

iシェアーズ ハイイールド  
債券インデックス・ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限です。(設定日:2013年9月12日)	
決算日	8月2日(休業日の場合は翌営業日)	
運用方針	<p>①ハイイールド債券インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、米ドル建てハイイールド債市場を代表する指数に連動する有価証券を主要投資対象とします。対象指数の選定および変更に当たっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性等を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。</p> <p>②効率的な運用を目的として、ハイイールド債を主要投資対象とする上場投資信託証券(ETF)への投資を行う場合があります。</p> <p>③外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>④ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ・エイ。(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に有価証券の貸付の指図に関する権限の全部または一部を委託します。</p> <p>⑤資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p>	
主要運用対象	子投資信託	【iシェアーズ ハイイールド債券インデックス・ファンド】 ハイイールド債券インデックス・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	親投資信託	【ハイイールド債券インデックス・マザーファンド】 米ドル建てハイイールド債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指す有価証券を主要投資対象とします。
組入制限	<p>■株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>■上場投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。</p>	
分配方針	<p>年1回の毎決算時(原則として8月2日、休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>■経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲として分配を行います。</p> <p>■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。</p> <p>■留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p> <p>※基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p>	

## 第11期 運用報告書(全体版)

(決算日:2024年8月2日)

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、当ファンドは上記の通り決算を行いましたので、  
期中の運用状況と収益分配金をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますよう

お願い申し上げます。

## ブラックロック・ジャパン株式会社

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号  
丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するお問い合わせ先

電話番号: 03-6703-4300

(受付時間 営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス

[www.blackrock.com/jp/](http://www.blackrock.com/jp/)

## CONTENTS

子投資信託(決算日:2024年8月2日)

「iシェアーズ ハイイールド債券インデックス・  
ファンド」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ 運用担当者コメント
- ◇ ファンド状況
- ◇ 資産状況

親投資信託(決算日:2024年8月2日)

「ハイイールド債券インデックス・マザーファンド」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ ファンド状況
- ◇ 運用内容
- ◇ 資産状況
- ◇ お知らせ
  
- ◇ マザーファンドの組入上位ファンドの概要

## ◇基準価額の推移

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) マークイット iBoxx 米ドル建てリキッド・ハイイールド・キャップト指数 (円換算ベース)	期中騰落率	投資信託証券組入比率	純資産
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率				
	円	円	%		%	%	百万円
7期(2020年8月3日)	13,642	0	1.5	23,937.92	2.3	99.0	566
8期(2021年8月2日)	15,196	0	11.4	27,013.67	12.8	99.3	766
9期(2022年8月2日)	17,055	0	12.2	30,524.39	13.0	98.8	979
10期(2023年8月2日)	18,800	0	10.2	34,116.70	11.8	98.4	1,427
11期(2024年8月2日)	21,420	0	13.9	39,226.94	15.0	99.1	2,016

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「投資信託証券組入比率」は、実質組入比率を記載しています。

(注3) マークイット iBoxx 米ドル建てリキッド・ハイイールド・キャップト指数は、マークイット・インディセズ・リミテッド(以下、同社)が開発、計算した指数です。同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利は、同社に帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

(注4) 純資産総額の単位未満は切捨て。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

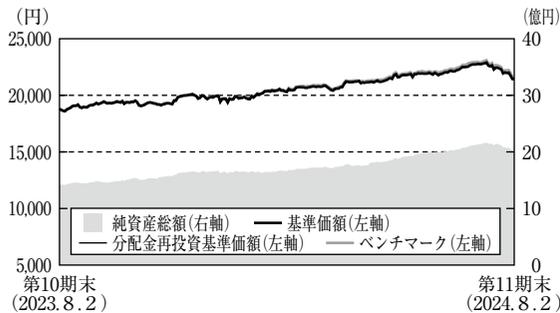
年月日	基準価額		(ベンチマーク) マークイット iBoxx 米ドル建てリキッド・ハイイールド・キャップト指数 (円換算ベース)	騰落率	投資信託証券組入比率
	騰落率	騰落率			
(期首) 2023年8月2日	円 18,800	% -	34,116.70	% -	% 98.4
8月末	19,325	2.8	35,023.89	2.7	98.4
9月末	19,406	3.2	35,281.73	3.4	98.9
10月末	19,215	2.2	34,940.91	2.4	98.5
11月末	19,791	5.3	36,068.45	5.7	96.3
12月末	19,676	4.7	35,879.63	5.2	99.0
2024年1月末	20,416	8.6	37,201.10	9.0	98.3
2月末	20,787	10.6	37,912.11	11.1	98.6
3月末	21,214	12.8	38,673.16	13.4	98.9
4月末	21,775	15.8	39,819.05	16.7	98.4
5月末	21,835	16.1	39,907.30	17.0	96.1
6月末	22,648	20.5	41,489.80	21.6	98.6
7月末	21,738	15.6	39,892.83	16.9	98.9
(期末) 2024年8月2日	21,420	13.9	39,226.94	15.0	99.1

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「投資信託証券組入比率」は、実質組入比率を記載しています。

(注3) マークイット iBoxx 米ドル建てリキッド・ハイイールド・キャップト指数は、マークイット・インディセズ・リミテッド(以下、同社)が開発、計算した指数です。同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利は、同社に帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

## ■当期中の基準価額等の推移について(第11期:2023年8月3日~2024年8月2日)



第11期首: 18,800円

第11期末: 21,420円(既払分配金0円)

騰落率: 13.9%(分配金再投資ベース)

- \* 分配金再投資基準価額は、収益分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- \* 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- \* ベンチマークは、マークイット *iBoxx* 米ドル建てリキッド・ハイイールド・キャップト指数(円換算ベース)です。
- \* 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

## ◇運用担当者コメント

### 投資環境について

当期(2023年8月3日から2024年8月2日)を通じて、米国ハイイールド債のспредは縮小しました。

期初から2023年末にかけては、米国のインフレ圧力に対する懸念や中東情勢の緊迫化などを背景にспредが一時拡大する局面はあったものの、底堅い企業ファンダメンタルズや中銀による利上げ終了との見方などがサポート材料となり、米国ハイイールド債のспредは堅調に推移しました。

2024年に入ってから、米国の金融政策が緩和的に転じることへの期待感やハイイールド債の良好な需給環境などが下支え要因となりました。期末にかけては、景気後退懸念の高まりなどを背景にグローバル市場全体でリスクオフとなりспредが拡大

しましたが、当期間を通じてみるとспредは縮小しました。

## ポートフォリオについて

### <当ファンド>

当期はハイイールド債券インデックス・マザーファンド受益証券を高位に組入れた運用を行いました。

### <ハイイールド債券インデックス・マザーファンド>

主としてiシェアーズ 米ドル建てハイイールド社債 UCITS ETFを組み入れることにより、米ドル建てハイイールド債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指し運用を行いました。組入比率については概ね100%程度を維持しました。

## 基準価額の主な変動要因

当期、当ファンドの基準価額は13.9%の上昇となりました。当期、米国ハイイールド債から得られる利回りやспред縮小、ドル円の上昇などがプラス要因となりました。

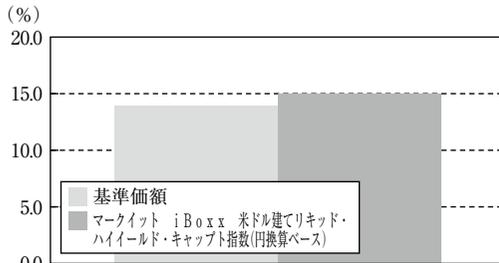
## ■組入ファンドの当期間中の騰落率

組入ファンド	騰落率
ハイイールド債券インデックス・マザーファンド	14.3%

## ベンチマークとの差異について

当期、当ファンドの基準価額は13.9%の上昇となりました。また、マークイット *iBoxx* 米ドル建てリキッド・ハイイールド・キャップト指数(円換算ベース)は15.0%の上昇となりました。ベンチマークとの差異については、当ファンドにおいて信託報酬等コスト負担が発生することなどが主なマイナス要因となりました。

## 【基準価額とベンチマークの対比(期別騰落率)】



第11期  
(2023.8.3 ~ 2024.8.2)

<ハイイールド債券インデックス・マザーファンド>  
米ドル建てハイイールド債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。

## 分配金について

収益分配は基準価額水準、市場動向等を勘案して、見送りとさせていただきます。留保益の運用につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行います。

## ■分配原資の内訳(1万口当たり)

項目	当期 2023年8月3日 ~2024年8月2日
当期分配金(税込み)	- 円
対基準価額比率	- %
当期の収益	- 円
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	11,420

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。  
また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

## 今後の運用方針について

## &lt;当ファンド&gt;

当ファンドの運用方針に従い、ハイイールド債券インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、米ドル建てハイイールド債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。

## ◇ファンド状況

## ■ 1万口当りの費用明細

項目	第11期		項目の概要
	(2023. 8. 3～2024. 8. 2)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 53	% 0.258	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は20,574円です。
(投信会社)	( 2)	(0.011)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(45)	(0.220)	販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	( 6)	(0.027)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	-	-	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税	-	-	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	8	0.038	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	( 1)	(0.006)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	( 6)	(0.030)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	( 0)	(0.002)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	61	0.297	

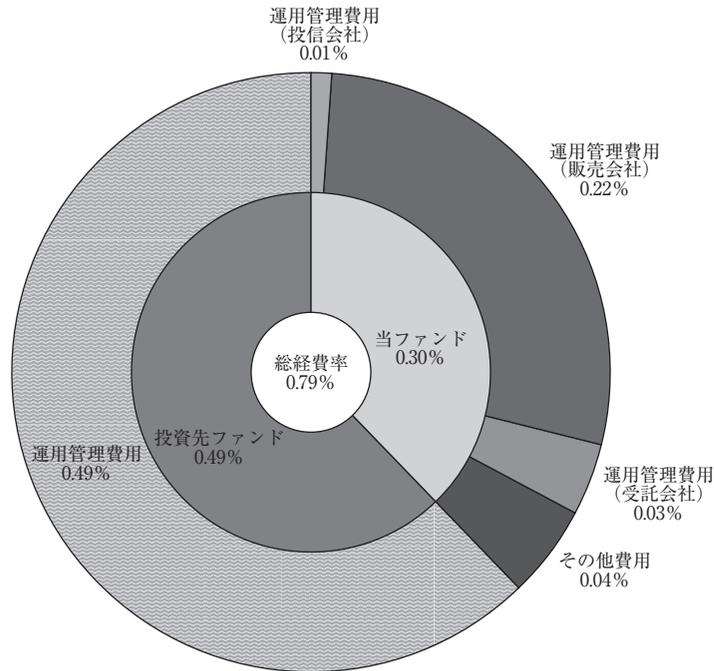
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当りのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## (参考情報)

## ■総経費率



※当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.79%です。

総経費率(①+②)	0.79%
①当ファンドの費用の比率	0.30%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.49%

(注1) ①の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

(注8) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

### ■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2023年8月3日から2024年8月2日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ハイイールド債券インデックス・マザーファンド	千口 489,128	千円 1,056,415	千口 316,697	千円 679,116

(注) 単位未満は切捨て。

### ■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2023年8月3日から2024年8月2日まで)

当期における株式の売買はありません。

### ■利害関係人との取引状況(2023年8月3日から2024年8月2日まで)

上記期間における利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

### ■組入資産の明細

親投資信託残高

銘	柄	期 首(前期末)		当 期 末	
		口 数	口 数	評 価	額
ハイイールド債券インデックス・マザーファンド		千口 729,338	千口 901,770	千円 2,018,883	

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 親投資信託の受益権総口数は901,770千口です。

## ◇資産状況

## ■投資信託財産の構成

2024年8月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ハイイールド債券インデックス・マザーファンド	2,018,883	99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,098	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	2,024,982	100.0

(注1) ハイイールド債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(1,998,279千円)の投資信託財産総額(2,025,025千円)に対する比率は、98.7%です。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。換算レートは、1米・ドル=149.52円、1ユーロ=161.35円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年8月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,024,982,280円
ハイイールド債券インデックス・マザーファンド(評価額)	2,018,883,361
未 収 入 金	6,098,919
(B) 負 債	8,798,344
未 払 解 約 金	6,098,919
未 払 信 託 報 酬	2,435,425
そ の 他 未 払 費 用	264,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,016,183,936
元 本	941,251,150
次 期 繰 越 損 益 金	1,074,932,786
(D) 受 益 権 総 口 数	941,251,150口
1万口当り基準価額(C/D)	21,420円

&lt;注記事項&gt;

期首元本額	759,064,766円
期中追加設定元本額	512,733,519円
期中一部解約元本額	330,547,135円

## ■損益の状況

自2023年8月3日 至2024年8月2日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	164,833,321円
売 買 益	207,892,704
売 買 損	△ 43,059,383
(B) 信 託 報 酬 等	△ 5,001,586
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	159,831,735
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	125,664,006
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	789,437,045
(配 当 等 相 当 額)	( 663,231,978)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 126,205,067)
(F) 合 計(C+D+E)	1,074,932,786
次 期 繰 越 損 益 金(F)	1,074,932,786
追 加 信 託 差 損 益 金	789,437,045
(配 当 等 相 当 額)	( 669,614,867)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 119,822,178)
分 配 準 備 積 立 金	285,495,741

(注1) 損益の状況の中で有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中の信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注3) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。

**■当期の分配金**

当期の分配金は見送らせていただきました。

(注) 第11期計算期末における、費用控除後の配当等収益(102,878,298円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売却等損益(56,953,437円)、収益調整金(有価証券売却等損益相当額)(119,822,178円)、収益調整金(その他収益調整金)(669,614,867円)、分配準備積立金(125,664,006円)により、分配対象収益は1,074,932,786円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしています。

## 運用報告書

－第11期－ 決算日 2024年8月2日  
 計算期間(2023年8月3日～2024年8月2日)

### ハイイールド債券インデックス・マザーファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

決 算 日	8月2日(原則)
運 用 方 針	<p>①米ドル建てハイイールド債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指す有価証券を主要投資対象とします。対象指数の選定および変更に当たっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性等を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。</p> <p>②効率的な運用を目的として、ハイイールド債を主要投資対象とする上場投資信託証券(ETF)への投資を行う場合があります。</p> <p>③外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>④ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ・エイ、(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に有価証券の貸付の指図に関する権限の全部または一部を委託します。</p> <p>⑤資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p>
主要運用対象	米ドル建てハイイールド債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指す有価証券を主要投資対象とします。
組 入 制 限	<p>■株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>■上場投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</p>

## ◇基準価額の推移

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) マークイット iBoxx 米ドル建てリキッド・ハイイールド・キャップト指数 (円換算ベース)		投資信託証券組入比率	純資産
	円	騰落率	円	騰落率		
7期(2020年8月3日)	14,088	1.8	23,937.92	2.3	98.8	百万円 567
8期(2021年8月2日)	15,743	11.7	27,013.67	12.8	99.1	767
9期(2022年8月2日)	17,723	12.6	30,524.39	13.0	98.7	981
10期(2023年8月2日)	19,594	10.6	34,116.70	11.8	98.2	1,429
11期(2024年8月2日)	22,388	14.3	39,226.94	15.0	99.0	2,018

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) マークイット iBoxx 米ドル建てリキッド・ハイイールド・キャップト指数は、マークイット・インディセズ・リミテッド(以下、同社)が開発、計算した指数です。同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利は、同社に帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

(注3) 純資産総額の単位未満は切捨て。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) マークイット iBoxx 米ドル建てリキッド・ハイイールド・キャップト指数 (円換算ベース)		投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率	
(期首) 2023年8月2日	19,594	-	34,116.70	-	98.2
8月末	20,145	2.8	35,023.89	2.7	98.4
9月末	20,235	3.3	35,281.73	3.4	98.9
10月末	20,041	2.3	34,940.91	2.4	98.4
11月末	20,646	5.4	36,068.45	5.7	96.2
12月末	20,531	4.8	35,879.63	5.2	98.9
2024年1月末	21,307	8.7	37,201.10	9.0	98.2
2月末	21,700	10.7	37,912.11	11.1	98.5
3月末	22,150	13.0	38,673.16	13.4	98.9
4月末	22,741	16.1	39,819.05	16.7	98.4
5月末	22,810	16.4	39,907.30	17.0	96.0
6月末	23,663	20.8	41,489.80	21.6	98.5
7月末	22,719	15.9	39,892.83	16.9	98.7
(期末) 2024年8月2日	22,388	14.3	39,226.94	15.0	99.0

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) マークイット iBoxx 米ドル建てリキッド・ハイイールド・キャップト指数は、マークイット・インディセズ・リミテッド(以下、同社)が開発、計算した指数です。同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利は、同社に帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

## ■基準価額の推移

(2023年8月2日～2024年8月2日)



(注1) 前期末を100とした指数値を使用しています。

(注2) ベンチマークは、マークイット i B o x x 米ドル建てリキッド・ハイイールド・キャップト指数(円換算ベース)です。

## ◇ファンド状況

## ■1万口当りの費用明細

項目	当期
	円
(a) 売買委託手数料	-
(b) 有価証券取引税	-
(c) その他費用	2
(保管費用)	(1)
(その他)	(0)
合計	2

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数

(b) 有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数

(c) その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数

(注2) 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

## ◇運用内容

## ■売買及び取引の状況(2023年8月3日から2024年8月2日まで)

投資信託受益証券

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外国	千口	千米・ドル	千口	千米・ドル
アメリカ	127	11,782	92	8,717
iShares \$ High Yield Corp Bond UCITS ETF(アイルランド)				

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ( )内は、発行国です。

## ■主要な売買銘柄(2023年8月3日から2024年8月2日まで)

## 投資信託受益証券

当			期				
買		付		売		付	
銘柄	口数	金額	銘柄	口数	金額	銘柄	口数
iShares \$ High Yield Corp Bond UCITS ETF(アイルランド)	千口 127	千円 1,752,937	iShares \$ High Yield Corp Bond UCITS ETF(アイルランド)	千口 92	千円 1,361,143		

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産の明細

## 外国投資信託受益証券

銘柄	柄	期首(前期末)	当期		期末
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千口	千米・ドル	千円
iShares \$ High Yield Corp Bond UCITS ETF		108	143	13,361	1,997.870
通貨小計	口数・金額	108	143	13,361	1,997.870
	銘柄数・比率	1銘柄	1銘柄	-	<99.0%>
合計	口数・金額	108	143	-	1,997.870
	銘柄数・比率	1銘柄	1銘柄	-	<99.0%>

(注1) 〈 〉内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。

(注3) 口数、評価額の単位未満は切捨て。

## ◇資産状況

## ■投資信託財産の構成

2024年8月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	1,997,870	98.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	27,155	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	2,025,025	100.0

(注1) 当期末における外貨建資産(1,998,279千円)の投資信託財産総額(2,025,025千円)に対する比率は、98.7%です。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。換算レートは、1米・ドル=149.52円、1ユーロ=161.35円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年8月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,025,025,047円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	27,155,037
投資信託受益証券(評価額)	1,997,870,010
(B) 負 債	6,098,919
未 払 解 約 金	6,098,919
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,018,926,128
元 本	901,770,306
次 期 繰 越 損 益 金	1,117,155,822
(D) 受 益 権 総 口 数	901,770,306口
1万口当り基準価額(C/D)	22,388円

&lt;注記事項&gt;

期首元本額	729,338,847円
期中追加設定元本額	1,089,884,934円
期中一部解約元本額	917,453,475円

期末における元本の内訳

iシェアズ ハイイールド債券インデックス・ファンド	901,770,306円
合計	901,770,306円

## ◇お知らせ

ハイイールド債券インデックス・マザーファンド

以下のとおりの投資信託約款の変更を行いました。

1. 成長投資枠N I S Aに適合する投資制限で運用していることを明確に記述するため、投資制限の文言を追記しました。

(変更日:2024年5月3日)

## ■損益の状況

自2023年8月3日 至2024年8月2日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	105,693,346円
受 取 配 当 金	105,658,510
受 取 利 息	8,034
そ の 他 収 益 金	26,802
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	207,528,901
売	207,528,901
(C) そ の 他 費 用	△ 164,643
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	313,057,604
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	699,758,687
(F) 解 約 差 損 益 金	△1,124,800,266
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,229,139,797
(H) 合 計(D+E+F+G)	1,117,155,822
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,117,155,822

(注1) 損益の状況の中で有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

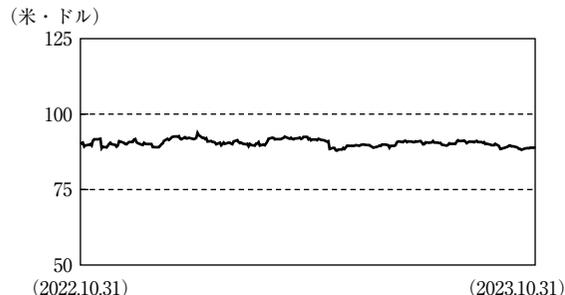
(注2) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。

(注3) 損益の状況の中で解約差損益金とは中途解約の際、解約代金と元本の差額をいいます。

## ◇マザーファンドの組入上位ファンドの概要

## ◆iShares \$ High Yield Corp Bond UCITS ETF

## ○基準価額の推移



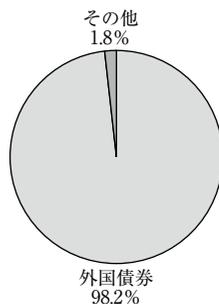
## ○上位10銘柄

銘柄名	通貨	比率
TRANSDIGM INC 5.5 15-NOV-2027 (SENIOR SUB)	米・ドル	1.3%
BLK ICS USD LEAF AGENCY DIST IOH	米・ドル	1.3
CCO HOLDINGS LLC 4.5 01-MAY-2032 (SENIOR)	米・ドル	1.2
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHER 3.15 01-OCT-2026 (SENIOR)	米・ドル	1.1
WESTERN DIGITAL CORPORATION 4.75 15-FEB-2026 (SENIOR)	米・ドル	1.1
VODAFONE GROUP PLC HYBRID 7.0 04-APR-2079 (CAPSEC (BTP))	米・ドル	1.0
NEWELL BRANDS INC 5.2 01-APR-2026 (SENIOR)	米・ドル	1.0
DISH DBS CORP 5.875 15-NOV-2024 (SENIOR)	米・ドル	0.8
UNITED RENTALS (NORTH AMERICA) INC 4.875 15-JAN-2028 (SENIOR)	米・ドル	0.8
DISH DBS CORP 7.75 01-JUL-2026 (SENIOR)	米・ドル	0.7
組入銘柄数	1,183銘柄	

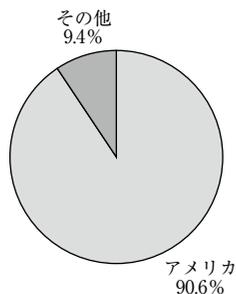
## ○1万口当りの費用の明細

当該情報の取得が不可能であるため記載しておりません。

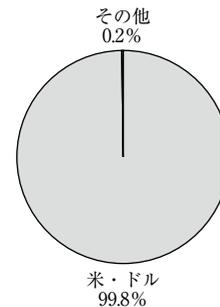
## ○資産別配分



## ○国別配分



## ○通貨別配分



(注1) 基準価額の推移は組入ファンドの直近の計算期間のものです。

(注2) 組入上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注3) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

\* 当社適時開示資料作成にあたり使用しておりますブラックロック・グループのデータに基づき記載しております。