



MAB 投信指数 月次レポート

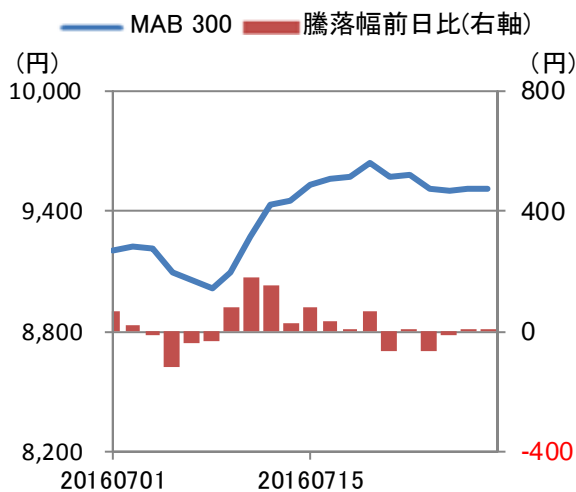
基準日：2016年7月29日

1. 指数

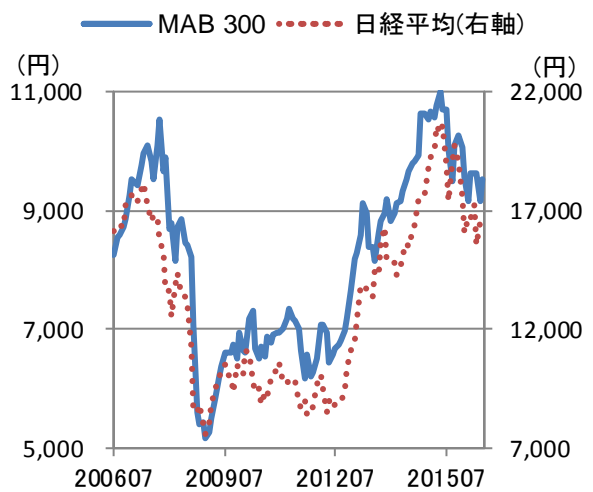
MAB 300 今月末	前月末	前月比	月間騰落率	
9,511円	9,141円	+370円	+4.05%	
MAB 300 年初来高値	年初来安値	純資産総額	前月比	月間 ネット資金流出入額
9,941円 (2016/01/04)	8,766円 (2016/02/12)	395,240 億円	+12,643億円	+517億円

2. 推移

○2016年7月



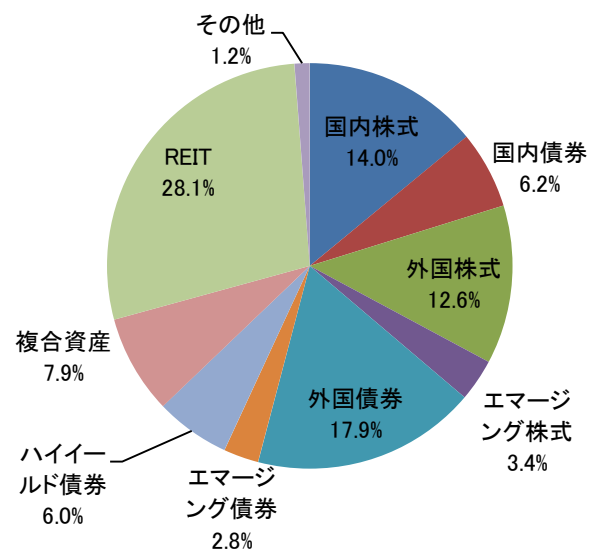
○直近10年



3. カテゴリー別寄与度

MAB第1分類	寄与度(円)
国内株式	85.3
国内債券	-3.3
外国株式(先進国)	82.1
エマージング株式	24.9
外国債券(先進国)	33.7
エマージング債券	15.4
ハイイールド債券	32.4
複合資産	26.5
REIT	69.5
その他	3.7
MAB 300 前月比	370.4

4. カテゴリー別 純資産総額構成比





5. 寄与度上位下位5ファンド

上位

順位	ファンド名	運用会社名	騰落率 (%)	寄与度 (円)
1	トヨタグループ株式ファンド	三井住友アセットマネジメント	14.94	6.00
2	朝日Nvestグローバルバリュー株オープン(Avest-E)	朝日ライフアセットマネジメント	7.20	5.36
3	LM・オーストラリア高配当株ファンド(毎月分配型)	レッグ・メイソン・アセット・マネジメント	10.85	4.12
4	野村インド株投資	野村アセットマネジメント	8.16	4.01
5	高成長インド・中型株式ファンド	三井住友アセットマネジメント	9.21	3.79

下位

順位	ファンド名	運用会社名	騰落率 (%)	寄与度 (円)
1	ダイワファンドラップコモディティセレクト	大和証券投資信託委託	-3.80	-0.33
2	DLIBJ公社債オープン(中期コース)	DIAMアセットマネジメント	-0.92	-0.27
3	三菱UFJ DC国内債券インデックスファンド	三菱UFJ国際投信	-0.86	-0.24
4	野村ファンドラップ日本債券	野村アセットマネジメント	-0.90	-0.24
5	三井住友・日本債券インデックス・ファンド	三井住友アセットマネジメント	-0.85	-0.24

6. 構成ファンド変更情報(月末)

構成銘柄に入ったファンド	運用会社	カテゴリー
ノムラ・ジャパン・オープン	野村アセットマネジメント	国内株式
東京海上J-REIT投信(通貨選択型)米ドルコース(毎月分配型)	東京海上アセットマネジメント	REIT
構成銘柄から外れたファンド	運用会社	カテゴリー
GS米国成長株集中投資ファンド毎月決算コース	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント	外国株式(先進国)
HSBCブラジル債券オープン(毎月決算型)	HSBC投信	エマージング債券

トピックス『MAB 300 の特徴』

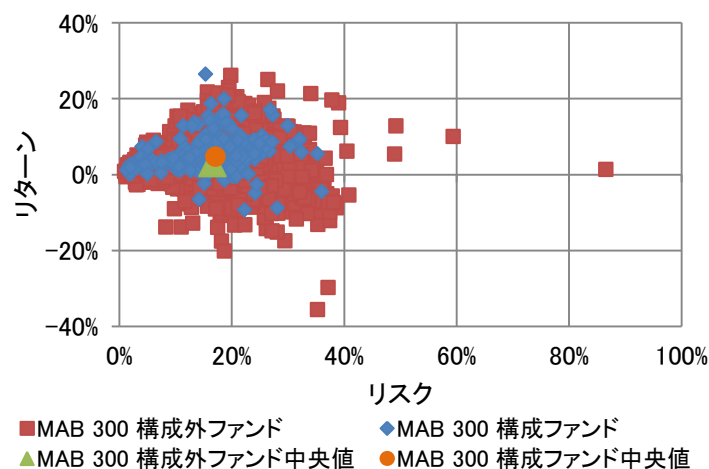
基準日：2016年7月29日

1. 「MAB 300」の構成ファンド

「MAB 300」構成ファンドで指数算出開始時(1997年3月末)から現在(本年7月末)まで残っているファンドは下記6ファンドです。これは全体の2%に過ぎません。同様に、10年前から残っているファンドは28%、5年前から残っているファンドは45%となっており、入替りの多いことがわかります。

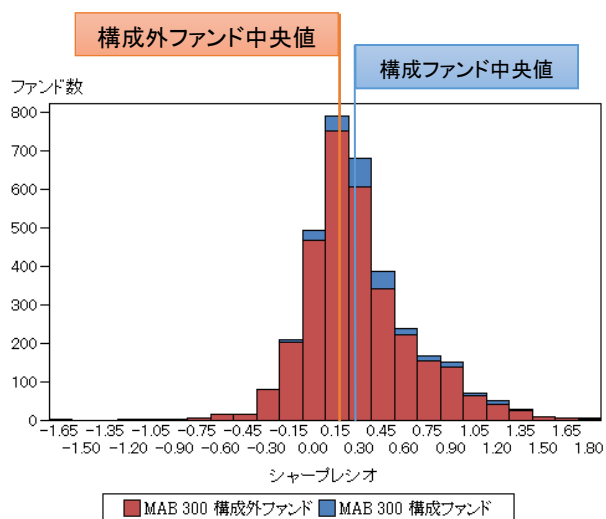
ファンド名	投信会社	純資産額(百万円)	
		1997年3月	2016年7月
インデックスファンド225	日興アセットマネジメント	92,976	239,485
MHAM株式インデックスファンド225	みずほ投信投資顧問	26,366	166,981
ストックインデックスファンド225	大和証券投資信託委託	98,356	96,144
インデックスファンド225	三菱UFJ国際投信	119,836	76,693
フィデリティ・ジャパン・オープン	フィデリティ投信	40,908	61,333
ノムラ・ジャパン・オープン	野村アセットマネジメント	71,580	36,729

2. リスク・リターン・シャープレシオの分布状況



公募追加型株式投信とMAB 300構成ファンドのリスクとリターンの分布状況を比較すると、構成ファンドのリターンは同じリスク水準の中で大半が中位以上に分布しています。

構成ファンドのリスク、リターン及びシャープレシオの中央値は(17.78%, 4.41%, 0.35)、構成外ファンドの中央値は(15.64%, 2.43%, 0.23)となっています。



公募追加型株式投信とMAB 300構成ファンドのシャープレシオの分布状況を見ると、構成ファンドは平均的即ちベンチマーク的なポジションに位置していることがわかります。

昨今販売会社のフィデューシャリー・デューティーが強く意識され始めておりますが、ラインアップファンドのクオリティの良し悪しを判断する指標として「MAB 300」を活用することができます。

●分析期間は1997年3月末から2016年7月末です。●リスクフリーレートは「無担保コール」を使用しています。●観測期間が3年に満たないファンドは分析対象から外しています。



- 本レポートに関する著作権、知的財産権等一切の権利は三菱アセット・ブレインズ株式会社(以下、MAB)に帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。
- 本レポートは、MABが信頼できると判断した情報源から入手した本レポート作成基準日現在における情報をもとに作成しておりますが、当該情報の正確性を保証するものではありません。
- MABは、本レポートの利用に関連して発生した一切の損害について何らの責任も負いません。
- 本レポート中のグラフ・数値等は、あくまでも本レポート作成基準日までの過去の実績を示すものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。
- 本レポートは、情報提供を目的としたものであり、投資信託の勧誘のために作成されたものではありません。
- 日経平均に関する著作権、知的財産権等一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。
- MAB 投信指数「MAB 300」(以下、本指数)に関する著作権、知的財産権等一切の権利はMABに帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。また、本指数を商業的に利用する場合にはMABの利用許諾が必要です。

【照会先】

三菱アセット・ブレインズ株式会社
アドバイザリーユニット

03-6721-1037

mab-index@mab.co.jp

〒107-0062 東京都港区南青山1丁目1番1号 新青山ビル西館8階

URL：<http://www.mab.jp/mab-index/>

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第1085号

加入協会名 一般社団法人 日本投資顧問業協会