

iシェアーズ 国内債券 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／国内／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国内債券インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、円建ての債券市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。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て委託会社が決定します。</p> <p>②効率的な運用を目的として、公社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、債券の実質投資比率(組入現物債券の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券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	子投資信託	【iシェアーズ 国内債券インデックス・ファンド】国内債券インデックス・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	【国内債券インデックス・マザーファンド】円建ての債券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は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。</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。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/

CONTENTS

子投資信託(決算日:2022年8月2日)

「iシェアーズ 国内債券インデックス・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:2022年8月2日)

「国内債券インデックス・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

◇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) NOMURA-BPI総合		公社債 組入比率	債券先物 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8月2日)	10,643	0	△0.1	379.72	0.3	99.0	-	990
6期(2019年8月2日)	11,005	0	3.4	393.78	3.7	99.9	-	912
7期(2020年8月3日)	10,789	0	△2.0	387.39	△1.6	99.9	-	1,071
8期(2021年8月2日)	10,785	0	△0.0	388.78	0.4	99.9	-	1,056
9期(2022年8月2日)	10,476	0	△2.9	378.88	△2.5	100.0	-	673

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 債券先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「公社債組入比率」、「債券先物組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注5) NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、NOMURA-BPI総合の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI総合を用いて行われるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

(注6) 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) NOMURA-BPI総合		公社債 組入比率	債券先物 組入比率
		騰落率		騰落率		
(期首) 2021年8月2日	円 10,785	% -	388.78	% -	% 99.9	% -
8月末	10,773	△0.1	388.46	△0.1	99.8	-
9月末	10,733	△0.5	387.12	△0.4	100.1	-
10月末	10,719	△0.6	386.72	△0.5	100.1	-
11月末	10,742	△0.4	387.65	△0.3	99.9	-
12月末	10,715	△0.6	386.84	△0.5	100.0	-
2022年1月末	10,634	△1.4	384.06	△1.2	99.9	-
2月末	10,579	△1.9	382.13	△1.7	99.7	-
3月末	10,546	△2.2	381.04	△2.0	101.7	-
4月末	10,517	△2.5	380.12	△2.2	99.9	-
5月末	10,499	△2.7	379.54	△2.4	100.1	-
6月末	10,399	△3.6	376.08	△3.3	109.3	-
7月末	10,467	△2.9	378.55	△2.6	100.2	-
(期末) 2022年8月2日	10,476	△2.9	378.88	△2.5	100.0	-

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

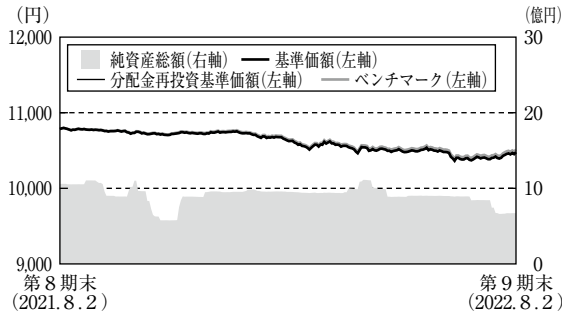
(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 債券先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「公社債組入比率」、「債券先物組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注5) NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、NOMURA-BPI総合の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI総合を用いて行われるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

■当期中の基準価額等の推移について(第9期:2021年8月3日~2022年8月2日)



第9期首：10,785円

第9期末：10,476円(既払分配金0円)

騰落率：-2.9%(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、NOMURA-BPI総合です。
- * 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8月3日から2022年8月2日)の日本債券市場は、海外からの外部要因や日銀の金融政策の影響を受け、日本国債の金利(10年物)は概ね0.00%から+0.26%のレンジで推移しました。

期初から2021年末にかけては、米国や欧州の中央銀行のタカ派的な姿勢による金利上昇圧力はあったものの、日本銀行によるイールドカーブ・コントロール効果等によって金利水準は小幅のレンジ内で推移し、2021年12月末の日本国債10年金利は0.07%となりました。

2022年1月から6月にかけては、米国および欧州の金融引き締め政策および高止まりするインフレ水準をうけて日本国債も米欧債券の動きに追随し、金

利上昇の流れとなりました。2022年6月には、日本国債の10年金利は2015年以来となる0.25%をつめました。

その後、7月以降には、グローバルに景気後退リスクが意識される中で長期金利は低下基調となり、期末時点の10年金利は0.16%となりました。

ポートフォリオについて

<当ファンド>

国内債券インデックス・マザーファンド受益証券を高位に組み入れた運用を行いました。

<国内債券インデックス・マザーファンド>

円建ての債券等(国債、社債等)を主要投資対象として、円建ての債券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99%以上を維持しました。

基準価額の主な変動要因

当期、当ファンドの基準価額は2.9%下落しました。当期、日本債券市場において金利が上昇するなか、「国内債券インデックス・マザーファンド」が下落したことがマイナス要因となりました。

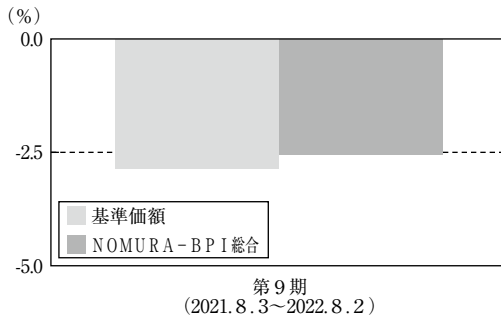
■組入ファンドの当期間中の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内債券インデックス・マザーファンド	△2.5%

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2.9%下落しました。また、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は2.5%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す。

■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期 2021年8月3日 ~2022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	685

- (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、円建ての債券市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。

<国内債券インデックス・マザーファンド>

円建ての債券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
	(2021.8.3~2022.8.2)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 32	% 0.297	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10,614円です。
(投信会社)	(15)	(0.137)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(15)	(0.137)	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)	(2)	(0.022)	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	4	0.033	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)	(3)	(0.032)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	35	0.330	

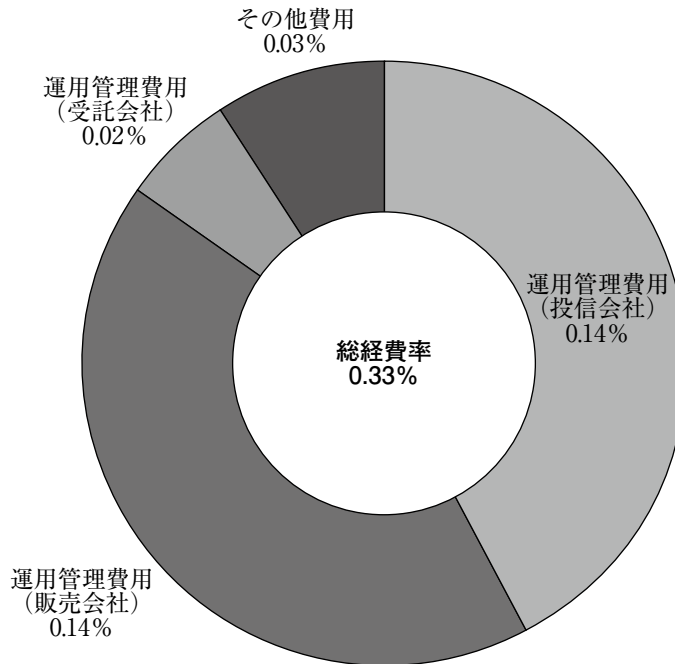
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(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0.33%です。

(注1) 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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2021年8月3日から2022年8月2日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内債券インデックス・マザーファンド	千口 869,876	千円 962,142	千口 1,197,656	千円 1,318,878

(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8月3日から2022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(2021年8月3日から2022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
国内債券インデックス・マザーファンド		千口 948,007	千口 620,227	千円 674,559

(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37,861,785千口です。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2022年8月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券インデックス・マザーファンド	千円 674,559	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	179	0.0
投 資 信 託 財 産 総 額	674,739	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8月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	674,739,109円
国内債券インデックス・マザーファンド(評価額)	674,559,944
未 収 入 金	179,165
(B) 負 債	1,661,777
未 払 解 約 金	179,165
未 払 信 託 報 酬	1,326,586
そ の 他 未 払 費 用	156,026
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	673,077,332
元 本	642,489,249
次 期 繰 越 損 益 金	30,588,083
(D) 受 益 権 総 口 数	642,489,249口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	10,476円

<注記事項>

期首元本額	979,568,245円
期中追加設定元本額	902,471,014円
期中一部解約元本額	1,239,550,010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(1,329,033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)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(40,417,877円)、分配準備積立金(2,306,359円)により、分配対象収益は44,053,269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8月3日 至2022年8月2日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	△11,396,791円
売 買 益	10,134,590
売 買 損	△21,531,381
(B) 信 託 報 酬 等	△ 3,003,585
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△14,400,376
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	162,472
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	44,825,987
(配 当 等 相 当 額)	(39,926,944)
(売 買 損 益 相 当 額)	(4,899,043)
(F) 合 計(C+D+E)	30,588,083
次 期 繰 越 損 益 金(F)	30,588,083
追 加 信 託 差 損 益 金	44,825,987
(配 当 等 相 当 額)	(40,417,877)
(売 買 損 益 相 当 額)	(4,408,110)
分 配 準 備 積 立 金	3,635,392
繰 越 損 益 金	△17,873,296

(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8月2日
 計算期間(2021年8月3日～2022年8月2日)

国内債券インデックス・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円建ての債券市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。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て委託会社が決定します。</p> <p>②効率的な運用を目的として、公社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、債券の実質投資比率(組入現物債券の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券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	円建ての債券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は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。</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) NOMURA-BPI総合		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	純資産
	期中 騰落率	騰落率	期中 騰落率	騰落率			
	円	%	%	%	%	%	百万円
5期(2018年8月2日)	10,904	0.3	379.72	0.3	98.8	-	14,521
6期(2019年8月2日)	11,312	3.7	393.78	3.7	99.7	-	13,954
7期(2020年8月3日)	11,127	△1.6	387.39	△1.6	99.7	-	30,718
8期(2021年8月2日)	11,160	0.3	388.78	0.4	99.7	-	41,493
9期(2022年8月2日)	10,876	△2.5	378.88	△2.5	99.7	-	41,178

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、NOMURA-BPI総合の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI総合を用いて行われるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

(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) NOMURA-BPI総合		公社債 組入比率	債券先物 組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2021年8月2日	円	%	%	%	%	%
8月末	11,160	-	388.78	-	99.7	-
9月末	11,150	△0.1	388.46	△0.1	99.7	-
10月末	11,112	△0.4	387.12	△0.4	100.0	-
11月末	11,100	△0.5	386.72	△0.5	99.9	-
12月末	11,127	△0.3	387.65	△0.3	99.8	-
2022年1月末	11,102	△0.5	386.84	△0.5	99.9	-
2月末	11,022	△1.2	384.06	△1.2	99.7	-
3月末	10,967	△1.7	382.13	△1.7	99.7	-
4月末	10,936	△2.0	381.04	△2.0	101.6	-
5月末	10,909	△2.2	380.12	△2.2	99.8	-
6月末	10,893	△2.4	379.54	△2.4	100.0	-
7月末	10,793	△3.3	376.08	△3.3	109.1	-
8月末	10,866	△2.6	378.55	△2.6	100.0	-
(期末) 2022年8月2日	10,876	△2.5	378.88	△2.5	99.7	-

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

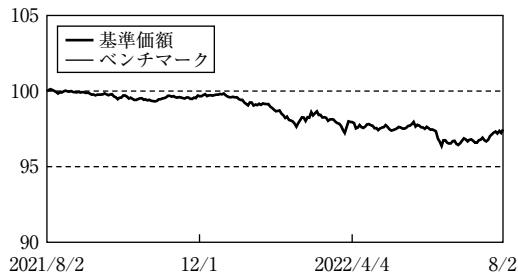
(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、NOMURA-BPI総合の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI総合を用いて行われるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

■基準価額の推移

(2021年8月2日～2022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NOMURA-BPI総合です。

◇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 (その他)	0 (0)
合計	0

(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(2021年8月3日から2022年8月2日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	37,986,229	37,370,186
	地方債証券	518,861	(340,000)
	特殊債券(除く金融債券)	100,000	(267,629)
	金融債券	-	(100,000)
	社債券	1,012,499	(200,000)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄(2021年8月3日から2022年8月2日まで)

公社債

買		付		売		付	
銘柄	金額	金額	銘柄	金額	金額	銘柄	金額
		千円			千円		
363 10年国債	1,492,800	363 10年国債	1,537,656				
364 10年国債	1,212,455	426 2年国債	921,640				
149 5年国債	1,027,794	364 10年国債	822,841				
434 2年国債	840,848	149 5年国債	799,506				
365 10年国債	797,993	359 10年国債	788,885				
433 2年国債	715,698	351 10年国債	788,407				
345 10年国債	705,309	136 5年国債	751,560				
150 5年国債	699,618	138 5年国債	662,248				
351 10年国債	693,293	345 10年国債	654,765				
147 5年国債	601,617	148 5年国債	651,745				

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産の明細

公社債

(A) 種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区分	当				期			末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率					
					5年以上	2年以上	2年未満			
	千円	千円	%	%	%	%	%	%	%	
国債証券	33,730,000	35,023,886	85.1	-	58.3	19.4		7.4		
地方債証券	1,790,000 (1,790,000)	1,823,002 (1,823,002)	4.4 (4.4)	- (-)	1.2 (1.2)	0.8 (0.8)		2.4 (2.4)		
特殊債証券 (除く金融債券)	1,881,389 (1,881,389)	1,911,442 (1,911,442)	4.6 (4.6)	- (-)	1.4 (1.4)	2.1 (2.1)		1.1 (1.1)		
金融債券	100,000 (100,000)	100,039 (100,039)	0.2 (0.2)	- (-)	- (-)	- (-)		0.2 (0.2)		
普通社債券	2,210,000 (2,210,000)	2,212,451 (2,212,451)	5.4 (5.4)	- (-)	2.4 (2.4)	2.7 (2.7)		0.2 (0.2)		
合計	39,711,389 (5,981,389)	41,070,823 (6,046,936)	99.7 (14.7)	- (-)	63.4 (5.0)	25.0 (5.6)		11.4 (4.0)		

(注1) ()内は非上場債で内書き。

(注2) 組入比率は、純資産総額(ただし追加型公社債投信については資産総額)に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(B) 詳細開示(個別銘柄別)

国内(邦貨建)公社債

銘柄	年 利率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額
(国債証券)	%		千円	千円
429 2年国債	0.0050	2023/10/01	120,000	120,208
431 2年国債	0.0050	2023/12/01	100,000	100,186
138 5年国債	0.1000	2023/12/20	100,000	100,318
332 10年国債	0.6000	2023/12/20	55,000	55,554
432 2年国債	0.0050	2024/01/01	165,000	165,315
433 2年国債	0.0050	2024/02/01	315,000	315,589
434 2年国債	0.0050	2024/03/01	330,000	330,623
139 5年国債	0.1000	2024/03/20	325,000	326,111
333 10年国債	0.6000	2024/03/20	185,000	187,140
435 2年国債	0.0050	2024/04/01	310,000	310,592
436 2年国債	0.0050	2024/05/01	270,000	270,518
437 2年国債	0.0050	2024/06/01	140,000	140,281
140 5年国債	0.1000	2024/06/20	285,000	286,071
334 10年国債	0.6000	2024/06/20	200,000	202,636
70 20年国債	2.4000	2024/06/20	4,000	4,188
438 2年国債	0.0050	2024/07/01	120,000	120,229
141 5年国債	0.1000	2024/09/20	477,000	479,036
335 10年国債	0.5000	2024/09/20	100,000	101,281
142 5年国債	0.1000	2024/12/20	245,000	246,168
336 10年国債	0.5000	2024/12/20	235,000	238,362
337 10年国債	0.3000	2024/12/20	200,000	201,908
143 5年国債	0.1000	2025/03/20	150,000	150,789
338 10年国債	0.4000	2025/03/20	386,000	391,083
144 5年国債	0.1000	2025/06/20	300,000	301,731
339 10年国債	0.4000	2025/06/20	350,000	355,050
145 5年国債	0.1000	2025/09/20	353,000	355,216
340 10年国債	0.4000	2025/09/20	390,000	396,123
146 5年国債	0.1000	2025/12/20	450,000	452,974
341 10年国債	0.3000	2025/12/20	500,000	506,695
147 5年国債	0.0050	2026/03/20	480,000	481,656
342 10年国債	0.1000	2026/03/20	495,000	498,420
148 5年国債	0.0050	2026/06/20	300,000	301,050
343 10年国債	0.1000	2026/06/20	200,000	201,440
88 20年国債	2.3000	2026/06/20	4,000	4,371
149 5年国債	0.0050	2026/09/20	225,000	225,744
344 10年国債	0.1000	2026/09/20	290,000	292,102
91 20年国債	2.3000	2026/09/20	15,000	16,476
150 5年国債	0.0050	2026/12/20	200,000	200,570
345 10年国債	0.1000	2026/12/20	465,000	468,264
151 5年国債	0.0050	2027/03/20	330,000	330,762
152 5年国債	0.1000	2027/03/20	100,000	100,672
346 10年国債	0.1000	2027/03/20	188,000	189,263
347 10年国債	0.1000	2027/06/20	485,000	488,079
348 10年国債	0.1000	2027/09/20	360,000	362,217
97 20年国債	2.2000	2027/09/20	10,000	11,140
349 10年国債	0.1000	2027/12/20	308,000	309,906
99 20年国債	2.1000	2027/12/20	50,000	55,694
350 10年国債	0.1000	2028/03/20	345,000	347,232
351 10年国債	0.1000	2028/06/20	403,000	405,486

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額
	%		千円	千円
352 10年国債	0.1000	2028/09/20	240,000	241,471
106 20年国債	2.2000	2028/09/20	45,000	51,070
353 10年国債	0.1000	2028/12/20	430,000	432,601
354 10年国債	0.1000	2029/03/20	510,000	513,039
355 10年国債	0.1000	2029/06/20	315,000	316,729
111 20年国債	2.2000	2029/06/20	85,000	97,729
356 10年国債	0.1000	2029/09/20	379,000	380,887
113 20年国債	2.1000	2029/09/20	10,000	11,473
357 10年国債	0.1000	2029/12/20	559,000	561,051
114 20年国債	2.1000	2029/12/20	191,000	219,873
358 10年国債	0.1000	2030/03/20	472,000	473,250
116 20年国債	2.2000	2030/03/20	3,000	3,487
359 10年国債	0.1000	2030/06/20	402,000	402,627
118 20年国債	2.0000	2030/06/20	103,000	118,530
360 10年国債	0.1000	2030/09/20	426,000	426,340
361 10年国債	0.1000	2030/12/20	240,000	240,000
123 20年国債	2.1000	2030/12/20	333,000	388,511
362 10年国債	0.1000	2031/03/20	355,000	354,694
125 20年国債	2.2000	2031/03/20	80,000	94,329
363 10年国債	0.1000	2031/06/20	405,000	404,287
128 20年国債	1.9000	2031/06/20	100,000	115,740
129 20年国債	1.8000	2031/06/20	100,000	114,861
364 10年国債	0.1000	2031/09/20	385,000	384,129
130 20年国債	1.8000	2031/09/20	264,000	304,196
131 20年国債	1.7000	2031/09/20	155,000	177,200
6 30年国債	2.4000	2031/11/20	80,000	96,728
365 10年国債	0.1000	2031/12/20	225,000	224,268
133 20年国債	1.8000	2031/12/20	160,000	184,676
366 10年国債	0.2000	2032/03/20	38,000	38,325
134 20年国債	1.8000	2032/03/20	226,000	261,389
367 10年国債	0.2000	2032/06/20	100,000	100,291
137 20年国債	1.7000	2032/06/20	130,000	149,397
138 20年国債	1.5000	2032/06/20	65,000	73,435
140 20年国債	1.7000	2032/09/20	240,000	276,297
141 20年国債	1.7000	2032/12/20	72,000	82,982
142 20年国債	1.8000	2032/12/20	164,000	190,684
143 20年国債	1.6000	2033/03/20	160,000	182,928
144 20年国債	1.5000	2033/03/20	160,000	181,267
145 20年国債	1.7000	2033/06/20	30,000	34,662
146 20年国債	1.7000	2033/09/20	150,000	173,461
147 20年国債	1.6000	2033/12/20	210,000	240,838
14 30年国債	2.4000	2034/03/20	100,000	123,872
148 20年国債	1.5000	2034/03/20	150,000	170,415
15 30年国債	2.5000	2034/06/20	80,000	100,303
149 20年国債	1.5000	2034/06/20	155,000	176,233
150 20年国債	1.4000	2034/09/20	161,000	181,305
151 20年国債	1.2000	2034/12/20	280,000	308,607
18 30年国債	2.3000	2035/03/20	50,000	61,902
152 20年国債	1.2000	2035/03/20	272,000	299,776
153 20年国債	1.3000	2035/06/20	220,000	245,152
20 30年国債	2.5000	2035/09/20	110,000	139,428
154 20年国債	1.2000	2035/09/20	110,000	121,129

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額
	%		千円	千円
21 30年国債	2.3000	2035/12/20	71,000	88,301
155 20年国債	1.0000	2035/12/20	99,000	106,409
22 30年国債	2.5000	2036/03/20	150,000	190,707
156 20年国債	0.4000	2036/03/20	176,000	174,980
157 20年国債	0.2000	2036/06/20	165,000	159,195
24 30年国債	2.5000	2036/09/20	197,000	251,492
158 20年国債	0.5000	2036/09/20	120,000	120,397
159 20年国債	0.6000	2036/12/20	152,000	154,245
26 30年国債	2.4000	2037/03/20	150,000	189,882
160 20年国債	0.7000	2037/03/20	120,000	123,187
161 20年国債	0.6000	2037/06/20	100,000	100,965
27 30年国債	2.5000	2037/09/20	190,000	243,625
162 20年国債	0.6000	2037/09/20	75,000	75,523
163 20年国債	0.6000	2037/12/20	50,000	50,247
28 30年国債	2.5000	2038/03/20	213,000	273,952
164 20年国債	0.5000	2038/03/20	115,000	113,599
165 20年国債	0.5000	2038/06/20	90,000	88,695
29 30年国債	2.4000	2038/09/20	250,000	318,527
166 20年国債	0.7000	2038/09/20	70,000	70,924
167 20年国債	0.5000	2038/12/20	105,000	102,820
30 30年国債	2.3000	2039/03/20	180,000	226,605
168 20年国債	0.4000	2039/03/20	50,000	48,016
169 20年国債	0.3000	2039/06/20	158,000	148,682
31 30年国債	2.2000	2039/09/20	147,000	182,826
170 20年国債	0.3000	2039/09/20	120,000	112,484
32 30年国債	2.3000	2040/03/20	228,000	287,496
172 20年国債	0.4000	2040/03/20	50,000	47,349
173 20年国債	0.4000	2040/06/20	138,000	130,281
33 30年国債	2.0000	2040/09/20	232,000	281,202
174 20年国債	0.4000	2040/09/20	91,000	85,642
175 20年国債	0.5000	2040/12/20	40,000	38,230
34 30年国債	2.2000	2041/03/20	255,000	317,768
176 20年国債	0.5000	2041/03/20	160,000	152,340
177 20年国債	0.4000	2041/06/20	117,000	109,054
35 30年国債	2.0000	2041/09/20	150,000	181,978
178 20年国債	0.5000	2041/09/20	80,000	75,766
179 20年国債	0.5000	2041/12/20	120,000	113,388
36 30年国債	2.0000	2042/03/20	220,000	267,278
180 20年国債	0.8000	2042/03/20	110,000	109,720
181 20年国債	0.9000	2042/06/20	60,000	60,820
37 30年国債	1.9000	2042/09/20	140,000	167,573
38 30年国債	1.8000	2043/03/20	30,000	35,342
39 30年国債	1.9000	2043/06/20	121,000	144,812
40 30年国債	1.8000	2043/09/20	118,000	138,952
41 30年国債	1.7000	2043/12/20	91,000	105,375
42 30年国債	1.7000	2044/03/20	101,000	116,897
43 30年国債	1.7000	2044/06/20	55,000	63,624
44 30年国債	1.7000	2044/09/20	125,000	144,521
45 30年国債	1.5000	2044/12/20	114,000	127,096
46 30年国債	1.5000	2045/03/20	130,000	144,799
47 30年国債	1.6000	2045/06/20	157,000	177,849
48 30年国債	1.4000	2045/09/20	95,000	103,597

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額
	%		千円	千円
49 30年国債	1.4000	2045/12/20	189,000	205,860
50 30年国債	0.8000	2046/03/20	49,000	47,126
51 30年国債	0.3000	2046/06/20	84,000	71,629
52 30年国債	0.5000	2046/09/20	41,000	36,587
53 30年国債	0.6000	2046/12/20	81,000	73,781
54 30年国債	0.8000	2047/03/20	109,000	103,769
55 30年国債	0.8000	2047/06/20	162,000	153,857
56 30年国債	0.8000	2047/09/20	153,000	144,817
57 30年国債	0.8000	2047/12/20	65,000	61,374
1 40年国債	2.4000	2048/03/20	17,000	22,080
58 30年国債	0.8000	2048/03/20	130,000	122,324
59 30年国債	0.7000	2048/06/20	145,000	132,780
60 30年国債	0.9000	2048/09/20	116,000	111,177
61 30年国債	0.7000	2048/12/20	90,000	81,884
62 30年国債	0.5000	2049/03/20	162,000	139,397
63 30年国債	0.4000	2049/06/20	154,000	128,437
64 30年国債	0.4000	2049/09/20	118,000	97,976
65 30年国債	0.4000	2049/12/20	177,000	147,058
3 40年国債	2.2000	2050/03/20	50,000	62,784
66 30年国債	0.4000	2050/03/20	67,000	55,647
67 30年国債	0.6000	2050/06/20	100,000	87,011
68 30年国債	0.6000	2050/09/20	93,000	80,754
69 30年国債	0.7000	2050/12/20	125,000	111,413
4 40年国債	2.2000	2051/03/20	61,000	76,440
70 30年国債	0.7000	2051/03/20	52,000	46,164
71 30年国債	0.7000	2051/06/20	126,000	111,649
72 30年国債	0.7000	2051/09/20	46,000	40,683
73 30年国債	0.7000	2051/12/20	80,000	70,696
5 40年国債	2.0000	2052/03/20	48,000	57,846
74 30年国債	1.0000	2052/03/20	140,000	133,733
75 30年国債	1.3000	2052/06/20	20,000	20,507
6 40年国債	1.9000	2053/03/20	5,000	5,889
7 40年国債	1.7000	2054/03/20	60,000	67,731
8 40年国債	1.4000	2055/03/20	101,000	106,108
9 40年国債	0.4000	2056/03/20	152,000	117,920
10 40年国債	0.9000	2057/03/20	158,000	144,111
11 40年国債	0.8000	2058/03/20	130,000	114,450
12 40年国債	0.5000	2059/03/20	162,000	127,780
13 40年国債	0.5000	2060/03/20	108,000	84,775
14 40年国債	0.7000	2061/03/20	265,000	222,395
小 計	-	-	33,730,000	35,023,886
(地方債証券)				
113 共同発行地方	0.7700	2022/08/25	100,000	100,048
29-10 愛知県5年	0.0200	2022/10/17	100,000	100,010
24-18 兵庫県公債	0.7700	2022/10/19	100,000	100,168
24-6 埼玉県公債	0.8010	2022/10/26	100,000	100,188
24-1 新潟市公債	0.7000	2022/12/21	50,000	50,138
718 東京都公債	0.6000	2023/03/20	30,000	30,119
121 共同発行地方	0.5700	2023/04/25	20,000	20,088
25-2 広島県公債	0.9200	2023/07/25	100,000	100,930
25-1 岐阜県公債	0.8100	2023/09/29	100,000	100,957
25-2 福井県公債	0.6800	2023/10/25	20,000	20,169

銘	柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額
		%		千円	千円
25-9 札幌市公債		0.6800	2023/12/20	20,000	20,189
132 共同発行地方		0.6600	2024/03/25	100,000	101,048
2 名古屋市20年		2.5600	2024/06/20	50,000	52,376
135 共同発行地方		0.6590	2024/06/25	100,000	101,178
26-8 埼玉県公債		0.3350	2025/01/28	100,000	100,753
2-1 北九州市5年		0.0200	2025/09/30	30,000	29,989
225 神奈川県公債		0.2350	2026/12/18	70,000	70,540
11 東京都20年		2.2200	2027/03/19	100,000	109,982
181 共同発行地方		0.1800	2028/04/25	100,000	100,455
91 川崎市公債		0.1850	2028/09/20	100,000	100,383
30-5 横浜市公債		0.2690	2028/11/15	100,000	100,873
16 東京都20年		2.0100	2028/12/20	100,000	111,937
30-5 千葉県公債		0.2100	2028/12/25	100,000	100,473
小	計	-	-	1,790,000	1,823,002
(特殊債券(除く金融債券))					
39政保地方公共団		0.8010	2022/08/15	15,000	15,004
19 政保政策投資C		0.6680	2023/03/15	30,000	30,140
57 鉄道建設・運		0.8350	2023/06/20	20,000	20,144
4政保地方公共8年		0.3110	2023/07/28	100,000	100,402
51政保地方公共団		0.8350	2023/08/14	100,000	100,960
26 住宅支援機構		2.1100	2023/12/20	100,000	102,855
87 日本政策金融		0.0010	2024/03/11	100,000	99,910
225 政保道路機構		0.5560	2024/08/30	100,000	101,257
38 道路債券		2.2600	2024/09/20	100,000	104,664
10 公営企業20年		2.2100	2024/09/24	100,000	104,566
229 政保道路機構		0.5390	2024/10/31	20,000	20,264
42 道路債券		2.2200	2025/03/21	50,000	52,819
13 公営企業20年		2.1600	2025/06/20	150,000	158,971
28 地方公共団5年		0.0200	2025/11/28	100,000	99,775
187 住宅支援機構		0.0900	2026/04/20	100,000	99,982
9 農林漁業		2.6600	2026/06/19	100,000	109,905
96 地方公共団体		0.2050	2027/05/28	30,000	30,086
112 鉄道建設・運		0.2600	2028/02/25	100,000	100,505
135 住宅機構R M B S		0.3900	2053/08/10	81,541	80,301
163 住宅機構R M B S		0.3500	2055/12/10	93,619	91,709
168 住宅機構R M B S		0.4000	2056/05/10	95,149	93,740
170 住宅機構R M B S		0.3600	2056/07/10	96,080	94,264
182 住宅機構R M B S		0.5000	2057/07/10	100,000	99,210
小	計	-	-	1,881,389	1,911,442
(金融債券)					
354 信中金		0.0500	2024/05/27	100,000	100,039
小	計	-	-	100,000	100,039
(普通社債券)					
76 三井不動産		0.2100	2023/04/28	100,000	100,142
16 成田国際空港		0.5700	2024/10/28	100,000	101,054
29 西日本高速道		0.3100	2026/02/12	100,000	100,661
19 三井住友T B		0.1400	2026/04/28	100,000	99,721
38 三菱重工業		0.0900	2026/09/01	100,000	99,281
1 日本酸素H D		0.1100	2026/10/14	100,000	98,966
25 B P C E S . A .		0.3020	2026/12/16	100,000	98,343
13 西日本旅客鉄		2.3400	2027/02/19	100,000	109,660
17 アサヒグループH D		0.2900	2027/06/01	100,000	100,138

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額
	%		千円	千円
14 クボタ	0.3000	2027/06/02	100,000	100,023
75 ホンダファイナンス	0.3000	2027/06/18	100,000	100,337
6 TDK	0.3100	2027/07/28	100,000	99,628
25 ニチレイ	0.2400	2027/08/31	100,000	99,699
17 オリエンタルランド	0.2000	2027/09/17	100,000	99,625
400 中国電力	0.3400	2027/09/24	10,000	9,936
15 セブンアンドアイ	0.2800	2027/12/20	100,000	99,777
17 NTTファイナンス	0.2800	2027/12/20	100,000	99,936
34 東京センチュリー	0.2200	2028/07/21	100,000	98,100
43 東洋紡	0.2500	2028/12/07	100,000	98,814
73 三井物産	0.2900	2029/07/11	100,000	99,431
41 京王電鉄	0.3700	2030/05/24	100,000	100,094
65 東京瓦斯	0.2250	2030/09/10	100,000	98,812
140 三菱地所	0.6440	2032/07/22	100,000	100,263
小 計	—	—	2,210,000	2,212,451
合 計	—	—	39,711,389	41,070,823

(注) 額面金額、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

2022年8月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 41,070,823	% 96.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,447,363	3.4
投 資 信 託 財 産 総 額	42,518,186	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8月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	42,518,186,680円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	54,829,494
公 社 債(評価額)	41,070,823,310
未 収 入 金	1,315,095,110
未 収 利 息	73,549,189
前 払 費 用	3,889,577
(B) 負 債	1,340,179,165
未 払 解 約 金	1,340,179,165
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	41,178,007,515
元 本	37,861,785,573
次 期 繰 越 損 益 金	3,316,221,942
(D) 受 益 権 総 口 数	37,861,785,573口
1万口当り基準価額(C/D)	10,876円

<注記事項>

期首元本額	37,182,206,949円
期中追加設定元本額	32,302,452,631円
期中一部解約元本額	31,622,874,007円

期末における元本の内訳

iシェアーズ 国内債券インデックス・ファンド	620,227,974円
国内債券インデックス・ファンド(適格機関投資家限定)	9,076,128,406円
ブラックロック・インデックス投資戦略ファンド	101,384,109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)	2,470,897,950円
ブラックロックLifePathファンド2055	328,053,849円
ブラックロックLifePathファンド2045	818,106,360円
ブラックロックLifePathファンド2035	3,280,071,141円
G T A A セレクト・ベガ(適格機関投資家限定)	944,564,454円
G T A A セレクト・ベガ 2019-03(適格機関投資家限定)	809,747,041円
G T A A セレクト・ベガ 2020-06(適格機関投資家限定)	1,065,414,059円
ブラックロック・つみたて・グローバルバランスファンド	6,420,420,209円
ブラックロックLifePathファンド2030	3,547,383,185円
ブラックロックLifePathファンド2040	1,664,830,652円
ブラックロックLifePathファンド2050	316,431,401円
マルチ・アセット投資戦略ファンド(年1回決算型/適格機関投資家限定)	3,649,512,045円
ブラックロックLifePathファンド2025	1,848,151,550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)	727,258,881円
ブラックロックLifePathファンド2060	45,880,861円
ブラックロックLifePathファンド2065	127,321,446円
合計	37,861,785,573円

■損益の状況

自2021年8月3日 至2022年8月2日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	290,822,970円
受 取 利 息	290,822,970
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,649,627,504
売 買 益	62,200,930
売 買 損	△1,711,828,434
(C) そ の 他 費 用	△ 393,599
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,359,198,133
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	4,311,582,276
(F) 解 約 差 損 益 金	△2,890,592,985
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,254,430,784
(H) 合 計(D+E+F+G)	3,316,221,942
次 期 繰 越 損 益 金(H)	3,316,221,942

- (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。