

iシェアーズ 国内株式  
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／国内／株式／インデックス型	
信 託 期 間	無期限です。(設定日:2013年9月3日)	
決 算 日	5月2日(休業日の場合は翌営業日)	
運 用 方 針	<p>①国内株式インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本の株式市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。対象指数の選定および変更にあたっては、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者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、株式を主要投資対象とする上場投資信託証券(E T F)への投資を行なう場合があります。</p> <p>③対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用することがあります。その際、株式の実質投資比率(組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)が100%を超える場合があります。</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.)に有価証券の買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 国内株式インデックス・ファンド】国内株式インデックス・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	【国内株式インデックス・マザーファンド】日本の株式等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には、制限を設けません。</p> <p>■外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。</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> <p>■株式以外の資産への投資(他の投資信託受益証券を通じて投資する部分も含みます。)は、原則として信託財産総額の50%未満とします。</p>	
分 配 方 針	<p>年1回の毎決算時(原則として5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。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> <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>	

第9期 運用報告書(全体版)  
(決算日:2022年5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ないましたので、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:2022年5月2日)

「iシェアーズ 国内株式インデックス・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:2022年5月2日)

「国内株式インデックス・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

- ◇ 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) 日経平均株価(日経225)		株 式 先 物 組 入 比 率	投 資 信 託 受 益 組 入 比 率	純 資 産
	(分配落)	税 込 分配金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
5期(2018年5月2日)	17,178	0	17.3	22,472.78	15.6	17.4	82.5	3,629
6期(2019年5月7日)	17,072	0	△ 0.6	21,923.72	△ 2.4	28.6	71.1	3,509
7期(2020年5月7日)	15,568	0	△ 8.8	19,674.77	△10.3	8.3	90.5	2,864
8期(2021年5月6日)	23,450	0	50.6	29,331.37	49.1	30.6	69.3	3,848
9期(2022年5月2日)	21,755	0	△ 7.2	26,818.53	△ 8.6	13.7	84.9	4,291

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 株式先物組入比率＝買建比率－売建比率。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式先物組入比率」、「投資信託受益証券組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注4) 日経平均株価(日経225)に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は本商品を保証するものではなく、本商品について一切の責任を負いません。

(注5) 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) 日経平均株価(日経225)		株 式 先 物 組 入 比 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021年5月6日	円 23,450	% －	29,331.37	% －	% 30.6	% 69.3
5月末	23,083	△1.6	28,860.08	△1.6	12.4	87.4
6月末	23,034	△1.8	28,791.53	△1.8	31.0	72.1
7月末	21,844	△6.8	27,283.59	△7.0	19.5	79.9
8月末	22,471	△4.2	28,089.54	△4.2	20.8	78.2
9月末	23,724	1.2	29,452.66	0.4	18.8	80.5
10月末	23,232	△0.9	28,892.69	△1.5	14.6	84.0
11月末	22,348	△4.7	27,821.76	△5.1	14.4	83.7
12月末	23,202	△1.1	28,791.71	△1.8	18.4	81.1
2022年1月末	21,763	△7.2	27,001.98	△7.9	12.9	86.0
2月末	21,363	△8.9	26,526.82	△9.6	11.7	87.0
3月末	22,581	△3.7	27,821.43	△5.1	9.6	89.9
4月末	21,789	△7.1	26,847.90	△8.5	13.7	84.7
(期 末) 2022年5月2日	21,755	△7.2	26,818.53	△8.6	13.7	84.9

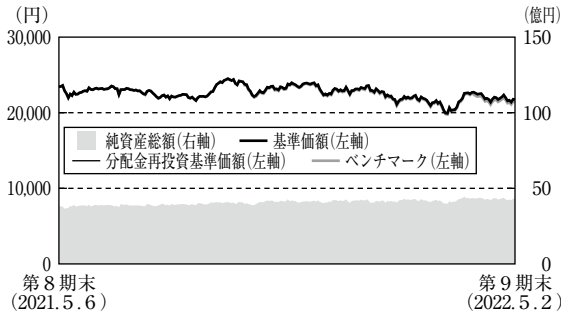
(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 株式先物組入比率＝買建比率－売建比率。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式先物組入比率」、「投資信託受益証券組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注4) 日経平均株価(日経225)に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は本商品を保証するものではなく、本商品について一切の責任を負いません。

## ■当期中の基準価額等の推移について(第9期:2021年5月7日～2022年5月2日)



第9期首：23,450円

第9期末：21,755円(既払分配金0円)

騰落率：-7.2%(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、日経平均株価(日経225)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(2021年5月7日から2022年5月2日)、ベンチマークである日経平均株価は8.6%下落しました。

2021年5月、米国で消費者物価や米長期金利が上昇したことを背景に米国株が大幅調整となり、日本株は一時下落しました。しかし、6月中旬にかけて、米長期金利の上昇一服や米インフラ投資報道、新型コロナワクチン接種の進展などから日本株は反発しました。8月にかけては、国内外における新型コロナ感染者数の増加に伴う景気回復懸念や、トヨタの減産報道から日本株は再び軟調な動きとなりました。9月、菅首相が自民党総裁選不出馬を表明したことにより、首相交代を好感した外国人投資家が日本株を大きく押し上げましたが、中国恒大集団の信用不安や、米長期金利上昇から日本株は上げ幅を戻す展

開となりました。12月末にかけては、中国恒大集団の信用不安や、米債務上限問題、米長期金利上昇・下落、新型コロナの変異株「オミクロン株」への警戒など好悪材料が入り混じり、日本株は方向性の定まらない展開となりました。2022年に入ると、米国で利上げや資産圧縮が早期に進むとの観測から米長期金利が上昇し、日本株はグロース株を中心に大幅調整となりました。2月から3月中旬にかけてはウクライナ情勢の緊迫化と米金融引き締めへの警戒から日本株は大幅に下落しました。3月中旬以降、ウクライナ情勢に安堵感が出てきたことや、円安ドル高が進んだことなどから日本株は反発しました。その後、米金融引き締めの強化が懸念される一方、円安ドル高が進み日本株は方向性の定まらない展開となりました。

## ポートフォリオについて

### <当ファンド>

国内株式インデックス・マザーファンド受益証券を高位に組入れた運用を行ないました。

### <国内株式インデックス・マザーファンド>

主としてiシェアーズ・コア 日経225 ETFおよび国内株式先物を組み入れることにより、日本株式への投資を行ないました。組入比率については概ね98%以上を維持しました。

### 基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は7.2%下落しました。当期、「国内株式インデックス・マザーファンド」が下落したこと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

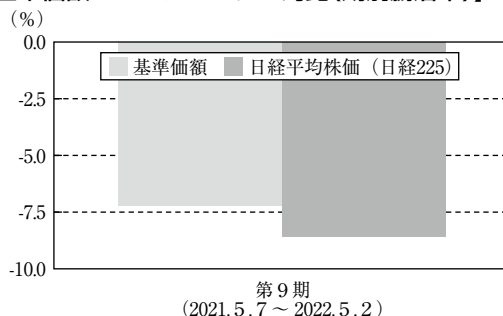
組入ファンド	騰落率
国内株式インデックス・マザーファンド	△7.0%

### 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7.2%下落しました。また、ベンチマークである日経平均株価は8.6%下落しました。

ベンチマークとの差異については、当ファンドが組み入れるマザーファンドにはマザー保有資産からの配当金が計上されましたが、ベンチマークには配当金の受け取りが反映されないことがプラス要因となりました。一方、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)】



### 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せん。

### ■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期 2021年5月7日 ~2022年5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	11,754

(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

#### <当ファンド>

当ファンドの運用方針に従い、国内株式インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本の株式市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。

#### <国内株式インデックス・マザーファンド>

日本の株式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9期		項目の概要
	(2021. 5. 7～2022. 5. 2)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 48	% 0.212	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22,630円です。
(投信会社)	( 5)	(0.022)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(37)	(0.163)	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	1	0.005	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
(先物・オプション)	( 1)	(0.005)	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	9	0.042	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監査費用)	( 5)	(0.021)	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)	( 5)	(0.021)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	59	0.259	

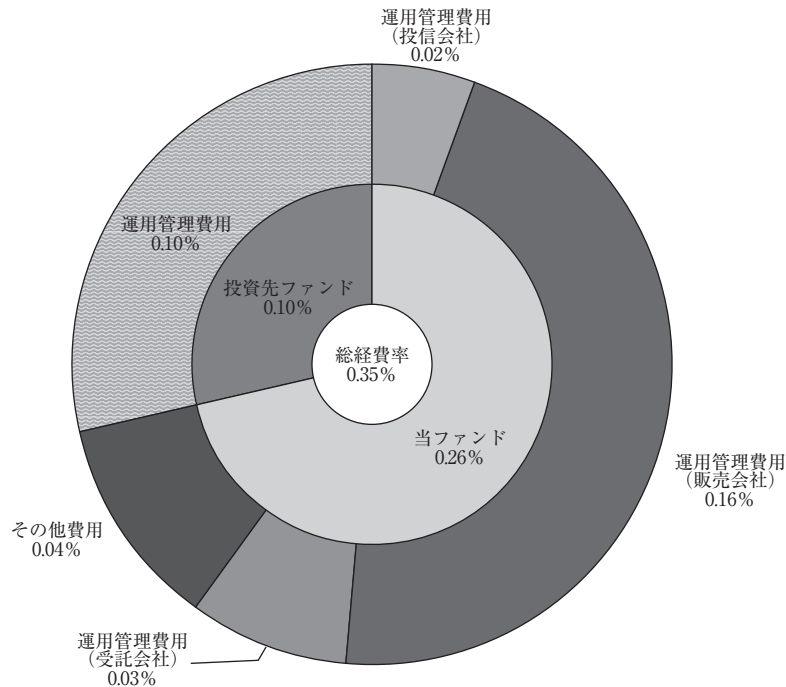
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(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0.35%です。

総経費率(①+②+③)	0.35%
①当ファンドの費用の比率	0.26%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.10%

(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②③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(2021年5月7日から2022年5月2日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内株式インデックス・マザーファンド	千口 1,922,895	千円 4,423,858	千口 1,601,983	千円 3,748,404

(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(2021年5月7日から2022年5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(2021年5月7日から2022年5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1) 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。

(注2) マザーファンドで組入れているiシェアーズ・コア 日経225 E T Fは、ブラックロックジャパン株式会社が設定・運用している上場投資信託です。

## ■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
国内株式インデックス・マザーファンド	千口 1,609,995	千口 1,930,907	千円 4,296,849

(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5,490,729千口です。



## ◇資産状況

## ■投資信託財産の構成

2022年5月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内株式インデックス・マザーファンド	千円 4,296,849	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	36,086	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	4,332,936	100.0

(注) 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

2022年5月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,332,936,339円
国内株式インデックス・マザーファンド(評価額)	4,296,849,454
未 収 入 金	36,086,885
(B) 負 債	40,970,632
未 払 解 約 金	36,086,885
未 払 信 託 報 酬	4,460,247
そ の 他 未 払 費 用	423,500
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	4,291,965,707
元 本	1,972,894,420
次 期 繰 越 損 益 金	2,319,071,287
(D) 受 益 権 総 口 数	1,972,894,420口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	21,755円

&lt;注記事項&gt;

期首元本額	1,641,234,385円
期中追加設定元本額	1,968,219,909円
期中一部解約元本額	1,636,559,874円

## ■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9期計算期末における、費用控除後の配当等収益(42,891,183円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(921,411,968円)、収益調整金(その他収益調整金)(1,117,634,100円)、分配準備積立金(237,134,036円)により、分配対象収益は2,319,071,287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きます。

## ■損益の状況

自2021年5月7日 至2022年5月2日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 191,001,540円
売 買 益	92,685,683
売 買 損	△ 283,687,223
(B) 信 託 報 酬 等	△ 9,988,750
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	△ 200,990,290
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	237,134,036
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,282,927,541
(配 当 等 相 当 額)	( 1,114,832,345)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 1,168,095,196)
(F) 合 計 (C+D+E)	2,319,071,287
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	2,319,071,287
追 加 信 託 差 損 益 金	2,282,927,541
(配 当 等 相 当 額)	( 1,117,634,100)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 1,165,293,441)
分 配 準 備 積 立 金	280,025,219
繰 越 損 益 金	△ 243,881,473

(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。

## 運 用 報 告 書

－第9期－ 決算日 2022年5月2日  
 計算期間(2021年5月7日～2022年5月2日)

## 国内株式インデックス・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	5月2日(原則)
運 用 方 針	<p>①日本の株式市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。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者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、株式を主要投資対象とする上場投資信託証券(ETF)への投資を行なう場合があります。</p> <p>③対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用することがあります。その際、株式の実質投資比率(組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)が100%を超える場合があります。</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	日本の株式等を主要投資対象とします。
組 入 制 限	<p>■株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>■外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。</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> <p>■株式以外の資産への投資(他の投資信託受益証券を通じて投資する部分も含みます。)は、原則として信託財産総額の50%未満とします。</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) 日経平均株価(日経225)		株 式 先 物 組 入 比 率	投資信託受益証券 組 入 比 率	純 資 産
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
	円	%		%	%	%	百万円
5期(2018年5月2日)	17,408	17.6	22,472.78	15.6	17.4	82.4	7,778
6期(2019年5月7日)	17,341	△ 0.4	21,923.72	△ 2.4	28.5	71.0	8,307
7期(2020年5月7日)	15,851	△ 8.6	19,674.77	△10.3	8.3	90.4	7,061
8期(2021年5月6日)	23,929	51.0	29,331.37	49.1	30.5	69.3	12,042
9期(2022年5月2日)	22,253	△ 7.0	26,818.53	△ 8.6	13.7	84.8	12,218

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 株式先物組入比率＝買建比率－売建比率。

(注3) 日経平均株価(日経225)に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は本商品を保証するものではなく、本商品について一切の責任を負いません。

(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) 日経平均株価(日経225)		株 式 先 物 組 入 比 率	投資信託受益証券 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021年5月6日	円 23,929	% -	29,331.37	% -	% 30.5	% 69.3
5月末	23,558	△1.6	28,860.08	△1.6	12.4	87.4
6月末	23,513	△1.7	28,791.53	△1.8	31.0	72.1
7月末	22,303	△6.8	27,283.59	△7.0	19.5	79.9
8月末	22,948	△4.1	28,089.54	△4.2	20.8	78.1
9月末	24,232	1.3	29,452.66	0.4	18.8	80.4
10月末	23,735	△0.8	28,892.69	△1.5	14.6	83.9
11月末	22,836	△4.6	27,821.76	△5.1	14.4	83.7
12月末	23,713	△0.9	28,791.71	△1.8	18.4	81.1
2022年1月末	22,248	△7.0	27,001.98	△7.9	12.9	86.0
2月末	21,844	△8.7	26,526.82	△9.6	11.7	86.9
3月末	23,093	△3.5	27,821.43	△5.1	9.6	89.8
4月末	22,287	△6.9	26,847.90	△8.5	13.7	84.6
(期 末) 2022年5月2日	22,253	△7.0	26,818.53	△8.6	13.7	84.8

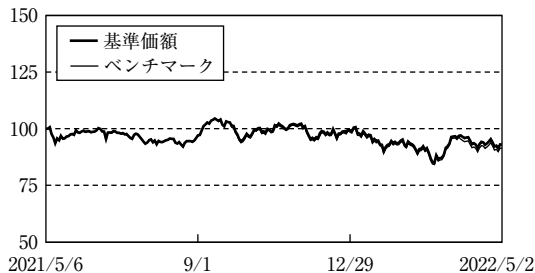
(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 株式先物組入比率＝買建比率－売建比率。

(注3) 日経平均株価(日経225)に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は本商品を保証するものではなく、本商品について一切の責任を負いません。

## ■基準価額の推移

(2021年5月6日～2022年5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) ベンチマークは日経平均株価(日経225)です。

## ◇ファンド状況

## ■1万口当りの費用明細

項 目	当 期
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	円 1 (1)
(b) 有価証券取引税	—
(c) その他費用 (その他)	5 (5)
合 計	6

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加、解約により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) 各項目ごと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(2021年5月7日から2022年5月2日まで)

## (1) 投資信託受益証券

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国内	iシェアーズ・コア 日経225 E T F	千口 97	千円 2,991,121	千口 —	千円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## (2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 15,909	百万円 17,827	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄(2021年5月7日から2022年5月2日まで)  
投資信託受益証券

買 付				売 付			
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
iシェアーズ・コア 日経225 E T F	千口 97	千円 2,991,121	円 30,599	—	千口 —	千円 —	円 —

(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

(1) 国内投資信託受益証券

銘 柄		期 首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価	額
iシェアーズ・コア 日経225 E T F		千口 274	千口 372	千円 10,365,012	
合 計	口 数 ・ 金 額	274	372	10,365,012	
	銘 柄 数・〈比 率〉	1銘柄	1銘柄	〈84.8%〉	

(注1) 合計欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 口数、評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別		当 期 末	当 期 末
		買 建 額	売 建 額
国内	日経平均	百万円 1,501	百万円 —
	ミニ日経平均	174	—

(注) 単位未満は切捨て。

## ◇資産状況

## ■投資信託財産の構成

2022年5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	10,365,012	84.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,895,754	15.5
投 資 信 託 財 産 総 額	12,260,767	100.0

(注) 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

2022年5月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	12,255,208,310円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,815,231,269
投資信託受益証券(評価額)	10,365,012,630
未 収 入 金	70,882,911
差 入 委 託 証 拠 金	4,081,500
(B) 負 債	36,565,130
未 払 解 約 金	36,565,130
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	12,218,643,180
元 本	5,490,729,563
次 期 繰 越 損 益 金	6,727,913,617
(D) 受 益 権 総 口 数	5,490,729,563口
1万口当り基準価額(C／D)	22,253円

## &lt;注記事項&gt;

期首元本額	5,032,690,565円
期中追加設定元本額	5,098,424,517円
期中一部解約元本額	4,640,385,519円

## 期末における元本の内訳

iシェアーズ 国内株式インデックス・ファンド	1,930,907,947円
ブラックロック・インデックス投資戦略ファンド	517,656,900円
マルチ・アセット投資戦略ファンド(適格機関投資家限定)	502,637,560円
ブラックロックLifePathファンド2055	133,126,458円
ブラックロックLifePathファンド2045	191,647,585円
ブラックロックLifePathファンド2035	401,790,436円
ブラックロックLifePathファンド2030	337,144,250円
ブラックロックLifePathファンド2040	275,457,284円
ブラックロックLifePathファンド2050	95,607,060円
マルチ・アセット投資戦略ファンド(年1回決算型／適格機関)	755,248,880円
ブラックロックLifePathファンド2025	143,616,613円
マルチ・アセット投資戦略ファンド3(適格機関投資家限定)	148,021,333円
ブラックロックLifePathファンド2060	15,408,567円
ブラックロックLifePathファンド2065	42,458,690円
合計	5,490,729,563円

## ■損益の状況

自2021年5月7日 至2022年5月2日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	162,982,428円
受 取 配 当 金	162,982,428
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 966,531,295
売 買 損 益	△ 966,531,295
(C) 先 物 取 引 等 損 益	△ 84,860,892
取 引 益	375,592,684
取 引 損	△ 460,453,576
(D) そ の 他 費 用	△ 2,777,363
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 891,187,122
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	7,010,245,012
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 6,039,664,136
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,648,519,863
(I) 合 計(E+F+G+H)	6,727,913,617
次 期 繰 越 損 益 金(I)	6,727,913,617

(注1) 損益の状況の中で有価証券売買損益及び先物取引等損益は、期末の評価換えによるものを含まず。

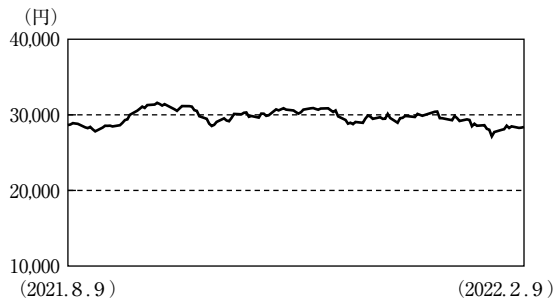
(注2) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。

(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

## ◆iシェアーズ・コア 日経225 ETF

## ○基準価額の推移



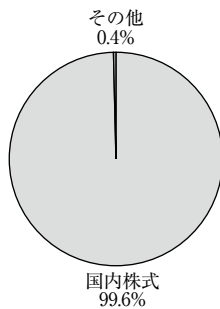
## ○上位10銘柄

銘柄名	通貨	比率
ファーストリテイリング	日本・円	8.2%
東京エレクトロン	日本・円	7.1
ソフトバンクグループ	日本・円	4.3
ファナック	日本・円	2.9
ダイキン工業	日本・円	2.9
KDDI	日本・円	2.9
信越化学	日本・円	2.4
アドバンテスト	日本・円	2.4
リクルートホールディングス	日本・円	2.3
テルモ	日本・円	2.1
組入銘柄数	225銘柄	

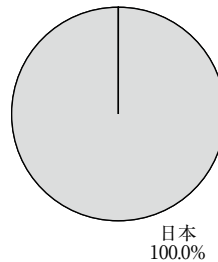
## ○1万口当りの費用の明細

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。

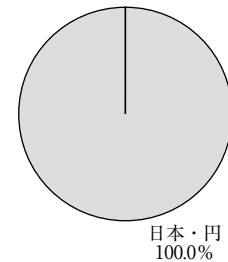
## ○資産別配分



## ○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。