

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 2020年6月9日

【発行者名】 J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 大越 昇一

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内二丁目7番3号  
東京ビルディング

【事務連絡者氏名】 内藤 敏信  
（連絡場所）  
東京都千代田区丸の内二丁目7番3号  
東京ビルディング

【電話番号】 03 - 6736 - 2000

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 J P M グローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】 2兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

・【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2019年12月9日付で提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また記載事項の一部訂正を行うため、訂正届出書を提出いたします。

・【訂正の内容】

第一部【証券情報】

（４）発行（売出）価格

<訂正前>

（略）

HPアドレス：<https://www.jpmorganasset.co.jp/>

<訂正後>

（略）

HPアドレス：<https://www.jpmorgan.com/jp/am/>

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（１）ファンドの目的及び基本的性格

（二）ファンドの特色

マザーファンドの特色

<訂正前>

（略）

**G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド**

（a）（略）

（b）主要投資対象は、新興国\*1の現地通貨建てのソブリン債券です。

\*1 「新興国」とは、運用委託先が、国内経済が成長過程にあると判断する国をいいます。例えば、当マザーファンドの参考指標（J PモルガンG B I - エマージング・マーケット・グローバル\*2（円ベース））の構成国（2019年9月未現在、ブラジル、ハンガリー、マレーシア、メキシコ、ポーランド、南アフリカ、トルコ、インドネシア、ペルー、ロシア、コロンビア、タイ、フィリピン、チリ、アルゼンチン、ルーマニア、チェコ、ウルグアイおよびドミニカ共和国）が該当します。

（以下略）

<訂正後>

（略）

**G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド**

（a）（略）

（b）主要投資対象は、新興国\*1の現地通貨建てのソブリン債券です。

\*1 「新興国」とは、運用委託先が、国内経済が成長過程にあると判断する国をいいます。例えば、当マザーファンドの参考指標（J PモルガンG B I - エマージング・マーケット・グローバル\*2（円ベース））の構成国（2020年3月未現在、ブラジル、ハンガリー、マレーシア、メキシコ、ポーランド、南アフリカ、トルコ、インドネシア、ペルー、ロシア、コロンビア、タイ、フィリピン、チリ、ルーマニア、チェコ、ウルグアイ、ドミニカ共和国および中国）が該当します。

（以下略）

（３）ファンドの仕組み

（八）委託会社の概況

<訂正前>

資本金 2,218百万円（2019年10月末現在）

（略）

大株主の状況（2019年10月末現在）

（以下略）

< 訂正後 >

資本金 2,218百万円（2020年4月末現在）

（略）

大株主の状況（2020年4月末現在）

（以下略）

## 2【投資方針】

### （3）運用体制

< 訂正前 >

#### （イ）当ファンドの運用体制

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2019年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（略）

#### （ロ）マザーファンドの運用体制

マザーファンドの運用体制は以下のとおりです。

（略）

##### **G I M世界投資適格債券マザーファンド**

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2019年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

##### **G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド**

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2019年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

##### **G I M米国高利回り社債マザーファンド**

（略）

当マザーファンドは、J P M I M社のグローバル債券運用グループに所属する高利回り社債運用チーム（40名）が運用を担当します。同チームは運用チームと調査チームにより構成されています。

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2019年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（以下略）

< 訂正後 >

#### （イ）当ファンドの運用体制

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2020年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（略）

#### （ロ）マザーファンドの運用体制

マザーファンドの運用体制は以下のとおりです。

（略）

##### **G I M世界投資適格債券マザーファンド**

（略）

(注)前記の運用体制、組織名称等は、2020年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### **G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド**

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、2020年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### **G I M米国高利回り社債マザーファンド**

(略)

当マザーファンドは、J P M I M社のグローバル債券運用グループに所属する高利回り社債運用チーム(約40名)が運用を担当します。同チームは運用チームと調査チームにより構成されています。

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、2020年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(以下略)

## **3【投資リスク】**

### **(1) リスク要因**

原届出書「第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 3投資リスク(1)リスク要因」末尾に記載される参考情報について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

## 参考情報

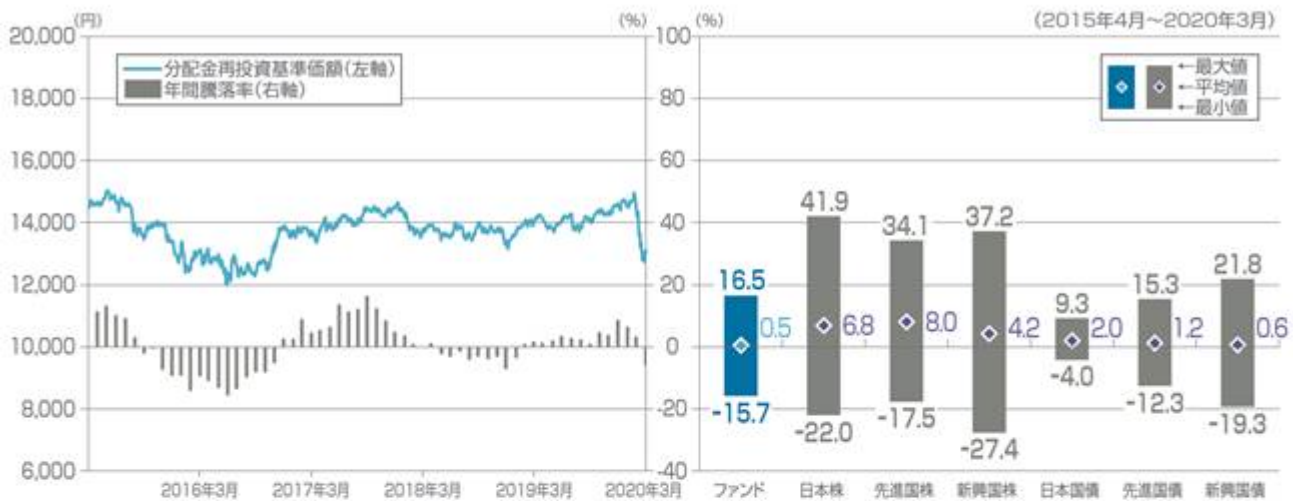
下記グラフは、ファンドの投資リスクをご理解いただくための情報の一つとしてご利用ください。

### <ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移>

2015年4月～2020年3月の5年間における、ファンドの分配金再投資基準価額(日次)と、年間騰落率(毎月末時点)の推移を示したものです。

### <ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較>

左のグラフと同じ期間における年間騰落率(毎月末時点)の平均と振れ幅を、ファンドと代表的な資産クラスとの間で比較したものです。



#### (ご注意)

- 分配金再投資基準価額は、信託報酬控除後のもので、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。
- ファンドの年間騰落率(毎月末時点)は、毎月末とその1年前における分配金再投資基準価額を対比して、その騰落率を算出したものです。(月末が休日の場合は直前の営業日を月末とみなします。設定から1年未満の時点では算出されません。)
- 代表的な資産クラスの年間騰落率(毎月末時点)は、毎月末とその1年前における下記の指数の値を対比して、その騰落率を算出したものです。(月末が休日の場合は直前の営業日を月末とみなします。)
- ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較は、上記の5年間の毎月末時点における年間騰落率を用いて、それらの平均・最大・最小をグラフにして比較したものです。
- ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率は、実際の基準価額およびそれに基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- ファンドは、代表的な資産クラスの全てに投資するものではありません。

#### ○代表的な資産クラスを表す指数

- 日本株・・・TOPIX(配当込み)
- 先進国株・・・MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)
- 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債・・・NOMURA-BPI(国債)
- 先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債・・・JPモルガンGBI-エマージング・マーケット・グローバル(円ベース)

(注)海外の指数は、為替ヘッジを行わないものとして算出されたものです。なお、MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、委託社にて円換算しています。

TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、ファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

MSCIコクサイ指数およびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が発表しています。同インデックスに関する情報の確実性および完結性をMSCI Inc.は何ら保証するものではありません。著作権はMSCI Inc.に帰属しています。MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、同社が発表したMSCIコクサイ指数(配当込み、米ドルベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)を委託社にて円ベースに換算したものです。

NOMURA-BPI(国債)は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。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。

JPモルガンGBI-エマージング・マーケット・グローバルは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが発表しており、著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しています。

## (2) 投資リスクに関する管理体制

### (ロ) マザーファンドにおけるリスク管理

#### 運用委託先におけるリスク管理

<訂正前>

(略)

(2019年9月末現在)

(以下略)

< 訂正後 >

（略）

(2020年3月末現在)

（以下略）

#### 4【手数料等及び税金】

(1) 申込手数料

< 訂正前 >

（略）

自動けいぞく投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

（略）

HPアドレス：<https://www.jpmorganasset.co.jp/>

（以下略）

< 訂正後 >

（略）

自動けいぞく投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

（略）

HPアドレス：<https://www.jpmorgan.com/jp/am/>

（以下略）

(5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

日本の居住者（法人を含みます。）である受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

なお、税法が改正された場合には、以下の内容が変更になることがあります。以下の税制は2019年10月末現在適用されるものです。

（略）

2020年1月1日以降の収益分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、収益分配時の税金が前記と異なる場合があります。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家（税務署等）に確認することをお勧めします。

< 訂正後 >

日本の居住者（法人を含みます。）である受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

なお、税法が改正された場合には、以下の内容が変更になることがあります。以下の税制は2020年4月末現在適用されるものです。

（略）

外国税額控除の適用となった場合には、収益分配時の税金が前記と異なる場合があります。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家（税務署等）に確認することをお勧めします。

#### 5【運用状況】

原届出書の「第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5 運用状況」について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

(1) 投資状況

(2020年4月10日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
G I M世界投資適格債券マザーファンド (適格機関投資家専用)	日本	654,454,416	34.60
G I M新興国現地通貨ソブリン・マザー ファンド(適格機関投資家専用)	日本	612,132,556	32.36
G I M米国高利回り社債マザーファンド (適格機関投資家専用)	日本	633,628,392	33.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	8,645,989	0.46
合計(純資産総額)		1,891,569,375	100.00

(注) 投資比率とは、当ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。投資比率は四捨五入です。

(参考) G I M世界投資適格債券マザーファンド(適格機関投資家専用)

(2020年4月10日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	1,435,244,983	16.19
	ドイツ	388,696,457	4.38
	イタリア	371,882,291	4.20
	フランス	52,929,581	0.60
	スペイン	169,584,886	1.91
	フィンランド	8,833,129	0.10
	ポルトガル	72,205,809	0.81
	イギリス	238,851,285	2.69
	オーストラリア	103,211,331	1.16
	ニュージーランド	23,029,773	0.26
	香港	240,380,565	2.71
	シンガポール	90,398,311	1.02
	中国	480,445,020	5.42
	小計	3,675,693,421	41.46
地方債証券	カナダ	133,344,063	1.50
	ドイツ	71,838,242	0.81
	オーストラリア	53,449,760	0.60
	小計	258,632,065	2.92
特殊債券	アメリカ	1,423,154,555	16.05
	フランス	48,702,660	0.55
	ルクセンブルク	62,196,304	0.70
	イギリス	145,555,275	1.64
	シンガポール	44,731,175	0.50

	小計	1,724,339,969	19.45
社債券	アメリカ	1,753,908,962	19.79
	カナダ	11,566,557	0.13
	ドイツ	46,088,162	0.52
	イタリア	11,604,150	0.13
	フランス	82,522,986	0.93
	オランダ	143,620,910	1.62
	スペイン	23,471,095	0.26
	アイルランド	37,138,713	0.42
	イギリス	770,955,871	8.70
	スイス	46,929,496	0.53
	オーストラリア	22,758,097	0.26
	シンガポール	44,732,549	0.50
	小計	2,995,297,548	33.79
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	210,788,881
合計(純資産総額)		8,864,751,884	100.00

(注) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。投資比率は四捨五入です。

(参考) G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)

(2020年4月10日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	284,624,563	3.70
	メキシコ	1,126,606,213	14.66
	ブラジル	1,115,663,817	14.52
	チリ	178,857,838	2.33
	コロンビア	357,938,089	4.66
	ペルー	84,994,635	1.11
	ルクセンブルク	23,429,645	0.30
	トルコ	195,003,647	2.54
	チェコ	113,490,109	1.48
	ハンガリー	195,765,065	2.55
	ポーランド	650,531,813	8.47
	ロシア	596,477,063	7.76
	ルーマニア	102,822,669	1.34
	マレーシア	458,739,595	5.97
	タイ	523,690,177	6.82
	フィリピン	22,221,427	0.29
	インドネシア	609,545,225	7.93
	エジプト	39,426,192	0.51
	南アフリカ	533,405,799	6.94
	セルビア	49,147,667	0.64
小計	7,262,381,248	94.51	
特殊債券	中国	114,005,284	1.48



社債券	アメリカ	22,077,446	0.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	285,716,097	3.72
合計(純資産総額)		7,684,180,075	100.00

(注1) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。投資比率は四捨五入です。

(注2) 上記の「国/地域」は、マザーファンドが保有する有価証券の発行地または上場取引所の国/地域を表しています。

具体的な投資対象については、「第1ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 (2) ファンドの特色」をご参照ください。

(参考) G I M米国高利回り社債マザーファンド(適格機関投資家専用)

(2020年4月10日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	3,339,045	0.53
新株予約権付社債券等	アメリカ	1,454,131	0.23
特殊債券	アメリカ	972,032	0.15
社債券	アメリカ	555,645,340	87.69
	カナダ	3,279,630	0.52
	ドイツ	3,322,814	0.52
	ルクセンブルク	1,981,841	0.31
	小計	564,229,625	89.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	63,624,688	10.04
合計(純資産総額)		633,619,521	100.00

(注1) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。投資比率は四捨五入です。

(注2) 上記の「国/地域」は、マザーファンドが保有する有価証券の発行地または上場取引所の国/地域を表しています。具体的な投資対象については、「第1ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 (2) ファンドの特色」をご参照ください。

(注3) 株式には優先証券を含みます。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(2020年4月10日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	G I M世界投資適格債券マザーファンド (適格機関投資家専用)	431,498,923	1.5173	654,755,858	1.5167	654,454,416	34.60
2	日本	親投資信託 受益証券	G I M米国高利回り社債マザーファンド (適格機関投資家専用)	303,229,514	2.1014	637,236,249	2.0896	633,628,392	33.50
3	日本	親投資信託 受益証券	G I M新興国現地通貨ソブリン・マザー ファンド(適格機関投資家専用)	445,868,276	1.4369	640,708,403	1.3729	612,132,556	32.36

(参考) G I M世界投資適格債券マザーファンド(適格機関投資家専用)

(2020年4月10日現在)

順位	国/地域	投資国/地域	種類	銘柄名	券面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	中国	中国	国債 証券	CHINA GOVT 2.94% OCT24	30,000,000	1,578.06	473,418,408	1,601.48	480,445,020	2.94	2024/10/17	5.42
2	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	FNCL 3.0% MAY50 TBA	3,040,000	11,423.35	347,269,953	11,478.71	348,953,069	3	2050/5/1	3.94
3	アメリカ	アメリカ	国債 証券	US T-BOND 3% FEB49	2,157,000	16,463.74	355,123,056	15,127.33	326,296,647	3	2049/2/15	3.68
4	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	FNCL 3.5% MAY50 TBA	2,210,000	11,500.14	254,153,169	11,522.84	254,654,811	3.5	2050/5/1	2.87

5	アメリカ	アメリカ	国債証券	US T-NOTE 1.5% FEB30	2,003,500	11,490.39	230,209,978	11,660.30	233,614,145	1.5	2030/2/15	2.64
6	イタリア	イタリア	国債証券	ITALY BTP 3% AUG29	1,648,000	13,529.93	222,973,297	13,338.52	219,818,955	3	2029/8/1	2.48
7	ドイツ	カナダ	国債証券	CANADA GOVT 2.25% JUN29	2,450,000	8,951.03	219,300,357	8,823.50	216,175,993	2.25	2029/6/1	2.44
8	アメリカ	アメリカ	国債証券	US T-NOTE 1.125% FEB22	1,930,000	11,039.02	213,053,171	11,042.15	213,113,649	1.125	2022/2/28	2.40
9	アメリカ	アメリカ	国債証券	US T-BOND 2.375% NOV49	1,334,800	14,833.49	197,997,545	13,550.79	180,876,003	2.375	2049/11/15	2.04
10	スペイン	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT 1.95% JUL30	1,180,000	13,844.07	163,360,120	13,198.35	155,740,594	1.95	2030/7/30	1.76
11	アメリカ	アメリカ	特殊債券	FN MA3990	1,346,422.28	10,958.74	147,551,038	11,350.12	152,820,586	2.5	2050/4/1	1.72
12	イギリス	イギリス	国債証券	UK GOVT 4.25% DEC40	582,541.22	23,696.50	138,041,932	23,003.36	134,004,073	4.25	2040/12/7	1.51
13	香港	中国	国債証券	CHINA GOVT 3.48% JUN27	8,000,000	1,633.43	130,674,643	1,619.73	129,578,875	3.48	2027/6/29	1.46
14	アメリカ	アメリカ	国債証券	US T-BOND 2% FEB50	959,500	13,339.56	127,993,121	12,593.66	120,836,251	2	2050/2/15	1.36
15	アメリカ	アメリカ	特殊債券	FN FM2399	975,671.86	11,468.12	111,891,315	11,498.82	112,190,768	3.5	2032/9/1	1.27
16	アメリカ	アメリカ	特殊債券	FN FM1747	889,135.47	11,900.39	105,810,656	11,822.80	105,120,795	3.5	2047/8/1	1.19
17	オーストラリア	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA 3% MAR47 150	1,223,000	9,485.01	116,001,687	8,439.19	103,211,331	3	2047/3/21	1.16
18	アメリカ	アメリカ	特殊債券	FG G18592	800,709.97	11,369.29	91,035,077	11,487.69	91,983,080	3	2031/3/1	1.04
19	イタリア	イタリア	国債証券	ITALY BTP 1.35% APR30	790,000	11,754.64	92,861,662	11,603.79	91,669,975	1.35	2030/4/1	1.03
20	シンガポール	シンガポール	国債証券	SINGAPOREGOVT 2.875%JUL29	1,020,000	8,906.73	90,848,645	8,862.57	90,398,311	2.875	2029/7/1	1.02
21	アメリカ	アメリカ	特殊債券	G2SF 3.0% MAY50 TBA	780,000	11,553.38	90,116,432	11,543.20	90,037,011	3	2050/5/1	1.02
22	カナダ	カナダ	地方債証券	ONTARIO 2.6%	1,090,000	8,324.03	90,731,999	8,203.02	89,412,999	2.6	2025/6/2	1.01
23	アメリカ	アメリカ	特殊債券	FNCL 2.5% MAY50 TBA	660,000	11,272.60	74,399,207	11,336.16	74,818,714	2.5	2050/5/1	0.84
24	アメリカ	アメリカ	特殊債券	FN BF0381	620,121.98	11,828.71	73,352,462	12,047.95	74,712,021	4	2059/4/1	0.84
25	アメリカ	アメリカ	特殊債券	FN BF0263	617,688.76	11,619.09	71,769,861	11,920.21	73,629,807	3.5	2058/5/1	0.83
26	アメリカ	ポーランド	国債証券	POLAND USD 3% MAR23	650,000	11,404.05	74,126,325	11,322.59	73,596,851	3	2023/3/17	0.83
27	ポルトガル	ポルトガル	国債証券	PORTUGAL OT 0.7% OCT27	609,667.96	11,836.58	72,163,876	11,843.46	72,205,809	0.7	2027/10/15	0.81
28	イギリス	オーストラリア	社債券	NAB 1.125% EMTN	500,000	13,683.80	68,419,021	13,621.25	68,106,293	1.125	2021/11/10	0.77
29	イギリス	オーストラリア	社債券	CBA 0.5% EMTN	550,000	12,410.20	68,256,135	11,912.00	65,516,054	0.5	2026/7/27	0.74
30	アメリカ	アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.375% MAY29	508,000	12,553.68	63,772,708	12,452.81	63,260,298	2.375	2029/5/15	0.71

## （参考）G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）

（2020年4月10日現在）

順位	国/地域	投資国/地域	種類	銘柄名	券面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN23 NTNF	15,848,000	2,408.19	381,651,001	2,435.04	385,905,416	10	2023/1/1	5.02
2	ポーランド	ポーランド	国債証券	POLAND 2.75% OCT29 1029	9,350,000	2,911.36	272,212,399	2,904.79	271,597,902	2.75	2029/10/25	3.53
3	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 8% DEC23	54,000,000	481.95	260,254,836	486.21	262,557,509	8	2023/12/7	3.42
4	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 1/L 6% AUG22 NTNB	3,166,000	7,798.79	246,909,905	7,717.47	244,335,323	6	2022/8/15	3.18
5	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 8.5% MAY29	44,110,000	512.50	226,067,355	498.60	219,935,230	8.5	2029/5/31	2.86
6	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 6.5% JUN22	45,980,000	458.30	210,727,389	463.38	213,062,814	6.5	2022/6/9	2.77
7	南アフリカ	南アフリカ	国債証券	S. AFRICA10.5% DEC26 R186	33,656,829	672.71	226,413,299	620.59	208,873,813	10.5	2026/12/21	2.72
8	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN27 NTNF	7,810,000	2,510.59	196,077,225	2,467.92	192,744,698	10	2027/1/1	2.51
9	アメリカ	ペルー	国債証券	PERU GOVT 6.9% AUG37 GDN	5,300,000	4,085.58	216,535,783	3,621.68	191,949,236	6.9	2037/8/12	2.50
10	ポーランド	ポーランド	国債証券	POLAND GOVT 5.75% SEP22	6,300,000	2,902.31	182,845,706	2,920.51	183,992,548	5.75	2022/9/23	2.39
11	コロンビア	コロンビア	国債証券	COLOMBIA TES 6% APR28	6,832,500,000	2.76	188,855,003	2.61	178,813,495	6	2028/4/28	2.33
12	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 7.5% JUN27	37,200,000	481.14	178,984,110	475.56	176,911,640	7.5	2027/6/3	2.30
13	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN25 NTNF	6,940,000	2,474.32	171,717,826	2,459.18	170,667,656	10	2025/1/1	2.22
14	インドネシア	インドネシア	国債証券	INDON 9% MAR29 FR71	22,542,000,000	0.76	172,269,662	0.71	161,570,079	9	2029/3/15	2.10
15	ロシア	ロシア	国債証券	RUSSIA 7.15% NOV25 6229	106,000,000	149.82	158,809,294	150.85	159,901,127	7.15	2025/11/12	2.08
16	タイ	タイ	国債証券	THAI GOVT 3.775% JUN32	37,062,000	439.03	162,714,588	409.33	151,706,907	3.775	2032/6/25	1.97
17	インドネシア	インドネシア	国債証券	INDON 8.25% MAY36 FR72	21,685,000,000	0.72	156,642,486	0.67	146,235,963	8.25	2036/5/15	1.90
18	コロンビア	コロンビア	国債証券	COLOMBIA TES 7% MAY22	4,800,000,000	2.94	141,473,285	2.92	140,532,688	7	2022/5/4	1.83
19	ロシア	ロシア	国債証券	RUSSIA 7% AUG23 6215	94,000,000	148.20	139,312,320	149.25	140,296,335	7	2023/8/16	1.83
20	チリ	チリ	国債証券	CHILE GOVT 4.5% MAR26	945,000,000	14.40	136,086,220	14.34	135,525,374	4.5	2026/3/1	1.76
21	タイ	タイ	国債証券	THAI GOVT 3.3% JUN38	30,000,000	451.65	135,495,840	396.23	118,871,604	3.3	2038/6/17	1.55
22	タイ	タイ	国債証券	THAI GOVT 2.875% DEC28	29,292,000	389.52	114,099,851	369.43	108,215,287	2.875	2028/12/17	1.41
23	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 8.5% NOV38	21,600,000	530.68	114,627,873	479.22	103,512,323	8.5	2038/11/18	1.35
24	ロシア	ロシア	国債証券	RUSSIA 8.15% FEB27 6207	64,550,000	162.23	104,722,822	159.64	103,050,951	8.15	2027/2/3	1.34
25	南アフリカ	南アフリカ	国債証券	S. AFRICA8.75% FEB48 2048	20,948,708	512.02	107,263,243	457.84	95,911,942	8.75	2048/2/28	1.25
26	ルーマニア	ルーマニア	国債証券	ROMANIA GOVT 3.65% SEP31	4,295,000	2,269.89	97,492,181	2,125.42	91,287,126	3.65	2031/9/24	1.19
27	ポーランド	ポーランド	国債証券	POLAND 3.25% JUL25 0725	3,150,000	2,849.17	89,749,104	2,890.62	91,054,812	3.25	2025/7/25	1.18
28	ハンガリー	ハンガリー	国債証券	HUNGARY 3% AUG30 30/A	245,070,000	34.61	84,826,820	34.49	84,536,029	3	2030/8/21	1.10
29	インドネシア	インドネシア	国債証券	INDON 8.75% MAY31 FR73	11,305,000,000	0.78	88,667,714	0.70	79,673,796	8.75	2031/5/15	1.04
30	ペルー	ペルー	国債証券	PERU GOVT 6.35% AUG28	2,210,000	3,850.73	85,101,304	3,586.93	79,271,226	6.35	2028/8/12	1.03

（注）上記の「国/地域」は、マザーファンドが保有する有価証券の発行地または上場取引所の国/地域を表しています。なお、「投資国/地域」は、「第1ファンドの状況 1 ファンドの性格（1）ファンドの目的及び基本的性格（2）ファンドの特色」の記載に基づき、どこの国への投資であるかを委託会社が分類し、記載したものです。そのため、有価証券の発行地と実質的な事業活動が行われている地域が異なる場合等には、上記の「国/地域」と「投資国/地域」における国/地域名が異なる場合があります。

## （参考）G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）

（2020年4月10日現在）

順位	国/ 地域	投資国/ 地域	種類	銘柄名	券面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS 5.25%	110,000	11,719.67	12,891,637	11,103.20	12,213,520	5.25	2024/6/1	1.93
2	アメリカ	アメリカ	社債券	SPRINT 7.625%	75,000	11,614.10	8,710,576	13,026.03	9,769,524	7.625	2025/2/15	1.54
3	アメリカ	アメリカ	社債券	SPRINT 7.625% 26	72,000	11,684.15	8,412,592	13,451.34	9,684,971	7.625	2026/3/1	1.53
4	アメリカ	アメリカ	社債券	ALLY FINANCIAL 5.75%	78,000	12,161.27	9,485,798	10,683.74	8,333,324	5.75	2025/11/20	1.32
5	アメリカ	アメリカ	社債券	DISH DBS 5.875% 24	80,000	11,078.54	8,862,836	10,266.36	8,213,088	5.875	2024/11/15	1.30
6	アメリカ	アメリカ	社債券	LAMAR MEDIA 5%	75,000	10,945.71	8,209,287	10,776.61	8,082,458	5	2023/5/1	1.28
7	アメリカ	アメリカ	社債券	JBS USA 5.75% REGS	67,000	11,305.37	7,574,603	10,833.84	7,258,678	5.75	2025/6/15	1.15
8	アメリカ	アメリカ	社債券	HCA 5.625%	62,000	12,387.07	7,679,989	11,443.58	7,095,022	5.625	2028/9/1	1.12
9	アメリカ	アメリカ	社債券	MGM RESORTS 5.75%	70,000	12,213.19	8,549,236	9,964.64	6,975,249	5.75	2025/6/15	1.10
10	アメリカ	アメリカ	社債券	CDW 4.25%	62,000	11,483.97	7,120,063	11,000.67	6,820,417	4.25	2028/4/1	1.08
11	アメリカ	アメリカ	社債券	NEWELL BRANDS MLT	55,000	11,290.44	6,209,744	11,436.95	6,290,327	4.7	2026/4/1	0.99
12	アメリカ	アメリカ	社債券	TENET HEALTH 5.125%	60,000	11,144.90	6,686,944	10,399.40	6,239,644	5.125	2025/5/1	0.98
13	アメリカ	アメリカ	社債券	DYNEGY 5.875%	48,000	11,078.11	5,317,493	11,127.74	5,341,318	5.875	2023/6/1	0.84
14	アメリカ	アメリカ	社債券	CLEAR CHNL 5.125% REGS	53,000	11,292.40	5,984,972	10,024.16	5,312,805	5.125	2027/8/15	0.84
15	アメリカ	アメリカ	社債券	SUMMIT MATE 5.125% REGS	52,000	11,182.37	5,814,836	10,210.20	5,309,309	5.125	2025/6/1	0.84
16	アメリカ	アメリカ	社債券	UNITED RENTALS 4.875%	45,000	11,398.95	5,129,531	10,504.43	4,726,995	4.875	2028/1/15	0.75
17	アメリカ	アメリカ	社債券	NIELSEN 5% REGS M	42,000	10,899.33	4,577,723	10,511.27	4,414,736	5	2022/4/15	0.70
18	アメリカ	アメリカ	社債券	CVR PARTNERS 9.25% REGS	49,000	11,362.77	5,567,761	8,976.50	4,398,489	9.25	2023/6/15	0.69
19	アメリカ	アメリカ	社債券	DISH DBS 6.75%	39,000	11,403.28	4,447,283	10,947.88	4,269,676	6.75	2021/6/1	0.67
20	アメリカ	アメリカ	社債券	MATTEL 6.75% MAY	38,000	11,454.44	4,352,689	10,854.05	4,124,539	6.75	2025/12/31	0.65
21	アメリカ	アメリカ	社債券	SEALED AIR 5.5% REGS	35,000	11,973.92	4,190,874	11,551.43	4,043,002	5.5	2025/9/15	0.64
22	アメリカ	アメリカ	社債券	ALBERTSONS 6.625%	35,000	11,377.98	3,982,295	11,178.90	3,912,616	6.625	2024/6/15	0.62
23	アメリカ	アメリカ	社債券	HCA INC 5.375%	33,000	12,023.12	3,967,631	11,612.14	3,832,008	5.375	2025/2/1	0.60
24	アメリカ	アメリカ	社債券	TEMPUR SEALY INTL 5.5%	38,000	11,438.80	4,346,746	9,903.16	3,763,204	5.5	2026/6/15	0.59
25	アメリカ	アメリカ	社債券	NETFLIX 5.875% T	29,000	12,039.20	3,491,369	12,221.99	3,544,378	5.875	2028/11/15	0.56
26	アメリカ	アメリカ	社債券	EMBARQ CORP 7.995%	30,000	11,462.15	3,438,647	11,520.48	3,456,144	7.995	2036/6/1	0.55
27	アメリカ	アメリカ	社債券	B&G FOODS 5.25%	33,000	11,187.91	3,692,012	10,466.63	3,453,990	5.25	2025/4/1	0.55
28	アメリカ	アメリカ	社債券	DELL INTL 7.125% REGS	30,000	11,426.31	3,427,894	11,255.47	3,376,641	7.125	2024/6/15	0.53
29	アメリカ	アメリカ	社債券	ARCONIC 5.9%	32,000	12,429.78	3,977,530	10,522.13	3,367,084	5.9	2027/2/1	0.53
30	アメリカ	アメリカ	社債券	REYNOLDS GP 5.125% REGS	30,000	11,144.90	3,343,472	11,164.89	3,349,467	5.125	2023/7/15	0.53

（注）上記の「国/地域」は、マザーファンドが保有する有価証券の発行地または上場取引所の国/地域を表しています。なお、「投資国/地域」は、「第1ファンドの状況 1 ファンドの性格（1）ファンドの目的及び基本的性格（2）ファンドの特色」の記載に基づき、どこへの投資であるかを委託会社が分類し、記載したものです。そのため、有価証券の発行地と実質的な事業活動が行われている地域が異なる場合等には、上記の「国/地域」と「投資国/地域」における国/地域名が異なる場合があります。

## 種類別および業種別投資比率

（2020年4月10日現在）

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	100.46

## （参考）G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）

（2020年4月10日現在）

種類	投資比率（％）
国債証券	41.46
地方債証券	2.92
特殊債券	19.45
社債券	33.79

## （参考）G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）

（2020年4月10日現在）

種類	投資比率（％）
国債証券	94.51
特殊債券	1.48
社債券	0.29

## （参考）G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）

（2020年4月10日現在）

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（％）
株式	外国	小売	0.53
新株予約権付社債券等	-		0.23
特殊債券	-		0.15
社債券	-		89.05

（注）株式には優先証券を含みます。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## (3) 運用実績

## 純資産の推移

2020年4月10日および同日前1年以内における各月末ならびに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額 (円) (分配落)	1口当たり 純資産額 (円) (分配付)
第8特定期間末	(2010年9月10日)	10,410	10,518	0.6308	0.6373
第9特定期間末	(2011年3月10日)	10,629	10,742	0.6123	0.6188
第10特定期間末	(2011年9月12日)	7,812	7,860	0.5617	0.5652
第11特定期間末	(2012年3月12日)	7,029	7,053	0.6008	0.6028
第12特定期間末	(2012年9月10日)	6,343	6,365	0.5752	0.5772
第13特定期間末	(2013年3月11日)	6,902	6,921	0.7210	0.7230
第14特定期間末	(2013年9月10日)	5,897	5,914	0.7028	0.7048
第15特定期間末	(2014年3月10日)	5,381	5,395	0.7456	0.7476
第16特定期間末	(2014年9月10日)	4,844	4,857	0.7728	0.7748
第17特定期間末	(2015年3月10日)	4,607	4,618	0.8115	0.8135
第18特定期間末	(2015年9月10日)	3,852	3,862	0.7529	0.7549
第19特定期間末	(2016年3月10日)	3,178	3,187	0.6947	0.6967
第20特定期間末	(2016年9月12日)	2,860	2,868	0.6627	0.6647
第21特定期間末	(2017年3月10日)	2,843	2,851	0.7196	0.7216
第22特定期間末	(2017年9月11日)	2,681	2,688	0.7183	0.7203
第23特定期間末	(2018年3月12日)	2,474	2,481	0.6943	0.6963
第24特定期間末	(2018年9月10日)	2,314	2,321	0.6652	0.6672
第25特定期間末	(2019年3月11日)	2,252	2,258	0.6737	0.6757
第26特定期間末	(2019年9月10日)	2,138	2,144	0.6720	0.6740
第27特定期間末	(2020年3月10日)	1,950	1,956	0.6360	0.6380
	2019年4月末日	2,266	-	0.6838	-
	2019年5月末日	2,175	-	0.6660	-
	2019年6月末日	2,199	-	0.6767	-
	2019年7月末日	2,186	-	0.6835	-
	2019年8月末日	2,116	-	0.6643	-
	2019年9月末日	2,134	-	0.6732	-
	2019年10月末日	2,161	-	0.6851	-
	2019年11月末日	2,142	-	0.6805	-
	2019年12月末日	2,166	-	0.6913	-
	2020年1月末日	2,113	-	0.6862	-
	2020年2月末日	2,088	-	0.6808	-
	2020年3月末日	1,870	-	0.6147	-
	2020年4月10日	1,891	1,897	0.6221	0.6241

(注) 純資産総額(分配付)および1口当たり純資産額(分配付)は特定期間末日のもので、2020年4月10日の純資産総額(分配付)および1口当たり純資産額(分配付)は第162期計算期間末日のもので。

## 分配の推移

期	1口当たり分配金(円)
第8特定期間	0.0390
第9特定期間	0.0390
第10特定期間	0.0240
第11特定期間	0.0120
第12特定期間	0.0120
第13特定期間	0.0120
第14特定期間	0.0120
第15特定期間	0.0120
第16特定期間	0.0120
第17特定期間	0.0120
第18特定期間	0.0120
第19特定期間	0.0120
第20特定期間	0.0120
第21特定期間	0.0120
第22特定期間	0.0120
第23特定期間	0.0120
第24特定期間	0.0120
第25特定期間	0.0120
第26特定期間	0.0120
第27特定期間	0.0120

## 収益率の推移

期	収益率(%)
第8特定期間	2.1
第9特定期間	3.2
第10特定期間	4.3
第11特定期間	9.1
第12特定期間	2.3
第13特定期間	27.4
第14特定期間	0.9
第15特定期間	7.8
第16特定期間	5.3
第17特定期間	6.6
第18特定期間	5.7
第19特定期間	6.1
第20特定期間	2.9
第21特定期間	10.4

第22特定期間	1.5
第23特定期間	1.7
第24特定期間	2.5
第25特定期間	3.1
第26特定期間	1.5
第27特定期間	3.6

（注）収益率とは特定期間末の基準価額（分配落）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落）（以下「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額に特定期間中の分配金累計額を加算して得た額を前特定期間末基準価額で除したものです。

#### （４）設定及び解約の実績

下記特定期間中の設定および解約の実績ならびに当該特定期間末の残存口数は次の通りです。

期	設定口数（口）	解約口数（口）	残存口数（口）
第8特定期間	3,748,350,254	2,134,077,668	16,504,284,677
第9特定期間	2,895,786,444	2,039,714,921	17,360,356,200
第10特定期間	1,401,999,188	4,853,363,384	13,908,992,004
第11特定期間	47,666,654	2,255,716,601	11,700,942,057
第12特定期間	54,040,516	728,123,682	11,026,858,891
第13特定期間	109,259,367	1,562,903,338	9,573,214,920
第14特定期間	191,750,829	1,373,783,379	8,391,182,370
第15特定期間	125,699,489	1,299,132,088	7,217,749,771
第16特定期間	113,447,876	1,061,668,357	6,269,529,290
第17特定期間	85,112,953	677,213,634	5,677,428,609
第18特定期間	60,027,255	620,984,481	5,116,471,383
第19特定期間	22,070,652	564,106,057	4,574,435,978
第20特定期間	18,742,534	277,109,214	4,316,069,298
第21特定期間	19,852,796	383,972,572	3,951,949,522
第22特定期間	25,207,680	244,519,523	3,732,637,679
第23特定期間	25,781,939	193,753,834	3,564,665,784
第24特定期間	32,228,730	116,723,306	3,480,171,208
第25特定期間	25,645,789	162,659,036	3,343,157,961
第26特定期間	23,037,099	183,783,766	3,182,411,294
第27特定期間	33,966,307	149,265,456	3,067,112,145

（注）設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。



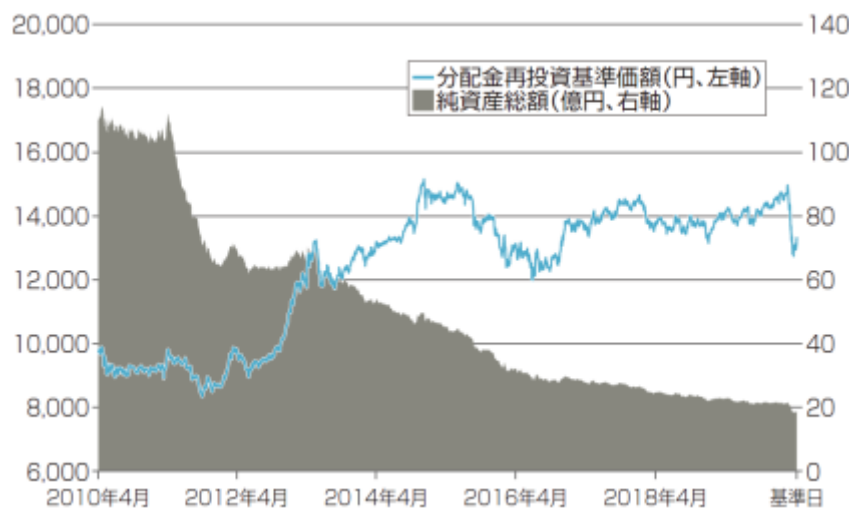
## &lt;参考情報&gt;

最新の運用実績は、委託会社ホームページ（<https://www.jpmorgan.com/jp/am/>）、または販売会社でご確認いただけます。  
過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準日	2020年4月10日	設定日	2006年9月29日
純資産総額	18億円	決算回数	年12回

## JPMグローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）

## 基準価額・純資産の推移



## 分配の推移

期	年月	円
158期	2019年12月	20
159期	2020年1月	20
160期	2020年2月	20
161期	2020年3月	20
162期	2020年4月	20
	設定来累計	5,515

\* 分配金は税引前1万口当たりの金額です。

\* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。

\* 分配金再投資基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## ポートフォリオの構成状況

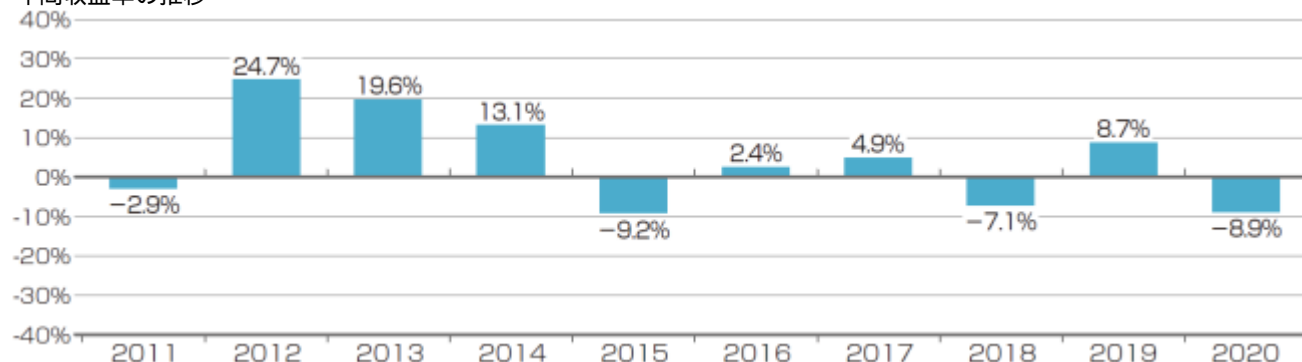
資産の種類	投資比率
GIM世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）	34.6%
GIM米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）	33.5%
GIM新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）	32.4%
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-0.5%
合計（純資産総額）	100.0%

\* 各比率はファンドの純資産総額に対する比率を記載しています。

## 通貨別構成状況

通貨	投資比率
米ドル	48.5%
ユーロ	8.1%
メキシコペソ	4.7%
ブラジルリアル	4.7%
オフショア元	3.3%
その他	25.7%

## 年間収益率の推移



\* 年間収益率(%) = { (年末営業日の基準価額 + その年に支払われた税引前の分配金) ÷ 前年末営業日の基準価額 - 1 } × 100

\* 2020年の年間収益率は前年末営業日から2020年4月10日までのものです。

\* ベンチマークは設定していません。

\* 当ページおよび次ページにおける「ファンド」は、JPMグローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）です。

上記において、金額は表示単位以下を切捨て、投資比率および収益率は表示単位以下を四捨五入して記載しています。

ファンドは各マザーファンドを通じて投資を行うため、各マザーファンドの投資銘柄をファンドが直接保有しているものとみなし、ファンドの純資産総額に対する投資比率として計算しています。

## 組入上位銘柄

## G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）

順位	銘柄名	種類	クーポン(%)	償還日	投資国/地域 <sup>*2</sup>	通貨	投資比率 <sup>*1</sup>
1	中国国債	国債証券	2.940	2024/10/17	中国	オフショア元	1.9%
2	ファニーメイ	特殊債券	3.000	2050/ 5 / 1	アメリカ	米ドル	1.4%
3	アメリカ国債	国債証券	3.000	2049/ 2 / 15	アメリカ	米ドル	1.3%
4	ファニーメイ	特殊債券	3.500	2050/ 5 / 1	アメリカ	米ドル	1.0%
5	アメリカ国債	国債証券	1.500	2030/ 2 / 15	アメリカ	米ドル	0.9%
6	イタリア国債	国債証券	3.000	2029/ 8 / 1	イタリア	ユーロ	0.9%
7	カナダ国債	国債証券	2.250	2029/ 6 / 1	カナダ	カナダドル	0.8%
8	アメリカ国債	国債証券	1.125	2022/ 2 / 28	アメリカ	米ドル	0.8%
9	アメリカ国債	国債証券	2.375	2049/11/15	アメリカ	米ドル	0.7%
10	スペイン国債	国債証券	1.950	2030/ 7 / 30	スペイン	ユーロ	0.6%

## G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）

順位	銘柄名	種類	クーポン(%)	償還日	投資国/地域 <sup>*2</sup>	通貨	投資比率 <sup>*1</sup>
1	ブラジル国債	国債証券	10.000	2023/ 1 / 1	ブラジル	ブラジルレアル	1.6%
2	ポーランド国債	国債証券	2.750	2029/10/25	ポーランド	ポーランドズロチ	1.1%
3	メキシコ国債	国債証券	8.000	2023/12/ 7	メキシコ	メキシコペソ	1.1%
4	ブラジル国債	国債証券	6.000	2022/ 8 / 15	ブラジル	ブラジルレアル	1.0%
5	メキシコ国債	国債証券	8.500	2029/ 5 / 31	メキシコ	メキシコペソ	0.9%
6	メキシコ国債	国債証券	6.500	2022/ 6 / 9	メキシコ	メキシコペソ	0.9%
7	南アフリカ国債	国債証券	10.500	2026/12/21	南アフリカ	南アフリカランド	0.9%
8	ブラジル国債	国債証券	10.000	2027/ 1 / 1	ブラジル	ブラジルレアル	0.8%
9	ペルー国債	国債証券	6.900	2037/ 8 / 12	ペルー	ペルーソル	0.8%
10	ポーランド国債	国債証券	5.750	2022/ 9 / 23	ポーランド	ポーランドズロチ	0.8%

## G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）

順位	銘柄名	種類	クーポン(%)	償還日	投資国/地域 <sup>*2</sup>	通貨	投資比率 <sup>*1</sup>
1	CSCホールディングス	社債券	5.250	2024/ 6 / 1	アメリカ	米ドル	0.6%
2	スプリント	社債券	7.625	2025/ 2 / 15	アメリカ	米ドル	0.5%
3	スプリント	社債券	7.625	2026/ 3 / 1	アメリカ	米ドル	0.5%
4	アライ・ファイナンシャル	社債券	5.750	2025/11/20	アメリカ	米ドル	0.4%
5	DISH DBS	社債券	5.875	2024/11/15	アメリカ	米ドル	0.4%
6	ラマー・メディア	社債券	5.000	2023/ 5 / 1	アメリカ	米ドル	0.4%
7	JBS USA LUX/JBS USAファイナンス	社債券	5.750	2025/ 6 / 15	アメリカ	米ドル	0.4%
8	HCA	社債券	5.625	2028/ 9 / 1	アメリカ	米ドル	0.4%
9	MGMリゾーツ・インターナショナル	社債券	5.750	2025/ 6 / 15	アメリカ	米ドル	0.4%
10	CDW/CDWファイナンス	社債券	4.250	2028/ 4 / 1	アメリカ	米ドル	0.4%

上記において、投資比率は表示単位以下を四捨五入して記載しています。

- 1 ファンドは各マザーファンドを通じて投資を行うため、各マザーファンドの投資銘柄をファンドが直接保有しているものとみなし、ファンドの純資産総額に対する投資比率として計算しています。
- 2 「投資国/地域」は、「第1ファンドの状況 1 ファンドの性格（1）ファンドの目的及び基本的性格（2）ファンドの特色」の記載に基づき、どこの国への投資であるかを委託会社が分類し、記載したものです。

**第2【管理及び運営】****1【申込（販売）手続等】**

申込取扱場所

&lt; 訂正前 &gt;

（略）

HPアドレス：<https://www.jpmorganasset.co.jp/>

&lt; 訂正後 &gt;

（略）

HPアドレス：<https://www.jpmorgan.com/jp/am/>**3【資産管理等の概要】**

&lt; 訂正前 &gt;

( 1 ) 資産の評価

（略）

HPアドレス：<https://www.jpmorganasset.co.jp/>

（略）

( 5 ) その他

（略）

運用報告書

（略）

HPアドレス：<https://www.jpmorganasset.co.jp/>

( 以下略 )

&lt; 訂正後 &gt;

( 1 ) 資産の評価

（略）

HPアドレス：<https://www.jpmorgan.com/jp/am/>

（略）

( 5 ) その他

（略）

運用報告書

（略）

HPアドレス：<https://www.jpmorgan.com/jp/am/>

### 第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況」について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

- 1．当ファンドの財務諸表は、「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）ならびに同規則第2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、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．当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- 3．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、第27特定期間（2019年9月11日から2020年3月10日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1 【財務諸表】

## 【JPMグローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 (2019年9月10日現在)	当期 (2020年3月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	2,147,424,103	1,959,644,748
未収入金	32,550	99
流動資産合計	2,147,456,653	1,959,644,847
資産合計	2,147,456,653	1,959,644,847
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	6,364,822	6,134,224
未払解約金	32,550	99
未払受託者報酬	87,514	91,692
未払委託者報酬	2,450,381	2,567,398
その他未払費用	34,995	36,666
流動負債合計	8,970,262	8,830,079
負債合計	8,970,262	8,830,079
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,318,241,294	1,306,712,145
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2 1,043,924,903	2 1,116,297,377
(分配準備積立金)	250,575,537	239,218,901
元本等合計	2,138,486,391	1,950,814,768
純資産合計	2,138,486,391	1,950,814,768
負債純資産合計	2,147,456,653	1,959,644,847

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	前期 (自 2019年 3月12日 至 2019年 9月10日)	当期 (自 2019年 9月11日 至 2020年 3月10日)
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	51,472,160	53,909,729
<b>営業収益合計</b>	<b>51,472,160</b>	<b>53,909,729</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	594,752	583,016
委託者報酬	<sup>1</sup> 16,653,059	<sup>1</sup> 16,324,466
その他費用	237,838	233,147
<b>営業費用合計</b>	<b>17,485,649</b>	<b>17,140,629</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>33,986,511</b>	<b>71,050,358</b>
経常利益又は経常損失( )	33,986,511	71,050,358
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>33,986,511</b>	<b>71,050,358</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	949,835	1,164,206
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>1,090,857,626</b>	<b>1,043,924,903</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	60,328,014	48,138,457
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	60,328,014	48,138,457
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,479,515	10,883,257
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,479,515	10,883,257
分配金	<sup>2</sup> 38,952,452	<sup>2</sup> 37,413,110
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>1,043,924,903</b>	<b>1,116,297,377</b>

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	当財務諸表対象期間
有価証券の評価基準および評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	前期 (2019年9月10日現在)	当期 (2020年3月10日現在)
1 期首元本額	3,343,157,961円	3,182,411,294円
期中追加設定元本額	23,037,099円	33,966,307円
期中一部解約元本額	183,783,766円	149,265,456円
2 元本の欠損	1,043,924,903円	1,116,297,377円
受益権の総数	3,182,411,294口	3,067,112,145口
1 口当たりの純資産額	0.6720円	0.6360円
(1万口当たりの純資産額)	(6,720円)	(6,360円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期 (自 2019年3月12日 至 2019年9月10日)	当期 (自 2019年9月11日 至 2020年3月10日)
1 信託財産の運用の指図に関する権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	G I M世界投資適格債券マザーファンド(適格機関投資家専用) 報酬対象期間の毎月末時点におけるベビーファンドの信託財産に属する当該マザーファンド受益証券の時価総額を平均した額に年率0.25%を乗じ、当該報酬対象期間の日数に応じて実日数に基づき日割り計算して得た金額 G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用) 報酬対象期間の毎月末時点におけるベビーファンドの信託財産に属する当該マザーファンド受益証券の時価総額を平均した額に年率0.35%を乗じ、当該報酬対象期間の日数に応じて実日数に基づき日割り計算して得た金額	G I M世界投資適格債券マザーファンド(適格機関投資家専用) 同左 G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用) 同左

	G I M米国高利回り社債マ ザーファンド(適格機関投資 家専用) 報酬対象期間の毎月末時 点におけるベビーファンド の信託財産に属する当該マ ザーファンド受益証券の時 価総額を平均した額に年率 0.35%を乗じ、当該報酬対 象期間の日数に応じて実日 数に基づき日割り計算して 得た金額 上記それぞれに算出した額の 合計額	G I M米国高利回り社債マ ザーファンド(適格機関投資 家専用) 同左 上記それぞれに算出した額の 合計額
2 分配金の計算過程		
	(自 2019年3月12日 至 2019年4月10日)	(自 2019年9月11日 至 2019年10月10日)
費用控除後の配当等収益額	8,245,634円	4,656,860円
費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	37,750,502円	38,077,972円
分配準備積立金額	256,863,584円	248,834,770円
当ファンドの分配対象収益額	302,859,720円	291,569,602円
当ファンドの期末残存口数	3,322,185,444口	3,167,809,905口
1万口当たり収益分配対象額	911.62円	920.41円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	6,644,370円	6,335,619円
	(自 2019年4月11日 至 2019年5月10日)	(自 2019年10月11日 至 2019年11月11日)
費用控除後の配当等収益額	5,296,116円	7,748,763円
費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	37,838,673円	38,467,491円
分配準備積立金額	256,280,138円	245,070,192円
当ファンドの分配対象収益額	299,414,927円	291,286,446円
当ファンドの期末残存口数	3,298,431,287口	3,148,698,245口
1万口当たり収益分配対象額	907.74円	925.10円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	6,596,862円	6,297,396円
	(自 2019年5月11日 至 2019年6月10日)	(自 2019年11月12日 至 2019年12月10日)
費用控除後の配当等収益額	5,498,480円	4,358,610円
費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	37,769,109円	38,879,903円
分配準備積立金額	252,214,231円	245,975,129円
当ファンドの分配対象収益額	295,481,820円	289,213,642円



当ファンドの期末残存口数	3,266,199,440口	3,147,092,411口
1万口当たり収益分配対象額	904.66円	918.98円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	6,532,398円	6,294,184円
	(自 2019年6月11日 至 2019年7月10日)	(自 2019年12月11日 至 2020年1月10日)
費用控除後の配当等収益額	12,464,561円	10,684,098円
費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	37,353,184円	38,559,369円
分配準備積立金額	246,766,310円	239,915,954円
当ファンドの分配対象収益額	296,584,055円	289,159,421円
当ファンドの期末残存口数	3,211,229,858口	3,097,294,523口
1万口当たり収益分配対象額	923.58円	933.58円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	6,422,459円	6,194,589円
	(自 2019年7月11日 至 2019年8月13日)	(自 2020年1月11日 至 2020年2月10日)
費用控除後の配当等収益額	5,558,746円	4,891,284円
費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	37,547,096円	38,648,635円
分配準備積立金額	251,236,020円	242,622,217円
当ファンドの分配対象収益額	294,341,862円	286,162,136円
当ファンドの期末残存口数	3,195,770,937口	3,078,549,226口
1万口当たり収益分配対象額	921.03円	929.53円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	6,391,541円	6,157,098円
	(自 2019年8月14日 至 2019年9月10日)	(自 2020年2月11日 至 2020年3月10日)
費用控除後の配当等収益額	7,817,634円	5,290,164円
費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	37,637,505円	38,916,920円
分配準備積立金額	249,122,725円	240,062,961円
当ファンドの分配対象収益額	294,577,864円	284,270,045円
当ファンドの期末残存口数	3,182,411,294口	3,067,112,145口
1万口当たり収益分配対象額	925.64円	926.83円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	6,364,822円	6,134,224円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する注記

	当財務諸表対象期間
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

2. 金融商品の内容およびそのリスク	<p>当ファンドが保有した主な金融商品は、以下に記載される各親投資信託受益証券であります。</p> <p>G I M世界投資適格債券マザーファンド(適格機関投資家専用)</p> <p>G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)</p> <p>G I M米国高利回り社債マザーファンド(適格機関投資家専用)</p> <p>各親投資信託の受益証券を主要投資対象として運用を行うため、各親投資信託受益証券と同様のリスクを伴います。各親投資信託受益証券には、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。当該リスクは結果的に当ファンドに影響を及ぼします。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>当ファンドで投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。</p> <p>(1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果(パフォーマンス)のモニターおよびリスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。更に、投資制限の管理を行います。</p> <p>(2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っています。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

	各特定期間末
1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額	<p>貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<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)有価証券以外の金融商品 有価証券以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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、異なる前提条件による場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（有価証券に関する注記）  
売買目的有価証券

種類	前期 (2019年9月10日現在)	当期 (2020年3月10日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた評価 差額（円）	最終計算期間の損益に含まれた評価 差額（円）
親投資信託受益証券	54,036,761	149,450,289
合計	54,036,761	149,450,289

（デリバティブ取引等に関する注記）  
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）  
該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表（2020年3月10日現在）

## (イ) 株式

該当事項はありません。

## (ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託 受益証券	日本円	G I M世界投資適格債券マザーファンド (適格機関投資家専用)	454,362,042	689,903,324	
		G I M新興国現地通貨ソブリン・マザー ファンド(適格機関投資家専用)	436,486,236	628,627,477	
		G I M米国高利回り社債マザーファンド (適格機関投資家専用)	304,900,341	641,113,947	
合計			1,195,748,619	1,959,644,748	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは「G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）」受益証券、「G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）」受益証券および「G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）」受益証券を主要投資対象としており、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、全て同親投資信託の受益証券であります。

尚、同親投資信託の状況は以下の通りであります。

「G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）」の状況

尚、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## （1）貸借対照表

（単位：円）

区分	注記 番号	(2019年9月10日現在)	(2020年3月10日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		1,141,498,148	358,123,931
コール・ローン		26,119,884	26,455,664
国債証券		4,609,864,433	4,616,312,057
地方債証券		152,547,091	213,113,250
特殊債券		1,700,770,841	924,000,864
社債券		2,957,851,261	2,677,540,401
派生商品評価勘定		69,505,207	500,709,726
未収入金		1,546,075,279	1,276,520,989
未収利息		55,474,010	38,428,998
前払費用		7,470,638	13,259,493
流動資産合計		12,267,176,792	10,644,465,373
資産合計		12,267,176,792	10,644,465,373
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		66,435,834	466,720,471
未払金		2,719,601,271	1,473,229,508
未払解約金		10,850	33
未払利息		67	72
流動負債合計		2,786,048,022	1,939,950,084
負債合計		2,786,048,022	1,939,950,084
純資産の部			
元本等			
元本	1	6,339,861,822	5,732,555,250
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,141,266,948	2,971,960,039
元本等合計		9,481,128,770	8,704,515,289
純資産合計		9,481,128,770	8,704,515,289
負債純資産合計		12,267,176,792	10,644,465,373

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

	当財務諸表対象期間
1. 有価証券の評価基準および評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券 個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(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、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の最終相場）で評価しております。</p> <p>当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該金融商品取引所等における気配相場で評価しております。</p> <p>(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（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供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。</p> <p>(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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準および評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>為替予約の評価は、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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条および第61条に従って処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区分	(2019年9月10日現在)	(2020年3月10日現在)
1期首元本額	6,713,371,944円	6,339,861,822円
期中追加設定元本額	32,921,843円	5,080,175円
期中解約元本額	406,431,965円	612,386,747円
元本の内訳（注）		
JPMグローバル債券3分散ファンド （毎月決算型）	483,704,489円	454,362,042円
GIM世界投資適格債券ファンドF （適格機関投資家専用）	5,856,157,333円	5,278,193,208円
合 計	6,339,861,822円	5,732,555,250円
受益権の総数	6,339,861,822口	5,732,555,250口
1口当たりの純資産額	1.4955円	1.5184円
（1万口当たりの純資産額）	(14,955円)	(15,184円)

（注）当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する注記

	当財務諸表対象期間
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容およびそのリスク	当ファンドが保有した主な金融商品は、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券およびデリバティブ取引であり、当ファンドで利用しているデリバティブ取引は、通貨関連では為替予約取引であります。当ファンドが保有した金融商品およびデリバティブ取引には、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。 なお、デリバティブ取引は、通貨関連では信託財産の効率的な運用に資する目的として利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドは運用を外部委託しておりますが、投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。 (1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターおよび外部委託先において運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果（パフォーマンス）のモニターを行います。さらに外部委託先のインベストメント・ダイレクターは、リスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。 (2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っています。 (3)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。

## 金融商品の時価等に関する事項

	各期末
1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませ 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。一部の 債券時価に関しては合理的に算定された価額を採用する場合があります。合 理的に算定された価額は発行体の格付けや債券の償還年限を基にした国債に 対する上乘せ金利、取引業者からの提示価格、流動性、将来発生しうる キャッシュフロー、その他個々の債券の特性等を考慮して価格提供会社が算 出した価格を利用しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、 時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価と しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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、異なる前提条件によった場合、当該価 額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	(2019年9月10日現在)	(2020年3月10日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	246,314,438	186,871,602
地方債証券	5,822,139	12,558,376
特殊債券	11,848,158	8,526,381
社債券	149,146,786	41,904,450
合計	413,131,521	249,860,809



## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## （通貨関連）

区分	種類	(2019年9月10日現在)				(2020年3月10日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場 取引 以外 の取 引	為替予約取引 買建								
	アメリカドル	1,448,906,235	-	1,468,119,968	19,213,733	3,219,683,592	-	3,023,519,673	196,163,919
	カナダドル	325,460,881	-	331,967,194	6,506,313	827,846,577	-	771,887,446	55,959,131
	メキシコペソ	-	-	-	-	66,137,875	-	57,150,985	8,986,890
	ユーロ	1,466,090,778	-	1,470,704,078	4,613,300	2,275,764,457	-	2,232,684,111	43,080,346
	英ポンド	328,248,164	-	337,703,682	9,455,518	503,426,326	-	475,279,599	28,146,727
	スイスフラン	161,461,012	-	161,099,987	361,025	382,884,858	-	373,807,212	9,077,646
	スウェーデンクロー ネ	78,664,316	-	79,453,601	789,285	292,165,412	-	279,979,334	12,186,078
	ノルウェークローネ	654,403,046	-	664,342,996	9,939,950	10,367,769	-	9,426,523	941,246
	デンマーククローネ	-	-	-	-	21,941,427	-	21,630,910	310,517
	チェココルナ	11,497,085	-	11,517,794	20,709	8,849,020	-	8,472,872	376,148
	ハンガリーフォリ ント	8,621,528	-	8,500,774	120,754	8,413,015	-	8,287,544	125,471
	ポーランドズロチ	-	-	-	-	43,070,873	-	41,647,337	1,423,536
	オーストラリアドル	487,263,002	-	499,029,055	11,766,053	476,903,714	-	450,855,096	26,048,618
	ニュージーランドド ル	126,738,974	-	128,196,936	1,457,962	669,328,744	-	624,456,191	44,872,553
	シンガポールドル	24,209,496	-	24,641,340	431,844	25,033,231	-	23,617,523	1,415,708
	タイバーツ	-	-	-	-	37,653,786	-	35,129,471	2,524,315
	イスラエル・シェケ ル	13,820,684	-	13,926,921	106,237	14,681,578	-	13,414,499	1,267,079
	オフショア元	77,331,824	-	77,956,892	625,068	505,720,550	-	481,264,749	24,455,801
	売建								
	アメリカドル	1,566,561,959	-	1,583,751,714	17,189,755	3,856,469,378	-	3,649,503,056	206,966,322
	カナダドル	354,180,195	-	361,003,007	6,822,812	1,101,826,263	-	1,009,553,329	92,272,934
	メキシコペソ	-	-	-	-	107,315,971	-	91,715,634	15,600,337
	ユーロ	1,649,187,867	-	1,662,813,251	13,625,384	1,450,657,731	-	1,426,097,494	24,560,237
	英ポンド	527,557,983	-	536,049,027	8,491,044	490,278,759	-	461,210,177	29,068,582
	スイスフラン	157,141,291	-	156,980,098	161,193	337,451,890	-	334,156,142	3,295,748
	スウェーデンクロー ネ	119,079,070	-	119,588,686	509,616	228,282,426	-	218,888,831	9,393,595
	ノルウェークローネ	210,548,841	-	215,213,397	4,664,556	-	-	-	-
	デンマーククローネ	20,448,608	-	20,538,974	90,366	-	-	-	-
	ポーランドズロチ	-	-	-	-	44,781,992	-	43,623,421	1,158,571
オーストラリアドル	424,753,577	-	434,108,352	9,354,775	457,238,203	-	426,994,507	30,243,696	
ニュージーランドド ル	130,507,595	-	130,584,396	76,801	640,045,878	-	602,949,044	37,096,834	
タイバーツ	3,723,337	-	3,777,455	54,118	-	-	-	-	
オフショア元	57,526,702	-	58,183,488	656,786	675,524,313	-	633,830,185	41,694,128	
合計		10,433,934,050	-	10,559,753,063	3,069,373	18,779,745,608	-	17,831,032,895	33,989,255

## （注）1．為替予約の時価の算定方法

- （1）対顧客先物売買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。  
為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物売買相場の仲値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。  
当該日の対顧客先物売買相場の仲値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。  
・当該日を越える対顧客先物売買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対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。  
・当該日を越える対顧客先物売買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売買相場の仲値により評価しております。
  - （2）対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値により評価しております。
- 2．換算において円未満の端数は切り捨てております。
  - 3．契約額等および時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表（2020年3月10日現在）

（イ）株式

該当事項はありません。

（ロ）株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	BERMUDA 4.75% FEB29 REGS		210,000.00	244,668.90	
		HUNGARY USD 5.375% MAR24		40,000.00	45,650.00	
		ITALY 2.375% OCT24		480,000.00	479,716.80	
		KUWAIT 2.75% MAR22 REGS		280,000.00	285,770.80	
		MEXICO USD 4.15% MAR27		210,000.00	225,502.20	
		POLAND USD 3% MAR23		650,000.00	682,500.00	
		SAUDI USD2.75%FEB32 REGS		420,000.00	413,439.60	
		US T-BOND 2.375% NOV49		1,400,000.00	1,917,125.00	
		US T-BOND 2% FEB50		680,000.00	866,150.00	
		US T-BOND 3.125% MAY48		106,000.00	162,088.90	
		US T-BOND 3% AUG48		75,000.00	112,699.21	
		US T-BOND 3% FEB48		172,500.00	256,775.68	
		US T-BOND 3% FEB49		2,157,000.00	3,269,708.65	
		US T-NOTE 1.125% FEB22		2,800,000.00	2,840,578.13	
		US T-NOTE 1.375% JAN25		1,800,000.00	1,873,828.12	
		US T-NOTE 1.5% FEB30		2,540,000.00	2,774,156.24	
		US T-NOTE 1.5% JAN27		360,000.00	382,106.25	
		US T-NOTE 1.625% DEC21		1,302,400.00	1,329,567.25	
		US T-NOTE 2.25% APR24		1,117,500.00	1,196,685.35	
		US T-NOTE 2.375% MAY29		553,000.00	640,615.93	
		US T-NOTE 2.625% JUN21		1,200,000.00	1,232,578.12	
	計	銘柄数：	21	18,553,400.00	21,231,911.13	
					(2,192,831,781)	
		組入時価比率：	25.2%		26.0%	
	カナダドル	CANADA GOVT 2.25% JUN29		2,450,000.00	2,827,128.50	
		CANADA GOVT 2% JUN28		320,000.00	357,603.20	
		CANADA GOVT 5% JUN37		460,000.00	781,655.00	
	計	銘柄数：	3	3,230,000.00	3,966,386.70	
					(300,017,489)	
		組入時価比率：	3.4%		3.6%	
	メキシコペソ	MEXICO GOVT 10% DEC24		5,500,000.00	6,271,265.00	
	計	銘柄数：	1	5,500,000.00	6,271,265.00	
					(31,168,187)	
		組入時価比率：	0.4%		0.4%	
	ユーロ	CYPRUS 2.375% SEP28 EMTN		344,000.00	393,742.40	
		FINLAND 1.375% APR47 30Y		60,000.00	85,498.80	
		FRANCE OAT 0% NOV29		320,000.00	332,134.40	
		FRANCE OAT 2% MAY48		540,000.00	806,814.00	
		FRANCE OAT 3.25% MAY45		264,800.00	469,702.24	
		GERMANY BUND 0% AUG29		1,540,000.00	1,673,841.40	
		GERMANY BUND 1.25% AUG48		280,000.00	428,386.00	
		INDNSA 1.45% SEP26		100,000.00	103,775.00	

		ITALY BTP 2.7% MAR47		2,000.00	2,204.28
		ITALY BTP 3.85% SEP49		336,000.00	451,530.24
		ITALY BTP 3% AUG29		3,592,000.00	4,098,148.72
		ITALY BTP 4.75% SEP44		52,000.00	77,200.76
		SAUDI EURO.75%JUL27 REGS		150,000.00	152,181.00
	計	銘柄数:	13	7,580,800.00	9,075,159.24
					(1,066,966,471)
		組入時価比率:	12.3%		12.7%
	英ポンド	UK GOVT 4.25% DEC40		582,541.22	1,019,662.67
		UK GOVT 4.25% DEC55		265,000.00	597,654.50
	計	銘柄数:	2	847,541.22	1,617,317.17
					(218,192,259)
		組入時価比率:	2.5%		2.6%
	ポーランドズロチ	POLAND GOVT 5.75% SEP22		650,000.00	723,352.50
	計	銘柄数:	1	650,000.00	723,352.50
					(19,631,786)
		組入時価比率:	0.2%		0.2%
	オーストラリアドル	AUSTRALIA 3% MAR47 150		1,003,000.00	1,414,631.20
	計	銘柄数:	1	1,003,000.00	1,414,631.20
					(96,180,775)
		組入時価比率:	1.1%		1.1%
	オフショア元	CHINA GOVT 2.94% OCT24		30,000,000.00	30,761,430.00
		CHINA GOVT 3.16% JUN23		500,000.00	512,195.00
		CHINA GOVT 3.38% NOV24		500,000.00	520,360.00
		CHINA GOVT 3.48% JUN27		8,000,000.00	8,490,880.00
		CHINA GOVT 4.1% DEC22		1,000,000.00	1,046,470.00
		CHINA GOVT 4.29% MAY29		3,000,000.00	3,397,590.00
		CHINA GOVT 4.5% MAY34		1,500,000.00	1,793,505.00
	計	銘柄数:	7	44,500,000.00	46,522,430.00
					(691,323,309)
		組入時価比率:	7.9%		8.2%
	小計				4,616,312,057
					(4,616,312,057)
地方債証券	カナダドル	HYDRO QUEBEC 6.5% 19		100,000.00	163,606.00
		ONTARIO 2.6%		1,090,000.00	1,169,679.00
		PROV BRCOL 2.8%		60,000.00	74,827.80
		QUEBEC 5%		250,000.00	397,322.50
	計	銘柄数:	4	1,500,000.00	1,805,435.30
					(136,563,126)
		組入時価比率:	1.6%		1.6%
	ユーロ	LAND NORDRHEIN2.15% EMTN		95,000.00	177,963.50
	計	銘柄数:	1	95,000.00	177,963.50
					(20,923,168)
		組入時価比率:	0.2%		0.2%
	オーストラリアドル	QUEENSLAND 3.5%		670,000.00	818,163.80
	計	銘柄数:	1	670,000.00	818,163.80
					(55,626,956)
		組入時価比率:	0.6%		0.7%
	小計				213,113,250
					(213,113,250)
特殊債券	アメリカドル	FG G18592		830,581.04	869,468.40
		FN BF0263		629,802.11	685,742.68

		FN BF0381		633,411.88	700,958.11
		FN FM1747		900,941.61	987,205.68
		FN FM2399		999,828.96	1,055,816.46
		FR SD8044		1,329,686.73	1,373,733.50
		PEMEX 6.35%		91,000.00	72,216.46
		SINOPEC 2.95% REGS		200,000.00	213,280.00
	計	銘柄数 :	8	5,615,252.33	5,958,421.29
					(615,385,750)
		組入時価比率 :	7.1%		7.3%
	ユーロ	BPIFRANCE 0.625%		300,000.00	318,084.00
		CA FRANCAISE 0.5% EMTN		100,000.00	106,085.00
		EFSF 0.95% EMTN		350,000.00	389,602.50
		EIB 0.875% EMTN		500,000.00	533,225.00
		ESM 1.125% EMTN		150,000.00	176,719.50
		EUROPEAN UNION3.375%EMTN		50,000.00	72,535.50
		KOREA HOUSING 0.01% REGS		380,000.00	384,126.80
		KOREA HOUSING 0.1% REGS		181,000.00	183,343.95
		KOREA HOUSING 0.75% REGS		100,000.00	103,249.00
		TEMASEK FIN 0.5% GMTN		190,000.00	199,317.60
	計	銘柄数 :	10	2,301,000.00	2,466,288.85
					(289,961,580)
		組入時価比率 :	3.3%		3.4%
	スウェーデンクローネ	EIB 1.25% EMTN		1,610,000.00	1,711,333.40
	計	銘柄数 :	1	1,610,000.00	1,711,333.40
					(18,653,534)
		組入時価比率 :	0.2%		0.2%
	小計				924,000,864
					(924,000,864)
社債券	アメリカドル	AB INBEV 4.439%		60,000.00	72,641.44
		AB INBEV 4.6%		40,000.00	46,420.00
		AB INBEV 4.7%		80,000.00	96,611.20
		AB INBEV 4.75%		80,000.00	93,962.40
		AB INBEV 4.9%		50,000.00	60,411.00
		ABBVIE 4.875%		135,000.00	168,640.65
		ACTAVIS 3.25%		90,000.00	93,938.40
		AIG 3.9%		55,000.00	60,477.45
		ALTRIA GROUP 2.85%		48,000.00	49,580.64
		AMER AIRLINE 3.2% AA		153,810.00	163,456.96
		AMERICAN TOWER 3.95%		30,000.00	34,296.00
		ANTHEM 5.1%		60,000.00	77,493.60
		APPLE 4.65%		50,000.00	69,071.00
		ARGENTUM VAR		200,000.00	216,950.00
		AT&T INC 4.3%		100,000.00	111,087.00
		BALTIMORE GAS&ELEC 2.8%		100,000.00	103,670.00
		BANK OF MONTREAL 3.3% E		120,000.00	128,874.00
		BAT 4.54%		60,000.00	62,670.00
		BBCMS 2017-C1 A4		250,000.00	279,067.50
		BCARD 2018-1X A		334,000.00	334,215.76
		BERKSHIRE 4.45% WI		65,000.00	87,018.75
		BK OF AMERICA 3.248% MTN		140,000.00	147,890.40
		BK OF AMERICA FLT		65,000.00	68,030.30

	BK OF AMERICA FLT MTN		150,000.00	153,681.00
	BK OF AMERICA FLT MTN R		95,000.00	101,326.05
	BK OF AMERICA FLT MTN T		90,000.00	96,584.40
	BNSF 3.55%		19,000.00	22,000.21
	BNSF 4.15%		3,000.00	3,838.80
	BOEING CO 3.5%		25,000.00	27,260.00
	BOSTON SCIENTIFIC 4.7%		40,000.00	54,773.20
	BOSTON SCIENTIFIC 4%		100,000.00	117,162.00
	BP CAPITAL 3%		40,000.00	40,282.00
	BPCE 2.75% REGS		250,000.00	260,202.50
	BRISTOL-MYERS 2.9% REGS		127,000.00	133,121.40
	BRISTOL-MYERS 3.4% REGS		80,000.00	90,903.20
	BRISTOL-MYERS 4.25% REGS		40,000.00	54,091.20
	BX 2020-BXLX A		185,000.00	184,593.49
	CAPITAL ONE 3.75%		20,000.00	22,365.00
	CGCMT 2016-P6 A5		250,000.00	277,972.50
	CIBC 3.1%		135,000.00	143,586.00
	CITIGROUP 4.65%		30,000.00	39,314.10
	CITIGROUP FLT		240,000.00	263,606.40
	CITIGROUP FLT V		340,000.00	348,343.60
	CLEVELAND 3.5% REGS		160,000.00	181,520.00
	CMS ENERGY 2.95%		35,000.00	36,944.95
	COMCAST 3.9%		45,000.00	53,359.65
	COMCAST 3.95%		50,000.00	55,801.50
	COMCAST 4%		80,000.00	98,736.00
	COMCAST CORP 4.45%		110,000.00	145,519.00
	COMCAST CORP 4.6%		50,000.00	69,354.00
	CONSTELLATION BR 4.5%		25,000.00	29,831.00
	COX COMMS 3.35% REGS		170,000.00	180,341.10
	CSX 3.25%		45,000.00	48,997.35
	CVS HEALTH 3.25%		50,000.00	52,624.50
	CVS HEALTH 3%		40,000.00	41,532.80
	CVS HEALTH 4.3%		119,000.00	133,804.79
	DBS BANK 3.3% REGS		400,000.00	416,092.00
	EMERA US FIN 4.75%		65,000.00	85,108.20
	ENTERGY 2.95%		45,000.00	48,501.90
	ENTERGY LOUISIANA 4.95%		49,000.00	55,589.03
	ENTERGY MISSISSIPPI 2.85%		80,000.00	87,951.20
	EPPLP 2.8%		60,000.00	62,999.40
	EXELON 3.4%		325,000.00	337,184.25
	FIRSTENERGY 2.65%		45,000.00	46,537.79
	FIRSTENERGY 3.9% B		125,000.00	140,107.50
	FORTIS 3.055%		96,000.00	104,521.92
	GE 3.1% GMTN		168,000.00	173,345.76
	GE 4.125%		2,000.00	2,207.78
	GE CAPITAL 4.418%		210,000.00	235,378.50
	GM 3.95%		30,000.00	31,454.40
	GM 5.15%		30,000.00	27,996.00
	GM 5.65%		105,000.00	114,425.85
	GOLDMAN SACHS 3.5%		270,000.00	295,906.50
	GOLDMAN SACHS 3.85%		175,000.00	188,870.50

	GOLDMAN SACHS FLT		45,000.00	46,526.85
	GSK 3%		105,000.00	111,779.85
	GSMS 2017-GS5 A4		125,000.00	138,036.25
	GSMS 2020-GS45 A5		134,000.00	143,696.24
	HALLIBURTON 5%		45,000.00	38,087.77
	HSBC HLDGS VAR		270,000.00	281,264.40
	KEURIG DR PEPPER 2.55%		51,000.00	52,186.77
	KEURIG DR PEPPER 3.43%		90,000.00	99,033.30
	KEURIG DR PEPPER 4.417%		19,000.00	21,070.81
	KIMCO REALITY 3.125%		265,000.00	276,010.75
	KIMCO REALITY 3.4%		45,000.00	47,294.55
	KROGER 3.875%		75,000.00	81,462.90
	M STANLEY FLT		330,000.00	353,057.10
	MPLX 4.5%		35,000.00	29,464.07
	MSAC 2004-SD2 A		111,357.17	111,285.12
	NATL RURAL UTIL 4.3%		10,000.00	14,235.10
	NEXTERA ENERGY 2.9%		220,000.00	226,045.60
	NEXTERA ENERGY 3.15%		40,000.00	42,627.20
	NISOURCE 2.95%		90,000.00	95,271.30
	NISOURCE 5.65%		20,000.00	27,509.20
	NOBLE ENERGY 3.9%		42,000.00	44,960.58
	NOBLE ENERGY 5.25%		50,000.00	54,340.00
	NORFOLK SOUTHERN 3.942%		75,000.00	89,365.50
	OCCIDENTAL PETRO 3.5%		45,000.00	45,931.05
	OCCIDENTAL PETRO 4.4%		50,000.00	31,813.50
	ORACLE 4%		50,000.00	62,647.00
	PENAR 2018-2X A1		333,000.00	333,230.43
	PEPSICO 3.375%		35,000.00	41,655.25
	PFIZER 3.45%		15,000.00	17,024.85
	PFIZER 4%		30,000.00	38,644.20
	PHILIP MORRIS 3.875%		30,000.00	32,784.30
	PHILLIPS 66 4.875%		10,000.00	12,069.70
	RBS FLT		250,000.00	258,565.00
	RBS FLT 25		200,000.00	212,960.00
	S CALIF EDISON 3.6% C		50,000.00	55,658.10
	SCHLUMBERGER 3.9% REGS		175,000.00	182,358.75
	SEMPRA ENERGY 3.8%		20,000.00	23,252.00
	SHELL 3.125%		40,000.00	44,112.00
	SHIRE ACQ 3.2%		140,000.00	148,499.40
	SPECTRA ENERGY 4.5%		40,000.00	43,187.64
	SUNOCO LOGISTICS 5.3%		110,000.00	115,790.40
	SWEPKO 3.9% J		15,000.00	18,249.11
	TOTAL 3.461%		40,000.00	47,012.00
	UBS FLT REGS		200,000.00	206,790.00
	UNION ELECTRIC 3.5%		15,000.00	16,938.90
	UNION PACIFIC 3.15%		55,000.00	58,304.40
	UNION PACIFIC 3.55% MTN		30,000.00	34,262.70
	UNITED AIR 3.1% AA		156,255.13	165,317.92
	UNITED TECH 3.95%		4,000.00	4,566.36
	UNITED TECH 4.125%		80,000.00	95,573.60
	VENTAS 4.375%		24,000.00	28,300.01

		VERIZON 2.625%		80,000.00	84,400.00
		VERIZON 4.272%		195,000.00	238,759.95
		VERIZON COMMS 4.329%		75,000.00	88,962.75
		VODAFONE 4.125%		35,000.00	38,719.45
		VODAFONE 4.25%		20,000.00	22,783.80
		VODAFONE 5%		75,000.00	92,251.50
		WELLS FARGO 3.75% MTN		40,000.00	42,432.40
		WELLS FARGO 5.375%		125,000.00	167,020.00
		WELLS FARGO FLT BKNT		490,000.00	492,944.90
		WESTPAC 2% REGS		200,000.00	210,598.00
		WESTPAC VAR EMTN		90,000.00	100,607.40
		WFCM 2017-RC1 A4		250,000.00	277,290.00
	計	銘柄数：	137	14,093,422.30	15,300,906.55
					(1,580,277,628)
		組入時価比率：	18.2%		18.7%
	ユ-口	ABN AMRO 6.375% EMTN		200,000.00	213,234.00
		ABN AMRO BANK 1.125%		100,000.00	122,902.00
		ABN AMRO BANK VAR EMTN		200,000.00	201,256.00
		AIB GRP VAR EMTN		215,000.00	211,329.95
		AMERICAN TOWER 1.375%		140,000.00	146,391.00
		ANZ BANK 0.45% EMTN		200,000.00	205,994.00
		APPLE 1.375%		100,000.00	110,630.00
		ASB FIN 0.625% EMTN		150,000.00	156,220.50
		ASB FIN 0.75% EMTN		430,000.00	453,211.40
		BANCO BILBAO VAR GMTN		100,000.00	101,809.00
		BANCO SANTANDER 0.25%		100,000.00	104,352.00
		BANCO SANTANDER3.25% DIP		200,000.00	215,196.00
		BAYER 2.125%		100,000.00	109,010.00
		BK OF AMERICA FLT EMTN		149,000.00	153,404.44
		BP CAPITAL 2.972% EMTN		100,000.00	113,139.00
		CBA 0.375% EMTN		111,000.00	113,608.50
		CBA 0.5% EMTN		550,000.00	575,564.00
		CIBC 0.04%		100,000.00	102,444.00
		EDP FIN 1.5% EMTN		161,000.00	172,754.61
		ENEL 1.125% EMTN		136,000.00	142,204.32
		GE 1.875%		100,000.00	105,944.00
		HEATHROW 1.5% EMTN		154,000.00	156,460.92
		ING GRP VAR EMTN		300,000.00	320,424.00
		LIB MUTUAL 1.75% REGS		114,000.00	119,163.06
		LLOYDS BK 0.125% EMTN		100,000.00	102,164.00
		M STANLEY 1.875% GMTN		200,000.00	214,280.00
		MEDTRONIC 1%		100,000.00	102,035.00
		MMB SCF 0.05% EMTN		100,000.00	101,353.00
		MONTE DEI PASCHI 0.875%		100,000.00	103,273.00
		MOTABILITY 0.875% EMTN		122,000.00	126,937.34
		NATIONWIDE 0.05% EMTN		100,000.00	101,524.00
		NATIONWIDE 0.625% EMTN		180,000.00	191,120.40
		NATL BK GREECE 2.75%EMTN		190,000.00	193,146.40
		NIBC BANK 0.01% EMTN		200,000.00	202,786.00
		NIBC BANK 0.5% EMTN		100,000.00	105,014.00
		NORTEGAS 2.065% EMTN		100,000.00	108,806.00

		SANTANDER UK 0.05% GMTN		143,000.00	145,817.10
		SEB VAR 26 S.289		105,000.00	107,460.15
		SIKA 0.875%		100,000.00	102,766.00
		SKY 2.25% GMTN		100,000.00	111,528.00
		TOTAL 1.375% EMTN		100,000.00	106,847.00
		TRANSURBAN FIN 2% EMTN		100,000.00	109,262.00
		VOLKSWAGEN 2.625%		60,000.00	63,797.40
		WESTPAC 0.5% GMTN		190,000.00	196,530.30
	計	銘柄数 :	44	6,700,000.00	7,023,093.79
					(825,705,136)
		組入時価比率 :	9.5%		9.8%
	英ポンド	BSKY UK2 A		172,612.77	172,672.14
		CENTRICA 4.375% EMTN		100,000.00	118,551.00
		EVERSHOLT 6.359% EMTN		100,000.00	123,702.00
		FSQ 2020-1X A		111,000.00	110,594.40
		HEATHROW 6.75% EMTN		100,000.00	130,591.00
		HSBC HLDGS 5.75% EMTN		100,000.00	121,464.00
		LAN 2020-1X 2A		146,000.00	145,808.01
		LLOYDS BK 9.625%		200,000.00	245,874.00
		LONDON & QUADRANT 3.125%		140,000.00	169,041.60
		NAB 1.125% EMTN		500,000.00	505,385.00
	計	銘柄数 :	10	1,669,612.77	1,843,683.15
					(248,731,293)
		組入時価比率 :	2.9%		3.0%
	スウェーデンクローネ	STADSHYPOTEK 1.5% 1587		2,000,000.00	2,094,160.00
	計	銘柄数 :	1	2,000,000.00	2,094,160.00
					(22,826,344)
		組入時価比率 :	0.3%		0.3%
	小計				2,677,540,401
					(2,677,540,401)
	合計				8,430,966,572
					(8,430,966,572)

(注) 各通貨計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注) 小計・合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各通貨計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表 該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

当表に記載すべき内容は、「デリバティブ取引等に関する注記 取引の時価等に関する事項」に開示しておりますので、記載を省略しております。



「G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)」の状況  
尚、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

区分	注記 番号	(2019年9月10日現在)	(2020年3月10日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		403,340,941	440,899,265
コール・ローン		3,444,981	15,445,918
国債証券		9,392,251,419	8,087,268,295
特殊債券		51,616,452	108,780,574
社債券		28,210,609	24,502,255
派生商品評価勘定		24,493,694	223,447,442
未収入金		266,389,188	199,471,877
未収利息		100,627,731	93,575,590
前払費用		22,282,265	18,929,963
差入委託証拠金		3,208,015	3,064,986
流動資産合計		10,295,865,295	9,215,386,165
資産合計		10,295,865,295	9,215,386,165
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		28,935,770	171,209,959
未払金		235,975,746	325,094,602
未払解約金		21,281,972	7,975,242
未払利息		8	42
流動負債合計		286,193,496	504,279,845
負債合計		286,193,496	504,279,845
純資産の部			
元本等			
元本	1	6,600,266,310	6,048,635,455
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		3,409,405,489	2,662,470,865
元本等合計		10,009,671,799	8,711,106,320
純資産合計		10,009,671,799	8,711,106,320
負債純資産合計		10,295,865,295	9,215,386,165

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

	当財務諸表対象期間
1. 有価証券の評価基準および評価方法	<p>国債証券、特殊債券および社債券 個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(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、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の最終相場）で評価しております。</p> <p>当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該金融商品取引所等における気配相場で評価しております。</p> <p>(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（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供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。</p> <p>(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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準および評価方法	<p>(1)デリバティブ取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として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最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 為替予約の評価は、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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条および第61条に従って処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区分	(2019年9月10日現在)	(2020年3月10日現在)
1期首元本額	6,871,292,248円	6,600,266,310円
期中追加設定元本額	548,885,553円	482,283,737円
期中解約元本額	819,911,491円	1,033,914,592円
元本の内訳（注）		
JPMグローバル債券3分散ファンド （毎月決算型）	464,601,790円	436,486,236円
GIM新興国現地通貨ソブリン・ファン ドF（適格機関投資家専用）	2,386,533,357円	2,328,521,037円
JPM新興国毎月決算ファンド	3,677,727,327円	3,194,038,412円
JPM新興国年1回決算ファンド	71,403,836円	89,589,770円
合計	6,600,266,310円	6,048,635,455円
受益権の総数	6,600,266,310口	6,048,635,455口
1口当たりの純資産額 （1万口当たりの純資産額）	1.5166円 (15,166円)	1.4402円 (14,402円)

（注）当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する注記

	当財務諸表対象期間
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容およびそのリスク	当ファンドが保有した主な金融商品は、国債証券、特殊債券、社債券およびデリバティブ取引であり、当ファンドで利用しているデリバティブ取引は、債券関連では債券先物取引、通貨関連では為替予約取引、金利関連では金利先物取引であります。当ファンドが保有した金融商品およびデリバティブ取引には、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。 なお、デリバティブ取引は、債券関連では将来の債券の価格変動リスクを回避し、通貨関連では信託財産の効率的な運用に資する目的、金利関連では金利変動リスクを回避し、効率的な運用に資することを目的として利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドは運用を外部委託しておりますが、投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。 (1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターおよび外部委託先において運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果（パフォーマンス）のモニターを行います。さらに外部委託先のインベストメント・ダイレクターは、リスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。 (2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っています。 (3)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。

## 金融商品の時価等に関する事項

	各期末
1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませ 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。一部の 債券時価に関しては合理的に算定された価額を採用する場合があります。合 理的に算定された価額は発行体の格付けや債券の償還年限を基にした国債に 対する上乘せ金利、取引業者からの提示価格、流動性、将来発生しうる キャッシュフロー、その他個々の債券の特性等を考慮して価格提供会社が算 出した価格を利用しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、 時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価と しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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、異なる前提条件によった場合、当該価 額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	(2019年9月10日現在)	(2020年3月10日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	414,367,120	129,501,910
特殊債券	70,187	2,069,953
社債券	552,137	536,502
合計	414,849,070	132,108,365

(デリバティブ取引等に関する注記)  
取引の時価等に関する事項  
(通貨関連)

区分	種類	(2019年9月10日現在)				(2020年3月10日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場 取引 以外 の取 引	為替予約取引 買建								
	アメリカドル	971,271,901	-	975,243,989	3,972,088	1,731,294,414	-	1,651,590,648	79,703,766
	メキシコペソ	109,138,277	-	111,418,623	2,280,346	54,750,025	-	46,249,556	8,500,469
	トルコリラ	107,251,837	-	108,191,166	939,329	32,474,112	-	30,215,817	2,258,295
	チェココルナ	92,884,930	-	93,052,240	167,310	231,118,191	-	221,751,717	9,366,474
	ハンガリーフォリント	163,928,277	-	162,180,039	1,748,238	79,177,841	-	77,588,905	1,588,936
	ポーランドズロチ	576,786,268	-	582,284,761	5,498,493	758,656,104	-	740,506,334	18,149,770
	タイバーツ	15,329,115	-	15,445,191	116,076	156,392,740	-	148,767,161	7,625,579
	南アフリカランド	177,200,848	-	184,704,753	7,503,905	251,552,187	-	225,998,497	25,553,690
	オフショア元	-	-	-	-	190,062,032	-	180,211,108	9,850,924
	売建								
	アメリカドル	1,267,519,552	-	1,280,327,698	12,808,146	1,754,183,232	-	1,665,089,176	89,094,056
	メキシコペソ	320,962,537	-	322,361,221	1,398,684	470,727,402	-	409,624,630	61,102,772
	トルコリラ	72,633,167	-	71,289,530	1,343,637	16,295,242	-	15,523,264	771,978
	チェココルナ	45,900,381	-	46,030,766	130,385	-	-	-	-
	ハンガリーフォリント	50,054,611	-	50,471,016	416,405	190,589,965	-	188,516,474	2,073,491
	ポーランドズロチ	101,713,835	-	102,492,100	778,265	365,649,445	-	362,088,817	3,560,628
	タイバーツ	169,687,654	-	171,970,041	2,282,387	212,469,360	-	197,944,001	14,525,359
	南アフリカランド	210,319,716	-	217,020,466	6,700,750	369,672,832	-	325,462,518	44,210,314
オフショア元	-	-	-	-	105,890,168	-	106,393,380	503,212	
合計		4,452,582,906	-	4,494,483,600	4,442,076	6,970,955,292	-	6,593,522,003	52,237,483

(注) 1. 為替予約の時価の算定方法

- (1) 対顧客先物売買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。  
為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物売買相場の仲値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。  
当該日の対顧客先物売買相場の仲値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。  
・当該日を越える対顧客先物売買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対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。  
・当該日を越える対顧客先物売買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売買相場の仲値により評価しております。
- (2) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値により評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。  
3. 契約額等および時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表（2020年3月10日現在）

## (イ) 株式

該当事項はありません。

## (ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考	
国債証券	メキシコペソ	MEXICO GOVT 10% DEC24		1,036,600.00	1,181,962.41		
		MEXICO GOVT 10% NOV36		3,307,300.00	4,338,648.43		
		MEXICO GOVT 5.75% MAR26		15,000,000.00	14,311,650.00		
		MEXICO GOVT 6.5% JUN22		45,980,000.00	46,010,346.80		
		MEXICO GOVT 7.5% JUN27		74,600,000.00	78,371,776.00		
		MEXICO GOVT 7.75% MAY31		7,800,000.00	8,412,768.00		
		MEXICO GOVT 7.75% NOV42		1,700,000.00	1,842,375.00		
		MEXICO GOVT 8.5% MAY29		41,710,000.00	46,870,778.30		
		MEXICO GOVT 8.5% NOV38		29,600,000.00	34,297,520.00		
		MEXICO GOVT 8% DEC23		54,000,000.00	56,824,200.00		
		MEXICO I/L 4% NOV40		530,000.00	3,816,082.89		
		計	銘柄数：	11	275,263,900.00	296,278,107.83	
						(1,472,502,195)	
	組入時価比率：	16.9%		17.9%			
ブラジルリアル	BRAZIL 10% JAN23 NTN	BRAZIL 10% JAN23 NTN		15,848,000.00	17,960,047.11		
		BRAZIL 10% JAN25 NTN		6,940,000.00	8,080,838.84		
		BRAZIL 10% JAN27 NTN		7,810,000.00	9,227,163.55		
		BRAZIL 10% JAN29 NTN		3,030,000.00	3,618,577.50		
		BRAZIL I/L 6% AUG22 NTN		3,166,000.00	11,619,289.65		
		BRAZIL I/L 6% AUG26 NTN		420,000.00	1,647,172.84		
		BRAZIL I/L 6% AUG50 NTN		150,000.00	712,572.45		
		計	銘柄数：	7	37,364,000.00	52,865,661.94	
				(1,156,172,026)			
	組入時価比率：	13.3%		14.1%			
チリペソ	CHILE GOVT 4.5% FEB21	CHILE GOVT 4.5% FEB21		180,000,000.00	185,194,800.00		
		CHILE GOVT 4.5% MAR26		945,000,000.00	1,052,484,300.00		
		CHILE GOVT 4.7% SEP30		130,000,000.00	150,985,900.00		
		計	銘柄数：	3	1,255,000,000.00	1,388,665,000.00	
				(170,250,328)			
	組入時価比率：	2.0%		2.1%			
コロンビアペソ	COLOMBIA 6% APR28 GDN	COLOMBIA 6% APR28 GDN		150,000,000.00	147,445,500.00		
		COLOMBIA GOVT 9.85% JUN27		92,000,000.00	115,931,040.00		
		COLOMBIA TES 10% JUL24		1,200,000,000.00	1,405,344,000.00		
		COLOMBIA TES 6% APR28		7,900,900,000.00	7,716,888,039.00		
		COLOMBIA TES 7.25% OCT34		650,000,000.00	715,117,000.00		
		COLOMBIA TES 7% MAY22		4,800,000,000.00	4,999,056,000.00		
		計	銘柄数：	6	14,792,900,000.00	15,099,781,579.00	
				(409,204,080)			
	組入時価比率：	4.7%		5.0%			
ペルーソル	PERU GOVT 5.4% AUG34	PERU GOVT 5.4% AUG34		180,000.00	199,125.00		
		PERU GOVT 5.94% FEB29 GDN		180,000.00	209,988.00		
		PERU GOVT 6.35% AUG28		2,210,000.00	2,642,077.10		
		PERU GOVT 6.9% AUG37 GDN		5,300,000.00	6,722,626.00		
		PERU GOVT 6.35% AUG28 GDN		429,000.00	513,903.39		
		PERU GOVT 6.95% AUG31 GDN		3,025,000.00	3,779,223.25		
		計	銘柄数：	6	11,324,000.00	14,066,942.74	
				(413,990,124)			
	組入時価比率：	4.8%		5.0%			
ウルグアイペソ	URUGUAY 9.875% JUN22 REGS		4,880,000.00	4,794,502.40			

	計	銘柄数:	1	4,880,000.00	4,794,502.40
					(11,554,750)
		組入時価比率:	0.1%		0.1%
	ドミニカペソ	DOMINICA 8.9% FEB23 REGS		17,000,000.00	16,753,840.00
		DOMREP 9.75% JUN26 REGS		14,000,000.00	14,112,420.00
	計	銘柄数:	2	31,000,000.00	30,866,260.00
					(59,263,219)
		組入時価比率:	0.7%		0.7%
	ディナール	SERBIA 4.5% JAN26 7Y		19,060,000.00	20,874,321.40
		SERBIA 5.875% FEB28 10Y		23,330,000.00	28,320,520.30
	計	銘柄数:	2	42,390,000.00	49,194,841.70
					(49,155,485)
		組入時価比率:	0.6%		0.6%
	トルコリラ	TURKEY GOVT 10.6% FEB26		4,150,000.00	3,981,634.50
		TURKEY GOVT 11% FEB27		3,070,000.00	2,973,233.60
		TURKEY GOVT 11% MAR22		1,286,046.00	1,273,699.95
		TURKEY GOVT 7.1% MAR23		219,389.00	195,012.68
		TURKEY GOVT 8.5% SEP22		1,221,507.00	1,145,309.39
		TURKEY GOVT 8.8% SEP23		1,530,000.00	1,402,245.00
		TURKEY GOVT 8% MAR25		1,019,108.00	883,882.55
		TURKEY GOVT 9.2% SEP21		852,812.00	827,270.28
	計	銘柄数:	8	13,348,862.00	12,682,287.95
					(212,808,791)
		組入時価比率:	2.4%		2.6%
	チェココルナ	CZECH REPUBLIC 4.2% 49		1,200,000.00	1,766,532.00
		CZECH REPUBLIC 4.85% 53		9,920,000.00	17,694,304.00
	計	銘柄数:	2	11,120,000.00	19,460,836.00
					(89,519,845)
		組入時価比率:	1.0%		1.1%
	ハンガリーフォリント	HUNGARY 1.5% AUG22 22/C		130,000,000.00	132,727,400.00
		HUNGARY 3% AUG30 30/A		251,000,000.00	279,455,870.00
		HUNGARY 3% OCT38 38/A		388,880,000.00	425,524,162.40
	計	銘柄数:	3	769,880,000.00	837,707,432.40
					(293,197,601)
		組入時価比率:	3.4%		3.6%
	ポーランドズロチ	POLAND 2.75% OCT29 1029		9,350,000.00	10,437,592.00
		POLAND GOVT 4% OCT23		1,640,000.00	1,801,556.40
		POLAND GOVT 5.75% SEP22		6,300,000.00	7,010,955.00
	計	銘柄数:	3	17,290,000.00	19,250,103.40
					(522,447,806)
		組入時価比率:	6.0%		6.4%
	ロシアルーブル	RUSSIA 7.25% MAY34 6225		52,098,000.00	55,129,582.62
		RUSSIA 7.65% APR30 6228		42,180,000.00	46,311,109.20
		RUSSIA 7.75% SEP26 6219		4,358,000.00	4,733,703.18
		RUSSIA 7.95% OCT26 6226		46,000,000.00	50,462,000.00
		RUSSIA 8.15% FEB27 6207		164,550,000.00	182,857,010.25
	計	銘柄数:	5	309,186,000.00	339,493,405.25
					(471,895,833)
		組入時価比率:	5.4%		5.7%
	ルーマニアレイ	ROMANIA GOVT 3.65% SEP31		4,295,000.00	3,967,935.75
		ROMANIA GOVT 5% FEB29		470,000.00	504,601.40
	計	銘柄数:	2	4,765,000.00	4,472,537.15
					(109,040,455)
		組入時価比率:	1.3%		1.3%
	マレーシアリングgit	MALAYSIA 3.48% MAR23		402,000.00	411,684.18
		MALAYSIA 3.502% MAY27		1,900,000.00	1,989,015.00
		MALAYSIA 3.8% AUG23		2,500,000.00	2,592,700.00
		MALAYSIA 3.828% JUL34		3,000,000.00	3,261,900.00

		MALAYSIA 3.882% MAR22		2,655,000.00	2,719,728.90
		MALAYSIA 4.07% SEP26		869,000.00	935,183.04
		MALAYSIA 4.181% JUL24		700,000.00	741,916.00
		MALAYSIA 4.232% JUN31		2,872,000.00	3,205,439.20
		MALAYSIA 4.498% APR30		2,080,000.00	2,361,424.00
		MALAYSIA 4.642% NOV33		2,400,000.00	2,800,752.00
		MALAYSIA 4.786% OCT35		400,000.00	480,920.00
	計	銘柄数:	11	19,778,000.00	21,500,662.32
					(524,401,153)
		組入時価比率:	6.0%		6.4%
	タイバーツ	THAI GOVT 1.6% JUN35		6,000,000.00	6,459,600.00
		THAI GOVT 2.125% DEC26		4,200,000.00	4,585,434.00
		THAI GOVT 2.4% DEC23 0		14,800,000.00	15,755,192.00
		THAI GOVT 2.875% DEC28		29,292,000.00	34,367,424.84
		THAI GOVT 3.3% JUN38		30,000,000.00	40,812,000.00
		THAI GOVT 3.4% JUN36		2,200,000.00	2,961,068.00
		THAI GOVT 3.58% DEC27		834,000.00	1,002,676.50
		THAI GOVT 3.625% JUN23		3,176,000.00	3,477,783.52
		THAI GOVT 3.65% JUN31		8,200,000.00	10,555,204.00
		THAI GOVT 3.775% JUN32		37,062,000.00	49,010,418.18
		THAI GOVT 4.875% JUN29		579,000.00	782,240.58
	計	銘柄数:	11	136,343,000.00	169,769,041.62
					(556,842,456)
		組入時価比率:	6.4%		6.8%
	フィリピンペソ	PHIL GOVT 8% JUL31 2017		5,600,000.00	7,583,520.00
		PHIL GOVT5.75%APR25 7-61		2,963,554.00	3,229,444.06
	計	銘柄数:	2	8,563,554.00	10,812,964.06
					(22,058,446)
		組入時価比率:	0.3%		0.3%
	インドネシアルピア	INDON 10.5% AUG30 FR52		6,191,000,000.00	7,515,874,000.00
		INDON 7.375% MAY48 FR76		9,601,000,000.00	9,340,908,910.00
		INDON 7.5% AUG32 FR74		6,760,000,000.00	6,681,854,400.00
		INDON 7.5% MAY38 FR75		2,937,000,000.00	2,895,882,000.00
		INDON 7% MAY27 FR59		10,597,000,000.00	10,598,271,640.00
		INDON 7% SEP30 FR82		1,940,000,000.00	1,924,732,200.00
		INDON 8.25% MAY36 FR72		21,685,000,000.00	22,701,809,650.00
		INDON 8.375% MAR34 FR68		148,000,000.00	155,624,960.00
		INDON 8.75% MAY31 FR73		11,305,000,000.00	12,850,393,500.00
		INDON 9% MAR29 FR71		22,542,000,000.00	24,966,617,520.00
	計	銘柄数:	10	93,706,000,000.00	99,631,968,780.00
					(717,350,175)
		組入時価比率:	8.2%		8.7%
	ウクライナフリブナ	UKRAI14.64%JUN20REGS GDN		400,000.00	404,991.08
		UKRAI15.84%FEB25REGSGDN		4,000,000.00	4,496,773.60
		UKRAINE 17.25% SEP20 GDN		1,435,000.00	1,498,378.78
		UKRAINE0% APR20 REGS GDN		2,300,000.00	2,287,042.18
	計	銘柄数:	4	8,135,000.00	8,687,185.64
					(35,964,948)
		組入時価比率:	0.4%		0.4%
	エジプトポンド	EGYPT T-BILL 13OCT20		850,000.00	774,713.80
		EGYPT T-BILL19JAN21 364D		2,000,000.00	1,781,102.58
		EGYPT T-BILL21APR20 273D		3,200,000.00	3,110,195.40
		EGYPT T-BILL28JUL20 273D		2,000,000.00	1,892,173.34
	計	銘柄数:	4	8,050,000.00	7,558,185.12
					(49,657,276)
		組入時価比率:	0.6%		0.6%
	南アフリカランド	S.AFRICA 7% FEB31 R213		23,210,000.00	19,382,438.90



		S.AFRICA 8.5% JAN37 2037		8,445,658.00	7,283,957.74
		S.AFRICA 8% JAN30 2030		6,338,251.00	5,851,156.41
		S.AFRICA 9% JAN40 2040		5,595,390.00	4,980,624.50
		S.AFRICA10.5% DEC26 R186		33,656,829.00	37,672,761.83
		S.AFRICA6.25% MAR36 R209		8,441,256.00	5,896,808.20
		S.AFRICA8.75% FEB48 2048		20,948,708.00	17,847,461.26
		S.AFRICA8.75% JAN44 2044		3,805,030.00	3,257,219.83
		S.AFRICA8.875%FEB35 2035		7,786,398.00	7,103,998.07
	計	銘柄数:	9	118,227,520.00	109,276,426.74
					(703,740,188)
		組入時価比率:	8.1%		8.6%
	ナイジェリアナイラ	NIGERIA GOVT13.98% FEB28		71,900,000.00	82,835,990.00
		NIGERIA T-BILL 09APR20		46,324,000.00	45,850,964.56
	計	銘柄数:	2	118,224,000.00	128,686,954.56
					(36,251,115)
		組入時価比率:	0.4%		0.4%
	小計				8,087,268,295
					(8,087,268,295)
特殊債券	オフショア元	CHINA DEV BK 3.42% 1908		3,400,000.00	3,496,940.80
		CHINA DEV BK 3.45% 1915		3,700,000.00	3,823,420.90
	計	銘柄数:	2	7,100,000.00	7,320,361.70
					(108,780,574)
		組入時価比率:	1.2%		1.3%
	小計				108,780,574
					(108,780,574)
社債券	コロンビアペソ	EPM 8.375% REGS		841,000,000.00	904,142,280.00
	計	銘柄数:	1	841,000,000.00	904,142,280.00
					(24,502,255)
		組入時価比率:	0.3%		0.3%
	小計				24,502,255
					(24,502,255)
	合計				8,220,551,124
					(8,220,551,124)

(注) 各通貨計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注) 小計・合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各通貨計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

当表に記載すべき内容は、「デリバティブ取引等に関する注記 取引の時価等に関する事項」に開示しておりますので、記載を省略しております。

「G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）」の状況  
尚、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（１）貸借対照表

（単位：円）

区分	注記 番号	(2019年9月10日現在)	(2020年3月10日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		46,749,206	49,742,923
コール・ローン		1,318,770	1,269,650
株式		3,368,383	3,225,386
特殊債券		1,111,188	1,020,566
社債券		655,711,506	576,761,780
未収入金		3,624,775	-
未収利息		10,506,085	8,865,470
前払費用		509,981	237,757
流動資産合計		722,899,894	641,123,532
資産合計		722,899,894	641,123,532
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		10,996	23,296
未払金		3,458,773	-
未払解約金		10,850	33
未払利息		3	3
流動負債合計		3,480,622	23,332
負債合計		3,480,622	23,332
純資産の部			
元本等			
元本	1	324,505,623	304,900,341
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		394,913,649	336,199,859
元本等合計		719,419,272	641,100,200
純資産合計		719,419,272	641,100,200
負債純資産合計		722,899,894	641,123,532

（注）「G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）」の計算期間は、毎年1月9日から7月8日および7月9日から翌年1月8日まで（計算期間終了日が休業日の場合は、その翌営業日まで）であり、当ファンドの特定期間と異なります。

( 2 ) 注記表  
 ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

	当財務諸表対象期間
1. 有価証券の 評価基準お よび評価方 法	<p>株式 移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>特殊債券および社債券 個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(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、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の最終相場）で評価しております。</p> <p>当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によるものが適当でない認められた場合は、当該金融商品取引所等における気配相場で評価しております。</p> <p>(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（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供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。</p> <p>(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。</p>
2. デリバティ ブ等の評価 基準および 評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>為替予約の評価は、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務 諸表作成の ための基本 となる重要 な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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条および第61条に従って処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区分	(2019年9月10日現在)	(2020年3月10日現在)
1期首元本額	340,686,886円	324,505,623円
期中追加設定元本額	11,191,341円	3,411,129円
期中解約元本額	27,372,604円	23,016,411円
元本の内訳（注）		
JPMグローバル債券3分散ファンド （毎月決算型）	324,505,623円	304,900,341円
合 計	324,505,623円	304,900,341円
受益権の総数	324,505,623口	304,900,341口
1口当たりの純資産額	2.2170円	2.1027円
（1万口当たりの純資産額）	(22,170円)	(21,027円)

（注）当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する注記

	当財務諸表対象期間
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容およびそのリスク	当ファンドが保有した主な金融商品は、株式、特殊債券、社債券およびデリバティブ取引であり、当ファンドで利用しているデリバティブ取引は、通貨関連では為替予約取引であります。当ファンドが保有した金融商品およびデリバティブ取引には、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。 なお、デリバティブ取引は、通貨関連では信託財産の効率的な運用に資する目的として利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドは運用を外部委託しておりますが、投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。 (1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターおよび外部委託先において運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果（パフォーマンス）のモニターを行います。さらに外部委託先のインベストメント・ダイレクターは、リスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。 (2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っております。 (3)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。

## 金融商品の時価等に関する事項

	各期間末
1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませ 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。一部の 債券時価に関しては合理的に算定された価額を採用する場合があります。合 理的に算定された価額は発行体の格付けや債券の償還年限を基にした国債に 対する上乗せ金利、取引業者からの提示価格、流動性、将来発生しうる キャッシュフロー、その他個々の債券の特性等を考慮して価格提供会社が算 出した価格を利用しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、 時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価と しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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、異なる前提条件によった場合、当該価 額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	(2019年9月10日現在)	(2020年3月10日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	71,491	411,948
特殊債券	6,012	48,273
社債券	263,749	27,048,475
合計	341,252	26,684,800

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間開始日から本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## (通貨関連)

区分	種類	(2019年9月10日現在)				(2020年3月10日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場 取引 以外 の取 引	為替予約取引 売建 アメリカドル	2,802,064	-	2,813,060	10,996	2,875,302	-	2,898,598	23,296
合計		2,802,064	-	2,813,060	10,996	2,875,302	-	2,898,598	23,296

## (注) 1. 為替予約の時価の算定方法

(1) 対顧客先物売買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。

為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物売買相場の仲値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。

当該日の対顧客先物売買相場の仲値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。

- ・当該日を越える対顧客先物売買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対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。
- ・当該日を越える対顧客先物売買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売買相場の仲値により評価しております。

(2) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値により評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等および時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表（2020年3月10日現在）

## (イ) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額単価	評価額金額	備考
アメリカドル	CLAIRE'S STORES 14% PFD	10	1,750.00	17,500.00	*
	CLAIRE'S STORES INC	17	600.00	10,200.00	
	MYT HOLDING CO 10% REGS PFD	4,227	0.83	3,529.54	*
小計	銘柄数：	3		31,229.54	
				(3,225,386)	
	組入時価比率：	0.5%		100.0%	
合計				3,225,386	
				(3,225,386)	

(注) 各通貨計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注) 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各通貨計欄の合計金額に対する比率であります。

(注) 備考欄の\*の銘柄は優先証券であることを表しております。

## (ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
特殊債券	アメリカドル	DAE FUNDING 4.5% REGS		5,000.00	4,912.50	
		DAE FUNDING 5% REGS		5,000.00	4,969.05	
		計	銘柄数：	2	10,000.00	9,881.55
					(1,020,566)	
		組入時価比率：	0.2%		0.2%	
	小計				1,020,566	
					(1,020,566)	
社債券	アメリカドル	ACADIA HLTH 5.125%		10,000.00	9,875.80	
		ACADIA HLTH 5.625%		10,000.00	10,094.10	
		ACADIA HLTH 6.5%		5,000.00	5,108.60	

	ACE CASH EXP 12% REGS		14,000.00	11,435.06
	ADT 4.125%		21,000.00	20,706.21
	ADT 4.875% REGS		10,000.00	9,132.90
	ADVANCED DRAINAGE5% REGS		2,000.00	2,065.60
	AECOM 5.125%		20,000.00	20,387.00
	AHERN RENTALS7.375% REGS		20,000.00	15,795.80
	ALBERTSONS 5.875% REGS		2,000.00	2,038.80
	ALBERTSONS 6.625%		35,000.00	35,667.10
	ALBERTSONS 7.5% REGS		8,000.00	8,805.52
	ALLIED UNIVERS6.625%REGS		3,000.00	3,109.80
	ALLY FINANCIAL 4.625%		15,000.00	16,142.85
	ALLY FINANCIAL 5.75%		78,000.00	87,436.44
	ALLY FINANCIAL 8% 31		12,000.00	16,331.10
	AMC ENTERTAIN 5.875% 26		3,000.00	1,980.45
	AMC ENTERTAINMENT 5.75%		11,000.00	7,139.00
	AMC ENTERTAINMENT 6.125%		12,000.00	7,752.48
	AMC NETWORKS 4.75%		3,000.00	2,977.89
	AMC NETWORKS 4.75% C		17,000.00	16,997.45
	AMER AIRLINE 5% REGS		6,000.00	5,146.68
	AMERICAN AXLE 6.25%		34,000.00	30,926.74
	AMERICAN AXLE 6.25% Y		8,000.00	7,196.72
	AMERICAN AXLE 6.5%		8,000.00	7,160.24
	AMERIGAS 5.625%		10,000.00	10,062.40
	AMERIGAS 5.875%		5,000.00	5,156.50
	AMKOR TECH 6.625% REGS		5,000.00	5,377.70
	AMSTED IND 5.625% REGS		7,000.00	7,424.83
	ANTERO RESCS 5.375%		3,000.00	1,950.00
	ANTERO RESCS 5.625%		2,000.00	777.86
	ARCONIC 5.9%		32,000.00	36,532.41
	ARCONIC 5.95%		5,000.00	5,385.00
	ARCONIC 6.15%		2,000.00	2,025.52
	ARCONIC 6.75%		7,000.00	7,975.10
	AUTOMATION 6.5% REGS		7,000.00	6,898.92
	AVIS BUDGET 5.25% REGS		14,000.00	13,104.14
	AVIS BUDGET 5.75% REGS		8,000.00	7,332.32
	AVOLON HLDGS 5.25% REGS		6,000.00	6,580.56
	AVOLON HLDGS 5.5% REGS		11,000.00	11,874.28
	B&G FOODS 5.25%		33,000.00	32,788.47
	BALL 5.25%		25,000.00	26,853.00
	BAUSCH HEALTH 7% REGS		7,000.00	7,263.83
	BAUSCH HEALTH 8.5% REGS		10,000.00	10,724.20
	BAUSCH HEALTH 9.25% REGS		15,000.00	16,419.37
	BAUSCH HEALTH5.875% REGS		2,000.00	1,998.00
	BAUSCH HEALTH6.125% REGS		26,000.00	26,130.00
	BAUSCH HEALTH7.25% REGS		7,000.00	7,382.34
	BERRY GLOBAL 4.5% REGS		8,000.00	7,833.68
	BERRY GLOBAL 5.125%		30,000.00	29,724.30
	BERRY GLOBAL 5.625% REGS		4,000.00	4,093.80
	BERRY PLSTCS 5.5%		20,000.00	19,827.40
	BIG RIVER 7.25% REGS		5,000.00	4,990.25
	BOMBARDIER 7.5% 24 REGS		26,000.00	24,327.68
	BOMBARDIER 7.5% 25 REGS		10,000.00	9,275.00
	BOOZ ALLEN 5.125% REGS		7,000.00	7,160.93
	BOYD GAMING 6.375%		10,000.00	10,001.50
	BOYD GAMING 6% WI		6,000.00	5,844.36

	BOYNE USA 7.25% REGS		19,000.00	20,187.50
	BRINK'S 4.625% REGS		20,000.00	20,451.80
	BROOKFIELD 5.75% REGS		16,000.00	14,554.96
	BUCKEYE PARTNERS 3.95%		15,000.00	13,836.60
	CALERES 6.25%		10,000.00	10,222.60
	CALLON PETRO 6.125%		7,000.00	2,800.14
	CALLON PETRO 6.375%		2,000.00	1,559.80
	CALPINE 5.5%		20,000.00	19,946.20
	CALPINE 8.5% ESCROW		200,000.00	-
	CATALENT PHARMA 5% REGS		2,000.00	2,050.00
	CB ESCROW 8% REGS		7,000.00	7,347.97
	CBS OUTDOOR 5.625%		20,000.00	20,187.80
	CCM MERGER 6% REGS		7,000.00	7,118.65
	CCO HLDGS 4.75% REGS		16,000.00	16,259.84
	CCO HLDGS 5.125% REGS R		5,000.00	5,100.65
	CCO HOLDINGS 5.75% REGS		25,000.00	25,871.75
	CDK GLOBAL 5.25% REGS		5,000.00	5,134.65
	CDW 4.25%		62,000.00	61,722.24
	CDW 5.5%		5,000.00	5,412.45
	CEDAR FAIR 5.25% REGS		2,000.00	1,946.46
	CEDAR FAIR 5.375%		3,000.00	2,880.00
	CENTENE 5.25% REGS		10,000.00	10,340.20
	CENTENE CORP 4.75%		5,000.00	5,027.85
	CENTURYLINK 5.625%		11,000.00	11,445.28
	CENTURYLINK 5.8% T		20,000.00	20,843.40
	CENTURYLINK 6.875% G		3,000.00	3,283.29
	CENTURYLINK 7.5% Y		5,000.00	5,490.85
	CHARTER COMM 4.908%		11,000.00	12,289.97
	CHEMOURS 5.375%		4,000.00	3,192.76
	CHEMOURS 7%		17,000.00	15,034.63
	CHENIERE ENERGY 5.25%		4,000.00	3,970.00
	CHENIERE ENERGY 5.625%		7,000.00	6,892.79
	CHUKCHANSI 9.75% REGS		20,875.04	10,364.03
	CINCINNATI BELL 7% REGS		15,000.00	15,282.75
	CINEMARK 4.875%		11,000.00	10,525.90
	CIT GROUP 4.75%		10,000.00	10,295.20
	CIT GROUP 5.25%		9,000.00	9,625.59
	CIT GROUP 6.125%		11,000.00	12,800.92
	CITGO 6.25% REGS		9,000.00	9,005.58
	CLEAR CHNL 5.125% REGS		53,000.00	53,085.86
	CLEAR CHNL 9.25% REGS		20,000.00	20,099.80
	CLW PAPER 4.5%		15,000.00	14,982.60
	CMTY HLTH SYS 6.25%		12,000.00	11,844.60
	CMTY HLTH SYS 8% REGS		13,000.00	13,106.99
	CMTY HLTH SYS8.625% REGS		16,000.00	16,636.48
	CNG HLDGS 12.5% REGS		30,000.00	27,981.00
	COLFAX 6.375% REGS		4,000.00	4,188.64
	COLFAX 6% REGS		2,000.00	2,067.84
	COMMERCIAL METALS 5.375%		9,000.00	8,979.48
	COMMSCOPE FIN 5.5% REGS		5,000.00	5,058.40
	COMMSCOPE FIN 6% REGS		22,000.00	22,229.90
	COMMSCOPE FIN 8.25% REGS		9,000.00	8,638.74
	COMMSCOPE TECH 5% REGS		7,000.00	5,924.18
	COMMSCOPE TECH 6% REGS		11,000.00	9,845.00
	CONCORDIA INTL 8%		15,000.00	13,913.55



	CONSTELLATION 8.5% REGS	11,000.00	7,729.83
	COVANTA 5.875% 25	2,000.00	2,040.00
	CRESTWOOD 5.625% REGS	5,000.00	3,878.25
	CRESTWOOD 5.75%	14,000.00	11,287.15
	CROWN AMER/CAP 4.25%	8,000.00	8,130.40
	CROWN AMER/CAP 4.75%	8,000.00	8,114.72
	CSC HOLDINGS 5.25%	110,000.00	114,936.80
	CSC HOLDINGS 6.75%	10,000.00	10,421.30
	CUMULUS MEDIA 6.75% REGS	7,000.00	7,113.26
	CURO GRP 8.25% REGS	24,000.00	19,308.48
	CVR PARTNERS 9.25% REGS	49,000.00	49,987.84
	DAVITA HEALTHCARE 5.125%	14,000.00	13,846.00
	DAVITA HEALTHCARE 5%	25,000.00	24,889.00
	DCP MIDSTREAM 3.875%	19,000.00	16,897.65
	DCP MIDSTREAM 4.95%	3,000.00	3,011.13
	DCP MIDSTREAM 5.375%	5,000.00	5,025.70
	DELEK LOGISTICS 6.75% WI	16,000.00	16,218.88
	DELL INTL 7.125% REGS	30,000.00	30,357.60
	DIEBOLD 8.5%	4,000.00	3,370.04
	DISH DBS 5.875% 22	7,000.00	7,105.56
	DISH DBS 5.875% 24	80,000.00	78,929.60
	DISH DBS 6.75%	39,000.00	39,879.06
	DOLE FOOD 7.25% REGS	19,000.00	18,674.72
	DOWNSTREAM DE10.5%REGS E	25,000.00	25,526.50
	DYNEGY 5.875%	48,000.00	48,285.60
	EMBARQ CORP 7.995%	30,000.00	31,750.20
	EMC 3.375%	6,000.00	5,989.44
	ENLINK MIDSTREAM 4.15%	6,000.00	4,565.04
	ENLINK MIDSTREAM 4.4%	15,000.00	12,460.65
	ENLINK MIDSTREAM 4.85%	4,000.00	3,343.22
	ENLINK MIDSTREAM 5.6%	3,000.00	2,219.22
	ENSCO 5.75%	3,000.00	590.01
	ENSCO 7.75%	3,000.00	626.76
	ENTERCON MEDIA 6.5% REGS	8,000.00	8,262.72
	ENTERPRISE 12% REGS	30,000.00	34,206.00
	EP NRG/EVRST 7.75% REGS	11,000.00	2,640.00
	EP NRG/EVRST 8% REGS C	8,000.00	3,735.84
	EP NRG/EVRST 9.375% REGS	23,000.00	417.91
	ESH HOSPITALIT4.625%REGS	9,000.00	8,143.11
	ESH HOSPITALITY5.25%REGS	12,000.00	11,532.36
	FMG RESCS 5.125% REGS	12,000.00	12,687.24
	FREEMPORT-MC 3.875%	28,000.00	27,930.00
	FREEMPORT-MC 4.55%	5,000.00	4,950.70
	FREEMPORT-MC 5.4%	3,000.00	2,853.19
	FREEMPORT-MC 5%	15,000.00	14,760.00
	FRONTIER COMMS 8.5% REGS	15,000.00	14,725.65
	GENESIS NRG 6.25%	8,000.00	5,280.00
	GENESYS 10% REGS	16,000.00	17,088.80
	GLOBAL AIR 6.5% REGS	10,000.00	9,517.50
	GLOBAL PRN 7%	7,000.00	7,259.77
	GM 6.75% ESCROW	25,000.00	-
	GM 8.1% ESCROW	200,000.00	-
	GM 8.375% ESCROW	265,000.00	-
	GM MLT ESCROW	35,000.00	-
	GOODYEAR TIRE 4.875%	26,000.00	23,950.16

	GOODYEAR TIRE 5.125%		10,000.00	9,812.25
	GOODYEAR TIRE 5%		28,000.00	26,750.50
	GRAY ESCROW 7% REGS		7,000.00	7,627.13
	GRAY TV 5.125% REGS		10,000.00	10,028.40
	GRAY TV 5.875% REGS		5,000.00	5,144.05
	GREIF 6.5% REGS		6,000.00	6,383.88
	H&E EQUIP 5.625%		15,000.00	14,524.20
	HANESBRANDS 4.625% REGS		5,000.00	5,084.45
	HANESBRANDS 4.875% REGS		5,000.00	5,093.30
	HARSCO 5.75% REGS		3,000.00	2,966.55
	HAT HLDGS 5.25% REGS		4,000.00	4,111.88
	HCA 5.625%		62,000.00	70,018.15
	HCA HEALTHCARE 6.25%		30,000.00	31,465.20
	HCA INC 5.375%		33,000.00	36,123.78
	HCA INC 5.875% 26		15,000.00	16,667.85
	HCA INC 7.5%		10,000.00	11,228.40
	HERC HLDGS 5.5% REGS		9,000.00	8,788.23
	HERTZ 5.5% REGS		7,000.00	5,640.53
	HERTZ 7.125% REGS		5,000.00	4,005.45
	HERTZ 7.625% REGS		2,000.00	1,913.70
	HILCORP NRG 6.25% REGS		6,000.00	4,746.54
	HILTON 4.625%		4,000.00	3,874.40
	HILTON 4.875%		12,000.00	11,913.24
	HILTON DOMESTIC 4.875%		3,000.00	2,946.03
	HILTON DOMESTIC 5.125%		3,000.00	2,992.65
	HILTON GRAND 6.125%		10,000.00	10,644.10
	HUDBAY MINERALS7.25%REGS		10,000.00	9,700.00
	HUGHES SAT 6.625%		6,000.00	6,508.86
	ICAHN ENTERPRI 6.375% WI		5,000.00	5,006.20
	ICAHN ENTERPRIS 6.25% WI		14,000.00	14,093.24
	ICAHN ENTERPRIS 6.75% WI		4,000.00	4,009.12
	ICAHN ENTERPRIS4.75%REGS		15,000.00	15,313.20
	ICAHN ENTERPRISES 6.25%		8,000.00	7,882.56
	IHEARTCOMMS 5.25% REGS		6,000.00	6,273.18
	IHEARTCOMMS 6.375%		30,000.00	32,426.40
	IHEARTCOMMS 8.375%		10,000.00	10,209.70
	INFOR 6.5%		21,000.00	20,998.74
	INTELSAT 5.5%		44,000.00	34,452.00
	INTELSAT 8.5% REGS		12,000.00	9,243.48
	INTELSAT 8% REGS		18,000.00	18,264.60
	INTERTAPE POLYMER7% REGS		3,000.00	3,173.19
	IRB HLDG 6.75 REGS		13,000.00	13,023.27
	IRON MOUNTAIN 5.25% REGS		9,000.00	9,098.91
	IRON MOUNTAIN 5.75%		22,000.00	21,620.28
	IRON MOUNTAIN4.875% REGS		13,000.00	12,926.94
	JBS USA 5.75% APR		4,000.00	3,998.40
	JBS USA 5.75% REGS		67,000.00	68,737.98
	JBS USA 5.875% APR		4,000.00	4,009.52
	JBS USA 6.5% REGS		17,000.00	18,455.54
	JBS USA 6.5% REGS D		4,000.00	4,288.68
	LAMAR MEDIA 5.75%		8,000.00	8,196.88
	LENNAR 4.5%		10,000.00	10,450.00
	LENNAR 5.25%		5,000.00	5,434.70
	LENNAR 5.875%		15,000.00	16,369.80
	LEVEL 3 5.25%		5,000.00	5,100.25

	LEVEL 3 5.375%		5,000.00	5,042.90
	LEVEL 3 5.375% 24		17,000.00	16,778.15
	LEVEL 3 5.625%		17,000.00	17,017.85
	LIB MED IT 4% EB		12,000.00	8,444.76
	LIBERTY INTERACT13.75%EB		8,000.00	5,637.28
	LIVE NATION 5.625% REGS		9,000.00	8,631.36
	LPL HLDGS 5.75% REGS		8,000.00	8,120.64
	LPL HLDGS 5.75% REGS C		5,000.00	5,163.75
	MALLINCKRODT 5.5% REGS		10,000.00	3,500.00
	MARRIOTT 4.75% REGS		2,000.00	1,921.78
	MARRIOTT 6.5%		15,000.00	15,974.70
	MASTEC INC 4.875%		17,000.00	17,050.66
	MATADOR 5.875%		6,000.00	4,680.00
	MATTEL 3.15%		12,000.00	11,851.68
	MATTEL 6.75% MAY		38,000.00	40,185.00
	MATTEL 6.75% REGS		11,000.00	11,472.45
	MGM GROWTH 5.75%		6,000.00	6,155.94
	MGM RESORTS 5.75%		70,000.00	70,014.00
	MIDCONTINENT 5.375% REGS		4,000.00	4,200.88
	MMLP 7.25%		17,000.00	15,730.27
	MPH ACQUISIT 7.125% REGS		14,000.00	12,904.78
	MTS SYSTEMS 5.75% REGS		6,000.00	5,910.72
	NATIONSTAR 8.125% REGS		16,000.00	16,617.44
	NATIONSTAR 9.125% REGS		8,000.00	8,670.88
	NAVIENT 5.875%		10,000.00	9,934.20
	NCR 5.75% REGS		5,000.00	5,210.05
	NCR 6.125% REGS		5,000.00	5,200.25
	NEIMAN MARCUS 14% REGS		13,277.00	5,974.65
	NEIMAN MARCUS 8% REGS		20,000.00	5,645.00
	NETFLIX 4.375%		10,000.00	10,446.00
	NETFLIX 4.875%		10,000.00	10,639.90
	NETFLIX 5.375% REGS		6,000.00	6,559.74
	NETFLIX 5.875%		2,000.00	2,215.92
	NETFLIX 5.875% T		29,000.00	32,454.48
	NEW ALBERTSONS 7.45%		27,000.00	27,135.00
	NEWELL BRANDS MLT		55,000.00	56,287.00
	NEXSTAR ESCR5.625%REGS27		6,000.00	6,151.38
	NEXSTAR ESCROW5.625%REGS		10,000.00	10,256.00
	NEXTERA ENERGY4.25% REGS		8,000.00	8,148.80
	NEXTERA ENERGY4.25%REGSF		4,000.00	4,087.56
	NIELSEN 5% REGS M		42,000.00	41,624.52
	NOKIA 3.375%		5,000.00	5,021.70
	NOVA CHEMICALS4.875%REGS		8,000.00	7,706.80
	NOVELIS 5.875% REGS		20,000.00	19,992.60
	NRG ENERGY 5.25% REGS		2,000.00	1,995.92
	NRG ENERGY 5.75% WI		8,000.00	8,166.40
	NRG ENERGY 7.25%		10,000.00	10,629.30
	NUANCE COMMS 5.625%		11,000.00	11,556.60
	NUSTAR LOGISTICS 5.625%		10,000.00	9,046.25
	NUSTAR LOGISTICS 6%		3,000.00	3,131.61
	OASIS PETRO 6.875%		4,000.00	1,269.84
	OCEANEERING INTL 6%		4,000.00	2,420.48
	OI EUROPEAN 4% REGS		6,000.00	6,067.14
	OI INC/OBGC 5.375% REGS		5,000.00	5,243.00
	OI INC/OBGC 5% REGS		10,000.00	9,946.60

	OI INC/OBGC 6.375% REGS		3,000.00	3,361.77
	OPEN TEXT 5.875% REGS		9,000.00	9,450.00
	OUTFRONT MEDIA 5% REGS		5,000.00	5,119.10
	PARK AEROSPACE 4.5% REGS		12,000.00	12,374.40
	PARK AEROSPACE 5.5% REGS		6,000.00	6,570.84
	PARK AEROSPACE5.25% REGS		5,000.00	5,281.55
	PBF HLDG 7.25%		6,000.00	6,048.06
	PBF LOGISTICS 6.875%		8,000.00	8,136.56
	PEABODY SEC FIN 6% REGS		10,000.00	7,604.90
	PENSKE AUTO 5.5%		29,000.00	28,776.41
	PERFORMANCE FOOD5.5%REGS		5,000.00	5,124.60
	PETSMART 5.875% REGS		28,000.00	27,941.48
	PILGRIM'S 5.75% MAR		4,000.00	4,040.48
	PILGRIM'S 5.75% REGS		21,000.00	21,262.71
	PILGRIM'S 5.75% REGS C		3,000.00	3,057.60
	PLANTRONICS 5.5% REGS		14,000.00	11,623.78
	POST HOLDINGS 5.5% REGS		7,000.00	7,157.99
	POST HOLDINGS 5% REGS		22,000.00	22,434.28
	PRECIS DRILL 5.25%		2,000.00	1,208.56
	PRECIS DRILL 7.125% REGS		6,000.00	4,263.72
	PRIME SECSRV 5.25% REGS		8,000.00	8,091.84
	PRIME SECSRV 5.75% REGS		17,000.00	17,550.97
	QEP RESOURCES 5.25%		2,000.00	869.78
	QEP RESOURCES 5.375%		14,000.00	7,696.08
	QORVO 5.5%		7,000.00	7,180.46
	QUICKEN LOANS 5.25% REGS		23,000.00	23,190.21
	QUICKEN LOANS 5.75% REGS		11,000.00	11,294.03
	RADIAN GRP 4.5%		8,000.00	8,348.64
	RADIAN GRP 4.875%		3,000.00	3,176.04
	REYNOLDS GP 5.125% REGS		30,000.00	29,781.60
	REYNOLDS GP 7% REGS		10,000.00	10,237.30
	RYMAN 4.75% REGS		5,000.00	4,651.37
	SCIENTIFIC GAMES 5% REGS		33,000.00	30,680.10
	SEALED AIR 4.875% REGS		10,000.00	10,472.90
	SEALED AIR 5.25% REGS		8,000.00	8,433.28
	SEALED AIR 5.5% REGS		35,000.00	38,197.95
	SHELF DRILL 8.25% REGS		10,000.00	8,412.50
	SINCLAIR TV 5.125% REGS		8,000.00	7,880.88
	SINCLAIR TV 5.625% REGS		15,000.00	15,116.70
	SIRIUS XM 4.625% REGS		12,000.00	12,015.96
	SIRIUS XM 4.625% REGS 24		17,000.00	17,714.00
	SIRIUS XM 5.375% 26 REGS		12,000.00	12,266.16
	SIRIUS XM 5.5% REGS		8,000.00	8,500.48
	SIX FLAGS 4.875% REGS		3,000.00	2,788.56
	SIX FLAGS 5.5% REGS		3,000.00	2,689.23
	SM ENERGY 6.625%		7,000.00	2,546.25
	SM ENERGY 6.75%		4,000.00	1,668.47
	SOLERA 10.5% REGS		15,000.00	15,636.90
	SPECTRUM BR 5.75%		20,000.00	19,857.80
	SPECTRUM BR 5% REGS		2,000.00	1,980.42
	SPECTRUM BR 6.125%		10,000.00	10,315.60
	SPRINGLEAF FIN 5.625%		22,000.00	23,229.80
	SPRINGLEAF FIN 6.125% 22		5,000.00	5,179.30
	SPRINGLEAF FIN 6.125% 24		5,000.00	5,175.95
	SPRINGLEAF FIN 7.125%		31,000.00	33,471.63

	SPRINT 7.125%		7,000.00	7,802.13
	SPRINT 7.25%		16,000.00	16,764.96
	SPRINT 7.625%		75,000.00	86,019.75
	SPRINT 7.625% 26		72,000.00	83,430.00
	SPRINT 7.875%		10,000.00	11,205.00
	SPRINT 8.75%		19,000.00	26,544.71
	SS&C TECH 5.5% REGS		10,000.00	10,456.80
	STANDARD INDUST4.75%REGS		15,000.00	14,985.45
	STANDARD INDUSTRIE5%REGS		5,000.00	5,039.55
	STAPLES 10.75% REGS		7,000.00	6,327.72
	STAPLES 7.5% REGS		15,000.00	14,446.05
	STARS GRP 7% REGS		10,000.00	10,500.50
	STATION CASINOS 5% REGS		10,000.00	9,100.00
	STEEL DYNAMICS 5.5%		10,000.00	10,218.80
	STEEL DYNAMICS 5%		10,000.00	10,835.00
	SUMMIT MATE 5.125% REGS		52,000.00	53,052.48
	SUMMIT MID 5.75%		15,000.00	9,750.00
	SUNOCO LP 4.875%		4,000.00	4,008.60
	SUNOCO LP 5.5%		5,000.00	3,998.50
	SUNOCO LP 5.875%		3,000.00	3,065.73
	SUNOCO LP 6%		13,000.00	13,257.14
	SYMANTEC 5% REGS		12,000.00	11,766.36
	T-MOBILE USA 4.5%		26,000.00	26,452.66
	T-MOBILE USA 4.75%		11,000.00	11,331.43
	T-MOBILE USA 6.5% 24		5,000.00	5,087.35
	T-MOBILE USA 6.5% 26		13,000.00	13,495.95
	T-MOBILE USA 6%		9,000.00	9,047.34
	T-MOBILE USA 6% 24		4,000.00	4,051.36
	TALLGRASS NRG 5.5% REGS		10,000.00	8,262.85
	TARGA RESCS 4.25%		26,000.00	23,698.74
	TARGA RESCS 5.875%		10,000.00	9,348.90
	TEAM HEALTH 6.375% REGS		62,000.00	32,755.22
	TEGNA 4.875% REGS		10,000.00	10,000.00
	TEGNA 5.5% REGS		10,000.00	10,278.10
	TELECOM ITALIA 6.375%		15,000.00	17,137.05
	TELECOM ITALIA 6%		6,000.00	6,660.00
	TELEFLEX 4.875%		2,000.00	2,095.46
	TEMPUR SEALY INTL 5.5%		38,000.00	39,600.75
	TENET HEALTH 4.625%		18,000.00	17,904.06
	TENET HEALTH 4.625% REGS		3,000.00	3,007.05
	TENET HEALTH 4.875% REGS		13,000.00	12,972.31
	TENET HEALTH 5.125%		60,000.00	60,678.00
	TENET HEALTH 5.125% REGS		11,000.00	11,141.13
	TENET HEALTH 6.25% REGS		13,000.00	13,196.43
	TENNANT 5.625%		15,000.00	15,465.15
	TERRAFORM 4.25% REGS		9,000.00	9,105.30
	TERRAFORM 5% REGS		11,000.00	11,426.47
	TERRAFORM 6.125% REGS		4,000.00	4,195.96
	THHH 11.5% REGS ESCROW		215,000.00	430.00
	TRANSDIGM 6.25% REGS		13,000.00	13,388.96
	TRANSDIGM 6.5%		8,000.00	7,926.64
	TRANSDIGM INC 6.5%		11,000.00	11,084.37
	TRANSOCEAN 5.875% REGS		5,010.06	4,114.66
	TRANSOCEAN 6.125% REGS		7,515.00	7,441.72
	TRANSOCEAN 6.25% REGS		6,300.00	5,545.00

		TRANSOCEAN 6.875% REGS		3,000.00	2,935.02	
		TRINSEO 5.375% REGS		19,000.00	16,625.00	
		TRONOX 6.5% REGS		12,000.00	10,915.32	
		ULTRA RESCS 11%		42,900.00	5,577.00	
		UNITED CONTINENTAL 5%		17,000.00	15,946.34	
		UNITED RENTALS 4.625%		15,000.00	14,987.55	
		UNITED RENTALS 4.875%		45,000.00	45,442.80	
		UNITED RENTALS 5.5% D		21,000.00	21,178.08	
		UNITED RENTALS 6.5%		10,000.00	10,493.90	
		VALEANT 5.5% REGS		29,000.00	29,418.76	
		VALEANT 9% REGS		25,000.00	26,965.00	
		VIACOM FLT		5,000.00	5,120.40	
		VIACOM FLT C		5,000.00	5,354.43	
		VIDEOTRON 5.125% REGS		28,000.00	29,070.44	
		VIDEOTRON 5.375% REGS		27,000.00	28,808.73	
		W&T OFFSHORE 9.75% REGS		7,000.00	5,011.30	
		WESCO 5.375%		10,000.00	10,282.30	
		WESTERN DIGI 4.75%		17,000.00	17,044.20	
		WHITING PETRO 1.25% CB		4,000.00	1,510.00	
		WHITING PETRO 6.625%		7,000.00	695.38	
		WILLIAM CARTER5.625%REGS		5,000.00	5,217.90	
		WMG ACQUISITION 5% REGS		10,000.00	10,207.90	
		WMG ACQUISITION5.5% REGS		4,000.00	4,155.00	
		WYNDHAM DESTINATI MLT 24		8,000.00	8,411.36	
		WYNDHAM DESTINATI MLT 25		2,000.00	2,192.70	
		WYNDHAM DESTINATI MLT 27		26,000.00	26,496.86	
		WYNN RESORTS 5.125% REGS		6,000.00	5,368.92	
		XPO LOGISTICS 6.75% REGS		22,000.00	22,501.82	
		XPO LOGISTICS6.125% REGS		9,000.00	9,132.30	
		YUM! BRANDS 4.75% REGS		7,000.00	7,290.99	
		ZAYO 5.75% REGS		22,000.00	22,398.42	
		ZAYO GRP 6%		10,000.00	10,206.60	
	計	銘柄数 :	420	6,663,877.10	5,584,447.92	
					(576,761,780)	
		組入時価比率 :	90.0%		99.8%	
	小計				576,761,780	
					(576,761,780)	
	合計				577,782,346	
					(577,782,346)	

(注)各通貨計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注)小計・合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各通貨計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

当表に記載すべき内容は、「デリバティブ取引等に関する注記 取引の時価等に関する事項」に開示しておりますので、記載を省略しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

(2020年4月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	1,900,215,364	円
負債総額	8,645,989	円
純資産総額( - )	1,891,569,375	円
発行済口数	3,040,433,410	口
1口当たり純資産額( / )	0.6221	円

(参考) G I M世界投資適格債券マザーファンド(適格機関投資家専用)

(2020年4月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	10,700,790,512	円
負債総額	1,836,038,628	円
純資産総額( - )	8,864,751,884	円
発行済口数	5,844,761,150	口
1口当たり純資産額( / )	1.5167	円

(参考) G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)

(2020年4月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	7,912,402,083	円
負債総額	228,222,008	円
純資産総額( - )	7,684,180,075	円
発行済口数	5,596,955,870	口
1口当たり純資産額( / )	1.3729	円

(参考) G I M米国高利回り社債マザーファンド(適格機関投資家専用)

(2020年4月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	633,619,521	円
負債総額	-	円
純資産総額( - )	633,619,521	円
発行済口数	303,229,514	口
1口当たり純資産額( / )	2.0896	円

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

<訂正前>

資本金の額（2019年10月末現在）

（略）

（略）

投資運用の意思決定機構

（イ）、（ロ）（略）

（注）前記（イ）および（ロ）の意思決定機構、組織名称等は、2019年10月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

資本金の額（2020年4月末現在）

（略）

（略）

投資運用の意思決定機構

（イ）、（ロ）（略）

（注）前記（イ）および（ロ）の意思決定機構、組織名称等は、2020年4月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

原届出書の「第三部委託会社等の情報 第1委託会社等の概況 2事業の内容及び営業の概況」について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行うとともに、金融商品取引法に定める金融商品取引業者として当該証券投資信託および投資一任契約に基づき委託された資産の運用（投資運用業）を行っています。また金融商品取引法に定める以下の業務を行っています。

- ・投資助言・代理業
- ・有価証券の募集もしくは売出しの取扱いまたは私募の取扱いに関する第一種金融商品取引業
- ・有価証券の募集もしくは売出しの取扱いまたは私募の取扱い、および証券投資信託の募集または私募に関する第二種金融商品取引業

委託会社が設定・運用している投資信託は、2020年4月末現在以下のとおりです（親投資信託は本数のみ。）。

	本数	純資産額（百万円）
公募追加型株式投資信託	67	692,218



公募単位型株式投資信託	-	-
公募追加型債券投資信託	-	-
公募単位型債券投資信託	-	-
私募投資信託	63	4,018,804
総合計	130	4,711,022
親投資信託	54	-

（注）百万円未満は四捨五入

### 3【委託会社等の経理状況】

#### <訂正前>

1. 委託会社であるJ Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社(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。以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号。以下「金融商品取引業等に関する内閣府令」という。)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

2. 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29期事業年度(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

3. 第29期事業年度より、日付の表示を和暦から西暦に変更しております。

#### <訂正後>

1. 委託会社であるJ Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社(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。以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号。以下「金融商品取引業等に関する内閣府令」という。)に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

2. 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29期事業年度(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

また、第30期中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、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。

原届出書「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」について、以下の中間財務諸表が追加されます。

#### <追加>

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第30期中間会計期間末 (2019年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		14,207,037
前払費用		56,845
未収入金		8,784
未収委託者報酬		1,928,542
未収収益		1,337,970
関係会社短期貸付金		3,300,000
その他		14,087
流動資産計		20,853,269
固定資産		
有形固定資産		
器具備品	1	23,160
有形固定資産計		23,160
投資その他の資産		
関係会社株式		60,000
投資有価証券		48,828
敷金保証金		98,745
前払年金費用		100,492
その他		55,013
投資その他の資産計		363,080
固定資産計		386,240
資産合計		21,239,510

(単位：千円)

第30期中間会計期間末

(2019年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

預り金 56,117

未払金 1,262,410

未払手数料 927,050

その他未払金 2 335,360

未払費用 645,623

未払法人税等 823,266

賞与引当金 1,193,264

役員賞与引当金 21,439

流動負債計 4,002,121

## 固定負債

長期未払金 285,932

賞与引当金 537,942

役員賞与引当金 194,404

繰延税金負債 30,770

固定負債計 1,049,049

## 負債合計

5,051,170

## 純資産の部

## 株主資本

資本金 2,218,000

## 資本剰余金

資本準備金 1,000,000

資本剰余金合計 1,000,000

## 利益剰余金

利益準備金 33,676

## その他利益剰余金

繰越利益剰余金 12,936,665

利益剰余金合計 12,970,341

株主資本合計 16,188,341

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金 1

評価・換算差額等合計 1

純資産合計 16,188,339

負債・純資産合計 21,239,510

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

		第30期中間会計期間
		(自2019年4月1日
		至2019年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		6,233,722
運用受託報酬		3,083,049
業務受託報酬		980,490
その他		52,983
営業収益計		10,350,245
営業費用		
支払手数料		3,313,168
調査費		844,332
その他営業費用		322,860
営業費用計		4,480,360
一般管理費		4,609,712
営業利益		1,260,173
営業外収益	1	30,880
営業外費用		4
経常利益		1,291,049
税引前中間純利益		1,291,049
法人税、住民税及び事業税		691,553
法人税等調整額		30,770
法人税等合計		722,324
中間純利益		568,725

## 重要な会計方針

項目	第30期中間会計期間 (自2019年4月1日 至2019年9月30日)
1. 有価証券の評価基準 及び評価方法	<p>(1) 関係会社株式 移動平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの 中間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。 時価のないもの 移動平均法による原価法を採用しております。</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対する賞与の支給に備えるため、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対する賞与の支給に備えるため、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員に対する退職給付に備えるため、当中間期末における退職給付債務と年金資産の見込額に基づき退職給付引当金を計上しております。ただし、当中間期末においては、年金資産の額が、退職給付債務に未認識数理計算上の差異等を加減した額を超過するため、資産の部に前払年金費用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中間期末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 過去勤務債務については、そ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（8年）による定額法により、発生した事業年度から費用処理しております。 数理計算上の差異は、そ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（8年）による定額法により按分額を、それぞれ発生した翌事業年度から費用処理することとしております。</p>
3. 固定資産の減価償却 方法	<p>有形固定資産 定率法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <p>器具備品 5年</p>
4. その他中間財務諸表 作成のための基本と なる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

第30期中間会計期間末 (2019年9月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	
器具備品	5,790千円
2 消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺の うえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債 の「その他未払金」に含めて表示しておりま す。	

## (中間損益計算書関係)

第30期中間会計期間 (自2019年4月1日 至2019年9月30日)	
1 営業外収益のうち主要なもの	
為替差益	9,871千円
受取利息	7,098千円

## (リース取引関係)

第30期中間会計期間末 (2019年9月30日)	
オペレーティング・リース取引のうち解約不能 のものに係る未経過リース料は以下のとおりであ ります。	
1年以内	44,442 千円
1年超	- 千円
合計	44,442 千円

## （金融商品関係）

第30期中間会計期間末（2019年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日における中間貸借対照表計上額、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と判断するものは次表には含めておりません。また、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません（（注）2．参照）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	14,207,037	14,207,037	-
(2) 未収委託者報酬	1,928,542	1,928,542	-
(3) 未収収益	1,337,970	1,337,970	-
(4) 関係会社短期貸付金	3,300,000	3,300,000	-
資産計	20,773,551	20,773,551	-
(1) 未払手数料	927,050	927,050	-
(2) その他未払金	335,360	335,360	-
(3) 未払費用	645,623	645,623	-
(4) 長期未払金	285,932	285,932	-
負債計	2,193,965	2,193,965	-

（注）1．金融商品の時価算定方法

資産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益、及び(4) 関係会社短期貸付金

これら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。

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、及び(3) 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。

(4) 長期未払金

長期未払金の時価については、当該未払金の支払までの期間を基にリスクフリーレートで割り引いた現在価値により算定しており、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。



## （注）２．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額
関係会社株式	60,000
投資有価証券（合同会社出資金）	48,810

上記の関係会社株式及び投資有価証券（合同会社出資金）については、市場価格がなく、かつ、将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、上表に含めておりません。

## 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

## （有価証券関係）

第30期中間会計期間末（2019年9月30日）

## １．関係会社株式

関係会社株式（中間貸借対照表計上額 60,000千円）については市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、記載しておりません。

## ２．その他有価証券

投資有価証券（合同会社出資金）（中間貸借対照表計上額 48,810千円）については市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、記載しておりません。

## （セグメント情報等）

## セグメント情報

当社は、資産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。

## 関連情報

第30期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

## 1．サービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	業務受託報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	6,233,722	3,083,049	980,490	52,983	10,350,245

## 2．地域ごとの情報

## 営業収益

（単位：千円）

日本	香港	英国	その他	合計
6,775,574	1,340,502	1,188,597	1,045,571	10,350,245

（注）営業収益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。

## 3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益	関連するセグメント
JPMorgan Asset Management (Asia Pacific) Limited	1,285,827	資産運用業
JPMorgan Asset Management (UK) Limited	1,187,009	資産運用業

## （1株当たり情報）

第30期中間会計期間 （自2019年4月1日 至2019年9月30日）	
1株当たり純資産額	287,715.98円
1株当たり中間純利益金額	10,107.97円
なお、潜在株式調整後1株当たり中間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。	
1株当たりの中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	568,725千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	568,725千円
普通株式の期中平均株式数	56,265株

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

原届出書の「第三部委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況 1 名称、資本金の額及び事業の内容」について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

## (1) 受託会社

名 称 三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額 324,279百万円（2019年9月末現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名 称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的: 原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本マスタートラスト信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## (2) 販売会社

	名 称	資本金の額 (2019年9月末現在)	事業の内容
1	a u カブコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
2	株式会社SBI証券	48,323百万円	同 上
3	楽天証券株式会社	7,495百万円	同 上
4	S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	同 上
5	株式会社S M B C 信託銀行	87,550百万円 (2019年3月末現在)	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## (3) 運用委託先の会社

名 称	資本金の額 (2019年9月末現在)	事業の内容
J . P . モルガン・インベストメント・マネージメント・インク	450万米ドル	投資運用業務および投資顧問業務を行っています。

## 独立監査人の監査報告書

2020年4月15日

J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	鶴田光夫
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山口健志

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JPMグローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）の2019年9月11日から2020年3月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表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、JPMグローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）の2020年3月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況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

JPMモルガン・アセット・マネジメント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データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年12月9日

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	鶴田光夫
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山口健志

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J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、重要な会計方針及びその他の注記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に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、J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績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

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。