

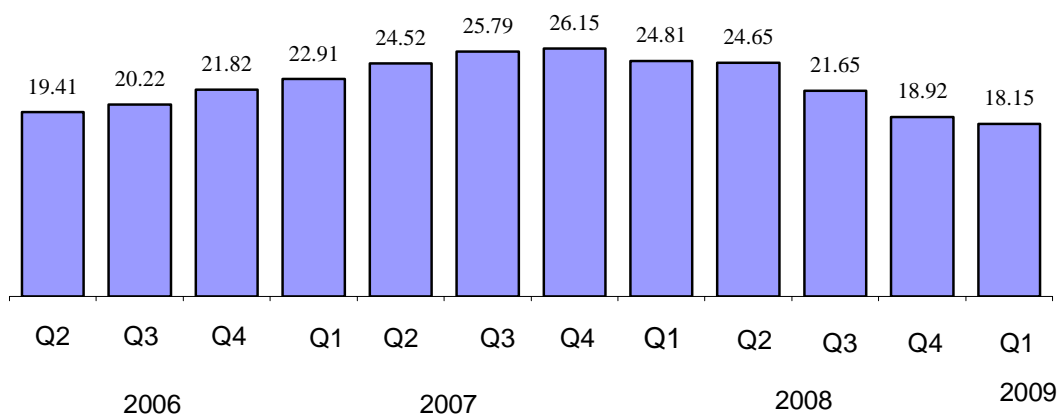
投資信託の世界統計

2009年第1四半期（1月～3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の残高は昨年12月末の18.92兆ドルから今年3月末には18.15兆ドルと4.0%減少した。資金純増額も昨年第4四半期の950億ドルから今年第1四半期には450億ドルに減少した。今回は44カ国から提供されたデータを集計したもの。

今年3月末の残高をタイプ別に昨年12月末と比べると、MMFを除く株式投信、公社債投信、バランスファンドで残高が減少した。

世界の投信残高
(兆ドル、四半期末)



投信残高上位10カ国（2009年3月末）

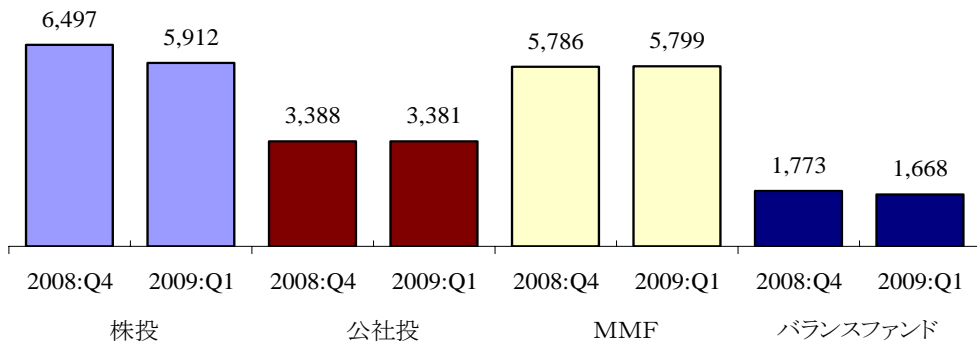
| 順位 | 国名 | 残高(十億ドル) | 順位 | 国名 | 残高(十億ドル) |
|----|---------|----------|----|------|----------|
| 1 | 米国 | 9,243 | 6 | 日本 | 520 |
| 2 | ルクセンブルグ | 1,742 | 7 | ブラジル | 498 |
| 3 | フランス | 1,538 | 8 | 英国 | 469 |
| 4 | オーストラリア | 808 | 9 | カナダ | 394 |
| 5 | アイルランド | 679 | 10 | 中国 | 286 |

¹ 世界各国の投資信託協会が加盟する国際組織。

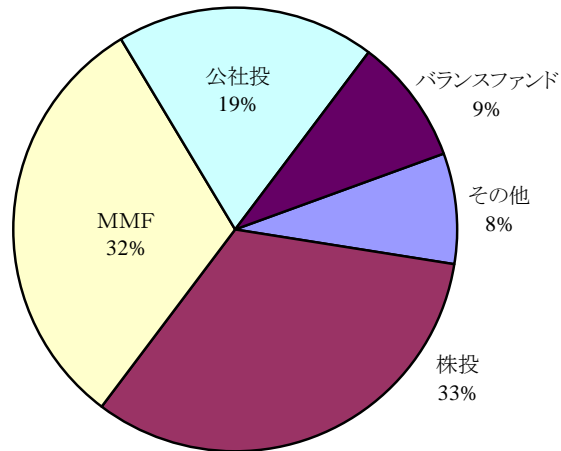
² この世界統計において、「投資信託」とはオープン・エンドの公募証券投資信託をいう。

今年3月末の株式投信の残高は5.9兆ドルで、昨年12月末に比べ9.0%の減少であった。公社債投信も0.2%、バランスファンドも5.9%の減少であったが、MMFは0.2%の微増であった。

世界の投信残高のタイプ別増減状況
(十億ドル、四半期末)



世界の投信残高のタイプ別構成比
(%、2009年3月末)



株式投信の資金純減額は、昨年第4四半期の1,210億ドルから今年第1四半期の410億ドルに減少した。南北アメリカは370億ドル、ヨーロッパは50億ドルの資金純減であったが、アジア・太平洋地域は8億ドルの資金純増であった。

公社債投信は、昨年第4四半期の1,570億ドルの資金純減から今年第1四半期は590億ドルの資金純増に転じた。南北アメリカは720億ドルの資金純増であったが、ヨーロッパは60億ドル、アジア・太平洋地域は70億ドルの資金純減であった。

MMFの資金純増額は、昨年第4四半期の4,440億ドルから今年第1四半期には630億ドルに減少した。南北アメリカは90億ドルの資金純減であったが、アジア・太平洋地域は20億ドル、ヨーロッパは680億ドルの資金純増であった。

世界の投信の資金純増減表 (十億ドル)

| | 2007 | | | 2008 | | | | 2009 |
|----------|------|-----|-----|------|-----|------|------|------|
| | Q2 | Q3 | Q4 | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 | Q1 |
| 合計 | 431 | 316 | 382 | 394 | 2 | -211 | 95 | 45 |
| 株式投信 | 99 | 31 | 84 | -132 | 29 | -147 | -121 | -41 |
| 公社債投信 | 97 | -50 | -30 | 13 | 14 | -67 | -157 | 59 |
| MMF | 138 | 279 | 250 | 486 | -70 | 31 | 444 | 63 |
| バランスファンド | 62 | 23 | 42 | -15 | 15 | -23 | -56 | -22 |
| その他 | 35 | 32 | 36 | 41 | 15 | -5 | -16 | -15 |

注) 資金純増減データの提供国数：2007年Q2～Q3は34カ国。2007年Q4と2008年Q1は35カ国。2008年Q2～Q4は36カ国、2009年Q1は37カ国。2009年Q1において資金純増減を提供した37カ国の残高は、今回データを提供した全ての国(44カ国)の残高の91%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, 2004-2009:Q1
 十億ドル

| | 2004 | 2005 | 2006 | 2007 | 2008 | | | | 2009 |
|--------------------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | | | | | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 | Q1 |
| データを提供した全ての国¹ | 16,165 | 17,771 | 21,823 | 26,151 | 24,807 | 24,649 | 21,645 | 18,917 | 18,152 |
| 株式投信 | 7,219 | 8,333 | 10,508 | 12,446 | 10,605 | 10,437 | 8,618 | 6,497 | 5,912 |
| 公社債投信 | 3,313 | 3,450 | 3,871 | 4,277 | 4,221 | 4,184 | 3,793 | 3,388 | 3,381 |
| MMF | 3,323 | 3,364 | 3,864 | 4,961 | 5,615 | 5,591 | 5,424 | 5,786 | 5,799 |
| バランスファンド | 1,445 | 1,566 | 2,049 | 2,632 | 2,495 | 2,476 | 2,159 | 1,773 | 1,668 |
| その他 | 398 | 512 | 676 | 884 | 885 | 975 | 823 | 676 | 641 |
| その内、全期間のデータを提供した国² | 15,246 | 16,731 | 20,333 | 23,981 | 22,697 | 22,645 | 19,936 | 17,422 | 16,685 |
| 株式投信 | 7,031 | 8,123 | 10,226 | 11,827 | 10,075 | 9,979 | 8,238 | 6,239 | 5,625 |
| 公社債投信 | 3,217 | 3,339 | 3,755 | 4,119 | 4,050 | 4,018 | 3,646 | 3,259 | 3,256 |
| MMF | 3,254 | 3,289 | 3,769 | 4,812 | 5,460 | 5,440 | 5,277 | 5,619 | 5,649 |
| バランスファンド | 1,364 | 1,485 | 1,927 | 2,367 | 2,255 | 2,260 | 1,975 | 1,636 | 1,523 |
| その他 | 380 | 495 | 656 | 856 | 857 | 947 | 801 | 669 | 632 |

(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25。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, 2005-2009:Q1
 十億ドル

| | 2005 | 2006 | 2007 | 2008 | 2008 | | | | 2009 |
|--------------------------------------|------------|--------------|--------------|------------|------------|------------|-------------|------------|-----------|
| | | | | | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 | Q1 |
| データを提供した全ての国² | 971 | 1,299 | 1,538 | 280 | 394 | 2 | -211 | 95 | 45 |
| 株式投信 | 416 | 534 | 328 | -371 | -132 | 29 | -147 | -121 | -41 |
| 公社債投信 | 224 | 108 | 84 | -197 | 13 | 14 | -67 | -157 | 59 |
| MMF | 120 | 366 | 800 | 891 | 486 | -70 | 31 | 444 | 63 |
| バランスファンド | 108 | 203 | 196 | -78 | -15 | 15 | -23 | -56 | -22 |
| その他 | 102 | 88 | 130 | 35 | 41 | 15 | -5 | -16 | -15 |
| その内、全期間のデータを提供した国³ | 671 | 951 | 1,212 | 397 | 361 | -27 | -135 | 198 | 66 |
| 株式投信 | 317 | 414 | 315 | -236 | -67 | 31 | -114 | -85 | -38 |
| 公社債投信 | 91 | 77 | 73 | -30 | 34 | 31 | -17 | -77 | 70 |
| MMF | 128 | 336 | 728 | 761 | 416 | -85 | 21 | 409 | 55 |
| バランスファンド | 112 | 102 | 68 | -98 | -28 | -7 | -22 | -40 | -18 |
| その他 | 23 | 21 | 28 | -1 | 5 | 3 | -1 | -8 | -2 |

(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17。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, 2004-2009:Q1

| | 2004 | 2005 | 2006 | 2007 | 2008 | | | | 2009 |
|--------------------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | | | | | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 | Q1 |
| データを提供した全ての国¹ | 54,982 | 56,868 | 61,855 | 66,350 | 67,220 | 68,513 | 69,496 | 68,574 | 66,988 |
| 株式投信 | 22,362 | 23,264 | 25,698 | 27,319 | 27,284 | 27,627 | 28,108 | 27,882 | 26,231 |
| 公社債投信 | 13,309 | 13,231 | 13,571 | 13,306 | 12,961 | 12,662 | 12,575 | 12,214 | 12,011 |
| MMF | 3,623 | 3,536 | 3,409 | 3,452 | 3,562 | 3,721 | 3,703 | 3,701 | 3,653 |
| バランスファンド | 11,603 | 11,393 | 12,530 | 13,756 | 13,973 | 14,390 | 14,686 | 14,510 | 14,824 |
| その他 | 1,997 | 3,317 | 4,116 | 5,619 | 6,538 | 7,144 | 7,383 | 7,170 | 7,215 |
| その内、全期間のデータを提供した国² | 42,354 | 42,427 | 45,394 | 47,661 | 47,520 | 48,031 | 48,878 | 58,104 | 58,398 |
| 株式投信 | 19,918 | 20,044 | 21,805 | 22,449 | 22,156 | 22,324 | 22,659 | 23,950 | 23,988 |
| 公社債投信 | 9,961 | 10,004 | 10,292 | 10,241 | 9,876 | 9,674 | 9,718 | 10,956 | 10,940 |
| MMF | 2,899 | 2,799 | 2,663 | 2,635 | 2,724 | 2,858 | 2,822 | 3,142 | 3,109 |
| バランスファンド | 8,095 | 7,857 | 8,540 | 9,737 | 9,826 | 10,142 | 10,580 | 13,210 | 13,465 |
| その他 | 1,481 | 1,723 | 2,094 | 2,599 | 2,938 | 3,033 | 3,099 | 6,846 | 6,896 |

(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。

本件に関する問い合わせ
 企画政策部 木島
 03-5614-8417