

平成 27 年 4 月 24 日

各 位

外国投資法人名 iシェアーズ III パブリック・リミテッド・カンパニー
代表者名 ディレクター
バリー・オドワイアー
管理会社名 ブラックロック・アセット・マネジメント・アイルランド・リミテッド
(管理会社コード 13614)
代表者名 ディレクター
バリー・オドワイアー
問合せ先 (代理人) 西村あさひ法律事務所
弁護士 濃川 耕平
(TEL. 03-5562-8500)

第 1 期（平成 26 年 11 月 17 日～平成 27 年 1 月 31 日）信託財産状況報告書

ブラックロック・アセット・マネジメント・アイルランド・リミテッドを管理会社に、iシェアーズ III パブリック・リミテッド・カンパニーを外国投資法人として上場する以下のETF銘柄について、信託財産状況報告書を開示致します。

上場ETF 銘柄 (1 銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	iシェアーズ 新興国債券ETF (バークレイズLocal EM国債コア)	1362	東

※注

本報告書は、信託業法第 27 条第 1 項の規定に基づき、受託者たる三菱 UFJ 信託銀行株式会社が作成し、東京証券取引所の有価証券上場規程に定める上場外国指標連動証券信託受益証券の管理会社が開示致します。

i シェアーズ 新興国債券 ETF 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 1 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「i シェアーズ 新興国債券 ETF (パークレイズ Local EM 国債コア)」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2015 年 1 月 31 日現在	
2014 年 11 月 17 日～2015 年 1 月 31 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	i シェアーズ 新興国債券 ETF (パークレイズ Local EM 国債コア)
銘柄コード	1362
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	メリルリンチ日本証券株式会社、野村證券株式会社、シティグループ証券株式会社
受託者	三菱UFJ 信託銀行株式会社、日本マスタートラスト信託銀行株式会社
信託財産	本信託財産は、パークレイズ新興市場自国通貨建てコア国債インデックス (以下、「本対象指数」といいます。) に連動する ETF (以下、「受託有価証券」といいます。) およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカスタディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される受益権の一口あたりの純資産総額は、仕組みとして本対象指数に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として年二回の分配を行う予定です。

■信託財産を構成する資産の内容

1、外国投資信託受益証券

資産の種類	外国投資信託受益証券
資産の名称	i シェアーズ 新興国債券 ETF (パークレイズ Local EM 国債コア)
純資産総額	225,738,850,729 円 (2015 年 1 月 31 日時点) (注 1)
一証券あたりの純資産額	8,624 円 (2015 年 1 月 31 日時点)
価額の算出方法および外国投資信託受益証券に係る権利を有する者への報告の頻度および方法	当該外国投資信託受益証券の価額は、保有資産等が評価時点で取引されていた取引所又は市場の最後に発表された公式の終値または最終取引価格を使用して決定されます。純資産残高および一口あた

	り総資産残高が運用者のウェブサイト (http://www.ishares.com/uk/individual/en/products/251724/) で毎日公表されています。
ファンド資産の運用者、保管者およびその他重要な業務を行う者の名称、住所および役割（注2）	<ul style="list-style-type: none"> ・ Investment Company（投資法人） iShares III Public Limited Company J.P. Morgan House, International Financial Services Centre, Dublin 1, Ireland ・ Manager（運用者） BlackRock Asset Management Ireland Limited J.P. Morgan House, International Financial Services Centre, Dublin 1, Ireland ・ Investment Manager and Promoter（投資顧問） BlackRock Advisors (UK) Limited 12 Throgmorton Avenue, London EC2N 2DL, England ・ Administrator（アドミニストレーター） State Street Fund Services (Ireland) Limited 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Ireland ・ Custodian（カストディアン） State Street Custodial Services (Ireland) Limited 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Ireland ・ Registrar（登録機関） Computershare Investor Services (Ireland) Limited Heron House, Corrig Road, Sandyford Industrial Estate, Dublin 18, Ireland ・ Legal Advisors（法律顧問） William Fry Fitzwilton House, Wilton Place, Dublin 2, Ireland ・ Auditors and Reporting Accountant（監査法人） PricewaterhouseCoopers One Spencer Dock, North Wall Quay, Dublin 1, Ireland
受託者と上記関係者との間の資本関係および人的関係	該当事項はありません。
ファンド資産に関する外部監査を行う者の氏名・名称（注2）	PricewaterhouseCoopers
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注1：計算期間末日（2015年1月31日）時点における外国ETFの純資産総額を記載しております。

注2：「ファンド資産」とは、外国投資信託受益証券に係る権利を有する者から出資または拠出を受けた資産をいいます。

2、金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円（2015年1月31日現在）

※ 上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額（注1）
468,844,907円

注1：受託者の採用する価格に基づく本信託の決算期日末日時点の状況であり、東京証券取引所に日々開示された信託財産である外国ETFの一口あたりの純資産額に上場外国ETF信託受益証券の上場受益権口数を乗じたものとは必ずしも一致するものではありません。

■取引の状況（自2014年11月17日至2015年1月31日）

1、信託の設定、解約 （千円未満切捨て）

設定		解約	
口数（単位：口）	金額（単位：千円）	口数（単位：口）	金額（単位：千円）
54,800	501,408	-	-

2、利害関係人等との取引状況

信託財産から受領した外貨建て分配金は、三菱UFJ信託銀行との外国為替取引により円転し、受益者へ分配するまでの間、現金を日本マスタートラスト信託銀行株式会社の銀行勘定に預入しました。また、1円に受益権の総口数を乗じた金額および一口あたりの分配金額の計算上生じた1円未満の端数に相当する金銭の総額「分配金支払に係る手数料」ならびに、銀行勘定預入利息については、信託契約に基づき、受託者が受領しております。なお、分配金に係る手数料については、分配金支払いに係る送金手数料や計算書作成郵送等の実費に充当されます。

3、信託業務の委託の状況

信託業務（信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。）の第三者への委託は行っておりません。カストディー業務については、三菱UFJグローバルカストディー ルクセンブルグに委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末（2015年1月31日）現在
（単位：千円）

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	468,844
固定資産合計	468,844
資産合計	468,844
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	501,408
元本合計	501,408
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	

その他有価証券評価差額金	△32,563
評価・換算差額等合計	△32,563
元本等合計	468,844
負債・元本等合計	468,844

<損益計算書(※1)>

当計算期間(自 2014年11月17日 至 2015年1月31日)

(単位:千円)

経常収益	11,985
経常費用	11,985
経常利益	0
当期純利益	0
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

※1 本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

■外貨建て分配金の円転取引について

信託財産から受領した外貨建て分配金は、三菱UFJ信託銀行との外国為替取引により円転致しました。

金額(単位:US\$)	約定日	為替レート	金額(単位:円)
99,987.60	2015年1月13日	117.01	11,699,549

■信託財産の銀行勘定への運用について

円転した分配金を受益者へ分配するまでの間、現金を日本マスタートラスト信託銀行株式会社の銀行勘定にて運用致しました。

金額(単位:円)	期間	利息額合計(単位:円)
11,699,549	2015年1月15日~2015年1月20日	38
59,549	2015年1月21日~2015年1月26日	

■収益の分配の状況について

2014年12月19日を分配金の支払いに係る基準日とし、一口あたり240円の分配金を2015年2月2日より支払いました。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額(単位:円)
2014年11月30日	9,412
2014年12月31日	8,784
2015年1月31日	8,624