00	8.80	3.98	4.58	4.49	0.01	0.22	0.19
その他	11.97	23.80	17.45	8.11	8.06	7.74	0.47	0.54	0.21
北米	3.13	11.21	17.61	6.62 ↑	6.37 ↑	5.28	0.16	0.34	0.31
米国	10.67	21.93	32.38	8.12	8.36	7.15	0.42	0.49	0.40
カナダ	20.02	34.66	19.38	8.95	8.25	8.78	0.70	0.74	0.21
欧州	0.30	1.68	-0.30	6.71	5.88	6.56	0.01	0.06	-0.00
イギリス	21.36	35.88	23.38	10.90	9.68	10.10	0.61	0.65	0.21
アジア・オセアニア	14.11	27.33	17.17	9.83	9.91	9.35	0.46	0.50	0.17
オーストラリア	14.81	28.23	17.43	9.80	9.96	9.41	0.48	0.51	0.17
ニュージーランド	10.83	20.53	23.76	10.72	9.69	10.04	0.32	0.39	0.22
複合地域	7.62	20.52	18.71	8.21	6.84 ↑	7.07	0.30	0.56	0.25
エマージング債券	31.26	29.37	31.65	8.11 ↑	10.28	10.62	1.17	0.52	0.26
グローバル	22.97	23.82	23.97	8.25 ↑	11.61	11.18	0.86	0.38	0.20
米ドル建て	21.56	23.27	24.66	8.87 ↑	12.31	11.60	0.76	0.35	0.19
現地通貨建て	28.20	26.22	18.50	7.49	9.71	10.26	1.15	0.49	0.17
その他	41.41	36.47	40.33	9.81 ↑	10.25	11.20	1.25	0.63	0.31
ロシア	-84.75	-84.93	-83.43	170.85	132.34	94.81	-0.27	-0.24	-0.17
アジア・オセアニア	22.28	26.10	39.48	6.42 ↑	7.28	7.02	1.08	0.65	0.48
中国	26.24	51.55	-	6.79	6.06	-	1.19	1.43	-
インド	33.82	49.74	77.56	10.13 ↑	9.69 ↑	9.88	1.01	0.87	0.60
インドネシア	32.59	54.46	76.64	9.71	13.21	13.61	1.02	0.69	0.43
ブラジル	66.97	18.07	24.89	14.71	16.86	18.33	1.27	0.20	0.12
メキシコ	50.83	56.25	36.16	14.86 ↑	16.94	15.99	0.99	0.55	0.20
トルコ	-40.47	-58.83	-79.43	28.51	25.86	27.86	-0.56	-0.63	-0.52
複合地域	22.64	21.26	7.70	10.70	11.64	11.59	0.66	0.34	0.07
ハイイールド債券	34.49	48.39	61.74	8.96 ↑	11.49	10.67	1.16	0.72	0.46
グローバル	26.58	34.73	45.03	7.68 ↑	11.02	10.46	1.06	0.56	0.36
北米	38.22	56.25	74.33	9.52 ↑	11.59	10.76	1.20	0.81	0.53
その他	24.42	28.35	33.22	8.82 ↑	12.34	11.35	0.86	0.42	0.26
欧州	24.75	29.75	33.30	9.44	12.99	12.04	0.81	0.41	0.24
アジア・オセアニア	22.87	21.51	32.81	9.86	12.11	10.50	0.72	0.33	0.28
複合地域	29.00	49.23	60.85	8.72 ↑	9.33	9.07	1.02	0.89	0.54
複合資産	14.28	27.76	47.17	6.93	7.25	7.24	0.66	0.69	0.55
安定	4.51	11.67	22.78	5.02	5.07	5.31	0.29	0.44	0.39
安定成長	17.70	34.00	55.26	7.27	7.69	7.65	0.77	0.78	0.59
成長	28.84	60.42	99.75	9.15	10.09	10.52	0.96	0.98	0.68
国内バランス	-3.97	-7.42	5.89	3.14	3.86	3.87 ↓	-0.43	-0.39	0.15
安定	-6.06	-10.18	3.34	3.04	3.75	3.13	-0.68	-0.57	0.11
一般	12.19	28.38	51.16	6.64	7.54	8.10	0.59	0.68	0.52
その他	-8.10	10.56	-	20.28	18.36	-	-0.14	0.11	-

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

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

<2> リスク・サマリー

(1) 期間別リスク・リターン

「総合」およびファンド分類別③

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	26.25	59.54	85.46	11.75	11.95	10.98	0.69	0.82	0.58
国内REIT	-9.39	-9.67	34.98	10.21	14.82	12.32	-0.32	-0.14	0.25
日本	-9.39	-9.67	34.98	10.21	14.82	12.32	-0.32	-0.14	0.25
外国REIT	30.85	56.20	109.24	17.61	19.15	16.65	0.53	0.49	0.46
グローバル	27.10	47.41	85.42	17.30	19.72	16.85	0.48	0.41	0.38
除く日本	29.37	55.54	113.31	17.93	20.46	17.31	0.50	0.45	0.46
含む日本	25.35	43.57	78.70	16.96	19.41	16.67	0.46	0.39	0.36
北米	35.88	68.24	135.28	18.55	19.05	17.02	0.58	0.58	0.53
その他	14.39	24.86	77.95	15.01	19.35	16.07	0.31	0.24	0.37
欧州	0.80	6.05	22.78	18.60	21.12	18.61	0.01	0.06	0.11
アジア・オセアニア	12.37	19.53	80.20	14.08	17.73	15.20	0.28	0.21	0.40
オーストラリア	20.62	39.80	76.20	23.18	30.18	23.36	0.28	0.23	0.25
複合地域	35.49	29.65	35.82	15.10	24.08	20.24	0.71	0.22	0.15
複数国	19.71	44.40	123.36	15.08	17.19	14.99	0.41	0.44	0.56
その他									
絶対収益型	-6.00	-1.18	-3.08	3.99	3.61	2.95	-0.51	-0.06	-0.10
ロング・ショート	-4.46	-8.37	-9.96	3.17	3.03	3.10	-0.48	-0.57	-0.33
マーケットニュートラル	-4.09	1.25	13.73	3.90	4.02	4.82	-0.36	0.06	0.27
GTAA	-0.55	11.43	14.68	4.22	4.63	3.62	-0.04	0.47	0.39
その他スタイル	-6.45	-1.07	-3.52	4.38	3.92	3.22	-0.50	-0.05	-0.11
CB	-4.05	16.01	21.43	6.48	8.52	7.63	-0.21	0.35	0.26
アジア・オセアニア	23.43	63.82	101.43	9.80	↑	12.05	11.69	0.74	0.86
日本	5.42	6.13	25.01	4.88	5.25	5.43	0.36	0.23	0.42
グローバル	-4.96	15.35	20.15	6.68	8.76	7.73	-0.25	0.33	0.24
コモディティ	66.64	107.82	53.09	11.54	↑	12.31	12.57	1.61	1.28
全業種	47.64	99.33	31.36	17.50	19.73	17.45	0.79	0.75	0.16
貴金属	65.53	95.88	101.94	11.95	13.26	11.79	1.53	1.09	0.62
エネルギー	70.19	143.60	29.91	26.84	35.73	32.22	0.72	0.55	0.08
その他コモディティ	54.34	89.80	46.12	16.13	18.99	17.07	0.96	0.72	0.23

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

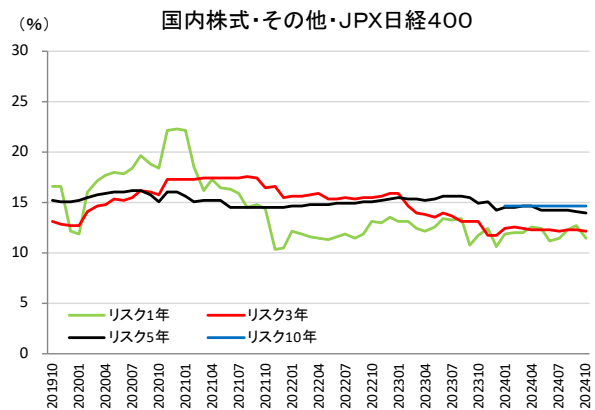
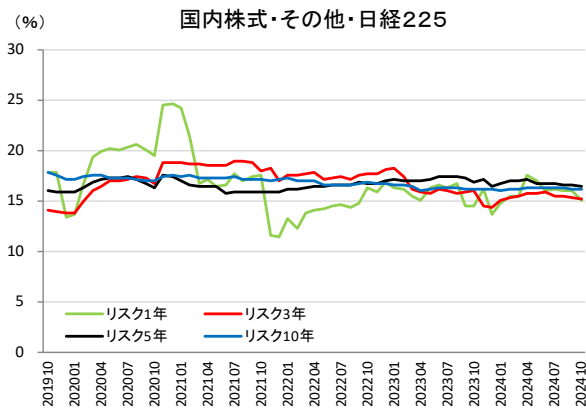
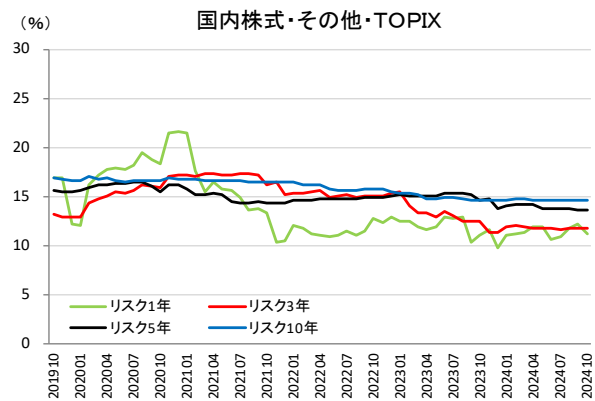
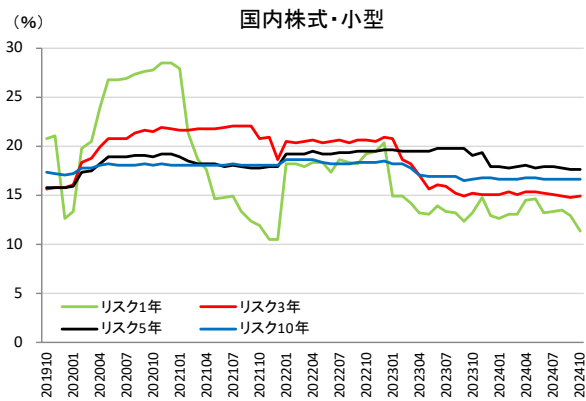
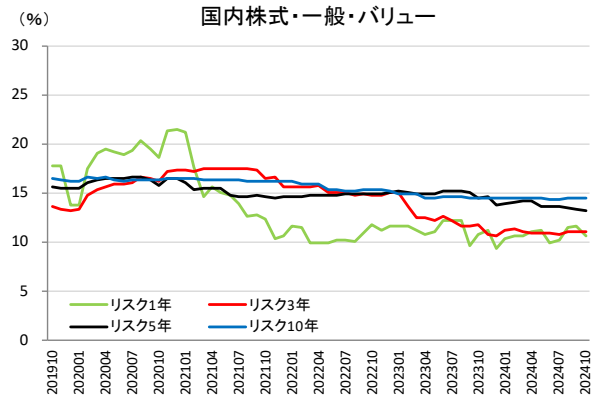
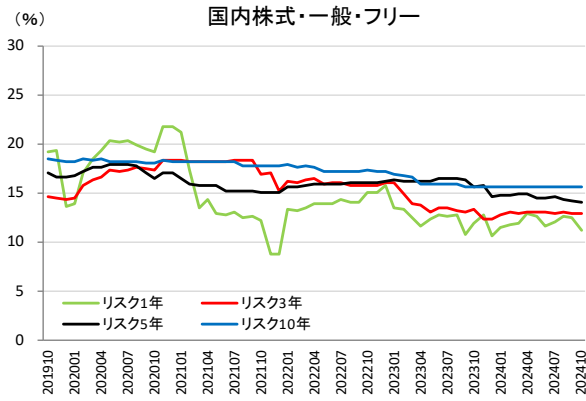
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

<2> リスク・サマリー

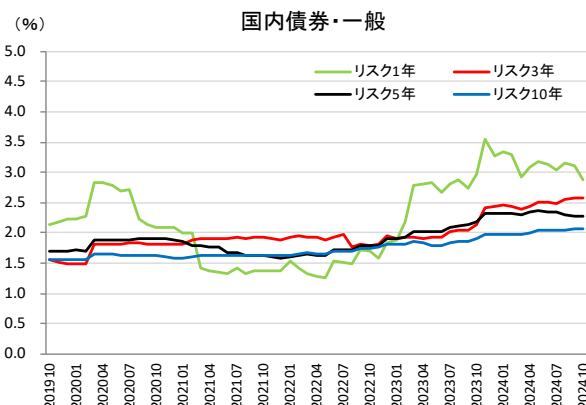
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別①

[国内株式]



[国内債券]

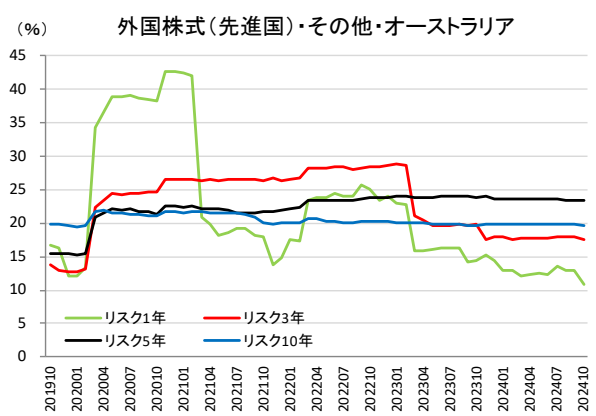
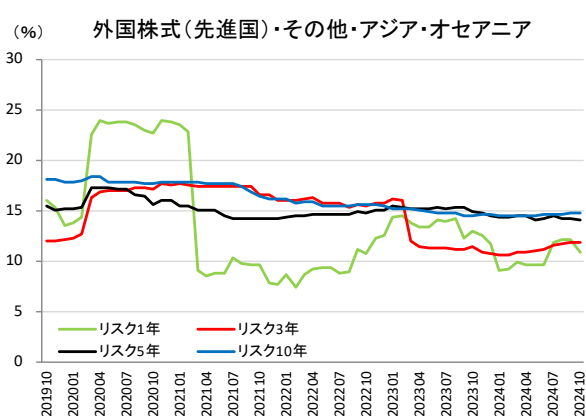
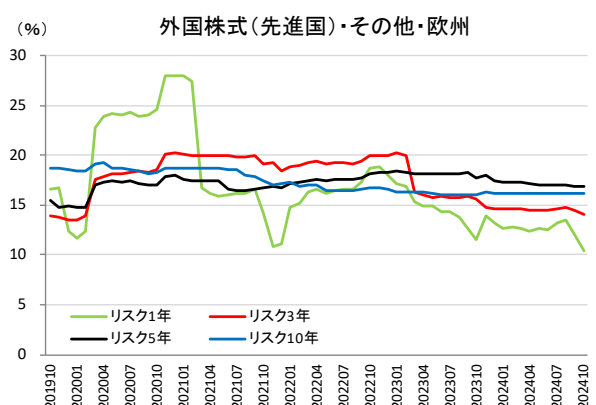
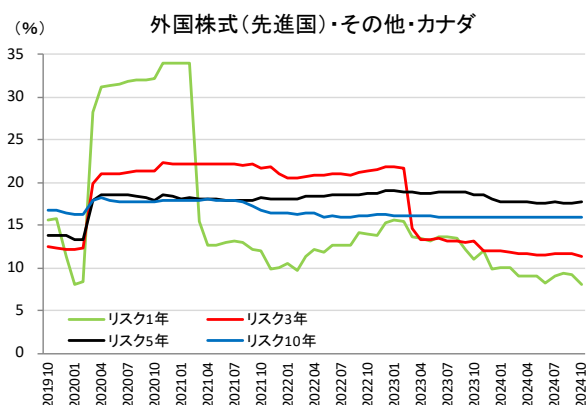
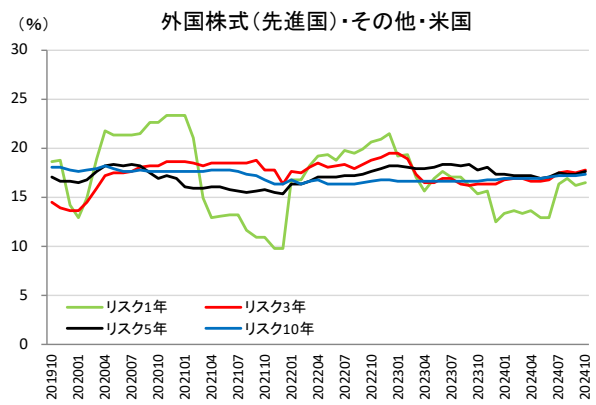
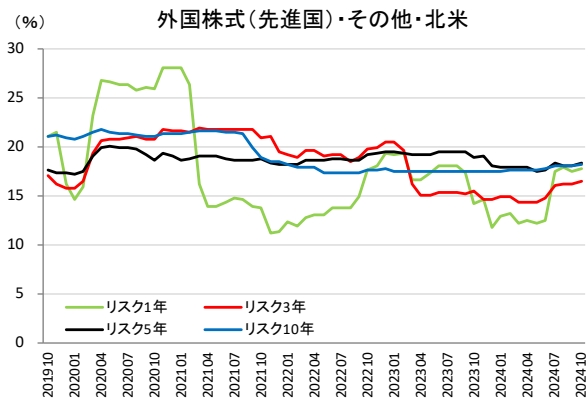
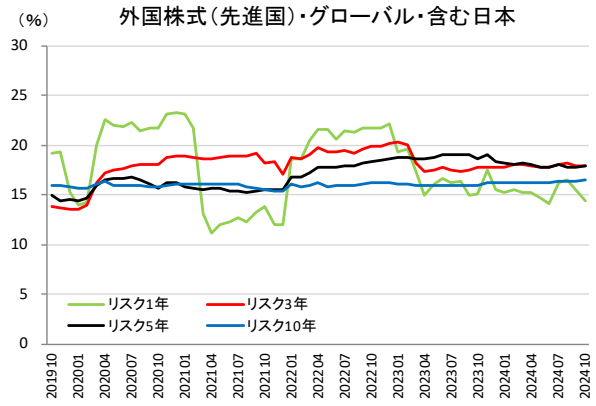
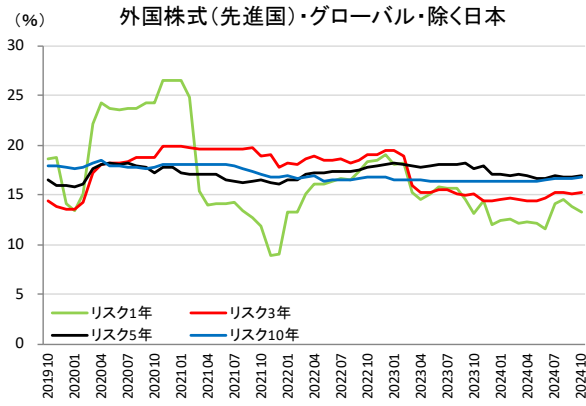


<2> リスク・サマリー

(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)]

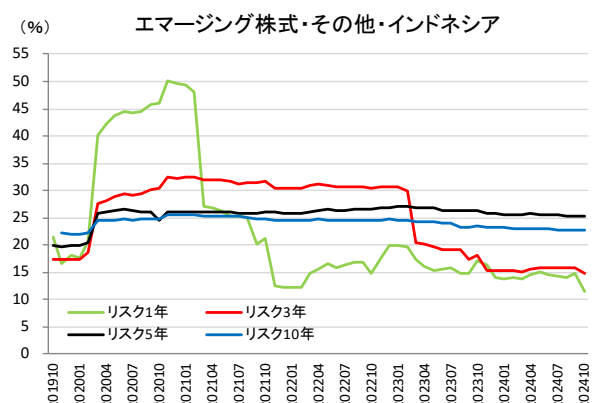
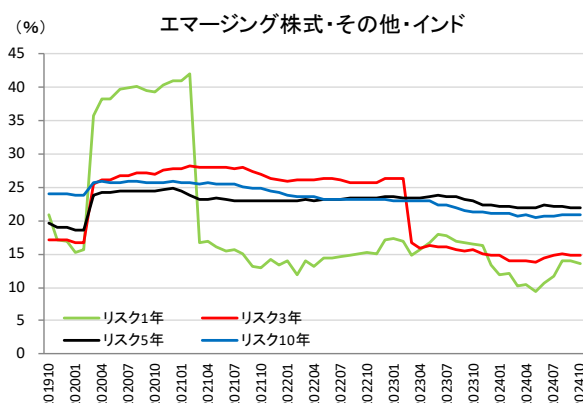
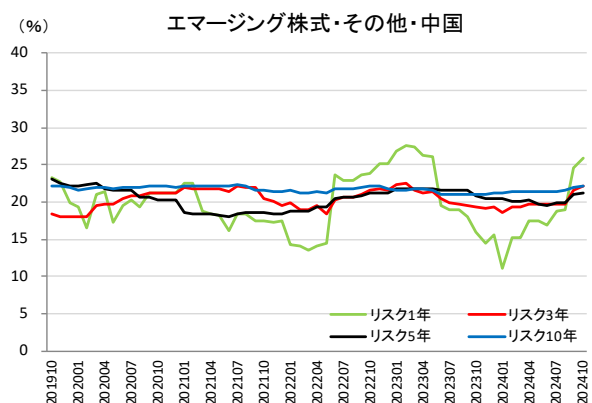
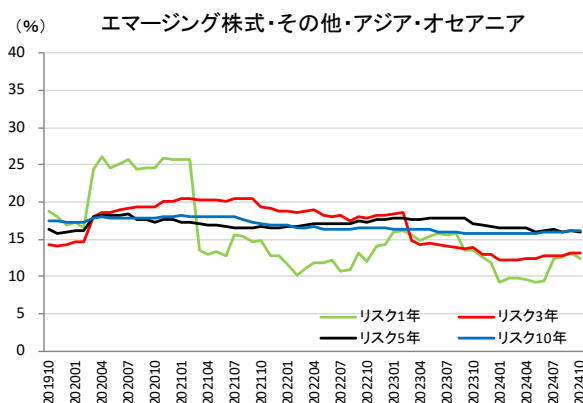
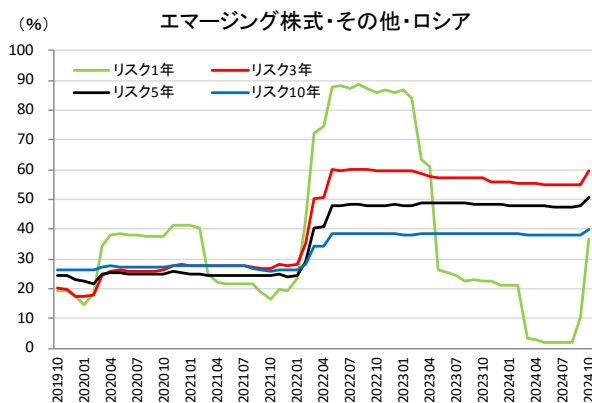
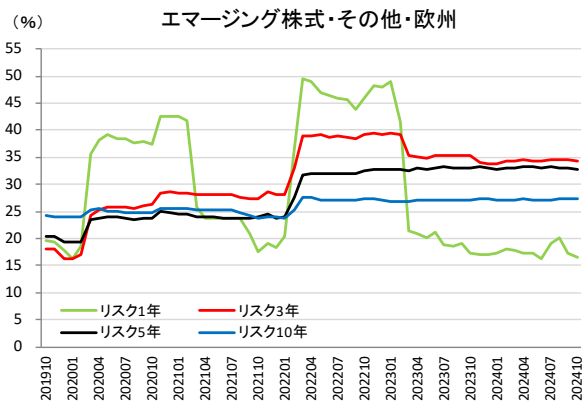
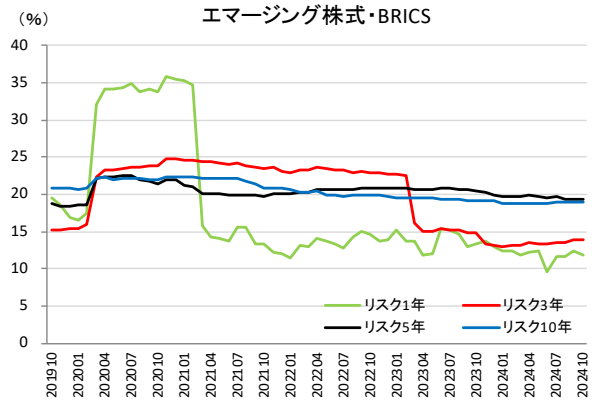
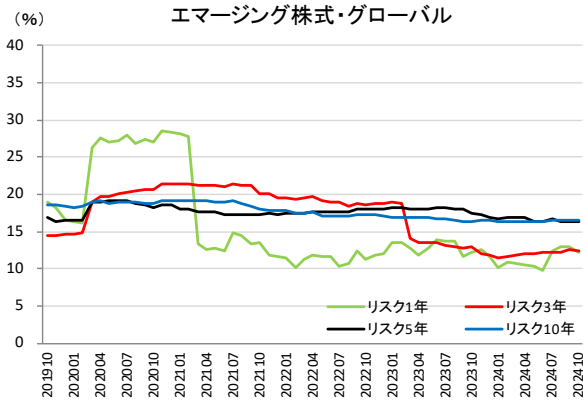


<2> リスク・サマリー

(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]

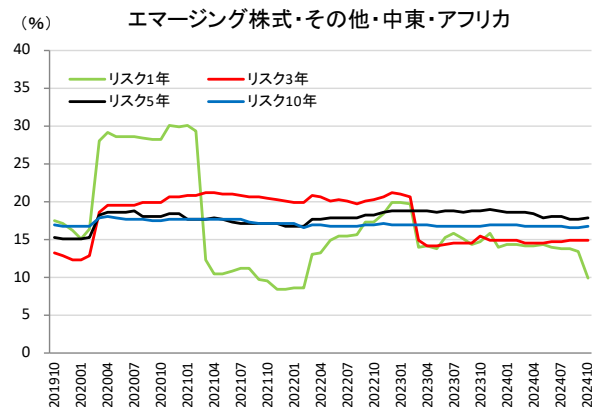
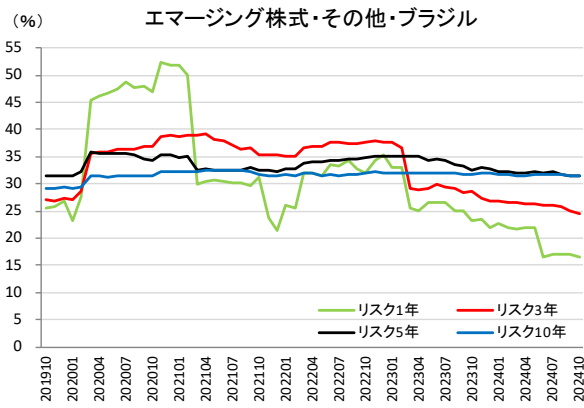
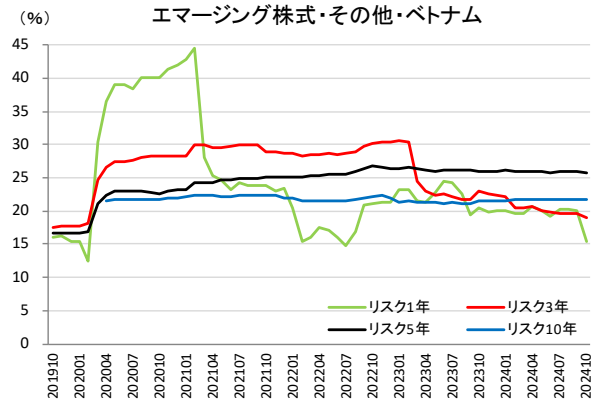
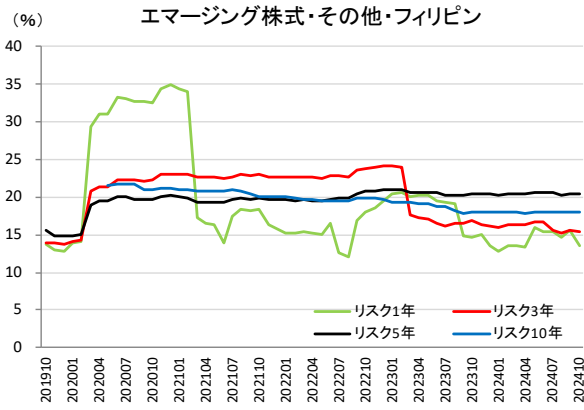


<2> リスク・サマリー

(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]

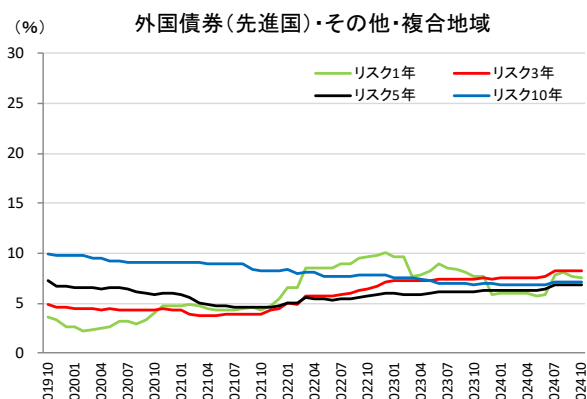
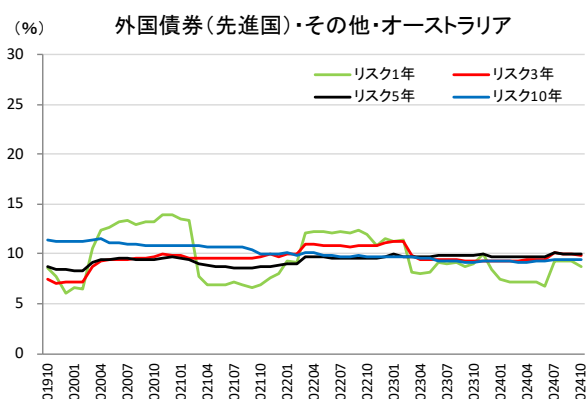
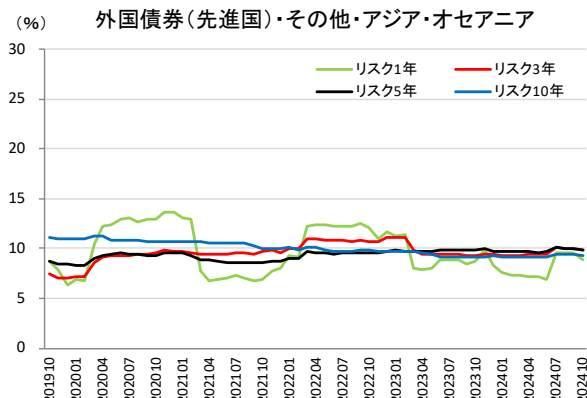
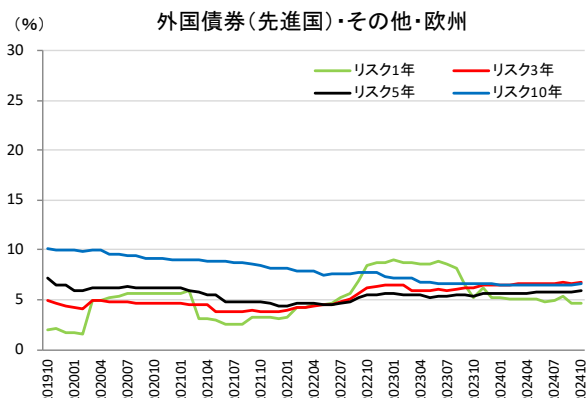
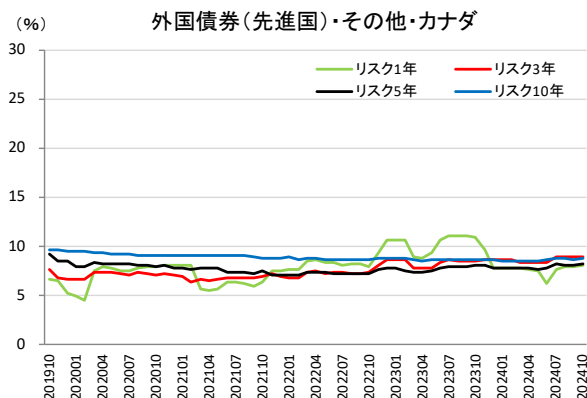
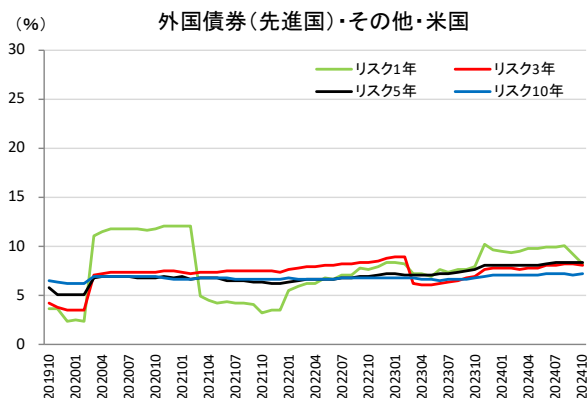
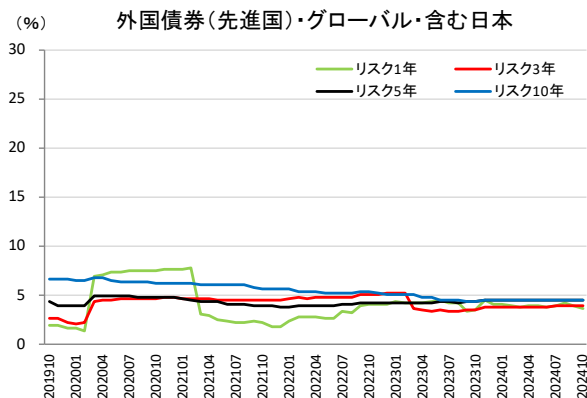
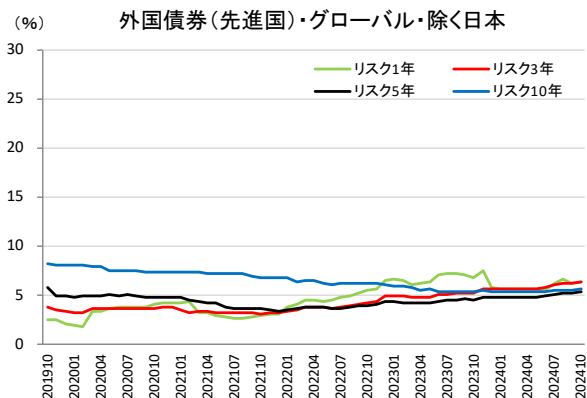


<2> リスク・サマリー

(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)]

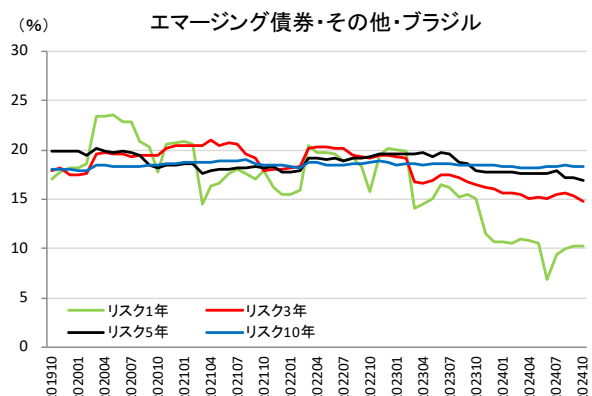
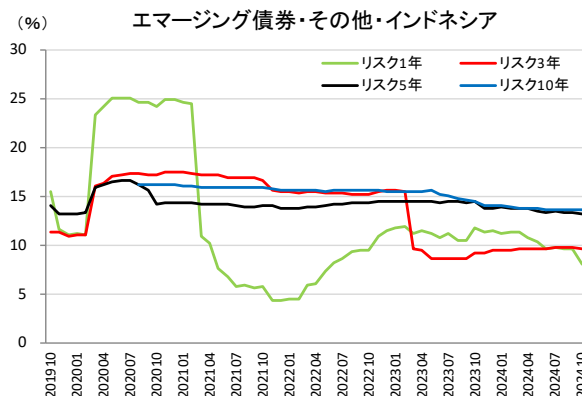
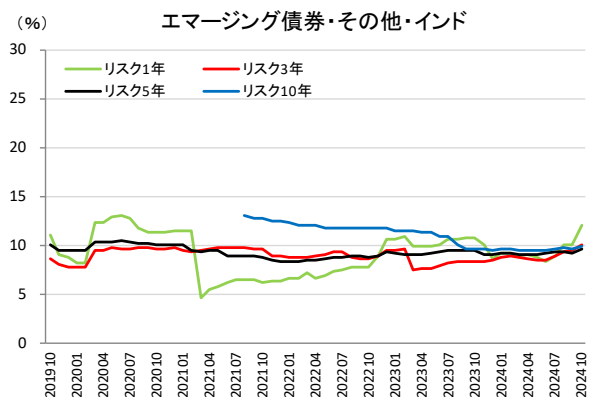
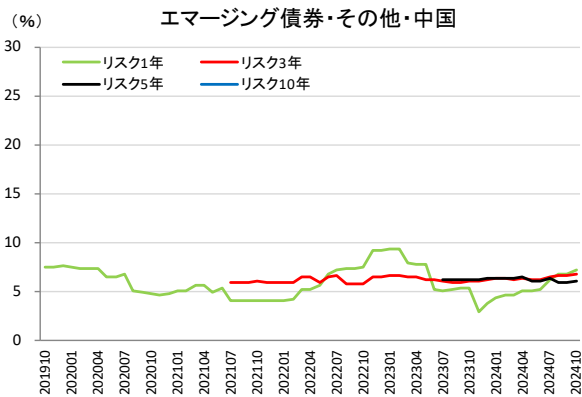
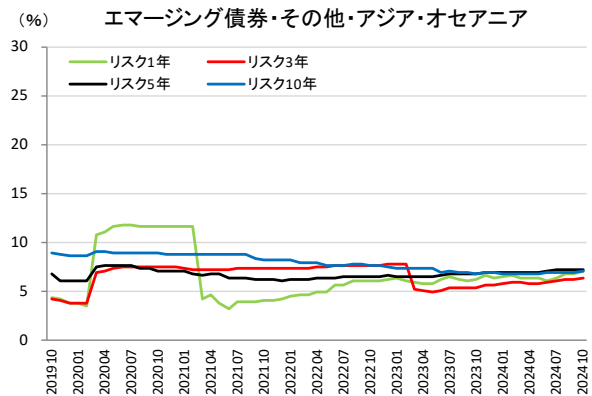
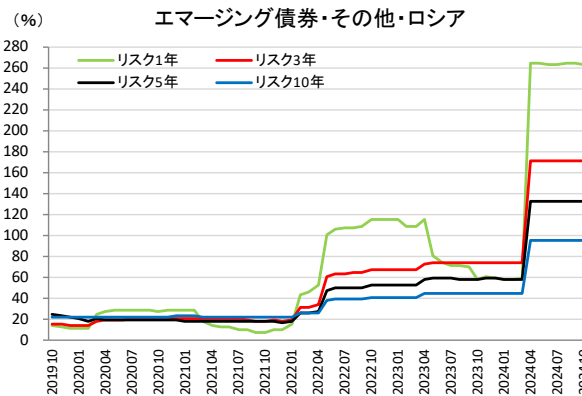
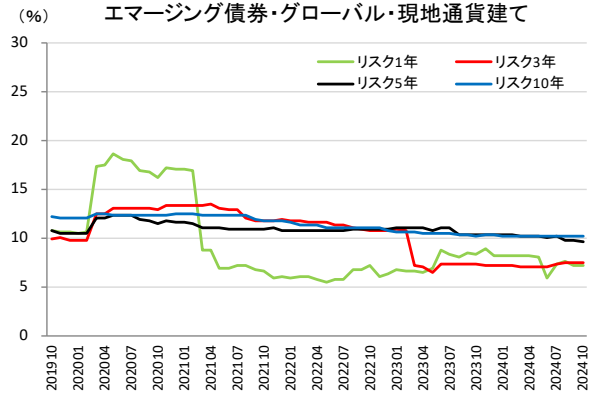
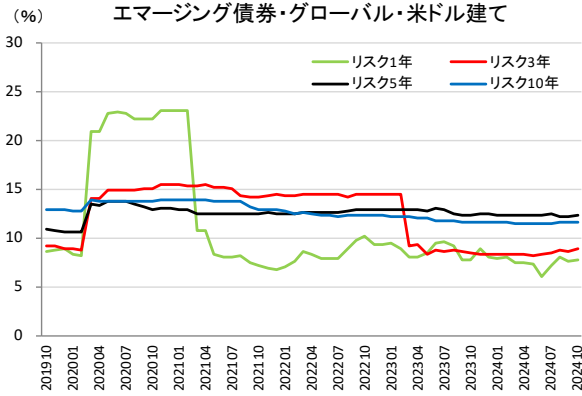


<2> リスク・サマリー

(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]

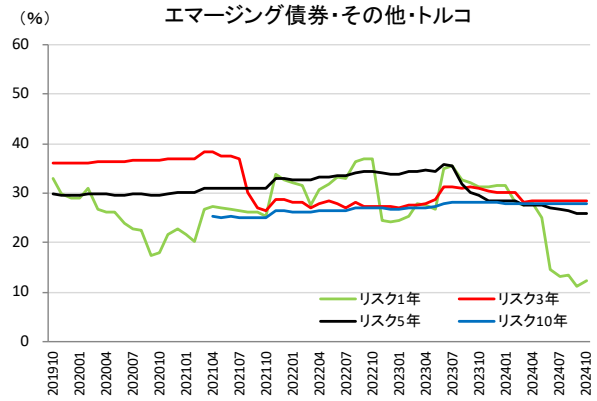
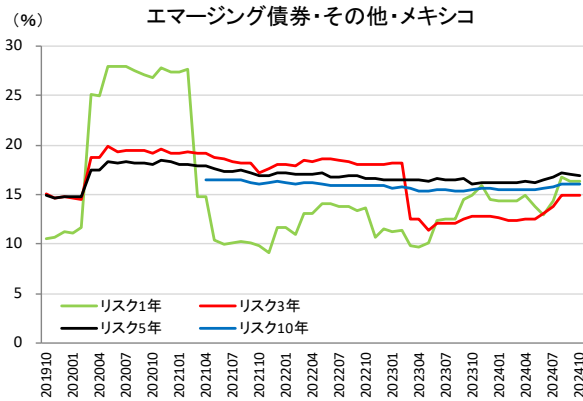


<2> リスク・サマリー

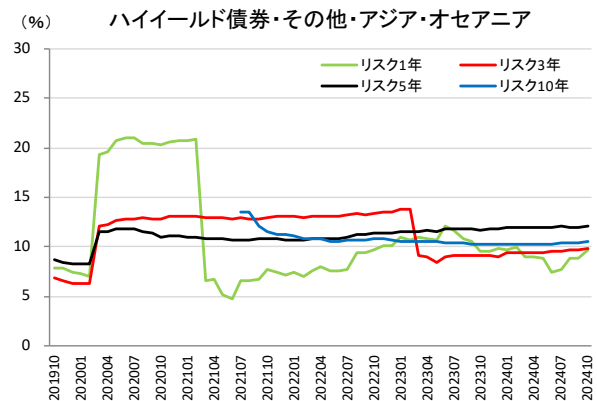
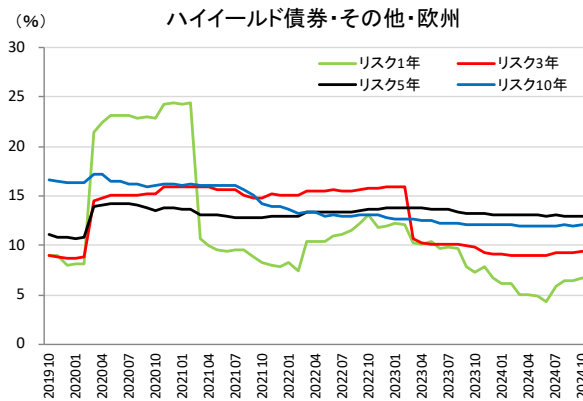
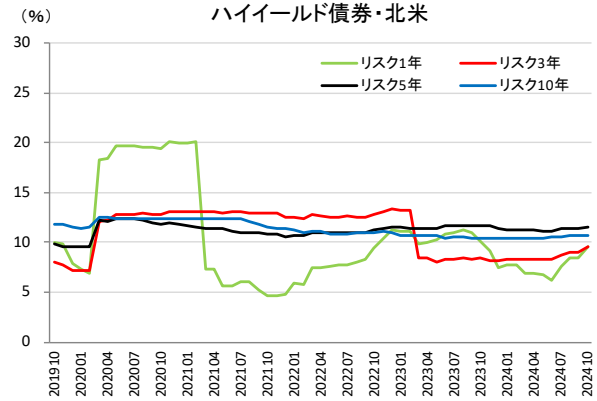
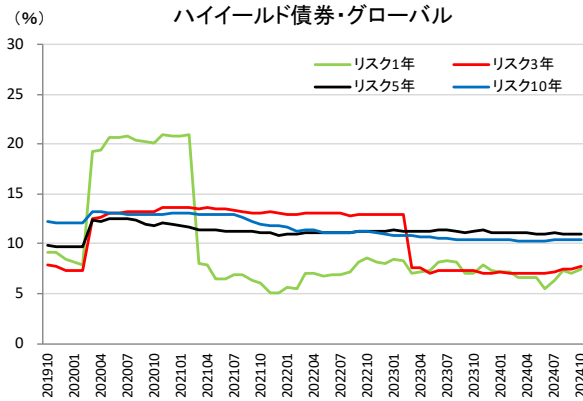
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑦

[エマージング債券]



[ハイイールド債券]

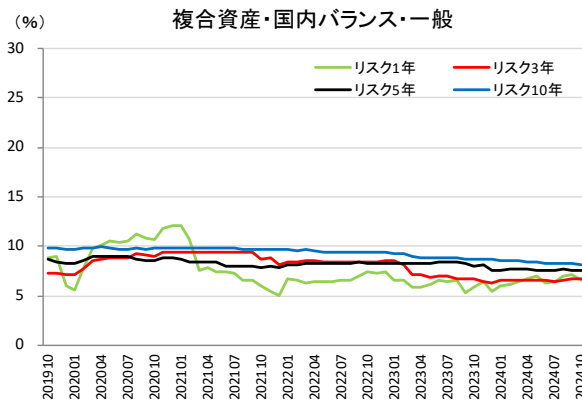
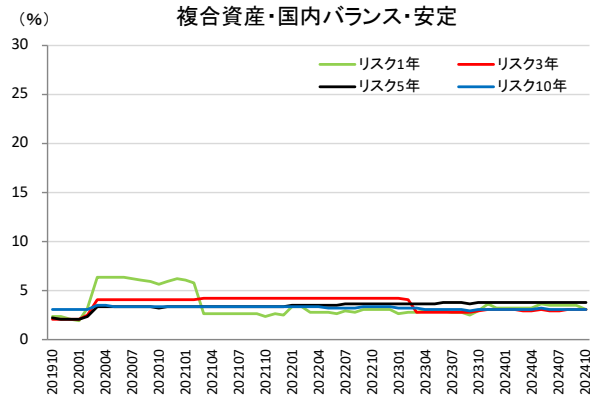
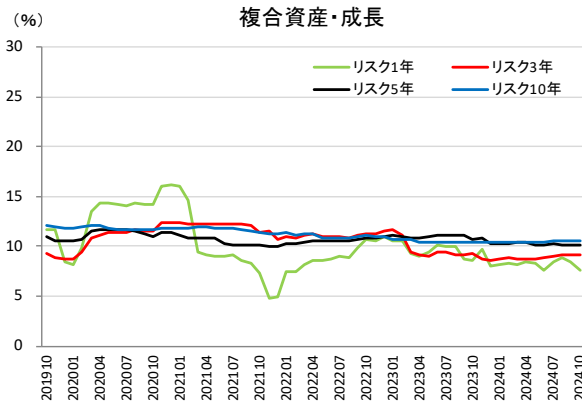
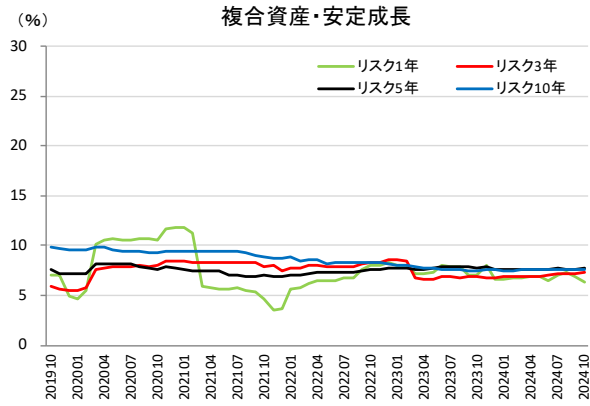
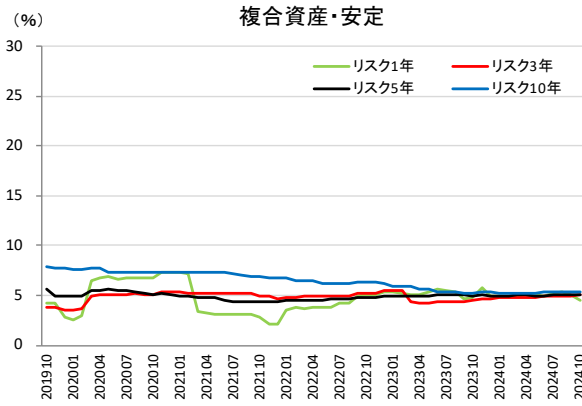


<2> リスク・サマリー

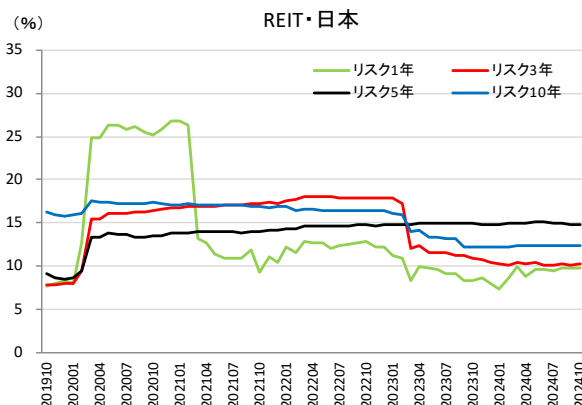
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

ファンド分類別⑧

[複合資産]



[国内 REIT]

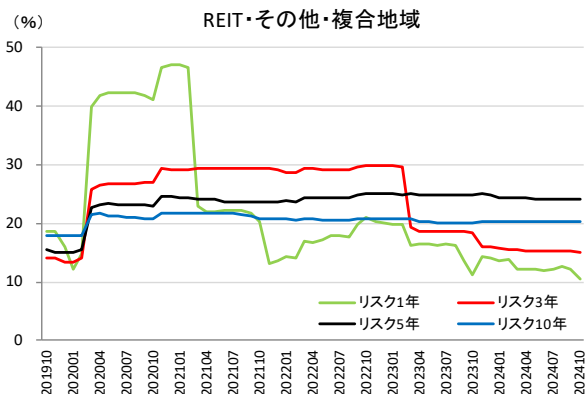
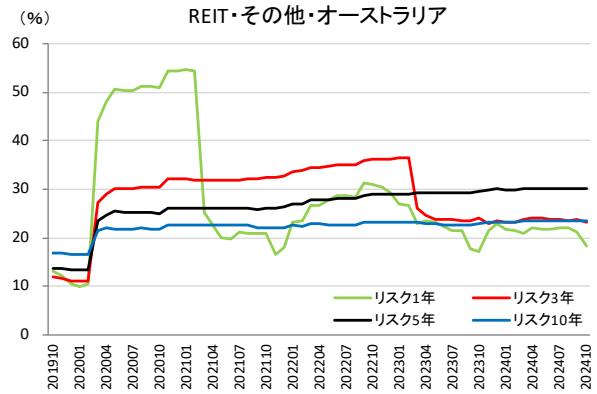
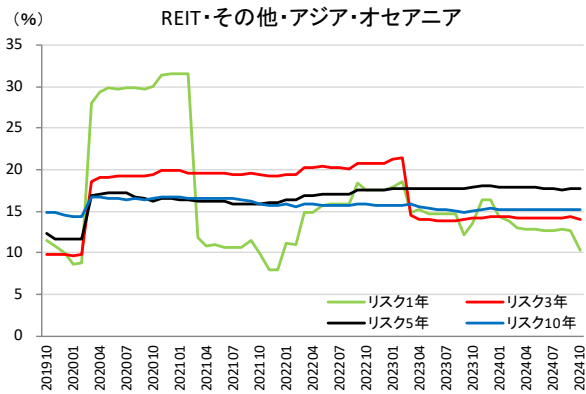
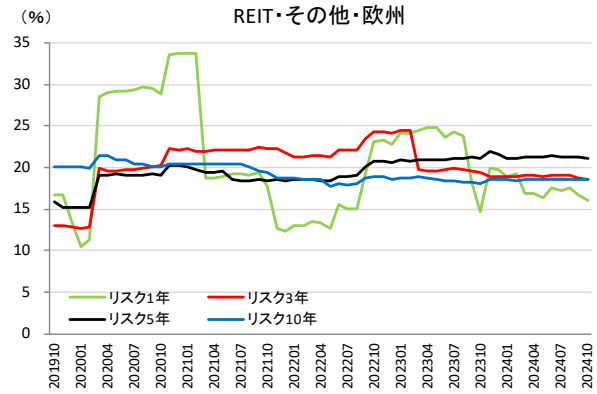
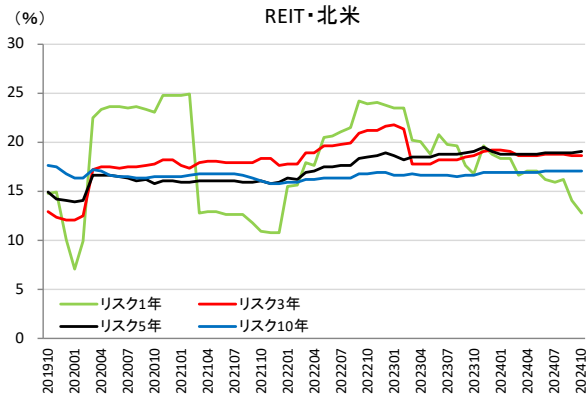
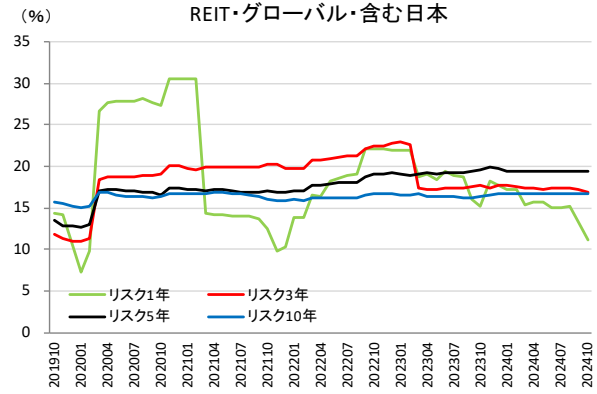
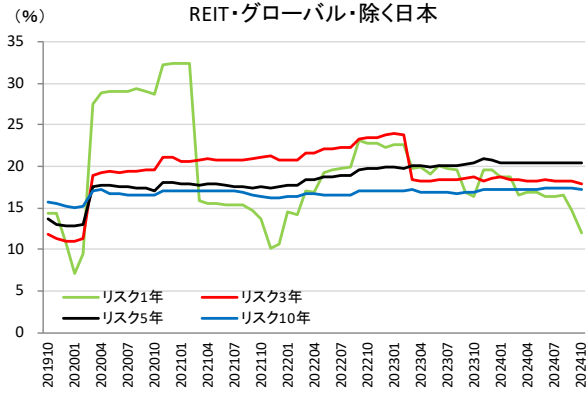


<2> リスク・サマリー

(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]

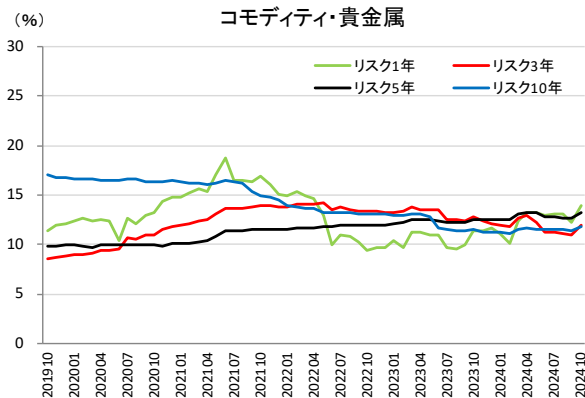
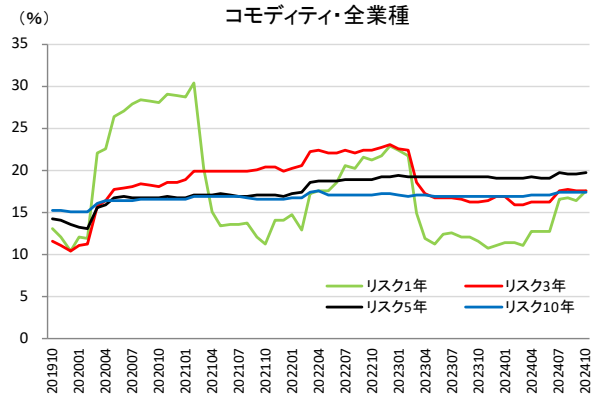
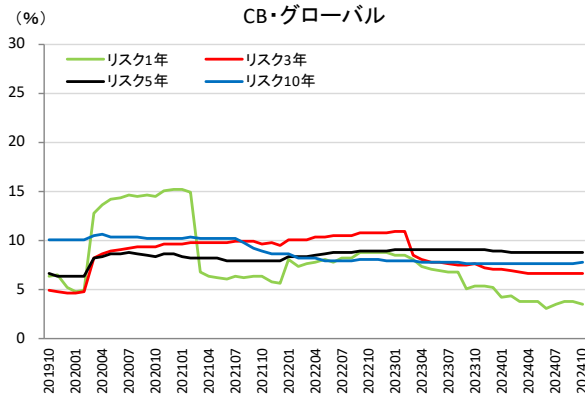
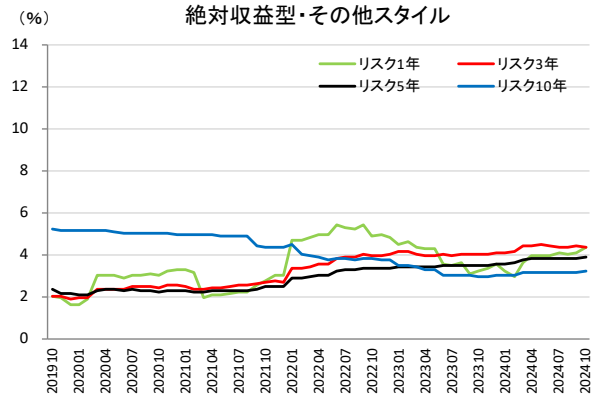
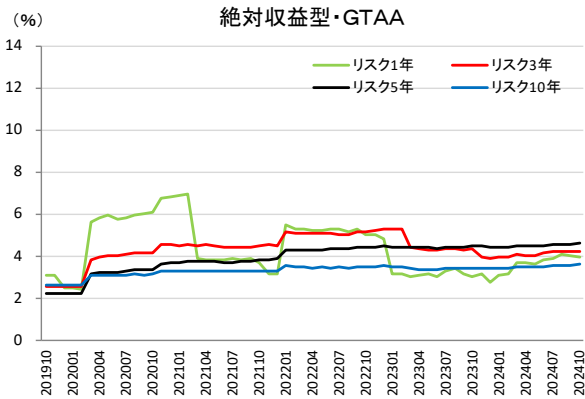
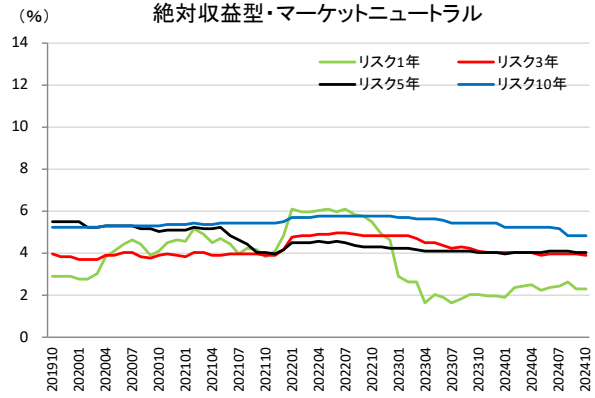
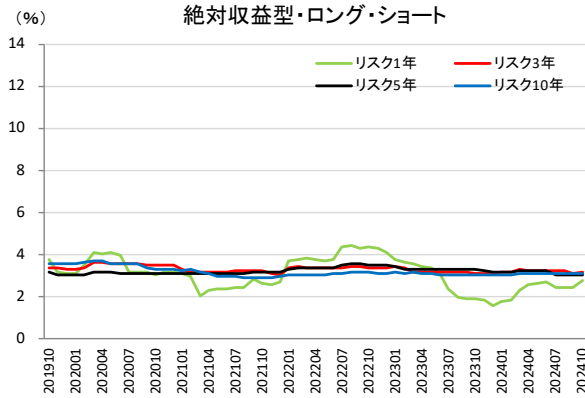


<2> リスク・サマリー

(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	8,102	33,407	82,661	142,120
国内株式	-361	3,434	6,891	13,623
一般	-258	794	2,378	5,994
フリー	-95	490	815	216
バリュー	-163	304	1,563	5,775
小型	-78	356	217	68
その他	-25	2,221	4,086	7,038
日経225	-228	850	1,081	1,817
TOPIX	156	907	1,784	3,052
JPX日経400	-6	32	58	44
国内債券	648	957	1,361	2,140
一般	648	957	1,361	2,140
外国株式(先進国)	6,975	23,301	57,121	97,808
グローバル	2,922	11,016	25,179	41,793
除く日本	834	2,666	6,919	11,506
含む日本	2,088	8,347	18,257	30,283
その他	4,053	12,285	31,942	56,015
北米	125	449	1,401	3,108
米国	3,946	11,814	30,430	52,921
カナダ	-1	23	20	7
欧州	8	49	181	263
ドイツ	0	0	1	0
アジア・オセアニア	0	0	0	-1
オーストラリア	-24	-47	-86	-274
ニュージーランド	0	0	0	-1
複合地域	0	-1	-4	-7
エマージング株式	277	1,333	8,131	16,087
グローバル	15	140	863	1,844
BRICS	-4	-8	-19	-51
その他	267	1,201	7,287	14,294
欧州	0	0	3	3
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-69	-54	-79	-493
中国	-40	-60	-132	-371
インド	400	1,372	7,569	15,337
インドネシア	1	4	31	30
フィリピン	0	-1	-3	-6
ベトナム	-13	-41	-61	-109
韓国	0	0	0	0
香港	-2	-2	-4	-3
中南米	0	-1	-5	-10
ブラジル	-7	-13	-27	-83
メキシコ	0	0	0	1
中東・アフリカ	-1	-2	-7	-19
トルコ	0	-2	-2	-10
複合地域	1	1	5	30

<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	8,102	33,407	82,661	142,120
外国債券(先進国)	-216	1,026	2,830	5,013
グローバル	-158	1,039	2,874	4,657
除く日本	-74	698	1,788	2,880
含む日本	-84	353	1,100	1,790
その他	-59	-13	-44	356
北米	5	15	29	108
米国	15	180	449	1,466
カナダ	-8	-20	-50	-130
欧州	1	2	12	23
イギリス	0	0	-2	-3
アジア・オセアニア	-17	-48	-108	-231
オーストラリア	-48	-124	-328	-770
ニュージーランド	-1	-2	-7	-19
複合地域	-5	-14	-39	-88
エマージング債券	-55	-42	-203	-248
グローバル	-13	20	-155	-152
米ドル建て	2	9	-156	-264
現地通貨建て	-15	11	0	112
その他	-42	-63	-47	-97
ロシア	0	0	0	0
アジア・オセアニア	-6	-6	-11	-25
中国	-2	-7	-13	-31
インド	-14	-8	64	191
インドネシア	-5	-6	6	2
ブラジル	-10	-28	-77	-190
メキシコ	-5	-7	-13	-37
トルコ	0	0	-1	-4
複合地域	0	0	-1	-4
ハイイールド債券	57	197	520	884
グローバル	70	216	311	284
北米	9	42	350	860
その他	-23	-62	-141	-260
欧州	-17	-44	-97	-198
アジア・オセアニア	-5	-17	-42	-59
複合地域	0	-1	-2	-3
複合資産	923	3,123	6,933	9,109
安定	-26	27	-60	-1,147
安定成長	551	1,815	4,670	6,458
成長	392	1,416	2,920	5,311
国内バランス	-46	-161	-442	-1,074
安定	-95	-277	-647	-1,421
一般	-2	-3	-10	-31
その他	52	25	-156	-440

< 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	8,102	33,407	82,661	142,120
国内REIT	-206	-718	-1,044	-1,886
日本	-206	-718	-1,044	-1,886
外国REIT	252	391	-411	-1,489
グローバル	39	33	-193	-660
除く日本	26	62	35	150
含む日本	13	-28	-228	-823
北米	254	461	1	-333
その他	-42	-104	-219	-496
欧州	-1	-2	-3	-10
アジア・オセアニア	-32	-84	-179	-388
オーストラリア	-7	-14	-27	-76
複合地域	-1	-1	-1	-4
複数国	-1	-3	-9	-19
その他	-192	406	532	1,080
絶対収益型	-258	-253	-148	133
ロング・ショート	-2	1	17	1
マーケットニュートラル	-2	-8	-28	-90
GTAA	-6	-12	-23	-58
その他スタイル	-248	-235	-124	262
CB	-57	-153	-348	-278
アジア・オセアニア	0	-1	-2	-4
日本	0	-1	-1	1
グローバル	-56	-151	-345	-275
コモディティ	259	778	1,507	2,289
全業種	14	49	153	255
貴金属	245	725	1,357	2,042
エネルギー	0	3	-4	-11
その他コモディティ	0	0	2	4

< 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	1,349,701	100.00	5,250	100.00
国内株式	169,313	12.54	758	14.44
一般	91,191	6.76	455	8.67
フリー	62,717	4.65	353	6.72
バリュー	28,474	2.11	102	1.94
小型	7,783	0.58	86	1.64
その他	68,806	5.10	211	4.02
日経225	32,717	2.42	72	1.37
TOPIX	29,014	2.15	85	1.62
JPX日経400	1,050	0.08	12	0.23
国内債券	44,513	3.30	152	2.90
一般	44,513	3.30	152	2.90
外国株式(先進国)	668,440	49.53	1,226	23.35
グローバル	418,926	31.04	850	16.19
除く日本	130,235	9.65	192	3.66
含む日本	288,691	21.39	658	12.53
その他	249,514	18.49	376	7.16
北米	5,511	0.41	12	0.23
米国	239,098	17.71	299	5.70
カナダ	150	0.01	3	0.06
欧州	2,013	0.15	36	0.69
ドイツ	21	0.00	1	0.02
アジア・オセアニア	38	0.00	1	0.02
オーストラリア	2,649	0.20	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	60,607	4.49	300	5.71
グローバル	13,206	0.98	93	1.77
BRICS	470	0.03	7	0.13
その他	46,931	3.48	200	3.81
欧州	108	0.01	6	0.11
ロシア	11	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	4,418	0.33	72	1.37
中国	1,134	0.08	31	0.59
インド	38,796	2.87	42	0.80
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	1,597	0.12	14	0.27
韓国	1	0.00	1	0.02
香港	17	0.00	1	0.02
中南米	51	0.00	2	0.04
ブラジル	379	0.03	10	0.19
メキシコ	8	0.00	1	0.02
中東・アフリカ	51	0.00	2	0.04
トルコ	42	0.00	1	0.02
複合地域	68	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	1,349,701	100.00	5,250	100.00
外国債券(先進国)	101,089	7.49	719	13.70
グローバル	82,985	6.15	517	9.85
除く日本	39,171	2.90	226	4.30
含む日本	43,814	3.25	291	5.54
その他	18,104	1.34	202	3.85
北米	222	0.02	8	0.15
米国	9,243	0.68	116	2.21
カナダ	582	0.04	3	0.06
欧州	1,094	0.08	22	0.42
イギリス	8	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	1,385	0.10	8	0.15
オーストラリア	4,516	0.33	31	0.59
ニュージーランド	60	0.00	3	0.06
複合地域	995	0.07	7	0.13
エマージング債券	11,586	0.86	204	3.89
グローバル	6,545	0.48	136	2.59
米ドル建て	4,504	0.33	100	1.90
現地通貨建て	2,041	0.15	36	0.69
その他	5,040	0.37	68	1.30
ロシア	12	0.00	4	0.08
アジア・オセアニア	219	0.02	8	0.15
中国	126	0.01	8	0.15
インド	2,894	0.21	16	0.30
インドネシア	337	0.02	6	0.11
ブラジル	1,187	0.09	20	0.38
メキシコ	206	0.02	3	0.06
トルコ	27	0.00	2	0.04
複合地域	31	0.00	1	0.02
ハイイールド債券	22,008	1.63	210	4.00
グローバル	3,236	0.24	45	0.86
北米	17,087	1.27	105	2.00
その他	1,686	0.12	60	1.14
欧州	1,305	0.10	38	0.72
アジア・オセアニア	343	0.03	21	0.40
複合地域	37	0.00	1	0.02
複合資産	168,656	12.50	1,069	20.36
安定	39,068	2.89	286	5.45
安定成長	78,692	5.83	440	8.38
成長	42,410	3.14	304	5.79
国内バランス	5,365	0.40	26	0.50
安定	4,069	0.30	8	0.15
一般	261	0.02	14	0.27
その他	3,121	0.23	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	1,349,701	100.00	5,250	100.00
国内REIT	21,800	1.62	142	2.70
日本	21,800	1.62	142	2.70
外国REIT	49,834	3.69	248	4.72
グローバル	20,732	1.54	152	2.90
除く日本	9,393	0.70	64	1.22
含む日本	11,338	0.84	88	1.68
北米	26,637	1.97	52	0.99
その他	2,466	0.18	44	0.84
欧州	75	0.01	4	0.08
アジア・オセアニア	1,576	0.12	24	0.46
オーストラリア	492	0.04	12	0.23
複合地域	65	0.00	3	0.06
複数国	257	0.02	1	0.02
その他	31,856	2.36	222	4.23
絶対収益型	12,063	0.89	84	1.60
ロング・ショート	847	0.06	25	0.48
マーケットニュートラル	298	0.02	12	0.23
GTAA	296	0.02	9	0.17
その他スタイル	10,534	0.78	37	0.70
CB	2,630	0.19	39	0.74
アジア・オセアニア	33	0.00	1	0.02
日本	27	0.00	1	0.02
グローバル	2,570	0.19	37	0.70
コモディティ	10,403	0.77	40	0.76
全業種	2,198	0.16	13	0.25
貴金属	8,115	0.60	25	0.48
エネルギー	56	0.00	1	0.02
その他コモディティ	35	0.00	1	0.02

< 5 > 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別①

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	16,324	10.7	3.07	2.72	1.037
国内株式	22,986	14.9	1.65	1.52	0.968
一般	21,656	14.7	2.38	2.22	1.344
フリー	21,079	14.4	1.87	1.70	1.401
バリュー	23,653	16.0	3.60	3.38	1.218
小型	25,339	15.2	1.53	1.41	1.701
その他	25,004	14.7	0.50	0.42	0.373
日経225	27,393	16.6	0.45	0.36	0.423
TOPIX	26,366	16.0	0.12	0.10	0.226
JPX日経400	24,496	10.1	0.51	0.42	0.460
国内債券	10,178	12.6	0.10	0.10	0.475
一般	10,178	12.6	0.10	0.10	0.475
外国株式(先進国)	20,778	8.1	3.86	3.37	1.022
グローバル	21,326	8.2	3.07	2.64	1.121
除く日本	33,047	11.3	0.67	0.57	0.512
含む日本	17,905	7.3	4.16	3.58	1.396
その他	19,539	7.7	5.19	4.60	0.854
北米	20,322	6.6	0.47	0.41	0.730
米国	20,628	6.9	5.27	4.67	0.842
カナダ	7,733	9.1	9.59	8.74	1.888
欧州	16,858	13.0	3.73	3.35	1.264
ドイツ	20,391	10.6	0.00	0.00	0.770
アジア・オセアニア	12,063	18.3	9.18	8.10	1.823
オーストラリア	11,038	9.6	3.05	2.73	1.672
ニュージーランド	18,330	12.3	12.68	13.13	1.705
複合地域	11,428	11.5	3.98	3.45	1.640
エマージング株式	16,174	11.2	0.75	0.66	0.854
グローバル	16,359	9.0	0.88	0.75	2.052
BRICS	17,651	18.4	4.87	4.21	1.857
その他	16,037	12.0	0.70	0.62	1.946
欧州	9,540	18.4	0.00	0.00	1.223
ロシア	1,420	15.4	2.95	2.55	1.721
アジア・オセアニア	17,601	14.0	0.73	0.69	1.906
中国	14,442	10.3	5.37	4.62	1.872
インド	19,708	9.9	0.99	0.94	1.780
インドネシア	12,486	10.0	0.42	0.35	1.680
フィリピン	10,787	11.7	2.73	2.51	1.856
ベトナム	18,314	6.8	0.00	0.00	1.804
韓国	13,665	5.8	3.01	2.49	0.858
香港	16,039	15.2	0.00	0.00	2.038
中南米	10,809	17.8	3.55	4.24	1.972
ブラジル	5,633	13.2	1.59	1.61	1.667
メキシコ	12,433	11.6	0.46	0.34	2.227
中東・アフリカ	16,241	16.7	2.83	2.57	1.980
トルコ	11,691	18.4	0.52	0.43	0.956
複合地域	18,444	8.5	-	-	-

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目録見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

< 5 > 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別②

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	16,324	10.7	3.07	2.72	1.037
外国債券(先進国)	10,880	11.1	1.21	1.11	0.945
グローバル	11,344	11.1	1.03	0.96	0.898
除く日本	12,668	13.6	0.67	0.63	0.683
含む日本	10,316	9.2	1.36	1.28	1.090
その他	9,693	11.2	2.02	1.77	1.160
北米	10,754	8.3	1.89	1.67	1.089
米国	10,414	8.6	2.06	1.72	1.086
カナダ	8,776	14.9	1.54	1.42	1.378
欧州	7,908	17.4	1.29	1.22	0.982
イギリス	7,430	9.3	4.03	3.45	1.394
アジア・オセアニア	10,515	15.1	2.44	2.23	1.425
オーストラリア	8,905	15.3	2.05	1.87	1.238
ニュージーランド	10,304	10.7	1.62	1.43	1.405
複合地域	6,130	14.5	2.07	1.94	1.193
エマージング債券	10,957	12.6	3.41	3.31	1.343
グローバル	11,527	13.2	2.03	1.85	1.114
米ドル建て	11,483	13.9	2.33	2.07	1.278
現地通貨建て	11,649	11.4	1.37	1.35	0.750
その他	9,818	11.4	5.19	5.21	1.641
ロシア	2,156	11.8	0.00	0.00	1.596
アジア・オセアニア	10,304	10.4	6.79	6.45	1.628
中国	12,513	5.0	1.25	1.15	1.236
インド	10,916	10.2	5.85	5.72	1.707
インドネシア	10,303	12.1	5.24	5.05	1.667
ブラジル	10,355	14.4	3.97	4.42	1.582
メキシコ	8,553	12.0	4.59	4.84	1.368
トルコ	1,370	12.0	5.47	5.78	1.474
複合地域	4,468	18.2	1.45	1.34	1.210
ハイールド債券	10,000	12.7	4.79	4.37	1.640
グローバル	8,965	10.8	2.81	2.50	1.381
北米	11,498	13.7	5.01	4.57	1.676
その他	8,154	12.2	6.36	5.94	1.767
欧州	8,518	11.8	5.71	5.29	1.739
アジア・オセアニア	7,639	12.6	8.97	8.55	1.868
複合地域	5,116	20.6	5.21	4.69	1.800
複合資産	14,835	10.1	1.15	1.08	0.908
安定	11,974	10.2	1.60	1.52	1.041
安定成長	14,376	10.6	1.24	1.15	0.919
成長	18,488	9.4	0.39	0.35	0.777
国内バランス	12,940	12.0	2.22	2.28	0.963
安定	10,686	12.9	1.75	1.78	0.913
一般	14,420	12.7	1.14	1.07	1.203
その他	11,713	4.5	1.65	1.33	0.654

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

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

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

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

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

< 5 > 属性、指標等（平均値）

「総合」およびファンド分類別③

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	16,324	10.7	3.07	2.72	1.037
国内REIT	13,112	10.8	6.58	7.85	0.881
日本	13,112	10.8	6.58	7.85	0.881
外国REIT	14,507	10.1	8.41	6.75	1.424
グローバル	16,264	9.8	3.36	2.63	1.157
除く日本	18,447	8.5	2.12	1.69	0.922
含む日本	14,677	10.8	4.40	3.42	1.351
北米	12,435	10.8	12.41	9.97	1.604
その他	10,883	10.5	7.26	6.44	1.736
欧州	5,218	11.6	5.67	4.79	1.921
アジア・オセアニア	11,480	9.8	9.21	8.44	1.798
オーストラリア	11,877	10.1	4.69	3.46	1.684
複合地域	8,952	12.7	0.93	0.65	0.769
複数国	13,089	20.5	2.28	1.83	1.650
その他					
絶対収益型	10,807	7.3	0.04	0.04	1.909
ロング・ショート	10,507	6.6	0.12	0.11	1.723
マーケットニュートラル	10,227	7.1	0.97	0.97	1.239
GTAA	11,917	11.4	0.22	0.22	1.567
その他スタイル	10,883	6.9	0.00	0.00	1.957
CB	12,836	7.7	0.35	0.32	1.189
アジア・オセアニア	11,671	14.3	2.28	2.06	1.823
日本	14,589	24.9	0.37	0.34	0.770
グローバル	12,820	7.0	0.32	0.29	1.185
コモディティ	15,708	7.4	0.06	0.06	0.841
全業種	11,650	11.1	0.27	0.30	1.237
貴金属	17,395	5.1	0.00	0.00	0.734
エネルギー	21,047	15.7	0.00	0.00	1.074
その他コモディティ	20,963	8.1	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