

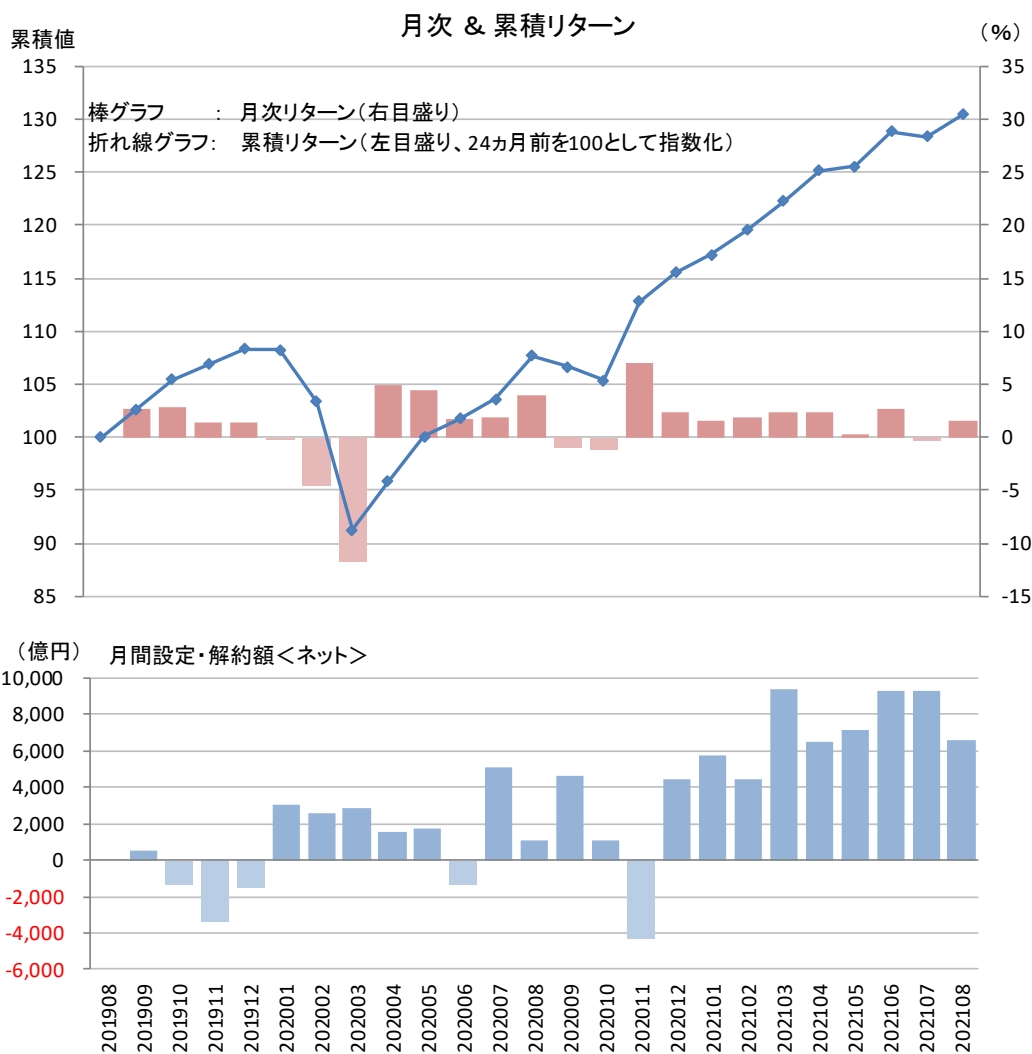
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

— Vol.1 ファンド大分類 編 —

2021年8月

「総合」 +1.62 %
(前月 -0.39 %)



MAB-FPI について

MAB-FPI とは日本の公募追加型株式投資信託全体の動向を表す指数で、弊社が独自に開発したものです。
(FPI は Fund Performance Index の略)

■主な特徴

- ・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）。
- ・月末に翌月の採用ファンドを選定します（月次リバランス）。
- ・総合および各カテゴリー別の日次収益率は、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。
- ・指数は算出開始時点（原則、1997年3月31日）を10,000（単位：ポイント）とし、各カテゴリーの日次収益率を乗じて算出します。
- ・カテゴリーは全体を表す「総合」のほかファンド分類別（大分類、中分類、小分類）、各種区分別（ヘッジ種別、アクティブ/パッシブ別、他）など、様々なサブ・カテゴリー指数を算出します。

詳細については『MAB 投信指数「MAB-FPI」算出要領』をご参照下さい。

■本レポートの内容

掲載対象カテゴリー：「総合」

|--- ファンド分類別「大分類」

|--- " " 「大分類（ヘッジ種別）」

<1>パフォーマンス・サマリー

- | | | |
|-----------------|-----------|------|
| 1. 「総合」 | ・ ・ ・ ・ ・ | P. 4 |
| 2. 「大分類」 | ・ ・ ・ ・ ・ | P. 5 |
| 3. 「大分類（ヘッジ種別）」 | ・ ・ ・ ・ ・ | P. 8 |

<2>リスク・サマリー

- | | | |
|-----------------|-----------|-------|
| 1. 「総合」および「大分類」 | ・ ・ ・ ・ ・ | P.1 3 |
| 2. 「大分類（ヘッジ種別）」 | ・ ・ ・ ・ ・ | P.1 6 |

<3>設定・解約額 [ネット金額]

- | | | |
|-----------------|-----------|-------|
| 1. 「総合」および「大分類」 | ・ ・ ・ ・ ・ | P.2 0 |
| 2. 「大分類（ヘッジ種別）」 | ・ ・ ・ ・ ・ | P.2 0 |

<4>純資産額、ファンド本数

- | | | |
|-----------------|-----------|-------|
| 1. 「総合」および「大分類」 | ・ ・ ・ ・ ・ | P.2 1 |
| 2. 「大分類（ヘッジ種別）」 | ・ ・ ・ ・ ・ | P.2 1 |

<5>属性、指標等

- | | | |
|-----------------|-----------|-------|
| 1. 「総合」および「大分類」 | ・ ・ ・ ・ ・ | P.2 2 |
| 2. 「大分類（ヘッジ種別）」 | ・ ・ ・ ・ ・ | P.2 2 |

2021年8月のMAB-FPI

<1>パフォーマンス・サマリー

8月のMAB-FPI「総合」は1.62%上昇し16,389ポイントとなり、算出来高値を更新。純資産総額は1兆6,948億円増加し、82兆2,852億円。

「大分類別」では国内株式+3.22%、外国株式(先進国)+2.45%、外国REIT+1.70%など8つのカテゴリーでプラスとなった一方、国内REIT-0.45%、外国債券(先進国)-0.14%など3つのカテゴリーでマイナスとなった。

<2>リスク・サマリー

「総合」のリスク推移は、概ね横ばい。

「大分類別」では外国債券(先進国)と複合資産の5年リスク、エマージング債券の3年リスクに低下傾向がみられる。

<3>設定・解約額[ネット金額] (弊社推計値)

「総合」は+6,539億円と9ヵ月連続で大幅な流入超となった。

「大分類別」では、引き続き外国株式(先進国)が+5,273億円と大幅な流入超となった。また複合資産+867億円、国内債券+528億円、その他+292億円など6つのカテゴリーで流入超となった。一方、エマージング株式-235億円、国内REIT-184億円、外国REIT-157億円など5つのカテゴリーで流出超となった。

本レポートは、投信指数MAB-FPIのパフォーマンス報告を目的としています。
個別投資信託の情報につきましては、下記の情報提供資料をご参照下さい。

『投信マーケット概況』

『DC投信マーケット概況』

(<https://www.mab.jp/business/information/summary/>)

<1>パフォーマンス・サマリー

1. 「総合」

◇指数(ポイント)

当月末	前月末	前月末比	月次リターン
16,389	16,128	+262	+1.62%

◇累積リターン

3ヵ月	+3.89%
6ヵ月	+9.10%
1年	+21.09%
年初来	+12.92%

◇年初来高値/安値

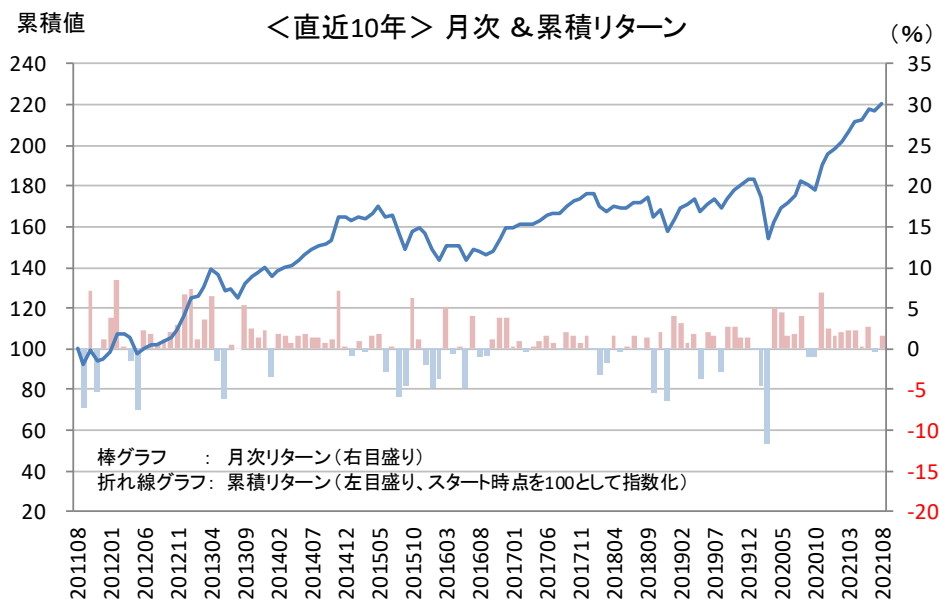
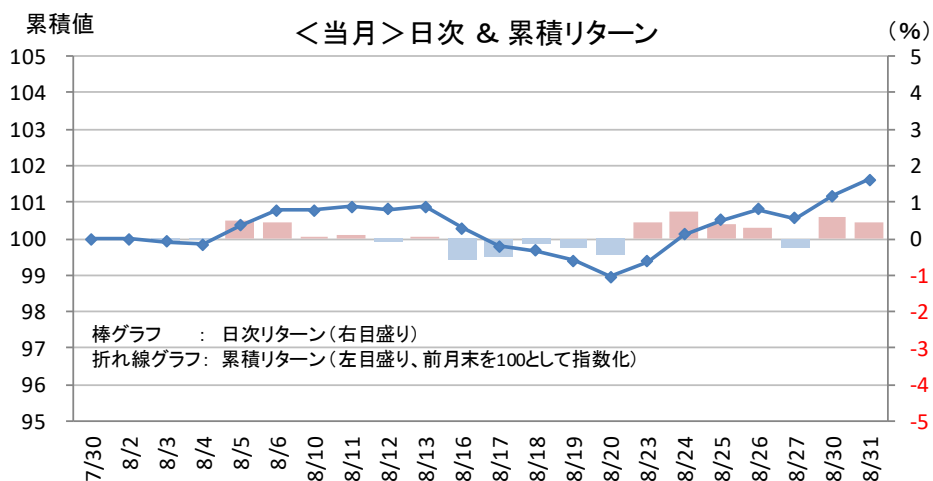
日付	指数	累積リターン
高値 2021/08/31	16,389	+12.92%
安値 2021/01/06	14,471	-0.30%

◇純資産総額

当月末	前月末	増減
82兆2,852億円	80兆5,904億円	+1兆6,948億円

◇月間設定・解約額<ネット>

(弊社推計値)	+6,539億円
---------	----------



<1>パフォーマンス・サマリー

2. 「大分類」

(1) 当月リターン

	指数 (算出開始時点)	(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)
総合		16,389	16,128	262	1.62
国内株式		20,119	19,490	628	3.22
国内債券		13,292	13,301	-9	-0.06
外国株式(先進国)		22,428	21,891	537	2.45
エマージング株式		18,620	18,369	251	1.36
外国債券(先進国)		18,960	18,986	-26	-0.14
エマージング債券		17,325	17,249	77	0.44
ハイイールド債券		23,581	23,457	124	0.53
複合資産		19,342	19,193	150	0.78
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	37,418	37,586	-168	-0.45
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	31,728	31,198	529	1.70
その他		6,724	6,647	76	1.15

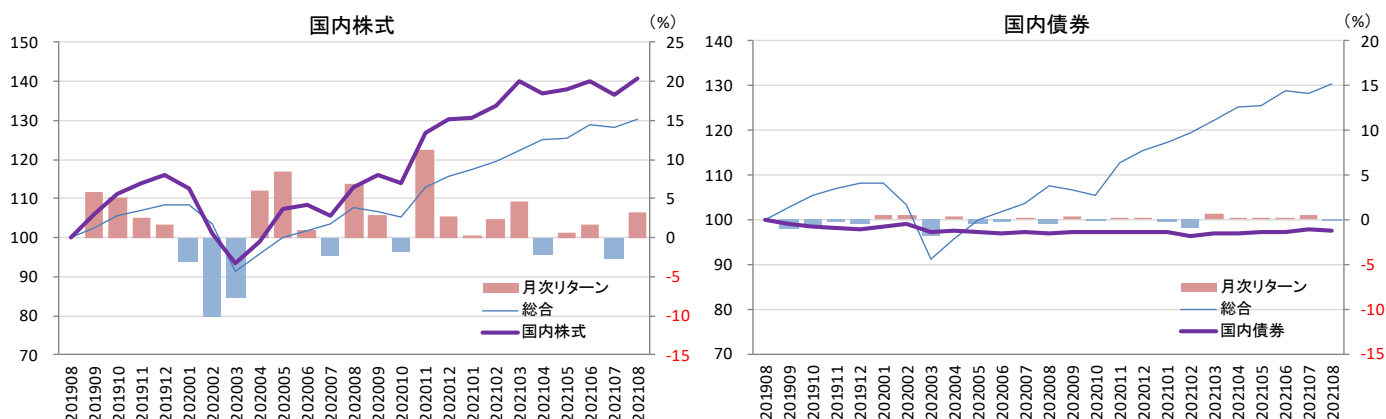
※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000
[色塗りの基準]月次リターン>総合

(2) 期間別リターン

	3カ月(%)	6カ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	3.89	9.10	21.09	12.92
国内株式	2.10	5.18	24.54	8.02
国内債券	0.60	1.49	0.81	0.40
外国株式(先進国)	7.02	13.62	31.49	19.31
エマージング株式	-0.83	2.70	27.92	13.94
外国債券(先進国)	0.11	2.50	3.97	2.38
エマージング債券	0.40	5.04	8.38	4.33
ハイイールド債券	1.45	6.05	14.58	9.77
複合資産	1.88	6.04	11.63	7.42
国内REIT	4.25	12.53	26.40	22.85
外国REIT	7.62	22.57	35.82	31.50
その他	1.89	4.49	9.59	6.09

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

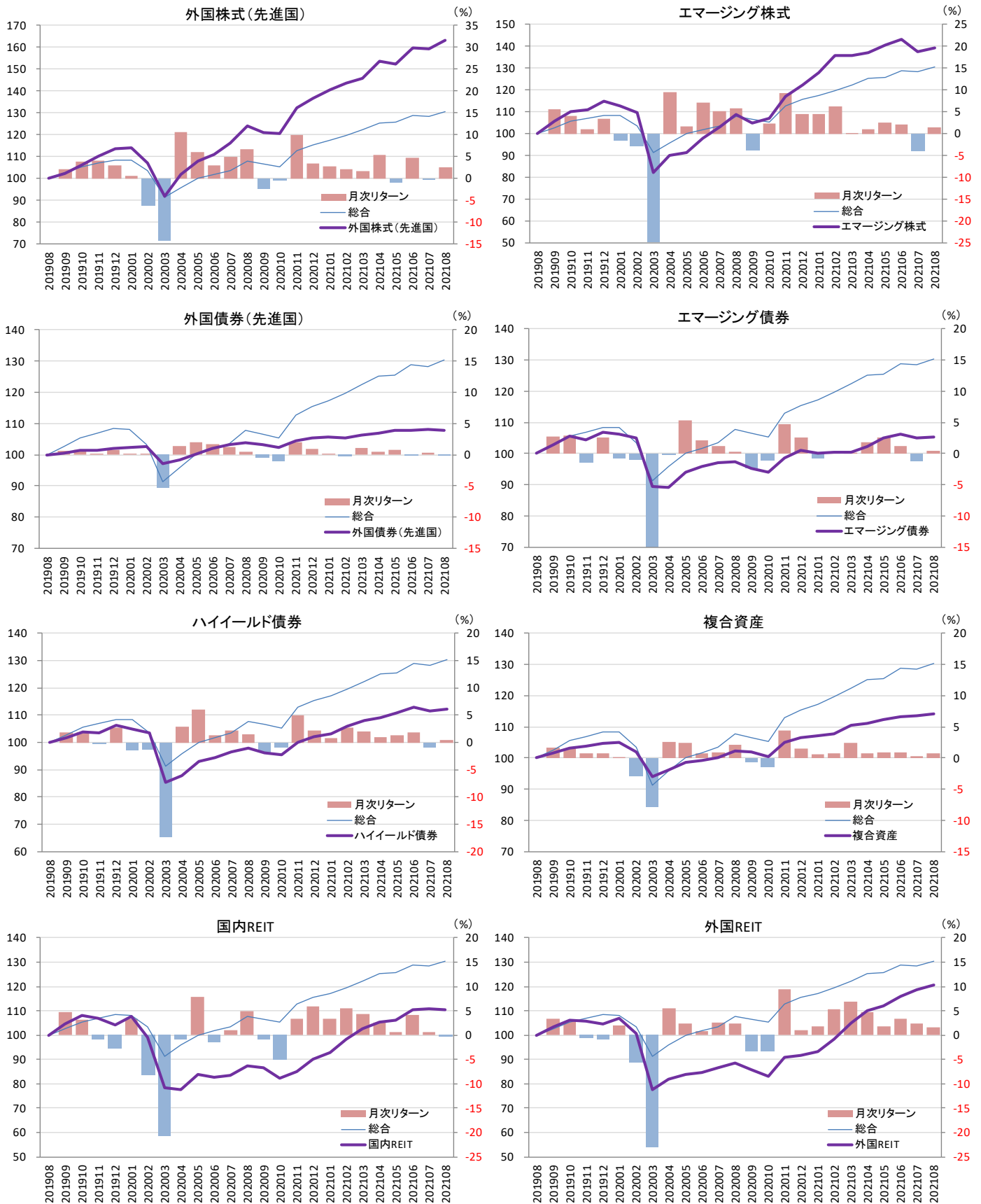
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化(折れ線グラフ、左目盛り))



<1>パフォーマンス・サマリー

2. 「大分類」

(3) リターン推移 (24ヵ月前を100として指数化(折れ線グラフ、左目盛り))



<1>パフォーマンス・サマリー

2. 「大分類」

(4) 対「総合」寄与度分析

[当月]

順位		累積 リターン(%)		構成比(%)		寄与度(%)
	総合	1.62				
1	外国株式(先進国)	2.45		38.99		0.96
2	国内株式	3.22		12.25		0.39
3	複合資産	0.78		14.96		0.12
4	外国REIT	1.70		5.78		0.10
5	エマージング株式	1.36		3.72		0.05
6	その他	1.15		2.21		0.03
7	ハイイールド債券	0.53		2.14		0.01
8	エマージング債券	0.44		1.55		0.01
9	国内債券	-0.06		4.77		-0.00
10	外国債券(先進国)	-0.14		9.95		-0.01
11	国内REIT	-0.45		3.68		-0.02
	合計			100.00		1.62

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)		構成比(%)		寄与度(%)
	総合	21.09				
1	外国株式(先進国)	31.49		34.83		10.68
2	国内株式	24.54		13.36		3.40
3	外国REIT	35.82		5.87		1.89
4	複合資産	11.63		15.70		1.87
5	エマージング株式	27.92		4.03		1.08
6	国内REIT	26.40		3.81		0.93
7	外国債券(先進国)	3.97		10.95		0.46
8	ハイイールド債券	14.58		2.48		0.36
9	その他	9.59		2.23		0.22
10	エマージング債券	8.38		1.89		0.16
11	国内債券	0.81		4.86		0.04
	合計			100.00		21.09

◆計算定義

$$\text{日次寄与度(}\%) = \text{日次リターン(}\%) \times \text{前日の純資産額構成比}$$

当月および直近1年間の寄与度は、日次寄与度について累積計算したものの
また、上表の「構成比(%)」は期間中の平均値

<1>パフォーマンス・サマリー

3. 「大分類（ヘッジ種別）」

(1) 当月リターン

指数 (算出開始時点)		(当月末)	前月末	前月末比	月次リターン(%)		
総合		16,389	16,128	262	1.62		
国内株式		20,119	19,490	628	3.22		
	ヘッジなし	20,799	20,132	667	3.31		
国内債券		13,292	13,301	-9	-0.06		
	ヘッジなし	13,372	13,383	-11	-0.08		
外国株式(先進国)		22,428	21,891	537	2.45		
	ヘッジなし	26,143	25,516	627	2.46		
	円ヘッジ	20,877	20,328	549	2.70		
エマージング株式		18,620	18,369	251	1.36		
	ヘッジなし	18,014	17,769	245	1.38		
	円ヘッジ	27,778	28,259	-481	-1.70		
外国債券(先進国)		18,960	18,986	-26	-0.14		
	ヘッジなし	19,742	19,786	-44	-0.22		
	円ヘッジ	14,908	14,908	0	0.00		
エマージング債券		17,325	17,249	77	0.44		
	ヘッジなし	18,208	18,127	80	0.44		
	円ヘッジ	20,200	20,034	166	0.83		
ハイイールド債券		23,581	23,457	124	0.53		
	ヘッジなし	27,008	26,770	239	0.89		
	円ヘッジ	17,730	17,666	64	0.36		
複合資産		19,342	19,193	150	0.78		
	ヘッジなし	19,562	19,401	161	0.83		
	円ヘッジ	15,979	15,853	126	0.80		
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	37,418	37,586	-168	-0.45		
	ヘッジなし	10,000 (2003.10.31)	37,869	38,046	-178	-0.47	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	31,728	31,198	529	1.70		
	ヘッジなし	10,000 (2003.09.30)	32,364	31,803	562	1.77	
	円ヘッジ	10,000 (2003.10.31)	20,795	20,651	144	0.70	
その他		6,724	6,647	76	1.15		

※月次リターンの色塗り：ヘッジなし、円ヘッジ両方有るカテゴリーについて、数値が大きい方算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

<1>パフォーマンス・サマリー

3. 「大分類（ヘッジ種別）」

(2) 期間別リターン

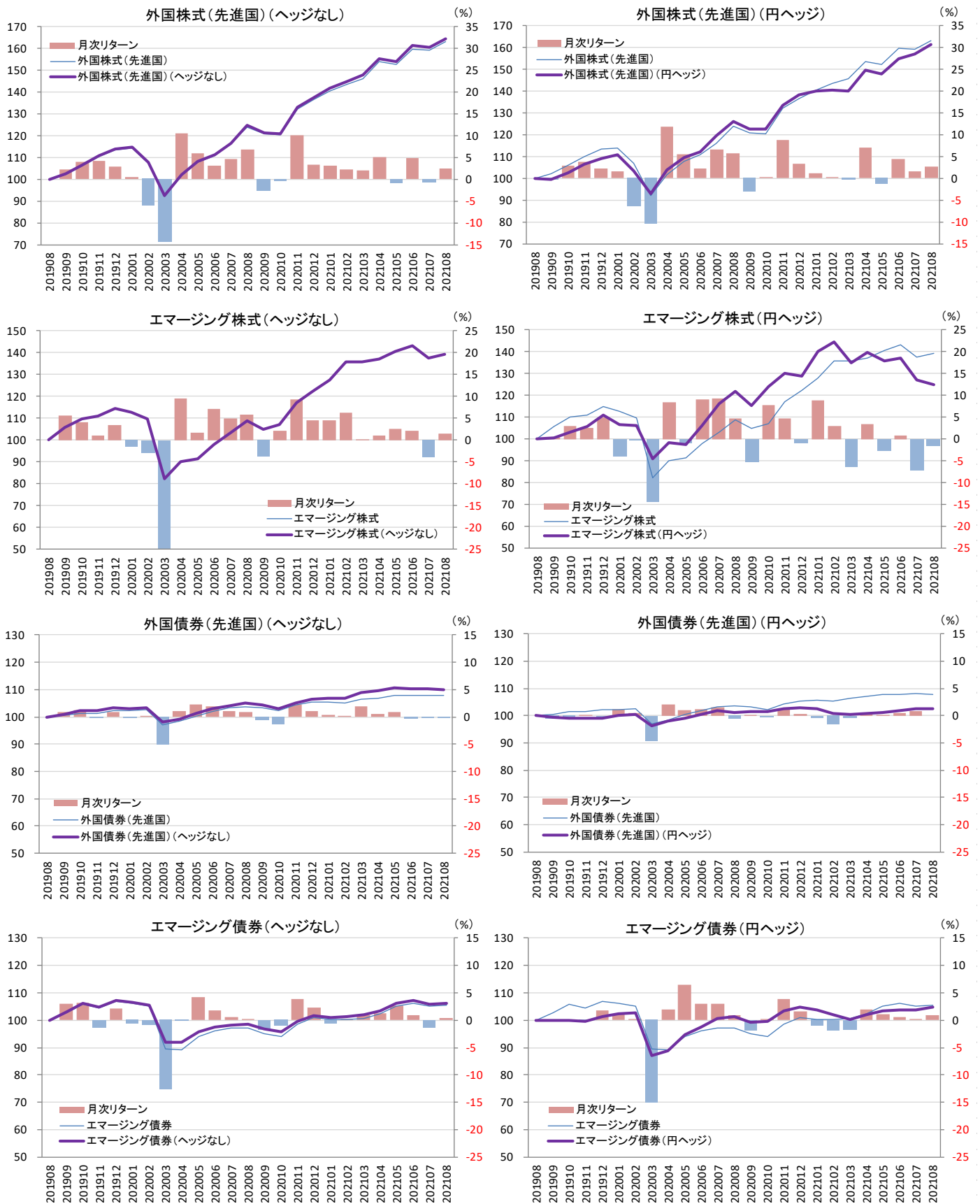
	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	3.89	9.10	21.09	12.92
国内株式	2.10	5.18	24.54	8.02
ヘッジなし	2.17	5.13	24.21	7.80
国内債券	0.60	1.49	0.81	0.40
ヘッジなし	0.52	1.44	0.78	0.43
外国株式(先進国)	7.02	13.62	31.49	19.31
ヘッジなし	6.85	13.55	32.11	19.72
円ヘッジ	9.08	15.01	27.87	16.93
エマージング株式	-0.83	2.70	27.92	13.94
ヘッジなし	-0.80	2.78	28.04	14.03
円ヘッジ	-8.18	-13.61	2.48	-3.10
外国債券(先進国)	0.11	2.50	3.97	2.38
ヘッジなし	-0.51	2.81	4.67	3.42
円ヘッジ	1.45	1.74	1.37	-0.26
エマージング債券	0.40	5.04	8.38	4.33
ヘッジなし	0.01	4.94	7.90	4.42
円ヘッジ	1.36	2.63	3.33	-0.26
ハイイールド債券	1.45	6.05	14.58	9.77
ヘッジなし	2.00	7.29	15.18	11.60
円ヘッジ	1.32	2.58	8.70	3.77
複合資産	1.88	6.04	11.63	7.42
ヘッジなし	1.79	6.39	12.50	8.05
円ヘッジ	3.34	6.31	10.57	6.85
国内REIT	4.25	12.53	26.40	22.85
ヘッジなし	4.24	12.47	26.14	22.64
外国REIT	7.62	22.57	35.82	31.50
ヘッジなし	7.68	22.91	36.29	32.10
円ヘッジ	7.46	17.66	27.98	22.67
その他	1.89	4.49	9.59	6.09

※期間別リターンの色塗り：ヘッジなし、円ヘッジ両方有るカテゴリーについて、数値が大きい方

<1>パフォーマンス・サマリー

3. 「大分類（ヘッジ種別）」

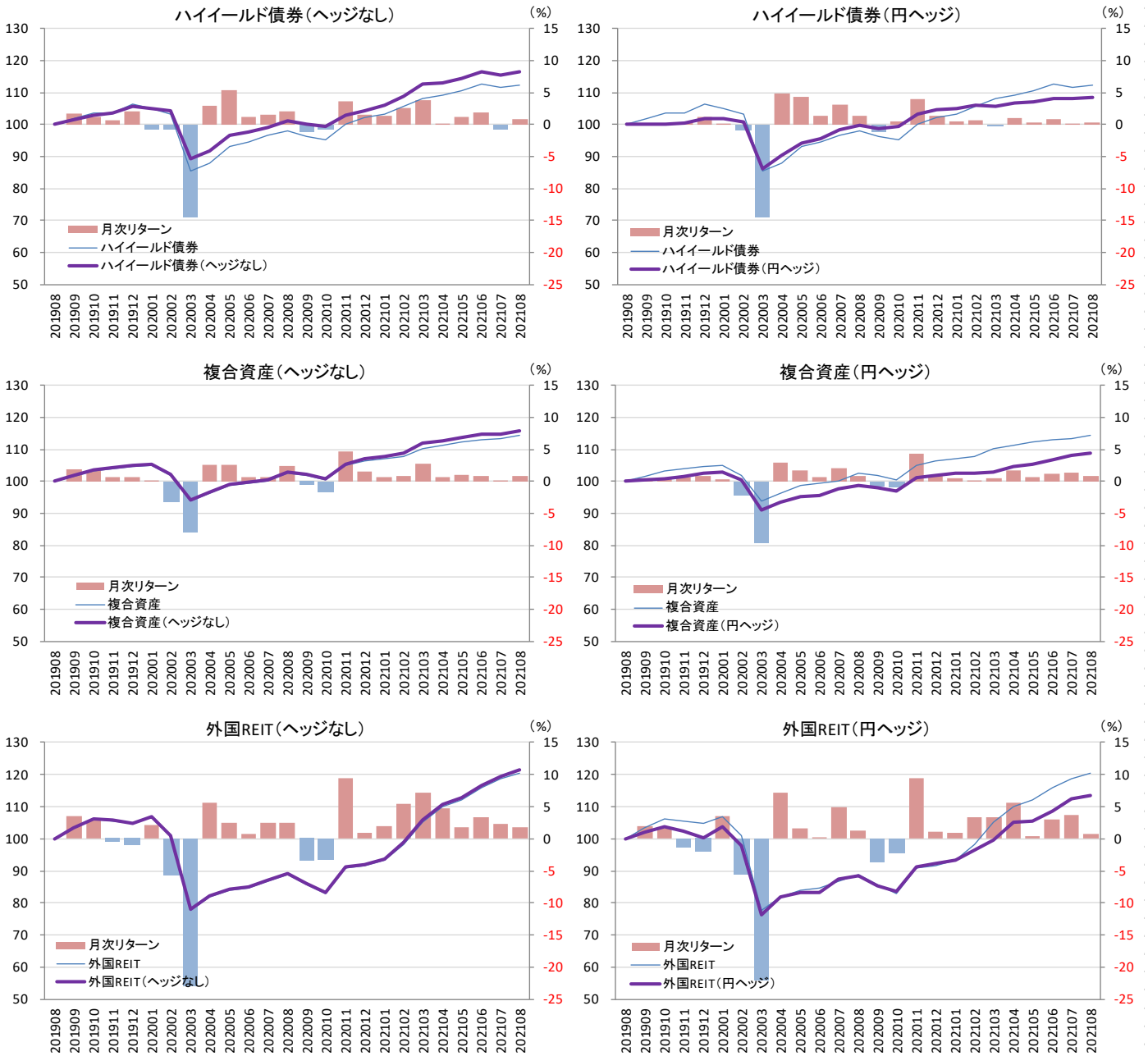
(3) リターン推移（24ヵ月前を100として指数化（折れ線グラフ、左目盛り））



<1>パフォーマンス・サマリー

3. 「大分類（ヘッジ種別）」

(3) リターン推移（24ヵ月前を100として指数化（折れ線グラフ、左目盛り））



<1>パフォーマンス・サマリー

3. 「大分類（ヘッジ種別）」

(4) 対「総合」寄与度分析

[当月]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	1.62		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	2.46	33.94	0.84
2	国内株式(ヘッジなし)	3.31	11.84	0.39
3	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	2.70	4.13	0.11
4	複合資産(ヘッジなし)	0.83	12.13	0.10
5	外国REIT(ヘッジなし)	1.77	5.44	0.10
6	エマージング株式(ヘッジなし)	1.38	3.70	0.05
7	その他(ヘッジなし)	1.19	1.31	0.02
8	ハイイールド債券(ヘッジなし)	0.89	1.38	0.01
9	その他(円ヘッジ)	1.72	0.55	0.01
10	複合資産(円ヘッジ)	0.80	1.01	0.01
11	エマージング債券(ヘッジなし)	0.44	1.18	0.00
12	外国REIT(円ヘッジ)	0.70	0.21	0.00
13	エマージング債券(円ヘッジ)	0.83	0.11	0.00
14	ハイイールド債券(円ヘッジ)	0.36	0.23	0.00
15	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	0.00	2.53	0.00
16	国内債券(円ヘッジ)	0.00	0.95	0.00
17	エマージング株式(円ヘッジ)	-1.70	0.01	-0.00
18	国内債券(ヘッジなし)	-0.08	3.82	-0.00
19	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	-0.22	6.45	-0.01
20	国内REIT(ヘッジなし)	-0.47	3.57	-0.02
	合計		94.50	1.60

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	21.09		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	32.11	30.21	9.41
2	国内株式(ヘッジなし)	24.21	12.88	3.25
3	外国REIT(ヘッジなし)	36.29	5.51	1.80
4	複合資産(ヘッジなし)	12.50	12.88	1.66
5	エマージング株式(ヘッジなし)	28.04	4.01	1.09
6	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	27.87	3.67	0.99
7	国内REIT(ヘッジなし)	26.14	3.67	0.90
8	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	4.67	7.25	0.36
9	ハイイールド債券(ヘッジなし)	15.18	1.58	0.24
10	複合資産(円ヘッジ)	10.57	1.18	0.12
11	エマージング債券(ヘッジなし)	7.90	1.44	0.11
12	その他(ヘッジなし)	7.10	1.37	0.11
13	その他(円ヘッジ)	11.42	0.55	0.06
14	外国REIT(円ヘッジ)	27.98	0.22	0.06
15	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	1.37	2.65	0.04
16	国内債券(ヘッジなし)	0.78	4.02	0.03
17	ハイイールド債券(円ヘッジ)	8.70	0.28	0.03
18	国内債券(円ヘッジ)	0.91	0.84	0.01
19	エマージング債券(円ヘッジ)	3.33	0.13	0.00
20	エマージング株式(円ヘッジ)	2.48	0.02	0.00
	合計		94.50	20.26

◆計算定義

日次寄与度(%) = 日次リターン(%) × 前日の純資産額構成比

当月および直近1年間の寄与度は、日次寄与度について累積計算したものの
また、上表の「構成比(%)」は期間中の平均値

<2>リスク・サマリー

1. 「総合」 & 「大分類」

(1) 期間別リスク・リターン

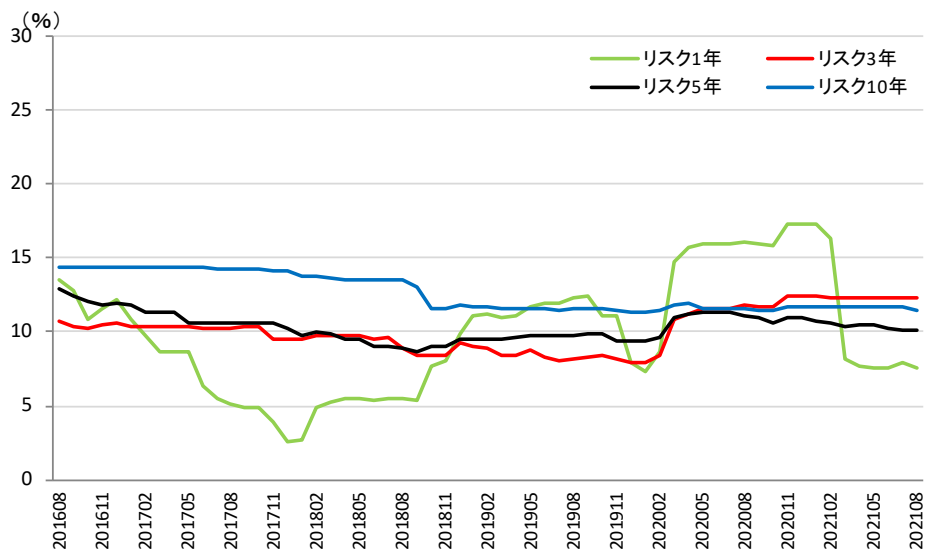
	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	28.29	49.38	120.47	12.31	10.06	11.51	0.71	0.84	0.71
国内株式	22.44	72.83	215.17	18.28	15.07	16.98	0.38	0.77	0.72
国内債券	2.04	0.52	12.09	1.90	1.62	1.62	0.38	0.09	0.70
外国株式(先進国)	55.29	106.99	229.46	18.90	15.39	16.21	0.84	1.02	0.78
エマージング株式	28.59	61.32	111.75	21.60	17.57	18.89	0.41	0.57	0.41
外国債券(先進国)	10.11	14.84	42.24	4.42	4.25 ↓	7.36	0.75	0.67	0.49
エマージング債券	12.92	13.91	27.62	11.89 ↓	10.72	13.12	0.35	0.25	0.19
ハイイールド債券	14.04	26.78	83.01	13.13	11.06	12.49	0.34	0.44	0.50
複合資産	14.94	28.95	94.16	7.68	6.43 ↓	8.81	0.62	0.82	0.78
国内REIT	34.80	39.42	199.81	17.08	13.90	17.07	0.62	0.50	0.68
外国REIT	28.15	39.50	190.81	18.83	16.22	16.37	0.46	0.43	0.69

※[色塗りの基準] 累積リターン>総合、リスク<総合、シャープ・レシオ>=0.5

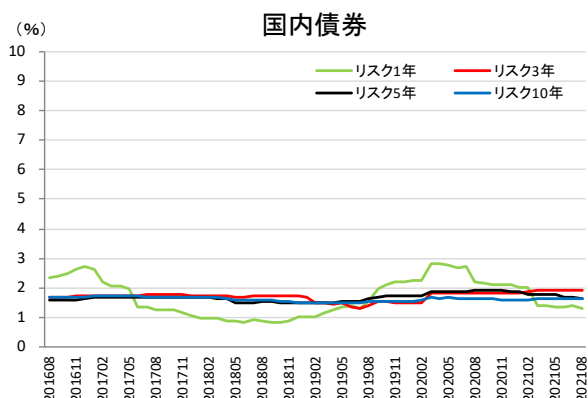
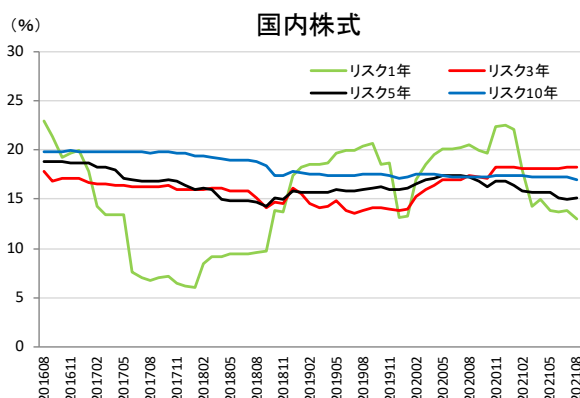
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑:上昇傾向、↓:低下傾向

(2) リスク推移(直近5年間、月次リターン・ベース)

① 「総合」



② 「大分類」

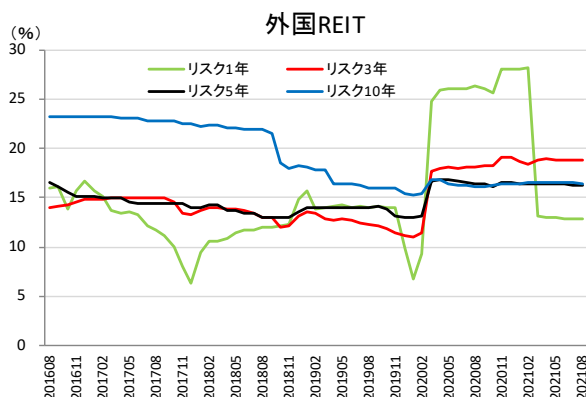
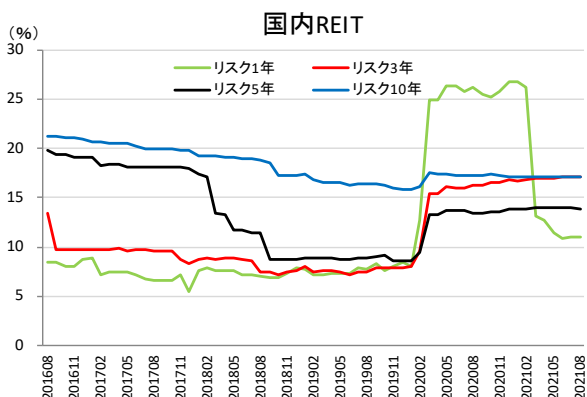
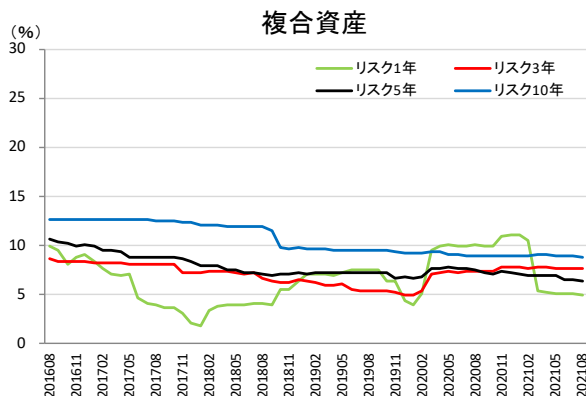
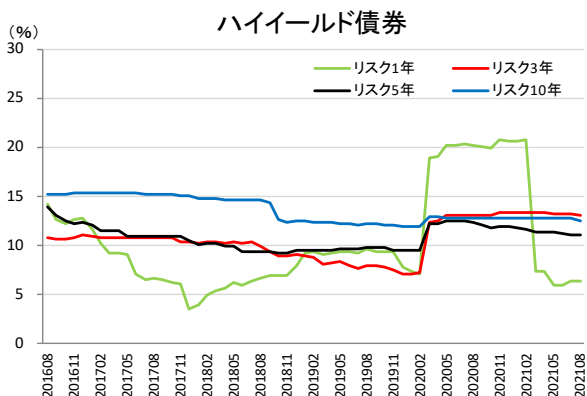
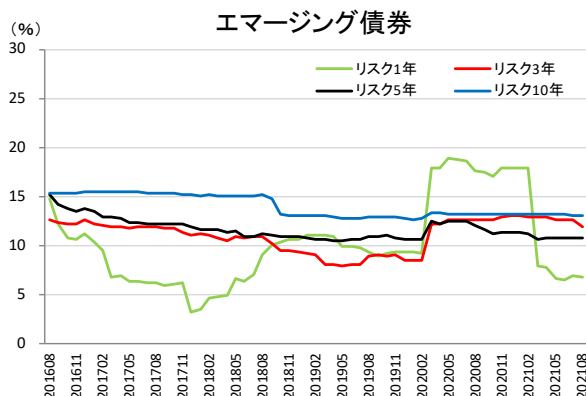
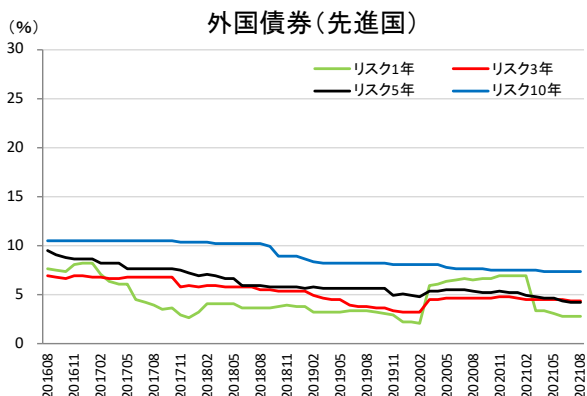
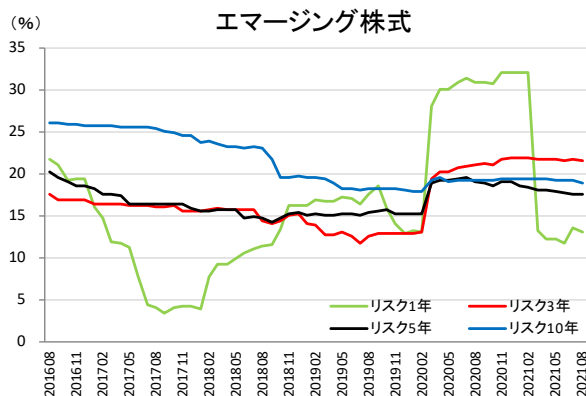
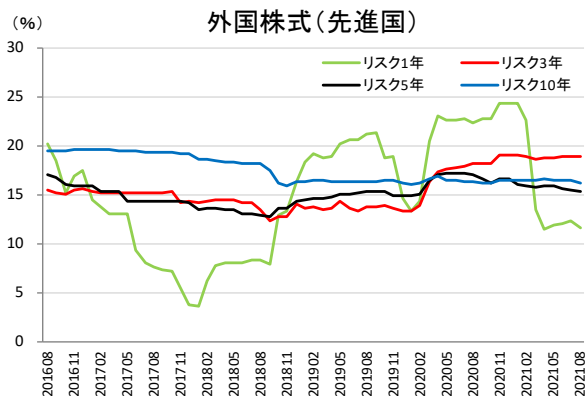


<2> リスク・サマリー

1. 「総合」 & 「大分類」

(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)

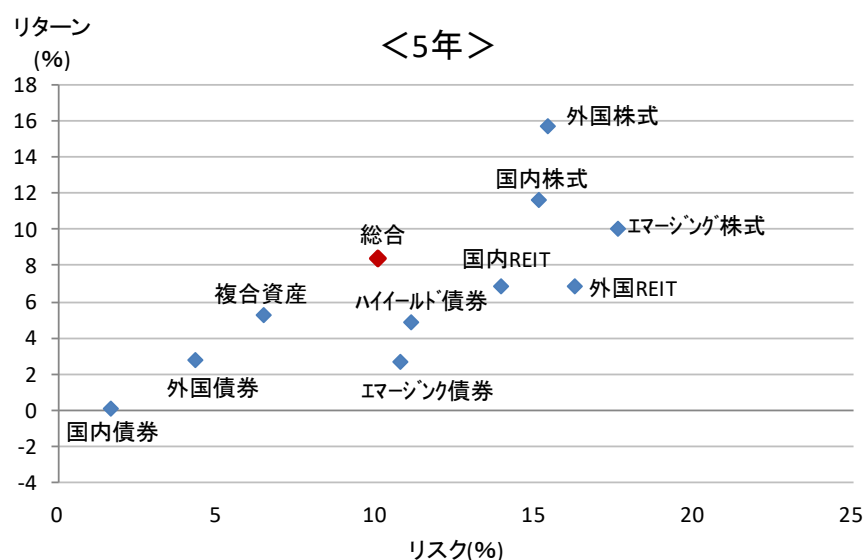
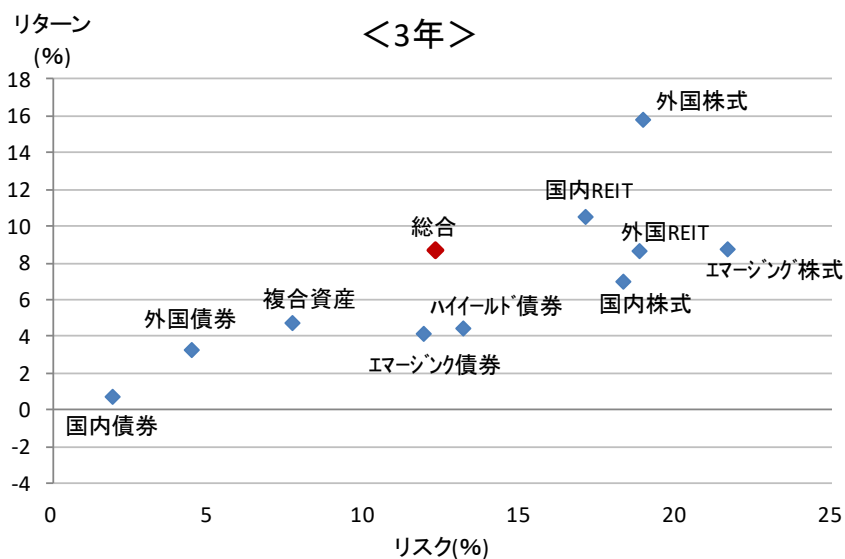
② 「大分類」



<2> リスク・サマリー

1. 「総合」 & 「大分類」

(3) リスク・リターン マップ (3年、5年)



	リターン(%)		リスク(%)	
	3年	5年	3年	5年
総合	8.66	8.36	12.31	10.06
国内株式	6.98	11.56	18.28	15.07
国内債券	0.68	0.10	1.90	1.62
外国株式(先進国)	15.80	15.66	18.90	15.39
エマーシング株式	8.74	10.04	21.60	17.57
外国債券(先進国)	3.26	2.81	4.42	4.25
エマーシング債券	4.13	2.64	11.89	10.72
ハイールド債券	4.48	4.86	13.13	11.06
複合資産	4.75	5.22	7.68	6.43
国内REIT	10.47	6.87	17.08	13.90
外国REIT	8.62	6.88	18.83	16.22

※リスク、リターンは年率換算値

<2> リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

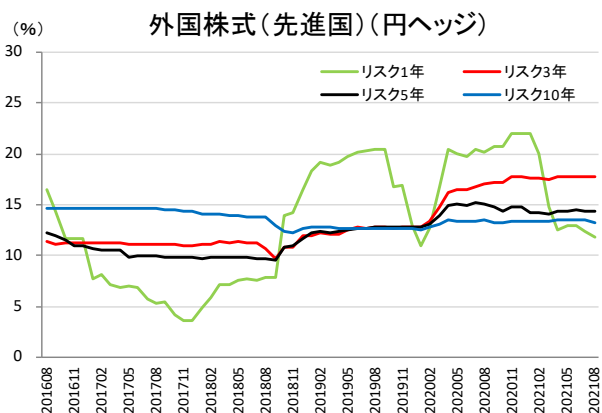
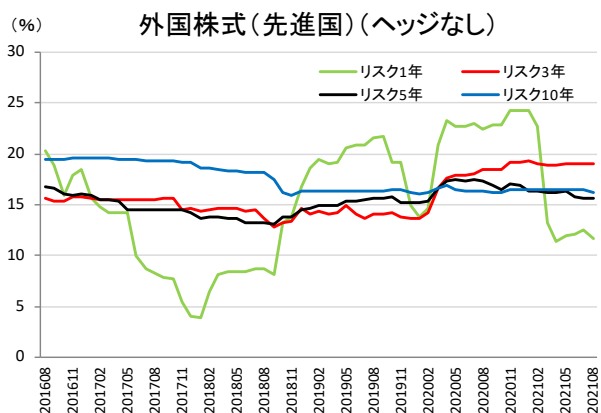
(1) 期間別リスク・リターン

	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	28.29	49.38	120.47	12.31	10.06	11.51	0.71	0.84	0.71
国内株式	22.44	72.83	215.17	18.28	15.07	16.98	0.38	0.77	0.72
ヘッジなし	22.77	72.88	225.65	18.15	14.86	16.39	0.39	0.78	0.76
国内債券	2.04	0.52	12.09	1.90	1.62	1.62	0.38	0.09	0.70
ヘッジなし	1.78	0.31	11.78	1.84	1.57	1.61	0.34	0.07	0.69
外国株式(先進国)	55.29	106.99	229.46	18.90	15.39	16.21	0.84	1.02	0.78
ヘッジなし	55.82	110.05	256.64	19.07	15.60	16.14	0.84	1.03	0.84
円ヘッジ	57.65	97.94	177.02	17.79	14.32	13.27	0.92	1.03	0.81
エマージング株式	28.59	61.32	111.75	21.60	17.57	18.89	0.41	0.57	0.41
ヘッジなし	28.65	61.53	112.43	21.62	17.58	18.92	0.41	0.58	0.41
円ヘッジ	15.23	33.46	69.71	21.99	18.95	18.52	0.22	0.32	0.29
外国債券(先進国)	10.11	14.84	42.24	4.42	4.25 ↓	7.36	0.75	0.67	0.49
ヘッジなし	10.70	17.50	44.44	4.86	5.03 ↓	8.04	0.72	0.66	0.47
円ヘッジ	8.77	5.66	23.28	3.88	3.32	3.20	0.74	0.35	0.66
エマージング債券	12.92	13.91	27.62	11.89 ↓	10.72	13.12	0.35	0.25	0.19
ヘッジなし	12.63	17.58	29.59	10.41 ↓	9.67	12.50	0.39	0.35	0.21
円ヘッジ	11.88	7.72	29.91	10.96	8.95	7.91	0.35	0.17	0.33
ハイイールド債券	14.04	26.78	83.01	13.13	11.06	12.49	0.34	0.44	0.50
ヘッジなし	16.53	37.02	138.25	11.40	10.06	10.59	0.46	0.65	0.86
円ヘッジ	10.81	15.30	51.63	10.46	8.20	7.12	0.34	0.36	0.60
複合資産	14.94	28.95	94.16	7.68	6.43 ↓	8.81	0.62	0.82	0.78
ヘッジなし	16.07	31.49	103.57	8.00	6.74 ↓	8.88	0.64	0.84	0.83
円ヘッジ	10.40	15.59	46.15	7.89	6.35	6.19	0.43	0.47	0.62
国内REIT	34.80	39.42	199.81	17.08	13.90	17.07	0.62	0.50	0.68
ヘッジなし	35.37	39.15	203.58	16.89	13.78	16.64	0.63	0.50	0.71
外国REIT	28.15	39.50	190.81	18.83	16.22	16.37	0.46	0.43	0.69
ヘッジなし	28.98	40.93	198.78	18.80	16.28	16.38	0.47	0.44	0.71
円ヘッジ	22.58	19.92	80.36	18.13	15.21	13.77	0.39	0.25	0.44

※[色塗りの基準] 累積リターン> 総合、リスク<総合、シャープ・レシオ>=0.5

[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑: 上昇傾向、↓: 低下傾向

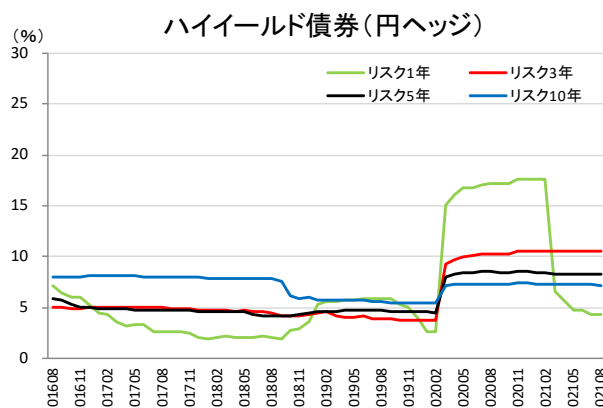
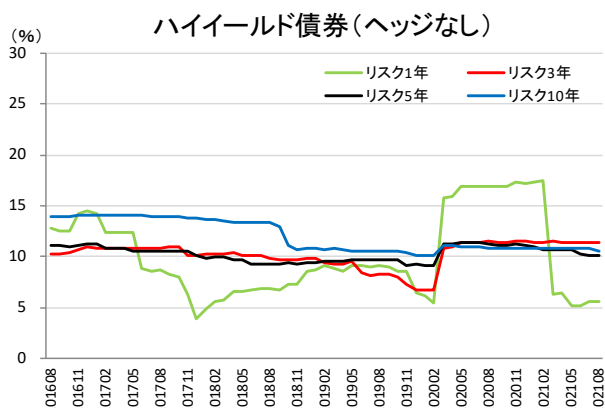
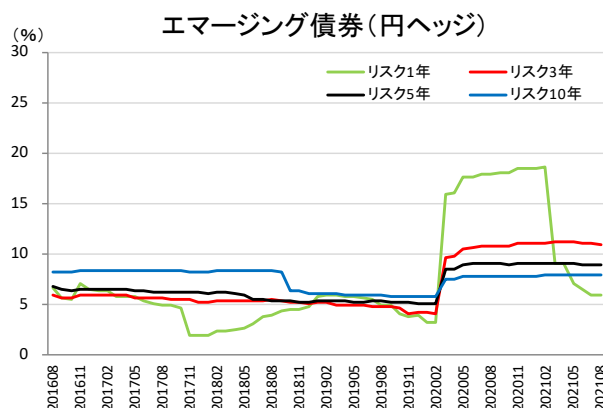
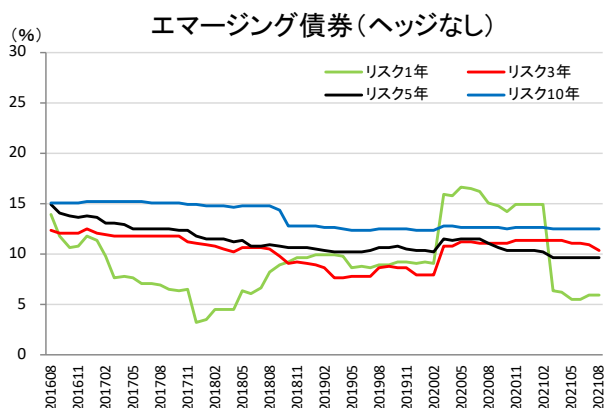
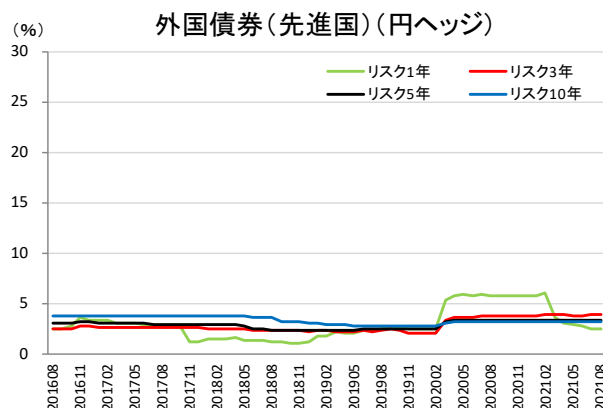
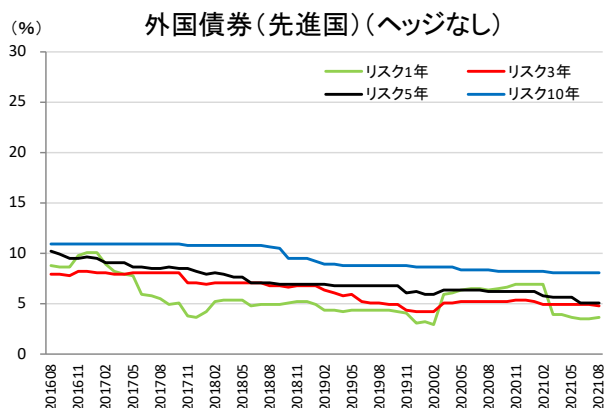
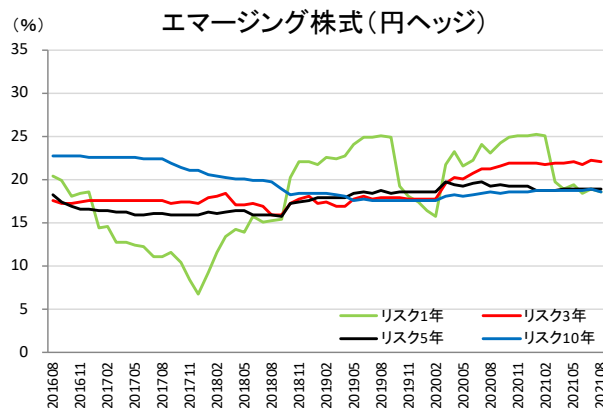
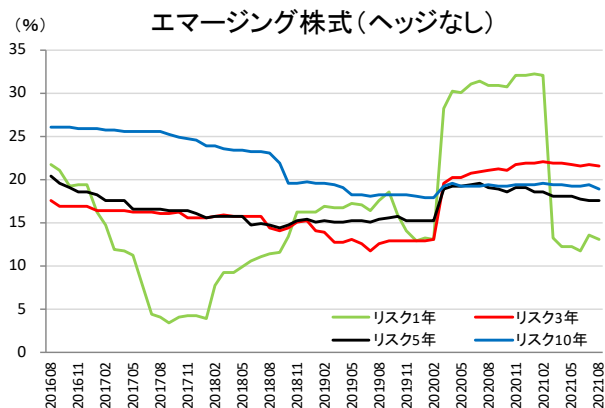
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)



<2> リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

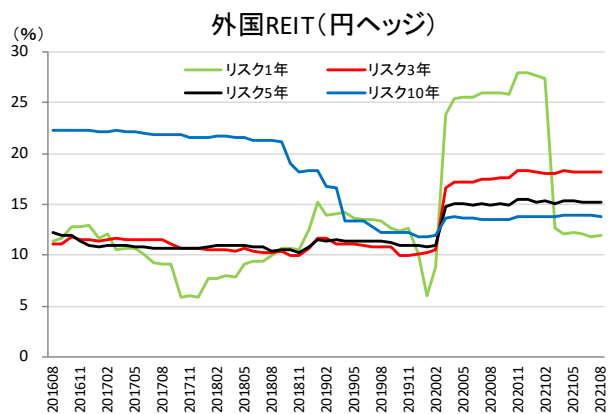
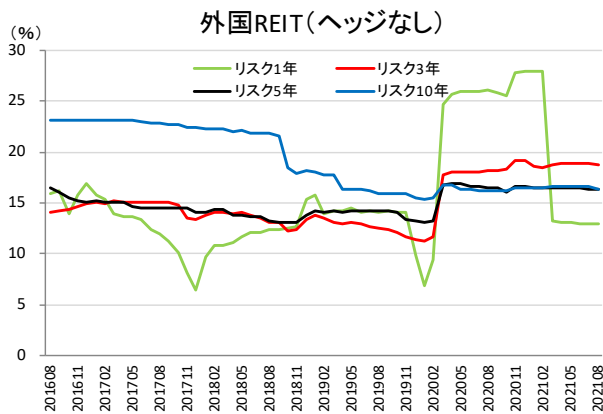
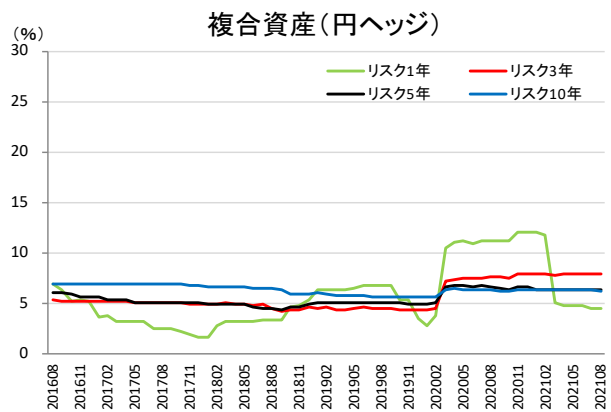
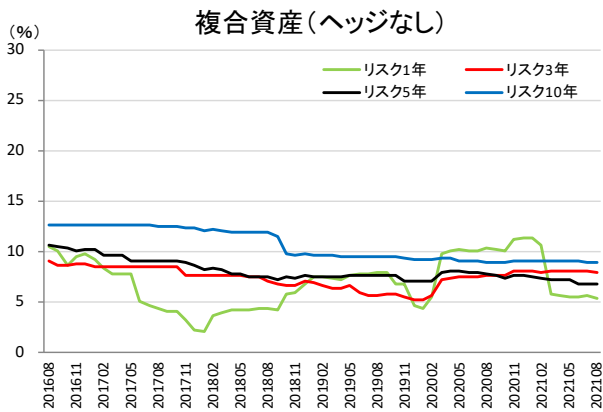
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



<2> リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

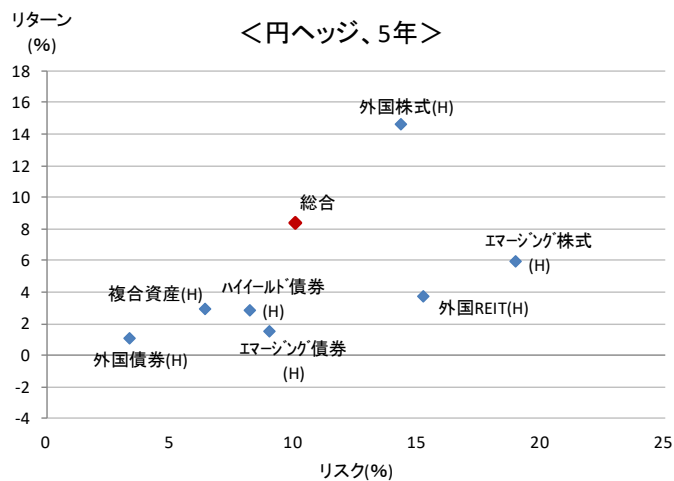
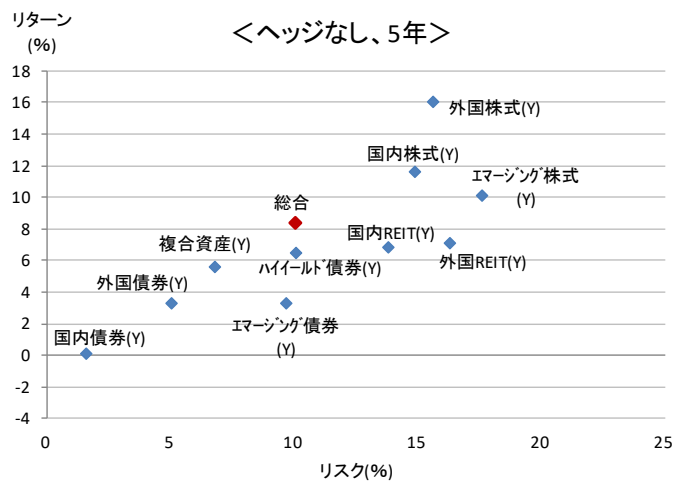
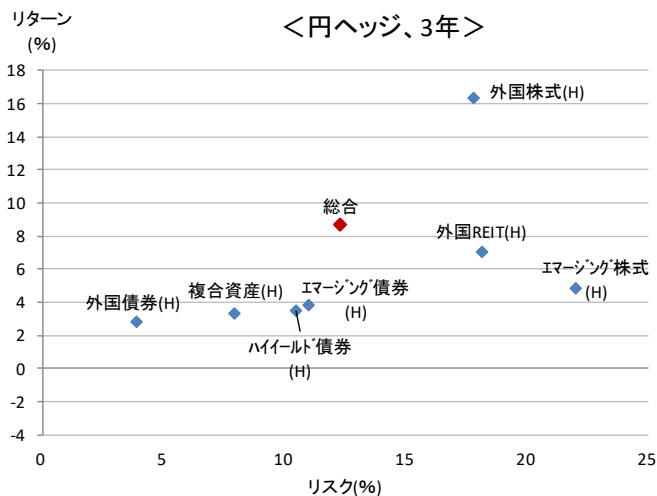
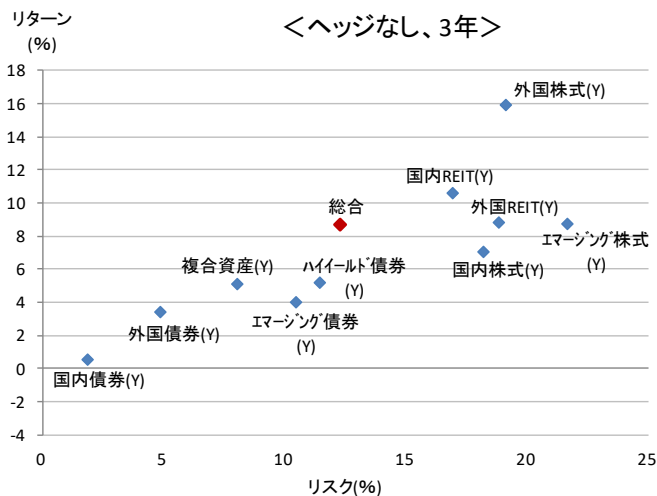
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



<2> リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

(3) リスク・リターン マップ（3年、5年）



<ヘッジなし>	リターン(%)		リスク(%)	
	3年	5年	3年	5年
総合	8.66	8.36	12.31	10.06
国内株式(Y)	7.08	11.57	18.15	14.86
国内債券(Y)	0.59	0.06	1.84	1.57
外国株式(先進国)(Y)	15.93	16.00	19.07	15.60
エマーシング株式(Y)	8.76	10.07	21.62	17.58
外国債券(先進国)(Y)	3.45	3.28	4.86	5.03
エマーシング債券(Y)	4.05	3.29	10.41	9.67
ハイイールド債券(Y)	5.23	6.50	11.40	10.06
複合資産(Y)	5.09	5.63	8.00	6.74
国内REIT(Y)	10.62	6.83	16.89	13.78
外国REIT(Y)	8.85	7.10	18.80	16.28

<円ヘッジ>	リターン(%)		リスク(%)	
	3年	5年	3年	5年
総合	8.66	8.36	12.31	10.06
外国株式(先進国)(H)	16.38	14.63	17.79	14.32
エマーシング株式(H)	4.84	5.94	21.99	18.95
外国債券(先進国)(H)	2.84	1.11	3.88	3.32
エマーシング債券(H)	3.81	1.50	10.96	8.95
ハイイールド債券(H)	3.48	2.89	10.46	8.20
複合資産(H)	3.35	2.94	7.89	6.35
外国REIT(H)	7.02	3.70	18.13	15.21

※リスク、リターンは年率換算値

<3> 設定・解約額 [ネット金額]

1. 「総合」 および 「大分類」

(単位:億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	6,539	25,117	48,063	64,033
国内株式	163	1,663	1,602	-8,938
国内債券	528	2,152	4,384	4,415
外国株式(先進国)	5,273	18,429	40,071	72,355
エマージング株式	-235	-579	-1,167	-1,876
外国債券(先進国)	233	1,928	1,400	-693
エマージング債券	-130	-515	-1,208	-2,667
ハイイールド債券	-113	-413	-1,061	-2,538
複合資産	867	2,673	4,391	3,480
国内REIT	-184	-611	-816	191
外国REIT	-157	-499	-1,385	-2,253
その他	292	888	1,851	2,558

2. 「大分類 (ヘッジ種別)」

(単位:億円)	当月	3ヵ月	6ヵ月	1年
総合	6,539	25,117	48,063	64,033
国内株式	163	1,663	1,602	-8,938
ヘッジなし	206	1,819	1,996	-7,914
国内債券	528	2,152	4,384	4,415
ヘッジなし	152	958	2,341	1,938
外国株式(先進国)	5,273	18,429	40,071	72,355
ヘッジなし	4,759	16,807	36,086	62,398
円ヘッジ	520	1,736	4,094	9,796
エマージング株式	-235	-579	-1,167	-1,876
ヘッジなし	-232	-572	-1,159	-1,876
円ヘッジ	-2	-4	-2	10
外国債券(先進国)	233	1,928	1,400	-693
ヘッジなし	22	-99	-384	-2,639
円ヘッジ	105	1,634	1,309	2,073
エマージング債券	-130	-515	-1,208	-2,667
ヘッジなし	-99	-390	-935	-2,002
円ヘッジ	-4	-23	-50	-145
ハイイールド債券	-113	-413	-1,061	-2,538
ヘッジなし	-79	-274	-634	-1,328
円ヘッジ	-4	-28	-99	-302
複合資産	867	2,673	4,391	3,480
ヘッジなし	564	1,870	2,451	-318
円ヘッジ	-76	-331	-707	-1,455
国内REIT	-184	-611	-816	191
ヘッジなし	-151	-523	-615	498
外国REIT	-157	-499	-1,385	-2,253
ヘッジなし	-135	-449	-1,285	-1,882
円ヘッジ	-14	-30	-56	-190
その他	292	888	1,851	2,558

< 4 > 純資産額、ファンド本数

1. 「総合」および「大分類」

	純資産額 (億円)	構成比(%)		本数	構成比(%)
総合	822,852	100.0		5,408	100.0
国内株式	101,516	12.3		865	16.0
国内債券	38,739	4.7		137	2.5
外国株式(先進国)	324,155	39.4		1,095	20.2
エマージング株式	30,283	3.7		333	6.2
外国債券(先進国)	80,670	9.8		797	14.7
エマージング債券	12,602	1.5		277	5.1
ハイイールド債券	17,299	2.1		275	5.1
複合資産	122,251	14.9		992	18.3
国内REIT	29,833	3.6		131	2.4
外国REIT	47,282	5.7		287	5.3
その他	18,221	2.2		219	4.0

2. 「大分類 (ヘッジ種別)」

	純資産額 (億円)	構成比(%)		本数	構成比(%)
総合	822,852	100.0		5,408	100.0
国内株式	101,516	12.3		865	16.0
ヘッジなし	98,212	11.9		768	14.2
国内債券	38,739	4.7		137	2.5
ヘッジなし	30,866	3.8		128	2.4
外国株式(先進国)	324,155	39.4		1,095	20.2
ヘッジなし	282,330	34.3		804	14.9
円ヘッジ	34,344	4.2		225	4.2
エマージング株式	30,283	3.7		333	6.2
ヘッジなし	30,150	3.7		316	5.8
円ヘッジ	104	0.0		10	0.2
外国債券(先進国)	80,670	9.8		797	14.7
ヘッジなし	52,199	6.3		438	8.1
円ヘッジ	20,551	2.5		280	5.2
エマージング債券	12,602	1.5		277	5.1
ヘッジなし	9,579	1.2		167	3.1
円ヘッジ	857	0.1		30	0.6
ハイイールド債券	17,299	2.1		275	5.1
ヘッジなし	11,206	1.4		83	1.5
円ヘッジ	1,862	0.2		80	1.5
複合資産	122,251	14.9		992	18.3
ヘッジなし	99,104	12.0		821	15.2
円ヘッジ	8,160	1.0		91	1.7
国内REIT	29,833	3.6		131	2.4
ヘッジなし	28,882	3.5		112	2.1
外国REIT	47,282	5.7		287	5.3
ヘッジなし	44,536	5.4		192	3.6
円ヘッジ	1,746	0.2		66	1.2
その他	18,221	2.2		219	4.0

< 5 > 属性、指標等（平均値）

1. 「総合」および「大分類」

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	13,702	9.2	4.13	3.84	1.269
国内株式	17,708	12.4	1.47	1.29	1.099
国内債券	10,983	11.2	0.23	0.23	0.386
外国株式(先進国)	16,618	6.9	5.50	5.18	1.490
エマーゼン株式	14,334	9.7	3.72	3.45	1.720
外国債券(先進国)	10,207	9.5	1.95	1.94	1.037
エマーゼン債券	8,832	9.9	5.40	5.36	1.552
ハイイールド債券	9,215	10.2	6.78	6.45	1.683
複合資産	13,264	8.7	1.50	1.42	1.019
国内REIT	15,230	9.0	9.75	9.10	0.938
外国REIT	12,340	8.2	11.11	9.36	1.520

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	13,702	9.2	4.13	3.84	1.269
国内株式	17,708	12.4	1.47	1.29	1.099
ヘッジなし	18,164	12.9	1.26	1.11	1.080
国内債券	10,983	11.2	0.23	0.23	0.386
ヘッジなし	11,032	11.6	0.27	0.27	0.316
外国株式(先進国)	16,618	6.9	5.50	5.18	1.490
ヘッジなし	17,258	6.9	5.14	4.83	1.458
円ヘッジ	15,698	6.7	8.56	8.10	1.681
エマーゼン株式	14,334	9.7	3.72	3.45	1.720
ヘッジなし	14,470	9.8	3.72	3.44	1.720
円ヘッジ	13,169	9.7	5.70	5.70	1.769
外国債券(先進国)	10,207	9.5	1.95	1.94	1.037
ヘッジなし	10,603	11.1	2.27	2.26	1.016
円ヘッジ	10,059	7.5	1.24	1.23	0.951
エマーゼン債券	8,832	9.9	5.40	5.36	1.552
ヘッジなし	8,757	9.5	5.36	5.37	1.497
円ヘッジ	9,347	10.4	3.30	3.33	1.684
ハイイールド債券	9,215	10.2	6.78	6.45	1.683
ヘッジなし	10,090	10.8	6.90	6.48	1.679
円ヘッジ	9,561	9.8	3.51	3.40	1.653
複合資産	13,264	8.7	1.50	1.42	1.019
ヘッジなし	13,550	9.2	1.59	1.51	0.910
円ヘッジ	11,916	6.5	1.21	1.11	1.474
国内REIT	15,230	9.0	9.75	9.10	0.938
ヘッジなし	15,577	9.1	9.77	9.15	0.923
外国REIT	12,340	8.2	11.11	9.36	1.520
ヘッジなし	12,381	8.2	11.28	9.47	1.518
円ヘッジ	11,784	7.0	4.21	3.51	1.398

(注1) 平均値

基準価額(円)と設定来年数(年)は単純平均値

実績分配金利回り(%)、予想分配金利回り(%)、運用管理費用(%)は純資産額加重平均値

(注2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注4) 分配金利回り(%)

実績分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数÷実績決算回数))÷1年前もしくは設定日の基準価額×100

予想分配金利回り(%)=(実績分配金×(決算回数÷実績決算回数))÷当月末の基準価額×100

- 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。
- 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 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

システムグループ 川真田 隆志

電話番号 : 03-6721-1013

Eメール : 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 助言・代理業、投資運用業

加入協会名 一般社団法人 日本投資顧問業協会