

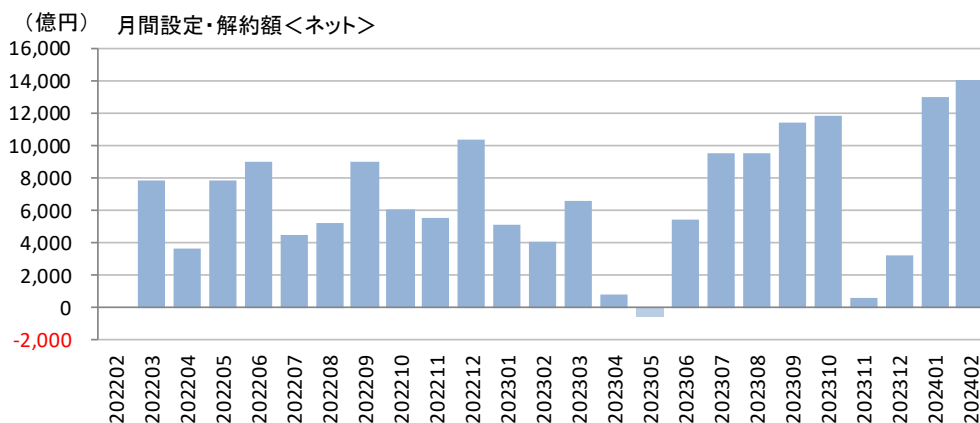
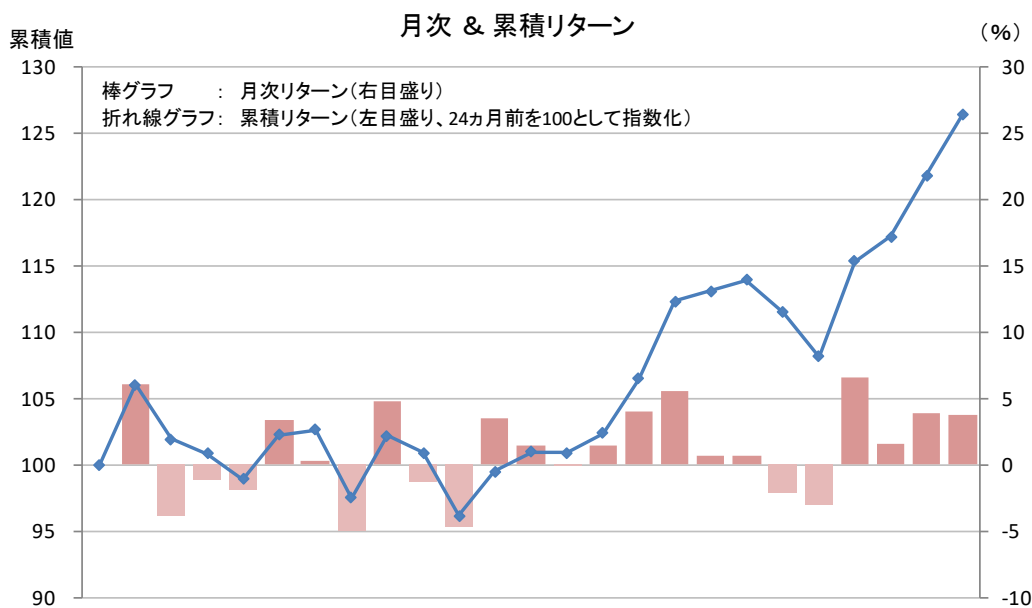
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

— Vol.1 ファンド大分類 編 —

2024年2月

「総合」 +3.75 %
(前月 +3.93 %)



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

2024年2月のMAB-FPI

<1>パフォーマンス・サマリー

2月のMAB-FPI「総合」は3.75%上昇し19,468ポイント。28日には算出来高値となる19,491ポイントを付けた。

純資産総額は前月末比5兆2,914億円増加し116兆706億円。

「大分類別」では、国内株式+5.77%、エマージング株式+5.36%、外国株式(先進国)+5.22%、その他+2.55%、エマージング債券+2.32%、複合資産+2.03%など、10カテゴリーで上昇した。一方、下落したのは国内REIT-4.65%のみ。

「総合」への寄与度では、外国株式(先進国)+2.37%、国内株式+0.76%、複合資産+0.27%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、エマージング株式と国内REITの3年リスクに低下傾向が見られるが、5年リスクは全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+1兆4,042億円と、引き続き流入超となった。

「大分類別」では、外国株式(先進国)が+9,952億円と大幅な流入超となり、それに続いてエマージング株式+1,476億円、国内株式+1,450億円、外国債券(先進国)+644億円、複合資産+641億円など、9つのカテゴリーで流入超となった。一方、流出超となったのは国内REIT-191億円 および 外国REIT-163億円の2カテゴリー。

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
19,468	18,763	+704	+3.75 %

◇累積リターン

3か月	+9.57 %
6か月	+10.96 %
1年	+25.20 %
年初来	+7.83 %

◇年初来高値／安値

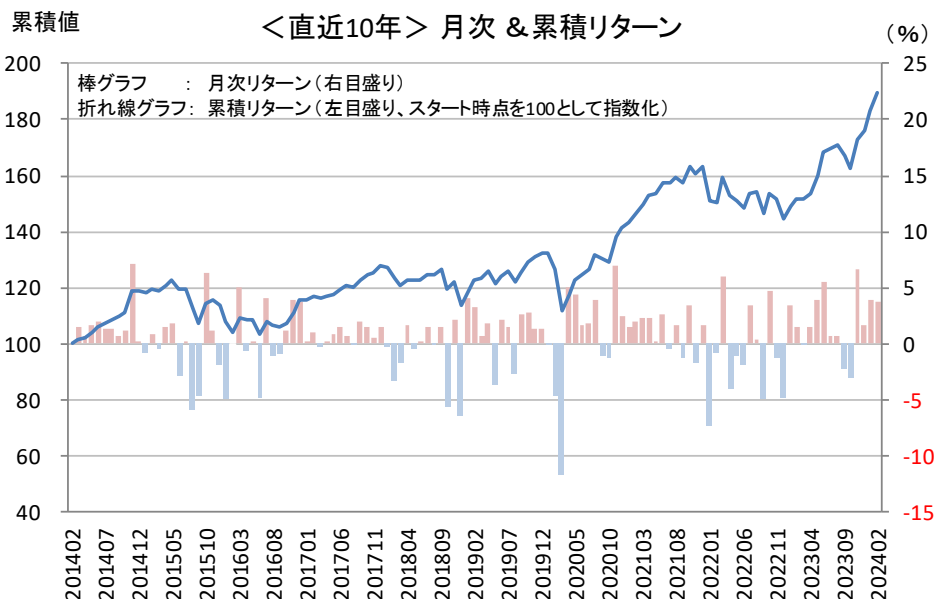
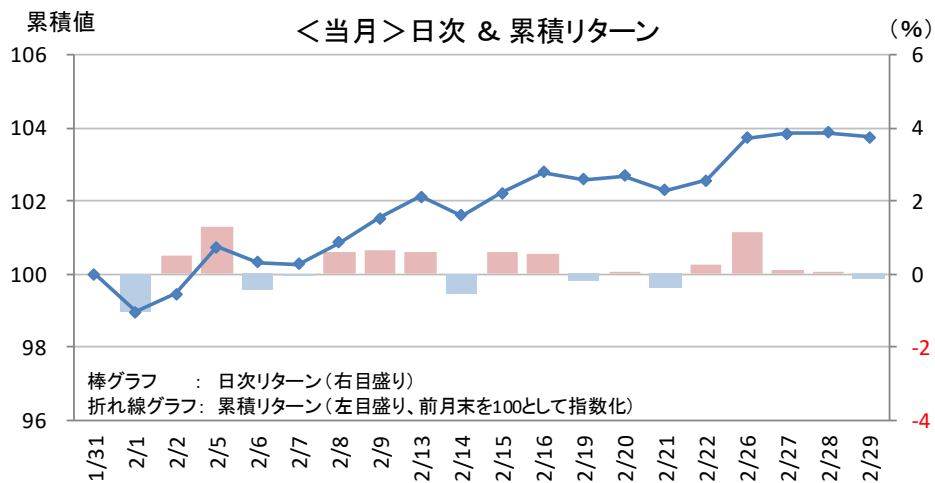
日付	指数	累積リターン
高値 2024/02/28	19,491	+7.96 %
安値 2024/01/04	17,915	-0.77 %

◇純資産総額

当月末	前月末	増減
116兆706億円	110兆7,793億円	+5兆2,914億円

◇月間設定・解約額<ネット>

(弊社推計値)	+14,042億円
---------	-----------



<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	19,468	18,763	704	3.75
国内株式	27,111	25,633	1,478	5.77
国内債券	12,418	12,384	35	0.28
外国株式(先進国)	28,001	26,612	1,389	5.22
エマージング株式	23,340	22,152	1,188	5.36
外国債券(先進国)	19,510	19,409	101	0.52
エマージング債券	21,872	21,375	496	2.32
ハイイールド債券	30,264	29,675	588	1.98
複合資産	21,203	20,782	421	2.03
国内REIT 10,000 (2003.10.31)	32,736	34,332	-1,596	-4.65
外国REIT 10,000 (2003.09.30)	37,180	36,580	600	1.64
その他	7,289	7,108	181	2.55

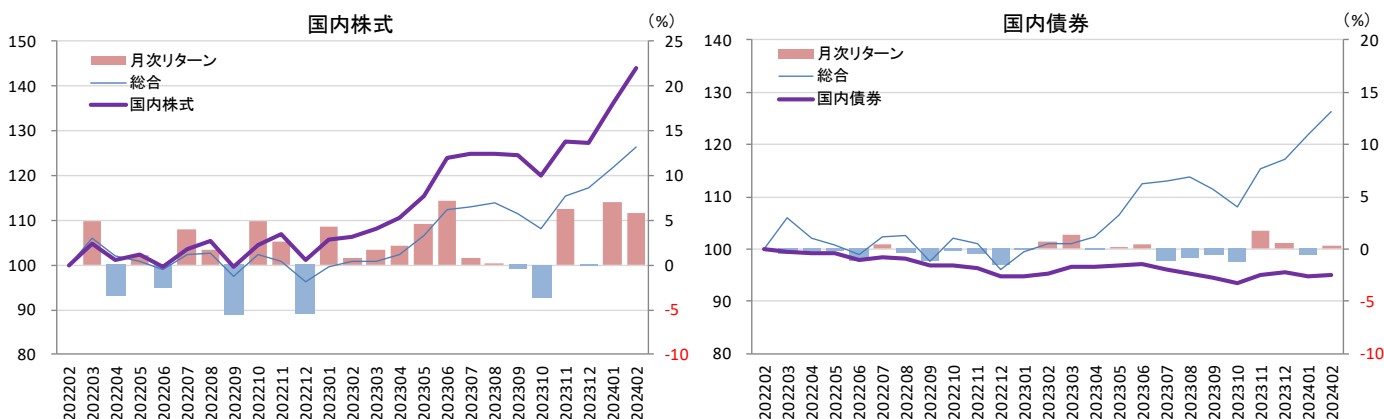
※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000
[色塗りの基準]月次リターン>総合

(2) 期間別リターン

	3カ月(%)	6カ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	9.57	10.96	25.20	7.83
国内株式	13.04	15.28	35.53	13.20
国内債券	0.15	-0.10	-0.22	-0.37
外国株式(先進国)	13.71	15.76	37.03	10.97
エマージング株式	9.50	11.27	28.42	8.34
外国債券(先進国)	2.59	3.67	8.28	1.45
エマージング債券	4.54	6.52	20.00	5.00
ハイイールド債券	5.54	8.00	18.58	5.52
複合資産	5.41	6.09	13.98	4.36
国内REIT	-6.28	-8.01	-3.80	-4.46
外国REIT	7.08	5.59	11.42	0.66
その他	6.52	8.05	17.94	4.84

※[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	3.75		
1	外国株式(先進国)	5.22	45.62	2.37
2	国内株式	5.77	13.41	0.76
3	複合資産	2.03	13.38	0.27
4	エマージング株式	5.36	3.97	0.21
5	外国REIT	1.64	3.96	0.07
6	その他	2.55	2.42	0.06
7	外国債券(先進国)	0.52	8.41	0.04
8	ハイイールド債券	1.98	1.85	0.04
9	エマージング債券	2.32	1.07	0.02
10	国内債券	0.28	3.79	0.01
11	国内REIT	-4.65	2.13	-0.10
	合計		100.00	3.75

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	25.20		
1	外国株式(先進国)	37.03	43.06	15.64
2	国内株式	35.53	12.96	4.36
3	複合資産	13.98	14.34	2.04
4	エマージング株式	28.42	3.53	0.93
5	外国債券(先進国)	8.28	9.00	0.78
6	外国REIT	11.42	4.44	0.49
7	その他	17.94	2.59	0.46
8	ハイイールド債券	18.58	1.94	0.35
9	エマージング債券	20.00	1.16	0.23
10	国内債券	-0.22	4.25	0.00
11	国内REIT	-3.80	2.73	-0.06
	合計		100.00	25.20

◆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	19,468	18,763	704	3.75	
国内株式	27,111	25,633	1,478	5.77	
ヘッジなし	27,675	26,182	1,494	5.70	
国内債券	12,418	12,384	35	0.28	
ヘッジなし	12,604	12,571	33	0.26	
外国株式(先進国)	28,001	26,612	1,389	5.22	
ヘッジなし	33,590	31,881	1,709	5.36	
円ヘッジ	19,108	18,537	571	3.08	
エマージング株式	23,340	22,152	1,188	5.36	
ヘッジなし	22,627	21,475	1,152	5.37	
円ヘッジ	17,540	16,871	669	3.96	
外国債券(先進国)	19,510	19,409	101	0.52	
ヘッジなし	22,128	21,902	226	1.03	
円ヘッジ	12,996	13,049	-53	-0.40	
エマージング債券	21,872	21,375	496	2.32	
ヘッジなし	24,062	23,512	550	2.34	
円ヘッジ	16,109	16,040	69	0.43	
ハイイールド債券	30,264	29,675	588	1.98	
ヘッジなし	36,186	35,409	778	2.20	
円ヘッジ	16,075	16,123	-49	-0.30	
複合資産	21,203	20,782	421	2.03	
ヘッジなし	22,233	21,754	479	2.20	
円ヘッジ	14,322	14,267	55	0.38	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	32,736	34,332	-1,596	-4.65
ヘッジなし	10,000 (2003.10.31)	32,703	34,334	-1,631	-4.75
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	37,180	36,580	600	1.64
ヘッジなし	10,000 (2003.09.30)	38,411	37,766	645	1.71
円ヘッジ	10,000 (2003.10.31)	16,438	16,533	-96	-0.58
その他		7,289	7,108	181	2.55

※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	9.57	10.96	25.20	7.83
国内株式	13.04	15.28	35.53	13.20
ヘッジなし	12.99	15.17	34.99	13.06
国内債券	0.15	-0.10	-0.22	-0.37
ヘッジなし	0.03	-0.14	-0.39	-0.43
外国株式(先進国)	13.71	15.76	37.03	10.97
ヘッジなし	13.93	16.11	38.41	11.34
円ヘッジ	11.21	11.47	21.77	5.63
エマージング株式	9.50	11.27	28.42	8.34
ヘッジなし	9.51	11.31	28.53	8.36
円ヘッジ	-0.09	-5.16	-10.20	-1.24
外国債券(先進国)	2.59	3.67	8.28	1.45
ヘッジなし	3.46	5.15	12.77	2.68
円ヘッジ	0.82	0.83	0.01	-0.90
エマージング債券	4.54	6.52	20.00	5.00
ヘッジなし	4.42	6.21	20.54	5.41
円ヘッジ	2.59	2.88	2.82	-1.16
ハイイールド債券	5.54	8.00	18.58	5.52
ヘッジなし	5.93	8.32	19.70	6.44
円ヘッジ	2.16	2.50	2.94	-0.48
複合資産	5.41	6.09	13.98	4.36
ヘッジなし	5.70	6.66	15.88	4.85
円ヘッジ	3.74	2.82	3.15	0.32
国内REIT	-6.28	-8.01	-3.80	-4.46
ヘッジなし	-6.45	-8.22	-4.33	-4.68
外国REIT	7.08	5.59	11.42	0.66
ヘッジなし	7.23	5.82	11.92	0.84
円ヘッジ	3.25	-0.41	-4.29	-5.49
その他	6.52	8.05	17.94	4.84

※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）」

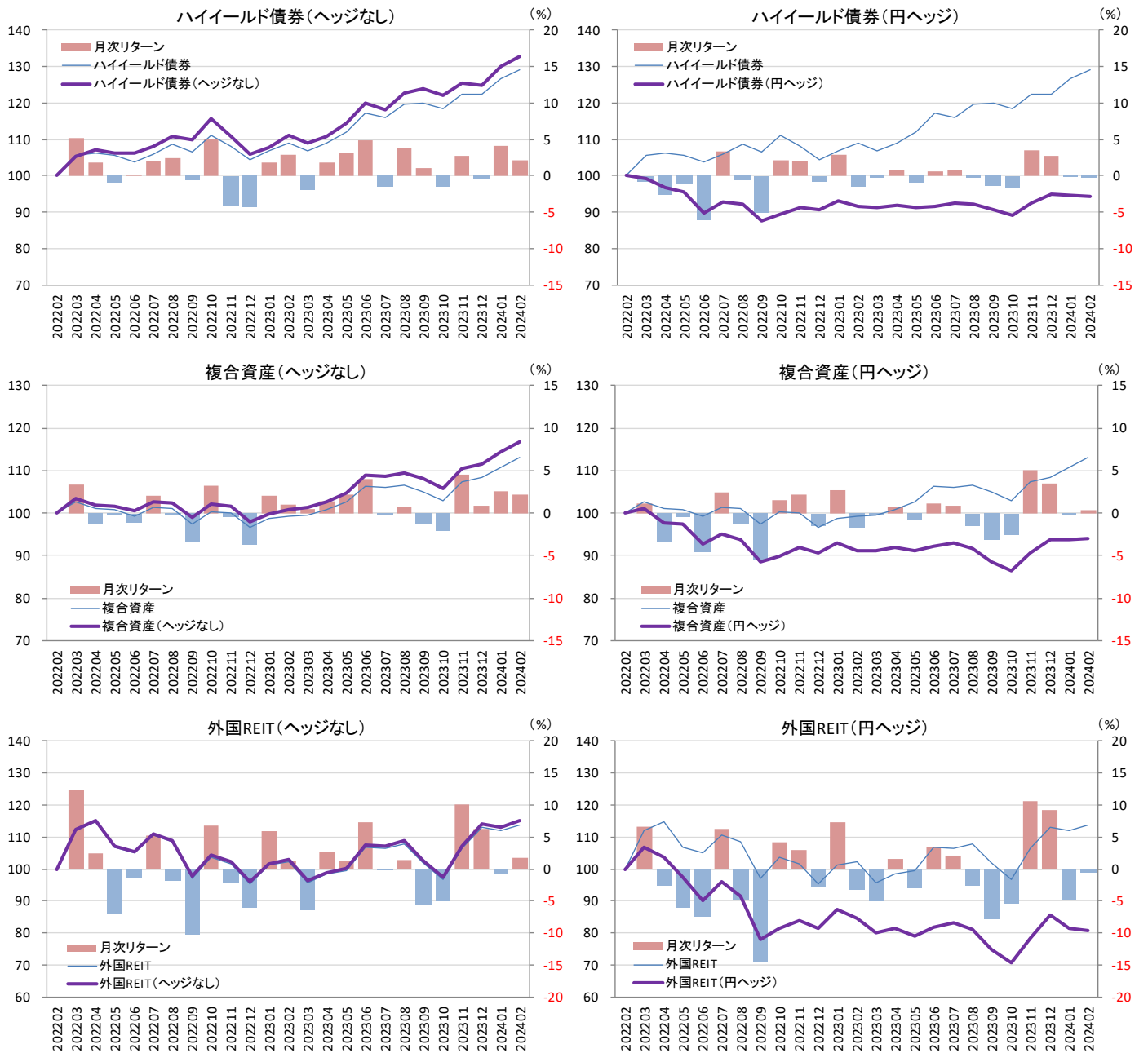
(3) リターン推移（24ヵ月前を100として指数化（折れ線グラフ、左目盛り））



<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	3.75		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	5.36	42.91	2.29
2	国内株式(ヘッジなし)	5.70	13.05	0.73
3	複合資産(ヘッジなし)	2.20	11.21	0.25
4	エマージング株式(ヘッジなし)	5.37	3.96	0.21
5	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	3.08	2.19	0.07
6	外国REIT(ヘッジなし)	1.71	3.78	0.07
7	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	1.03	5.37	0.06
8	その他(ヘッジなし)	2.87	1.33	0.04
9	ハイイールド債券(ヘッジなし)	2.20	1.40	0.03
10	エマージング債券(ヘッジなし)	2.34	0.88	0.02
11	その他(円ヘッジ)	1.89	0.74	0.01
12	国内債券(ヘッジなし)	0.26	2.80	0.01
13	国内債券(円ヘッジ)	0.33	0.99	0.00
14	複合資産(円ヘッジ)	0.38	0.52	0.00
15	国内株式(円ヘッジ)	7.09	0.02	0.00
16	エマージング債券(円ヘッジ)	0.43	0.04	0.00
17	エマージング株式(円ヘッジ)	3.96	0.00	0.00
18	ハイイールド債券(円ヘッジ)	-0.30	0.13	-0.00
19	外国REIT(円ヘッジ)	-0.58	0.12	-0.00
20	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	-0.40	2.12	-0.01
21	国内REIT(ヘッジなし)	-4.75	2.07	-0.10
	合計		95.65	3.67

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	25.20		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	38.41	39.88	14.97
2	国内株式(ヘッジなし)	34.99	12.58	4.19
3	複合資産(ヘッジなし)	15.88	11.83	1.90
4	エマージング株式(ヘッジなし)	28.53	3.52	0.94
5	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	12.77	5.67	0.74
6	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	21.77	2.60	0.54
7	外国REIT(ヘッジなし)	11.92	4.23	0.49
8	ハイイールド債券(ヘッジなし)	19.70	1.41	0.27
9	その他(円ヘッジ)	32.27	0.77	0.23
10	その他(ヘッジなし)	14.41	1.40	0.20
11	エマージング債券(ヘッジなし)	20.54	0.94	0.19
12	複合資産(円ヘッジ)	3.15	0.64	0.02
13	国内株式(円ヘッジ)	26.20	0.02	0.01
14	国内債券(円ヘッジ)	0.28	1.09	0.01
15	ハイイールド債券(円ヘッジ)	2.94	0.16	0.00
16	エマージング債券(円ヘッジ)	2.82	0.05	0.00
17	エマージング株式(円ヘッジ)	-10.20	0.01	-0.00
18	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	0.01	2.38	-0.00
19	国内債券(ヘッジなし)	-0.39	3.16	-0.01
20	外国REIT(円ヘッジ)	-4.29	0.14	-0.01
21	国内REIT(ヘッジなし)	-4.33	2.66	-0.07
	合計		95.65	24.61

◆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

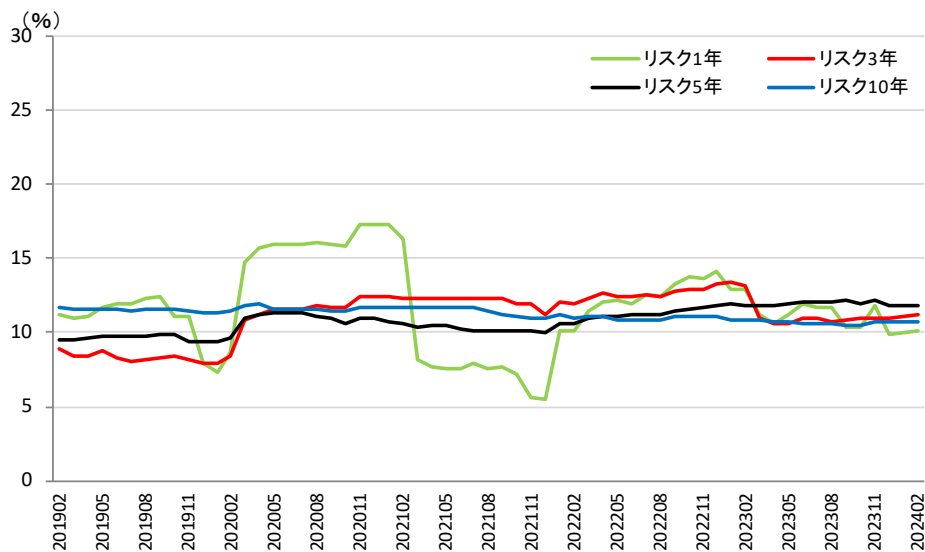
	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	29.60	54.65	89.68	11.18	11.80	10.72	0.81	0.77	0.62
国内株式	41.74	80.40	158.80	13.00	14.95	15.31	0.95	0.84	0.65
国内債券	-5.18	-5.96	0.27	2.43	2.33	1.98	-0.71	-0.51	0.02
外国株式(先進国)	41.86	100.58	157.32	16.74	17.49	16.12	0.74	0.86	0.62
エマージング株式	28.74	65.56	112.30	10.37 ↓	17.09	16.11	0.85	0.62	0.49
外国債券(先進国)	5.47	12.01	16.77	4.95	4.94	5.33	0.37	0.47	0.30
エマージング債券	32.60	29.65	43.88	7.37	10.50	10.57	1.34	0.51	0.35
ハイイールド債券	36.10	41.26	64.69	7.82	11.26	10.42	1.39	0.64	0.49
複合資産	16.24	27.00	50.66	6.61	7.17	7.14	0.78	0.69	0.59
国内REIT	-1.55	9.58	54.81	10.18 ↓	14.90	12.24	-0.05	0.13	0.37
外国REIT	43.63	47.28	111.90	18.17	19.03	16.62	0.71	0.42	0.47

※[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

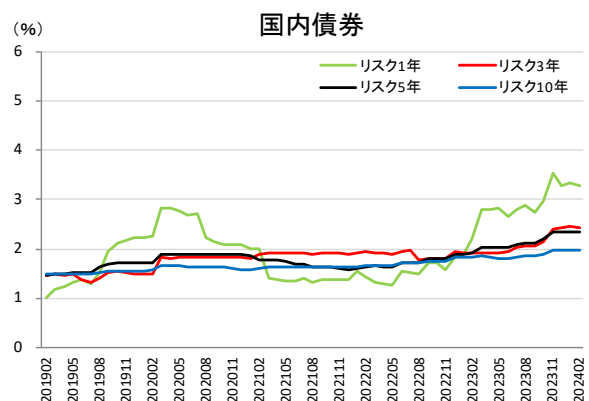
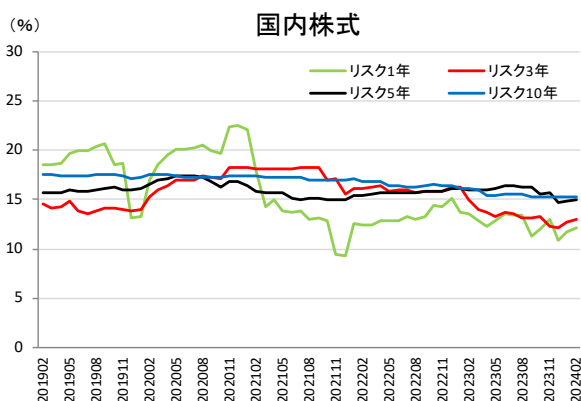
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

(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」

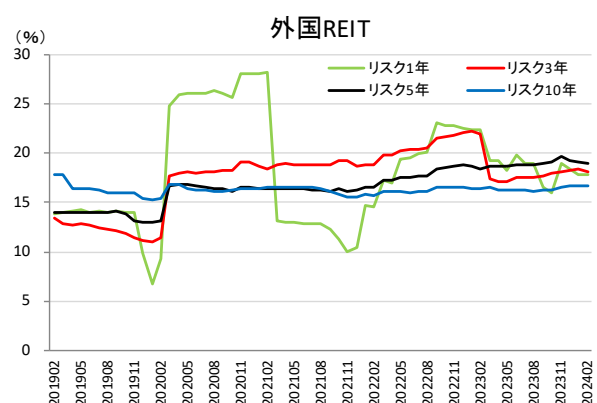
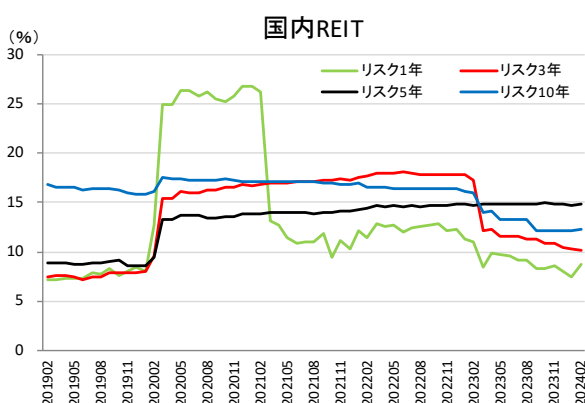
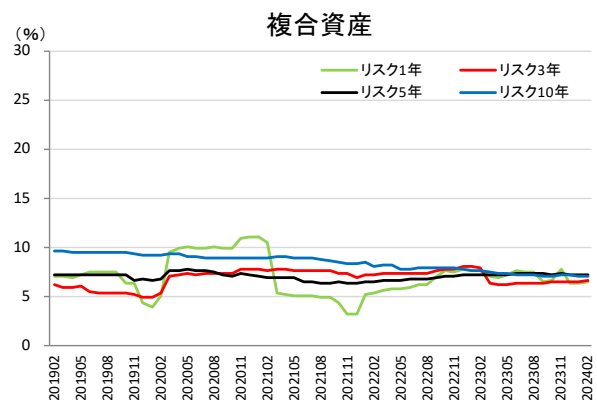
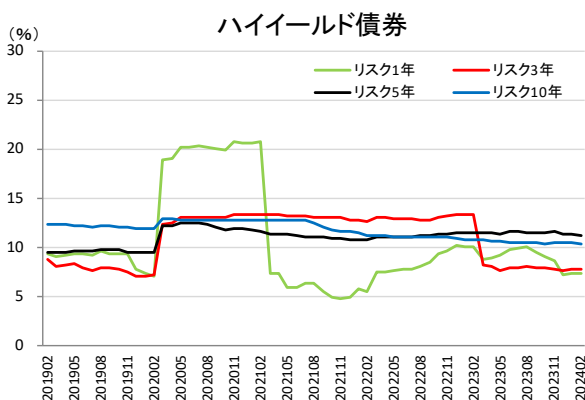
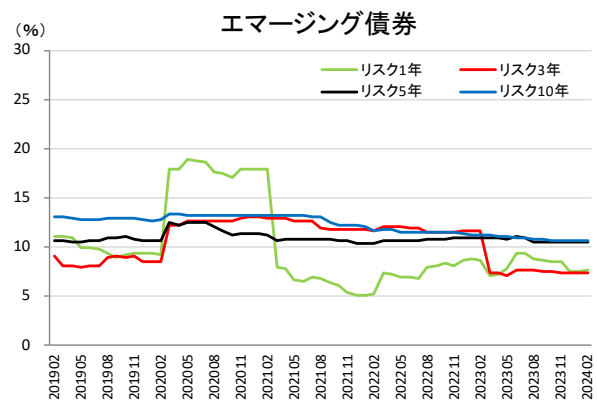
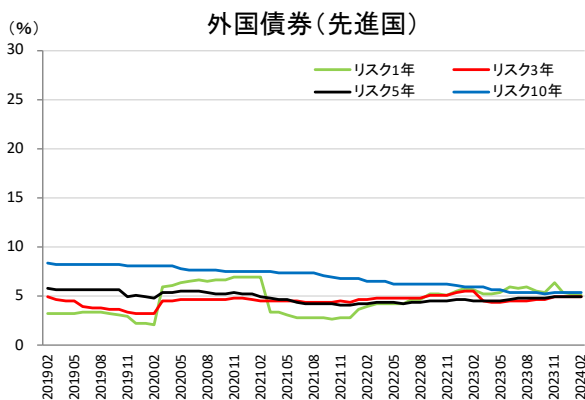
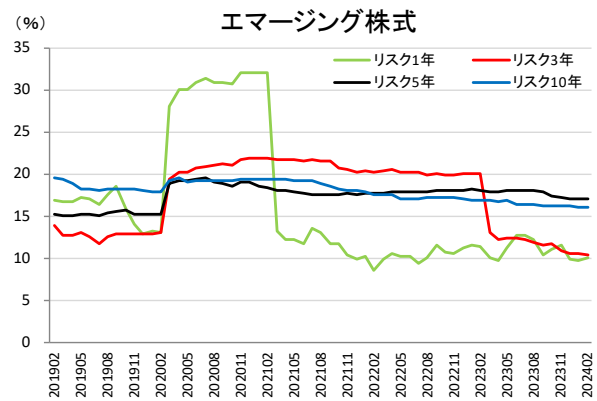
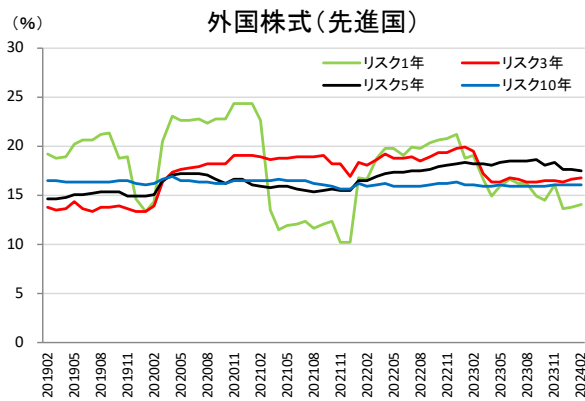


<2> リスク・サマリー

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)

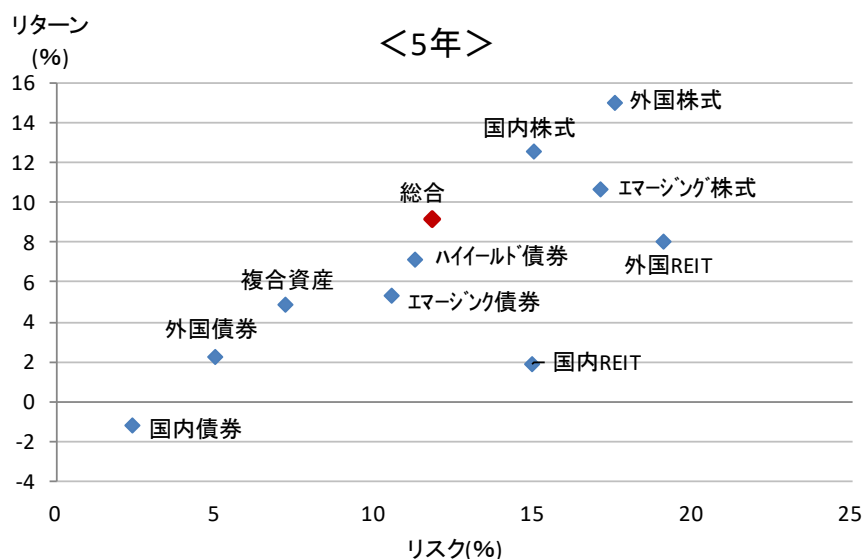
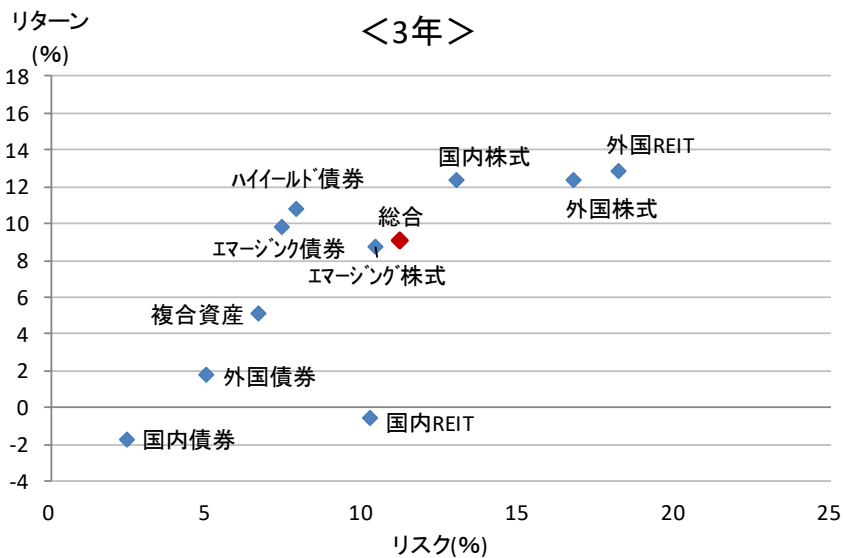
② 「大分類」



<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	9.03	9.11	11.18	11.80
国内株式	12.33	12.52	13.00	14.95
国内債券	-1.76	-1.22	2.43	2.33
外国株式(先進国)	12.36	14.94	16.74	17.49
エマーシング株式	8.79	10.61	10.37	17.09
外国債券(先進国)	1.79	2.29	4.95	4.94
エマーシング債券	9.86	5.33	7.37	10.50
ハイールド債券	10.82	7.15	7.82	11.26
複合資産	5.14	4.90	6.61	7.17
国内REIT	-0.52	1.85	10.18	14.90
外国REIT	12.83	8.05	18.17	19.03

※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）」

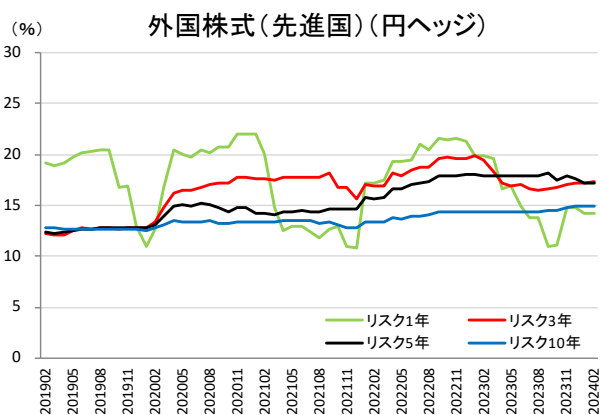
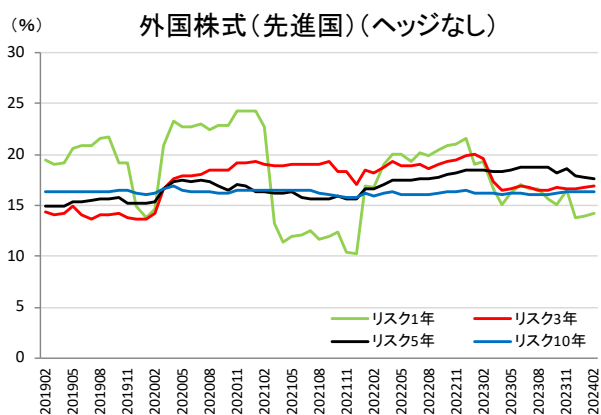
(1) 期間別リスク・リターン

	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	29.60	54.65	89.68	11.18	11.80	10.72	0.81	0.77	0.62
国内株式	41.74	80.40	158.80	13.00	14.95	15.31	0.95	0.84	0.65
ヘッジなし	39.89	79.40	160.27	12.98	14.84	14.87	0.91	0.84	0.68
国内債券	-5.18	-5.96	0.27	2.43	2.33	1.98	-0.71	-0.51	0.02
ヘッジなし	-4.39	-5.41	0.85	2.44	2.30	1.96	-0.60	-0.47	0.05
外国株式(先進国)	41.86	100.58	157.32	16.74	17.49	16.12	0.74	0.86	0.62
ヘッジなし	45.89	107.35	169.64	16.92	17.66 ↓	16.33	0.79	0.89	0.64
円ヘッジ	5.27	51.79	84.18	17.28	17.12	14.86	0.10	0.51	0.43
エマージング株式	28.74	65.56	112.30	10.37 ↓	17.09	16.11	0.85	0.62	0.49
ヘッジなし	29.10	66.00	113.08	10.38 ↓	17.11	16.12	0.86	0.63	0.49
円ヘッジ	-45.45	-24.83	-7.46	19.71	20.73 ↓	19.36	-0.93	-0.27	-0.04
外国債券(先進国)	5.47	12.01	16.77	4.95	4.94	5.33	0.37	0.47	0.30
ヘッジなし	15.23	22.71	27.91	6.55	6.01	6.46	0.74	0.70	0.39
円ヘッジ	-11.30	-5.75	-2.30	4.46	4.59	3.64	-0.87	-0.25	-0.06
エマージング債券	32.60	29.65	43.88	7.37	10.50	10.57	1.34	0.51	0.35
ヘッジなし	38.68	36.68	51.36	7.49	9.67	9.98	1.54	0.67	0.43
円ヘッジ	-18.16	-13.45	-4.08	9.57	11.08	8.69	-0.67	-0.25	-0.05
ハイイールド債券	36.10	41.26	64.69	7.82	11.26	10.42	1.39	0.64	0.49
ヘッジなし	43.74	55.42	92.51	8.40	10.25	9.89	1.53	0.90	0.69
円ヘッジ	-7.00	1.04	10.25	6.96	9.42	7.40	-0.34	0.03	0.14
複合資産	16.24	27.00	50.66	6.61	7.17	7.14	0.78	0.69	0.59
ヘッジなし	20.92	32.80	59.41	6.99	7.49	7.49	0.94	0.78	0.64
円ヘッジ	-4.72	1.12	9.63	7.99 ↑	8.19	6.78	-0.20	0.03	0.14
国内REIT	-1.55	9.58	54.81	10.18 ↓	14.90	12.24	-0.05	0.13	0.37
ヘッジなし	-2.87	8.89	54.51	10.13 ↓	14.77	12.09	-0.09	0.12	0.37
外国REIT	43.63	47.28	111.90	18.17	19.03	16.62	0.71	0.42	0.47
ヘッジなし	45.88	50.50	118.13	18.30	19.07	16.70	0.73	0.45	0.49
円ヘッジ	-6.99	-3.66	16.55	19.25	19.35	15.83	-0.12	-0.04	0.10

※[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

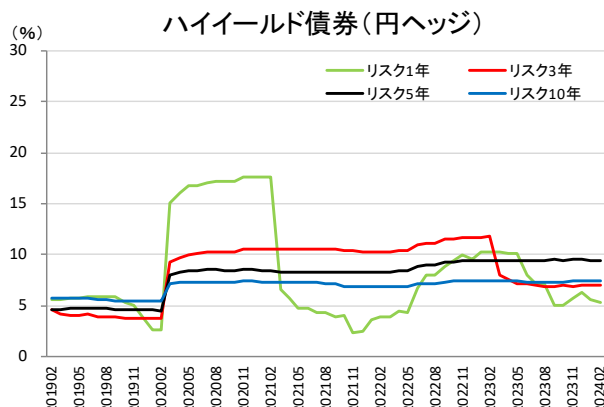
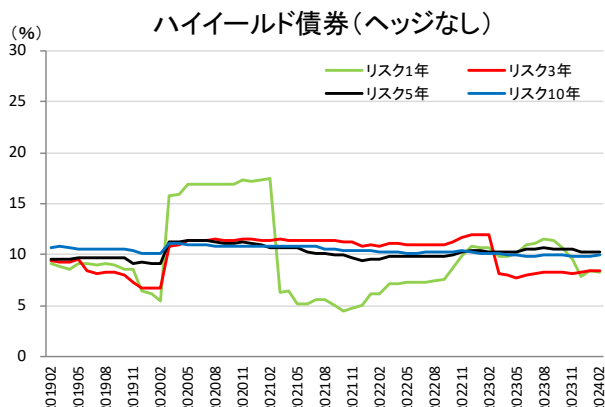
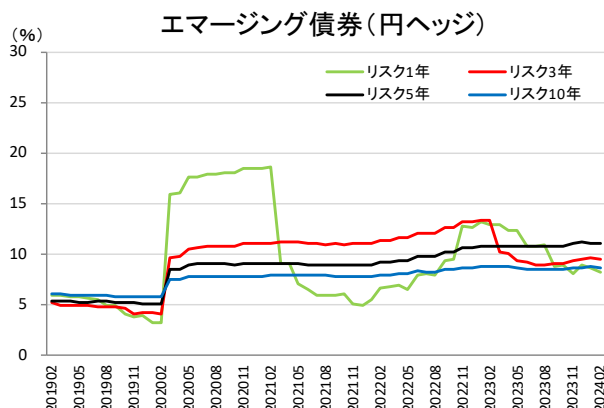
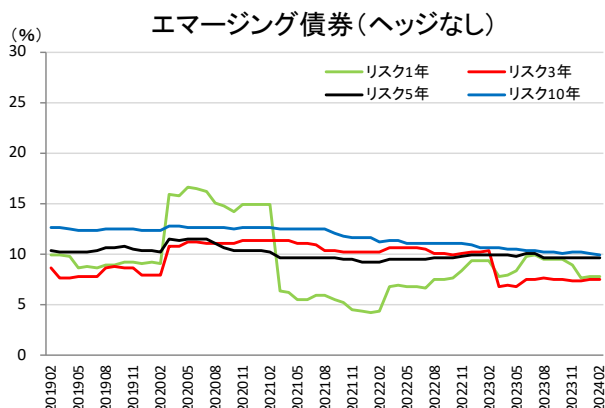
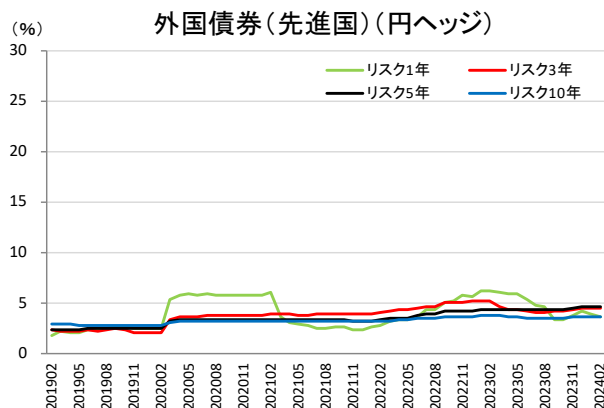
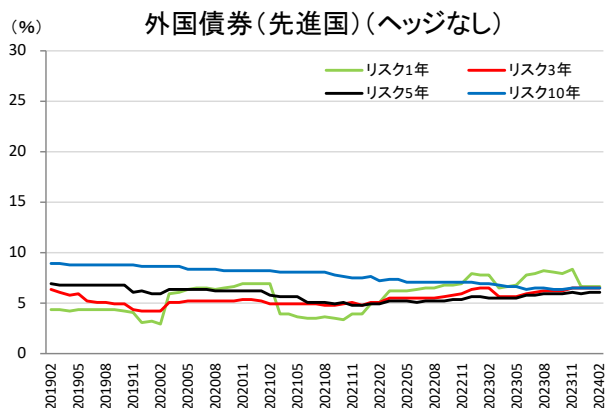
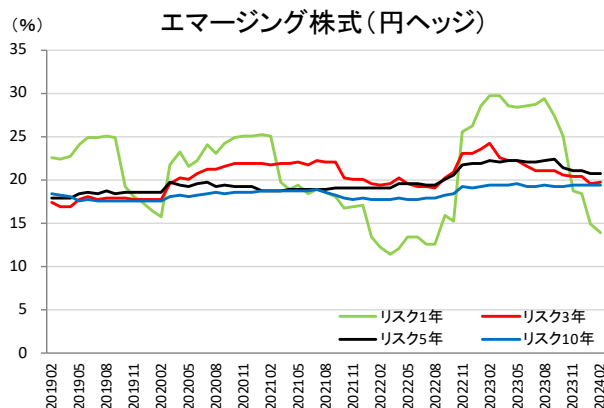
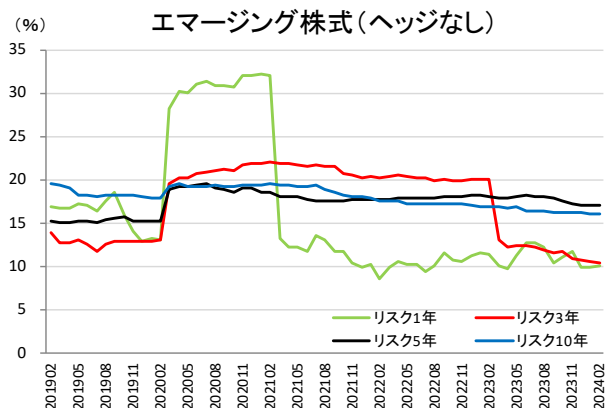
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)



<2> リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

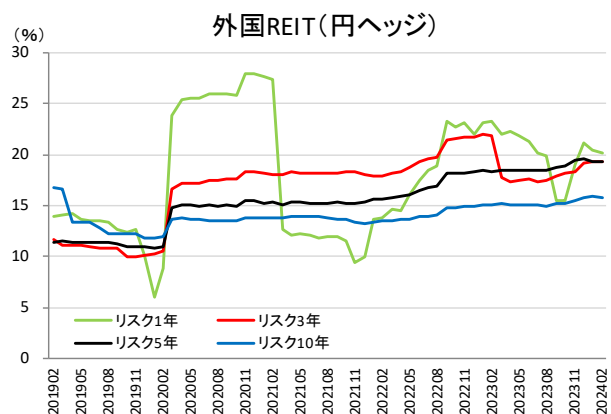
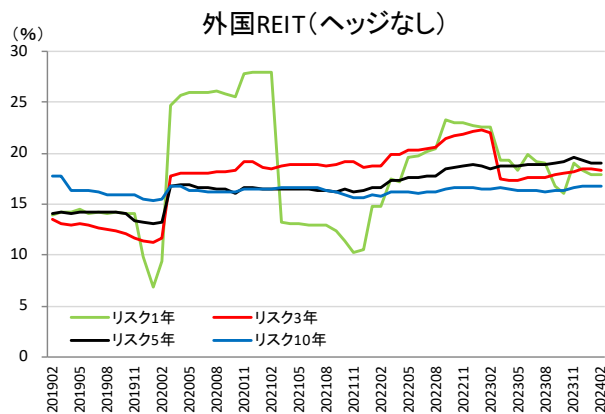
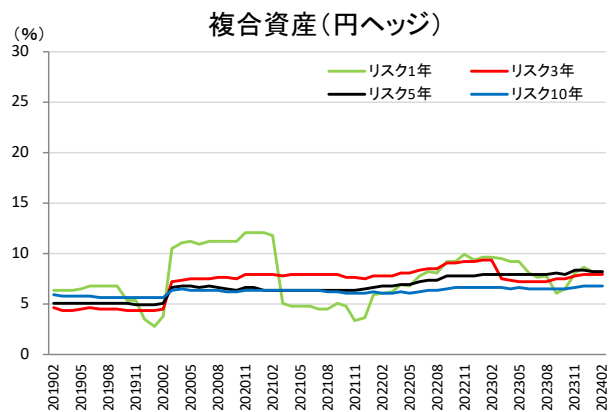
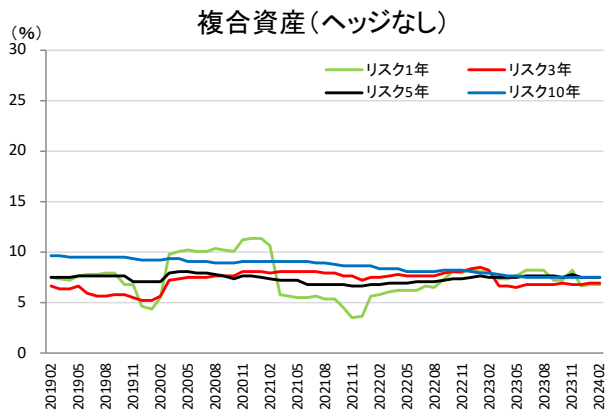
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



<2> リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

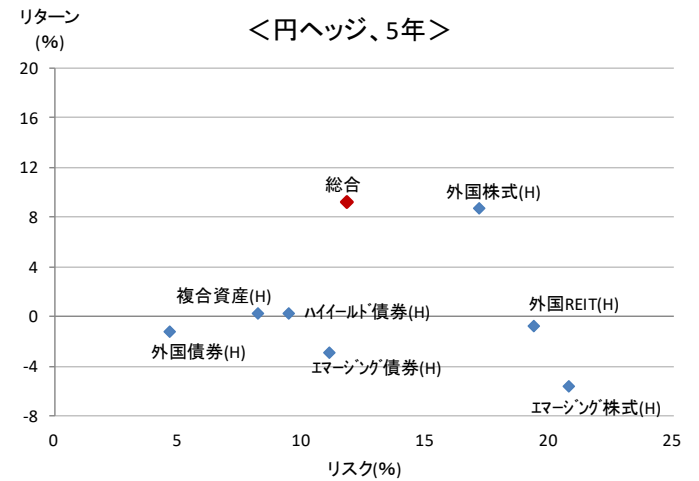
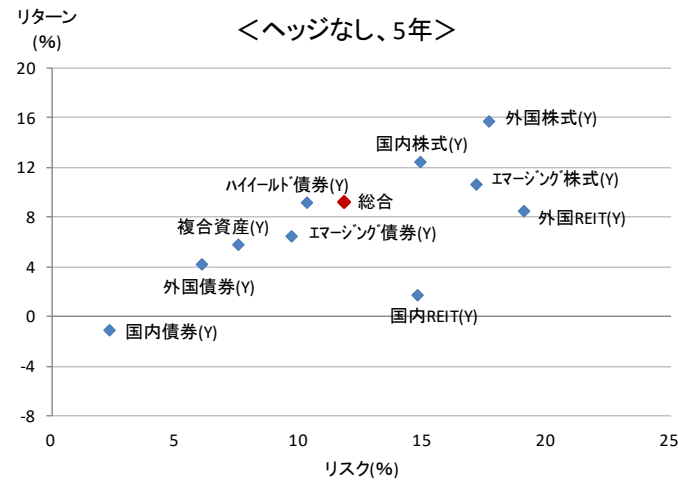
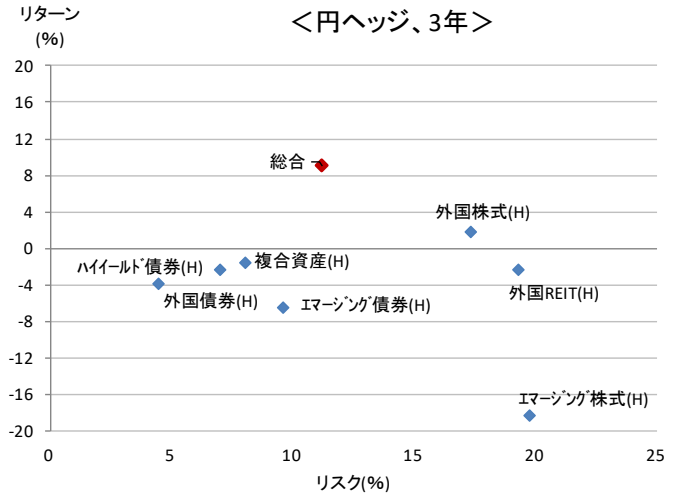
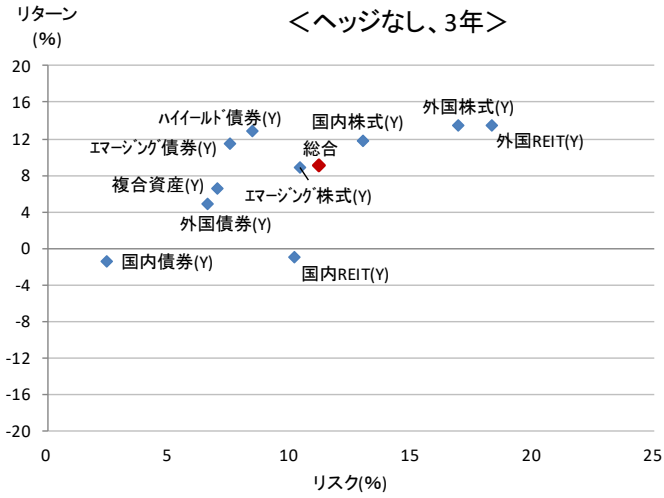
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



<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	9.03	9.11	11.18	11.80
国内株式(Y)	11.84	12.40	12.98	14.84
国内債券(Y)	-1.48	-1.11	2.44	2.30
外国株式(先進国)(Y)	13.42	15.70	16.92	17.66
エマーシング株式(Y)	8.89	10.67	10.38	17.11
外国債券(先進国)(Y)	4.84	4.18	6.55	6.01
エマーシング債券(Y)	11.52	6.45	7.49	9.67
ハイールド債券(Y)	12.86	9.22	8.40	10.25
複合資産(Y)	6.54	5.84	6.99	7.49
国内REIT(Y)	-0.97	1.72	10.13	14.77
外国REIT(Y)	13.41	8.52	18.30	19.07

<円ヘッジ>	リターン(%)		リスク(%)	
	3年	5年	3年	5年
総合	9.03	9.11	11.18	11.80
外国株式(先進国)(H)	1.73	8.70	17.28	17.12
エマーシング株式(H)	-18.29	-5.55	19.71	20.73
外国債券(先進国)(H)	-3.92	-1.18	4.46	4.59
エマーシング債券(H)	-6.46	-2.85	9.57	11.08
ハイールド債券(H)	-2.39	0.21	6.96	9.42
複合資産(H)	-1.60	0.22	7.99	8.19
外国REIT(H)	-2.39	-0.74	19.25	19.35

※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	14,042	30,221	54,070	85,340
国内株式	1,450	3,428	7,456	10,656
国内債券	119	-169	1,656	1,138
外国株式(先進国)	9,952	22,445	34,250	47,118
エマージング株式	1,476	3,867	6,981	11,180
外国債券(先進国)	644	1,408	3,624	7,967
エマージング債券	65	-19	-26	157
ハイイールド債券	40	155	541	1,394
複合資産	641	1,004	2,307	5,414
国内REIT	-191	-826	-1,300	-821
外国REIT	-163	-853	-963	236
その他	9	-220	-455	903

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	14,042	30,221	54,070	85,340
国内株式	1,450	3,428	7,456	10,656
ヘッジなし	1,482	3,532	7,661	11,164
国内債券	119	-169	1,656	1,138
ヘッジなし	201	124	856	923
外国株式(先進国)	9,952	22,445	34,250	47,118
ヘッジなし	10,621	24,382	37,940	53,402
円ヘッジ	-560	-1,610	-3,029	-5,260
エマージング株式	1,476	3,867	6,981	11,180
ヘッジなし	1,478	3,874	6,995	11,194
円ヘッジ	-1	-4	-5	-8
外国債券(先進国)	644	1,408	3,624	7,967
ヘッジなし	530	1,151	2,139	4,878
円ヘッジ	89	271	278	1,810
エマージング債券	65	-19	-26	157
ヘッジなし	90	66	128	432
円ヘッジ	-6	-19	-32	-55
ハイイールド債券	40	155	541	1,394
ヘッジなし	85	450	1,007	2,086
円ヘッジ	-19	-56	-96	-106
複合資産	641	1,004	2,307	5,414
ヘッジなし	852	1,798	3,289	6,820
円ヘッジ	-51	-332	-485	-665
国内REIT	-191	-826	-1,300	-821
ヘッジなし	-181	-798	-1,242	-697
外国REIT	-163	-853	-963	236
ヘッジなし	-144	-823	-894	286
円ヘッジ	-10	5	1	82
その他	9	-220	-455	903

< 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	1,160,706	100.0	5,380	100.0
国内株式	157,586	13.6	772	14.3
国内債券	42,960	3.7	148	2.8
外国株式(先進国)	534,497	46.0	1,221	22.7
エマージング株式	46,583	4.0	312	5.8
外国債券(先進国)	95,719	8.2	751	14.0
エマージング債券	12,276	1.1	239	4.4
ハイイールド債券	21,103	1.8	239	4.4
複合資産	153,637	13.2	1,062	19.7
国内REIT	23,461	2.0	142	2.6
外国REIT	45,015	3.9	270	5.0
その他	27,869	2.4	224	4.2

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	1,160,706	100.0	5,380	100.0
国内株式	157,586	13.6	772	14.3
ヘッジなし	153,342	13.2	721	13.4
国内債券	42,960	3.7	148	2.8
ヘッジなし	31,768	2.7	139	2.6
外国株式(先進国)	534,497	46.0	1,221	22.7
ヘッジなし	503,717	43.4	925	17.2
円ヘッジ	24,844	2.1	229	4.3
エマージング株式	46,583	4.0	312	5.8
ヘッジなし	46,504	4.0	297	5.5
円ヘッジ	50	0.0	10	0.2
外国債券(先進国)	95,719	8.2	751	14.0
ヘッジなし	61,388	5.3	425	7.9
円ヘッジ	23,972	2.1	247	4.6
エマージング債券	12,276	1.1	239	4.4
ヘッジなし	10,149	0.9	136	2.5
円ヘッジ	492	0.0	29	0.5
ハイイールド債券	21,103	1.8	239	4.4
ヘッジなし	16,061	1.4	75	1.4
円ヘッジ	1,515	0.1	64	1.2
複合資産	153,637	13.2	1,062	19.7
ヘッジなし	129,000	11.1	809	15.0
円ヘッジ	5,935	0.5	73	1.4
国内REIT	23,461	2.0	142	2.6
ヘッジなし	22,784	2.0	123	2.3
外国REIT	45,015	3.9	270	5.0
ヘッジなし	43,030	3.7	189	3.5
円ヘッジ	1,350	0.1	55	1.0
その他	27,869	2.4	224	4.2

< 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	15,504	10.3	2.69	2.39	1.092
国内株式	23,200	14.4	1.59	1.27	1.004
国内債券	10,335	12.3	0.12	0.12	0.454
外国株式(先進国)	19,071	7.8	3.14	2.65	1.125
エマージング株式	14,850	11.0	3.61	2.81	1.658
外国債券(先進国)	10,516	10.7	1.38	1.30	0.967
エマージング債券	10,072	12.2	3.85	3.41	1.387
ハイイールド債券	10,191	12.7	5.17	4.65	1.660
複合資産	14,259	9.7	1.12	1.05	0.920
国内REIT	13,114	10.2	7.62	9.17	0.905
外国REIT	12,862	9.7	8.22	8.33	1.445

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	15,504	10.3	2.69	2.39	1.092
国内株式	23,200	14.4	1.59	1.27	1.004
ヘッジなし	22,915	14.6	1.48	1.20	0.987
国内債券	10,335	12.3	0.12	0.12	0.454
ヘッジなし	10,396	12.6	0.13	0.14	0.372
外国株式(先進国)	19,071	7.8	3.14	2.65	1.125
ヘッジなし	20,735	7.5	3.21	2.70	1.096
円ヘッジ	13,781	8.0	1.82	1.49	1.552
エマージング株式	14,850	11.0	3.61	2.81	1.658
ヘッジなし	15,167	11.0	3.61	2.82	1.659
円ヘッジ	9,181	12.2	0.32	0.43	1.671
外国債券(先進国)	10,516	10.7	1.38	1.30	0.967
ヘッジなし	11,904	12.3	1.69	1.57	0.949
円ヘッジ	8,670	8.1	0.79	0.83	0.871
エマージング債券	10,072	12.2	3.85	3.41	1.387
ヘッジなし	11,048	11.7	3.68	3.26	1.320
円ヘッジ	6,988	12.6	3.07	3.14	1.628
ハイイールド債券	10,191	12.7	5.17	4.65	1.660
ヘッジなし	12,196	12.6	5.48	4.91	1.661
円ヘッジ	8,341	13.1	2.85	2.90	1.632
複合資産	14,259	9.7	1.12	1.05	0.920
ヘッジなし	15,150	10.7	1.20	1.12	0.840
円ヘッジ	10,548	8.6	1.12	1.17	1.382
国内REIT	13,114	10.2	7.62	9.17	0.905
ヘッジなし	12,601	10.1	7.67	9.28	0.891
外国REIT	12,862	9.7	8.22	8.33	1.445
ヘッジなし	13,566	9.7	8.29	8.39	1.446
円ヘッジ	9,507	8.5	4.54	5.29	1.268

(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、川真田

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