

【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】 2021年 9月13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 U S トレジャー・インカム・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】

繰上償還を行うことが決定されましたので、2021年1月14日付で提出した有価証券届出書（2021年7月14日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。以下「原届出書」といいます。）において、第一部および第二部における繰上償還に関連する記載等に関し訂正を行うため、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】

#### （7）申込期間

##### <訂正前>

2021年1月15日から2022年1月13日までとします。

申込期間は、前記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

##### <訂正後>

2021年1月15日から2021年10月13日までとします。

（注）当ファンドは2021年10月15日に信託を終了（繰上償還）します。

### 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

##### （イ）ファンドの目的

##### <訂正前>

##### （略）

\* 1 「実質的に同一の運用の基本方針」とは、投資の対象とする資産の種類、運用方針、運用方法、投資の対象とする資産についての保有額もしくは保有割合にかかる制限または取得できる範囲にかかる制限その他の運用上の制限が実質的に同一（マザーファンドにおける収益分配方針およびマザーファンドへの投資にかかるものを除きます。）のものをいいます。

\* 2 「ジニー・メイ・パス・スルー証券」とは、米国政府抵当金庫保証モーゲージ・バック証券とも呼ばれ、住宅ローン債権を証券化したもので、担保となっている住宅ローンから金利の支払いや元本の返済がなされます。ジニー・メイ（米国政府抵当金庫）によって元本・利息の支払いについて信用補完がされています。

##### <訂正後>

##### （略）

\* 1 「実質的に同一の運用の基本方針」とは、投資の対象とする資産の種類、運用方針、運用方法、投資の対象とする資産についての保有額もしくは保有割合にかかる制限または取得できる範囲にかかる制限その他の運用上の制限が実質的に同一（マザーファンドにおける収益分配方針およびマザーファンドへの投資にかかるものを除きます。）のものをいいます。

\* 2 「ジニー・メイ・パス・スルー証券」とは、米国政府抵当金庫保証モーゲージ・バック証券とも呼ばれ、住宅ローン債権を証券化したもので、担保となっている住宅ローンから金利の支払いや元本の返済がなされます。ジニー・メイ（米国政府抵当金庫）によって元本・利息の支払いについて信用補完がされています。

（注）当ファンドは2021年10月15日に繰上償還されます。当ファンドは、償還にむけてマザーファンドの売却を開始した場合には、本書に記載する運用は行えません。（以下同じ。）

#### （二）ファンドの特色

##### <訂正前>

##### （略）

（略）

\* 1 15日が休業日の場合は翌営業日となります。

\* 2 「配当等収益」とは、配当金、利金、貸付有価証券にかかる品賃料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。配当等収益には、マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドの信託財産に帰属するとみなされる額（マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に対する当ファンドの信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額。）を含みます。

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

（以下略）

< 訂正後 >

（略）

（略）

\* 1 15日が休業日の場合は翌営業日となります。当ファンドは繰上償還されるため、最後の決算日は2021年9月15日となります。

\* 2 「配当等収益」とは、配当金、利金、貸付有価証券にかかる品賃料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。配当等収益には、マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドの信託財産に帰属するとみなされる額（マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に対する当ファンドの信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額。）を含みます。

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

（以下略）

## （ 2 ） ファンドの沿革

< 訂正前 >

2003年12月16日 マザーファンドの信託契約締結、および設定・運用開始  
 2005年2月25日 当ファンドの信託契約締結、および設定・運用開始  
 2006年1月4日 当ファンドおよびマザーファンドの名称変更  
 2015年5月29日 マザーファンドの名称変更

< 訂正後 >

2003年12月16日 マザーファンドの信託契約締結、および設定・運用開始  
 2005年2月25日 当ファンドの信託契約締結、および設定・運用開始  
 2006年1月4日 当ファンドおよびマザーファンドの名称変更  
 2015年5月29日 マザーファンドの名称変更  
2021年10月15日 当ファンドの信託終了（予定）

## （ 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（2021年5月末現在）  
 ~ （略）  
 大株主の状況（2021年5月末現在）

（以下略）

< 訂正後 >

資本金 2,218百万円（2021年7月末現在）  
 ~ （略）  
 大株主の状況（2021年7月末現在）

（以下略）

## 2【投資方針】

### (1) 投資方針

#### (イ) 運用方針

< 訂正前 >

(略)

マザーファンドは、米国国債および信用度がそれと同等とみなされるジニー・メイ・パス・スルー証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として運用を行います。

< 訂正後 >

(略)

マザーファンドは、米国国債および信用度がそれと同等とみなされるジニー・メイ・パス・スルー証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として運用を行います。

(注) 当ファンドは2021年10月15日に繰上償還されます。当ファンドは、償還にむけてマザーファンドの売却を開始した場合には、本書に記載する運用は行えません。(以下同じ。)

## 3【投資リスク】

### (1) リスク要因

< 訂正前 >

(略)

～ (略)

繰上償還等について

当ファンドは、信託期間中において、信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなった場合、委託会社が受益者のため有利であると認める場合、またはやむを得ない事情が発生した場合には、信託期間の途中であっても繰上償還することがあります。また、投資環境の変化等により、委託会社が当ファンドの申込期間を更新しないことや申込みの受付を停止することがあります。この場合は新たに当ファンドを購入することはできなくなります。

(以下略)

< 訂正後 >

(略)

～ (略)

繰上償還等について

(注) 当ファンドは2021年10月15日に信託を終了（繰上償還）します。

当ファンドは、信託期間中において、信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなった場合、委託会社が受益者のため有利であると認める場合、またはやむを得ない事情が発生した場合には、信託期間の途中であっても繰上償還することがあります。また、投資環境の変化等により、委託会社が当ファンドの申込期間を更新しないことや申込みの受付を停止することがあります。この場合は新たに当ファンドを購入することはできなくなります。

(以下略)

## 4【手数料等及び税金】

### (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2021年5月末現在適用されるものです。

（以下略）

< 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2021年7月末現在適用されるものです。

（以下略）

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

申込方法

< 訂正前 >

（略）

取得申込みの受付を行わない日（申込受付中止日）については、販売会社にお問い合わせください。

< 訂正後 >

（略）

取得申込みの受付を行わない日（申込受付中止日）については、販売会社にお問い合わせください。

（注）当ファンドの受益権の取得申込みの受付は2021年10月13日までです。なお、当ファンドは2021年10月15日に信託を終了します。

### 2【換金（解約）手続等】

換金方法

< 訂正前 >

（略）

換金方法には、解約請求と買取請求の2つの方法があります。販売会社によっては、解約請求のみの取扱いの場合があります。

< 訂正後 >

（略）

換金方法には、解約請求と買取請求の2つの方法があります。販売会社によっては、解約請求のみの取扱いの場合があります。

（注）当ファンドの換金申込みの受付は2021年10月13日までです。なお、当ファンドは2021年10月15日に信託を終了します。

### 3【資産管理等の概要】

< 訂正前 >

（略）

（3）信託期間

無期限です。

ただし、後記「（5）その他 信託の終了等」に記載する特定の場合には、信託は終了します。

（4）計算期間

（略）

なお、計算期間終了日を「決算日」ということがあり、前記より当ファンドの決算日は原則として毎月15日(該当日が休業日の場合は翌営業日)となります。

(5) その他

信託の終了等(詳しくは、信託約款をご参照ください。)

(略)

信託約款の変更(詳しくは、信託約款をご参照ください。)

(以下略)

<訂正後>

(略)

(3) 信託期間

2005年2月25日から2021年10月15日までです。

(4) 計算期間

(略)

なお、計算期間終了日を「決算日」ということがあり、前記より当ファンドの決算日は原則として毎月15日(該当日が休業日の場合は翌営業日)となります。

(注) 当ファンドは2021年10月15日に信託を終了します。なお、当ファンドの最終計算期間は、2021年9月16日から2021年10月15日までとします。

(5) その他

信託の終了等(詳しくは、信託約款をご参照ください。)

(注) 当ファンドは2021年10月15日に信託を終了します。

(略)

信託約款の変更(詳しくは、信託約款をご参照ください。)

(注) 当ファンドは信託の終了までに信託約款を変更する予定はありません。

(以下略)

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(2021年5月末現在)

資本金の額	2,218百万円
会社が発行する株式の総数	70,000株
発行済株式総数	56,265株

(略)

投資運用の意思決定機構

(略)

(注)前記(イ)、(ロ)および(ハ)の意思決定機構、組織名称等は、2021年5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(2021年7月末現在)

資本金の額	2,218百万円
会社が発行する株式の総数	70,000株
発行済株式総数	56,265株

(略)

投資運用の意思決定機構

(略)

(注)前記(イ)、(ロ)および(ハ)の意思決定機構、組織名称等は、2021年7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】

<訂正前>

(略)

委託会社が設定・運用している投資信託は、2021年5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	73	835,065
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	5,087,081
総合計	136	5,922,146
親投資信託	55	-

(注)百万円未満は四捨五入

<訂正後>

(略)

委託会社が設定・運用している投資信託は、2021年7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	71	806,520
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	66	5,224,894
総合計	137	6,031,414
親投資信託	55	-

(注)百万円未満は四捨五入