

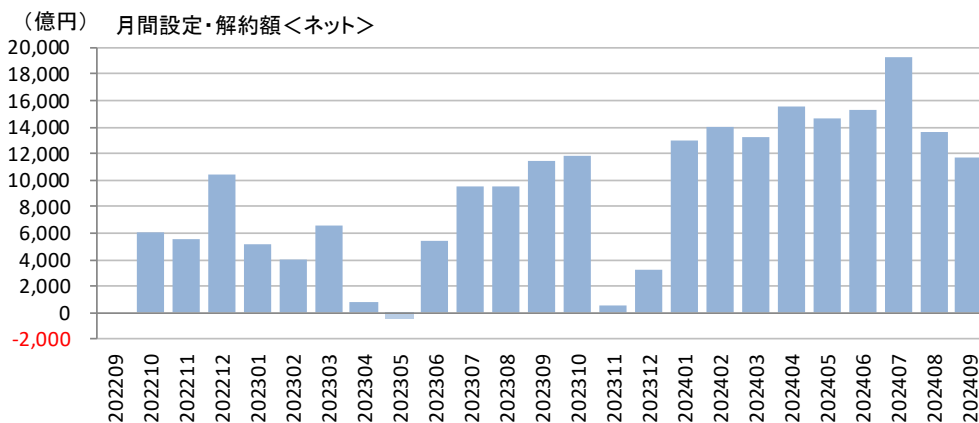
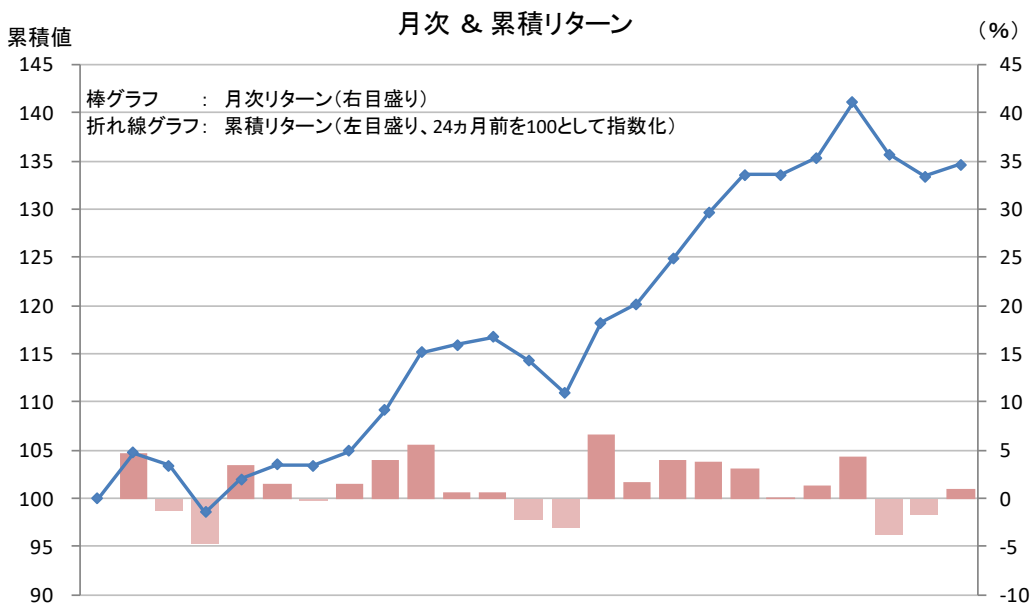
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

— Vol.1 ファンド大分類 編 —

2024年9月

「総合」 +0.94 %
(前月 -1.70 %)



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9月のMAB-FPI

<1>パフォーマンス・サマリー

9月のMAB-FPI「総合」は0.94%上昇し、20,228ポイント。
純資産総額は前月末比2兆1,347億円増加し128兆5,989億円。

「大分類別」では、エマージング株式+3.14%、外国REIT+2.15%、その他+1.75%、
外国株式(先進国)+1.43% など9カテゴリーで上昇し、下落したのは国内REIT-1.60%と
国内株式-0.80%の2カテゴリー。

「総合」への寄与度では、外国株式(先進国)+0.69%、エマージング株式+0.14%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+1兆1,649億円と、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+8,197億円と大幅な流入超となり、続いて複合資産
+1,043億円、国内株式+893億円、外国債券(先進国)+638億円、エマージング株式+554
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国内REIT-261
億円、その他-65億円など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
20,228	20,039	+189	+0.94%

◇累積リターン

3ヵ月	-4.58%
6ヵ月	+0.79%
1年	+17.79%
年初来	+12.04%

◇年初来高値/安値

日付	指数	累積リターン
高値 2024/07/11	21,715	+20.28%
安値 2024/01/04	17,915	-0.77%

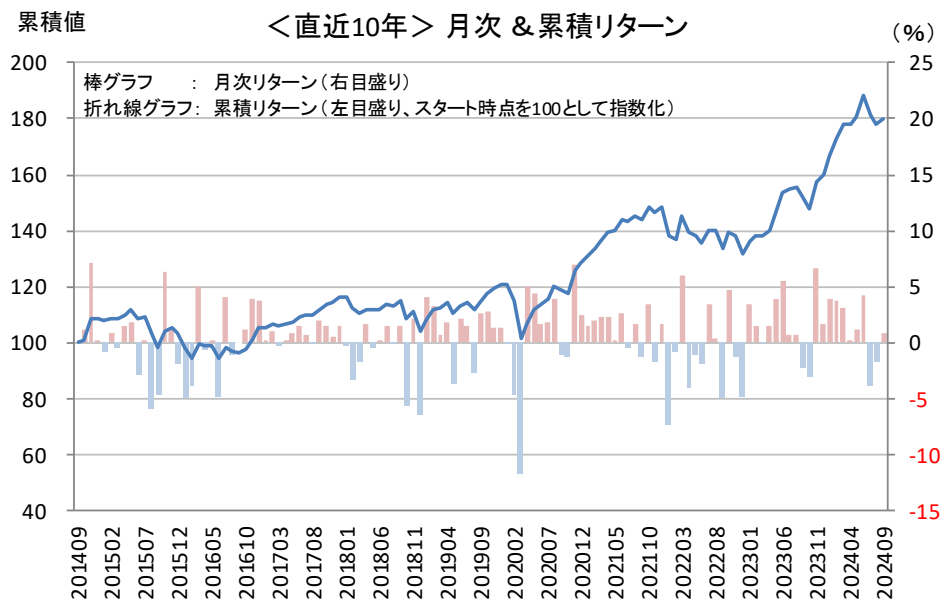
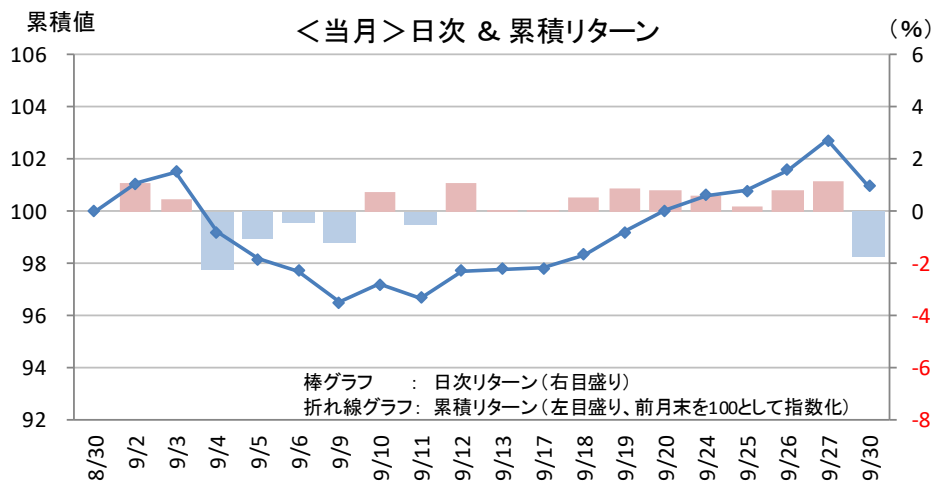
◇純資産総額

当月末	前月末	増減
128兆5,989億円	126兆4,642億円	+2兆1,347億円

◇月間設定・解約額<ネット>

(弊社推計値)

+1兆1,649億円



<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	20,228	20,039	189	0.94
国内株式	27,122	27,339	-218	-0.80
国内債券	12,316	12,278	39	0.32
外国株式(先進国)	29,442	29,028	415	1.43
エマージング株式	25,780	24,996	784	3.14
外国債券(先進国)	19,793	19,720	72	0.37
エマージング債券	21,646	21,450	196	0.91
ハイイールド債券	30,645	30,455	191	0.63
複合資産	21,806	21,687	119	0.55
国内REIT 10,000 (2003.10.31)	33,849	34,400	-551	-1.60
外国REIT 10,000 (2003.09.30)	41,484	40,612	872	2.15
その他	7,645	7,514	131	1.75

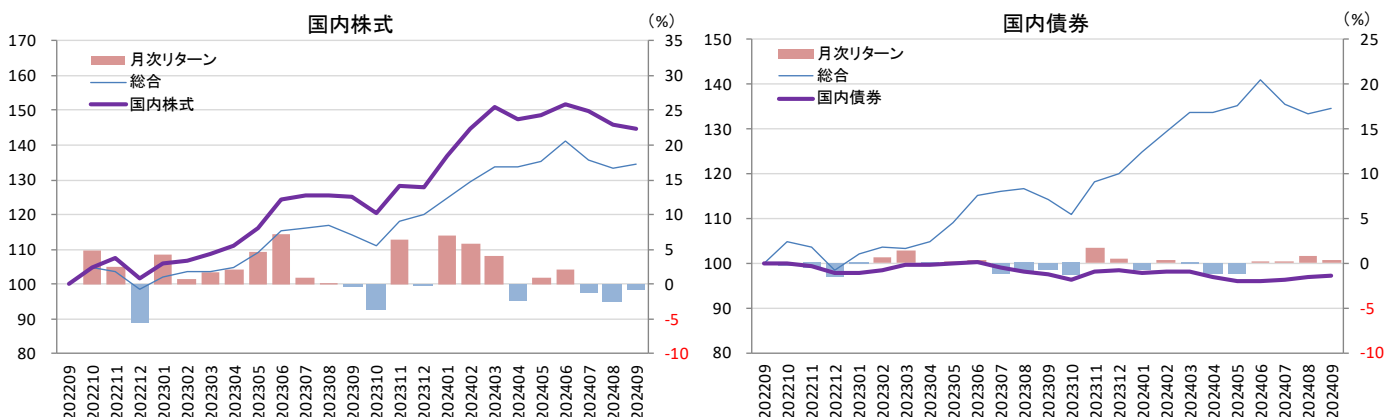
※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000
[色塗りの基準]月次リターン> 総合

(2) 期間別リターン

	3カ月(%)	6カ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	-4.58	0.79	17.79	12.04
国内株式	-4.48	-3.92	15.81	13.25
国内債券	1.38	-0.79	-0.27	-1.19
外国株式(先進国)	-6.65	1.50	25.71	16.69
エマージング株式	-4.68	8.55	22.93	19.66
外国債券(先進国)	-3.06	0.31	6.53	2.92
エマージング債券	-5.84	-2.20	6.52	3.91
ハイイールド債券	-5.87	-0.19	8.89	6.85
複合資産	-2.28	0.40	10.72	7.33
国内REIT	0.81	-2.13	-3.37	-1.21
外国REIT	3.10	7.89	24.74	12.32
その他	-2.49	0.64	15.50	9.96

※[色塗りの基準]期間別リターン> 総合

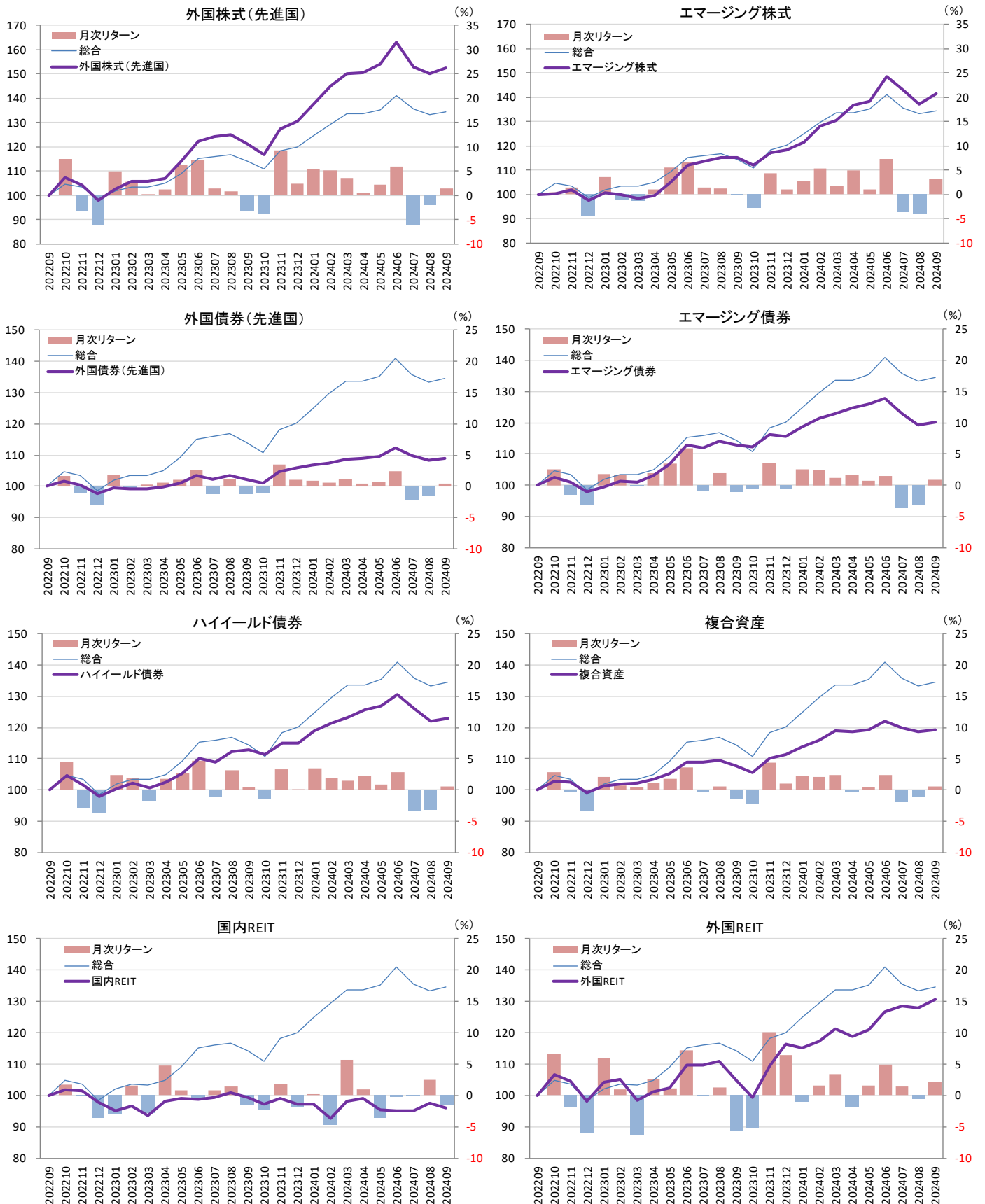
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化(折れ線グラフ、左目盛り))



<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	0.94		
1	外国株式(先進国)	1.43	47.48	0.69
2	エマージング株式	3.14	4.72	0.14
3	外国REIT	2.15	3.75	0.08
4	複合資産	0.55	12.85	0.07
5	その他	1.75	2.41	0.04
6	外国債券(先進国)	0.37	7.86	0.03
7	国内債券	0.32	3.49	0.01
8	ハイイールド債券	0.63	1.65	0.01
9	エマージング債券	0.91	0.91	0.01
10	国内REIT	-1.60	1.83	-0.03
11	国内株式	-0.80	13.05	-0.11
	合計		100.00	0.94

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	17.79		
1	外国株式(先進国)	25.71	45.95	11.19
2	国内株式	15.81	13.20	2.26
3	複合資産	10.72	13.27	1.48
4	外国REIT	24.74	3.90	0.90
5	エマージング株式	22.93	4.21	0.84
6	外国債券(先進国)	6.53	8.30	0.58
7	その他	15.50	2.46	0.38
8	ハイイールド債券	8.89	1.81	0.17
9	エマージング債券	6.52	1.04	0.08
10	国内債券	-0.27	3.72	-0.01
11	国内REIT	-3.37	2.13	-0.08
	合計		100.00	17.79

◆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	20,228	20,039	189	0.94		
国内株式	27,122	27,339	-218	-0.80		
ヘッジなし	27,698	27,938	-240	-0.86		
国内債券	12,316	12,278	39	0.32		
ヘッジなし	12,482	12,445	37	0.30		
外国株式(先進国)	29,442	29,028	415	1.43		
ヘッジなし	35,323	34,836	487	1.40		
円ヘッジ	20,128	19,769	359	1.81		
エマージング株式	25,780	24,996	784	3.14		
ヘッジなし	24,994	24,234	760	3.13		
円ヘッジ	18,856	18,189	667	3.67		
外国債券(先進国)	19,793	19,720	72	0.37		
ヘッジなし	22,381	22,321	60	0.27		
円ヘッジ	13,158	13,103	55	0.42		
エマージング債券	21,646	21,450	196	0.91		
ヘッジなし	23,697	23,517	180	0.76		
円ヘッジ	16,815	16,641	173	1.04		
ハイイールド債券	30,645	30,455	191	0.63		
ヘッジなし	36,658	36,541	116	0.32		
円ヘッジ	16,480	16,362	118	0.72		
複合資産	21,806	21,687	119	0.55		
ヘッジなし	22,863	22,751	112	0.49		
円ヘッジ	15,101	14,876	225	1.51		
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	33,849	34,400	-551	-1.60	
ヘッジなし	10,000 (2003.10.31)	33,850	34,409	-558	-1.62	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	41,484	40,612	872	2.15	
ヘッジなし	10,000 (2003.09.30)	42,893	42,003	890	2.12	
円ヘッジ	10,000 (2003.10.31)	18,625	18,132	493	2.72	
その他		7,645	7,514	131	1.75	

※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	-4.58	0.79	17.79	12.04
国内株式	-4.48	-3.92	15.81	13.25
ヘッジなし	-4.30	-3.87	15.82	13.15
国内債券	1.38	-0.79	-0.27	-1.19
ヘッジなし	1.36	-0.90	-0.49	-1.39
外国株式(先進国)	-6.65	1.50	25.71	16.69
ヘッジなし	-7.00	1.47	25.93	17.09
円ヘッジ	0.93	2.64	23.66	11.26
エマージング株式	-4.68	8.55	22.93	19.66
ヘッジなし	-4.69	8.56	22.95	19.69
円ヘッジ	1.95	6.41	8.18	6.17
外国債券(先進国)	-3.06	0.31	6.53	2.92
ヘッジなし	-5.45	-0.29	7.58	3.86
円ヘッジ	1.26	0.77	3.56	0.34
エマージング債券	-5.84	-2.20	6.52	3.91
ヘッジなし	-6.47	-2.49	5.31	3.81
円ヘッジ	3.52	2.69	11.16	3.17
ハイイールド債券	-5.87	-0.19	8.89	6.85
ヘッジなし	-6.89	-0.30	8.65	7.83
円ヘッジ	2.25	1.95	6.59	2.03
複合資産	-2.28	0.40	10.72	7.33
ヘッジなし	-2.69	0.31	11.15	7.82
円ヘッジ	3.25	3.02	11.97	5.78
国内REIT	0.81	-2.13	-3.37	-1.21
ヘッジなし	1.06	-2.02	-3.48	-1.34
外国REIT	3.10	7.89	24.74	12.32
ヘッジなし	2.85	7.90	25.03	12.60
円ヘッジ	13.22	10.71	22.37	7.09
その他	-2.49	0.64	15.50	9.96

※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）」

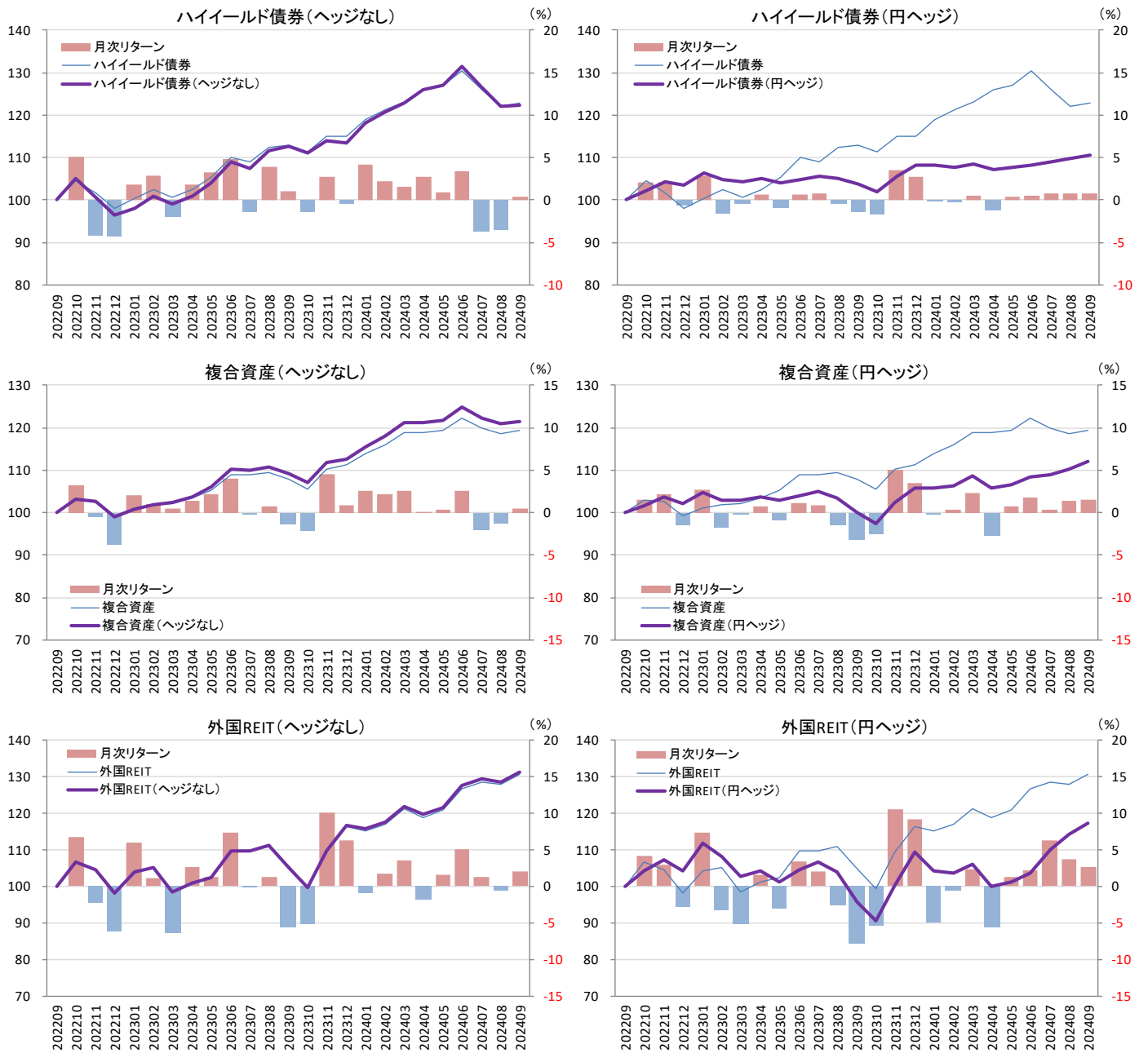
(3) リターン推移（24ヵ月前を100として指数化（折れ線グラフ、左目盛り））



<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	0.94		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	1.40	45.31	0.65
2	エマージング株式(ヘッジなし)	3.13	4.72	0.14
3	外国REIT(ヘッジなし)	2.12	3.59	0.07
4	複合資産(ヘッジなし)	0.49	10.93	0.06
5	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	1.81	1.75	0.03
6	その他(円ヘッジ)	4.11	0.68	0.03
7	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	0.27	4.90	0.01
8	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	0.42	1.88	0.01
9	国内債券(ヘッジなし)	0.30	2.58	0.01
10	複合資産(円ヘッジ)	1.51	0.47	0.01
11	その他(ヘッジなし)	0.39	1.44	0.01
12	エマージング債券(ヘッジなし)	0.76	0.77	0.01
13	ハイイールド債券(ヘッジなし)	0.32	1.30	0.00
14	国内債券(円ヘッジ)	0.37	0.90	0.00
15	外国REIT(円ヘッジ)	2.72	0.12	0.00
16	ハイイールド債券(円ヘッジ)	0.72	0.10	0.00
17	エマージング債券(円ヘッジ)	1.04	0.04	0.00
18	エマージング株式(円ヘッジ)	3.67	0.00	0.00
19	国内株式(円ヘッジ)	-1.37	0.02	-0.00
20	国内REIT(ヘッジなし)	-1.62	1.78	-0.03
21	国内株式(ヘッジなし)	-0.86	12.75	-0.12
	合計		96.02	0.89

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	17.79		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	25.93	43.41	10.60
2	国内株式(ヘッジなし)	15.82	12.85	2.21
3	複合資産(ヘッジなし)	11.15	11.17	1.29
4	外国REIT(ヘッジなし)	25.03	3.73	0.88
5	エマージング株式(ヘッジなし)	22.95	4.21	0.84
6	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	23.66	2.05	0.48
7	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	7.58	5.28	0.45
8	その他(円ヘッジ)	33.80	0.72	0.22
9	ハイイールド債券(ヘッジなし)	8.65	1.38	0.13
10	その他(ヘッジなし)	8.65	1.39	0.12
11	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	3.56	2.06	0.08
12	複合資産(円ヘッジ)	11.97	0.51	0.06
13	エマージング債券(ヘッジなし)	5.31	0.86	0.06
14	外国REIT(円ヘッジ)	22.37	0.12	0.02
15	ハイイールド債券(円ヘッジ)	6.59	0.13	0.01
16	エマージング債券(円ヘッジ)	11.16	0.04	0.00
17	国内株式(円ヘッジ)	15.72	0.02	0.00
18	国内債券(円ヘッジ)	0.34	0.97	0.00
19	エマージング株式(円ヘッジ)	8.18	0.00	0.00
20	国内債券(ヘッジなし)	-0.49	2.75	-0.01
21	国内REIT(ヘッジなし)	-3.48	2.07	-0.08
	合計		96.02	17.35

◆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

<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

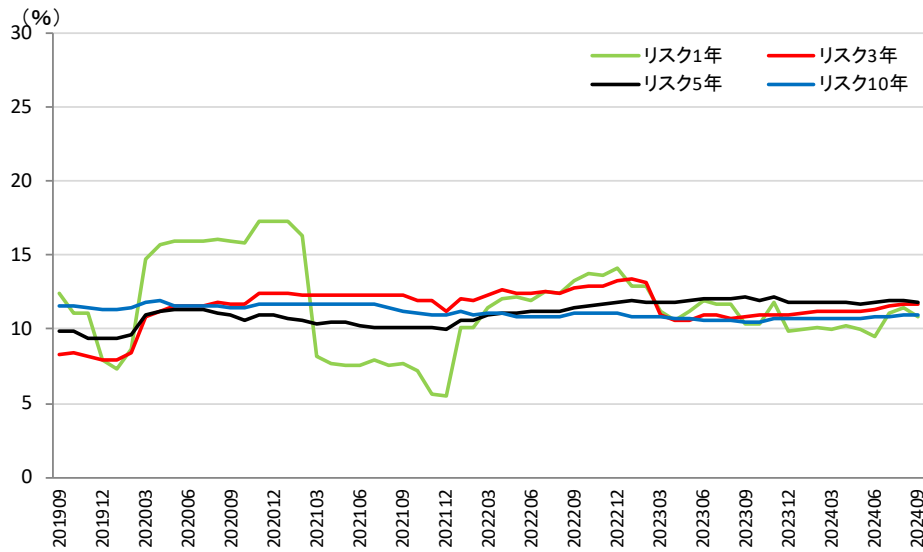
	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	24.96	56.84	79.61	11.64	11.87	10.91	0.66	0.80	0.55
国内株式	29.47	79.27	130.23	12.86	14.40	15.25	0.70	0.86	0.57
国内債券	-6.98	-8.60	-1.51	2.58	2.28	2.06	-0.92	-0.77	-0.07
外国株式(先進国)	35.91	109.73	142.80	17.08	17.33	16.39	0.63	0.92	0.57
エマージング株式	37.93	82.66	99.97	11.64 ↑	17.00	16.33	0.97	0.75	0.44
外国債券(先進国)	4.98	11.95	11.38	5.33	5.15	5.40	0.31	0.45	0.20
エマージング債券	26.22	28.12	29.92	7.91	10.22	10.59	1.02	0.50	0.25
ハイイールド債券	28.85	43.17	55.72	8.52	11.30	10.56	1.04	0.66	0.43
複合資産	13.33	26.80	43.97	6.87	7.22	7.21	0.62	0.68	0.52
国内REIT	-6.40	-4.53	41.41	10.15	14.85	12.31	-0.21	-0.06	0.29
外国REIT	33.63	52.32	111.38	17.85	19.06	16.69	0.57	0.46	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

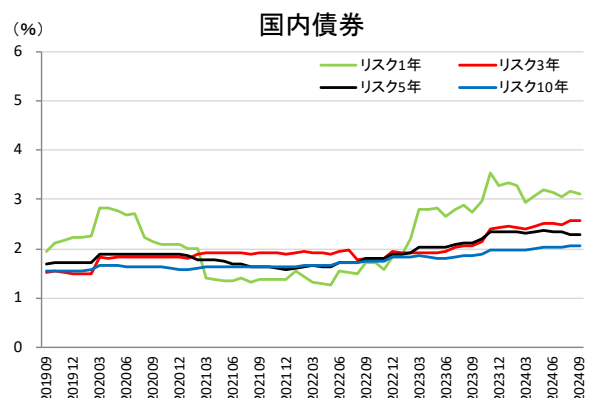
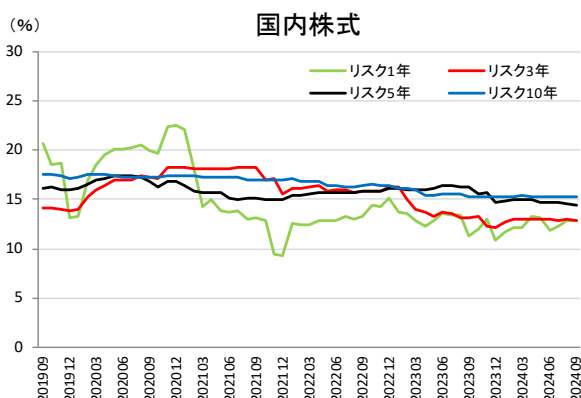
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

(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」

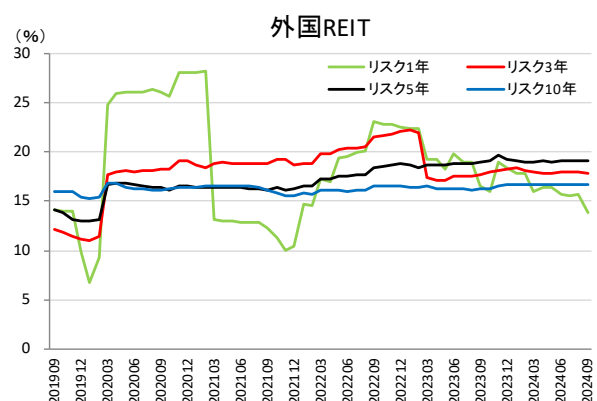
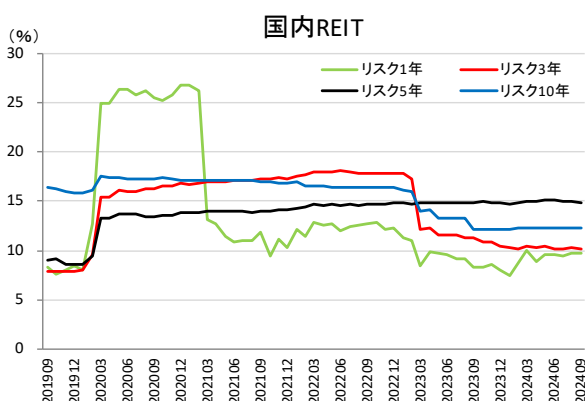
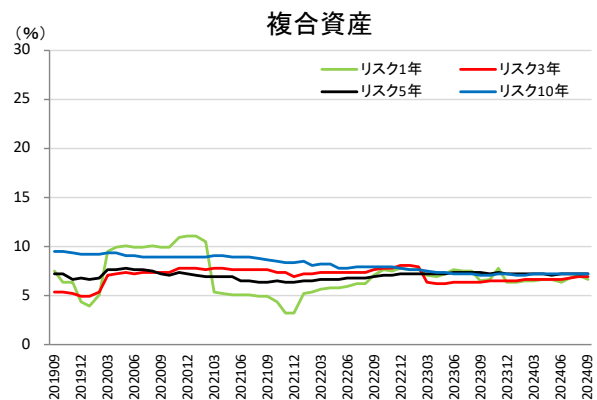
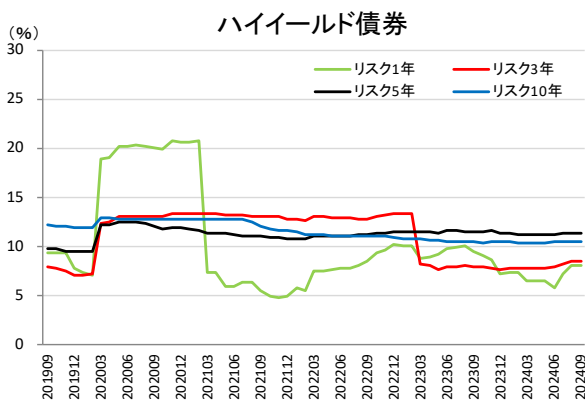
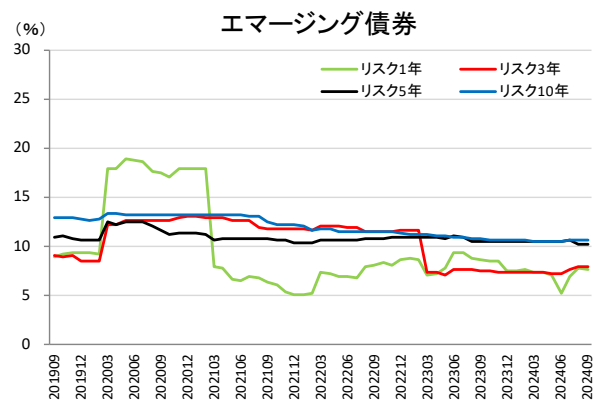
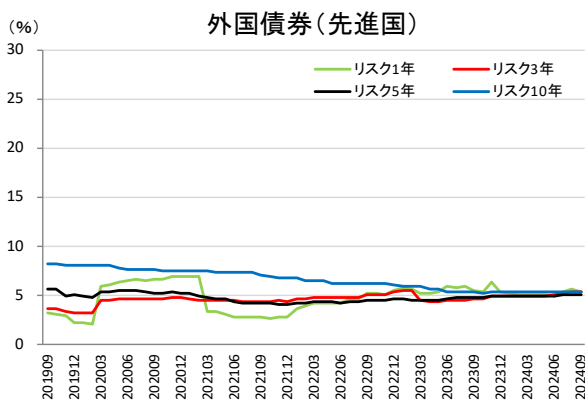
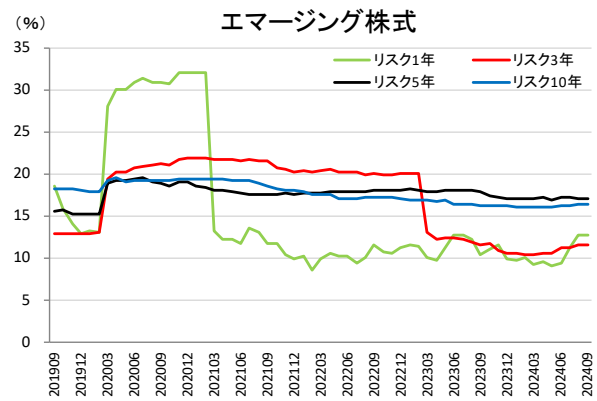
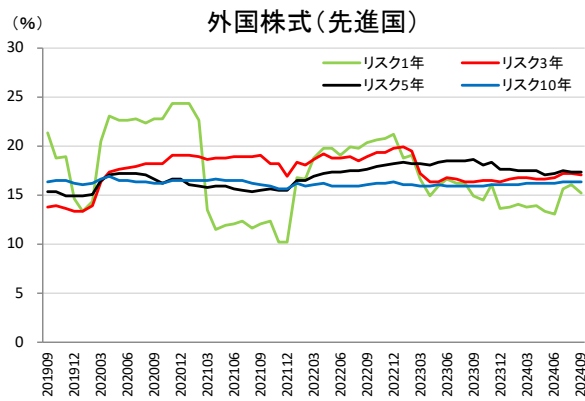


<2>リスク・サマリー

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)

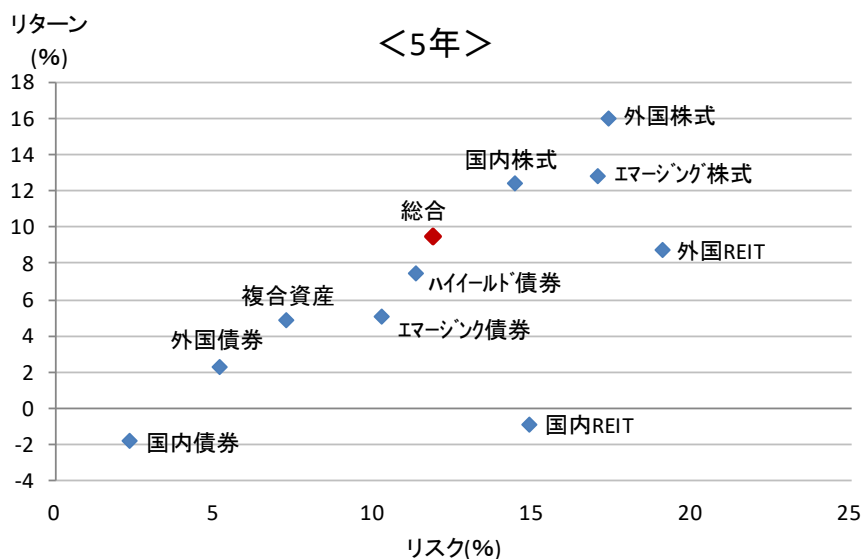
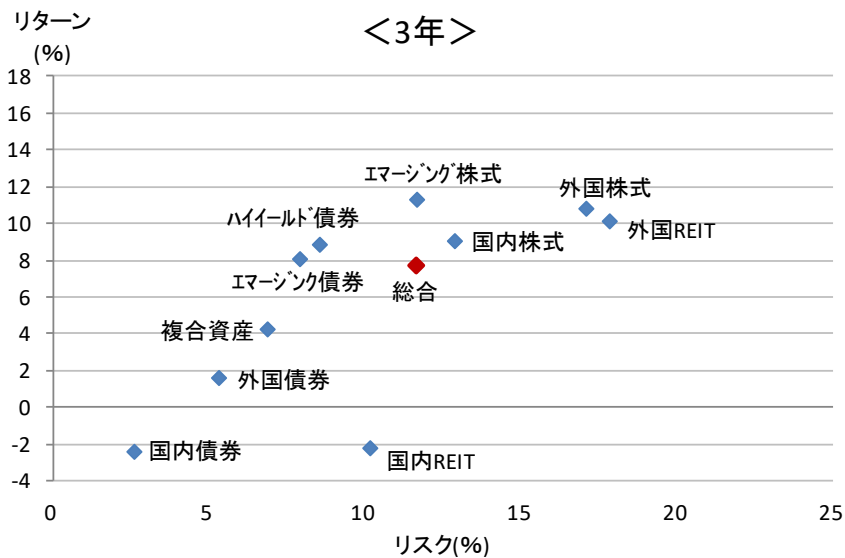
② 「大分類」



<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	7.71	9.42	11.64	11.87
国内株式	8.99	12.38	12.86	14.40
国内債券	-2.38	-1.78	2.58	2.28
外国株式(先進国)	10.77	15.97	17.08	17.33
エマーヅィング株式	11.31	12.81	11.64	17.00
外国債券(先進国)	1.63	2.28	5.33	5.15
エマーヅィング債券	8.07	5.08	7.91	10.22
ハイイルド債券	8.82	7.44	8.52	11.30
複合資産	4.26	4.86	6.87	7.22
国内REIT	-2.18	-0.92	10.15	14.85
外国REIT	10.15	8.78	17.85	19.06

※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）」

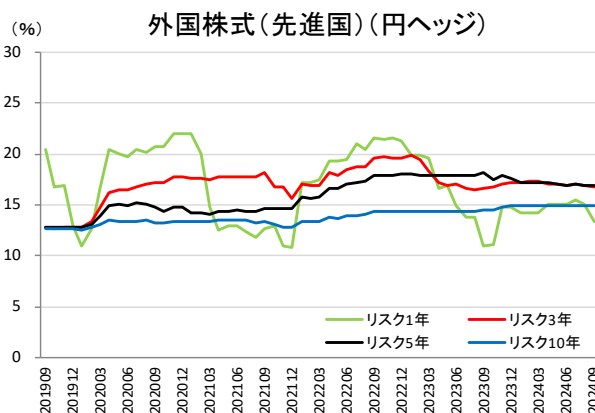
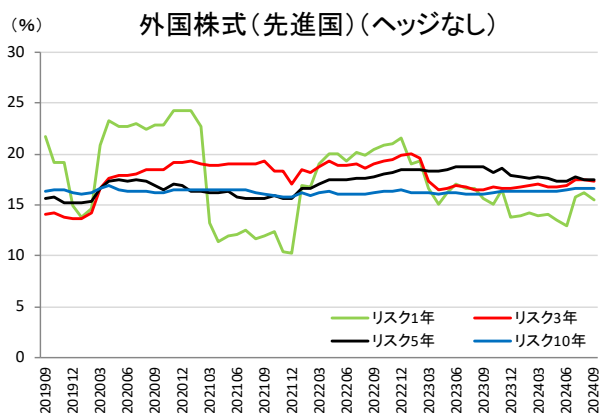
(1) 期間別リスク・リターン

	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	24.96	56.84	79.61	11.64	11.87	10.91	0.66	0.80	0.55
国内株式	29.47	79.27	130.23	12.86	14.40	15.25	0.70	0.86	0.57
ヘッジなし	27.98	77.87	134.92	12.82	14.34	14.81	0.67	0.85	0.60
国内債券	-6.98	-8.60	-1.51	2.58	2.28	2.06	-0.92	-0.77	-0.07
ヘッジなし	-6.31	-7.99	-1.01	2.61	2.29	2.06	-0.82	-0.72	-0.04
外国株式(先進国)	35.91	109.73	142.80	17.08	17.33	16.39	0.63	0.92	0.57
ヘッジなし	39.68	117.26	159.97	17.33	17.48	16.62	0.68	0.96	0.60
円ヘッジ	1.22	56.16	85.66	16.75	16.92	14.96	0.02	0.55	0.43
エマージング株式	37.93	82.66	99.97	11.64	↑ 17.00	16.33	0.97	0.75	0.44
ヘッジなし	38.19	83.10	100.59	11.64	↑ 17.01	16.34	0.98	0.76	0.44
円ヘッジ	-29.47	-15.54	-5.23	19.39	20.07	19.22	-0.57	-0.16	-0.03
外国債券(先進国)	4.98	11.95	11.38	5.33	5.15	5.40	0.31	0.45	0.20
ヘッジなし	13.88	23.53	20.92	7.25	6.43	6.65	0.61	0.67	0.29
円ヘッジ	-10.88	-8.90	-3.00	4.46	4.47	3.63	-0.84	-0.41	-0.08
エマージング債券	26.22	28.12	29.92	7.91	10.22	10.59	1.02	0.50	0.25
ヘッジなし	30.96	34.11	36.94	8.18	9.43	10.07	1.15	0.64	0.32
円ヘッジ	-15.14	-12.76	-3.99	9.63	11.11	8.67	-0.55	-0.24	-0.05
ハイイールド債券	28.85	43.17	55.72	8.52	11.30	10.56	1.04	0.66	0.43
ヘッジなし	33.53	55.64	83.18	9.17	10.51	10.11	1.10	0.88	0.62
円ヘッジ	-7.00	0.92	12.10	6.99	9.41	7.37	-0.34	0.02	0.16
複合資産	13.33	26.80	43.97	6.87	7.22	7.21	0.62	0.68	0.52
ヘッジなし	17.24	32.81	52.05	7.26	7.55	7.57	0.75	0.78	0.57
円ヘッジ	-3.75	2.43	12.02	8.20	8.34	6.88	-0.15	0.06	0.17
国内REIT	-6.40	-4.53	41.41	10.15	14.85	12.31	-0.21	-0.06	0.29
ヘッジなし	-7.51	-5.58	42.20	10.11	14.70	12.16	-0.25	-0.08	0.30
外国REIT	33.63	52.32	111.38	17.85	19.06	16.69	0.57	0.46	0.47
ヘッジなし	35.34	55.55	117.62	17.98	19.09	16.77	0.59	0.48	0.48
円ヘッジ	-6.99	-0.49	27.52	19.46	19.76	16.01	-0.12	-0.00	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

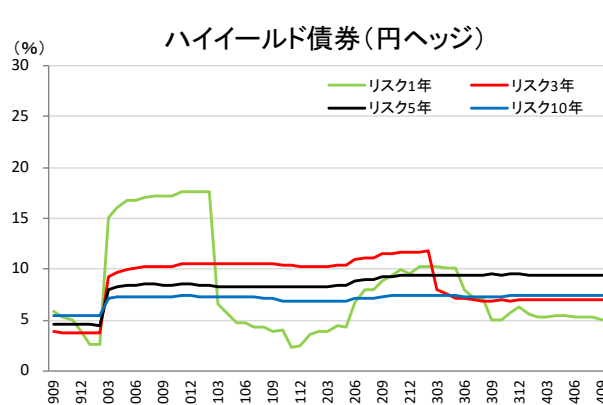
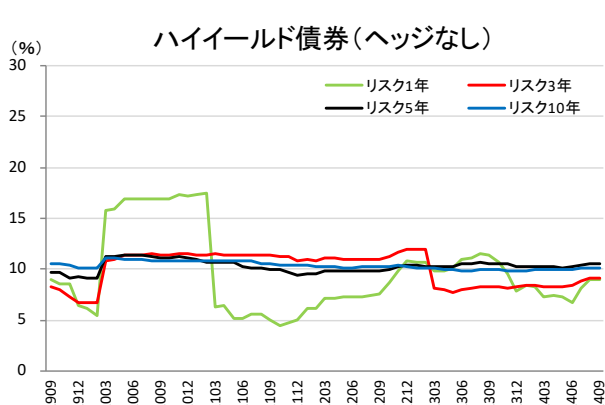
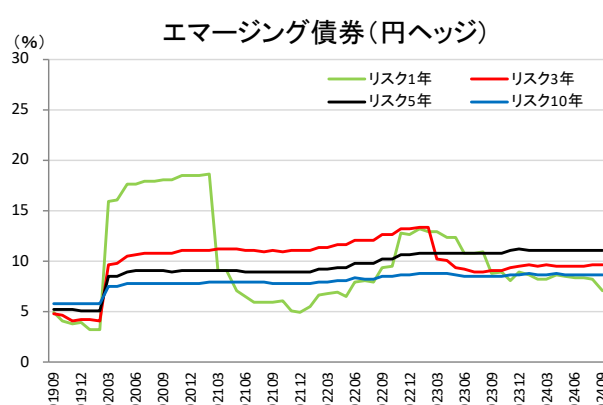
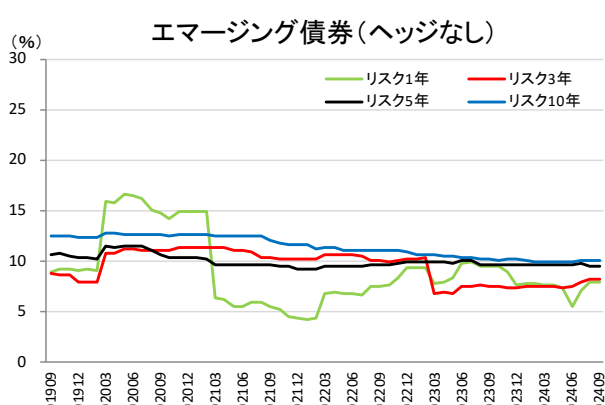
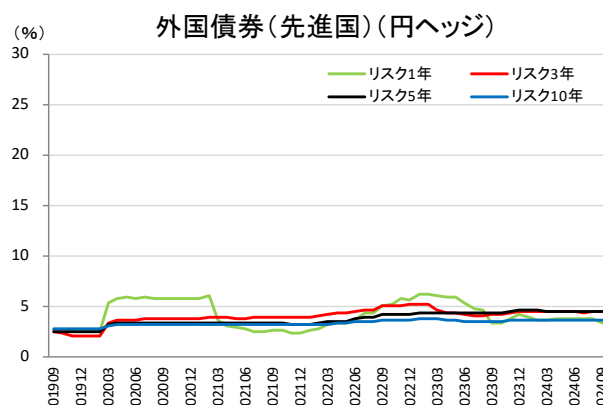
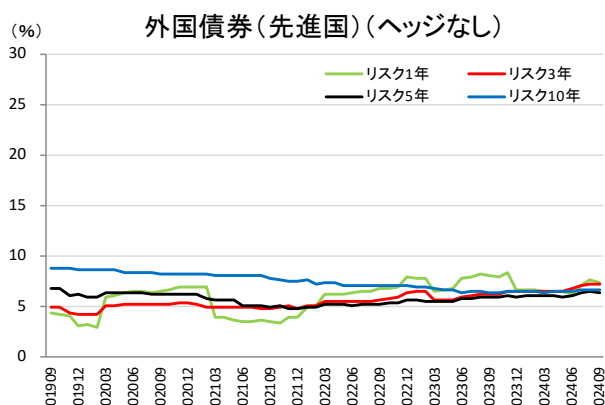
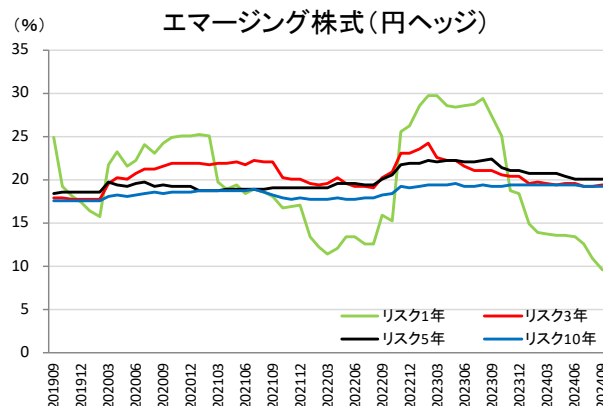
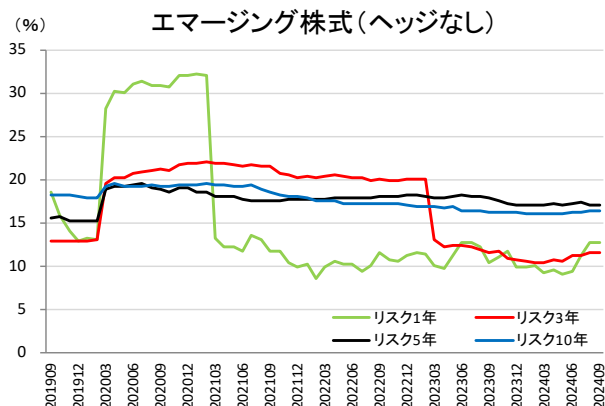
(2) リスク推移 (直近5年間、月次リターン・ベース)



<2> リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

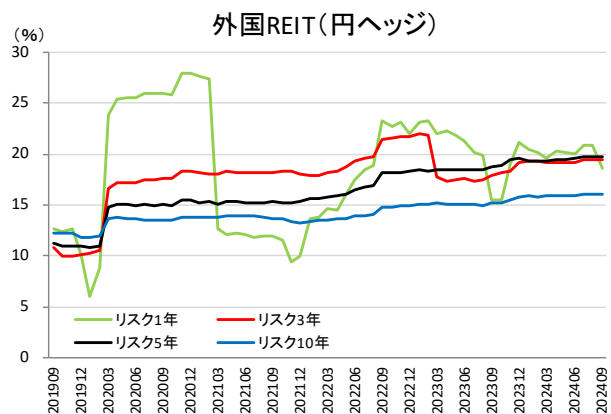
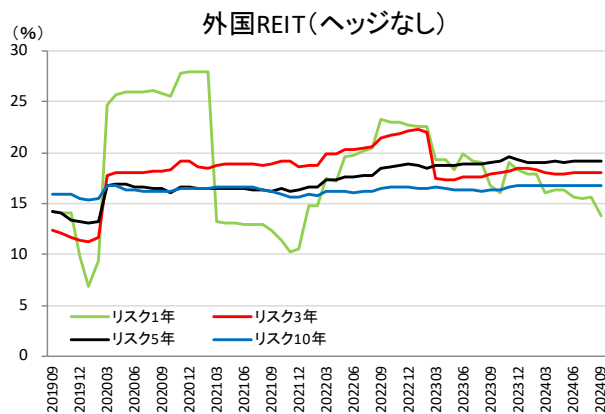
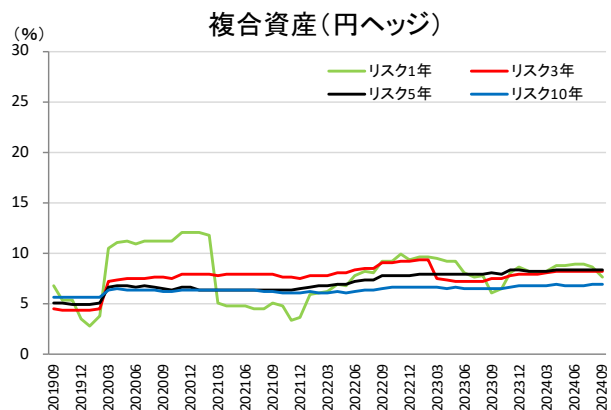
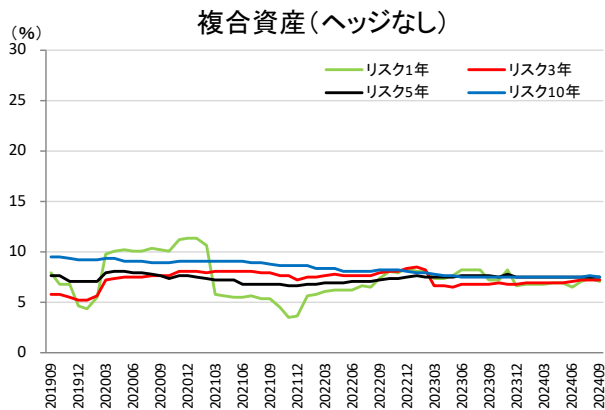
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



<2> リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

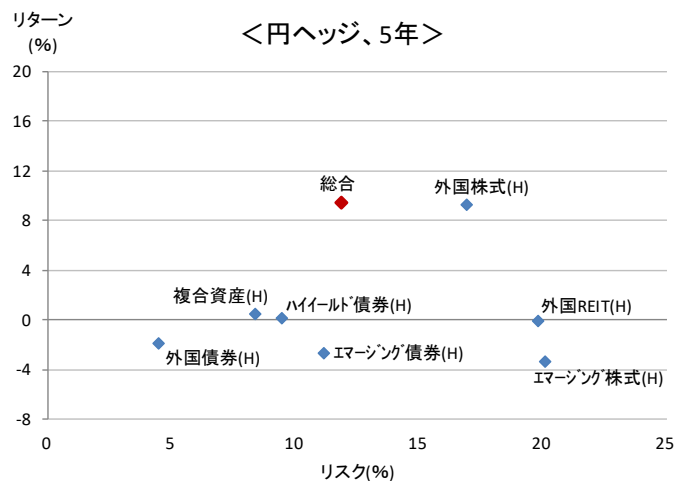
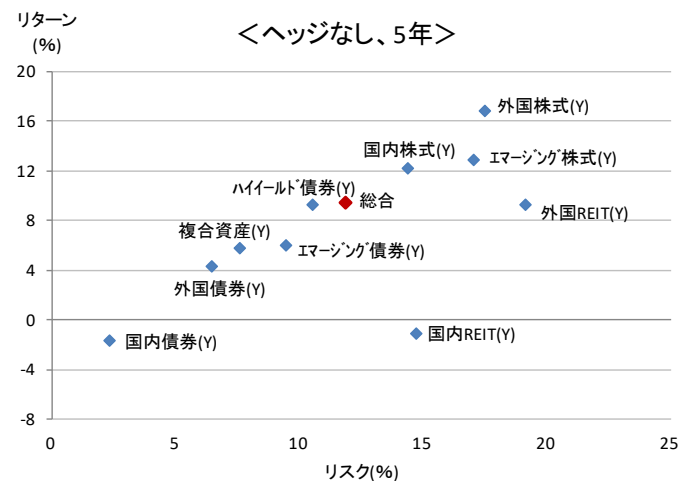
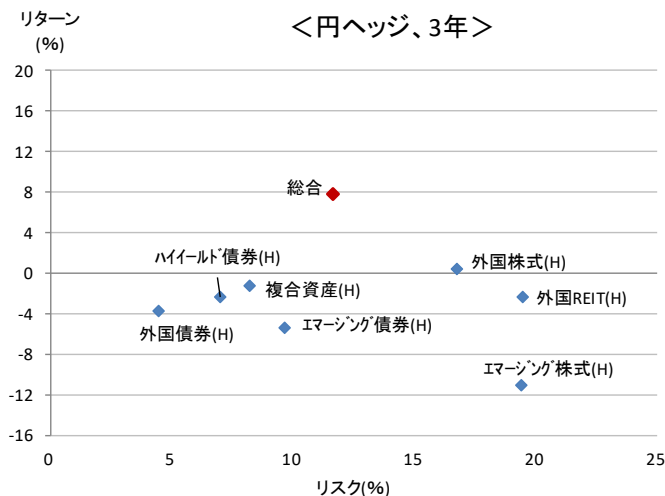
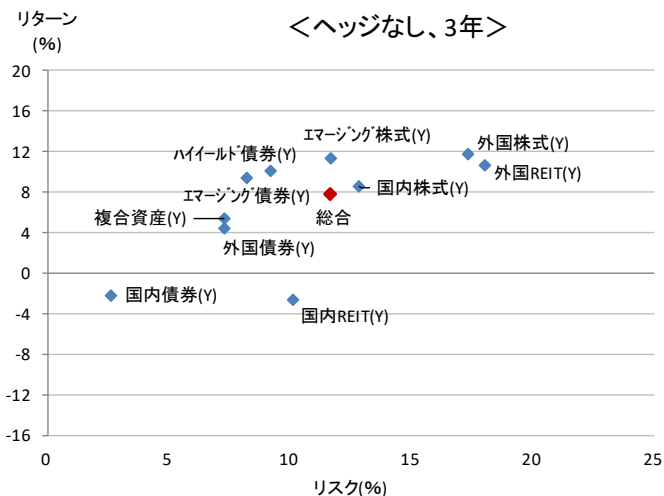
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



<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	7.71	9.42	11.64	11.87
国内株式(Y)	8.57	12.21	12.82	14.34
国内債券(Y)	-2.15	-1.65	2.61	2.29
外国株式(先進国)(Y)	11.78	16.79	17.33	17.48
エマーシング株式(Y)	11.39	12.86	11.64	17.01
外国債券(先進国)(Y)	4.43	4.32	7.25	6.43
エマーシング債券(Y)	9.41	6.05	8.18	9.43
ハイールド債券(Y)	10.12	9.25	9.17	10.51
複合資産(Y)	5.44	5.84	7.26	7.55
国内REIT(Y)	-2.57	-1.14	10.11	14.70
外国REIT(Y)	10.61	9.24	17.98	19.09

<円ヘッジ>	リターン(%)		リスク(%)	
	3年	5年	3年	5年
総合	7.71	9.42	11.64	11.87
外国株式(先進国)(H)	0.40	9.32	16.75	16.92
エマーシング株式(H)	-10.99	-3.32	19.39	20.07
外国債券(先進国)(H)	-3.77	-1.85	4.46	4.47
エマーシング債券(H)	-5.33	-2.69	9.63	11.11
ハイールド債券(H)	-2.39	0.18	6.99	9.41
複合資産(H)	-1.27	0.48	8.20	8.34
外国REIT(H)	-2.39	-0.10	19.46	19.76

※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	11,649	44,602	90,028	145,857
国内株式	893	5,726	10,474	17,170
国内債券	243	543	1,353	2,961
外国株式(先進国)	8,197	29,609	57,659	95,908
エマージング株式	554	3,113	9,801	16,718
外国債券(先進国)	638	1,834	3,368	5,627
エマージング債券	-3	-231	-173	-271
ハイイールド債券	144	278	450	915
複合資産	1,043	3,845	6,622	8,746
国内REIT	-261	-703	-668	-1,738
外国REIT	267	-322	-568	-1,655
その他	-65	908	1,710	1,474

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	11,649	44,602	90,028	145,857
国内株式	893	5,726	10,474	17,170
ヘッジなし	920	5,774	10,540	17,449
国内債券	243	543	1,353	2,961
ヘッジなし	71	203	907	1,772
外国株式(先進国)	8,197	29,609	57,659	95,908
ヘッジなし	8,417	30,704	60,940	103,006
円ヘッジ	-166	-866	-2,695	-5,869
エマージング株式	554	3,113	9,801	16,718
ヘッジなし	555	3,117	9,811	16,744
円ヘッジ	-1	-3	-7	-13
外国債券(先進国)	638	1,834	3,368	5,627
ヘッジなし	325	1,461	2,999	4,790
円ヘッジ	270	213	276	96
エマージング債券	-3	-231	-173	-271
ヘッジなし	15	-170	-15	46
円ヘッジ	-2	-13	-31	-64
ハイイールド債券	144	278	450	915
ヘッジなし	153	369	699	1,613
円ヘッジ	-4	-45	-134	-237
複合資産	1,043	3,845	6,622	8,746
ヘッジなし	1,002	3,647	7,313	10,785
円ヘッジ	-22	-67	-192	-672
国内REIT	-261	-703	-668	-1,738
ヘッジなし	-256	-690	-648	-1,662
外国REIT	267	-322	-568	-1,655
ヘッジなし	219	-304	-511	-1,548
円ヘッジ	50	2	-13	6
その他	-65	908	1,710	1,474

<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	1,285,989	100.0		5,265	100.0
国内株式	167,877	13.1		759	14.4
国内債券	44,120	3.4		151	2.9
外国株式(先進国)	617,113	48.0		1,220	23.2
エマージング株式	59,639	4.6		302	5.7
外国債券(先進国)	99,749	7.8		726	13.8
エマージング債券	11,499	0.9		219	4.2
ハイイールド債券	20,967	1.6		212	4.0
複合資産	164,005	12.8		1,063	20.2
国内REIT	22,673	1.8		142	2.7
外国REIT	47,325	3.7		248	4.7
その他	31,021	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	1,285,989	100.0		5,265	100.0
国内株式	167,877	13.1		759	14.4
ヘッジなし	163,962	12.7		715	13.6
国内債券	44,120	3.4		151	2.9
ヘッジなし	25,257	2.0		141	2.7
外国株式(先進国)	617,113	48.0		1,220	23.2
ヘッジなし	589,223	45.8		939	17.8
円ヘッジ	22,368	1.7		220	4.2
エマージング株式	59,639	4.6		302	5.7
ヘッジなし	59,571	4.6		289	5.5
円ヘッジ	44	0.0		8	0.2
外国債券(先進国)	99,749	7.8		726	13.8
ヘッジなし	62,042	4.8		410	7.8
円ヘッジ	23,929	1.9		239	4.5
エマージング債券	11,499	0.9		219	4.2
ヘッジなし	9,796	0.8		134	2.5
円ヘッジ	447	0.0		27	0.5
ハイイールド債券	20,967	1.6		212	4.0
ヘッジなし	16,537	1.3		75	1.4
円ヘッジ	1,301	0.1		55	1.0
複合資産	164,005	12.8		1,063	20.2
ヘッジなし	139,651	10.9		800	15.2
円ヘッジ	5,928	0.5		72	1.4
国内REIT	22,673	1.8		142	2.7
ヘッジなし	22,045	1.7		123	2.3
外国REIT	47,325	3.7		248	4.7
ヘッジなし	45,313	3.5		179	3.4
円ヘッジ	1,486	0.1		51	1.0
その他	31,021	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	15,836	10.7	2.92	2.83	1.045
国内株式	22,821	14.8	1.58	1.54	0.976
国内債券	10,220	12.6	0.10	0.10	0.472
外国株式(先進国)	19,704	8.1	3.69	3.57	1.034
エマージング株式	15,799	11.3	3.92	3.49	1.649
外国債券(先進国)	10,619	11.1	1.20	1.15	0.946
エマージング債券	10,392	12.6	3.37	3.44	1.353
ハイイールド債券	9,472	12.8	4.75	4.66	1.641
複合資産	14,553	10.1	1.14	1.12	0.909
国内REIT	13,357	10.7	6.52	7.79	0.882
外国REIT	14,072	10.1	7.94	7.14	1.424

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	15,836	10.7	2.92	2.83	1.045
国内株式	22,821	14.8	1.58	1.54	0.976
ヘッジなし	22,634	15.0	1.50	1.45	0.960
国内債券	10,220	12.6	0.10	0.10	0.472
ヘッジなし	10,267	12.8	0.14	0.15	0.288
外国株式(先進国)	19,704	8.1	3.69	3.57	1.034
ヘッジなし	21,179	7.8	3.72	3.61	1.009
円ヘッジ	14,553	8.5	2.98	2.55	1.508
エマージング株式	15,799	11.3	3.92	3.49	1.649
ヘッジなし	16,093	11.3	3.92	3.49	1.649
円ヘッジ	10,029	15.1	0.76	0.74	1.691
外国債券(先進国)	10,619	11.1	1.20	1.15	0.946
ヘッジなし	11,980	12.8	1.51	1.45	0.954
円ヘッジ	8,837	8.4	0.75	0.72	0.838
エマージング債券	10,392	12.6	3.37	3.44	1.353
ヘッジなし	10,913	12.2	3.22	3.35	1.292
円ヘッジ	7,442	12.9	2.83	2.68	1.614
ハイイールド債券	9,472	12.8	4.75	4.66	1.641
ヘッジなし	12,042	12.7	4.97	4.90	1.646
円ヘッジ	8,198	13.8	2.93	2.87	1.618
複合資産	14,553	10.1	1.14	1.12	0.909
ヘッジなし	15,491	11.2	1.20	1.19	0.840
円ヘッジ	10,990	8.9	1.16	1.09	1.348
国内REIT	13,357	10.7	6.52	7.79	0.882
ヘッジなし	12,922	10.6	6.55	7.84	0.868
外国REIT	14,072	10.1	7.94	7.14	1.424
ヘッジなし	15,085	10.2	7.99	7.16	1.426
円ヘッジ	10,306	8.7	5.25	4.78	1.238

(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