

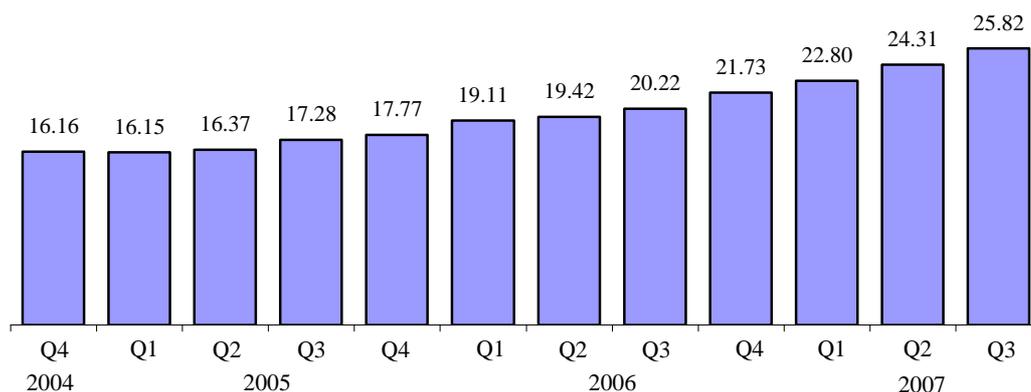
投資信託の世界統計

2007年第3四半期(7月~9月)

国際投資信託協会¹が加盟各国の協力の下に集めたデータによると、世界の投資信託²の残高は6月末の24.31兆ドルから9月末には25.82兆ドルと6.2%増加した(今回から中国がデータの提供を開始。中国の影響を除くと、4.5%の増加)。一方、資金純増額は第2四半期の4,320億ドルから第3四半期には3,190億ドルに減少した。今回は43カ国から提供されたデータを集計したもの。

9月末の残高をタイプ別に6月末と比べると、全てのタイプ(株式投信、公社債投信、MMF、バランスファンド)で残高が増加した。

世界の投信残高のタイプ別構成比
(%、2007年9月末)



投信残高上位10カ国(2007年9月末)

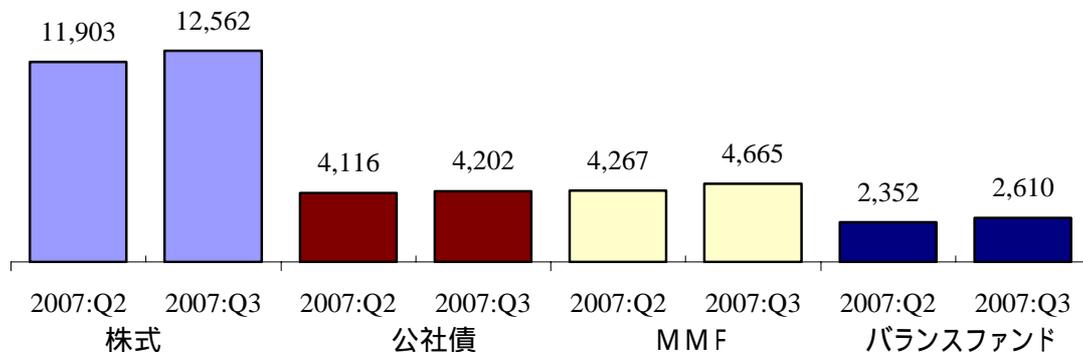
順位	国名	残高(十億ドル)	順位	国名	残高(十億ドル)
1	米国	11,922	6	アイルランド	920
2	ルクセンブルグ	2,609	7	香港	721
3	フランス	1,994	8	カナダ	706
4	オーストラリア	1,224	9	日本	700
5	英国	951	10	ブラジル	575

¹ 世界各国の投資信託協会が加盟する国際組織。

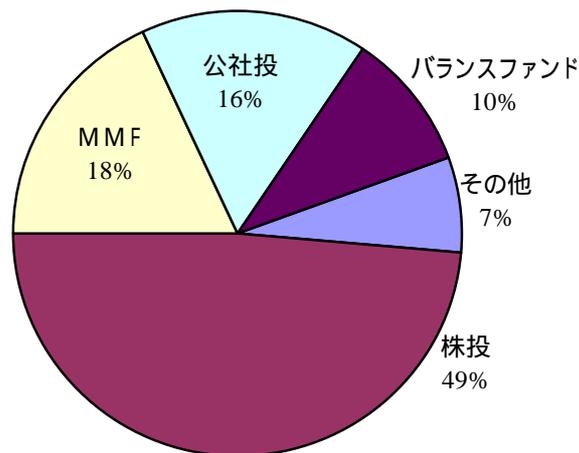
² この世界統計において、「投資信託」とはオープン・エンドの公募証券投資信託をいう。

9月末の株式投信の残高は12.6兆ドルで、6月末に比べ5.5%の増加であった。公社債投信は2.1%、MMFは9.3%、バランスファンドは11.0%の増加であった。

世界の投信残高のタイプ別増減状況
(%、2007年9月末現在)



世界の投信残高のタイプ別構成比
(%、2007年9月末)



株式投信の資金純増額は、第2四半期の1,030億ドルから第3四半期は320億ドルと大幅に減少。南北アメリカは140億ドル、アジア・太平洋地域480億ドルの資金純増であったが、ヨーロッパは310億ドルの資金純減であった。

公社債投信は、第2四半期の980億ドルの資金純増から第3四半期には510億ドルの資金純減に転じた。南北アメリカは140億ドルの資金純増であったが、第2四半

期に 150 億ドルの資金純増であったヨーロッパは第 3 四半期に 630 億ドルの資金純減に転じた。アジア・太平洋地域は第 3 四半期に 20 億ドルの資金純減であった。

MMF の資金純増額は、第 2 四半期の 1,380 億ドルから第 3 四半期には 2,820 億ドルへと倍増した。米国では、資金純増額が第 2 四半期の 1,000 億ドルから第 3 四半期には 3,120 億ドルに急増した。これに対し、米国以外は資金純減であった。特にヨーロッパでは、第 2 四半期の 350 億ドルの資金純増から第 3 四半期には 270 億ドルの資金純減に転じた。

世界の投信の資金純増減 (十億ドル)

	2005	2006				2007		
	Q4	Q1	Q2	Q3	Q4	Q1	Q2	Q3
合計	284	437	206	252	404	417	432	319
株式投信	160	246	74	65	150	118	103	32
公社債投信	-14	65	-5	8	40	69	98	-51
MMF	81	28	71	124	143	134	138	282
バランスファンド	34	73	48	38	45	69	58	23
その他	22	25	19	18	26	26	35	33

(注) 資金純増減データの提供国数：2005 年 Q4 は 32 カ国、2006 年 Q1 と Q2 は 33 カ国、2006 年 Q3～Q4 および 2007 年 Q1～Q3 は 34 カ国。2007 年 Q3 において資金純増減を提供した 34 カ国の残高は、今回データを提供した全ての国(43 カ国)の残高の 92%を占める。四捨五入のためタイプ別の計は合計と一致しない。「資金純増減」=設定 解約 償還。

図表 1
投信残高, 2002-2007:Q3
十億ドル

	2002	2003	2004	2005	2006		2007		
					Q3	Q4	Q1	Q2	Q3
データを提供した全ての国¹	11,324	14,048	16,165	17,771	20,219	21,728	22,797	24,314	25,822
株式投信	4,204	5,923	7,219	8,333	9,556	10,504	11,013	11,903	12,562
公社債投信	2,534	3,047	3,313	3,450	3,710	3,870	4,006	4,116	4,202
MMF	3,190	3,206	3,323	3,364	3,685	3,864	4,063	4,267	4,665
バランスファンド	918	1,198	1,445	1,566	1,923	2,048	2,187	2,352	2,610
その他	229	311	398	512	619	675	706	793	862
その内、全期間のデータを提供した国²	10,767	13,300	15,246	16,731	18,859	20,275	21,277	22,678	23,743
株式投信	4,084	5,766	7,031	8,123	9,290	10,209	10,712	11,571	11,969
公社債投信	2,462	2,953	3,217	3,339	3,587	3,752	3,889	3,993	4,054
MMF	3,159	3,157	3,254	3,289	3,571	3,736	3,934	4,132	4,535
バランスファンド	860	1,128	1,364	1,485	1,812	1,924	2,060	2,215	2,348
その他	202	296	380	495	599	654	682	766	837

(出典) 各国の投信協会および欧州資産運用協会(同協会に加盟している国のデータ)

¹ 四捨五入や未分類のファンドがあるためタイプ別の計と合計とは一致しない。

² 国数は26。四捨五入のためタイプ別の計と合計とは一致しない。

図表 2
資金純増減,¹ 2003-2007:Q3
十億ドル

	2003	2004	2005	2006	2006		2007		
					Q3	Q4	Q1	Q2	Q3
データを提供した全ての国²	317	457	971	1,299	252	404	416	432	319
株式投信	283	357	416	535	65	150	118	103	32
公社債投信	177	109	224	108	8	40	69	98	-51
MMF	-212	-120	120	365	124	143	134	138	282
バランスファンド	56	82	108	203	38	45	69	58	23
その他	14	29	102	88	18	26	26	35	33
その内、全期間のデータを提供した国³	165	307	672	951	206	331	317	310	267
株式投信	250	298	317	414	53	123	111	92	36
公社債投信	86	62	91	78	18	38	48	59	-26
MMF	-218	-131	128	336	117	147	113	124	257
バランスファンド	40	69	112	102	14	20	35	22	-5
その他	6	8	23	21	5	4	10	12	5

(出典) 各国の投信協会および欧州資産運用協会(同協会に加盟している国のデータ)

¹ 資金純増減 = 設定 - 解約 - 償還

² 四捨五入や未分類のファンドがあるためタイプ別の計と合計とは一致しない。

³ 国数は18。四捨五入のためタイプ別の計と合計とは一致しない。

図表 3
ファンド本数, 2002-2007:Q3

	2002	2003	2004	2005	2006		2007		
					Q3	Q4	Q1	Q2	Q3
データを提供した全ての国¹	54,110	54,569	54,982	56,868	59,761	61,498	62,512	63,292	64,062
株式投信	22,974	22,688	22,362	23,264	24,572	25,583	25,599	25,947	26,060
公社債投信	11,619	11,886	13,309	13,231	13,455	13,557	13,498	13,420	13,517
MMF	4,394	4,974	3,623	3,536	3,498	3,407	3,406	3,382	3,447
バランスファンド	11,228	11,465	11,603	11,393	11,992	12,515	13,069	13,072	13,333
その他	1,310	1,578	1,997	3,317	3,969	4,097	4,521	4,996	5,174
その内、全期間のデータを提供した国²	42,393	41,689	42,354	42,427	44,011	44,985	45,318	45,723	46,836
株式投信	20,808	20,018	19,918	20,044	20,734	21,555	21,341	21,477	21,703
公社債投信	9,946	9,847	9,961	10,004	10,222	10,291	10,299	10,261	10,443
MMF	2,674	2,652	2,899	2,799	2,710	2,595	2,589	2,569	2,661
バランスファンド	7,723	7,857	8,095	7,857	8,335	8,465	8,784	8,975	9,510
その他	1,242	1,315	1,481	1,723	2,010	2,079	2,305	2,441	2,519

(出典) 各国の投信協会および欧州資産運用協会(同協会に加盟している国のデータ)

¹ 未分類のファンドがあるため、タイプ別の計と合計とは一致しない。

² 国数は24。