日本経済新聞

全世界株インデックス投信の運用効率、高配当の指数連動型が首位 投信番付

2026/10/20 12:00 | 日本経済新聞　電子版

全世界株指数に連動するインデックスファンドについて、過去1年の運用効率（シャープレシオ）をランキングすると、高配当株で構成する指数に連動するタイプが首位に立った。運用効率は、数値が高いほど運用で取った価格変動リスクに見合うリターンを効果的に上げたと評価する。

運用効率の高い全世界株型インデックスファンド（１年）

	ファンド名称（運用会社略称）	シャープレシオ	リスク
1	（アムンディ・インデックスシリーズ）オールカントリー・高配当株（アムンディ）	1.96	10.46%
2	eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）（三菱UFJ）	1.88	14.29
3	楽天・全世界株式（除く米国）インデックス・ファンド（楽天）	1.68	13.54
4	eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）（三菱UFJ）	1.67	13.06
5	楽天・全世界株式インデックス・ファンド（楽天）	1.65	13.00
6	eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）（三菱UFJ）	1.62	13.19
7	五大陸株式ファンド（アモーヴァAM）	1.58	13.50
8	iFreeNEXT 全世界半導体株インデックス（楽天）	1.58	33.04
9	たわらノーロード フォーカス 次世代通信（アセマネOne）	1.30	26.17
10	SBI・V・世界小型株式（除く米国）インデックス・ファンド（SBI）	1.22	13.85

（注）QUICK資産運用研究所調べ。データは2026年10月2日時点。対象は国内公募の追加型株式投資信託（ETFを除く）のうち、全世界株指数に連動するインデックスファンド。シャープレシオとリスクは1年（52週間）の週次リターンを基に計測し、年率化。小数第3位以下も含めてランキング。同じ指数に連動するファンドは残高上位の1本のみ掲載

1位の「（アムンディ・インデックスシリーズ）オールカントリー・高配当株」の運用効率は1.96。連動指数は「MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（ACWI）」採用銘柄の中で配当利回りの高い銘柄で構成する。過去1年の価格変動リスクは上位10本の中で最も低く、リターンも堅調だったのが運用効率を押し上げた。

ACWIに連動する「eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）」（通称オルカン）の運用効率は1.67で4位だった。

（QUICK資産運用研究所　近藤拓人）