

iシェアーズ 日本株・Jリート ETF の連動対象指数変更および 外国株・外国リート ETF の連動対象指数名称変更について

iシェアーズ東証上場 ETF の連動対象指数についての変更を以下の通り2点予定しておりますので、お知らせいたします。

- iシェアーズ 日本株・Jリート ETF の連動対象指数を「配当抜き指数」から「配当込み指数」に変更
- iシェアーズ 外国株・外国リート ETF の連動対象指数名称を「配当込み」を明記した指数名称に変更

今回の変更に伴い、各ETFの運用方針、運用体制、商品性等が変更になるものではありません。

対象ETFと変更内容

日本株・JリートETF 連動対象指数変更

銘柄コード	ファンド名称	変更前 連動対象指数	変更後 連動対象指数
1329	iシェアーズ・コア 日経225 ETF	日経平均株価指数（日経225）	日経平均トータルリターン・インデックス
1364	iシェアーズ JPX日経400 ETF	JPX日経インデックス400	JPX日経400（配当込み）
1475	iシェアーズ・コア TOPIX ETF	東証株価指数（TOPIX）	TOPIX（配当込み）
1476	iシェアーズ・コア Jリート ETF	東証REIT指数	東証REIT指数（配当込み）
1477	iシェアーズ MSCI日本株最小分散ETF	MSCI日本株最小分散インデックス	MSCI日本株最小分散指数（配当込み）
1478	iシェアーズ MSCI日本高配当利回りETF	MSCI日本高配当利回りインデックス	MSCI日本高配当利回り指数（配当込み）
1483	iシェアーズ JPX/S&P 設備・人材投資ETF	JPX/S&P 設備・人材投資指数	JPX/S&P 設備・人材投資指数（トータルリターン）

外国株・外国リート ETF 連動対象指数名称変更

銘柄コード	ファンド名称	名称変更前 連動対象指数	名称変更後 連動対象指数
1655	iシェアーズ S&P 500 米国株 ETF	S&P500® (TTM、円建て)	S&P500® (税引後配当込み、TTM、円建て)
2563	iシェアーズ S&P 500 米国株 ETF (為替ヘッジあり)	S&P500® (TTM、円建て、円ヘッジ)	S&P500® (税引後配当込み、TTM、円建て、円ヘッジ)
1657	iシェアーズ・コア MSCI 先進国株 (除く日本) ETF	M S C I コクサイ指数 (国内投信用 円建て)	M S C I コクサイ指数 (税引後配当込み、国内投信用、円建て)
1658	iシェアーズ・コア MSCI 新興国株 ETF	M S C I エマージング・マーケット IMI 指数 (国内投信用 円建て)	M S C I エマージング・マーケット IMI 指数 (税引後配当込み、国内投信用、円建て)
1659	iシェアーズ 米国リート ETF	FTSE Nareit Equity REITs インデックス (TTM 円建て)	FTSE Nareit Equity REITs インデックス (配当込み、TTM、円建て)
2522	iシェアーズ オートメーション & ロボット ETF	S T O X X グローバルオートメーション アンド ロボティクス インデックス (TTM、円換算)	S T O X X グローバルオートメーション アンド ロボティクス インデックス (TTM、円換算、ネットリターン)

変更の実施予定日

2022 年 11 月 10 日

変更の理由について

これまで、iシェアーズ 日本株・Jリート ETF は、「配当抜き」指数を採用しておりました。これは、日本で一般的に利用されている連動対象指数が配当を含まない指数であったこと、各 ETF 設定時に「配当込み指数」が公表されていなかったこと等が理由です。その結果として、各 ETF は実際の運用成果と、連動対象指数に乖離が生じている状況となっております。今般、より適切な開示手法について見直しを行い、連動対象指数を「配当込み指数」に変更することが望ましいとの判断に至りました。

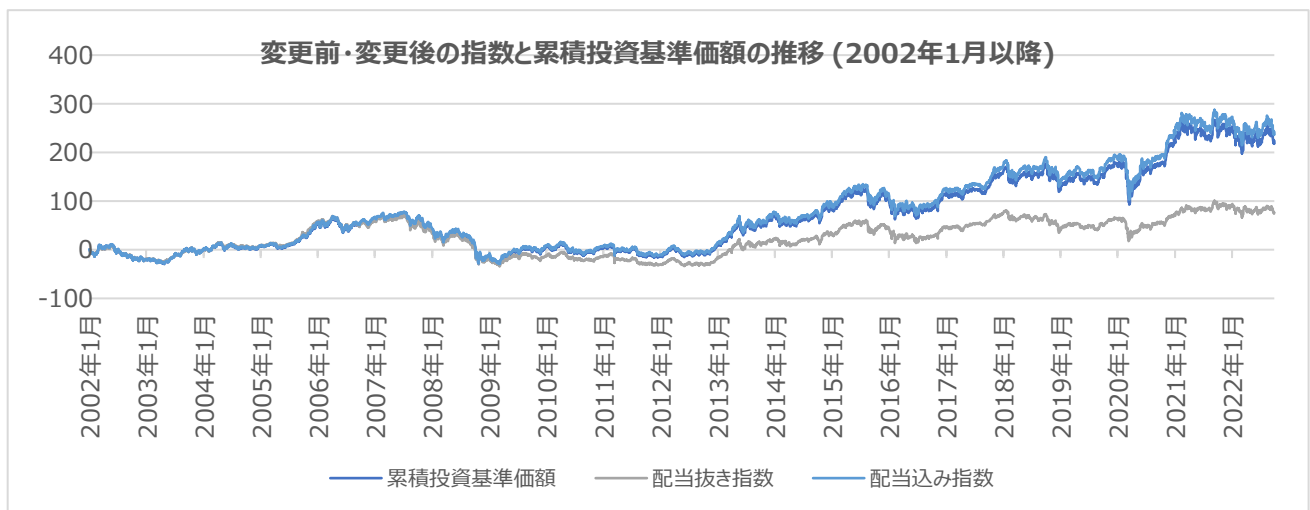
iシェアーズ 外国株・外国リート ETF は、これまで「配当込み」指数を採用しておりますが、それを明示することで、一貫性のある情報開示につながると考えております。

【よくあるご質問】

Q: i シェアーズ 日本株・Jリート ETF の連動対象指数変更に基づいて、指標に対するファンドの連動は具体的にどう変わりますか？

A: これまでは、ETF は投資している株式等の配当金を受け取る一方で、指数は「配当抜き」指数であったため、配当金相当分の差が生じており、上振れておりました。今般の変更により、ファンドと連動対象指数のリターンの乖離は縮小されるものと想定しています。

以下は、i シェアーズ・コア 日経 225 ETF (1329) を一例とした変更前・変更後の乖離の比較です。
パフォーマンス (2022 年 9 月末時点)



	3ヶ月	1年	3年	5年	2002年1月～
ファンド パフォーマンス(%)	-0.9	-10.1	25.7	39.5	218.1
変更前 (配当抜き指数) (%)	-1.7	-11.9	19.2	27.4	138.6
対配当抜き指数 乖離 (%)	0.9	1.8	6.5	12.0	79.5
変更後 (配当込み指数) (%)	-0.8	-10.0	26.3	40.7	236.6
対配当込み指数 乖離 (%)	-0.04	-0.1	-0.6	-1.2	-18.4

* ファンドにかかる費用分の乖離が連動対象指数に対して生じます

Q: i シェアーズ 日本株・Jリート ETF の連動対象指数変更に基づいて、ファンドのパフォーマンスに変更はありますか？

A: 変更ございません。

Q: 対象 ETF に記載されていない ETF への変更はありますか？

A: 変更ございません。

以上

お問合せ先

ブラックロック・ジャパン株式会社 ETF 事業部 TEL : 03-6703-4110

重要事項：本資料は、ブラックロック・インク、ブラックロック・ジャパン株式会社を含むその関係会社（以下、「ブラックロック」という。）が設定・運用等を行う国内上場投信である i シェアーズ・ファンドに関する情報を含む投資情報の提供を目的として作成されたものであり、特定の有価証券等への投資勧誘を目的としたものではありません。また、金融商品取引法に基づく開示資料でもありません。本資料は、ブラックロックが作成したものであり、ご参考のためにご提供するものです。ご投資の決定等は、法定の開示資料等を予め十分にお読みのうえご自身の判断と責任でなさるようお願い致します。

留意事項：本資料は公開情報および各種の信頼できると考えられる情報・データに基づき作成したものです。本情報は、本資料作成時点における、入手可能な情報のみに基づいて提供されています。ブラックロックは本情報の正確性・適時性・完全性・適格性、特定の目的に沿った適切性を含むあらゆる点に関し、明示的にも黙示的にも表明・保証するものではなく、また御社および第三者に対して保証するものではありません。本情報は、この文書の作成日現在の情報です。ブラックロックは本情報に含まれる誤りや脱漏がもたらす結果についていかなる責任も負うものではありません。

また、本資料に掲載されたブラックロックの意見、見解は、過去あるいは本資料作成日時点におけるものであり、今後、予告なく変更されることがあります。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。本資料の使用権は、ブラックロックに帰属し、全部または一部分であってもこれを複製・転用、再配布することは社内用、社外用を問わず許諾されていません。

日経平均株価指数（日経 225）および日経平均トータルリターン・インデックスに関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は日本経済新聞社（以下「日経」といいます。）に帰属します。なお、同社は日経 225 連動型上場投資信託について一切の責任を負いません。

「J P X 日経インデックス 400」および「JPX 日経 400（配当込み）」は、株式会社 J P X 総研（以下「J P X 総研」といいます。）及び日経によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、J P X 総研及び日経は、「J P X 日経インデックス 400」および「JPX 日経 400（配当込み）」自体及び「J P X 日経インデックス 400」および「JPX 日経 400（配当込み）」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。「J P X 日経インデックス 400」および「JPX 日経 400（配当込み）」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て J P X 総研、株式会社日本取引所グループ及び日経に帰属しています。「i シェアーズ JPX 日経 400 ETF」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、J P X 総研及び日経は、その運用及び「i シェアーズ JPX 日経 400 ETF」の取引に関して、一切の責任を負いません。

東証株価指数（TOPIX）および T O P I X（配当込み）指数値及び TOPIX に係る標章又は商標は、J P X 総研又は J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など TOPIX に関するすべての権利・ノウハウ及び TOPIX に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数（TOPIX）および T O P I X（配当込み）指数指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。

東証 REIT 指数および東証 REIT 指数（配当込み）の指数値及び東証 REIT 指数に係る標章又は商標は、J P X の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証 REIT 指数および東証 REIT 指数（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証 REIT 指数および東証 REIT 指数（配当込み）に係る標章又は商標に関するすべての権利は JPX が有します。JPX は、東証 REIT 指数および東証 REIT 指数（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPX

により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても JPX は責任を負いません。

「MSCI」および「MSCI Index」は MSCI Inc.のサービスマークであり、ブラックロックはその使用許諾を得ています。iシェアーズ ETF は MSCI Inc.が出資、保証、発行、販売、または販売促進を行なうものではありません。また、同社は、iシェアーズ ETF への投資の妥当性に関していかなる表明も行いません。ブラックロックは上記の会社の関連会社ではありません。

J P X/S & P 設備・人材投資指数および JPX/S&P 設備・人材投資指数(トータルリターン) (以下「当指数」) は S&P Dow Jones Indices LLC (以下「SPDJI」)、J P Xの商品であり、これを利用するライセンスがブラックロックに付与されています。Standard & Poor's®および S&P®は Standard & Poor's Financial Services LLC (以下「S&P」) の登録商標で、Dow Jones®は Dow Jones Trademark Holdings LLC (以下「Dow Jones」) の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが SPDJI に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがブラックロックにそれぞれ付与されています。また、ブラックロックは一定の目的での使用についてこれらの登録商標のサブライセンスを供与されています。JPX®は J P Xの登録商標であり、これを利用するライセンスが SPDJI に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがブラックロックに付与されています。iシェアーズ ETF は、SPDJI、Dow Jones、S&P またはもしくはそれぞれの関連会社、J P Xによって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、iシェアーズ ETF への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当指数の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。ブラックロックは上記の会社の関連会社ではありません。

FTSE®は、London Stock Exchange Group の会社が所有する商標であり、ライセンス契約に基づき、FTSE International Limited (以下「FTSE」) が使用 Nareit® は National Association of Real Estate Investment Trusts (以下「Nareit」)が所有する商標です。FTSE Nareit Equity REITs インデックス (TTM 円建て) は、FTSE が算出を行います。FTSE と Nareit のいずれも本商品のスポンサー、保証、販売促進を行っておらず、さらにいかなる形においても本商品に関わっておらず、一切の責務を負うものではありません。インデックスの価格および構成リストにおける全ての知的財産は FTSE と Nareit に帰属します。ブラックロックは、本商品の創出に関する知的財産を使用する全ライセンスを FTSE から取得しています。

S T O X X グローバルオートメーション アンド ロボティクス インデックス (TTM、円換算) および S T O X X グローバルオートメーション アンド ロボティクス インデックス (TTM、円換算、ネットリターン) は、STOXX リミテッド (スイス、チューリヒ) (以下「STOXX 社」)、ドイツ取引所グループ又は同社のライセンサーの知的財産であり、ライセンスの下で使用されます。iシェアーズ オートメーション & ロボット ETF は、STOXX 社、ドイツ取引所グループ若しくは同社のライセンサー、リサーチパートナー又はデータプロバイダーが後援、宣伝、販売又はその他のいかなる形での支援も行わないものではありません。又、STOXX 社、ドイツ取引所グループ及び同社のライセンサー、リサーチパートナー又はデータプロバイダーは、iシェアーズ オートメーション & ロボット ETF に一般的に関係して、又は対象インデックス若しくはそのデータにおけるエラー、遺漏若しくは中断に個別に関連して、いかなる責任も負うものではありません。

©2022 BlackRock Japan Co., Ltd. All rights reserved.

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

ホームページ <http://www.blackrock.com/jp/ishares> <<http://www.blackrock.com/jp/ishares>>

〒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