

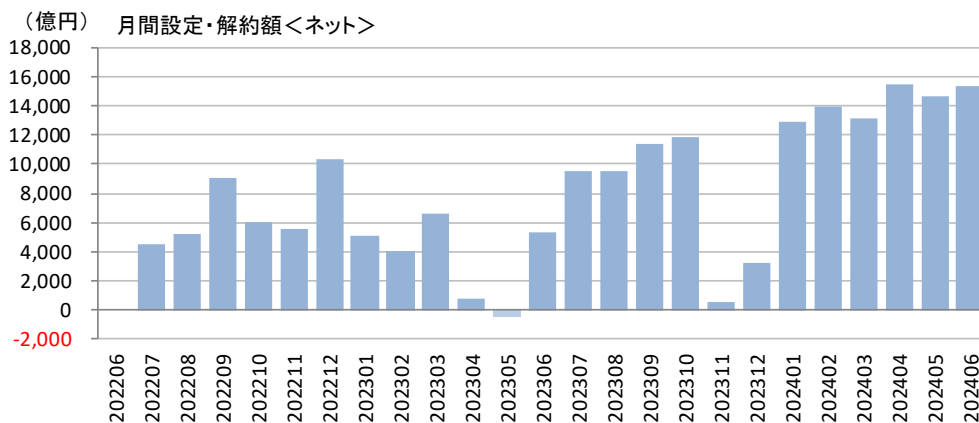
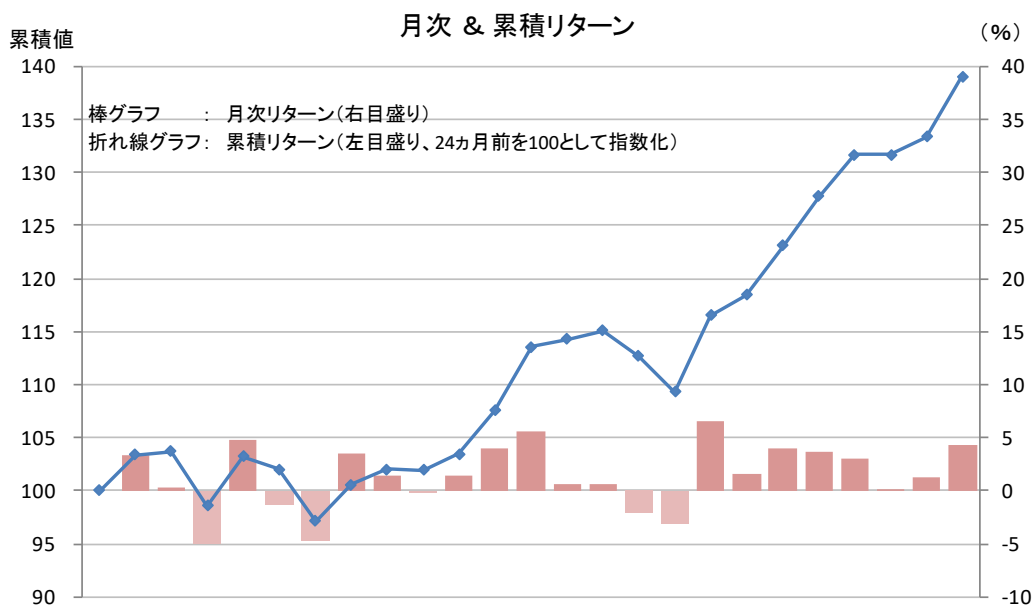
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

— Vol.1 ファンド大分類 編 —

2024年6月

「総合」 +4.26 %
(前月 +1.28 %)



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6月のMAB-FPI

<1>パフォーマンス・サマリー

6月のMAB-FPI「総合」は4.26%上昇し、21,199ポイント（算出来高値）。
純資産総額は前月末比6兆4,775億円増加し131兆1,636億円。

「大分類別」では、エマージング株式+7.39%、外国株式(先進国)+6.01%、外国REIT+4.90%など10カテゴリーで上昇し、下落したのは国内REIT-0.29%の1つのみ。

「総合」への寄与度では、外国株式(先進国)+2.86%、エマージング株式+0.33%、複合資産+0.31%、国内株式+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、国内株式とエマージング株式の3年リスクに上昇傾向が見られる。
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+1兆5,350億円と、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+1兆1,284億円と大幅な流入超となり、続いてエマージング株式+2,527億円、複合資産+1,255億円など、8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その他-193億円、外国REIT-162億円、そして国内REIT-84億円の3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
21,199	20,332	+867	+4.26 %

◇累積リターン

3か月	+5.63 %
6か月	+17.42 %
1年	+22.49 %
年初来	+17.42 %

◇年初来高値/安値

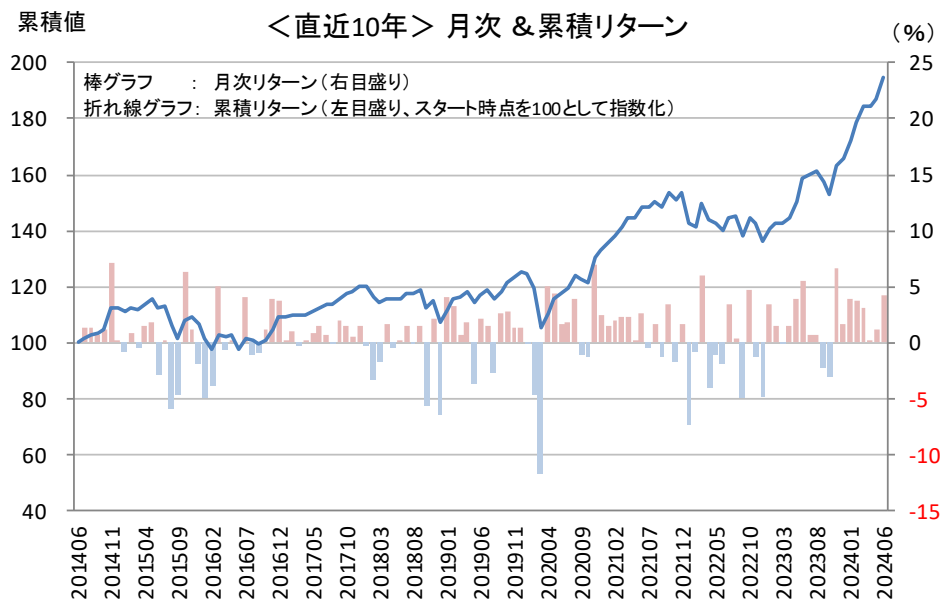
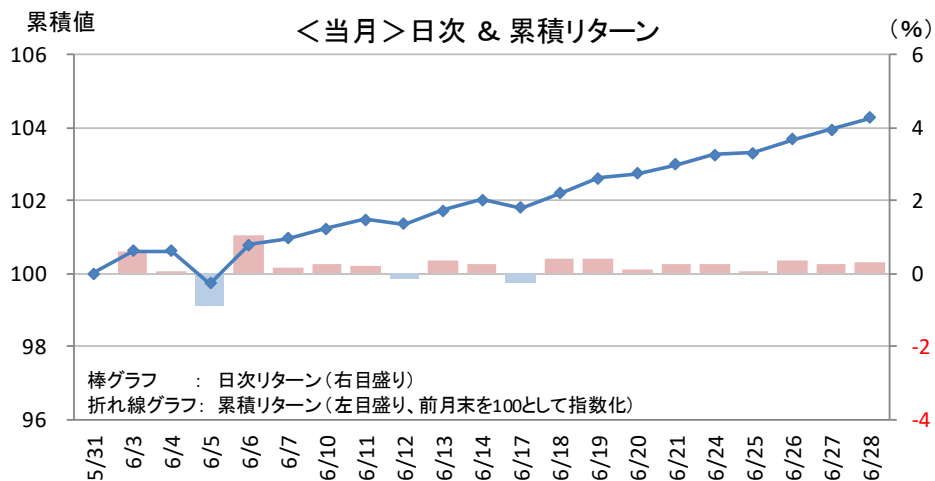
日付	指数	累積リターン
高値 2024/06/28	21,199	+17.42 %
安値 2024/01/04	17,915	-0.77 %

◇純資産総額

当月末	前月末	増減
131兆1,636億円	124兆6,861億円	+6兆4,775億円

◇月間設定・解約額<ネット>

(弊社推計値)	+15,350億円
---------	-----------



<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	21,199	20,332	867	4.26
国内株式	28,395	27,808	587	2.11
国内債券	12,148	12,130	18	0.15
外国株式(先進国)	31,538	29,751	1,787	6.01
エマージング株式	27,046	25,186	1,860	7.39
外国債券(先進国)	20,418	19,942	476	2.39
エマージング債券	22,989	22,661	327	1.44
ハイイールド債券	32,556	31,671	885	2.79
複合資産	22,315	21,783	532	2.44
国内REIT 10,000 (2003.10.31)	33,578	33,677	-99	-0.29
外国REIT 10,000 (2003.09.30)	40,235	38,357	1,879	4.90
その他	7,840	7,649	192	2.51

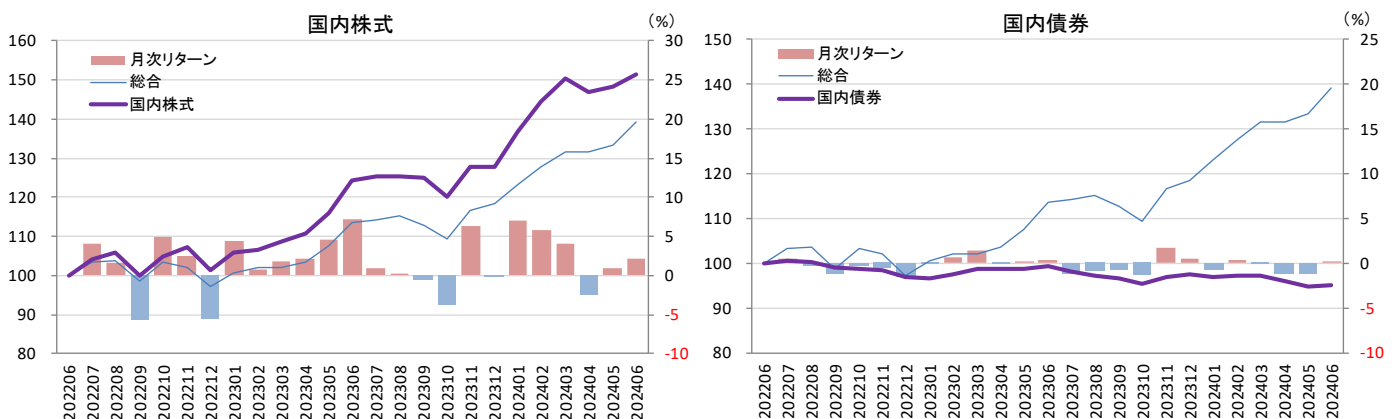
※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000
[色塗りの基準]月次リターン>総合

(2) 期間別リターン

	3カ月(%)	6カ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	5.63	17.42	22.49	17.42
国内株式	0.59	18.56	21.84	18.56
国内債券	-2.14	-2.53	-4.23	-2.53
外国株式(先進国)	8.73	24.99	33.44	24.99
エマージング株式	13.89	25.54	32.47	25.54
外国債券(先進国)	3.48	6.17	8.46	6.17
エマージング債券	3.86	10.36	13.15	10.36
ハイイールド債券	6.03	13.51	18.51	13.51
複合資産	2.75	9.84	12.07	9.84
国内REIT	-2.91	-2.00	-3.48	-2.00
外国REIT	4.64	8.93	15.56	8.93
その他	3.21	12.77	17.40	12.77

※[色塗りの基準]期間別リターン>総合

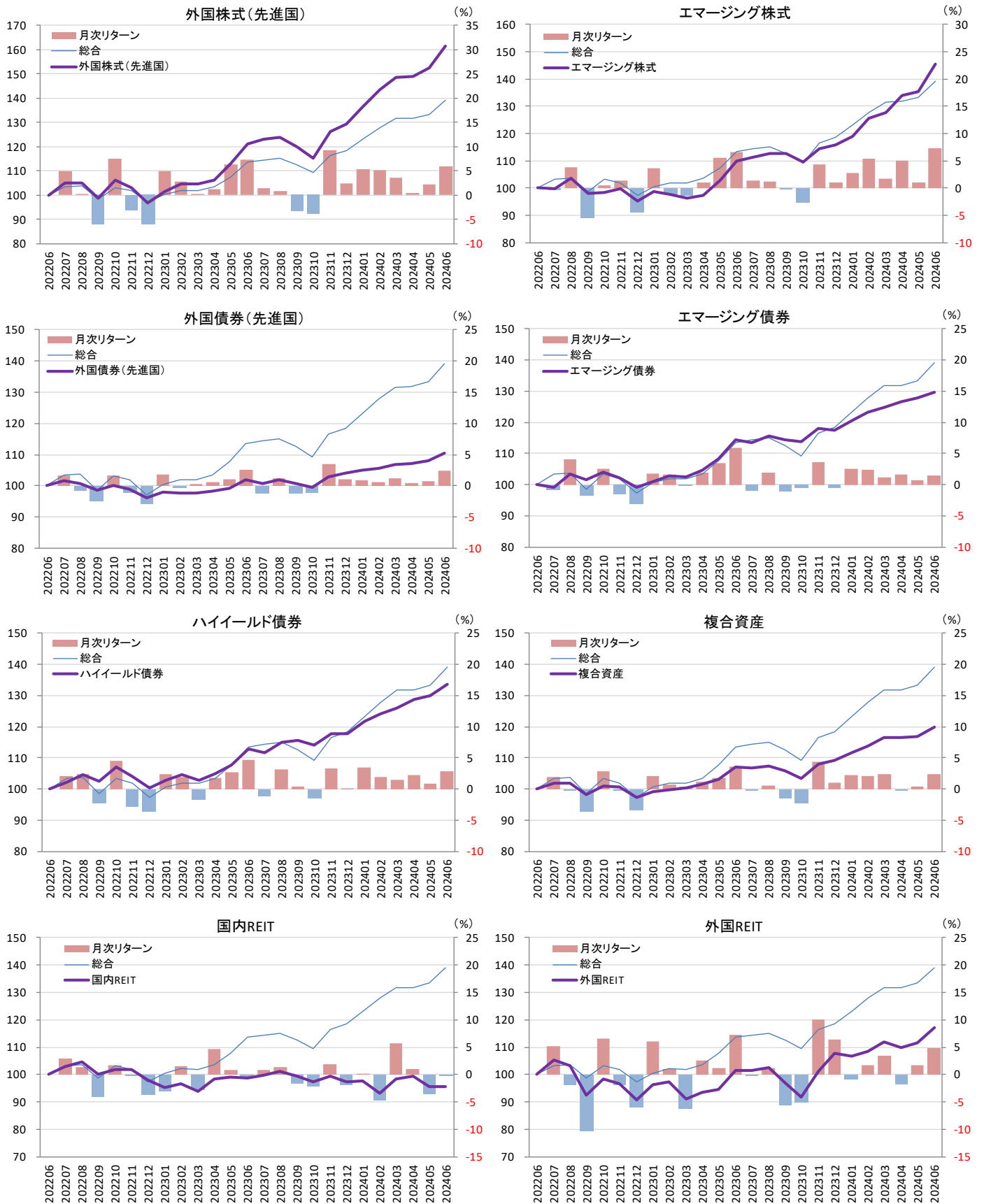
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化(折れ線グラフ、左目盛り))



<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	4.26		
1	外国株式(先進国)	6.01	47.82	2.86
2	エマージング株式	7.39	4.58	0.33
3	複合資産	2.44	12.65	0.31
4	国内株式	2.11	13.08	0.27
5	外国債券(先進国)	2.39	7.89	0.19
6	外国REIT	4.90	3.63	0.18
7	その他	2.51	2.40	0.06
8	ハイイールド債券	2.79	1.73	0.05
9	エマージング債券	1.44	0.99	0.01
10	国内債券	0.15	3.38	0.01
11	国内REIT	-0.29	1.86	-0.01
	合計		100.00	4.26

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	22.49		
1	外国株式(先進国)	33.44	44.78	14.84
2	国内株式	21.84	13.19	2.87
3	複合資産	12.07	13.67	1.63
4	エマージング株式	32.47	3.90	1.20
5	外国債券(先進国)	8.46	8.57	0.71
6	外国REIT	15.56	4.11	0.60
7	その他	17.40	2.52	0.42
8	ハイイールド債券	18.51	1.87	0.33
9	エマージング債券	13.15	1.10	0.14
10	国内REIT	-3.48	2.38	-0.07
11	国内債券	-4.23	3.91	-0.17
	合計		100.00	22.49

◆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

＜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	21,199	20,332	867	4.26	
国内株式	28,395	27,808	587	2.11	
ヘッジなし	28,942	28,352	591	2.08	
国内債券	12,148	12,130	18	0.15	
ヘッジなし	12,314	12,293	21	0.17	
外国株式(先進国)	31,538	29,751	1,787	6.01	
ヘッジなし	37,980	35,777	2,202	6.16	
円ヘッジ	19,942	19,299	642	3.33	
エマージング株式	27,046	25,186	1,860	7.39	
ヘッジなし	26,224	24,418	1,806	7.39	
円ヘッジ	18,495	18,453	42	0.23	
外国債券(先進国)	20,418	19,942	476	2.39	
ヘッジなし	23,670	22,915	755	3.30	
円ヘッジ	12,994	12,937	58	0.45	
エマージング債券	22,989	22,661	327	1.44	
ヘッジなし	25,337	24,927	410	1.64	
円ヘッジ	16,242	16,157	86	0.53	
ハイイールド債券	32,556	31,671	885	2.79	
ヘッジなし	39,370	38,070	1,300	3.42	
円ヘッジ	16,118	16,044	74	0.46	
複合資産	22,315	21,783	532	2.44	
ヘッジなし	23,496	22,905	591	2.58	
円ヘッジ	14,625	14,376	249	1.73	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	33,578	33,677	-99	-0.29
ヘッジなし	10,000 (2003.10.31)	33,494	33,613	-119	-0.35
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	40,235	38,357	1,879	4.90
ヘッジなし	10,000 (2003.09.30)	41,706	39,707	1,999	5.04
円ヘッジ	10,000 (2003.10.31)	16,450	16,092	358	2.22
その他		7,840	7,649	192	2.51

※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

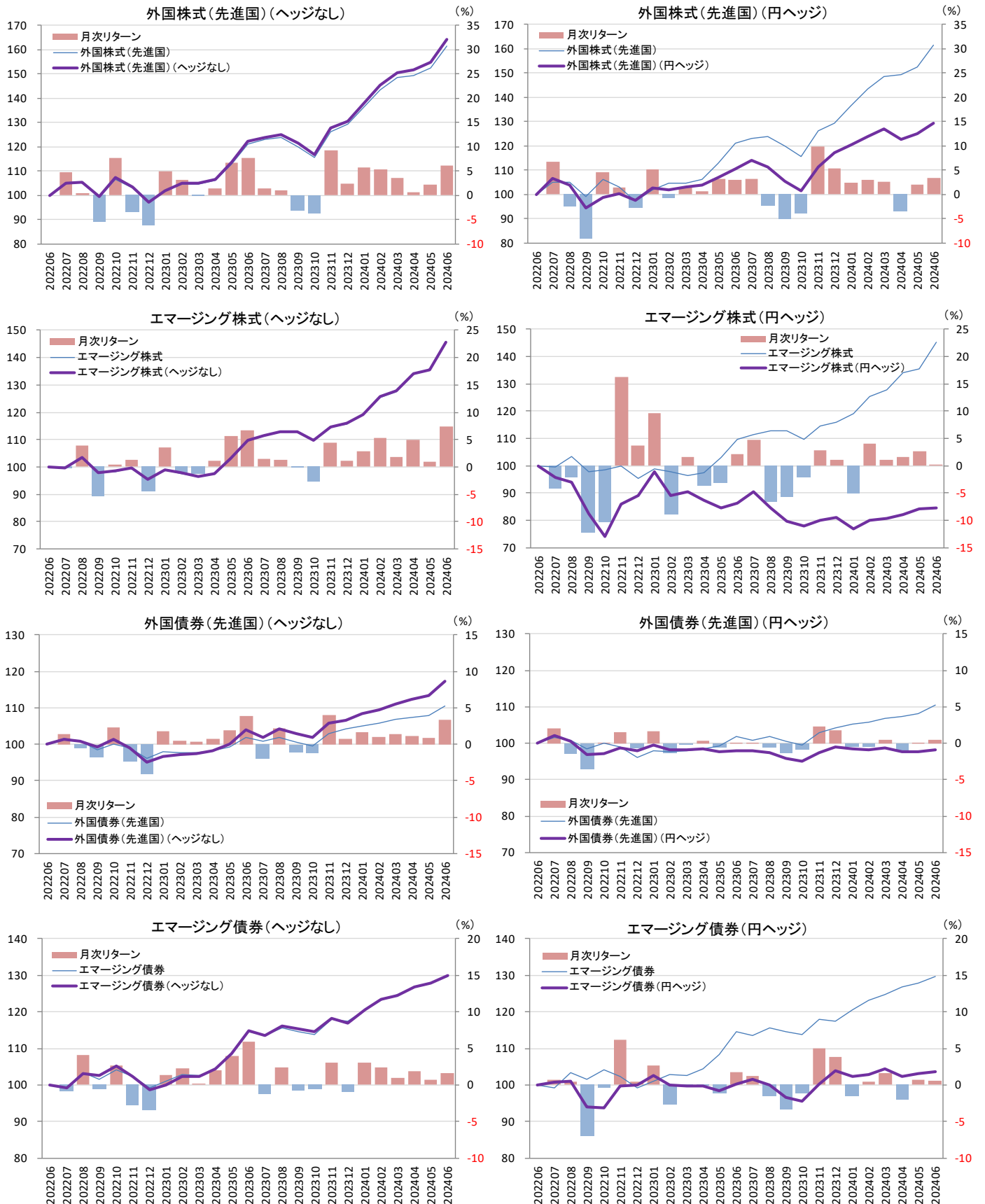
	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	5.63	17.42	22.49	17.42
国内株式	0.59	18.56	21.84	18.56
ヘッジなし	0.45	18.24	21.46	18.24
国内債券	-2.14	-2.53	-4.23	-2.53
ヘッジなし	-2.23	-2.71	-4.50	-2.71
外国株式(先進国)	8.73	24.99	33.44	24.99
ヘッジなし	9.10	25.90	34.54	25.90
円ヘッジ	1.69	10.24	17.09	10.24
エマージング株式	13.89	25.54	32.47	25.54
ヘッジなし	13.90	25.58	32.54	25.58
円ヘッジ	4.37	4.14	-2.19	4.14
外国債券(先進国)	3.48	6.17	8.46	6.17
ヘッジなし	5.46	9.84	12.66	9.84
円ヘッジ	-0.48	-0.91	0.28	-0.91
エマージング債券	3.86	10.36	13.15	10.36
ヘッジなし	4.25	11.00	13.00	11.00
円ヘッジ	-0.80	-0.34	3.41	-0.34
ハイイールド債券	6.03	13.51	18.51	13.51
ヘッジなし	7.08	15.81	20.54	15.81
円ヘッジ	-0.29	-0.22	3.21	-0.22
複合資産	2.75	9.84	12.07	9.84
ヘッジなし	3.09	10.80	13.31	10.80
円ヘッジ	-0.23	2.44	4.34	2.44
国内REIT	-2.91	-2.00	-3.48	-2.00
ヘッジなし	-3.05	-2.37	-3.89	-2.37
外国REIT	4.64	8.93	15.56	8.93
ヘッジなし	4.92	9.49	16.27	9.49
円ヘッジ	-2.22	-5.42	-0.89	-5.42
その他	3.21	12.77	17.40	12.77

※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）」

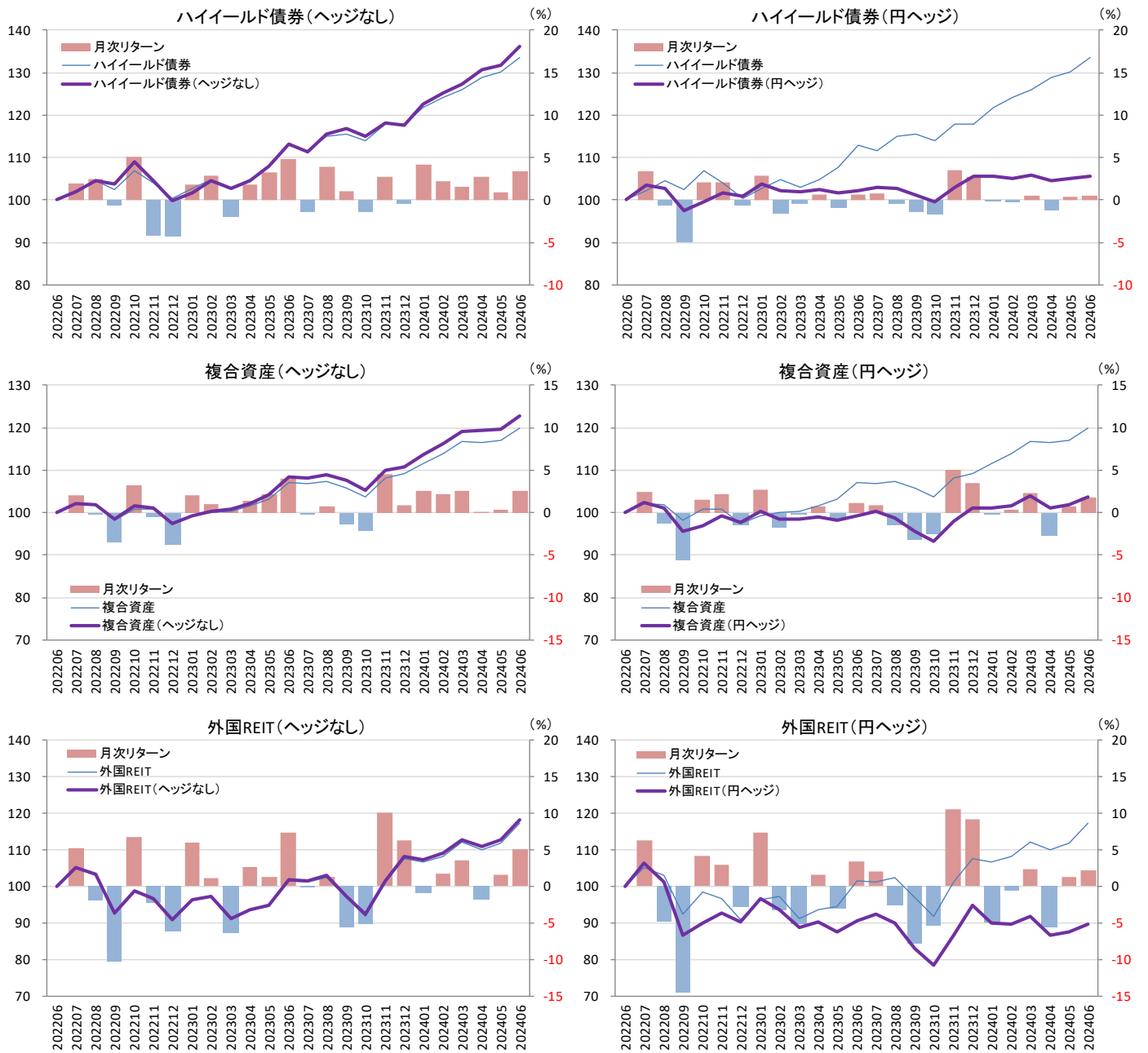
(3) リターン推移（24ヵ月前を100として指数化（折れ線グラフ、左目盛り））



<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	4.26		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	6.16	45.55	2.79
2	エマージング株式(ヘッジなし)	7.39	4.57	0.33
3	複合資産(ヘッジなし)	2.58	10.77	0.28
4	国内株式(ヘッジなし)	2.08	12.74	0.26
5	外国REIT(ヘッジなし)	5.04	3.47	0.17
6	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	3.30	5.17	0.17
7	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	3.33	1.82	0.06
8	ハイイールド債券(ヘッジなし)	3.42	1.35	0.05
9	その他(円ヘッジ)	5.83	0.68	0.04
10	その他(ヘッジなし)	1.57	1.41	0.02
11	エマージング債券(ヘッジなし)	1.64	0.83	0.01
12	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	0.45	1.90	0.01
13	複合資産(円ヘッジ)	1.73	0.46	0.01
14	国内債券(ヘッジなし)	0.17	2.51	0.01
15	外国REIT(円ヘッジ)	2.22	0.10	0.00
16	国内債券(円ヘッジ)	0.08	0.87	0.00
17	国内株式(円ヘッジ)	4.78	0.02	0.00
18	ハイイールド債券(円ヘッジ)	0.46	0.11	0.00
19	エマージング債券(円ヘッジ)	0.53	0.04	0.00
20	エマージング株式(円ヘッジ)	0.23	0.00	0.00
21	国内REIT(ヘッジなし)	-0.35	1.80	-0.01
	合計		96.17	4.21

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	22.49		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	34.54	41.97	14.38
2	国内株式(ヘッジなし)	21.46	12.82	2.76
3	複合資産(ヘッジなし)	13.31	11.41	1.51
4	エマージング株式(ヘッジなし)	32.54	3.89	1.21
5	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	12.66	5.47	0.68
6	外国REIT(ヘッジなし)	16.27	3.93	0.60
7	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	17.09	2.27	0.36
8	ハイイールド債券(ヘッジなし)	20.54	1.40	0.27
9	その他(ヘッジなし)	15.29	1.39	0.21
10	その他(円ヘッジ)	26.14	0.75	0.18
11	エマージング債券(ヘッジなし)	13.00	0.91	0.11
12	複合資産(円ヘッジ)	4.34	0.56	0.02
13	ハイイールド債券(円ヘッジ)	3.21	0.14	0.00
14	国内株式(円ヘッジ)	17.42	0.02	0.00
15	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	0.28	2.20	0.00
16	エマージング債券(円ヘッジ)	3.41	0.05	0.00
17	エマージング株式(円ヘッジ)	-2.19	0.00	-0.00
18	外国REIT(円ヘッジ)	-0.89	0.12	-0.00
19	国内債券(円ヘッジ)	-3.46	1.01	-0.04
20	国内REIT(ヘッジなし)	-3.89	2.31	-0.08
21	国内債券(ヘッジなし)	-4.50	2.90	-0.14
	合計		96.17	22.04

◆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

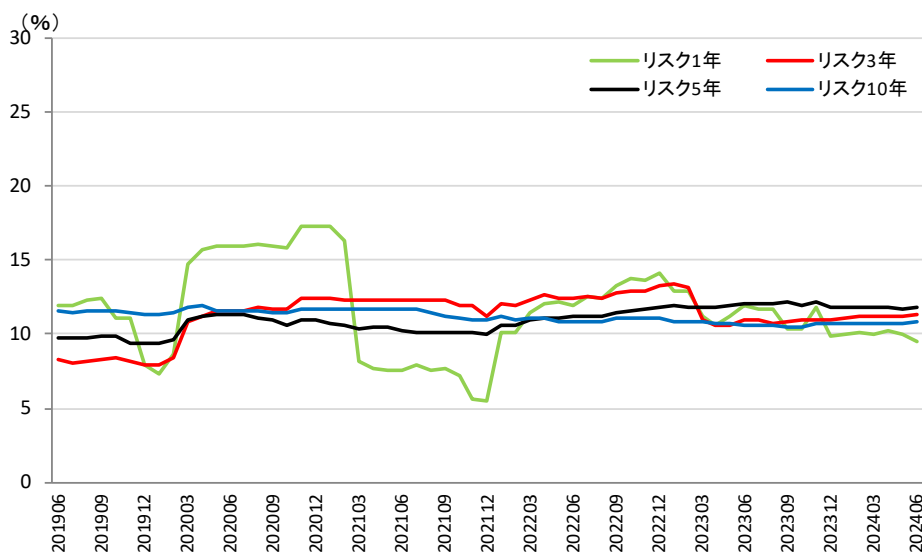
	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	30.93	66.75	94.72	11.33	11.76	10.80	0.83	0.92	0.64
国内株式	41.74	91.90	158.58	12.98 ↑	14.64	15.25	0.95	0.95	0.65
国内債券	-8.18	-9.38	-2.47	2.51	2.35	2.04	-1.11	-0.82	-0.11
外国株式(先進国)	43.68	123.26	170.99	16.70	17.20	16.22	0.77	1.01	0.65
エマージング株式	41.22	87.18	122.53	11.26 ↑	17.19	16.24	1.09	0.78	0.51
外国債券(先進国)	7.81	15.91	17.44	5.11	5.01	5.35	0.50	0.60	0.31
エマージング債券	31.72	34.73	37.95	7.29	10.44	10.49	1.32	0.59	0.31
ハイイールド債券	37.47	52.09	67.36	7.88	11.18	10.43	1.42	0.78	0.51
複合資産	16.55	32.11	52.73	6.72	7.16	7.18	0.78	0.80	0.60
国内REIT	-10.13	6.89	47.74	10.17	15.12	12.30	-0.34	0.09	0.33
外国REIT	31.99	56.38	111.71	17.93	19.10	16.69	0.54	0.49	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

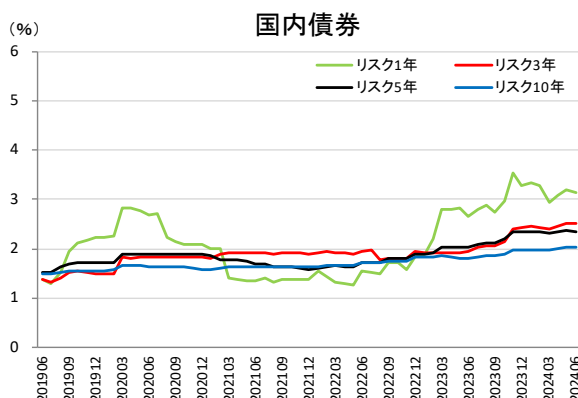
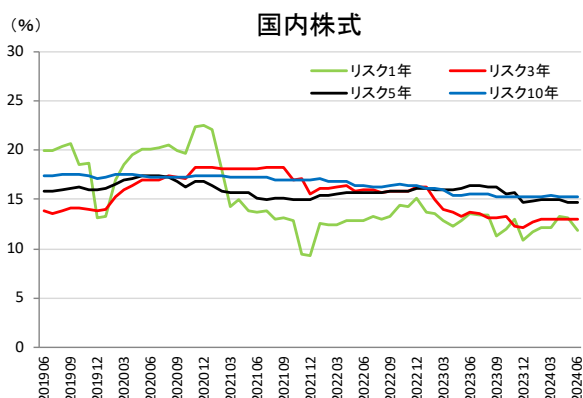
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

(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」

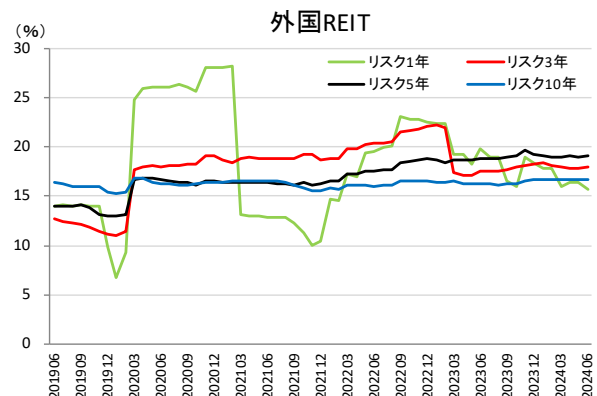
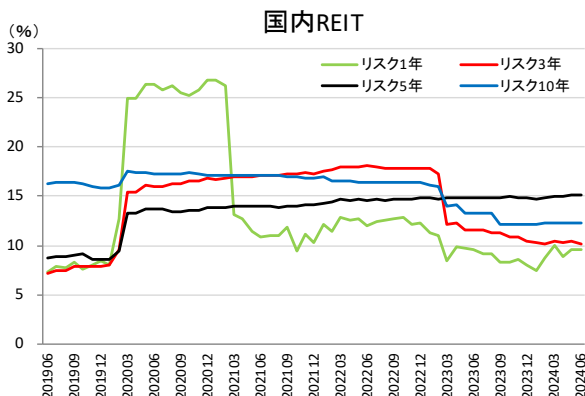
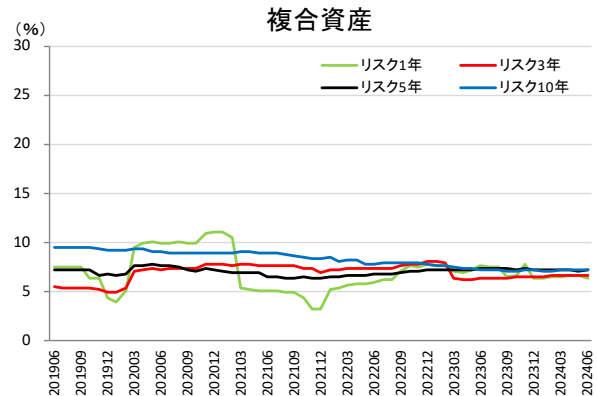
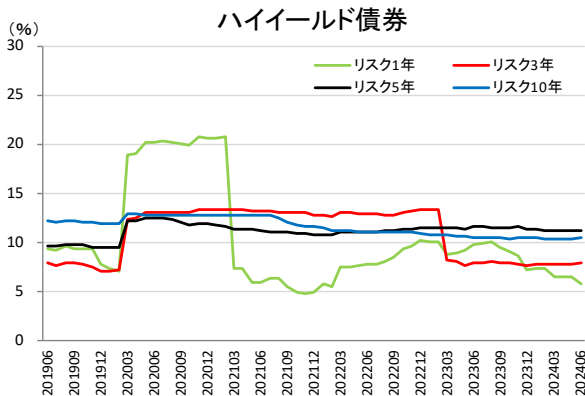
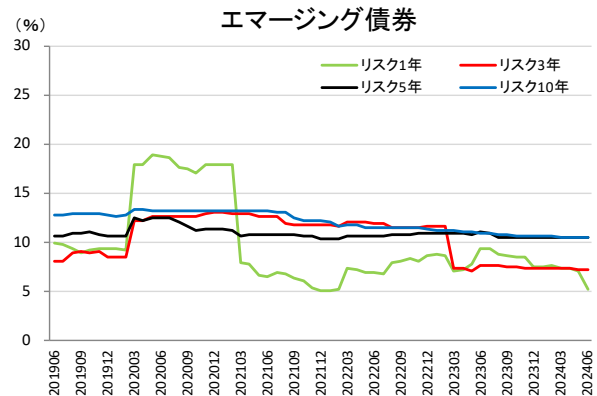
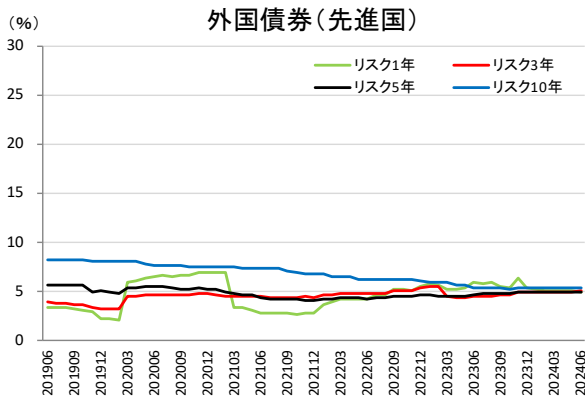
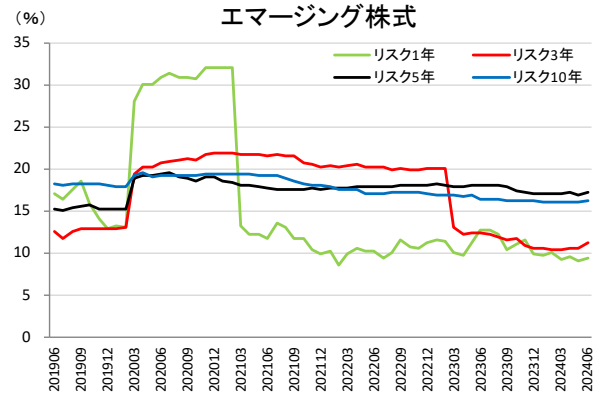
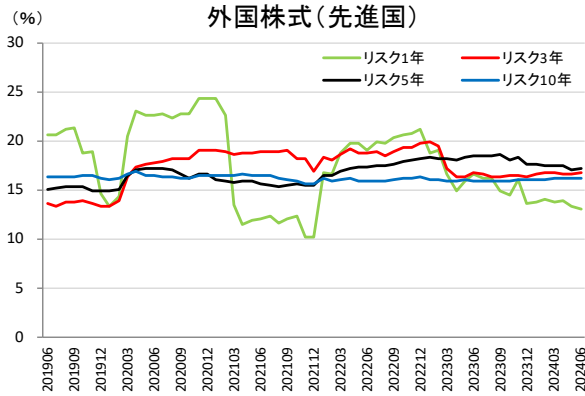


<2> リスク・サマリー

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)

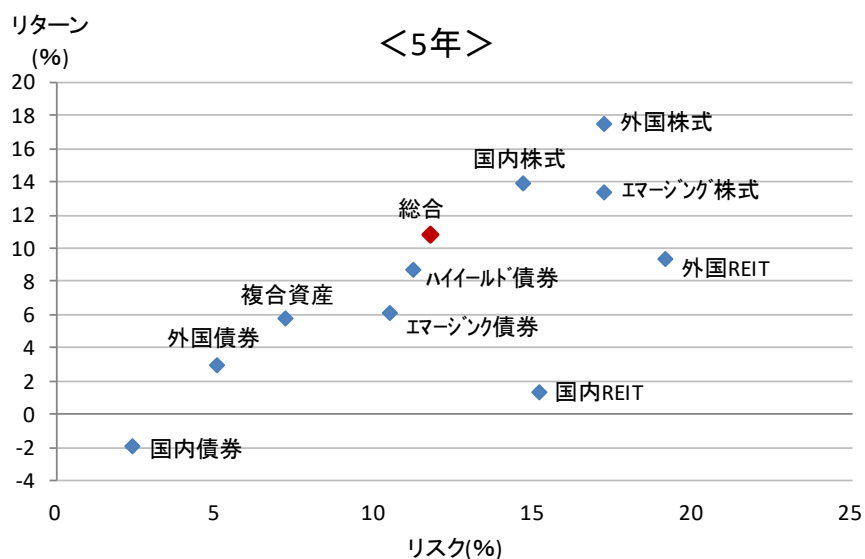
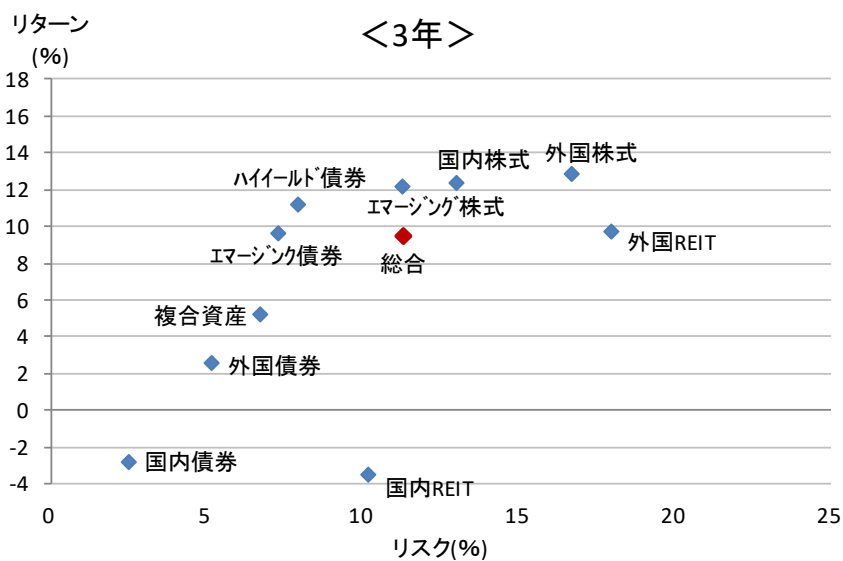
② 「大分類」



<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	9.40	10.77	11.33	11.76
国内株式	12.33	13.92	12.98	14.64
国内債券	-2.80	-1.95	2.51	2.35
外国株式(先進国)	12.84	17.43	16.70	17.20
エマーシング株式	12.19	13.36	11.26	17.19
外国債券(先進国)	2.54	3.00	5.11	5.01
エマーシング債券	9.62	6.14	7.29	10.44
ハイールド債券	11.19	8.75	7.88	11.18
複合資産	5.24	5.73	6.72	7.16
国内REIT	-3.50	1.34	10.17	15.12
外国REIT	9.69	9.36	17.93	19.10

※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）」

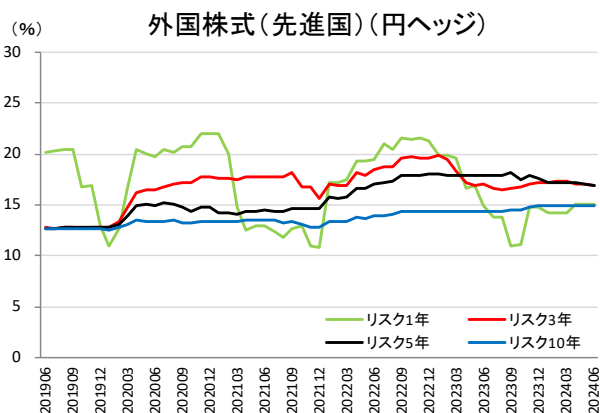
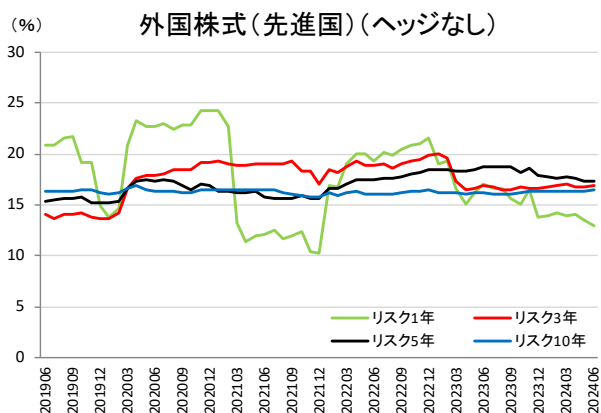
(1) 期間別リスク・リターン

	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	30.93	66.75	94.72	11.33	11.76	10.80	0.83	0.92	0.64
国内株式	41.74	91.90	158.58	12.98	↑ 14.64	15.25	0.95	0.95	0.65
ヘッジなし	39.89	90.14	161.39	12.96	↑ 14.54	14.80	0.91	0.94	0.68
国内債券	-8.18	-9.38	-2.47	2.51	2.35	2.04	-1.11	-0.82	-0.11
ヘッジなし	-7.53	-8.86	-1.94	2.54	2.34	2.03	-1.01	-0.77	-0.09
外国株式(先進国)	43.68	123.26	170.99	16.70	17.20	16.22	0.77	1.01	0.65
ヘッジなし	48.09	132.20	190.98	16.90	17.35	16.43	0.83	1.06	0.69
円ヘッジ	-0.26	53.13	84.23	16.93	16.95	14.92	-0.00	0.53	0.42
エマージング株式	41.22	87.18	122.53	11.26	↑ 17.19	16.24	1.09	0.78	0.51
ヘッジなし	41.57	87.69	123.32	11.26	↑ 17.21	16.25	1.09	0.78	0.52
円ヘッジ	-39.32	-21.62	-6.51	19.52	20.08	19.33	-0.78	-0.24	-0.03
外国債券(先進国)	7.81	15.91	17.44	5.11	5.01	5.35	0.50	0.60	0.31
ヘッジなし	19.62	30.84	31.29	6.73	6.11	6.51	0.92	0.91	0.43
円ヘッジ	-12.05	-8.80	-4.38	4.47	4.52	3.64	-0.93	-0.40	-0.12
エマージング債券	31.72	34.73	37.95	7.29	10.44	10.49	1.32	0.59	0.31
ヘッジなし	37.87	42.17	47.88	7.44	9.62	9.94	1.52	0.76	0.40
円ヘッジ	-18.89	-15.65	-8.73	9.54	11.07	8.66	-0.70	-0.30	-0.10
ハイイールド債券	37.47	52.09	67.36	7.88	11.18	10.43	1.42	0.78	0.51
ヘッジなし	46.04	68.96	105.75	8.39	10.18	9.95	1.61	1.09	0.75
円ヘッジ	-8.70	-0.84	7.53	6.94	9.39	7.40	-0.43	-0.02	0.10
複合資産	16.55	32.11	52.73	6.72	7.16	7.18	0.78	0.80	0.60
ヘッジなし	21.25	39.11	62.51	7.06	7.48	7.53	0.94	0.92	0.66
円ヘッジ	-6.54	0.48	8.75	8.22	8.30	6.86	-0.27	0.01	0.13
国内REIT	-10.13	6.89	47.74	10.17	15.12	12.30	-0.34	0.09	0.33
ヘッジなし	-11.38	5.68	48.02	10.11	14.98	12.15	-0.39	0.08	0.33
外国REIT	31.99	56.38	111.71	17.93	19.10	16.69	0.54	0.49	0.47
ヘッジなし	34.19	60.64	118.94	18.05	19.13	16.77	0.57	0.52	0.49
円ヘッジ	-17.43	-6.79	8.98	19.12	19.52	15.92	-0.32	-0.07	0.06

※[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

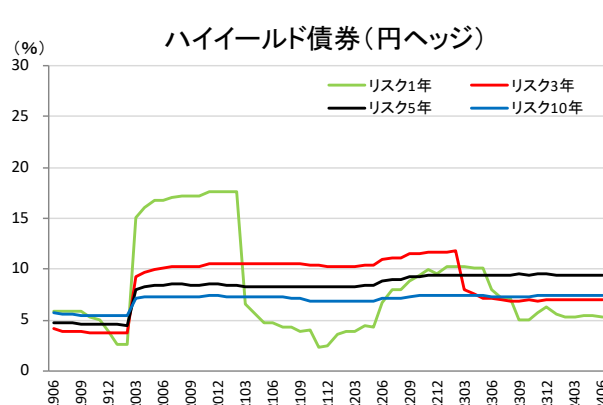
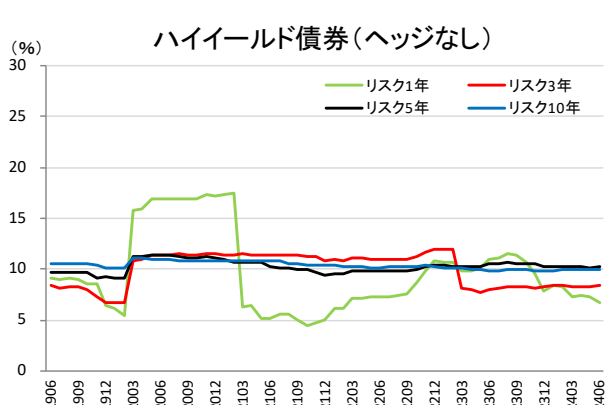
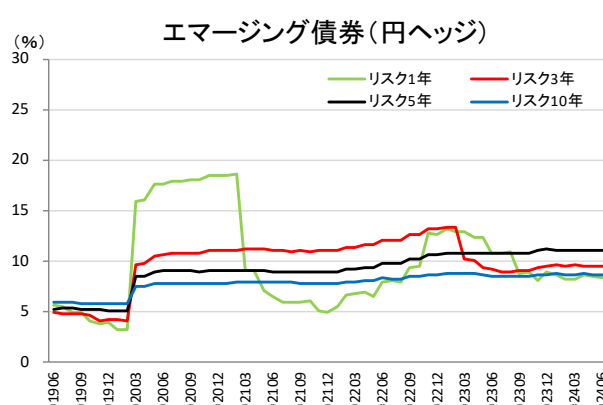
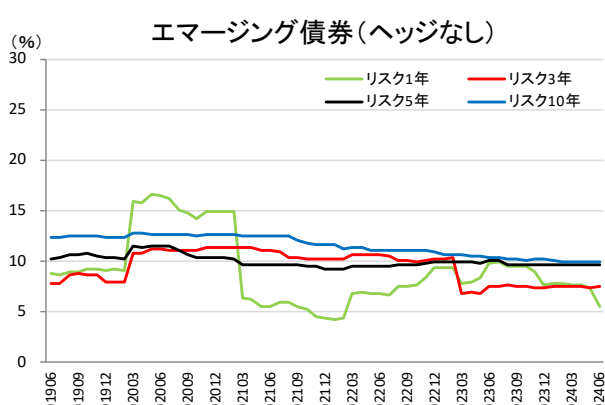
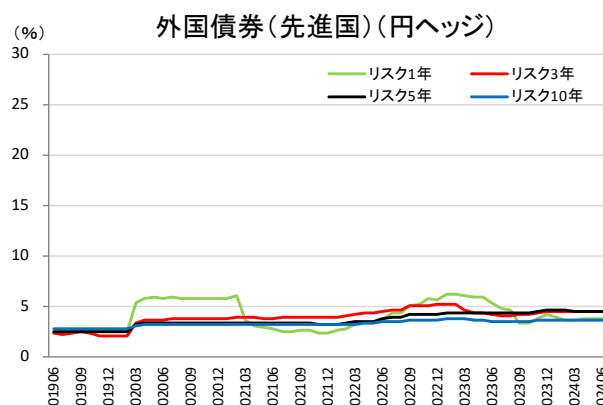
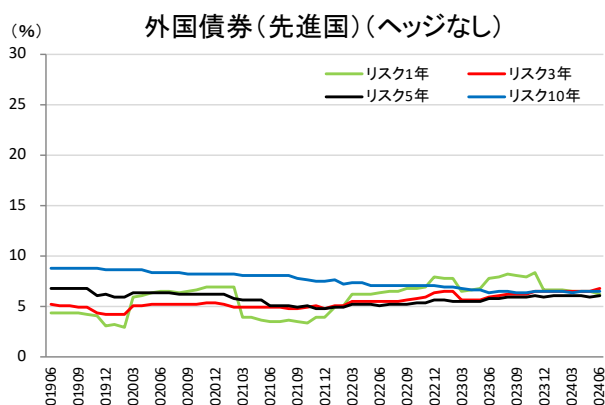
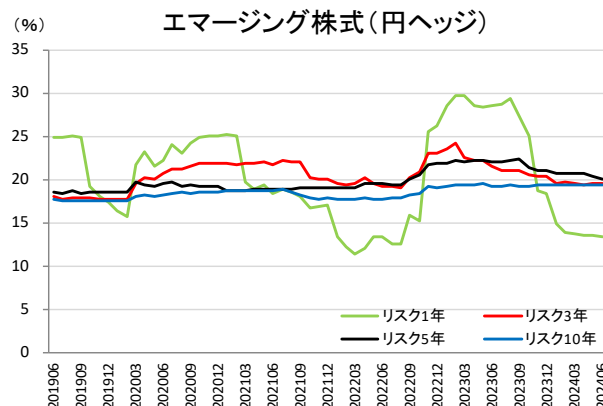
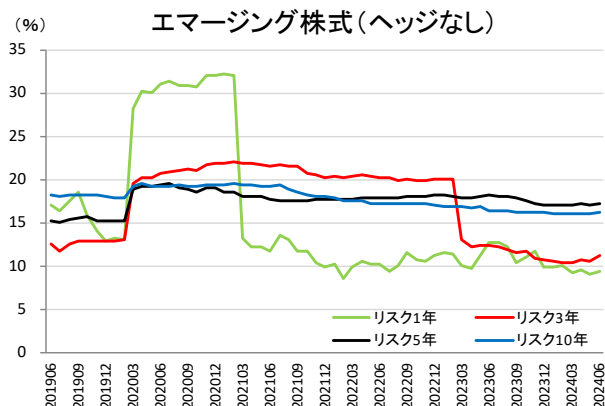
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)



<2> リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

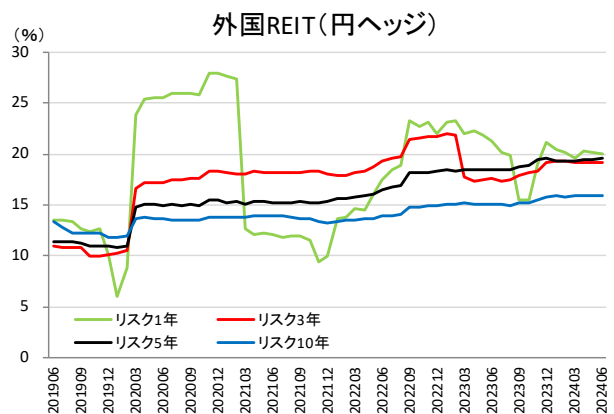
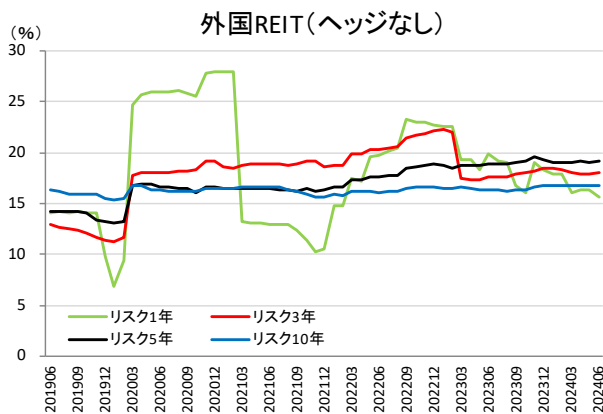
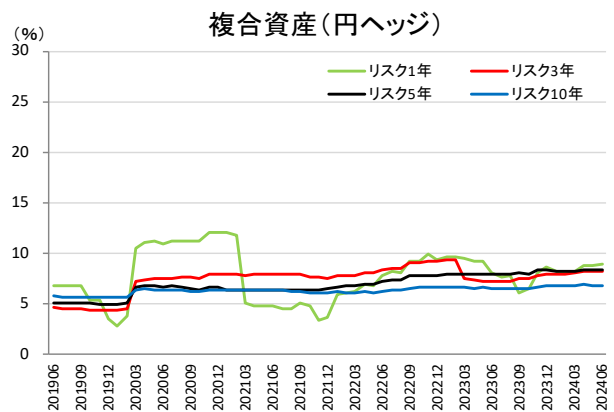
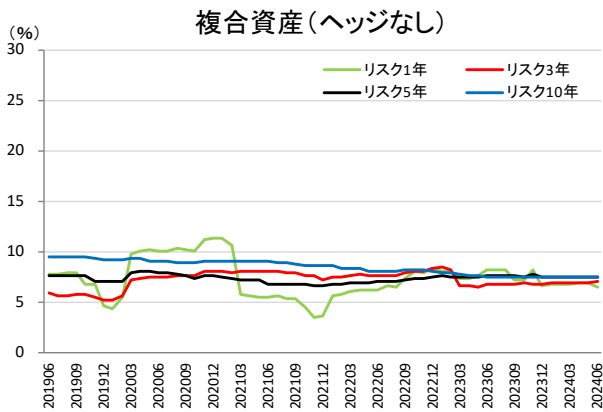
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



<2> リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

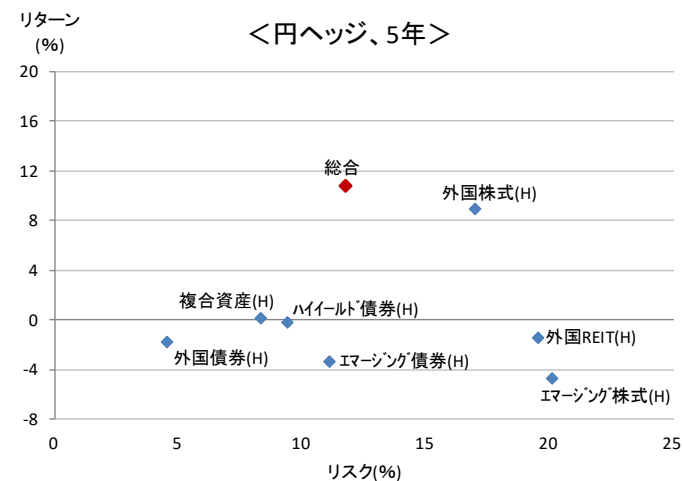
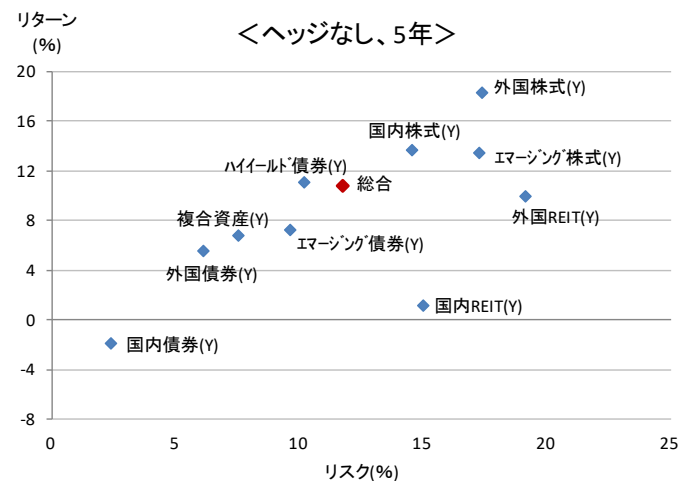
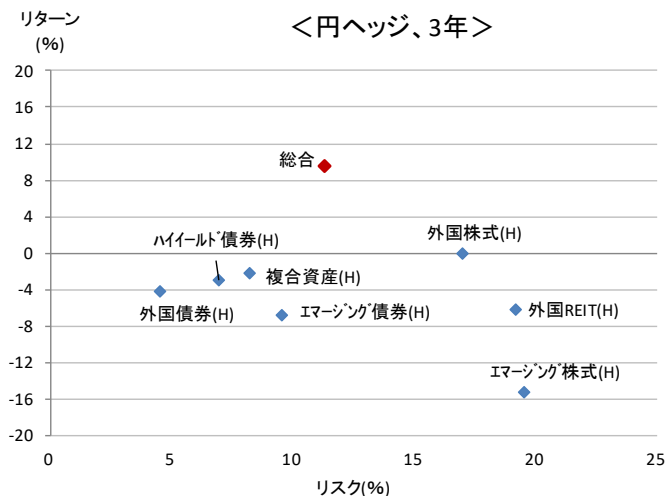
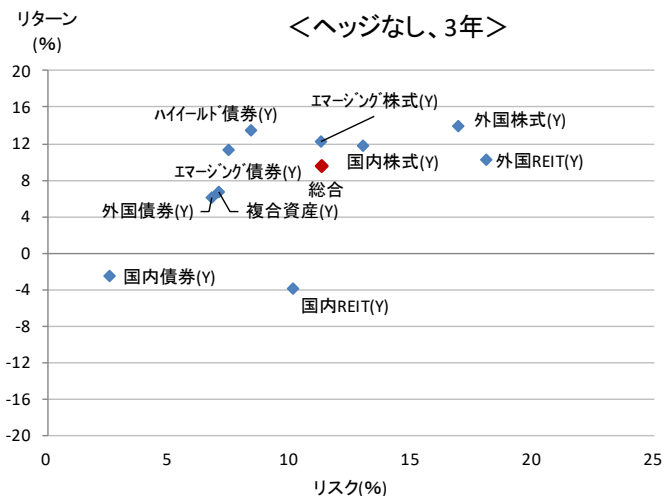
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



<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	9.40	10.77	11.33	11.76
国内株式(Y)	11.84	13.71	12.96	14.54
国内債券(Y)	-2.57	-1.84	2.54	2.34
外国株式(先進国)(Y)	13.98	18.35	16.90	17.35
エマーシング株式(Y)	12.28	13.42	11.26	17.21
外国債券(先進国)(Y)	6.15	5.52	6.73	6.11
エマーシング債券(Y)	11.30	7.29	7.44	9.62
ハイイルド債券(Y)	13.45	11.06	8.39	10.18
複合資産(Y)	6.63	6.82	7.06	7.48
国内REIT(Y)	-3.95	1.11	10.11	14.98
外国REIT(Y)	10.30	9.94	18.05	19.13

<円ヘッジ>	リターン(%)		リスク(%)	
	3年	5年	3年	5年
総合	9.40	10.77	11.33	11.76
外国株式(先進国)(H)	-0.09	8.90	16.93	16.95
エマーシング株式(H)	-15.34	-4.75	19.52	20.08
外国債券(先進国)(H)	-4.19	-1.83	4.47	4.52
エマーシング債券(H)	-6.74	-3.35	9.54	11.07
ハイイルド債券(H)	-2.99	-0.17	6.94	9.39
複合資産(H)	-2.23	0.10	8.22	8.30
外国REIT(H)	-6.18	-1.40	19.12	19.52

※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	15,350	45,450	85,604	131,654
国内株式	75	4,752	8,673	16,999
国内債券	134	808	874	4,008
外国株式(先進国)	11,284	28,061	57,019	78,241
エマージング株式	2,527	6,692	10,953	17,368
外国債券(先進国)	396	1,533	2,992	7,419
エマージング債券	35	59	80	232
ハイイールド債券	83	173	344	1,119
複合資産	1,255	2,781	4,662	7,266
国内REIT	-84	33	-230	-1,058
外国REIT	-162	-249	-702	-1,207
その他	-193	808	939	1,269

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	15,350	45,450	85,604	131,654
国内株式	75	4,752	8,673	16,999
ヘッジなし	95	4,770	8,801	17,338
国内債券	134	808	874	4,008
ヘッジなし	173	703	1,051	2,758
外国株式(先進国)	11,284	28,061	57,019	78,241
ヘッジなし	11,916	30,247	61,077	85,899
円ヘッジ	-526	-1,829	-3,401	-6,421
エマージング株式	2,527	6,692	10,953	17,368
ヘッジなし	2,529	6,699	10,965	17,392
円ヘッジ	-1	-4	-7	-12
外国債券(先進国)	396	1,533	2,992	7,419
ヘッジなし	631	1,538	2,887	5,308
円ヘッジ	-175	63	155	935
エマージング債券	35	59	80	232
ヘッジなし	66	155	250	550
円ヘッジ	-5	-18	-34	-61
ハイイールド債券	83	173	344	1,119
ヘッジなし	135	330	786	1,862
円ヘッジ	-26	-90	-149	-217
複合資産	1,255	2,781	4,662	7,266
ヘッジなし	1,339	3,670	6,382	9,433
円ヘッジ	-29	-124	-443	-731
国内REIT	-84	33	-230	-1,058
ヘッジなし	-80	42	-196	-966
外国REIT	-162	-249	-702	-1,207
ヘッジなし	-152	-211	-664	-1,141
円ヘッジ	-3	-15	18	61
その他	-193	808	939	1,269

<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	1,311,636	100.0		5,324	100.0
国内株式	170,232	13.0		760	14.3
国内債券	42,990	3.3		150	2.8
外国株式(先進国)	633,374	48.3		1,213	22.8
エマージング株式	61,968	4.7		315	5.9
外国債券(先進国)	101,933	7.8		741	13.9
エマージング債券	12,766	1.0		227	4.3
ハイイールド債券	22,450	1.7		222	4.2
複合資産	164,307	12.5		1,063	20.0
国内REIT	23,591	1.8		142	2.7
外国REIT	47,070	3.6		268	5.0
その他	30,955	2.4		223	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	1,311,636	100.0		5,324	100.0
国内株式	170,232	13.0		760	14.3
ヘッジなし	165,714	12.6		715	13.4
国内債券	42,990	3.3		150	2.8
ヘッジなし	31,974	2.4		141	2.6
外国株式(先進国)	633,374	48.3		1,213	22.8
ヘッジなし	604,421	46.1		924	17.4
円ヘッジ	23,187	1.8		225	4.2
エマージング株式	61,968	4.7		315	5.9
ヘッジなし	61,896	4.7		300	5.6
円ヘッジ	47	0.0		10	0.2
外国債券(先進国)	101,933	7.8		741	13.9
ヘッジなし	64,296	4.9		419	7.9
円ヘッジ	24,083	1.8		240	4.5
エマージング債券	12,766	1.0		227	4.3
ヘッジなし	10,732	0.8		133	2.5
円ヘッジ	468	0.0		28	0.5
ハイイールド債券	22,450	1.7		222	4.2
ヘッジなし	17,662	1.3		72	1.4
円ヘッジ	1,373	0.1		60	1.1
複合資産	164,307	12.5		1,063	20.0
ヘッジなし	140,164	10.7		807	15.2
円ヘッジ	5,827	0.4		72	1.4
国内REIT	23,591	1.8		142	2.7
ヘッジなし	22,890	1.7		123	2.3
外国REIT	47,070	3.6		268	5.0
ヘッジなし	45,151	3.4		186	3.5
円ヘッジ	1,335	0.1		56	1.1
その他	30,955	2.4		223	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	16,464	10.5	2.91	2.65	1.065
国内株式	24,032	14.7	1.67	1.50	0.990
国内債券	10,119	12.5	0.11	0.12	0.466
外国株式(先進国)	20,880	8.0	3.57	3.18	1.062
エマージング株式	16,390	11.1	4.11	3.29	1.667
外国債券(先進国)	11,024	10.9	1.26	1.18	0.959
エマージング債券	10,718	12.5	3.40	3.21	1.357
ハイイールド債券	10,503	13.0	4.87	4.36	1.655
複合資産	14,946	9.9	1.18	1.14	0.911
国内REIT	13,462	10.5	6.87	8.19	0.885
外国REIT	13,640	9.9	7.61	7.41	1.429

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	16,464	10.5	2.91	2.65	1.065
国内株式	24,032	14.7	1.67	1.50	0.990
ヘッジなし	23,706	14.9	1.56	1.41	0.973
国内債券	10,119	12.5	0.11	0.12	0.466
ヘッジなし	10,172	12.8	0.12	0.13	0.389
外国株式(先進国)	20,880	8.0	3.57	3.18	1.062
ヘッジなし	22,880	7.7	3.62	3.23	1.037
円ヘッジ	14,126	8.3	2.50	2.19	1.531
エマージング株式	16,390	11.1	4.11	3.29	1.667
ヘッジなし	16,759	11.1	4.11	3.29	1.668
円ヘッジ	9,640	12.6	0.39	0.45	1.681
外国債券(先進国)	11,024	10.9	1.26	1.18	0.959
ヘッジなし	12,763	12.6	1.58	1.46	0.965
円ヘッジ	8,648	8.3	0.76	0.77	0.856
エマージング債券	10,718	12.5	3.40	3.21	1.357
ヘッジなし	11,607	12.0	3.22	3.07	1.290
円ヘッジ	7,033	12.9	2.88	2.93	1.624
ハイイールド債券	10,503	13.0	4.87	4.36	1.655
ヘッジなし	13,115	13.0	5.11	4.53	1.657
円ヘッジ	8,270	13.5	2.85	2.88	1.629
複合資産	14,946	9.9	1.18	1.14	0.911
ヘッジなし	15,941	10.9	1.26	1.21	0.841
円ヘッジ	10,773	8.6	1.10	1.11	1.362
国内REIT	13,462	10.5	6.87	8.19	0.885
ヘッジなし	12,828	10.3	6.92	8.27	0.870
外国REIT	13,640	9.9	7.61	7.41	1.429
ヘッジなし	14,658	9.9	7.66	7.42	1.430
円ヘッジ	9,376	8.5	4.82	5.51	1.241

(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

目録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