

【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】 2022年 8 月12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 コア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）

【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、2022年2月14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より訂正するため、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

< 訂正前 >

(略)

投資先ファンドの特徴

米国総合債券ファンド

(略)	
ベンチマーク*1	ブルームバーグ米国総合インデックス 「Bloomberg」およびブルームバーグ米国総合インデックスは、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited（以下「BISL」）をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）のサービスマークであり、J.P.モルガン・アセット・マネジメントによる特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはJ.P.モルガン・アセット・マネジメントとは提携しておらず、また、J.P.モルガン・アセット・マネジメントが設定する商品を承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、J.P.モルガン・アセット・マネジメントが設定する商品に関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません。
運用会社	J.P.モルガン・インベストメント・マネジメント・インク*2（米国法人）（以下「JPMIM社」という場合があります。）

(略)

マネープール・ファンド

(略)	
運用会社	J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社*2（委託会社） マネープール・マザーファンドの運用の指図の権限を J P モルガン・アセット・マネジメント（UK）リミテッド*2（英国法人）に委託します（以下「運用委託先」という場合があります。）。

*1 (略)

*2 (略)

< 訂正後 >

(略)

投資先ファンドの特徴

米国総合債券ファンド

(略)

ベンチマーク*1	<p>ブルームバーグ米国総合インデックス</p> <p>「Bloomberg_」およびブルームバーグ米国総合インデックスは、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg IndexServices Limited（以下「BISL」）をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）のサービスマークであり、J.P.モルガン・アセット・マネジメントによる特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはJ.P.モルガン・アセット・マネジメントとは提携しておらず、また、J.P.モルガン・アセット・マネジメントが設定する商品を承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、J.P.モルガン・アセット・マネジメントが設定する商品に関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません。</p>
運用会社	<p>J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク（米国法人）（以下「JPMIM社」という場合があります。）</p> <p>2022年6月末時点において実際に運用を行っている運用会社であり、今後変更される場合があります。</p>

（略）

マネープール・ファンド

（略）	
運用会社	<p>J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社*2（委託会社）</p> <p>マネープール・マザーファンドの運用の指図の権限をJ Pモルガン・アセット・マネジメント（UK）リミテッド*2（英国法人）に委託します（以下「運用委託先」という場合があります。）。</p> <p>2022年6月末時点では運用委託先が実際に運用を行っていますが、今後変更される場合があります。</p>

*1（略）

*2（略）

（注）資金動向、市況動向、経済情勢、投資環境等の変化に対応するために、やむを得ない事情がある場合には、前記にしたがった運用が行えないことがあります。

（3）ファンドの仕組み

<訂正前>

（略）

（八）委託会社の概況

資本金 2,218百万円（2021年12月末現在）

（略）

大株主の状況（2021年12月末現在）

（以下略）

<訂正後>

（略）

（八）委託会社の概況

資本金 2,218百万円（2022年6月末現在）

（略）

大株主の状況（2022年6月末現在）

（以下略）

2【投資方針】

(1) 投資方針

< 訂正前 >

(略)

(ロ) 投資態度

マザーファンドの投資態度

マザーファンドは、投資対象とする投資適格債券に投資することにより、配当等収益を確保し、信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として、米国総合債券ファンドの組入比率を高位に保ちます。また、円建ての公社債への投資により安定した収益を確保することを目的として、マネープール・ファンドにも必ず投資します。

投資先ファンドの投資態度および運用プロセス

(略)

マネープール・ファンド

・ 投資態度

マネープール・マザーファンドを通じ、日本の発行体が発行する円建ての公社債を中心に投資し、元本の安定性と安定した収益の確保を図るとともに、高い流動性の確保に配慮します。

・ 運用プロセス

(以下略)

< 訂正後 >

(略)

(ロ) 投資態度

マザーファンドの投資態度

マザーファンドは、投資対象とする投資適格債券に投資することにより、配当等収益を確保し、信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として、米国総合債券ファンドの組入比率を高位に保ちます。また、円建ての公社債への投資により安定した収益を確保することを目的として、マネープール・ファンドにも必ず投資します。

なお、資金動向、市況動向、経済情勢、投資環境等の変化に対応するために、やむを得ない事情がある場合には、前記にしたがった運用が行えないことがあります。

投資先ファンドの投資態度および運用プロセス

(略)

マネープール・ファンド

・ 投資態度

マネープール・マザーファンドを通じ、日本の発行体が発行する円建ての公社債を中心に投資し、元本の安定性と安定した収益の確保を図るとともに、高い流動性の確保に配慮します。ただし、市況動向に急激な変化が生じた場合、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、このような運用ができないことがあります。

・ 運用プロセス

(以下略)

(2) 投資対象

< 訂正前 >

(略)

(参考) マザーファンドの投資対象

(略)

(ホ) マザーファンドが投資対象とする投資先ファンドの名称、主要投資対象、主な運用方針および運用会社の名称は、以下のとおりです。

米国総合債券ファンド

(略)	(略)
運用会社	J.P. モルガン・インベストメント・マネージメント・インク(米国法人)

マネープール・ファンド

(略)	(略)
運用会社	J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社(委託会社) マネープール・マザーファンドの運用の指図の権限を J P モルガン・アセット・マネジメント(UK)リミテッド(英国法人)に委託します。

<訂正後>

(略)

(参考) マザーファンドの投資対象

(略)

(ホ) マザーファンドが投資対象とする投資先ファンドの名称、主要投資対象、主な運用方針および運用会社の名称は、以下のとおりです。

米国総合債券ファンド

(略)	(略)
運用会社	J.P. モルガン・インベストメント・マネージメント・インク(米国法人) 2022年6月末時点において実際に運用を行っている運用会社であり、今後変更される場合があります。

マネープール・ファンド

(略)	(略)
運用会社	J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社(委託会社) マネープール・マザーファンドの運用の指図の権限を J P モルガン・アセット・マネジメント(UK)リミテッド(英国法人)に委託します。 2022年6月末時点では運用委託先が実際に運用を行っていますが、今後変更される場合があります。

(3) 運用体制

<訂正前>

(イ) マザーファンドの運用体制

(略)

(注) 前記の運用体制、組織名称等は、2022年1月4日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(略)

(ハ) 投資先ファンドの運用体制

以下は、投資先ファンドにおける運用体制です。

米国総合債券ファンド

当該投資先ファンドの運用は、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米国コア債券運用チーム（約10名（2021年9月末現在））のポートフォリオ・マネジャーが行います。

（略）

（注1）（略）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、2021年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

マネープール・ファンド

以下は、当該投資先ファンドの主要投資先であるマネープール・マザーファンドにおける運用体制です。

マネープール・マザーファンドの運用は、グローバル債券運用グループのグローバル・レイツ・チーム（約20名（2021年9月末現在））に所属するJ P モルガン・アセット・マネジメント（U K）リミテッドのポートフォリオ・マネジャーが行います。

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2021年12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）マザーファンドの運用体制

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2022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。

（略）

（ハ）投資先ファンドの運用体制

以下は、投資先ファンドにおける運用体制です。

米国総合債券ファンド

当該投資先ファンドの運用は、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米国コア債券運用チーム（約10名（2022年3月末現在））のポートフォリオ・マネジャーが行います。

（略）

（注1）（略）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、2022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。

マネープール・ファンド

以下は、当該投資先ファンドの主要投資先であるマネープール・マザーファンドにおける運用体制です。

マネープール・マザーファンドの運用は、グローバル債券運用グループのグローバル・レイツ・チーム（約20名（2022年3月末現在））に所属するJ P モルガン・アセット・マネジメント（U K）リミテッドのポートフォリオ・マネジャーが行います。

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2022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。

（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」末尾の参考情報について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

参考情報

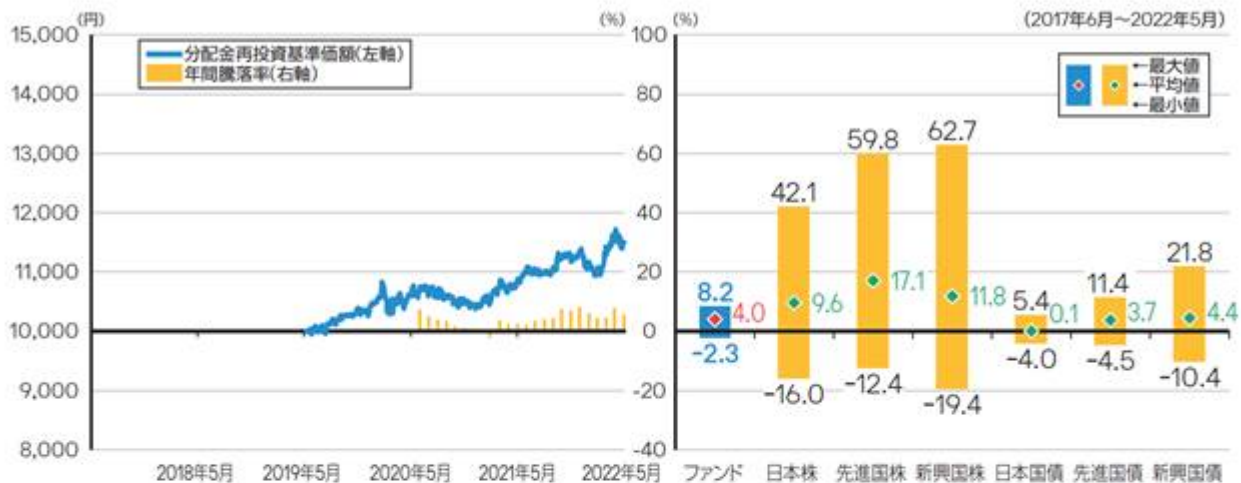
下記グラフは、ファンドの投資リスクをご理解いただくための情報の一つとしてご利用ください。

<ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移>

2017年6月～2022年5月の5年間に於ける、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。ただし、ファンドは設定から6年未満で、設定日から2020年5月末までは年間騰落率が算出されないことから、それ以降の毎月末時点における年間騰落率を用いています。
- 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、委託会社で円換算しています。

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

MSCI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)を委託会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

<訂正前>

(略)

(ロ) 投資先ファンドにおけるリスク管理

米国総合債券ファンド

(略)

(2021年12月末現在)

（略）

マネープール・ファンド

（略）

（2021年12月末現在）

（以下略）

<訂正後>

（略）

（ロ）投資先ファンドにおけるリスク管理

米国総合債券ファンド

（略）

（2022年6月末現在）

（略）

マネープール・ファンド

（略）

（2022年6月末現在）

（以下略）

4【手数料等及び税金】

（4）その他の手数料等

<訂正前>

（略）

（へ）ご参考：投資先ファンドのその他の手数料等

（略）

米国総合債券ファンド

事務管理費用*が実費でかかります。

ただし、当該投資先ファンドの会計期間中につき、日々の純資産総額に対し0.11%（年率）を上限とします。

（略）

マネープール・ファンド

（略）

当該投資先ファンドの監査費用*は、実際に支払う金額を支弁する方法に代えて、信託財産の純資産総額に年率0.022%（税抜0.02%）を乗じて得た額（ただし、年間330万円（税抜300万円）を上限とします。）を当該監査費用とみなし、委託会社はそのみなし額の支弁を、当該投資先ファンドの毎計算期間の最初の6ヵ月終了日、毎計算期間終了日および信託終了日の翌営業日以降、当該投資先ファンドの信託財産中から受けるものとします。委託会社が当該投資先ファンドの信託財産から支弁を受ける金額については、当該投資先ファンドの計算期間を通じて毎日費用計上するものとします。

（以下略）

< 訂正後 >

（略）

（へ）ご参考：投資先ファンドのその他の手数料等

（略）

米国総合債券ファンド

事務管理費用*が実費でかかります。

ただし、当該投資先ファンドの会計期間中につき、日々の純資産総額に対し0.10%（年率）を上限とします。

（略）

マネープール・ファンド

（略）

当該投資先ファンドの監査費用*は、実際に支払う金額を支弁する方法に代えて、信託財産の純資産総額に年率0.022%（税抜0.02%）を乗じて得た額（ただし、年間330万円（税抜300万円）を上限とします。）を当該監査費用とみなし、委託会社はのみなし額の支弁を、当該投資先ファンドの毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）、毎計算期間終了日および信託終了日の翌営業日以降、当該投資先ファンドの信託財産中から受けるものとします。委託会社が当該投資先ファンドの信託財産から支弁を受ける金額については、当該投資先ファンドの計算期間を通じて毎日費用計上するものとします。

（以下略）

（5）課税上の取扱い

< 訂正前 >

（略）

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12月末現在適用されるものです。

（略）

法人、個人別の課税の取扱いについて

（a）個人の受益者に対する課税

（略）

（二）少額投資非課税制度について

公募株式投資信託は、税法上の少額投資非課税制度である「NISA」および「ジュニアNISA」の適用対象です。毎年、NISAをご利用の場合は年間120万円の範囲で、またジュニアNISAをご利用の場合は年間80万円の範囲で、新たに取得した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、その年の1月1日現在、NISAをご利用の場合は満20歳以上の方、ジュニアNISAをご利用の場合は満20歳未満の方で、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、少額投資非課税制度をご利用の場合、非課税口座で生じた配当所得および譲渡所得を、非課税口座以外で生じた配当所得および譲渡所得と損益通算することはできません。詳しくは販売会社にご確認ください。

（以下略）

< 訂正後 >

（略）

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2022年6月末現在適用されるものです。

(略)

法人、個人別の課税の取扱について

(a) 個人の受益者に対する課税

(略)

(二) 少額投資非課税制度について

公募株式投資信託は、税法上の少額投資非課税制度である「NISA」および「ジュニアNISA」の適用対象です。少額投資非課税制度をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、非課税口座で生じた配当所得および譲渡所得を、非課税口座以外で生じた配当所得および譲渡所得と損益通算することはできません。詳しくは販売会社にご確認ください。

(以下略)

5【運用状況】

原届出書「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】

(2022年6月1日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	432,570,590	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	188,487	0.04
合計(純資産総額)		432,382,103	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。

親投資信託は、全て「GIM USコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)」です(以下同じ)。

(参考) GIM USコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)

(2022年6月1日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	994,453	0.07
投資証券	ルクセンブルク	1,369,815,983	99.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	6,740,536	0.49
合計(純資産総額)		1,377,550,972	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。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(2022年6月1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	GIM USコア債券マザーファンド (為替ヘッジなし)(適格機関投資家 専用)	362,955,689	1.1903	432,026,157	1.1918	432,570,590	100.04

(参考) GIM USコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)

(2022年6月1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	ルクセンブルク	投資証券	JPM US AGGR BOND X(MTH) JPY	124,201.286	10,802.89	1,341,733,755	11,029	1,369,815,983	99.44
2	日本	投資信託 受益証券	GIMジャパン・マネーブ ール・ファンドF(適格機関投 資家専用)	996,247	1.0016	997,840	0.9982	994,453	0.07

種類別投資比率

(2022年6月1日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.04

(参考) G I M U S コア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)

(2022年6月1日現在)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.07
投資証券	99.44

【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】

2022年6月1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1特定期間末	(2019年11月15日)	328	329	1.0229	1.0244
第2特定期間末	(2020年5月15日)	410	411	1.0420	1.0435
第3特定期間末	(2020年11月16日)	803	805	1.0392	1.0407
第4特定期間末	(2021年5月17日)	743	744	1.0606	1.0621
第5特定期間末	(2021年11月15日)	512	513	1.1058	1.1073
第6特定期間末	(2022年5月16日)	462	463	1.1311	1.1326
	2021年6月末日	747	-	1.0816	-
	2021年7月末日	694	-	1.0810	-
	2021年8月末日	656	-	1.0814	-
	2021年9月末日	640	-	1.0872	-
	2021年10月末日	520	-	1.1033	-
	2021年11月末日	496	-	1.1023	-
	2021年12月末日	497	-	1.1100	-
	2022年1月末日	485	-	1.0914	-
	2022年2月末日	478	-	1.0732	-
	2022年3月末日	485	-	1.1041	-
	2022年4月末日	463	-	1.1340	-
	2022年5月末日	428	-	1.1227	-
	2022年6月1日	432	-	1.1319	-

(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す。

【分配の推移】

期	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0030
第2特定期間	0.0045
第3特定期間	0.0045
第4特定期間	0.0045
第5特定期間	0.0045
第6特定期間	0.0045

【収益率の推移】

期	収益率（％）
第1 特定期間	2.59
第2 特定期間	2.31
第3 特定期間	0.16
第4 特定期間	2.49
第5 特定期間	4.69
第6 特定期間	2.69

（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1 特定期間	351,295,968	29,886,039	321,409,929
第2 特定期間	170,696,051	97,765,443	394,340,537
第3 特定期間	428,408,150	49,127,746	773,620,941
第4 特定期間	102,127,267	174,592,904	701,155,304
第5 特定期間	33,289,341	270,985,938	463,458,707
第6 特定期間	13,921,841	68,215,762	409,164,786

（注1）第1 特定期間の設定口数には、当初申込期間中の設定口数を含みます。

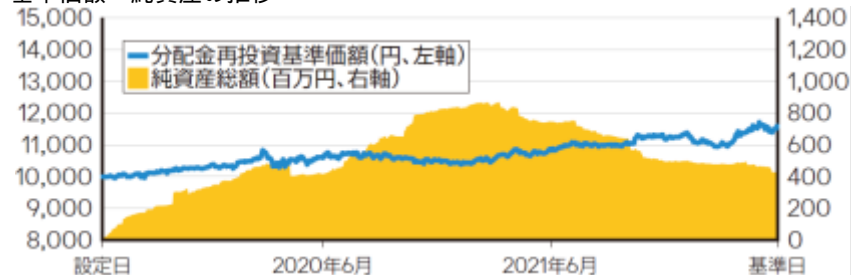
（注2）設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

<参考情報>

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	2022年6月1日	設定日	2019年6月10日
純資産総額	432百万円	決算回数	年6回

基準価額・純資産の推移



分配の推移

期	年月	円
14期	2021年9月	15
15期	2021年11月	15
16期	2022年1月	15
17期	2022年3月	15
18期	2022年5月	15
	設定来累計	255

* 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。

* 分配金は税引前1万口当たりの金額です。

ポートフォリオの構成状況

資産の種類	投資比率 1
J P M U S アグリゲート・ボンド（Xクラス）（円建て）	99.4%
G I M ジャパン・マネーブル・ファンドF（適格機関投資家専用）	0.1%
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%

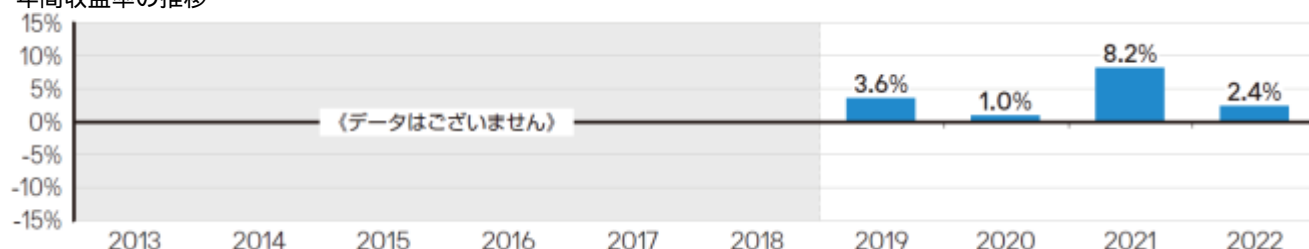
種類別構成状況

種類	投資比率 2
社債	32.3%
国債・政府機関債等	27.5%
住宅ローン担保証券等	25.0%
商業用不動産担保証券	12.1%
資産担保証券	0.8%
地方債	0.2%

組入上位銘柄

順位	銘柄名	債券種別	クーポン(%)	償還日	投資比率 ^②
1	ジニーメイ	住宅ローン担保証券等	2.500%	2051/8/20	1.8%
2	米国国債	国債・政府機関債等	2.875%	2025/5/31	1.3%
3	米国国債	国債・政府機関債等	1.500%	2023/2/28	1.2%
4	米国国債	国債・政府機関債等	1.250%	2028/4/30	1.1%
5	米国国債	国債・政府機関債等	1.875%	2032/2/15	1.1%
6	米国国債	国債・政府機関債等	0.875%	2026/6/30	1.0%
7	ファニーメイ	住宅ローン担保証券等	3.500%	2052/6/25	0.9%
8	米国国債	国債・政府機関債等	1.250%	2028/6/30	0.9%
9	米国国債	国債・政府機関債等	2.875%	2029/4/30	0.8%
10	米国国債	国債・政府機関債等	1.875%	2041/2/15	0.8%

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

* 2019年の年間収益率は設定日から年末営業日、2022年の年間収益率は前年末営業日から2022年6月1日までのものです。

* ベンチマークは設定していません。

* 当ページにおける「ファンド」は、J P M U S コア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）です。

運用実績において、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。

1 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。

2 ファンドは各投資先ファンドを通じて投資を行うため、各投資先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。なお、運用実績の基準日のファンドの基準価額算出に使用されているデータ（J P M U S アグリゲート・ボンド（Xクラス）（円建て）およびG I M ジャパン・マネーブル・ファンドF（適格機関投資家専用）は2022年5月最終営業日のもの）を使用しています。

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6特定期間（2021年11月16日から2022年5月16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 USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 (2021年11月15日現在)	当期 (2022年5月16日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	514,124,797	464,183,495
流動資産合計	514,124,797	464,183,495
資産合計	514,124,797	464,183,495
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	695,188	613,747
未払受託者報酬	31,700	26,677
未払委託者報酬	792,515	667,005
その他未払費用	105,634	88,901
流動負債合計	1,625,037	1,396,330
負債合計	1,625,037	1,396,330
純資産の部		
元本等		
元本	1,463,458,707	1,409,164,786
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	49,041,053	53,622,379
（分配準備積立金）	29,505,063	35,623,953
元本等合計	512,499,760	462,787,165
純資産合計	512,499,760	462,787,165
負債純資産合計	514,124,797	464,183,495

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 (自 2021年5月18日 至 2021年11月15日)	当期 (自 2021年11月16日 至 2022年5月16日)
営業収益		
有価証券売買等損益	32,998,800	14,948,822
営業収益合計	32,998,800	14,948,822
営業費用		
受託者報酬	109,224	79,812
委託者報酬	2,730,434	1,995,312
その他費用	2,363,951	2,265,933
営業費用合計	3,203,609	2,341,057
営業利益又は営業損失 ()	29,795,191	12,607,765
経常利益又は経常損失 ()	29,795,191	12,607,765
当期純利益又は当期純損失 ()	29,795,191	12,607,765
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 ()	2,792,885	1,411,687
期首剰余金又は期首欠損金 ()	42,494,656	49,041,053
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,833,753	1,414,241
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,833,753	1,414,241
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,701,394	6,078,575
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,701,394	6,078,575
分配金	12,588,268	11,950,418
期末剰余金又は期末欠損金 ()	49,041,053	53,622,379

(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
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	特定期間末日の取扱い 2022年5月15日が休日のため、信託約款第30条により、第6特定期間末日を2022年5月16日としております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

前期 (2021年11月15日現在)	当期 (2022年5月16日現在)
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当特定期間の翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	前期 (2021年11月15日現在)	当期 (2022年5月16日現在)
1 期首元本額	701,155,304円	463,458,707円
期中追加設定元本額	33,289,341円	13,921,841円
期中一部解約元本額	270,985,938円	68,215,762円
受益権の総数	463,458,707口	409,164,786口
1 口当たりの純資産額	1.1058円	1.1311円
(1 万口当たりの純資産額)	(11,058円)	(11,311円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期	当期
	(自 2021年5月18日 至 2021年11月15日)	(自 2021年11月16日 至 2022年5月16日)
1 分配金の計算過程	(自 2021年5月18日 至 2021年7月15日)	(自 2021年11月16日 至 2022年1月17日)
費用控除後の配当等収益額	3,259,709円	1,575,733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	2,862,796円	- 円
収益調整金額	26,624,710円	18,814,450円
分配準備積立金額	20,379,342円	28,068,967円
当ファンドの分配対象収益額	53,126,557円	48,459,150円
当ファンドの期末残存口数	663,198,013口	448,524,150口
1万口当たり収益分配対象額	801.06円	1,080.41円
1万口当たり分配金額	15.00円	15.00円
収益分配金金額	994,797円	672,786円
	(自 2021年7月16日 至 2021年9月15日)	(自 2022年1月18日 至 2022年3月15日)
費用控除後の配当等収益額	2,042,047円	1,622,489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	24,494,581円	18,689,426円
分配準備積立金額	22,417,243円	28,469,549円
当ファンドの分配対象収益額	48,953,871円	48,781,464円
当ファンドの期末残存口数	598,855,390口	442,590,020口
1万口当たり収益分配対象額	817.45円	1,102.18円
1万口当たり分配金額	15.00円	15.00円
収益分配金金額	898,283円	663,885円
	(自 2021年9月16日 至 2021年11月15日)	(自 2022年3月16日 至 2022年5月16日)
費用控除後の配当等収益額	2,312,188円	2,100,060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	9,915,844円	7,201,771円
収益調整金額	19,535,990円	17,998,426円
分配準備積立金額	17,972,219円	26,935,869円
当ファンドの分配対象収益額	49,736,241円	54,236,126円
当ファンドの期末残存口数	463,458,707口	409,164,786口
1万口当たり収益分配対象額	1,073.15円	1,325.53円
1万口当たり分配金額	15.00円	15.00円
収益分配金金額	695,188円	613,747円
2 その他費用の内訳	監査費用 72,756円 その他 291,195円	監査費用 53,154円 その他 212,779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	当ファンドが保有した主な金融商品は、以下に記載される親投資信託受益証券であります。 G I M U Sコア債券マザーファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用） 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、親投資信託受益証券と同様のリスクを伴います。親投資信託受益証券には、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。当該リスクは結果的に当ファンドに影響を及ぼします。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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。 (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、運用成果やリスク水準のチェック等を行います。 (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。

金融商品の時価等に関する事項

	前期 (2021年11月15日現在)	当期 (2022年5月16日現在)
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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2)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。	(1)有価証券 同左 (2)有価証券以外の金融商品 同左
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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 (2021年11月15日現在)	当期 (2022年5月16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	13,268,330	22,317,858
合計	13,268,330	22,317,858

(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(2022年5月16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 U S コア債券マザーファンド (為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)	389,939,092	464,183,495	
合計			389,939,092	464,183,495	

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 USコア債券マザーファンド（為替ヘッジなし）（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 USコア債券マザーファンド（為替ヘッジなし）（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	(2021年11月15日現在)	(2022年5月16日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		21,687,777	9,845,271
投資信託受益証券		997,840	994,354
投資証券		1,604,805,094	1,382,347,537
未収入金		10,400,000	-
未収配当金		3,900,363	3,263,806
流動資産合計		1,641,791,074	1,396,450,968
資産合計		1,641,791,074	1,396,450,968
負債の部			
流動負債			
未払解約金		13,353,438	-
その他未払費用		929,227	736,251
流動負債合計		14,282,665	736,251
負債合計		14,282,665	736,251
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,410,883,252	1,172,442,119
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		216,625,157	223,272,598
元本等合計		1,627,508,409	1,395,714,717
純資産合計		1,627,508,409	1,395,714,717
負債純資産合計		1,641,791,074	1,396,450,968

（注）「G I M USコア債券マザーファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）」の計算期間は、毎年11月16日から翌年11月15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
有価証券の評価基準および評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>投資証券 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>(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。 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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

(2021年11月15日現在)	(2022年5月16日現在)
当期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当期間の翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区分	(2021年11月15日現在)	(2022年5月16日現在)
1期首元本額	2,049,174,002円	1,410,883,252円
期中追加設定元本額	189,748,420円	42,248,689円
期中解約元本額	828,039,170円	280,689,822円
元本の内訳（注）		
JPM USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、年1回決算型）	965,174,715円	782,503,027円
JPM USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）	445,708,537円	389,939,092円
合 計	1,410,883,252円	1,172,442,119円
受益権の総数	1,410,883,252口	1,172,442,119口
1口当たりの純資産額 （1万口当たりの純資産額）	1.1535円 (11,535円)	1.1904円 (11,904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、投資信託受益証券および投資証券であります。当ファンドが保有した金融商品には、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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。 (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、運用成果やリスク水準のチェック等を行います。 (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。

金融商品の時価等に関する事項

	(2021年11月15日現在)	(2022年5月16日現在)
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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2)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。	(1)有価証券 同左 (2)有価証券以外の金融商品 同左
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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(2021年11月15日現在)	(2022年5月16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)
投資信託受益証券	2,591	3,486
投資証券	84,006,740	26,487,044
合計	84,004,149	26,483,558

(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)

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。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表（2022年5月16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
投資信託 受益証券	日本円	G I M ジャパン・マネープール・ファン ドF（適格機関投資家専用）		996,247	994,354	
	計	銘柄数：	1	996,247	994,354	
		組入時価比率：	0.1%		0.1%	
	小計				994,354	
投資証券	日本円	JPM US AGGR BOND X(MTH) JPY		125,531.015	1,382,347,537	
	計	銘柄数：	1	125,531.015	1,382,347,537	
		組入時価比率：	99.0%		99.9%	
	小計				1,382,347,537	
	合計				1,383,341,891	

(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) 投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

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

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「GIMジャパン・マネープール・ファンドF（適格機関投資家専用）」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「投資信託受益証券」は、同証券投資信託であります。

尚、「GIMジャパン・マネープール・ファンドF（適格機関投資家専用）」は「GIMマネープール・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。

同証券投資信託および親投資信託の状況は以下の通りであります。

以下に記載した情報は同証券投資信託の直近計算期間末における監査済財務諸表であります。尚、当ファンドの監査対象ではありません。

1 財務諸表

GIMジャパン・マネープール・ファンドF（適格機関投資家専用）

（1）貸借対照表

（単位：円）

区分	注記 番号	第9期 (2021年1月14日現在)	第10期 (2022年1月14日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
親投資信託受益証券		6,228,002	6,226,798
流動資産合計		6,228,002	6,226,798
資産合計		6,228,002	6,226,798
負債の部			
流動負債			
未払受託者報酬		614	710
未払委託者報酬		2,217	2,480
その他未払費用		539	612
流動負債合計		3,370	3,802
負債合計		3,370	3,802
純資産の部			
元本等			
元本	1	6,203,087	6,223,017
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	21,545	21
（分配準備積立金）		106,306	109,324
元本等合計		6,224,632	6,222,996
純資産合計		6,224,632	6,222,996
負債純資産合計		6,228,002	6,226,798

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位 : 円)

区分	注記 番号	第 9 期	第 10 期
		(自 2020年 1 月 15 日 至 2021年 1 月 14 日)	(自 2021年 1 月 15 日 至 2022年 1 月 14 日)
		金額	金額
営業収益			
有価証券売買等損益		2,800	14,100
営業収益合計		2,800	14,100
営業費用			
受託者報酬		1,010	1,408
委託者報酬	1	3,856	4,917
その他費用	3	930	1,212
営業費用合計		5,796	7,537
営業利益又は営業損失 ()		8,596	21,637
経常利益又は経常損失 ()		8,596	21,637
当期純利益又は当期純損失 ()		8,596	21,637
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 ()		100	-
期首剰余金又は期首欠損金 ()		22,516	21,545
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,269	71
当期追加信託に伴う剰余金増加額又 は欠損金減少額		8,269	71
剰余金減少額又は欠損金増加額		544	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又 は欠損金増加額		544	-
分配金	2	-	-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		21,545	21

(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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第10期（2022年1月14日現在）

当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当計算期間の翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第9期 (2021年1月14日現在)	第10期 (2022年1月14日現在)
1 期首元本額	4,110,503円	6,203,087円
期中追加設定元本額	2,191,732円	19,930円
期中一部解約元本額	99,148円	- 円
2 元本の欠損	- 円	21円
受益権の総数	6,203,087口	6,223,017口
1 口当たりの純資産額 (1 万口当たりの純資産額)	1.0035円 (10,035円)	1.0000円 (10,000円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第9期 (自 2020年1月15日 至 2021年1月14日)	第10期 (自 2021年1月15日 至 2022年1月14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	純資産総額に年率0.049%を乗じて得た額	同左
2 分配金の計算過程		
費用控除後の配当等収益額	3,756円	3,018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	204,139円	205,138円
分配準備積立金額	102,550円	106,306円
当ファンドの分配対象収益額	310,445円	314,462円
当ファンドの期末残存口数	6,203,087口	6,223,017口
1万口当たり収益分配対象額	500.46円	505.32円
1万口当たり分配金額	- 円	- 円
収益分配金金額	- 円	- 円
3 その他費用の内訳	監査費用 930円	監査費用 1,212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	当ファンドが保有した主な金融商品は、以下に記載される親投資信託受益証券であります。 G I Mマネープール・マザーファンド（適格機関投資家専用） 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、親投資信託受益証券と同様のリスクを伴います。親投資信託受益証券には、金利変動リスク、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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。 (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、運用成果やリスク水準のチェック等を行います。 (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。

金融商品の時価等に関する事項

	各計算期間末
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。 (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。
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	第9期 (2021年1月14日現在)	第10期 (2022年1月14日現在)
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当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	2,908	14,099
合計	2,908	14,099

（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（2022年1月14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 マネープール・マザーファンド (適格機関投資家専用)	6,129,342	6,226,798	
合計			6,129,342	6,226,798	

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「GIMマネープール・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。

「GIMマネープール・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	(2021年1月14日現在)	(2022年1月14日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		2,792,644	2,802,474
国債証券		3,433,235	3,421,387
未収利息		2,420	2,975
流動資産合計		6,228,299	6,226,836
資産合計		6,228,299	6,226,836
負債の部			
流動負債			
流動負債合計		-	-
負債合計		-	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	6,116,679	6,129,342
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		111,620	97,494
元本等合計		6,228,299	6,226,836
純資産合計		6,228,299	6,226,836
負債純資産合計		6,228,299	6,226,836

(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
有価証券の評価基準および評価方法	<p>国債証券および地方債証券 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。 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思われた場合は、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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

(2022年 1月14日現在)

当期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当期間の翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	(2021年 1月14日現在)	(2022年 1月14日現在)
1期首元本額	4,058,379円	6,116,679円
期中追加設定元本額	2,160,930円	19,640円
期中解約元本額	102,630円	6,977円
元本の内訳（注）		
G I M ジャパン・マネープール・ ファンド F（適格機関投資家専用）	6,116,679円	6,129,342円
合 計	6,116,679円	6,129,342円
受益権の総数	6,116,679口	6,129,342口
1口当たりの純資産額 (1万口当たりの純資産額)	1.0182円 (10,182円)	1.0159円 (10,159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、国債証券および地方債証券であります。当ファンドが保有した金融商品には、金利変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。
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、運用成果やリスク水準のチェック等を行います。</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> <p>(3)当ファンドは、運用の一部または全部について外部委託をしております。</p> <p>運用商品部門は外部委託先が適切に運用業務を行っているか継続的にモニタリングします。運用商品部門はその結果重大な問題があると判断する場合は、リスク管理を担当する部署が主催し、リスク管理上の重要な事項について決議または審議を行う委員会に報告し、対応を協議します。また運用商品部門は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、同委員会に報告します。</p>

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	<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。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。</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	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	(2021年1月14日現在)	(2022年1月14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	8,392	21,528
合計	8,392	21,528

(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。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表(2022年1月14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	日本円	第141回利付国債(5年)		1,800,000	1,808,424	
		第340回利付国債(10年)		850,000	864,390	
		第353回利付国債(10年)		400,000	402,488	
		第116回利付国債(20年)		150,000	176,311	
		第129回利付国債(20年)		50,000	57,879	
		第154回利付国債(20年)		100,000	111,895	
	計	銘柄数:	6	3,350,000	3,421,387	
		組入時価比率:	54.9%		100.0%	
	小計				3,421,387	
	合計				3,421,387	

(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

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「JPM US AGGR BOND X(MTH) JPY」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「投資証券」は、同投資証券であります。

同投資証券の状況は以下の通りであります。

以下に記載した情報は同投資証券の直近計算期間末における監査済財務諸表の抜粋であります。尚、当ファンドの監査対象ではありません。

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

純資産計算書

2021年6月30日現在

	米ドル
資産	
投資有価証券 - 取得原価	4,138,639,667
未実現利益 / (損失)	166,822,337
投資有価証券 - 時価	4,305,461,994
TBA証券への投資 - 時価	127,291,363
現金預金およびブローカー預託金	223,299
定期預金	—
証券発行未収入金	13,193,515
投資有価証券売却未収入金	1,457,396
TBA証券売却未収入金	99,197,868
未収入配当	—
未収入還付税額	20,686,994
未収入報酬除額	131,968
オプション契約 - 公正価値	—
金融先物契約未実現利益	—
先渡し為替契約未実現利益	2,459,908
スワップ契約 - 公正価値	—
その他の資産	5,339
資産合計	4,570,109,644
負債	
当座借越	—
ブローカーに対する債務	1,646,242
証券買戻未払金	7,381,627
投資有価証券購入未払金	9,928,070
TBA証券購入未払金	226,106,981
未払利息	5
未払販売報酬	146,917
未払運用および顧問報酬	1,883,662
未払ファンド・サービス報酬	360,156
未払オプション契約 - 公正価値	—
金融先物契約未実現損失	—
先渡し為替契約未実現損失	37,850,564
スワップ契約 - 公正価値	—
その他の負債*	301,567
負債合計	286,606,791
純資産額合計	4,284,503,853

*その他の負債は主に取替報酬、監査および監査関連費用、登録、発行、発送、印刷、法務ならびにマーケティング費用から構成されている。

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

損益および純資産変動計算書

2021年6月30日をもって終了する会計年度

	米ドル
期首現在純資産額	4,462,174,658
受取配当金、源泉徴収税控除後	658,475
投資有価証券からの受取利息、源泉徴収税控除後	127,127,578
スワップ契約にかかる受取利息	—
証券貸付取引収益	23
受取銀行利息	43,865
その他の収益	1,297
収益合計	127,831,238
費用および顧問報酬	26,022,403
ファンド・サービス報酬	4,699,500
業績報酬	—
保管、支払代行、事務および所在地代行報酬	1,293,518
販売報酬	2,122,891
登録および名義書換代行報酬	451,735
税銀銀行およびその他の支払利息	1,417,325
スワップ契約にかかる支払利息	1,809
その他の費用*	821,007
控除：報酬免除額	(1,722,747)
費用合計	35,107,441
投資純利益 (損失)	92,723,797
投資有価証券売却実現純利益 (損失)	47,767,994
TBA証券実現純利益 (損失)	(361,309)
オプション契約実現純利益 (損失)	—
金融先物契約実現純利益 (損失)	—
先渡し為替契約実現純利益 (損失)	114,404,487
スワップ契約実現純利益 (損失)	—
為替差実現純利益 (損失)	1,582,189
当期実現純利益 (損失)	163,393,361
投資有価証券未実現評価益 (損) 純増減	(125,021,693)
TBA証券未実現評価益 (損) 純増減	206,392
オプション契約未実現評価益 (損) 純増減	—
金融先物契約未実現評価益 (損) 純増減	—
先渡し為替契約未実現評価益 (損) 純増減	(45,755,926)
スワップ契約未実現評価益 (損) 純増減	—
為替差未実現評価益 (損) 純増減	15,327
当期未実現評価益 (損) 純増減	(170,555,900)
事業活動による純資産増減	85,561,258
設定	2,949,673,191
解約	(3,185,957,169)
資本の増減による純資産増減	(236,283,978)
支払配当金	(26,948,085)
期末現在純資産額	4,284,503,853

*その他の費用は主に取替報酬、監査および監査関連費用、登録、発行、発送、印刷、法務ならびにマーケティング費用から構成されている。

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める	
			時価(米ドル)	割合(%)				時価(米ドル)	割合(%)
証券取引所に上場を承認されている譲渡性有価証券および短期金融市場商品					コロンビア				
債券					Colombia Government Bond 4%	USD	1,000,000	1,061,135	0.02
オーストラリア					Colombia Government Bond 1.375%	USD	500,000	660,040	0.02
BHP Billiton Finance USA Ltd. 6.45%	USD	695,000	858,415	0.02	Colombia Government Bond 5%	USD	374,000	399,196	0.01
01/03/2026					15/06/2045				
			858,415	0.02	Ecopetrol SA 5.875% 18/09/2023	USD	226,000	245,299	0.01
カナダ					Ecopetrol SA 5.375% 28/06/2026	USD	494,000	513,393	0.01
Bank of Montreal 1.9% 27/03/2021	USD	750,000	752,042	0.02				2,879,063	0.07
Barrick Gold Corp. 6.45% 15/10/2025	USD	709,000	975,255	0.02	フランス				
Brookfield Finance, Inc. 4.85%	USD	1,089,000	1,283,797	0.03	Credit Agricole SA, 144A 4.375%	USD	400,000	440,728	0.01
29/03/2029					17/03/2025				
Canadian Pacific Railway Co. 2.9%	USD	346,000	367,584	0.01	Societa Generale SA, 144A 4.25%	USD	700,000	760,328	0.02
01/02/2025					14/04/2025				
Canadian Pacific Railway Co. 5.7%	USD	305,000	399,483	0.01	Tota Energies Capital International SA	USD	1,450,000	1,580,239	0.04
15/03/2033					3.40% 12/01/2049				
Fortis, Inc. 3.055% 04/10/2026	USD	1,406,000	1,509,718	0.03	Tota Energies Capital International SA	USD	2,555,000	2,604,025	0.06
Nutrien Ltd. 4.2% 01/04/2029	USD	275,000	36,921	0.01	3.12% 28/05/2030			5,385,320	0.13
Nutrien Ltd. 5% 01/04/2049	USD	400,000	527,496	0.01					
Rogers Communications, Inc. 4.35%	USD	980,000	1,158,450	0.03	ドイツ				
01/05/2049					Deutsche Bank AG 4.125% 14/10/2021	USD	1,284,000	1,298,086	0.03
Royal Bank of Canada 2.75% 01/02/2022	USD	429,000	435,419	0.01	Deutsche Bank AG 3.2% 16/11/2032	USD	800,000	828,136	0.02
Suncor Energy, Inc. 1.1% 01/02/2022	USD	150,000	21,080	0.00	Deutsche Bank AG 2.7% 30/05/2024	USD	400,000	428,944	0.01
Suncor Energy, Inc. 6.8% 15/05/2028	USD	550,000	790,126	0.02				2,555,166	0.06
Suncor Energy, Inc. 4% 15/11/2047	USD	1,045,000	1,163,466	0.03	香港				
TransCanada Pipelines Ltd. 6.2%	USD	540,000	742,166	0.02	Alfa Group Ltd., 144A 3.25% 16/09/2040	USD	1,475,000	1,538,053	0.04
15/10/2037								1,538,053	0.04
TransCanada Pipelines Ltd. 4.15%	USD	1,150,000	1,384,897	0.03					
15/05/2038			12,016,909	0.28					
ケイマン諸島					アイルランド				
CK Hutchison International B Ltd.,	USD	669,000	671,394	0.02	AerCap Ireland Capital DAC 4.45%	USD	1,330,000	1,350,478	0.03
144A 1.875% 03/10/2021					16/12/2021				
CK Hutchison International B Ltd.,	USD	1,050,000	1,117,153	0.03	AerCap Ireland Capital DAC 4.2%	USD	5,870,000	6,295,494	0.15
144A 2.75% 03/10/2026					15/09/2023				
CK Hutchison International B Ltd.,	USD	565,000	627,674	0.01	AerCap Ireland Capital DAC 1.875%	USD	1,385,000	1,449,697	0.03
144A 3.625% 11/04/2029					14/08/2024				
Hutchison Wharfedere International B Ltd.	USD	363,000	376,098	0.01	AerCap Ireland Capital DAC 3.5%	USD	212,000	224,841	0.01
12 11 Ltd., 144A 1.25% 08/11/2022					15/01/2025				
Vale Overseas Ltd. 3.75% 08/01/2030	USD	1,235,000	1,362,200	0.03	AerCap Ireland Capital DAC 8.5%	USD	743,000	872,240	0.02
Vale Overseas Ltd. 6.875% 10/11/2039	USD	1,000,000	1,394,000	0.03	15/07/2025				
			5,488,459	0.13	AerCap Ireland Capital DAC 4.45%	USD	958,000	1,054,425	0.02
					01/06/2025				
チリ					AerCap Ireland Capital DAC 1.75%	USD	997,000	986,629	0.02
Chile Government Bond 2.55%	USD	1,272,000	1,303,164	0.03	20/01/2026				
27/01/2032			1,303,164	0.03	AerCap Ireland Capital DAC 4.45%	USD	735,000	808,975	0.02
					03/04/2026				

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に
				占める					占める
				割合(%)					割合(%)
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co. 4.41% 15/11/2035	USD	8,173,000	9,897,738	0.23	ルグセンブルク				
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.31% 23/09/2021	USD	445,000	465,821	0.01	DN Europe Finances II Sarl 3.25% 15/11/2039	USD	2,600,000	2,779,527	0.06
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.2% 23/09/2036	USD	3,120,000	3,389,169	0.08	Schlumberger Investment SA 2.65% 25/06/2030	USD	2,000,000	2,108,982	0.05
								4,888,509	0.11
			26,795,507	0.62					
日本					メキシコ				
Dai-ichi Life Insurance Co. Ltd. (The), FOM, 10A 4% Preferred	USD	734,000	795,472	0.02	AmericaMovil SAB de CV 3.125% 15/07/2022	USD	307,000	315,540	0.01
Mitsubishi HC Capital, Inc., 144A 2.59% 28/02/2024	USD	700,000	747,016	0.02	AmericaMovil SAB de CV 3.625% 22/04/2029	USD	1,405,000	1,552,136	0.04
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2.98% 22/03/2022	USD	413,000	420,370	0.01	AmericaMovil SAB de CV 4.375% 22/04/2049	USD	966,000	1,190,122	0.03
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2.76% 26/07/2023	USD	432,000	461,646	0.01	Coca-Cola Famosa SAB de CV 2.75% 22/01/2030	USD	1,490,000	1,555,724	0.04
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2.32% 13/09/2023	USD	294,000	307,362	0.01	Coca-Cola Famosa SAB de CV 1.85% 01/09/2032	USD	1,500,000	1,442,363	0.03
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3.48% 07/03/2024	USD	1,595,000	1,709,874	0.04	Fomento Economico Mexicano SAB de CV 1.5% 16/01/2050	USD	2,460,000	2,583,578	0.06
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2.35% 25/02/2025	USD	4,210,000	4,365,150	0.10	Grupo Televisa SAB 8.2% 11/09/2032	USD	263,000	388,188	0.01
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2.94% 11/07/2030	USD	3,120,000	3,117,694	0.07	Grupo Televisa SAB 6.125% 31/01/2046	USD	204,000	279,565	0.01
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3.75% 18/07/2029	USD	1,280,000	1,459,695	0.03	Mexico City Airport Trust, 144A 5.5% 31/07/2047	USD	210,000	212,625	0.00
Mizuho Financial Group, Inc. 2.95% 28/02/2022	USD	435,000	442,833	0.01	Mexico Government Bond 3.6% 30/01/2025	USD	779,000	858,146	0.02
Mizuho Financial Group, Inc., FOM 1.31% 22/05/2021	USD	2,291,000	2,258,488	0.05	Mexico Government Bond 4.15% 28/03/2027	USD	1,000,000	1,132,725	0.03
Nomura Holdings, Inc. 2.64% 16/01/2025	USD	2,072,000	2,179,092	0.05	Mexico Government Bond 3.75% 11/01/2028	USD	2,317,000	2,533,952	0.06
Nomura Holdings, Inc. 2.67% 16/07/2030	USD	1,640,000	1,668,893	0.04	Mexico Government Bond 2.65% 24/05/2051	USD	2,763,000	2,706,441	0.06
Sunito Mitsui Financial Group, Inc., 144A 4.4% 02/04/2024	USD	1,200,000	1,207,733	0.03	Mexico Government Bond 4.75% 08/03/2044	USD	640,000	718,259	0.02
Sunito Mitsui Financial Group, Inc. 2.46% 19/10/2021	USD	398,000	400,696	0.01	Mexico Government Bond 4.35% 15/01/2047	USD	36,000	37,709	0.00
Sunito Mitsui Financial Group, Inc. 3.32% 11/01/2023	USD	413,000	430,404	0.01	Mexico Government Bond 4.6% 10/02/2049	USD	1,282,000	1,380,451	0.03
Sunito Mitsui Financial Group, Inc. 1.47% 09/07/2025	USD	3,068,000	3,101,005	0.07	Mexico Government Bond 4.5% 31/01/2050	USD	3,705,000	3,948,678	0.09
Sunito Mitsui Financial Group, Inc. 2.01% 19/10/2026	USD	297,000	320,926	0.01	Mexico Government Bond 3.771% 24/05/2061	USD	1,811,000	1,689,889	0.04
Sunito Mitsui Financial Group, Inc. 3.04% 16/07/2029	USD	2,290,000	2,460,879	0.06	Mexico Government Bond 5.75% 12/10/2110	USD	566,000	678,776	0.01
								25,204,867	0.59
			27,975,228	0.65	オランダ				
					ABN AMRO Bank NY, 144A 4.75% 28/07/2025	USD	1,031,000	1,157,174	0.03

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に		投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に	
			時価(米ドル)	割合(%)				時価(米ドル)	割合(%)
ING Group NY 4.1% 02/10/2023	USD	2,430,000	2,620,930	0.06	Banco Santander SA 1.849%	USD	2,000,000	2,027,429	0.05
ING Group NY 3.95% 29/03/2027	USD	650,000	751,567	0.02	25/03/2026				
ING Group NY, FRN 1.73% 01/04/2027	USD	695,000	701,499	0.02	Banco Santander SA 2.749%	USD	1,600,000	1,587,950	0.04
Shell International Finance BV 2.37% 07/11/2029	USD	2,295,000	2,263,863	0.05	03/12/2030				
			<u>7,595,035</u>	<u>0.18</u>	Telefonica Emisiones SA 4.66%	USD	980,000	1,158,352	0.03
					06/03/2038			<u>7,292,917</u>	<u>0.17</u>
ニュージーランド					スイス				
ANZ New Zealand Int' l Ltd., 144A 2.81% 25/01/2022	USD	300,000	304,539	0.01	Credit Suisse AG 2.93% 09/04/2025	USD	1,350,000	1,446,580	0.03
ANZ New Zealand Int' l Ltd., 144A 2.4% 23/09/2024	USD	1,000,000	1,073,855	0.02	Credit Suisse Group AG, FRN, 144A 2.93% 11/09/2025	USD	1,210,000	1,260,286	0.03
ANZ New Zealand Int' l Ltd., 144A 2.45% 17/01/2021	USD	667,000	739,275	0.02	Credit Suisse Group AG 3.8% 09/06/2023	USD	350,000	265,014	0.01
ANZ New Zealand Int' l Ltd., 144A 2.55% 12/02/2020	USD	1,066,000	1,113,254	0.02	UBS Group AG, 144A 4.253% 23/03/2028	USD	550,000	623,112	0.02
BNL International Funding Ltd., 144A 2.5% 16/09/2021	USD	305,000	306,175	0.01	UBS Group AG, FRN, 144A 3.126% 13/08/2030	USD	2,560,000	2,757,063	0.06
			<u>3,537,699</u>	<u>0.08</u>				<u>6,352,055</u>	<u>0.15</u>
パナマ					イギリス				
Panama Government Bond 4.5% 16/04/2050	USD	425,000	484,742	0.01	Anglo American Capital plc, 144A 4% 11/09/2027	USD	500,000	555,729	0.01
			<u>484,742</u>	<u>0.01</u>	Anglo American Capital plc, 144A 2.61% 10/09/2030	USD	2,176,000	2,187,901	0.05
サウジアラビア					Anglo American Capital plc, 144A 2.91% 10/09/2030				
Saudi Arabian Oil Co., 144A 1.25% 24/11/2022	USD	348,000	351,824	0.01	Anglo American Capital plc, 144A 2.91% 10/09/2030	USD	2,500,000	2,720,420	0.06
Saudi Arabian Oil Co., 144A 1.61% 24/11/2025	USD	691,000	698,508	0.02	Barclays Bank plc 1.7% 12/05/2022	USD	1,000,000	1,011,592	0.02
Saudi Government Bond, 144A 2.25% 02/02/2032	USD	1,495,000	1,455,604	0.03	Barclays plc 3.65% 16/03/2025	USD	990,000	1,082,480	0.03
			<u>2,595,936</u>	<u>0.06</u>	Barclays plc 5.2% 12/05/2026	USD	1,460,000	1,673,400	0.04
					Barclays plc, FRN 4.13% 16/06/2024	USD	1,000,000	1,066,393	0.02
					Barclays plc, FRN 1.00% 10/12/2024	USD	3,467,000	3,480,316	0.08
					BP Capital Markets plc 3.27% 19/09/2027	USD	855,000	936,949	0.02
シンガポール					Diageo Capital plc 1.37% 29/09/2025				
BOC Aviation Ltd., 144A 3.5% 10/10/2024	USD	790,000	842,722	0.02	HSBC Holdings plc 4.17% 23/11/2026	USD	983,000	1,110,318	0.03
			<u>842,722</u>	<u>0.02</u>	HSBC Holdings plc 6.5% 15/09/2027	USD	3,140,000	4,371,818	0.10
					HSBC Holdings plc 6.1% 14/01/2042	USD	3,155,000	4,571,921	0.11
					HSBC Holdings plc, FRN 2.357% 18/08/2031	USD	2,870,000	2,875,779	0.07
南アフリカ					Invesco Finance plc 3.75% 15/01/2026				
South Africa Government Bond 5.87% 16/09/2025	USD	200,000	226,216	0.00	Lloyds Banking Group plc 4.5% 04/11/2024	USD	2,550,000	2,822,188	0.07
			<u>226,216</u>	<u>0.00</u>	Lloyds Banking Group plc 4.45% 08/05/2025	USD	755,000	847,747	0.02
					Lloyds Banking Group plc 4.58% 10/12/2025	USD	600,000	674,816	0.02
スペイン					Lloyds Banking Group plc 4.37% 22/03/2028				
Banco Santander SA 3.125% 23/02/2023	USD	1,000,000	1,041,783	0.02					
Banco Santander SA 2.746% 28/06/2025	USD	1,400,000	1,476,503	0.03					

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に
				占める					占める
				割合(%)					割合(%)
Lloyds Banking Group plc, FNN 1.33% 15/06/2023	USD	1,000,000	1,008,223	0.02	Aetna, Inc. 6.75% 15/12/2037	USD	300,000	444,467	0.01
Lloyds Banking Group plc, FNN 2.90% 07/11/2023	USD	800,000	824,962	0.02	Aetna, Inc. 4.5% 15/05/2042	USD	147,000	176,582	0.00
Lloyds Banking Group plc, FNN 1.62% 11/05/2027	USD	2,085,000	2,083,066	0.05	Air Lease Corp. 3.37% 01/01/2025	USD	3,021,000	3,247,905	0.08
LSBFA Financing plc, 144A 2% 06/04/2028	USD	3,975,000	4,023,063	0.09	Air Lease Corp. 2.87% 15/01/2026	USD	2,500,000	2,627,915	0.06
Natwest Building Society, 044 2% 28/08/2025	USD	1,230,000	1,224,662	0.03	Air Lease Corp. 1.7% 01/04/2026	USD	958,000	1,048,025	0.02
Natwest Group plc 1.87% 12/09/2023	USD	1,600,000	1,708,653	0.04	Air Lease Corp. 1.81% 15/08/2026	USD	3,125,000	3,129,114	0.07
Natwest Group plc 4.2% 04/2025	USD	1,275,000	1,461,596	0.03	Air Lease Corp. 1.2% 01/10/2029	USD	4,540,000	4,740,576	0.11
Natwest Group plc, FNN 4.51% 25/06/2024	USD	365,000	381,329	0.01	Air Products and Chemicals, Inc. 1.6% 15/09/2027	USD	3,000,000	3,084,693	0.07
Natwest Group plc, FNN 4.26% 22/03/2025	USD	640,000	694,398	0.02	Alabama Power Co. 5.7% 15/01/2033	USD	150,000	195,188	0.00
Natwest Group plc, FNN 3.07% 22/05/2023	USD	2,535,000	2,677,363	0.06	Alabama Power Co. 6.125% 15/05/2038	USD	179,000	254,736	0.01
Natwest Group plc, FNN 4.89% 18/05/2029	USD	250,000	293,222	0.01	Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 3.8% 15/04/2026	USD	214,000	238,896	0.01
Natwest Group plc, FNN 3.754% 01/11/2029	USD	1,500,000	1,595,625	0.04	Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 3.9% 15/01/2028	USD	1,347,000	1,523,169	0.04
Natwest Group plc, FNN 4.44% 08/05/2030	USD	1,095,000	1,253,772	0.03	Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 4.5% 15/02/2030	USD	2,000,000	2,442,945	0.06
Santander UK Group Holdings plc, 144A 4.7% 15/09/2025	USD	1,000,000	1,123,668	0.03	Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 1.87% 01/02/2033	USD	2,690,000	2,548,505	0.06
Santander UK Group Holdings plc 3.571% 10/01/2023	USD	500,000	508,032	0.01	Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 4% 01/02/2030	USD	1,016,000	1,168,167	0.03
Santander UK Group Holdings plc, FNN 1.08% 15/03/2025	USD	1,630,000	1,635,635	0.04	Allstate Corp. (The) 5.2% 01/09/2023	USD	805,000	1,046,094	0.02
Santander UK Group Holdings plc, FNN 1.67% 14/06/2027	USD	1,485,000	1,484,080	0.03	American Campus Communities Quoting Partnership LP, REIT 1.87% 30/01/2021	USD	1,230,000	1,371,997	0.03
Standard Chartered plc, FNN, 144A 2.744% 10/09/2022	USD	700,000	702,917	0.02	American Express Co. 3.4% 27/02/2023	USD	701,000	734,334	0.02
Standard Chartered plc, FNN, 144A 4.347% 20/01/2022	USD	1,000,000	1,020,251	0.02	American Financial Group, Inc. 3.5% 15/09/2028	USD	1,000,000	1,087,772	0.03
Standard Chartered plc, FNN, 144A 2.819% 20/01/2026	USD	1,770,000	1,859,156	0.04	American International Group, Inc. 3.87% 15/01/2025	USD	1,000,000	1,135,209	0.03
Standard Chartered plc, FNN, 144A 1.49% 14/01/2027	USD	2,590,000	2,569,447	0.06	American Tower Corp., REIT 5% 15/02/2024	USD	367,000	407,262	0.01
Standard Chartered plc, FNN, 144A 4.86% 15/01/2022	USD	700,000	778,154	0.02	American Tower Corp., REIT 1.37% 15/08/2026	USD	437,000	476,511	0.01
			<u>65,896,270</u>	<u>1.54</u>	American Tower Corp., REIT 1.5% 21/01/2028	USD	2,820,000	2,745,976	0.06
アメリカ					American Tower Corp., REIT 2.1% 15/08/2030	USD	1,440,000	1,421,594	0.03
Abbott Laboratories 1.1% 30/01/2028	USD	1,330,000	1,301,721	0.03	American Tower Corp., REIT 3.7% 15/10/2049	USD	1,995,000	2,176,403	0.05
AbbVie, Inc. 3.2% 21/11/2029	USD	4,396,000	4,779,675	0.11	American Tower Corp., REIT 3.1% 15/08/2050	USD	1,231,000	1,207,192	0.03
AbbVie, Inc. 4.5% 14/05/2035	USD	1,624,000	1,967,061	0.05	American Tower Corp., REIT 2.9% 15/01/2051	USD	804,000	766,160	0.02
AbbVie, Inc. 4.4% 06/11/2042	USD	1,200,000	1,462,382	0.03	American Water Capital Corp. 3.4% 01/06/2029	USD	365,000	404,975	0.01
					American Water Capital Corp. 6.3% 15/10/2027	USD	125,000	184,758	0.00

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)	割合(%)					割合(%)	割合(%)
American Water Capital Corp. 4% 01/12/2046	USD	375,000	437,019	0.01		Baralta, Inc. 3.6% 23/06/2022	USD	62,000	63,634	0.00	
American Water Capital Corp. 3.4% 01/05/2050	USD	2,181,000	2,372,736	0.06		Beetm Dickinson and Co. 3.7% 15/12/2034	USD	33,000	35,957	0.00	
Anheuser-Busch Cos. LLC 4.7% 01/02/2036	USD	5,960,000	7,320,875	0.17		Bedshire Hollow Energy Co. 6.12% 04/04/2066	USD	1,437,000	2,026,258	0.05	
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. 4.62% 01/02/2044	USD	150,000	182,495	0.00		Berkshire Hathaway Finance Corp. 4.7% 15/05/2042	USD	312,000	388,652	0.01	
Abbott Laboratories 4.3% 15/04/2038	USD	1,000,000	1,197,283	0.03		Berkshire Hathaway Finance Corp. 4.2% 15/01/2049	USD	1,090,000	1,351,823	0.03	
Abbott Laboratories 4.2% 01/06/2040	USD	2,525,000	3,009,223	0.07		Boardwalk Pipelines LP 4.8% 03/05/2029	USD	705,000	814,198	0.02	
Abbott Laboratories 4.42% 06/10/2048	USD	1,200,000	1,531,492	0.04		Boardwalk Pipelines LP 3.4% 15/02/2031	USD	1,610,000	1,707,914	0.04	
Abbott Laboratories 4.5% 02/06/2050	USD	3,315,000	4,050,975	0.09		Boeing Co. (The) 4.87% 01/06/2025	USD	1,205,000	1,352,003	0.03	
Abbott Laboratories 4.7% 15/04/2038	USD	3,080,000	3,870,232	0.09		Boeing Co. (The) 2.1% 01/02/2016	USD	1,950,000	2,036,878	0.05	
Abbott Laboratories 4.8% 02/06/2050	USD	1,175,000	1,453,094	0.03		Boeing Co. (The) 2.19% 04/06/2026	USD	1,635,000	1,651,259	0.04	
Anthem, Inc. 3.12% 15/05/2022	USD	300,000	307,481	0.01		Boeing Co. (The) 2.7% 01/02/2017	USD	5,050,000	5,218,339	0.12	
Anthem, Inc. 3.3% 15/01/2023	USD	224,000	233,896	0.01		Boeing Co. (The) 5.1% 01/05/2010	USD	1,885,000	2,234,581	0.05	
Anthem, Inc. 3.35% 01/12/2024	USD	1,365,000	1,462,830	0.03		Boeing Co. (The) 5.70% 01/06/2040	USD	1,615,000	2,089,166	0.05	
Anthem, Inc. 4.10% 01/03/2028	USD	885,000	1,014,917	0.02		Boeing Co. (The) 5.80% 01/06/2050	USD	1,500,000	2,026,790	0.05	
Anthem, Inc. 4.62% 15/05/2042	USD	344,000	428,754	0.01		Boston Properties LP, REIT 3.2% 15/01/2025	USD	456,000	488,800	0.01	
Anthem, Inc. 4.37% 01/12/2047	USD	301,000	345,286	0.01		Boston Properties LP, REIT 1.6% 01/02/2016	USD	297,000	327,297	0.01	
Arizona Public Service Co. 5.0% 01/09/2041	USD	210,000	274,959	0.01		Boston Properties LP, REIT 2.7% 01/06/2016	USD	300,000	320,626	0.01	
Arrow Electronics, Inc. 4.5% 01/03/2023	USD	96,000	99,994	0.00		Boston Scientific Corp. 4% 01/03/2029	USD	1,140,000	1,299,022	0.03	
Arrow Electronics, Inc. 3.25% 08/09/2024	USD	469,000	499,319	0.01		Boston Scientific Corp. 4.55% 01/03/2039	USD	1,470,000	1,802,360	0.04	
Arrow Electronics, Inc. 3.87% 12/01/2028	USD	761,000	852,983	0.02		EP Capital Markets America, Inc. 3.4% 11/02/2026	USD	2,150,000	2,353,984	0.06	
AT&T, Inc. 2.3% 01/06/2027	USD	5,180,000	5,365,703	0.13		EP Capital Markets America, Inc. 2.77% 10/11/2030	USD	2,000,000	1,870,430	0.04	
AT&T, Inc. 1.65% 01/02/2028	USD	1,905,000	1,889,574	0.04		EP Capital Markets America, Inc. 2.92% 04/06/2031	USD	2,200,000	2,123,454	0.05	
AT&T, Inc. 2.25% 01/02/2032	USD	3,220,000	3,167,906	0.07		Erimer Operating Partnership LP, REIT 2.8% 01/02/2015	USD	900,000	979,770	0.02	
AT&T, Inc. 3.5% 01/06/2041	USD	1,382,000	1,443,929	0.03		Brookfield Finance LLC 3.45% 15/04/2050	USD	1,080,000	1,116,585	0.03	
Atmos Energy Corp. 0.62% 09/03/2023	USD	930,000	930,194	0.02		Brown & Brown, Inc. 2.37% 15/03/2031	USD	4,620,000	4,625,339	0.11	
Atmos Energy Corp. 4.1% 15/01/2043	USD	690,000	812,385	0.02		Bunge Ltd Finance Corp. 2.7% 14/05/2031	USD	3,310,000	3,348,894	0.08	
Atmos Energy Corp. 4.12% 15/08/2049	USD	780,000	941,435	0.02		Burlington Northern Santa Fe LLC 2.6% 01/09/2023	USD	560,000	617,510	0.01	
Autozone, Inc. 1.6% 15/01/2031	USD	1,740,000	1,658,354	0.04		Burlington Northern Santa Fe LLC 1.9% 15/08/2030	USD	250,000	365,036	0.01	
Baker Hughes Holdings LLC 5.1% 15/09/2040	USD	700,000	902,011	0.02		Burlington Northern Santa Fe LLC 6.1% 01/05/2031	USD	870,000	1,258,865	0.03	
Bank of America Corp. 3.34% 21/10/2027	USD	707,000	767,268	0.02							
Bank of America NA 6% 15/10/2036	USD	1,800,000	2,520,236	0.06							
Bank of New York Mellon Corp. (The) 3.3% 21/08/2029	USD	57,000	63,316	0.00							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に
				占める割合(%)					占める割合(%)
Burlington Northern Santa Fe LLC 5.75% 01/05/2040	USD	700,000	995,991	0.02	Corning, Inc. 3.9% 15/11/2049	USD	2,044,000	2,299,886	0.05
Burlington Northern Santa Fe LLC 2.55% 15/01/2050	USD	1,397,000	1,583,915	0.04	Corporate Office Properties LP, REIT 2.75% 15/04/2031	USD	3,203,000	3,221,185	0.08
Campbell Soup Co. 2.375% 24/04/2030	USD	965,000	965,323	0.02	Cross Castle International Corp., REIT 4% 01/03/2027	USD	238,000	255,574	0.01
Campbell Soup Co. 3.125% 24/04/2050	USD	470,000	457,630	0.01	Cross Castle International Corp., REIT 2.25% 15/04/2031	USD	2,710,000	2,679,677	0.06
Capital One Financial Corp. 1.9% 29/01/2034	USD	810,000	874,148	0.02	CVS Health Corp. 4.3% 25/01/2038	USD	732,000	841,166	0.02
Capital One Financial Corp. 3.15% 24/04/2034	USD	937,000	1,002,393	0.02	CVS Health Corp. 5.05% 25/01/2048	USD	4,205,000	5,480,976	0.13
Capital One Financial Corp. 4.2% 29/04/2025	USD	350,000	391,228	0.01	Danaher Corp. 2.6% 01/10/2050	USD	932,000	893,310	0.02
Caterpillar, Inc. 6.05% 15/08/2036	USD	355,000	511,902	0.01	Dell International LLC 6.02% 15/06/2026	USD	4,036,000	4,839,087	0.11
CenterPoint Energy Resources Corp. 5.85% 15/01/2041	USD	250,000	341,695	0.01	Digital Realty Trust LP, REIT 3.7% 15/08/2037	USD	385,000	431,277	0.01
Cherren Corp. 1.955% 11/05/2027	USD	1,390,000	1,497,628	0.03	Discover Bank 3.45% 27/07/2026	USD	1,150,000	1,255,653	0.03
Cherren Corp. 2.978% 11/05/2040	USD	1,330,000	1,397,438	0.03	Domain Energy, Inc. 2.75% 15/01/2022	USD	794,000	803,138	0.02
Chubb INA Holdings, Inc. 2.7% 13/03/2023	USD	300,000	208,037	0.00	Domain Energy, Inc. 2.85% 15/08/2026	USD	183,000	195,074	0.00
Citigroup, Inc. 2.9% 08/12/2021	USD	1,350,000	1,362,871	0.03	Domain Energy, Inc. 4.9% 01/08/2041	USD	111,000	141,056	0.00
Citigroup, Inc. 1.2% 21/10/2026	USD	1,293,000	1,400,095	0.03	Domain Energy, Inc. 5.25% 01/08/2033	USD	785,000	985,665	0.02
Citigroup, Inc. 6.625% 15/01/2028	USD	500,000	641,318	0.02	Dow Chemical Co. (The) 3.6% 15/11/2050	USD	2,795,000	2,929,866	0.07
Citizens Financial Group, Inc. 2.85% 27/07/2026	USD	2,000,000	2,134,655	0.05	DTE Electric Co. 2.7% 15/01/2045	USD	308,000	352,937	0.01
Cleveland Electric Illuminating Co. (The) 5.5% 15/08/2024	USD	400,000	454,685	0.01	Duke Energy Carolinas LLC 6.45% 15/10/2032	USD	100,000	137,694	0.00
Cleveland Electric Illuminating Co. (The) 5.9% 15/12/2036	USD	425,000	541,632	0.01	Duke Energy Corp. 2.65% 01/09/2026	USD	810,000	855,867	0.02
CMS Energy Corp. 3.87% 01/09/2024	USD	1,200,000	1,267,534	0.03	Duke Energy Corp. 1.4% 15/06/2019	USD	854,000	937,301	0.02
CMS Energy Corp. 2% 15/05/2028	USD	219,000	294,632	0.01	Duke Energy Indiana LLC 6.12% 15/10/2035	USD	150,000	207,087	0.00
CMS Energy Corp. 2.95% 15/01/2027	USD	387,000	409,020	0.01	Duke Energy Indiana LLC 3.75% 15/05/2046	USD	350,000	393,423	0.01
CM Financial Corp. 1.9% 15/09/2024	USD	173,000	187,358	0.00	Duke Energy Ohio, Inc. 3.7% 15/06/2046	USD	265,000	298,447	0.01
Columbia Pipeline Group, Inc. 5.2% 01/06/2045	USD	1,550,000	2,119,153	0.05	Duke Energy Progress LLC 4.1% 15/05/2042	USD	189,000	222,905	0.01
Comerica Bank 4% 27/07/2025	USD	1,100,000	1,215,571	0.03	Duke Energy Progress LLC 3.7% 15/10/2046	USD	431,000	491,536	0.01
Comerica, Inc. 4% 01/02/2029	USD	400,000	459,320	0.01	Duke Realty LP, REIT 2.875% 15/11/2029	USD	830,000	874,753	0.02
Cosco Brands, Inc. 5.2% 01/11/2038	USD	330,000	421,145	0.01	DuPont de Nemours, Inc. 5.31% 15/11/2038	USD	2,230,000	2,939,507	0.07
Cosco Brands, Inc. 5.4% 01/11/2040	USD	2,125,000	2,857,054	0.07	EMC Technology Co. 4.2% 15/04/2024	USD	427,000	463,504	0.01
Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 5.7% 15/06/2040	USD	173,000	294,901	0.01	Eastern Energy Gas Holdings LLC 4.6% 15/12/2044	USD	900,000	1,053,900	0.02
Constellation Brands, Inc. 4.4% 15/11/2025	USD	475,000	536,384	0.01	Eastern Energy Gas Holdings LLC 3.5% 15/11/2049	USD	1,119,000	1,215,722	0.03
Constellation Brands, Inc. 5.25% 15/11/2049	USD	260,000	346,806	0.01					
Consumers Energy Co. 3.25% 15/08/2046	USD	190,000	204,995	0.00					

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
Eaton Corp. 7.625% 01/04/2024	USD	400,000	471,833	0.01		BUM Midstream Partners LP 5.25% 15/07/2028	USD	1,350,000	1,350,937	0.03	
Eaton Corp. 4% 02/11/2032	USD	146,000	170,156	0.00		Essex Portfolio LP, REIT 2.65% 15/03/2032	USD	4,000,000	4,067,727	0.10	
Eaton Corp. 5.0% 15/03/2037	USD	100,000	127,116	0.00		Eversgy, Inc. 2.5% 15/09/2029	USD	1,775,000	1,880,949	0.04	
Edison International 3.5% 15/11/2024	USD	2,880,000	3,067,527	0.07		Exxon Mobil Corp. 2.992% 15/06/2025	USD	2,810,000	3,016,464	0.07	
Edison International 5.75% 15/06/2027	USD	800,000	912,496	0.02		Exxon Mobil Corp. 2.992% 16/06/2029	USD	1,615,000	1,669,283	0.04	
Edison International 4.125% 15/03/2028	USD	520,000	553,976	0.01		Exxon Mobil Corp. 3.092% 16/06/2049	USD	2,810,000	2,853,281	0.05	
Enbridge Midstream Partners LP 4.4% 15/01/2027	USD	850,000	938,210	0.02		Fidelity National Information Services, Inc. 4.5% 15/06/2046	USD	2,360,000	2,903,314	0.07	
Enbridge Midstream Partners LP 4.9% 15/05/2028	USD	430,000	492,773	0.01		Florida Power & Light Co. 5.4% 01/09/2035	USD	700,000	943,262	0.02	
Enbridge Midstream Partners LP 4.1% 15/09/2029	USD	1,068,000	1,170,742	0.03		General Electric Co. 5.25% 03/01/2036	USD	392,000	465,552	0.01	
Energy Transfer LP 3.0% 01/02/2023	USD	240,000	248,936	0.01		General Electric Co. 3.625% 01/05/2030	USD	1,730,000	1,933,289	0.05	
Energy Transfer LP 4.05% 15/01/2025	USD	2,332,000	2,530,462	0.06		General Motors Co. 6.125% 01/10/2025	USD	1,185,000	1,403,560	0.03	
Energy Transfer LP 4.75% 15/01/2026	USD	2,365,000	2,665,706	0.06		General Motors Financial Co., Inc. 1.25% 06/01/2026	USD	4,269,000	4,237,722	0.10	
Energy Transfer LP 3.5% 15/01/2026	USD	122,000	133,411	0.00		General Motors Financial Co., Inc. 4.35% 17/01/2027	USD	1,831,000	1,159,087	0.03	
Energy Transfer LP 6.05% 01/06/2041	USD	650,000	829,899	0.02		General Motors Financial Co., Inc. 2.75% 06/01/2031	USD	2,852,000	2,818,521	0.07	
Energy Transfer LP 6.1% 15/02/2042	USD	800,000	998,918	0.02		General Motors Financial Co., Inc. 2.7% 10/06/2031	USD	1,585,000	1,602,115	0.04	
Energy Transfer LP 5% 15/03/2040	USD	4,080,000	4,740,016	0.11		Global Payments, Inc. 3.3% 15/08/2029	USD	2,250,000	2,412,436	0.06	
Eni USA, Inc. 7.3% 15/11/2027	USD	1,000,000	1,345,774	0.03		Global Payments, Inc. 4.15% 15/08/2049	USD	1,425,000	1,638,513	0.04	
Entergy Arkansas LLC 3.5% 01/04/2026	USD	202,000	222,229	0.01		Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.7% 22/09/2025	USD	818,000	895,747	0.02	
Entergy Corp. 2.95% 01/09/2028	USD	220,000	234,962	0.01		Goldman Sachs Group, Inc. (The) 4.25% 22/09/2025	USD	457,000	512,038	0.01	
Entergy Louisiana LLC 4.05% 01/09/2023	USD	239,000	254,349	0.01		Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.5% 15/11/2026	USD	5,764,000	6,276,082	0.15	
Entergy Louisiana LLC 2.4% 01/10/2026	USD	532,000	557,519	0.01		Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.85% 26/01/2027	USD	1,830,000	2,021,457	0.05	
Entergy Louisiana LLC 3.12% 01/09/2027	USD	320,000	349,270	0.01		Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.5% 22/01/2025	USD	2,321,000	2,510,572	0.06	
Entergy Louisiana LLC 3.25% 01/04/2028	USD	188,000	206,040	0.00		Gulf Power Co. 3.2% 30/05/2027	USD	670,000	735,977	0.02	
Entergy Louisiana LLC 3.05% 01/06/2031	USD	314,000	340,537	0.01		Halliburton Co. 4.75% 01/08/2043	USD	430,000	499,594	0.01	
Entergy Louisiana LLC 4% 15/01/2033	USD	330,000	367,369	0.01		Recover Insurance Group, Inc. (The) 2.5% 01/09/2030	USD	1,420,000	1,424,239	0.03	
Entergy Louisiana LLC 2.9% 15/03/2031	USD	1,040,000	1,051,078	0.02		Barclay Financial Services Group, Inc. (The) 6.1% 01/10/2040	USD	600,000	858,614	0.02	
Entergy Mississippi LLC 3.85% 01/06/2049	USD	1,640,000	1,898,239	0.04		Barclay Financial Services Group, Inc. (The) 4.3% 15/04/2040	USD	500,000	591,690	0.01	
Enterprise Products Operating LLC 3.9% 15/02/2024	USD	800,000	860,659	0.02		HCA, Inc. 5.25% 15/06/2026	USD	3,300,000	3,820,585	0.09	
Enterprise Products Operating LLC 7.55% 15/04/2038	USD	847,000	1,302,740	0.03		HCA, Inc. 4.125% 15/06/2029	USD	380,000	429,316	0.01	
Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/01/2043	USD	846,000	1,003,784	0.02		HCA, Inc. 5.125% 15/06/2039	USD	3,095,000	3,863,632	0.09	
Enterprise Products Operating LLC 3.2% 15/02/2052	USD	3,000,000	2,975,136	0.07							
Enterprise Products Operating LLC 5.75% 01/01/2035	USD	1,345,000	1,613,656	0.04							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)	割合(%)						
HCA, Inc. 3.5% 15/07/2051	USD	360,000	361,215	0.01		UMB International Finance III LLC 1.25% 01/10/2025	USD	780,000	779,617	0.02	
Healthcare Trust of America Holdings LP, REIT 3.3% 15/02/2030	USD	1,161,000	1,234,942	0.03		Wegelin Midstream Partners LP 3.25% 15/03/2025	USD	171,000	181,096	0.00	
Healthcare Trust of America Holdings LP, REIT 2% 15/03/2031	USD	1,540,000	1,490,241	0.03		Wegelin Midstream Partners LP 6.45% 01/05/2027	USD	235,000	304,412	0.01	
Healthpeak Properties, Inc., REIT 3.4% 01/02/2025	USD	14,000	15,045	0.00		Worabon Oil Corp. 6.8% 15/05/2032	USD	241,000	318,262	0.01	
Healthpeak Properties, Inc., REIT 3.5% 15/07/2029	USD	1,334,000	1,477,030	0.03		Marathon Petroleum Corp. 4.5% 01/05/2023	USD	2,009,000	2,143,127	0.05	
Hess Corp. 6% 15/01/2040	USD	287,000	369,036	0.01		Marathon Petroleum Corp. 4.7% 01/05/2025	USD	1,209,000	1,363,015	0.03	
HollyFrontier Corp. 2.82% 01/10/2023	USD	2,365,000	2,446,465	0.06		Markel Corp. 5% 05/04/2046	USD	1,000,000	1,289,221	0.03	
HollyFrontier Corp. 5.875% 01/04/2026	USD	1,960,000	2,267,162	0.05		Martin Marietta Materials, Inc. 3.45% 05/05/2027	USD	666,000	728,658	0.02	
HP, Inc. 3% 17/05/2027	USD	1,445,000	1,547,319	0.04		Masco Corp. 2% 01/10/2030	USD	840,000	821,554	0.02	
Illinois Tool Works, Inc. 2.85% 15/11/2025	USD	900,000	966,126	0.02		Masco Corp. 6.5% 15/08/2032	USD	1,000,000	1,333,681	0.03	
International Flavors & Fragrances, Inc. 4.45% 26/09/2023	USD	368,000	426,380	0.01		McDonald's Corp. 4.75% 09/12/2035	USD	547,000	679,952	0.02	
International Flavors & Fragrances, Inc. 3% 26/09/2048	USD	452,000	580,580	0.01		McDonald's Corp. 6.2% 15/10/2037	USD	179,000	258,003	0.01	
International Lease Finance Corp. 8.65% 15/01/2032	USD	2,200,000	2,294,139	0.05		MOG Holdings, Inc. 2.3% 15/01/2031	USD	2,210,000	2,151,811	0.05	
International Lease Finance Corp. 5.815% 15/06/2032	USD	623,000	659,318	0.02		NetLife, Inc. 4.365% 15/09/2023	USD	400,000	433,059	0.01	
International Paper Co. 8.7% 15/06/2038	USD	850,000	1,422,797	0.03		NetLife, Inc. 6.5% 15/12/2032	USD	616,000	875,860	0.02	
Jersey Central Power & Light Co. 6.15% 01/06/2037	USD	320,000	415,096	0.01		Net-America Apartments LP, REIT 4% 15/11/2025	USD	930,000	1,033,967	0.02	
Kinder Morgan, Inc. 2% 15/01/2031	USD	1,370,000	1,316,444	0.03		Net-America Apartments LP, REIT 1.7% 15/02/2031	USD	1,470,000	1,399,346	0.03	
Kinder Morgan, Inc. 1.25% 01/09/2030	USD	1,540,000	1,505,837	0.04		Morgan Stanley 5.5% 28/07/2022	USD	950,000	953,665	0.02	
Kohl's Corp. 3.375% 01/05/2031	USD	2,000,000	2,072,792	0.05		Morgan Stanley 3.625% 17/11/2031	USD	1,730,000	1,745,717	0.04	
Kroger Co. (The) 1.2% 01/05/2030	USD	3,500,000	3,524,255	0.08		Morgan Stanley 3.875% 29/04/2034	USD	2,697,000	2,932,588	0.07	
Kroger Co. (The) 5.4% 15/01/2040	USD	114,000	149,676	0.00		Morgan Stanley 4% 23/07/2025	USD	3,125,000	3,477,342	0.08	
Kroger Co. (The) 1.95% 15/01/2030	USD	1,220,000	1,394,260	0.03		Morgan Stanley 3.875% 27/01/2036	USD	270,000	301,912	0.01	
LSHarris Technologies, Inc. 3.825% 27/04/2025	USD	700,000	767,355	0.02		Morgan Stanley 3.125% 27/01/2036	USD	1,056,000	1,145,229	0.03	
LSHarris Technologies, Inc. 1.8% 15/01/2031	USD	2,090,000	2,087,252	0.05		Morgan Stanley 3.625% 20/01/2037	USD	945,000	1,049,562	0.02	
Legg Mason, Inc. 1.95% 15/01/2024	USD	350,000	383,362	0.01		Morgan Stanley 4.2% 27/01/2045	USD	1,125,000	1,397,032	0.03	
Lennar Corp. 4.5% 30/04/2024	USD	1,220,000	1,355,900	0.03		Morgan Stanley, FRN 1.794% 13/02/2032	USD	2,080,000	2,000,125	0.05	
Life Storage LP, REIT 4% 15/06/2029	USD	1,373,000	1,539,715	0.04		MPLX LP 4.875% 01/12/2024	USD	1,284,000	1,438,300	0.03	
Life Storage LP, REIT 2.2% 15/10/2030	USD	2,940,000	2,900,466	0.07		MPLX LP 4.8% 15/02/2029	USD	362,000	425,453	0.01	
Lincoln National Corp. 4.2% 15/03/2022	USD	541,000	555,562	0.01		MPLX LP 5.2% 01/03/2047	USD	323,000	398,486	0.01	
Lincoln National Corp. 4% 01/09/2023	USD	1,042,000	1,118,756	0.03		15/11/2025	USD	583,000	645,048	0.02	
Low's Cos., Inc. 2.3% 15/04/2026	USD	550,000	583,090	0.01		National Retail Properties, Inc., REIT	USD	1,000,000	1,093,555	0.03	
Low's Cos., Inc. 3.65% 05/04/2029	USD	1,150,000	1,288,205	0.03		3.8% 15/12/2036	USD	1,600,000	1,799,858	0.04	
Low's Cos., Inc. 1.7% 15/10/2030	USD	3,000,000	2,878,743	0.07		Nevada Power Co. 2.7% 01/01/2039	USD	200,000	292,384	0.01	
						Nevada Power Co. 6.45% 01/04/2036	USD	365,000	478,501	0.01	
						Nevada Power Co. 5.37% 15/09/2040	USD	615,000	651,424	0.02	
						NiSource, Inc. 2.95% 01/09/2029	USD	1,830,000	1,734,941	0.04	
						NiSource, Inc. 5.8% 01/02/2042	USD	628,000	853,060	0.02	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)	割合(%)						
Norfolk Southern Corp. 2.90% 15/02/2023	USD	42,000	43,493	0.00		PNC Bank NA 3.25% 01/06/2025	USD	750,000	815,757	0.02	
OGE Energy Corp. 0.70% 26/09/2023	USD	1,180,000	1,179,408	0.03		RFI Industries, Inc. 1.2% 15/09/2026	USD	1,275,000	1,273,004	0.03	
Ohio Edison Co. 6.87% 15/01/2036	USD	350,000	497,590	0.01		Precision Castparts Corp. 1.2% 15/06/2025	USD	332,000	360,473	0.01	
Oklahoma Gas and Electric Co. 0.55% 26/05/2023	USD	1,425,000	1,425,182	0.03		Precision Castparts Corp. 4.2% 15/06/2025	USD	250,000	294,147	0.01	
ONE Gas, Inc. 2% 15/05/2030	USD	2,060,000	2,020,764	0.05		Precision Castparts Corp. 4.37% 15/06/2025	USD	250,000	302,159	0.01	
ONEOK Partners LP 3.375% 01/10/2022	USD	76,000	78,092	0.00		Progress Energy, Inc. 3.15% 01/04/2022	USD	350,000	355,028	0.01	
ONEOK Partners LP 5% 15/09/2023	USD	169,000	182,475	0.00		Progress Energy, Inc. 7% 30/10/2021	USD	300,000	416,225	0.01	
ONEOK Partners LP 6.6% 01/10/2036	USD	910,000	1,220,368	0.03		Prologis LP, REIT 2.12% 15/10/2020	USD	525,000	449,834	0.01	
ONEOK, Inc. 7.5% 01/09/2023	USD	2,741,000	3,088,101	0.07		Quest Diagnostics, Inc. 2.8% 30/06/2021	USD	955,000	999,117	0.02	
ONEOK, Inc. 2.2% 15/09/2025	USD	2,750,000	2,829,604	0.07		Quest Corp. 6.75% 01/12/2021	USD	444,000	454,822	0.01	
ONEOK, Inc. 3.4% 01/09/2029	USD	980,000	1,045,708	0.02		Raytheon Technologies Corp. 4.5% 01/06/2022	USD	800,000	998,338	0.02	
Oracle Corp. 2.95% 15/05/2025	USD	1,500,000	1,598,753	0.04		Raytheon Technologies Corp. 4.15% 15/06/2025	USD	395,000	472,083	0.01	
Oracle Corp. 2.3% 25/03/2028	USD	2,875,000	2,953,564	0.07		Raytheon Technologies Corp. 2.75% 01/11/2026	USD	2,800,000	3,169,267	0.07	
Oracle Corp. 3.9% 15/05/2035	USD	1,175,000	1,312,816	0.03		Realty Income Corp., REIT 1.875% 15/04/2025	USD	255,000	281,919	0.01	
Oracle Corp. 3.85% 15/07/2036	USD	1,335,000	1,473,018	0.03		Realty Income Corp., REIT 2.2% 15/01/2031	USD	1,480,000	1,613,539	0.04	
Oracle Corp. 3.6% 01/04/2040	USD	1,800,000	1,901,522	0.04		Regency Centers LP, REIT 2.9% 15/09/2029	USD	1,305,000	1,376,054	0.03	
Oracle Corp. 4% 15/07/2046	USD	1,070,000	1,167,773	0.03		Regions Financial Corp. 3.8% 14/08/2023	USD	1,160,000	1,237,132	0.03	
Oracle Corp. 4.375% 15/05/2055	USD	940,000	1,095,688	0.03		Reliance Steel & Aluminum Co. 2.1% 15/09/2030	USD	3,330,000	3,291,354	0.08	
Pacific Gas and Electric Co. 1.7% 16/06/2022	USD	5,015,000	5,012,730	0.12		Republic Services, Inc. 1.45% 15/02/2021	USD	2,120,000	1,988,338	0.05	
Pacific Gas and Electric Co. 1.36% 10/03/2023	USD	2,415,000	2,415,136	0.06		Roper Technologies, Inc. 1.4% 15/09/2027	USD	3,420,000	3,367,826	0.08	
Pacific Gas and Electric Co. 2.9% 01/02/2026	USD	970,000	992,528	0.02		Roper Technologies, Inc. 4.2% 15/09/2028	USD	450,000	517,423	0.01	
Pacific Gas and Electric Co. 2.7% 15/04/2042	USD	451,000	441,798	0.01		Safelord Operating Partnership LP, REIT 2.8% 15/06/2031	USD	5,000,000	5,007,307	0.12	
Pacific Gas and Electric Co. 4.3% 15/02/2045	USD	770,000	740,773	0.02		San Diego Gas & Electric Co. 6.12% 15/09/2027	USD	150,000	208,046	0.00	
Pacific Gas and Electric Co. 4% 01/12/2048	USD	1,500,000	1,404,008	0.03		San Diego Gas & Electric Co. 1.95% 15/11/2041	USD	218,000	245,058	0.01	
PacificCorp 4.15% 15/02/2050	USD	1,600,000	1,943,656	0.05		Sherwin-Williams Co. (The) 4.55% 01/04/2045	USD	1,821,000	2,266,893	0.05	
Packaging Corp. of America 4.0% 15/12/2049	USD	1,565,000	1,851,792	0.04		Simon Property Group LP, REIT 3.2% 15/09/2049	USD	1,518,000	1,530,951	0.04	
Parker-Hannifin Corp. 4.1% 01/03/2047	USD	416,000	494,987	0.01		SITE Centers Corp., REIT 3.82% 01/02/2025	USD	345,000	364,897	0.01	
Phillips 66 4.875% 15/11/2044	USD	85,000	105,867	0.00							
Phillips 66 Partners LP 3.805% 15/02/2025	USD	700,000	754,800	0.02							
Phillips 66 Partners LP 3.55% 01/10/2026	USD	147,000	159,966	0.00							
Phillips 66 Partners LP 3.15% 15/12/2029	USD	1,130,000	1,189,950	0.03							
Phillips 66 Partners LP 4.9% 01/10/2046	USD	306,000	364,590	0.01							
Pioneer Natural Resources Co. 1.5% 15/06/2030	USD	2,580,000	2,486,375	0.06							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める	
			時価(米ドル)	割合(%)				時価(米ドル)	割合(%)
Southern California Edison Co. 1.6% 01/01/2038	USD	800,000	880,252	0.02	UnitedHealth Group, Inc. 4.62% 15/01/2015	USD	396,000	501,630	0.01
Southern California Edison Co. 4% 15/01/2034	USD	150,000	194,786	0.00	UnitedHealth Group, Inc. 3.5% 15/08/2039	USD	1,495,000	1,674,557	0.04
Southern California Edison Co. 5.2% 15/01/2036	USD	530,000	661,429	0.02	US Bancorp 3.375% 05/02/2024	USD	1,200,000	1,285,542	0.03
Southern California Edison Co. 4.0% 15/01/2042	USD	900,000	970,767	0.02	US Treasury 2% 31/10/2021	USD	14,600,000	14,694,360	0.34
Southern California Gas Co. 2.5% 01/02/2030	USD	2,260,000	2,359,558	0.05	US Treasury 1.75% 30/11/2021	USD	15,000,000	15,105,783	0.35
Southern Co. (Inc) 3.25% 01/01/2036	USD	258,000	279,950	0.01	US Treasury 2% 31/12/2021	USD	20,000,000	20,191,900	0.47
Southern Co. Gas Capital Corp. 2.4% 01/10/2023	USD	153,000	159,018	0.00	US Treasury 2.5% 15/01/2022	USD	81,200,000	82,264,793	1.92
Southern Co. Gas Capital Corp. 5.87% 15/01/2041	USD	550,000	762,467	0.02	US Treasury 1.75% 28/02/2022	USD	9,300,000	9,402,395	0.22
Southern Co. Gas Capital Corp. 4.4% 01/06/2043	USD	167,000	198,564	0.00	US Treasury 1.875% 30/04/2022	USD	69,800,000	70,833,577	1.65
Southern Co. Gas Capital Corp. 3.9% 01/10/2046	USD	188,000	209,627	0.00	US Treasury 1.75% 15/05/2022	USD	20,000,000	20,290,726	0.47
Southern Natural Gas Co. LLC 8% 01/03/2032	USD	624,000	892,970	0.02	US Treasury 1.625% 31/08/2022	USD	5,000,000	5,087,891	0.12
Southern Power Co. 5.1% 15/09/2041	USD	871,000	1,054,195	0.02	US Treasury 1.75% 30/09/2022	USD	10,000,000	10,202,539	0.24
SouthTrust Bank 7.6% 15/01/2025	USD	250,000	304,382	0.01	US Treasury 1.875% 30/09/2022	USD	10,000,000	10,217,773	0.24
Southwest Gas Corp. 3.8% 28/09/2046	USD	442,000	480,488	0.01	US Treasury 1.5% 28/02/2023	USD	42,000,000	42,913,008	1.00
TC Pipelines LP 3.9% 25/05/2027	USD	467,000	504,027	0.01	US Treasury 1.75% 15/05/2023	USD	24,636,000	25,335,624	0.59
Tennessee Valley Authority 5.8% 01/04/2035	USD	2,548,000	3,793,499	0.09	US Treasury 2.75% 31/05/2023	USD	880,000	922,350	0.02
Tennessee Valley Authority 4.62% 15/09/2060	USD	433,000	638,344	0.01	US Treasury 1.375% 30/06/2023	USD	10,000,000	10,225,781	0.24
Tennessee Valley Authority 4.2% 15/09/2065	USD	438,000	616,287	0.01	US Treasury 1.375% 31/08/2023	USD	10,000,000	10,237,500	0.24
T-Mobile USA, Inc. 1.3% 15/02/2026	USD	4,510,000	4,543,487	0.11	US Treasury 1.625% 31/10/2023	USD	11,000,000	11,336,016	0.26
T-Mobile USA, Inc. 3.7% 15/04/2027	USD	4,600,000	5,067,071	0.12	US Treasury 2.125% 29/02/2024	USD	17,730,000	18,550,705	0.43
T-Mobile USA, Inc. 2.0% 15/02/2028	USD	3,460,000	3,512,886	0.08	US Treasury 2.5% 15/05/2024	USD	369,000	390,960	0.01
T-Mobile USA, Inc. 3.8% 15/04/2030	USD	8,485,000	9,493,018	0.22	US Treasury 2% 30/06/2024	USD	1,068,000	1,117,145	0.03
Toledo Edison Co. (The) 6.1% 15/05/2037	USD	600,000	824,534	0.02	US Treasury 1.75% 31/12/2024	USD	22,019,000	22,919,543	0.54
Truist Bank 3.3% 15/05/2026	USD	950,000	1,042,054	0.02	US Treasury 2.875% 31/05/2025	USD	46,008,000	49,965,407	1.17
Truist Financial Corp. 2.7% 21/01/2022	USD	365,000	359,414	0.01	US Treasury 2% 15/08/2025	USD	10,000,000	10,527,344	0.25
Truist Financial Corp. 4% 01/05/2025	USD	408,000	454,088	0.01	US Treasury 1.625% 15/02/2026	USD	639,100	662,767	0.02
Tyson Foods, Inc. 4.87% 15/08/2034	USD	390,000	485,044	0.01	US Treasury 0.5% 28/02/2026	USD	36,325,000	35,790,058	0.84
UDR, Inc., REIT 1.9% 01/09/2026	USD	276,000	295,393	0.01	US Treasury 1.75% 31/12/2026	USD	20,466,000	21,339,802	0.50
UDR, Inc., REIT 3.5% 01/07/2027	USD	1,383,000	1,531,192	0.04	US Treasury 0.5% 30/04/2027	USD	25,000,000	24,257,812	0.57
UDR, Inc., REIT 3% 15/08/2031	USD	460,000	484,442	0.01	US Treasury 0.375% 30/09/2027	USD	13,990,000	13,368,101	0.31
UDR, Inc., REIT 2.1% 01/08/2032	USD	1,520,000	1,464,425	0.03	US Treasury 1.25% 31/03/2028	USD	18,725,000	18,806,190	0.44
Union Carbide Corp. 7.7% 01/10/2091	USD	650,000	1,062,030	0.03	US Treasury 1.25% 30/04/2028	USD	42,760,000	42,913,669	1.00
Union Electric Co. 2.9% 15/06/2027	USD	715,000	774,391	0.02	US Treasury 2.875% 15/05/2028	USD	7,360,400	8,179,676	0.19
Union Pacific Corp. 1.9% 15/08/2039	USD	900,000	1,045,566	0.02	US Treasury 1.625% 15/08/2029	USD	775,000	792,922	0.02
					US Treasury 1.75% 15/11/2029	USD	2,410,000	2,488,419	0.06
					US Treasury 1.625% 15/05/2031	USD	2,965,000	3,012,486	0.07
					US Treasury 4.375% 15/02/2038	USD	1,830,000	2,519,467	0.06
					US Treasury 1.125% 15/05/2040	USD	3,105,000	2,682,914	0.06
					US Treasury 3.875% 15/08/2040	USD	1,250,000	1,644,141	0.04
					US Treasury 4.25% 15/11/2040	USD	6,500,000	8,967,715	0.21
					US Treasury 4.75% 15/02/2041	USD	3,000,000	4,400,742	0.10
					US Treasury 2.75% 15/11/2042	USD	27,000,000	31,332,555	0.73
					US Treasury 3.125% 15/02/2043	USD	7,800,000	9,325,570	0.22
					US Treasury 3.625% 15/08/2043	USD	22,000,000	28,350,781	0.66
					US Treasury 3.625% 15/02/2044	USD	9,348,000	12,090,689	0.28
					US Treasury 3% 15/11/2044	USD	634,000	747,006	0.02
					US Treasury 2.25% 15/08/2046	USD	2,450,000	2,534,889	0.06

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
US Treasury 3% 15/02/2048	USD	1,330,000	1,586,129	0.04		Verizon Communications, Inc. 2.98% 30/10/2036	USD	1,091,000	1,031,742	0.02	
US Treasury 2.875% 15/05/2049	USD	23,296,000	27,301,820	0.64		Virginia Electric and Power Co. 6% 15/05/2027	USD	200,000	277,920	0.01	
US Treasury 2.25% 15/08/2049	USD	1,880,000	1,949,545	0.05		Virginia Electric and Power Co. 3.8% 15/09/2047	USD	700,000	811,663	0.02	
US Treasury 2.375% 15/11/2049	USD	10,005,000	10,662,369	0.25		WVare, Inc. 2.95% 21/08/2022	USD	1,944,000	1,994,583	0.05	
US Treasury 2% 15/02/2050	USD	10,484,000	10,309,949	0.24		Wells Fargo & Co. 2.5% 29/09/2025	USD	750,000	824,779	0.02	
US Treasury 1.25% 15/05/2050	USD	12,240,000	10,006,678	0.23		Wells Fargo & Co. 4.1% 02/06/2026	USD	317,000	357,126	0.01	
US Treasury 1.375% 15/08/2050	USD	1,655,000	1,396,988	0.03		Wells Fargo & Co. 5.375% 02/11/2043	USD	284,000	379,429	0.01	
US Treasury 1.625% 15/11/2050	USD	14,815,000	13,323,083	0.31		Wells Fargo & Co. 5.60% 15/01/2044	USD	2,640,000	3,632,992	0.08	
US Treasury 1.875% 15/02/2051	USD	34,365,000	32,830,497	0.77		Wells Fargo & Co. 4.9% 17/11/2045	USD	359,000	462,133	0.01	
US Treasury 2.375% 15/05/2051	USD	510,000	545,302	0.01		Wells Fargo & Co. 4.75% 07/12/2046	USD	478,000	606,651	0.01	
US Treasury Inflation Indexed 0.25% 15/01/2022	USD	5,360,000	6,461,030	0.15		Welltower, Inc., REIT 2.7% 15/02/2027	USD	412,000	437,326	0.01	
US Treasury Inflation Indexed 1.7% 15/01/2023	USD	1,500,000	2,312,103	0.05		Welltower, Inc., REIT 4.95% 01/09/2048	USD	1,372,000	1,757,190	0.04	
US Treasury Inflation Indexed 2.0% 15/01/2029	USD	1,000,000	1,601,529	0.04		Williams Cos., Inc. (The) 4.8% 01/03/2048	USD	876,000	827,736	0.02	
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/11/2023	USD	3,287,000	3,261,830	0.08		W Care, Inc., REIT 4.2% 01/02/2026	USD	4,400,000	4,949,129	0.12	
Valero Energy Corp. 2.7% 15/04/2023	USD	1,460,000	1,514,399	0.04		W Care, Inc., REIT 2.4% 01/02/2031	USD	1,975,000	1,961,867	0.05	
Valero Energy Corp. 1.2% 15/02/2024	USD	2,320,000	2,338,838	0.05		W Care, Inc., REIT 2.2% 01/04/2033	USD	3,000,000	2,881,492	0.07	
Valero Energy Corp. 2.1% 15/09/2027	USD	2,090,000	2,126,744	0.05		WRC Co, Inc. 3.9% 01/06/2028	USD	315,000	357,149	0.01	
Valero Energy Corp. 1.5% 15/04/2032	USD	251,000	353,470	0.01		Xylem, Inc. 3.2% 01/11/2026	USD	166,000	181,855	0.00	
Ventas Realty LP, REIT 3.75% 01/05/2024	USD	300,000	322,286	0.01		Zimmer Biomet Holdings, Inc. 2.7% 19/02/2022	USD	349,000	366,998	0.01	
Ventas Realty LP, REIT 4.125% 15/01/2026	USD	43,000	48,174	0.00		Zoetis, Inc. 2% 15/05/2030	USD	1,630,000	1,625,718	0.04	
Ventas Realty LP, REIT 3.25% 15/10/2026	USD	108,000	117,256	0.00					1,438,642,190	32.58	
Ventas Realty LP, REIT 3.85% 01/04/2027	USD	369,000	413,823	0.01		英ヴァージン諸島					
WEHET Operating Partnership LP, REIT 4.375% 01/06/2026	USD	1,500,000	1,727,205	0.04		China Southern Power Grid International Finance BVI Co. Ltd., M44 2.5% 08/05/2027	USD	1,751,000	1,922,020	0.04	
Verizon Communications, Inc. 2.1% 22/02/2028	USD	1,545,000	1,578,350	0.04					1,922,020	0.04	
Verizon Communications, Inc. 3.1% 22/03/2030	USD	2,915,000	3,149,259	0.07		債券合計			1,652,044,932	38.56	
Verizon Communications, Inc. 4.5% 10/04/2033	USD	1,290,000	1,545,010	0.04		証券取引所に上場を承認されている譲渡性有価証券および短期金融市場商品合計			1,652,044,932	38.56	
Verizon Communications, Inc. 4.4% 01/11/2034	USD	3,083,000	3,630,808	0.08		その他の規制市場で取引される譲渡性有価証券および短期金融市場商品					
Verizon Communications, Inc. 4.27% 15/01/2036	USD	1,500,000	1,791,371	0.04		債券					
Verizon Communications, Inc. 2.6% 20/11/2040	USD	2,481,000	2,391,336	0.06		オーストラリア					
Verizon Communications, Inc. 4.8% 21/08/2046	USD	3,047,000	3,942,813	0.09		APT Pipelines Ltd., 144A 4.2% 15/07/2027	USD	895,000	1,012,394	0.02	
Verizon Communications, Inc. 4.67% 15/03/2055	USD	700,000	915,460	0.02		Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 144A 4.4% 19/03/2026	USD	200,000	225,680	0.01	
						Commonwealth Bank of Australia, 144A 2.5% 18/03/2022	USD	600,000	615,684	0.01	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める	
			時価(米ドル)	割合(%)				時価(米ドル)	割合(%)
QIF Bond Issuer Pty. Ltd., BEET, 144A 3.4% 30/09/2026	USD	826,000	902,059	0.02	Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 3.8% 25/01/2020	USD	2,525,000	2,716,362	0.06
Macquarie Bank Ltd., FNM, 144A 3.052% 03/02/2028	USD	1,585,000	1,559,210	0.04	Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 3.62% 12/05/2021	USD	1,325,000	1,388,770	0.03
Macquarie Group Ltd., FNM, 144A 5.033% 15/01/2020	USD	4,000,000	4,753,071	0.11	Bank of Montreal 1.3% 05/02/2024	USD	1,200,000	1,285,537	0.03
National Australia Bank Ltd., 144A 2.332% 21/08/2020	USD	1,060,000	1,013,024	0.04	Bank of Montreal 1.82% 01/05/2025	USD	1,950,000	2,017,610	0.05
National Australia Bank Ltd., 144A 2.648% 14/01/2041	USD	785,000	719,305	0.02	Bank of Montreal, FNM 3.803% 15/12/2022	USD	433,000	477,883	0.01
National Australia Bank Ltd., FNM, 144A 3.932% 03/09/2024	USD	1,795,000	1,942,154	0.05	Bank of Nova Scotia (The) 2.2% 03/02/2025	USD	2,727,000	2,847,204	0.07
National Australia Bank Ltd. 3.37% 14/01/2025	USD	1,337,000	1,474,897	0.04	Bank of Nova Scotia (The) 4.5% 16/12/2025	USD	365,000	413,929	0.01
National Australia Bank Ltd. 2.5% 12/01/2025	USD	500,000	532,167	0.01	Brookfield Finance, Inc. 3.9% 25/01/2028	USD	432,000	471,614	0.01
Newcrest Finance Pty. Ltd., 144A 3.23% 12/05/2020	USD	955,000	1,027,752	0.02	Brookfield Finance, Inc. 4.7% 20/09/2047	USD	335,000	408,173	0.01
Sentrx Group Trust 1, BEET, 144A 3.5% 12/02/2025	USD	1,700,000	1,834,201	0.04	Canadian Imperial Bank of Commerce 3.1% 02/04/2024	USD	500,000	531,605	0.01
Sentrx Group Trust 2, BEET, FNM, 144A 4.7% 24/09/2020	USD	4,065,000	4,333,781	0.10	Genovus Energy, Inc. 3.95% 15/04/2022	USD	300,000	305,402	0.01
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd., 144A 3.37% 30/04/2025	USD	1,200,000	1,284,616	0.03	Genovus Finance Canada Ltd., 144A 4.9% 15/11/2021	USD	2,155,000	2,190,549	0.05
Westpac Banking Corp. 4.421% 24/07/2029	USD	865,000	1,025,714	0.02	Manulife Financial Corp., FNM 4.061% 26/02/2022	USD	1,700,000	1,878,675	0.04
Westpac Banking Corp., FNM 4.312% 22/11/2031	USD	1,950,000	2,167,273	0.05	Nutrien Ltd. 4% 15/12/2026	USD	850,000	958,396	0.02
			27,022,981	0.63	Nutrien Ltd. 4.125% 15/02/2025	USD	500,000	572,285	0.01
					Nutrien Ltd. 5.125% 15/01/2040	USD	125,000	179,196	0.00
					Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust, 144A 3.12% 20/02/2022	USD	772,000	786,445	0.02
パミューダ					Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust, 144A 3.87% 20/02/2027	USD	804,000	887,765	0.02
Triton Container International Ltd., 144A 1.1% 01/06/2024	USD	2,005,000	2,001,609	0.05	Province of Quebec Canada 6.3% 30/01/2026	USD	270,000	329,169	0.01
			2,001,609	0.05	Royal Bank of Canada 3.7% 05/10/2023	USD	1,500,000	1,610,481	0.04
カナダ					Royal Bank of Canada 4.65% 27/01/2026	USD	400,000	458,703	0.01
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2012-1 'A', 144A 4.12% 15/11/2026	USD	642,292	663,167	0.02	Schlumberger Finance Canada Ltd. 1.4% 17/09/2025	USD	2,950,000	2,989,922	0.07
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2015-1 'A', 144A 3.0% 15/09/2028	USD	371,561	378,993	0.01	Toronto-Dominion Bank (The) 1.25% 11/01/2024	USD	1,245,000	1,334,576	0.03
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2017-1 'A', 144A 3.35% 15/01/2031	USD	2,186,976	2,132,302	0.05				33,083,607	0.77
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2017-2 'M', 144A 2.3% 15/01/2031	USD	714,168	725,323	0.02					
Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 2.9% 25/01/2020	USD	875,000	911,822	0.02	ケイマン諸島				
Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 3.42% 12/02/2041	USD	1,190,000	1,231,889	0.03	Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 5.5% 15/01/2023	USD	3,965,000	4,212,238	0.10

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める	
			時価 (米ドル)	割合 (%)				時価 (米ドル)	割合 (%)
Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 5.25% 15/05/2024	USD	2,915,000	3,208,072	0.07	フィンランド Nordea Bank Abp, 144A 4.25% 21/09/2022	USD	680,000	710,460	0.02
Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 2.875% 15/02/2025	USD	1,898,000	1,955,874	0.05				710,460	0.02
Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 5.3% 15/01/2026	USD	4,015,000	4,558,014	0.11	フランス				
Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 2.125% 21/02/2026	USD	1,380,000	1,369,532	0.03	Air Liquide Finance SA, 144A 2.35% 27/01/2022	USD	578,000	599,409	0.01
Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 4.25% 15/04/2026	USD	1,830,000	1,984,558	0.05	BNP Paribas SA, 144A 3.375% 09/01/2025	USD	350,000	375,943	0.01
Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 4.375% 01/05/2026	USD	605,000	657,791	0.02	BNP Paribas SA, 144A 2.824% 26/01/2041	USD	669,000	634,593	0.01
Colony American Finance Ltd., Series 2017-2 'A', 144A 2.55% 15/11/2048	USD	323,974	323,997	0.01	BNP Paribas SA, FRN, 144A 1.219% 09/06/2026	USD	1,072,000	1,105,400	0.03
HE20 Funding II, Series 2016-2B 'B', 144A 5.24% 30/09/2042	USD	1,008,256	1,010,890	0.02	BNP Paribas SA, FRN, 144A 1.321% 13/01/2027	USD	840,000	837,555	0.02
HE20 Funding II, Series 2016-2B 'B', 144A 5.73% 30/09/2047	USD	1,236,591	1,262,369	0.03	BNP Paribas SA, FRN, 144A 1.051% 13/01/2021	USD	2,000,000	2,111,322	0.05
HE20 Funding Trust, Series 2017-1A 'A2', 144A 4.46% 30/09/2047	USD	2,654,004	2,798,445	0.06	BNP Paribas SA, FRN, 144A 1.583% 12/01/2015	USD	2,221,000	2,172,568	0.05
Hotchison Wharfedale International II Ltd., 144A 4.625% 11/01/2022	USD	300,000	306,796	0.01	BPCE SA, 144A 4.825% 11/07/2024	USD	1,100,000	1,209,645	0.03
Hotchison Wharfedale International III Ltd., 144A 3.625% 31/10/2024	USD	550,000	599,409	0.01	BPCE SA, 144A 1% 20/01/2026	USD	3,415,000	3,372,835	0.08
Park Aerospace Holdings Ltd., 144A 5.25% 15/08/2022	USD	9,950,000	10,413,037	0.24	BPCE SA, FRN, 144A 1.652% 06/10/2026	USD	1,734,000	1,740,958	0.04
Park Aerospace Holdings Ltd., 144A 4.3% 15/02/2023	USD	860,000	904,462	0.02	BPCE SA, FRN, 144A 2.277% 20/01/2032	USD	2,495,000	2,451,449	0.06
Park Aerospace Holdings Ltd., 144A 5.3% 15/02/2024	USD	2,625,000	2,887,236	0.07	Credit Agricole SA, 144A 2.811% 11/01/2041	USD	1,355,000	1,287,953	0.03
Rose, Series 2017-1A 'A', 144A 3.67% 20/09/2022	USD	1,138,666	1,199,150	0.03	Credit Agricole SA, FRN, 144A 1.249% 26/01/2027	USD	6,207,000	6,106,405	0.14
			39,651,869	0.93	Societe Generale SA, 144A 4.25% 19/08/2026	USD	3,600,000	3,952,336	0.09
中国					Societe Generale SA, 144A 3% 22/01/2020	USD	1,349,000	1,405,570	0.03
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 2.45% 20/10/2021	USD	1,000,000	1,005,233	0.02	Societe Generale SA, FRN, 144A 1.483% 14/12/2026	USD	4,226,000	4,195,318	0.10
			1,005,233	0.02	Societe Generale SA, FRN, 144A 1.792% 09/06/2027	USD	865,000	862,793	0.02
デンマーク					Societe Generale SA, FRN, 144A 2.889% 09/06/2022	USD	2,085,000	2,112,459	0.05
Danske Bank A/S, 144A 2% 08/09/2021	USD	429,000	430,343	0.01	Tota Energies Capital International SA 2.98% 23/06/2041	USD	2,750,000	2,806,324	0.07
Danske Bank A/S, 144A 2.7% 02/08/2022	USD	550,000	558,814	0.01				39,341,343	0.92
Danske Bank A/S, FRN, 144A 1.111% 08/12/2022	USD	5,034,000	5,060,189	0.12	ドイツ				
			6,649,345	0.14	Deutsche Bank AG, FRN 2.222% 18/09/2024	USD	3,955,000	4,059,206	0.09

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める	
			時価(米ドル)	割合(%)				時価(米ドル)	割合(%)
Deutsche Bank AG, FRN 2.125% 34/11/2026	USD	1,940,000	1,972,297	0.05	Nissan Motor Co. Ltd., 144A4.245% 17/09/2027	USD	7,754,000	8,524,245	0.20
Deutsche Telekom AG, 144A 1.615% 21/01/2030	USD	799,000	852,468	0.02	ORIX Corp. 2.9% 18/07/2022	USD	564,000	578,776	0.01
			6,868,971	0.16	ORIX Corp. 3.7% 18/07/2027	USD	500,000	560,201	0.01
香港					Sumitomo Life Insurance Co., FRN, 144A 2% 14/09/2017	USD	1,000,000	1,080,250	0.02
AIA Group Ltd., 144A 3.8% 09/04/2029	USD	595,000	659,822	0.02	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 5% 26/11/2030	USD	2,065,000	2,487,915	0.06
			659,822	0.02	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.025% 09/07/2040	USD	1,540,000	1,554,746	0.04
アイルランド					Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1.17% 09/07/2030	USD	1,490,000	1,511,849	0.04
AIB Group plc, 144A 4.7% 12/10/2023	USD	1,285,000	1,395,436	0.03	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.375% 09/07/2060	USD	1,045,000	1,072,664	0.02
AIB Group plc, FRN, 144A 4.283% 10/04/2025	USD	2,000,000	2,156,435	0.05			22,486,255	0.52	
Irifiguro Securitisation Finance plc, Series 2018-14 'A2', MA 1.7% 15/06/2022	USD	10,133,535	10,202,321	0.24	ジャージー				
			13,754,192	0.32	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 144 2.9% 30/09/2040	USD	2,400,000	2,386,415	0.06
イスラエル							2,386,415	0.06	
Israel Government Bond 5.5% 18/09/2033	USD	1,080,000	2,374,986	0.06	ルクセンブルク				
			2,374,986	0.06	ifent Finance Sarl 4.5% 15/04/2028	USD	900,000	990,254	0.02
イタリア					SES SA, 144A 3.6% 04/04/2023	USD	200,000	209,192	0.00
Eni SpA, 144A 4% 12/09/2023	USD	320,000	342,021	0.01	Swiss Re Finance Luxembourg SA, FRN, 144A 3% 02/04/2049	USD	1,000,000	1,139,304	0.03
UniCredit SpA, 144A 6.572% 14/01/2022	USD	2,500,000	2,577,659	0.06			2,338,750	0.05	
UniCredit SpA, FRN, 144A 2.589% 22/09/2026	USD	2,800,000	2,941,031	0.07	オランダ				
UniCredit SpA, FRN, 144A 1.982% 02/06/2027	USD	510,000	508,028	0.01	Airbus SE, 144A 1.95% 10/04/2047	USD	210,000	239,140	0.00
UniCredit SpA, FRN, 144A 5.861% 19/06/2032	USD	1,400,000	1,547,056	0.03	Cooperatieve Rabobank UA 2.75% 10/01/2022	USD	1,600,000	1,621,568	0.04
UniCredit SpA, FRN, 144A 7.296% 02/04/2034	USD	710,000	850,828	0.02	Cooperatieve Rabobank UA 4.625% 01/12/2022	USD	250,000	273,405	0.01
			8,666,623	0.20	Cooperatieve Rabobank UA 4.175% 04/08/2025	USD	501,000	559,519	0.01
日本					Cooperatieve Rabobank UA 3.75% 21/07/2026	USD	1,257,000	1,383,081	0.03
Daiwa Securities Group, Inc., 144A 3.125% 19/04/2022	USD	793,000	810,574	0.02	EDP Finance BV, 144A 3.625% 15/07/2024	USD	800,000	859,259	0.02
Mitsubishi HC Capital, Inc., 144A 2.652% 19/09/2022	USD	600,000	614,220	0.01	Bnel Finance International NV, 144A 4.625% 14/09/2023	USD	370,000	419,512	0.01
Nimbo Financial Group, Inc., FRN 2.235% 25/05/2026	USD	1,675,000	1,734,816	0.04	Bnel Finance International NV, 144A 3.625% 29/05/2027	USD	640,000	704,000	0.02
Nimbo Financial Group, Inc., FRN 2.891% 13/09/2028	USD	1,872,000	1,966,000	0.05	Bnel Finance International NV, 144A 3.5% 06/04/2028	USD	745,000	817,007	0.02
					Lundin Energy Finance BV, 144A 3% 15/07/2026	USD	1,041,000	1,045,095	0.02

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A 1.12% 05/01/2026	USD	700,000	747,431	0.02		Credit Suisse Group AG, FRN, 144A 2.09% 14/05/2022	USD	1,960,000	1,917,014	0.04	
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A 2.35% 15/10/2026	USD	500,000	525,969	0.01		UBS Group AG, 144A 4.125% 24/09/2025	USD	2,295,000	2,560,943	0.06	
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A 4.4% 27/05/2045	USD	250,000	321,079	0.01		UBS Group AG, FRN, 144A 1.364% 30/01/2027	USD	2,000,000	1,988,261	0.05	
			<u>9,515,965</u>	<u>0.22</u>				<u>14,602,585</u>	<u>0.34</u>		
ニュージーランド						イギリス					
ASB Bank Ltd., 144A 3.125% 23/05/2024	USD	1,585,000	1,692,406	0.04		AstraZeneca plc 6.45% 15/09/2027	USD	520,000	777,802	0.02	
Bank of New Zealand, 144A 3.5% 20/02/2024	USD	620,000	665,156	0.02		AstraZeneca plc 4% 18/09/2042	USD	430,000	513,647	0.01	
BNI International Funding Ltd., 144A 2.5% 20/02/2022	USD	500,000	508,653	0.01		AstraZeneca plc 1.13% 06/08/2050	USD	1,210,000	1,061,968	0.02	
BNI International Funding Ltd., 144A 2.6% 03/11/2022	USD	900,000	928,966	0.02		BAE Systems plc, 144A 1.9% 15/02/2031	USD	2,613,000	2,520,982	0.06	
			<u>3,795,121</u>	<u>0.09</u>		BIG System plc, 144A 2% 15/09/2050	USD	1,272,000	1,248,026	0.03	
						Royalty Pharma plc, 144A 0.75% 02/09/2023	USD	2,360,000	2,367,169	0.05	
						Royalty Pharma plc, 144A 1.2% 02/09/2025	USD	2,515,000	2,495,209	0.06	
パナマ						アメリカ					
Banco Nacional de Panama, 144A 2.5% 11/06/2030	USD	3,060,000	2,954,642	0.07		Royalty Pharma plc, 144A 1.7% 02/09/2027	USD	2,515,000	2,477,568	0.06	
			<u>2,954,642</u>	<u>0.07</u>		Royalty Pharma plc, 144A 3.3% 02/09/2040	USD	1,930,000	1,930,376	0.04	
						Royalty Pharma plc, 144A 3.5% 02/09/2050	USD	1,985,000	1,986,117	0.05	
シンガポール						イギリス					
BOC Aviation Ltd., 144A 2.75% 18/09/2022	USD	650,000	661,965	0.02		Vodafone Group plc 5.25% 30/05/2048	USD	683,000	900,371	0.02	
			<u>661,965</u>	<u>0.02</u>		Vodafone Group plc 4.875% 19/06/2049	USD	2,550,000	3,238,148	0.08	
								<u>21,517,383</u>	<u>0.50</u>		
国際機関						アメリカ					
Broadcom Corp. 3.815% 15/01/2027	USD	300,000	221,158	0.01		F-Eleven, Inc., 144A 1.2% 10/02/2028	USD	1,234,000	1,191,745	0.03	
NXP BV, 144A 2.5% 11/05/2031	USD	2,975,000	3,034,394	0.07		F-Eleven, Inc., 144A 2.5% 10/02/2041	USD	1,258,000	1,171,515	0.03	
NXP BV, 144A 3.25% 11/05/2041	USD	3,060,000	3,147,441	0.07		AbbVie, Inc. 2.8% 15/03/2023	USD	1,100,000	1,136,558	0.03	
			<u>6,392,993</u>	<u>0.15</u>		AbbVie, Inc. 3.85% 15/06/2024	USD	801,000	868,945	0.02	
スウェーデン						アメリカ					
Sveabank AB, 144A 2.8% 14/01/2022	USD	500,000	508,027	0.01		AbbVie, Inc. 4.55% 15/03/2035	USD	500,000	606,610	0.01	
			<u>508,027</u>	<u>0.01</u>		AbbVie, Inc. 4.05% 21/11/2039	USD	2,729,000	3,178,085	0.07	
						AbbVie, Inc. 4.35% 21/11/2049	USD	1,580,000	1,874,898	0.04	
スイス						アメリカ					
Credit Suisse Group AG, 144A 1.51% 09/01/2023	USD	1,808,000	1,836,774	0.04		ARC Inst. STR, Series 2005-01 'M' 4.99% 26/01/2024	USD	9,660	9,666	0.00	
Credit Suisse Group AG, 144A 4.28% 09/01/2028	USD	594,000	661,385	0.01		Advocate Health & Hospitals Corp. 2.11% 15/06/2038	USD	1,300,000	1,319,725	0.03	
Credit Suisse Group AG, FRN, 144A 2.19% 05/06/2026	USD	1,070,000	1,095,934	0.03		AEP Transmission Co. LLC 4% 01/12/2046	USD	467,000	551,842	0.01	
Credit Suisse Group AG, FRN, 144A 1.30% 02/02/2021	USD	4,635,000	4,542,364	0.11		AEP Transmission Co. LLC 3.8% 15/06/2049	USD	615,000	711,524	0.02	
						AIG Global Funding, 144A 1.9% 06/10/2021	USD	800,000	803,450	0.02	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める割合(%)		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める割合(%)	
				時価(米ドル)	割合(%)					時価(米ドル)	割合(%)
AIG SunAmerica Global Financing 3, 1444 6.5% 15/03/2032	USD	650,000	929,043	0.02		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFRC 'g', 1444 4.201% 17/12/2036	USD	750,000	799,442	0.02	
Air Lease Corp. 1.875% 03/01/2023	USD	925,000	962,325	0.02		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFRC 'c', 1444 4.105% 17/10/2036	USD	1,300,000	1,397,458	0.03	
Alexander Funding Trust, 1444 1.84% 15/11/2023	USD	2,000,000	2,037,053	0.05		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFRC 'c', 1444 4.996% 17/12/2036	USD	500,000	537,769	0.01	
Alternative Loan Trust, Series 2005-SACB '1A11' 5.3% 25/11/2035	USD	148,349	140,209	0.00		American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFRC 'b', 1444 4.691% 17/10/2032	USD	1,893,000	2,059,267	0.05	
Alternative Loan Trust, Series 2005-20CB '1A4' 5.5% 15/03/2035	USD	121,969	121,935	0.00		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFRC 'b', 1444 5.04% 17/12/2036	USD	523,000	564,821	0.01	
Alternative Loan Trust, Series 2004-0CB '1A9' 5.75% 15/01/2034	USD	367,205	369,808	0.01		American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFRC 'b', 1444 5.036% 17/10/2032	USD	4,103,000	4,486,196	0.11	
Alternative Loan Trust, Series 2004-20CB '3A1' 6% 15/01/2035	USD	25,652	26,022	0.00		American Municipal Power, Inc. 'B' 7.49% 15/02/2030	USD	715,000	1,166,835	0.03	
Alternative Loan Trust, 30, RRA, Series 2005-20CB '3A8' 4.65% 25/01/2035	USD	513,943	70,237	0.00		American Tower Corp., REIT 1.875% 15/05/2030	USD	2,740,000	2,648,547	0.06	
Amazon.com, Inc. 3.875% 22/08/2037	USD	1,000,000	1,195,266	0.03		American Tower Trust #1, REIT, 1444 3.07% 15/03/2048	USD	1,950,000	1,959,501	0.05	
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2014-1 'A' 1.7% 01/04/2038	USD	1,627,380	1,655,859	0.04		AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2017-1 'c' 2.7% 13/08/2022	USD	24,164	24,191	0.00	
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-2 'AA' 3.2% 15/12/2039	USD	472,200	482,824	0.01		AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2017-1 'd' 3.1% 13/01/2023	USD	1,372,000	1,382,878	0.03	
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-3 'AA' 3% 15/04/2030	USD	1,569,802	1,590,998	0.04		AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2017-2 'd' 3.4% 13/04/2023	USD	10,400,000	10,552,855	0.25	
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2017-1 'M' 3.6% 15/08/2030	USD	1,759,730	1,847,716	0.04		AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2017-1 'd' 3.1% 13/01/2023	USD	12,435,000	12,666,900	0.30	
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-1 'M' 3.1% 15/08/2031	USD	2,175,478	2,229,865	0.05		AmeriCredit Automobile Receivables Trust, Series 2017-4 'd' 3.0% 13/12/2023	USD	11,550,000	11,799,124	0.28	
American Credit Acceptance Receivables Trust, Series 2014-1 'B', 1444 3.9% 10/04/2024	USD	1,233,667	1,342,930	0.03		Amgen, Inc. 2.2% 21/02/2027	USD	1,190,000	1,235,922	0.03	
American Homes 4 Rent, Series 2015-SFBL 'A', 1444 3.467% 17/04/2052	USD	6,393,250	6,789,379	0.16		Amgen, Inc. 3.1% 21/02/2040	USD	625,000	650,630	0.02	
American Homes 4 Rent, Series 2015-SFBL 'D', 1444 4.407% 17/04/2052	USD	6,418,000	6,828,594	0.16							
American Homes 4 Rent, Series 2015-SFBL 'E', 1444 5.639% 17/04/2052	USD	650,000	713,001	0.02							
American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFRC 'A', 1444 3.78% 17/10/2036	USD	5,744,400	6,112,793	0.14							
American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFRC 'A', 1444 3.67% 17/12/2036	USD	5,811,588	6,194,160	0.15							
American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFRC 'A', 1444 3.73% 17/10/2032	USD	1,424,834	1,533,522	0.04							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)	割合(%)						
Analog Devices, Inc. 3.125% 05/12/2023	USD	611,000	646,542	0.02		Bank of America Funding Trust, Series 2006-6 '30' 5.5% 25/10/2005	USD	75,972	76,749	0.00	
Analog Devices, Inc. 4.5% 06/20/2006	USD	803,000	948,493	0.02		Bank of America Funding Trust, PO, Series 2004-2 '30Y' 05/20/09/2004	USD	8,335	7,012	0.00	
Appalachian Power Co. 4.5% 01/03/2049	USD	380,000	465,731	0.01		Bank of America Funding Trust, PO, Series 2005-1 '30Y' 05/25/11/2005	USD	16,370	15,747	0.00	
Apple, Inc. 3.25% 23/02/2026	USD	266,000	292,202	0.01		Bank of America Funding Trust, FNM, Series 2005-6 '4A1' 2.97% 20/03/2005	USD	1,675	1,677	0.00	
Apple, Inc. 2.45% 04/08/2026	USD	1,259,000	1,340,734	0.03		Bank of America Corp., FNM 1.864% 23/01/2024	USD	300,000	319,096	0.01	
Apple, Inc. 3% 20/06/2027	USD	1,350,000	1,485,355	0.04		Bank of America Corp., FNM 1.458% 15/02/2025	USD	500,000	534,165	0.01	
Apple, Inc. 3.45% 09/02/2045	USD	792,000	890,831	0.02		Bank of America Corp., FNM 1.693% 01/06/2025	USD	635,000	676,835	0.02	
Apple, Inc. 3.85% 04/08/2046	USD	879,000	1,052,069	0.03		Bank of America Corp., FNM 1.366% 23/01/2026	USD	1,000,000	1,078,690	0.03	
Ascension Health 2.532% 15/11/2029	USD	1,770,000	1,866,842	0.04		Bank of America Corp., FNM 1.658% 11/02/2027	USD	2,510,000	2,533,578	0.06	
Accurant, Inc. 4.1% 27/09/2023	USD	910,000	976,466	0.02		Bank of America Corp., FNM 1.734% 22/01/2027	USD	829,000	836,231	0.02	
AT&T, Inc., 144A 1.5% 15/09/2053	USD	3,188,000	3,179,184	0.07		Bank of America Corp., FNM 1.705% 24/04/2028	USD	3,600,000	3,983,951	0.09	
AT&T, Inc., 144A 1.55% 15/09/2055	USD	309,000	309,840	0.01		Bank of America Corp., FNM 1.419% 20/12/2028	USD	3,165,000	3,449,287	0.08	
AT&T, Inc., 144A 1.4% 01/11/2057	USD	346,000	258,681	0.01		Bank of America Corp., FNM 1.97% 05/02/2029	USD	1,500,000	1,690,800	0.04	
AT&T, Inc. 3.1% 01/02/2043	USD	4,835,000	4,730,253	0.11		Bank of America Corp., FNM 1.496% 13/02/2031	USD	7,205,000	7,384,080	0.17	
Athens Global Funding, 144A 0.95% 08/01/2024	USD	3,665,000	3,675,025	0.09		Bank of America Corp., FNM 1.593% 29/04/2031	USD	3,045,000	3,138,167	0.07	
Athens Global Funding, 144A 2.15% 25/06/2024	USD	1,885,000	1,977,897	0.05		Bank of America Corp., FNM 1.898% 23/01/2031	USD	1,675,000	1,630,363	0.04	
Athens Global Funding, 144A 1.45% 08/01/2026	USD	2,770,000	2,774,802	0.07		Bank of America Corp., FNM 1.687% 22/04/2032	USD	2,635,000	2,720,519	0.06	
Athens Global Funding, 144A 2.95% 12/11/2026	USD	4,250,000	4,531,815	0.11		Bank of America Corp., FNM 1.676% 19/06/2041	USD	9,751,000	9,524,218	0.22	
Aviation Capital Group LLC, 144A 2.875% 20/01/2032	USD	1,200,000	1,212,493	0.03		BBUS Trust, Series 2002-GROW 'A', 144A 1.42% 05/12/2006	USD	3,850,000	4,082,552	0.10	
Aviation Capital Group LLC, 144A 2.875% 01/05/2032	USD	750,000	785,957	0.02		BBVA USA 2.5% 27/08/2024	USD	1,750,000	1,842,920	0.04	
Aviation Capital Group LLC, 144A 5.5% 15/12/2034	USD	2,094,000	2,371,114	0.06		Bear Stearns ADM Trust, FNM, Series 2004-2 '14A' 2.69% 25/05/2004	USD	38,265	27,925	0.00	
Avis Budget Rental Car Funding ABSX LLC, Series 2018-2A 'A', 144A 4% 20/03/2025	USD	7,000,000	7,566,580	0.18		Bear Stearns ADM Trust, FNM, Series 2003-7 'M' 2.18% 25/10/2003	USD	3,802	3,803	0.00	
Baltimore Gas and Electric Co. 2.5% 15/08/2022	USD	619,000	632,289	0.02		Bear Stearns ADM Trust, FNM, Series 2003-4 'M1' 2.41% 25/07/2003	USD	38,957	40,751	0.00	
Baltimore Gas and Electric Co. 3.5% 15/08/2046	USD	385,000	425,024	0.01		Bear Stearns ADM Trust, FNM, Series 2006-1 'M1' 2.31% 25/02/2006	USD	54,702	55,810	0.00	
Baltimore Gas and Electric Co. 3.2% 15/09/2049	USD	885,000	929,811	0.02							
Baltimore Gas and Electric Co. 2.5% 15/06/2050	USD	1,000,000	1,001,962	0.02							
BAMLL Re-REMIC Trust, FNM, Series 2016-FR13 'A', 144A 1.549% 27/08/2045	USD	7,475,000	7,393,194	0.17							
Bank of America Funding Trust, FNM, Series 2004-C 'M1' 1.232% 20/12/2004	USD	23,789	34,701	0.00							
Bank of America Funding Trust, Series 2004-2 '1231' 5.71% 20/09/2004	USD	41,575	44,904	0.00							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust, IO, FNM, Series 2005-FN38 'X1', 144A 0.716% 11/06/2041	USD	4,853	6	0.00		Cameron LNG LLC, 144A 3.302% 15/01/2055	USD	2,200,000	2,366,192	0.06	
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust, IO, FNM, Series 2007-735 'X1', 144A 0.605% 12/01/2045	USD	8,270,518	1,337	0.00		Capital One Financial Corp., FNM 3.98% 30/12/2154	USD	2,035,000	2,075,700	0.05	
Biogen, Inc. 2.25% 01/05/2030	USD	2,872,000	2,885,755	0.07		Gargill, Inc., 144A 3.25% 01/02/2023	USD	350,000	367,000	0.01	
Biogen, Inc. 3.15% 01/05/2050	USD	600,000	592,261	0.01		Gargill, Inc., 144A 2.25% 23/04/2000	USD	2,800,000	2,841,225	0.07	
Blackstone Secured Lending Fund, 144A 2.65% 14/01/2021	USD	1,860,000	1,909,538	0.05		CarMax Auto Owner Trust, Series 2018-4 'A3' 3.37% 15/09/2023	USD	1,345,452	1,364,003	0.03	
Boeing Co. (The) 1.25% 01/01/2028	USD	2,043,000	2,148,205	0.05		CarMax Auto Owner Trust, Series 2017-4 'C' 2.7% 15/10/2023	USD	2,560,000	2,585,178	0.06	
Bon Secury Mercy Health, Inc. 1.205% 01/06/2030	USD	1,980,000	2,054,331	0.05		CD Commercial Mortgage Trust, IO, FNM, Series 2007-CD4 'XC', 144A 1.77% 11/12/2049	USD	28,560	946	0.00	
Boston Gas Co., 144A 4.487% 15/02/2042	USD	149,000	176,286	0.00		Charles Schwab Corp. (The), FNM 4% Perpetual	USD	2,430,000	2,495,002	0.06	
Brambles USA, Inc., 144A 4.125% 23/10/2025	USD	500,000	552,651	0.01		Charles Schwab Corp. (The), FNM 4% Perpetual	USD	2,895,000	3,028,567	0.07	
Bristol-Myers Squibb Co. 3.5% 20/02/2028	USD	1,000,000	1,143,816	0.03		Charter Communications Operating LLC 1.75% 15/02/2028	USD	2,280,000	2,515,182	0.06	
Bristol-Myers Squibb Co. 4.125% 15/06/2039	USD	936,000	1,134,775	0.03		Charter Communications Operating LLC 6.304% 23/10/2033	USD	275,000	370,140	0.01	
Bristol-Myers Squibb Co. 5% 15/08/2045	USD	971,000	1,302,315	0.03		Charter Communications Operating LLC 5.375% 01/04/2038	USD	400,000	495,470	0.01	
Bristol-Myers Squibb Co. 4.55% 20/02/2048	USD	1,000,000	1,298,975	0.03		Charter Communications Operating LLC 1.5% 01/06/2041	USD	1,345,000	1,352,447	0.03	
British Airways Pass-Through Trust, Series 2013-1 'A', 144A 4.125% 20/03/2033	USD	1,576,437	1,602,584	0.04		Charter Communications Operating LLC 4.8% 01/03/2050	USD	2,585,000	3,004,087	0.07	
British Airways Pass-Through Trust, Series 2018-1 'M', 144A 3.8% 20/03/2033	USD	694,781	696,482	0.02		Charter Communications Operating LLC 1.7% 01/04/2051	USD	2,570,000	2,563,229	0.06	
British Airways Pass-Through Trust, Series 2019-1 'M', 144A 3.1% 15/06/2034	USD	1,172,370	1,189,240	0.03		Charter Communications Operating LLC 6.834% 23/10/2033	USD	350,000	516,247	0.01	
Broadcom, Inc., 144A 2.45% 15/02/2031	USD	4,373,000	4,316,097	0.10		Chase Funding Trust, STEP, Series 2001-4 '1A5' 5.064% 25/05/2033	USD	126,608	130,138	0.00	
Broadcom, Inc. 4.25% 15/04/2026	USD	3,010,000	3,376,570	0.08		Chase Funding Trust, STEP, Series 2001-6 '1A7' 4.973% 25/11/2034	USD	74,534	78,554	0.00	
Broadcom, Inc. 4.11% 15/09/2028	USD	2,218,000	2,498,137	0.06		Chase Mortgage Finance Trust, FNM, Series 2007-K1 '1A1' 2.58% 25/02/2037	USD	235,319	238,896	0.01	
Broadcom, Inc. 4.19% 15/11/2030	USD	1,500,000	1,686,681	0.04		Chase Mortgage Finance Trust, FNM, Series 2007-K1 '2A1' 2.791% 25/02/2037	USD	23,270	23,578	0.00	
Brooklyn Union Gas Co. (The), 144A 2.855% 04/01/2029	USD	785,000	866,363	0.02		Chase Mortgage Finance Trust, FNM, Series 2007-K2 '2A1' 2.76% 25/02/2038	USD	95,045	96,734	0.00	
Brooklyn Union Gas Co. (The), 144A 4.272% 15/02/2048	USD	760,000	871,563	0.02		Chase Mortgage Finance Trust, FNM, Series 2007-K1 '1A1' 3.03% 25/02/2037	USD	19,393	19,918	0.00	
Bukeye Partners LP 5.83% 15/11/2040	USD	450,000	445,171	0.01							
BOJ Receivables Note Trust, Series 2018-A 'C', 144A 4.44% 02/02/2034	USD	3,287,548	3,444,843	0.08							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に
				占める					占める
				割合(%)					割合(%)
Close Mortgage Finance Trust, FRN, Series 2007-A1 '9A1' 2.83% 25/02/2037	USD	20,448	20,822	0.00	Citigroup Global Markets Mortgage Securities VII, Inc., FRN, Series 2003-UP2 'P01' 0% 15/06/2033	USD	52	48	0.00
Comione Corpus Christi Holdings LLC 5.25% 30/06/2027	USD	420,000	488,900	0.01	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2006-2 '2A11' 5.5% 25/05/2035	USD	78,565	80,815	0.00
Comione Corpus Christi Holdings LLC 3.7% 15/11/2029	USD	1,200,000	1,313,684	0.03	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2009-1 '2A5' 5.25% 25/09/2033	USD	6,509	7,062	0.00
Chevron Phillips Chemical Co. LLC, 144A 5.125% 01/04/2025	USD	1,965,000	2,248,138	0.05	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2009-1 '3A1' 5.25% 25/09/2033	USD	29,273	29,702	0.00
Chevron USA, Inc. 3.9% 15/11/2024	USD	400,000	439,107	0.01	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2009-UP3 'A3' 7% 25/09/2033	USD	531	540	0.00
Chevron USA, Inc. 3.25% 15/10/2029	USD	1,480,000	1,641,752	0.04	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., FRN, Series 2004-UP1 'A3' 2.25% 25/09/2034	USD	13,593	13,951	0.00
Chevron USA, Inc. 8% 01/03/2041	USD	540,000	790,319	0.02	Citigroup, Inc., FRN 3.352% 24/04/2025	USD	1,175,000	1,253,019	0.03
Chevron USA, Inc. 5.25% 15/11/2043	USD	500,000	682,593	0.02	Citigroup, Inc., FRN 3.106% 08/04/2026	USD	3,700,000	3,962,197	0.09
Children's Health System of Texas 2.51% 15/08/2030	USD	2,430,000	2,261,171	0.05	Citigroup, Inc., FRN 1.82% 28/01/2027	USD	3,207,000	3,163,463	0.07
Children's Hospital Corp. (The) 3.88% 01/03/2030	USD	1,587,000	1,328,375	0.03	Citigroup, Inc., FRN 3.887% 10/01/2028	USD	4,700,000	5,225,656	0.12
Children's Hospital/DC 2.92% 15/07/2030	USD	1,580,000	1,574,654	0.04	Citigroup, Inc., FRN 3.668% 24/07/2028	USD	1,100,000	1,213,385	0.03
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-5 '144' 5.5% 25/06/2034	USD	99,597	102,439	0.00	Citigroup, Inc., FRN 3.3% 21/09/2028	USD	750,000	821,625	0.02
CHL Mortgage Pass-Through Trust, FRN, Series 2004-1 '141' 2.45% 25/06/2034	USD	20,483	20,763	0.00	Citigroup, Inc., FRN 4.075% 23/04/2029	USD	2,326,000	2,527,814	0.06
CHL Mortgage Pass-Through Trust, FRN, Series 2005-22 '2A1' 2.60% 25/11/2035	USD	125,966	120,506	0.00	Citigroup, Inc., FRN 1.9% 20/01/2030	USD	2,000,000	2,276,034	0.05
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-3 '205' 5.5% 25/06/2034	USD	146,572	152,674	0.00	Citigroup, Inc., FRN 3.878% 24/01/2039	USD	200,000	231,116	0.01
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-3 'M' 5.75% 25/06/2034	USD	73,286	76,480	0.00	Citigroup, Inc., FRN 1.87% Perpetual	USD	3,315,000	3,389,587	0.08
Cigna Corp. 4.5% 25/02/2026	USD	1,366,000	1,555,596	0.04	Citizens Financial Group, Inc. 2.63% 30/09/2032	USD	199,000	199,724	0.01
Cigna Corp. 4.8% 15/07/2046	USD	156,000	198,042	0.01	Citrix System, Inc. 1.25% 01/03/2036	USD	755,000	746,217	0.02
Cincinnati Financial Corp. 6.92% 15/05/2028	USD	290,000	381,065	0.01	City of Los Angeles Department of Airports 6.58% 15/05/2039	USD	285,000	383,119	0.01
Cincinnati Financial Corp. 6.125% 01/11/2034	USD	1,000,000	1,367,779	0.03	Cleveland Electric Illuminating Co. (The), 144A 3.5% 01/04/2038	USD	857,000	917,428	0.02
Citicorp Mortgage Securities RMHC Pass-Through Certificate Trust, Series 2005-3 '2A2' 5% 25/04/2038	USD	3,249	3,352	0.00	Comcast Cable Communications LLC 8.5% 01/05/2037	USD	394,000	536,603	0.01
Citicorp Mortgage Securities Trust, Series 2006-4 '1A2' 8% 25/08/2036	USD	61,342	82,632	0.00	Comcast Corp. 3.37% 15/01/2025	USD	793,000	862,312	0.02
Citicorp Mortgage Securities, Inc., Series 2004-3 'A5' 5.25% 25/06/2034	USD	197,801	203,954	0.01	Comcast Corp. 3.15% 01/03/2026	USD	972,000	1,058,637	0.03
Citigroup Global Markets Mortgage Securities VII, Inc., FRN, Series 2003-UP1 'A' 2.58% 25/09/2033	USD	29,294	30,618	0.00	Comcast Corp. 3.55% 01/05/2028	USD	886,000	993,227	0.02
					Comcast Corp. 1.95% 15/01/2031	USD	2,660,000	2,622,293	0.06
					Comcast Corp. 4.25% 15/01/2033	USD	2,133,000	2,544,465	0.06
					Comcast Corp. 4.2% 15/08/2034	USD	676,000	800,783	0.02
					Comcast Corp. 3.2% 15/07/2036	USD	850,000	913,616	0.02
					Comcast Corp. 3.0% 01/03/2038	USD	2,000,000	2,303,759	0.05

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)	割合(%)					割合(%)	割合(%)
Comcast Corp. 4.6% 15/10/2038	USD	1,120,000	1,387,937	0.03		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities 5% 25/09/2031	USD	8,146	4,664	0.00	
Comcast Corp. 3.25% 01/11/2039	USD	1,260,000	1,342,344	0.03		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., Series 2003-21 '1A'	USD	57,740	59,424	0.00	
Comcast Corp. 3.75% 01/04/2040	USD	2,155,000	2,441,004	0.06		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., Series 2003-21 '1A'	USD	57,740	59,424	0.00	
COMM Mortgage Trust, FPM, Series 2018-2018 'A', 144A 3.815% 10/04/2033	USD	13,840,000	15,187,197	0.36		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., FPM, Series 2004-602 '2A'	USD	205,183	209,419	0.01	
COMM Mortgage Trust, Series 2015-0225 'A' 3.75% 10/08/2040	USD	1,250,000	1,374,523	0.03		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., Series 2004-5 '2A'	USD	9,097	5,241	0.00	
Commercial Mortgage Trust, III, FPM, Series 2012-022 'A' 1.617% 15/09/2045	USD	1,960,544	19,273	0.00		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., FPM, Series 2003-21 'A'	USD	12,013	10,791	0.00	
CommonSpirit Health 1.547% 01/10/2025	USD	1,385,000	1,397,755	0.03		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., FPM, Series 2003-21 'A'	USD	11,465	9,693	0.00	
CommonSpirit Health 2.782% 01/10/2030	USD	1,385,000	1,440,424	0.03		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., FPM, Series 2003-21 'A'	USD	28,523	28,879	0.00	
CommonSpirit Health 3.93% 01/10/2050	USD	1,385,000	1,511,273	0.04		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., FPM, Series 2003-21 'A'	USD	290,000	328,037	0.01	
Commonwealth Edison Co. 5.875% 01/02/2032	USD	1,000,000	1,357,460	0.03		CRH America Finance, Inc., 144A 3.4% 09/05/2027	USD	200,000	219,431	0.01	
ConocoPhillips, 144A 2.4% 15/02/2031	USD	1,265,000	1,273,776	0.03		CRH America, Inc., 144A 3.875% 18/05/2025	USD	200,000	261,488	0.01	
ConocoPhillips, FPM, 144A 3.15% 01/05/2037	USD	1,200,000	1,350,454	0.03		CRH America, Inc., 144A 5.125% 18/05/2045	USD	332,000	332,445	0.01	
Continental Airlines Pass-Through Trust, Series 2007-1 'A' 5.982% 19/10/2023	USD	107,665	110,088	0.00		Crown Castle Towers LLC, 144A 3.225% 15/05/2042	USD	900,000	949,280	0.02	
Continental Airlines Pass-Through Trust, Series 2012-2 'A' 4% 29/04/2026	USD	357,098	357,324	0.01		CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-8 '1A'	USD	102,173	103,983	0.00	
Cottage Health Obligated Group 3.304% 01/11/2049	USD	1,220,000	1,328,813	0.03		CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-4 '2A'	USD	62,562	65,523	0.00	
Cox Communications, Inc., 144A 3.2% 15/09/2028	USD	503,000	547,189	0.01		CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2003-27 '1A'	USD	35,769	36,286	0.00	
Cox Communications, Inc., 144A 3.2% 15/09/2027	USD	162,000	178,076	0.00		CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, FPM, Series 2003-27 '1A'	USD	10,588	9,341	0.00	
Cox Communications, Inc., 144A 1.8% 01/10/2030	USD	2,460,000	2,349,632	0.06		CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, FPM, Series 2003-10 'A'	USD	23,035	16,250	0.00	
Cox Communications, Inc., 144A 2.9% 01/10/2030	USD	1,485,000	1,415,150	0.03		CSMC Oil L.L.C., Series 2014-05A 'D', 144A 4.315% 15/09/2037	USD	6,000,000	5,790,577	0.14	
CPS Auto Receivables Trust, Series 2017-0 'D', 144A 3.95% 15/02/2023	USD	146,342	146,463	0.00		CSX Corp. 6% 01/10/2036	USD	500,000	692,061	0.02	
CPS Auto Receivables Trust, Series 2018-0 'D', 144A 4.34% 16/09/2024	USD	1,978,000	2,063,592	0.05							
Credit Acceptance Auto Loan Trust, Series 2018-24 'D', 144A 3.94% 15/07/2027	USD	573,917	574,983	0.01							
Credit Acceptance Auto Loan Trust, Series 2018-24 'C', 144A 4.16% 15/09/2027	USD	1,255,000	1,266,688	0.03							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
CSX Corp. 4.75% 30/05/2042	USD	164,000	208,326	0.01		Emera US Finance LP 4.75% 15/06/2046	USD	1,200,000	1,433,245	0.03	
CSX Corp. 4.75% 15/11/2048	USD	910,000	1,183,450	0.03		Energy Transfer LP 5.5% 01/06/2027	USD	254,000	297,900	0.01	
CSX Corp. 3.35% 15/09/2049	USD	230,000	244,985	0.01		Spains, Inc., 2017 2.5% 18/11/2026	USD	2,850,000	3,053,197	0.07	
CYS Pass-Through Trust, 144A 5.25% 11/01/2027	USD	130,719	143,270	0.00		ERAC USA Finance LLC, 144A 2.0% 01/12/2021	USD	430,000	423,229	0.01	
CYS Pass-Through Trust, 144A 1.50% 10/01/2032	USD	998,813	1,266,111	0.03		ERAC USA Finance LLC, 144A 7% 15/10/2037	USD	510,000	763,669	0.02	
CYS Pass-Through Trust, 144A 5.17% 10/01/2033	USD	542,154	645,708	0.02		ERAC USA Finance LLC, 144A 5.625% 15/03/2042	USD	96,000	131,104	0.00	
CYS Pass-Through Trust, 144A 5.50% 10/01/2034	USD	540,678	654,952	0.02		Energy Metro, Inc. 3.12% 15/09/2023	USD	380,000	395,038	0.01	
CYS Pass-Through Trust, Series 2008, 144A 8.33% 10/07/2031	USD	267,108	337,427	0.01		Energy Metro, Inc. 4.2% 15/09/2048	USD	670,000	814,559	0.02	
CYS Pass-Through Trust, Series 2004, 144A 4.16% 11/08/2026	USD	390,163	430,175	0.01		Erelon Generation Co. LLC 3.25% 01/08/2025	USD	1,230,000	1,327,532	0.03	
Declar Finance North America LLC, 144A 3.35% 22/02/2023	USD	530,000	554,373	0.01		Erelon Generation Co. LLC 6.25% 01/10/2039	USD	1,000,000	1,236,083	0.03	
Declar Finance North America LLC, 144A 3.3% 19/05/2025	USD	365,000	383,783	0.01		Erelon Generation Co. LLC 5.75% 01/10/2041	USD	114,000	135,046	0.00	
Dell International LLC 5.45% 15/06/2023	USD	1,100,000	1,192,208	0.03		F&G Global Funding, 144A 1.75% 30/06/2028	USD	1,575,000	1,581,412	0.04	
Dell International LLC 4.9% 01/10/2026	USD	1,660,000	1,917,199	0.05		PHLMC, Series T-54 '2A' 6.5% 25/02/2043	USD	16,945	20,151	0.00	
Delmarva Power & Light Co. 4% 01/06/2042	USD	141,000	160,388	0.00		PHLMC, Series T-76 '2A' 1.75% 25/10/2027	USD	354,811	360,794	0.01	
Delmarva Power & Light Co. 4.15% 15/05/2045	USD	1,000,000	1,196,822	0.03		PHLMC, Series T-41 'M' 5.10% 25/07/2022	USD	11,619	13,010	0.00	
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust, STMP, Series 2004-1 '2A6' 5.24% 25/12/2033	USD	4,229	4,291	0.00		PHLMC, Series T-54 '3A' 7% 25/02/2043	USD	21,456	25,775	0.00	
Diamond Report Owner Trust, Series 2017-14 'A', 144A 1.37% 22/10/2029	USD	768,917	783,933	0.02		PHLMC, Series ST12 'A' 0.807% 25/09/2022	USD	37,762	37,810	0.00	
Diamondback Energy, Inc. 4.75% 31/05/2025	USD	2,925,000	3,294,750	0.08		PHLMC, Series XPLB 'A' 2.77% 25/05/2025	USD	2,000,000	2,145,682	0.05	
Diamondback Energy, Inc. 3.25% 01/12/2028	USD	1,435,000	1,536,803	0.04		PHLMC, Series X037 'A2' 3.49% 25/01/2034	USD	2,500,000	2,670,033	0.06	
Discovery Communications LLC 5.2% 20/09/2047	USD	1,280,000	1,595,372	0.04		PHLMC, Series X048 'A2' 3.28% 25/09/2025	USD	3,000,000	3,268,748	0.08	
Discovery Communications LLC 4% 15/09/2055	USD	257,000	272,897	0.01		PHLMC, Series X054 'A2' 1.745% 25/01/2036	USD	4,000,000	4,303,149	0.10	
Dollar General Corp. 4.125% 01/05/2028	USD	505,000	579,223	0.01		PHLMC, Series X065 'A2' 1.243% 25/04/2037	USD	2,983,000	3,310,489	0.08	
Drive Auto Receivables Trust, Series 2017-1 'B' 1.94% 15/03/2023	USD	561,899	564,593	0.01		PHLMC, Series X088 'A2' 3.09% 25/01/2029	USD	1,156,000	1,334,338	0.03	
Duquesne Light Holdings, Inc., 144A 3.61% 01/08/2027	USD	1,350,000	1,467,104	0.03		PHLMC, Series X152 'A2' 3.08% 25/01/2031	USD	3,761,000	4,212,315	0.10	
Duquesne Light Holdings, Inc., 144A 2.53% 01/10/2030	USD	2,320,000	2,284,557	0.05		PHLMC, Series XJ11 'A2' 1.933% 25/01/2023	USD	1,209,065	1,248,912	0.03	
						PHLMC, Series XJ36 'A2' 1.606% 25/07/2027	USD	10,000,000	10,712,114	0.25	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に
				占める					占める
				割合(%)					割合(%)
FHLMC, Series T-42 'A5' 7.5%	USD	232,612	283,997	0.01	FHLMC, FRN 782870 2.616%	USD	122,959	131,959	0.00
25/02/2042					01/09/2034				
FHLMC, Series T-56 'A5' 5.121%	USD	62,729	744,643	0.02	FHLMC, FRN 782979 2.375%	USD	171,122	182,722	0.00
25/05/2043					01/01/2035				
FHLMC, FRN Series V82 'A7' 1.24%	USD	2,228,000	2,482,350	0.06	FHLMC, FRN 782980 2.375%	USD	72,903	76,705	0.00
25/04/2038					01/01/2035				
FHLMC, Series 8065 'A6' 1.136%	USD	1,600,000	1,780,054	0.04	FHLMC, FRN 847821 2.407%	USD	46,537	49,535	0.00
25/05/2037					01/05/2033				
FHLMC, Series 24 'J' 6.25% 25/11/2033	USD	8,539	8,971	0.00	FHLMC, FRN 848365 2.557%	USD	154,878	165,265	0.00
FHLMC, Series 29 'L' 1.5% 25/04/2034	USD	26,879	38,015	0.00	01/07/2036				
FHLMC, FRN 1A1082 2.009%	USD	23,830	24,935	0.00	FHLMC, FRN 848431 2.413%	USD	90,699	95,517	0.00
01/07/2036					01/02/2036				
FHLMC, FRN 1A1085 1.972%	USD	50,448	52,755	0.00	FHLMC, FRN 848699 2.547%	USD	65,262	69,292	0.00
01/08/2036					01/07/2040				
FHLMC, FRN 1A1096 1.981%	USD	56,171	58,760	0.00	FHLMC, FRN 972200 2.21%	USD	24,388	24,527	0.00
01/10/2036					01/03/2036				
FHLMC, FRN 1A1097 2.087%	USD	70,057	73,541	0.00	FHLMC 461376 6.5% 01/07/2032	USD	79,979	89,189	0.00
01/10/2036					FHLMC 488871 7% 01/01/2031	USD	72,286	81,335	0.00
FHLMC, FRN 1B1865 2.068%	USD	11,919	12,097	0.00	FHLMC 890491 7.5% 01/01/2032	USD	74,172	85,117	0.00
01/04/2034					FHLMC 875791 5.5% 01/01/2033	USD	24,892	28,554	0.00
FHLMC, FRN 1B3485 2.657%	USD	17,762	17,850	0.00	FHLMC 820985 6.5% 01/08/2026	USD	17,145	18,952	0.00
01/07/2037					FHLMC 801448 7% 01/08/2032	USD	5,094	5,836	0.00
FHLMC, FRN 1G2557 2.445%	USD	135,611	144,810	0.00	FHLMC 803436 6.5% 01/09/2036	USD	70,168	83,263	0.00
01/06/2036					FHLMC 804077 6.5% 01/03/2038	USD	72,457	86,602	0.00
FHLMC, FRN 1J1399 2.575%	USD	5,876	5,938	0.00	FHLMC 804952 7.5% 01/01/2038	USD	74,712	90,274	0.00
01/12/2036					FHLMC 805671 5.5% 01/08/2038	USD	107,324	125,062	0.00
FHLMC, FRN 1J1418 2.065%	USD	19,686	19,780	0.00	FHLMC 806493 4.5% 01/05/2041	USD	1,468,525	1,643,069	0.04
01/12/2036					FHLMC 831899 4% 01/01/2038	USD	4,357,940	4,802,561	0.11
FHLMC, FRN 1J1516 2.0% 01/02/2037	USD	21,043	22,302	0.00	FHLMC 868214 5% 01/07/2035	USD	5,742,837	6,589,980	0.15
FHLMC, FRN 1J1514 2.3% 01/04/2037	USD	2,694	2,704	0.00	FHLMC 118221 6% 01/01/2034	USD	27,590	28,986	0.00
FHLMC, FRN 1J2945 2.375%	USD	10,304	10,329	0.00	FHLMC 118224 6% 01/12/2034	USD	114,504	124,007	0.00
01/11/2037					FHLMC P50201 5.5% 01/01/2034	USD	7,681	8,039	0.00
FHLMC, FRN 1K0046 2.48%	USD	65,979	66,511	0.00	FHLMC 843657 3.5% 01/08/2046	USD	2,781,890	2,967,208	0.07
01/10/2036					FHLMC 849329 4.5% 01/07/2047	USD	1,130,784	1,235,059	0.03
FHLMC, FRN 1L1286 2.375%	USD	48,649	51,601	0.00	FHLMC 852834 4% 01/12/2047	USD	3,209,101	3,435,095	0.08
01/05/2036					FHLMC 863546 5% 01/11/2043	USD	47,361	52,528	0.00
FHLMC, FRN 1N0206 1.952%	USD	41,000	42,071	0.00	FHLMC 869030 4.5% 01/01/2046	USD	2,965,272	3,272,044	0.08
01/08/2036					FHLMC 890673 4% 01/01/2043	USD	479,849	529,834	0.01
FHLMC, FRN 1N0353 2.36%	USD	32,655	33,431	0.00	FHLMC 890690 3.5% 01/06/2042	USD	1,418,719	1,534,297	0.04
01/02/2037					FHLMC 890975 4% 01/06/2042	USD	1,219,784	1,345,893	0.03
FHLMC, FRN 1N1403 2.3% 01/05/2037	USD	6,490	6,549	0.00	FHLMC 891253 4% 01/04/2043	USD	2,530,579	2,791,969	0.07
FHLMC, FRN 1Q0007 2.384%	USD	21,436	21,797	0.00	FHLMC 891305 3.5% 01/04/2043	USD	537,002	576,586	0.01
01/12/2035					FHLMC 891494 4% 01/05/2043	USD	3,495,683	3,759,810	0.09
FHLMC, FRN 1Q0737 2.328%	USD	46,451	47,104	0.00	FHLMC 893007 3.5% 01/07/2045	USD	674,230	729,240	0.02
01/11/2036					FHLMC 893024 3.5% 01/08/2045	USD	864,698	935,303	0.02
FHLMC, FRN 1Q0739 2.152%	USD	94,225	99,099	0.00	FHLMC 893089 3.5% 01/12/2035	USD	608,540	649,115	0.02
01/03/2037					FHLMC 893090 3.5% 01/11/2045	USD	908,947	979,470	0.02
FHLMC, FRN 782760 2.495%	USD	51,244	54,791	0.00	FHLMC 893143 3.5% 01/04/2046	USD	752,711	811,138	0.02
01/11/2036					FHLMC 893154 3.5% 01/05/2046	USD	501,434	542,301	0.01

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に占める	
				割合 (%)	割合 (%)					割合 (%)	割合 (%)
FDMC U99051 3.5% 01/06/2043	USD	1,715,699	1,844,362	0.04		FDMC BEMDC, D1, Series 3756 'BI' 5%	USD	192,735	10,509	0.00	
FDMC U99134 4% 01/01/2046	USD	1,676,041	1,849,522	0.04		15/10/2009					
FDMC Y85515 4% 01/03/2049	USD	636,784	679,577	0.02		FDMC BEMDC, P0, Series 3117 'BI'	USD	14,764	13,735	0.00	
FDMC Z40024 5.5% 01/04/2036	USD	32,775	37,429	0.00		0% 15/02/2036					
FDMC Pool B80011 2.5% 01/11/2049	USD	5,522,470	5,691,886	0.13		FDMC BEMDC, P0, Series 3153 'BI'	USD	73,120	66,875	0.00	
FDMC BEMDC, Series 2619 'AE' 5%	USD	83,560	85,657	0.00		0% 15/05/2036					
15/05/2023						FDMC BEMDC, P0, Series 4280 'BI'	USD	697,409	589,474	0.01	
FDMC BEMDC, 10, STEP, Series 2422	USD	344,875	1,794	0.00		0% 15/12/2043					
'AI' 0.2% 15/01/2038						FDMC BEMDC, Series 1704 'BI' 7.5%	USD	149,467	104,327	0.00	
FDMC BEMDC, P0, Series 3001 'AO'	USD	32,285	29,482	0.00		15/12/2006					
0% 15/04/2036						FDMC BEMDC, Series 2388 'BI' 8.5%	USD	16,566	20,190	0.00	
FDMC BEMDC, Series 3381 'AJ' 6.5%	USD	237,064	282,925	0.01		15/06/2001					
15/07/2006						FDMC BEMDC, F0N, Series 270 'FI'	USD	429,083	436,351	0.01	
FDMC BEMDC, Series 3453 'B' 5.5%	USD	15,413	17,794	0.00		0.57% 15/08/2043					
15/05/2038						FDMC BEMDC, F0N, Series 3549 'FA'	USD	18,413	18,800	0.00	
FDMC BEMDC, Series 2917 'B' 4%	USD	102,209	112,575	0.00		1.27% 15/01/2039					
15/11/2041						FDMC BEMDC, F0N, Series 2388 'FB'	USD	20,992	21,164	0.00	
FDMC BEMDC, Series 2894 'BA' 4%	USD	6,512	6,771	0.00		0.67% 15/01/2009					
15/06/2031						FDMC BEMDC, F0N, Series 4085 'FB'	USD	75,876	75,976	0.00	
FDMC BEMDC, Series 3343 'BC' 5.5%	USD	119,659	139,123	0.00		0.47% 15/01/2039					
15/02/2036						FDMC BEMDC, F0N, Series 4048 'FJ'	USD	906,971	907,397	0.02	
FDMC BEMDC, F0N, Series 1966 'BF'	USD	88,562	88,889	0.00		0.53% 15/01/2037					
0.57% 15/10/2040						FDMC BEMDC, F0N, Series 3275 'FL'	USD	10,797	10,910	0.00	
FDMC BEMDC, P0, Series 3001 'BO'	USD	24,221	22,716	0.00		0.53% 15/02/2037					
0% 15/04/2036						FDMC BEMDC, Series 2944 'BC' 6%	USD	26,813	32,872	0.00	
FDMC BEMDC, P0, Series 3021 'BO'	USD	58,106	54,283	0.00		15/12/2032					
0% 15/01/2040						FDMC BEMDC, 10, F0N, Series 3303	USD	310,510	64,898	0.00	
FDMC BEMDC, F0N, Series 3032 'BS'	USD	145,029	211,125	0.01		'HI' 6.577% 15/08/2036					
17.25% 15/02/2040						FDMC BEMDC, Series 2483 'BE' 4.5%	USD	488,358	552,861	0.01	
FDMC BEMDC, Series 3001 'CS' 5.5%	USD	180,887	208,583	0.01		15/09/2002					
15/01/2039						FDMC BEMDC, D0, Series 3714 'P' 5%	USD	148,528	14,487	0.00	
FDMC BEMDC, 10, F0N, Series 1260	USD	27,990	5,525	0.00		15/09/2040					
'CS' 6.067% 15/01/2037						FDMC BEMDC, Series 1821 'J' 6.4%	USD	44,284	46,343	0.00	
FDMC BEMDC, F0N, Series 3088 'CX'	USD	609	611	0.00		15/11/2023					
6.604% 15/12/2021						FDMC BEMDC, Series 2033 'J' 5.6%	USD	8,595	8,920	0.00	
FDMC BEMDC, Series 3094 'CY' 4.5%	USD	397,501	420,235	0.01		15/06/2023					
15/06/2025						FDMC BEMDC, P0, Series 3316 'J'	USD	9,596	9,052	0.00	
FDMC BEMDC, Series 2928 'D' 4%	USD	2,165,967	2,350,602	0.06		0% 15/05/2037					
15/09/2041						FDMC BEMDC, P0, Series 3293 'J'	USD	380,828	354,479	0.01	
FDMC BEMDC, Series 4998 'D' 2%	USD	2,998,254	3,141,543	0.07		0% 15/09/2032					
25/01/2040						FDMC BEMDC, Series 1878 'K' 6.5%	USD	5,220	5,485	0.00	
FDMC BEMDC, 10, Series 3219 'DI' 6%	USD	30,830	6,445	0.00		15/09/2023					
15/04/2036						FDMC BEMDC, Series 2283 'K' 6.5%	USD	6,504	6,851	0.00	
FDMC BEMDC, F0N, Series 1051 'DF'	USD	10,784	14,380	0.00		15/12/2023					
27.707% 15/10/2025						FDMC BEMDC, P0, Series 3338 'L'	USD	76,173	68,063	0.00	
FDMC BEMDC, Series 3704 'DI' 7.5%	USD	162,891	198,881	0.01		0% 15/05/2037					
15/11/2036						FDMC BEMDC, 10, F0N, Series 2003	USD	227,029	10,530	0.00	
FDMC BEMDC, Series 4318 'DC' 4%	USD	6,798,545	7,274,048	0.17		'LS' 1.940% 15/01/2040					
15/06/2048											

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に
				占める割合(%)					占める割合(%)
FHMC REMICS, Series 2694 'L2' 6.5% 15/07/2032	USD	12,822	15,306	0.00	FHMC REMICS, Series 2614 '8B' 4% 15/12/2024	USD	791,090	826,873	0.02
FHMC REMICS, Series 2461 'L2' 6% 15/06/2030	USD	29,970	35,153	0.00	FHMC REMICS, Series 2372 '9C' 7% 15/07/2029	USD	56,364	65,812	0.00
FHMC REMICS, Series 2575 '9E' 6% 15/02/2033	USD	31,366	36,330	0.00	FHMC REMICS, FOM, Series 2832 '9W' 5.3% 15/09/2041	USD	199,649	217,608	0.01
FHMC REMICS, FOM, Series 2152 '9U' 6% 15/03/2036	USD	145,408	136,329	0.00	FHMC REMICS, FOM, Series 2671 '9Q' 6% 15/12/2036	USD	152,003	139,151	0.00
FHMC REMICS, FOM, Series 2171 '9U' 6% 15/06/2036	USD	22,689	21,934	0.00	FHMC REMICS, FOM, Series 2671 'S' H. 625% 15/09/2033	USD	12,189	16,224	0.00
FHMC REMICS, Series 2906 '9M' 4% 15/12/2041	USD	908,827	1,009,790	0.02	FHMC REMICS, FOM, Series 2567 'S' 33.43% 15/04/2025	USD	17,174	21,395	0.00
FHMC REMICS, Series 2810 '9C' 6.5% 15/02/2032	USD	6,777	7,940	0.00	FHMC REMICS, IO, FOM, Series 2194 'SA' 7.027% 15/07/2036	USD	7,503	1,538	0.00
FHMC REMICS, Series 2047 '9D' 5.5% 15/10/2035	USD	152,138	169,874	0.00	FHMC REMICS, IO, FOM, Series 2387 'SA' 6.247% 15/11/2037	USD	113,838	20,976	0.00
FHMC REMICS, Series 2094 '9E' 5.5% 15/11/2035	USD	305,938	351,726	0.01	FHMC REMICS, IO, FOM, Series 2511 'SA' 5.927% 15/02/2039	USD	80,473	15,187	0.00
FHMC REMICS, FOM, Series 2117 '9C' 6% 15/02/2036	USD	44,734	42,109	0.00	FHMC REMICS, FOM, Series 2621 'SA' H. 7.1% 15/06/2033	USD	21,357	27,438	0.00
FHMC REMICS, FOM, Series 2122 '9B' 6% 15/03/2036	USD	46,355	43,215	0.00	FHMC REMICS, FOM, Series 2733 'SB' 7.94% 15/10/2033	USD	357,585	412,243	0.01
FHMC REMICS, FOM, Series 2117 '9B' 6% 15/02/2036	USD	17,288	16,105	0.00	FHMC REMICS, IO, FOM, Series 2404 'SC' 5.927% 15/01/2038	USD	224,277	43,767	0.00
FHMC REMICS, Series 2720 '9C' 5% 15/12/2023	USD	13,288	13,735	0.00	FHMC REMICS, IO, FOM, Series 2740 'SC' 5.927% 15/10/2040	USD	185,960	35,969	0.00
FHMC REMICS, Series 2165 '9E' 6% 15/06/2029	USD	122,898	139,035	0.00	FHMC REMICS, FOM, Series 2725 'SC' 8.91% 15/12/2033	USD	27,676	29,480	0.00
FHMC REMICS, Series 2130 '9C' 6% 15/01/2029	USD	31,673	35,764	0.00	FHMC REMICS, IO, FOM, Series 2455 'SE' 6.127% 15/06/2038	USD	212,102	33,299	0.00
FHMC REMICS, Series 2075 '9B' 6.5% 15/08/2028	USD	7,464	8,469	0.00	FHMC REMICS, IO, FOM, Series 4321 'SE' 6.527% 15/02/2044	USD	3,254,519	713,753	0.02
FHMC REMICS, IO, FOM, Series 2424 'PI' 6.727% 15/04/2038	USD	66,554	15,844	0.00	FHMC REMICS, FOM, Series 2094 'SC' 21.75% 15/11/2035	USD	84,411	120,384	0.00
FHMC REMICS, FOM, Series 2134 '9D' 6% 15/03/2036	USD	3,624	3,455	0.00	FHMC REMICS, FOM, Series 2416 'SB' 15.83% 17/02/2032	USD	3,573	4,158	0.00
FHMC REMICS, FOM, Series 2138 '9D' 6% 15/04/2036	USD	14,588	13,431	0.00	FHMC REMICS, IO, FOM, Series 2481 'S' 5.177% 15/06/2038	USD	60,888	11,468	0.00
FHMC REMICS, FOM, Series 2151 '9D' 6% 15/05/2036	USD	88,657	84,123	0.00	FHMC REMICS, FOM, Series 2590 'SL' 24.23% 15/06/2034	USD	23,662	28,356	0.00
FHMC REMICS, FOM, Series 2200 '9D' 6% 15/08/2036	USD	80,482	56,542	0.00	FHMC REMICS, IO, FOM, Series 2385 'SN' 5.927% 15/11/2037	USD	18,752	2,904	0.00
FHMC REMICS, FOM, Series 2697 '9D' 6% 15/05/2037	USD	182,844	148,740	0.00	FHMC REMICS, FOM, Series 2029 'SP' 28.45% 15/09/2035	USD	74,148	122,943	0.00
FHMC REMICS, FOM, Series 2611 '9D' 6% 15/07/2034	USD	19,089	17,953	0.00	FHMC REMICS, IO, FOM, Series 2232 'ST' 6.427% 15/10/2036	USD	51,212	10,487	0.00
FHMC REMICS, FOM, Series 2621 '9D' 6% 15/01/2040	USD	94,181	87,473	0.00	FHMC REMICS, FOM, Series 2571 'ST' 21.42% 15/12/2032	USD	72,603	101,675	0.00

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に
				占める					占める
				割合(%)					割合(%)
FHMC BEMCS, FOM, Series 2022 '01' 15.00% 15/09/2025	USD	20,947	23,943	0.00	FHMC STRIPS, Series 2022 '35' 3.5% 15/07/2042	USD	1,985,688	2,146,329	0.05
FHMC BEMCS, Series 2019 '10' 7% 15/06/2029	USD	10,482	11,925	0.00	FHMC STRIPS, FOM, Series 204 'F1' 0.62% 15/01/2042	USD	1,313,511	1,394,210	0.03
FHMC BEMCS, Series 2021 '10' 6.5% 15/09/2032	USD	61,492	69,962	0.00	FHMC STRIPS, FOM, Series 219 '50' 7.627% 15/03/2036	USD	174,448	43,353	0.00
FHMC BEMCS, Series 204 '10' 7% 15/04/2032	USD	7,585	8,973	0.00	Fifth Third Bancorp 3.65% 25/01/2024	USD	890,000	953,686	0.02
FHMC BEMCS, FOM, Series 2077 '10' 0% 15/04/2035	USD	59,676	59,297	0.00	Fifth Third Bank NA 3.85% 15/09/2026	USD	200,000	221,973	0.01
FHMC BEMCS, FOM, Series 2052 '10' 5.5% 15/06/2041	USD	215,210	233,263	0.01	First Investors Auto Owner Trust, Series 2017-2A 'C', 144A 2% 15/08/2022	USD	914,147	917,268	0.02
FHMC BEMCS, Series 2078 '12' 5.5% 15/07/2036	USD	137,449	161,386	0.00	Fiserv, Inc. 3.2% 01/07/2026	USD	690,000	748,370	0.02
FHMC BEMCS, FOM, Series 2085 'W' 0.871% 15/08/2026	USD	196,570	200,862	0.01	Fiserv, Inc. 4.4% 01/07/2049	USD	660,000	797,751	0.02
FHMC BEMCS, FOM, Series 2090 'W' 15.00% 15/09/2035	USD	1,590	1,843	0.00	Flagship Credit Auto Trust, Series 2018-1 'C', 144A 3.3% 16/01/2024	USD	293,565	296,710	0.01
FHMC BEMCS, Series 1983 'Z' 6.5% 15/07/2026	USD	8,659	9,179	0.00	Flagship Credit Auto Trust, Series 2017-1 'D', 144A 4.2% 15/05/2023	USD	339,880	345,589	0.01
FHMC BEMCS, Series 2001 'Z' 6.5% 15/06/2028	USD	4,818	5,439	0.00	Flagship Credit Auto Trust, Series 2017-3 'D', 144A 3.7% 15/09/2023	USD	2,300,000	2,353,482	0.06
FHMC BEMCS, Series 2035 'Z' 5.85% 15/09/2035	USD	460,723	530,332	0.01	Flex Intermediate Holko LLC, 144A 3.26% 30/06/2031	USD	1,625,000	1,648,952	0.04
FHMC BEMCS, Series 2120 'Z' 6% 15/09/2036	USD	6,713	7,685	0.00	Flex Intermediate Holko LLC, 144A 4.71% 30/12/2039	USD	1,145,000	1,168,372	0.03
FHMC BEMCS, Series 2461 'Z' 6% 15/06/2038	USD	417,892	482,838	0.01	FHMA 1.27% 01/12/2029	USD	4,757,992	4,655,488	0.11
FHMC BEMCS, Series 1927 '2A' 6.5% 15/01/2027	USD	36,076	40,391	0.00	FHMA 1.5% 01/01/2031	USD	10,500,000	10,466,003	0.24
FHMC BEMCS, Series 2163 '2A' 6% 15/03/2034	USD	4,083,858	4,767,323	0.11	FHMA 5.5% 01/01/2068	USD	7,384,572	8,763,758	0.21
FHMC BEMCS, Series 2045 '2B' 5.5% 15/02/2035	USD	1,156,225	1,330,806	0.03	FHMA, Series 2004-72 '1A4' 7.5% 25/11/2043	USD	193,684	226,249	0.01
FHMC BEMCS, Series 4322 '2B' 4% 15/07/2048	USD	7,838,559	8,396,672	0.20	FHMA, Series 2004-71 '2A2' 7% 25/12/2033	USD	42,065	49,484	0.00
FHMC BEMCS, Series 2179 '2C' 6% 15/04/2034	USD	2,501,171	2,894,616	0.07	FHMA, Series 2004-72 '2A2' 7% 25/02/2044	USD	10,781	12,864	0.00
FHMC BEMCS, Series 2244 '2D' 6.5% 15/08/2031	USD	26,448	30,599	0.00	FHMA, FOM, Series 2005-#3 '2A4' 0.312% 15/03/2045	USD	460,033	458,779	0.01
FHMC BEMCS, Series 2219 '2E' 7% 15/10/2030	USD	7,167	8,417	0.00	FHMA, FOM, Series 2003-#6 '2F1' 0.492% 15/05/2042	USD	49,810	49,800	0.00
FHMC BEMCS, Series 2091 '2D' 5.5% 15/09/2033	USD	1,230,491	1,422,908	0.03	FHMA, FOM, Series 2003-#6 '4T' 0.55% 25/09/2042	USD	2,010,546	35,785	0.00
FHMC STRIPS, FOM, Series 213 '11' 5% 15/09/2035	USD	39,153	7,297	0.00	FHMA, Series 2000-76 'A1' 7.5% 25/11/2048	USD	126,632	135,379	0.00
FHMC STRIPS, FOM, Series 213 '13' 5% 15/09/2035	USD	90,751	18,249	0.00	FHMA, Series 2001-71 'A1' 7.5% 25/02/2041	USD	106,418	126,395	0.00
					FHMA, Series 2002-T16 'A2' 7% 25/07/2042	USD	14,776	17,776	0.00
					FHMA, FOM, Series 2004-73 '2T1' 10.152% 15/01/2046	USD	112,802	136,602	0.00
					FHMA 3.52409 6.5% 01/03/2029	USD	3,493	3,867	0.00
					FHMA 2.57172 5.5% 01/04/2038	USD	15,625	17,371	0.00

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)	割合(%)						
FNMA 257183 7% 01/03/2038	USD	68,567	73,265	0.00		FNMA, FRN 888605 2.047%	USD	16,742	16,668	0.00	
FNMA 257209 5.5% 01/05/2038	USD	17,297	19,609	0.00		01/07/2035					
FNMA 468128 4.33% 01/07/2021	USD	937,168	926,974	0.02		FNMA 888796 6% 01/09/2037	USD	63,305	71,168	0.00	
FNMA 468571 4.45% 01/07/2026	USD	844,047	953,356	0.02		FNMA, FRN 888829 5.888%	USD	474,253	494,297	0.01	
FNMA, FRN 470623 0.907%	USD	1,198,536	1,198,031	0.03		01/06/2037					
01/03/2022						FNMA, FRN 896463 2.653%	USD	37,586	40,256	0.00	
FNMA 471828 2.65% 01/08/2022	USD	6,000,000	6,090,480	0.14		01/10/2034					
FNMA 471881 2.67% 01/07/2022	USD	3,000,000	3,040,571	0.07		FNMA 900177 7.5% 01/08/2036	USD	20,920	23,748	0.00	
FNMA 650236 5% 01/12/2032	USD	1,316	1,353	0.00		FNMA, FRN 900197 2.575%	USD	20,322	21,850	0.00	
FNMA, FRN 722985 2.527%	USD	9,735	9,796	0.00		01/10/2036					
01/07/2033						FNMA, FRN 906694 2.106%	USD	21,360	22,614	0.00	
FNMA, FRN 735332 2.351%	USD	29,844	30,691	0.00		01/12/2036					
01/08/2034						FNMA 907742 7% 01/12/2036	USD	34,905	39,822	0.00	
FNMA, FRN 745445 2.376%	USD	60,592	64,269	0.00		FNMA, FRN 90843 2.15% 01/01/2016	USD	160,105	171,849	0.00	
01/01/2036						FNMA, FRN 920954 1.707%	USD	81,491	84,968	0.00	
FNMA, FRN 745446 2.422%	USD	13,776	14,432	0.00		01/01/2037					
01/04/2033						FNMA 932355 6% 01/12/2039	USD	580,337	646,983	0.02	
FNMA 754922 5.5% 01/09/2033	USD	11,781	13,278	0.00		FNMA 933032 6% 01/10/2037	USD	9,372	9,875	0.00	
FNMA, FRN 766610 2.076%	USD	10,292	10,465	0.00		FNMA 961192 7% 01/01/2038	USD	26,717	28,611	0.00	
01/01/2034						FNMA, FRN 96946 2.16% 01/01/2018	USD	19,520	19,533	0.00	
FNMA 771959 5.5% 01/02/2034	USD	15,499	16,239	0.00		FNMA 995783 6% 01/11/2037	USD	11,680	12,867	0.00	
FNMA, FRN 771132 2.77% 01/06/2034	USD	61,088	65,128	0.00		FNMA ADP278 4.125% 01/07/2040	USD	132,887	136,855	0.00	
FNMA, FRN 781309 2.685%	USD	12,391	12,434	0.00		FNMA AD8548 5.5% 01/01/2033	USD	68,734	75,356	0.00	
01/07/2034						FNMA AD9346 6% 01/05/2037	USD	69,343	77,611	0.00	
FNMA, FRN 790235 2.137%	USD	20,340	20,635	0.00		FNMA AB4168 4.25% 01/07/2040	USD	111,092	115,849	0.00	
01/08/2034						FNMA AB4183 4.125% 01/09/2040	USD	103,433	107,574	0.00	
FNMA, FRN 791961 1.563%	USD	12,860	12,885	0.00		FNMA, FRN ALD602 4.142%	USD	234,822	234,820	0.01	
01/09/2034						01/07/2021					
FNMA, FRN 801342 2.191%	USD	26,069	26,451	0.00		FNMA AL2606 4% 01/03/2042	USD	104,590	109,709	0.00	
01/09/2034						FNMA AL6167 3.5% 01/01/2044	USD	2,042,838	2,208,323	0.05	
FNMA, FRN 810896 1.763%	USD	26,086	26,508	0.00		FNMA, FRN AL6805 3.782%	USD	1,956,426	2,063,454	0.05	
01/01/2035						01/01/2026					
FNMA, FRN 816997 1.92% 01/01/2035	USD	11,088	10,991	0.00		FNMA AL7395 5.572% 01/03/2038	USD	2,296,650	2,624,045	0.06	
FNMA, FRN 823660 2.265%	USD	25,956	26,250	0.00		FNMA AM811 2.42% 01/12/2022	USD	1,278,299	1,303,699	0.03	
01/06/2035						FNMA AM1769 2.34% 01/12/2022	USD	1,665,341	1,697,058	0.04	
FNMA, FRN 843025 1.785%	USD	41,759	43,523	0.00		FNMA AM333 2.45% 01/02/2023	USD	2,000,000	2,047,442	0.05	
01/09/2035						FNMA AM344 2.52% 01/05/2023	USD	2,000,000	2,058,721	0.05	
FNMA, FRN 843028 1.785%	USD	26,243	27,357	0.00		FNMA AM346 2.64% 01/07/2023	USD	2,000,000	2,068,791	0.05	
01/09/2035						FNMA AM3990 AM3990 3.74%	USD	929,025	975,955	0.02	
FNMA 847108 6.5% 01/10/2035	USD	71,083	79,968	0.00		01/07/2023					
FNMA, FRN 848251 2.13% 01/01/2036	USD	67,429	71,513	0.00		FNMA AM4011 AM4011 3.67%	USD	4,000,000	4,200,512	0.10	
FNMA, FRN 851432 2.79% 01/10/2035	USD	138,043	138,984	0.00		01/07/2023					
FNMA, FRN 872502 2.902%	USD	58,680	62,189	0.00		FNMA AM660 3.765% 01/12/2025	USD	1,919,509	2,132,944	0.05	
01/06/2036						FNMA AM6940 3.24% 01/06/2026	USD	877,017	961,832	0.02	
FNMA, FRN 884066 2.768%	USD	38,492	39,186	0.00		FNMA AM6448 3.25% 01/09/2026	USD	2,855,590	3,143,169	0.07	
01/06/2036						FNMA AM7231 2.92% 01/12/2024	USD	1,463,525	1,463,525	0.03	
FNMA, FRN 886558 2.396%	USD	17,444	18,314	0.00		FNMA AM7514 3.07% 01/02/2025	USD	6,000,000	6,453,494	0.15	
01/08/2036						FNMA AM7596 3.16% 01/01/2027	USD	4,991,099	5,489,942	0.13	
FNMA 888408 6% 01/03/2037	USD	31,088	34,923	0.00		FNMA AM7649 2.885% 01/01/2025	USD	5,660,173	6,050,328	0.14	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)	割合(%)					割合(%)	割合(%)
FONM AN7785 3.17% 01/02/2030	USD	1,884,091	2,092,994	0.05		FONM EL4118 2.42% 01/09/2028	USD	4,754,516	5,058,583	0.12	
FONM AN7836 3.11% 01/03/2027	USD	2,832,651	3,104,111	0.07		FONM EL4398 2.58% 01/10/2031	USD	1,800,000	1,942,561	0.05	
FONM AN8351 2.7% 01/04/2025	USD	4,698,021	5,061,172	0.12		FONM EL4411 2.47% 01/10/2031	USD	5,600,000	5,978,869	0.14	
FONM AN8544 3.08% 01/04/2030	USD	1,886,992	2,092,078	0.05		FONM EL4435 2.42% 01/10/2029	USD	5,525,000	5,876,472	0.14	
FONM AN8846 2.68% 01/05/2025	USD	3,555,174	3,791,323	0.09		FONM EL4455 2.37% 01/11/2028	USD	8,779,249	9,313,304	0.22	
FONM AN9188 3.12% 01/06/2035	USD	3,000,000	3,384,155	0.08		FONM EL4660 2.45% 01/10/2031	USD	7,762,000	8,276,301	0.19	
FONM AN9432 3.12% 01/12/2022	USD	1,641,555	1,685,462	0.04		FONM MA1463 3.5% 01/06/2043	USD	690,266	746,188	0.02	
FONM AN9548 3.17% 01/08/2025	USD	3,000,000	3,264,760	0.08		FONM MA2592 3.5% 01/04/2046	USD	2,720,025	2,939,980	0.07	
FONM AN9934 3.08% 01/10/2025	USD	5,203,647	5,739,926	0.13		FONM MA2833 3.5% 01/04/2046	USD	1,443,868	1,560,561	0.04	
FONM AN0029 3.1% 01/09/2025	USD	2,107,743	2,290,666	0.05		FONM MA2734 3.5% 01/08/2046	USD	3,568,849	3,853,956	0.09	
FONM AN1243 2.64% 01/06/2026	USD	2,999,000	3,213,655	0.08		FONM ACES, Series 2021-W3 'A1' 1% 25/11/2030	USD	3,239,606	3,198,096	0.08	
FONM AN1247 2.64% 01/06/2026	USD	2,462,000	2,638,219	0.06		FONM ACES, Series 2021-W3 'A1' 0.67% 25/10/2030	USD	11,391,573	11,187,429	0.26	
FONM AN1292 2.84% 01/04/2026	USD	1,819,560	1,960,653	0.05		FONM ACES, Series 2011-W3 'A2' 2.922% 25/08/2021	USD	52,752	52,805	0.00	
FONM AN1583 3.04% 01/05/2031	USD	1,444,685	1,597,425	0.04		FONM ACES, Series 2019-W 'A2' 2.28% 27/12/2022	USD	1,159,742	1,186,249	0.03	
FONM AN1590 2.4% 01/05/2026	USD	2,696,976	2,854,062	0.07		FONM ACES, Series 2015-W1 'A3' 2.522% 25/09/2024	USD	2,516,697	2,630,056	0.06	
FONM AN1751 2.85% 01/06/2028	USD	2,090,044	2,282,695	0.05		FONM ACES, FOM, Series 2015-W10 'A2' 3.092% 25/04/2027	USD	3,471,604	3,808,145	0.09	
FONM AN1802 2.85% 01/06/2028	USD	2,448,687	2,671,274	0.06		FONM ACES, Series 2015-W3 'A2' 2.722% 25/10/2024	USD	4,545,579	4,782,059	0.11	
FONM AN2005 2.73% 01/07/2028	USD	1,967,823	2,141,371	0.05		FONM ACES, Series 2015-W7 'A2' 2.95% 25/12/2024	USD	2,700,786	2,846,003	0.07	
FONM AN2009 2.7% 01/07/2026	USD	4,859,386	5,234,173	0.12		FONM ACES, Series 2016-W6 'A2' 2.488% 25/05/2026	USD	4,725,000	5,027,297	0.12	
FONM AN2124 2.85% 01/01/2029	USD	2,118,630	2,311,508	0.05		FONM ACES, Series 2016-W7 'A2' 2.499% 25/09/2026	USD	2,994,790	3,121,792	0.07	
FONM AN2347 2.88% 01/10/2026	USD	6,454,337	6,836,041	0.16		FONM ACES, FOM, Series 2017-W1 'A2' 2.419% 25/10/2026	USD	3,818,779	4,054,020	0.10	
FONM AN2363 2.23% 01/04/2024	USD	4,732,260	4,933,216	0.12		FONM ACES, FOM, Series 2017-W2 'A2' 3.078% 25/06/2027	USD	4,927,063	5,439,506	0.13	
FONM AN2370 2.44% 01/08/2026	USD	3,101,286	3,290,990	0.08		FONM ACES, FOM, Series 2017-W3 'A2' 2.477% 25/12/2026	USD	1,266,319	1,352,979	0.03	
FONM AN2388 2.64% 01/08/2028	USD	2,527,926	2,721,522	0.06		FONM ACES, FOM, Series 2017-W4 'A2' 2.574% 25/12/2026	USD	7,423,998	7,970,736	0.19	
FONM AN2429 2.45% 01/12/2026	USD	3,812,752	4,046,135	0.10		FONM ACES, FOM, Series 2017-W5 'A2' 3.12% 25/04/2029	USD	4,586,000	5,145,101	0.12	
FONM AN2444 2.43% 01/08/2026	USD	6,514,561	6,912,245	0.16		FONM ACES, FOM, Series 2017-W6 'A2' 3.052% 25/05/2027	USD	5,015,000	5,507,301	0.13	
FONM AN2487 2.86% 01/08/2028	USD	934,251	1,022,013	0.02		FONM ACES, FOM, Series 2018-W10 'A2' 3.37% 25/07/2028	USD	4,677,000	5,281,061	0.12	
FONM AN2906 2.63% 01/10/2031	USD	5,668,240	6,106,595	0.14		FONM ACES, FOM, Series 2018-W4 'A2' 3.045% 25/05/2028	USD	2,614,000	2,901,381	0.07	
FONM AN3134 2.58% 01/10/2028	USD	1,730,973	1,863,230	0.04		FONM ACES, Series 2021-W3 'A3' 1.2% 25/10/2030	USD	3,925,000	3,881,389	0.09	
FONM AN3254 2.8% 01/11/2031	USD	1,718,500	1,880,657	0.04							
FONM AN3364 2.6% 01/10/2028	USD	5,030,825	5,422,016	0.13							
FONM AN3431 2.6% 01/11/2028	USD	4,143,985	4,467,823	0.10							
FONM AN3685 2.94% 01/12/2028	USD	8,720,000	9,625,719	0.23							
FONM AN3685 2.69% 01/12/2028	USD	9,548,000	10,381,584	0.24							
FONM AN3788 2.79% 01/02/2027	USD	2,100,090	2,266,594	0.05							
FONM AN3881 2.94% 01/12/2026	USD	3,629,860	3,927,743	0.09							
FONM AN4110 2.95% 01/04/2025	USD	5,100,830	5,461,400	0.13							
FONM AN4154 3.17% 01/01/2029	USD	7,560,000	8,446,078	0.20							
FONM AN5527 3.02% 01/07/2029	USD	10,000,000	11,108,719	0.26							
FONM AN5935 3.13% 01/07/2027	USD	1,071,982	1,179,809	0.03							
FONM AN6244 3.09% 01/09/2029	USD	7,788,000	8,691,939	0.20							
FONM A09952 4% 01/07/2042	USD	313,928	346,192	0.01							
FONM A09999 3% 01/02/2043	USD	1,487,900	1,589,528	0.04							
FONM A57212 3.5% 01/04/2036	USD	1,202,038	1,292,467	0.03							
FONM BFD464 3.5% 01/03/2030	USD	10,097,061	10,990,478	0.26							
FONM EL2595 3.34% 01/07/2028	USD	2,963,701	3,313,168	0.08							
FONM EL2905 3.07% 01/08/2031	USD	6,208,000	6,889,591	0.16							
FONM EL3616 2.88% 01/07/2028	USD	11,410,000	12,468,484	0.29							
FONM EL4070 2.57% 01/08/2030	USD	9,730,469	10,313,119	0.24							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に
				占める					占める
				割合(%)					割合(%)
FNMA ACES, FNM, Series 2015-W17 'EX' 1.045% 25/12/2022	USD	359,751	360,344	0.01	FNMA REMICS, DO, FNM, Series 2007-60 'A3' 7.050% 25/07/2037	USD	284,108	71,762	0.00
FNMA ACES, IO, FNM, Series 2009-W30 'X1' 1.917% 25/10/2030	USD	66,732,056	7,453,434	0.17	FNMA REMICS, Series 2009-106 'A2' 5.5% 25/10/2033	USD	615,425	709,822	0.02
FNMA ACES, IO, FNM, Series 2021-W3 'X1' 2.009% 25/11/2032	USD	14,459,639	2,069,343	0.05	FNMA REMICS, Series 2007-76 'A2' 5.5% 25/08/2037	USD	75,869	87,115	0.00
FNMA Grantor Trust, Series 2007-T1 'Y' 2.995% 25/06/2037	USD	4,308,040	4,689,862	0.11	FNMA REMICS, Series 2004-91 'B' 5.5% 25/01/2005	USD	3,993,213	4,621,050	0.11
FNMA INTEREST STRIP, PO, Series 203 '1' 0% 25/12/2034	USD	30,009	29,702	0.00	FNMA REMICS, Series 2007-42 'B' 6% 25/05/2037	USD	162,320	190,408	0.01
FNMA INTEREST STRIP, PO, Series 200 '1' 0% 25/09/2034	USD	29,454	28,977	0.00	FNMA REMICS, Series 2010-26 'B' 5.5% 25/03/2035	USD	16,805	17,179	0.00
FNMA INTEREST STRIP, IO, Series 203 '2' 6% 25/03/2038	USD	40,501	9,528	0.00	FNMA REMICS, Series 2001-79 'B4' 7% 25/03/2045	USD	74,507	86,970	0.00
FNMA INTEREST STRIP, FNM, Series 412 'F2' 0.925% 25/08/2042	USD	517,828	522,777	0.01	FNMA REMICS, IO, FNM, Series 2008-1 'B1' 5.815% 25/02/2038	USD	94,877	18,347	0.00
FNMA REMICS, Series 2004-W11 'A1' 6% 25/05/2044	USD	316,708	377,919	0.01	FNMA REMICS, FNM, Series 2012-137 'CF' 0.392% 25/08/2041	USD	583,331	582,878	0.01
FNMA REMICS, Series 2005-W1 'A2' 6.2% 25/10/2044	USD	310,364	369,092	0.01	FNMA REMICS, IO, FNM, Series 2008-53 'C1' 7.180% 25/07/2038	USD	43,242	9,928	0.00
FNMA REMICS, FNM, Series 2001-W7 'A4' 38.62% 25/07/2037	USD	7,630	13,422	0.00	FNMA REMICS, FNM, Series 2005-74 'CS' 19.768% 25/05/2035	USD	52,497	65,099	0.00
FNMA REMICS, FNM, Series 2002-W4 '2A' 5.63% 25/10/2042	USD	4,457	5,092	0.00	FNMA REMICS, FNM, Series 2005-45 'DC' 21.974% 25/06/2035	USD	68,294	99,816	0.00
FNMA REMICS, Series 2006-W5 '2A' 6% 25/09/2046	USD	114,916	129,557	0.00	FNMA REMICS, FNM, Series 2006-79 'DF' 0.442% 25/08/2036	USD	27,596	28,168	0.00
FNMA REMICS, FNM, Series 2002-W6 '2A1' 7% 25/06/2042	USD	58,512	64,629	0.00	FNMA REMICS, PO, Series 2006-79 'D0' 0% 25/08/2036	USD	20,255	19,565	0.00
FNMA REMICS, Series 2009-W1 'A' 6% 25/12/2049	USD	298,538	345,683	0.01	FNMA REMICS, IO, FNM, Series 2007-72 '2S' 6.305% 25/07/2037	USD	361,815	69,956	0.00
FNMA REMICS, FNM, Series 2007-101 'A2' 0.322% 27/06/2036	USD	74,053	73,007	0.00	FNMA REMICS, PO, Series 2007-111 'E0' 0% 25/11/2036	USD	7,596	6,967	0.00
FNMA REMICS, FNM, Series 2007-106 'A7' 6.25% 25/10/2037	USD	71,509	83,887	0.00	FNMA REMICS, PO, Series 2004-46 'EP' 0% 25/03/2034	USD	50,132	49,452	0.00
FNMA REMICS, Series 2008-56 'A' 5% 25/07/2038	USD	96,004	108,705	0.00	FNMA REMICS, FNM, Series 2005-90 'ES' 16.646% 25/10/2035	USD	40,469	55,476	0.00
FNMA REMICS, STEP, Series 2001-W4 'AF6' 5.11% 25/01/2032	USD	20,965	22,486	0.00	FNMA REMICS, Series 2005-67 'EY' 5.5% 25/08/2025	USD	66,961	71,818	0.00
FNMA REMICS, Series 2010-111 'AM' 5.2% 25/10/2040	USD	725,411	858,811	0.02	FNMA REMICS, FNM, Series 2007-54 'FA' 0.492% 25/06/2037	USD	27,666	28,118	0.00
FNMA REMICS, PO, Series 2006-22 'A0' 0% 25/04/2036	USD	26,030	24,417	0.00	FNMA REMICS, FNM, Series 2007-16 'FC' 0.842% 25/03/2037	USD	5,397	5,640	0.00
FNMA REMICS, PO, Series 2007-42 'A0' 0% 25/05/2037	USD	10,539	9,591	0.00	FNMA REMICS, FNM, Series 2010-43 'FD' 0.691% 25/05/2040	USD	193,882	197,201	0.01
FNMA REMICS, PO, Series 2009-113 'A0' 0% 25/01/2040	USD	65,626	58,211	0.00	FNMA REMICS, FNM, Series 2003-119 'FE' 0.592% 25/12/2032	USD	119,238	120,883	0.00
FNMA REMICS, PO, Series 2006-58 'A' 0% 25/07/2036	USD	17,466	16,183	0.00	FNMA REMICS, FNM, Series 2004-61 'FI' 0.892% 25/11/2032	USD	161,748	165,044	0.00

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に占める	
				割合 (%)	割合 (%)						
FNMA REMICS, FPN, Series 2010-00 'FJ' 0.091% 25/04/2040	USD	112,126	113,131	0.00		FNMA REMICS, Series 2005-04 'NE' 5.75% 25/10/2035	USD	46,034	51,592	0.00	
FNMA REMICS, Series 2007-71 'G' 6% 25/09/2037	USD	94,663	111,054	0.00		FNMA REMICS, FPN, Series 2009-103 'NE' 2.122% 25/12/2039	USD	53,760	56,319	0.00	
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2006-94 'G' 6.59% 25/10/2026	USD	120,239	10,318	0.00		FNMA REMICS, Series 2011-118 'WT' 7% 25/11/2041	USD	603,051	731,527	0.02	
FNMA REMICS, Series 2009-09 'G' 5% 25/09/2039	USD	483,422	556,405	0.01		FNMA REMICS, Series 2006-05 'NE' 6.5% 25/09/2036	USD	34,628	41,137	0.00	
FNMA REMICS, PO, Series 2008-44 'G0' 6% 25/06/2036	USD	14,053	13,202	0.00		FNMA REMICS, Series 2007-38 'M' 5% 25/01/2046	USD	2,405,530	2,587,004	0.06	
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2009-6 'G' 6.49% 25/02/2039	USD	70,910	15,056	0.00		FNMA REMICS, PO, Series 2007-15 'G0' 6% 25/09/2022	USD	241	241	0.00	
FNMA REMICS, FPN, Series 2006-104 'G' 2.193% 25/11/2036	USD	50,823	51,836	0.00		FNMA REMICS, Series 2011-118 'WT' 7% 25/11/2041	USD	708,778	854,439	0.02	
FNMA REMICS, Series 2009-39 'G' 5% 25/09/2039	USD	207,111	235,088	0.01		FNMA REMICS, PO, Series 2006-27 'G0' 6% 25/04/2036	USD	29,985	28,222	0.00	
FNMA REMICS, Series 2001-81 'G' 6.9% 25/01/2032	USD	219,216	258,771	0.01		FNMA REMICS, PO, Series 2006-15 'G0' 6% 25/09/2036	USD	82,768	77,110	0.00	
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2007-116 'G1' 1.45% 25/01/2038	USD	101,762	4,344	0.00		FNMA REMICS, PO, Series 2009-06 'G0' 6% 25/10/2037	USD	184,628	169,083	0.00	
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2008-46 'G' 1.72% 25/06/2038	USD	66,334	4,737	0.00		FNMA REMICS, Series 2009-63 'P' 5% 25/09/2037	USD	8,253	9,326	0.00	
FNMA REMICS, IO, Series 2007-13 'G' 6.9% 25/06/2033	USD	80,519	16,646	0.00		FNMA REMICS, PO, Series 2006-44 'P' 6% 25/12/2033	USD	39,400	36,960	0.00	
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2003-410 'G' 0.917% 25/04/2042	USD	603,867	11,857	0.00		FNMA REMICS, Series 1998-58 'G' 6.5% 25/10/2028	USD	37,983	43,014	0.00	
FNMA REMICS, IO, Series 2009-06 'G' 5.5% 25/10/2039	USD	61,267	10,568	0.00		FNMA REMICS, Series 2005-109 'G' 6% 25/12/2035	USD	86,771	97,311	0.00	
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2008-16 'G' 6.10% 25/03/2038	USD	32,927	5,478	0.00		FNMA REMICS, Series 2006-77 'G' 6.5% 25/09/2036	USD	70,154	80,965	0.00	
FNMA REMICS, IO, Series 2007-15 'G' 6% 25/05/2033	USD	65,863	11,345	0.00		FNMA REMICS, Series 1997-39 'G' 7.5% 20/06/2027	USD	7,578	8,580	0.00	
FNMA REMICS, IO, Series 2007-44 'G' 7% 25/06/2033	USD	25,234	4,979	0.00		FNMA REMICS, Series 2001-44 'G' 7% 25/09/2031	USD	2,285	2,684	0.00	
FNMA REMICS, Series 1999-25 'G' 7.5% 25/01/2033	USD	1,500	1,576	0.00		FNMA REMICS, Series 2001-7 'G' 7% 25/09/2031	USD	1,231	1,460	0.00	
FNMA REMICS, Series 09-1 'G' 7.9% 25/01/2033	USD	628	650	0.00		FNMA REMICS, Series 2011-52 'G' 5% 25/09/2041	USD	1,224,065	1,444,782	0.03	
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2007-65 'G' 6.32% 25/07/2037	USD	95,332	17,119	0.00		FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2007-109 'G1' 6.25% 25/12/2037	USD	281,683	51,863	0.00	
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2010-23 'G' 7.00% 25/02/2040	USD	102,159	17,325	0.00		FNMA REMICS, IO, Series 2009-52 'G1' 6% 25/07/2039	USD	46,568	6,954	0.00	
FNMA REMICS, Series 2011-118 'G' 7% 25/11/2041	USD	661,540	806,088	0.02		FNMA REMICS, Series 1994-63 'G' 7% 25/04/2034	USD	26,585	28,375	0.00	
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2011-30 'G' 1.621% 25/04/2041	USD	182,292	11,938	0.00		FNMA REMICS, Series 1999-200 'G' 6.5% 25/10/2023	USD	18,392	19,522	0.00	
FNMA REMICS, FPN, Series 2006-23 'G' 29.731% 25/05/2036	USD	39,754	63,355	0.00		FNMA REMICS, PO, Series 2005-90 'G0' 6% 25/09/2035	USD	11,184	11,043	0.00	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める	
			時価 (米ドル)	割合 (%)				時価 (米ドル)	割合 (%)
FNMA REMICS, PO, Series 2006-110 'PO' 0% 25/11/2026	USD	15,849	14,827	0.00	FNMA REMICS, FPN, Series 2007-1 'SU' 30.451% 25/02/2037	USD	20,326	60,582	0.00
FNMA REMICS, PO, Series 2006-113 'PO' 0% 25/01/2026	USD	818	818	0.00	FNMA REMICS, FPN, Series 2002-5 'SE' 15.433% 25/02/2032	USD	16,760	20,718	0.00
FNMA REMICS, PO, Series 2006-36 'PV' 0% 25/05/2026	USD	51,794	49,794	0.00	FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2007-F 'SO' 6.405% 25/06/2026	USD	84,873	23,134	0.00
FNMA REMICS, PO, Series 2006-58 'PV' 0% 25/07/2026	USD	43,238	40,453	0.00	FNMA REMICS, FPN, Series 2006-95 'SO' 25.824% 25/10/2026	USD	21,917	36,018	0.00
FNMA REMICS, PO, Series 2007-48 'PV' 0% 25/05/2027	USD	97,582	94,471	0.00	FNMA REMICS, FPN, Series 2007-29 'SO' 21.361% 25/04/2037	USD	24,596	38,381	0.00
FNMA REMICS, PO, Series 2007-89 'PV' 0% 25/09/2029	USD	74,914	69,074	0.00	FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2007-53 'SO' 6.005% 25/06/2037	USD	72,133	11,158	0.00
FNMA REMICS, PO, Series 2007-93 'PV' 0% 25/09/2043	USD	338,483	309,495	0.01	FNMA REMICS, FPN, Series 2004-61 'SO' 21.623% 25/11/2032	USD	20,218	30,871	0.00
FNMA REMICS, FPN, Series 2006-11 'PS' 34.211% 25/02/2026	USD	52,315	85,189	0.00	FNMA REMICS, FPN, Series 030-17 'SH' 30.02% 25/04/2033	USD	3,218	3,705	0.00
FNMA REMICS, FPN, Series 2006-62 'PS' 39.351% 25/07/2026	USD	9,721	19,459	0.00	FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2008-47 'SI' 6.405% 25/06/2023	USD	230	2	0.00
FNMA REMICS, Series 2005-76 'PS' 5.9% 25/09/2025	USD	537,777	616,381	0.02	FNMA REMICS, IO, FPN, Series 1997-50 'SO' 6.505% 25/05/2023	USD	16,974	787	0.00
FNMA REMICS, PO, Series 2006-65 'SO' 0% 25/07/2026	USD	12,983	12,255	0.00	FNMA REMICS, FPN, Series 2004-46 'SO' 16.348% 25/05/2034	USD	46,597	61,215	0.00
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2009-17 'SO' 6.595% 25/03/2029	USD	54,034	8,725	0.00	FNMA REMICS, FPN, Series 2005-74 'SO' 19.878% 25/05/2025	USD	52,497	65,384	0.00
FNMA REMICS, FPN, Series 2008-28 'SO' 30.428% 25/04/2028	USD	38,852	55,436	0.00	FNMA REMICS, FPN, Series 2007-85 'SO' 15.921% 25/09/2037	USD	16,261	21,859	0.00
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2005-36 'S' 6.618% 25/01/2025	USD	55,710	11,096	0.00	FNMA REMICS, FPN, Series 2008-18 'SO' 13.817% 25/02/2038	USD	14,978	17,972	0.00
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 1996-4 'SO' 8.405% 25/02/2024	USD	21,069	1,800	0.00	FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2009-112 'SI' 6.158% 25/01/2040	USD	107,318	19,410	0.00
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2007-108 'SA' 6.282% 25/12/2027	USD	12,587	1,795	0.00	FNMA REMICS, FPN, Series 2005-75 'SO' 21.824% 25/09/2025	USD	53,880	77,767	0.00
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2008-80 'SO' 5.795% 25/09/2028	USD	66,597	12,080	0.00	FNMA REMICS, FPN, Series 2004-74 'SO' 15.335% 25/11/2021	USD	27,133	34,800	0.00
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2010-125 'SA' 4.249% 25/11/2040	USD	272,670	33,746	0.00	FNMA REMICS, FPN, Series 2002-52 'SO' 22.676% 25/10/2021	USD	6,298	9,106	0.00
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2010-68 'SO' 4.905% 25/07/2040	USD	269,688	37,227	0.00	FNMA REMICS, PO, Series 2007-72 'TU' 0% 25/08/2026	USD	16,564	15,223	0.00
FNMA REMICS, FPN, Series 2004-25 'SA' 19.271% 25/04/2024	USD	3,971	5,662	0.00	FNMA REMICS, FPN, Series 2005-56 'TP' 17.876% 25/08/2023	USD	26,489	32,810	0.00
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2003-116 'SO' 1.502% 25/11/2023	USD	19,688	3,773	0.00	FNMA REMICS, Series 2009-79 'Ud' 7% 25/03/2028	USD	13,670	15,713	0.00
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2008-81 'SO' 5.795% 25/09/2028	USD	100,769	16,780	0.00	FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2006-53 'US' 6.405% 25/06/2026	USD	105,410	20,274	0.00
FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2010-35 'SO' 6.325% 25/04/2040	USD	77,526	12,485	0.00	FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2012-134 'US' 6.109% 25/01/2042	USD	3,442,531	373,084	0.01
FNMA REMICS, FPN, Series 2003-122 'SO' 22.726% 25/06/2025	USD	60,480	65,456	0.00	FNMA REMICS, IO, FPN, Series 2007-88 'YI' 6.445% 25/09/2027	USD	186,086	40,158	0.00
FNMA REMICS, FPN, Series 2010-49 'SO' 12.471% 25/02/2040	USD	167,747	215,269	0.01	FNMA REMICS, Series 2004-50 'YZ' 5.5% 25/07/2024	USD	640,187	728,881	0.02

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める	
			時価(米ドル)	割合(%)				時価(米ドル)	割合(%)
FNMA REMICS, FN, Series 2010-1 'W' 6.20% 25/02/2040	USD	90,900	112,641	0.00	FNMA REMICS, Series 2017-05 '00' 6% 25/09/2027	USD	110,610	129,949	0.00
FNMA REMICS, FN, Series 2010-61 'NA' 6.01% 25/06/2040	USD	90,588	114,116	0.00	Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2018-0 'AS' 3.24% 15/04/2023	USD	1,425,272	1,437,372	0.03
FNMA REMICS, FN, Series 2011-43 'NA' 5.81% 25/05/2051	USD	125,778	146,006	0.00	Ford Foundation (The) 2.815% 01/06/2070	USD	825,000	826,627	0.02
FNMA REMICS, Series 2009-50 'WE' 6% 25/06/2036	USD	506,736	606,175	0.02	FORD CBE LLC, FN, Series 2018-1A 'A2', 144A 1.79% 16/11/2015	USD	6,000,000	5,994,050	0.14
FNMA REMICS, FN, Series 2006-8 'W' 6.60% 25/03/2036	USD	825,577	173,177	0.00	FORD CBE LLC, FN, Series 2018-1A 'Y', 144A 3.32% 21/12/2023	USD	10,000,000	9,639,493	0.23
FNMA REMICS, FN, Series 2006-8 'W' 6% 25/03/2036	USD	225,103	203,652	0.01	Foundation Finance Trust, Series 2017-1A 'K', 144A 3.3% 15/07/2023	USD	2,895,380	2,938,242	0.07
FNMA REMICS, FN, Series 2009-04 'W' 5.90% 25/10/2039	USD	29,155	4,615	0.00	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2015-04A 'B', 144A 3.03% 25/01/2040	USD	13,563,000	14,650,526	0.34
FNMA REMICS, Series 2005-04 'ZJ' 5.75% 25/10/2035	USD	501,625	567,361	0.01	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2015-045 'B', 144A 3.58% 25/04/2040	USD	8,250,000	8,908,563	0.21
FNMA REMICS, FN, Series 2008-10 'ZJ' 6.15% 25/03/2038	USD	30,240	5,623	0.00	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2015-048 'B', 144A 3.64% 25/08/2040	USD	11,935,000	12,968,165	0.30
FNMA REMICS, Series 2005-04 'ZM' 5.75% 25/10/2035	USD	34,522	39,046	0.00	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2015-051 'B', 144A 3.96% 25/08/2040	USD	7,149,000	7,857,397	0.18
FNMA REMICS, FN, Series 2007-30 'ZS' 5.65% 25/05/2037	USD	171,303	31,925	0.00	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2015-0731 'B', 144A 3.55% 25/11/2041	USD	2,665,000	2,750,602	0.06
FNMA REMICS, Series 1992-09 'Z' 6% 25/05/2022	USD	8,519	8,716	0.00	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2016-055 'B', 144A 4.16% 25/04/2049	USD	5,000,000	5,575,821	0.13
FNMA REMICS, Series 1993-141 'Z' 7% 25/06/2023	USD	28,723	30,085	0.00	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2016-058 'B', 144A 3.73% 25/09/2049	USD	6,000,000	6,597,161	0.15
FNMA REMICS, Series 1993-99 'Z' 7% 25/07/2023	USD	22,848	23,936	0.00	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2016-059 'B', 144A 3.56% 25/11/2049	USD	6,179,000	6,725,947	0.16
FNMA REMICS, Series 1996-48 'Z' 7% 25/11/2026	USD	48,341	52,289	0.00	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2016-0731 'B', 144A 3.84% 25/01/2049	USD	4,050,000	4,265,331	0.10
FNMA REMICS, Series 2002-30 'Z' 6% 25/05/2032	USD	104,616	121,072	0.00	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2011-0725 'B', 144A 3.87% 25/02/2039	USD	6,606,000	7,088,647	0.17
FNMA REMICS, Series 092-43 'Z' 7.5% 25/07/2022	USD	282	283	0.00	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2011-0728 'B', 144A 3.64% 25/11/2039	USD	6,000,000	6,428,309	0.15
FNMA REMICS, Series 092-61 'Z' 7% 25/10/2022	USD	7,204	7,382	0.00	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2018-0151 'B', 144A 4.39% 25/08/2023	USD	5,150,000	5,556,732	0.13
FNMA REMICS, Series 1988-44 'ZA' 6.3% 28/07/2028	USD	294,438	329,243	0.01	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2018-0731 'B', 144A 4.05% 25/05/2025	USD	4,910,000	5,365,564	0.13
FNMA REMICS, Series 2002-30 'Z' 6% 25/06/2031	USD	134,865	152,442	0.00	FREMF Mortgage Trust, FN, Series 2018-0751 'B' 2.03% 25/09/2028	USD	2,561,486	2,484,122	0.06
FNMA REMICS, Series 2011-39 'Z' 6% 25/11/2032	USD	290,606	306,096	0.01					
FNMA REMICS, Series 2011-47 'ZA' 5.3% 25/07/2038	USD	261,084	302,808	0.01					
FNMA REMICS, Series 1992-145 'ZB' 6% 25/08/2022	USD	5,844	6,019	0.00					
FNMA REMICS, FN, Series 1993-136 'ZB' 6% 25/07/2023	USD	20,627	21,610	0.00					
FNMA REMICS, Series 1999-36 'Z' 6% 18/07/2028	USD	1,248	1,392	0.00					

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に
				占める					占める
				割合(%)					割合(%)
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-03L1 'B', 144A 3.825% 25/11/2025	USD	10,000,000	10,270,441	0.34	FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-07B 'C', 144A 4.03% 25/09/2031	USD	5,147,000	5,673,273	0.13
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-0907 'B', 144A 4.681% 25/04/2031	USD	5,516,000	5,848,433	0.14	FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-03L1 'C', 144A 3.819% 25/11/2025	USD	8,000,000	7,877,009	0.18
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-0228 'BB', 144A 3.709% 25/01/2025	USD	7,734,500	7,702,771	0.18	FREMF Trust, FRM, Series 2018-KW4 'B', 144A 3.911% 25/09/2028	USD	6,775,000	7,108,957	0.17
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2017-03L1 'BPL', 144A 3.691% 25/04/2027	USD	6,623,133	6,607,310	0.15	GE Capital Funding LLC 4.4% 15/05/2030	USD	1,135,000	1,313,484	0.03
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2017-03X1 'BPK', 144A 3.932% 25/04/2027	USD	5,000,000	4,885,230	0.11	General Motors Financial Co., Inc., FRM 1.25% 07/11/2023	USD	1,000,000	1,016,770	0.02
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2017-027 'C', 144A 2.492% 25/01/2046	USD	2,000,000	2,074,930	0.05	Gilead Sciences, Inc. 2.6% 01/09/2040	USD	3,870,000	2,988,404	0.07
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2017-030 'C', 144A 2.553% 25/04/2045	USD	4,910,000	5,139,184	0.13	Glencore Funding LLC, 144A 4.125% 20/05/2022	USD	1,062,000	1,129,669	0.03
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2014-039 'C', 144A 4.153% 25/04/2047	USD	2,500,000	2,702,985	0.06	Glencore Funding LLC, 144A 4.625% 29/04/2024	USD	700,000	767,741	0.02
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2014-040 'C', 144A 4.071% 25/11/2047	USD	3,521,000	3,794,107	0.09	Glencore Funding LLC, 144A 1.625% 01/09/2025	USD	5,795,000	5,870,899	0.14
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2015-034 'C', 144A 4.03% 25/04/2049	USD	3,000,000	3,225,710	0.08	Glencore Funding LLC, 144A 2.5% 01/09/2030	USD	5,585,000	5,576,547	0.13
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2016-0722 'C', 144A 3.847% 25/01/2049	USD	8,635,000	9,000,053	0.21	GLS Auto Receivables Trust, Series 2018-24 'C', 144A 4.2% 15/01/2028	USD	2,470,000	2,542,546	0.06
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2017-0724 'C', 144A 3.494% 25/12/2049	USD	6,325,000	6,605,392	0.15	GMAC Mortgage Loan Trust, FRM, Series 2016-AR3 '3A4' 3.311% 19/06/2035	USD	66,415	64,493	0.00
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2017-0725 'C', 144A 3.879% 25/02/2050	USD	2,255,000	2,384,397	0.06	GNMA, IO, FRM, Series 2019-B17 1.749% 20/11/2019	USD	24,411,752	1,570,750	0.04
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2017-0726 'C', 144A 3.983% 25/01/2049	USD	4,409,000	4,684,716	0.11	GNMA 2.5% 20/01/2061	USD	57,342,921	59,483,382	1.39
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2017-0728 'C', 144A 3.647% 25/11/2050	USD	5,540,000	5,856,953	0.14	GNMA, Series 2019-44 'A' 3.2% 20/04/2049	USD	6,123,416	6,479,929	0.15
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-0723 'C', 144A 4.079% 25/09/2025	USD	2,083,000	2,247,176	0.05	GNMA, Series 2009-104 'AB' 7% 16/08/2039	USD	87,087	94,016	0.00
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-076 'C', 144A 4.203% 25/04/2051	USD	4,061,000	4,494,172	0.10	GNMA, FRM, Series 2011-009 'AF' 0.601% 20/03/2061	USD	644,820	648,075	0.02
					GNMA, IO, FRM, Series 2007-50 'AI' 6.682% 20/08/2037	USD	59,718	1,700	0.00
					GNMA, PO, Series 2006-12 'AO' 0% 20/05/2036	USD	36,753	35,875	0.00
					GNMA, PO, Series 2007-28 'AO' 0% 16/06/2037	USD	524,672	514,910	0.01
					GNMA, IO, FRM, Series 2008-03 'AS' 5.603% 20/12/2038	USD	75,706	14,220	0.00
					GNMA, IO, FRM, Series 2009-106 'AS' 6.203% 16/11/2039	USD	194,873	35,173	0.00
					GNMA, FRM, Series 2010-129 'AH' 5.928% 20/04/2037	USD	193,537	222,356	0.01
					GNMA, Series 2005-12 'AZ' 5.5% 20/09/2035	USD	482,475	545,973	0.01

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に
				占める					占める
				割合(%)					割合(%)
GNMA, FPN, Series 2011-000 'BF' 0.50% 20/01/2061	USD	1,204,670	1,200,501	0.03	GNMA, FPN, Series 2015-000 'FC' 0.50% 20/03/2065	USD	3,561,557	3,506,645	0.08
GNMA, FPN, Series 2010-14 'BO' 0% 20/11/2035	USD	91,430	85,627	0.00	GNMA, FPN, Series 2015-010 'FC' 0.50% 20/04/2065	USD	1,974,682	1,997,507	0.05
GNMA, FPN, Series 2011-021 'CF' 0.80% 20/05/2061	USD	7,263	7,349	0.00	GNMA, FPN, Series 2016-036 'FC' 1.10% 20/12/2066	USD	1,668,794	1,711,642	0.04
GNMA, FPN, Series 2010-14 'CO' 0% 20/09/2035	USD	68,262	63,954	0.00	GNMA, FPN, Series 2012-031 'FD' 0.44% 20/12/2062	USD	1,071,492	1,073,788	0.03
GNMA, Series 2010-130 'CP' 7% 16/10/2040	USD	117,765	140,575	0.00	GNMA, FPN, Series 2016-011 'FD' 0.60% 20/05/2066	USD	1,433,222	1,426,642	0.03
GNMA, FPN, Series 2011-021 'DF' 0.75% 20/05/2061	USD	12,958	13,095	0.00	GNMA, FPN, Series 2010-022 'FE' 0.45% 20/05/2059	USD	289,727	290,062	0.01
GNMA, FPN, Series 2011-009 'DF' 0.60% 20/02/2061	USD	4,937,364	4,989,188	0.12	GNMA, FPN, Series 2011-034 'FG' 0.57% 20/04/2060	USD	9,633	9,685	0.00
GNMA, FPN, Series 2009-005 'DI' 2.88% 20/01/2070	USD	37,269,302	2,169,813	0.05	GNMA, FPN, Series 2015-036 'FG' 0.62% 20/10/2065	USD	995,393	999,386	0.02
GNMA, FPN, Series 2005-00 'DP' 16.25% 17/06/2035	USD	67,687	84,612	0.00	GNMA, FPN, Series 2015-032 'FH' 0.76% 20/12/2065	USD	1,087,528	1,102,360	0.03
GNMA, FPN, Series 2008-95 'DS' 7.20% 20/12/2038	USD	176,975	26,841	0.00	GNMA, FPN, Series 2016-021 'FH' 0.95% 20/09/2066	USD	6,797,173	6,934,457	0.16
GNMA, FPN, Series 2007-53 'ES' 6.45% 20/09/2037	USD	136,896	30,012	0.00	GNMA, FPN, Series 2015-015 'FJ' 0.54% 20/06/2065	USD	1,381,831	1,390,093	0.03
GNMA, FPN, Series 2011-007 'ES' 0.50% 20/02/2065	USD	1,346,480	1,350,321	0.03	GNMA, FPN, Series 2020-005 'FK' 0.70% 20/03/2030	USD	7,912,962	8,076,233	0.19
GNMA, FPN, Series 2016-023 'F' 0.85% 20/04/2066	USD	3,255,991	3,300,426	0.08	GNMA, FPN, Series 2015-016 'FL' 0.54% 20/07/2065	USD	2,115,159	2,128,453	0.05
GNMA, FPN, Series 2012-010 'FK' 0.65% 20/12/2061	USD	1,745,242	1,754,707	0.04	GNMA, FPN, Series 2016-001 'FL' 0.80% 20/03/2066	USD	3,150,698	3,206,873	0.08
GNMA, FPN, Series 2012-015 'FM' 0.55% 20/05/2062	USD	132	133	0.00	GNMA, FPN, Series 2012-000 'FS' 0.80% 20/04/2062	USD	788,556	798,717	0.02
GNMA, FPN, Series 2012-024 'FK' 0.55% 20/02/2060	USD	18,146	18,261	0.00	GNMA, FPN, Series 2011-014 'FY' 0.60% 20/06/2067	USD	4,479,636	4,515,489	0.11
GNMA, FPN, Series 2011-020 'FK' 0.60% 20/09/2062	USD	14,421	14,496	0.00	GNMA, FPN, Series 2020-010 'G' 1.80% 20/06/2070	USD	35,098,969	2,534,040	0.06
GNMA, FPN, Series 2011-029 'FK' 0.62% 20/04/2062	USD	1,526,134	1,533,279	0.04	GNMA, Series 2017-112 'GE' 2% 20/07/2047	USD	2,444,602	2,510,224	0.06
GNMA, Series 2012-001 'FK' 1.60% 20/01/2063	USD	136,242	136,526	0.00	GNMA, FPN, Series 2020-004 'H' 3% 20/09/2030	USD	6,795,804	1,006,808	0.02
GNMA, FPN, Series 2012-003 'FM' 0.40% 20/08/2060	USD	1,580	1,582	0.00	GNMA, FPN, Series 2012-036 'JA' 0.65% 20/10/2061	USD	2,267	2,280	0.00
GNMA, FPN, Series 2015-006 'FK' 0.50% 20/02/2065	USD	1,273,983	1,281,900	0.03	GNMA, FPN, Series 2012-001 'JA' 0.42% 20/01/2063	USD	1,255,518	1,257,093	0.03
GNMA, FPN, Series 2015-012 'FK' 0.50% 20/05/2065	USD	3,254,593	3,277,306	0.08	GNMA, FPN, Series 2007-17 'JI' 6.73% 16/04/2037	USD	139,370	30,372	0.00
GNMA, FPN, Series 2015-023 'FB' 0.62% 20/09/2065	USD	1,622,382	1,636,522	0.04	GNMA, FPN, Series 2005-7 'JM' 18.50% 18/05/2004	USD	977	1,199	0.00
GNMA, FPN, Series 2014-017 'FC' 0.60% 20/07/2064	USD	443,227	444,786	0.01	GNMA, FPN, Series 2005-68 'KI' 6.20% 20/09/2035	USD	280,536	52,817	0.00
GNMA, FPN, Series 2015-005 'FC' 0.50% 20/02/2065	USD	1,843,804	1,841,391	0.04	GNMA, Series 2002-70 'LG' 2% 20/08/2033	USD	561,249	610,285	0.01

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)	割合(%)						
ONMA, FBN, Series 2011-026 'MI' 6.65% 20/01/2012	USD	3,188	3,192	0.00		ONMA, FBN, Series 2001-61 'SD' 14.55% 20/08/2012	USD	49,268	63,743	0.00	
ONMA, 10, FBN, Series 2007-73 'MI' 5.90% 20/11/2017	USD	156,289	18,893	0.00		ONMA, 10, FBN, Series 2007-36 'SE' 6.29% 16/06/2017	USD	40,323	4,322	0.00	
ONMA, 10, Series 2009-14 'MI' 6.5% 20/03/2019	USD	56,829	12,568	0.00		ONMA, 10, FBN, Series 2004-90 'SI' 6.00% 20/10/2014	USD	182,037	27,934	0.00	
ONMA, FBN, Series 2007-16 'MS' 22.94% 20/04/2017	USD	72,738	104,956	0.00		ONMA, 10, FBN, Series 2007-61 'SI' 6.41% 20/11/2017	USD	81,883	14,751	0.00	
ONMA, FO, Series 2009-73 'OK' 6% 16/11/2017	USD	65,866	62,292	0.00		ONMA, 10, FBN, Series 2007-74 'SL' 6.46% 16/11/2017	USD	128,969	25,016	0.00	
ONMA, FO, Series 2010-151 'OP' 6% 20/12/2010	USD	143,589	136,640	0.00		ONMA, 10, FBN, Series 2007-40 'SN' 6.58% 20/01/2017	USD	165,917	38,084	0.00	
ONMA, 10, Series 2008-12 'PI' 5.5% 16/10/2017	USD	49,350	2,257	0.00		ONMA, 10, FBN, Series 2009-64 'SN' 6.02% 16/01/2019	USD	129,716	16,842	0.00	
ONMA, FBN, Series 2011-138 'PT' 3.91% 16/11/2012	USD	439,253	487,811	0.01		ONMA, 10, Series 2005-66 'SP' 20.52% 16/08/2015	USD	46,525	68,258	0.00	
ONMA, FBN, Series 2010-30 'PT' 4.79% 20/02/2010	USD	7,552,514	8,548,995	0.20		ONMA, 10, FBN, Series 2006-38 'SN' 6.46% 20/06/2016	USD	30,310	1,603	0.00	
ONMA, Series 2010-10 'P2' 5.5% 20/02/2010	USD	930,492	984,160	0.02		ONMA, FBN, Series 2001-51 'SN' 19.92% 20/09/2017	USD	29,929	38,317	0.00	
ONMA, Series 2006-51 'P2' 5.56% 20/10/2016	USD	678,536	740,028	0.02		ONMA, 10, FBN, Series 2007-19 'SN' 6.45% 20/12/2017	USD	103,110	14,499	0.00	
ONMA, 10, FBN, Series 2006-65 'SA' 6.70% 20/11/2016	USD	91,777	11,434	0.00		ONMA, FBN, Series 2012-101 'TA' 0.60% 20/01/2012	USD	17,222	17,316	0.00	
ONMA, 10, FBN, Series 2007-21 'SA' 6.10% 20/05/2017	USD	84,080	11,869	0.00		ONMA, 10, Series 2009-11 'TI' 6% 20/05/2019	USD	39,165	8,958	0.00	
ONMA, 10, FBN, Series 2007-76 'SA' 6.43% 20/11/2017	USD	76,858	9,913	0.00		ONMA, 10, FBN, Series 2009-31 'TS' 6.20% 20/03/2019	USD	110,302	8,147	0.00	
ONMA, 10, FBN, Series 2008-40 'SA' 6.22% 16/05/2018	USD	75,127	13,336	0.00		ONMA, FBN, Series 2004-94 'TS' 18.16% 20/10/2014	USD	72,509	90,616	0.00	
ONMA, 10, FBN, Series 2009-10 'SA' 5.85% 20/02/2019	USD	121,561	17,164	0.00		ONMA, 10, FBN, Series 2008-76 'US' 5.80% 20/09/2018	USD	221,603	35,595	0.00	
ONMA, 10, FBN, Series 2009-22 'SA' 6.17% 20/04/2019	USD	157,522	24,476	0.00		ONMA, Series 2018-128 'UJ' 3.5% 20/08/2018	USD	1,354,535	1,447,881	0.03	
ONMA, 10, FBN, Series 2009-6 'SA' 6.02% 16/02/2019	USD	55,113	5,295	0.00		ONMA, FBN, Series 2014-168 'VB' 3.44% 16/06/2017	USD	891,105	915,571	0.02	
ONMA, 10, FBN, Series 2007-40 'SB' 6.65% 20/01/2017	USD	116,801	21,939	0.00		ONMA, FBN, Series 2015-117 'V' 5.55% 20/10/2015	USD	1,160,717	1,339,307	0.03	
ONMA, 10, FBN, Series 2007-42 'SB' 6.65% 20/01/2017	USD	70,289	15,294	0.00		ONMA, FBN, Series 2011-131 'WA' 5.57% 20/07/2011	USD	1,593,742	1,863,789	0.04	
ONMA, 10, FBN, Series 2007-81 'SB' 6.55% 20/12/2017	USD	199,633	46,591	0.00		ONMA, FBN, Series 2011-162 'WA' 5.88% 20/12/2011	USD	382,617	444,874	0.01	
ONMA, 10, FBN, Series 2009-42 'SC' 5.90% 20/06/2019	USD	124,525	23,179	0.00		ONMA, FBN, Series 2012-122 'WA' 0.62% 20/10/2012	USD	457,655	460,041	0.01	
ONMA, 10, FBN, Series 2006-59 'SD' 6.80% 20/10/2016	USD	87,905	18,246	0.00		ONMA, FBN, Series 2012-141 'WC' 3.66% 20/01/2012	USD	634,966	693,830	0.02	
ONMA, 10, FBN, Series 2007-76 'SD' 5.70% 20/11/2017	USD	204,706	38,217	0.00		ONMA, FBN, Series 2015-151 'WX' 4.71% 20/10/2015	USD	1,028,161	1,179,849	0.03	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)	割合(%)					割合(%)	割合(%)
GNMA, FN, Series 2017-04 'X' 1.75% 20/06/2037	USD	8,684,530	648,482	0.02		GNMA 781614 7% 15/06/2033	USD	2,502	3,523	0.00	
GNMA, FN, Series 2010-0117 '2Q' 5.20% 20/01/2050	USD	6,439	6,787	0.00		GNMA 781648 6% 15/06/2033	USD	14,680	17,478	0.00	
GNMA, Series 2006-23 'Z' 6.5% 20/07/2038	USD	431,971	499,581	0.01		GNMA 782507 9.5% 15/10/2024	USD	284	289	0.00	
GNMA, Series 2003-75 '2Z' 6% 16/09/2032	USD	999,162	1,124,129	0.03		GNMA 782615 7% 15/06/2035	USD	97,719	114,608	0.00	
GNMA 4189 6.5% 20/07/2038	USD	53,886	60,283	0.00		GNMA 783133 5.5% 15/04/2033	USD	166,772	194,427	0.01	
GNMA 4217 6.5% 20/06/2038	USD	10,662	11,789	0.00		GNMA 783389 6% 20/06/2039	USD	191,979	219,809	0.01	
GNMA 4285 6% 20/11/2038	USD	8,522	9,493	0.00		GNMA 783444 5.5% 20/09/2039	USD	178,961	207,662	0.01	
GNMA 458388 7.5% 15/03/2028	USD	13,097	13,157	0.00		GNMA 784045 4.5% 20/07/2045	USD	587,735	637,950	0.02	
GNMA 465505 7.5% 15/06/2028	USD	7,982	8,931	0.00		GNMA A77628 4% 15/07/2046	USD	6,032,038	6,671,399	0.16	
GNMA 530795 6.5% 15/01/2023	USD	4,242	4,300	0.00		GNMA A77478 4% 15/09/2046	USD	3,355,630	3,710,262	0.09	
GNMA 569568 6.5% 15/01/2032	USD	46,695	54,697	0.00		GNMA A36215 4% 15/04/2047	USD	1,049,143	1,148,870	0.03	
GNMA 591882 6.5% 15/07/2032	USD	3,084	3,442	0.00		GNMA A36607 4% 15/06/2047	USD	551,575	604,410	0.01	
GNMA 607645 6.5% 15/02/2033	USD	3,334	3,758	0.00		GNMA A38715 4% 15/12/2046	USD	3,170,947	3,480,128	0.08	
GNMA 607728 6% 15/03/2033	USD	1,143	1,285	0.00		GNMA A78208 4% 15/01/2047	USD	241,717	266,085	0.01	
GNMA 611453 7% 15/04/2032	USD	3,764	3,871	0.00		GNMA BA7587 4.5% 20/05/2048	USD	3,589,237	3,846,670	0.09	
GNMA 621970 6% 15/02/2034	USD	5,873	6,825	0.00		GNMA BB3340 4% 15/07/2047	USD	85,891	93,531	0.00	
GNMA 742051 4.25% 20/07/2040	USD	507,102	611,806	0.01		GNMA BE6104 4.5% 20/09/2048	USD	1,749,537	1,913,075	0.05	
GNMA 742052 4.4% 20/06/2040	USD	485,996	512,166	0.01		GNMA BJ1314 5% 20/06/2049	USD	1,641,523	1,818,902	0.04	
GNMA 742147 4.25% 20/07/2040	USD	1,621,554	1,802,739	0.04		GNMA BK7198 4.5% 20/03/2049	USD	2,884,192	3,103,328	0.07	
GNMA 742155 4.25% 20/07/2040	USD	749,372	792,569	0.02		GNMA BM2163 5% 15/07/2049	USD	5,718,660	6,604,679	0.15	
GNMA 742178 4.25% 20/07/2040	USD	440,473	473,734	0.01		GNMA BM2262 4.5% 20/07/2049	USD	929,536	1,019,901	0.02	
GNMA 742196 4.4% 20/07/2040	USD	270,002	287,082	0.01		GNMA BM3691 4.5% 15/07/2049	USD	8,205,090	9,142,089	0.21	
GNMA 742197 4.25% 20/08/2040	USD	2,723,315	3,030,364	0.07		GNMA BM6992 4.5% 20/07/2049	USD	9,683,764	10,432,891	0.24	
GNMA 742203 4.25% 20/08/2040	USD	912,886	1,014,883	0.02		GNMA BM9701 4.5% 20/08/2049	USD	7,794,836	8,279,159	0.19	
GNMA 742310 4.25% 20/06/2040	USD	373,881	397,863	0.01		GNMA BM9713 4.5% 20/09/2049	USD	5,302,106	5,710,801	0.13	
GNMA 745389 4.25% 20/06/2040	USD	1,012,148	1,125,331	0.03		GNMA BM9734 4% 20/10/2049	USD	6,600,310	7,104,787	0.17	
GNMA 745394 4.4% 20/05/2040	USD	133,539	141,037	0.00		GNMA BN3949 5.5% 20/07/2049	USD	4,328,081	4,882,583	0.11	
GNMA 745410 4.25% 20/08/2040	USD	397,964	422,514	0.01		GNMA B03340 4.5% 20/08/2049	USD	8,180,380	8,979,761	0.21	
GNMA 749766 6.5% 20/01/2039	USD	53,352	56,203	0.00		GNMA B08204 4.5% 20/09/2049	USD	4,901,917	5,275,420	0.12	
GNMA 749803 4.4% 20/06/2040	USD	87,082	91,956	0.00		GNMA BP7143 4.5% 20/09/2049	USD	3,108,569	3,409,992	0.08	
GNMA 749951 4.4% 20/06/2040	USD	88,076	93,005	0.00		GNMA B57412 4.5% 15/04/2050	USD	4,018,377	4,519,228	0.11	
GNMA 749952 4.25% 20/09/2040	USD	1,132,888	1,255,096	0.03		GNMA B57592 4.5% 20/03/2050	USD	1,940,936	2,019,191	0.05	
GNMA 752485 4.25% 20/09/2040	USD	584,890	629,976	0.02		GNMA BT8093 3.5% 20/04/2050	USD	15,109,675	16,211,240	0.38	
GNMA 752521 4.25% 20/09/2040	USD	962,307	1,069,785	0.03		GNMA B37638 2.5% 20/09/2050	USD	7,271,613	7,598,866	0.18	
GNMA 752523 4.85% 20/07/2040	USD	73,530	78,049	0.00		GNMA B07669 3% 20/07/2050	USD	7,562,646	7,889,427	0.18	
GNMA 752597 4% 15/10/2040	USD	839,442	919,937	0.02		GNMA MA7052 2.5% 20/12/2050	USD	23,161,597	23,979,298	0.56	
GNMA 752598 4.25% 20/09/2040	USD	531,551	566,488	0.01		GNMA BEMICS, FN, Series 2011-007 'BA' 0.517% 20/03/2063	USD	587,635	589,642	0.01	
GNMA 752636 4.25% 20/10/2040	USD	306,515	326,254	0.01		Gold Key Resorts LLC, Series 2014-A 'A', 1444 3.25% 17/03/2031	USD	50,771	51,414	0.00	
GNMA 752667 4.25% 20/09/2040	USD	115,844	122,689	0.00		Golden Bear LLC, Series 2008-R 'B', 1444 5.625% 20/09/2047	USD	1,283,169	1,286,689	0.03	
GNMA 752668 4% 15/10/2040	USD	359,781	388,134	0.01		Golden Sachs Group, Inc. (Ish), FN 3.27% 29/09/2035	USD	1,773,000	1,899,884	0.05	
GNMA 752721 4.25% 20/09/2040	USD	253,530	268,787	0.01		Golden Sachs Group, Inc. (Ish), FN 1.431% 09/03/2037	USD	5,790,000	5,780,062	0.14	
GNMA 757072 4% 15/11/2040	USD	435,237	475,406	0.01		Golden Sachs Group, Inc. (Ish), FN 1.934% 28/10/2037	USD	1,200,000	1,271,258	0.03	
GNMA 757076 4.25% 20/10/2040	USD	181,469	191,982	0.01							
GNMA 757125 4.25% 15/09/2040	USD	138,504	151,552	0.00							
GNMA 781328 7% 15/09/2031	USD	76,882	89,687	0.00							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)	割合(%)						
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FOM 3.8915 05/06/2023	USD	4,080,000	4,517,850	0.11		HEBO Funding Trust, Series 2016-3A 'A1', 144A 3.08% 20/09/2042	USD	367,153	379,996	0.01	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FOM 4.2235 01/05/2029	USD	3,605,000	4,119,379	0.10		HEBO Funding Trust, Series 2016-4A 'A1', 144A 3.57% 20/09/2047	USD	1,684,129	1,741,114	0.04	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FOM 4.4115 23/04/2029	USD	2,300,000	2,804,975	0.07		Hilton Grand Vacations Trust, Series 2017-AA 'X', 144A 2.85% 26/12/2028	USD	730,027	747,881	0.02	
Goodman Trust, Series 2007-AA 'X', 144A 3.74% 15/10/2032	USD	892,591	945,769	0.02		Hyundai Capital America, 144A 1.95% 10/11/2032	USD	3,763,000	3,789,505	0.09	
Goodman Trust, Series 2007-BA 'X', 144A 3.28% 15/10/2031	USD	2,635,181	2,745,195	0.06		Hyundai Capital America, 144A 1.85% 15/10/2025	USD	1,340,000	1,361,429	0.03	
Goodman US Finance Three LLC, REIT, 144A 3.75 15/03/2028	USD	431,000	467,706	0.01		Hyundai Capital America, 144A 1.35% 08/01/2026	USD	1,005,000	994,621	0.02	
Graphic Packaging International LLC, 144A 1.512% 15/04/2026	USD	2,710,000	2,697,789	0.06		Hyundai Capital America, 144A 1.35% 15/09/2026	USD	1,005,000	997,559	0.02	
Gray Oak Pipeline LLC, 144A 2% 15/09/2023	USD	1,365,000	1,382,155	0.03		Hyundai Capital America, 144A 1% 10/02/2027	USD	605,000	641,745	0.02	
Gray Oak Pipeline LLC, 144A 2.6% 15/09/2025	USD	3,150,000	3,238,387	0.08		Hyundai Capital America, 144A 2.375% 15/09/2027	USD	1,330,000	1,361,963	0.03	
GSMP Mortgage Loan Trust, FOM, Series 2004-A '1A2', 144A 0.432% 25/06/2034	USD	75,780	68,814	0.00		Hyundai Capital America, 144A 1.85% 10/01/2028	USD	1,940,000	1,926,188	0.05	
GSMP Mortgage Loan Trust, FOM, Series 2005-1P1 '1P', 144A 0.462% 25/01/2035	USD	29,287	26,984	0.00		Impact Secured Assets OM Owner Trust, Series 2001-2 'A1' 5.5% 25/08/2012	USD	31,619	31,091	0.00	
GSMP Mortgage Loan Trust, FOM, Series 2005-1P2 '1P', 144A 0.462% 25/01/2035	USD	120,880	113,290	0.00		Independence Plaza Trust, Series 2018-INDP 'A', 144A 3.752% 10/01/2025	USD	3,660,000	3,885,023	0.09	
GSMP Mortgage Loan Trust, FOM, Series 2006-1P2 '1P2', 144A 0.940% 25/04/2036	USD	540,970	83,345	0.00		IndyMac INDX Mortgage Loan Trust, FOM, Series 2004-1P2 'A1' 0.972% 25/09/2034	USD	2,758	2,823	0.00	
GSX Mortgage Loan Trust, Series 2003-7F '1A4' 5.25% 25/06/2033	USD	171,534	176,626	0.00		Intact US Holdings, Inc. 4.6% 09/11/2022	USD	1,000,000	1,048,574	0.03	
GSX Mortgage Loan Trust, Series 2004-4F '1A6' 6.5% 25/05/2034	USD	72,262	78,189	0.00		International Flavors & Fragrances, Inc., 144A 1.832% 15/10/2027	USD	1,995,000	1,993,881	0.05	
GTP Acquisition Partners I LLC, 144A 3.482% 15/06/2030	USD	225,000	235,080	0.01		International Flavors & Fragrances, Inc., 144A 3.268% 15/11/2040	USD	1,140,000	1,174,155	0.03	
Guardian Life Global Funding, 144A 2.3% 08/05/2022	USD	720,000	753,993	0.02		International Flavors & Fragrances, Inc., 144A 3.468% 01/12/2030	USD	885,000	924,819	0.02	
Guardian Life Insurance Co. of America (The), 144A 4.85% 24/01/2017	USD	250,000	321,374	0.01		ITC Holdings Corp., 144A 2.95% 14/05/2030	USD	910,000	959,711	0.02	
Hackensack Meridian Health, Inc. 2.875% 01/09/2030	USD	2,000,000	1,981,691	0.05		J.P. Morgan Class Commercial Mortgage Securities Trust, FOM, Series 2006-1P3 'A' 0.397% 15/05/2045	USD	31,893	35	0.00	
Hartford HealthCare Corp. 1.441% 01/01/2034	USD	2,680,000	2,830,080	0.07		J.P. Morgan Mortgage Trust, FOM, Series 2004-AA '1A1' 3.888% 25/09/2034	USD	6,929	6,836	0.00	
Headlands Residential LLC, STEP, Series 2017-RPL1 'A', 144A 3.875% 25/11/2024	USD	5,715,000	5,829,136	0.14		J.P. Morgan Mortgage Trust, FOM, Series 2004-A3 '4A1' 3.671% 25/07/2034	USD	3,448	3,569	0.00	
Headlands Residential LLC, STEP, Series 2018-RPL1 'A', 144A 3.875% 25/08/2024	USD	5,540,000	5,584,066	0.13							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に占める割合(%)		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に占める割合(%)	
J.P. Morgan Mortgage Trust, FIM, Series 2006-A2 '6A1' 2.742% 25/09/2034	USD	26,113	27,495	0.00		Liberty Mutual Group, Inc., 144A 3.951% 15/10/2050	USD	1,120,000	1,244,392	0.03	
J.P. Morgan Mortgage Trust, FIM, Series 2006-A2 '6A3' 2.516% 25/11/2033	USD	70,450	71,239	0.00		Liberty Mutual Insurance Co., 144A 8.5% 15/06/2025	USD	400,000	492,993	0.01	
J.P. Morgan Securitization Trust, FIM Series 2009-7 '11A1', 144A 5.204% 27/07/2037	USD	6,298	6,304	0.00		Massachusetts Electric Co., 144A 4.004% 15/08/2046	USD	483,000	542,817	0.01	
Judson National Life Global Funding, 144A 2.9% 27/06/2022	USD	710,000	726,040	0.02		WarpMutual Global Funding II, 144A 2.75% 22/06/2024	USD	1,000,000	1,061,121	0.03	
Judson National Life Global Funding, 144A 3.2% 20/10/2024	USD	173,000	184,422	0.00		WSTR Adjustable Rate Mortgages Trust, FIM, Series 2004-13 '2A1' 2.702% 21/04/2034	USD	66,589	66,813	0.00	
Judson National Life Global Funding, 144A 3.0% 29/04/2026	USD	1,084,000	1,112,475	0.03		WSTR Adjustable Rate Mortgages Trust, FIM, Series 2004-13 '3A' 2.965% 21/11/2034	USD	206,393	208,633	0.01	
JB Hunt Transport Services, Inc. 3.85% 15/09/2024	USD	1,200,000	1,287,308	0.03		WSTR Adjustable Rate Mortgages Trust, FIM, Series 2004-3 '4B' 1.266% 26/04/2024	USD	7,149	7,192	0.00	
JB Hunt Transport Services, Inc. 3.875% 01/02/2026	USD	860,000	956,746	0.02		WSTR Alternative Loan Trust, Series 2004-4 '1A1' 5% 25/05/2024	USD	12,828	13,036	0.00	
Jersey Central Power & Light Co., 144A 4.2% 15/01/2026	USD	460,000	509,883	0.01		WSTR Alternative Loan Trust, Series 2004-10 '1A1' 4.9% 25/09/2019	USD	907	945	0.00	
John Severi Combined Cycle Generation LLC 4.696% 15/01/2042	USD	315,475	382,193	0.01		WSTR Alternative Loan Trust, Series 2004-4 '1A1' 5.5% 25/05/2024	USD	78,571	81,052	0.00	
Kouzig Dr Pepper, Inc. 3.13% 15/12/2023	USD	560,000	584,420	0.01		WSTR Alternative Loan Trust, Series 2006-6 '1A1' 5.5% 25/12/2025	USD	24,909	23,970	0.00	
Kouzig Dr Pepper, Inc. 4.41% 25/05/2025	USD	336,000	377,456	0.01		WSTR Alternative Loan Trust, Series 2004-6 '1A1' 5% 25/07/2024	USD	38,581	40,710	0.00	
Kouzig Dr Pepper, Inc. 3.43% 15/06/2027	USD	450,000	497,187	0.01		WSTR Alternative Loan Trust, Series 2004-4 '1A1' 5.5% 25/04/2020	USD	53,090	51,647	0.00	
Kouzig Dr Pepper, Inc. 3.2% 01/05/2030	USD	1,500,000	1,624,035	0.04		WSTR Asset Securitization Trust, Series 2004-4 '1A6' 5.25% 25/12/2023	USD	38,156	39,440	0.00	
Kouzig Dr Pepper, Inc. 4.985% 25/05/2028	USD	484,000	618,283	0.02		WSTR Performing Loan Trust, FIM, Series 2005-2 '1A1B', 144A 0.442% 25/05/2026	USD	331,352	181,199	0.00	
Kouzig Dr Pepper, Inc. 4.42% 15/12/2046	USD	500,000	603,358	0.01		WSTR Seasoned Securitization Trust, FIM, Series 2004-2 'A1' 6.5% 25/09/2022	USD	37,826	39,065	0.00	
KeyBank NA 3.18% 15/10/2027	USD	650,000	666,900	0.02		WSTR Seasoned Securitization Trust, FIM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/09/2022	USD	121,657	127,238	0.00	
KeySpan Gas East Corp., 144A 2.742% 15/08/2026	USD	448,000	470,635	0.01		Mead Johnson Nutrition Co. 4.125% 15/11/2025	USD	502,000	565,041	0.01	
LO-US Commercial Mortgage Trust, D, FIM, Series 2006-C1 '3D', 144A 0.26% 15/02/2061	USD	772,307	1,513	0.00		Mead Johnson Nutrition Co. 5.9% 01/11/2039	USD	50,000	71,868	0.00	
Lohm Mortgage Trust, Series 2009-2 '1A6' 5% 25/03/2038	USD	246,017	132,980	0.00		Mead Johnson Nutrition Co. 4.8% 01/06/2044	USD	500,000	653,510	0.02	
Leidos, Inc. 3.625% 15/05/2025	USD	5,000,000	5,457,300	0.13		Memorial Health Services 1.467% 01/11/2049	USD	2,440,000	2,658,979	0.06	
Leidos, Inc. 2.3% 15/02/2031	USD	1,190,000	1,164,058	0.03							
Lendmark Funding Trust, Series 2019-28 'B', 144A 4.48% 20/04/2027	USD	6,000,000	6,069,904	0.14							
Liberty Mutual Group, Inc., 144A 4.593% 01/02/2029	USD	258,000	302,154	0.01							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める	
			時価(米ドル)	割合(%)				時価(米ドル)	割合(%)
Memorial Sloan-Kettering Cancer Center 4.2% 01/01/2035	USD	394,000	429,512	0.01	Mylan, Inc. 5.4% 29/11/2043	USD	1,265,000	1,562,996	0.04
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust, FOM, Series 2004-1 '2M1' 2.116% 25/12/2004	USD	123,282	125,513	0.00	Mylan, Inc. 5.2% 15/04/2048	USD	1,500,000	1,853,327	0.04
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust N.M.I. FOM, Series 2003-4M '2M' 2.945% 25/07/2003	USD	26,476	26,309	0.00	New York and Presbyterian Hospital (The) 2.605% 01/08/2060	USD	1,330,000	1,242,733	0.03
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust N.M.I. FOM, Series 2004-4M '2M' 2.765% 25/03/2004	USD	49,698	51,587	0.00	New York Life Global Funding, 144A 2.35% 14/07/2036	USD	503,000	527,652	0.01
Metropolitan Life Global Funding I, 144A 3% 10/01/2023	USD	530,000	551,140	0.01	New York Life Insurance Co., 144A 4.45% 15/06/2069	USD	1,040,000	1,308,968	0.03
Metropolitan Life Global Funding I, 144A 3% 19/09/2027	USD	1,100,000	1,187,187	0.03	New York State Dormitory Authority 5.6% 15/03/2040	USD	175,000	236,705	0.01
Microchip Technology, Inc., 144A 0.912% 15/02/2034	USD	3,045,000	3,044,485	0.07	NGPL PipeCo LLC, 144A 3.25% 15/07/2031	USD	1,755,000	1,811,348	0.04
Microchip Technology, Inc., 144A 0.932% 01/09/2034	USD	3,000,000	2,989,199	0.07	Niagara Mohawk Power Corp., 144A 1.95% 27/06/2030	USD	2,250,000	2,223,250	0.05
Microsoft Corp. 1.5% 12/02/2035	USD	1,907,000	2,216,909	0.05	Noura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2003-01 'A1' 5.5% 25/09/2033	USD	269	277	0.00
Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC, 144A 4.1% 15/05/2038	USD	410,000	460,984	0.01	Noura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2003-01 'A2' 6% 25/06/2033	USD	1,253	1,265	0.00
MidMichigan Health 3.409% 01/06/2050	USD	780,000	839,730	0.02	Noura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2003-01 'A5' 7% 25/04/2033	USD	1,701	1,747	0.00
ML-CFC Commercial Mortgage Trust, 10, FOM, Series 2009-4 'C', 144A 1.176% 12/12/2049	USD	8,893	1	0.00	Nordstrom, Inc., 144A 4.25% 01/08/2031	USD	2,510,000	2,619,989	0.06
Mondelez International, Inc. 1.5% 04/05/2035	USD	730,000	744,922	0.02	Norfolk Southern Corp. 5.59% 17/05/2025	USD	4,000	4,888	0.00
Morgan Stanley, FOM 0.529% 25/01/2024	USD	3,120,000	3,119,149	0.07	Norfolk Southern Corp. 4.05% 15/08/2052	USD	1,273,000	1,509,771	0.04
Morgan Stanley, FOM 2.180% 28/04/2026	USD	4,740,000	4,929,174	0.12	Northern Trust Corp., FOM 1.375% 08/05/2032	USD	823,000	895,761	0.02
Morgan Stanley, FOM 3.971% 22/07/2038	USD	1,000,000	1,178,870	0.03	Northwestern Mutual Global Funding, 144A 1.7% 01/06/2028	USD	1,685,000	1,690,520	0.04
Morgan Stanley, FOM 3.217% 22/04/2042	USD	2,000,000	2,123,113	0.05	NOG Energy, Inc., 144A 2% 02/12/2027	USD	1,770,000	1,796,579	0.04
Wega Stabler Capital I Trust, 10, FOM, Series 2009-10A 'D', 144A 0.202% 15/12/2043	USD	297,553	836	0.00	NOG Energy, Inc., 144A 2.45% 15/06/2029	USD	1,975,000	1,990,692	0.05
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, Series 2004-3 '1A' 3% 25/09/2019	USD	158	159	0.00	NOG Energy, Inc., 144A 4.45% 15/06/2029	USD	1,080,000	1,195,946	0.03
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, FOM, Series 2004-3 '4A' 5.63% 25/04/2024	USD	140,398	149,028	0.00	NR2 Excess Spread-Collateralized Notes, Series 2021-FMT2 'A', 144A 3.228% 25/05/2036	USD	7,287,508	7,287,465	0.17
Mount Sinai Hospital Group, Inc. 2.931% 01/01/2048	USD	366,000	412,558	0.01	Nucor Corp., 144A 2.97% 15/12/2065	USD	1,470,000	1,427,377	0.03
MPLX LP 5.2% 01/12/2047	USD	585,000	715,950	0.02	NYU Langone Hospitals 3.38% 01/07/2055	USD	1,010,000	1,077,882	0.03
MultiCare Health System 2.803% 15/08/2050	USD	1,115,000	1,100,797	0.03	Office Properties Income Trust, REIT 4.15% 01/02/2022	USD	2,850,000	2,691,283	0.06
					Office Properties Income Trust, REIT 4% 15/01/2022	USD	1,176,000	1,214,809	0.03

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)	割合(%)						
Ohio Power Co. 5.75% 01/03/2033	USD	240,000	350,283	0.01		Port Authority of New York & New Jersey 5.647% 01/11/2040	USD	285,000	402,166	0.01	
Ohio State University (The) 4.35% 01/06/2111	USD	716,000	1,018,453	0.02		Port Authority of New York & New Jersey 5.647% 01/11/2040	USD	650,000	917,300	0.02	
Ohio State University (The) 'A' 4.045% 01/12/2066	USD	325,000	414,887	0.01		Port Authority of New York & New Jersey 4.452% 01/10/2062	USD	1,330,000	1,770,796	0.04	
Omni Electric Delivery Co. LLC 5.75% 15/09/2029	USD	150,000	188,733	0.01		Potomac Electric Power Co. 5.25% 15/11/2037	USD	200,000	295,163	0.01	
Omni Electric Delivery Co. LLC 5.25% 15/09/2049	USD	1,990,000	2,102,674	0.05		Prestige Auto Receivables Trust, Series 2009-2A 'D', 1444 3.91% 15/10/2032	USD	1,542,942	1,545,169	0.04	
Omni Electric Delivery Co. LLC 5.35% 01/10/2032	USD	295,000	431,214	0.01		Principal Life Global Funding II, 1444 2.37% 21/11/2021	USD	950,000	958,042	0.02	
Omni Direct Auto Receivables Trust, Series 2018-1A 'C', 1444 3.85% 14/10/2025	USD	1,005,000	1,017,488	0.02		Progress Residential Trust, Series 2018-SF23 'B', 1444 4.437% 17/10/2026	USD	8,372,000	8,443,291	0.20	
Omni Direct Auto Receivables Trust, Series 2018-1A 'D', 1444 4.45% 14/10/2026	USD	14,173,000	14,366,719	0.34		Progress Residential Trust, Series 2018-SF23 'E', 1444 4.872% 17/10/2026	USD	4,458,000	4,518,855	0.11	
Opertus Funding LLC, Series 2018-C 'A', 1444 4.25% 08/10/2024	USD	8,008,000	8,014,682	0.19		Progressive Corp. (The), FPM 5.375% Perpetual	USD	690,000	724,500	0.02	
O' Kelly Automotive, Inc. 1.6% 01/09/2027	USD	556,000	623,051	0.02		Providence St Joseph Health Obligated Group 2.743% 01/10/2038	USD	280,000	300,013	0.01	
Otis Worldwide Corp. 2.565% 15/02/2030	USD	2,750,000	2,853,343	0.07		Prudential Insurance Co. of America (The), 1444 3.25% 01/01/2025	USD	1,350,000	1,698,204	0.04	
Pacific Gas and Electric Co. 3.45% 01/01/2025	USD	1,535,000	1,607,901	0.04		Public Service Co. of Colorado 6.5% 01/09/2038	USD	135,000	203,262	0.01	
Pacific Gas and Electric Co., FPM 1.52% 15/11/2021	USD	4,610,000	4,619,706	0.11		Public Service Co. of Oklahoma 6.625% 15/11/2027	USD	300,000	429,136	0.01	
Pacific Life Global Funding II, 1444 1.25% 24/06/2025	USD	1,560,000	1,565,834	0.04		RLI Trust, Series 2004-2S14 'A1' 5% 25/07/2018	USD	571	516	0.00	
Pacific Life Insurance Co., FPM 1444 4.25% 26/10/2067	USD	627,000	721,188	0.02		RMP Trust, Series 2004-S12 'A1' 7% 25/09/2021	USD	133,305	140,739	0.00	
PECO Energy Co. 2.8% 15/06/2050	USD	900,000	900,860	0.02		Raytheon Technologies Corp. 2.2% 15/02/2024	USD	420,000	446,629	0.01	
Pennsylvania Electric Co., 1444 3.25% 15/09/2028	USD	75,000	78,834	0.00		Raytheon Technologies Corp. 4.35% 15/04/2047	USD	166,000	205,042	0.01	
Penske Truck Leasing Co. LP, 1444 2.4% 15/11/2026	USD	177,000	191,906	0.01		Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 1.7% 15/09/2020	USD	3,100,000	2,949,999	0.07	
Pepco Holdings LLC 7.45% 15/08/2032	USD	174,000	244,652	0.01		Regents of the University of California Medical Center Pooled 3.705% 15/05/2020	USD	2,540,000	2,752,553	0.06	
Pepperdine University 3.301% 01/12/2059	USD	1,170,000	1,179,549	0.03		Reliance Standard Life Global Funding II, 1444 3.85% 19/09/2021	USD	300,000	321,071	0.01	
Piedmont Natural Gas Co., Inc. 3.25% 01/06/2029	USD	1,550,000	1,709,119	0.04		RFCI Trust, FPM, Series 2005-SA4 '1A1' 2.923% 15/09/2025	USD	13,119	11,834	0.00	
Plains All American Pipeline LP 3.65% 15/10/2023	USD	2,770,000	2,937,026	0.07		Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 01/03/2025	USD	2,000,000	2,287,749	0.05	
Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	USD	1,280,000	1,433,044	0.03		Santander Drive Auto Receivables Trust, Series 2017-2 'E' 4.97% 15/01/2025	USD	12,000,000	12,274,877	0.29	
Plains All American Pipeline LP 5.15% 01/06/2042	USD	1,465,000	1,636,249	0.04							
Plains All American Pipeline LP 4.7% 15/06/2044	USD	1,110,000	1,181,395	0.03							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める	
			時価(米ドル)	割合(%)				時価(米ドル)	割合(%)
SCB Recovery Funding LLC 2.51% 15/11/2043	USD	1,140,000	1,000,276	0.03	Structured Asset Mortgage Investments II Trust, FOM, Series 2005-ABS 'A3' 0.597% 19/01/2015	USD	206,689	209,747	0.01
Schlumberger Holdings Corp., 144A 2.75% 01/05/2024	USD	640,000	689,231	0.02	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates Trust, FOM, Series 2003-24A 'M3' 2.784% 25/11/2003	USD	106,713	108,642	0.00
Schlumberger Holdings Corp., 144A 2.9% 17/05/2023	USD	455,000	507,942	0.01	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates Trust, SIRE, Series 2004-60S 'ASB' 6.05% 25/09/2004	USD	84,256	85,224	0.00
Seasoned Credit Risk Transfer Trust, Series 2018-4 'W' 3.5% 25/02/2030	USD	3,670,923	3,061,318	0.09	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates Trust, SIRE, Series 2004-60S 'ASB' 6.05% 25/09/2004	USD	49,039	46,839	0.00
Seasoned Credit Risk Transfer Trust, Series 2018-4 'W' 3.5% 25/02/2030	USD	7,354,446	8,511,130	0.20	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates Trust, SIRE, Series 2004-60S 'ASB' 6.05% 25/09/2004	USD	5,000,000	5,033,224	0.12
Seasoned Loans Structured Transaction, Series 2018-1 'A1' 3.5% 25/06/2030	USD	3,467,415	3,632,866	0.09	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates Trust, Series 2018-11 'X' 3.3% 15/09/2018	USD	400,000	521,225	0.01
Securitized Asset-Behind Receivables LLC Trust, SIRE, Series 2006-031 'W3' 3.0% 25/01/2036	USD	31,185	31,336	0.00	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A 4.9% 15/01/2044	USD	800,000	959,881	0.02
Sequoia Mortgage Trust, FOM, Series 10 'A' 0.85% 20/03/2027	USD	81,166	82,141	0.00	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A 4.2% 15/05/2047	USD	1,535,000	1,594,331	0.04
Sequoia Mortgage Trust, FOM, Series 2000-1 'A' 0.85% 20/04/2033	USD	76,079	77,195	0.00	Tennessee Gas Pipeline Co. LLC, 144A 2.9% 01/03/2030	USD	32,651	32,717	0.00
Sequoia Mortgage Trust, FOM, Series 2004-12 'A3' 0.58% 20/01/2035	USD	57,014	55,437	0.00	Tesla Auto Lease Trust, Series 2018-B 'X', 144A 3.71% 20/09/2023	USD	554,000	565,637	0.01
Sierra Timber Receivables Funding LLC, Series 2018-2A 'A', 144A 3.85% 20/09/2035	USD	997,584	1,042,740	0.03	Texas Eastern Transmission LP, 144A 2.8% 15/10/2022	USD	90,000	98,004	0.00
Smithfield Foods, Inc., 144A 5.2% 01/04/2029	USD	1,600,000	1,064,113	0.04	Texas Eastern Transmission LP, 144A 3.5% 15/01/2028	USD	1,260,000	1,138,755	0.03
SoFi Professional Loan Program LLC, Series 2016-C 'A20', 144A 3.30% 27/12/2032	USD	83,859	83,662	0.00	Texas Health Resources 2.328% 15/11/2050	USD	700,000	917,410	0.02
Southern Natural Gas Co. LLC, 144A 4.8% 15/01/2047	USD	407,000	503,855	0.01	Texas Health Resources 4.33% 15/11/2055	USD	400,000	543,942	0.01
Southwestern Electric Power Co. 2.75% 01/10/2038	USD	500,000	531,237	0.01	Time Warner Cable LLC 6.55% 01/05/2037	USD	1,560,000	2,190,956	0.05
Southwestern Public Service Co. 4.5% 15/06/2041	USD	250,000	309,763	0.01	Time Warner Cable LLC 6.75% 15/06/2039	USD	202,000	217,993	0.01
Spirit Airlines Pass Through Trust, Series 2017-1A 'A' 1.37% 15/08/2031	USD	641,899	656,342	0.02	Tri-State Generation and Transmission Association, Inc. 4.2% 01/06/2046	USD	2,443	2,738	0.00
SpurcoABS Trust, Series 2016-01 'B', 144A 6.5% 15/06/2038	USD	952,937	999,173	0.02	UMBS 254305 6.5% 01/05/2022	USD	8,120	8,649	0.00
Starbucks Corp. 2.55% 15/11/2030	USD	1,640,000	1,701,628	0.04	UMBS 255843 5.5% 01/09/2035	USD	50,457	58,557	0.00
State of Texas 5% 01/04/2025	USD	536,000	555,571	0.01	UMBS 256648 7.5% 01/01/2022	USD	2,631	2,639	0.00
Steel Dynamics, Inc. 1.6% 15/10/2027	USD	1,519,000	1,517,683	0.04	UMBS 257055 6.5% 01/12/2027	USD	71,095	85,704	0.00
Steel Dynamics, Inc. 3.45% 15/04/2030	USD	1,424,000	1,552,916	0.04	UMBS 257510 7% 01/12/2038	USD	2,165	2,510	0.00
Structured Asset Mortgage Investments II Trust, FOM, Series 2004-ABS 'A1' 0.75% 15/10/2014	USD	145,879	143,614	0.00	UMBS 555791 6.5% 01/12/2022	USD	323	362	0.00
					UMBS 598559 8.5% 01/08/2031	USD	4,099	4,839	0.00

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に	
				占める	割合(%)					占める	割合(%)
UMBS 602589 7% 01/09/2031	USD	16,927	19,210	0.00		UMBS B03950 5% 01/08/2049	USD	1,193,125	1,340,206	0.03	
UMBS 622534 3% 01/09/2031	USD	113,243	118,365	0.00		UMBS B03951 5% 01/08/2049	USD	602,532	680,677	0.02	
UMBS 622543 5.5% 01/09/2031	USD	145,029	165,500	0.00		UMBS B04194 5% 01/09/2049	USD	683,775	773,789	0.02	
UMBS 674349 6% 01/03/2033	USD	1,682	1,894	0.00		UMBS B04199 5% 01/08/2049	USD	1,141,193	1,294,062	0.03	
UMBS 689977 8% 01/03/2027	USD	8,582	9,316	0.00		UMBS B04200 5% 01/08/2049	USD	2,890,359	3,260,938	0.08	
UMBS 695533 8% 01/06/2027	USD	4,531	4,991	0.00		UMBS B04201 5% 01/08/2049	USD	3,947,382	3,424,582	0.08	
UMBS 725704 6% 01/08/2034	USD	3,419	3,942	0.00		UMBS B04202 5% 01/08/2049	USD	2,470,167	2,786,690	0.07	
UMBS 745148 5% 01/01/2036	USD	41,540	47,744	0.00		UMBS B04203 5% 01/08/2049	USD	2,619,558	2,962,124	0.07	
UMBS 745418 5.5% 01/04/2036	USD	54,373	62,982	0.00		UMBS B05594 4% 01/09/2049	USD	3,121,009	3,949,945	0.08	
UMBS 755973 8% 01/11/2028	USD	17,358	19,785	0.00		UMBS B05635 3.5% 01/08/2049	USD	8,609,393	9,239,534	0.22	
UMBS 755994 8% 01/10/2028	USD	4,613	5,038	0.00		UMBS B06078 3.5% 01/10/2049	USD	4,065,969	4,285,454	0.10	
UMBS 775902 8.5% 01/04/2030	USD	33,827	37,539	0.00		UMBS B06817 3.5% 01/10/2049	USD	4,947,803	4,580,426	0.11	
UMBS 788150 6% 01/03/2032	USD	22,175	24,967	0.00		UMBS BQ1623 3% 01/06/2050	USD	4,378,194	4,628,013	0.11	
UMBS 870770 6.5% 01/01/2036	USD	24,207	27,953	0.00		UMBS CA1294 4% 01/02/2038	USD	1,351,076	1,488,482	0.04	
UMBS 888892 7.5% 01/11/2037	USD	85,855	100,868	0.00		UMBS CA1298 4% 01/02/2038	USD	1,372,428	1,520,986	0.04	
UMBS 889519 5.5% 01/12/2035	USD	63,342	73,510	0.00		UMBS CA5729 3% 01/05/2050	USD	10,848,406	11,338,820	0.27	
UMBS 889573 6.5% 01/03/2023	USD	22,682	23,205	0.00		UMBS FMI219 4% 01/07/2049	USD	1,785,416	1,905,799	0.05	
UMBS 889757 5% 01/02/2038	USD	47,324	55,063	0.00		UMBS FMI758 3.5% 01/09/2049	USD	3,591,972	3,798,949	0.09	
UMBS 924857 8.5% 01/09/2037	USD	16,284	16,497	0.00		UMBS MA0406 4.5% 01/05/2030	USD	123,430	134,317	0.00	
UMBS 929560 7% 01/06/2038	USD	60,521	73,380	0.00		UMBS MA0948 5% 01/11/2031	USD	163,963	183,443	0.00	
UMBS 945870 6.5% 01/08/2037	USD	34,358	40,756	0.00		UMBS Q49332 2.5% 01/05/2050	USD	5,252,289	5,434,733	0.13	
UMBS 946338 7% 01/09/2037	USD	58,988	68,631	0.00		UMBS Q49361 3.5% 01/06/2050	USD	897,302	970,682	0.02	
UMBS 960150 6% 01/11/2037	USD	53,350	61,955	0.00		UMBS RA2008 4% 01/01/2050	USD	5,669,892	6,137,888	0.14	
UMBS 976871 6.5% 01/08/2036	USD	172,131	197,913	0.01		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2013-1 'A' 4.2% 15/08/2027	USD	1,014,790	1,070,803	0.03	
UMBS 995149 6.5% 01/10/2038	USD	93,231	108,638	0.00		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2014-1 'A' 4% 11/10/2027	USD	851,467	688,926	0.02	
UMBS 995456 6.5% 01/02/2024	USD	38,239	39,549	0.00		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2014-2 'A' 3.75% 03/03/2028	USD	483,315	509,897	0.01	
UMBS 995505 8% 01/01/2038	USD	51,776	60,998	0.00		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-2 'A' 3.25% 07/04/2030	USD	2,355,301	2,361,190	0.06	
UMBS A40922 6% 01/09/2036	USD	106,373	124,892	0.00		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2018-1 'A' 3.75% 01/09/2031	USD	1,264,980	1,385,153	0.03	
UMBS A41019 6% 01/11/2036	USD	86,320	102,801	0.00		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-1 'A' 4.5% 25/10/2033	USD	1,092,077	1,122,110	0.03	
UMBS AB9551 3% 01/06/2043	USD	2,042,588	2,183,186	0.05		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-2 'A' 2.875% 01/04/2030	USD	1,641,471	1,731,752	0.04	
UMBS AC3407 5.5% 01/10/2039	USD	65,889	73,973	0.00		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-1 'M' 3.5% 01/09/2031	USD	1,415,537	1,557,091	0.04	
UMBS AD0133 5% 01/08/2024	USD	29,310	30,574	0.00		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-2 'M' 2.75% 01/11/2033	USD	2,243,220	2,255,557	0.05	
UMBS AD0364 5% 01/05/2023	USD	7,687	7,987	0.00		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-1 'B' 3.65% 07/01/2027	USD	1,490,569	1,486,943	0.04	
UMBS AD0753 7% 01/01/2039	USD	73,947	89,891	0.00		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2018-1 'B' 4.2% 01/09/2027	USD	312,647	322,026	0.01	
UMBS AD0755 7% 01/06/2035	USD	3,985,028	4,708,165	0.11		Series 2018-1 'B' 4.2% 01/09/2027	USD	1,770,000	1,782,001	0.04	
UMBS B94683 4% 01/06/2047	USD	2,292,045	2,514,321	0.06		Universal Health Services, Inc., 144 2.65% 15/10/2030	USD	1,770,000	1,782,001	0.04	
UMBS B94684 4% 01/06/2047	USD	2,807,769	3,071,821	0.07							
UMBS B94685 4% 01/06/2047	USD	2,860,683	3,129,517	0.07							
UMBS B97663 4% 01/10/2047	USD	5,179,541	5,622,330	0.13							
UMBS BK0319 4.5% 01/03/2049	USD	1,286,770	1,402,799	0.03							
UMBS BK3753 4.5% 01/06/2049	USD	3,975,380	4,357,363	0.10							
UMBS BK9929 4.5% 01/09/2048	USD	9,352,841	10,242,234	0.24							
UMBS BM1213 4% 01/04/2047	USD	5,210,352	5,648,071	0.13							
UMBS BM3254 4% 01/01/2038	USD	3,370,535	3,723,552	0.09							
UMBS BM3566 4% 01/02/2038	USD	4,194,071	4,611,061	0.11							
UMBS BM5430 5% 01/01/2049	USD	4,919,401	5,527,774	0.13							
UMBS BN5899 5% 01/02/2049	USD	1,555,644	1,712,958	0.04							
UMBS BN9169 4.5% 01/04/2049	USD	1,496,311	1,633,397	0.04							
UMBS BQ2504 5% 01/08/2049	USD	1,143,536	1,289,814	0.03							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に
				占める					占める
				割合(%)					割合(%)
University of Southern California 2.23% 01/01/2130	USD	1,090,000	1,065,678	0.03	ViacomCBS, Inc. 2.7% 15/01/2024	USD	176,000	190,302	0.01
US Auto Funding LLC, Series 2018-M 'A', 144A 5.5% 15/01/2023	USD	392,529	396,271	0.01	ViacomCBS, Inc. 4% 15/01/2026	USD	750,000	834,557	0.02
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/02/2022	USD	4,420,000	4,410,661	0.10	ViacomCBS, Inc. 2.9% 15/01/2027	USD	198,000	210,557	0.01
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/05/2022	USD	12,905,000	12,897,941	0.30	ViacomCBS, Inc. 4.85% 01/01/2042	USD	150,000	184,582	0.00
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/08/2022	USD	3,460,000	3,456,034	0.08	ViacomCBS, Inc. 5.85% 01/01/2043	USD	945,000	1,299,892	0.03
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/11/2022	USD	16,400,000	16,262,316	0.38	Vistria, Inc., 144A 3.85% 22/06/2040	USD	1,326,000	1,414,944	0.03
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/02/2023	USD	15,076,000	15,027,437	0.35	W000 Trust, Series 2016-150P 'A', 144A 1.80% 10/01/2035	USD	5,294,000	5,845,024	0.14
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/05/2023	USD	11,765,000	11,697,759	0.27	Wavespan Group of America Finance LLC, 144A 1.62% 24/11/2037	USD	1,760,000	1,743,399	0.04
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/08/2023	USD	7,713,000	7,637,472	0.18	Walt Disney Co. (The) 8.875% 26/04/2023	USD	300,000	345,122	0.01
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/11/2023	USD	4,150,000	4,098,269	0.10	Walt Disney Co. (The) 9.5% 15/07/2024	USD	480,000	606,508	0.01
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/02/2024	USD	1,000,000	955,636	0.02	Walt Disney Co. (The) 7.7% 30/09/2025	USD	170,000	215,518	0.01
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/05/2024	USD	100,000	95,009	0.00	Walt Disney Co. (The) 7.825% 30/11/2026	USD	200,000	277,357	0.01
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/08/2024	USD	1,600,000	1,288,747	0.03	Walt Disney Co. (The) 6.4% 12/12/2025	USD	382,000	561,171	0.01
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/11/2024	USD	3,920,000	3,139,295	0.07	Walu Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2003-53 '14'	USD	74,683	76,473	0.00
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/02/2025	USD	3,600,000	2,812,045	0.07	Walu Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-53 '16'	USD	26,042	26,300	0.00
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/05/2025	USD	1,515,000	1,176,777	0.03	Walu Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, FOM, Series 2003-489 '14'	USD	112,229	114,322	0.00
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/08/2025	USD	2,600,000	2,007,039	0.05	Walu Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-52 '24'	USD	80,547	82,924	0.00
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/11/2025	USD	10,000,000	6,123,747	0.14	Walu Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-53 '22'	USD	157,149	160,075	0.00
Udalt Acquisition Sub, Inc. 2.95% 15/06/2026	USD	1,215,000	1,209,905	0.03	Walu Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, FOM, Series 2003-488 'A'	USD	9,040	9,348	0.00
Wende Mortgage Trust, Series 199-2 '10' 6.75% 15/06/2028	USD	143,065	163,655	0.00	Walu Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-52 '24'	USD	116,156	119,503	0.00
Wende Mortgage Trust, Series 199-1 '25' 7% 15/06/2028	USD	18,512	20,537	0.00	Walu Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2003-51 '15'	USD	68,695	70,676	0.00
Verizon Communications, Inc. 1.6% 30/10/2030	USD	585,000	560,440	0.01	Walu Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, FOM, Series 2003-4811 'A6'	USD	167,764	169,853	0.00
Verizon Owner Trust, Series 2018-A 'AAA' 3.25% 20/04/2023	USD	1,387,920	1,368,423	0.03	Walu Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, FOM, Series 2003-485 'A'	USD	101,474	103,489	0.00
Vets Automobile Receivables Trust, Series 2018-1 'C', 144A 4.65% 15/02/2024	USD	1,623,698	1,630,936	0.04	Walu Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, FOM, Series 2003-487 'A'	USD	15,062	15,429	0.00

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に
				占める					占める
				割合(%)					割合(%)
Washington Mutual Mortgage-Backed Pass-Through Certificates WMLT Trust, Series 2005-4 'CD' 5.75 25/06/2035	USD	99,380	100,190	0.00	他の譲渡性有価証券および短期金融市場商品				
Washington Mutual Mortgage-Backed Pass-Through Certificates WMLT Trust, Series 2005-3 'CA' 5.50 25/05/2035	USD	359,542	63,074	0.00	債券				
Wells Fargo & Co., FRN 3.190% 17/06/2027	USD	7,064,000	7,630,556	0.10	アメリカ				
Wells Fargo & Co., FRN 3.060% 30/04/2041	USD	4,290,000	4,407,255	0.10	Camillo 1-A-1 Issuer LLC, Series 2019-SFR1 'A' 5.25% 05/06/2028*	USD	4,311,978	4,435,947	0.10
Wells Fargo & Co., FRN 3.9% 31/12/2164	USD	2,190,000	2,265,281	0.05	Camillo LLC, Series 2019-SFR1 5% 05/12/2027*	USD	4,262,151	4,374,053	0.10
Wepgate Deposits LLC, Series 2017-H 'A', 3444 1.00% 20/10/2030	USD	356,529	356,349	0.01	LY Tower 02 Issuer, Series 2021 'X', 1444 5.75% 05/06/2027*	USD	1,753,328	1,768,389	0.04
World Financial Network Credit Card MasterTrust, Series 2019-C 'X' 3.50% 15/08/2025	USD	2,600,000	2,625,391	0.06	LY Tower 02 Issuer, Series 2021 'Y', 1444 7.75% 05/06/2027*	USD	387,470	390,799	0.01
WFCo, Inc. 3.75% 15/03/2025	USD	800,000	874,806	0.02	債券合計			10,969,168	0.25
Xilinx, Inc. 2.375% 01/06/2030	USD	1,700,000	1,730,316	0.04	他の譲渡性有価証券および短期金融市場商品合計			10,969,168	0.25
Yale-New Haven Health Services Corp. 2.49% 01/07/2030	USD	1,710,000	1,574,781	0.04	UCITSと認められたユニットまたは他の集団投資事業				
			2,237,007,737	52.21	集団投資スキーム - UCITS				
債券合計			2,505,474,670	58.48	集団投資スキーム - UCITS				
コーポレート・ペーパー					ルクセンブルク				
アメリカ					JPMorgan USD Liquidity LVMY Fund - RM USD Liquidity LVMY I (dist.) †	USD	130,078,781	130,078,780	3.04
Resolution Funding Corp. 0% 15/01/2030	USD	4,000,000	3,480,130	0.08	UCITSと認められたユニットまたは他の集団投資事業合計			130,078,780	3.04
Resolution Funding Corp. 0% 15/04/2030	USD	200,000	172,075	0.00	投資有価証券合計			4,305,461,994	100.49
Tennessee Valley Authority 0% 01/11/2025	USD	1,150,000	1,106,096	0.03	現金			(1,422,845)	(0.03)
Tennessee Valley Authority 0% 15/03/2032	USD	800,000	663,719	0.02	その他の資産/(負債)			(19,535,198)	(0.46)
Tennessee Valley Authority 0% 15/06/2035	USD	2,000,000	1,471,634	0.03	純資産合計			4,284,503,851	100.00
			6,894,444	0.16					
コーポレート・ペーパー合計			6,894,444	0.16					
その他の規制市場で取引される譲渡性 有価証券および短期金融市場商品合計			2,512,360,114	58.64					

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

2021年6月30日現在の 投資有価証券の地域別内訳	純資産に 占める割合(%)
アメリカ	86.20
ルクセンブルク	3.20
イギリス	2.04
日本	1.17
ケイマン諸島	1.06
カナダ	1.06
フランス	1.06
アイルランド	0.94
オーストラリア	0.66
メキシコ	0.59
スイス	0.49
オランダ	0.40
ドイツ	0.22
イタリア	0.20
ニュージーランド	0.17
スペイン	0.17
国際機関	0.15
デンマーク	0.14
パナマ	0.08
コロンビア	0.07
サウジアラビア	0.06
ジャージー	0.06
イスラエル	0.06
香港	0.06
バミューダ	0.05
英ヴァージン諸島	0.04
シンガポール	0.04
チリ	0.03
中国	0.02
フィンランド	0.02
スウェーデン	0.01
南アフリカ	—
投資有価証券合計	100.49
現金およびその他資産／(負債)	(0.49)
合計	100.00

TBA契約

国名	証券名	通貨	想定元本	時価 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)	純資産に 占める割合(%)
アメリカ	UMBS, 2.00%, 25/09/2036	USD	13,700,000	14,089,806	27,836	0.33
アメリカ	UMBS, 2.50%, 25/08/2051	USD	37,130,000	38,328,022	89,825	0.89
アメリカ	UMBS, 2.50%, 25/09/2051	USD	72,690,000	74,873,535	181,117	1.75
TBA契約買建合計				127,291,363	298,778	2.97
TBA契約純値				127,291,363	298,778	2.97

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

先渡為替契約明細表

買建通貨	買建価	売建通貨	売建価	満期日	カウンター パーティー	未実現損益 (米ドル)	純資産に 占める割合(%)
EUR	2,469,944	USD	2,931,463	06/07/2021	BNP Paribas	1,644	—
GBP	8,556	USD	11,815	06/07/2021	Barclays	27	—
SGD	26,564	USD	19,730	06/07/2021	HSBC	32	—
SGD	11,793,282	USD	8,789,281	04/08/2021	Citibank	3,268	—
USD	307,165	AUD	409,335	06/07/2021	Standard Chartered	31	—
USD	943	AUD	1,219	06/07/2021	State Street	28	—
USD	932	AUD	1,237	06/07/2021	Toronto-Dominion Bank	4	—
USD	1,064	CHF	966	06/07/2021	State Street	29	—
USD	660,388	EUR	545,234	01/07/2021	Toronto-Dominion Bank	2,967	—
USD	2,369,967	EUR	1,990,570	06/07/2021	Barclays	6,126	—
USD	1,295,688,137	EUR	1,090,028,346	06/07/2021	BNP Paribas	1,258,016	0.03
USD	2,084,389	EUR	1,721,315	06/07/2021	Citibank	40,294	—
USD	2,244,161	EUR	1,836,945	06/07/2021	Goldman Sachs	62,753	—
USD	2,620	EUR	2,205	06/07/2021	Merrill Lynch	2	—
USD	3,086,233	EUR	2,532,729	06/07/2021	RBC	78,568	—
USD	440,951	EUR	370,293	06/07/2021	Standard Chartered	1,221	—
USD	13,420,630	EUR	11,018,099	06/07/2021	State Street	336,420	0.01
USD	2,345,745	EUR	1,924,068	06/07/2021	Toronto-Dominion Bank	60,888	—
USD	95,102,901	EUR	79,860,738	04/08/2021	RBC	446,316	0.01
USD	20,744,555	EUR	17,349,891	04/08/2021	State Street	128,697	0.01
USD	2,914	EUR	2,439	04/08/2021	Toronto-Dominion Bank	16	—
USD	5,247,747	GBP	3,785,704	06/07/2021	Barclays	8,124	—
USD	19,639	GBP	13,913	06/07/2021	RBC	383	—
USD	9,398	GBP	6,624	06/07/2021	Toronto-Dominion Bank	229	—
USD	21,751	JPY	2,390,298	06/07/2021	BNP Paribas	155	—
USD	52,279	JPY	5,735,511	06/07/2021	Citibank	460	—
USD	11,925,684	JPY	1,317,499,689	06/07/2021	Goldman Sachs	22,278	—
USD	7,122	SGD	9,455	06/07/2021	BNP Paribas	88	—
USD	25,886	SGD	34,272	06/07/2021	HSBC	390	—
USD	46,234	SGD	61,538	06/07/2021	State Street	454	—
先渡為替契約未実現利益合計						2,459,908	0.06
AUD	1,369	USD	1,062	06/07/2021	Barclays	(34)	—
AUD	1,018	USD	791	06/07/2021	BNP Paribas	(27)	—
AUD	1,415	USD	1,096	06/07/2021	Citibank	(34)	—
AUD	1,480	USD	1,141	06/07/2021	HSBC	(31)	—
AUD	406,509	USD	314,290	06/07/2021	State Street	(9,277)	—
AUD	409,335	USD	307,207	04/08/2021	Standard Chartered	(29)	—
CHF	1,085	USD	1,207	06/07/2021	Barclays	(33)	—
CHF	179,932	USD	200,666	06/07/2021	Merrill Lynch	(5,876)	—
CHF	1,497	USD	1,668	06/07/2021	Standard Chartered	(47)	—
EUR	298,043	USD	354,461	02/07/2021	State Street	(559)	—
EUR	1,046	USD	1,270	06/07/2021	BNP Paribas	(28)	—
EUR	488,153,001	USD	595,639,899	06/07/2021	Citibank	(15,948,599)	(0.37)
EUR	597,612,118	USD	729,260,689	06/07/2021	Goldman Sachs	(19,584,533)	(0.46)
EUR	1,682,711	USD	2,051,809	06/07/2021	HSBC	(53,556)	—
EUR	11,406,134	USD	13,906,396	06/07/2021	RBC	(360,388)	(0.01)

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2021年6月30日現在

先渡為替契約明細表

買建通貨	買建価	売建通貨	売建価	満期日	カウンター パーティー	未実現損益 (米ドル)	純資産に 占める割合(%)
EUR	5,861,631	USD	6,847,111	06/07/2021	State Street	(123,812)	—
EUR	4,805,492	USD	5,874,307	06/07/2021	Tomoto-Dominio Bank	(167,690)	(0.01)
EUR	1,088,731,580	USD	1,294,863,307	04/08/2021	BNP Paribas	(1,187,402)	(0.03)
EUR	1,196	USD	1,430	04/08/2021	Merrill Lynch	(9)	—
EUR	178,139	USD	212,960	04/08/2021	State Street	(1,278)	—
EUR	545,234	USD	650,837	04/08/2021	Tomoto-Dominio Bank	(2,968)	—
GBP	30,739	USD	43,509	06/07/2021	Barclays	(964)	—
GBP	3,755,279	USD	5,327,250	06/07/2021	BNP Paribas	(129,737)	—
GBP	11,667	USD	16,469	06/07/2021	RBC	(321)	—
GBP	3,778,839	USD	5,238,605	04/08/2021	Barclays	(8,090)	—
JPY	1,298,741,754	USD	11,829,240	06/07/2021	BNP Paribas	(95,309)	—
JPY	9,200,000	USD	84,511	06/07/2021	HSBC	(1,390)	—
JPY	2,826,296	USD	25,822	06/07/2021	State Street	(287)	—
JPY	14,857,449	USD	136,060	06/07/2021	Tomoto-Dominio Bank	(1,825)	—
JPY	1,312,599,689	USD	11,883,817	04/08/2021	Goldman Sachs	(21,712)	—
SGD	11,738,803	USD	8,872,321	06/07/2021	Citibank	(139,575)	(0.01)
SGD	5,439	USD	4,109	06/07/2021	HSBC	(63)	—
SGD	18,869	USD	14,246	06/07/2021	RBC	(209)	—
SGD	78,983	USD	59,631	06/07/2021	State Street	(874)	—
SGD	29,870	USD	22,565	06/07/2021	Tomoto-Dominio Bank	(344)	—
SGD	32,670	USD	24,308	04/08/2021	BNP Paribas	(6)	—
SGD	16,830	USD	12,542	04/08/2021	HSBC	(23)	—
USD	436,198	EUR	367,519	06/07/2021	State Street	(238)	—
USD	8,769,871	SGD	11,793,262	06/07/2021	Citibank	(3,387)	—
先渡為替契約の未実現損失合計						(37,850,564)	(0.89)
先渡為替契約の未実現純損失						(35,390,656)	(0.83)

JPM US Aggregate Bond X (mth) - JPY

直近計算期間におけるTER(総費用率)

2021年6月30日現在

0.1%

(注) TER(総費用率)は、運用にかかる費用の合計をファンドの純資産の日次平均に対する比率で表したものです。

運用にかかる費用の合計には、保管報酬、税金、その他費用が含まれております。

当座貸越利息と実績報酬は計算対象から除いております。日々の純資産に対してかかる年率0.45%の運用報酬は含みません。

(注) 1万口当たりの費用明細が取得できないため、TER(総費用率)を表示しています。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(2022年6月1日現在)

種類	金額	単位
資産総額	432,570,590	円
負債総額	188,487	円
純資産総額(-)	432,382,103	円
発行済口数	381,993,873	口
1口当たり純資産額(/)	1.1319	円

(参考) G I M U S コア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)

(2022年6月1日現在)

種類	金額	単位
資産総額	1,389,955,315	円
負債総額	12,404,343	円
純資産総額(-)	1,377,550,972	円
発行済口数	1,155,838,455	口
1口当たり純資産額(/)	1.1918	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（2021年12月末現在）

（略）

（略）

投資運用の意思決定機構

（略）

（注）前記（イ）および（ロ）の意思決定機構、組織名称等は、2022年1月4日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 訂正後 >

資本金の額（2022年6月末現在）

（略）

（略）

投資運用の意思決定機構

（略）

（注）前記（イ）および（ロ）の意思決定機構、組織名称等は、2022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。

2【事業の内容及び営業の概況】

届出書「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、2022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	58	667,833
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	71	4,979,510
総合計	129	5,647,343
親投資信託	50	-

(注) 百万円未満は四捨五入

3【委託会社等の経理状況】

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、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・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。

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32期事業年度（2021年4月1日から2022年3月31日まで）の財務諸表について、P w Cあらた有限責任監査法人による監査を受けておりません。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第31期 (2021年 3 月31日)	第32期 (2022年 3 月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	18,142,958	18,159,513
前払費用	21,674	14,017
未収入金	8,485	18,237
未収委託者報酬	2,100,011	1,938,156
未収収益	2,599,647	956,791
関係会社短期貸付金	1,700,000	1,000,000
その他	4,938	14,727
流動資産合計	24,577,716	22,101,444
固定資産		
有形固定資産		
器具備品	21,892	21,892
器具備品減価償却累計額	12,845	16,377
有形固定資産計	9,046	5,514
投資その他の資産		
関係会社株式	60,000	60,000
投資有価証券	192,744	2,343,640
敷金保証金	83,967	76,522
前払年金費用	150,945	189,042
繰延税金資産	393,031	891,939
その他	8,754	5,500
投資その他の資産合計	889,443	3,566,646
固定資産合計	898,490	3,572,160
資産合計	25,476,207	25,673,604

(単位：千円)

	第31期 (2021年3月31日)	第32期 (2022年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	152,810	172,706
未払金	1,657,429	3,043,065
未払手数料	969,445	900,327
その他未払金	687,983	2,142,738
未払費用	513,505	154,360
未払法人税等	1,604,718	582,160
賞与引当金	852,844	924,994
役員賞与引当金	66,485	54,793
流動負債合計	4,847,794	4,932,080
固定負債		
長期未払金	230,152	259,178
賞与引当金	468,136	743,912
役員賞与引当金	132,202	128,761
固定負債合計	830,491	1,131,851
負債合計	5,678,285	6,063,932
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,218,000	2,218,000
資本剰余金		
資本準備金	1,000,000	1,000,000
資本剰余金合計	1,000,000	1,000,000
利益剰余金		
利益準備金	33,676	33,676
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	16,546,042	16,475,344
利益剰余金合計	16,579,718	16,509,020
株主資本合計	19,797,718	19,727,020
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	202	117,348
評価・換算差額等合計	202	117,348
純資産合計	19,797,921	19,609,672
負債・純資産合計	25,476,207	25,673,604

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)	第32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	11,210,022	11,638,721
運用受託報酬	9,990,252	7,817,385
業務受託報酬	1,781,474	2,379,908
その他営業収益	93,012	132,493
営業収益合計	23,074,762	21,968,508
営業費用		
支払手数料	5,711,697	5,885,809
広告宣伝費	92,591	105,330
調査費	1,989,635	1,887,761
委託調査費	1,704,125	1,597,303
調査費	267,484	273,818
図書費	18,025	16,638
委託計算費	279,663	263,612
営業雑経費	202,218	182,365
通信費	12,892	8,534
印刷費	147,956	138,892
協会費	41,369	34,938
営業費用合計	8,275,806	8,324,879
一般管理費		
給料	5,189,294	5,437,200
役員報酬及び賞与	282,890	325,451
給料・手当	2,896,911	2,845,134
賞与	867,658	1,166,857
賞与引当金繰入額	1,070,437	1,021,409
役員賞与引当金繰入額	71,396	78,348
福利厚生費	376,875	373,895
交際費	12,096	12,247
寄付金	16,761	10,608
旅費交通費	687	3,585
租税公課	171,713	152,691
不動産関連費用	1,071,717	1,074,147
退職給付費用	195,441	179,059
退職金	215,744	48,776
消耗器具備品費	19,208	10,588
事務委託費	246,791	214,091
関係会社等配賦経費	2,096,413	2,065,052
減価償却費	6,092	3,532
諸経費	70,894	89,441
一般管理費合計	9,689,732	9,674,918
営業利益	5,109,223	3,968,710

（単位：千円）

		第31期 （自2020年4月1日 至2021年3月31日）	第32期 （自2021年4月1日 至2022年3月31日）
営業外収益			
受取配当金	1	352,360	24
投資有価証券売却益		268	0
受取利息	1	8,463	5,171
為替差益		27,896	-
その他営業外収益		326	11,371
営業外収益合計		389,316	16,567
営業外費用			
為替差損		-	128,721
その他営業外費用		2,756	-
営業外費用合計		2,756	128,721
経常利益		5,495,782	3,856,556
税引前当期純利益		5,495,782	3,856,556
法人税、住民税及び事業税		1,960,274	1,474,283
法人税等調整額		427,280	447,028
法人税等合計		1,532,993	1,027,254
当期純利益		3,962,788	2,829,301

(3) 【株主資本等変動計算書】

第31期（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	2,218,000	1,000,000	1,000,000	33,676	14,583,253	14,616,930	17,834,930
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	-	2,000,000	2,000,000	2,000,000
当期純利益	-	-	-	-	3,962,788	3,962,788	3,962,788
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	1,962,788	1,962,788	1,962,788
当期末残高	2,218,000	1,000,000	1,000,000	33,676	16,546,042	16,579,718	19,797,718

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有 価証券評 価差額金	評価・換 算差額等 合計	
当期首残高	54	54	17,834,985
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	2,000,000
当期純利益	-	-	3,962,788
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	147	147	147
当期変動額合計	147	147	1,962,936
当期末残高	202	202	19,797,921

第32期（自2021年4月1日 至2022年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	2,218,000	1,000,000	1,000,000	33,676	16,546,042	16,579,718	19,797,718
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	-	2,900,000	2,900,000	2,900,000
当期純利益	-	-	-	-	2,829,301	2,829,301	2,829,301
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	70,698	70,698	70,698
当期末残高	2,218,000	1,000,000	1,000,000	33,676	16,475,344	16,509,020	19,727,020

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	202	202	19,797,921
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	2,900,000
当期純利益	-	-	2,829,301
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	117,550	117,550	117,550
当期変動額合計	117,550	117,550	188,249
当期末残高	117,348	117,348	19,609,672

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（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。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

期末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。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

従業員に対する賞与の支給に備えるため、当事業年度に帰属する額を計上しております。

（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、当事業年度に帰属する額を計上しております。

（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、当事業年度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、当事業年度末においては、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事業年度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。

過去勤務費用については、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。

3．固定資産の減価償却の方法

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。

器具備品 5年

4．収益及び費用の計上基準

当社は、投資運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬、業務受託報酬およびその他営業収益を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

委託者報酬：当該報酬は投資信託の信託約款に基づき日々の純資産価額を基礎として算定し、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

運用受託報酬：当該報酬は対象顧客との投資一任契約等に基づき純資産価額を基礎として算定し、対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

業務受託報酬およびその他営業収益：グループ会社から受領する収益は、当社のグループ会社との契約で定められた算式に基づき月次で算定し、当該報酬は当社がグループ会社にオフショアファンド関連のサービス等を提供する期間にわたり収益として認識しております。

成功報酬：成功報酬は対象となるファンドまたは口座の運用益に対する一定割合、もしくは特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は契約上支払われることが確定した時点で収益として認識しております。

5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

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。

（会計方針の変更に関する注記）

「収益認識に関する会計基準」を当期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。これによる当期の財務諸表に与える影響はありません。

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」といいます。）等を当期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号2019年7月4日）第44 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。これによる当期の財務諸表に与える影響はありません。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当事業年度の財務諸表等の作成にあたって行った会計上の見積りが当事業年度の翌事業年度の財務諸表等に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表関係）

関係会社に対する資産及び負債

第31期 (2021年3月31日)	第32期 (2022年3月31日)
関係会社に対する資産および負債には区分掲記されたものの以外に注記すべき事項はありません。	関係会社に対する資産および負債には区分掲記されたものの以外に注記すべき事項はありません。

（損益計算書関係）

1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	第31期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)	第32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)
関係会社からの受取利息	8,463千円	5,171千円
関係会社からの受取配当金	344,000千円	- 千円

（株主資本等変動計算書関係）

第31期（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	56,265	-	-	56,265
合計	56,265	-	-	56,265

2．配当に関する事項

配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
2020年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,000,000	35,546	2020年3月31日	2020年6月26日

第32期（自2021年4月1日 至2022年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	56,265	-	-	56,265
合計	56,265	-	-	56,265

2．配当に関する事項

配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり配当額 （円）	基準日	効力発生日
2021年6月24日 定時株主総会	普通株式	2,900,000	51,541	2021年3月31日	2021年6月28日

（リース取引関係）

第31期 （自2020年4月1日 至2021年3月31日）	第32期 （自2021年4月1日 至2022年3月31日）						
該当事項はありません。	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。 <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="padding-right: 20px;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">2,087千円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td style="text-align: right;">7,133千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">9,221千円</td> </tr> </table>	1年以内	2,087千円	1年超	7,133千円	合計	9,221千円
1年以内	2,087千円						
1年超	7,133千円						
合計	9,221千円						

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

自社が設定する投資信託やグループ会社が運用する投資信託について、その設定時に運用上十分な信託財産があることが見込めない場合に、「シードキャピタル」として当該投資信託を自己資金により取得することがあります。

当社は、営業活動援助のため、子会社であるJPMAMジャパン・ケイマン・ファンド・リミテッドへの短期貸付を行っております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

営業債権のうち、自社が設定・運用する投資信託から受領する未収委託者報酬、及び未収収益のうち国内年金基金等から受領する債権については信託銀行により分別管理されている信託財産から回収され、一般債権とは異なり、信用リスクは極めて低いと認識しております。海外グループ会社に対する未収収益は未払費用と部分的に相殺され、信用リスクが軽減されております。また、外貨建て債権の未収収益については為替の変動リスクに晒されておりますが、外貨建て債務と部分的に相殺され、為替変動リスクが軽減されております。

営業債務である未払金は基本的に3ヶ月以内の支払い期日であり、未払手数料、及び未払費用についてはそのほとんどが6ヶ月以内の支払い期日であります。一部外貨建てのものについては、為替の変動リスクに晒されておりますが、上述の通り外貨建て債権と部分的に相殺され、リスクが軽減されております。

関係会社に対し短期貸付を行っており、関係会社短期貸付金は貸出先の信用リスクに晒されております。関係会社短期貸付金は、3ヶ月の期日であり、金利の変動リスクは僅少です。

投資有価証券のうち、上述のシードキャピタルは、市場価格の変動リスクに晒されております。

敷金保証金は建物等の賃貸契約に関連する保証金であり、差入先の信用リスクに晒されております。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権のうち、海外グループ会社に対する未収収益は担当部署が各関係会社ごとに期日及び残高を定期的に管理し、回収懸念の早期把握を図っております。

関係会社短期貸付金は、子会社であるJPMAMジャパン・ケイマン・ファンド・リミテッドの営業活動から得られるキャッシュ・フローをモニタリングしており、貸倒や回収遅延の懸念はほぼないと認識しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

外貨建ての営業債権債務のうち、大半を占める米国ドル建ての債権債務に対しての為替変動リスクについては担当部署が月次でモニタリングしており、債権もしくは債務の超過に対して米国ドル建て預金と円建て預金との間で資金移動をして為替変動リスクの軽減に努めております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

各部署からの報告に基づき担当部署が適宜資金繰計画を作成・更新するとともに、手許流動性の維持などにより流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

(1) 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、「市場価格のない株式等」は次表には含めておりません（（注2）参照）。

第31期（2021年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
長期未払金	230,152	230,152	-
負債計	230,152	230,152	-

（注1）時価と貸借対照表計上額との差額の表への記載を省略しているものとその理由

資産

「現金及び預金」「未収委託者報酬」「未収収益」「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が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しています。

負債

「未払手数料」「その他未払金」「未払費用」

これらは短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しています。

（注2）市場価格のない株式等

下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、市場価格のない株式等と認められるため、上表に含めておりません。

（単位：千円）

	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）	188,432

第32期（2022年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
投資有価証券	2,034,881	2,034,881	-
資産計	2,034,881	2,034,881	-
長期未払金	259,178	259,178	-
負債計	259,178	259,178	-

（注1）時価と貸借対照表計上額との差額の表への記載を省略しているものとその理由

資産

「現金及び預金」「未収委託者報酬」「未収収益」「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が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しています。

負債

「未払手数料」「その他未払金」「未払費用」

これらは短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しています。

（注2）市場価格のない株式等

下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、市場価格のない株式等と認められるため、上表に含めておりません。

（単位：千円）

	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）	308,759

（2）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もあります。

（3）金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接又は間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価をもって貸借対照表計上額とする金融商品以外の金融商品

第31期（2021年3月31日）

（単位：千円）

	レベル1	レベル2	レベル3	合計
長期未払金	-	230,152	-	230,152
負債計	-	230,152	-	230,152

第32期（2022年3月31日）

（単位：千円）

	レベル1	レベル2	レベル3	合計
長期未払金	-	259,178	-	259,178
負債計	-	259,178	-	259,178

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

「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信用リスクを加味した利率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。これに伴い、レベル2の時価に分類しております。

なお、（金融商品関係）の「2．金融商品の時価等に関する事項」に記載の「投資有価証券」は、投資信託受益証券であり、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」第26項の経過措置を適用しており、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」第5 - 2項の注記を行っておりません。

当該投資信託受益証券の貸借対照表計上額は（金融商品関係）の「2．金融商品の時価等に関する事項」に記載しております。

3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第31期(2021年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	18,142,958	-	-	-
未収委託者報酬	2,100,011	-	-	-
未収収益	2,599,647	-	-	-
関係会社短期貸付金	1,700,000	-	-	-
合計	24,542,617	-	-	-

第32期(2022年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	18,159,513	-	-	-
未収委託者報酬	1,938,156	-	-	-
未収収益	956,791	-	-	-
関係会社短期貸付金	1,000,000	-	-	-
合計	22,054,462	-	-	-

（有価証券関係）

1．関係会社株式

関係会社株式（第31期の貸借対照表計上額は60,000千円、第32期の貸借対照表計上額は60,000千円）については市場価格のない株式等と認められるため、記載しておりません。

2．その他有価証券

第31期（2021年3月31日）

投資有価証券（合同会社出資金）（貸借対照表計上額 188,432千円）については市場価格のない株式等と認められるため、次表には記載しておりません。

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他投資信託	4,312	4,020	292
合計		4,312	4,020	292

第32期（2022年3月31日）

投資有価証券（合同会社出資金）（貸借対照表計上額 308,759千円）については市場価格のない株式等と認められるため、次表には記載しておりません。

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他投資信託	5,415	5,010	405
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他投資信託	2,029,466	2,199,010	169,543
合計		2,034,881	2,204,020	169,138

3．当事業年度中に売却したその他有価証券

第31期（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他投資信託	3,768	268	-

第32期（自2021年4月1日 至2022年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他投資信託	10	0	-

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は確定拠出型年金制度、及びキャッシュバランス型年金制度を採用しております。

2. キャッシュバランス型年金制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第31期 (2021年3月31日)	第32期 (2022年3月31日)
	(千円)	(千円)
退職給付債務の期首残高	1,395,783	1,464,414
勤務費用	167,249	161,163
利息費用	6,979	7,322
数理計算上の差異の発生額	53,192	13,354
退職給付の支払額	158,789	84,742
退職給付債務の期末残高	1,464,414	1,561,511

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第31期 (2021年3月31日)	第32期 (2022年3月31日)
	(千円)	(千円)
年金資産の期首残高	1,604,595	1,776,761
期待運用収益	8,023	5,330
数理計算上の差異の発生額	149,600	78,815
事業主からの拠出額	173,332	161,872
退職給付の支払額	158,789	84,742
年金資産の期末残高	1,776,761	1,780,406

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

	第31期 (2021年3月31日)	第32期 (2022年3月31日)
	(千円)	(千円)
積立型制度の退職給付債務	1,464,414	1,561,511
年金資産	1,776,761	1,780,406
	312,347	218,895
未認識数理計算上の差異	161,402	29,853
未認識過去勤務費用	-	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	150,945	189,042
前払年金費用	150,945	189,042
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	150,945	189,042

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第31期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)	第32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)
	(千円)	(千円)
勤務費用	167,249	161,163
利息費用	6,979	7,322
期待運用収益	8,023	5,330
数理計算上の差異の費用処理額	32,260	39,380
過去勤務債務の費用処理額	-	-
その他(注1)	1,303	1,758
キャッシュバランス型年金制度に係る退職給付費用(注2)	135,248	125,533

(注1) その他の金額は、主に当社への出向者分の退職給付費用であります。

(注2) 当社からの出向者分の退職給付費用は、上記金額に含まれておりません。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第31期 (2021年3月31日)	第32期 (2022年3月31日)
債券	13%	30%
現金及び預金	87%	70%
合計	100%	100%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	第31期 (2021年3月31日)	第32期 (2022年3月31日)
主要な数理計算上の計算基礎		
割引率	0.5%	0.5%
長期期待運用収益率	0.5%	0.3%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第31期事業年度60,193千円、第32期事業年度53,526千円であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第31期 (2021年3月31日)	第32期 (2022年3月31日)
繰延税金資産	(千円)	(千円)
賞与引当金	391,656	494,974
未払費用	82,101	92,420
未払事業税	86,823	43,648
長期前払費用	100,644	108,639
減価償却超過額	146,344	156,941
その他有価証券評価差額金	-	51,790
その他	6,254	6,965
繰延税金資産小計	813,822	955,380
評価性引当額	374,481	5,556
繰延税金資産合計	439,340	949,824
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	46,309	57,884
繰延税金資産又は繰延税金負債()の純額	393,031	891,939

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	第31期 (2021年3月31日)	第32期 (2022年3月31日)
法定実効税率	30.62%	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.85%	5.45%
評価性引当額	4.81%	9.56%
住民税等均等割	0.08%	0.09%
過年度法人税等	0.16%	0.03%
その他	0.01%	0.00%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.90%	26.63%

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであり、顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、以下のとおりであります。

第31期（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

（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
残高報酬	11,210,022	7,849,150	1,781,474	93,012	20,933,660
成功報酬	-	2,141,101	-	-	2,141,101
合計	11,210,022	9,990,252	1,781,474	93,012	23,074,762

第32期（自2021年4月1日 至2022年3月31日）

（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
残高報酬	11,638,721	7,767,763	2,379,908	132,493	21,918,886
成功報酬	-	49,621	-	-	49,621
合計	11,638,721	7,817,385	2,379,908	132,493	21,968,508

（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31期（自2020年4月1日 至2021年3月31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	11,210,022	9,990,252	1,781,474	93,012	23,074,762

2．地域ごとの情報

営業収益

（単位：千円）

日本	英国	香港	その他	合計
12,799,203	4,977,728	3,394,022	1,903,807	23,074,762

（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 (UK) Limited	4,966,592	資産運用業
JPMorgan Asset Management (Asia Pacific) Limited	3,333,286	資産運用業

第32期（自2021年4月1日 至2022年3月31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	11,638,721	7,817,385	2,379,908	132,493	21,968,508

2．地域ごとの情報

営業収益

(単位：千円)

日本	英国	香港	その他	合計
12,737,897	3,941,639	2,874,061	2,414,909	21,968,508

(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 (UK) Limited	3,923,766	資産運用業
JPMorgan Asset Management (Asia Pacific) Limited	2,802,256	資産運用業

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

第31期（自2020年4月1日 至2021年3月31日）

親会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	J P モルガン・チェース・ホールディングス・エルエルシー	米国 ニューヨーク	213,649 百万米ドル	持株会社	被所有 間接 100%	人件費の立替	-	-	未払金	391,741

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

当社の役職員への賞与の支払いの一部はJ P モルガン・チェース・ホールディングス・エルエルシー（以下、「親会社」という。）により行われております。これらの費用は親会社より当社に請求されるものであり、未払いの金額については親会社に対する債務として処理しております。

子会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
子会社	JPMAMジャパン・ケイマン・ファン・ド・リミテッド	英国領 ケイマン諸島 グランドケイマン	3,500千円	外国投資 信託の管理 会社としての 業務	所有 直接 100%	資金の貸借等 及び役員の兼 任	資金の貸付 （注）	8,000,000	関係会社 短期貸付金	1,700,000
							資金の回収	9,100,000		
							受取利息	8,463	未収収益	17
							配当の受取	344,000	-	-

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

資金の貸付については、貸付利率は市場金利を勘案して利率を合理的に決定しており、返済条件は期間3ヶ月であります。なお、担保は受け入れておりません。

兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
最終的な親会社がある会社	JPMorgan Asset Management (UK) Limited	英国 ロンドン	24百万 ポンド	投資運用業	なし	投資の助言または投資一任	運用受託報酬	4,733,256	未収収益	790,138
							調査費	994,861	未払費用	299,344
最終的な親会社がある会社	JPMorgan Asset Management (Asia Pacific) Limited	香港 セントラル	60百万 香港ドル	投資運用業	なし	投資の助言または投資一任	運用受託報酬	3,325,196	未収収益	968,603

（注1）取引金額および期末残高には、消費税等は含まれておりません。

（注2）取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬及び調査費に関しては、運用の再委託の一般的な手数料率を勘案し、協議の上、再委託契約を結んで行っております。

第32期（自2021年4月1日 至2022年3月31日）

親会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	J Pモルガン・チェース・ホールディングス・エルエルシー	米国 ニューヨーク	214,618 百万米ドル	持株会社	被所有 間接 100%	人件費の立替	-	-	未払金	419,815

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

当社の役員への賞与の支払いの一部はJ Pモルガン・チェース・ホールディングス・エルエルシー（以下、「親会社」という。）により行われております。これらの費用は親会社より当社に請求されるものであり、未払いの金額については親会社に対する債務として処理しております。

子会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
子会社	JPMAMジャパン・ケイマン・ファン・ド・リミテッド	英国領 ケイマン諸島 グランドケイマン	3,500千円	外国投資信託の管理会社としての業務	所有 直接 100%	資金の貸借等及び役員の兼任	資金の貸付（注）	5,000,000	関係会社 短期貸付金	1,000,000
							資金の回収	5,700,000		
							受取利息	5,171	未収収益	10
							配当の受取	-	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

資金の貸付については、貸付利率は市場金利を勘案して利率を合理的に決定しており、返済条件は期間3ヶ月であります。なお、担保は受け入れておりません。

兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
最終的な親会社 が同一である 会社	JPMorgan Asset Management (UK) Limited	英国 ロンドン	24百万 ポンド	投資運用業	なし	投資の助言または投資一任	運用受託報酬	3,567,211	未収収益	291,744
							調査費	1,133,637	未払金	1,448,636
最終的な親会社 が同一である 会社	JPMorgan Asset Management (Asia Pacific) Limited	香港 セントラル	2,790百万 香港ドル	投資運用業	なし	投資の助言または投資一任	運用受託報酬	2,794,833	未収収益	123,299

(注1) 取引金額および期末残高には、消費税等は含まれておりません。

(注2) 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬及び調査費に関しては、運用の再委託の一般的な手数料率を勘案し、協議の上、再委託契約を結んで行っております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

直接親会社 J Pモルガン・アセット・マネジメント（アジア）インク（非上場）

最終的な親会社 J Pモルガン・チェース・アンド・カンパニー（ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所に上場）

（ 1 株当たり情報）

	第31期 （自2020年4月1日 至2021年3月31日）	第32期 （自2021年4月1日 至2022年3月31日）
1株当たり純資産額	351,869.22円	348,523.46円
1株当たり当期純利益	70,430.80円	50,285.28円

なお、当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

1株当たりの当期純利益の算定上の基礎

	第31期 （自2020年4月1日 至2021年3月31日）	第32期 （自2021年4月1日 至2022年3月31日）
損益計算書上の当期純利益	3,962,788千円	2,829,301千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,962,788千円	2,829,301千円
普通株式の期中平均株式数	56,265株	56,265株

（重要な後発事象に関する注記）

該当ありません。

独立監査人の監査報告書

2022年7月20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
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

監査意見

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 J P M U S コア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）の2021年11月16日から2022年5月16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。

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、J P M U S コア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）の2022年5月16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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

J P 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 . 上記の監査報告書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](#)

独立監査人の監査報告書

2022年6月6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
東京事務所指定有限責任社員
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

監査意見

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2021年4月1日から2022年3月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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、J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査役への責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役への責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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. 上記の監査報告書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。