

【表紙】

【提出書類】 半期報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成30年5月2日

【計算期間】 第2期中(自 平成29年8月3日 至 平成30年2月2日)

【ファンド名】 ブラックロックLifePathファンド2055

【発行者名】 ブラックロック・ジャパン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役会長 井澤 吉幸

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【事務連絡者氏名】 加藤 淳一郎

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【電話番号】 03 - 6703 - 4930

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

(注) 本書において文中および表中の数字は四捨五入された数値として表示されている場合があり、従って合計として表示された数字はかかる数値の総和と必ずしも一致するとは限りません。

1【ファンドの運用状況】

以下の運用状況は2018年1月末現在のものです。

「ブラックロックLifePathファンド2055」

(1)【投資状況】

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,296,343	95.88
内 日本	1,296,343	95.88
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	55,696	4.12
純資産総額	1,352,039	100.00

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

2018年1月末現在、同日前1年以内における各月末および各計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期(2017年8月2日)	1,044,050	(同左)	1.0441	(同左)
2017年3月末現在	1,005,158	-	1.0052	-
2017年4月末現在	1,012,642	-	1.0126	-
2017年5月末現在	1,023,833	-	1.0238	-
2017年6月末現在	1,037,403	-	1.0374	-
2017年7月末現在	1,039,287	-	1.0393	-
2017年8月末現在	1,038,155	-	1.0382	-
2017年9月末現在	1,062,882	-	1.0629	-
2017年10月末現在	1,091,962	-	1.0920	-
2017年11月末現在	1,528,267	-	1.1055	-
2017年12月末現在	1,307,922	-	1.1182	-
2018年1月末現在	1,352,039	-	1.1168	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1期	-
2017年8月3日～ 2018年2月2日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1期	4.4
2017年8月3日～ 2018年2月2日	7.5

(注) 収益率とは、計算期間末の基準価額(分配額の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配額の額。以下「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た額です。なお、第1期計算期間については、前期末基準価額を10,000円(1万口当たり)として計算しています。

(参考情報)

「国内債券インデックス・マザーファンド」

投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
国債証券	7,967,187,730	76.18
内 日本	7,967,187,730	76.18
地方債証券	585,250,830	5.60
内 日本	585,250,830	5.60
特殊債券	615,971,610	5.89
内 日本	615,971,610	5.89
社債券	404,770,300	3.87
内 日本	404,770,300	3.87
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	885,305,389	8.46
純資産総額	10,458,485,859	100.00

(注) 当ファンドは、ファミリーファンド方式による運用を行っているため、実質の運用はマザーファンドにおいて行っております。

「先進国債券インデックス・マザーファンド」
投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
国債証券	6,098,626,698	98.47
内 アメリカ	2,563,876,428	41.40
内 フランス	637,136,916	10.29
内 イタリア	615,713,049	9.94
内 イギリス	446,310,271	7.21
内 ドイツ	446,247,465	7.20
内 スペイン	368,722,596	5.95
内 ベルギー	160,882,592	2.60
内 オランダ	138,853,416	2.24
内 オーストラリア	136,162,856	2.20
内 カナダ	131,254,084	2.12
内 オーストリア	98,194,369	1.59
内 アイルランド	49,101,045	0.79
内 メキシコ	45,024,034	0.73
内 ポーランド	40,522,806	0.65
内 フィンランド	38,808,575	0.63
内 南アフリカ	37,143,839	0.60
内 デンマーク	36,909,952	0.60
内 マレーシア	28,731,466	0.46
内 スウェーデン	27,988,490	0.45
内 シンガポール	22,096,834	0.36
内 ノルウェー	19,378,336	0.31
内 スイス	9,567,279	0.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	95,020,073	1.53
純資産総額	6,193,646,771	100.00

(注) 当ファンドは、ファミリーファンド方式による運用を行っているため、実質の運用はマザーファンドにおいて行っております。

「国内株式インデックス・マザーファンド」

投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	6,585,253,380	78.25
内 日本	6,585,253,380	78.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,830,238,843	21.75
純資産総額	8,415,492,223	100.00

(注) 当ファンドは、ファミリーファンド方式による運用を行っているため、実質の運用はマザーファンドにおいて行っております。

「先進国株式インデックス・マザーファンド」

投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	5,059,160,658	98.28
内 アメリカ	3,640,537,001	70.72
内 ドイツ	796,780,461	15.48
内 アイルランド	426,613,897	8.29
内 カナダ	195,229,299	3.79
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	88,337,687	1.72
純資産総額	5,147,498,345	100.00

(注) 当ファンドは、ファミリー・ファンド方式による運用を行っているため、実質の運用はマザー・ファンドにおいて行っております。

「新興国株式インデックス・マザーファンド」

投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	796,254,188	98.87
内 アメリカ	796,254,188	98.87
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,105,207	1.13
純資産総額	805,359,395	100.00

(注) 当ファンドは、ファミリーファンド方式による運用を行っているため、実質の運用はマザーファンドにおいて行っております。

「国内リート・インデックス・マザーファンド」
投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	3,442,981,300	97.60
内 日本	3,442,981,300	97.60
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	84,658,598	2.40
純資産総額	3,527,639,898	100.00

(注) 当ファンドは、ファミリーファンド方式による運用を行っているため、実質の運用はマザーファンドにおいて行っております。

「先進国リート・インデックス・マザーファンド」
投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	1,706,000,377	98.66
内 アメリカ	1,176,898,445	68.06
内 オーストラリア	140,726,348	8.14
内 イギリス	101,851,892	5.89
内 フランス	86,593,422	5.01
内 シンガポール	66,178,142	3.83
内 香港	35,471,957	2.05
内 カナダ	34,132,625	1.97
内 スペイン	20,045,618	1.16
内 ベルギー	13,404,181	0.78
内 オランダ	8,782,019	0.51
内 ニュージーランド	6,779,509	0.39
内 アイルランド	5,091,473	0.29
内 ドイツ	4,623,058	0.27
内 イタリア	2,091,893	0.12
内 ガーンジー	1,271,362	0.07
内 イスラエル	1,168,887	0.07
内 マン島	889,546	0.05
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	23,257,580	1.34
純資産総額	1,729,257,957	100.00

(注) 当ファンドは、ファミリーファンド方式による運用を行っているため、実質の運用はマザーファンドにおいて行っております。

2【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	1,000,000	0	1,000,000
2017年8月3日～ 2018年2月2日	464,622	253,992	1,210,630

3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)及び同規則第38条の3並びに第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成29年8月3日から平成30年2月2日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

(3) 当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行っておりますので、参考情報として「国内債券インデックス・マザーファンド」、「先進国債券インデックス・マザーファンド」、「国内株式インデックス・マザーファンド」、「先進国株式インデックス・マザーファンド」及び「新興国株式インデックス・マザーファンド」、「国内リート・インデックス・マザーファンド」、「先進国リート・インデックス・マザーファンド」の貸借対照表及び注記表を記載しております。

なお、当該参考情報は監査意見の対象外となっております。

【中間財務諸表】

【ブラックロックLifePathファンド2055】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 (平成29年8月2日現在)	当中間計算期間末 (平成30年2月2日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	97	5,072
親投資信託受益証券	1,044,007	1,356,220
未収入金	1,516	-
流動資産合計	1,045,620	1,361,292
資産合計		
1,045,620		
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	47	158
未払委託者報酬	1,150	1,804
その他未払費用	373	618
流動負債合計	1,570	2,580
負債合計		
1,570		
純資産の部		
元本等		
元本	1,000,000	1,210,630
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	44,050	148,082
(分配準備積立金)	44,050	35,956
元本等合計	1,044,050	1,358,712
純資産合計		
1,044,050		
負債純資産合計		
1,045,620		
1,361,292		

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 平成29年 8月 3日 至 平成30年 2月 2日
営業収益	
有価証券売買等損益	87,654
営業収益合計	87,654
営業費用	
受託者報酬	158
委託者報酬	1,804
その他費用	618
営業費用合計	2,580
営業利益又は営業損失()	85,074
経常利益又は経常損失()	85,074
中間純利益又は中間純損失()	85,074
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	15,075
期首剰余金又は期首欠損金()	44,050
剰余金増加額又は欠損金減少額	49,310
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	49,310
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,277
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	15,277
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	148,082

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、当該親投資信託受益証券の基準価額で時価評価しております。

2 収益及び費用の計上基準

有価証券売買等損益の計上基準
約定日基準で計上しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	前計算期間末 (平成29年8月2日現在)	当中間計算期間末 (平成30年2月2日現在)
1 当該中間計算期間の末日 における受益権総数	1,000,000口	1,210,630口
2 1口当たり純資産額	1.0441円	1.1223円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

前計算期間末 (平成29年8月2日現在)	当中間計算期間末 (平成30年2月2日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	<p>1 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 同左 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
<p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>
<p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>4 金銭債権の中間計算期間末日後の償還予定額 同左</p>

(その他の注記)

1 期中元本変動額

項目	前計算期間末 (平成29年8月2日現在)	当中間計算期間末 (平成30年2月2日現在)
期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	464,622円
期中一部解約元本額	- 円	253,992円

2 有価証券関係

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(参考情報)

当ファンドは、「国内債券インデックス・マザーファンド」、「先進国債券インデックス・マザーファンド」、「国内株式インデックス・マザーファンド」、「先進国株式インデックス・マザーファンド」、「新興国株式インデックス・マザーファンド」、「国内リート・インデックス・マザーファンド」、「先進国リート・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ており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。同マザーファンドの平成30年2月2日現在(以下「計算日」という)の状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外であります。

「国内債券インデックス・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	(平成30年2月2日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	24,473,477
国債証券	7,914,229,960
地方債証券	585,199,050
特殊債券	615,785,660
社債券	404,721,800
未収入金	910,818,130
未収利息	13,609,694
前払費用	3,520,556
流動資産合計	10,472,358,327
資産合計	10,472,358,327
負債の部	
流動負債	
未払解約金	931,292,573
流動負債合計	931,292,573
負債合計	931,292,573
純資産の部	
元本等	
元本	8,750,923,166
剰余金	
剰余金又は欠損金()	790,142,588
元本等合計	9,541,065,754
純資産合計	9,541,065,754
負債純資産合計	10,472,358,327

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

公社債は個別法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として当該取引所等における計算日において知りうる直近の最終相場で評価しております。

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。

(3) 時価が入手できなかった有価証券

適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年2月2日現在)
1 当該計算日における受益権総数	8,750,923,166口
2 1口当たり純資産額	1.0903円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

(平成30年2月2日現在)	
1	貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2	時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3	金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4	金銭債権の計算日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。

(その他の注記)

- 1 本報告書における開示対象ファンドの当該中間計算期間における当該親投資信託の元本額の変動及び計算日における元本の内訳

(平成30年2月2日現在)	
同中間計算期間の期首元本額	3,728,941,503円
同中間計算期間中の追加設定元本額	7,108,164,150円
同中間計算期間中の一部解約元本額	2,086,182,487円
同中間計算期間末日の元本額	8,750,923,166円
当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託の元本額は次の通りです。	
i-mizuho 国内債券インデックス	742,645,513円
みずほインデックス投資戦略ファンド	1,413,072,976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)	4,619,617,188円
ブラックロックLifePathファンド2055	294,084円
ブラックロックLifePathファンド2045	423,748円
ブラックロックLifePathファンド2035	639,418円
GTAAセレクト・アルファ(適格機関投資家限定)	1,963,629,372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	10,600,867円
合計	8,750,923,166円

- 2 有価証券関係

該当事項はありません。

- 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

「先進国債券インデックス・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	(平成30年2月2日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	35,151,583
金銭信託	131,127,163
国債証券	6,283,849,316
派生商品評価勘定	1,189,097
未収入金	19,631,446
未収利息	42,852,561
前払費用	8,572,185
流動資産合計	6,522,373,351
資産合計	6,522,373,351
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	82,874
未払金	145,360,160
未払解約金	2,762,656
流動負債合計	148,205,690
負債合計	148,205,690
純資産の部	
元本等	
元本	5,264,953,377
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,109,214,284
元本等合計	6,374,167,661
純資産合計	6,374,167,661
負債純資産合計	6,522,373,351

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

公社債は個別法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として当該取引所等における計算日において知りうる直近の最終相場で評価しております。

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

当該有価証券については、原則として、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。

(3) 時価が入手できなかった有価証券

適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建資産・負債の円換算については原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。

4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

外貨建資産等の会計処理

外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年2月2日現在)
1 当該計算日における受益権総数	5,264,953,377口
2 1口当たり純資産額	1.2107円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

(平成30年2月2日現在)	
1	貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2	時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3	金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4	金銭債権の計算日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。

(その他の注記)

- 1 本報告書における開示対象ファンドの当該中間計算期間における当該親投資信託の元本額の変動及び計算日における元本の内訳

(平成30年2月2日現在)	
同中間計算期間の期首元本額	6,109,346,530円
同中間計算期間中の追加設定元本額	3,825,576,027円
同中間計算期間中の一部解約元本額	4,669,969,180円
同中間計算期間末日の元本額	5,264,953,377円
当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託の元本額は次の通りです。	
i-mizuho 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	353,405,873円
i-mizuho 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	289,004,108円
みずほインデックス投資戦略ファンド	1,357,451,251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)	3,259,790,668円
ブラックロックLifePathファンド2055	187,245円
ブラックロックLifePathファンド2045	191,910円
ブラックロックLifePathファンド2035	141,761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	4,780,561円
合計	5,264,953,377円

2 有価証券関係

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	(平成30年2月2日現在)			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超 (円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	ユーロ	10,891,016		10,971,245	80,229
	買建				
	アメリカドル	64,753,509		65,072,712	319,203
	イギリスポンド	5,793,075		5,874,107	81,032
	オーストラリアドル	4,460,441		4,465,396	4,955
	カナダドル	5,258,820		5,320,813	61,993
	スウェーデンクローナ	1,770,016		1,789,087	19,071
	メキシコペソ	2,368,755		2,401,433	32,678
	ユーロ	50,830,160		51,497,680	667,520
	合計	146,125,792		147,392,473	1,106,223

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

1 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」という。)の対顧客先物相場が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

「国内株式インデックス・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	(平成30年2月2日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,899,040,355
投資信託受益証券	6,632,251,410
派生商品評価勘定	15,569,185
差入委託証拠金	37,686,000
流動資産合計	8,584,546,950
資産合計	8,584,546,950
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,181,888
前受金	17,272,000
未払解約金	547,672,539
流動負債合計	570,126,427
負債合計	570,126,427
純資産の部	
元本等	
元本	4,485,537,748
剰余金	
剰余金又は欠損金()	3,528,882,775
元本等合計	8,014,420,523
純資産合計	8,014,420,523
負債純資産合計	8,584,546,950

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資信託受益証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として当該取引所等における計算日において知りうる直近の最終相場で評価しております。

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

当該有価証券については、原則として、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。

(3) 時価が入手できなかった有価証券

適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

株価指数先物取引

個別法に基づき、原則として時価評価しております。時価評価にあたっては、原則として、当該取引所の発表する計算日に知りうる直近の日の清算値段又は最終相場で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年2月2日現在)
1 当該計算日における受益権総数	4,485,537,748口
2 1口当たり純資産額	1.7867円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

(平成30年2月2日現在)	
1	<p>貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2	<p>時価の算定方法</p> <p>(1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3	<p>金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
4	<p>金銭債権の計算日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>

(その他の注記)

1 本報告書における開示対象ファンドの当該中間計算期間における当該親投資信託の元本額の変動及び計算日における元本の内訳

(平成30年2月2日現在)	
同中間計算期間の期首元本額	2,382,974,240円
同中間計算期間中の追加設定元本額	5,225,880,062円
同中間計算期間中の一部解約元本額	3,123,316,554円
同中間計算期間末日の元本額	4,485,537,748円
当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託の元本額は次の通りです。	
i-mizuho 国内株式インデックス	1,740,183,337円
みずほインデックス投資戦略ファンド	1,046,052,234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)	1,698,775,284円
ブラックロックLifePathファンド2055	184,797円
ブラックロックLifePathファンド2045	200,229円
ブラックロックLifePathファンド2035	141,867円
合計	4,485,537,748円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係
取引の時価等に関する事項
株式関連

区分	種類	(平成30年2月2日現在)			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超 (円)		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,321,152,000		1,331,572,000	10,420,000
合計		1,321,152,000		1,331,572,000	10,420,000

(注1) 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として当計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は証拠金算定基準値段を用いております。このような時価が発表されていない場合には、当計算日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(3) 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

「先進国株式インデックス・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	(平成30年2月2日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	897,251
金銭信託	483,734,548
投資信託受益証券	4,914,059,523
未収入金	176,658,123
流動資産合計	5,575,349,445
資産合計	5,575,349,445
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,063,875
未払解約金	650,830,962
流動負債合計	651,894,837
負債合計	651,894,837
純資産の部	
元本等	
元本	2,797,671,571
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,125,783,037
元本等合計	4,923,454,608
純資産合計	4,923,454,608
負債純資産合計	5,575,349,445

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資信託受益証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として当該取引所等における計算日において知りうる直近の最終相場で評価しております。

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

当該有価証券については、原則として、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。

(3) 時価が入手できなかった有価証券

適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建資産・負債の円換算については原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。

4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

外貨建資産等の会計処理

外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年2月2日現在)
1 当該計算日における受益権総数	2,797,671,571口
2 1口当たり純資産額	1.7598円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

(平成30年2月2日現在)	
1	<p>貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2	<p>時価の算定方法</p> <p>(1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3	<p>金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
4	<p>金銭債権の計算日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>

(その他の注記)

1 本報告書における開示対象ファンドの当該中間計算期間における当該親投資信託の元本額の変動及び計算日における元本の内訳

(平成30年2月2日現在)	
同中間計算期間の期首元本額	3,740,963,375円
同中間計算期間中の追加設定元本額	1,653,087,350円
同中間計算期間中の一部解約元本額	2,596,379,154円
同中間計算期間末日の元本額	2,797,671,571円
当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託の元本額は次の通りです。	
i-mizuho 先進国株式インデックス(為替ヘッジあり)	281,770,041円
i-mizuho 先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)	487,987,881円
みずほインデックス投資戦略ファンド	1,638,040,179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)	389,383,905円
ブラックロックLifePathファンド2055	178,247円
ブラックロックLifePathファンド2045	186,439円
ブラックロックLifePathファンド2035	124,879円
合計	2,797,671,571円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	(平成30年2月2日現在)			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超(円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	115,142,296	-	115,560,056	417,760
	イギリスポンド	10,629,328	-	10,764,109	134,781
	カナダドル	8,636,038	-	8,727,798	91,760
	ユーロ	35,394,773	-	35,814,347	419,574
合計		169,802,435	-	170,866,310	1,063,875

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

- 1 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」という)の対顧客先物相場が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 計算日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

「新興国株式インデックス・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	(平成30年2月2日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	164,545
金銭信託	24,967,194
投資信託受益証券	797,143,797
流動資産合計	822,275,536
資産合計	822,275,536
負債の部	
流動負債	
未払解約金	14,093,862
流動負債合計	14,093,862
負債合計	14,093,862
純資産の部	
元本等	
元本	503,839,549
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	304,342,125
元本等合計	808,181,674
純資産合計	808,181,674
負債純資産合計	822,275,536

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資信託受益証券は、移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として当該取引所等における計算日において知りうる直近の最終相場で評価しております。

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

当該有価証券については、原則として、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。

(3) 時価が入手できなかった有価証券

適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建資産・負債の円換算については原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。

4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

外貨建資産等の会計処理

外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年2月2日現在)
1 当該計算日における受益権総数	503,839,549口
2 1口当たり純資産額	1.6040円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

(平成30年2月2日現在)	
1	貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2	時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3	金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4	金銭債権の計算日後の償還予定額 金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(その他の注記)

- 1 本報告書における開示対象ファンドの当該中間計算期間における当該親投資信託の元本額の変動及び計算日における元本の内訳

(平成30年2月2日現在)	
同中間計算期間の期首元本額	356,807,156円
同中間計算期間中の追加設定元本額	477,682,114円
同中間計算期間中の一部解約元本額	330,649,721円
同中間計算期間末日の元本額	503,839,549円
当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託の元本額は次の通りです。	
i-mizuho 新興国株式インデックス	503,757,665円
ブラックロックLifePathファンド2055	31,121円
ブラックロックLifePathファンド2045	32,313円
ブラックロックLifePathファンド2035	18,450円
合計	503,839,549円

2 有価証券関係

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

「国内リート・インデックス・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	(平成30年2月2日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	62,307,171
投資証券	3,432,470,400
派生商品評価勘定	1,623,588
未収配当金	35,266,445
差入委託証拠金	513,000
流動資産合計	3,532,180,604
資産合計	3,532,180,604
負債の部	
流動負債	
前受金	1,683,400
未払金	5,309,445
未払解約金	12,755,057
流動負債合計	19,747,902
負債合計	19,747,902
純資産の部	
元本等	
元本	2,586,396,556
剰余金	
剰余金又は欠損金()	926,036,146
元本等合計	3,512,432,702
純資産合計	3,512,432,702
負債純資産合計	3,532,180,604

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は、移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として当該取引所等における計算日において知りうる直近の最終相場で評価しております。

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

当該有価証券については、原則として、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。

(3) 時価が入手できなかった有価証券

適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

不動産投信指数先物取引

個別法に基づき、原則として時価評価しております。時価評価にあたっては、原則として、当該取引所の発表する計算日に知り得る直近の日の清算値段又は最終相場で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年2月2日現在)
1 当該計算日における受益権総数	2,586,396,556口
2 1口当たり純資産額	1.3580円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

(平成30年2月2日現在)	
1	貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2	時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3	金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4	金銭債権の計算日後の償還予定額 金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(その他の注記)

- 1 本報告書における開示対象ファンドの当該中間計算期間における当該親投資信託の元本額の変動及び計算日における元本の内訳

(平成30年2月2日現在)	
同中間計算期間の期首元本額	2,148,673,162円
同中間計算期間中の追加設定元本額	887,335,850円
同中間計算期間中の一部解約元本額	449,612,456円
同中間計算期間末日の元本額	2,586,396,556円
当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託の元本額は次の通りです。	
i-mizuho 国内リートインデックス	1,051,800,135円
国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定）	1,404,122,144円
みずほインデックス投資戦略ファンド	130,433,856円
ブラックロックLifePathファンド2055	22,307円
ブラックロックLifePathファンド2045	18,114円
合計	2,586,396,556円

2 有価証券関係

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係
取引の時価等に関する事項
株式関連

区分	種類	(平成30年2月2日現在)			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超 (円)		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	31,139,100		32,775,000	1,635,900
合計		31,139,100		32,775,000	1,635,900

(注1) 時価の算定方法

(1) 不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として当計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は証拠金算定基準値段を用いております。このような時価が発表されていない場合には、当計算日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(2) 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(3) 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

「先進国リート・インデックス・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	(平成30年2月2日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,267,927
金銭信託	23,931,452
投資証券	1,713,005,806
未収入金	54,922
未収配当金	4,158,739
流動資産合計	1,742,418,846
資産合計	1,742,418,846
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,130,255
流動負債合計	1,130,255
負債合計	1,130,255
純資産の部	
元本等	
元本	1,159,508,007
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	581,780,584
元本等合計	1,741,288,591
純資産合計	1,741,288,591
負債純資産合計	1,742,418,846

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は、移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として当該取引所等における計算日において知りうる直近の最終相場で評価しております。

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

当該有価証券については、原則として、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。

(3) 時価が入手できなかった有価証券

適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建資産・負債の円換算については原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。

4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

外貨建資産等の会計処理

外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年2月2日現在)
1 当該計算日における受益権総数	1,159,508,007口
2 1口当たり純資産額	1.5017円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

(平成30年2月2日現在)	
1	貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2	時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3	金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4	金銭債権の計算日後の償還予定額 金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(その他の注記)

- 1 本報告書における開示対象ファンドの当該中間計算期間における当該親投資信託の元本額の変動及び計算日における元本の内訳

(平成30年2月2日現在)	
同中間計算期間の期首元本額	770,013,505円
同中間計算期間中の追加設定元本額	496,757,950円
同中間計算期間中の一部解約元本額	107,263,448円
同中間計算期間末日の元本額	1,159,508,007円
当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託の元本額は次の通りです。	
i-mizuho 先進国リートインデックス(為替ヘッジあり)	129,270,126円
i-mizuho 先進国リートインデックス(為替ヘッジなし)	300,588,222円
先進国リートインデックス・ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定)	726,857,006円
ブラックロックLifePathファンド2055	56,482円
ブラックロックLifePathファンド2045	52,888円
ブラックロックLifePathファンド2035	25,932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	2,657,351円
合計	1,159,508,007円

2 有価証券関係

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

(2)【事業の内容及び営業の状況】

投信法に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務、第一種金融商品取引業務および第二種金融商品取引業務等を行なっています。

委託会社の運用する証券投資信託は2018年1月末現在、以下の通りです（親投資信託を除きます。）。

種類		本数	純資産総額
公募投資信託	追加型株式投資信託	82本	1,230,585百万円
	単体型株式投資信託	0本	0百万円
私募投資信託		67本	5,651,536百万円
合計		149本	6,882,122百万円

(3)【その他】

訴訟事件その他委託会社等に重要な影響を及ぼした事実および重要な影響を及ぼすことが予想される事実に関する事項

該当事項はありません。

5【委託会社等の経理状況】

1. 財務諸表の作成方法について

委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社(以下「当社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。)第2条及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号。)に基づいて作成しております。

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第31期事業年度(自平成29年1月1日 至平成29年12月31日)の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

3. 財務諸表に記載している金額については、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第30期 (平成28年12月31日現在)	第31期 (平成29年12月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	12,415	19,097
立替金	49	11
前払費用	127	171
未収入金	2	3
未収委託者報酬	1,163	1,585
未収運用受託報酬	2,771	2,642
未収収益	2	1,384
為替予約	-	0
繰延税金資産	845	860
その他流動資産	5	33
流動資産計	18,573	25,789
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1	946
器具備品	1	411
有形固定資産計	1,536	1,358
無形固定資産		
ソフトウェア	8	4
のれん	98	42
無形固定資産計	106	47
投資その他の資産		
投資有価証券	0	3
長期差入保証金	972	1,124
前払年金費用	501	588
長期前払費用	8	25
投資その他の資産計	1,483	1,741
固定資産計	3,127	3,147
資産合計	21,701	28,937

	第30期 (平成28年12月31日現在)	第31期 (平成29年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	86	119
未払金	2	
未払収益分配金	3	4
未払償還金	75	74
未払手数料	392	593
その他未払金	1,385	1,737
未払費用	2	
未払消費税等	52	150
未払法人税等	263	438
前受金	-	79
前受収益	-	15
賞与引当金	1,884	1,886
役員賞与引当金	141	144
早期退職慰労引当金	37	9
流動負債計	5,465	6,500
固定負債		
退職給付引当金	60	55
資産除去債務	258	262
繰延税金負債	29	74
固定負債計	348	392
負債合計	5,813	6,892
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,435	3,120
資本剰余金		
資本準備金	2,316	3,001
その他資本剰余金	3,846	3,846
資本剰余金合計	6,162	6,847
利益剰余金		
利益準備金	336	336
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	6,953	11,739
利益剰余金合計	7,290	12,076
株主資本合計	15,887	22,044
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等合計	0	0
純資産合計	15,887	22,044
負債・純資産合計	21,701	28,937

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	第30期 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)	第31期 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
営業収益		
委託者報酬	3,977	5,202
運用受託報酬	1 9,036	8,890
その他営業収益	1 10,533	12,257
営業収益計	23,546	26,350
営業費用		
支払手数料	1,296	1,830
広告宣伝費	237	208
調査費		
調査費	383	380
委託調査費	1 4,020	4,313
調査費計	4,404	4,693
委託計算費	114	86
営業雑経費		
通信費	53	50
印刷費	63	62
諸会費	31	32
営業雑経費計	148	145
営業費用計	6,201	6,964
一般管理費		
給料		
役員報酬	604	353
給料・手当	3,809	3,960
賞与	2,232	2,232
給料計	6,646	6,546
退職給付費用	256	287
福利厚生費	822	892
事務委託費	1 2,216	2,433
交際費	51	69
寄付金	2	2
旅費交通費	241	243
租税公課	142	231
不動産賃借料	732	735
水道光熱費	64	65
固定資産減価償却費	229	262
のれん償却額	56	56
資産除去債務利息費用	3	3
諸経費	414	363
一般管理費計	11,881	12,194
営業利益	5,463	7,191

	第30期 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)	第31期 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
営業外収益		
受取利息	3	0
有価証券売却益	-	0
為替差益	12	-
雑益	0	0
営業外収益計	16	1
営業外費用		
支払利息	0	-
有価証券売却損	0	-
為替差損	-	34
固定資産除却損	1	-
営業外費用計	1	34
経常利益	5,479	7,158
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	163	119
特別損失計	163	119
税引前当期純利益	5,315	7,039
法人税、住民税及び事業税	1,920	2,223
法人税等調整額	76	29
当期純利益	3,318	4,786

(3)【株主資本等変動計算書】

第30期(自平成28年1月1日至平成28年12月31日)

(単位:百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他 有価証券 評価 差額金		評価・換 算差額等 合計
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益 剰余金 合計				
平成28年1月1日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	9,634	9,971	18,569	-	-	18,569
事業年度中の変動額											
剰余金の配当						6,000	6,000	6,000			6,000
当期純利益						3,318	3,318	3,318			3,318
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額(純額)									0	0	0
事業年度中の変動額合計	-	-	-	-	-	2,681	2,681	2,681	0	0	2,681
平成28年12月31日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	6,953	7,290	15,887	0	0	15,887

第31期(自平成29年1月1日至平成29年12月31日)

(単位:百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他 有価証券 評価 差額金		評価・換 算差額等 合計
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益 剰余金 合計				
平成29年1月1日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	6,953	7,290	15,887	0	0	15,887
事業年度中の変動額											
新株の発行	685	685		685				1,370			1,370
剰余金の配当							-	-			-
当期純利益						4,786	4,786	4,786			4,786
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額(純額)									0	0	0
事業年度中の変動額合計	685	685	-	685	-	4,786	4,786	6,156	0	0	6,156
平成29年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	11,739	12,076	22,044	0	0	22,044

注 記 事 項

〔重要な会計方針〕

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定）を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は建物附属設備6～18年、器具備品2～15年であります。

(2) 無形固定資産

自社利用のソフトウェアの減価償却方法については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

のれんの償却方法については、その効果の及ぶ期間（5～9年）に基づく定額法によっております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金の計上方法

債権の貸倒損失に備えるため、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 退職給付引当金の計上方法

旧退職金制度

適格退職年金制度移行日現在在籍していた従業員については、旧退職金制度に基づく給付額を保証しているため、期末現在の当該給付額と年金制度に基づく給付額との差額を引当て計上しております。

確定拠出年金制度

確定拠出年金制度（DC）による退職年金制度を有しております。

確定給付年金制度

キャッシュ・バランス型の年金制度（CB）の退職年金制度を有しております。CBには、一定の利回り保証を付しており、これの将来の支払に備えるため、確定給付型の会計基準に準じた会計処理方法により引当金を計上しております。

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当期までの期間に帰属させる方法については、ポイント基準によっております。

過去勤務債務は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理または費用から控除することとしております。

- (3) 賞与引当金の計上方法
従業員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
- (4) 役員賞与引当金の計上方法
役員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
- (5) 早期退職慰労引当金の計上方法
早期退職慰労の支払に備えて、早期退職慰労支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、期末の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項
- (1) 消費税等の処理方法
消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。
- (2) 連結納税制度の適用
親会社であるブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
建物附属設備	1,191 百万円	1,346 百万円
器具備品	717 百万円	821 百万円

2 関係会社に対する資産及び負債

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
未収収益	484 百万円	508 百万円
未払金	1,361 百万円	1,713 百万円
未払費用	173 百万円	356 百万円

3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行2行と当座貸越契約を締結しております。これら契約に基づく事業年度末の借入未実行残高は次のとおりであります。

	前事業年度 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
当座貸越極度額	1,000 百万円	1,000 百万円
借入実行残高	-	-
差引額	1,000 百万円	1,000 百万円

(損益計算書関係)

1 関係会社に対する営業収益及び営業費用

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)		(自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)	
その他営業収益	4,730	百万円	4,670	百万円
委託調査費	377	百万円	438	百万円
事務委託費	630	百万円	824	百万円
運用受託報酬	4	百万円	48	百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度 (自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

1. 発行済株式に関する事項

	前事業年度期首	増加	減少	前事業年度末
普通株式(株)	10,158	-	-	10,158

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

配当支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年9月8日 取締役会決議	普通株式	6,000	590,667	平成28年9月9日	平成28年9月9日

当事業年度 (自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

1. 発行済株式に関する事項

	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	10,158	4,842	-	15,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定し、また、資金調達については関連当事者からの長期借入に限定しています。

投資有価証券は、当社設定の投資信託であり、通常の営業過程において保有しております。

デリバティブについては、外貨建て営業債権及び債務の為替変動リスクを回避するために利用し、投機的な取引は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。当該リスクに関しては、当社の経理規程に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行い、個別に未収債権の回収可能性を管理する体制をしいております。

営業債務である未払手数料はその全てが1年以内の支払期日となっております。

営業債務は流動性リスクに晒されていますが、当社では資金繰計画を作成するなどの方法により管理しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、金額的重要性が低いものについては含めておりません。

前事業年度（平成28年12月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 現金・預金	12,415	12,415	-
(2) 未収委託者報酬	1,163	1,163	-
(3) 未収運用受託報酬	2,771	2,771	-
(4) 未収収益	1,192	1,192	-
(5) 長期差入保証金	972	969	3
資産計	18,516	18,512	3
(1) 未払手数料	392	392	-
(2) 未払費用	1,141	1,141	-
負債計	1,533	1,533	-

当事業年度 (平成29年12月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 現金・預金	19,097	19,097	-
(2) 未収委託者報酬	1,585	1,585	-
(3) 未収運用受託報酬	2,642	2,642	-
(4) 未収収益	1,384	1,384	-
(5) 長期差入保証金	1,124	1,109	14
資産計	25,834	25,819	14
(1) 未払手数料	593	593	-
(2) 未払費用	1,245	1,245	-
負債計	1,838	1,838	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収収益

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(5) 長期差入保証金

事務所敷金の時価については、事務所の敷金を当該賃貸借契約期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。また従業員社宅敷金の時価については、平均残存勤務期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。

負 債

(1)未払手数料、(2) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成28年12月31日)

	1年以内 (百万円)	1年超 5年以内 (百万円)	5年超 10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	12,415	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,163	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,771	-	-	-
(4) 未収収益	1,192	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	907	53	11
合計	17,543	907	53	11

当事業年度(平成29年12月31日)

	1年以内 (百万円)	1年超 5年以内 (百万円)	5年超 10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	19,097	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,585	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,642	-	-	-
(4) 未収収益	1,384	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	1,051	61	11
合計	24,709	1,051	61	11

(有価証券関係)

前事業年度(平成28年12月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(平成29年12月31日)

その他有価証券

	種類	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他 投資信託	3	3	0
合計		3	3	0

(退職給付関係)

前事業年度(自平成28年1月1日至平成28年12月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、平成21年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度(確定拠出年金制度及び確定給付年金制度)を承継しました。また、平成23年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の確定給付年金制度に移行しました。従って、平成23年1月1日以降、からの三つの制度を有しています。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:百万円)

	前事業年度 (自平成28年1月1日 至平成28年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,661
勤務費用	250
利息費用	11
数理計算上の差異の発生額	8
退職給付の支払額	168
退職給付債務の期末残高	1,745

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位:百万円)

	前事業年度 (自平成28年1月1日 至平成28年12月31日)
年金資産の期首残高	2,304
期待運用収益	27
数理計算上の差異の発生額	56
事業主からの拠出額	274
退職給付の支払額	168
年金資産の期末残高	2,381

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成28年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,685
年金資産	2,381
	696
非積立型制度の退職給付債務	60
未積立退職給付債務	635
未認識数理計算上の差異	174
未認識過去勤務費用	20
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	441
退職給付引当金	60
前払年金費用	501
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	441

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)
勤務費用	250
利息費用	11
期待運用収益	27
数理計算上の差異の費用処理額	39
過去勤務費用の処理額	6
確定給付制度に係る退職給付費用合計	188
特別退職金	163
合計	351

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	前事業年度 (平成28年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券73%、株式22%及びその他3%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)
割引率	0.5%
長期期待運用収益率	0.8%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、68百万円 でありました。

当事業年度（自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、平成21年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度（確定拠出年金制度及び 確定給付年金制度）を承継しました。また、平成23年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の 確定給付年金制度に移行しました。従って、平成23年1月1日以降、 から の三つの制度を有しています。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,745
勤務費用	268
利息費用	8
数理計算上の差異の発生額	20
退職給付の支払額	170
退職給付債務の期末残高	1,832

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
年金資産の期首残高	2,381
期待運用収益	19
数理計算上の差異の発生額	83
事業主からの拠出額	290
退職給付の支払額	153
年金資産の期末残高	2,621

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位:百万円)

	当事業年度 (平成29年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,776
年金資産	2,621
	845
非積立型制度の退職給付債務	55
未積立退職給付債務	789
未認識数理計算上の差異	242
未認識過去勤務費用	13
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	532
退職給付引当金	55
前払年金費用	588
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	532

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位:百万円)

	当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
勤務費用	268
利息費用	8
期待運用収益	19
数理計算上の差異の費用処理額	35
過去勤務費用の処理額	6
確定給付制度に係る退職給付費用合計	216
特別退職金	119
合計	335

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	当事業年度 (平成29年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券72%、株式23%及びその他5%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
割引率	0.4%
長期期待運用収益率	0.9%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、71百万円 でありました。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	196	206
賞与引当金	581	537
資産除去債務	79	80
資産調整勘定	24	4
未払事業税	55	74
早期退職慰労引当金	11	2
退職給付引当金	18	17
有形固定資産	5	4
その他	9	44
繰延税金資産合計	983	973
繰延税金負債		
退職給付引当金	153	180
資産除去債務に対応する除去費用	13	6
繰延税金負債合計	167	186
繰延税金資産の純額	815	786

(注) 前事業年度及び当事業年度における繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
流動資産 - 繰延税金資産	845	860
固定負債 - 繰延税金負債	29	74

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

	前事業年度 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
法定実効税率	33.1 %	30.9 %
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.3	2.1
損金不算入ののれん償却額	0.3	0.2
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.8	0.2
所得拡大促進税制による税額控除	-	1.8
その他	0.0	0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.5 %	32.0 %

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

当社事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該定期建物賃貸借契約上の賃貸借期間10年と見積り、割引率は1.5%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)	当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
期首残高	254	258
時の経過による調整額	3	3
資産除去債務の履行による減少額	-	-
期末残高	258	262

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 (平成28年12月31日)

該当事項はありません。

当事業年度 (平成29年12月31日)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	69	-	0	0
合計		69	-	0	0

(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

1. セグメント情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位:百万円)

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	3,977	9,036	10,533	23,546

(2) 地域ごとの情報

売上高

(単位:百万円)

日本	北米	その他	合計
12,127	9,200	2,218	23,546

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位:百万円)

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	4,735	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	2,815	投資運用業

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自平成29年1月1日至平成29年12月31日)

1. セグメント情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位:百万円)

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	5,202	8,890	12,257	26,350

(2) 地域ごとの情報

売上高

(単位:百万円)

日本	北米	その他	合計
13,186	10,831	2,332	26,350

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位:百万円)

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	4,719	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	3,512	投資運用業

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自平成28年1月1日至平成28年12月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 ニュー ヨーク州	13,889 百万 米ドル	投資 顧問業	(被所有) 間接 100	投資顧問 契約の 再委任等	運用受託報酬	4	未収収益	484
							受入手数料	4,730		
							委託調査費	377	未払費用	173
							事務委託費	630		
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	0	その他未払金	1,361

当事業年度（自平成29年1月1日至平成29年12月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 ニュー ヨーク州	14,286 百万 米ドル	投資 顧問業	(被所有) 間接 100	投資顧問 契約の 再委任等	運用受託報酬	48	未収収益	508
							受入手数料	4,670		
							委託調査費	438	未払費用	356
							事務委託費	824		
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	0	その他未払金	1,645

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

前事業年度（自平成28年1月1日至平成28年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自平成29年1月1日至平成29年12月31日）

該当事項はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自平成28年1月1日至平成28年12月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国 カリフォル ニア州	1,000 米ドル	投資 顧問業	なし	投資顧問 契約の 再委任等	受入手数料	2,815	未収収益	267
							委託調査費	40		
							事務委託費	0	未払費用	3
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国 デラウェア 州	87 百万 米ドル	投資 顧問業	なし	投資顧問 契約の 再委任等	受入手数料	425	未収収益	35
							委託調査費	1,556		
							事務委託費	81	未払費用	135

当事業年度 (自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	3,512	未収収益	296
							委託調査費	77	未払費用	17
							事務委託費	10		
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国デラウェア州	213百万米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	363	未収収益	28
							委託調査費	1,427	未払費用	129
							事務委託費	119	その他未払金	1

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 運用受託報酬については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (2) 受入手数料については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (3) 委託調査費については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (4) 事務委託費については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (5) 支払利息については、市場金利を勘案して決定しております。なお、担保は差し入れておりません。
- (6) 長期借入金の期末残高は劣後特約付借入金に係るものであります。

2. 親会社に関する注記

(1) 親会社情報

ブラックロック・インク(ニューヨーク証券取引所に上場)

ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク(非上場)

ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社(非上場)

(1株当たり情報)

項目	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)	当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
1株当たり純資産額	1,564,056 円 75 銭	1,469,634 円 10 銭
1株当たり当期純利益金額	326,685 円 49 銭	456,306 円 62 銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)	当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
当期純利益 (百万円)	3,318	4,786
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益 (百万円)	3,318	4,786
普通株式の期中平均株式数 (株)	10,158	10,490

独立監査人の監査報告書は、当事業年度(自 平成29年1月1日 至平成29年12月31日)を対象としております。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月28日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 星 知子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 中島 紀子

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているブラックロック・ジャパン株式会社の平成29年1月1日から平成29年12月31日までの第31期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の平成29年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

- (注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年3月14日

ブラックロック・ジャパン株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 辻村和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロックLifePathファンド2055の平成29年8月3日から平成30年2月2日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ブラックロックLifePathファンド2055の平成30年2月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年8月3日から平成30年2月2日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

ブラックロック・ジャパン株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）1． 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2． XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。