

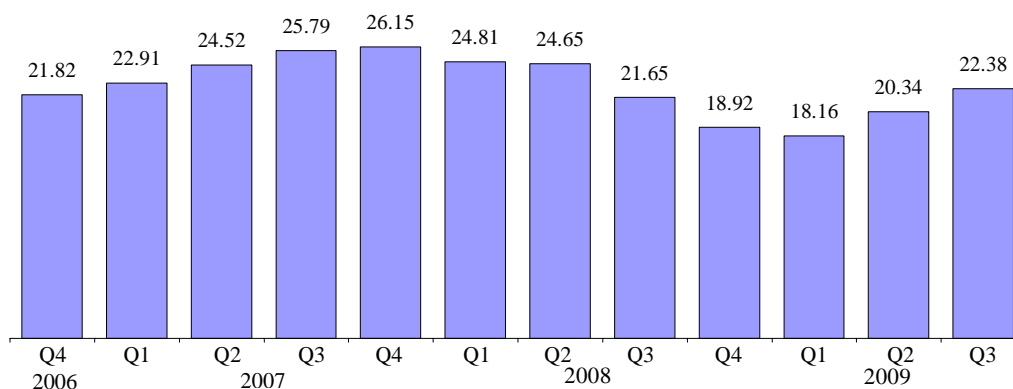
投資信託の世界統計

2009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20.34兆ドルから9月末には22.38兆ドルと10.0%増加した。資金純増額は第2四半期の820億ドルから第3四半期には690億ドルに減少した。今回は45カ国から提供されたデータを集計したものの。

9月末の残高をタイプ別に6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増加した。

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)

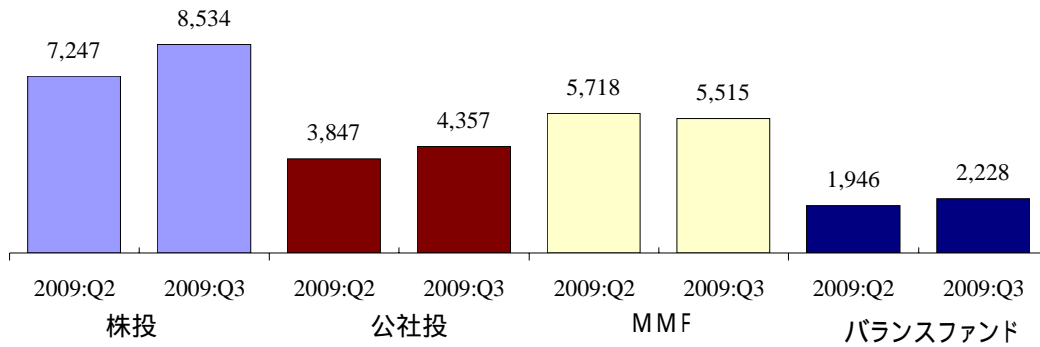
| 順位 | 国名 | 残高(十億ドル) | 順位 | 国名 | 残高(十億ドル) |
|----|---------|----------|----|------|----------|
| 1 | 米国 | 10,832 | 6 | ブラジル | 741 |
| 2 | ルクセンブルグ | 2,238 | 7 | 英国 | 702 |
| 3 | フランス | 1,851 | 8 | 日本 | 662 |
| 4 | オーストラリア | 1,150 | 9 | カナダ | 544 |
| 5 | アイルランド | 834 | 10 | ドイツ | 312 |

¹ 世界各国の投資信託協会が加盟する国際組織。

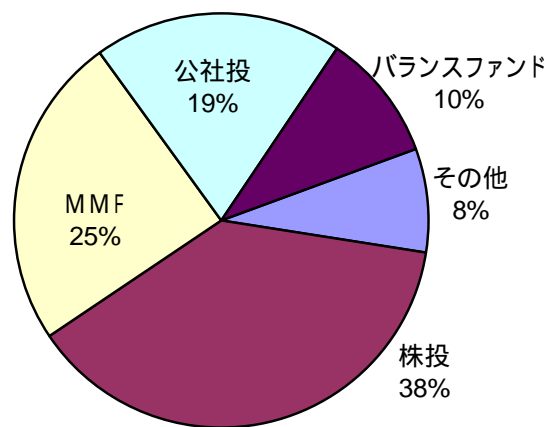
² この世界統計において、「投資信託」とはオープン・エンドの公募証券投資信託をいう。

9月末の株式投信の残高は8.5兆ドルで、6月末に比べ17.8%の増加であった。公社債投信は13.3%、バランスファンドも14.5%の増加であったが、MMFは3.5%の減少であった。

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9月末)



株式投信の資金純増額は、第2四半期の930億ドルから第3四半期には670億ドルに減少した。南北アメリカは110億ドル、ヨーロッパは190億ドル、アジア・太平洋地域は370億ドルの資金純増であった。

公社債投信の資金純増額は、第2四半期の1,650億ドルから第2四半期には2,190億ドルに増加した。南北アメリカは1,570億ドル、ヨーロッパは490億ドル、アジア・太平洋地域は130億ドルの資金純増であった。

MMFの資金純減額は、第2四半期の2,120億ドルから第3四半期には2,830億ドルに増加した。南北アメリカは2,360億ドル、ヨーロッパは130億ドル、アジア・太平洋地域は340億ドルの資金純減であった。

**世界の投信の資金純増減表
(十億ドル)**

| | 2007 | 2008 | | | | 2009 | | |
|----------|------|------|-----|------|------|------|------|------|
| | Q4 | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 | Q1 | Q2 | Q3 |
| 合計 | 382 | 394 | 2 | -211 | 95 | 47 | 82 | 69 |
| 株式投信 | 84 | -132 | 29 | -147 | -121 | -39 | 93 | 67 |
| 公社債投信 | -30 | 13 | 14 | -67 | -157 | 59 | 165 | 219 |
| MMF | 250 | 486 | -70 | 31 | 444 | 63 | -212 | -283 |
| バランスファンド | 42 | -15 | 15 | -23 | -56 | -22 | 35 | 66 |
| その他 | 36 | 41 | 15 | -5 | -16 | -15 | 1 | * |

* = 5億ドル未満

注) 資金純増減データの提供国数：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Q2とQ3は38カ国。2009年Q3において資金純増減を提供した38カ国の残高は、今回データを提供した全ての国(45カ国)の残高の90%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:Q3
 十億ドル

| | 2004 | 2005 | 2006 | 2007 | 2008 | | 2009 | | |
|--------------------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | | | | | Q3 | Q4 | Q1 | Q2 | Q3 |
| データを提供した全ての国¹ | 16,165 | 17,771 | 21,823 | 26,151 | 21,645 | 18,917 | 18,164 | 20,337 | 22,376 |
| 株式投信 | 7,219 | 8,333 | 10,508 | 12,446 | 8,618 | 6,497 | 5,925 | 7,247 | 8,534 |
| 公社債投信 | 3,313 | 3,450 | 3,871 | 4,277 | 3,793 | 3,388 | 3,380 | 3,847 | 4,357 |
| M M F | 3,223 | 3,364 | 3,864 | 4,961 | 5,424 | 5,786 | 5,799 | 5,718 | 5,515 |
| バランスファンド | 1,445 | 1,566 | 2,049 | 2,632 | 2,159 | 1,773 | 1,668 | 1,946 | 2,228 |
| その他 | 398 | 512 | 676 | 884 | 823 | 676 | 641 | 732 | 813 |
| その内、全期間のデータを提供した国² | 15,279 | 16,772 | 20,391 | 24,090 | 20,001 | 17,462 | 17,927 | 20,092 | 20,949 |
| 株式投信 | 7,037 | 8,138 | 10,250 | 11,866 | 8,260 | 6,239 | 6,317 | 7,718 | 8,631 |
| 公社債投信 | 3,227 | 3,348 | 3,763 | 4,151 | 3,669 | 3,283 | 3,442 | 3,939 | 4,393 |
| M M F | 3,268 | 3,304 | 3,791 | 4,841 | 5,291 | 5,635 | 5,868 | 5,781 | 5,327 |
| バランスファンド | 1,365 | 1,486 | 1,929 | 2,371 | 1,977 | 1,636 | 1,628 | 1,887 | 2,156 |
| その他 | 381 | 496 | 658 | 861 | 804 | 669 | 672 | 767 | 441 |

(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, 2005-2009:Q3
 十億ドル

| | 2005 | 2006 | 2007 | 2008 | 2008 | | 2009 | | |
|--------------------------------------|------------|--------------|--------------|------------|-------------|------------|-----------|-----------|------------|
| | | | | | Q3 | Q4 | Q1 | Q2 | Q3 |
| データを提供した全ての国² | 971 | 1,299 | 1,538 | 280 | -211 | 95 | 47 | 82 | 69 |
| 株式投信 | 416 | 534 | 328 | -371 | -147 | -121 | -39 | 93 | 67 |
| 公社債投信 | 224 | 108 | 84 | -197 | -67 | -157 | 59 | 165 | 219 |
| M M F | 120 | 366 | 800 | 891 | 31 | 444 | 63 | -212 | -283 |
| バランスファンド | 108 | 203 | 196 | -78 | -23 | -56 | -22 | 35 | 66 |
| その他 | 102 | 88 | 130 | 35 | -5 | -16 | -15 | 1 | 0 |
| その内、全期間のデータを提供した国³ | 671 | 951 | 1,212 | 398 | -150 | 203 | 71 | 51 | -31 |
| 株式投信 | 317 | 414 | 315 | -232 | -114 | -86 | -36 | 74 | 31 |
| 公社債投信 | 91 | 77 | 73 | -27 | -28 | -75 | 71 | 149 | 175 |
| M M F | 128 | 336 | 728 | 753 | 15 | 411 | 56 | -189 | -277 |
| バランスファンド | 112 | 102 | 68 | -97 | -22 | -40 | -19 | 18 | 38 |
| その他 | 23 | 21 | 28 | 1 | -1 | -7 | -2 | -2 | 3 |

(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, 2004-2009:Q3

| | 2004 | 2005 | 2006 | 2007 | 2008 | | 2009 | | |
|--------------------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | | | | | Q3 | Q4 | Q1 | Q2 | Q3 |
| データを提供した全ての国¹ | 54,982 | 56,868 | 61,855 | 66,350 | 69,496 | 68,574 | 67,007 | 66,483 | 66,110 |
| 株式投信 | 22,362 | 23,264 | 25,698 | 27,319 | 28,108 | 27,882 | 26,234 | 25,978 | 25,866 |
| 公社債投信 | 13,309 | 13,231 | 13,571 | 13,306 | 12,575 | 12,214 | 12,096 | 12,233 | 12,205 |
| M M F | 3,623 | 3,536 | 3,409 | 3,452 | 3,703 | 3,701 | 3,652 | 3,591 | 3,533 |
| バランスファンド | 11,603 | 11,393 | 12,530 | 13,756 | 14,686 | 14,510 | 14,756 | 14,534 | 14,538 |
| その他 | 1,997 | 3,317 | 4,116 | 5,619 | 7,383 | 7,170 | 7,215 | 7,016 | 6,815 |
| その内、全期間のデータを提供した国² | 42,748 | 42,872 | 45,862 | 48,216 | 49,415 | 58,655 | 58,944 | 58,313 | 57,890 |
| 株式投信 | 20,058 | 20,221 | 22,004 | 22,665 | 22,891 | 24,190 | 24,225 | 23,972 | 23,886 |
| 公社債投信 | 10,090 | 10,142 | 10,423 | 10,433 | 9,874 | 11,115 | 11,174 | 11,311 | 11,272 |
| M M F | 2,938 | 2,842 | 2,713 | 2,693 | 2,880 | 3,199 | 3,163 | 3,093 | 3,018 |
| バランスファンド | 8,131 | 7,891 | 8,574 | 9,769 | 10,610 | 13,240 | 13,417 | 13,166 | 13,143 |
| その他 | 1,531 | 1,776 | 2,148 | 2,656 | 3,160 | 6,911 | 6,965 | 6,771 | 6,571 |

(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25。