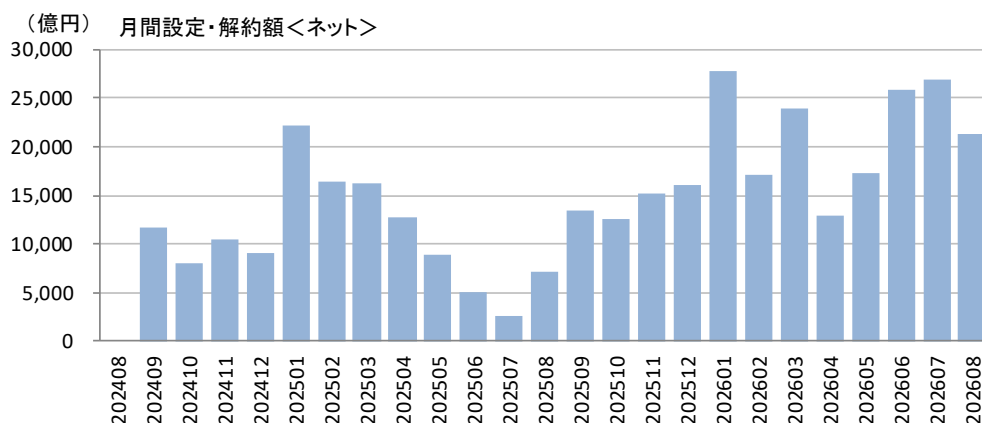
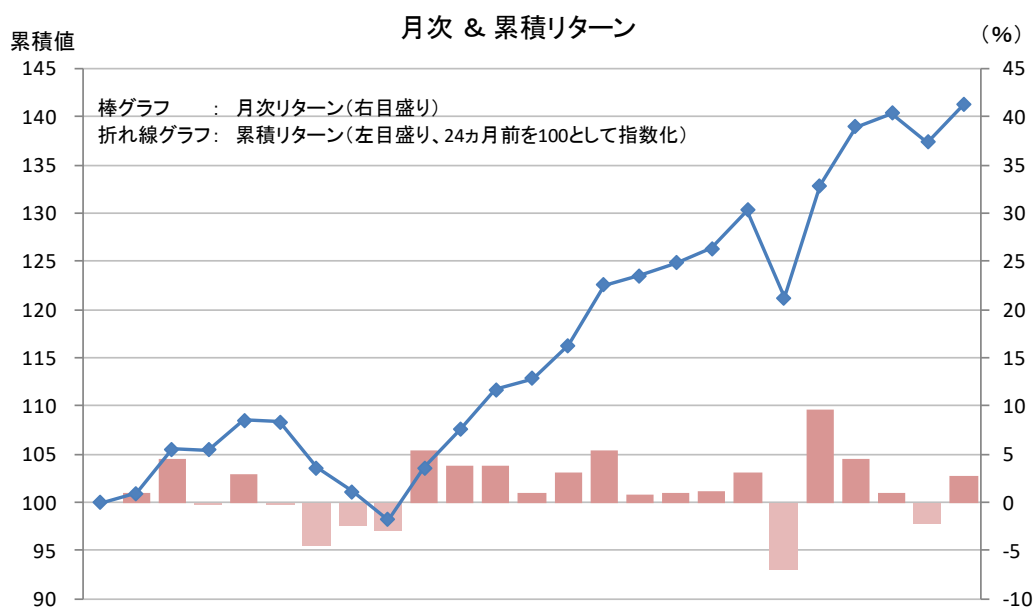


投信指数 MAB-FPI パフォーマンス・サマリー

－ Vol.1 ファンド大分類 編 －

2026年8月

「総合」 +2.79 %
 (前月 -2.10 %)



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

2026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2.79%上昇し、28,299ポイント。
純資産総額は前月末比7兆4,618億円増加し211兆8,128億円。

「大分類別」では、その他+7.05%、エマージング株式+4.39%、外国株式(先進国)+3.45%、国内株式+3.35%など8カテゴリーで上昇した。下落したのは外国REIT-3.54%、国内REIT-3.31%、国内債券-0.73%の3カテゴリー。

「総合」への寄与度では、外国株式(先進国)+1.94%、国内株式+0.47%、その他+0.21%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、5年リスクに上昇傾向が見られる。

「大分類別」では国内株式と外国株式(先進国)、複合資産の5年リスク、およびエマージング株式と国内REITの3年・5年リスクに上昇傾向が見られる。一方、エマージング債券とハイイールド債券の3年リスクには低下傾向が見られる。

＜3＞設定・解約額[ネット金額]（弊社推計値）

「総合」は+2兆1,371億円と引き続き大幅な流入超となった。

「大分類別」では、外国株式(先進国)+1兆5,331億円、国内株式+3,161億円、複合資産+1,792億円、外国債券(先進国)+581億円、その他+426億円、国内債券+405億円など、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エマージング株式-270億円、外国REIT-198億円 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
28,299	27,531	+767	+2.79 %

◇累積リターン

3ヵ月	+1.65 %
6ヵ月	+8.40 %
1年	+25.14 %
年初来	+13.10 %

◇年初来高値／安値

日付	指数	累積リターン
高値 2026/08/14	28,513	+13.95 %
安値 2026/03/31	24,285	-2.94 %

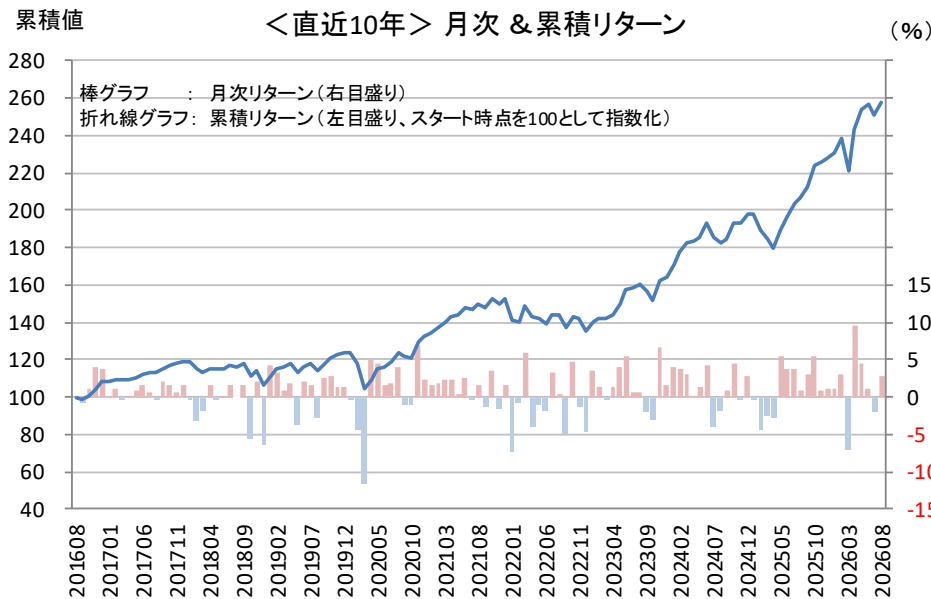
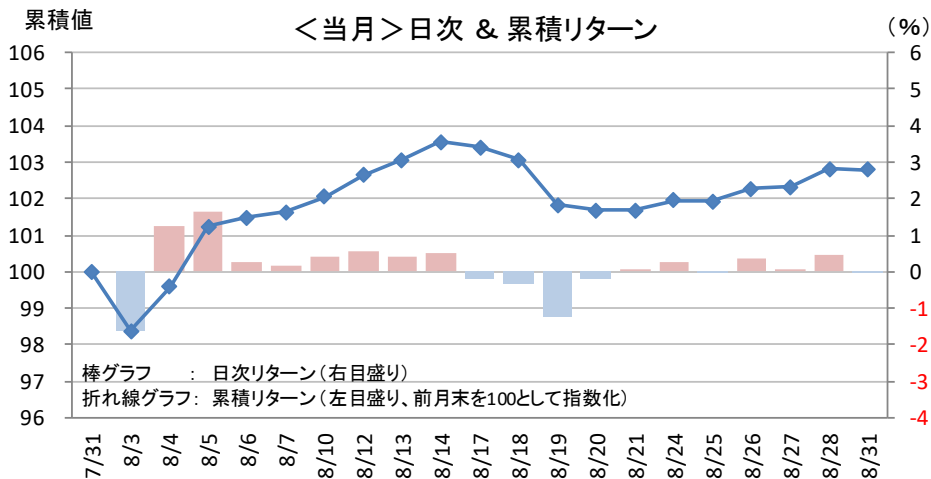
◇純資産総額

当月末	前月末	増減
211兆8,128億円	204兆3,510億円	+7兆4,618億円

◇月間設定・解約額<ネット>

(弊社推計値)

+2兆1,371億円



<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		28,299	27,531	767	2.79
国内株式		44,402	42,964	1,439	3.35
国内債券		11,126	11,207	-82	-0.73
外国株式(先進国)		44,284	42,805	1,479	3.45
エマージング株式		30,007	28,745	1,262	4.39
外国債券(先進国)		21,790	21,786	5	0.02
エマージング債券		26,339	26,268	71	0.27
ハイイールド債券		37,386	37,228	158	0.42
複合資産		26,932	26,513	420	1.58
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	38,225	39,534	-1,309	-3.31
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	50,126	51,967	-1,841	-3.54
その他		11,179	10,442	736	7.05

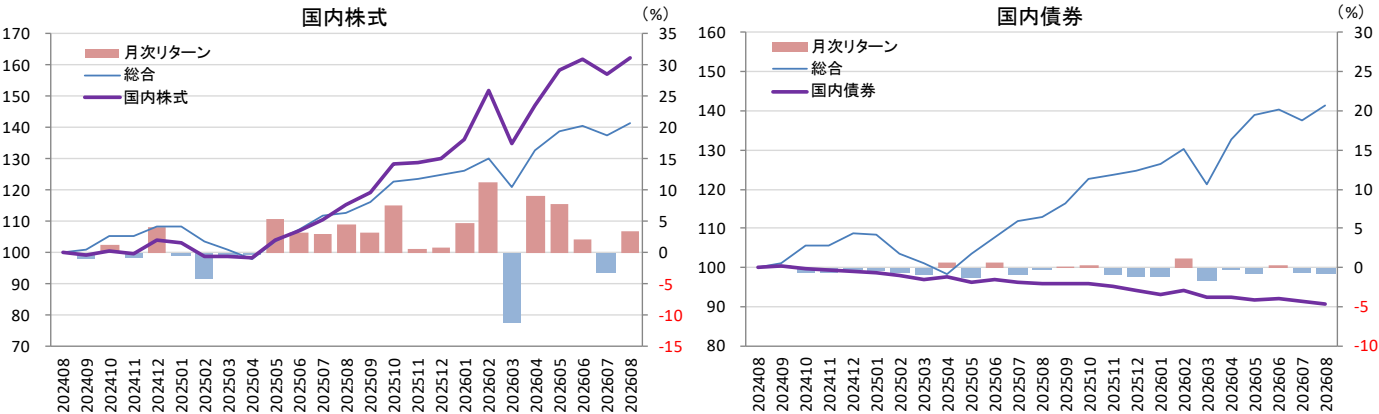
※算出開始時点に記載がない場合、1997 年 3 月 31 日=10,000
[色塗りの基準]月次リターン> 総合

(2) 期間別リターン

	3ヵ月(%)	6ヵ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	1.65	8.40	25.14	13.10
国内株式	2.45	7.05	40.72	24.78
国内債券	-1.10	-3.69	-5.42	-3.64
外国株式(先進国)	1.95	13.20	28.81	14.91
エマージング株式	2.25	2.73	18.19	7.04
外国債券(先進国)	-0.24	0.02	7.49	1.53
エマージング債券	1.25	1.75	14.06	4.76
ハイイールド債券	0.97	3.64	13.24	4.89
複合資産	1.31	2.89	15.88	7.57
国内REIT	0.09	-8.82	-2.54	-8.32
外国REIT	1.44	5.94	22.05	14.96
その他	-0.68	-2.95	30.66	9.41

※[色塗りの基準]期間別リターン> 総合

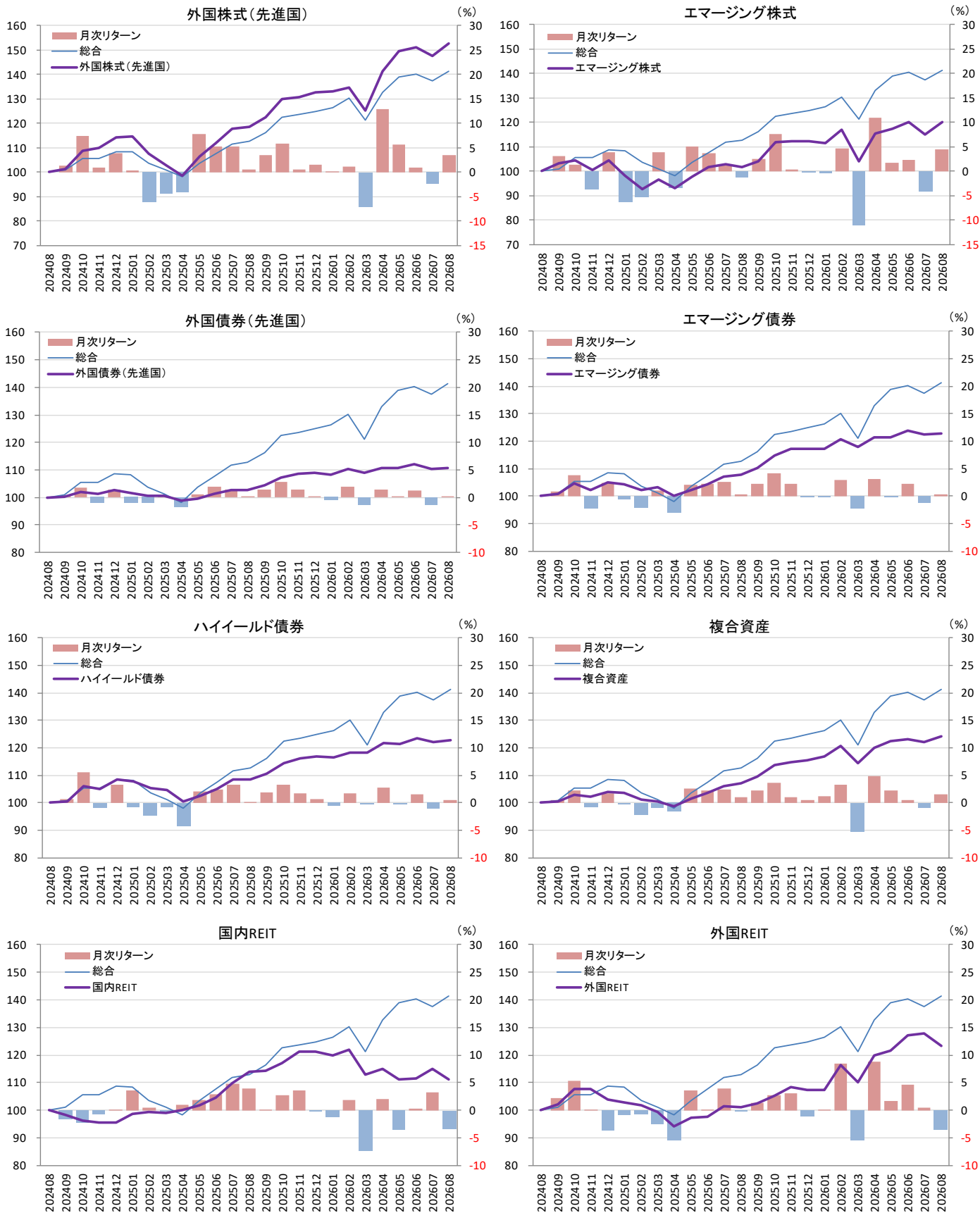
(3) リターン推移 (24 ヶ月前を 100 として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))



＜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	2.79		
1	外国株式(先進国)	3.45	56.21	1.94
2	国内株式	3.35	14.09	0.47
3	その他	7.05	3.03	0.21
4	複合資産	1.58	11.27	0.18
5	エマージング株式	4.39	3.02	0.13
6	ハイイールド債券	0.42	1.15	0.00
7	エマージング債券	0.27	0.58	0.00
8	外国債券(先進国)	0.02	4.97	-0.00
9	国内債券	-0.73	2.30	-0.02
10	国内REIT	-3.31	1.08	-0.04
11	外国REIT	-3.54	2.31	-0.09
	合計		100.00	2.79

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	25.14		
1	外国株式(先進国)	28.81	54.62	15.69
2	国内株式	40.72	13.29	4.96
3	複合資産	15.88	11.69	1.89
4	その他	30.66	3.10	0.84
5	エマージング株式	18.19	3.36	0.62
6	外国REIT	22.05	2.55	0.54
7	外国債券(先進国)	7.49	5.62	0.47
8	ハイイールド債券	13.24	1.29	0.18
9	エマージング債券	14.06	0.66	0.10
10	国内REIT	-2.54	1.31	-0.01
11	国内債券	-5.42	2.52	-0.13
	合計		100.00	25.14

◆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		28,299	27,531	767	2.79	
国内株式		44,402	42,964	1,439	3.35	
	ヘッジなし	45,175	43,713	1,462	3.35	
国内債券		11,126	11,207	-82	-0.73	
	ヘッジなし	11,211	11,297	-86	-0.76	
外国株式(先進国)		44,284	42,805	1,479	3.45	
	ヘッジなし	53,445	51,656	1,789	3.46	
	円ヘッジ	25,094	24,222	873	3.60	
エマージング株式		30,007	28,745	1,262	4.39	
	ヘッジなし	29,088	27,865	1,223	4.39	
	円ヘッジ	26,430	24,176	2,254	9.32	
外国債券(先進国)		21,790	21,786	5	0.02	
	ヘッジなし	25,933	25,912	20	0.08	
	円ヘッジ	12,974	12,982	-8	-0.06	
エマージング債券		26,339	26,268	71	0.27	
	ヘッジなし	28,633	28,583	49	0.17	
	円ヘッジ	17,725	17,601	124	0.70	
ハイイールド債券		37,386	37,228	158	0.42	
	ヘッジなし	44,793	44,628	165	0.37	
	円ヘッジ	16,722	16,603	119	0.71	
複合資産		26,932	26,513	420	1.58	
	ヘッジなし	28,616	28,170	446	1.58	
	円ヘッジ	16,632	16,381	251	1.53	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	38,225	39,534	-1,309	-3.31	
	ヘッジなし 10,000 (2003.10.31)	37,953	39,238	-1,285	-3.28	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	50,126	51,967	-1,841	-3.54	
	ヘッジなし 10,000 (2003.09.30)	52,076	53,999	-1,923	-3.56	
	円ヘッジ 10,000 (2003.10.31)	18,947	19,598	-651	-3.32	
その他		11,179	10,442	736	7.05	

※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

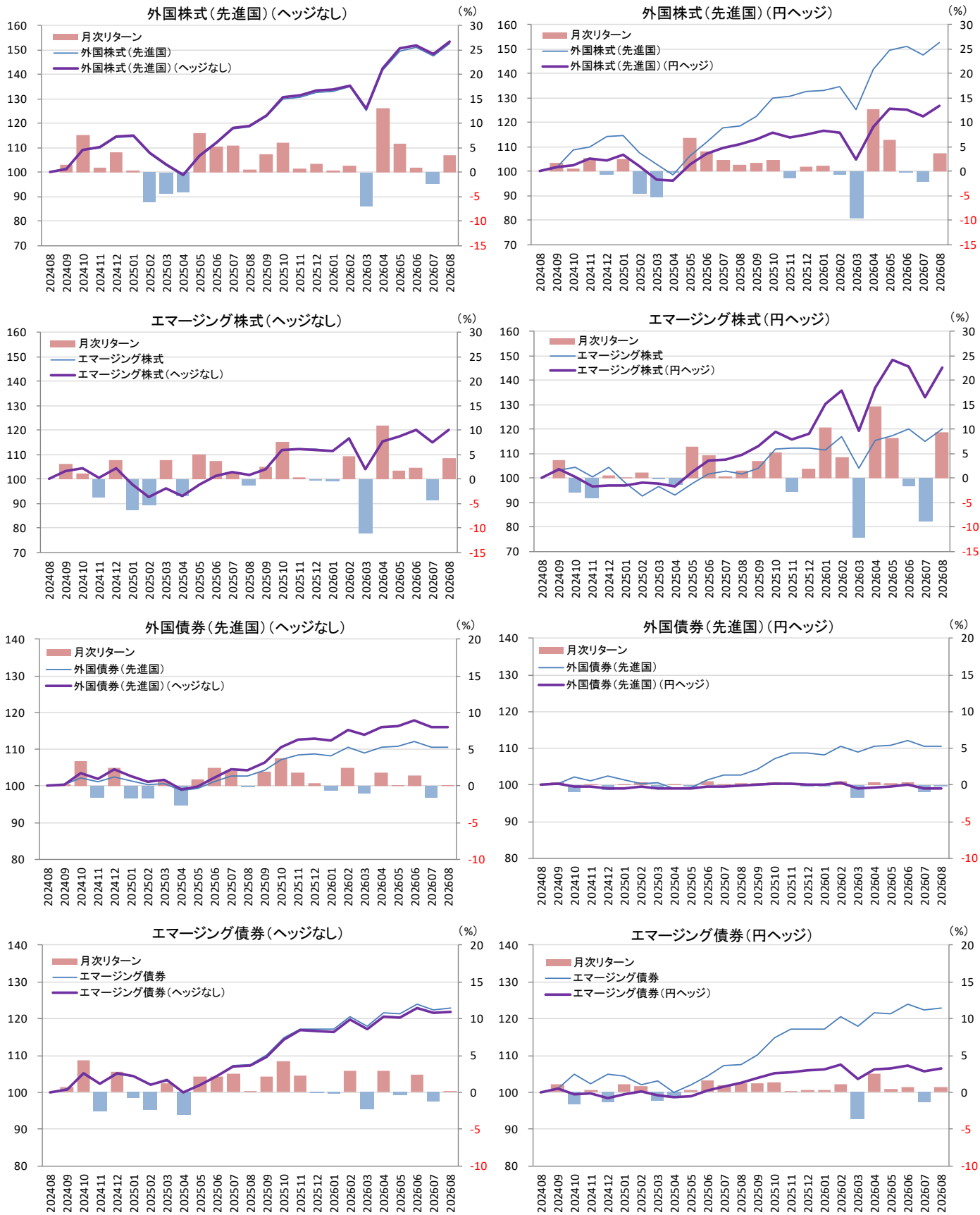
	3ヵ月(%)		6ヵ月(%)		1年(%)		年初来(%)	
総合	1.65		8.40		25.14		13.10	
国内株式	2.45		7.05		40.72		24.78	
ヘッジなし	2.41		6.93		40.33		24.59	
国内債券	-1.10		-3.69		-5.42		-3.64	
ヘッジなし	-1.24		-3.91		-5.82		-3.84	
外国株式(先進国)	1.95		13.20		28.81		14.91	
ヘッジなし	1.98		13.33		29.21		15.01	
円ヘッジ	0.99		9.59		14.22		10.33	
エマージング株式	2.25		2.73		18.19		7.04	
ヘッジなし	2.26		2.73		18.18		7.03	
円ヘッジ	-1.93		6.91		32.90		23.04	
外国債券(先進国)	-0.24		0.02		7.49		1.53	
ヘッジなし	-0.04		0.87		11.31		2.76	
円ヘッジ	-0.64		-1.63		-0.75		-1.16	
エマージング債券	1.25		1.75		14.06		4.76	
ヘッジなし	1.29		1.57		13.50		4.29	
円ヘッジ	-0.09		-0.84		3.81		0.63	
ハイイールド債券	0.97		3.64		13.24		4.89	
ヘッジなし	0.95		3.73		12.91		4.23	
円ヘッジ	0.17		-0.28		0.32		0.03	
複合資産	1.31		2.89		15.88		7.57	
ヘッジなし	1.37		3.07		16.69		7.91	
円ヘッジ	0.61		1.37		9.79		5.82	
国内REIT	0.09		-8.82		-2.54		-8.32	
ヘッジなし	0.01		-8.98		-3.12		-8.65	
外国REIT	1.44		5.94		22.05		14.96	
ヘッジなし	1.46		6.08		22.46		15.11	
円ヘッジ	0.46		2.17		9.89		11.10	
その他	-0.68		-2.95		30.66		9.41	

※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）」

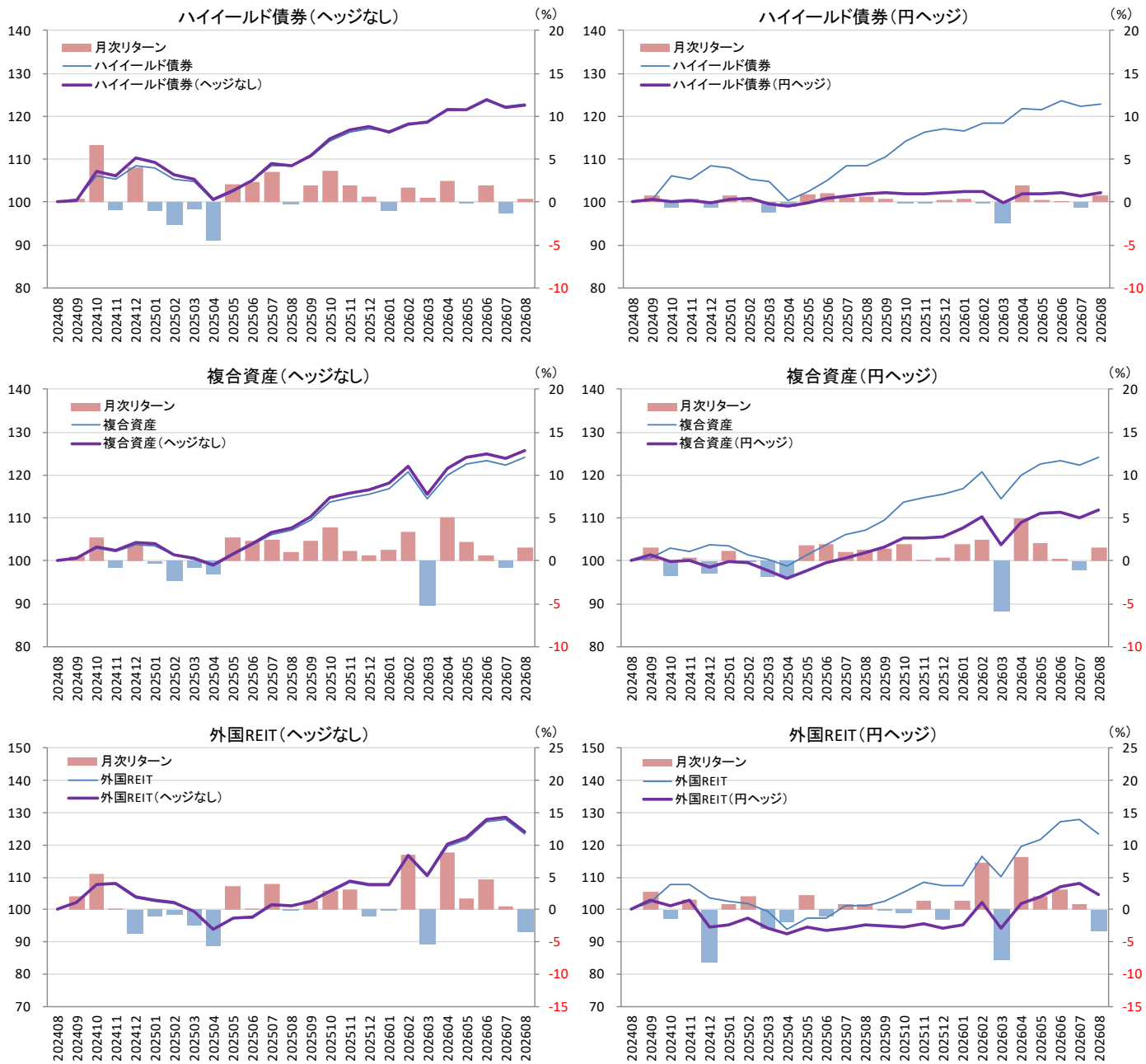
(3) リターン推移（24ヵ月前を100として指数化（折れ線グラフ、左目盛り））



<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	2.79		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	3.46	54.94	1.90
2	国内株式(ヘッジなし)	3.35	13.81	0.46
3	その他(ヘッジなし)	7.02	2.36	0.16
4	複合資産(ヘッジなし)	1.58	9.64	0.15
5	エマージング株式(ヘッジなし)	4.39	3.02	0.13
6	その他(円ヘッジ)	8.14	0.56	0.04
7	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	3.60	0.99	0.04
8	複合資産(円ヘッジ)	1.53	0.25	0.00
9	ハイイールド債券(ヘッジなし)	0.37	0.95	0.00
10	国内株式(円ヘッジ)	5.33	0.02	0.00
11	エマージング債券(ヘッジなし)	0.17	0.51	0.00
12	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	0.08	3.50	0.00
13	ハイイールド債券(円ヘッジ)	0.71	0.05	0.00
14	エマージング債券(円ヘッジ)	0.70	0.02	0.00
15	エマージング株式(円ヘッジ)	9.32	0.00	0.00
16	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	-0.06	0.84	-0.00
17	外国REIT(円ヘッジ)	-3.32	0.06	-0.00
18	国内債券(円ヘッジ)	-0.69	1.05	-0.01
19	国内債券(ヘッジなし)	-0.76	1.25	-0.01
20	国内REIT(ヘッジなし)	-3.28	1.04	-0.04
21	外国REIT(ヘッジなし)	-3.56	2.23	-0.08
	合計		97.09	2.75

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	25.14		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	29.21	53.17	15.46
2	国内株式(ヘッジなし)	40.33	13.01	4.83
3	複合資産(ヘッジなし)	16.69	10.01	1.69
4	その他(ヘッジなし)	34.15	2.33	0.66
5	エマージング株式(ヘッジなし)	18.18	3.35	0.62
6	外国REIT(ヘッジなし)	22.46	2.46	0.53
7	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	11.31	3.88	0.47
8	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	14.22	1.12	0.16
9	その他(円ヘッジ)	23.77	0.61	0.15
10	ハイイールド債券(ヘッジなし)	12.91	1.06	0.14
11	エマージング債券(ヘッジなし)	13.50	0.58	0.08
12	複合資産(円ヘッジ)	9.79	0.29	0.03
13	国内株式(円ヘッジ)	44.10	0.02	0.01
14	外国REIT(円ヘッジ)	9.89	0.07	0.01
15	エマージング債券(円ヘッジ)	3.81	0.02	0.00
16	エマージング株式(円ヘッジ)	32.90	0.00	0.00
17	ハイイールド債券(円ヘッジ)	0.32	0.06	0.00
18	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	-0.75	1.04	-0.00
19	国内REIT(ヘッジなし)	-3.12	1.27	-0.02
20	国内債券(円ヘッジ)	-4.92	1.14	-0.05
21	国内債券(ヘッジなし)	-5.82	1.38	-0.08
	合計		97.09	24.67

◆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」

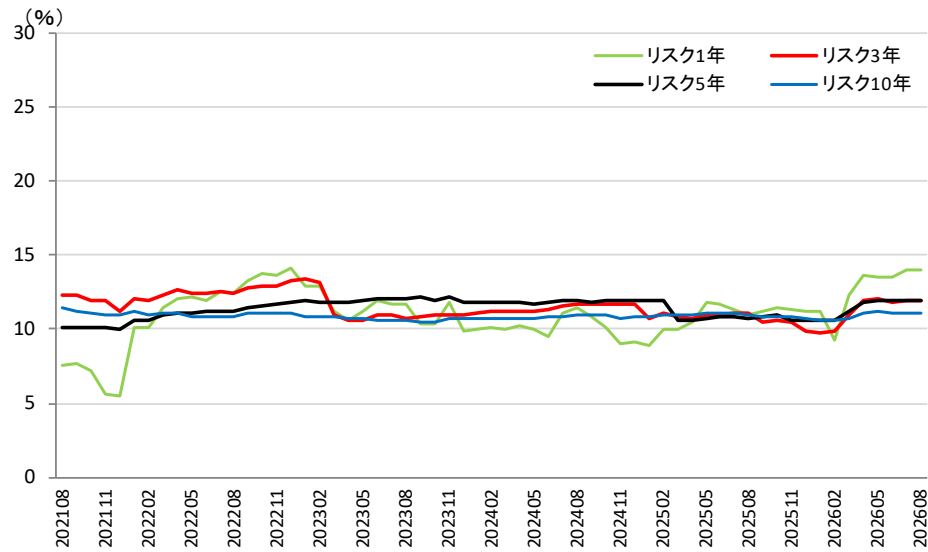
(1) 期間別リスク・リターン

	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	61.29	72.67	157.93	11.96	11.98 ↑	11.03	1.41	0.95	0.89
国内株式	88.81	120.70	281.45	15.04	14.37 ↑	14.68	1.54	1.18	0.97
国内債券	-10.50	-16.30	-15.86	2.65	2.48	2.15	-1.51	-1.49	-0.83
外国株式(先進国)	83.08	97.45	308.71	15.88	16.77 ↑	16.03	1.38	0.86	0.94
エマージング株式	43.06	61.16	159.98	15.32 ↑	13.69 ↑	15.68	0.80	0.72	0.63
外国債券(先進国)	15.79	14.93	31.99	4.75	4.95	4.60	0.98	0.53	0.59
エマージング債券	28.27	52.03	73.17	7.32 ↓	7.62	9.29	1.13	1.12	0.60
ハイイールド債券	33.41	58.54	101.00	7.43 ↓	7.98	9.62	1.31	1.18	0.74
複合資産	34.76	39.24	79.54	7.25	7.13 ↑	6.77	1.39	0.93	0.88
国内REIT	7.42	2.16	42.43	9.71 ↑	10.07 ↑	12.12	0.21	0.02	0.29
外国REIT	42.36	57.99	120.40	13.77	16.03	16.07	0.88	0.58	0.51

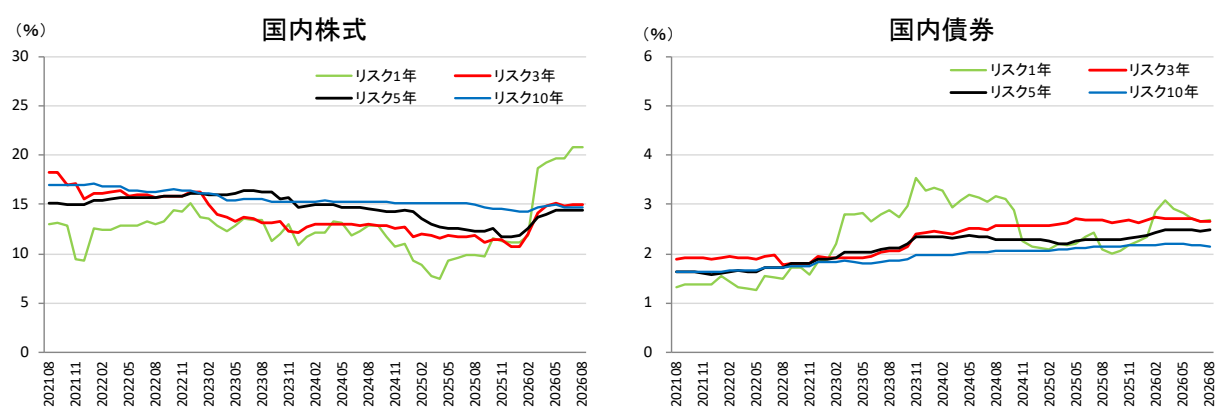
※[色塗りの基準] 累積リターン> 総合、リスク< 総合、シャープ・レシオ>=0.5
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

(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」

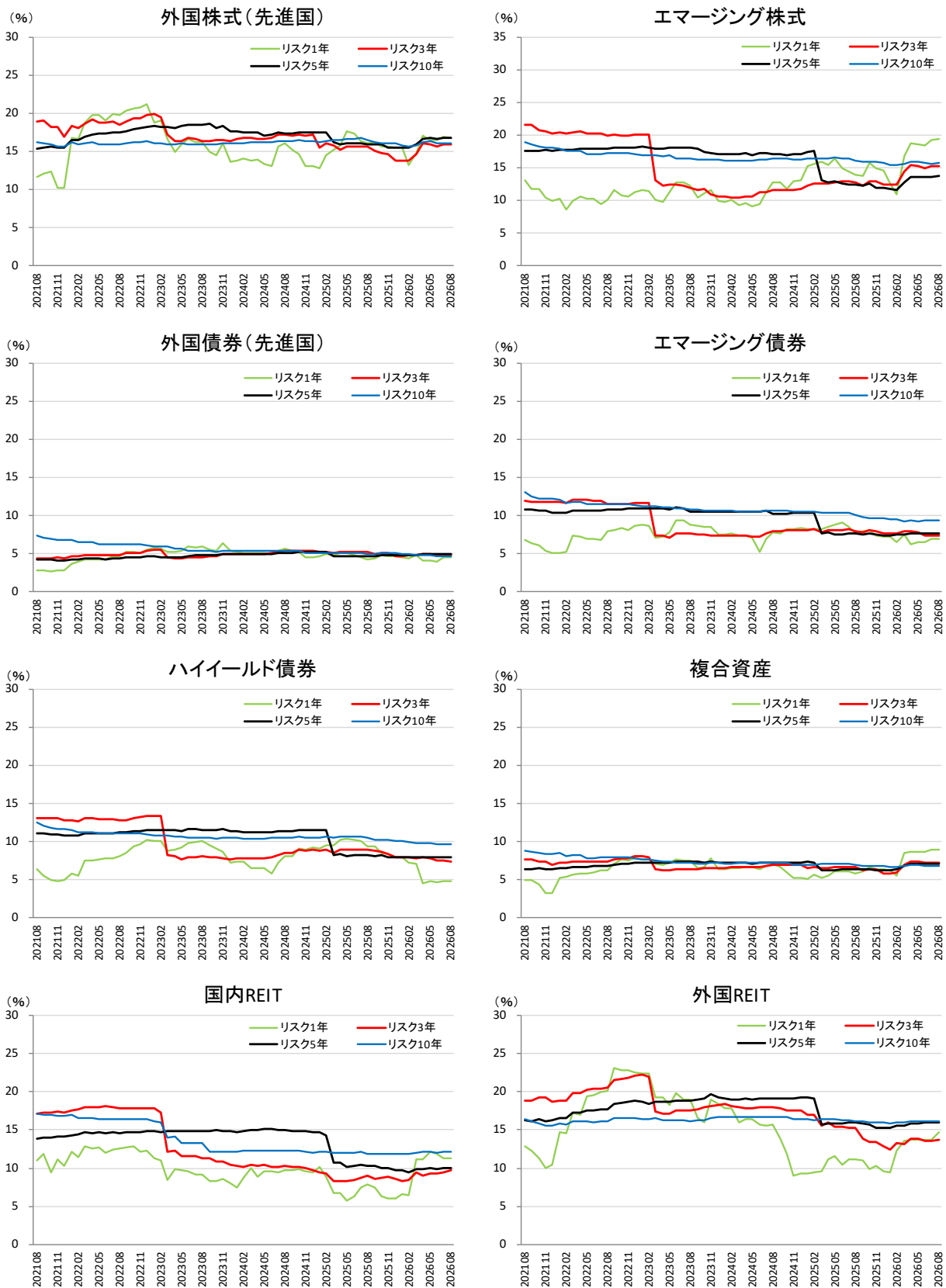


＜2＞リスク・サマリー

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)

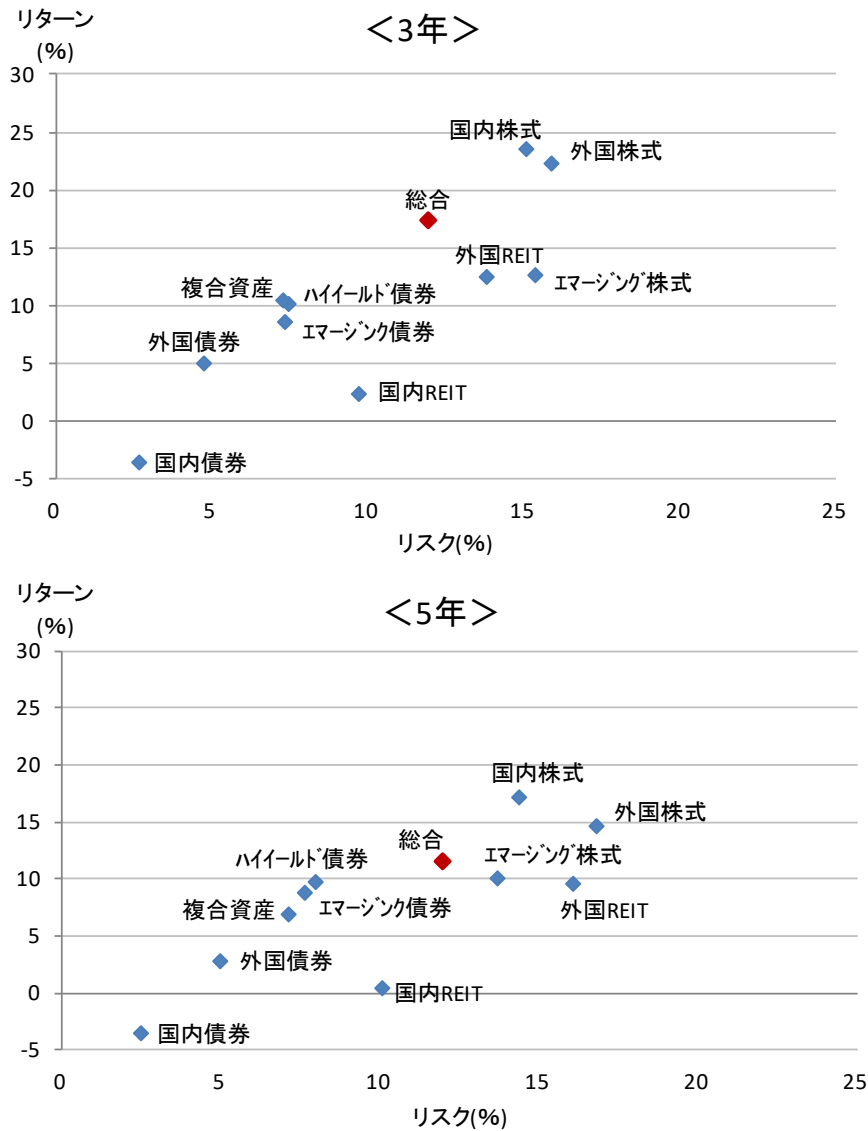
② 「大分類」



＜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	17.28	11.54	11.96	11.98
国内株式	23.60	17.16	15.04	14.37
国内債券	-3.63	-3.50	2.65	2.48
外国株式(先進国)	22.33	14.58	15.88	16.77
エマージング株式	12.68	10.01	15.32	13.69
外国債券(先進国)	5.01	2.82	4.75	4.95
エマージング債券	8.65	8.74	7.32	7.62
ハイイールド債券	10.09	9.65	7.43	7.98
複合資産	10.45	6.84	7.25	7.13
国内REIT	2.41	0.43	9.71	10.07
外国REIT	12.49	9.58	13.77	16.03

※リスク、リターンは年率換算値

<2> リスク・サマリー

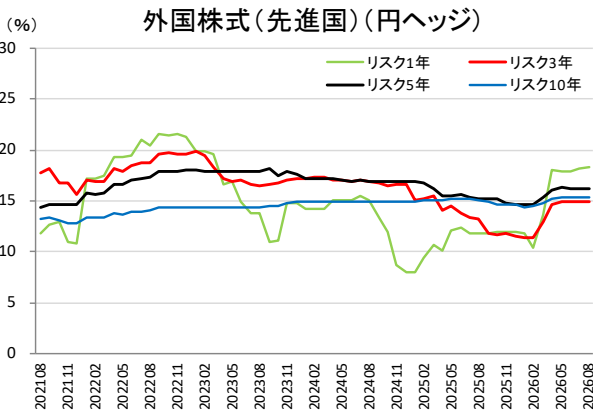
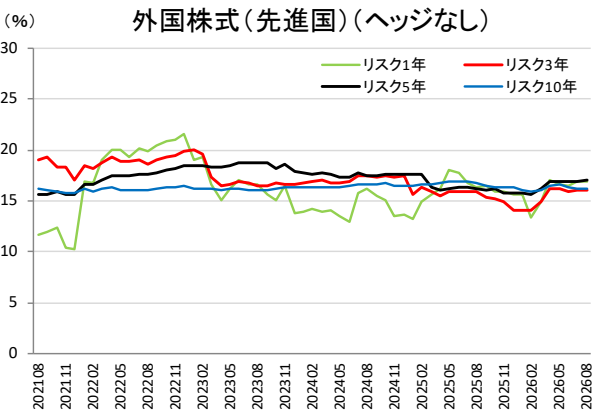
2. 「大分類（ヘッジ種別）」

(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	61.29	72.67	157.93	11.96	11.98 ↑	11.03	1.41	0.95	0.89
国内株式	88.81	120.70	281.45	15.04	14.37 ↑	14.68	1.54	1.18	0.97
ヘッジなし	87.99	117.20	275.51	15.00	14.34 ↑	14.56	1.54	1.16	0.97
国内債券	-10.50	-16.30	-15.86	2.65	2.48	2.15	-1.51	-1.49	-0.83
ヘッジなし	-11.18	-16.16	-15.90	2.68	2.50	2.14	-1.58	-1.47	-0.84
外国株式(先進国)	83.08	97.45	308.71	15.88	16.77 ↑	16.03	1.38	0.86	0.94
ヘッジなし	84.74	104.43	329.40	16.05	16.97 ↑	16.23	1.39	0.89	0.96
円ヘッジ	46.39	20.20	137.93	14.89	16.23	15.30	0.88	0.22	0.59
エマージング株式	43.06	61.16	159.98	15.32 ↑	13.69 ↑	15.68	0.80	0.72	0.63
ヘッジなし	43.09	61.48	160.84	15.33 ↑	13.70 ↑	15.69	0.80	0.72	0.64
円ヘッジ	42.91	-4.85	26.98	18.04 ↑	20.20 ↑	19.52 ↑	0.68	-0.06	0.12
外国債券(先進国)	15.79	14.93	31.99	4.75	4.95	4.60	0.98	0.53	0.59
ヘッジなし	23.23	31.36	54.34	6.56	6.81	5.97	1.04	0.79	0.73
円ヘッジ	0.65	-12.97	-8.05	2.63	3.66	3.53	-0.06	-0.81	-0.26
エマージング債券	28.27	52.03	73.17	7.32 ↓	7.62	9.29	1.13	1.12	0.60
ヘッジなし	26.38	57.26	84.90	7.57 ↓	7.86	8.81	1.02	1.18	0.71
円ヘッジ	13.20	-12.25	-5.47	5.90	8.04	8.49	0.65	-0.35	-0.08
ハイイールド債券	33.41	58.54	101.00	7.43 ↓	7.98	9.62	1.31	1.18	0.74
ヘッジなし	34.09	65.85	127.24	8.39 ↓	8.75	9.40	1.18	1.19	0.90
円ヘッジ	6.62	-5.69	8.74	3.87 ↑	5.71	7.06	0.46	-0.24	0.11
複合資産	34.76	39.24	79.54	7.25	7.13 ↑	6.77	1.39	0.93	0.88
ヘッジなし	37.28	46.29	92.35	7.54	7.46 ↑	7.08	1.43	1.03	0.94
円ヘッジ	19.40	4.09	20.32	7.64	7.86 ↑	7.12	0.75	0.08	0.25
国内REIT	7.42	2.16	42.43	9.71 ↑	10.07 ↑	12.12	0.21	0.02	0.29
ヘッジなし	6.52	0.22	39.46	9.70 ↑	10.02 ↑	12.04	0.18	-0.02	0.27
外国REIT	42.36	57.99	120.40	13.77	16.03	16.07	0.88	0.58	0.51
ヘッジなし	43.47	60.91	126.76	13.84	16.15	16.15	0.90	0.61	0.52
円ヘッジ	14.80	-8.89	9.26	15.68 ↑	17.04	16.10	0.28	-0.12	0.05

※[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 ヶ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

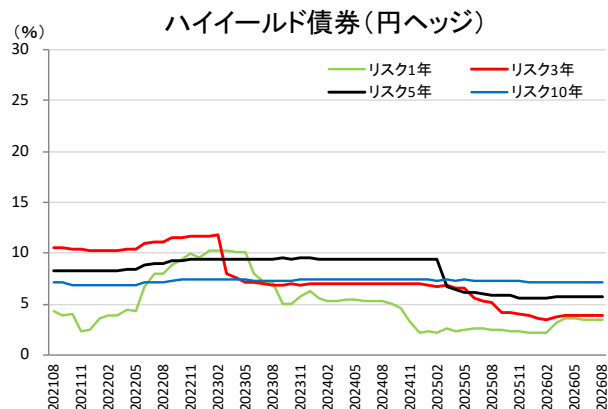
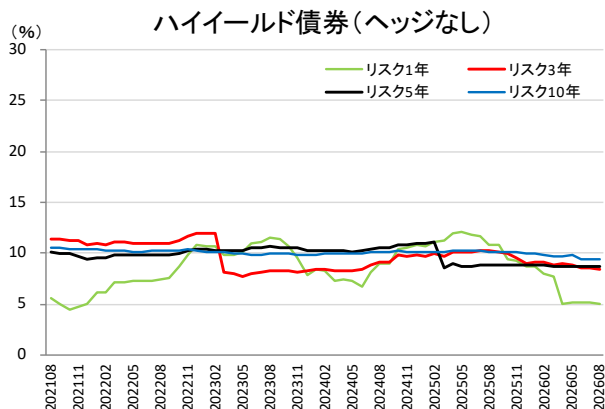
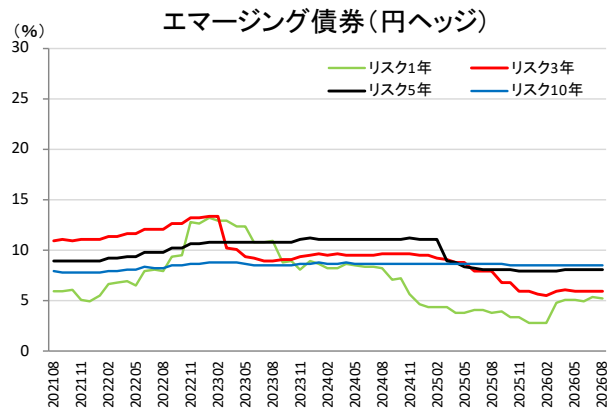
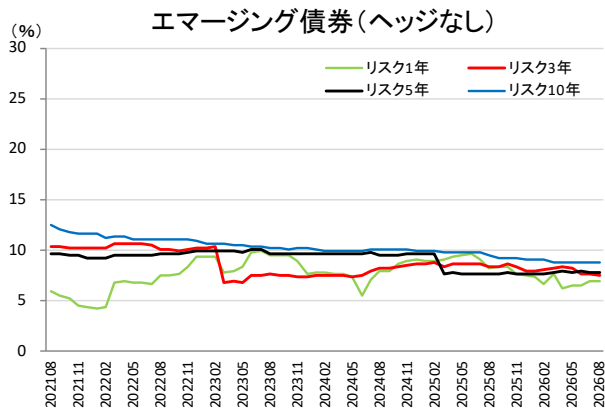
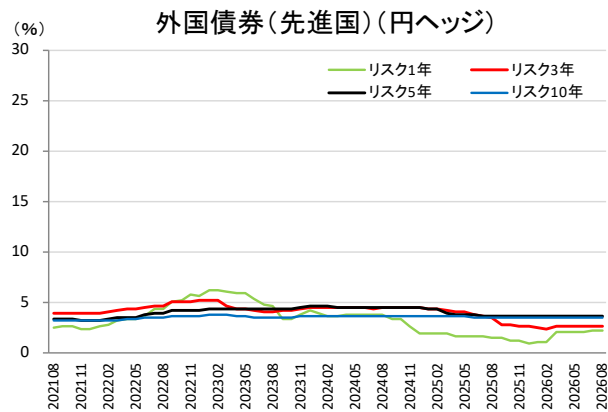
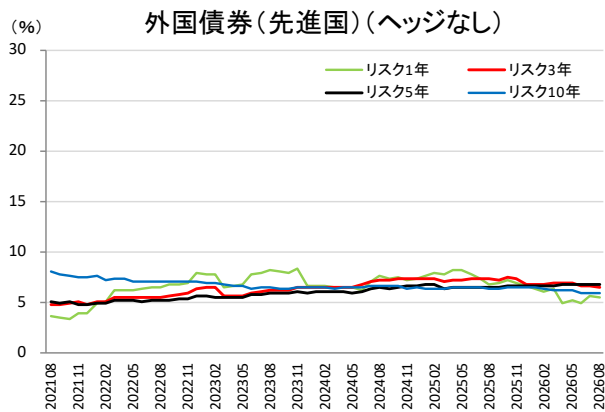
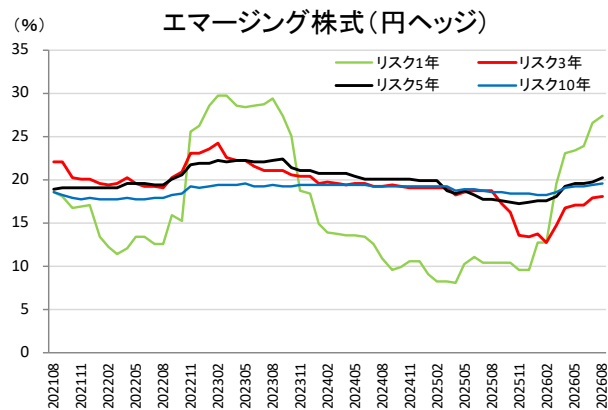
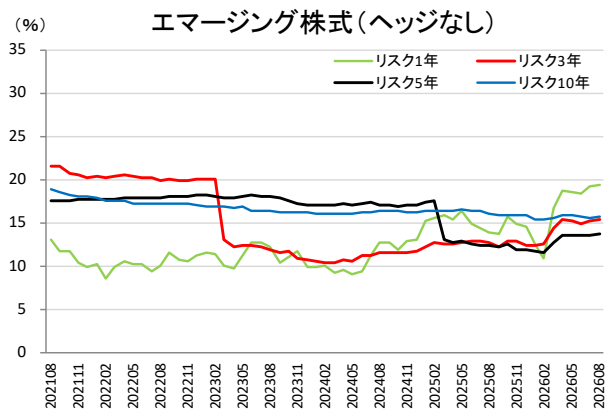
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)



<2> リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

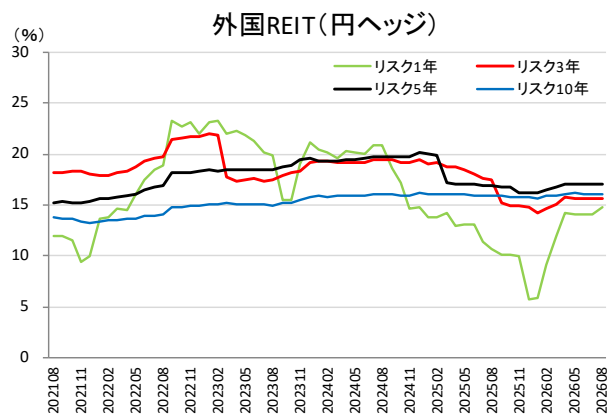
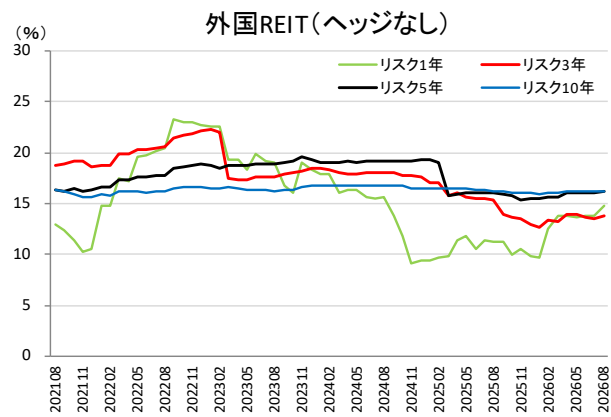
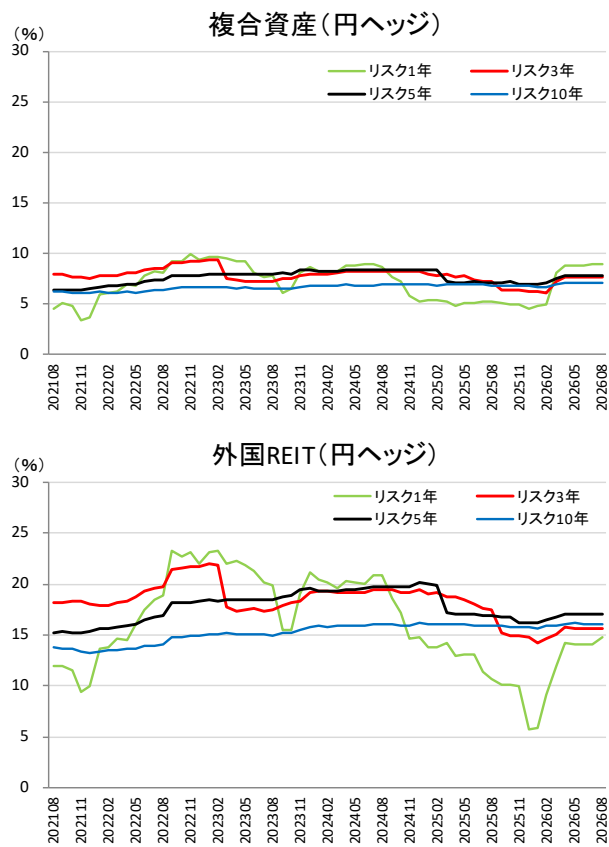
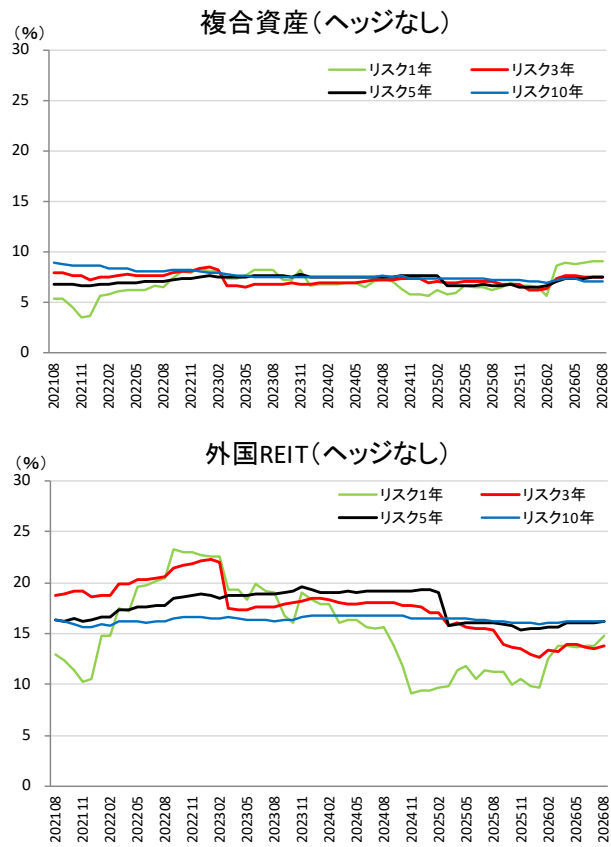
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



＜2＞リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

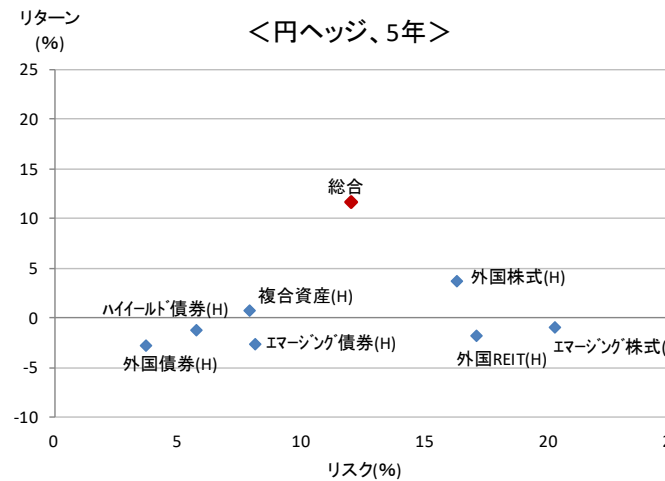
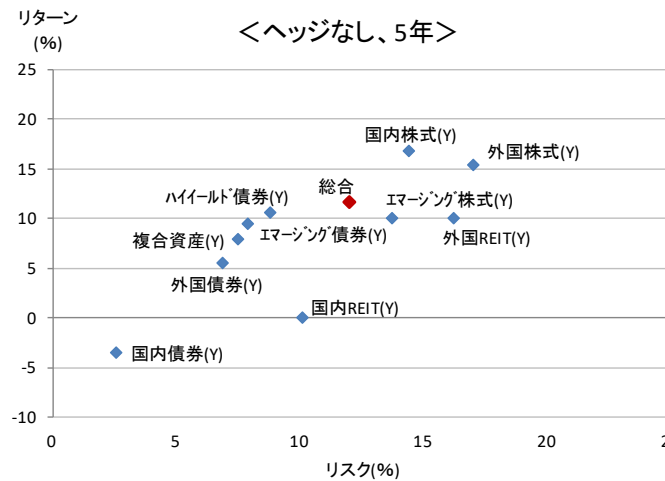
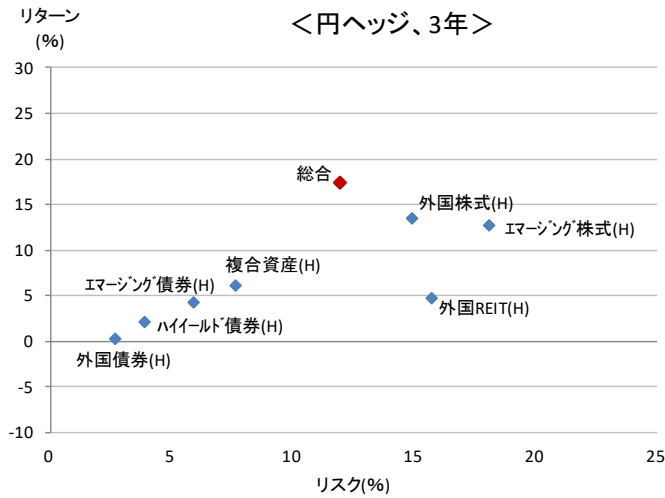
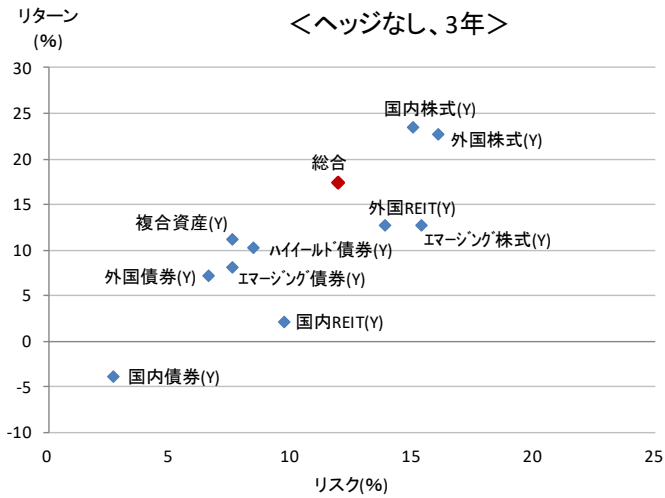
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



<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	17.28	11.54	11.96	11.98
国内株式 (Y)	23.42	16.78	15.00	14.34
国内債券 (Y)	-3.87	-3.46	2.68	2.50
外国株式 (先進国) (Y)	22.70	15.37	16.05	16.97
エマージング株式 (Y)	12.69	10.06	15.33	13.70
外国債券 (先進国) (Y)	7.21	5.61	6.56	6.81
エマージング債券 (Y)	8.12	9.48	7.57	7.86
ハイイールド債券 (Y)	10.27	10.65	8.39	8.75
複合資産 (Y)	11.14	7.91	7.54	7.46
国内REIT (Y)	2.13	0.04	9.70	10.02
外国REIT (Y)	12.78	9.98	13.84	16.15

＜円ヘッジ＞	リターン(%)		リスク(%)	
	3年	5年	3年	5年
総合	17.28	11.54	11.96	11.98
外国株式 (先進国) (H)	13.54	3.75	14.89	16.23
エマージング株式 (H)	12.64	-0.99	18.04	20.20
外国債券 (先進国) (H)	0.22	-2.74	2.63	3.66
エマージング債券 (H)	4.22	-2.58	5.90	8.04
ハイイールド債券 (H)	2.16	-1.16	3.87	5.71
複合資産 (H)	6.09	0.80	7.64	7.86
外国REIT (H)	4.71	-1.84	15.68	17.04

※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	21,371	74,188	128,474	230,427
国内株式	3,161	13,417	21,489	32,293
国内債券	405	2,472	3,702	7,365
外国株式(先進国)	15,331	51,169	86,163	153,307
エマージング株式	-270	-638	78	-2,312
外国債券(先進国)	581	1,472	2,471	3,351
エマージング債券	38	-161	-237	-99
ハイイールド債券	55	87	365	731
複合資産	1,792	6,026	12,479	24,481
国内REIT	49	186	196	124
外国REIT	-198	-823	-1,220	-2,481
その他	426	979	2,989	13,668

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	21,371	74,188	128,474	230,427
国内株式	3,161	13,417	21,489	32,293
ヘッジなし	3,196	13,593	21,715	32,601
国内債券	405	2,472	3,702	7,365
ヘッジなし	283	1,367	1,937	2,968
外国株式(先進国)	15,331	51,169	86,163	153,307
ヘッジなし	15,770	52,113	87,854	156,649
円ヘッジ	-340	-706	-1,389	-2,742
エマージング株式	-270	-638	78	-2,312
ヘッジなし	-270	-636	80	-2,303
円ヘッジ	0	-2	-2	-4
外国債券(先進国)	581	1,472	2,471	3,351
ヘッジなし	450	1,254	2,241	3,094
円ヘッジ	-91	-222	-382	-770
エマージング債券	38	-161	-237	-99
ヘッジなし	41	-140	-187	-62
円ヘッジ	4	3	3	43
ハイイールド債券	55	87	365	731
ヘッジなし	80	160	251	738
円ヘッジ	-16	-35	-68	-59
複合資産	1,792	6,026	12,479	24,481
ヘッジなし	1,505	4,834	10,480	23,341
円ヘッジ	-27	-106	-215	-522
国内REIT	49	186	196	124
ヘッジなし	54	202	224	150
外国REIT	-198	-823	-1,220	-2,481
ヘッジなし	-168	-752	-1,061	-2,209
円ヘッジ	-26	-59	-136	-209
その他	426	979	2,989	13,668

< 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	2,118,128	100.0		5,190	100.0
国内株式	299,519	14.1		780	15.0
国内債券	47,956	2.3		158	3.0
外国株式(先進国)	1,192,709	56.3		1,275	24.6
エマージング株式	64,046	3.0		309	6.0
外国債券(先進国)	104,516	4.9		670	12.9
エマージング債券	12,109	0.6		174	3.4
ハイイールド債券	24,154	1.1		171	3.3
複合資産	238,136	11.2		1,097	21.1
国内REIT	22,360	1.1		136	2.6
外国REIT	47,646	2.2		216	4.2
その他	64,979	3.1		204	3.9

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	2,118,128	100.0		5,190	100.0
国内株式	299,519	14.1		780	15.0
ヘッジなし	293,663	13.9		742	14.3
国内債券	47,956	2.3		158	3.0
ヘッジなし	26,019	1.2		148	2.9
外国株式(先進国)	1,192,709	56.3		1,275	24.6
ヘッジなし	1,166,340	55.1		1,005	19.4
円ヘッジ	20,467	1.0		218	4.2
エマージング株式	64,046	3.0		309	6.0
ヘッジなし	63,998	3.0		298	5.7
円ヘッジ	25	0.0		6	0.1
外国債券(先進国)	104,516	4.9		670	12.9
ヘッジなし	73,845	3.5		383	7.4
円ヘッジ	17,357	0.8		216	4.2
エマージング債券	12,109	0.6		174	3.4
ヘッジなし	10,702	0.5		122	2.4
円ヘッジ	404	0.0		19	0.4
ハイイールド債券	24,154	1.1		171	3.3
ヘッジなし	19,992	0.9		78	1.5
円ヘッジ	998	0.0		50	1.0
複合資産	238,136	11.2		1,097	21.1
ヘッジなし	203,909	9.6		776	15.0
円ヘッジ	5,219	0.2		66	1.3
国内REIT	22,360	1.1		136	2.6
ヘッジなし	21,633	1.0		119	2.3
外国REIT	47,646	2.2		216	4.2
ヘッジなし	46,053	2.2		160	3.1
円ヘッジ	1,133	0.1		43	0.8
その他	64,979	3.1		204	3.9

< 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	21,173	11.5	2.38	2.23	0.892
国内株式	35,338	15.4	2.00	1.61	0.885
国内債券	9,339	13.3	0.05	0.06	0.402
外国株式(先進国)	26,457	8.8	2.90	2.77	0.851
エマージング株式	20,648	11.7	1.35	1.25	1.361
外国債券(先進国)	11,734	12.5	0.88	0.83	0.886
エマージング債券	12,546	13.9	2.78	2.62	1.197
ハイイールド債券	11,882	13.0	4.08	3.83	1.580
複合資産	17,320	10.7	1.03	0.98	0.891
国内REIT	15,346	12.7	4.61	5.38	0.800
外国REIT	16,660	12.1	6.66	6.02	1.329

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	21,173	11.5	2.38	2.23	0.892
国内株式	35,338	15.4	2.00	1.61	0.885
ヘッジなし	34,355	15.4	1.94	1.57	0.871
国内債券	9,339	13.3	0.05	0.06	0.402
ヘッジなし	9,365	13.5	0.07	0.08	0.274
外国株式(先進国)	26,457	8.8	2.90	2.77	0.851
ヘッジなし	28,929	8.4	2.92	2.79	0.837
円ヘッジ	17,122	9.7	2.07	1.95	1.380
エマージング株式	20,648	11.7	1.35	1.25	1.361
ヘッジなし	20,955	11.8	1.35	1.24	1.361
円ヘッジ	14,317	14.8	2.22	1.69	1.679
外国債券(先進国)	11,734	12.5	0.88	0.83	0.886
ヘッジなし	13,820	14.4	1.05	0.98	0.883
円ヘッジ	8,694	9.6	0.50	0.52	0.732
エマージング債券	12,546	13.9	2.78	2.62	1.197
ヘッジなし	13,453	13.7	2.66	2.53	1.134
円ヘッジ	7,389	14.4	1.76	1.80	1.514
ハイイールド債券	11,882	13.0	4.08	3.83	1.580
ヘッジなし	13,458	11.9	4.39	4.15	1.602
円ヘッジ	8,664	13.6	2.12	2.20	1.478
複合資産	17,320	10.7	1.03	0.98	0.891
ヘッジなし	18,886	12.2	1.12	1.06	0.846
円ヘッジ	12,018	10.6	1.02	0.99	1.244
国内REIT	15,346	12.7	4.61	5.38	0.800
ヘッジなし	14,240	12.6	4.61	5.42	0.782
外国REIT	16,660	12.1	6.66	6.02	1.329
ヘッジなし	18,305	12.2	6.73	6.08	1.329
円ヘッジ	10,372	10.9	4.23	4.25	1.105

(注 1) 平均値

基準価額（円）と設定来年数（年）は単純平均値

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

(注 2) 色塗りの基準

運用管理費用合計は総合より低い場合、それ以外は総合より数値が大きい場合

(注 3) 運用管理費用合計

目論見書等に記載のある実質値を集計

(注 4) 分配金利回り（%）

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

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

- 本レポートに関する著作権、知的財産権等一切の権利は三菱アセット・ブレインズ株式会社（以下、MAB）に帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。
- 本レポートは、MABが信頼できると判断した情報源から入手した本レポート作成基準日現在における情報をもとに作成しておりますが、当該情報の正確性を保証するものではありません。
- MABは、本レポートの利用に関連して発生した一切の損害について何らの責任も負いません。
- 本レポート中のグラフ・数値等は、あくまでも本レポート作成基準日までの過去の実績を示すものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。
- 本レポートは、情報提供を目的としたものであり、投資信託の勧誘のために作成されたものではありません。
- MAB 投信指数「MAB-FPI」（以下、本指数）に関する著作権、知的財産権等一切の権利は MAB に帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。また、本指数を商業的に利用する場合には MAB の利用許諾が必要です。

【照会先】

三菱アセット・ブレインズ株式会社

システムグループ 川眞田、寺西

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 資産運用業協会