

投信指数 MAB-FPI

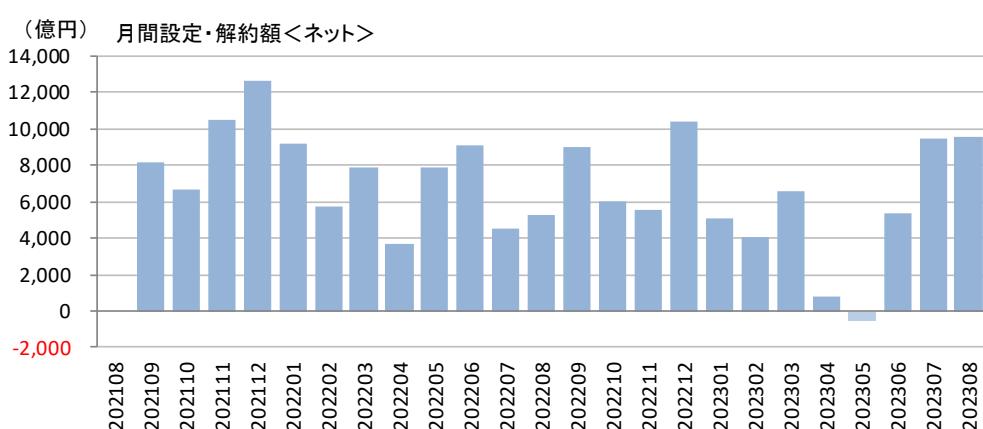
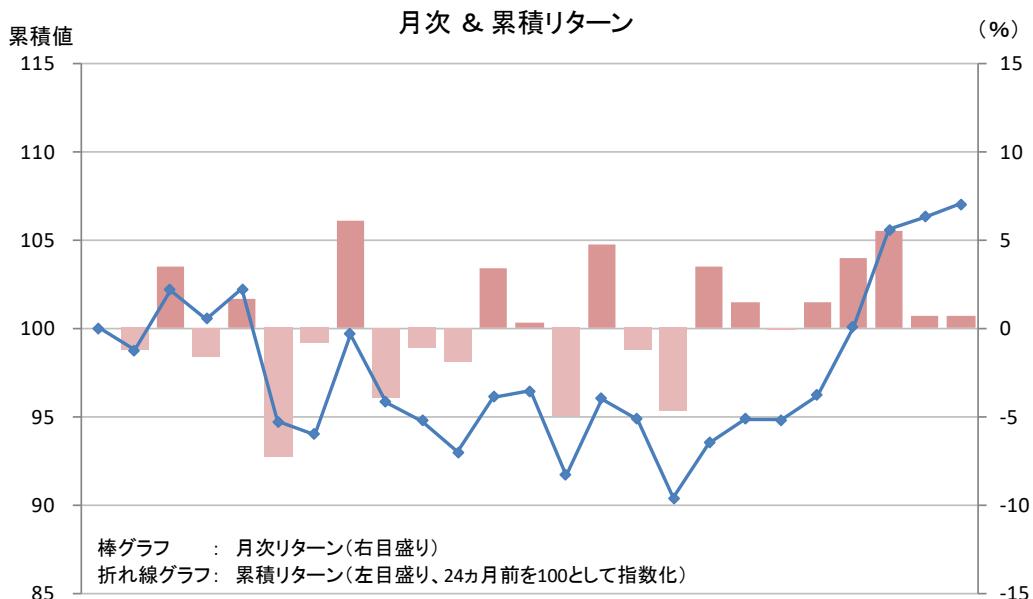
パフォーマンス・サマリー

- Vol.1 ファンド大分類 編 -

2023年8月

「総合」 +0.69 %

(前月 +0.68 %)



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

2023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0.69%上昇し17,545ポイント。

純資産総額は前月末比1兆4,142億円増加し100兆8,193億円。100兆円台乗せは、算出来初。

「大分類別」では、ハイイールド債券+3.11%、エマージング債券+2.00%、国内REIT+1.40%、エマージング株式+1.28%、外国REIT+1.22%、外国債券(先進国)+1.18%など、9つのカテゴリーが上昇した。

一方、その他-0.92%、国内債券-0.83%の2つのカテゴリーが下落した。

「総合」への寄与度では、外国株式(先進国)+0.33%、外国債券(先進国)+0.10%、複合資産+0.08%などがプラス寄与上位となった。

<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、国内株式、外国株式(先進国)、エマージング株式、および国内REITの3年リスクに低下傾向が見られ、5年は全力カテゴリーで概ね横ばい。

<3>設定・解約額[ネット金額] (弊社推計値)

「総合」は+9,517億円と、前月と同程度の大幅な流入超となった。

「大分類別」では、全力カテゴリーで流入超となった。

このうち、外国株式(先進国)+3,723億円、国内株式+1,950億円、エマージング株式+1,140億円、外国債券(先進国)+1,056億円と、4つのカテゴリーで1,000億円を超える大幅な流入超となった。

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
17,545	17,425	+120	+0.69 %

◇累積リターン

3ヶ月	+6.98 %
6ヶ月	+12.83 %
1年	+10.98 %
年初来	+18.45 %

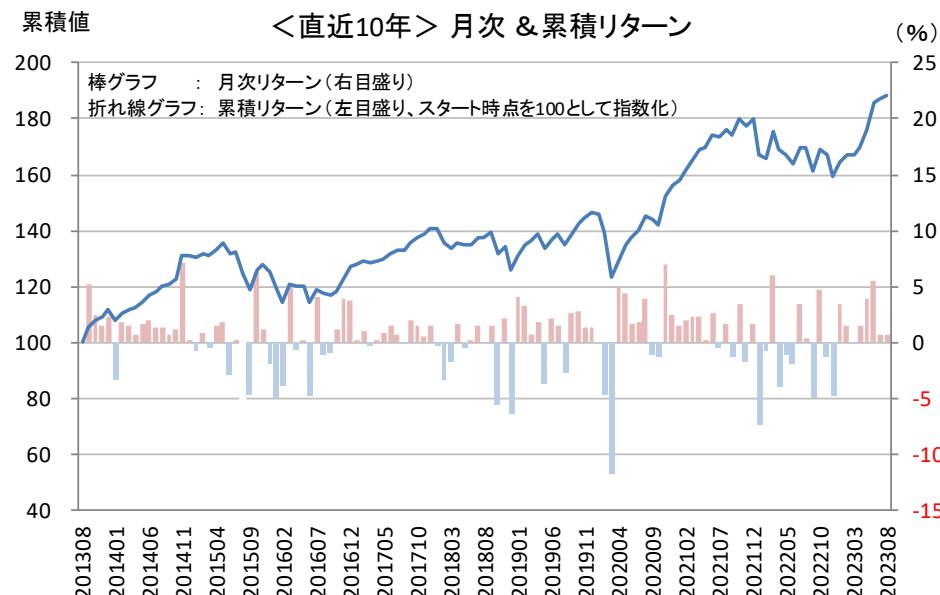
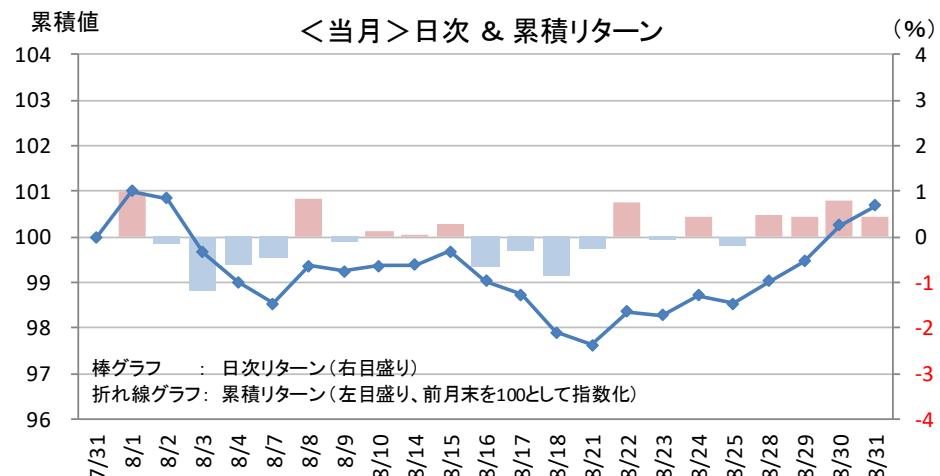
◇年初来高値／安値

高値	2023/08/01	17,599	+18.82 %
安値	2023/01/04	14,637	-1.18 %

◇純資産総額

当月末	前月末	増減	(弊社推計値)
100兆8,193億円	99兆4,051億円	+1兆4,142億円	+9,517億円

◇月間設定・解約額<ネット>



<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	17,545	17,425	120	0.69
国内株式	23,517	23,505	12	0.05
国内債券	12,431	12,535	-104	-0.83
外国株式(先進国)	24,189	23,999	190	0.79
エマージング株式	20,976	20,711	265	1.28
外国債券(先進国)	18,819	18,600	219	1.18
エマージング債券	20,533	20,130	403	2.00
ハイイールド債券	28,022	27,178	844	3.11
複合資産	19,986	19,883	103	0.52
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	35,585	35,092	493 1.40
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	35,211	34,788	423 1.22
その他	6,746	6,808	-62	-0.92

※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000

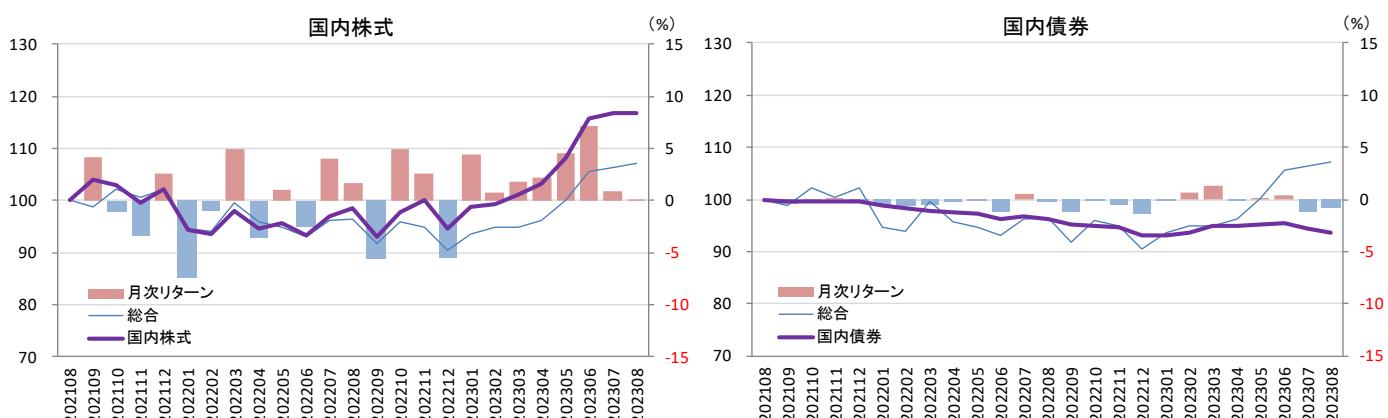
[色塗りの基準]月次リターン>総合

(2) 期間別リターン

	3ヶ月(%)	6ヶ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	6.98	12.83	10.98	18.45
国内株式	8.17	17.57	18.54	23.57
国内債券	-1.63	-0.12	-2.91	0.40
外国株式(先進国)	9.77	18.37	17.78	27.75
エマージング株式	9.58	15.41	8.99	18.23
外国債券(先進国)	2.61	4.45	1.05	6.03
エマージング債券	6.97	12.66	12.02	16.64
ハイイールド債券	6.82	9.80	9.99	14.58
複合資産	3.94	7.44	5.47	10.34
国内REIT	1.91	4.57	-3.19	3.05
外国REIT	8.46	5.52	-0.55	12.94
その他	3.13	9.16	5.85	12.12

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

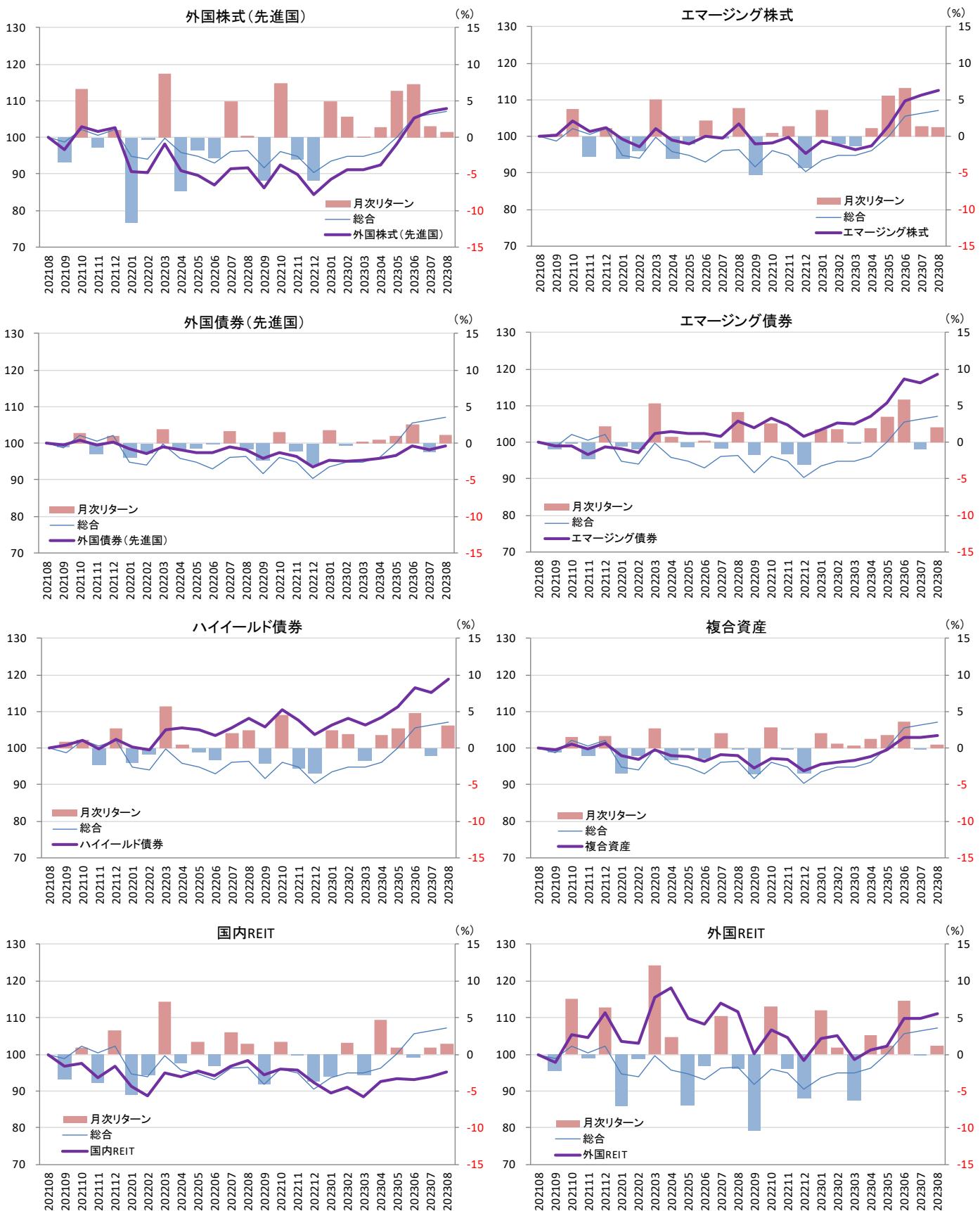
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化(折れ線グラフ、左目盛り))



<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」

(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	0.69		
1 外国株式(先進国)	0.79	43.13	0.33
2 外国債券(先進国)	1.18	8.95	0.10
3 複合資産	0.52	14.31	0.08
4 ハイイールド債券	3.11	1.94	0.06
5 外国REIT	1.22	4.52	0.05
6 エマージング株式	1.28	3.52	0.04
7 国内REIT	1.40	2.79	0.04
8 エマージング債券	2.00	1.18	0.02
9 国内株式	0.05	12.87	0.01
10 その他	-0.92	2.62	-0.02
11 国内債券	-0.83	4.17	-0.04
合計		100.00	0.69

[直近1年間]

順位	累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
総合	10.98		
1 外国株式(先進国)	17.78	41.49	7.45
2 国内株式	18.54	12.54	2.31
3 複合資産	5.47	14.94	0.81
4 エマージング株式	8.99	3.23	0.26
5 ハイイールド債券	9.99	1.96	0.18
6 その他	5.85	2.64	0.16
7 エマージング債券	12.02	1.22	0.14
8 外国債券(先進国)	1.05	9.29	0.07
9 外国REIT	-0.55	4.88	-0.10
10 国内債券	-2.91	4.70	-0.16
11 国内REIT	-3.19	3.11	-0.17
合計		100.00	10.98

◆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
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	17,545	17,425	120	0.69	
国内株式	23,517	23,505	12	0.05	
ヘッジなし	24,031	24,049	-18	-0.08	
国内債券	12,431	12,535	-104	-0.83	
ヘッジなし	12,622	12,728	-105	-0.83	
外国株式（先進国）	24,189	23,999	190	0.79	
ヘッジなし	28,929	28,633	296	1.03	
円ヘッジ	17,143	17,562	-419	-2.39	
エマージング株式	20,976	20,711	265	1.28	
ヘッジなし	20,329	20,068	261	1.30	
円ヘッジ	18,495	19,792	-1,297	-6.55	
外国債券（先進国）	18,819	18,600	219	1.18	
ヘッジなし	21,045	20,598	447	2.17	
円ヘッジ	12,890	12,961	-71	-0.55	
エマージング債券	20,533	20,130	403	2.00	
ヘッジなし	22,655	22,132	524	2.37	
円ヘッジ	15,658	15,896	-237	-1.49	
ハイイールド債券	28,022	27,178	844	3.11	
ヘッジなし	33,406	32,169	1,237	3.85	
円ヘッジ	15,683	15,742	-58	-0.37	
複合資産	19,986	19,883	103	0.52	
ヘッジなし	20,846	20,685	161	0.78	
円ヘッジ	13,929	14,142	-213	-1.51	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	35,585	35,092	493	1.40
ヘッジなし	10,000 (2003.10.31)	35,631	35,168	463	1.32
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	35,211	34,788	423	1.22
ヘッジなし	10,000 (2003.09.30)	36,299	35,814	485	1.35
円ヘッジ	10,000 (2003.10.31)	16,505	16,932	-428	-2.53
その他	6,746	6,808	-62	-0.92	

※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

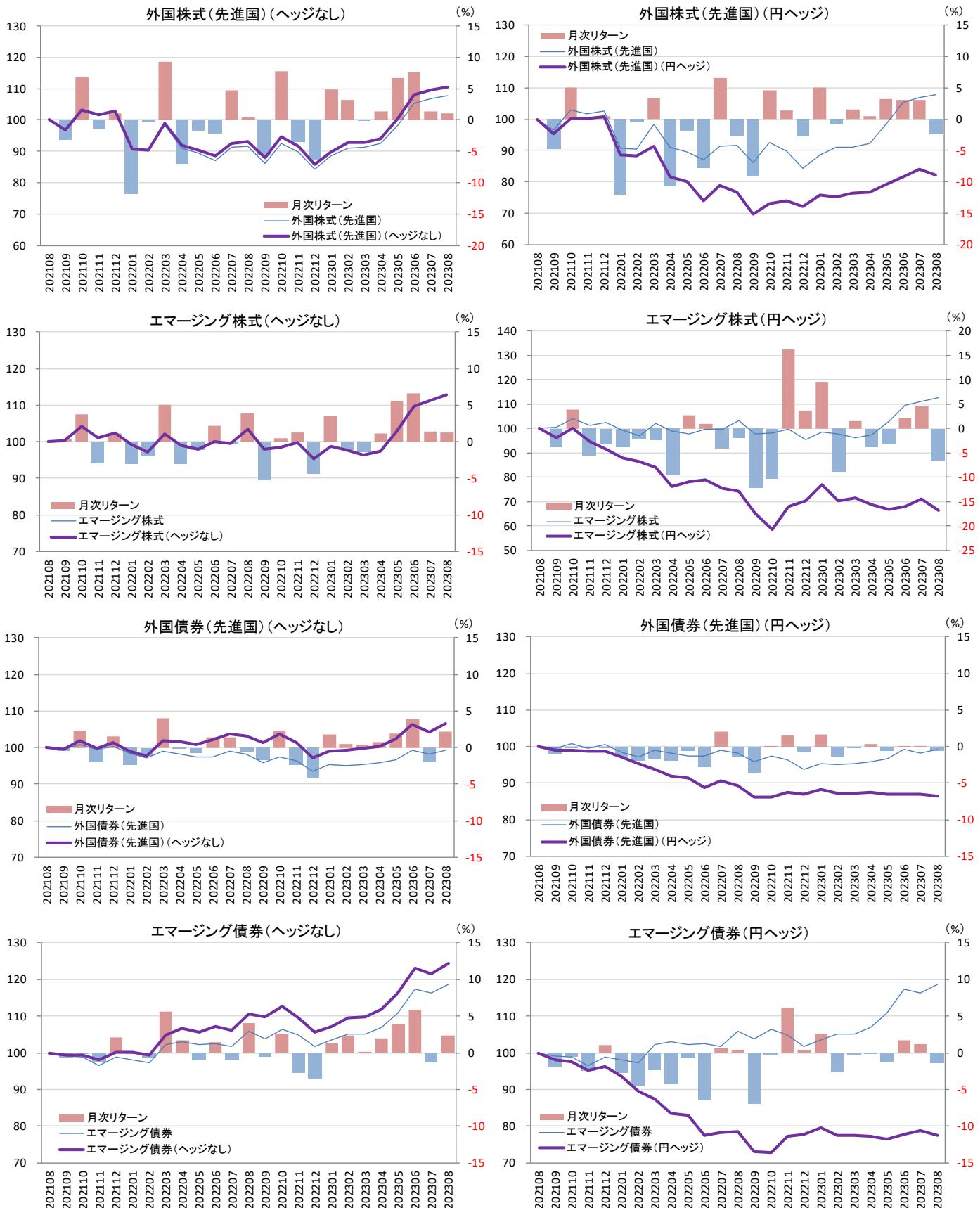
	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	6.98	12.83	10.98	18.45
国内株式	8.17	17.57	18.54	23.57
ヘッジなし	8.02	17.21	18.15	23.08
国内債券	-1.63	-0.12	-2.91	0.40
ヘッジなし	-1.78	-0.25	-2.59	0.38
外国株式(先進国)	9.77	18.37	17.78	27.75
ヘッジなし	10.27	19.20	18.82	29.06
円ヘッジ	3.75	9.25	6.90	13.93
エマージング株式	9.58	15.41	8.99	18.23
ヘッジなし	9.61	15.47	9.04	18.30
円ヘッジ	-0.05	-5.31	-10.10	-5.41
外国債券(先進国)	2.61	4.45	1.05	6.03
ヘッジなし	4.10	7.25	3.31	9.72
円ヘッジ	-0.44	-0.81	-3.17	-0.56
エマージング債券	6.97	12.66	12.02	16.64
ヘッジなし	7.01	13.50	12.61	17.71
円ヘッジ	1.40	-0.05	-1.20	-0.12
ハイイールド債券	6.82	9.80	9.99	14.58
ヘッジなし	7.19	10.50	10.73	15.68
円ヘッジ	1.07	0.43	-0.09	1.69
複合資産	3.94	7.44	5.47	10.34
ヘッジなし	4.50	8.65	6.88	12.00
円ヘッジ	0.44	0.32	-2.43	1.18
国内REIT	1.91	4.57	-3.19	3.05
ヘッジなし	1.71	4.24	-3.51	2.61
外国REIT	8.46	5.52	-0.55	12.94
ヘッジなし	8.65	5.76	-0.19	13.36
円ヘッジ	2.81	-3.90	-11.15	-0.32
その他	3.13	9.16	5.85	12.12

※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）」

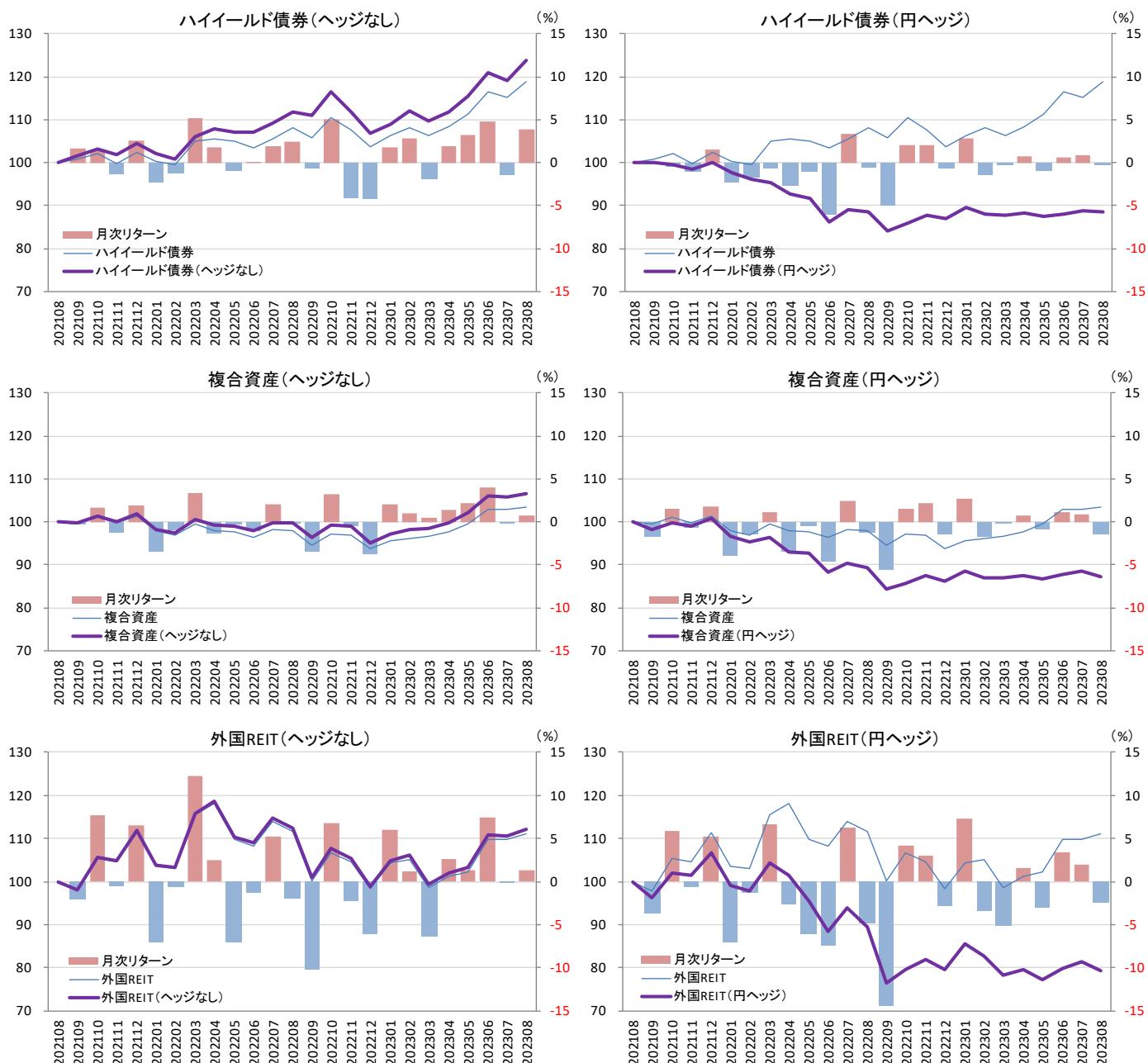
(3) リターン推移（24カ月前を100として指数化（折れ線グラフ、左目盛り））



<1>パフォーマンス・サマリー

3. 「大分類（ヘッジ種別）」

(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

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	0.69		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	1.03	39.92	0.41
2	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	2.17	5.64	0.12
3	複合資産(ヘッジなし)	0.78	11.81	0.09
4	外国REIT(ヘッジなし)	1.35	4.31	0.06
5	ハイイールド債券(ヘッジなし)	3.85	1.41	0.05
6	エマージング株式(ヘッジなし)	1.30	3.51	0.05
7	国内REIT(ヘッジなし)	1.32	2.72	0.04
8	エマージング債券(ヘッジなし)	2.37	0.96	0.02
9	その他(ヘッジなし)	0.71	1.41	0.01
10	国内株式(円ヘッジ)	-0.97	0.02	-0.00
11	エマージング株式(円ヘッジ)	-6.55	0.01	-0.00
12	ハイイールド債券(円ヘッジ)	-0.37	0.16	-0.00
13	エマージング債券(円ヘッジ)	-1.49	0.05	-0.00
14	国内株式(ヘッジなし)	-0.08	12.49	-0.00
15	外国REIT(円ヘッジ)	-2.53	0.14	-0.00
16	国内債券(円ヘッジ)	-0.84	1.05	-0.01
17	複合資産(円ヘッジ)	-1.51	0.64	-0.01
18	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	-0.55	2.41	-0.01
19	その他(円ヘッジ)	-2.57	0.79	-0.02
20	国内債券(ヘッジなし)	-0.83	3.11	-0.03
21	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	-2.39	2.63	-0.07
	合計		95.19	0.69

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	10.98		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	18.82	37.91	7.22
2	国内株式(ヘッジなし)	18.15	12.14	2.21
3	複合資産(ヘッジなし)	6.88	12.18	0.85
4	エマージング株式(ヘッジなし)	9.04	3.22	0.26
5	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	6.90	2.94	0.21
6	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	3.31	5.87	0.17
7	ハイイールド債券(ヘッジなし)	10.73	1.38	0.14
8	エマージング債券(ヘッジなし)	12.61	0.98	0.11
9	その他(円ヘッジ)	13.19	0.72	0.11
10	その他(ヘッジなし)	5.32	1.44	0.08
11	国内株式(円ヘッジ)	9.80	0.03	0.00
12	ハイイールド債券(円ヘッジ)	-0.09	0.18	-0.00
13	エマージング株式(円ヘッジ)	-10.10	0.01	-0.00
14	エマージング債券(円ヘッジ)	-1.20	0.06	-0.00
15	外国REIT(円ヘッジ)	-11.15	0.15	-0.02
16	複合資産(円ヘッジ)	-2.43	0.74	-0.02
17	国内債券(円ヘッジ)	-3.76	1.21	-0.06
18	外国REIT(ヘッジなし)	-0.19	4.64	-0.07
19	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	-3.17	2.47	-0.09
20	国内債券(ヘッジなし)	-2.59	3.48	-0.10
21	国内REIT(ヘッジなし)	-3.51	3.02	-0.17
	合計		95.19	10.83

◆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。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

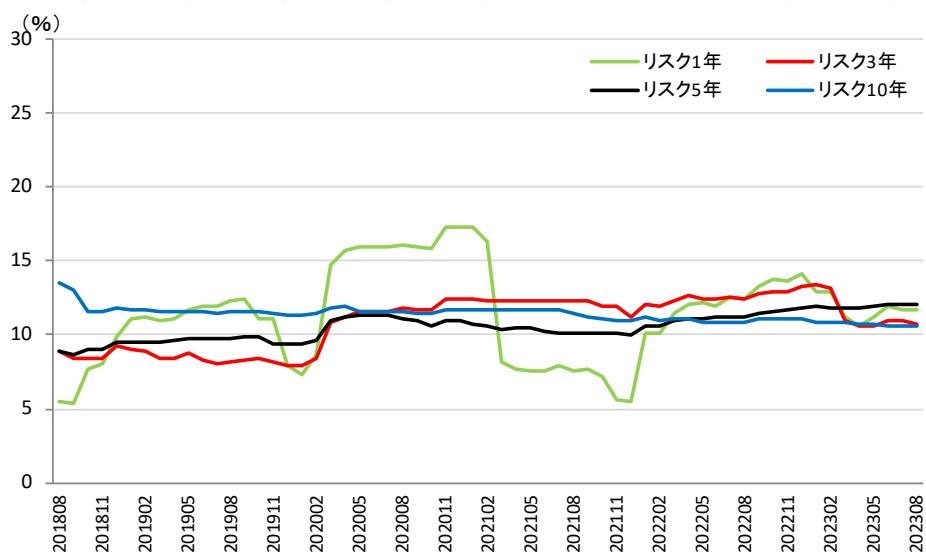
	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	29.63	37.34	88.54	10.77	12.08	10.57	0.84	0.55	0.62
国内株式	45.58	43.13	151.09	13.11 ↓	16.33	15.49	1.02	0.46	0.62
国内債券	-5.72	-4.57	1.87	2.05	2.11	1.86	-0.93	-0.42	0.11
外国株式(先進国)	41.82	67.48	156.65	16.29 ↓	18.46	15.88	0.76	0.59	0.62
エマージング株式	44.11	44.86	108.29	11.87 ↓	18.01	16.35	1.09	0.43	0.47
外国債券(先進国)	3.20	9.29	19.66	4.54	4.74	5.33 ↓	0.24	0.39	0.34
エマージング債券	28.45	33.83	45.36	7.70	10.51	10.81	1.14	0.57	0.35
ハイイールド債券	36.16	35.51	69.67	8.08	11.55	10.50	1.34	0.55	0.52
複合資産	15.34	18.76	55.04	6.35	7.31	7.19	0.77	0.48	0.63
国内REIT	20.21	28.20	100.50	11.26 ↓	14.89	13.21 ↓	0.56	0.34	0.55
外国REIT	50.73	42.22	126.08	17.51	18.82	16.13	0.84	0.39	0.53

※[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

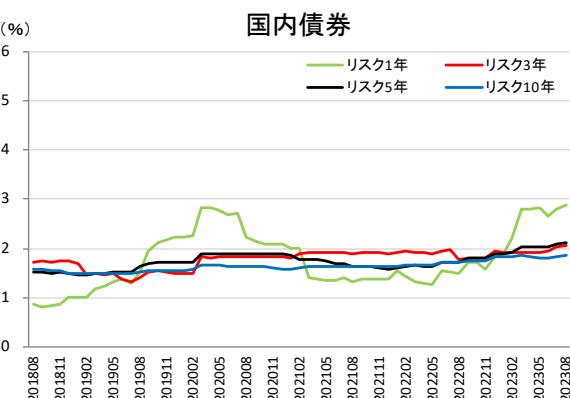
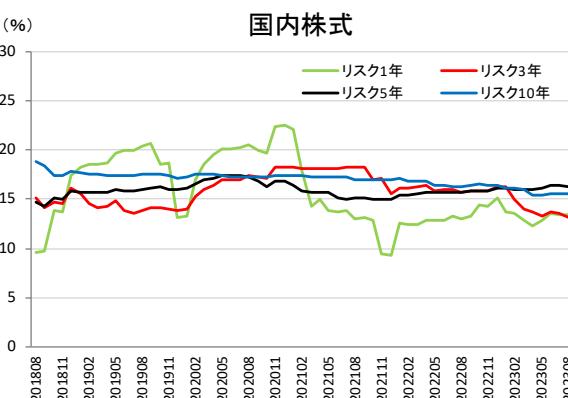
[リスクの矢印] 直近6カ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑: 上昇傾向、↓: 低下傾向

(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」

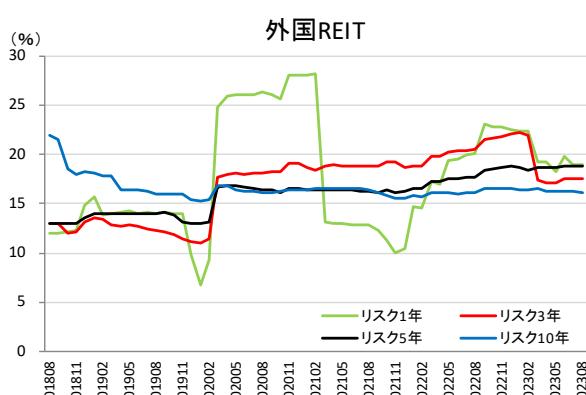
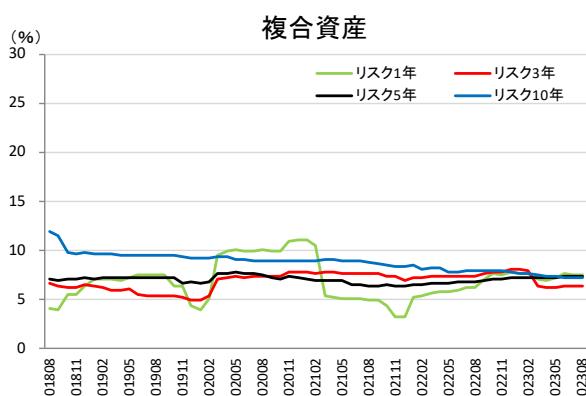
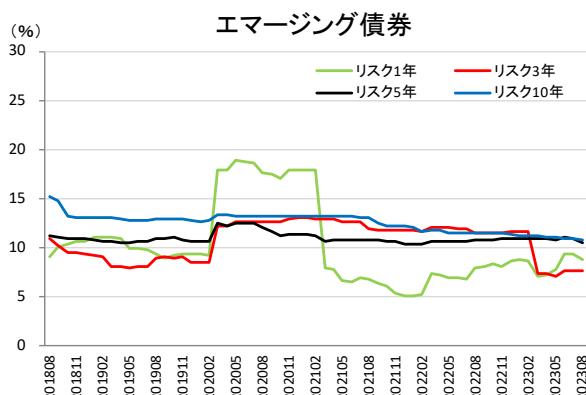
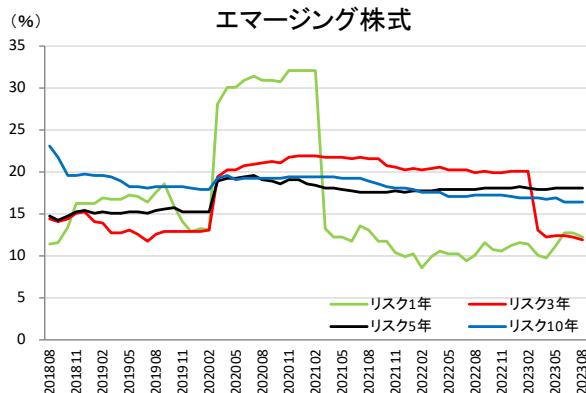
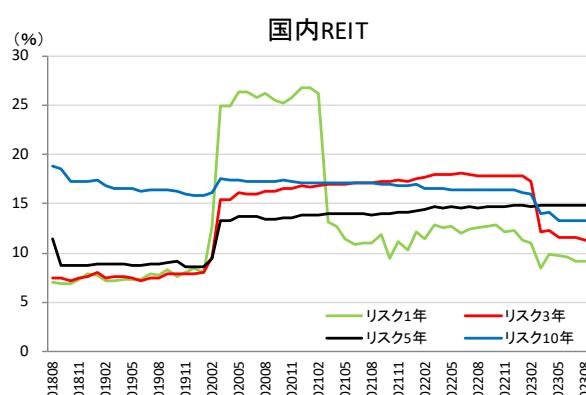
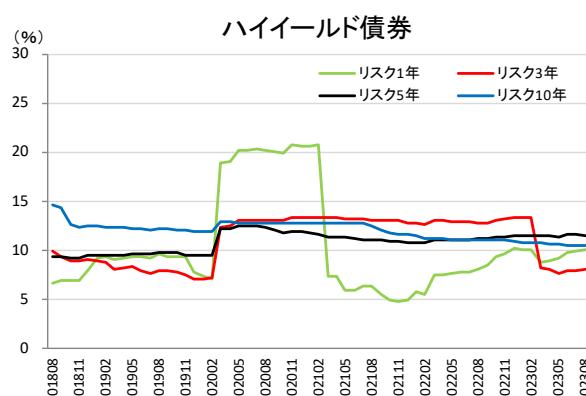
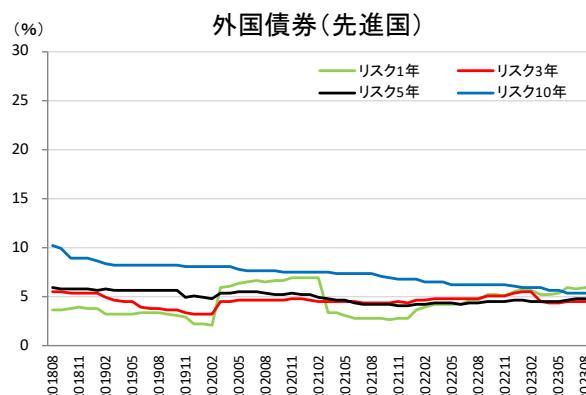
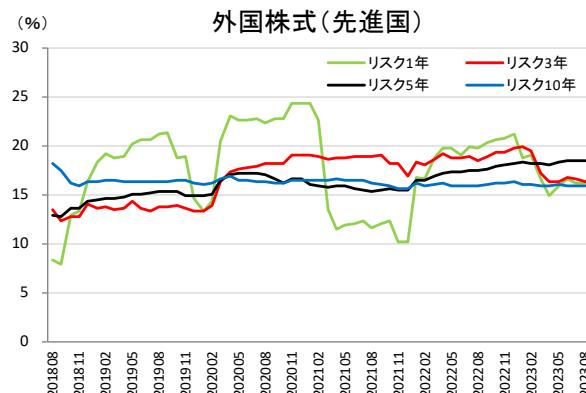


＜2＞リスク・サマリー

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)

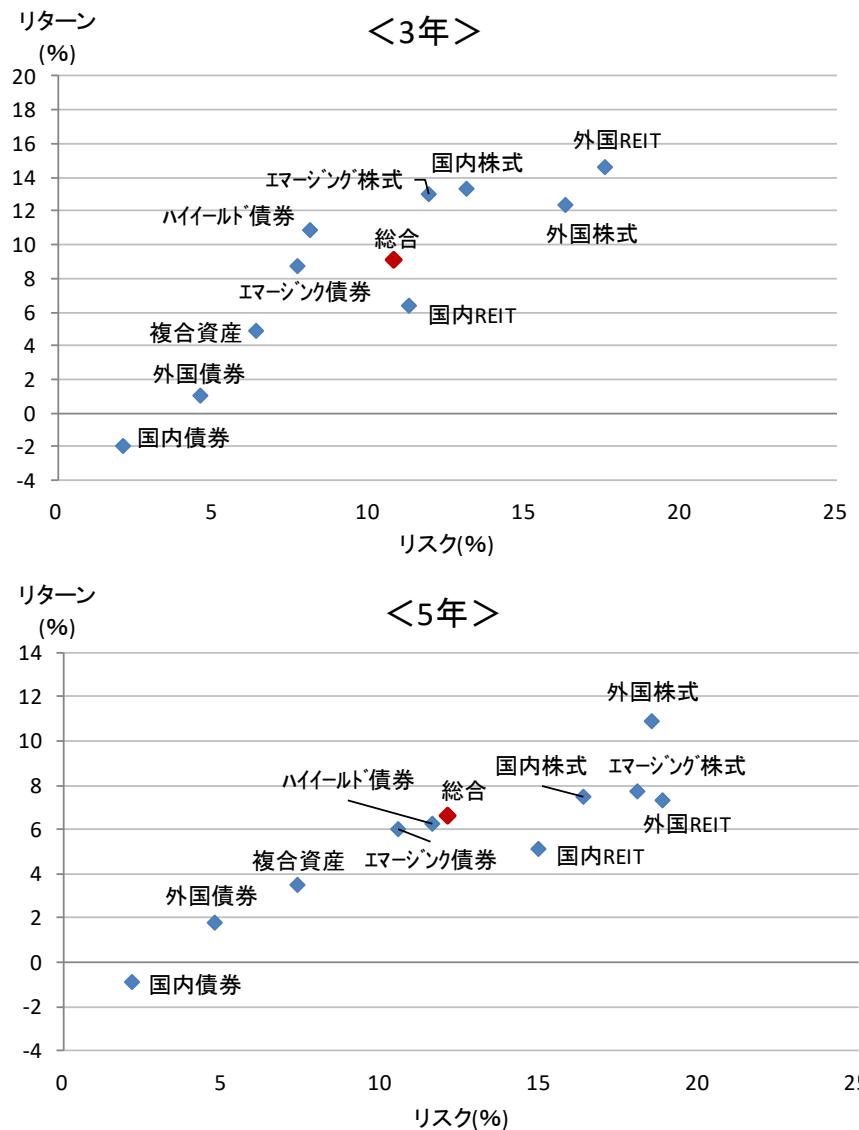
② 「大分類」



<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	9.03	6.55	10.77	12.08
国内株式	13.33	7.43	13.11	16.33
国内債券	-1.94	-0.93	2.05	2.11
外国株式(先進国)	12.35	10.87	16.29	18.46
エマージング株式	12.95	7.69	11.87	18.01
外国債券(先進国)	1.05	1.79	4.54	4.74
エマージング債券	8.70	6.00	7.70	10.51
ハイイールド債券	10.84	6.27	8.08	11.55
複合資産	4.87	3.50	6.35	7.31
国内REIT	6.33	5.09	11.26	14.89
外国REIT	14.66	7.30	17.51	18.82

※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）」

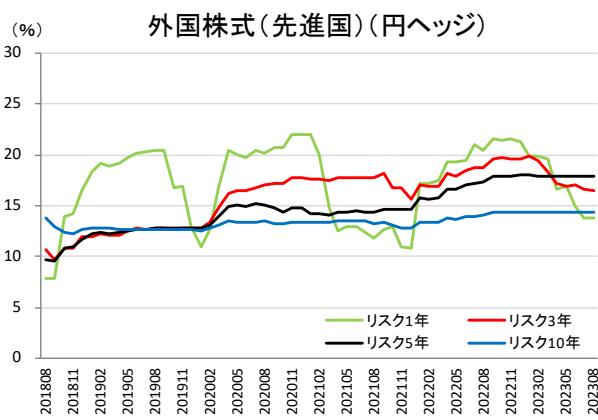
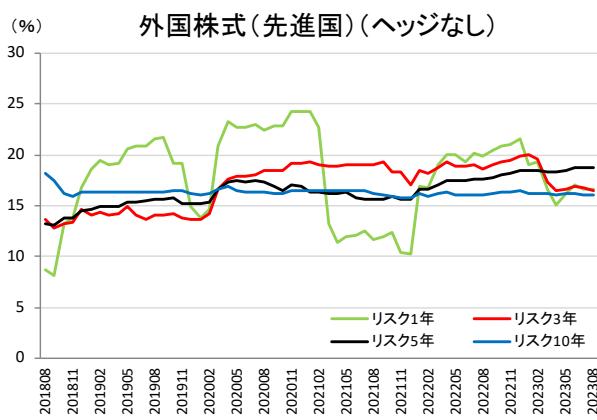
(1) 期間別リスク・リターン

	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	29.63	37.34	88.54	10.77	12.08	10.57	0.84	0.55	0.62
国内株式	45.58	43.13	151.09	13.11	↓	16.33	15.49	1.02	0.46
ヘッジなし	43.51	41.84	151.66	13.07	↓	16.24	15.02	0.98	0.45
国内債券	-5.72	-4.57	1.87	2.05	2.11	1.86	-0.93	-0.42	0.11
ヘッジなし	-4.87	-3.93	2.52	2.02	2.05	1.83	-0.80	-0.37	0.14
外国株式（先進国）	41.82	67.48	156.65	16.29	↓	18.46	15.88	0.76	0.59
ヘッジなし	46.19	72.43	167.90	16.49	↓	18.67	16.08	0.82	0.62
円ヘッジ	5.00	29.45	85.54	16.46	↓	17.95	14.36	0.10	0.30
エマージング株式	44.11	44.86	108.29	11.87	↓	18.01	16.35	1.09	0.43
ヘッジなし	44.50	45.19	109.00	11.87	↓	18.03	16.36	1.10	0.43
円ヘッジ	-31.77	-23.28	6.05	21.10	22.24	19.34	-0.57	-0.23	0.03
外国債券（先進国）	3.20	9.29	19.66	4.54	4.74	5.33	↓	0.24	0.39
ヘッジなし	11.57	18.01	29.44	6.22	5.87	6.45	0.60	0.58	0.41
円ヘッジ	-12.35	-5.95	0.66	4.14	4.38	3.54	-1.03	-0.27	0.02
エマージング債券	28.45	33.83	45.36	7.70	10.51	10.81	1.14	0.57	0.35
ヘッジなし	34.26	40.15	52.44	7.60	9.64	10.27	1.36	0.73	0.42
円ヘッジ	-19.90	-13.27	-2.63	8.98	↓	10.74	8.50	-0.79	-0.26
ハイイールド債券	36.16	35.51	69.67	8.08	11.55	10.50	1.34	0.55	0.52
ヘッジなし	42.46	44.14	96.43	8.28	10.60	9.91	1.52	0.72	0.71
円ヘッジ	-3.85	-1.98	14.14	6.88	↓	9.45	7.28	-0.18	-0.04
複合資産	15.34	18.76	55.04	6.35	7.31	7.19	0.77	0.48	0.63
ヘッジなし	19.88	23.69	63.63	6.75	7.67	7.53	0.93	0.57	0.67
円ヘッジ	-3.61	-3.77	11.69	7.22	7.94	6.45	-0.16	-0.09	0.17
国内REIT	20.21	28.20	100.50	11.26	↓	14.89	13.21	↓	0.56
ヘッジなし	18.69	27.37	98.98	11.18	↓	14.75	12.99	↓	0.53
外国REIT	50.73	42.22	126.08	17.51	18.82	16.13	0.84	0.39	0.53
ヘッジなし	52.85	44.66	132.27	17.66	18.88	16.21	0.86	0.41	0.54
円ヘッジ	1.58	-2.71	24.47	17.43	18.48	14.96	0.03	-0.03	0.15

※[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カ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

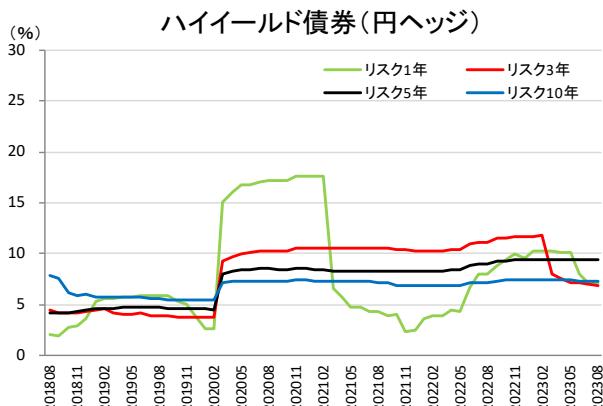
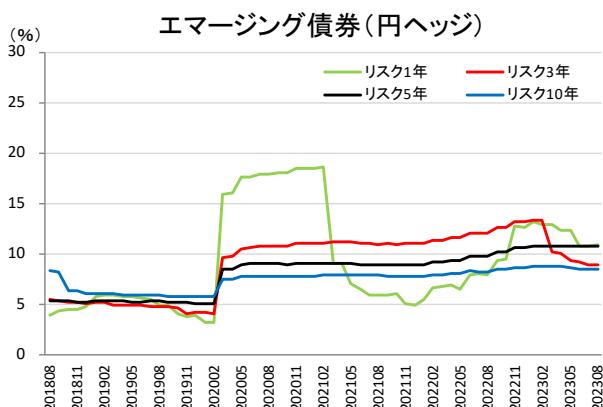
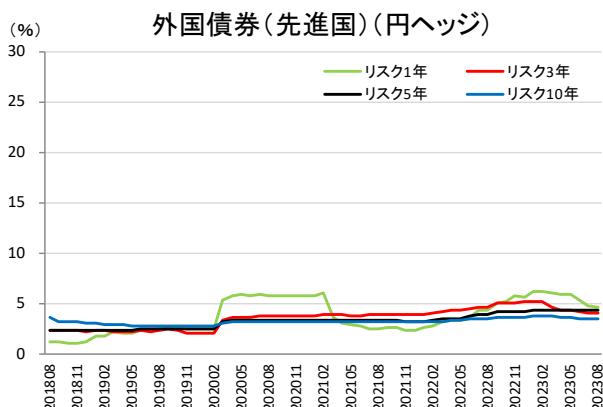
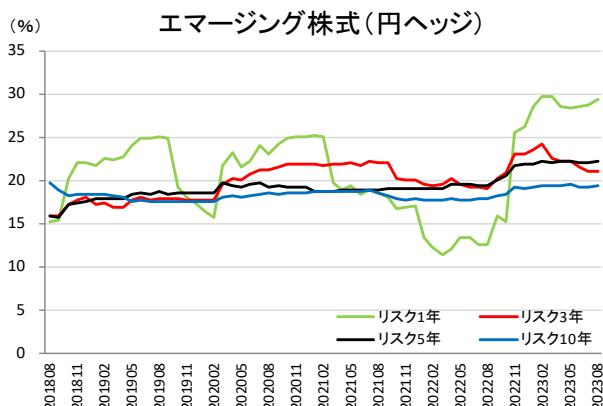
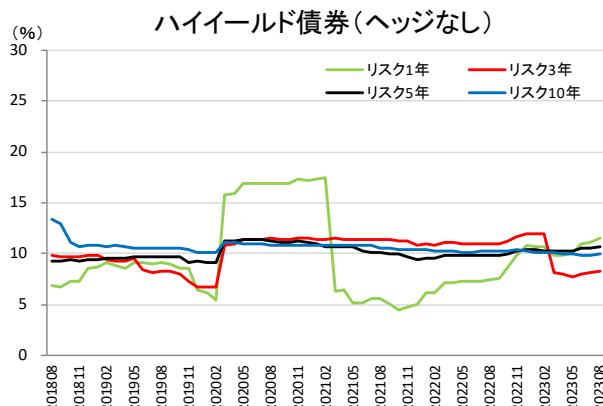
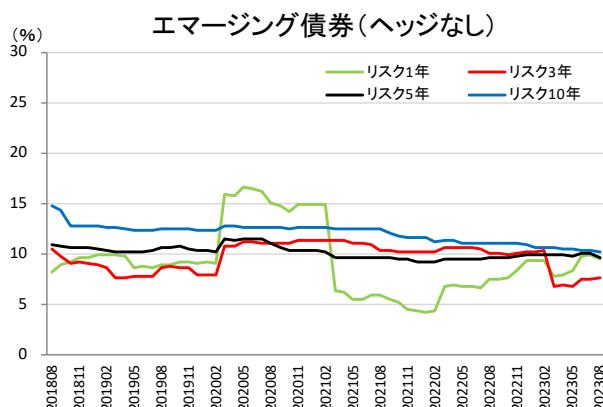
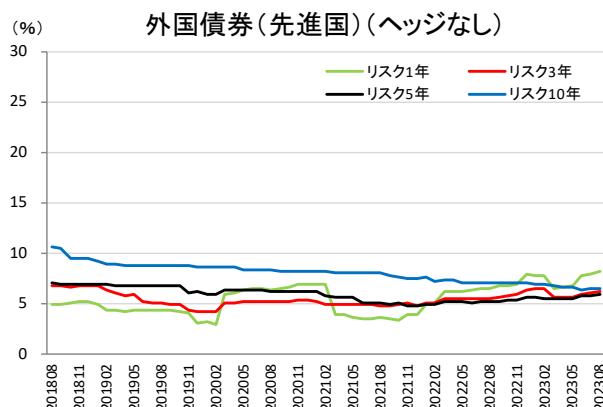
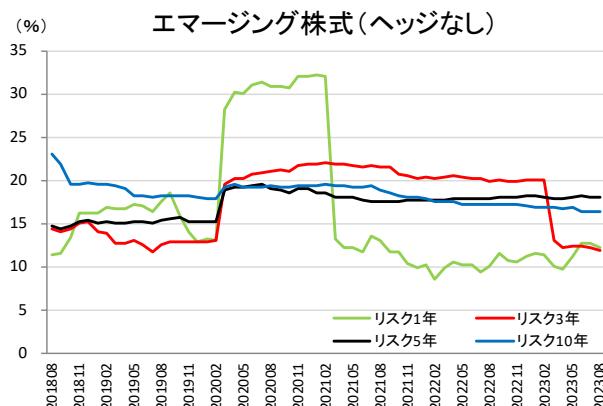
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



<2>リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

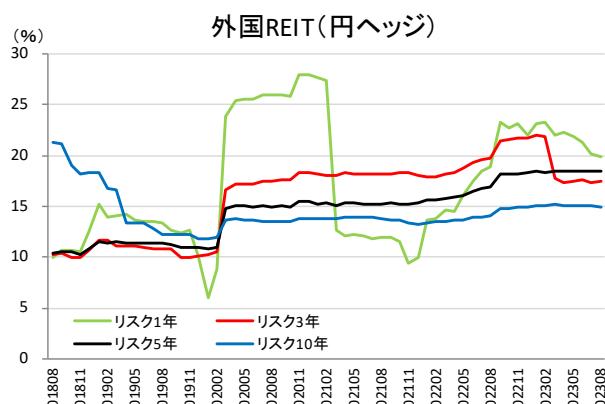
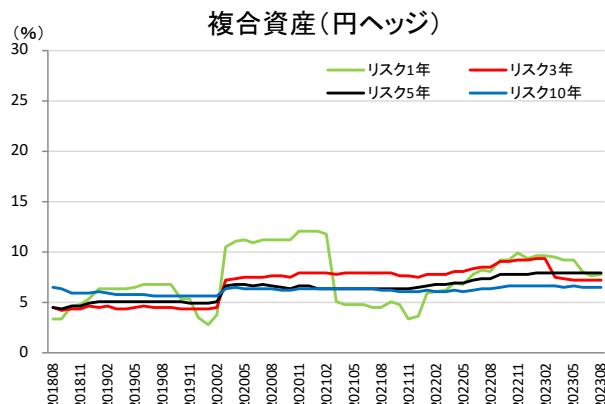
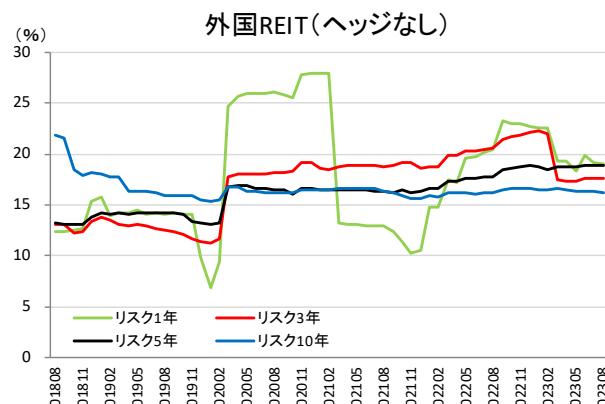
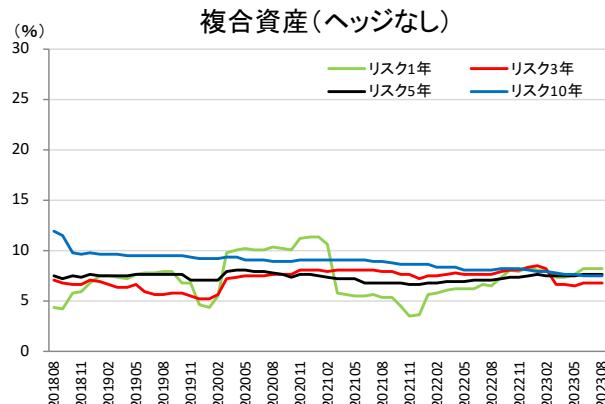
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



＜2＞リスク・サマリー

2. 「大分類 (ヘッジ種別)」

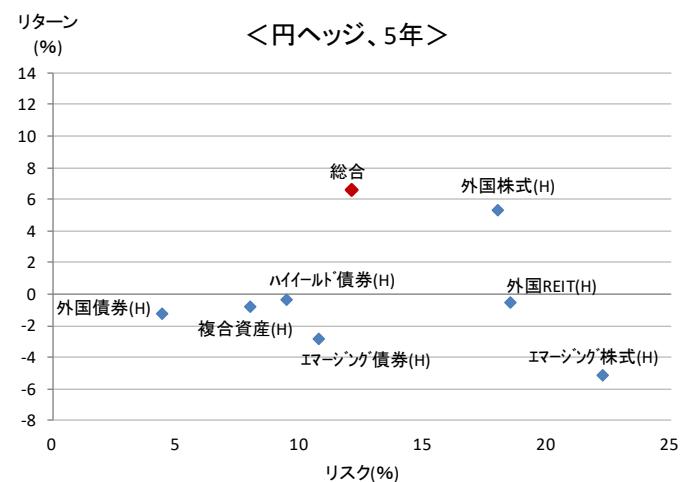
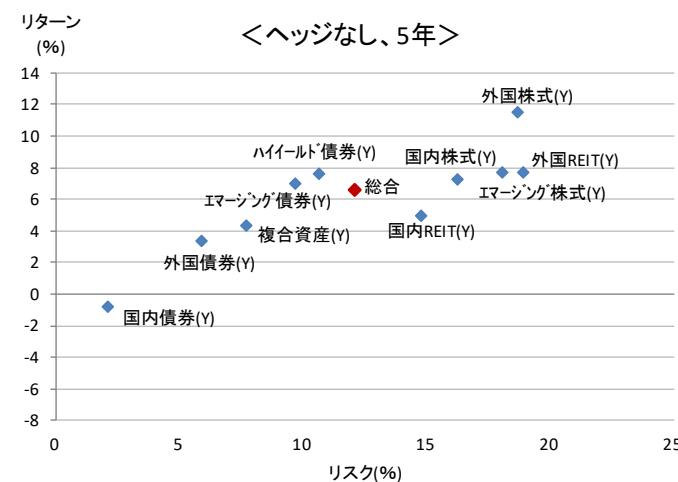
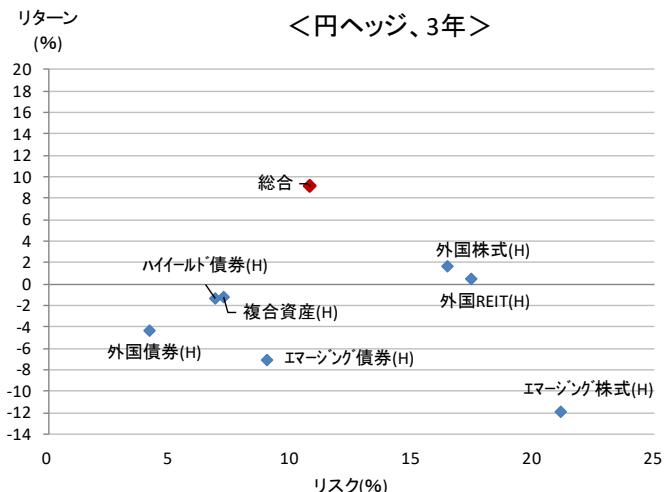
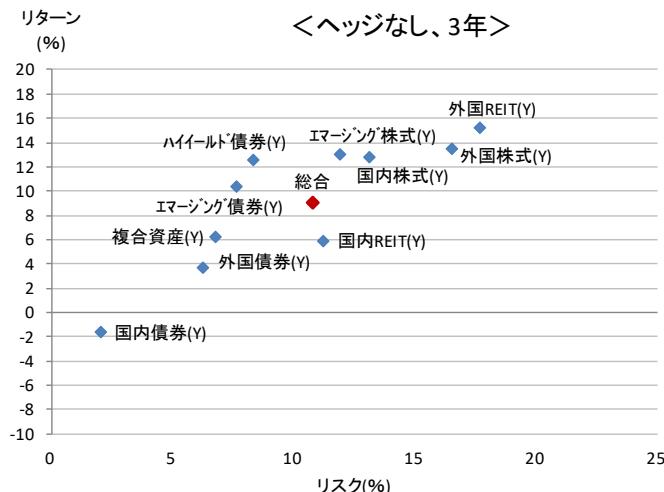
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)



<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	9.03	6.55	10.77	12.08
国内株式(Y)	12.80	7.24	13.07	16.24
国内債券(Y)	-1.65	-0.80	2.02	2.05
外国株式(先進国)(Y)	13.49	11.51	16.49	18.67
エマージング株式(Y)	13.05	7.74	11.87	18.03
外国債券(先進国)(Y)	3.72	3.37	6.22	5.87
エマージング債券((Y)	10.32	6.98	7.60	9.64
ハイールド債券(Y)	12.52	7.59	8.28	10.60
複合資産(Y)	6.23	4.34	6.75	7.67
国内REIT(Y)	5.88	4.96	11.18	14.75
外国REIT(Y)	15.19	7.66	17.66	18.88

<円ヘッジ>	リターン(%)		リスク(%)	
	3年	5年	3年	5年
総合	9.03	6.55	10.77	12.08
外国株式(先進国)(H)	1.64	5.30	16.46	17.95
エマージング株式(H)	-11.96	-5.16	21.10	22.24
外国債券(先進国)(H)	-4.30	-1.22	4.14	4.38
エマージング債券(H)	-7.13	-2.81	8.98	10.74
ハイールド債券(H)	-1.30	-0.40	6.88	9.45
複合資産(H)	-1.22	-0.76	7.22	7.94
外国REIT(H)	0.52	-0.55	17.43	18.48

※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カ月	6カ月	1年
総合	9,517	24,401	31,299	71,494
国内株式	1,950	4,446	3,204	8,058
国内債券	209	1,457	-516	-258
外国株式(先進国)	3,723	8,420	12,878	31,990
エマージング株式	1,140	3,135	4,200	5,578
外国債券(先進国)	1,056	3,000	4,346	8,324
エマージング債券	23	205	184	-74
ハイイールド債券	125	508	854	2,058
複合資産	848	1,982	3,110	7,769
国内REIT	14	141	478	2,572
外国REIT	99	213	1,198	2,543
その他	330	895	1,364	2,933

2. 「大分類(ヘッジ種別)」

(単位:億円)	当月	3カ月	6カ月	1年
総合	9,517	24,401	31,299	71,494
国内株式	1,950	4,446	3,204	8,058
ヘッジなし	1,985	4,583	3,507	8,548
国内債券	209	1,457	-516	-258
ヘッジなし	251	1,094	67	414
外国株式(先進国)	3,723	8,420	12,878	31,990
ヘッジなし	4,374	10,268	15,468	34,897
円ヘッジ	-586	-1,663	-2,228	-2,307
エマージング株式	1,140	3,135	4,200	5,578
ヘッジなし	1,140	3,134	4,200	5,566
円ヘッジ	0	-1	-2	-4
外国債券(先進国)	1,056	3,000	4,346	8,324
ヘッジなし	862	1,421	2,742	4,207
円ヘッジ	145	1,522	1,532	3,519
エマージング債券	23	205	184	-74
ヘッジなし	44	276	305	129
円ヘッジ	-2	-9	-23	-34
ハイイールド債券	125	508	854	2,058
ヘッジなし	159	634	1,079	2,186
円ヘッジ	-4	-7	-10	157
複合資産	848	1,982	3,110	7,769
ヘッジなし	841	2,141	3,533	8,044
円ヘッジ	-25	-98	-179	-285
国内REIT	14	141	478	2,572
ヘッジなし	24	175	544	2,709
外国REIT	99	213	1,198	2,543
ヘッジなし	70	206	1,179	2,454
円ヘッジ	37	48	81	159
その他	330	895	1,364	2,933

<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	1,008,193	100.0	5,390	100.0
国内株式	130,644	13.0	810	15.0
国内債券	41,362	4.1	145	2.7
外国株式(先進国)	436,336	43.3	1,190	22.1
エマージング株式	35,725	3.5	309	5.7
外国債券(先進国)	89,587	8.9	764	14.2
エマージング債券	11,795	1.2	251	4.7
ハイイールド債券	19,507	1.9	250	4.6
複合資産	143,521	14.2	1,036	19.2
国内REIT	27,983	2.8	134	2.5
外国REIT	45,420	4.5	279	5.2
その他	26,310	2.6	222	4.1

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	1,008,193	100.0	5,390	100.0
国内株式	130,644	13.0	810	15.0
ヘッジなし	126,723	12.6	727	13.5
国内債券	41,362	4.1	145	2.7
ヘッジなし	30,977	3.1	136	2.5
外国株式(先進国)	436,336	43.3	1,190	22.1
ヘッジなし	404,614	40.1	892	16.5
円ヘッジ	25,978	2.6	235	4.4
エマージング株式	35,725	3.5	309	5.7
ヘッジなし	35,629	3.5	295	5.5
円ヘッジ	59	0.0	10	0.2
外国債券(先進国)	89,587	8.9	764	14.2
ヘッジなし	56,796	5.6	420	7.8
円ヘッジ	23,794	2.4	257	4.8
エマージング債券	11,795	1.2	251	4.7
ヘッジなし	9,607	1.0	143	2.7
円ヘッジ	518	0.1	29	0.5
ハイイールド債券	19,507	1.9	250	4.6
ヘッジなし	14,241	1.4	77	1.4
円ヘッジ	1,596	0.2	65	1.2
複合資産	143,521	14.2	1,036	19.2
ヘッジなし	118,642	11.8	793	14.7
円ヘッジ	6,378	0.6	80	1.5
国内REIT	27,983	2.8	134	2.5
ヘッジなし	27,225	2.7	115	2.1
外国REIT	45,420	4.5	279	5.2
ヘッジなし	43,305	4.3	191	3.5
円ヘッジ	1,396	0.1	62	1.2
その他	26,310	2.6	222	4.1

<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	14,437	10.2	2.16	2.19	1.131
国内株式	20,708	14.1	1.04	0.90	1.033
国内債券	10,363	12.1	0.14	0.14	0.454
外国株式(先進国)	17,248	7.7	2.19	2.07	1.205
エマージング株式	14,380	10.8	2.44	2.37	1.659
外国債券(先進国)	10,194	10.6	1.36	1.41	0.979
エマージング債券	9,503	11.6	3.84	3.67	1.417
ハイイールド債券	9,835	12.2	5.11	4.97	1.665
複合資産	13,538	9.6	1.01	1.03	0.940
国内REIT	14,414	10.3	7.89	9.56	0.916
外国REIT	12,262	9.3	7.80	8.89	1.466

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	14,437	10.2	2.16	2.19	1.131
国内株式	20,708	14.1	1.04	0.90	1.033
ヘッジなし	20,466	14.5	0.92	0.81	1.014
国内債券	10,363	12.1	0.14	0.14	0.454
ヘッジなし	10,426	12.5	0.15	0.15	0.374
外国株式(先進国)	17,248	7.7	2.19	2.07	1.205
ヘッジなし	18,716	7.5	2.24	2.11	1.173
円ヘッジ	12,846	7.9	1.33	1.31	1.575
エマージング株式	14,380	10.8	2.44	2.37	1.659
ヘッジなし	14,657	10.9	2.44	2.37	1.659
円ヘッジ	9,325	11.7	0.48	0.59	1.667
外国債券(先進国)	10,194	10.6	1.36	1.41	0.979
ヘッジなし	11,447	12.3	1.64	1.69	0.968
円ヘッジ	8,618	8.0	0.83	0.91	0.869
エマージング債券	9,503	11.6	3.84	3.67	1.417
ヘッジなし	10,362	11.1	3.64	3.47	1.349
円ヘッジ	6,855	12.1	3.52	3.76	1.660
ハイイールド債券	9,835	12.2	5.11	4.97	1.665
ヘッジなし	11,544	12.2	5.49	5.32	1.676
円ヘッジ	8,236	12.6	2.90	3.03	1.632
複合資産	13,538	9.6	1.01	1.03	0.940
ヘッジなし	14,317	10.6	1.07	1.08	0.854
円ヘッジ	10,205	8.4	1.10	1.19	1.376
国内REIT	14,414	10.3	7.89	9.56	0.916
ヘッジなし	14,006	10.2	7.95	9.67	0.903
外国REIT	12,262	9.3	7.80	8.89	1.466
ヘッジなし	12,926	9.3	7.89	8.99	1.466
円ヘッジ	9,354	8.1	3.89	4.79	1.278

(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 青木、川眞田
電話番号 : 03-6721-1033
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