

MAB 投信指数「MAB-FPI」 算出要領

2020年1月8日
三菱アセット・プレインズ株式会社

1. 名称

正式名称 : MAB 投信指数「MAB - F P I」
(FPI は「Fund Performance Index」の略)

2. 概要

日本の公募追加型株式投資信託全体の動向を表す日次投資収益率指数です。
全体を表す「MAB - FPI 総合」のほか、様々なサブ・カテゴリー別の指数や収益率、純資産額
合計、設定・解約額合計なども算出します。

3. 選定基準

(1) ユニバース

国内籍の公募追加型株式投資信託をユニバースとします(但し、ETF は除く)。

(2) 新規設定・償還

新規設定ファンドは設定月の翌月より、また償還ファンドは償還日までユニバース対象
とします。

(3) 採用ファンドの選定

(1) (2) に基づき月末に翌月の採用ファンドを選定します。

4. 算出方法

(1) 算出開始時点

原則 1997 年 3 月 31 日とします。

但し、この時点に投資信託が存在しないカテゴリについては、当該カテゴリに属する投資信託が設定された時点、もしくは弊社が適切と判断した時点より指数算出を開始します。

(2) 日次収益率の計算方法

総合および各カテゴリ別の日次収益率は、個々の投資信託の日次収益率を前日の純資産額によって加重した平均値として計算します。

なお、個々の投資信託の日次収益率は分配や受益分割・併合を考慮して計算します。

(3) 指数算出

各指数の算出開始時点を 10,000 (単位: ポイント) とし、日次収益率を乗じて算出します。

(4) 留意事項

①個別投資信託の基準価額や各種属性データについて変更・修正が発生した場合、全期間または一部期間の指数や関連情報について再計算することがあります。

②各カテゴリの採用ファンドがゼロとなった場合は算出を停止し、その後再び選定された場合の指数は、原則、算出停止前の指数に再開後の日次収益率を掛け合わせて算出します。この場合、指数の連続性が無く、あくまでも参考値となります。

5. 算出タイミング

翌日に算出します。

6. 指数ラインアップ

(1) 総合

採用ファンド全てを対象とします。

(2) ファンド分類別

弊社独自のファンド分類のうち、直近までの一定期間、指数算出が可能な分類を対象とします。

- ・大分類
- ・中分類
- ・小分類

⇒P.5（表1）参照

(3) 各種区分別

総合、またはファンド分類別に下記の区分を組み合わせたカテゴリーを対象とします。

- ・ヘッジ種別（ヘッジ無し／円ヘッジ）
- ・アクティブ／パッシブ別
- ・純資産額区分別
- ・設定来年数別
- ・基準価額帯別

など

(4) 等ウェイト指数

総合および各カテゴリー別の日次収益率について、個々の投資信託の日次収益率を等ウェイトとして平均値を計算し、それによる指数も算出します。

上記の他、様々なカテゴリーについても算出対象としていく予定です。

(表1) ファンド分類

大分類	中分類(*)	小分類(*)
国内株式	一般	フリー、バリュー
	小型	-
	その他	日経225、TOPIX、JPX日経400
国内債券	一般	-
	その他	-
外国株式(先進国)	グローバル	除く日本、含む日本
	その他	北米、米国、カナダ、欧州、ドイツ、イギリス、アジア・オセアニア、オーストラリア、ニュージーランド、複合地域
エマージング株式	グローバル	-
	BRICS	-
	その他	欧州、ロシア、アジア・オセアニア、中国、インド、インドネシア、タイ、フィリピン、ベトナム、韓国、香港、台湾、中南米、ブラジル、メキシコ、中東・アフリカ、トルコ、複合地域
外国債券(先進国)	グローバル	除く日本、含む日本
	その他	北米、米国、カナダ、欧州、イギリス、アジア・オセアニア、オーストラリア、ニュージーランド、複合地域
エマージング債券	グローバル	米ドル建て、現地通貨建て
	その他	ロシア、アジア・オセアニア、インド、インドネシア、ブラジル、メキシコ、南アフリカ、トルコ、複合地域
ハイイールド債券	グローバル	-
	北米	-
	その他	欧州、アジア・オセアニア、複合地域
複合資産	安定	-
	安定成長	-
	成長	-
	国内バランス	安定、一般
	その他	-
国内REIT	日本	-
外国REIT	グローバル	除く日本、含む日本
	北米	-
	その他	欧州、アジア・オセアニア、オーストラリア、複合地域、複数国
その他	絶対収益型	ロング・ショート、マーケットニュートラル、GTAA、その他スタイル
	CB	アジア・オセアニア、日本、グローバル
	コモディティ	全業種、貴金属、エネルギー、その他コモディティ

(*)上記の中分類と小分類は指数算出が可能なカテゴリからの抜粋です。

7. その他

(1) 利用許諾

- MAB 投信指数「MAB-FPI」（以下、本指数）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。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。

(2) 免責

- MAB は本指数を継続的に算出する義務を負うものではなく、算出の誤謬、遅延、または中断に関して、一切の責任を負いません。
- MAB は本指数の計算方法、その他の本指数に関する内容を変える権利および算出を停止する権利を有しています。
- 本指数は原則として本資料に記載された方法に基づいて算出されます。但し、本資料に記載のない事象が発生した場合や本資料の方法による算出が困難と MAB が判断した場合は、事前または事後の連絡無しに MAB が適当とみなした処理方法により算出することがあります。
- 本指数は、MAB が信頼できると判断した情報源から入手した本指数算出基準日現在における情報をもとに算出しておりますが、当該情報の正確性を保証するものではありません。
- MAB は、本指数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。
- 本指数中のグラフ・数値等は、あくまでも本指数算出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。
- 本指数は情報提供を目的として開発したものであり、投資信託の勧誘のために開発されたものではありません。
- 本指数はファンド評価で用いる MAB 独自の分類情報等に基づいて算出しております。

【照会先】

三菱アセット・ブレインズ株式会社
コンサルティンググループ

川真田 隆志

03-6721-1013

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: <https://www.mab.jp/business/information/mab-fpi/>

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