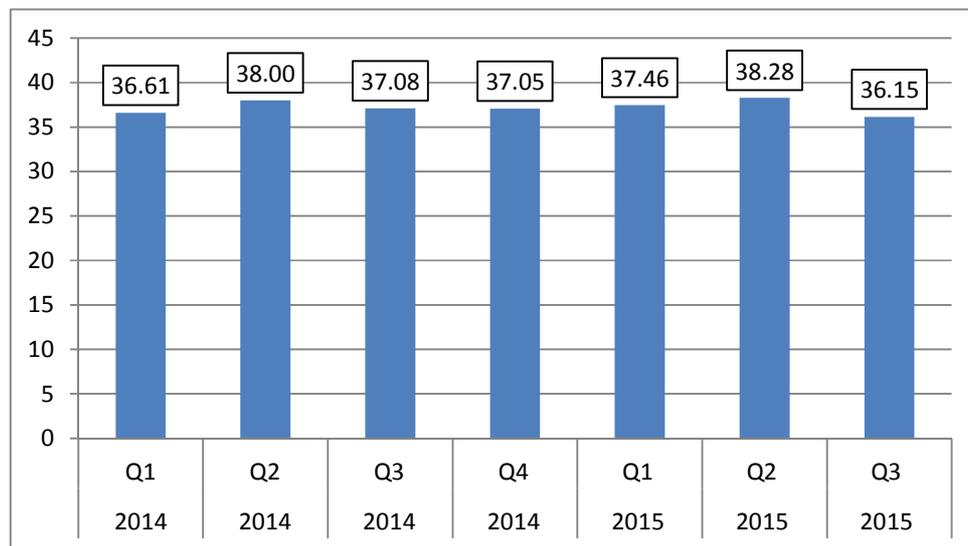


投資信託の世界統計 2015年第3四半期(7月～9月)

国際投資信託協会(IIFA)¹が加盟各協会の協力の下に集めたデータによると、2015年第3四半期末の世界の規制オープンエンド投資信託²の残高は2015年第2四半期末から5.6%減少し36.15兆ドルとなった(ファンドオブファンズを除く)。この減少の大部分は資金純流入額の変動というよりも株式のパフォーマンスの影響によるものである。2015年第3四半期は世界全体で2,230億ドルの資金純流入となった。2015年第2四半期は、5,890億ドルの資金純流入であった。

2015年第3四半期の統計は、46カ国から提供されたデータを集計したもの。(なお、2015年第1四半期より、IIFAはオープンエンド型投資信託の集計対象範囲を拡大、すなわち、上場投信(ETFs)、機関投資家向けファンド(institutional funds)、元本保証/保全型ファンド(guaranteed/protected funds)等を追加している。)

世界の規制オープンエンド投資信託の残高(兆ドル、四半期末)



¹ 世界各国の投資信託協会が加盟する国際組織。

² 規制オープンエンド投資信託とは、ミューチュアルファンド、上場投信、機関投資家向けファンドを含む。以下「投資信託」という。

投資信託残高上位 10 カ国(2015 年 9 月末)

	国名	残高(10億ドル)		国名	残高(10億ドル)
1	米国	17,234	6	英国	1,543
2	ルクセンブルグ	3,525	7	オーストラリア	1,427
3	アイルランド	1,994	8	日本	1,249
4	フランス	1,856	9	中国	1,027
5	ドイツ	1,794	10	カナダ	896

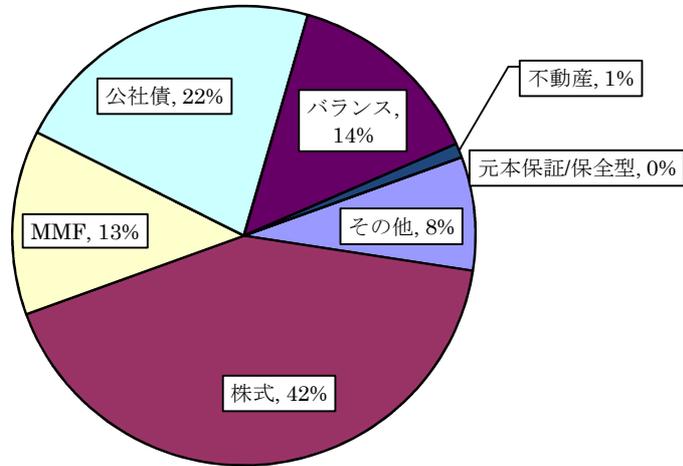
世界の投資信託の資産残高表(10 億ドル)

	2014				2015		
	Q1	Q2	Q3	Q4	Q1	Q2	Q3
合計※	36,612	38,000	37,080	37,049	37,455	38,279	36,151
株式投信	15,478	16,226	15,784	16,054	16,561	16,729	15,121
公社債投信	8,141	8,491	8,323	8,205	8,126	8,209	7,902
バランスファンド	4,852	5,099	4,971	4,918	5,043	5,418	5,055
元本保証/保全型	144	134	118	110	96	86	80
不動産	348	359	336	436	402	435	438
その他	2,837	3,262	3,107	2,688	2,679	2,817	2,659
MMF	4,813	4,430	4,441	4,639	4,549	4,585	4,832
参考 (上記に含む)							
ETF	1,868	2,006	2,002	2,451	2,585	2,666	2,557
機関投資家向け	2,818	2,920	2,782	2,746	2,660	2,739	2,688

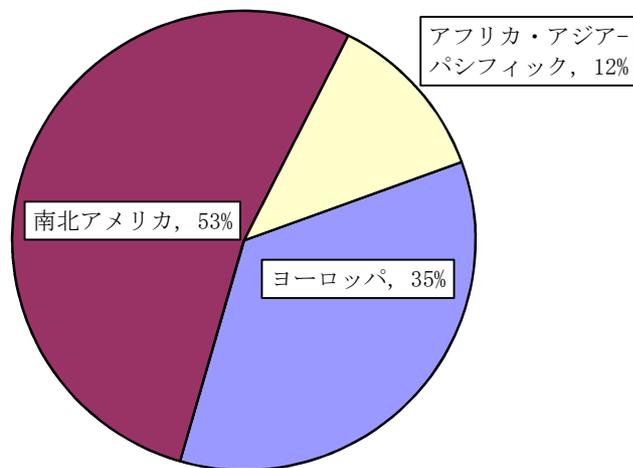
※可能な場合は、FOF を除く。

2015 年第 3 四半期の株式投信の残高は前四半期末比で 9.6%減少して、15.12 兆ドルとなった。公社債投信は前四半期末比 3.7%減の 7.9 兆ドルとなった。バランスファンドは前四半期比で 6.7%減少して、5.05 兆ドルとなった。MMF は前四半期末から 5.4%増加し 4.83 兆ドルとなった。

世界の投信残高のタイプ別構成比
(2015年9月末)



世界の投信残高の地域別構成比
(2015年9月末)



2015年第3四半期では、世界の投資信託の42%を株式投信が占めており、公社債投信のシェアは22%、バランスファンドのシェアは14%、MMFのシェアは13%であった。

地域別にみると、南北アメリカが53%、ヨーロッパが35%、アフリカ・アジア-パシフィックが12%であった。

世界の投資信託の資金純流出入表 (10 億ドル)

	2014				2015		
	Q1	Q2	Q3	Q4	Q1	Q2	Q3
合計	426	401	418	549	562	589	223
株式投信	132	121	80	164	161	131	85
公社債投信	132	180	126	109	197	110	-23
バランスファンド	109	124	114	107	189	329	-60
元本保証/保全型	0	0	0	-4	-6	-8	-4
不動産	7	8	7	11	8	8	6
その他	17	38	2	17	24	41	18
MMF	29	-70	89	145	-11	-22	201
参考 (上記に含む)							
ETF	21	64	50	136	83	48	88
機関投資家向け	34	40	47	65	90	64	67

注) 資金純流出入データの提供国数: 2014年Q1~Q3及び2015年Q3は43カ国。2014年Q4~2015年Q2にかけては44カ国。資金純流出入データを提供した44カ国の残高は、今回データを提供した全ての国の残高の96%を占める。「資金純流出入」=設定(再投資分含む)ー解約・償還+乗換分。四捨五入や未分類のファンドがあるため、タイプ別の計は合計と一致しない。可能な場合は、ファンドオブファンズを除外している。

投資信託の資金純流入についてみると、全体で2015年第3四半期には2,230億ドルの資金純流入となった。

そのうち、株式投信全体では850億ドルの資金純流入があった(第2四半期は1,310億ドルの資金流入)。地域別にみると、アジア-パシフィック地域では560億ドルの資金純流入(第2四半期は540億ドル)が、ヨーロッパでは180億ドルの資金純流入が、南北アメリカでは110億ドルの資金純流入があった。

公社債投信は、全体で2015年第3四半期に230億ドルの資金純流出(第2四半期は1,100億ドルの資金純流入)となった。地域別でみると、南北アメリカは80億ドル、ヨーロッパは240億ドル、そ

れぞれ資金純流出となった。一方、アジア-パシフィック地域では 90 億ドルの資金純流入となった(第 2 四半期は 230 億ドルの資金流入)。

バランスファンドは、全体で 2015 年第 3 四半期に 600 億ドルの資金純流出となった(第 2 四半期の 3,290 億ドルの資金純流入)。地域別でみると、ヨーロッパは 450 億ドルの資金純流入、アジア-パシフィック地域は 1,060 億ドルの資金純流出となった。

MMFは全体で 2015 年第 3 四半期で 2,010 億ドルの資金純流入となった(第 2 四半期は 220 億ドルの資金純流出)。地域別では、アジア-パシフィック地域で 1,240 億ドル、南北アメリカで 510 億ドル、ヨーロッパで 250 億ドルの資金純流入がそれぞれ見られた。