

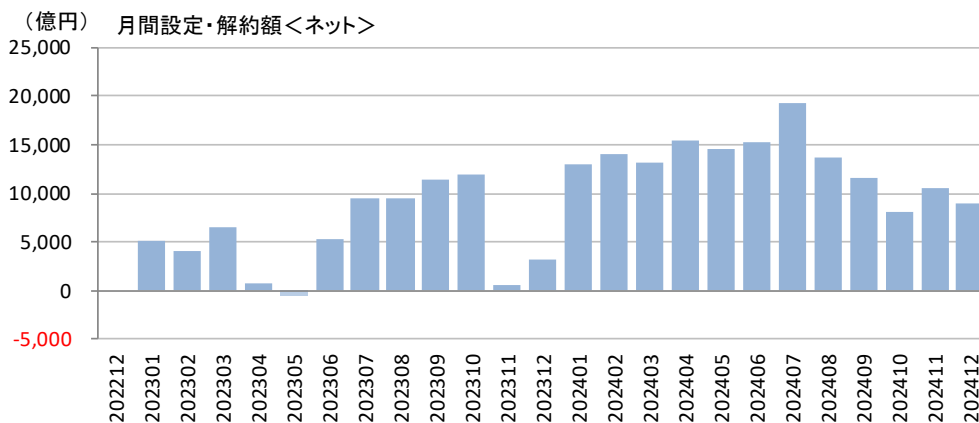
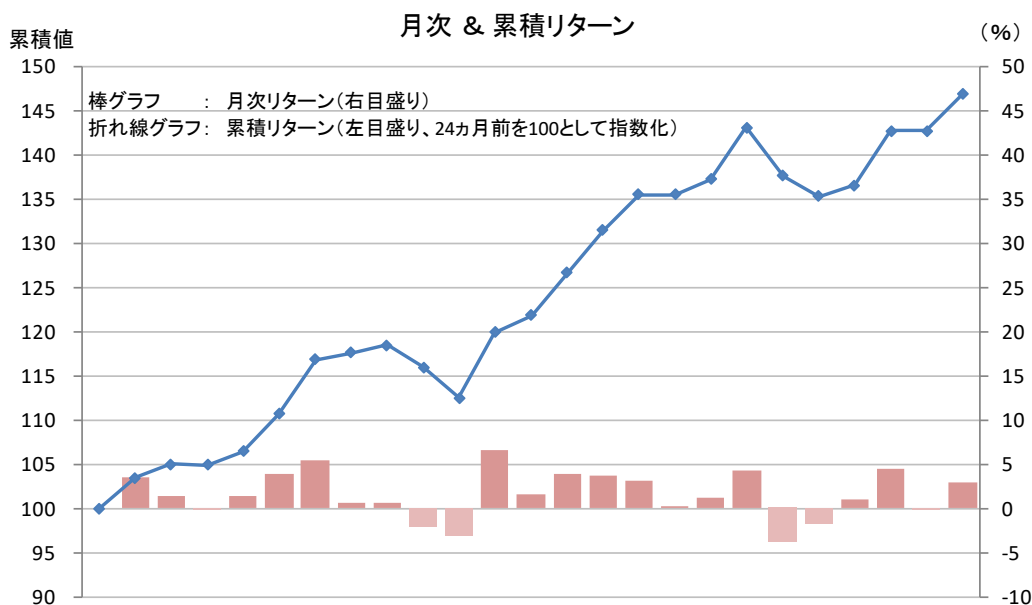
投信指数 MAB-FPI

パフォーマンス・サマリー

— Vol.1 ファンド大分類 編 —

2024年12月

「総合」 +2.92 %
(前月 -0.04 %)



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12月のMAB-FPI

<1>パフォーマンス・サマリー

12月のMAB-FPI「総合」は2.92%上昇し、21,753ポイント。
純資産総額は前月末比4兆4,986億円増加し140兆1,473億円。

「大分類別」では、国内株式+4.07%、エマージング株式+3.98%、外国株式(先進国)+3.86%、ハイイールド債券+3.21% など9カテゴリーで上昇し、下落したのは 外国REIT-3.74%、国内債券-0.09% の2カテゴリー。

「総合」への寄与度では、外国株式(先進国)+1.95%、国内株式+0.50%、複合資産+0.21%、エマージング株式+0.17% 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」ではエマージング債券とハイイールド債券の3年リスクに上昇傾向が見られ、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+9,057億円と、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+1兆1,222億円と大幅な流入超となり、複合資産+534億円など、5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 国内株式-1,868億円、国内REIT-292億円、その他-285億円 など6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
21,753	21,136	+617	+2.92 %

◇累積リターン

3ヵ月	+7.54 %
6ヵ月	+2.61 %
1年	+20.49 %
年初来	+20.49 %

◇年初来高値／安値

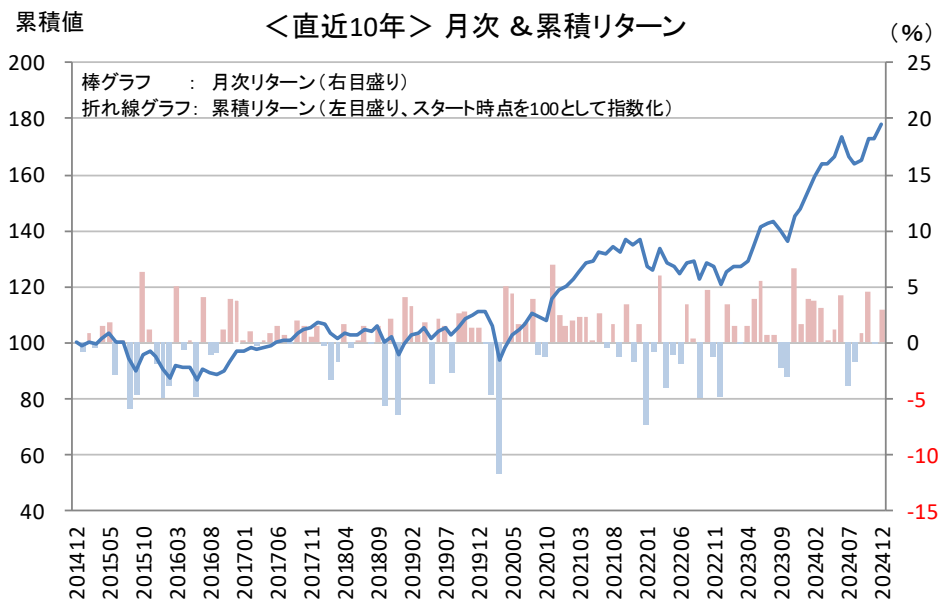
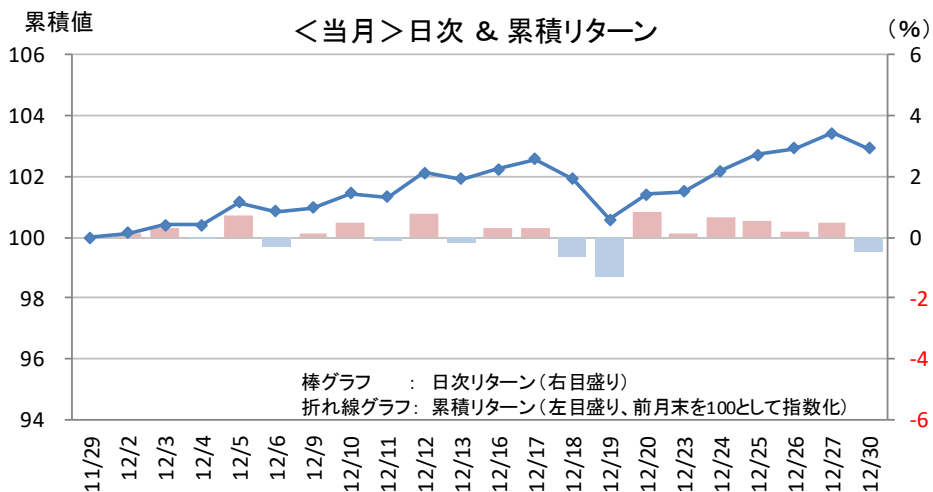
日付	指数	累積リターン
高値 2024/12/27	21,862	+21.09 %
安値 2024/01/04	17,915	-0.77 %

◇純資産総額

当月末	前月末	増減
140兆1,473億円	135兆6,487億円	+4兆4,986億円

◇月間設定・解約額<ネット>

(弊社推計値)	+9,057億円
---------	----------



<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	21,753	21,136	617	2.92
国内株式	28,402	27,290	1,112	4.07
国内債券	12,168	12,179	-11	-0.09
外国株式(先進国)	33,145	31,915	1,230	3.86
エマージング株式	26,128	25,128	999	3.98
外国債券(先進国)	20,218	19,942	275	1.38
エマージング債券	22,504	21,959	545	2.48
ハイイールド債券	33,061	32,032	1,029	3.21
複合資産	22,515	22,149	367	1.66
国内REIT 10,000 (2003.10.31)	32,823	32,806	18	0.05
外国REIT 10,000 (2003.09.30)	42,110	43,745	-1,635	-3.74
その他	7,954	7,749	205	2.64

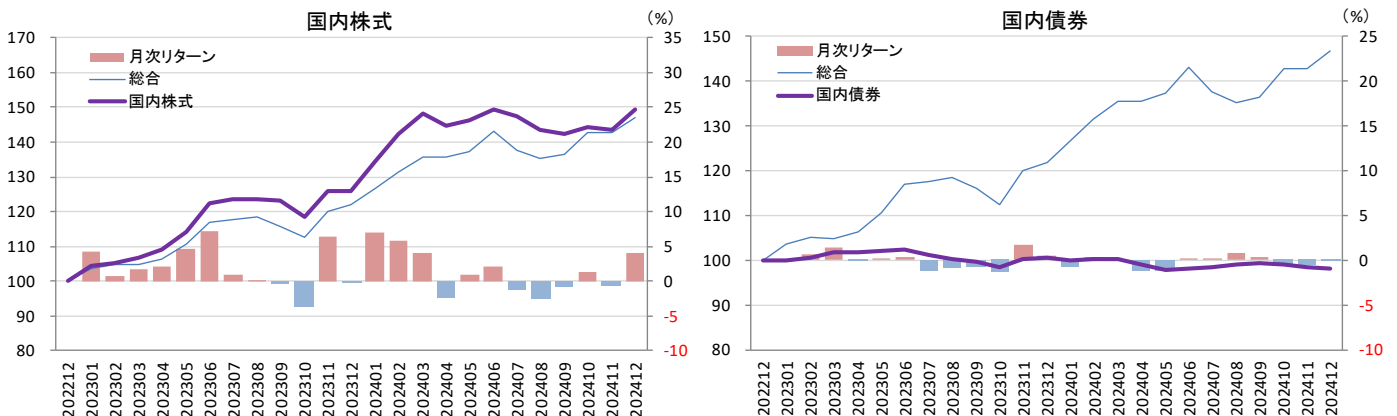
※算出開始時点に記載がない場合、1997年3月31日=10,000
[色塗りの基準]月次リターン> 総合

(2) 期間別リターン

	3カ月(%)	6カ月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	7.54	2.61	20.49	20.49
国内株式	4.72	0.03	18.60	18.60
国内債券	-1.20	0.16	-2.38	-2.38
外国株式(先進国)	12.58	5.10	31.36	31.36
エマージング株式	1.35	-3.40	21.28	21.28
外国債券(先進国)	2.15	-0.98	5.13	5.13
エマージング債券	3.96	-2.11	8.03	8.03
ハイイールド債券	7.88	1.55	15.27	15.27
複合資産	3.25	0.90	10.82	10.82
国内REIT	-3.03	-2.25	-4.20	-4.20
外国REIT	1.51	4.66	14.01	14.01
その他	4.04	1.45	14.40	14.40

※[色塗りの基準]期間別リターン> 総合

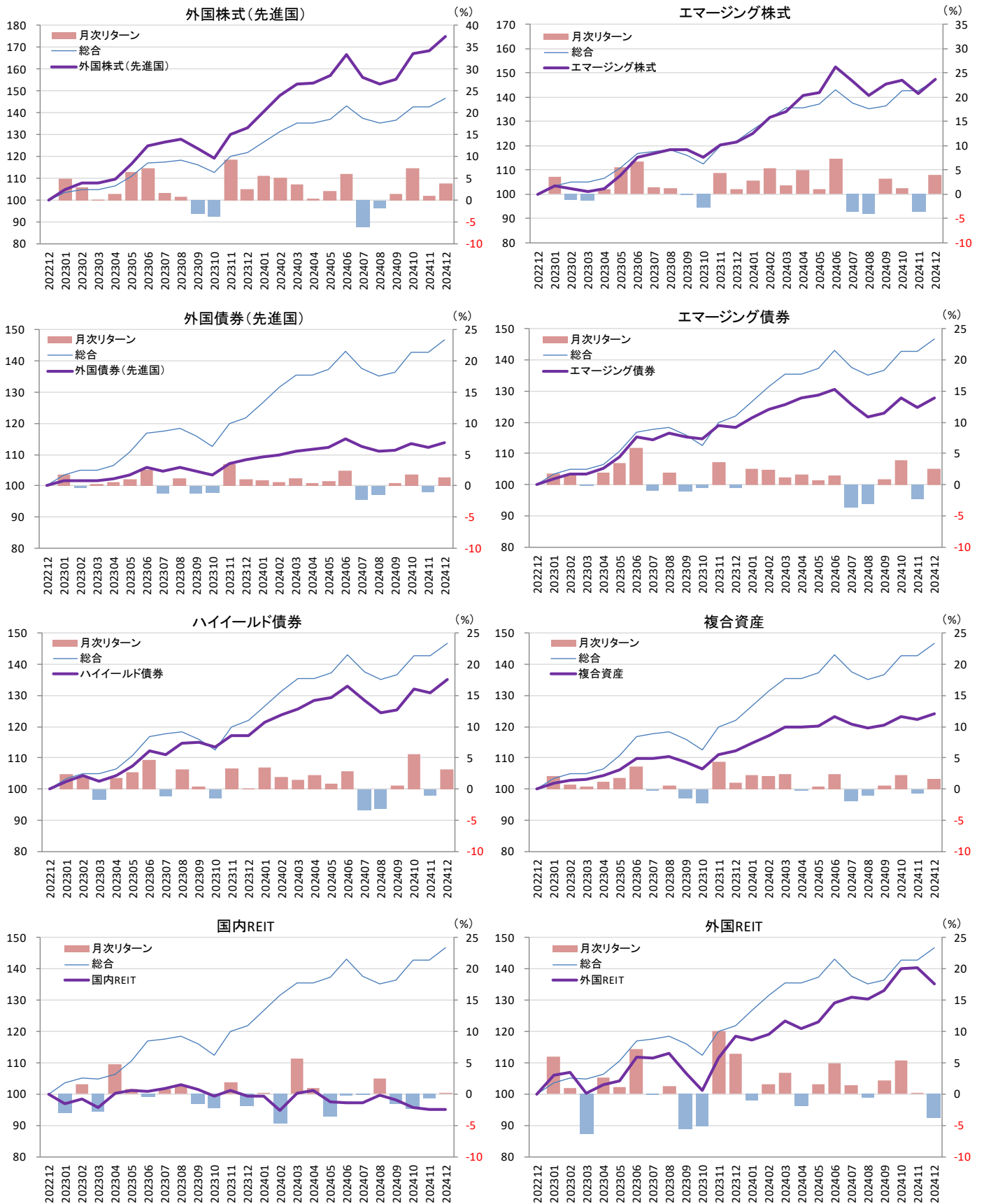
(3) リターン推移 (24カ月前を100として指数化 (折れ線グラフ、左目盛り))



<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	2.92		
1	外国株式(先進国)	3.86	50.76	1.95
2	国内株式	4.07	12.39	0.50
3	複合資産	1.66	12.32	0.21
4	エマージング株式	3.98	4.31	0.17
5	外国債券(先進国)	1.38	7.30	0.10
6	その他	2.64	2.32	0.06
7	ハイイールド債券	3.21	1.59	0.05
8	エマージング債券	2.48	0.82	0.02
9	国内REIT	0.05	1.51	-0.00
10	国内債券	-0.09	3.22	-0.00
11	外国REIT	-3.74	3.47	-0.14
	合計		100.00	2.92

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	20.49		
1	外国株式(先進国)	31.36	47.60	14.23
2	国内株式	18.60	13.06	2.53
3	複合資産	10.82	12.85	1.45
4	エマージング株式	21.28	4.38	0.81
5	外国REIT	14.01	3.73	0.51
6	外国債券(先進国)	5.13	7.91	0.43
7	その他	14.40	2.40	0.35
8	ハイイールド債券	15.27	1.72	0.26
9	エマージング債券	8.03	0.96	0.09
10	国内REIT	-4.20	1.88	-0.07
11	国内債券	-2.38	3.49	-0.08
	合計		100.00	20.49

◆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		21,753	21,136	617	2.92	
国内株式		28,402	27,290	1,112	4.07	
	ヘッジなし	28,980	27,865	1,116	4.00	
国内債券		12,168	12,179	-11	-0.09	
	ヘッジなし	12,334	12,346	-11	-0.09	
外国株式(先進国)		33,145	31,915	1,230	3.86	
	ヘッジなし	39,923	38,367	1,556	4.06	
	円ヘッジ	20,636	20,785	-149	-0.72	
エマージング株式		26,128	25,128	999	3.98	
	ヘッジなし	25,333	24,363	970	3.98	
	円ヘッジ	17,626	17,544	82	0.47	
外国債券(先進国)		20,218	19,942	275	1.38	
	ヘッジなし	23,333	22,774	559	2.45	
	円ヘッジ	12,973	13,055	-82	-0.63	
エマージング債券		22,504	21,959	545	2.48	
	ヘッジなし	24,755	24,081	674	2.80	
	円ヘッジ	16,367	16,588	-222	-1.34	
ハイイールド債券		33,061	32,032	1,029	3.21	
	ヘッジなし	40,288	38,737	1,550	4.00	
	円ヘッジ	16,325	16,427	-103	-0.62	
複合資産		22,515	22,149	367	1.66	
	ヘッジなし	23,731	23,275	456	1.96	
	円ヘッジ	14,667	14,881	-215	-1.44	
国内REIT	10,000 (2003.10.31)	32,823	32,806	18	0.05	
	ヘッジなし	32,780	32,783	-3	-0.01	
外国REIT	10,000 (2003.09.30)	42,110	43,745	-1,635	-3.74	
	ヘッジなし	43,697	45,331	-1,634	-3.60	
	円ヘッジ	17,119	18,660	-1,540	-8.26	
その他		7,954	7,749	205	2.64	

※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

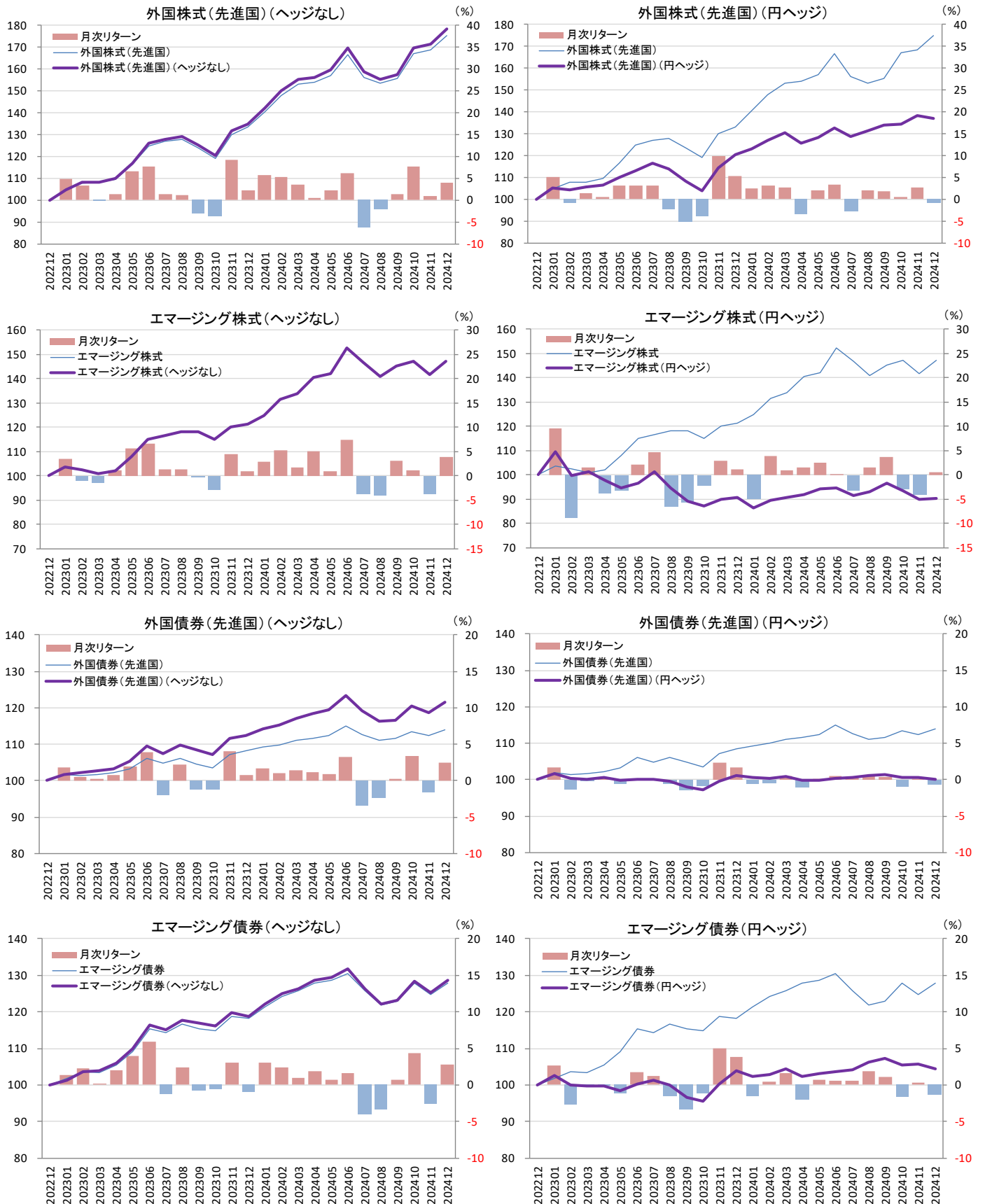
	3か月(%)	6か月(%)	1年(%)	年初来(%)
総合	7.54	2.61	20.49	20.49
国内株式	4.72	0.03	18.60	18.60
ヘッジなし	4.63	0.13	18.39	18.39
国内債券	-1.20	0.16	-2.38	-2.38
ヘッジなし	-1.18	0.16	-2.56	-2.56
外国株式(先進国)	12.58	5.10	31.36	31.36
ヘッジなし	13.02	5.12	32.34	32.34
円ヘッジ	2.53	3.48	14.07	14.07
エマージング株式	1.35	-3.40	21.28	21.28
ヘッジなし	1.36	-3.40	21.32	21.32
円ヘッジ	-6.52	-4.70	-0.76	-0.76
外国債券(先進国)	2.15	-0.98	5.13	5.13
ヘッジなし	4.25	-1.43	8.28	8.28
円ヘッジ	-1.41	-0.17	-1.07	-1.07
エマージング債券	3.96	-2.11	8.03	8.03
ヘッジなし	4.46	-2.30	8.45	8.45
円ヘッジ	-2.67	0.77	0.42	0.42
ハイイールド債券	7.88	1.55	15.27	15.27
ヘッジなし	9.90	2.33	18.51	18.51
円ヘッジ	-0.94	1.28	1.06	1.06
複合資産	3.25	0.90	10.82	10.82
ヘッジなし	3.79	1.00	11.91	11.91
円ヘッジ	-2.87	0.29	2.73	2.73
国内REIT	-3.03	-2.25	-4.20	-4.20
ヘッジなし	-3.16	-2.13	-4.46	-4.46
外国REIT	1.51	4.66	14.01	14.01
ヘッジなし	1.88	4.77	14.72	14.72
円ヘッジ	-8.08	4.07	-1.57	-1.57
その他	4.04	1.45	14.40	14.40

※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）」

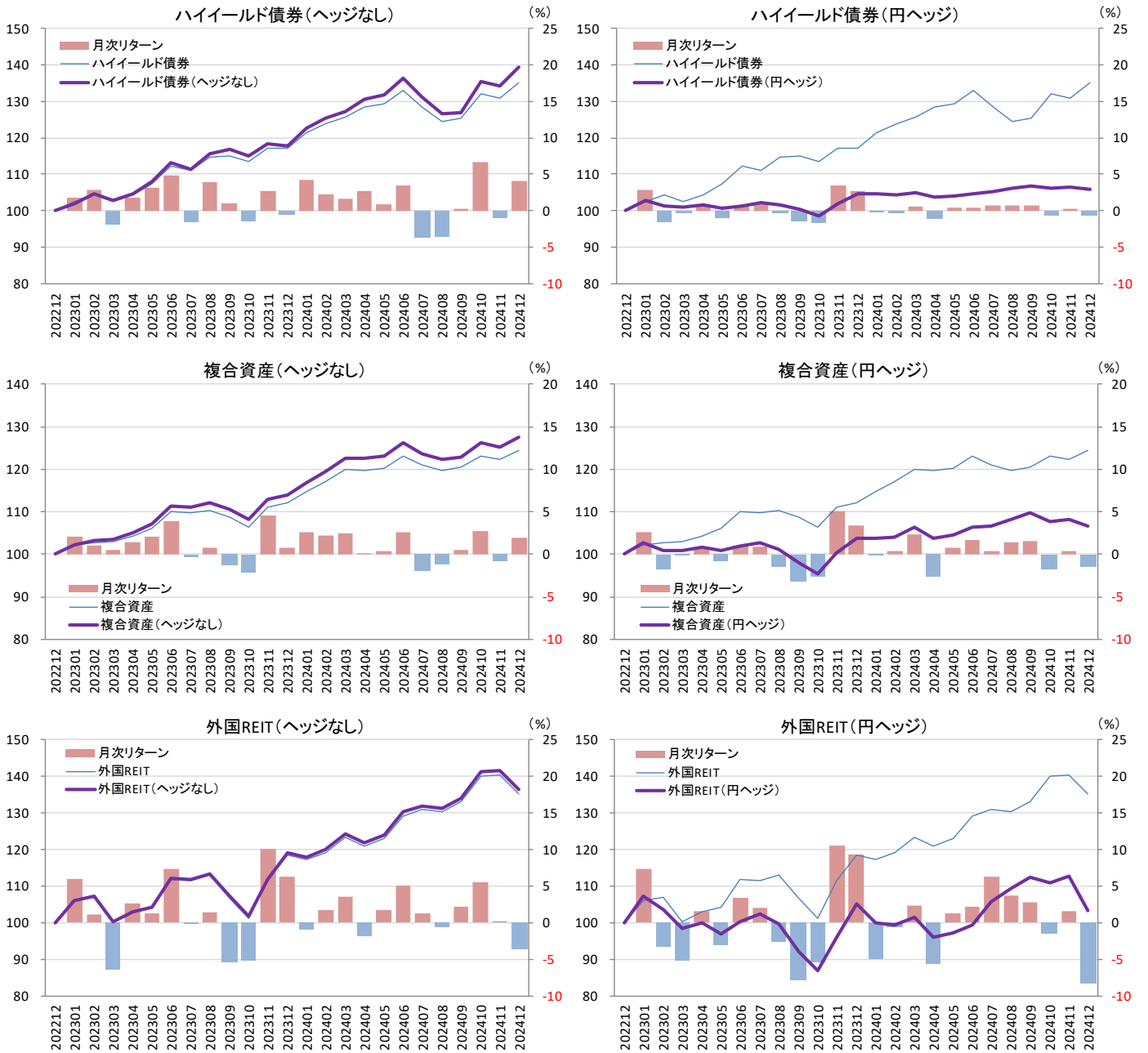
(3) リターン推移（24ヵ月前を100として指数化（折れ線グラフ、左目盛り））



<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	2.92		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	4.06	48.74	1.97
2	国内株式(ヘッジなし)	4.00	12.11	0.48
3	複合資産(ヘッジなし)	1.96	10.56	0.21
4	エマージング株式(ヘッジなし)	3.98	4.31	0.17
5	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	2.45	4.64	0.11
6	ハイイールド債券(ヘッジなし)	4.00	1.29	0.05
7	その他(ヘッジなし)	3.45	1.41	0.05
8	エマージング債券(ヘッジなし)	2.80	0.72	0.02
9	その他(円ヘッジ)	2.23	0.66	0.02
10	国内株式(円ヘッジ)	2.07	0.02	0.00
11	エマージング株式(円ヘッジ)	0.47	0.00	0.00
12	エマージング債券(円ヘッジ)	-1.34	0.03	-0.00
13	ハイイールド債券(円ヘッジ)	-0.62	0.09	-0.00
14	国内債券(円ヘッジ)	-0.09	1.40	-0.00
15	国内REIT(ヘッジなし)	-0.01	1.47	-0.00
16	国内債券(ヘッジなし)	-0.09	1.83	-0.00
17	複合資産(円ヘッジ)	-1.44	0.41	-0.01
18	外国REIT(円ヘッジ)	-8.26	0.10	-0.01
19	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	-0.63	1.67	-0.01
20	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	-0.72	1.61	-0.01
21	外国REIT(ヘッジなし)	-3.60	3.33	-0.13
	合計		96.38	2.91

[直近1年間]

順位		累積 リターン(%)	構成比(%)	寄与度(%)
	総合	20.49		
1	外国株式(先進国)(ヘッジなし)	32.34	45.28	13.86
2	国内株式(ヘッジなし)	18.39	12.73	2.45
3	複合資産(ヘッジなし)	11.91	10.90	1.35
4	エマージング株式(ヘッジなし)	21.32	4.37	0.81
5	外国REIT(ヘッジなし)	14.72	3.57	0.51
6	外国債券(先進国)(ヘッジなし)	8.28	5.04	0.45
7	外国株式(先進国)(円ヘッジ)	14.07	1.87	0.28
8	ハイイールド債券(ヘッジなし)	18.51	1.34	0.24
9	その他(ヘッジなし)	13.68	1.40	0.19
10	その他(円ヘッジ)	22.95	0.69	0.15
11	エマージング債券(ヘッジなし)	8.45	0.81	0.08
12	複合資産(円ヘッジ)	2.73	0.47	0.01
13	国内株式(円ヘッジ)	15.09	0.02	0.00
14	ハイイールド債券(円ヘッジ)	1.06	0.11	0.00
15	エマージング債券(円ヘッジ)	0.42	0.04	0.00
16	エマージング株式(円ヘッジ)	-0.76	0.00	0.00
17	外国REIT(円ヘッジ)	-1.57	0.11	-0.00
18	外国債券(先進国)(円ヘッジ)	-1.07	1.91	-0.02
19	国内債券(円ヘッジ)	-1.83	1.05	-0.02
20	国内債券(ヘッジなし)	-2.56	2.44	-0.06
21	国内REIT(ヘッジなし)	-4.46	1.83	-0.08
	合計		96.38	20.19

◆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

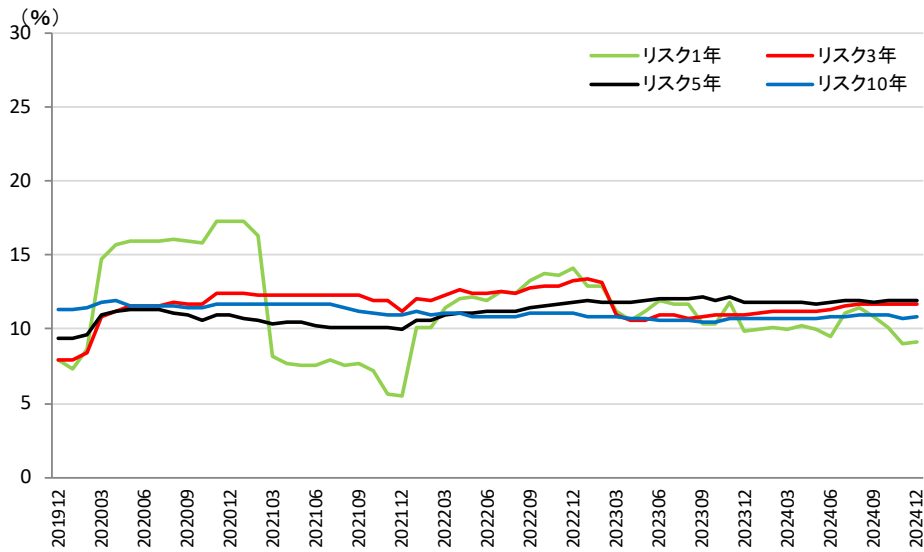
	累積リターン(%)			リスク(%)			シャープ・レシオ		
	3年	5年	10年	3年	5年	10年	3年	5年	10年
総合	29.84	59.79	77.89	11.73	11.99	10.80	0.77	0.82	0.55
国内株式	38.33	71.24	126.35	12.69	14.35	15.14	0.90	0.79	0.56
国内債券	-8.07	-8.67	-4.14	2.58	2.29	2.05	-1.08	-0.78	-0.20
外国株式(先進国)	44.00	112.50	152.23	17.19	17.49	16.30	0.75	0.93	0.60
エマージング株式	37.17	70.54	89.33	11.76	17.10	16.19	0.94	0.66	0.41
外国債券(先進国)	6.16	12.63	7.03	5.34	5.24	5.13	0.37	0.46	0.14
エマージング債券	31.56	28.05	31.20	8.13 ↑	10.32	10.48	1.17	0.49	0.26
ハイイールド債券	37.00	48.03	59.18	8.88 ↑	11.53	10.56	1.24	0.71	0.45
複合資産	14.74	27.10	39.39	6.90	7.29	7.00	0.68	0.67	0.48
国内REIT	-9.26	-7.00	19.59	9.78	14.77	12.04	-0.33	-0.10	0.15
外国REIT	19.16	52.81	75.74	17.48	19.23	16.40	0.34	0.46	0.35

※[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

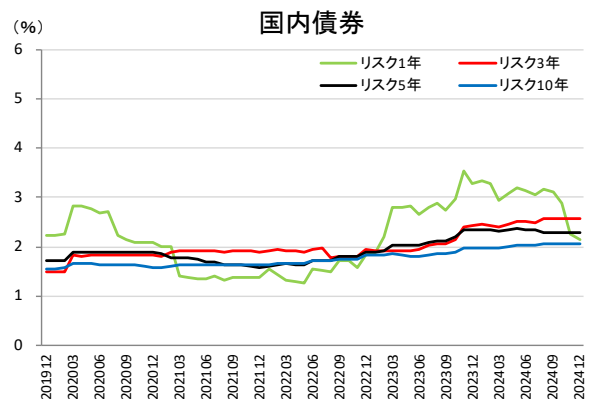
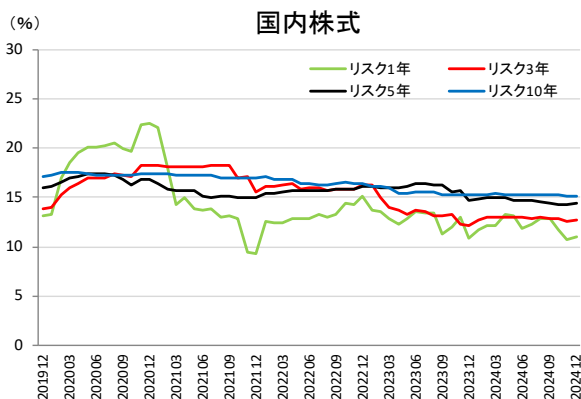
[リスクの矢印] 直近6ヵ月間のリスク推移の傾向を表したもの ↑：上昇傾向、↓：低下傾向

(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」

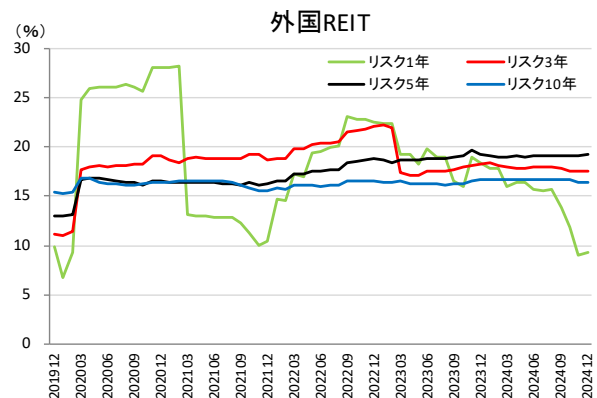
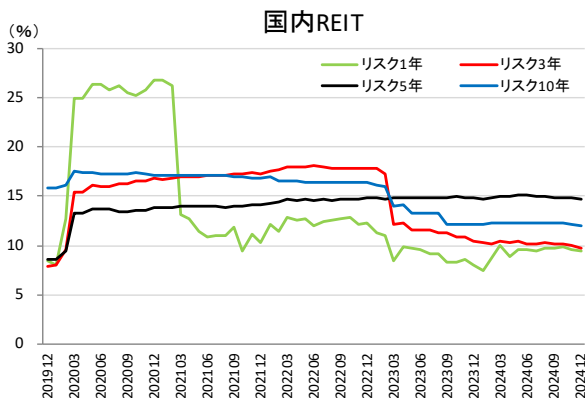
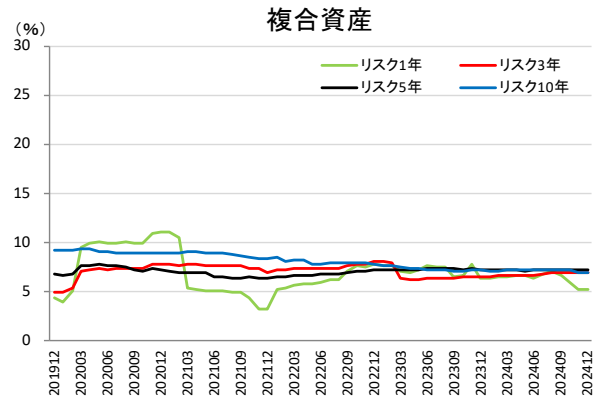
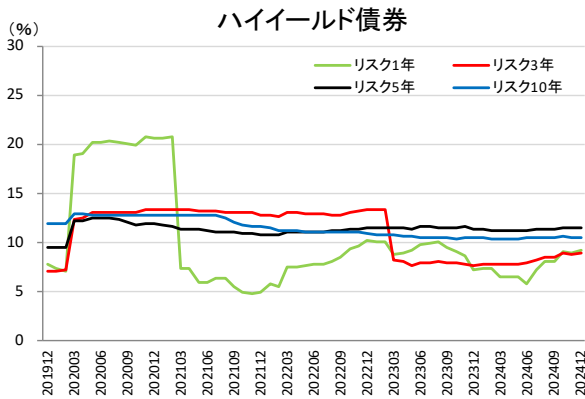
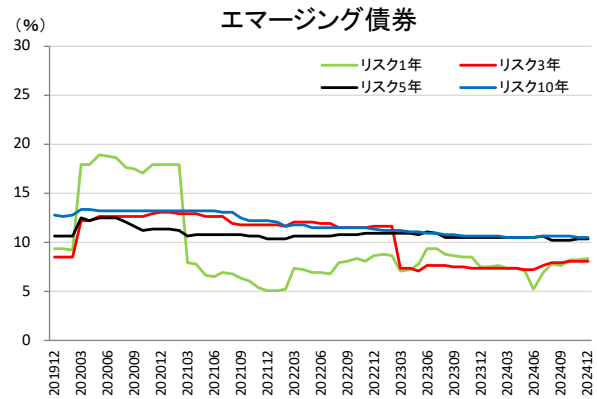
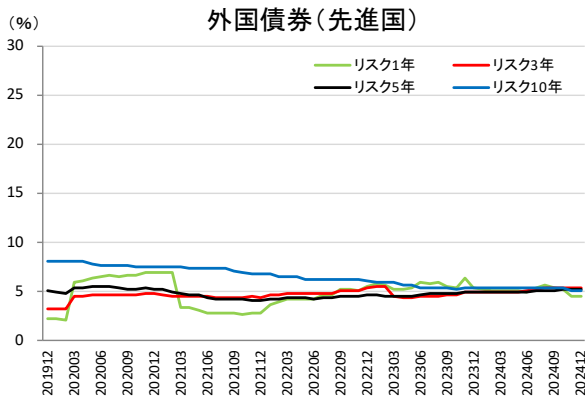
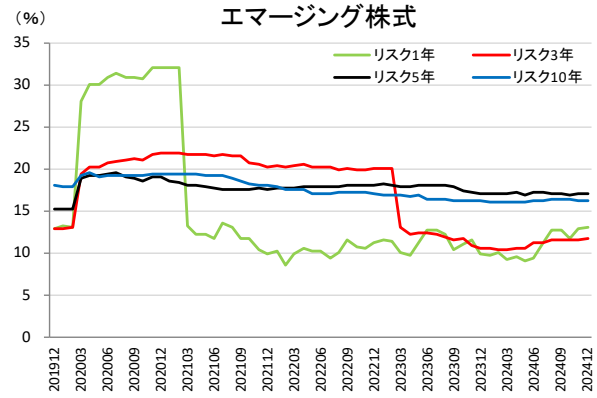
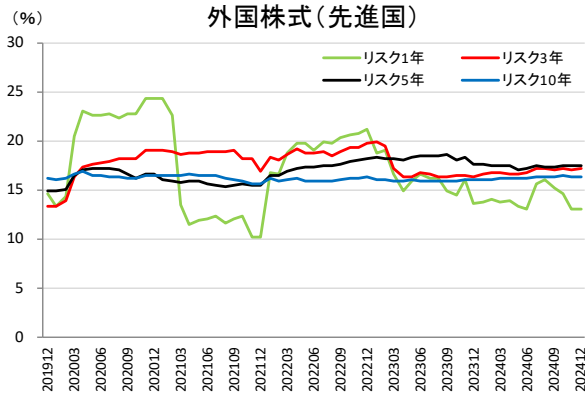


<2> リスク・サマリー

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)

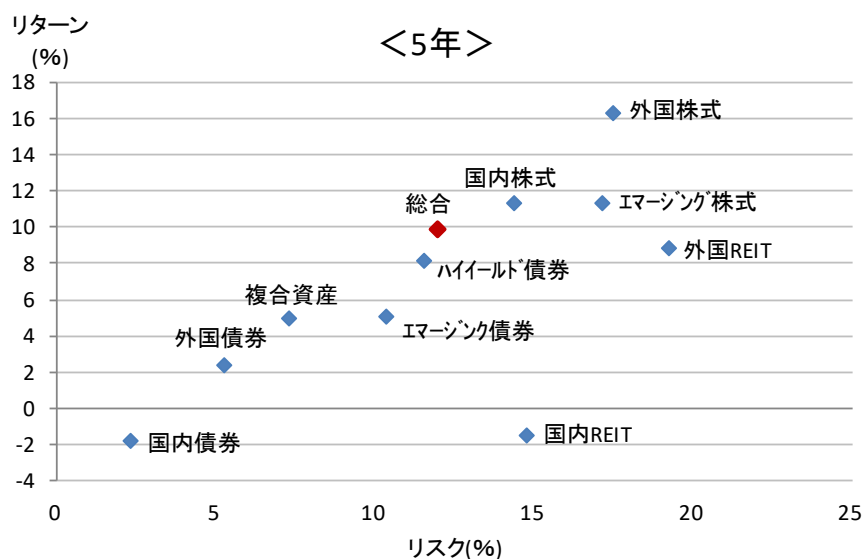
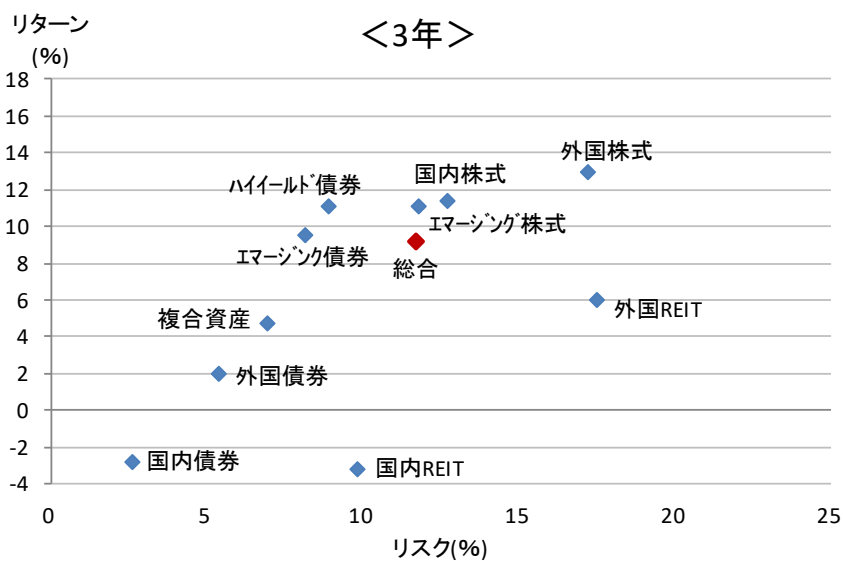
② 「大分類」



<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	9.09	9.83	11.73	11.99
国内株式	11.42	11.36	12.69	14.35
国内債券	-2.77	-1.80	2.58	2.29
外国株式(先進国)	12.93	16.27	17.19	17.49
エマーシング株式	11.11	11.27	11.76	17.10
外国債券(先進国)	2.01	2.41	5.34	5.24
エマーシング債券	9.57	5.07	8.13	10.32
ハイールド債券	11.07	8.16	8.88	11.53
複合資産	4.69	4.91	6.90	7.29
国内REIT	-3.19	-1.44	9.78	14.77
外国REIT	6.02	8.85	17.48	19.23

※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）」

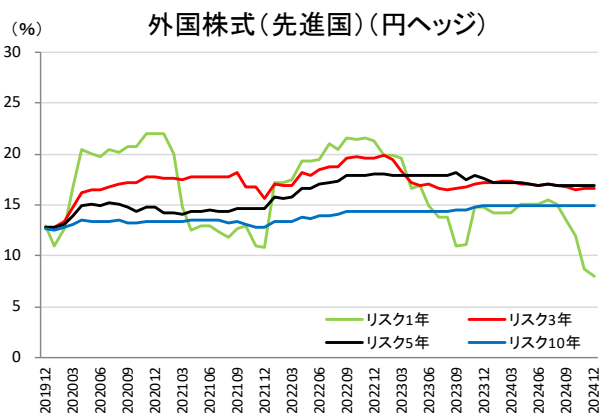
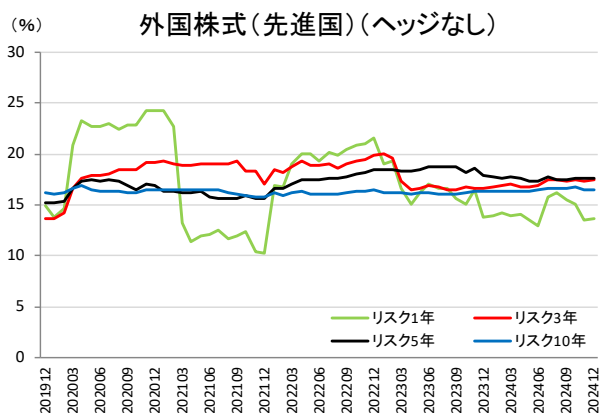
(1) 期間別リスク・リターン

	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	29.84	59.79	77.89	11.73	11.99	10.80	0.77	0.82	0.55
国内株式	38.33	71.24	126.35	12.69	14.35	15.14	0.90	0.79	0.56
ヘッジなし	36.72	69.97	132.71	12.64	14.28	14.76	0.87	0.78	0.60
国内債券	-8.07	-8.67	-4.14	2.58	2.29	2.05	-1.08	-0.78	-0.20
ヘッジなし	-7.36	-8.06	-3.67	2.62	2.30	2.05	-0.97	-0.73	-0.18
外国株式(先進国)	44.00	112.50	152.23	17.19	17.49	16.30	0.75	0.93	0.60
ヘッジなし	48.48	120.38	169.28	17.45	17.65	16.52	0.81	0.97	0.63
円ヘッジ	-1.96	46.43	88.38	16.57	16.86	14.92	-0.04	0.47	0.44
エマージング株式	37.17	70.54	89.33	11.76	17.10	16.19	0.94	0.66	0.41
ヘッジなし	37.42	70.99	89.87	11.77	17.12	16.20	0.95	0.66	0.41
円ヘッジ	-30.72	-28.70	-13.33	19.10	19.95	19.26	-0.60	-0.33	-0.07
外国債券(先進国)	6.16	12.63	7.03	5.34	5.24	5.13	0.37	0.46	0.14
ヘッジなし	16.63	26.01	17.42	7.40	6.67	6.46	0.71	0.71	0.25
円ヘッジ	-11.81	-9.75	-4.87	4.48	4.48	3.64	-0.92	-0.45	-0.13
エマージング債券	31.56	28.05	31.20	8.13	10.32	10.48	1.17	0.49	0.26
ヘッジなし	35.70	34.74	37.38	8.61	9.60	9.97	1.24	0.64	0.32
円ヘッジ	-15.76	-16.31	-4.63	9.57	11.11	8.64	-0.58	-0.31	-0.05
ハイイールド債券	37.00	48.03	59.18	8.88	11.53	10.56	1.24	0.71	0.45
ヘッジなし	42.82	64.52	84.75	9.85	10.95	10.13	1.28	0.96	0.63
円ヘッジ	-7.92	-1.68	12.51	6.92	9.40	7.35	-0.39	-0.04	0.16
複合資産	14.74	27.10	39.39	6.90	7.29	7.00	0.68	0.67	0.48
ヘッジなし	19.14	33.49	47.28	7.32	7.64	7.36	0.82	0.78	0.54
円ヘッジ	-8.84	-2.34	7.54	8.16	8.39	6.88	-0.37	-0.06	0.11
国内REIT	-9.26	-7.00	19.59	9.78	14.77	12.04	-0.33	-0.10	0.15
ヘッジなし	-10.40	-7.93	20.20	9.75	14.62	11.91	-0.37	-0.11	0.16
外国REIT	19.16	52.81	75.74	17.48	19.23	16.40	0.34	0.46	0.35
ヘッジなし	20.84	56.53	81.12	17.60	19.27	16.48	0.37	0.49	0.37
円ヘッジ	-22.80	-6.80	6.08	19.45	20.10	16.13	-0.43	-0.07	0.04

※[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

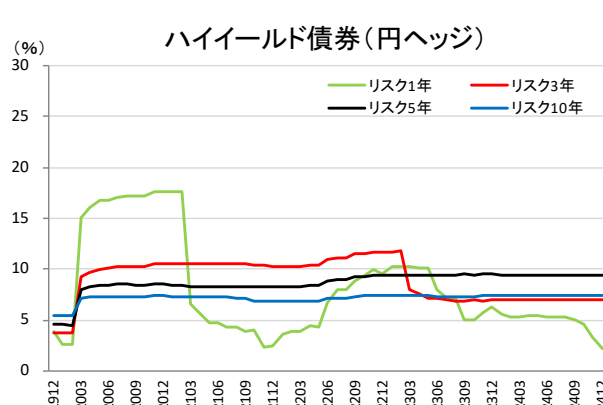
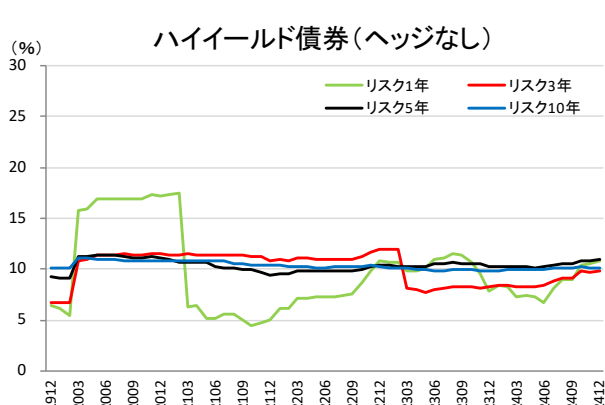
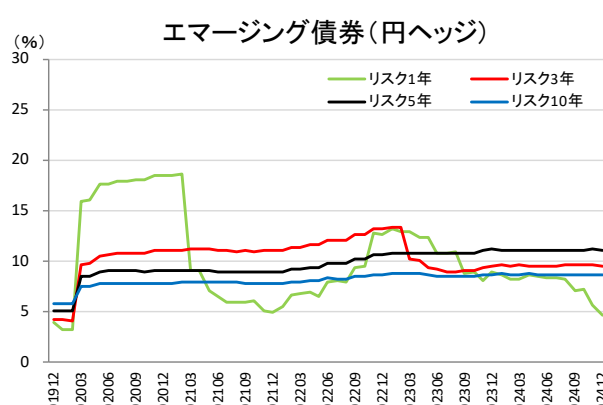
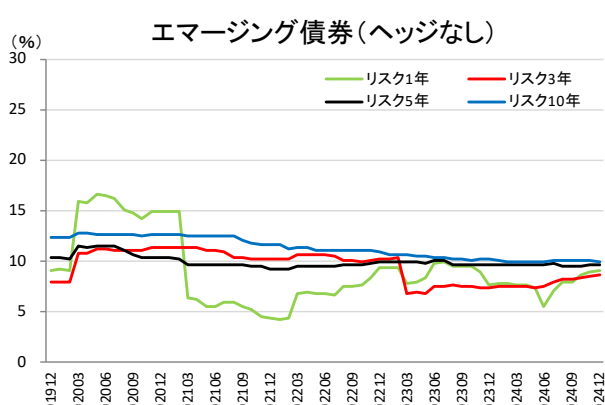
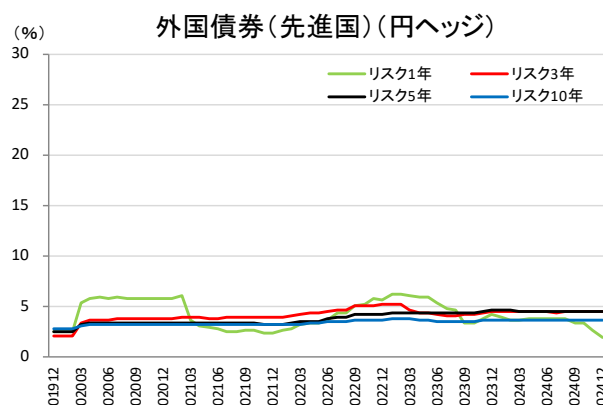
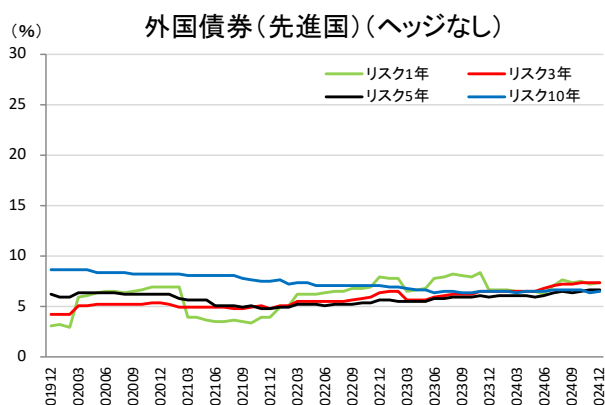
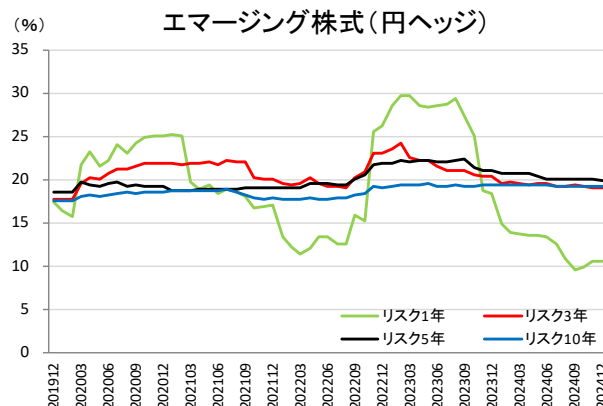
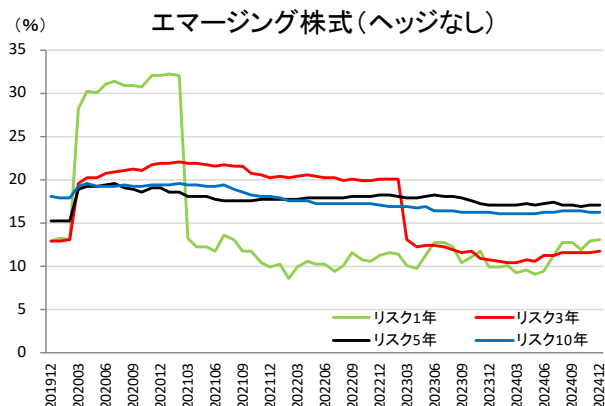
(2) リスク推移 (直近 5 年間、月次リターン・ベース)



<2> リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

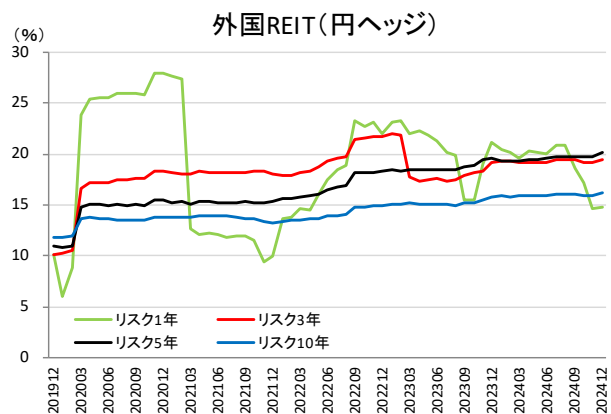
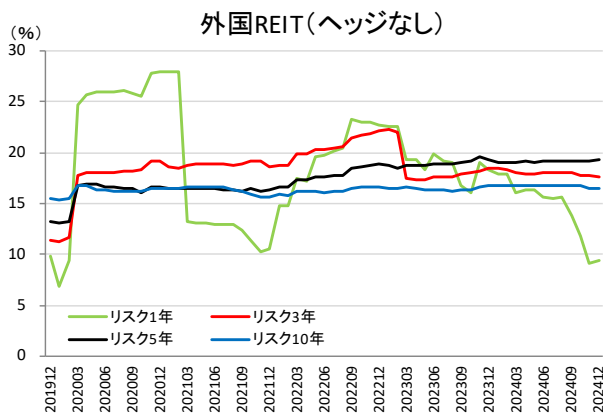
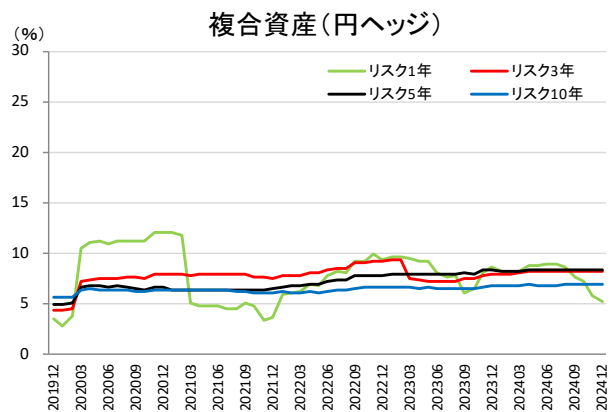
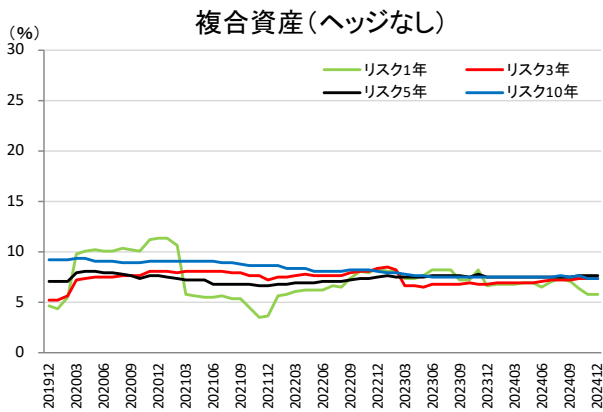
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



<2> リスク・サマリー

2. 「大分類（ヘッジ種別）」

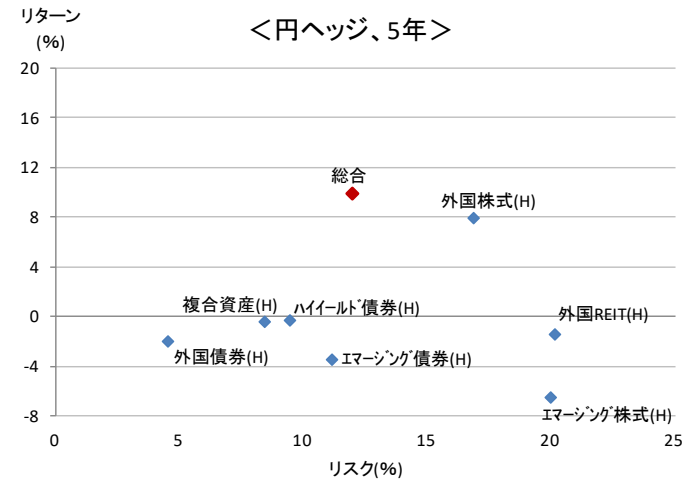
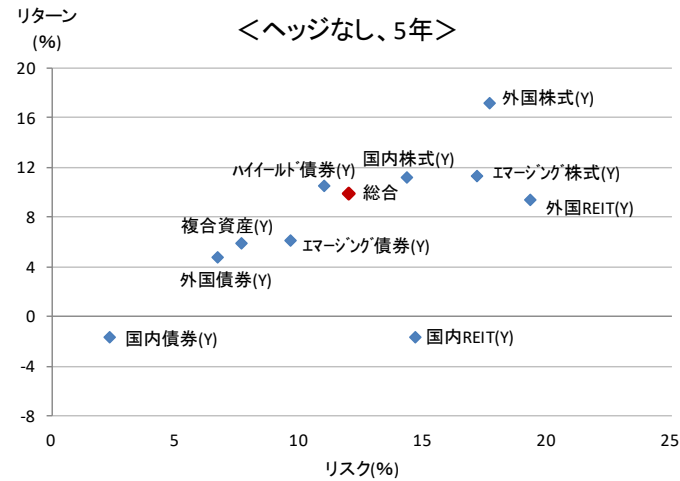
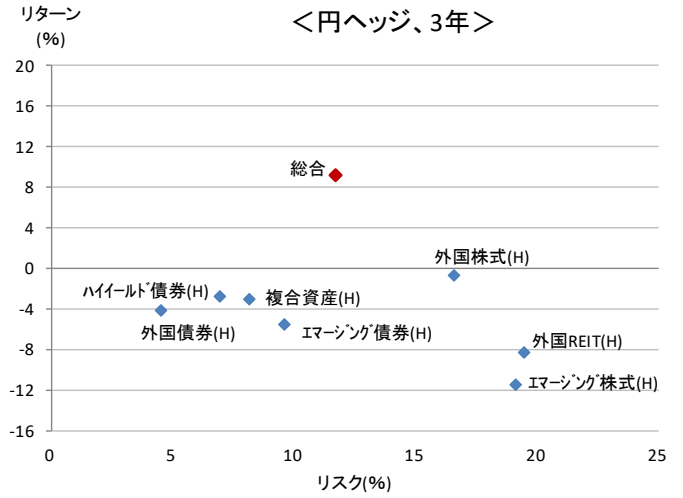
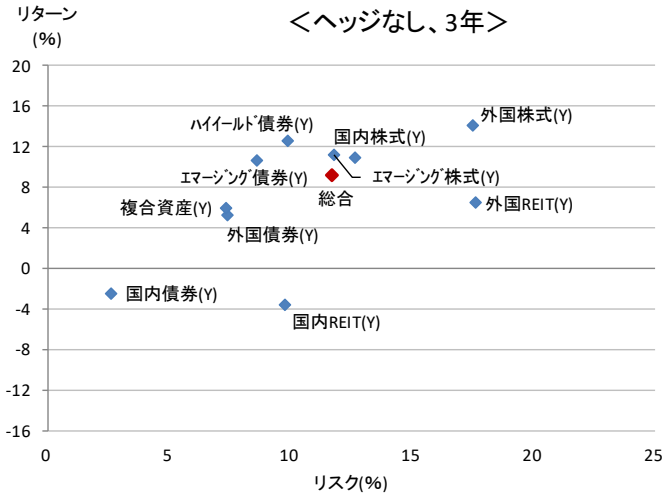
(2) リスク推移（直近5年間、月次リターン・ベース）



<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	9.09	9.83	11.73	11.99
国内株式(Y)	10.99	11.19	12.64	14.28
国内債券(Y)	-2.52	-1.67	2.62	2.30
外国株式(先進国)(Y)	14.08	17.12	17.45	17.65
エマージング株式(Y)	11.18	11.32	11.77	17.12
外国債券(先進国)(Y)	5.26	4.73	7.40	6.67
エマージング債券(Y)	10.71	6.15	8.61	9.60
ハイールド債券(Y)	12.62	10.47	9.85	10.95
複合資産(Y)	6.01	5.95	7.32	7.64
国内REIT(Y)	-3.59	-1.64	9.75	14.62
外国REIT(Y)	6.51	9.38	17.60	19.27

<円ヘッジ>	リターン(%)		リスク(%)	
	3年	5年	3年	5年
総合	9.09	9.83	11.73	11.99
外国株式(先進国)(H)	-0.66	7.93	16.57	16.86
エマージング株式(H)	-11.51	-6.54	19.10	19.95
外国債券(先進国)(H)	-4.10	-2.03	4.48	4.48
エマージング債券(H)	-5.55	-3.50	9.57	11.11
ハイールド債券(H)	-2.71	-0.34	6.92	9.40
複合資産(H)	-3.04	-0.47	8.16	8.39
外国REIT(H)	-8.27	-1.40	19.45	20.10

※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	9,057	27,539	72,166	157,746
国内株式	-1,868	-1,775	3,943	12,612
国内債券	41	875	1,419	2,294
外国株式(先進国)	11,222	26,867	56,494	113,502
エマージング株式	-186	-186	2,928	13,877
外国債券(先進国)	-150	-147	1,690	4,682
エマージング債券	-31	-171	-402	-323
ハイイールド債券	39	48	324	668
複合資産	534	2,708	6,557	11,214
国内REIT	-292	-712	-1,414	-1,643
外国REIT	32	275	-43	-741
その他	-285	-246	670	1,603

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	9,057	27,539	72,166	157,746
国内株式	-1,868	-1,775	3,943	12,612
ヘッジなし	-1,800	-1,596	4,170	12,967
国内債券	41	875	1,419	2,294
ヘッジなし	63	295	498	1,550
外国株式(先進国)	11,222	26,867	56,494	113,502
ヘッジなし	11,613	28,020	58,742	119,808
円ヘッジ	-300	-914	-1,780	-5,181
エマージング株式	-186	-186	2,928	13,877
ヘッジなし	-185	-187	2,930	13,891
円ヘッジ	0	-3	-6	-13
外国債券(先進国)	-150	-147	1,690	4,682
ヘッジなし	114	542	2,005	4,892
円ヘッジ	-212	-634	-420	-265
エマージング債券	-31	-171	-402	-323
ヘッジなし	-13	-120	-290	-41
円ヘッジ	-4	-10	-23	-57
ハイイールド債券	39	48	324	668
ヘッジなし	89	190	558	1,343
円ヘッジ	-22	-69	-113	-262
複合資産	534	2,708	6,557	11,214
ヘッジなし	587	2,901	6,552	12,930
円ヘッジ	-76	-166	-233	-676
国内REIT	-292	-712	-1,414	-1,643
ヘッジなし	-279	-682	-1,372	-1,568
外国REIT	32	275	-43	-741
ヘッジなし	44	288	-13	-673
円ヘッジ	0	15	17	35
その他	-285	-246	670	1,603

< 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	1,401,473	100.0		5,229	100.0
国内株式	173,185	12.4		757	14.5
国内債券	44,449	3.2		154	2.9
外国株式(先進国)	716,994	51.2		1,227	23.5
エマージング株式	59,865	4.3		304	5.8
外国債券(先進国)	101,317	7.2		720	13.8
エマージング債券	11,267	0.8		189	3.6
ハイイールド債券	22,329	1.6		210	4.0
複合資産	171,644	12.2		1,070	20.5
国内REIT	20,883	1.5		141	2.7
外国REIT	47,494	3.4		243	4.6
その他	32,046	2.3		214	4.1

2. 「大分類 (ヘッジ種別)」

	純資産額 (億円)	構成比(%)		本数	構成比(%)
総合	1,401,473	100.0		5,229	100.0
国内株式	173,185	12.4		757	14.5
ヘッジなし	169,182	12.1		714	13.7
国内債券	44,449	3.2		154	2.9
ヘッジなし	25,246	1.8		144	2.8
外国株式(先進国)	716,994	51.2		1,227	23.5
ヘッジなし	689,751	49.2		948	18.1
円ヘッジ	21,748	1.6		218	4.2
エマージング株式	59,865	4.3		304	5.8
ヘッジなし	59,813	4.3		292	5.6
円ヘッジ	25	0.0		7	0.1
外国債券(先進国)	101,317	7.2		720	13.8
ヘッジなし	64,982	4.6		412	7.9
円ヘッジ	22,821	1.6		239	4.6
エマージング債券	11,267	0.8		189	3.6
ヘッジなし	10,022	0.7		133	2.5
円ヘッジ	347	0.0		20	0.4
ハイイールド債券	22,329	1.6		210	4.0
ヘッジなし	18,155	1.3		78	1.5
円ヘッジ	1,209	0.1		54	1.0
複合資産	171,644	12.2		1,070	20.5
ヘッジなし	144,301	10.3		785	15.0
円ヘッジ	5,578	0.4		71	1.4
国内REIT	20,883	1.5		141	2.7
ヘッジなし	20,283	1.4		122	2.3
外国REIT	47,494	3.4		243	4.6
ヘッジなし	45,656	3.3		178	3.4
円ヘッジ	1,366	0.1		51	1.0
その他	32,046	2.3		214	4.1

< 5 > 属性、指標等（平均値）

1. 「総合」および「大分類」

	基準価額(円)	設定来 年数(年)	実績分配金 利回り(%)	予想分配金 利回り(%)	運用管理費用 合計(%)
総合	16,562	10.7	2.92	2.76	1.021
国内株式	23,717	14.8	1.61	1.48	0.963
国内債券	10,107	12.6	0.09	0.09	0.466
外国株式(先進国)	21,350	8.2	3.74	3.50	1.000
エマーヅング株式	16,022	11.1	3.49	3.14	1.629
外国債券(先進国)	10,893	11.2	1.08	1.05	0.941
エマーヅング債券	10,618	12.5	3.36	3.31	1.322
ハイイールド債券	10,108	12.8	4.68	4.27	1.635
複合資産	14,961	10.3	1.08	1.06	0.901
国内REIT	12,991	11.0	6.34	7.59	0.873
外国REIT	13,727	10.2	7.20	6.96	1.420

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	16,562	10.7	2.92	2.76	1.021
国内株式	23,717	14.8	1.61	1.48	0.963
ヘッジなし	23,475	15.0	1.54	1.41	0.948
国内債券	10,107	12.6	0.09	0.09	0.466
ヘッジなし	10,153	12.8	0.12	0.13	0.273
外国株式(先進国)	21,350	8.2	3.74	3.50	1.000
ヘッジなし	23,222	7.9	3.76	3.52	0.979
円ヘッジ	14,545	8.6	3.19	2.98	1.494
エマーヅング株式	16,022	11.1	3.49	3.14	1.629
ヘッジなし	16,334	11.2	3.49	3.14	1.629
円ヘッジ	9,204	13.2	0.54	0.54	1.707
外国債券(先進国)	10,893	11.2	1.08	1.05	0.941
ヘッジなし	12,518	12.9	1.36	1.30	0.945
円ヘッジ	8,681	8.5	0.64	0.67	0.826
エマーヅング債券	10,618	12.5	3.36	3.31	1.322
ヘッジなし	11,168	12.3	3.22	3.19	1.276
円ヘッジ	7,206	12.6	2.63	2.76	1.569
ハイイールド債券	10,108	12.8	4.68	4.27	1.635
ヘッジなし	13,058	12.3	4.91	4.42	1.639
円ヘッジ	8,193	14.1	2.81	2.89	1.618
複合資産	14,961	10.3	1.08	1.06	0.901
ヘッジなし	16,042	11.5	1.17	1.14	0.837
円ヘッジ	10,771	9.2	1.09	1.11	1.328
国内REIT	12,991	11.0	6.34	7.59	0.873
ヘッジなし	12,452	10.9	6.36	7.64	0.858
外国REIT	13,727	10.2	7.20	6.96	1.420
ヘッジなし	15,159	10.4	7.25	6.97	1.421
円ヘッジ	9,466	9.0	4.59	5.14	1.248

(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