

データ時点 (運用実績、ポートフォリオ内訳、純資産、配当利回り) : 2024年11月30日。

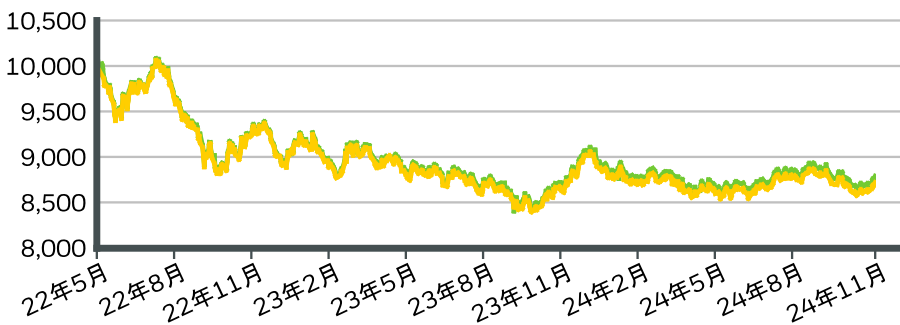
投資目的

iシェアーズ 気候リスク調整世界国債 ETF (除く日本・為替ヘッジあり) は、FTSEアドバンスド気候リスク調整世界国債インデックス (除く日本、国内投信用、円ヘッジ・円ベース) への連動を目指すETF (上場投資信託) です。FTSEアドバンスド気候リスク調整世界国債インデックス (除く日本、国内投信用、円ヘッジ・円ベース) は代表的な債券指数であるWGBI (FTSE世界国債インデックス) をベースに、各国の気候変動に関する3つの指標 (物理的リスク、移行リスク、耐性) に基づく評価により指数ウェイトが調整された債券インデックスです。為替の変動リスクを回避するために、為替ヘッジが行われています。

3つのポイント

- 環境への対応が進んだ、気候変動リスク体制に優れた世界の国債に投資しながら各国の通貨と円のための為替変動リスクの低減を図ることができ、分散投資および長期的な資産形成を目指すために活用できます。
- 東京証券取引所 (東証) に上場している円建ての日本を除く世界国債ファンドで、日本株と同じように日本時間で取引できます。
- NISAにおける「成長投資枠」の対象ファンドとして投資ができます。

設定来のパフォーマンス推移



上記のパフォーマンス推移は、ファンドに1万円投資し、分配金 (税引前) を当該ファンドに再投資したと仮定して算出したものです。ファンドの費用 (管理報酬およびその他の費用) は控除後です。上記のパフォーマンス推移は過去のものであり、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

運用実績 (%)

	累積リターン					年率リターン		
	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	年初来	1年	3年	5年	設定来
ファンド	1.05	-0.22	2.14	-3.15	0.22	-	-	-4.99
インデックス	1.03	-0.30	1.95	-3.37	-0.10	-	-	-5.29

暦年の実績

	2019	2020	2021	2022	2023
ファンド	-	-	-	-	1.31
ベンチマーク	-	-	-	-	1.03

上記のファンドのパフォーマンスに関する情報は、税引前分配金を再投資されることを前提に算出したものです。ファンドの保有にかかる費用 (信託報酬およびその他の費用) については、費用控除後の実績を表示しております。「累積リターン」は対象期間の基準価格の変化率です。「年率リターン」は対象期間の基準価格の変化率を複利計算により1年あたりの率に換算しています。上記の運用実績は過去のものであり、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。また当ファンドの基準価額の騰落率と連動指数の騰落率の間に乖離が発生することがあります。

当ETFの連動対象となるiシェアーズ 気候リスク調整世界国債 ETF (除く日本・為替ヘッジあり) は、全構成銘柄の組み入れにおいてESG (環境・社会・ガバナンス) を主要な要素として考慮しております。当指数は、気候変動に関する3つの指標 (物理的リスク、移行リスク、耐性) の観点からウェイト付けされた銘柄のパフォーマンスを表すように設計されています。当指数の気候変動に関する指標に関連するデータ・指標は指数プロバイダーのURL <https://www.ftserussell.com/products/indices/climate-wgbi> のIndex Resources下のFTSE Advanced Climate Risk-Adjusted World Government Bond Index ex Japan Sustainable Investment Metrics Reportのリンク先データをご参照ください。なお当指数はこれらのデータ・指標の達成を目標等として設計されているものではありません。

ファンドの詳細

アセットクラス: 債券

連動対象指数: FTSEアドバンスド気候リスク調整世界国債インデックス (除く日本、国内投信用、円ヘッジ・円ベース)

設定日: 2022年05月24日

基準通貨: JPY

分配頻度: 年4回

ファンドの純資産 (M): 2,947.67 JPY

ファンド籍: 日本

ISIN: JP3049600004

SEDOL: BPW61Y1

売買単位: 10

発行済口数: 4,401,240

取引所: 東京証券取引所

NISA対象: NISA 成長投資枠対象

※2022年5月24日から2024年5月24日までの期間は、年0.11% (税抜0.10%) の報酬が適用されます。2024年5月25日以降は、年0.132% (税抜0.12%) の報酬が適用されます。なお、委託会社および受託会社の判断で当該料率の変更、また適用される期間を変更することができます。

※運用管理費用 (信託報酬) 等に関する詳細は、3ページ「当ファンドにかかる手数料・費用等について」をご確認ください。

※保有銘柄数はフォワードおよび先物を含みません。

連動対象指数について

FTSEアドバンスド気候リスク調整世界国債インデックス (除く日本、国内投信用、円ヘッジ・円ベース) は、代表的な債券指数であるWGBI (FTSE世界国債インデックス) をベースに、各国の気候変動に関する3つの指標 (物理的リスク、移行リスク、耐性) に基づく評価により指数ウェイトが調整された債券インデックスです。為替の変動リスクを回避するために、為替ヘッジが行われています。

費用

信託報酬 (税抜) : 0.1000%

信託報酬 (税込) : 0.1100%

ポートフォリオ特性

加重平均残存期間 (年) : 9.45年

平均利回り : 3.13%

実効デュレーション : 7.25年

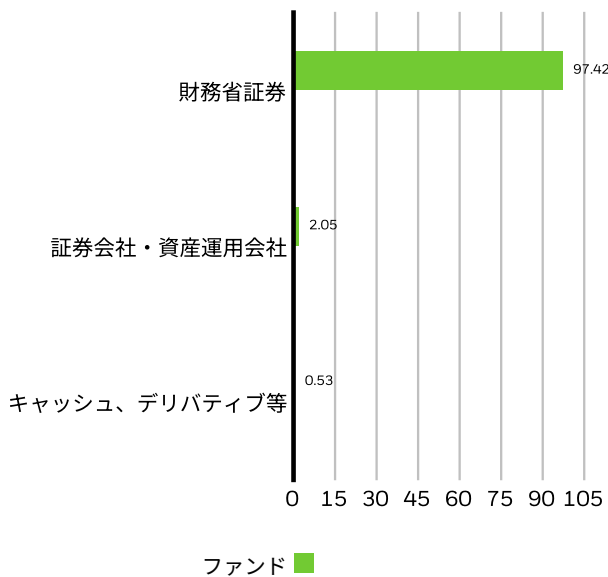
保有銘柄数 : 548

iシェアーズ 気候リスク調整世界国債 ETF (除く日本・為替ヘッジあり)

上位発行体

UNITED STATES TREASURY	18.52%
UK CONV GILT	16.55%
ITALY (REPUBLIC OF)	15.01%
FRANCE (REPUBLIC OF)	14.01%
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF)	12.95%
SPAIN (KINGDOM OF)	11.45%
ISHARES CHINA GOVERNMENT BON CL1	2.05%
AUSTRIA (REPUBLIC OF)	1.32%
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN AND NORTHERN IRELAND (GOVERNMENT)	1.20%
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GOVERNMENT)	0.84%
	93.90%

業種別投資内訳 (%)



※GICS業種分類

※上記は当ファンドが投資対象とする外国籍ETFの資産構成を参考情報として表示しており、上記は当ファンドで直接保有する証券の資産構成を示すものではありません。

※上記の構成比は記載時点のものであり、現在または将来の構成比を必ずしも表すものではありません。なお、当社内のデータを用いて「業種別投資内訳(%)」を表示しております。

分配金実績

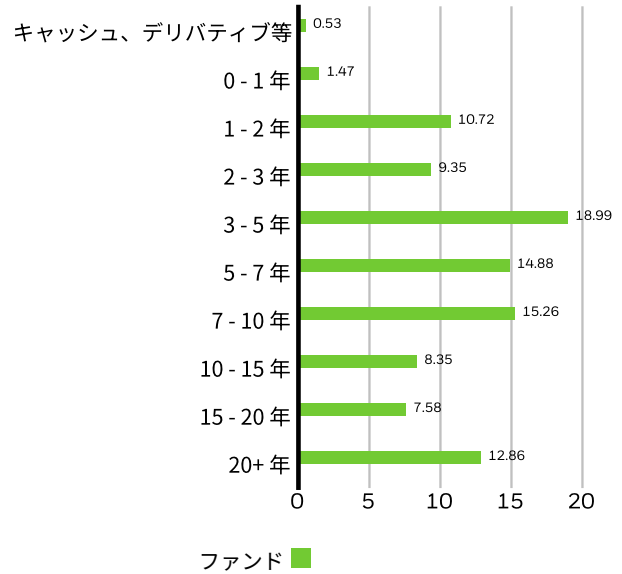
決算日	分配金単価 (円)
2024/10/11	3.8000 JPY
2024/07/11	4.0000 JPY
2024/04/11	3.8000 JPY
2024/01/11	3.6000 JPY
2023/10/11	3.5000 JPY

※ 分配金は税引き前、1口当たり。

※ 収益の分配は、原則として、毎決算時に、信託財産 から生ずる配当等収益の合計額から経費を控除した額の全額を分配します。ただし、その一部または全部を分配準備積立金として、次期以降の分配に充当することができます。

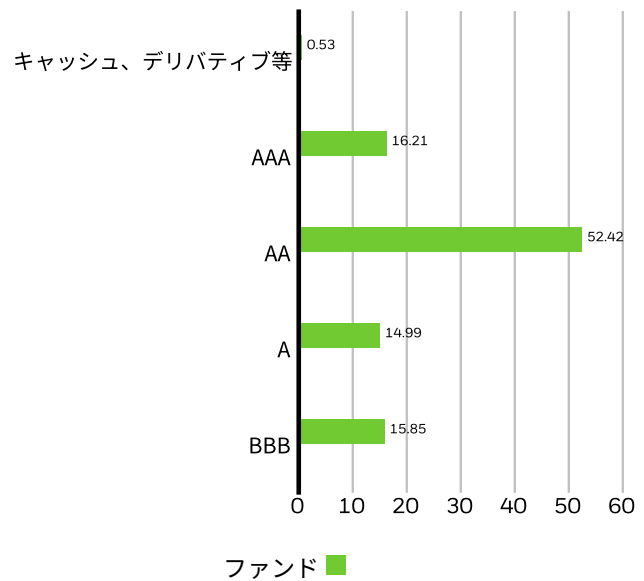
※ 将来の分配金の支払いおよびその金額については保証するものではありません。

残存期間別投資内訳 (%)



※上記は記載時点のものであり、現在または将来の構成比を必ずしも表すものではありません。
※当社内のデータを用いて「残存期間別投資内訳(%)」を表示しております。

信用格付け (%)



※上記は記載時点のものであり、現在または将来の構成比を必ずしも表すものではありません。
※格付けは、S&P、ムーディーズ、フィッチの各格付け機関のレーティングを平均し、S&Pの格付けに準拠して表記しております。(AAA (最高) からD (最低)) 格付け機関3社すべてによる格付けが取得できる場合はその中央値、格付け機関2社による格付けが取得できる場合は低い方を採用、取得できる格付けが1社のみ場合はその1社の格付けを採用します。

※当社内のデータを用いて「信用格付け(%)」を表示しております。

iシェアーズ 気候リスク調整世界国債 ETF (除く日本・為替ヘッジあり)



サステナビリティ特性

サステナビリティ特性は、投資家が非財務情報を投資プロセスに組み入れる際に役立つ指標であり、これにより、環境、社会、およびガバナンス (ESG) のリスクと機会に基づいたファンドの評価に資する情報です。この特性分析は、ファンドの効果的な運用と長期的な財務の見通しについての情報を提供することを目的としています。

以下の指標は、透明性の確保と情報提供のみを目的とするものです。当ESGレーティングは、ESG要因のファンドへの組み入れの有無、また組み入れの方法を示すものではありません。当指標はMSCI ESGファンドレーティングに基づいて提供されるものであり、ファンドの目論見書に投資目的に関わる記載が別途ある場合を除き、ファンドの投資目的を変更、またはファンドの投資対象を制限するものではありません。また、ファンドがESGやインパクトに焦点を当てた投資戦略やスクリーニングを行うことを示唆するものではありません。ファンドの投資戦略の詳細については、ファンドの目論見書を参照してください。

MSCI ESGファンドレーティング (AAA~CCC)	A	MSCI ESGカバー率 (%)	100.00%
MSCI ESGクオリティスコア (0~10)	6.25	MSCI ESGクオリティスコア - ピア比較パーセンタイル値	55.86%
リッパー・グローバル分類	Bond Global JPY	ピアグループ内ファンド	145
MSCI加重平均炭素排出原単位 排出量 (単位: トン) /売上高 (単位: 百)	-	MSCI加重平均炭素原単位カバレッジ (%)	0.00%

すべてのデータは、**2024年07月31日** の保有状況に基づき、**2024年11月21日** のMSCI ESGファンドレーティングから取得したものです。したがって、ファンドのサステナビリティ特性は、直近のMSCI ESGファンドレーティングとは異なる場合があります。

MSCI ESGファンドレーティングは、ファンドの65%以上 (グロス・ウェイトによる算出、なお債券ファンドとマネーマーケットファンドの場合には50%以上) の保有銘柄がMSCI ESGリサーチの対象となっているファンドに付与されます (MSCIによるESG分析に関係しないと見なされる現金ポジションやその他の資産は、リサーチ対象銘柄のグロス・ウェイトを算出する際に控除されます。ショートポジションの絶対値は算出に含まれますが、リサーチの対象外として扱われます。) また、銘柄の保有状況は1年以内の基準日のものとし、ファンドには10銘柄以上が必要です。

重要な情報:

ここに記載する情報 (以下「本情報」) は、1940年投資顧問法に基づくRIAであるMSCI ESG Research LLCが提供するものであり、その関連会社 (MSCI Inc.とその子会社 (以下「MSCI」) を含む)、または第三者 (以下「情報提供者」) から入手したデータを含むことがあり、その全部または一部を書面による事前の許可なしに複製または再配布することは禁止されています。本情報は、米国証券取引委員会 (SEC) またはその他の規制当局に提出されたもの、もしくは承認を受けたものではありません。本情報は、派生商品の作成またはそれに類する目的で使用することはできません。また本情報は、いかなる有価証券、金融商品および商品、または取引戦略の売買提供、勧誘または推奨を行うものではなく、将来的な業績、分析、予測または予想を示唆または保証するものではありません。ファンドによってはMSCI指数をベースとするもの、もしくはMSCI指数に連動するものがあり、MSCIはファンドの運用資産残高やその他の指標に基づいて報酬を得ることがあります。MSCIは、株価指数調査と本情報の間に情報共有の制限を設けています。本情報を使用して、売買する有価証券または有価証券を売買するタイミングを判断することはできません。本情報は「現状のまま」提供されており、本情報の利用者は本情報の利用に際して発生するもしくは発生しうるあらゆるリスクを負うものとします。MSCI ESGリサーチおよび情報提供を行う当事者は、明示的か黙示的であるかを問わず、あらゆる保証を明示的に否認します。また、本情報の誤りや脱落またはそれらに関連する損害について責任を負いません。上記は、適用法で除外または制限できない責任を除外しようとするものではありません。

用語集

MSCI ESGファンドレーティング(AAA~CCC): MSCI ESGレーティングは、ESGクオリティスコアを格付けに直接マッピングしています。(例: AAA = 8.6-10)。ESGレーティングの範囲は上位(AAA、AA)、平均(A、BBB、BB)から下位(B、CCC)までです。

MSCI ESGクオリティスコア (0~10): ファンドのMSCI ESGクオリティスコア (0~10) は、保有銘柄のESGレーティングを加重平均し算出されます。このスコアでは、保有銘柄のESGレーティングの動向やESGレーティングの低い企業に対するファンドのエクスポージャーも考慮されます。MSCIは、35項目にわたる業種固有の ESG リスクへのエクスポージャーならびに同業他社と比較してそれらのリスクを管理する能力に応じて発行体の格付けを行います。

リッパー・グローバル分類: リッパー・グローバル分類で定義されるファンドのピアグループを示します。

MSCI加重平均炭素排出原単位 カーボン排出量 (単位: トン) /売上高 (単位: 百万米ドル): MSCI加重平均炭素排出原単位は、炭素排出強度の高い企業へのファンドのエクスポージャーを測定するもので、ファンドの保有銘柄における売上高100万米ドルあたりの温室効果ガス排出量の推定値を示します。これにより規模の異なるファンド間での比較が可能になります。

実行デュレーション: 実行デュレーションはファンドの利回り感度を測定します。簡単に言うと、ファンドのデュレーションが長いほど、ファンドの利率変動は敏感です。デュレーションが 10 年のファンドは、5年のファンドよりも2倍のボラティリティです。

MSCI ESGカバー比率 (%) : MSCI ESG格付けデータが利用可能なファンドの保有比率を表します。MSCI ESGファンド格付け、MSCI ESG クオリティスコア、MSCI ESGクオリティスコア、ピアパーセンタイルの指標は、65%以上のカバレッジを持つファンドについて表示されます。

MSCI ESGクオリティスコア - ピア比較パーセンタイル値: リッパー・グローバル分類で定義されるピアグループ内で比較した際のファンドのESGパーセンタイル値を示します。

ピアグループ内ファンド: リッパー・グローバル分類で定義されるピアグループに含まれるファンドであり、ESGデータの対象となるものの数を示します。

MSCI加重平均炭素強度カバー率 (%) : ファンドの保有銘柄のうち、炭素排出原単位データがMSCIより入手可能な銘柄の割合を示します。MSCI加重平均炭素強度指標は、カバー率が0%ではないすべてのファンドについて表示されます。そのため、カバー率が低いファンドにおいては、ファンドの炭素排出に関する特性が十分に提供されていない場合があります。

満期利回り: 満期利回り(YTM)は、債券のキャッシュフローの現在価値を市場価格(未収利息を含む)と等しくする割引率です。ファンドYTMは、純資産価値(「NAV」)に基づくファンドの個々の債券保有YTMの加重平均です。この措置には、手数料や費用は含まれていません。償還可能な債券の場合、YTMはYield-to-Worstです。

重要な情報：

他のデータ時点 2024年12月08日.

当ファンドにかかる手数料・費用等について

売買時の手数料（取引所で売買する場合）

当ファンドを売買する際の手数は取扱い金融商品取引業者（証券会社）等によって定められます。詳しくは取扱い金融商品取引業者までお問い合わせください。

購入時手数料（指定参加者で一定口数以上の取得申込を行う場合）

指定参加者が定める申込手数料（消費税等相当額を含む。）を投資者から徴収することができるものとします。詳しくは、指定参加者にお問い合わせください。

換金（買取）時手数料（指定参加者で一定口数以上の交換請求等を行う場合）

指定参加者は、投資者が換金を行なうときおよび受益権の買取りを請求するときは、当該投資者から、指定参加者が独自に定める手数料（消費税等相当額を含む。）を投資者から徴収することができるものとします。詳細は、指定参加者にお問い合わせください。

運用管理費用（信託報酬）

ファンドの純資産総額に対して年0.132%（税抜 0.12%）の率を乗じて得た額。運用管理費用（信託報酬）は毎計算期末、または信託終了のときファンドから支払われます。2022年5月24日から2024年5月24日までの期間は、ファンドの純資産総額に対して年0.11%（税抜0.10%）以内の率を乗じて得た額。なお、委託会社および受託会社の判断で当該料率の変更、また適用される期間を変更することができます。

その他の費用・手数料

上場に係る費用、対象指数の商標の使用料についてファンドの純資産総額の年0.0297%（税抜0.027%）を上限として、日々計上され、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払うことができます。ファンドの諸経費、売買委託手数料、外貨建資産の保管費用等は、その都度もしくは日々計上され、その都度もしくは毎計算期末または信託終了のとき、ファンドから支払われます。有価証券の貸付を行なった場合はその都度、信託財産の収益となる品賃料の2分の1相当額以内が報酬としてファンドから運用の委託先等に支払われます。

※詳しくは、投資信託説明書（交付目論見書）に記載の「ファンドの費用・税金」をご覧ください。

当ファンドにかかる主なリスクについて

基準価額の変動要因

ファンドの基準価額は、組入れられている有価証券の値動きの他、為替変動による影響を受けます。これらの信託財産の運用により生じた損益はすべて投資者の皆様へ帰属します。したがって、当ファンドは元金および元金からの収益の確保が保証されているものではなく、基準価額の下落により投資者は損失を被り、元金を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。当ファンドに係る主なリスクは以下のとおりです。

金利変動リスク

日本を除く世界の国債等に投資します。債券の価格は、政治、経済、社会情勢等の影響により金利が上昇すれば下落し、金利が低下すれば上昇します。したがって、金利の変動が当ファンドの運用成果に影響を与えます。

信用リスク

日本を除く世界の国債等に投資します。投資した債券の発行体の財務状況により、債務不履行が生じることがあります。債務不履行が生じた場合には、債券価格が下落する等、当ファンドの運用成果に影響を与えます。また、債券の格付の変更により債券の価格が変動することがあり、それに伴い、当ファンドの運用成果に影響を与えます。

為替変動リスク

外貨建て資産に投資します。為替変動リスクの低減を図ることを目指し、原則として外貨建て資産に対して為替ヘッジを行います。為替変動による影響のすべてを回避することはできません。また、ヘッジ対象通貨の金利が円金利より高い場合、ヘッジ・コストがかかります。カントリー・リスク

日本を除く世界の国債等に投資します。投資先の国の政治・経済事情、通貨・資本規制等の要因により、債券の価格が変動することがあり、それに伴い当ファンドの運用成果に影響を与えます。

デリバティブ取引のリスク

デリバティブ取引を用いることができます。このような投資手法は現物資産への投資に代わって運用の効率を高めるため、または証券価格、市場金利、為替等の変動による影響からファンドを守るために用いられます。デリバティブ取引を用いた結果、コストとリスクが伴い、当ファンドの運用成果に影響を与えます。また、デリバティブ取引は必ず用いられるわけではなく、用いられたとしても本来の目的を達成できる保証はありません。

有価証券の貸付等におけるリスク

有価証券の貸付等において、取引先リスク（取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる危険のこと）が生じる可能性があり、損失を被ることがあります。

市場価格と基準価額の乖離要因

取引所での市場価格は取引時間中に変動するものであり、取引所における需給のバランスや売買高の状況、各種取引規制、投資対象市場と取引市場の時差または取引日の相違等の影響を受けることにより、ETFの市場価格は基準価額から乖離することがあります。

※詳しくは、投資信託説明書（交付目論見書）に記載の「投資リスク」をご覧ください。

「FTSEアドバンスト気候リスク調整世界国債インデックス（除く日本、国内投信用、円ヘッジ・円ベース）」の著作権等について

FTSEアドバンスト気候リスク調整世界国債インデックス（除く日本、国内投信用、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

©2024 BlackRock Japan Co., Ltd. All Rights Reserved. iShares®（iシェアーズ®）およびBlackRock®（ブラックロック®）はブラックロック・インクおよび米国その他の地域におけるその子会社の登録商標です。他のすべての商標、サービスマーク、または登録商標はそれぞれの所有者に帰属します。

ブラックロック・ジャパン株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第375号

加入協会：一般社団法人 日本投資顧問業協会／一般社団法人 投資信託協会／

日本証券業協会／一般社団法人 第二種金融商品取引業協会