

【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（SMA専用）

【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2月24日付で提出した有価証券届出書（2021年8月24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2月25日から2022年2月24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2月25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。）

#### （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

- 2007年2月16日 当ファンドの信託契約締結、および設定・運用開始
- 2012年3月15日 当ファンドの換金価格を、一部解約の実行請求日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額から、一部解約の実行請求日の翌営業日の基準価額に変更
- 2015年5月29日 マザーファンドの名称変更

## &lt; 訂正後 &gt;

- 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
- 2007年2月16日 当ファンドの信託契約締結、および設定・運用開始
- 2012年3月15日 当ファンドの換金価格を、一部解約の実行請求日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額から、一部解約の実行請求日の翌営業日の基準価額に変更
- 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

## &lt; 訂正前 &gt;

- 資本金 2,218百万円（2021年6月末現在）
- ～（略）
- 大株主の状況（2021年6月末現在）
- （以下略）

## &lt; 訂正後 &gt;

- 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

## &lt; 訂正前 &gt;

(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。

## &lt; 訂正後 &gt;

(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。）

## (4) 分配方針

## &lt; 訂正前 &gt;

毎計算期間終了時に、以下の方針に基づき分配を行います。

なお、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。

## 分配対象額の範囲

（以下略）

<訂正後>

毎計算期間終了時に、以下の方針に基づき分配を行います。

なお、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。

信託終了日までの間に分配は行いません。

## 分配対象額の範囲

（以下略）

## 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6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)

当ファンドは、投資者と販売会社の間のSMA(セパレートリー・マネージド・アカウント)にかかる契約に基づいて、SMA取引口座の資金を運用するためのファンドです。

当ファンドの取得申込みを行う投資者は、原則として販売会社にSMA取引口座を開設した方に限るものとします。

<訂正後>

(略)

当ファンドは、投資者と販売会社の間のSMA(セパレートリー・マネージド・アカウント)にかかる契約に基づいて、SMA取引口座の資金を運用するためのファンドです。

当ファンドの取得申込みを行う投資者は、原則として販売会社にSMA取引口座を開設した方に限るものとします。

(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)

換金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年5月25日および11月25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

2006年2月16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年5月25日および11月25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5月26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6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6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

&lt; 訂正後 &gt;

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】

&lt; 訂正前 &gt;

(略)

委託会社が設定・運用している投資信託は、2021年6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	72	839,217
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	64	5,150,991
総合計	136	5,990,208
親投資信託	55	-

(注) 百万円未満は四捨五入

&lt; 訂正後 &gt;

(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