

【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】 2023年 8 月14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（為替ヘッジあり、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、2023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）	
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* <sup>2</sup> （米国法人）（以下「JPMIM社」という場合があります。） 2022年12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。

（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* <sup>2</sup> （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* <sup>2</sup> （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。） 2022年12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。

（以下略）

<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）	
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* <sup>2</sup> （米国法人）（以下「JPMIM社」という場合があります。） 2023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。

（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)  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(U K)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。 )。  2023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>
------	--

(以下略)

### (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 (2022年12月末現在)

(略)

大株主の状況 (2022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 (2023年6月末現在)

(略)

大株主の状況 (2023年6月末現在)

(以下略)

## 2 【投資方針】

### (1) 投資方針

#### (ロ) 投資態度

投資先ファンドの投資態度および運用プロセス

米国総合債券ファンド

<訂正前>

(略)

(ESG\*投資について)

当該投資先ファンドの運用プロセスにおいて、環境、社会、そしてガバナンス面(企業統治)の要素が、投資対象候補銘柄のキャッシュ・フローに大きくプラスあるいはマイナスの影響を与える可能性があるかどうか、あるいは何らかのリスク要因となり得るかどうかを分析・評価しています。なお、こうした評価のみが投資判断を決定付けるものではなく、当該評価の低い発行会社の有価証券の組み入れまたは継続保有、あるいは当該評価の高い発行会社の有価証券を売却または保有しない可能性があります。

\* 「ESG」とは、環境(Environment)、社会(Social)、ガバナンス(Governance)の頭文字を合わせたものをいいます。

(以下略)

<訂正後>

(略)

## （ E S G \*投資について ）

投資先ファンドの運用会社は、投資先ファンドの運用プロセスの一環として、財務的に重要な環境、社会、ガバナンス面（企業統治）（ E S G ）の要素を組み入れています（これらの要素の運用プロセスへの組み入れを「 E S G インテグレーション」といいます。以下同じ）。 E S G インテグレーションは、銘柄分析と投資判断に E S G の要素を体系的に統合するものです。運用プロセスの一環として、投資先ファンドの運用会社のポートフォリオ・マネジャーは、環境、社会、ガバナンス面の各要素が、投資先ファンドの投資対象の発行会社または国・地域等の発行体に与える影響を評価します。投資先ファンドの運用会社のポートフォリオ・マネジャーは、各業界の主要な投資機会とリスクを分析することで、発行会社等にかかる E S G の要素のうち財務的に重要性が高い要因を特定し、当該会社等との対話に役立つ重要な問題を確認します。これらの評価は決定的なものではなく、これらの要素により悪影響を受ける可能性のある発行会社または国・地域等の発行体の有価証券に投資を行い保有することがあります。一方、投資先ファンドは、これらの要素によりプラスの影響を受ける可能性のある発行会社または国・地域等の発行体の有価証券であっても、それらを売却することや投資しないことがあります。特に、 E S G インテグレーションは、投資先ファンドの投資目的を変更するものではなく、特定の業種や企業を除外したり、投資先ファンドの投資対象を制限したりするものでもありません。投資先ファンドは、特定の種類の企業もしくは投資対象を除外したい、または特定の E S G 目標を実現するファンドを探している投資家のために設計されているものではありません。

\* 「 E S G 」とは、環境（ Environment ）、社会（ Social ）、ガバナンス（ Governance ）の頭文字を合わせたものをいいます。

（以下略）

## （ 2 ）投資対象

&lt;訂正前&gt;

（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12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・マネージメント（UK）リミテッド（英国法人）に委託します。 2022年12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。

&lt;訂正後&gt;

（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) 2023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。 2023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

委託会社の運用商品管理部門(約30名)に所属する、ポートフォリオ・マネジャーがマザーファンドの運用を行います。

(略)

(注) 前記の運用体制、組織名称等は、2022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。

(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、2022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(2022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(UK)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

委託会社の運用商品管理部門（約40名）に所属する、ポートフォリオ・マネジャーがマザーファンドの運用を行います。

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2023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、JPMIM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（2023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、2023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（2023年3月末現在））に所属するJPモルガン・アセット・マネジメント（UK）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、2023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。

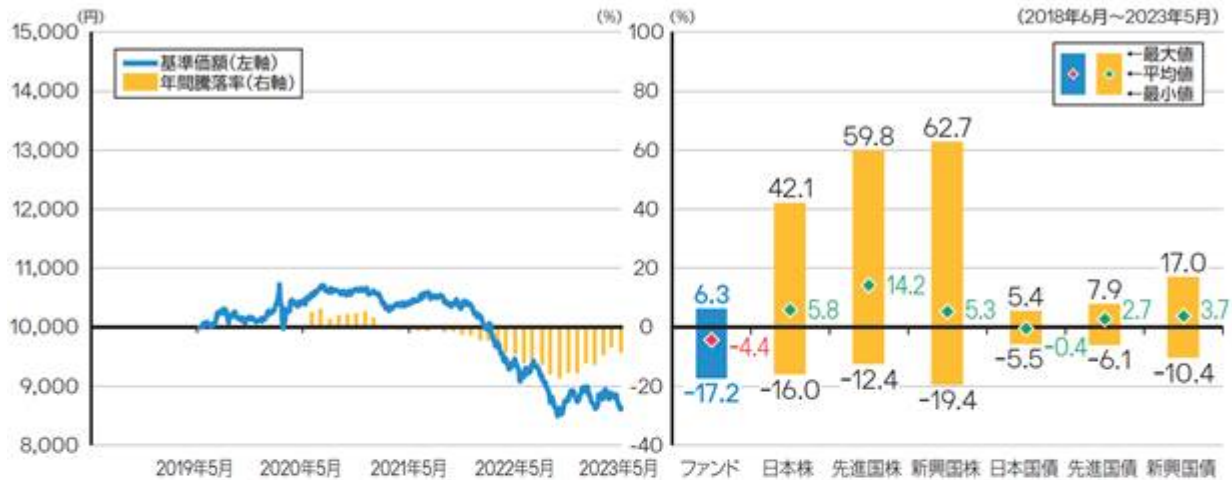
## ＜ファンドの基準価額・年間騰落率の推移＞

2018年6月～2023年5月の5年間に於ける、ファンドの基準価額（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)

- 基準価額は、信託報酬控除後です。
- 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・ローナル (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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属しております。また、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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・ローナルは、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)

(2022年12月末現在)

(略)

マネープール・ファンド

(略)

(2022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)

(2023年6月末現在)

(略)

マネープール・ファンド

(略)

(2023年6月末現在)

(以下略)

#### 4【手数料等及び税金】

(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2022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。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)

<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2023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

(2023年12月31日まで)

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。

(2024年1月1日以降)

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、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無期限で非課税となります。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。また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。

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。

上記は2023年6月末現在のものです。税法が改正された場合等には変更される場合があります。

(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

(2023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	183,139,884	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	82,453	0.05
合計(純資産総額)		183,057,431	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(為替ヘッジあり)(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(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)

(2023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	992,361	0.14
投資証券	ルクセンブルク	686,598,808	99.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	5,889,136	0.85

合計(純資産総額)	693,480,305	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

(2023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	G I M U S コア債券マザーファンド (為替ヘッジあり)(適格機関投資家 専用)	203,240,356	0.9187	186,716,916	0.9011	183,139,884	100.05

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

(2023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 HD	84,525.275	8,199.1	693,031,182	8,123	686,598,808	99.01
2	日本	投資信託 受益証券	G I M 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	0.9969	993,158	0.9961	992,361	0.14

### 種類別投資比率

(2023年6月1日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.05

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

(2023年6月1日現在)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.14
投資証券	99.01

### 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

2023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)	303	303	1.0116	1.0116
第2特定期間末	(2020年5月15日)	297	297	1.0397	1.0397
第3特定期間末	(2020年11月16日)	471	471	1.0591	1.0591
第4特定期間末	(2021年5月17日)	412	412	1.0377	1.0377
第5特定期間末	(2021年11月15日)	323	323	1.0400	1.0400
第6特定期間末	(2022年5月16日)	199	199	0.9362	0.9362
第7特定期間末	(2022年11月15日)	183	183	0.8685	0.8685
第8特定期間末	(2023年5月15日)	186	186	0.8855	0.8855
	2022年6月末日	194	-	0.9175	-
	2022年7月末日	199	-	0.9385	-
	2022年8月末日	194	-	0.9182	-
	2022年9月末日	185	-	0.8772	-
	2022年10月末日	181	-	0.8626	-
	2022年11月末日	186	-	0.8776	-
	2022年12月末日	185	-	0.8736	-
	2023年1月末日	186	-	0.8924	-
	2023年2月末日	182	-	0.8681	-
	2023年3月末日	185	-	0.8792	-
	2023年4月末日	186	-	0.8832	-
	2023年5月末日	182	-	0.8635	-
	2023年6月1日	183	-	0.8681	-

(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	0.0000
第2特定期間	0.0000
第3特定期間	0.0000
第4特定期間	0.0000
第5特定期間	0.0000
第6特定期間	0.0000
第7特定期間	0.0000
第8特定期間	0.0000

## 収益率の推移

期	収益率（％）
第1 特定期間	1.16
第2 特定期間	2.78
第3 特定期間	1.87
第4 特定期間	2.02
第5 特定期間	0.22
第6 特定期間	9.98
第7 特定期間	7.23
第8 特定期間	1.96

（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	301,057,361	1,000,000	300,057,361
第2 特定期間	123,363,977	137,062,399	286,358,939
第3 特定期間	249,680,855	90,714,178	445,325,616
第4 特定期間	11,890,516	60,139,881	397,076,251
第5 特定期間	13,678,045	99,751,539	311,002,757
第6 特定期間	1,450,999	99,194,980	213,258,776
第7 特定期間	968,155	3,275,154	210,951,777
第8 特定期間	4,085,842	4,167,494	210,870,125

（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。

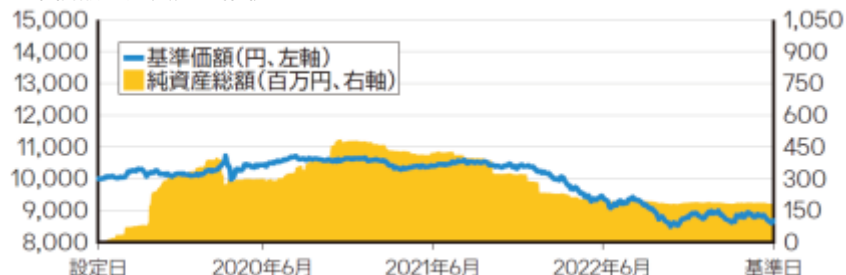
（注2）設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

## &lt;参考情報&gt;

最新の運用実績は、委託会社ホームページ（am.jpmorgan.com/jp）、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	2023年6月1日	設定日	2019年6月10日
純資産総額	183百万円	決算回数	年6回

## 基準価額・純資産の推移



\* 基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 分配の推移

期	年月	円
20期	2022年9月	0
21期	2022年11月	0
22期	2023年1月	0
23期	2023年3月	0
24期	2023年5月	0
	設定来累計	0

\* 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、円ヘッジ）	99.1%
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）	0.8%
合計（純資産総額）	100.0%

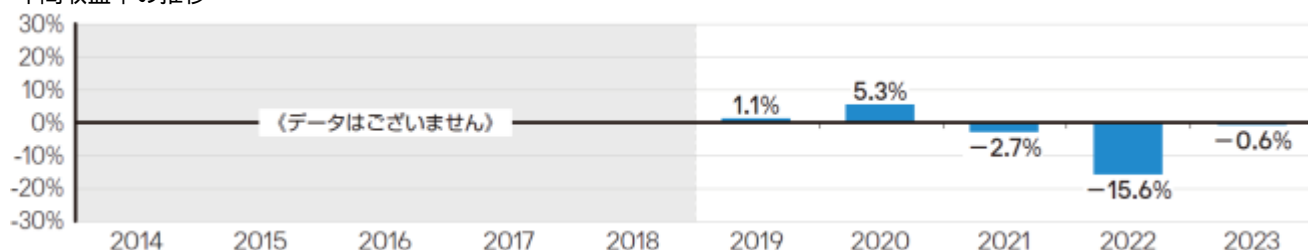
## 種類別構成状況

種類	投資比率 2
国債・政府機関債等	30.7%
社債	27.5%
住宅ローン担保証券等	26.1%
商業用不動産担保証券	11.1%
資産担保証券	0.2%
地方債	0.1%

## 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 <sup>※2</sup>
1	米国国債	国債・政府機関債等	2.750%	2027/7/31	3.0%
2	米国国債	国債・政府機関債等	2.750%	2042/11/15	1.8%
3	ジニーメイ	住宅ローン担保証券等	2.500%	2051/8/20	1.2%
4	米国国債	国債・政府機関債等	0.500%	2026/2/28	1.1%
5	米国国債	国債・政府機関債等	2.875%	2032/5/15	1.1%
6	米国国債	国債・政府機関債等	2.750%	2032/8/15	1.0%
7	米国国債	国債・政府機関債等	1.250%	2028/4/30	0.8%
8	米国国債	国債・政府機関債等	1.750%	2041/8/15	0.8%
9	米国国債	国債・政府機関債等	2.250%	2052/2/15	0.8%
10	米国国債	国債・政府機関債等	2.250%	2027/11/15	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 ÷ 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、2023年の年間収益率は前年末営業日から2023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（為替ヘッジあり、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。

- 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。
- 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、円ヘッジ）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2023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8特定期間(2022年11月16日から2023年5月15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（為替ヘッジあり、隔月決算型）】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 (2022年11月15日現在)	当期 (2023年5月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	183,505,039	187,017,358
流動資産合計	183,505,039	187,017,358
資産合計	183,505,039	187,017,358
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	10,139	10,245
未払委託者報酬	253,520	256,092
その他未払費用	33,760	34,106
流動負債合計	297,419	300,443
負債合計	297,419	300,443
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,210,951,777	1,210,870,125
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2 27,744,157	2 24,153,210
(分配準備積立金)	14,275,356	16,329,569
元本等合計	183,207,620	186,716,915
純資産合計	183,207,620	186,716,915
負債純資産合計	183,505,039	187,017,358

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 (自 2022年5月17日 至 2022年11月15日)	当期 (自 2022年11月16日 至 2023年5月15日)
営業収益		
有価証券売買等損益	13,446,809	4,496,877
営業収益合計	13,446,809	4,496,877
営業費用		
受託者報酬	31,864	30,453
委託者報酬	796,591	761,237
その他費用	2,106,085	2,101,379
営業費用合計	934,540	893,069
営業利益又は営業損失（ ）	14,381,349	3,603,808
経常利益又は経常損失（ ）	14,381,349	3,603,808
当期純利益又は当期純損失（ ）	14,381,349	3,603,808
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（ ）	45,580	3,701
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	13,604,892	27,744,157
剰余金増加額又は欠損金減少額	282,132	448,927
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	282,132	448,927
剰余金減少額又は欠損金増加額	85,628	465,489
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	85,628	465,489
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,744,157	24,153,210



## ( 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 )

前期 (2022年11月15日現在)	当期 (2023年5月15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 (2022年11月15日現在)	当期 (2023年5月15日現在)
1 期首元本額	213,258,776円	210,951,777円
期中追加設定元本額	968,155円	4,085,842円
期中一部解約元本額	3,275,154円	4,167,494円
2 元本の欠損	27,744,157円	24,153,210円
受益権の総数	210,951,777口	210,870,125口
1 口当たりの純資産額	0.8685円	0.8855円
( 1 万口当たりの純資産額 )	( 8,685円 )	( 8,855円 )

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期	当期
	(自 2022年5月17日 至 2022年11月15日)	(自 2022年11月16日 至 2023年5月15日)
1 分配金の計算過程	(自 2022年5月17日 至 2022年7月15日)	(自 2022年11月16日 至 2023年1月16日)
費用控除後の配当等収益額	704,050円	929,314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	7,224,919円	7,439,383円
分配準備積立金額	12,362,727円	14,242,780円
当ファンドの分配対象収益額	20,291,696円	22,611,477円
当ファンドの期末残存口数	212,532,339口	212,900,399口
1万口当たり収益分配対象額	954.75円	1,062.06円
1万口当たり分配金額	- 円	- 円
収益分配金金額	- 円	- 円
	(自 2022年7月16日 至 2022年9月15日)	(自 2023年1月17日 至 2023年3月15日)
費用控除後の配当等収益額	665,221円	647,684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	7,268,560円	7,441,609円
分配準備積立金額	13,050,055円	14,909,799円
当ファンドの分配対象収益額	20,983,836円	22,999,092円
当ファンドの期末残存口数	212,801,106口	210,426,648口
1万口当たり収益分配対象額	986.07円	1,092.97円
1万口当たり分配金額	- 円	- 円
収益分配金金額	- 円	- 円
	(自 2022年9月16日 至 2022年11月15日)	(自 2023年3月16日 至 2023年5月15日)
費用控除後の配当等収益額	679,272円	772,086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	7,205,392円	7,491,114円
分配準備積立金額	13,596,084円	15,557,483円
当ファンドの分配対象収益額	21,480,748円	23,820,683円
当ファンドの期末残存口数	210,951,777口	210,870,125口
1万口当たり収益分配対象額	1,018.27円	1,129.63円
1万口当たり分配金額	- 円	- 円
収益分配金金額	- 円	- 円
2 その他費用の内訳	監査費用	監査費用
	21,179円	20,238円
	その他	その他
	84,906円	81,141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（為替ヘッジあり）（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 (2022年11月15日現在)	当期 (2023年5月15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 (2022年11月15日現在)	当期 (2023年5月15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	6,015,888	1,403,246
合計	6,015,888	1,403,246

## （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（2023年5月15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 (為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	203,567,387	187,017,358	
合計			203,567,387	187,017,358	

## 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 U Sコア債券マザーファンド（為替ヘッジあり）（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 U Sコア債券マザーファンド（為替ヘッジあり）（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	(2022年11月15日現在)	(2023年5月15日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		9,114,167	5,508,583
投資信託受益証券		993,158	992,660
投資証券		699,686,656	699,953,802
未収入金		-	9,200,000
未収配当金		-	1,883,998
流動資産合計		709,793,981	717,539,043
資産合計		709,793,981	717,539,043
負債の部			
流動負債			
未払解約金		2,379,792	7,261,295
その他未払費用		1,243,898	363,372
流動負債合計		3,623,690	7,624,667
負債合計		3,623,690	7,624,667
純資産の部			
元本等			
元本	1	787,413,185	772,749,698
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	81,242,894	62,835,322
元本等合計		706,170,291	709,914,376
純資産合計		706,170,291	709,914,376
負債純資産合計		709,793,981	717,539,043

（注）「G I M U Sコア債券マザーファンド（為替ヘッジあり）（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 )

(2022年11月15日現在)	(2023年5月15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	(2022年11月15日現在)	(2023年5月15日現在)
1期首元本額	855,481,956円	787,413,185円
期中追加設定元本額	20,684,614円	47,877,941円
期中解約元本額	88,753,385円	62,541,428円
元本の内訳（注）		
JPM USコア債券ファンド（為替ヘッジあり、年1回決算型）	582,791,152円	569,182,311円
JPM USコア債券ファンド（為替ヘッジあり、隔月決算型）	204,622,033円	203,567,387円
合 計	787,413,185円	772,749,698円
2元本の欠損	81,242,894円	62,835,322円
受益権の総数	787,413,185口	772,749,698口
1口当たりの純資産額	0.8968円	0.9187円
（1万口当たりの純資産額）	（8,968円）	（9,187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

	(2022年11月15日現在)	(2023年5月15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る場合、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	(2022年11月15日現在)	(2023年5月15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	4,682	498
投資証券	149,146,927	6,922,620
合計	149,151,609	6,922,122

(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（2023年 5 月15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	992,660	
	計	銘柄数：	1	996,247	992,660	
		組入時価比率：	0.1%		0.1%	
	小計				992,660	
投資証券	日本円	JPM US AGGR BOND X(MTH) JPY HD		84,525.275	699,953,802	
	計	銘柄数：	1	84,525.275	699,953,802	
		組入時価比率：	98.6%		99.9%	
	小計				699,953,802	
	合計				700,946,462	

(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、「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）」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、「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）」は「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）」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

### 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）

#### （1）貸借対照表

（単位：円）

区分	注記 番号	第10期 (2022年1月14日現在)	第11期 (2023年1月16日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
親投資信託受益証券		6,226,798	6,184,361
流動資産合計		6,226,798	6,184,361
資産合計		6,226,798	6,184,361
負債の部			
流動負債			
未払受託者報酬		710	714
未払委託者報酬		2,480	2,510
その他未払費用		612	616
流動負債合計		3,802	3,840
負債合計		3,802	3,840
純資産の部			
元本等			
元本	1	6,223,017	6,223,017
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	21	42,496
（分配準備積立金）		109,324	112,806
元本等合計		6,222,996	6,180,521
純資産合計		6,222,996	6,180,521
負債純資産合計		6,226,798	6,184,361

## ( 2 ) 損益及び剰余金計算書

( 単位 : 円 )

区分	注記 番号	第10期	第11期
		(自 2021年 1月15日 至 2022年 1月14日)	(自 2022年 1月15日 至 2023年 1月16日)
		金額	金額
営業収益			
有価証券売買等損益		14,100	34,901
営業収益合計		14,100	34,901
営業費用			
受託者報酬		1,408	1,410
委託者報酬	1	4,917	4,950
その他費用	3	1,212	1,214
営業費用合計		7,537	7,574
営業利益又は営業損失 ( )		21,637	42,475
経常利益又は経常損失 ( )		21,637	42,475
当期純利益又は当期純損失 ( )		21,637	42,475
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 ( )		-	-
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		21,545	21
剰余金増加額又は欠損金減少額		71	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又 は欠損金減少額		71	-
剰余金減少額又は欠損金増加額		-	-
分配金	2	-	-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		21	42,496

## (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	計算期間末日の取扱い 2023年1月14日および2023年1月15日が休日のため、信託約款第29条により、第11期計算期間末日を2023年1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)

第10期 (2022年1月14日現在)	第11期 (2023年1月16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。	同左

## (会計方針の変更に関する注記)

第11期(2023年1月16日現在)

(時価の算定に関する会計基準等の適用)

「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」という。)等を当計算期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19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、財務諸表への影響は軽微であります。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	第10期 (2022年1月14日現在)	第11期 (2023年1月16日現在)
1 期首元本額	6,203,087円	6,223,017円
期中追加設定元本額	19,930円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2 元本の欠損	21円	42,496円
受益権の総数	6,223,017口	6,223,017口
1 口当たりの純資産額	1.0000円	0.9932円
(1万口当たりの純資産額)	(10,000円)	(9,932円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第10期 (自 2021年1月15日 至 2022年1月14日)	第11期 (自 2022年1月15日 至 2023年1月16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	3,018円	3,482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	205,138円	205,138円
分配準備積立金額	106,306円	109,324円
当ファンドの配対象収益額	314,462円	317,944円
当ファンドの期末残存口数	6,223,017口	6,223,017口
1万口当たり収益配対象額	505.32円	510.91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 1,212円	監査費用 1,214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

	第10期 (2022年1月14日現在)	第11期 (2023年1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。	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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第10期 (2022年1月14日現在)	第11期 (2023年1月16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	14,099	34,896
合計	14,099	34,896

## (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(2023年1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 マネープール・マザーファンド (適格機関投資家専用)	6,121,918	6,184,361	
合計			6,121,918	6,184,361	

## 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	(2022年1月14日現在)	(2023年1月16日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		2,802,474	2,802,595
国債証券		3,421,387	3,378,928
未収利息		2,975	3,031
流動資産合計		6,226,836	6,184,554
資産合計		6,226,836	6,184,554
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	6,129,342	6,121,918
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		97,494	62,636
元本等合計		6,226,836	6,184,554
純資産合計		6,226,836	6,184,554
負債純資産合計		6,226,836	6,184,554



## ( 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 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 )

(2022年 1月14日現在)	(2023年 1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

## ( 会計方針の変更に関する注記 )

( 2023年 1月16日現在 )

( 時価の算定に関する会計基準等の適用 )

「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」という。）等を当期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19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、財務諸表への影響は軽微であります。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	(2022年1月14日現在)	(2023年1月16日現在)
1期首元本額	6,116,679円	6,129,342円
期中追加設定元本額	19,640円	-円
期中解約元本額	6,977円	7,424円
元本の内訳（注）		
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）	6,129,342円	6,121,918円
合計	6,129,342円	6,121,918円
受益権の総数	6,129,342口	6,121,918口
1口当たりの純資産額 （1万口当たりの純資産額）	1.0159円 (10,159円)	1.0102円 (10,102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

	(2022年1月14日現在)	(2023年1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	<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>	<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 同左</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。	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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	(2022年1月14日現在)	(2023年1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)
国債証券	21,528	42,459
合計	21,528	42,459

## (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（2023年1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
国債証券	日本円	第141回利付国債（5年）		1,800,000	1,802,106	
		第340回利付国債（10年）		850,000	857,939	
		第353回利付国債（10年）		400,000	392,712	
		第116回利付国債（20年）		150,000	167,824	
		第129回利付国債（20年）		50,000	54,876	
		第154回利付国債（20年）		100,000	103,471	
	計	銘柄数：	6	3,350,000	3,378,928	
		組入時価比率：	54.6%		100.0%	
	小計				3,378,928	
	合計				3,378,928	

(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 HD」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  
2022年6月30日現在

	米ドル
資産	
投資有価証券 - 取得原価	3,905,586,438
未実現利益 / (損失)	(308,794,344)
投資有価証券 - 時価	3,596,792,094
TBA証券への投資 - 時価	92,787,012
現金預金およびブローカー預託金	5,099,023
定期証券発行未収金	5,320,879
投資有価証券売却未収金	2,502,161
TBA証券売却未収金	—
未収配当	—
未収利息	18,328,345
未収還付税額	—
未収報酬免除額	108,392
建オプショナル契約 - 公正価値	—
金融先物契約未実現利益	—
先渡為替契約未実現利益	1,092,704
スワップ契約 - 公正価値	—
その他の資産	2,390,147
資産合計	3,724,420,757
負債	
建オプショナル・ポジション - 時価	—
当座借越	—
ブローカーに対する債務	—
証券買戻未払金	5,133,832
投資有価証券購入未払金	10,419,760
TBA証券購入未払金	94,333,651
未払利息	—
未払販売報酬	97,425
未払運用および顧問報酬	1,411,814
未払ファンド・サービス報酬	292,997
未払建オプショナル契約 - 公正価値	—
金融先物契約未実現損失	—
先渡為替契約未実現損失	36,152,119
スワップ契約 - 公正価値	—
その他の負債*	252,415
負債合計	148,094,013
純資産額合計	3,576,326,744

\*その他の負債は主に取締役報酬、監査および税務関連報酬および費用、登録、発行、発送、印刷、送付、印刷、送付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  
2022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	4,284,503,853
受取配当金、源泉徴収税控除後	498,149
投資有価証券からの受取利息、源泉徴収税控除後	108,270,918
スワップ契約にかかる受取利息	—
証券貸付取引収益	—
受取銀行利息	313
その他の収益	511
収益合計	108,769,891
費用	
運用および顧問報酬	19,886,514
ファンド・サービス報酬	3,940,371
業績報酬	—
保管、支払代行、事務および所在地代行報酬	571,550
販売報酬	1,467,427
登録および名義書換代行報酬	326,907
税	1,118,168
支払配当金、源泉徴収税控除後	—
銀行およびその他の支払利息	3,221
スワップ契約にかかる支払利息	—
その他の費用*	637,713
控除：報酬免除額	(1,106,129)
費用合計	26,846,742
投資純利益 (損失)	81,923,149
投資有価証券売却実現純利益 (損失)	(5,697,104)
TBA証券実現純利益 (損失)	(4,767,748)
オプショナル契約実現純利益 (損失)	—
金融先物契約実現純利益 (損失)	—
先渡為替契約実現純利益 (損失)	(157,868,092)
スワップ契約実現純利益 (損失)	—
為替差実現純利益 (損失)	(556,691)
当期実現純利益 (損失)	(168,889,635)
投資有価証券未実現評価益 (損) 純増減	(475,616,681)
TBA証券未実現評価益 (損) 純増減	(1,845,417)
オプショナル契約未実現評価益 (損) 純増減	—
金融先物契約未実現評価益 (損) 純増減	—
先渡為替契約未実現評価益 (損) 純増減	331,241
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	2,527,183
当期末実現評価益 (損) 純増減	(474,603,674)
事業活動による純資産増減	(561,570,160)
設定	1,674,492,860
解約	(1,803,496,661)
資本の増減による純資産増減	(129,003,801)
支払配当金	(17,603,148)
期末現在純資産額	3,576,326,744

\*その他の費用は主に取締役報酬、監査および税務関連費用、登録、発行、発送、印刷、送付、印刷、送付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

2022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(%)	
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						フィンランド					
債券						Nordea Bank Abp, 144A 1.5%	USD	1,136,000	1,007,071	0.03	
オーストラリア						30/09/2026			1,007,071	0.03	
BHP Billiton Finance USA Ltd. 6.4%	USD	695,000	750,705	0.02							
01/03/2026											
			750,705	0.02							
カナダ						フランス					
Bank of Montreal 3.7%	USD	3,000,000	2,967,866	0.08		Credit Agricole SA, 144B 4.375%	USD	400,000	393,803	0.01	
15/03/2025						17/03/2025					
Barrick Gold Corp. 6.4%	USD	709,000	788,582	0.02		Tota Energies Capital International SA	USD	1,450,000	1,177,686	0.03	
15/10/2026						3.46%					
Brookfield Finance, Inc. 4.85%	USD	1,089,000	1,079,343	0.03		12/01/2049					
29/03/2029						Tota Energies Capital International SA	USD	2,555,000	1,939,744	0.06	
Canadian Pacific Railway Co. 2.9%	USD	346,000	336,141	0.01		3.12%					
01/02/2025						29/05/2030					
Canadian Pacific Railway Co. 5.7%	USD	305,000	336,144	0.01					3,511,233	0.10	
15/03/2023											
Fortis, Inc. 3.055%	USD	1,406,000	1,333,729	0.04		ドイツ					
04/10/2026						Deutsche Bank AG 3.7%	USD	400,000	393,176	0.01	
Nutrien Ltd. 4.2%	USD	275,000	267,111	0.01		30/05/2024			393,176	0.01	
01/04/2029											
Nutrien Ltd. 5%	USD	400,000	395,843	0.01		香港					
01/04/2049						Ald Group Ltd., 144A 1.2%	USD	1,475,000	1,182,877	0.03	
Suncor Energy, Inc. 7.1%	USD	150,000	169,856	0.00		16/09/2060			1,182,877	0.03	
01/09/2030											
Suncor Energy, Inc. 6.8%	USD	550,000	619,135	0.02							
15/09/2030						アイルランド					
TransCanada Pipelines Ltd. 6.2%	USD	540,000	587,821	0.02		AerCap Ireland Capital DAC 4.5%	USD	5,870,000	5,847,045	0.16	
15/10/2027						15/09/2023					
TransCanada Pipelines Ltd. 4.75%	USD	1,150,000	1,096,957	0.03		AerCap Ireland Capital DAC 2.815%	USD	1,385,000	1,323,842	0.04	
15/05/2028						14/08/2024					
			9,967,528	0.28		AerCap Ireland Capital DAC 3.5%	USD	212,000	202,581	0.01	
						15/01/2025					
ケイマン諸島						AerCap Ireland Capital DAC 6.5%	USD	743,000	760,852	0.02	
CR Hutchison International B Ltd.,	USD	1,050,000	1,008,707	0.03		15/07/2025					
144A 2.75%						AerCap Ireland Capital DAC 4.45%	USD	958,000	927,531	0.03	
03/10/2026						01/10/2025					
CR Hutchison International B Ltd.,	USD	585,000	542,539	0.01		AerCap Ireland Capital DAC 1.75%	USD	997,000	871,121	0.02	
144A 1.63%						30/01/2026					
11/04/2029						AerCap Ireland Capital DAC 4.45%	USD	735,000	702,952	0.02	
Hutchison Wharfedere International II	USD	383,000	383,466	0.01		03/04/2026					
Ltd., 144A 3.2%						AerCap Ireland Capital DAC 1.45%	USD	790,000	687,884	0.02	
09/11/2022						29/10/2026					
			1,914,712	0.05		AerCap Ireland Capital DAC 5%	USD	975,000	819,196	0.02	
						29/10/2028					
チリ						AerCap Ireland Capital DAC 3.3%	USD	920,000	737,839	0.02	
Chile Government Bond 2.55%	USD	1,272,000	1,074,938	0.03		30/01/2022					
27/01/2032						Bank of Ireland Group plc, FIN, 144A	USD	1,132,000	992,729	0.03	
			1,074,938	0.03		2.02%					
						30/09/2027					
コロンビア											
Ecopetrol SA 5.875%	USD	226,000	226,930	0.01							
18/09/2023											
Ecopetrol SA 5.375%	USD	464,000	429,975	0.01							
26/06/2026											
			656,905	0.02							

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co. 4.43% 15/11/2035	USD	4,415,000	4,134,117	0.12		Fomento Economico Mexicano SAB de CV 1.5% 16/01/2050	USD	2,460,000	1,902,072	0.05	
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.87% 23/09/2023	USD	177,000	175,185	0.00		Grupo Televisa SAB 8.5% 11/05/2002	USD	263,000	326,269	0.01	
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.2% 23/09/2026	USD	3,120,000	2,987,644	0.08		Grupo Televisa SAB 6.125% 31/01/2046	USD	204,000	234,477	0.01	
			21,160,518	0.59		Mexico City Airport Trust, 1444 5.5% 31/01/2047	USD	210,000	144,778	0.00	
日本						Mexico Government Bond 4.15% 28/03/2027	USD	1,000,000	982,392	0.03	
Dai-ichi Life Insurance Co. Ltd. (The), FOM 1444 4% Perpetual	USD	734,000	690,283	0.02		Mexico Government Bond 3.75% 11/01/2028	USD	2,317,000	2,212,291	0.06	
Mitsubishi DC Capital, Inc., 1444 3.55% 24/02/2024	USD	700,000	695,247	0.02		Mexico Government Bond 2.65% 24/05/2031	USD	2,783,000	2,258,437	0.06	
Witabishi OFJ Financial Group, Inc. 2.04% 17/07/2020	USD	3,120,000	2,548,271	0.07		Mexico Government Bond 4.75% 08/03/2044	USD	648,000	534,593	0.02	
Witabishi OFJ Financial Group, Inc. 3.75% 18/07/2029	USD	1,280,000	1,111,989	0.03		Mexico Government Bond 4.35% 15/01/2047	USD	36,000	27,368	0.00	
Witabishi Financial Group, Inc., FOM 1.22% 12/06/2027	USD	2,291,000	2,000,531	0.06		Mexico Government Bond 4.6% 10/02/2048	USD	1,282,000	1,006,531	0.03	
Nomura Holdings, Inc. 2.64% 16/01/2025	USD	2,072,000	1,983,318	0.05		Mexico Government Bond 4.4% 12/02/2052	USD	3,900,000	2,905,185	0.08	
Nomura Holdings, Inc. 2.67% 16/07/2030	USD	1,640,000	1,341,421	0.04		Mexico Government Bond 3.771% 24/05/2061	USD	1,811,000	1,180,423	0.03	
Saitama Mitsui Financial Group, Inc., 1444 4.43% 02/04/2024	USD	1,200,000	1,200,637	0.03		Mexico Government Bond 5.75% 12/10/2110	USD	566,000	470,001	0.01	
Saitama Mitsui Financial Group, Inc. 1.47% 08/07/2025	USD	3,068,000	2,825,262	0.08				18,870,524	0.53		
Saitama Mitsui Financial Group, Inc. 3.05% 19/10/2026	USD	297,000	279,752	0.01		オランダ					
Saitama Mitsui Financial Group, Inc. 3.04% 16/07/2029	USD	2,280,000	2,040,811	0.06		ING Groep NV 3.95% 29/03/2027	USD	650,000	625,171	0.02	
			16,717,522	0.47		ING Groep NV, FOM 1.72% 01/04/2027	USD	695,000	621,355	0.01	
ルクセンブルク								1,246,526	0.03		
DH Europe Finance II Ser1 3.25% 15/11/2029	USD	2,600,000	2,143,050	0.06		ニュージーランド					
			2,143,050	0.06		ANZ New Zealand Int'l Ltd., 1444 1.4% 13/03/2024	USD	1,000,000	994,824	0.03	
						ANZ New Zealand Int'l Ltd., 1444 2.5% 11/02/2030	USD	1,066,000	927,130	0.02	
								1,921,954	0.05		
メキシコ						パナマ					
America Movil SAB de CV 3.625% 22/04/2029	USD	1,405,000	1,330,363	0.04		Panama Government Bond 4.5% 16/04/2050	USD	425,000	345,968	0.01	
America Movil SAB de CV 4.375% 22/04/2049	USD	966,000	889,514	0.03				345,968	0.01		
Coca-Cola Fespa SAB de CV 2.75% 22/01/2030	USD	1,490,000	1,332,425	0.04		サウジアラビア					
Coca-Cola Fespa SAB de CV 1.85% 01/09/2032	USD	1,500,000	1,163,415	0.03		Saudi Arabian Oil Co., 1444 1.25% 24/11/2023	USD	348,000	336,516	0.01	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
Saudi Arabian Oil Co., 144A 1.615% 24/11/2015	USD	891,000	637,879	0.02		Diageo Capital plc 1.375% 29/09/2025	USD	1,780,000	1,658,791	0.05	
						HSBC Holdings plc 6.5% 15/09/2037	USD	3,140,000	3,348,762	0.09	
			974,385	0.03		HSBC Holdings plc 6.1% 14/01/2042	USD	3,155,000	3,518,045	0.10	
シンガポール						HSBC Holdings plc, FNN 4.18% 09/12/2025	USD	5,000,000	4,931,383	0.14	
BOC Aviation Ltd., 144A 3.5% 10/10/2024	USD	790,000	781,298	0.02		HSBC Holdings plc, FNN 2.206% 17/08/2029	USD	1,605,000	1,348,767	0.04	
			781,298	0.02		HSBC Holdings plc, FNN 2.357% 18/08/2031	USD	2,870,000	2,321,828	0.06	
南アフリカ						Lloyds Banking Group plc 4.5% 04/11/2024	USD	2,550,000	2,545,404	0.07	
South Africa Government Bond 5.87% 16/09/2025	USD	300,000	198,574	0.01		Lloyds Banking Group plc 4.582% 10/12/2025	USD	600,000	588,886	0.02	
			198,574	0.01		Lloyds Banking Group plc 4.375% 22/03/2028	USD	633,000	614,864	0.02	
スペイン						Lloyds Banking Group plc, FNN 2.90% 07/10/2025	USD	800,000	797,329	0.02	
Banco Santander SA 3.125% 23/02/2023	USD	1,000,000	996,034	0.03		Lloyds Banking Group plc, FNN 1.62% 11/05/2027	USD	2,085,000	1,854,378	0.05	
Banco Santander SA 2.746% 28/06/2025	USD	1,400,000	1,327,143	0.04		LEBGA Financing plc, 144A 2% 06/04/2028	USD	3,975,000	3,487,797	0.10	
Banco Santander SA 1.849% 25/03/2026	USD	2,000,000	1,790,171	0.05		Nationwide Building Society, 144A 2% 20/09/2025	USD	1,230,000	1,116,962	0.03	
Banco Santander SA 2.749% 03/12/2030	USD	1,600,000	1,272,749	0.04		NatWest Group plc 3.87% 12/09/2023	USD	1,600,000	1,594,278	0.04	
Banco Santander SA, FNN 1.722% 14/09/2027	USD	1,000,000	870,317	0.02		NatWest Group plc 4.2% 05/04/2026	USD	1,275,000	1,273,162	0.04	
Telefonos e Emisiones SA 4.665% 06/02/2028	USD	980,000	870,603	0.02		NatWest Group plc, FNN 4.518% 25/06/2024	USD	355,000	354,740	0.01	
			7,135,017	0.20		NatWest Group plc, FNN 4.268% 22/03/2025	USD	640,000	633,804	0.02	
スイス						NatWest Group plc, FNN 3.07% 22/05/2028	USD	2,535,000	2,304,755	0.06	
Credit Suisse AG 3.7% 21/02/2025	USD	1,000,000	977,709	0.03		NatWest Group plc, FNN 4.892% 18/05/2029	USD	667,000	647,458	0.02	
Credit Suisse Group AG, FNN, 144A 2.912% 11/09/2025	USD	1,210,000	1,140,594	0.03		NatWest Group plc, FNN 3.754% 01/11/2029	USD	1,500,000	1,440,470	0.04	
Credit Suisse Group AG 3.8% 09/06/2023	USD	250,000	248,833	0.01		NatWest Group plc, FNN 4.445% 08/05/2030	USD	678,000	640,284	0.02	
UBS Group AG, 144A 4.253% 23/03/2028	USD	550,000	533,912	0.01		NatWest Markets plc, 144A 1.6% 29/09/2026	USD	1,420,000	1,249,221	0.03	
UBS Group AG, FNN, 144A 3.126% 13/08/2030	USD	2,580,000	2,280,675	0.06		Santander UK Group Holdings plc, FNN 1.98% 19/01/2025	USD	1,630,000	1,528,776	0.04	
			5,169,723	0.14		Santander UK Group Holdings plc, FNN 1.67% 14/06/2027	USD	1,495,000	1,298,777	0.04	
イギリス						Standard Chartered plc, FNN, 144A 2.785% 11/05/2025	USD	2,000,000	1,983,261	0.05	
Barclays plc 5.2% 12/05/2026	USD	1,460,000	1,458,423	0.04		Standard Chartered plc, FNN, 144A 2.819% 26/01/2026	USD	1,770,000	1,680,558	0.05	
Barclays plc, FNN 4.338% 16/09/2024	USD	1,000,000	1,000,522	0.03		Standard Chartered plc, FNN, 144A 1.456% 14/01/2027	USD	3,601,000	3,176,080	0.09	
Barclays plc, FNN 1.007% 20/12/2024	USD	3,467,000	3,296,188	0.09							
Barclays plc, FNN 2.894% 26/11/2022	USD	1,171,000	947,819	0.03							
BP Capital Markets plc 3.279% 19/09/2027	USD	461,000	440,625	0.01							



## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)
Standard Chartered plc, FTM, 144A 4.85% 15/03/2023	USD	700,000	650,712	0.03	American Water Capital Corp. 3.45% 01/06/2029	USD	365,000	342,669	0.01
			55,721,169	1.56	American Water Capital Corp. 6.55% 15/10/2027	USD	125,000	145,034	0.00
アメリカ					American Water Capital Corp. 4% 01/12/2046	USD	375,000	327,397	0.01
AbbVie, Inc. 3.2% 21/11/2029	USD	4,396,000	4,042,870	0.11	American Water Capital Corp. 3.45% 01/05/2020	USD	2,181,000	1,753,911	0.05
AbbVie, Inc. 4.5% 14/05/2035	USD	1,624,000	1,576,027	0.04	Anheuser-Busch Cos. LLC 4.7% 01/02/2036	USD	3,903,000	3,743,260	0.10
AbbVie, Inc. 4.05% 21/11/2039	USD	2,729,000	2,438,106	0.07	Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. 4.62% 01/02/2044	USD	150,000	135,370	0.00
AbbVie, Inc. 4.4% 06/11/2042	USD	1,200,000	1,095,815	0.03	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4.37% 15/04/2033	USD	1,800,000	919,614	0.03
AbbVie, Inc. 4.25% 21/11/2049	USD	1,560,000	1,388,490	0.04	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4.0% 15/04/2048	USD	1,810,000	1,631,305	0.05
Aetna, Inc. 6.75% 15/12/2037	USD	300,000	343,313	0.01	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4.42% 06/03/2043	USD	1,280,000	1,128,100	0.03
Aetna, Inc. 4.5% 15/05/2042	USD	147,000	132,362	0.00	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4.7% 15/04/2038	USD	3,080,000	2,784,134	0.08
Air Lease Corp. 3.11% 01/07/2025	USD	3,021,000	2,838,723	0.08	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4.0% 01/06/2000	USD	1,175,000	1,032,814	0.03
Air Lease Corp. 2.81% 15/01/2026	USD	2,500,000	2,296,353	0.06	Arizona Public Service Co. 5.05% 01/09/2041	USD	210,000	199,284	0.01
Air Lease Corp. 2.7% 01/06/2026	USD	958,000	900,666	0.03	Arrow Electronics, Inc. 4.5% 01/03/2023	USD	95,000	95,372	0.00
Air Lease Corp. 1.81% 15/06/2026	USD	3,125,000	2,715,676	0.08	Arrow Electronics, Inc. 3.25% 08/09/2024	USD	469,000	458,750	0.01
Air Lease Corp. 2.1% 01/10/2029	USD	4,540,000	3,824,600	0.11	Arrow Electronics, Inc. 3.87% 12/01/2028	USD	761,000	726,641	0.02
Air Products and Chemicals, Inc. 1.8% 15/06/2027	USD	3,000,000	2,733,810	0.08	AT&T, Inc. 2.3% 01/06/2027	USD	5,180,000	4,722,412	0.13
Alabama Power Co. 5.7% 15/02/2023	USD	150,000	163,736	0.00	AT&T, Inc. 1.65% 01/02/2028	USD	485,000	418,741	0.01
Alabama Power Co. 6.125% 15/05/2038	USD	179,000	198,266	0.01	AT&T, Inc. 2.25% 01/02/2032	USD	3,220,000	2,826,595	0.07
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 3.8% 15/04/2026	USD	314,000	309,733	0.01	AT&T, Inc. 3.5% 01/06/2041	USD	1,382,000	1,188,211	0.03
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 3.9% 15/01/2028	USD	1,347,000	1,305,082	0.04	AT&T, Inc. 3.65% 01/06/2051	USD	3,168,000	2,488,176	0.07
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 4.9% 15/12/2030	USD	2,000,000	1,985,124	0.06	AT&T, Inc. 3.55% 15/09/2055	USD	1,332,000	1,003,967	0.03
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 1.81% 01/02/2030	USD	2,690,000	2,029,624	0.06	AT&T, Inc. 3.8% 01/12/2057	USD	246,000	190,820	0.01
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 4% 01/02/2030	USD	1,016,000	843,096	0.02	Atmos Energy Corp. 4.1% 15/01/2043	USD	690,000	614,372	0.02
Allstate Corp. (The) 5.1% 01/06/2033	USD	805,000	849,847	0.02	Atmos Energy Corp. 4.125% 15/03/2049	USD	780,000	789,682	0.02
American Tower Corp., REIT 5% 15/02/2024	USD	367,000	371,489	0.01	AutoZone, Inc. 1.6% 15/01/2021	USD	1,740,000	1,365,678	0.04
American Tower Corp., REIT 3.31% 15/06/2026	USD	437,000	412,967	0.01	Bank of America NA 6% 15/10/2026	USD	1,800,000	1,969,870	0.06
American Tower Corp., REIT 1.5% 31/01/2028	USD	2,820,000	2,342,619	0.07	Bank of New York Mellon Corp. (The) 3.1% 23/08/2029	USD	57,000	52,764	0.00
American Tower Corp., REIT 2.1% 15/06/2020	USD	1,440,000	1,152,621	0.03	Berkshire Hathaway Energy Co. 6.12% 09/04/2026	USD	1,437,000	1,589,890	0.04
American Tower Corp., REIT 1.81% 15/10/2020	USD	2,740,000	2,130,779	0.06	Berkshire Hathaway Finance Corp. 4.2% 15/05/2042	USD	312,000	290,946	0.01
American Tower Corp., REIT 3.7% 15/10/2049	USD	1,995,000	1,585,615	0.04					
American Tower Corp., REIT 3.1% 15/06/2050	USD	1,231,000	868,706	0.02					
American Tower Corp., REIT 2.9% 15/01/2051	USD	804,000	546,677	0.02					

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
Berkshire Hathaway Finance Corp. 4.25% 15/01/2049	USD	1,090,000	1,016,812	0.03		CenterPoint Energy Resources Corp. 5.85% 15/01/2041	USD	250,000	272,803	0.01	
Berkshire Hathaway Finance Corp. 3.85% 15/02/2052	USD	1,550,000	1,333,362	0.04		Cherone Corp. 1.995% 11/05/2017	USD	1,390,000	1,277,997	0.04	
Boardwalk Pipelines LP 3.4% 15/02/2031	USD	1,610,000	1,376,100	0.04		Cherone USA, Inc. 3.25% 15/10/2029	USD	1,490,000	1,399,503	0.04	
Boston Properties LP, REIT 3.2% 15/01/2025	USD	456,000	445,004	0.01		Citigroup, Inc. 3.2% 21/10/2036	USD	1,293,000	1,229,865	0.03	
Boston Properties LP, REIT 3.65% 01/02/2026	USD	397,000	389,460	0.01		Citigroup, Inc. 6.625% 15/01/2028	USD	500,000	549,016	0.02	
Boston Properties LP, REIT 2.75% 01/10/2026	USD	300,000	279,523	0.01		Citizens Financial Group, Inc. 2.8% 27/07/2026	USD	2,000,000	1,873,010	0.05	
Boston Scientific Corp. 4.55% 01/03/2039	USD	721,000	677,484	0.02		Cleveland Electric Illuminating Co. (The) 5.2% 15/03/2024	USD	400,000	412,624	0.01	
EP Capital Markets America, Inc. 3.41% 11/02/2026	USD	2,150,000	2,107,137	0.06		Cleveland Electric Illuminating Co. (The) 5.95% 15/12/2026	USD	425,000	449,851	0.01	
EP Capital Markets America, Inc. 2.712% 10/11/2050	USD	2,000,000	1,384,563	0.04		CMS Energy Corp. 1.875% 01/02/2024	USD	1,200,000	1,199,039	0.03	
EP Capital Markets America, Inc. 2.925% 04/06/2051	USD	2,300,000	1,575,088	0.04		CMS Energy Corp. 3% 15/05/2026	USD	219,000	210,558	0.01	
Enclave Operating Partnership LP, REIT 3.85% 01/02/2025	USD	900,000	886,084	0.02		CMS Energy Corp. 1.95% 15/02/2027	USD	387,000	363,962	0.01	
Brookfield Finance LLC 3.45% 15/04/2050	USD	1,080,000	778,128	0.02		ONE Financial Corp. 3.95% 15/05/2024	USD	173,000	173,249	0.00	
Brown & Brown, Inc. 2.375% 15/03/2031	USD	4,620,000	3,659,990	0.10		Columbia Pipeline Group, Inc. 5.8% 01/06/2045	USD	1,550,000	1,597,037	0.04	
Bunge Ltd. Finance Corp. 2.75% 14/05/2031	USD	3,310,000	2,731,834	0.08		Comerica Bank 4% 27/07/2025	USD	1,100,000	1,087,638	0.03	
Burlington Northern Santa Fe LLC 2.65% 01/05/2025	USD	560,000	563,372	0.02		Comerica, Inc. 4% 01/02/2029	USD	400,000	387,959	0.01	
Burlington Northern Santa Fe LLC 7.95% 15/08/2026	USD	250,000	308,185	0.01		Conagra Brands, Inc. 5.2% 01/11/2028	USD	330,000	312,294	0.01	
Burlington Northern Santa Fe LLC 6.15% 01/05/2027	USD	870,000	1,024,010	0.03		Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 5.7% 15/06/2040	USD	173,000	182,897	0.01	
Burlington Northern Santa Fe LLC 5.75% 01/05/2040	USD	700,000	771,004	0.02		Constellation Brands, Inc. 4.4% 15/11/2025	USD	475,000	476,417	0.01	
Burlington Northern Santa Fe LLC 3.55% 15/02/2050	USD	1,397,000	1,175,678	0.03		Constellation Brands, Inc. 5.25% 15/11/2048	USD	280,000	257,506	0.01	
Campbell Soup Co. 2.375% 24/04/2030	USD	955,000	805,902	0.02		Consumers Energy Co. 3.25% 15/08/2046	USD	190,000	153,587	0.00	
Campbell Soup Co. 3.125% 24/04/2050	USD	470,000	333,492	0.01		Corning, Inc. 3.9% 15/11/2049	USD	2,044,000	1,644,621	0.05	
Capital One Financial Corp. 3.9% 29/01/2024	USD	810,000	808,946	0.02		Corporate Office Properties LP, REIT 2% 15/01/2029	USD	660,000	531,434	0.01	
Capital One Financial Corp. 4.2% 29/10/2025	USD	350,000	345,602	0.01		Corporate Office Properties LP, REIT 2.75% 15/04/2021	USD	3,203,000	2,592,290	0.07	
Caterpillar, Inc. 6.05% 15/08/2026	USD	355,000	411,793	0.01		Crown Castle International Corp., REIT 4% 01/02/2027	USD	228,000	221,406	0.01	
						CVS Health Corp. 4.2% 25/03/2028	USD	285,000	281,816	0.01	
						CVS Health Corp. 1.05% 25/03/2048	USD	4,205,000	4,022,200	0.11	
						Danaher Corp. 2.6% 01/10/2050	USD	932,000	659,142	0.02	
						Dell International LLC 6.02% 15/06/2026	USD	5,696,000	5,898,549	0.16	
						Digital Realty Trust LP, REIT 1.7% 15/08/2027	USD	385,000	387,845	0.01	
						Dominion Energy, Inc. 2.85% 15/08/2026	USD	183,000	173,502	0.00	
						Dominion Energy, Inc. 4.9% 01/08/2041	USD	111,000	106,614	0.00	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
Dominion Energy, Inc. 5.25% 01/08/2033	USD	785,000	810,267	0.02		Entergy Louisiana LLC 3.4% 01/10/2026	USD	532,000	493,284	0.01	
DTE Electric Co. 3.7% 15/03/2045	USD	308,000	263,045	0.01		Entergy Louisiana LLC 3.12% 01/09/2027	USD	320,000	304,011	0.01	
Duke Energy Carolinas LLC 6.45% 15/10/2032	USD	100,000	112,327	0.00		Entergy Louisiana LLC 3.25% 01/04/2028	USD	188,000	176,685	0.00	
Duke Energy Corp. 2.6% 01/09/2036	USD	810,000	760,368	0.02		Entergy Louisiana LLC 3.05% 01/06/2031	USD	314,000	283,907	0.01	
Duke Energy Indiana LLC 6.12% 15/10/2035	USD	150,000	164,139	0.00		Entergy Louisiana LLC 4% 15/03/2033	USD	330,000	315,660	0.01	
Duke Energy Indiana LLC 3.75% 15/05/2046	USD	350,000	298,325	0.01		Entergy Louisiana LLC 2.9% 15/03/2031	USD	1,040,000	753,964	0.02	
Duke Energy Ohio, Inc. 3.7% 15/06/2046	USD	365,000	223,183	0.01		Entergy Mississippi LLC 3.85% 01/06/2049	USD	1,640,000	1,413,369	0.04	
Duke Energy Progress LLC 4.1% 15/05/2042	USD	189,000	171,451	0.00		Enterprise Products Operating LLC 7.5% 15/04/2038	USD	847,000	1,010,397	0.03	
Duke Energy Progress LLC 3.7% 15/10/2046	USD	431,000	368,619	0.01		Enterprise Products Operating LLC 3.2% 15/02/2032	USD	3,000,000	2,161,054	0.06	
Duke Energy Progress LLC 2.9% 15/08/2051	USD	1,255,000	931,760	0.03		Enterprise Products Operating LLC 5.7% 01/03/2035	USD	1,245,000	1,266,265	0.04	
Duke Realty LP, REIT 2.875% 15/11/2029	USD	830,000	746,105	0.02		EGM Midstream Partners LP 5.5% 15/07/2028	USD	1,250,000	1,084,194	0.03	
DuPont de Nemours, Inc. 5.319% 15/11/2038	USD	2,230,000	2,200,503	0.06		Essex Portfolio LP, REIT 2.85% 15/03/2032	USD	4,000,000	3,329,052	0.09	
Eaton Corp. 7.625% 01/04/2024	USD	490,000	424,561	0.01		Energy Metro, Inc. 3.1% 15/03/2023	USD	380,000	378,698	0.01	
Eaton Corp. 4% 02/11/2032	USD	146,000	141,364	0.00		Energy Metro, Inc. 4.2% 15/03/2048	USD	670,000	603,415	0.02	
Eaton Corp. 5.8% 15/03/2037	USD	100,000	108,263	0.00		Energy, Inc. 2.9% 15/09/2029	USD	1,775,000	1,565,029	0.04	
Edison International 1.5% 15/11/2034	USD	2,880,000	2,811,765	0.08		Exxon Mobil Corp. 2.99% 16/08/2039	USD	1,615,000	1,323,664	0.04	
Elevance Health, Inc. 3.35% 01/12/2024	USD	1,355,000	1,338,908	0.04		Exxon Mobil Corp. 3.09% 16/08/2049	USD	2,010,000	1,576,386	0.04	
Elevance Health, Inc. 4.101% 01/03/2028	USD	885,000	874,569	0.02		Fidelity National Information Services, Inc. 4.2% 15/08/2048	USD	2,360,000	2,092,481	0.06	
Elevance Health, Inc. 4.625% 15/05/2042	USD	344,000	327,671	0.01		Florida Power & Light Co. 5.4% 01/09/2035	USD	700,000	746,541	0.02	
Elevance Health, Inc. 4.375% 01/12/2047	USD	301,000	185,684	0.01		General Motors Co. 6.25% 01/10/2025	USD	1,185,000	1,225,047	0.03	
Energy Transfer LP 3.6% 01/02/2023	USD	340,000	239,367	0.01		General Motors Financial Co., Inc. 1.2% 15/10/2024	USD	960,000	893,017	0.02	
Energy Transfer LP 4.7% 15/01/2038	USD	1,821,000	1,817,210	0.05		General Motors Financial Co., Inc. 1.2% 07/04/2025	USD	565,000	550,986	0.02	
Energy Transfer LP 3.9% 15/01/2038	USD	122,000	117,346	0.00		General Motors Financial Co., Inc. 1.25% 08/01/2026	USD	4,269,000	3,747,118	0.10	
Energy Transfer LP 4.4% 15/03/2027	USD	850,000	822,999	0.02		General Motors Financial Co., Inc. 4.3% 17/01/2027	USD	1,831,000	989,803	0.03	
Energy Transfer LP 4.9% 15/05/2038	USD	430,000	420,071	0.01		General Motors Financial Co., Inc. 3% 09/04/2027	USD	1,900,000	1,868,127	0.05	
Energy Transfer LP 4.1% 15/09/2028	USD	1,088,000	978,592	0.03		General Motors Financial Co., Inc. 2.3% 08/01/2031	USD	1,197,000	929,005	0.03	
Energy Transfer LP 6.0% 01/06/2041	USD	650,000	625,373	0.02		General Motors Financial Co., Inc. 2.5% 10/06/2031	USD	1,585,000	1,252,179	0.04	
Energy Transfer LP 6.2% 15/02/2042	USD	800,000	747,033	0.02							
Eni USA, Inc. 7.3% 15/11/2027	USD	1,030,000	1,147,490	0.03							
Entergy Arkansas LLC 3.5% 01/04/2026	USD	202,000	199,198	0.01							
Entergy Corp. 2.95% 01/09/2036	USD	220,000	208,551	0.01							
Entergy Louisiana LLC 4.05% 01/09/2023	USD	239,000	240,222	0.01							

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
Global Payments, Inc. 3.2% 15/01/2029	USD	4,145,000	3,623,889	0.10		Lennar Corp. 4.5% 30/04/2024	USD	1,220,000	1,220,637	0.03	
Global Payments, Inc. 2.9% 15/05/2030	USD	488,000	411,904	0.01		Life Storage LP, REIT 2.2% 15/06/2029	USD	1,373,000	1,259,085	0.04	
Global Payments, Inc. 2.5% 15/11/2031	USD	937,000	769,167	0.02		Life Storage LP, REIT 2.2% 15/10/2030	USD	2,940,000	2,357,449	0.07	
Golden Sachs Group, Inc. (The) 4.25% 21/10/2025	USD	457,000	453,830	0.01		Lowe's Cos., Inc. 2.5% 15/04/2026	USD	550,000	520,455	0.01	
Golden Sachs Group, Inc. (The) 3.85% 26/01/2027	USD	1,830,000	1,767,792	0.05		Lowe's Cos., Inc. 1.7% 15/10/2028	USD	3,000,000	2,406,502	0.07	
Golden Sachs Group, Inc. (The) 3.5% 23/01/2025	USD	2,321,000	2,289,999	0.06		LYB International Finance III LLC 1.2% 01/10/2025	USD	766,000	693,906	0.02	
Gulf Power Co. 3.2% 30/06/2027	USD	670,000	646,803	0.02		LYB International Finance III LLC 3.625% 01/04/2031	USD	2,705,000	1,992,371	0.06	
Halliburton Co. 4.75% 01/06/2042	USD	430,000	383,793	0.01		Magellan Midstream Partners LP 3.2% 15/09/2025	USD	171,000	166,118	0.00	
Hanover Insurance Group, Inc. (The) 2.5% 01/09/2030	USD	1,420,000	1,185,639	0.03		Marathon Oil Corp. 6.5% 15/02/2022	USD	241,000	260,563	0.01	
Hartford Financial Services Group, Inc. (The) 6.1% 01/10/2041	USD	600,000	654,237	0.02		Marathon Petroleum Corp. 4.7% 01/05/2025	USD	1,209,000	1,225,500	0.03	
Hartford Financial Services Group, Inc. (The) 4.5% 15/04/2040	USD	500,000	443,505	0.01		Markel Corp. 5% 05/04/2046	USD	1,000,000	945,918	0.03	
HCA, Inc. 5.25% 15/06/2026	USD	3,300,000	3,385,986	0.09		Martin Marietta Materials, Inc. 3.4% 01/06/2027	USD	666,000	635,515	0.02	
HCA, Inc. 5.625% 01/09/2028	USD	7,000,000	7,031,311	0.20		Masco Corp. 2% 01/10/2030	USD	840,000	863,578	0.02	
HCA, Inc. 4.125% 15/06/2029	USD	380,000	349,003	0.01		Masco Corp. 6.5% 15/08/2032	USD	1,000,000	1,077,277	0.03	
HCA, Inc. 5.125% 15/06/2030	USD	3,095,000	2,759,499	0.08		McDonald's Corp. 4.7% 09/12/2035	USD	547,000	544,590	0.02	
HCA, Inc. 3.5% 15/07/2031	USD	170,000	117,045	0.00		McDonald's Corp. 6.2% 15/10/2037	USD	179,000	205,525	0.01	
Healthcare Trust of America Holdings LP, REIT 3.5% 15/02/2030	USD	1,161,000	998,749	0.03		MOG Holdings, Inc. 2.5% 15/01/2021	USD	2,210,000	1,634,127	0.05	
Healthcare Trust of America Holdings LP, REIT 2% 15/02/2031	USD	1,540,000	1,193,999	0.03		MetLife, Inc. 6.5% 15/12/2032	USD	616,000	713,509	0.02	
Healthpeak Properties, Inc., REIT 3.4% 01/02/2025	USD	14,000	13,775	0.00		Mid-America Apartments LP, REIT 4% 15/11/2025	USD	930,000	923,455	0.03	
Healthpeak Properties, Inc., REIT 3.5% 15/07/2029	USD	1,334,000	1,228,582	0.03		Mid-America Apartment LP, REIT 1.7% 15/02/2021	USD	1,470,000	1,164,462	0.03	
HP, Inc. 3% 17/06/2027	USD	1,445,000	1,334,410	0.04		Morgan Stanley 1.875% 21/04/2024	USD	2,697,000	2,781,249	0.08	
Illinois Tool Works, Inc. 2.65% 15/11/2026	USD	900,000	860,219	0.02		Morgan Stanley 1.875% 21/01/2026	USD	270,000	266,055	0.01	
International Flavors & Fragrances, Inc. 3% 26/09/2048	USD	452,000	425,768	0.01		Morgan Stanley 1.125% 21/07/2026	USD	1,056,000	1,006,080	0.03	
International Lease Finance Corp. 5.81% 15/08/2022	USD	623,000	624,205	0.02		Morgan Stanley 1.625% 20/01/2027	USD	681,000	657,850	0.02	
International Paper Co. 8.7% 15/06/2038	USD	850,000	1,094,411	0.03		Morgan Stanley 4.3% 21/01/2045	USD	1,125,000	1,005,017	0.03	
Jersey Central Power & Light Co. 6.1% 01/06/2027	USD	320,000	341,415	0.01		Morgan Stanley FRN 1.794% 13/02/2032	USD	2,080,000	1,638,384	0.05	
Kroger Co. (The) 2.2% 01/05/2030	USD	3,500,000	2,955,260	0.08		MPLX LP 4.875% 01/12/2024	USD	1,284,000	1,294,902	0.04	
Kroger Co. (The) 5.4% 15/07/2040	USD	114,000	115,607	0.00		MPLX LP 4.8% 15/02/2029	USD	362,000	356,353	0.01	
Kroger Co. (The) 4.4% 01/02/2041	USD	1,220,000	1,105,796	0.03		National Retail Properties, Inc., REIT 4% 15/11/2025	USD	583,000	579,400	0.02	
Lear Corp. 2.6% 15/01/2032	USD	865,000	674,969	0.02		National Retail Properties, Inc., REIT 3.6% 15/12/2026	USD	1,000,000	961,040	0.03	
Legg Mason, Inc. 3.9% 15/07/2034	USD	350,000	351,489	0.01		Nevada Power Co. 3.7% 01/05/2029	USD	1,600,000	1,540,938	0.04	
						Nevada Power Co. 6.6% 01/04/2036	USD	200,000	230,149	0.01	
						Nevada Power Co. 5.37% 15/09/2040	USD	365,000	378,614	0.01	
						NiSource, Inc. 2.9% 01/09/2029	USD	615,000	545,226	0.02	
						NiSource, Inc. 1.7% 15/02/2031	USD	1,830,000	1,431,208	0.04	
						NiSource, Inc. 5.8% 01/02/2042	USD	628,000	638,888	0.02	
						OGE Energy Corp. 0.70% 26/05/2023	USD	1,180,000	1,150,265	0.03	
						Ohio Edison Co. 6.875% 15/07/2036	USD	350,000	410,240	0.01	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
Idaho Gas and Electric Co. 0.55%	USD	1,425,000	1,389,089	0.04		Realty Income Corp., REIT 3.25%	USD	1,480,000	1,344,655	0.04	
26/03/2023						15/01/2021					
ONE Gas, Inc. 2%	USD	2,080,000	1,719,575	0.05		Regency Centers LP, REIT 2.95%	USD	1,305,000	1,147,621	0.03	
ONEOK Partners LP 3.375%	USD	76,000	76,004	0.00		15/09/2029					
01/10/2022						Ballance Steel & Aluminum Co. 2.1%	USD	3,330,000	2,709,561	0.08	
ONEOK Partners LP 5%	USD	169,000	170,004	0.00		15/08/2020					
ONEOK Partners LP 6.6%	USD	910,000	938,246	0.03		Roper Technologies, Inc. 1.4%	USD	3,420,000	2,928,288	0.08	
ONEOK, Inc. 7.5%	USD	2,741,000	2,840,013	0.08		15/09/2027					
ONEOK, Inc. 2.2%	USD	2,750,000	2,560,578	0.07		Roper Technologies, Inc. 4.2%	USD	450,000	440,949	0.01	
Oracle Corp. 3.6%	USD	1,800,000	1,357,191	0.04		15/09/2028					
Oracle Corp. 4%	USD	1,070,000	806,798	0.02		Safeshield Operating Partnership LP, REIT 2.8%	USD	5,000,000	4,075,682	0.11	
Oracle Corp. 4.375%	USD	940,000	725,257	0.02		15/06/2031					
Pacific Gas and Electric Co. 1.26%	USD	2,415,000	2,378,727	0.07		San Diego Gas & Electric Co. 6.125%	USD	150,000	162,824	0.00	
10/03/2023						15/09/2027					
Pacific Gas and Electric Co. 1.1%	USD	1,390,000	1,340,036	0.04		San Diego Gas & Electric Co. 1.95%	USD	218,000	188,027	0.01	
15/11/2023						15/11/2041					
Pacific Gas and Electric Co. 3.25%	USD	3,795,000	3,696,930	0.10		Shawin-Williams Co. (The) 4.5%	USD	1,821,000	1,606,527	0.04	
16/02/2024						01/08/2045					
Pacific Gas and Electric Co. 2.9%	USD	970,000	879,473	0.02		Sison Property Group LP, REIT 1.25%	USD	1,518,000	1,105,263	0.03	
01/02/2026						12/09/2049					
Pacific Gas and Electric Co. 3.7%	USD	461,000	306,975	0.01		SITE Centers Corp., REIT 3.825%	USD	345,000	335,825	0.01	
15/08/2042						01/02/2025					
Pacific Gas and Electric Co. 4.2%	USD	770,000	560,735	0.02		Southern California Edison Co. 3.6%	USD	800,000	755,895	0.02	
15/02/2045						01/03/2028					
Pacific Gas and Electric Co. 4%	USD	1,500,000	1,053,815	0.03		Southern California Edison Co. 6%	USD	150,000	161,577	0.00	
01/12/2046						15/01/2024					
PacificCorp 4.15%	USD	1,600,000	1,453,720	0.04		Southern California Edison Co. 5.5%	USD	530,000	532,487	0.01	
15/02/2050						15/01/2026					
Packaging Corp. of America 4.0%	USD	1,565,000	1,308,737	0.04		Southern California Edison Co. 4.0%	USD	900,000	743,920	0.02	
15/12/2049						15/02/2042					
Parkaz-Hannifin Corp. 4.1%	USD	416,000	358,290	0.01		Southern California Gas Co. 3.5%	USD	2,280,000	1,997,813	0.06	
01/03/2047						01/02/2020					
Phillips 66 4.875%	USD	85,000	82,711	0.00		Southern Co. Gas Capital Corp. 2.4%	USD	153,000	150,942	0.00	
15/11/2044						02/10/2023					
Pioneer Natural Resources Co. 1.5%	USD	2,580,000	2,110,697	0.06		Southern Co. Gas Capital Corp. 5.87%	USD	550,000	578,426	0.02	
15/08/2020						15/02/2041					
PNC Bank NA 3.25%	USD	750,000	739,046	0.02		Southern Co. Gas Capital Corp. 4.4%	USD	167,000	146,032	0.00	
01/06/2025						01/06/2043					
Precision Castparts Corp. 4.2%	USD	250,000	246,583	0.01		Southern Co. Gas Capital Corp. 3.9%	USD	188,000	154,524	0.00	
15/09/2025						02/10/2046					
Precision Castparts Corp. 4.375%	USD	250,000	237,999	0.01		Southern Natural Gas Co. LLC 8%	USD	624,000	731,232	0.02	
15/06/2045						01/02/2032					
Progress Energy, Inc. 7%	USD	300,000	337,303	0.01		Southern Power Co. 5.1%	USD	871,000	825,373	0.02	
30/10/2031						15/08/2041					
Prologis LP, REIT 2.12%	USD	525,000	336,006	0.01		SouthTrust Bank T.09%	USD	250,000	289,869	0.01	
15/10/2030						15/05/2025					
Public Storage, REIT 1.9%	USD	1,384,000	1,091,800	0.03		Southwest Gas Corp. 3.8%	USD	442,000	361,218	0.01	
09/11/2023						29/09/2046					
Public Storage, REIT 2.2%	USD	1,082,000	882,256	0.02		Targa Resources Corp. 4.2%	USD	590,000	532,310	0.01	
09/11/2031						01/02/2033					
Quanta Services, Inc. 2.35%	USD	2,395,000	1,776,958	0.05		Tennessee Valley Authority 5.88%	USD	2,548,000	3,088,704	0.09	
15/01/2032						01/04/2026					
Quest Diagnostics, Inc. 3.5%	USD	4,000,000	3,939,127	0.11							
30/03/2025											
Realty Income Corp., REIT 3.87%	USD	255,000	253,165	0.01							
15/04/2025											

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
Tennessee Valley Authority 4.615% 15/09/2040	USD	433,000	479,668	0.01		US Treasury 0.5% 30/04/2027	USD	42,000,000	37,127,344	1.04	
Tennessee Valley Authority 4.15% 15/09/2045	USD	438,000	449,736	0.01		US Treasury 1.25% 31/03/2028	USD	20,065,000	18,106,311	0.51	
Thermo Fisher Scientific, Inc. 2.5% 15/10/2041	USD	805,000	629,791	0.02		US Treasury 1.25% 30/04/2028	USD	42,760,000	38,515,736	1.08	
T-Mobile US, Inc. 3.37% 15/04/2030	USD	8,485,000	7,937,038	0.22		US Treasury 2.875% 15/05/2028	USD	7,360,400	7,286,814	0.20	
Toledo Edison Co. (The) 6.15% 15/05/2037	USD	600,000	666,439	0.02		US Treasury 1.25% 30/06/2028	USD	33,971,500	30,515,961	0.85	
Truist Financial Corp. 4.5% 01/05/2035	USD	408,000	408,609	0.01		US Treasury 1.875% 28/02/2029	USD	23,300,000	21,625,313	0.60	
TSMC Arizona Corp. 4.5% 22/04/2032	USD	1,270,000	1,250,398	0.03		US Treasury 2.875% 30/04/2029	USD	27,675,000	27,307,441	0.76	
Tyson Foods, Inc. 4.87% 15/09/2034	USD	390,000	393,113	0.01		US Treasury 1.625% 15/08/2029	USD	775,000	784,554	0.02	
UDR, Inc., REIT 2.9% 01/09/2036	USD	276,000	260,174	0.01		US Treasury 1.75% 15/11/2029	USD	2,410,000	2,208,445	0.06	
UDR, Inc., REIT 3.5% 01/07/2027	USD	1,383,000	1,318,575	0.04		US Treasury 1.5% 15/02/2030	USD	2,230,000	1,999,509	0.06	
UDR, Inc., REIT 5% 15/08/2031	USD	460,000	393,267	0.01		US Treasury 0.625% 15/08/2030	USD	2,715,000	2,248,269	0.06	
UDR, Inc., REIT 2.1% 01/08/2032	USD	1,520,000	1,182,171	0.03		US Treasury 1.625% 15/05/2031	USD	12,825,000	11,446,813	0.32	
Union Carbide Corp. 7.1% 01/10/2036	USD	650,000	775,819	0.02		US Treasury 1.25% 15/08/2031	USD	11,390,000	9,794,065	0.27	
Union Electric Co. 2.9% 15/09/2027	USD	715,000	682,699	0.02		US Treasury 1.375% 15/11/2031	USD	11,322,000	9,808,567	0.27	
Union Pacific Corp. 3.9% 15/09/2039	USD	900,000	771,598	0.02		US Treasury 1.875% 15/02/2032	USD	41,900,000	37,909,680	1.06	
UnitedHealth Group, Inc. 4.615% 15/07/2035	USD	396,000	400,083	0.01		US Treasury 2.875% 15/05/2032	USD	20,000,000	19,750,000	0.55	
UnitedHealth Group, Inc. 3.5% 15/08/2039	USD	1,485,000	1,305,317	0.04		US Treasury 4.375% 15/02/2038	USD	1,830,000	2,129,663	0.06	
US Treasury 1.625% 31/08/2022	USD	5,000,000	5,000,434	0.14		US Treasury 3.5% 15/02/2039	USD	1,449,500	1,514,727	0.04	
US Treasury 1.75% 30/09/2022	USD	10,000,000	9,998,541	0.28		US Treasury 4.25% 15/05/2039	USD	6,800,000	7,768,602	0.22	
US Treasury 1.875% 30/09/2022	USD	10,000,000	10,001,622	0.28		US Treasury 1.125% 15/05/2040	USD	11,045,000	7,698,710	0.22	
US Treasury 1.5% 28/02/2023	USD	42,000,000	41,668,321	1.17		US Treasury 3.875% 15/08/2040	USD	1,250,000	1,348,633	0.04	
US Treasury 1.75% 15/05/2023	USD	24,636,000	24,396,460	0.68		US Treasury 4.25% 15/11/2040	USD	6,500,000	7,349,834	0.21	
US Treasury 2.75% 31/05/2023	USD	880,000	878,733	0.02		US Treasury 1.875% 15/02/2041	USD	33,400,000	26,232,047	0.73	
US Treasury 1.375% 30/06/2023	USD	10,000,000	9,947,656	0.28		US Treasury 4.75% 15/02/2041	USD	3,800,000	3,617,051	0.10	
US Treasury 1.375% 31/08/2023	USD	10,000,000	9,821,289	0.27		US Treasury 2.25% 15/05/2041	USD	4,800,000	4,810,250	0.11	
US Treasury 1.625% 31/10/2023	USD	11,000,000	10,813,945	0.30		US Treasury 1.75% 15/08/2041	USD	5,195,000	3,957,332	0.11	
US Treasury 2.125% 29/02/2024	USD	17,730,000	17,480,368	0.49		US Treasury 2% 15/11/2041	USD	2,305,000	1,833,375	0.05	
US Treasury 2.5% 15/05/2024	USD	369,000	365,714	0.01		US Treasury 2.375% 15/02/2042	USD	30,660,000	26,832,256	0.73	
US Treasury 2% 30/06/2024	USD	1,068,000	1,047,516	0.03		US Treasury 3.25% 15/05/2042	USD	12,000,000	11,728,125	0.33	
US Treasury 1.75% 31/12/2024	USD	22,464,000	21,755,382	0.61		US Treasury 2.75% 15/11/2042	USD	52,800,000	47,377,688	1.32	
US Treasury 2.125% 15/05/2025	USD	695,000	677,734	0.02		US Treasury 3.125% 15/02/2043	USD	7,800,000	7,426,148	0.21	
US Treasury 2.875% 31/05/2025	USD	46,008,000	45,792,338	1.28		US Treasury 3.625% 15/08/2043	USD	22,000,000	22,623,047	0.63	
US Treasury 2% 15/08/2025	USD	10,000,000	9,684,375	0.27		US Treasury 3.625% 15/02/2044	USD	9,348,000	9,610,913	0.27	
US Treasury 0.375% 31/01/2026	USD	15,800,000	14,356,398	0.40		US Treasury 3% 15/11/2044	USD	634,000	589,001	0.02	
US Treasury 1.625% 15/02/2026	USD	639,100	607,045	0.02		US Treasury 2.875% 15/08/2045	USD	495,000	450,933	0.01	
US Treasury 0.5% 28/02/2026	USD	20,750,000	18,899,521	0.53		US Treasury 2.25% 15/08/2046	USD	2,450,000	1,982,203	0.06	
US Treasury 2.5% 28/02/2026	USD	1,565,000	1,534,097	0.04		US Treasury 3% 15/02/2047	USD	488,000	457,252	0.01	
US Treasury 0.75% 30/04/2026	USD	980,000	897,542	0.03		US Treasury 3% 15/02/2048	USD	1,330,000	1,256,798	0.04	
US Treasury 0.875% 30/06/2026	USD	37,356,000	34,258,079	0.96		US Treasury 2.875% 15/05/2049	USD	5,296,000	4,952,588	0.14	
US Treasury 0.875% 30/09/2026	USD	1,793,700	1,636,611	0.05		US Treasury 2.35% 15/08/2049	USD	1,880,000	1,547,632	0.04	
US Treasury 1.75% 31/12/2026	USD	18,861,000	17,813,330	0.50		US Treasury 2.375% 15/11/2049	USD	19,805,000	16,100,066	0.45	
US Treasury 2.25% 15/02/2027	USD	1,460,000	1,406,334	0.04		US Treasury 2% 15/02/2050	USD	12,454,000	9,679,093	0.27	
						US Treasury 1.25% 15/05/2050	USD	12,378,000	7,900,645	0.22	
						US Treasury 1.375% 15/08/2050	USD	2,615,000	1,726,462	0.05	
						US Treasury 1.625% 15/11/2050	USD	14,815,000	10,448,915	0.29	
						US Treasury 1.875% 15/02/2051	USD	30,489,000	22,928,681	0.64	
						US Treasury 2.375% 15/05/2051	USD	8,990,000	7,606,383	0.21	
						US Treasury 2% 15/08/2051	USD	9,200,000	7,126,766	0.20	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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 1.875% 15/11/2051	USD	16,095,000	12,103,943	0.34		英ヴァージン諸島					
US Treasury 2.25% 15/02/2052	USD	26,800,000	22,101,625	0.62		China Southern Power Grid					
US Treasury Inflation Indexed 1.75% 15/01/2028	USD	1,500,000	2,201,377	0.06		International Finance BVI Co. Ltd., 144A 3.5% 08/05/2027	USD	1,751,000	1,725,775	0.05	
US Treasury Inflation Indexed 2.5% 15/01/2029	USD	1,000,000	1,501,462	0.04					1,725,775	0.05	
US Treasury STRIP Coupon 0% 15/11/2023	USD	3,287,000	3,163,639	0.09		債券合計			1,453,754,146	40.65	
Valero Energy Corp. 2.15% 15/09/2027	USD	2,090,000	1,859,474	0.05		コマーシャル・ペーパー					
Valero Energy Corp. 7.5% 15/04/2032	USD	251,000	288,922	0.01		アメリカ					
Ventas Realty LP, REIT 3.75% 01/05/2024	USD	300,000	297,659	0.01		Resolution Funding Corp. 0% 15/01/2030	USD	4,000,000	3,076,911	0.09	
Ventas Realty LP, REIT 4.125% 15/01/2026	USD	43,000	42,553	0.00		Resolution Funding Corp. 0% 15/04/2030	USD	200,000	151,665	0.00	
Ventas Realty LP, REIT 3.25% 15/10/2026	USD	108,000	101,971	0.00					3,228,576	0.09	
Ventas Realty LP, REIT 3.85% 01/04/2027	USD	369,000	356,072	0.01		コマーシャル・ペーパー合計			3,228,576	0.09	
Verizon Communications, Inc. 0.85% 20/11/2025	USD	9,198,000	8,330,357	0.23		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			1,456,982,722	40.74	
Verizon Communications, Inc. 2.1% 22/02/2028	USD	745,000	661,479	0.02		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債券					
Verizon Communications, Inc. 1.15% 22/03/2030	USD	2,915,000	2,653,125	0.07		オーストラリア					
Verizon Communications, Inc. 3.65% 20/11/2040	USD	2,481,000	1,823,329	0.05		A4 Infrastructure Ltd., 144A 4.25% 15/01/2027	USD	895,000	868,869	0.02	
Virginia Electric and Power Co. 6% 15/05/2031	USD	300,000	221,832	0.01		Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 144A 4.4% 19/05/2026	USD	200,000	197,412	0.01	
Virginia Electric and Power Co. 3.5% 15/09/2047	USD	700,000	603,289	0.02		Commonwealth Bank of Australia, 144A 3.265% 11/03/2041	USD	765,000	581,972	0.02	
VMware, Inc. 1.8% 15/08/2028	USD	1,512,000	1,254,472	0.04		GEF Bond Issuer Pty. Ltd., REIT, 144A 3.4% 20/09/2035	USD	826,000	797,871	0.02	
Wells Fargo & Co. 5.375% 02/11/2043	USD	284,000	279,600	0.01		Macquarie Bank Ltd., FRN, 144A 3.052% 02/02/2038	USD	1,565,000	1,253,067	0.03	
Wells Fargo & Co. 5.605% 15/01/2044	USD	2,640,000	2,685,032	0.08		Macquarie Group Ltd., FRN, 144A 5.033% 15/01/2030	USD	4,000,000	3,993,903	0.11	
Wells Fargo & Co. 4.9% 11/11/2045	USD	359,000	333,988	0.01		National Australia Bank Ltd., 144A 2.233% 21/08/2030	USD	1,660,000	1,335,964	0.04	
Welltower, Inc., REIT 2.7% 15/02/2027	USD	412,000	380,995	0.01		National Australia Bank Ltd., FRN, 144A 3.923% 02/08/2024	USD	1,795,000	1,627,410	0.05	
Welltower, Inc., REIT 4.95% 01/09/2048	USD	1,372,000	1,309,386	0.04		National Australia Bank Ltd. 1.5% 09/06/2025	USD	3,000,000	2,973,921	0.08	
Williams Cos., Inc. (The) 2.6% 15/02/2031	USD	1,140,000	955,539	0.03		Newcrest Finance Pty. Ltd., 144A 3.25% 12/05/2030	USD	955,000	849,187	0.02	
W Carey, Inc., REIT 4.25% 01/10/2026	USD	4,400,000	4,339,795	0.12		Scentre Group Trust 1, REIT, 144A 3.5% 12/02/2025	USD	1,700,000	1,652,263	0.05	
W Carey, Inc., REIT 2.4% 01/02/2031	USD	1,975,000	1,614,637	0.05		Scentre Group Trust 2, REIT, FRN, 144A 4.75% 24/09/2030	USD	4,855,000	3,610,415	0.10	
W Carey, Inc., REIT 2.25% 01/04/2033	USD	3,000,000	2,309,536	0.06		Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd., 144A 3.37% 30/06/2025	USD	1,200,000	1,165,958	0.03	
WEKCo, Inc. 3.9% 01/06/2028	USD	315,000	304,534	0.01		Westpac Banking Corp. 3.133% 18/11/2041	USD	1,789,000	1,318,263	0.04	
Xylem, Inc. 3.25% 01/11/2026	USD	166,000	161,473	0.00							
Zimmer Biomet Holdings, Inc. 2.6% 24/11/2031	USD	2,328,000	1,906,859	0.05							
Zoetis, Inc. 2% 15/05/2030	USD	1,630,000	1,364,949	0.04							
			<u>1,299,183,048</u>	<u>36.33</u>							

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)
Westpac Banking Corp., FNN 4.312% 21/11/2021	USD	1,950,000	1,873,903	0.05	ケイマン諸島				
			24,100,538	0.67	Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 5.25% 15/05/2024	USD	2,915,000	2,867,230	0.08
バミューダ					Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 2.87% 15/02/2025	USD	3,209,000	2,954,513	0.08
Triton Container International Ltd., 144A 1.1% 07/09/2024	USD	2,005,000	1,874,312	0.05	Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 5.5% 15/01/2026	USD	7,175,000	6,965,276	0.20
			1,874,312	0.05	Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 2.12% 21/02/2026	USD	1,380,000	1,189,412	0.03
カナダ					Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 4.25% 15/04/2026	USD	1,830,000	1,694,636	0.05
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2019-1 'K', 144A 4.32% 15/11/2026	USD	594,598	556,985	0.02	Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 4.37% 01/05/2026	USD	605,000	560,776	0.02
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2015-1 'K', 144A 3.8% 15/09/2028	USD	347,437	329,175	0.01	Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 2.52% 18/11/2027	USD	13,361,000	10,954,066	0.31
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2017-1 'K', 144A 3.55% 15/01/2031	USD	2,058,566	1,864,119	0.05	BBDO Funding Trust, Series 2017-1A 'A2', 144A 4.45% 20/09/2047	USD	1,931,535	1,900,556	0.05
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2017-2 'M', 144A 3.5% 15/01/2031	USD	673,235	603,213	0.02	Hutchison Wampoa International 14 Ltd., 144A 1.62% 11/10/2024	USD	550,000	551,397	0.02
Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 3.42% 11/05/2041	USD	1,190,000	895,998	0.03	Park Aerospace Holdings Ltd., 144A 4.5% 15/03/2021	USD	860,000	857,079	0.02
Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 3.8% 25/01/2030	USD	2,525,000	1,913,248	0.05	Park Aerospace Holdings Ltd., 144A 5.5% 15/02/2024	USD	368,000	365,125	0.01
Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 3.82% 11/05/2031	USD	1,325,000	969,080	0.03	Reneo, Series 2017-1A 'K', 144A 3.6% 20/09/2032	USD	875,756	815,754	0.02
Bank of Montreal 3.2% 05/02/2034	USD	1,300,000	1,195,927	0.03			31,676,610	0.99	
Bank of Montreal 1.85% 01/05/2025	USD	1,950,000	1,847,054	0.05	デンマーク				
Bank of Montreal, FNN 3.80% 15/12/2032	USD	433,000	402,029	0.01	Danske Bank A/S, FNN, 144A 1.111% 08/12/2022	USD	5,034,000	4,969,447	0.14
Brookfield Finance, Inc. 3.9% 25/01/2028	USD	422,000	401,441	0.01			4,969,447	0.14	
Brookfield Finance, Inc. 4.7% 20/09/2047	USD	69,000	61,082	0.00	フィンランド				
Canadian Imperial Bank of Commerce 3.5% 02/04/2034	USD	500,000	494,927	0.01	Nordea Bank Abp, 144A 4.25% 21/09/2022	USD	680,000	681,516	0.02
CGI, Inc. 2.3% 14/09/2031	USD	3,025,000	2,427,754	0.07	Nordea Bank Abp, 144A 3.6% 06/06/2025	USD	5,000,000	4,952,871	0.14
Nutrien Ltd. 4% 15/12/2026	USD	850,000	844,072	0.02			5,634,387	0.16	
Nutrien Ltd. 4.125% 15/03/2025	USD	500,000	464,986	0.01	フランス				
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust, 144A 1.87% 20/03/2027	USD	804,000	782,843	0.02	Air Liquide Finance SA, 144A 2.25% 27/09/2022	USD	578,000	571,161	0.02
Province of Quebec Canada 6.25% 30/01/2025	USD	370,000	294,429	0.01	Banque Federative de Credit Mutuel SA, 144A 1.69% 04/10/2026	USD	2,845,000	2,527,638	0.07
Royal Bank of Canada 4.65% 27/01/2026	USD	400,000	403,820	0.01	BNP Paribas SA, 144A 3.375% 09/01/2025	USD	350,000	341,987	0.01
Schlumberger Finance Canada Ltd. 1.4% 11/09/2025	USD	2,950,000	2,737,066	0.08					
			19,489,248	0.54					



## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
BNP Paribas SA, FRN, 144A 2.219% 09/06/2026	USD	1,073,000	993,516	0.03		アイルランド					
BNP Paribas SA, FRN, 144A 1.312% 12/01/2027	USD	840,000	749,439	0.02		AIB Group plc, 144A 4.75% 12/30/2023	USD	1,285,000	1,285,450	0.04	
BNP Paribas SA, FRN, 144A 2.191% 15/09/2029	USD	3,415,000	2,865,597	0.08		AIB Group plc, FRN, 144A 4.283% 10/04/2025	USD	2,000,000	1,989,246	0.05	
									3,254,686	0.09	
BNP Paribas SA, FRN, 144A 3.052% 12/01/2021	USD	1,438,000	1,243,707	0.04		イスラエル					
BNP Paribas SA, FRN, 144A 2.582% 12/08/2025	USD	2,891,000	2,375,748	0.06		Israel Government Bond 5.5% 18/09/2033	USD	1,630,000	1,938,748	0.06	
									1,938,748	0.06	
BPCE SA, 144A 4.625% 11/07/2024	USD	1,100,000	1,094,954	0.03		イタリア					
BPCE SA, 144A 1% 20/01/2026	USD	3,415,000	3,028,517	0.08		Eni SpA, 144A 4% 12/09/2023	USD	320,000	319,971	0.01	
BPCE SA, FRN, 144A 1.652% 06/10/2026	USD	1,734,000	1,551,826	0.04		UniCredit SpA, FRN, 144A 2.589% 22/09/2026	USD	2,000,000	2,512,267	0.07	
BPCE SA, FRN, 144A 2.277% 20/01/2032	USD	2,495,000	1,981,631	0.06		UniCredit SpA, FRN, 144A 1.982% 03/08/2027	USD	510,000	440,128	0.01	
Credit Agricole SA, 144A 2.811% 11/01/2041	USD	1,355,000	940,616	0.03		UniCredit SpA, FRN, 144A 5.851% 19/08/2032	USD	1,400,000	1,243,205	0.03	
Credit Agricole SA, FRN, 144A 1.241% 26/01/2027	USD	6,207,000	5,476,363	0.15		UniCredit SpA, FRN, 144A 7.296% 02/04/2034	USD	710,000	660,577	0.02	
Societe Generale SA, 144A 4.351% 12/06/2025	USD	5,000,000	4,976,667	0.14					5,175,148	0.14	
Societe Generale SA, 144A 3% 22/01/2030	USD	384,000	309,232	0.01		日本					
Societe Generale SA, FRN, 144A 1.488% 14/12/2026	USD	9,442,000	8,940,560	0.23		Mitsubishi HC Capital, Inc., 144A 2.452% 19/09/2022	USD	600,000	599,991	0.02	
Societe Generale SA, FRN, 144A 1.792% 09/06/2027	USD	865,000	755,088	0.02		Mizuho Financial Group, Inc., FRN 2.256% 15/05/2026	USD	1,675,000	1,568,078	0.04	
Societe Generale SA, FRN, 144A 2.889% 09/06/2032	USD	2,085,000	1,655,146	0.05		Mizuho Financial Group, Inc., FRN 2.869% 12/09/2030	USD	1,872,000	1,628,691	0.04	
TotalEnergies Capital International SA 2.986% 29/06/2041	USD	2,750,000	2,157,248	0.06		Nissan Motor Co. Ltd., 144A 4.145% 17/09/2027	USD	7,754,000	7,117,454	0.20	
			43,835,750	1.23		ORIX Corp. 2.9% 18/07/2022	USD	564,000	564,008	0.02	
						ORIX Corp. 3.7% 18/07/2027	USD	500,000	483,492	0.01	
ドイツ						Sumitomo Life Insurance Co., FRN, 144A 4% 14/09/2077	USD	1,000,000	938,247	0.03	
Deutsche Bank AG, FRN 2.222% 18/09/2024	USD	3,955,000	3,813,550	0.10		Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 5% 26/11/2028	USD	2,065,000	2,101,839	0.06	
Deutsche Bank AG, FRN 2.125% 24/11/2026	USD	1,940,000	1,723,824	0.05		Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.023% 09/07/2040	USD	3,175,000	2,439,496	0.07	
Deutsche Telekom AG, 144A 3.621% 21/01/2030	USD	799,000	631,316	0.02		Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2.179% 09/07/2050	USD	1,490,000	1,119,200	0.03	
			6,168,600	0.17					18,560,406	0.52	
香港						ジャージー					
AIA Group Ltd., 144A 3.6% 09/04/2029	USD	595,000	573,351	0.02		Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 144A 2.94% 30/09/2040	USD	2,358,264	1,930,350	0.05	
			573,351	0.02					1,930,350	0.05	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)							
<b>ルクセンブルク</b>																	
nVent Finance Sarl 4.55% 15/04/2028	USD	900,000	869,533	0.02	0.06	NXP BY 3.25% 11/05/2041	USD	3,060,000	2,310,969	0.06	0.13						
SES SA, 144A 3.6% 04/04/2023	USD	200,000	197,791	0.01		4,756,255											
Swiss Re Finance Luxembourg SA, FFM, 144A 3.0% 02/04/2049	USD	1,000,000	953,922	0.03	0.06	<b>スイス</b>											
<b>オランダ</b>																	
ABN AMRO Bank NV, FFM, 144A 2.41% 13/12/2029	USD	2,300,000	1,070,138	0.05	0.03	Credit Suisse Group AG, 144A 4.20% 09/01/2038	USD	594,000	555,257	0.01	0.03						
Airbus SE, 144A 2.93% 10/04/2047	USD	210,000	185,861	0.01		Credit Suisse Group AG, FFM, 144A 2.19% 05/06/2026	USD	1,070,000	970,418	0.03							
Cooperatieve Rabobank UA 4.31% 04/08/2025	USD	501,000	497,154	0.01	0.11	Credit Suisse Group AG, FFM, 144A 1.30% 02/01/2027	USD	4,635,000	3,996,705	0.11	0.04						
Cooperatieve Rabobank UA 3.75% 21/07/2026	USD	1,357,000	1,201,609	0.03	0.09	Credit Suisse Group AG, FFM, 144A 2.091% 14/05/2022	USD	1,860,000	1,476,146	0.04							
EDP Finance BV, 144A 3.625% 15/07/2024	USD	800,000	793,969	0.02	0.05	UBS Group AG, 144A 4.125% 24/09/2025	USD	3,156,000	3,128,951	0.09	0.33						
Enel Finance International NV, 144A 3.5% 06/04/2028	USD	745,000	687,948	0.02	0.05	UBS Group AG, FFM, 144A 1.364% 30/01/2027	USD	2,000,000	1,775,712	0.05							
Lanxin Energy Finance BV, 144A 2% 15/07/2026	USD	1,041,000	928,962	0.03	0.21	<b>イギリス</b>											
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A 1.12% 16/02/2024	USD	700,000	695,351	0.02	0.02	AstraZeneca plc 6.45% 15/09/2027	USD	520,000	623,772	0.02	0.01						
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A 2.1% 15/10/2026	USD	500,000	465,943	0.01		AstraZeneca plc 4% 18/09/2042	USD	430,000	397,445	0.01							
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A 4.4% 27/05/2045	USD	250,000	237,900	0.01	0.02	AstraZeneca plc 2.11% 06/08/2028	USD	1,210,000	810,479	0.02	0.06						
<b>ニュージーランド</b>																	
Bank of New Zealand, 144A 2.5% 20/02/2024	USD	620,000	617,973	0.02	0.04	Royalty Pharma plc 0.1% 02/08/2023	USD	2,360,000	2,273,183	0.06	0.03						
BNZ International Funding Ltd., 144A 2.6% 03/11/2022	USD	900,000	899,691	0.02		Royalty Pharma plc 1.2% 02/08/2025	USD	1,057,000	945,271	0.03							
<b>パナマ</b>																	
Banco Nacional de Panama, 144A 2.5% 11/08/2020	USD	3,050,000	2,424,292	0.07	0.01	Vodafone Group plc 5.25% 30/05/2048	USD	683,000	658,872	0.02	0.07						
<b>シンガポール</b>																	
BOC Aviation Ltd., 144A 2.75% 18/09/2022	USD	650,000	649,486	0.02	0.21	Vodafone Group plc 4.875% 19/06/2049	USD	2,550,000	2,336,833	0.07	0.23						
<b>国際機関</b>																	
NXP BY 2.5% 11/05/2031	USD	2,975,000	2,445,206	0.07	<b>アメリカ</b>												
<b>アメリカ</b>																	
7-Eleven, Inc., 144A 1.5% 10/02/2028																	
7-Eleven, Inc., 144A 2.5% 10/02/2041																	
AbbVie, Inc. 3.85% 15/06/2024																	
AbbVie, Inc. 4.55% 15/03/2035																	
Activision Blizzard, Inc. 1.5% 15/09/2030																	
Advocate Health & Hospitals Corp. 2.11% 15/06/2020																	
AEP Transmission Co. LLC 4% 01/12/2046																	
AEP Transmission Co. LLC 3.8% 15/06/2049																	
ASG Sintermeta Global Financing 1, 144A 6.5% 15/01/2022																	
Air Lease Corp. 3.875% 01/07/2023																	
Alexander Funding Trust, 144A 1.04% 16/11/2023																	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)						
Alternative Loan Trust, Series 2005-94CB 'A11' 5.9% 25/11/2026	USD	115,565	96,581	0.00		American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFR1 'D', 144A 4.401% 17/04/2032	USD	6,418,000	6,327,697	0.18	
Alternative Loan Trust, Series 2005-29CB 'A4' 5.5% 25/06/2025	USD	94,128	86,296	0.00		American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFR2 'D', 144A 5.036% 17/10/2032	USD	4,103,000	4,082,524	0.11	
Alternative Loan Trust, Series 2004-32CB 'A9' 5.15% 25/03/2024	USD	286,765	287,730	0.01		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR2 'E', 144A 6.231% 17/10/2026	USD	5,950,000	5,995,976	0.17	
Alternative Loan Trust, Series 2004-29CB 'A1' 6% 25/01/2025	USD	22,360	20,806	0.00		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR3 'E', 144A 6.418% 17/12/2026	USD	3,681,000	3,715,146	0.10	
Alternative Loan Trust, II, FOM, Series 2005-20CB 'A8' 3.12% 25/01/2026	USD	428,422	26,236	0.00		American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFR1 'E', 144A 5.635% 17/04/2032	USD	2,800,000	2,854,413	0.08	
Amazon.com, Inc. 3.871% 22/09/2027	USD	1,000,000	944,226	0.03		American Municipal Power, Inc. 'E' 7.49% 15/02/2030	USD	715,000	941,060	0.03	
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2014-1 'A' 3.1% 01/04/2028	USD	1,500,730	1,294,413	0.04		American Tower Trust #1, REIT, 144A 3.07% 15/03/2048	USD	1,950,000	1,937,671	0.05	
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2018-2 'A' 3.2% 15/12/2029	USD	445,200	406,450	0.01		Angen, Inc. 1.65% 15/08/2028	USD	1,190,000	1,019,613	0.03	
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2018-2 'A' 2% 15/04/2030	USD	1,462,210	1,316,396	0.04		Angen, Inc. 3.15% 21/02/2040	USD	625,000	496,903	0.01	
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2017-1 'A' 3.6% 15/08/2030	USD	1,655,895	1,517,866	0.04		Analog Devices, Inc. 2.8% 01/01/2041	USD	1,854,000	1,459,654	0.04	
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-1 'A' 3.1% 15/08/2031	USD	2,050,617	1,822,647	0.05		Apple, Inc. 3.25% 23/02/2026	USD	266,000	284,043	0.01	
American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR2 'A', 144A 3.78% 17/10/2026	USD	5,617,826	5,574,621	0.16		Apple, Inc. 2.45% 04/08/2026	USD	1,259,000	1,208,496	0.03	
American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR3 'A', 144A 3.67% 17/12/2026	USD	12,554,628	12,397,711	0.35		Apple, Inc. 3.45% 09/02/2045	USD	792,000	689,584	0.02	
American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFR1 'A', 144A 3.467% 17/04/2032	USD	6,255,230	6,113,674	0.17		Apple, Inc. 3.85% 04/08/2046	USD	879,000	809,814	0.02	
American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFR2 'A', 144A 3.73% 17/10/2032	USD	1,397,004	1,370,522	0.04		Ascension Health 2.52% 15/11/2029	USD	1,770,000	1,596,076	0.05	
American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR1 'B', 144A 4.201% 17/12/2026	USD	750,000	745,996	0.02		Assurant, Inc. 4.2% 27/09/2023	USD	910,000	916,569	0.03	
American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR2 'C', 144A 4.70% 17/10/2026	USD	1,300,000	1,306,345	0.04		Athens Global Funding, 144A 0.95% 08/01/2024	USD	2,718,000	2,590,569	0.07	
American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR1 'C', 144A 4.99% 17/12/2026	USD	500,000	497,172	0.01		Athens Global Funding, 144A 2.75% 25/06/2024	USD	1,885,000	1,821,473	0.05	
American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFR2 'C', 144A 4.691% 17/10/2032	USD	1,893,000	1,874,973	0.05		Athens Global Funding, 144A 1.5% 14/01/2025	USD	767,000	730,082	0.02	
American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR1 'D', 144A 5.04% 17/12/2026	USD	523,000	521,850	0.02		Athens Global Funding, 144A 1.45% 08/01/2026	USD	2,770,000	2,464,299	0.07	
						Athens Global Funding, 144A 2.95% 12/11/2026	USD	5,285,000	4,852,921	0.14	
						Aviation Capital Group LLC, 144A 3.315% 01/05/2023	USD	1,950,000	1,933,587	0.05	
						Aviation Capital Group LLC, 144A 5.3% 15/12/2024	USD	2,094,000	2,076,331	0.06	
						Avis Budget Rental Car Funding/ABS LLC, Series 2018-24 'A', 144A 4% 20/02/2025	USD	7,000,000	6,995,042	0.20	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
Baker Hughes Holdings LLC 5.125% 15/09/2049	USD	700,000	702,429	0.02		Bank of America Corp., FPM 2.616% 19/06/2041	USD	6,636,000	4,776,540	0.13	
Baltimore Gas and Electric Co. 2.8% 15/08/2022	USD	619,000	619,000	0.02		Bank of New York Mellon Corp. (The), FPM 3.43% 15/06/2025	USD	5,000,000	4,988,667	0.14	
Baltimore Gas and Electric Co. 3.5% 15/08/2046	USD	385,000	318,126	0.01		BBUS Trust, Series 2002-SHOW 'A', 144A 3.43% 09/11/2036	USD	3,850,000	3,700,332	0.10	
Baltimore Gas and Electric Co. 3.2% 15/09/2049	USD	885,000	688,188	0.02		Bear Stearns ARM Trust, FPM, Series 2004-2 '14A' 3.07% 25/05/2034	USD	17,823	16,987	0.00	
Baltimore Gas and Electric Co. 2.5% 15/06/2050	USD	1,000,000	733,793	0.02		Bear Stearns ARM Trust, FPM, Series 2003-7 '3A' 3.03% 25/10/2033	USD	3,523	3,348	0.00	
BAMLL Ye-BENIC Trust, FPM, Series 2016-FR11 'A', 144A 0.599% 27/08/2045	USD	2,631,163	2,626,231	0.07		Bear Stearns ARM Trust, FPM, Series 2003-4 '3A' 2.67% 25/01/2033	USD	36,568	36,045	0.00	
Base of America Funding Trust, Series 2004-2 '1CB' 5.75% 20/09/2004	USD	25,465	25,357	0.00		Bear Stearns ARM Trust, FPM, Series 2006-1 'A1' 2.4% 25/02/2036	USD	35,206	34,557	0.00	
Base of America Funding Trust, Series 2005-6 '3A7' 5.5% 25/10/2005	USD	70,684	63,736	0.00		Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust, IO, FPM, Series 2005-FRM8 'X1', 144A 0.716% 11/06/2041	USD	3,286	3	0.00	
Base of America Funding Trust, PO, Series 2004-2 '3AP' 0% 20/09/2004	USD	7,700	5,876	0.00		Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust, IO, FPM, Series 2001-736 'X1', 144A 1.168% 12/01/2045	USD	49,409	106	0.00	
Base of America Funding Trust, PO, Series 2006-7 '3AP' 0% 25/11/2005	USD	13,096	12,119	0.00		Biogen, Inc. 2.25% 01/05/2030	USD	1,520,000	1,249,120	0.04	
Bank of America Corp., FPM 3.458% 15/03/2025	USD	500,000	493,445	0.01		Blackstone Secured Lending Fund 3.6% 14/07/2023	USD	1,860,000	1,833,406	0.05	
Bank of America Corp., FPM 3.092% 01/10/2025	USD	635,000	614,977	0.02		Bin Sengus Mercy Health, Inc. 3.20% 02/09/2050	USD	1,980,000	1,488,404	0.04	
Bank of America Corp., FPM 3.396% 23/01/2026	USD	1,000,000	970,564	0.03		Boston Gas Co., 144A 4.487% 15/02/2042	USD	149,000	133,505	0.00	
Bank of America Corp., FPM 1.698% 11/03/2021	USD	2,510,000	2,257,140	0.06		Bristol-Myers Squibb Co. 3.8% 20/02/2028	USD	1,000,000	999,007	0.03	
Bank of America Corp., FPM 1.734% 22/07/2021	USD	705,000	629,695	0.02		Bristol-Myers Squibb Co. 4.13% 15/06/2029	USD	936,000	895,945	0.03	
Bank of America Corp., FPM 3.709% 24/04/2022	USD	3,600,000	3,433,820	0.10		Bristol-Myers Squibb Co. 4.53% 20/02/2043	USD	777,000	760,531	0.02	
Bank of America Corp., FPM 4.376% 27/04/2022	USD	2,700,000	2,660,447	0.07		British Airways Pass-Through Trust, Series 2013-1 'A', 144A 4.12% 20/03/2033	USD	1,407,635	1,250,369	0.04	
Bank of America Corp., FPM 3.419% 30/12/2022	USD	66,000	61,449	0.00		British Airways Pass-Through Trust, Series 2018-1 'A', 144A 3.8% 20/03/2033	USD	605,360	567,156	0.02	
Bank of America Corp., FPM 3.97% 05/03/2023	USD	409,000	389,752	0.01		British Airways Pass-Through Trust, Series 2019-1 'A', 144A 3.3% 15/06/2034	USD	1,113,205	988,475	0.03	
Bank of America Corp., FPM 2.087% 14/06/2023	USD	1,091,000	930,831	0.03		Brimor Operating Partnership LP, REIT 2.5% 16/04/2021	USD	765,000	599,915	0.02	
Bank of America Corp., FPM 2.592% 23/04/2021	USD	3,045,000	2,587,473	0.07		Broadcom, Inc., 144A 2.45% 15/02/2031	USD	4,373,000	3,515,367	0.10	
Bank of America Corp., FPM 1.898% 23/07/2021	USD	1,675,000	1,341,046	0.04							
Bank of America Corp., FPM 2.687% 22/04/2022	USD	2,635,000	2,217,602	0.06							
Bank of America Corp., FPM 2.572% 20/10/2022	USD	1,190,000	982,938	0.03							

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)
Broadcom, Inc., 144A 3.137% 15/11/2035	USD	3,709,000	2,007,230	0.08	Chase Mortgage Finance Trust, FPM, Series 2007-02 '241' 2.435% 25/02/2035	USD	57,961	57,161	0.00
Broadcom, Inc., 144A 3.187% 15/11/2036	USD	77,000	50,065	0.00	Chase Mortgage Finance Trust, FPM, Series 2007-01 '741' 2.835% 25/02/2037	USD	9,776	9,788	0.00
Brooklyn Union Gas Co. (The), 144A 3.865% 04/02/2029	USD	785,000	739,419	0.02	Chase Mortgage Finance Trust, FPM, Series 2007-01 '941' 2.715% 25/02/2037	USD	12,254	12,022	0.00
Brooklyn Union Gas Co. (The), 144A 4.215% 15/02/2040	USD	760,000	623,021	0.02	Chamire Capex Christi Holdings LLC 5.125% 30/06/2027	USD	420,000	421,051	0.01
Budge Partners LP 5.85% 15/11/2043	USD	450,000	320,496	0.01	Chamire Capex Christi Holdings LLC 3.75% 15/11/2029	USD	1,200,000	1,103,516	0.03
BOJ Receivables Note Trust, Series 2018-A 'C', 144A 4.445% 02/02/2034	USD	2,463,357	2,399,320	0.07	Chevron Phillips Chemical Co. LLC, 144A 5.125% 01/04/2025	USD	1,955,000	2,015,069	0.06
Cameron LNG LLC, 144A 3.302% 15/01/2035	USD	2,300,000	1,075,212	0.05	Chevron USA, Inc. 2.5% 15/11/2024	USD	400,000	403,843	0.01
Camillo LLC, Series 2016-SFR 1.5% 05/12/2021	USD	4,181,310	4,214,778	0.12	Children's Health System of Texas 2.515% 15/08/2030	USD	2,430,000	1,661,498	0.05
Camillo LLC, Series 2018-SFR1 'A', 144A 5.25% 05/06/2028	USD	4,232,320	4,285,385	0.12	Children's Hospital Corp. (The) 3.585% 01/02/2030	USD	1,387,000	966,024	0.03
Capital One Financial Corp., FPM 4.165% 09/05/2025	USD	7,000,000	6,901,367	0.19	Children's Hospital/DC 2.928% 15/07/2030	USD	1,580,000	1,133,300	0.03
Capital One Financial Corp., FPM 4.925% 10/05/2028	USD	1,407,000	1,394,218	0.04	CHL Mortgage Pass-Through Trust 4.5% 25/06/2021	USD	2,161	2,175	0.00
Capital One Financial Corp., FPM 2.615% 02/11/2032	USD	1,385,000	1,096,385	0.03	CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-5 'M' 5.5% 25/06/2004	USD	77,884	75,362	0.00
Carmax Auto Owner Trust, Series 2018-4 'A3' 3.385% 15/09/2023	USD	14,453	14,460	0.00	CHL Mortgage Pass-Through Trust, FPM, Series 2004-7 '2A1' 3.064% 25/06/2024	USD	15,538	14,958	0.00
Charter Communications Operating LLC 2.75% 15/02/2028	USD	1,146,000	1,053,720	0.03	CHL Mortgage Pass-Through Trust, FPM, Series 2005-22 '2A1' 2.485% 25/11/2025	USD	110,526	99,581	0.00
Charter Communications Operating LLC 6.304% 23/10/2025	USD	375,000	376,509	0.01	CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-1 'A2' 5.5% 25/04/2004	USD	112,528	105,549	0.00
Charter Communications Operating LLC 5.315% 01/04/2028	USD	400,000	356,071	0.01	CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-1 'M' 5.75% 25/04/2004	USD	56,264	53,020	0.00
Charter Communications Operating LLC 2.5% 01/06/2041	USD	1,345,000	940,212	0.03	Cigna Corp. 4.5% 25/02/2026	USD	1,366,000	1,381,562	0.04
Charter Communications Operating LLC 4.0% 01/01/2030	USD	2,585,000	2,071,299	0.06	Cincinnati Financial Corp. 6.92% 15/05/2028	USD	156,000	149,086	0.00
Charter Communications Operating LLC 2.7% 01/04/2031	USD	2,570,000	1,741,763	0.05	Cincinnati Financial Corp. 6.125% 01/11/2024	USD	290,000	329,381	0.01
Charter Communications Operating LLC 6.814% 23/10/2025	USD	350,000	353,271	0.01	Citicorp Mortgage Securities RMBS Pass-Through Certificates Trust, Series 2005-1 'A2' 5% 25/04/2009	USD	3,037	2,876	0.00
Chase Funding Trust, STSP, Series 2002-4 '1A5' 4.944% 25/05/2023	USD	98,274	96,384	0.00	Citicorp Mortgage Securities Trust, Series 2009-4 '1A2' 6% 25/03/2026	USD	43,050	40,853	0.00
Chase Funding Trust, STSP, Series 2002-6 '1A1' 4.904% 25/11/2024	USD	59,918	58,062	0.00	Citicorp Mortgage Securities, Inc., Series 2004-1 'A5' 5.25% 25/05/2004	USD	165,057	159,001	0.01
Chase Mortgage Finance Trust, FPM, Series 2007-01 '1A3' 2.415% 25/02/2017	USD	179,360	174,321	0.01					
Chase Mortgage Finance Trust, FPM, Series 2007-01 '2A1' 2.775% 25/02/2017	USD	16,000	15,714	0.00					

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
Citigroup Global Markets Mortgage Securities VII, Inc., FPN, Series 2001-0031 'A' 1.24% 25/09/2013	USD	20,007	20,346	0.00		COMM Mortgage Trust, FPN, Series 2018-0006 'A', 144A 1.815% 10/04/2013	USD	13,940,000	13,999,489	0.36	
Citigroup Global Markets Mortgage Securities VII, Inc., FPN, Series 2001-0031 '001' 0% 25/09/2013	USD	52	49	0.00		COMM Mortgage Trust, Series 2015-0025 'A' 3.125% 10/08/2008	USD	1,250,000	1,227,543	0.03	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2005-2 '2011' 5.9% 25/09/2005	USD	54,964	53,451	0.00		Commercial Mortgage Trust, 10, FPN, Series 2012-002 '3A' 1.435% 15/08/2005	USD	123,053	8	0.00	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2003-1 '205' 5.25% 25/09/2003	USD	5,217	5,059	0.00		CommonSpirit Health 1.547% 01/10/2025	USD	1,385,000	1,273,677	0.04	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2003-1 '204' 5.25% 25/09/2003	USD	16,254	15,165	0.00		CommonSpirit Health 2.782% 01/10/2030	USD	1,385,000	1,184,062	0.03	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2000-003 '03' 7% 25/09/2000	USD	466	463	0.00		CommonSpirit Health 3.91% 01/10/2050	USD	1,385,000	1,100,942	0.03	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., FPN, Series 2004-0011 '01' 2.012% 25/09/2004	USD	9,623	9,408	0.00		Commonwealth Edison Co. 5.875% 01/02/2033	USD	1,000,000	1,096,136	0.03	
Citigroup, Inc., FPN 3.352% 24/04/2025	USD	1,175,000	1,153,619	0.03		Constellation Energy Generation LLC 3.25% 01/06/2025	USD	1,230,000	1,178,302	0.03	
Citigroup, Inc., FPN 3.887% 10/01/2028	USD	4,700,000	4,516,736	0.13		Constellation Energy Generation LLC 6.25% 01/10/2039	USD	1,000,000	1,028,040	0.03	
Citigroup, Inc., FPN 3.668% 24/07/2028	USD	4,305,000	4,067,290	0.11		Constellation Energy Generation LLC 5.75% 01/10/2041	USD	114,000	111,753	0.00	
Citigroup, Inc., FPN 1.52% 27/09/2028	USD	750,000	700,640	0.02		Continental Airlines Pass-Through Trust, Series 2012-2 'A' 4% 20/04/2026	USD	310,612	298,256	0.01	
Citigroup, Inc., FPN 4.075% 23/04/2029	USD	2,226,000	2,125,630	0.06		Corbridge Financial, Inc., 144A 3.35% 06/04/2029	USD	985,000	909,682	0.03	
Citigroup, Inc., FPN 2.52% 09/11/2032	USD	1,740,000	1,411,327	0.04		Cottage Health Obligated Group 3.304% 01/11/2049	USD	1,220,000	991,010	0.03	
Citigroup, Inc., FPN 3.057% 25/01/2033	USD	569,000	482,878	0.01		Cox Communications, Inc., 144A 3.35% 15/09/2026	USD	503,000	480,811	0.01	
Citigroup, Inc., FPN 3.878% 24/01/2039	USD	200,000	173,350	0.01		Cox Communications, Inc., 144A 3.5% 15/09/2027	USD	162,000	153,648	0.00	
Citizens Financial Group, Inc. 2.68% 30/09/2032	USD	199,000	150,978	0.00		Cox Communications, Inc., 144A 2.95% 01/10/2050	USD	1,495,000	989,865	0.03	
City of Los Angeles Department of Airports 6.582% 15/05/2079	USD	275,000	315,855	0.01		CPS Auto Receivables Trust, Series 2018-0 '0', 144A 4.34% 16/09/2024	USD	708,784	709,979	0.02	
Cleveland Electric Illuminating Co. (The), 144A 3.5% 01/04/2028	USD	857,000	808,825	0.02		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities 5% 25/03/2022	USD	8,146	5,988	0.00	
Comcast Cable Communications LLC 8.5% 01/05/2017	USD	394,000	460,168	0.01		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., Series 2003-21 '1M'	USD	49,438	47,153	0.00	
Comcast Corp. 1.375% 15/02/2015	USD	793,000	787,608	0.02		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., Series 2004-02 '2A1' 2.275% 25/02/2034	USD	49,364	48,344	0.00	
Comcast Corp. 3.55% 01/05/2028	USD	886,000	857,636	0.02		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., Series 2004-02 '2A1' 2.275% 25/02/2034	USD	9,097	5,217	0.00	
Comcast Corp. 4.25% 15/01/2033	USD	2,133,000	2,094,516	0.06		Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., Series 2004-02 '2A1' 2.275% 25/02/2034	USD	1,033,560	1,033,560	0.03	
Comcast Corp. 4.2% 15/08/2034	USD	676,000	649,888	0.02							
Comcast Corp. 3.2% 15/07/2036	USD	850,000	723,071	0.02							
Comcast Corp. 3.9% 01/03/2038	USD	2,000,000	1,813,161	0.05							
Comcast Corp. 3.25% 01/11/2039	USD	1,380,000	1,037,467	0.03							
Comcast Corp. 3.75% 01/04/2040	USD	2,155,000	1,890,690	0.05							
Comcast Corp. 1.881% 01/11/2051	USD	1,439,000	1,033,560	0.03							

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)						
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., PO, Series 2007-31 'A' 6% 25/09/2033	USD	9,222	7,697	0.00		CYS Pass-Through Trust, Series 2014, 1444 4.15% 11/09/2036	USD	371,310	339,535	0.01	
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., PO, Series 2004-3 'A' 6% 25/06/2044	USD	11,313	7,054	0.00		Banlar Finance North America LLC, 1444 3.3% 19/05/2025	USD	355,000	347,447	0.01	
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., FOM, Series 2003-1 'BB' 6.65% 25/02/2032	USD	23,839	23,477	0.00		Dell International LLC 5.45% 15/06/2023	USD	292,000	295,640	0.01	
CRF America Finance, Inc., 1444 3.4% 09/05/2027	USD	298,000	284,508	0.01		Delmarva Power & Light Co. 4% 01/06/2042	USD	141,000	122,715	0.00	
CRF America, Inc., 1444 3.875% 18/05/2025	USD	300,000	199,266	0.01		Delmarva Power & Light Co. 4.15% 15/06/2045	USD	1,000,000	894,734	0.03	
CRF America, Inc., 1444 5.125% 18/05/2045	USD	300,000	194,561	0.01		Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust, STP, Series 2004-1 '3A' 5.24% 25/12/2033	USD	1,798	1,760	0.00	
Crown Castle Towers LLC, 1444 3.65% 15/05/2045	USD	900,000	873,800	0.02		Devon Energy Corp. 5.2% 15/09/2024	USD	1,300,000	1,326,488	0.04	
CSB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-8 'AA' 5.5% 25/12/2024	USD	88,996	83,852	0.00		Diamondback Energy, Inc. 3.25% 01/12/2026	USD	1,435,000	1,401,227	0.04	
CSB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-4 'AA' 5.5% 25/06/2024	USD	50,705	49,091	0.00		Discovery Communications LLC 5.2% 20/09/2047	USD	1,280,000	1,101,578	0.03	
CSB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2005-27 'AA' 5.25% 25/11/2033	USD	5,147	4,849	0.00		Discovery Communications LLC 4% 15/09/2035	USD	257,000	182,137	0.01	
CSB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, PO, Series 2003-27 'A' 6% 25/11/2033	USD	8,426	6,696	0.00		Duquesne Light Holdings, Inc., 1444 3.61% 01/08/2027	USD	1,350,000	1,254,014	0.04	
CSB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, PO, Series 2005-10 'A' 6% 25/11/2033	USD	16,880	11,453	0.00		Duquesne Light Holdings, Inc., 1444 2.55% 01/10/2030	USD	2,320,000	1,907,776	0.05	
CSX Corp. 6% 01/10/2036	USD	500,000	555,471	0.02		Eastern Gas Transmission & Storage, Inc., 1444 4.6% 15/12/2044	USD	900,000	825,509	0.02	
CSX Corp. 4.1% 15/03/2044	USD	185,000	145,822	0.00		Eastern Gas Transmission & Storage, Inc., 1444 3.9% 15/11/2049	USD	1,119,000	904,135	0.03	
CSX Corp. 4.75% 15/11/2048	USD	910,000	890,034	0.03		Emera US Finance LP 4.75% 15/06/2046	USD	1,200,000	1,066,376	0.03	
CSX Corp. 3.35% 15/09/2049	USD	230,000	181,102	0.01		Energy Transfer LP 5.5% 01/06/2027	USD	254,000	257,244	0.01	
CYS Pass-Through Trust, 1444 5.25% 11/01/2027	USD	108,817	110,020	0.00		Equinix, Inc., REIT 2.9% 18/11/2026	USD	2,850,000	2,647,710	0.07	
CYS Pass-Through Trust, 1444 7.50% 10/01/2032	USD	932,565	1,015,065	0.03		ERAC USA Finance LLC, 1444 7% 15/10/2037	USD	510,000	598,988	0.02	
CYS Pass-Through Trust, 1444 5.77% 10/01/2033	USD	507,485	514,118	0.01		ERAC USA Finance LLC, 1444 5.625% 15/03/2042	USD	96,000	96,784	0.00	
CYS Pass-Through Trust, 1444 5.92% 10/01/2034	USD	510,818	519,886	0.02		P&G Global Funding, 1444 1.75% 30/06/2026	USD	1,575,000	1,396,429	0.04	
CYS Pass-Through Trust, Series 2009, 1444 8.35% 10/07/2031	USD	349,196	281,109	0.01		Fellis Point Funding Trust, 1444 3.04% 31/01/2027	USD	4,370,000	4,030,395	0.11	
						FHLBNC 4% 01/07/2048	USD	4,645,120	4,639,385	0.13	
						FHLBNC, Series T-54 '2A' 6.5% 25/02/2045	USD	15,417	16,757	0.00	
						FHLBNC, FOM, Series T-76 '2A' 1.5% 25/10/2027	USD	265,110	252,818	0.01	
						FHLBNC, FOM, Series T-41 '2A' 4.9% 25/07/2032	USD	10,405	10,432	0.00	
						FHLBNC, Series T-54 '2A' 7% 25/02/2043	USD	19,707	20,993	0.00	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
FHLMC, Series KPLB 'A' 2.77% 25/05/2025	USD	2,000,000	1,963,307	0.06		FHLMC, FRN 1K0046 2.48% 01/10/2036	USD	61,534	61,143	0.00	
FHLMC, Series K037 'A2' 3.49% 25/01/2034	USD	2,500,000	2,503,193	0.07		FHLMC, FRN 1L1286 3.2% 01/05/2036	USD	20,744	21,498	0.00	
FHLMC, FRN Series 8040 'A2' 3.28% 25/06/2025	USD	3,000,000	2,979,369	0.08		FHLMC, FRN 1N0206 1.995% 01/08/2036	USD	23,316	23,813	0.00	
FHLMC, Series K054 'A2' 2.745% 25/01/2026	USD	4,000,000	3,897,916	0.11		FHLMC, FRN 1N0353 2.396% 01/02/2037	USD	30,990	31,316	0.00	
FHLMC, Series K045 'A2' 3.241% 25/04/2027	USD	2,983,000	2,936,861	0.08		FHLMC, FRN 1N1463 2.804% 01/05/2037	USD	6,049	5,992	0.00	
FHLMC, Series K038 'A2' 3.69% 25/01/2029	USD	1,156,000	1,159,604	0.03		FHLMC, FRN 1Q0007 2.39% 01/12/2036	USD	15,872	15,963	0.00	
FHLMC, Series K152 'A2' 3.08% 25/01/2031	USD	3,761,000	3,611,538	0.10		FHLMC, FRN 1Q0737 1.968% 01/11/2036	USD	32,572	32,604	0.00	
FHLMC, Series KJ11 'A2' 2.912% 25/01/2022	USD	508,762	507,387	0.01		FHLMC, FRN 1Q0739 2.236% 01/03/2037	USD	66,906	68,999	0.00	
FHLMC, Series KJ26 'A2' 2.692% 25/01/2021	USD	10,000,000	9,717,663	0.27		FHLMC, FRN 782760 2.307% 01/11/2036	USD	33,301	34,559	0.00	
FHLMC, Series T-42 'A5' 7.5% 25/02/2042	USD	300,667	223,747	0.01		FHLMC, FRN 782870 2.457% 01/09/2034	USD	108,149	112,016	0.00	
FHLMC, Series T-56 'A5' 5.211% 25/05/2041	USD	594,761	612,403	0.02		FHLMC, FRN 782979 2.375% 01/01/2035	USD	140,279	144,214	0.00	
FHLMC, FRN Series FRN 'A2' 3.24% 25/04/2028	USD	2,228,000	2,191,139	0.06		FHLMC, FRN 782980 2.375% 01/01/2035	USD	62,774	64,163	0.00	
FHLMC, Series K065 'AN' 3.30% 25/05/2027	USD	1,600,000	1,574,902	0.04		FHLMC, FRN 847621 2.585% 01/05/2033	USD	33,195	33,737	0.00	
FHLMC, Series 24 'J' 6.25% 25/11/2023	USD	3,473	3,519	0.00		FHLMC, FRN 848365 2.337% 01/07/2036	USD	129,125	133,741	0.00	
FHLMC, Series 29 'L' 7.5% 25/04/2024	USD	15,044	15,326	0.00		FHLMC, FRN 848431 2.369% 01/02/2036	USD	73,809	75,912	0.00	
FHLMC, FRN 1A1082 2.071% 01/07/2036	USD	19,266	19,097	0.00		FHLMC, FRN 848699 2.105% 01/07/2040	USD	46,389	47,755	0.00	
FHLMC, FRN 1A1085 2.042% 01/08/2036	USD	41,346	42,610	0.00		FHLMC, FRN 972200 2.155% 01/03/2036	USD	15,954	15,865	0.00	
FHLMC, FRN 1A1096 2.307% 01/10/2036	USD	40,683	50,117	0.00		FHLMC 861376 6.5% 01/07/2032	USD	71,421	74,955	0.00	
FHLMC, FRN 1A1097 2.57% 01/10/2036	USD	54,419	55,901	0.00		FHLMC 888871 7% 01/01/2031	USD	59,461	62,576	0.00	
FHLMC, FRN 1B1665 2.862% 01/04/2034	USD	7,985	7,982	0.00		FHLMC 890491 7.5% 01/01/2032	USD	54,093	57,601	0.00	
FHLMC, FRN 1G2557 2.562% 01/06/2036	USD	81,641	84,546	0.00		FHLMC C75791 5.5% 01/01/2033	USD	13,288	13,914	0.00	
FHLMC, FRN 1J1399 2.375% 01/12/2036	USD	5,497	5,466	0.00		FHLMC C80985 6.5% 01/08/2026	USD	10,196	10,571	0.00	
FHLMC, FRN 1J1410 1.9% 01/12/2036	USD	18,638	18,524	0.00		FHLMC G01440 7% 01/08/2032	USD	4,266	4,564	0.00	
FHLMC, FRN 1J1516 2.074% 01/02/2037	USD	19,830	20,234	0.00		FHLMC G02436 6.5% 01/09/2036	USD	61,825	67,625	0.00	
FHLMC, FRN 1J1574 2.725% 01/04/2037	USD	2,561	2,549	0.00		FHLMC G04077 6.5% 01/03/2038	USD	46,646	50,566	0.00	
FHLMC, FRN 1J2945 2% 01/11/2037	USD	9,808	9,723	0.00		FHLMC G04952 7.5% 01/01/2038	USD	57,815	61,443	0.00	
						FHLMC G05671 5.5% 01/08/2038	USD	80,256	85,591	0.00	
						FHLMC G06493 4.5% 01/05/2041	USD	1,825,455	1,856,142	0.03	
						FHLMC G31099 4% 01/01/2038	USD	3,427,447	3,514,839	0.10	
						FHLMC G60214 5% 01/07/2035	USD	4,483,074	4,825,069	0.13	
						FHLMC L10221 6% 01/01/2034	USD	25,104	25,134	0.00	
						FHLMC L10224 6% 01/12/2034	USD	108,559	112,332	0.00	



## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)						
FHLAC Q42657 3.5% 01/08/2046	USD	2,184,544	2,127,485	0.06		FHLAC REMICS, 10, FHM, Series 1369	USD	21,905	2,800	0.00	
FHLAC Q49329 4.5% 01/07/2047	USD	553,655	563,976	0.02		'CS' 4.810% 15/01/2031					
FHLAC Q62834 4% 01/12/2047	USD	2,359,322	2,255,461	0.06		FHLAC REMICS, Series 369A 'C' 4.5%	USD	207,999	210,759	0.01	
FHLAC U63546 5% 01/11/2043	USD	44,719	46,185	0.00		15/06/2025					
FHLAC U69030 4.5% 01/01/2046	USD	2,087,365	2,136,102	0.06		FHLAC REMICS, Series 2928 'D' 4%	USD	2,165,967	2,047,001	0.06	
FHLAC U90673 4% 01/01/2043	USD	344,940	345,480	0.01		15/09/2041					
FHLAC U90690 3.5% 01/06/2042	USD	983,892	957,466	0.03		FHLAC REMICS, Series 4900 'D' 3%	USD	1,686,581	1,616,463	0.05	
FHLAC U90975 4% 01/06/2042	USD	856,070	858,873	0.02		25/07/2049					
FHLAC U91253 4% 01/04/2043	USD	2,383,295	2,270,752	0.06		FHLAC REMICS, 10, Series 2219 'D1' 0%	USD	23,342	4,725	0.00	
FHLAC U91305 3.5% 01/04/2043	USD	493,629	393,115	0.01		15/04/2026					
FHLAC U91484 4% 01/05/2043	USD	2,462,175	2,470,267	0.07		FHLAC REMICS, FHM, Series 3051 'D'	USD	7,101	7,439	0.00	
FHLAC U93007 3.5% 01/07/2045	USD	649,611	634,083	0.02		22/2021 15/10/2025					
FHLAC U93024 3.5% 01/08/2045	USD	659,065	641,992	0.02		FHLAC REMICS, Series 379A 'D' 7.5%	USD	125,049	139,521	0.00	
FHLAC U93089 3.5% 01/12/2035	USD	495,568	493,386	0.01		05/11/2026					
FHLAC U93090 3.5% 01/11/2045	USD	494,795	480,075	0.01		FHLAC REMICS, 10, Series 3795 'E1' 5%	USD	67,553	1,718	0.00	
FHLAC U93143 3.5% 01/04/2046	USD	623,620	610,458	0.02		15/10/2029					
FHLAC U93154 3.5% 01/05/2046	USD	86,988	83,876	0.00		FHLAC REMICS, FQ, Series 3117 'B0'	USD	11,094	9,584	0.00	
FHLAC U93051 3.5% 01/06/2043	USD	1,133,191	1,102,894	0.03		05/15/03/2026					
FHLAC U93134 4% 01/01/2046	USD	1,288,946	1,273,108	0.04		FHLAC REMICS, FQ, Series 3153 'B0'	USD	56,243	48,326	0.00	
FHLAC Y85515 4% 01/03/2049	USD	381,989	298,587	0.01		05/15/05/2026					
FHLAC Z40024 5.5% 01/04/2056	USD	26,736	28,249	0.00		FHLAC REMICS, FQ, Series 4280 'B0'	USD	460,392	386,916	0.01	
FHLAC Pool 269011 1.5% 01/12/2049	USD	4,552,673	4,264,579	0.12		05/15/12/2043					
FHLAC REMICS, Series 2619 'A'	USD	26,001	26,085	0.00		FHLAC REMICS, Series 379A 'E2' 7.5%	USD	114,200	128,805	0.00	
15/05/2023						15/12/2026					
FHLAC REMICS, 10, STEP, Series 2422	USD	186,415	1,585	0.00		FHLAC REMICS, Series 2388 'E2' 8.5%	USD	12,493	14,108	0.00	
'A1' 0.2% 15/01/2028						15/06/2021					
FHLAC REMICS, FQ, Series 3697 'A0'	USD	24,632	20,826	0.00		FHLAC REMICS, FHM, Series 3549 'E4'	USD	10,465	10,649	0.00	
0% 15/04/2026						2.204% 15/01/2029					
FHLAC REMICS, Series 2811 'A2' 6.5%	USD	161,016	176,090	0.01		FHLAC REMICS, FHM, Series 2088 'E8'	USD	14,930	14,904	0.00	
15/07/2026						1.904% 15/01/2029					
FHLAC REMICS, Series 2420 'B' 5.5%	USD	10,783	11,322	0.00		FHLAC REMICS, FHM, Series 4048 'EJ'	USD	665,199	660,661	0.02	
15/05/2028						0.855% 15/01/2027					
FHLAC REMICS, Series 2951 'B' 4%	USD	65,976	66,321	0.00		FHLAC REMICS, FHM, Series 2275 'E2'	USD	7,637	7,624	0.00	
15/11/2041						1.794% 15/02/2027					
FHLAC REMICS, Series 2694 'B4' 4%	USD	4,011	4,021	0.00		FHLAC REMICS, Series 2594 'E2' 6%	USD	17,961	19,533	0.00	
15/06/2011						15/12/2022					
FHLAC REMICS, Series 2143 'B2' 5.5%	USD	94,061	99,992	0.00		FHLAC REMICS, FQ, FHM, Series 1302	USD	235,503	30,642	0.00	
15/02/2026						'B1' 5.120% 15/02/2026					
FHLAC REMICS, FHM, Series 2966 'D'	USD	620	620	0.00		FHLAC REMICS, Series 2483 'E6' 4.5%	USD	380,477	394,994	0.01	
1.824% 15/10/2040						15/06/2022					
FHLAC REMICS, FQ, Series 3697 'B0'	USD	18,474	16,020	0.00		FHLAC REMICS, 10, Series 3714 'E' 5%	USD	81,517	7,446	0.00	
0% 15/04/2026						15/06/2040					
FHLAC REMICS, FQ, Series 3621 'B0'	USD	42,929	36,988	0.00		FHLAC REMICS, Series 1821 'J' 6.4%	USD	18,538	18,762	0.00	
0% 15/01/2040						15/11/2023					
FHLAC REMICS, FHM, Series 2632 'B'	USD	109,747	120,920	0.00		FHLAC REMICS, Series 2003 'J' 5.6%	USD	2,990	3,015	0.00	
11.000% 15/02/2040						15/06/2023					
FHLAC REMICS, Series 2801 'B3' 5.5%	USD	144,024	152,266	0.00		FHLAC REMICS, FQ, Series 3316 'J0'	USD	7,404	6,519	0.00	
15/01/2029						05/15/05/2017					

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
FILAC BEMICS, PO, Series 3300 'JO' 0% 15/09/2032	USD	295,739	257,095	0.01		FILAC BEMICS, PO, Series 3151 'RO' 0% 15/05/2036	USD	59,641	51,529	0.00	
FILAC BEMICS, Series 1578 'K' 6.9% 15/09/2033	USD	2,061	2,094	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3200 'RO' 0% 15/08/2036	USD	50,216	43,434	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2283 'K' 6.5% 15/12/2033	USD	2,923	2,970	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3807 'RO' 0% 15/05/2037	USD	132,548	110,814	0.00	
FILAC BEMICS, PO, Series 3288 'LO' 0% 15/03/2037	USD	50,968	43,836	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3611 'RO' 0% 15/07/2034	USD	14,909	13,014	0.00	
FILAC BEMICS, PO, FBN, Series 2892 'LS' 1.252% 15/01/2040	USD	175,487	6,209	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3821 'RO' 0% 15/01/2040	USD	73,265	63,103	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2894 'L2' 6.5% 15/07/2032	USD	9,965	10,656	0.00		FILAC BEMICS, Series 2694 'Q8' 4% 15/12/2034	USD	418,453	421,791	0.01	
FILAC BEMICS, Series 2461 'L2' 6% 15/06/2038	USD	18,233	19,572	0.00		FILAC BEMICS, Series 2172 'Q8' 7% 15/07/2039	USD	41,067	44,415	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2575 'M2' 6% 15/02/2033	USD	24,436	26,108	0.00		FILAC BEMICS, FBN, Series 3832 'QW' 5.3% 15/09/2041	USD	126,241	125,931	0.00	
FILAC BEMICS, PO, Series 3132 'NO' 0% 15/03/2036	USD	111,034	96,314	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3671 'QO' 0% 15/12/2036	USD	119,419	101,198	0.00	
FILAC BEMICS, PO, Series 3171 'NO' 0% 15/06/2036	USD	17,104	15,495	0.00		FILAC BEMICS, FBN, Series 3671 'S' 2.331% 15/09/2033	USD	8,969	10,126	0.00	
FILAC BEMICS, Series 3596 'M' 4% 15/12/2041	USD	634,128	644,504	0.02		FILAC BEMICS, FBN, Series 2867 'S' 26.942% 15/04/2025	USD	9,612	9,510	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2810 'NO' 6.5% 15/02/2032	USD	5,139	5,554	0.00		FILAC BEMICS, PO, FBN, Series 3194 'SA' 5.176% 15/07/2036	USD	7,213	1,059	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2047 'O0' 5.5% 15/10/2035	USD	108,980	112,954	0.00		FILAC BEMICS, PO, FBN, Series 3287 'SA' 5.096% 15/11/2037	USD	93,854	10,934	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2094 'O2' 5.5% 15/11/2035	USD	228,393	242,764	0.01		FILAC BEMICS, PO, FBN, Series 3511 'SA' 4.676% 15/02/2039	USD	60,773	6,186	0.00	
FILAC BEMICS, PO, Series 3117 'O0' 0% 15/02/2036	USD	32,506	28,800	0.00		FILAC BEMICS, FBN, Series 2830 'Sd' 12.422% 15/06/2033	USD	15,206	17,447	0.00	
FILAC BEMICS, PO, Series 3122 'O8' 0% 15/03/2036	USD	33,709	29,602	0.00		FILAC BEMICS, FBN, Series 2733 'Sd' 6.802% 15/03/2033	USD	272,743	272,790	0.01	
FILAC BEMICS, PO, Series 3117 'O8' 0% 15/02/2036	USD	13,134	11,294	0.00		FILAC BEMICS, PO, FBN, Series 3404 'Sd' 4.676% 15/01/2033	USD	162,383	18,668	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2728 'P0' 5% 15/12/2033	USD	5,638	5,675	0.00		FILAC BEMICS, PO, FBN, Series 3748 'Sd' 4.676% 15/10/2040	USD	119,645	16,993	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2165 'P2' 6% 15/06/2039	USD	93,739	98,637	0.00		FILAC BEMICS, FBN, Series 2725 'Sd' 7.872% 15/11/2033	USD	12,200	11,953	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2110 'P0' 6% 15/01/2039	USD	22,616	23,766	0.00		FILAC BEMICS, PO, FBN, Series 3455 'Sd' 4.676% 15/06/2033	USD	169,752	16,043	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2095 'O8' 6.5% 15/08/2038	USD	5,586	5,919	0.00		FILAC BEMICS, PO, FBN, Series 4321 'Sd' 5.276% 15/03/2044	USD	2,550,940	434,045	0.01	
FILAC BEMICS, PO, FBN, Series 3434 'P1' 5.476% 15/04/2033	USD	51,473	8,114	0.00		FILAC BEMICS, FBN, Series 3094 'Sd' 15.587% 15/11/2035	USD	64,035	77,970	0.00	
FILAC BEMICS, PO, Series 3134 'P0' 0% 15/03/2036	USD	2,738	2,426	0.00		FILAC BEMICS, FBN, Series 2816 'Sd' 12.953% 11/02/2032	USD	1,695	1,685	0.00	
FILAC BEMICS, PO, Series 3130 'P0' 0% 15/04/2036	USD	12,012	10,302	0.00		FILAC BEMICS, PO, FBN, Series 3481 'Sj' 4.526% 15/03/2033	USD	48,369	5,474	0.00	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
PRINC BOND, FOM, Series 2390 '31' 19.63% 15/09/2024	USD	7,504	7,721	0.00		PRINC BOND, Series 2259 '30' 7% 15/10/2020	USD	5,485	5,979	0.00	
PRINC BOND, 10, FOM, Series 2385 '30' 4.61% 15/11/2021	USD	14,954	1,521	0.00		PRINC BOND, Series 2081 '20' 5.5% 15/09/2023	USD	1,013,082	1,076,550	0.03	
PRINC BOND, FOM, Series 2329 '30' 22.76% 15/09/2025	USD	54,022	70,381	0.00		PRINC STRIPS, 10, Series 233 '11' 3% 15/09/2025	USD	30,129	6,550	0.00	
PRINC BOND, 10, FOM, Series 2322 '30' 5.17% 15/10/2026	USD	26,390	4,727	0.00		PRINC STRIPS, 10, Series 233 '13' 3% 15/09/2025	USD	77,989	16,665	0.00	
PRINC BOND, FOM, Series 2371 '30' 15.42% 15/12/2022	USD	59,284	65,849	0.00		PRINC STRIPS, Series 232 '15' 3.5% 15/07/2042	USD	1,450,132	1,416,416	0.04	
PRINC BOND, FOM, Series 2322 '30' 13.92% 15/08/2025	USD	15,344	14,999	0.00		PRINC STRIPS, FOM, Series 264 'F1' 1.87% 15/07/2042	USD	900,386	912,535	0.03	
PRINC BOND, Series 2109 '30' 7% 15/06/2029	USD	7,572	8,137	0.00		PRINC STRIPS, FOM, Series 270 'F1' 1.82% 15/08/2042	USD	266,784	271,755	0.01	
PRINC BOND, Series 2423 '30' 6.5% 15/03/2032	USD	51,625	54,414	0.00		PRINC STRIPS, 10, FOM, Series 239 '30' 6.37% 15/04/2026	USD	133,482	22,236	0.00	
PRINC BOND, Series 2434 '30' 7% 15/04/2032	USD	6,081	6,658	0.00		FifthThirdBank NA 3.8% 15/03/2026	USD	200,000	195,403	0.01	
PRINC BOND, FOM, Series 2017 '10' 0% 15/04/2025	USD	30,011	31,529	0.00		Piserv, Inc. 3.2% 01/07/2026	USD	690,000	655,847	0.02	
PRINC BOND, FOM, Series 2382 '30' 5.5% 15/05/2041	USD	134,635	133,139	0.00		Piserv, Inc. 4.4% 01/07/2049	USD	660,000	570,068	0.02	
PRINC BOND, Series 2378 '30' 5.5% 15/09/2026	USD	105,155	112,281	0.00		Flex Intermediate Boléo LLC, 144A 3.26% 30/06/2021	USD	2,255,000	1,863,877	0.05	
PRINC BOND, FOM, Series 2085 '30' 2.24% 15/09/2025	USD	146,444	148,668	0.00		Flex Intermediate Boléo LLC, 144A 4.21% 30/12/2029	USD	1,145,000	893,675	0.03	
PRINC BOND, FOM, Series 2390 '30' 14.77% 15/05/2025	USD	967	1,055	0.00		FMMA 1.27% 01/12/2029	USD	4,680,289	4,023,677	0.11	
PRINC BOND, Series 1883 '2' 6.5% 15/07/2026	USD	4,220	4,302	0.00		FMMA 1.5% 01/01/2031	USD	10,500,000	8,876,490	0.25	
PRINC BOND, Series 2061 '2' 6.5% 15/06/2028	USD	3,065	3,245	0.00		FMMA 5.5% 01/01/2058	USD	5,869,159	6,425,528	0.18	
PRINC BOND, Series 2005 '2' 5.8% 15/09/2025	USD	370,087	391,743	0.01		FMMA 2.5% 01/07/2061	USD	7,563,030	6,680,513	0.19	
PRINC BOND, Series 2230 '2' 6% 15/09/2026	USD	6,444	6,729	0.00		FMMA 2.5% 01/09/2061	USD	11,899,798	10,511,232	0.29	
PRINC BOND, Series 2461 '2' 6% 15/06/2028	USD	329,576	350,105	0.01		FMMA, Series 2004-T2 '144' 1.5% 25/11/2040	USD	160,868	173,200	0.01	
PRINC BOND, Series 1927 '24' 6.5% 15/01/2027	USD	22,113	23,280	0.00		FMMA, Series 2004-W1 '282' 7% 25/12/2023	USD	35,451	38,623	0.00	
PRINC BOND, Series 2703 '24' 6% 15/03/2024	USD	3,187,399	3,397,068	0.10		FMMA, Series 2004-W2 '282' 7% 25/02/2044	USD	8,561	9,264	0.00	
PRINC BOND, Series 2045 '20' 5.5% 15/03/2025	USD	1,221,445	1,256,459	0.04		FMMA, FOM, Series 2005-W3 '24F' 1.28% 15/01/2045	USD	354,934	354,085	0.01	
PRINC BOND, Series 2779 '20' 6% 15/04/2024	USD	1,944,401	2,094,384	0.06		FMMA, FOM, Series 2003-W0 '2F1' 1.40% 15/05/2042	USD	42,443	42,235	0.00	
PRINC BOND, Series 2394 '20' 6.5% 15/08/2021	USD	20,193	21,628	0.00		FMMA, 10, FOM, Series 2003-W6 '40' 0.55% 25/09/2042	USD	1,690,065	20,094	0.00	
						FMMA, Series 2000-T6 'A1' 1.5% 25/11/2040	USD	106,557	107,796	0.00	
						FMMA, Series 2001-T7 'A1' 1.5% 25/03/2041	USD	92,468	102,241	0.00	
						FMMA, Series 2002-T16 '82' 7% 25/07/2042	USD	13,028	14,262	0.00	
						FMMA, FOM, Series 2000-T2 'PT1' 10.18% 25/01/2044	USD	95,549	106,146	0.00	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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 252409 6.5% 01/03/2029	USD	2,358	2,453	0.00		FNMA, FRN 888829 5.888%	USD	456,266	459,483	0.01	
FNMA 257172 5.5% 01/04/2030	USD	11,837	12,366	0.00		01/06/2037					
FNMA 257183 7% 01/03/2038	USD	66,468	68,317	0.00		FNMA, FRN 896463 2.418%	USD	32,827	34,268	0.00	
FNMA 257209 5.5% 01/05/2030	USD	15,063	15,685	0.00		01/10/2034					
FNMA 468571 4.45% 01/07/2026	USD	822,581	851,919	0.02		FNMA 900177 7.5% 01/08/2036	USD	20,176	21,497	0.00	
FNMA 471828 2.65% 01/08/2022	USD	6,000,000	6,000,000	0.17		FNMA, FRN 900197 2.325%	USD	17,805	18,584	0.00	
FNMA 650236 5% 01/12/2032	USD	1,212	1,222	0.00		01/10/2036					
FNMA, FRN 72295 2.15% 01/07/2030	USD	8,608	8,595	0.00		FNMA, FRN 906694 2.068%	USD	12,162	12,461	0.00	
FNMA, FRN 72533 2.45% 01/06/2024	USD	19,624	19,866	0.00		01/12/2036					
FNMA, FRN 745445 2.501% 01/01/2036	USD	35,187	36,415	0.00		FNMA, FRN 920843 2.779%	USD	136,483	143,698	0.00	
FNMA, FRN 745446 2.553% 01/04/2033	USD	10,972	11,249	0.00		01/03/2036					
FNMA 754922 5.5% 01/09/2030	USD	10,791	11,231	0.00		FNMA, FRN 920954 1.697%	USD	55,172	56,639	0.00	
FNMA, FRN 766610 1.965% 01/01/2034	USD	6,410	6,376	0.00		01/01/2037					
FNMA 771959 5.5% 01/02/2034	USD	14,656	14,878	0.00		FNMA 932355 6% 01/12/2039	USD	561,919	586,948	0.02	
FNMA, FRN 77193 2.45% 01/06/2024	USD	54,278	55,942	0.00		FNMA 933032 6% 01/10/2037	USD	9,043	9,140	0.00	
FNMA, FRN 781309 2.1% 01/07/2024	USD	11,595	11,571	0.00		FNMA 961192 7% 01/01/2038	USD	25,695	26,437	0.00	
FNMA, FRN 790235 1.894% 01/08/2034	USD	15,767	15,722	0.00		FNMA, FRN 966946 2.285%	USD	18,572	18,504	0.00	
FNMA, FRN 791961 1.688% 01/09/2034	USD	12,010	11,901	0.00		01/01/2038					
FNMA, FRN 801342 1.855% 01/09/2034	USD	33,741	33,513	0.00		FNMA 995763 6% 01/11/2037	USD	11,326	11,080	0.00	
FNMA, FRN 810896 1.862% 01/01/2035	USD	28,096	28,781	0.00		FNMA AD270 4.125% 01/07/2040	USD	125,400	123,957	0.00	
FNMA, FRN 816597 2.045% 01/02/2035	USD	10,332	10,266	0.00		FNMA AD8549 5.5% 01/01/2033	USD	64,472	65,569	0.00	
FNMA, FRN 823660 2.429% 01/05/2035	USD	21,657	21,594	0.00		FNMA AD8346 6% 01/05/2037	USD	57,812	60,333	0.00	
FNMA, FRN 843026 1.945% 01/09/2035	USD	29,356	30,151	0.00		FNMA AD4168 4.25% 01/07/2040	USD	107,426	107,438	0.00	
FNMA, FRN 843028 1.982% 01/09/2035	USD	17,721	18,173	0.00		FNMA AD4183 4.125% 01/09/2040	USD	98,632	98,471	0.00	
FNMA 847188 6.5% 01/10/2035	USD	52,832	54,029	0.00		FNMA AL2606 4% 01/05/2042	USD	54,898	53,252	0.00	
FNMA, FRN 848251 2.11% 01/01/2036	USD	48,225	50,413	0.00		FNMA AL6167 3.5% 01/01/2044	USD	1,491,199	1,449,879	0.04	
FNMA, FRN 851432 2.607% 01/10/2035	USD	121,985	121,851	0.00		FNMA, FRN AL6805 3.782% 01/01/2026	USD	1,820,164	1,835,119	0.05	
FNMA, FRN 872302 2.12% 01/06/2036	USD	39,044	40,462	0.00		FNMA AL7395 5.55% 01/03/2038	USD	1,823,125	1,937,404	0.05	
FNMA, FRN 884066 2.107% 01/06/2036	USD	22,288	22,409	0.00		FNMA AM1769 2.34% 01/12/2022	USD	1,617,648	1,614,934	0.05	
FNMA, FRN 886558 2.023% 01/08/2036	USD	16,481	16,989	0.00		FNMA AM3244 2.52% 01/05/2023	USD	2,000,000	1,991,850	0.06	
FNMA 888408 6% 01/03/2037	USD	14,356	14,925	0.00		FNMA AM660 3.765% 01/12/2025	USD	1,885,184	1,910,193	0.05	
FNMA, FRN 888605 2.384% 01/07/2035	USD	8,386	8,259	0.00		FNMA AM6940 3.34% 01/06/2026	USD	855,925	846,733	0.02	
FNMA 888796 6% 01/09/2037	USD	48,134	49,741	0.00		FNMA AM6448 3.25% 01/09/2026	USD	2,798,885	2,770,010	0.08	
						FNMA AM7514 3.07% 01/02/2025	USD	6,000,000	5,940,790	0.17	
						FNMA AM7649 2.88% 01/01/2025	USD	5,547,420	5,450,161	0.15	
						FNMA AM7785 3.17% 01/02/2030	USD	1,846,078	1,786,933	0.05	
						FNMA AM7836 3.11% 01/03/2027	USD	2,776,140	2,724,453	0.08	
						FNMA AM8251 2.7% 01/04/2025	USD	4,595,007	4,498,964	0.13	
						FNMA AM8544 3.08% 01/04/2030	USD	1,848,124	1,777,720	0.05	
						FNMA AM8846 2.68% 01/05/2025	USD	3,470,199	3,387,170	0.10	
						FNMA AM8188 3.12% 01/06/2035	USD	3,000,000	2,744,463	0.08	
						FNMA AM8548 3.17% 01/08/2025	USD	3,000,000	2,966,601	0.08	
						FNMA AM934 3.08% 01/10/2025	USD	5,180,203	5,108,334	0.14	
						FNMA AN1243 2.64% 01/06/2026	USD	2,999,000	2,900,192	0.08	
						FNMA AN1347 2.64% 01/06/2026	USD	2,462,000	2,380,885	0.07	
						FNMA AN1583 3.04% 01/05/2031	USD	1,413,646	1,347,170	0.04	
						FNMA AN1590 2.4% 01/05/2026	USD	2,630,437	2,526,156	0.07	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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 AN1751 2.85% 01/06/2028	USD	2,049,952	2,049,952	0.06		FNMA ACES, Series 2015-W1 'A2'	USD	2,164,279	2,113,578	0.06	
FNMA AN1802 2.83% 01/06/2028	USD	2,401,487	2,401,487	0.07		2.512% 25/09/2024					
FNMA AN2005 2.73% 01/07/2028	USD	1,931,394	1,943,075	0.05		FNMA ACES, FNM, Series 2015-W10 'A2'	USD	3,379,621	3,313,011	0.09	
FNMA AN2009 2.7% 01/07/2028	USD	4,765,989	4,617,167	0.13		3.092% 25/04/2027					
FNMA AN2124 2.85% 01/01/2029	USD	2,076,039	1,989,170	0.06		FNMA ACES, Series 2015-W1 'A2' 2.58%	USD	2,254,066	2,211,092	0.06	
FNMA AN2363 2.23% 01/04/2024	USD	4,631,633	4,536,697	0.13		25/12/2024					
FNMA AN2370 2.44% 01/08/2026	USD	3,027,712	2,907,113	0.08		FNMA ACES, Series 2016-W6 'A2'	USD	4,690,456	4,524,734	0.13	
FNMA AN2388 2.64% 01/08/2028	USD	2,473,396	2,357,673	0.07		2.488% 15/05/2026					
FNMA AN2429 2.45% 01/12/2026	USD	3,739,248	3,576,257	0.10		FNMA ACES, Series 2016-W1 'A2'	USD	2,112,517	2,052,149	0.06	
FNMA AN2444 2.43% 01/08/2026	USD	6,492,145	6,141,943	0.17		2.499% 15/09/2026					
FNMA AN2487 2.86% 01/08/2028	USD	915,198	892,553	0.03		FNMA ACES, FNM, Series 2017-W0 'A2'	USD	3,492,961	3,329,162	0.09	
FNMA AN2906 2.63% 01/10/2031	USD	5,533,472	5,110,919	0.14		2.415% 25/02/2026					
FNMA AN3134 2.58% 01/10/2028	USD	1,690,634	1,603,460	0.05		FNMA ACES, FNM, Series 2017-W10 'A2'	USD	4,044,197	3,968,924	0.11	
FNMA AN3254 2.8% 01/11/2031	USD	1,637,636	1,592,440	0.04		3.067% 25/05/2027					
FNMA AN3364 2.6% 01/10/2028	USD	4,918,060	4,669,025	0.13		FNMA ACES, FNM, Series 2017-W0 'A2'	USD	1,019,751	978,234	0.03	
FNMA AN3431 2.6% 01/11/2028	USD	4,056,282	3,948,452	0.11		2.474% 25/02/2026					
FNMA AN3665 2.94% 01/12/2028	USD	8,720,000	8,440,165	0.24		FNMA ACES, FNM, Series 2017-W4 'A2'	USD	5,018,980	5,009,441	0.16	
FNMA AN3685 2.69% 01/12/2028	USD	9,548,000	9,071,925	0.25		2.57% 25/12/2026					
FNMA AN3788 2.79% 01/02/2027	USD	2,059,231	1,995,638	0.06		FNMA ACES, FNM, Series 2017-W5 'A2'	USD	4,260,562	4,164,690	0.12	
FNMA AN3801 2.94% 01/12/2026	USD	3,560,986	3,460,018	0.10		3.117% 25/04/2029					
FNMA AN4110 2.95% 01/04/2025	USD	5,013,067	4,917,825	0.14		FNMA ACES, FNM, Series 2017-W8 'A2'	USD	4,825,022	4,724,190	0.13	
FNMA AN4154 3.17% 01/01/2029	USD	7,560,000	7,376,328	0.21		3.065% 25/05/2027					
FNMA AN5237 3.02% 01/07/2029	USD	10,000,000	9,666,707	0.27		FNMA ACES, FNM, Series 2018-W10 'A2'	USD	4,677,000	4,626,413	0.13	
FNMA AN5935 3.13% 01/07/2027	USD	1,051,210	1,031,610	0.03		3.364% 25/01/2028					
FNMA AN6244 3.09% 01/09/2029	USD	7,788,000	7,513,165	0.21		FNMA ACES, FNM, Series 2018-W4 'A2'	USD	2,368,466	2,309,266	0.07	
FNMA A09352 4% 01/07/2042	USD	233,442	233,293	0.01		3.056% 25/05/2028					
FNMA A09999 3% 01/02/2043	USD	1,036,681	978,166	0.03		FNMA ACES, Series 2020-W50 'A2'	USD	3,925,000	3,498,439	0.10	
FNMA A57212 3.5% 01/04/2036	USD	1,027,973	1,010,102	0.03		1.26 25/10/2039					
FNMA EP0464 3.5% 01/03/2060	USD	8,059,251	7,789,376	0.22		FNMA ACES, FNM 'A2' 1.707%	USD	7,400,000	6,240,446	0.18	
FNMA EL2595 3.34% 01/07/2028	USD	2,923,996	2,892,666	0.08		25/11/2031					
FNMA EL2905 3.07% 01/08/2031	USD	6,208,000	5,935,657	0.17		FNMA ACES, FNM, Series 2015-W11 'A'	USD	28,878	28,049	0.00	
FNMA EL3616 2.88% 01/07/2028	USD	11,410,000	10,974,760	0.31		1.524% 25/11/2022					
FNMA EL4070 2.37% 01/08/2030	USD	9,541,651	8,799,323	0.25		FNMA ACES, III, FNM, Series 2020-W50	USD	61,998,946	5,758,363	0.16	
FNMA EL4118 2.42% 01/09/2028	USD	4,680,124	4,386,747	0.12		'11' 1.903% 25/10/2030					
FNMA EL4398 2.59% 01/10/2031	USD	1,800,000	1,663,472	0.05		FNMA ACES, IO, FNM, Series 2021-W3	USD	13,303,082	1,516,503	0.04	
FNMA EL4411 2.47% 01/10/2031	USD	5,539,510	5,089,152	0.14		'X1' 1.971% 25/11/2031					
FNMA EL4435 2.42% 01/10/2029	USD	5,525,000	5,130,944	0.14		FNM Greater Trust, Series 2017-F1 'A'	USD	4,302,128	4,165,448	0.12	
FNMA EL4455 2.37% 01/11/2028	USD	8,631,214	8,058,256	0.23		2.885% 25/06/2027					
FNMA MA1463 3.5% 01/06/2043	USD	492,306	490,181	0.01		FNMA INTEREST STRIP, F0, Series 293	USD	14,440	14,126	0.00	
FNMA MA2592 3.5% 01/04/2046	USD	1,786,581	1,743,883	0.05		'1' 0% 25/12/2026					
FNMA MA2633 3.5% 01/04/2046	USD	921,585	901,018	0.03		FNMA INTEREST STRIP, F0, Series 300	USD	13,363	13,002	0.00	
FNMA MA2734 3.5% 01/08/2046	USD	2,569,705	2,512,429	0.07		'1' 0% 25/09/2026					
FNMA ACES, Series 2021-W0 '1A1' 1% 25/11/2031	USD	2,082,413	1,989,013	0.06		FNMA INTEREST STRIP, IO, Series 303	USD	30,426	8,773	0.00	
FNMA ACES, Series 2020-W50 'A1' 0.61% 25/10/2030	USD	6,657,943	6,106,662	0.17		'32' 0% 25/01/2030					
FNMA ACES, Series 2012-W1 'A2' 2.38% 27/12/2022	USD	575,062	572,571	0.02		FNMA INTEREST STRIP, FNM, Series 432	USD	359,237	361,523	0.01	
						'P2' 2.124% 25/08/2042					
						FNMA BONDS, Series 2004-W11 '1A1' 0% 25/05/2044	USD	268,280	288,786	0.01	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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 BEMICS, Series 2005-#1 '142' 6.3% 25/10/2044	USD	287,451	280,504	0.01		FNMA BEMICS, FBN, Series 2005-74 'CS' 15.555% 25/05/2035	USD	34,082	35,454	0.00	
FNMA BEMICS, FBN, Series 2007-#7 '144' 11.190% 25/07/2037	USD	5,467	7,268	0.00		FNMA BEMICS, FBN, Series 2005-45 'DC' 18.351% 25/06/2035	USD	50,552	56,748	0.00	
FNMA BEMICS, FBN, Series 2003-#4 '24' 5.061% 15/10/2042	USD	3,797	3,968	0.00		FNMA BEMICS, FBN, Series 2006-79 'DF' 1.974% 25/08/2036	USD	22,102	22,007	0.00	
FNMA BEMICS, Series 2006-#5 '24' 6% 25/09/2046	USD	87,083	89,561	0.00		FNMA BEMICS, F0, Series 2006-79 'D0' 0% 25/08/2036	USD	15,991	14,402	0.00	
FNMA BEMICS, FBN, Series 2003-#6 '241' 1% 25/06/2042	USD	49,301	49,680	0.00		FNMA BEMICS, F0, FBN, Series 2007-72 '24' 4.176% 25/07/2037	USD	284,178	36,476	0.00	
FNMA BEMICS, Series 2009-#1 'A' 6% 25/12/2049	USD	310,115	320,683	0.01		FNMA BEMICS, F0, Series 2006-111 '20' 0% 25/11/2036	USD	6,229	5,283	0.00	
FNMA BEMICS, FBN, Series 2007-101 'A1' 0.982% 27/06/2036	USD	61,678	60,855	0.00		FNMA BEMICS, F0, Series 2004-#6 '20' 0% 25/02/2034	USD	34,324	32,697	0.00	
FNMA BEMICS, FBN, Series 2007-106 'A1' 6.212% 15/10/2037	USD	53,171	57,217	0.00		FNMA BEMICS, FBN, Series 2005-98 '25' 11.816% 25/10/2035	USD	28,986	32,359	0.00	
FNMA BEMICS, Series 2006-#6 'A2' 3% 25/07/2038	USD	70,462	72,460	0.00		FNMA BEMICS, Series 2004-67 '20' 5.5% 25/08/2028	USD	41,608	42,395	0.00	
FNMA BEMICS, STEP, Series 2001-#4 'A2' 5.11% 15/01/2032	USD	8,686	8,901	0.00		FNMA BEMICS, FBN, Series 2007-54 '24' 2.626% 25/06/2037	USD	20,152	20,094	0.00	
FNMA BEMICS, Series 2010-111 'A3' 5.3% 25/10/2040	USD	493,500	526,517	0.02		FNMA BEMICS, FBN, Series 2007-16 '24' 2.376% 25/02/2037	USD	4,072	4,110	0.00	
FNMA BEMICS, F0, Series 2006-22 'A3' 0% 25/04/2036	USD	19,245	16,661	0.00		FNMA BEMICS, FBN, Series 2010-43 '24' 2.224% 25/05/2040	USD	135,952	136,912	0.00	
FNMA BEMICS, F0, Series 2007-42 'A3' 0% 25/05/2037	USD	6,948	6,124	0.00		FNMA BEMICS, FBN, Series 2003-119 '24' 2.124% 25/12/2037	USD	88,755	88,914	0.00	
FNMA BEMICS, F0, Series 2009-113 'A3' 0% 15/01/2040	USD	52,125	45,463	0.00		FNMA BEMICS, FBN, Series 2004-61 '24' 2.424% 25/11/2037	USD	125,340	126,859	0.00	
FNMA BEMICS, F0, Series 2006-38 'A3' 0% 25/07/2036	USD	14,842	12,726	0.00		FNMA BEMICS, FBN, Series 2010-40 '24' 2.224% 25/04/2040	USD	74,527	74,884	0.00	
FNMA BEMICS, F0, FBN, Series 2007-60 'A3' 5.526% 25/07/2037	USD	221,193	37,713	0.00		FNMA BEMICS, Series 2007-71 '28' 0% 25/07/2037	USD	75,913	81,372	0.00	
FNMA BEMICS, Series 2007-105 'A2' 5.3% 25/10/2033	USD	501,791	531,529	0.02		FNMA BEMICS, F0, FBN, Series 2006-94 '21' 5.026% 25/10/2026	USD	79,642	2,682	0.00	
FNMA BEMICS, Series 2007-76 'A2' 5.3% 25/08/2037	USD	54,717	57,306	0.00		FNMA BEMICS, Series 2009-69 '24' 3% 25/09/2039	USD	382,081	396,432	0.01	
FNMA BEMICS, Series 2004-97 '2' 5.3% 25/01/2035	USD	3,097,799	3,279,349	0.09		FNMA BEMICS, F0, Series 2006-44 '20' 0% 25/06/2036	USD	11,077	9,645	0.00	
FNMA BEMICS, Series 2007-42 '2' 6% 25/05/2037	USD	115,869	124,253	0.00		FNMA BEMICS, F0, FBN, Series 2009-6 '25' 4.902% 25/02/2039	USD	48,533	6,067	0.00	
FNMA BEMICS, Series 2007-79 '24' 1% 25/05/2045	USD	55,994	59,678	0.00		FNMA BEMICS, FBN, Series 2006-124 '28' 2.402% 25/11/2036	USD	43,303	45,435	0.00	
FNMA BEMICS, F0, FBN, Series 2006-1 '21' 4.202% 25/02/2038	USD	69,388	7,961	0.00		FNMA BEMICS, Series 2009-59 '28' 3% 25/09/2039	USD	168,490	174,518	0.01	
FNMA BEMICS, FBN, Series 2012-117 '24' 1.914% 15/08/2041	USD	283,818	282,692	0.01		FNMA BEMICS, Series 2007-81 '26' 6.5% 25/01/2032	USD	166,384	178,038	0.01	
FNMA BEMICS, F0, FBN, Series 2008-50 '21' 5.576% 25/07/2038	USD	31,261	4,350	0.00		FNMA BEMICS, F0, FBN, Series 2007-116 '21' 0.114% 25/01/2038	USD	74,679	2,563	0.00	

## JPMorgan Funds – US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表（続き）

2022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(%)						
FPM BEMICS, IO, FPM, Series 2008-05 'H' 0.785% 25/06/2008	USD	41,775	2,273	0.00		FPM BEMICS, IO, Series 2006-04 'Y' 0% 25/12/2003	USD	33,145	28,560	0.00	
FPM BEMICS, IO, Series 2009-35 'M' 6.5% 25/05/2003	USD	61,599	11,234	0.00		FPM BEMICS, Series 1999-58 '0C' 6.5% 25/10/2008	USD	28,862	30,503	0.00	
FPM BEMICS, IO, FPM, Series 2002-010 '10' 0.945% 25/08/2042	USD	543,631	11,375	0.00		FPM BEMICS, Series 2005-109 '0C' 0% 25/12/2005	USD	61,400	64,154	0.00	
FPM BEMICS, IO, Series 2009-06 'E' 5.5% 25/10/2009	USD	47,106	8,752	0.00		FPM BEMICS, Series 2008-17 '0C' 6.5% 25/08/2006	USD	51,557	54,992	0.00	
FPM BEMICS, IO, FPM, Series 2008-16 'D' 4.575% 25/09/2008	USD	27,491	2,945	0.00		FPM BEMICS, Series 1997-39 '00' 7.5% 20/05/2007	USD	5,319	5,635	0.00	
FPM BEMICS, IO, Series 2009-35 '0' 0% 25/06/2003	USD	51,162	9,234	0.00		FPM BEMICS, Series 2001-04 'Y0' 0% 25/09/2001	USD	1,416	1,540	0.00	
FPM BEMICS, IO, Series 2009-04 '0' 0% 25/06/2003	USD	19,149	3,359	0.00		FPM BEMICS, Series 2001-7 '0F' 0% 25/09/2001	USD	1,036	1,139	0.00	
FPM BEMICS, Series 1997-25 'J' 7.5% 25/05/2003	USD	450	500	0.00		FPM BEMICS, Series 2011-52 '0Y' 0% 25/06/2011	USD	1,224,055	1,275,163	0.04	
FPM BEMICS, Series 030-1 'M' 7.5% 25/01/2003	USD	40	41	0.00		FPM BEMICS, IO, FPM, Series 2007-109 '0I' 4.124% 25/12/2007	USD	153,913	17,648	0.00	
FPM BEMICS, IO, FPM, Series 2007-65 'K' 4.995% 25/07/2007	USD	66,840	8,045	0.00		FPM BEMICS, IO, Series 2009-52 '0I' 0% 25/07/2009	USD	35,146	6,471	0.00	
FPM BEMICS, IO, FPM, Series 2008-23 'L' 5.475% 25/02/2040	USD	74,504	8,617	0.00		FPM BEMICS, Series 1994-63 '0K' 0% 25/04/2004	USD	13,203	13,503	0.00	
FPM BEMICS, Series 2011-18 'L' 0% 25/11/2041	USD	486,102	541,413	0.02		FPM BEMICS, Series 1993-203 '0L' 6.5% 25/10/2003	USD	7,521	7,667	0.00	
FPM BEMICS, IO, FPM, Series 2011-30 'L' 1.525% 25/04/2041	USD	130,471	6,933	0.00		FPM BEMICS, IO, Series 2006-90 '0L' 0% 25/09/2005	USD	7,145	6,844	0.00	
FPM BEMICS, FPM, Series 2006-23 'L' 11.844% 25/05/2016	USD	31,525	41,142	0.00		FPM BEMICS, IO, Series 2006-110 '0L' 0% 25/11/2006	USD	11,892	10,220	0.00	
FPM BEMICS, Series 2005-04 'M' 5.75% 25/10/2005	USD	32,653	34,017	0.00		FPM BEMICS, IO, Series 2006-36 '0L' 0% 25/05/2006	USD	40,069	35,049	0.00	
FPM BEMICS, FPM, Series 2009-102 'M' 2.556% 25/12/2009	USD	39,941	41,608	0.00		FPM BEMICS, IO, Series 2006-58 '0L' 0% 25/07/2006	USD	35,741	30,001	0.00	
FPM BEMICS, Series 2011-18 'M' 0% 25/11/2041	USD	416,295	461,122	0.01		FPM BEMICS, IO, Series 2007-48 '0L' 0% 25/05/2007	USD	75,303	68,991	0.00	
FPM BEMICS, Series 2006-05 'M' 6.5% 25/09/2006	USD	22,455	24,454	0.00		FPM BEMICS, IO, Series 2009-69 '0L' 0% 25/09/2009	USD	62,297	53,261	0.00	
FPM BEMICS, Series 2016-30 'M' 0% 25/01/2046	USD	1,982,364	1,922,764	0.05		FPM BEMICS, IO, Series 2012-50 '0L' 0% 25/09/2012	USD	237,039	197,603	0.01	
FPM BEMICS, Series 2011-18 'M' 0% 25/11/2041	USD	518,369	570,706	0.02		FPM BEMICS, FPM, Series 2006-11 '0S' 18.614% 25/01/2006	USD	40,957	54,008	0.00	
FPM BEMICS, IO, Series 2008-21 '0' 0% 25/04/2008	USD	21,705	19,286	0.00		FPM BEMICS, FPM, Series 2006-62 '0S' 30.199% 25/01/2006	USD	7,694	10,972	0.00	
FPM BEMICS, IO, Series 2008-35 '0' 0% 25/03/2008	USD	64,460	54,823	0.00		FPM BEMICS, Series 2005-16 '0S' 5.5% 25/09/2005	USD	433,599	456,463	0.01	
FPM BEMICS, IO, Series 2009-06 '0' 0% 25/10/2009	USD	143,882	120,865	0.00		FPM BEMICS, IO, Series 2006-65 '0' 0% 25/07/2006	USD	10,236	8,957	0.00	
FPM BEMICS, Series 2009-63 '0' 5% 25/03/2017	USD	5,823	5,979	0.00		FPM BEMICS, IO, FPM, Series 2009-17 '0S' 5.000% 25/02/2009	USD	32,822	3,646	0.00	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
FPMX BEMICS, FPM, Series 2008-18 'CS' 15.829% 25/04/2018	USD	30,674	30,031	0.00		FPMX BEMICS, FPM, Series 2008-18 'CS' 10.751% 25/01/2018	USD	13,361	13,885	0.00	
FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2005-56 'S' 5.000% 25/07/2005	USD	42,220	5,133	0.00		FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2009-112 'ST' 4.638% 25/01/2010	USD	82,809	9,837	0.00	
FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 1996-4 'SA' 6.876% 25/02/2004	USD	9,416	336	0.00		FPMX BEMICS, FPM, Series 2005-75 'ST' 11.706% 25/09/2015	USD	39,060	43,225	0.00	
FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2001-100 'SA' 4.136% 25/12/2017	USD	7,956	581	0.00		FPMX BEMICS, FPM, Series 2004-74 'SW' 11.311% 25/11/2011	USD	20,162	22,122	0.00	
FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2008-00 'SA' 4.226% 25/09/2008	USD	41,074	4,557	0.00		FPMX BEMICS, FPM, Series 2002-52 'SA' 18.679% 25/10/2011	USD	4,730	5,790	0.00	
FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2010-125 'SA' 2.816% 25/11/2010	USD	188,495	13,033	0.00		FPMX BEMICS, 10, Series 2006-72 'W' 0% 25/02/2016	USD	12,184	10,374	0.00	
FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2010-08 'SA' 3.176% 25/07/2010	USD	180,024	15,703	0.00		FPMX BEMICS, FPM, Series 2005-56 'TP' 11.279% 25/03/2011	USD	18,016	18,313	0.00	
FPMX BEMICS, FPM, Series 2004-25 'SA' 15.046% 25/04/2014	USD	2,965	3,387	0.00		FPMX BEMICS, Series 2009-79 'W' 0% 25/03/2008	USD	10,479	11,264	0.00	
FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2002-116 'CS' 5.916% 25/11/2012	USD	14,822	1,765	0.00		FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2006-53 'US' 4.966% 25/06/2016	USD	80,386	9,649	0.00	
FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2008-81 'CS' 4.226% 25/09/2008	USD	76,096	7,800	0.00		FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2012-134 'US' 4.516% 25/01/2012	USD	1,615,377	174,476	0.01	
FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2008-35 'CS' 4.793% 25/04/2010	USD	51,845	5,640	0.00		FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2007-88 'YI' 4.916% 25/09/2017	USD	152,097	20,540	0.00	
FPMX BEMICS, FPM, Series 2010-48 'CS' 9.412% 25/01/2010	USD	116,937	125,063	0.00		FPMX BEMICS, Series 2004-90 'K2' 5.15% 25/07/2014	USD	503,031	530,953	0.02	
FPMX BEMICS, FPM, Series 2001-1 'CS' 23.256% 25/02/2007	USD	20,326	43,926	0.00		FPMX BEMICS, FPM, Series 2000-1 'W' 6.202% 25/02/2010	USD	70,315	74,554	0.00	
FPMX BEMICS, FPM, Series 2002-5 'CS' 12.463% 25/02/2002	USD	11,648	12,273	0.00		FPMX BEMICS, FPM, Series 2010-61 'WA' 6.003% 25/05/2010	USD	75,635	80,676	0.00	
FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2007-7 'CS' 4.876% 25/08/2006	USD	84,673	13,316	0.00		FPMX BEMICS, FPM, Series 2011-43 'WA' 5.856% 25/05/2011	USD	67,294	71,672	0.00	
FPMX BEMICS, FPM, Series 2006-95 'CS' 19.106% 25/10/2016	USD	17,344	21,307	0.00		FPMX BEMICS, Series 2006-53 'WE' 0% 25/06/2006	USD	479,782	514,340	0.01	
FPMX BEMICS, FPM, Series 2007-29 'CS' 11.256% 25/04/2017	USD	18,243	23,316	0.00		FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2006-8 'WS' 5.076% 25/10/2016	USD	655,541	84,556	0.00	
FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2007-50 'CS' 4.476% 25/06/2007	USD	60,604	6,901	0.00		FPMX BEMICS, 10, Series 2006-8 'W' 0% 25/02/2016	USD	178,784	147,564	0.00	
FPMX BEMICS, FPM, Series 2004-61 'CS' 11.497% 25/11/2012	USD	15,660	18,192	0.00		FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2009-84 'WS' 4.276% 25/10/2019	USD	22,077	2,368	0.00	
FPMX BEMICS, FPM, Series 00-11 'CS' 23.263% 25/04/2001	USD	707	713	0.00		FPMX BEMICS, Series 2005-84 'X' 5.75% 25/10/2015	USD	372,521	388,813	0.01	
FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 1997-50 'CS' 5.176% 25/05/2003	USD	5,261	78	0.00		FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2008-10 'X1' 4.006% 25/10/2018	USD	21,725	2,425	0.00	
FPMX BEMICS, FPM, Series 2004-46 'CS' 11.036% 25/05/2014	USD	34,358	36,413	0.00		FPMX BEMICS, Series 2005-84 'XW' 5.75% 25/10/2015	USD	25,637	26,758	0.00	
FPMX BEMICS, FPM, Series 2005-74 'CS' 15.666% 25/05/2015	USD	34,082	35,581	0.00		FPMX BEMICS, 10, FPM, Series 2007-92 'XS' 4.166% 25/06/2017	USD	119,125	14,535	0.00	
FPMX BEMICS, FPM, Series 2007-85 'SL' 11.091% 25/01/2017	USD	10,902	11,842	0.00		FPMX BEMICS, Series 1990-141 'Z' 0% 25/09/2003	USD	10,639	10,763	0.00	



## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
FHNA REWARDS, Series 1999-99 'A' 7%	USD	8,418	8,514	0.00		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2016-639 'B', 144A 3.57% 25/11/2040	USD	6,179,000	5,922,189	0.17	
FHNA REWARDS, Series 1996-48 'A' 7%	USD	23,871	26,594	0.00		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2016-K712 'B', 144A 1.89%	USD	4,050,000	4,040,289	0.11	
FHNA REWARDS, Series 2002-90 'A' 6%	USD	80,348	89,431	0.00		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2011-K712 'B', 144A 1.88%	USD	6,606,000	6,513,963	0.18	
FHNA REWARDS, Series 1998-44 '2A' 6.5%	USD	224,762	236,648	0.01		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2011-K710 'B', 144A 1.64%	USD	6,000,000	5,912,003	0.17	
FHNA REWARDS, Series 2000-90 '2A' 6%	USD	103,619	108,965	0.00		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2018-K151 'B', 144A 4.29%	USD	5,150,000	4,750,321	0.13	
FHNA REWARDS, Series 2011-29 '2A' 6%	USD	232,745	248,339	0.01		FREMF Mortgage Trust, FOM 'B', 144A 3.79%	USD	10,000,000	9,834,839	0.28	
FHNA REWARDS, Series 2011-47 '2A' 5.5%	USD	195,015	203,933	0.01		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2018-K712 'B', 144A 4.05%	USD	4,910,000	4,828,834	0.14	
FHNA REWARDS, Series 1992-145 '2B' 6%	USD	190	190	0.00		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2018-K74 'B', 144A 4.09%	USD	3,570,000	3,456,328	0.10	
FHNA REWARDS, Series 1998-26 '2B' 6%	USD	987	1,034	0.00		FREMF Mortgage Trust, FOM 'B', 144A 4.21%	USD	1,040,000	1,005,970	0.03	
Ford Foundation (The) 2.815%	USD	825,000	570,275	0.02		FREMF Mortgage Trust, FOM 'B', 144A 4.17%	USD	6,526,000	6,292,567	0.18	
Fondation Finance Trust, Series 2017-1A 'A', 144A 3.2%	USD	303,235	303,479	0.01		FREMF Mortgage Trust, FOM 'B', 144A 4.18%	USD	12,000,000	11,525,818	0.32	
FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2015-K44 'B', 144A 3.71%	USD	13,563,000	13,258,766	0.37		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2018-K511 'B', 144A 1.82%	USD	1,615,442	1,600,115	0.05	
FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2015-K45 'B', 144A 3.61%	USD	8,250,000	8,074,796	0.23		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2018-K511 'B', 144A 1.82%	USD	10,000,000	9,350,705	0.26	
FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2015-K48 'B', 144A 3.64%	USD	11,935,000	11,602,600	0.32		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2018-K901 'B', 144A 4.08%	USD	5,516,000	5,186,970	0.15	
FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2015-K51 'B', 144A 1.93%	USD	7,149,000	6,992,835	0.20		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2018-K128 'B', 144A 1.70%	USD	7,724,300	7,174,276	0.20	
FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2015-K711 'B', 144A 1.14%	USD	2,685,000	2,682,902	0.08		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2011-K211 'B', 144A 3.30%	USD	5,822,989	5,816,262	0.16	
FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2016-K55 'B', 144A 4.16%	USD	5,000,000	4,920,561	0.14		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2011-K231 'B', 144A 3.59%	USD	5,000,000	4,611,116	0.13	
FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2016-K58 'B', 144A 3.71%	USD	7,215,000	6,965,382	0.20		FREMF Mortgage Trust, FOM, Series 2012-K21 'C', 144A 3.49%	USD	2,000,000	1,987,892	0.06	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)						
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2012-K20 'C', 1444 3.55% 25/06/2045	USD	4,910,000	4,854,049	0.14		Glencore Funding LLC, 1444 4.115% 30/05/2023	USD	1,062,000	1,061,363	0.03	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2014-K29 'C', 1444 4.15% 25/08/2041	USD	2,500,000	2,466,467	0.07		Glencore Funding LLC, 1444 4.635% 29/04/2024	USD	700,000	702,171	0.02	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2014-K40 'C', 1444 4.01% 25/11/2041	USD	3,521,000	3,465,997	0.10		Glencore Funding LLC, 1444 2.5% 01/09/2020	USD	5,585,000	4,549,910	0.13	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2015-K45 'C', 1444 3.81% 25/04/2048	USD	2,598,000	2,513,153	0.07		US Auto Receivables Trust, Series 2018-24 'C', 1444 4.1% 15/07/2024	USD	1,136,438	1,138,636	0.03	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2016-K54 'C', 1444 4.05% 25/04/2048	USD	3,000,000	2,883,297	0.08		GMAC Mortgage Loan Trust, FNM, Series 2005-AR3 '3M' 3.00% 19/04/2025	USD	46,343	43,847	0.00	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2016-K712 'C', 1444 1.81% 25/07/2049	USD	8,635,000	8,578,892	0.24		GNMA, 10, FNM, Series 2019-H17 1.72% 20/11/2029	USD	18,910,406	1,886,670	0.03	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2017-K714 'C', 1444 1.57% 25/12/2049	USD	6,325,000	6,194,508	0.17		GNMA, 2.5% 20/08/2051	USD	68,425,341	62,335,305	1.74	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2017-K715 'C', 1444 1.89% 25/02/2050	USD	2,355,000	2,218,284	0.06		GNMA, 2.5% 20/10/2051	USD	13,816,902	11,879,684	0.33	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2017-K716 'C', 1444 1.99% 25/07/2049	USD	4,489,000	4,335,733	0.12		GNMA, FNM 3.47% 20/03/2072	USD	6,497,359	6,903,337	0.19	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2017-K718 'C', 1444 1.64% 25/11/2050	USD	5,540,000	5,396,709	0.15		GNMA, FNM 3.43% 20/04/2072	USD	7,695,473	8,094,676	0.23	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2018-K711 'C', 1444 1.92% 25/02/2025	USD	4,725,000	4,613,988	0.13		GNMA, FNM 3.45% 20/04/2072	USD	8,079,812	8,474,965	0.24	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2018-K712 'C', 1444 4.08% 25/09/2025	USD	2,083,000	2,028,854	0.06		GNMA, FNM 3.69% 20/05/2072	USD	6,662,775	6,981,772	0.20	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2018-K76 'C', 1444 4.37% 25/06/2051	USD	4,061,000	3,812,574	0.11		GNMA, Series 2009-44 'A' 3.5% 20/04/2049	USD	3,927,155	3,816,280	0.11	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2018-K78 'C', 1444 4.23% 25/06/2051	USD	5,147,000	4,853,251	0.14		GNMA, Series 2009-104 'AB' 7% 16/03/2029	USD	41,537	42,767	0.00	
FREMF Mortgage Trust, FNM, Series 2018-KSL1 'C', 1444 1.82% 25/11/2025	USD	8,000,000	7,206,877	0.20		GNMA, FNM, Series 2011-890 'AP' 1.30% 20/01/2061	USD	495,955	482,891	0.01	
FREMF Trust, FNM, Series 2018-SFM4 'B', 1444 1.91% 25/09/2028	USD	6,775,000	6,223,058	0.17		GNMA, PO, Series 2006-22 'AO' 0% 20/05/2026	USD	29,232	26,858	0.00	
General Motors Financial Co., Inc., FNM 2.39% 17/11/2023	USD	1,000,000	985,952	0.03		GNMA, PO, Series 2001-38 'AO' 0% 16/06/2027	USD	410,660	380,918	0.01	
GlaxoSmithKline, Inc. 2.0% 01/01/2040	USD	3,070,000	2,252,837	0.06		GNMA, 10, FNM, Series 2008-93 'AS' 4.10% 20/12/2038	USD	61,957	6,800	0.00	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
GNMA, FNM, Series 2017-009 'DF' 1.362% 20/02/2067	USD	3,717,343	3,684,169	0.10		GNMA, FNM, Series 2010-022 'DS' 1.152% 20/05/2069	USD	103,952	103,165	0.00	
GNMA, IO, FNM, Series 2020-005 'DI' 2.902% 20/01/2070	USD	28,454,660	1,714,107	0.05		GNMA, FNM, Series 2012-024 'DS' 1.212% 20/04/2060	USD	9,644	9,527	0.00	
GNMA, FNM, Series 2005-68 'DE' 12.197% 17/06/2035	USD	50,913	53,148	0.00		GNMA, FNM, Series 2015-026 'DS' 1.222% 20/10/2065	USD	841,260	833,343	0.02	
GNMA, IO, FNM, Series 2008-96 'DS' 5.702% 20/12/2038	USD	137,681	10,733	0.00		GNMA, FNM, Series 2015-032 'DS' 1.462% 20/12/2065	USD	926,456	921,097	0.03	
GNMA, IO, FNM, Series 2007-33 'DS' 4.952% 20/09/2037	USD	109,673	15,474	0.00		GNMA, FNM, Series 2016-021 'DS' 1.652% 20/09/2066	USD	5,099,396	5,093,367	0.14	
GNMA, FNM, Series 2015-007 'DS' 0.940% 20/02/2065	USD	1,037,455	1,028,631	0.03		GNMA, FNM, Series 2015-015 'DJ' 1.242% 20/06/2065	USD	1,150,580	1,138,290	0.03	
GNMA, FNM, Series 2016-022 'F' 1.552% 20/10/2066	USD	2,500,972	2,491,752	0.07		GNMA, FNM, Series 2020-005 'FS' 1.412% 20/03/2070	USD	5,499,175	5,403,446	0.15	
GNMA, FNM, Series 2012-010 'FA' 1.252% 20/12/2061	USD	1,186,074	1,179,328	0.03		GNMA, FNM, Series 2015-016 'FL' 1.242% 20/07/2065	USD	1,817,478	1,797,389	0.05	
GNMA, FNM, Series 2012-015 'FA' 1.252% 20/06/2062	USD	29	29	0.00		GNMA, FNM, Series 2016-007 'FQ' 1.502% 20/03/2066	USD	2,608,511	2,595,635	0.07	
GNMA, FNM, Series 2012-024 'FA' 1.252% 20/02/2060	USD	17,739	17,519	0.00		GNMA, FNM, Series 2012-008 'FS' 1.502% 20/04/2062	USD	630,897	628,019	0.02	
GNMA, FNM, Series 2012-028 'FA' 1.202% 20/09/2062	USD	8,600	8,560	0.00		GNMA, FNM, Series 2017-014 'FV' 1.202% 20/06/2067	USD	3,790,556	3,753,024	0.11	
GNMA, FNM, Series 2012-029 'FA' 1.210% 20/10/2062	USD	983,641	977,389	0.03		GNMA, IO, FNM, Series 2020-010 'GI' 1.630% 20/06/2070	USD	26,998,624	2,981,265	0.08	
GNMA, Series 2013-001 'FA' 1.60% 20/01/2063	USD	6,171	6,032	0.00		GNMA, Series 2007-112 'GZ' 2% 20/07/2047	USD	2,518,956	2,250,672	0.06	
GNMA, FNM, Series 2012-003 'FA' 1.102% 20/08/2060	USD	943	934	0.00		GNMA, IO, Series 2020-124 'H' 2% 20/09/2030	USD	6,194,995	905,890	0.03	
GNMA, FNM, Series 2015-006 'FA' 1.202% 20/02/2065	USD	988,586	989,526	0.03		GNMA, FNM, Series 2012-026 'JA' 1.252% 20/10/2061	USD	2,829	2,810	0.00	
GNMA, FNM, Series 2015-012 'FA' 1.202% 20/05/2065	USD	2,606,391	2,581,485	0.07		GNMA, FNM, Series 2013-001 'JA' 1.122% 20/01/2063	USD	738,306	731,585	0.02	
GNMA, FNM, Series 2015-023 'FB' 1.222% 20/09/2065	USD	1,296,095	1,284,093	0.04		GNMA, IO, FNM, Series 2007-17 'JI' 5.202% 16/04/2037	USD	112,736	12,844	0.00	
GNMA, FNM, Series 2014-017 'FC' 1.202% 20/07/2064	USD	374,167	373,842	0.01		GNMA, FNM, Series 2005-7 'JW' 12.4% 20/05/2004	USD	589	623	0.00	
GNMA, FNM, Series 2015-005 'FC' 1.202% 20/02/2065	USD	1,569,798	1,553,843	0.04		GNMA, IO, FNM, Series 2005-68 'KT' 4.702% 20/09/2035	USD	199,173	24,224	0.00	
GNMA, FNM, Series 2015-008 'FC' 1.202% 20/03/2065	USD	3,035,545	3,007,120	0.08		GNMA, Series 2008-70 'LG' 5% 20/03/2033	USD	435,163	445,856	0.01	
GNMA, FNM, Series 2015-010 'FC' 1.202% 20/04/2065	USD	1,639,994	1,637,902	0.05		GNMA, FNM, Series 2012-028 'MA' 1.252% 20/07/2062	USD	2,931	2,907	0.00	
GNMA, FNM, Series 2016-026 'FC' 1.802% 20/12/2066	USD	1,325,184	1,327,743	0.04		GNMA, IO, FNM, Series 2007-73 'ME' 4.402% 20/11/2037	USD	124,592	5,938	0.00	
GNMA, FNM, Series 2012-021 'FD' 1.142% 20/12/2062	USD	875,892	866,493	0.02		GNMA, IO, Series 2009-14 'NI' 6.5% 20/03/2039	USD	44,279	8,204	0.00	
GNMA, FNM, Series 2016-011 'FD' 2.512% 20/05/2066	USD	1,104,366	1,087,115	0.03		GNMA, FNM, Series 2007-16 'OS' 17.682% 20/04/2037	USD	57,350	64,444	0.00	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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, FO, Series 2009-19 '00' 0%	USD	53,737	47,764	0.00		ONMA, IO, FOM, Series 2007-74 '3L'	USD	109,502	13,130	0.00	
16/11/2017						5.03% 16/11/2017					
ONMA, FO, Series 2010-15' '00' 0%	USD	105,579	91,058	0.00		ONMA, IO, FOM, Series 2007-40 '3M'	USD	133,262	19,970	0.00	
20/12/2040						5.08% 20/01/2017					
ONMA, IO, Series 2008-32 'P1' 5.5%	USD	17,969	313	0.00		ONMA, IO, FOM, Series 2009-64 '3N'	USD	89,865	7,498	0.00	
16/10/2017						4.59% 16/01/2019					
ONMA, FOM, Series 2012-138 'PT'	USD	321,523	323,683	0.01		ONMA, FOM, Series 2005-66 '3P'	USD	37,515	41,922	0.00	
3.91% 16/11/2042						15.80% 16/02/2015					
ONMA, FOM, Series 2010-20 'PT'	USD	6,095,379	6,237,771	0.17		ONMA, IO, FOM, Series 2006-28 '3Q'	USD	11,394	189	0.00	
4.71% 24/02/2048						4.90% 20/06/2016					
ONMA, Series 2001-10 'P2' 5.5%	USD	732,779	739,164	0.02		ONMA, FOM, Series 2007-52 '3R'	USD	22,984	26,341	0.00	
21/02/2011						15.42% 24/01/2017					
ONMA, Series 2006-57 'P2' 5.58%	USD	541,138	556,669	0.02		ONMA, IO, FOM, Series 2007-79 '3Y'	USD	82,872	3,522	0.00	
20/10/2016						4.95% 20/12/2017					
ONMA, IO, FOM, Series 2006-65 'SA'	USD	72,641	3,552	0.00		ONMA, FOM, Series 2013-881 '3X'	USD	6,770	6,696	0.00	
5.20% 20/11/2016						1.20% 24/01/2013					
ONMA, IO, FOM, Series 2007-27 'SA'	USD	70,874	4,316	0.00		ONMA, IO, Series 2009-33 'TI' 6%	USD	29,738	6,991	0.00	
4.60% 20/05/2017						20/05/2019					
ONMA, IO, FOM, Series 2007-16 'SA'	USD	61,386	3,221	0.00		ONMA, IO, FOM, Series 2009-31 'TS'	USD	70,835	2,329	0.00	
4.93% 20/11/2017						4.70% 20/03/2019					
ONMA, IO, FOM, Series 2008-40 'SA'	USD	60,725	5,360	0.00		ONMA, FOM, Series 2004-94 'TS'	USD	56,456	57,384	0.00	
4.85% 16/05/2018						14.03% 20/10/2014					
ONMA, IO, FOM, Series 2009-10 'SA'	USD	92,476	6,930	0.00		ONMA, IO, FOM, Series 2008-76 'US'	USD	175,215	12,009	0.00	
4.35% 20/02/2019						4.20% 20/09/2018					
ONMA, IO, FOM, Series 2009-22 'SA'	USD	117,789	9,444	0.00		ONMA, Series 2018-138 'U2' 1.5%	USD	1,402,712	1,337,956	0.04	
4.67% 20/04/2019						20/10/2048					
ONMA, IO, FOM, Series 2009-6 'SA'	USD	39,528	396	0.00		ONMA, FOM, Series 2014-968 'U3'	USD	603,617	602,878	0.02	
4.99% 16/02/2019						2.42% 16/06/2047					
ONMA, IO, FOM, Series 2007-40 'SB'	USD	96,973	8,606	0.00		ONMA, FOM, Series 2015-121 'U'	USD	957,913	1,018,384	0.03	
5.15% 20/01/2017						5.10% 24/10/2040					
ONMA, IO, FOM, Series 2007-42 'SB'	USD	56,276	8,071	0.00		ONMA, FOM, Series 2011-117 'UA'	USD	1,226,067	1,324,156	0.04	
5.15% 20/01/2017						5.60% 24/07/2040					
ONMA, IO, FOM, Series 2007-81 'SB'	USD	159,550	25,225	0.00		ONMA, FOM, Series 2011-063 'UA'	USD	305,215	325,831	0.01	
5.05% 20/12/2017						5.88% 24/11/2018					
ONMA, IO, FOM, Series 2009-42 'SC'	USD	94,608	11,370	0.00		ONMA, FOM, Series 2012-823 'UA'	USD	323,433	321,311	0.01	
4.48% 20/06/2019						1.22% 24/10/2012					
ONMA, IO, FOM, Series 2006-59 'SD'	USD	72,532	9,116	0.00		ONMA, FOM, Series 2012-141 'UC'	USD	502,438	502,122	0.01	
5.10% 20/10/2016						2.20% 24/01/2042					
ONMA, IO, FOM, Series 2007-16 'SD'	USD	182,659	18,918	0.00		ONMA, FOM, Series 2015-151 'UD'	USD	799,908	832,895	0.02	
4.20% 20/11/2017						4.26% 24/10/2043					
ONMA, FOM, Series 2001-67 'SD'	USD	40,685	43,607	0.00		ONMA, IO, FOM, Series 2017-814 'UI'	USD	6,685,270	279,375	0.01	
13.16% 24/08/2013						1.69% 20/06/2017					
ONMA, IO, FOM, Series 2007-36 'SE'	USD	32,819	1,866	0.00		ONMA, FOM, Series 2010-817 'UJ'	USD	6,730	6,677	0.00	
4.96% 16/06/2017						5.21% 24/01/2010					
ONMA, IO, FOM, Series 2004-90 'SI'	USD	143,554	10,814	0.00		ONMA, Series 2000-33 'Z' 6.5%	USD	355,270	385,151	0.01	
4.90% 20/10/2014						20/07/2016					
ONMA, IO, FOM, Series 2007-67 'SI'	USD	65,084	5,008	0.00		ONMA, Series 2008-75 'ZX' 8%	USD	815,069	854,734	0.02	
4.91% 20/11/2017						16/09/2013					

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)						
GNMA 4189 6.5% 20/07/2038	USD	37,266	38,843	0.00		GNMA AX6215 4% 15/04/2047	USD	778,303	794,103	0.02	
GNMA 4285 6% 20/11/2038	USD	8,211	8,647	0.00		GNMA AX6607 4% 15/06/2047	USD	539,640	551,870	0.02	
GNMA 456388 7.5% 15/03/2028	USD	7,348	7,369	0.00		GNMA AX8715 4% 15/12/2046	USD	1,691,967	1,730,327	0.05	
GNMA 465585 7.5% 15/06/2028	USD	7,020	7,343	0.00		GNMA BA7567 4.5% 20/05/2048	USD	1,858,522	1,879,661	0.05	
GNMA 530795 6.5% 15/01/2023	USD	885	889	0.00		GNMA BB9340 4% 15/07/2047	USD	84,099	86,619	0.00	
GNMA 569568 6.5% 15/01/2032	USD	39,061	41,886	0.00		GNMA B16104 4.5% 20/09/2048	USD	1,291,373	1,320,184	0.04	
GNMA 591882 6.5% 15/07/2032	USD	2,827	2,964	0.00		GNMA B13114 5% 20/06/2049	USD	1,085,825	1,139,639	0.03	
GNMA 607645 6.5% 15/02/2033	USD	3,046	3,195	0.00		GNMA B17198 4.5% 20/03/2049	USD	1,320,566	1,340,253	0.04	
GNMA 607728 6% 15/03/2033	USD	1,024	1,077	0.00		GNMA B20163 5% 15/07/2049	USD	3,593,317	3,810,957	0.11	
GNMA 611453 7% 15/04/2032	USD	3,460	3,500	0.00		GNMA B22262 4.5% 20/07/2049	USD	567,909	588,309	0.02	
GNMA 621970 6% 15/02/2034	USD	3,666	3,889	0.00		GNMA B29691 4.5% 15/07/2049	USD	4,586,670	4,738,083	0.13	
GNMA 742051 4.25% 20/07/2040	USD	545,336	549,532	0.02		GNMA B29692 4.5% 20/07/2049	USD	4,928,772	5,009,789	0.14	
GNMA 742052 4.4% 20/06/2040	USD	468,575	467,386	0.01		GNMA B29701 4.5% 20/08/2049	USD	3,719,910	3,770,745	0.11	
GNMA 742147 4.25% 20/07/2040	USD	812,705	848,757	0.02		GNMA B29713 4.5% 20/09/2049	USD	2,987,448	3,039,118	0.09	
GNMA 742155 4.25% 20/07/2040	USD	716,479	715,837	0.02		GNMA B29734 4% 20/10/2049	USD	3,552,143	3,595,939	0.10	
GNMA 742178 4.25% 20/07/2040	USD	240,067	241,361	0.01		GNMA B29949 5.5% 20/07/2049	USD	2,549,438	2,663,950	0.08	
GNMA 742196 4.4% 20/07/2040	USD	261,054	262,303	0.01		GNMA B30249 4.5% 20/08/2049	USD	6,029,107	6,241,465	0.18	
GNMA 742197 4.25% 20/08/2040	USD	1,938,291	2,015,516	0.06		GNMA B30264 4.5% 20/09/2049	USD	3,261,358	3,306,204	0.09	
GNMA 742203 4.25% 20/08/2040	USD	655,457	688,716	0.02		GNMA B37143 4.5% 20/09/2049	USD	1,886,096	1,947,079	0.05	
GNMA 742310 4.25% 20/06/2040	USD	360,384	361,939	0.01		GNMA B57412 4.5% 15/04/2050	USD	2,518,103	2,574,574	0.07	
GNMA 745389 4.25% 20/06/2040	USD	839,768	882,873	0.03		GNMA B57592 4.5% 20/03/2050	USD	1,424,857	1,452,079	0.04	
GNMA 745410 4.25% 20/08/2040	USD	383,422	383,232	0.01		GNMA B70893 3.5% 20/04/2050	USD	13,378,523	13,254,571	0.37	
GNMA 748766 6.5% 20/01/2039	USD	50,531	50,894	0.00		GNMA B17638 2.5% 20/09/2050	USD	6,584,905	6,862,487	0.17	
GNMA 748803 4.4% 20/06/2040	USD	84,091	84,443	0.00		GNMA B17669 3% 20/07/2050	USD	6,311,840	5,924,041	0.17	
GNMA 748951 4.4% 20/06/2040	USD	85,195	85,557	0.00		GNMA BEMDCS, FOM, Series 2012-007	USD	414,897	411,094	0.01	
GNMA 748952 4.25% 20/09/2040	USD	802,052	829,614	0.02		'RA' 1.21% 04/01/2061	USD				
GNMA 752485 4.25% 20/09/2040	USD	559,781	563,439	0.02		Gold Key Securities LLC, Series 2014-d	USD				
GNMA 752521 4.25% 20/09/2040	USD	850,048	884,530	0.03		'K', 1444 1.22% 17/01/2031	USD	22,824	22,510	0.00	
GNMA 752523 4.85% 20/07/2040	USD	70,818	72,066	0.00		Goldman Sachs Group, Inc. (Dbl), RM	USD				
GNMA 752597 4% 15/10/2040	USD	799,535	816,812	0.02		3.27% 29/09/2025	USD	1,773,000	1,726,213	0.05	
GNMA 752598 4.25% 20/09/2040	USD	195,502	196,583	0.01		Goldman Sachs Group, Inc. (Dbl), RM	USD				
GNMA 752636 4.25% 20/10/2040	USD	202,700	202,573	0.01		1.431% 09/01/2027	USD	5,790,000	5,146,412	0.14	
GNMA 752667 4.25% 20/09/2040	USD	111,480	111,735	0.00		Goldman Sachs Group, Inc. (Dbl), RM	USD				
GNMA 752668 4% 15/10/2040	USD	344,836	349,135	0.01		1.943% 21/10/2027	USD	1,365,000	1,213,167	0.03	
GNMA 752721 4.25% 20/09/2040	USD	344,285	344,259	0.01		Goldman Sachs Group, Inc. (Dbl), RM	USD				
GNMA 752722 4% 15/11/2040	USD	420,725	427,658	0.01		2.988% 28/10/2027	USD	1,200,000	1,187,227	0.03	
GNMA 752726 4.25% 20/10/2040	USD	171,948	171,667	0.01		Goldman Sachs Group, Inc. (Dbl), RM	USD				
GNMA 752725 4.25% 15/09/2040	USD	134,404	136,308	0.00		2.64% 24/02/2028	USD	2,292,000	2,078,746	0.06	
GNMA 761328 7% 15/09/2031	USD	60,033	64,766	0.00		Goldman Sachs Group, Inc. (Dbl), RM	USD				
GNMA 761614 7% 15/06/2033	USD	2,514	2,765	0.00		3.691% 04/06/2028	USD	4,090,000	3,873,837	0.11	
GNMA 761648 6% 15/08/2033	USD	11,243	12,412	0.00		Goldman Sachs Group, Inc. (Dbl), RM	USD				
GNMA 762615 7% 15/06/2035	USD	73,011	79,156	0.00		2.38% 21/07/2032	USD	975,000	787,951	0.02	
GNMA 783123 5.5% 15/04/2033	USD	149,761	163,119	0.01		Goldman Sachs Group, Inc. (Dbl), RM	USD				
GNMA 783389 6% 20/06/2039	USD	153,718	167,245	0.01		4.411% 21/04/2019	USD	2,300,000	2,094,712	0.06	
GNMA 783444 5.5% 20/09/2039	USD	133,406	145,293	0.00		Goodrum Trust, Series 2017-2A 'K',	USD				
GNMA 784045 4.5% 20/07/2045	USD	471,532	493,837	0.01		144 1.74% 15/10/2062	USD	686,248	680,958	0.02	
GNMA AT7628 4% 15/07/2046	USD	3,005,484	3,062,666	0.09		Goodrum Trust, Series 2017-2A 'K',	USD				
GNMA AV7478 4% 15/09/2046	USD	2,095,999	2,146,073	0.06		144 1.26% 15/10/2063	USD	2,064,733	1,900,712	0.05	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
Goodman US Finance Three LLC, BEIT, 144A 1.75% 15/09/2038	USD	431,000	412,298	0.01		Hyundai Capital America, 144A 1.15% 10/11/2032	USD	3,763,000	3,736,382	0.11	
Graphic Packaging International LLC, 144A 1.502% 15/04/2038	USD	2,710,000	2,446,057	0.07		Hyundai Capital America, 144A 1.85% 15/10/2035	USD	1,340,000	1,224,463	0.03	
Gray Oak Pipeline LLC, 144A 2% 15/09/2023	USD	1,355,000	1,320,601	0.04		Hyundai Capital America, 144A 1.15% 08/01/2036	USD	1,005,000	896,202	0.03	
Gray Oak Pipeline LLC, 144A 2.6% 15/10/2025	USD	3,150,000	2,942,699	0.08		Hyundai Capital America, 144A 1.5% 15/06/2036	USD	1,005,000	890,561	0.03	
GSC Consumer Healthcare Capital US LLC, 144A 3.175% 24/03/2029	USD	1,970,000	1,043,355	0.05		Hyundai Capital America, 144A 3% 10/02/2027	USD	605,000	557,456	0.02	
GWFS Mortgage Loan Trust, FOM, Series 2004-4 '1A7', 144A 1.405% 25/06/2034	USD	65,489	56,470	0.00		Hyundai Capital America, 144A 2.375% 15/10/2027	USD	1,330,000	1,169,588	0.03	
GWFS Mortgage Loan Trust, FOM, Series 2005-8P1 '1A7', 144A 1.91% 25/01/2035	USD	25,392	23,033	0.00		Hyundai Capital America, 144A 1.8% 10/01/2038	USD	1,940,000	1,638,440	0.05	
GWFS Mortgage Loan Trust, FOM, Series 2005-8P2 '1A7', 144A 1.91% 25/03/2035	USD	102,555	99,304	0.00		Impact Secured Assets CMF Owner Trust, Series 2002-2 'A1' 5.5% 25/08/2033	USD	23,675	20,035	0.00	
GWFS Mortgage Loan Trust, III, FOM, Series 2006-8P2 '1A2', 144A 3.57% 25/04/2036	USD	458,928	38,560	0.00		Independence Plaza Trust, Series 2018-INDP 'A', 144A 1.763% 10/07/2035	USD	3,660,000	3,545,938	0.10	
GX Mortgage Loan Trust, Series 2003-7F '1A4' 5.25% 25/06/2032	USD	103,345	90,596	0.00		IndyMac DM3 Mortgage Loan Trust, FOM, Series 2004-8M 'A1' 3.054% 25/09/2024	USD	2,297	2,065	0.00	
GX Mortgage Loan Trust, Series 2004-6F '3M4' 6.5% 25/05/2034	USD	58,432	56,947	0.00		Intact US Holdings, Inc. 4.6% 09/11/2022	USD	1,000,000	1,004,143	0.03	
GTP Acquisition Partners I LLC, 144A 3.472% 15/06/2030	USD	225,000	221,006	0.01		International Flavors & Fragrances, Inc., 144A 1.822% 15/10/2027	USD	1,995,000	1,716,547	0.05	
Guardian Life Insurance Co. of America (Ibb), 144A 4.8% 24/01/2077	USD	250,000	227,546	0.01		International Flavors & Fragrances, Inc., 144A 3.268% 19/11/2040	USD	1,140,000	871,763	0.02	
Hakensack Meridian Health, Inc. 2.815% 01/09/2050	USD	2,000,000	1,458,916	0.04		International Flavors & Fragrances, Inc., 144A 3.468% 01/12/2030	USD	836,000	622,222	0.02	
Hartford HealthCare Corp. 3.441% 01/07/2034	USD	2,680,000	2,190,858	0.06		ITC Holdings Corp., 144A 2.95% 14/05/2030	USD	910,000	801,435	0.02	
HCA, Inc., 144A 4.615% 15/03/2032	USD	190,000	153,051	0.00		J.P. Morgan Mortgage Trust, FOM, Series 2004-A4 '1A1' 2.242% 25/09/2034	USD	6,055	5,707	0.00	
Headlands Residential LLC, STXP, Series 2017-8P1 'A', 144A 3.875% 25/11/2034	USD	2,454,636	2,390,402	0.07		J.P. Morgan Mortgage Trust, FOM, Series 2004-A1 '4A1' 2.750% 25/07/2034	USD	1,531	1,516	0.00	
HE20 Funding Trust, Series 2006-3A 'A1', 144A 3.08% 30/09/2042	USD	253,007	246,247	0.01		J.P. Morgan Mortgage Trust, FOM, Series 2005-A1 '4A1' 2.442% 25/08/2034	USD	18,607	18,846	0.00	
HE20 Funding Trust, Series 2006-4A 'A1', 144A 3.57% 30/09/2047	USD	1,302,450	1,182,145	0.03		J.P. Morgan Mortgage Trust, FOM, Series 2006-A1 '5A2' 2.282% 25/11/2032	USD	46,602	45,776	0.00	
HF Sinclair Corp., 144A 2.625% 01/10/2023	USD	2,385,000	2,297,427	0.06		J.P. Morgan Resecuritisation Trust, FOM, Series 2009-7 '1A1', 144A 4.96% 21/01/2037	USD	2,217	2,215	0.00	
HF Sinclair Corp., 144A 5.875% 01/04/2026	USD	1,960,000	1,984,916	0.06							
Hilton Grand Vacations Trust, Series 2017-A 'A', 144A 2.68% 26/12/2038	USD	448,606	442,120	0.01							

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)						
JB Hunt Transport Services, Inc. 3.35% 15/09/2024	USD	1,200,000	1,199,219	0.03		WSTF Alternative Loan Trust, Series 2004-4 '11' 5.5% 25/09/2024	USD	54,749	53,108	0.00	
JB Hunt Transport Services, Inc. 3.815% 01/03/2026	USD	880,000	849,793	0.02		WSTF Alternative Loan Trust, Series 2006-6 '31' 5.5% 25/12/2025	USD	14,884	12,276	0.00	
Jersey Central Power & Light Co., 144A 4.5% 15/01/2026	USD	460,000	454,888	0.01		WSTF Alternative Loan Trust, Series 2004-6 '11' 5% 25/01/2024	USD	27,591	26,139	0.00	
John Sevier Combined Cycle Generation LLC 4.625% 15/01/2042	USD	308,481	313,165	0.01		WSTF Alternative Loan Trust, Series 2004-4 '91' 5.5% 25/04/2019	USD	53,090	51,608	0.00	
Keurig Dr Pepper, Inc. 4.417% 25/05/2025	USD	81,000	81,774	0.00		WSTF Asset Securitization Trust, Series 2004-4 '16' 5.25% 26/12/2020	USD	28,344	27,808	0.00	
Keurig Dr Pepper, Inc. 3.45% 15/06/2027	USD	450,000	429,588	0.01		WSTF Repurchasing Loan Trust, FRN, Series 2005-2 '1A1F', 144A 1.914% 25/09/2025	USD	300,448	186,577	0.01	
Keurig Dr Pepper, Inc. 3.2% 01/05/2030	USD	1,500,000	1,341,869	0.04		WSTF Seasoned Securitization Trust, FRN, Series 2004-2 'A1' 6.5% 25/09/2022	USD	31,714	30,517	0.00	
Keurig Dr Pepper, Inc. 4.42% 15/12/2046	USD	500,000	448,750	0.01		WSTF Seasoned Securitization Trust, FRN, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/09/2022	USD	102,542	99,055	0.00	
KeyCorp, FRN 4.789% 01/06/2023	USD	400,000	394,753	0.01		Need Johnson Nutrition Co. 4.125% 15/11/2025	USD	502,000	507,247	0.01	
KeySpan Gas East Corp., 144A 2.742% 15/08/2026	USD	448,000	422,343	0.01		Need Johnson Nutrition Co. 5.9% 01/11/2029	USD	50,000	56,143	0.00	
KLA Corp. 3.3% 01/03/2050	USD	1,000,000	795,178	0.02		Need Johnson Nutrition Co. 4.8% 01/06/2044	USD	500,000	485,857	0.01	
Kraft Heinz Foods Co. 4.825% 01/10/2029	USD	1,600,000	1,404,178	0.04		Memorial Health Services 3.441% 01/11/2048	USD	2,440,000	2,016,807	0.06	
Kraft Heinz Foods Co. 4.375% 01/06/2046	USD	1,158,000	964,555	0.03		Memorial Sloan-Kettering Cancer Center 4.2% 01/07/2055	USD	334,000	307,317	0.01	
Lehman Mortgage Trust, Series 2008-2 '16' 6% 25/09/2028	USD	221,620	87,948	0.00		Merrill Lynch Mortgage Investor Trust, FRN, Series 2004-1 '31' 3.05% 26/12/2024	USD	88,434	85,296	0.00	
Liberty Mutual Group, Inc., 144A 4.565% 01/02/2029	USD	258,000	253,046	0.01		Merrill Lynch Mortgage Investor Trust, FRN, Series 2002-44 '21' 2.77% 25/01/2023	USD	24,332	23,136	0.00	
Liberty Mutual Group, Inc., 144A 3.951% 15/10/2050	USD	1,120,000	859,628	0.02		Merrill Lynch Mortgage Investor Trust, FRN, Series 2004-44 '42' 2.88% 25/08/2024	USD	41,854	40,242	0.00	
Liberty Mutual Insurance Co., 144A 8.5% 15/09/2025	USD	400,000	436,768	0.01		Metropolitan Life Global Funding I, 144A 3% 15/09/2027	USD	1,100,000	1,036,681	0.03	
Massachusetts Electric Co., 144A 4.094% 15/08/2046	USD	483,000	405,637	0.01		Microchip Technology, Inc. 0.912% 15/02/2024	USD	3,045,000	2,893,138	0.08	
MassMutual Global Funding II, 144A 2.75% 22/06/2024	USD	1,000,000	980,938	0.03		Microchip Technology, Inc. 0.943% 01/09/2024	USD	2,397,000	2,235,360	0.06	
WSTF Adjustable Rate Mortgages Trust, FRN, Series 2004-13 '3A1' 2.704% 21/04/2024	USD	51,255	49,703	0.00		Microsoft Corp. 3.5% 12/02/2025	USD	1,907,000	1,830,647	0.05	
WSTF Adjustable Rate Mortgages Trust, FRN, Series 2004-13 '3A1' 2.845% 21/11/2024	USD	150,719	144,431	0.00		Microsoft Corp. 3.041% 11/02/2022	USD	536,000	418,160	0.01	
WSTF Adjustable Rate Mortgages Trust, FRN, Series 2004-2 '4A1' 2.334% 15/04/2024	USD	7,010	6,569	0.00		Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC, 144A 4.5% 15/06/2028	USD	410,000	399,944	0.01	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
MidMichigan Health 3.40% 01/06/2050	USD	780,000	628,326	0.02		Northwestern Mutual Global Funding, 144A 1.7% 01/06/2028	USD	1,685,000	1,491,038	0.04	
Morgan Stanley, FRN 2.18% 28/04/2026	USD	4,740,000	4,447,733	0.13		NRG Energy, Inc., 144A 2% 02/02/2025	USD	1,770,000	1,603,587	0.05	
Morgan Stanley, FRN 2.475% 21/01/2028	USD	394,000	240,135	0.01		NRG Energy, Inc., 144A 2.45% 02/12/2027	USD	1,975,000	1,691,775	0.05	
Morgan Stanley, FRN 3.971% 22/07/2038	USD	1,000,000	893,895	0.03		NRG Energy, Inc., 144A 4.45% 15/06/2029	USD	1,080,000	966,309	0.03	
Morgan Stanley, FRN 3.217% 22/04/2042	USD	2,000,000	1,579,404	0.04		NEZ Excess Spread-Collateralized Notes, Series 2021-FM2 'A', 144A 3.22% 28/05/2026	USD	5,792,757	5,287,856	0.15	
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, FRN, Series 2004-1 '4A' 5.64% 25/04/2024	USD	107,759	105,905	0.00		Nucor Corp. 2.97% 15/12/2055	USD	1,470,000	995,118	0.03	
Mount Sinai Hospitals Group, Inc. 3.93% 01/07/2048	USD	366,000	323,769	0.01		NYU Langone Hospitals 3.38% 01/07/2055	USD	1,010,000	789,252	0.02	
MultiCare Health System 3.803% 15/08/2050	USD	1,115,000	817,228	0.02		Office Properties Income Trust, SEIT 4.3% 01/02/2025	USD	1,667,000	1,597,704	0.05	
Mylan, Inc. 5.4% 29/11/2043	USD	1,365,000	1,077,110	0.03		Office Properties Income Trust, SEIT 2.4% 01/02/2027	USD	2,030,000	1,662,032	0.05	
Mylan, Inc. 5.2% 15/04/2048	USD	1,500,000	1,214,929	0.03		Ohio Power Co. 6.8% 01/03/2033	USD	240,000	280,503	0.01	
Nationwide Children's Hospital, Inc. 4.58% 01/11/2032	USD	451,000	455,101	0.01		Ohio State University (The) 4.8% 01/06/2111	USD	716,000	721,471	0.02	
New York and Presbyterian Hospital (The) 2.68% 01/08/2050	USD	1,330,000	866,377	0.02		Ohio State University (The) 'A' 4.0% 01/12/2036	USD	325,000	314,156	0.01	
New York Life Global Funding, 144A 2.3% 14/07/2026	USD	503,000	474,188	0.01		Omni Electric Delivery Co. LLC 5.7% 15/03/2029	USD	150,000	162,767	0.01	
New York Life Insurance Co., 144A 4.4% 15/05/2069	USD	1,040,000	903,657	0.03		Onor Electric Delivery Co. LLC 3.1% 15/09/2049	USD	1,990,000	1,547,567	0.04	
New York State Dormitory Authority 5.6% 15/03/2040	USD	175,000	194,274	0.01		Omni Electric Delivery Co. LLC 5.3% 09/10/2032	USD	295,000	326,602	0.01	
NGPL PipeCo LLC, 144A 3.2% 15/07/2031	USD	1,755,000	1,463,455	0.04		O'Reilly Automotive, Inc. 3.6% 01/09/2027	USD	556,000	536,627	0.02	
Niagara Mohawk Power Corp., 144A 1.9% 27/06/2030	USD	2,250,000	1,861,995	0.05		Otis Worldwide Corp. 2.56% 15/02/2030	USD	2,750,000	2,367,887	0.07	
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2003-A1 'A1' 5.8% 25/05/2033	USD	248	238	0.00		Pacific Gas and Electric Co. 3.4% 01/07/2025	USD	1,535,000	1,443,947	0.04	
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2003-A1 'A2' 6% 25/05/2033	USD	1,128	1,097	0.00		Pacific Life Global Funding II, 144A 1.2% 24/06/2025	USD	1,560,000	1,433,057	0.04	
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2003-A1 'A5' 7% 25/04/2033	USD	1,691	1,677	0.00		Pacific Life Insurance Co., FRN, 144A 4.3% 24/10/2037	USD	627,000	530,881	0.02	
Nordstrom, Inc. 4.2% 01/08/2031	USD	2,510,000	1,899,950	0.05		Paramount Global 4% 15/01/2026	USD	750,000	731,790	0.02	
Norfolk Southern Corp. 5.5% 17/05/2025	USD	4,000	4,130	0.00		Paramount Global 3.9% 15/01/2027	USD	198,000	182,245	0.01	
Norfolk Southern Corp. 4.0% 15/08/2052	USD	1,373,000	1,113,938	0.03		Paramount Global 4.8% 01/07/2042	USD	150,000	124,942	0.00	
Northam Trust Corp., FRN 3.37% 08/06/2031	USD	823,000	777,032	0.02		PECO Energy Co. 2.8% 15/06/2050	USD	900,000	662,520	0.02	
						Pennsylvania Electric Co., 144A 3.2% 15/03/2028	USD	75,000	69,624	0.00	
						Penske Truck Leasing Co. LP, 144A 3.4% 15/11/2036	USD	177,000	167,855	0.01	
						Pepco Holdings LLC 7.4% 15/08/2032	USD	174,000	203,854	0.01	
						Pepperdine University 3.301% 01/12/2059	USD	1,170,000	872,401	0.02	



## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)
PNR Wilfire Recovery Funding LLC 4.35% 01/06/2038	USD	815,000	819,676	0.02	Sabra Health Care LP, REIT 3.2% 01/12/2031	USD	1,685,000	1,340,409	0.04
Phillips 66 Co., 144A 3.60% 15/02/2025	USD	700,000	692,007	0.02	SCB Recovery Funding LLC 2.51% 15/11/2043	USD	1,140,000	857,875	0.02
Phillips 66 Co., 144A 3.55% 01/10/2026	USD	147,000	142,510	0.00	Schlumberger Holdings Corp., 144A 2.1% 01/05/2034	USD	640,000	637,371	0.02
Phillips 66 Co., 144A 4.5% 01/10/2046	USD	306,000	292,303	0.01	Schlumberger Holdings Corp., 144A 2.9% 17/05/2038	USD	455,000	429,510	0.01
Phillips 66 Co., FOM, 144A 3.15% 15/12/2029	USD	1,130,000	1,016,198	0.03	Seasoned Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-4 'M' 1.5% 25/03/2088	USD	2,718,090	2,683,653	0.08
Physicians Realty LP, REIT 2.62% 01/11/2021	USD	1,050,000	845,189	0.02	Seasoned Credit Risk Transfer Trust 'WU' 3.2% 25/11/2061	USD	6,537,659	6,222,962	0.17
Piedmont Natural Gas Co., Inc. 3.3% 01/06/2029	USD	1,550,000	1,441,116	0.04	Seasoned Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-4 'M' 1.5% 25/03/2088	USD	7,616,021	6,765,823	0.19
Plains All American Pipeline LP 3.8% 15/10/2023	USD	2,770,000	2,754,928	0.08	Seasoned Loans Structured Transaction, Series 2019-1 'A1' 1.3% 25/06/2028	USD	2,700,550	2,667,861	0.08
Plains All American Pipeline LP 5.1% 01/06/2042	USD	1,455,000	1,231,561	0.03	Securitized Asset-backed Receivables LLC Trust, SEF, Series 2006-CN 'W2' 2.90% 26/01/2026	USD	28,763	23,688	0.00
Plains All American Pipeline LP 4.1% 15/06/2044	USD	1,110,000	885,934	0.03	Sequoia Mortgage Trust, FOM, Series 20 '1A' 1.72% 20/10/2027	USD	54,091	53,063	0.00
PNC Bank NA 2.5% 27/08/2024	USD	1,750,000	1,701,490	0.05	Sequoia Mortgage Trust, FOM, Series 2013-1 '1A' 1.68% 20/04/2033	USD	63,162	59,544	0.00
Port Authority of New York & New Jersey 5.64% 01/11/2040	USD	285,000	319,962	0.01	Sequoia Mortgage Trust, FOM, Series 2014-12 'A3' 0.63% 20/01/2035	USD	49,582	46,866	0.00
Port Authority of New York & New Jersey 5.64% 01/11/2040	USD	650,000	729,739	0.02	Sierra Timberr Receivables Funding LLC, Series 2019-3A 'K', 144A 3.6% 20/09/2035	USD	632,710	625,462	0.02
Port Authority of New York & New Jersey 4.45% 01/10/2062	USD	1,330,000	1,298,575	0.04	Smithfield Foods, Inc., 144A 5.2% 01/04/2029	USD	1,600,000	1,572,589	0.04
Potomac Electric Power Co. 6.5% 15/11/2037	USD	200,000	232,620	0.01	Sofi Professional Loan Program LLC, Series 2016-C 'A2B', 144A 2.3% 27/12/2032	USD	12,285	12,280	0.00
Providence St Joseph Health Obligated Group 2.74% 01/10/2026	USD	280,000	268,941	0.01	Southern Natural Gas Co. LLC, 144A 4.8% 15/02/2047	USD	407,000	361,956	0.01
Prudential Insurance Co. of America (The), 144A 3.1% 01/07/2025	USD	1,350,000	1,485,532	0.04	Southwestern Electric Power Co. 2.7% 09/10/2026	USD	500,000	467,650	0.01
Public Service Co. of Colorado 6.3% 01/08/2038	USD	135,000	160,237	0.01	Southwestern Public Service Co. 4.5% 15/09/2041	USD	250,000	239,754	0.01
Public Service Co. of Oklahoma 6.62% 15/11/2037	USD	300,000	339,122	0.01	Spirit Airlines Pass Through Trust, Series 2017-3A 'AA' 1.31% 15/09/2031	USD	598,412	542,311	0.02
RMP Trust, Series 2014-3.2 'A3' 1% 25/10/2031	USD	105,220	102,685	0.00	Synovus ABS Trust, Series 2016-61 'B', 144A 6.3% 15/06/2038	USD	275,866	277,625	0.01
Realty Income Corp., REIT 4.81% 01/06/2026	USD	1,500,000	1,529,914	0.04	Steel Dynamics, Inc. 1.6% 15/10/2027	USD	1,519,000	1,303,165	0.04
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 1.7% 15/09/2030	USD	3,100,000	2,487,656	0.07	Stellantis Finance US, Inc., 144A 2.691% 15/09/2031	USD	1,547,000	1,237,028	0.04
Regents of the University of California Medical Center Pooled 3.70% 15/06/2130	USD	2,540,000	1,856,911	0.05					
S&P Global, Inc., 144A 2.9% 01/03/2032	USD	1,450,000	1,290,240	0.04					
Sabine Pass Liquefaction LLC 5.62% 01/03/2025	USD	2,000,000	2,042,287	0.06					

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
Structured Asset Mortgage Investments II Trust, FOM, Series 2004-ABS 'M1' 1.58% 09/10/2034	USD	100,948	96,680	0.00		UMBS 622534 3% 01/09/2031	USD	99,939	93,180	0.00	
Structured Asset Mortgage Investments II Trust, FOM, Series 2005-ABS 'A3' 1.84% 19/01/2035	USD	159,639	149,347	0.00		UMBS 622543 5.5% 01/09/2031	USD	102,943	100,548	0.00	
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates Trust, FOM, Series 2003-36A 'AS' 3.0% 25/11/2033	USD	63,583	63,347	0.00		UMBS 674349 6% 01/03/2033	USD	1,578	1,660	0.00	
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates Trust, FOM, Series 2004-63S 'AS' 6.0% 25/10/2034	USD	48,882	48,345	0.00		UMBS 689977 8% 01/03/2027	USD	6,751	7,038	0.00	
Structured Asset Securities Corp. Pass-Through Certificates Trust, Series 2005-AJ 'A' 1.4% 26/02/2032	USD	34,875	22,200	0.00		UMBS 695533 8% 01/06/2027	USD	3,761	3,931	0.00	
Teachers Insurance & Annuity Association of America, 1944 A 2% 15/09/2044	USD	400,000	384,403	0.01		UMBS 725704 8% 01/08/2034	USD	2,836	2,852	0.00	
Teachers Insurance & Annuity Association of America, 1944 A 2.2% 15/05/2047	USD	800,000	714,584	0.02		UMBS 745148 5% 01/01/2036	USD	31,049	32,616	0.00	
Texas Eastern Transmission LP, 1444 2.3% 15/10/2032	USD	554,000	553,210	0.02		UMBS 745418 5.5% 01/04/2036	USD	41,182	44,022	0.00	
Texas Eastern Transmission LP, 1444 3.3% 15/01/2038	USD	90,000	84,910	0.00		UMBS 755973 8% 01/11/2028	USD	12,333	13,167	0.00	
Texas Health Resources 2.32% 15/11/2050	USD	1,260,000	831,513	0.02		UMBS 755994 8% 01/10/2028	USD	2,934	3,047	0.00	
Texas Health Resources 4.33% 15/11/2055	USD	700,000	683,227	0.02		UMBS 775902 8.5% 01/04/2030	USD	23,782	24,864	0.00	
Time Warner Cable LLC 6.55% 01/05/2037	USD	400,000	400,519	0.01		UMBS 788150 6% 01/03/2032	USD	17,563	18,446	0.00	
Time Warner Cable LLC 6.75% 15/06/2039	USD	1,580,000	1,557,332	0.04		UMBS 870770 6.5% 01/07/2036	USD	17,889	19,084	0.00	
Tri-State Generation and Transmission Association, Inc. 4.2% 01/06/2046	USD	302,000	176,324	0.01		UMBS 888892 7.5% 01/11/2037	USD	60,759	67,069	0.00	
UMBS 4% 01/06/2048	USD	3,958,182	3,937,431	0.11		UMBS 889519 5.5% 01/12/2035	USD	48,950	52,346	0.00	
UMBS 2.5% 01/01/2052	USD	7,940,608	7,116,392	0.20		UMBS 889573 6.5% 01/03/2023	USD	5,782	5,797	0.00	
UMBS 3% 01/01/2052	USD	7,102,612	6,590,843	0.18		UMBS 889757 5% 01/02/2038	USD	35,379	37,511	0.00	
UMBS 2.55052 4% 01/11/2023	USD	269	270	0.00		UMBS 924897 8.5% 01/09/2037	USD	15,563	15,668	0.00	
UMBS 2.55843 5.5% 01/09/2035	USD	38,253	40,904	0.00		UMBS 929560 7% 01/06/2038	USD	55,740	61,519	0.00	
UMBS 2.57855 6.5% 01/12/2027	USD	19,169	20,154	0.00		UMBS 945870 6.5% 01/08/2037	USD	30,951	34,283	0.00	
UMBS 2.57510 7% 01/12/2038	USD	55,276	60,990	0.00		UMBS 946338 7% 01/09/2037	USD	56,552	60,440	0.00	
UMBS 2.57639 5.5% 01/11/2034	USD	1,543	1,648	0.00		UMBS 960150 6% 01/11/2037	USD	32,250	33,999	0.00	
UMBS 2.55791 6.5% 01/12/2022	USD	10	10	0.00		UMBS 976871 6.5% 01/08/2036	USD	136,135	145,200	0.00	
UMBS 2.59859 6.5% 01/08/2031	USD	3,786	4,047	0.00		UMBS 995149 6.5% 01/10/2038	USD	68,795	74,400	0.00	
UMBS 6.02589 7% 01/09/2031	USD	15,688	16,528	0.00		UMBS 995456 6.5% 01/02/2024	USD	11,287	11,375	0.00	
						UMBS 995505 8% 01/01/2038	USD	37,891	40,571	0.00	
						UMBS AA0922 6% 01/09/2036	USD	81,615	89,256	0.00	
						UMBS AA1019 6% 01/11/2036	USD	50,446	54,545	0.00	
						UMBS AB9551 3% 01/06/2043	USD	1,701,567	1,615,046	0.05	
						UMBS AC3407 5.5% 01/10/2039	USD	27,543	28,547	0.00	
						UMBS AD0133 5% 01/08/2024	USD	9,900	10,147	0.00	
						UMBS AD0364 5% 01/05/2023	USD	911	934	0.00	
						UMBS AD0753 7% 01/01/2039	USD	60,273	68,509	0.00	
						UMBS AD0755 7% 01/06/2035	USD	3,158,252	3,445,550	0.10	
						UMBS BH4663 4% 01/06/2047	USD	1,476,990	1,474,058	0.04	
						UMBS BH4684 4% 01/06/2047	USD	2,000,938	2,000,695	0.06	
						UMBS BH4685 4% 01/06/2047	USD	1,949,306	1,973,811	0.06	
						UMBS BH7663 4% 01/10/2047	USD	3,479,564	3,503,744	0.10	
						UMBS BK0319 4.5% 01/03/2049	USD	657,925	659,991	0.02	
						UMBS BK8753 4.5% 01/06/2049	USD	1,977,816	1,981,401	0.06	
						UMBS BK9929 4.5% 01/09/2048	USD	3,978,921	3,986,137	0.11	
						UMBS BM1213 4% 01/04/2047	USD	3,737,069	3,780,782	0.11	
						UMBS BMS254 4% 01/01/2038	USD	2,640,467	2,672,832	0.08	
						UMBS BMS566 4% 01/02/2038	USD	3,267,835	3,292,572	0.09	
						UMBS BMS430 5% 01/01/2049	USD	3,249,919	3,376,812	0.09	
						UMBS BMS899 5% 01/02/2049	USD	790,667	812,651	0.02	
						UMBS BMS918 4.5% 01/04/2049	USD	853,038	856,630	0.02	
						UMBS B02504 5% 01/08/2049	USD	805,607	840,865	0.02	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
UMBS B03950 5% 01/08/2049	USD	895,895	917,940	0.03		University of Miami 4.063%	USD	880,000	801,428	0.02	
UMBS B04194 5% 01/09/2049	USD	350,694	363,535	0.01		01/04/2052					
UMBS B04199 5% 01/08/2049	USD	520,603	536,094	0.02		University of Southern California	USD	1,090,000	733,773	0.02	
UMBS B04200 5% 01/08/2049	USD	1,876,453	1,950,756	0.06		3.15% 01/10/1120					
UMBS B04201 5% 01/08/2049	USD	2,817,656	2,916,873	0.08		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	3,460,000	3,454,413	0.10	
UMBS B04202 5% 01/08/2049	USD	1,393,776	1,452,825	0.04		15/08/2022					
UMBS B04203 5% 01/08/2049	USD	1,920,116	2,022,598	0.06		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	16,400,000	16,285,760	0.46	
UMBS B05594 4% 01/09/2049	USD	2,662,582	2,656,115	0.07		15/11/2022					
UMBS B05625 3.5% 01/08/2049	USD	6,833,886	6,740,256	0.19		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	15,076,000	14,861,588	0.42	
UMBS B06078 3.5% 01/10/2049	USD	2,132,459	2,066,480	0.06		15/02/2023					
UMBS B06817 3.5% 01/10/2049	USD	1,733,946	1,674,938	0.05		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	11,785,000	11,418,013	0.32	
UMBS B01623 3% 01/08/2050	USD	3,941,282	3,679,775	0.10		15/08/2023					
UMBS CA1234 4% 01/02/2038	USD	1,009,214	1,033,973	0.03		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	7,713,000	7,364,295	0.21	
UMBS CA1238 4% 01/02/2038	USD	1,122,701	1,157,224	0.03		15/02/2024					
UMBS CA5729 3% 01/05/2050	USD	6,543,706	6,060,662	0.17		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	4,150,000	3,930,579	0.11	
UMBS FMI219 4% 01/07/2049	USD	888,777	895,633	0.03		15/05/2024					
UMBS FMI758 3.5% 01/09/2049	USD	2,355,532	2,286,978	0.06		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	1,000,000	889,643	0.03	
UMBS MA0406 4.5% 01/05/2030	USD	86,955	87,750	0.00		15/02/2026					
UMBS MA0948 5% 01/11/2031	USD	100,610	103,142	0.00		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	100,000	88,254	0.00	
UMBS GA9932 2.5% 01/05/2050	USD	4,375,978	3,852,853	0.11		15/08/2026					
UMBS CB1061 3.5% 01/06/2050	USD	727,204	701,412	0.02		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	1,600,000	1,126,650	0.03	
UMBS BA2008 4% 01/01/2050	USD	3,356,055	3,331,741	0.09		15/08/2033					
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2013-1 'A' 4.2% 15/02/2027	USD	940,166	904,622	0.03		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	3,920,000	2,738,896	0.08	
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2014-1 'A' 4% 11/10/2027	USD	598,922	561,166	0.02		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	3,600,000	2,428,033	0.07	
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2014-2 'A' 3.75% 02/09/2028	USD	444,754	415,949	0.01		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	1,515,000	1,012,592	0.03	
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-2 'A' 3.1% 01/04/2030	USD	2,302,530	1,809,122	0.05		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	2,600,000	1,722,052	0.05	
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2018-1 'A' 3.75% 01/09/2031	USD	2,977,000	2,641,287	0.07		US Treasury STRIP Coupon 0%	USD	10,000,000	4,658,572	0.13	
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-1 'A' 4.5% 25/02/2033	USD	1,195,770	1,054,236	0.03		Utah Acquisition Sub, Inc. 2.95%	USD	1,215,000	1,146,256	0.03	
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-2 'M' 2.875% 01/04/2030	USD	1,021,242	919,662	0.03		Yankee Mortgage Trust, Series 2002 'D' 6.75% 15/06/2023	USD	102,551	108,526	0.00	
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2018-1 'M' 3.2% 01/09/2031	USD	3,383,951	3,052,087	0.09		Yankee Mortgage Trust, Series 2001 '2E' 7% 15/09/2023	USD	13,464	13,938	0.00	
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-1 'M' 4.1% 25/02/2033	USD	1,337,838	1,240,006	0.04		Verizon Communications, Inc. 1.6% 30/10/2030	USD	585,000	470,556	0.01	
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-2 'M' 2.75% 01/11/2033	USD	2,124,060	1,795,614	0.05		Verizon Communications, Inc. 2.35% 15/09/2032	USD	520,000	438,102	0.01	
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-1 'B' 3.6% 01/09/2027	USD	1,318,759	1,214,824	0.03		Viatris, Inc. 3.85% 22/06/2040	USD	1,326,000	952,073	0.03	
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2018-1 'B' 4.6% 01/09/2027	USD	954,660	886,963	0.03		WFO Trust, Series 2016-39P 'A', 144A 3.80% 30/01/2035	USD	5,294,000	5,017,728	0.14	
Universal Health Services, Inc., 144A 2.6% 15/10/2030	USD	3,043,000	2,456,107	0.07		Wolkswagen Group of America Finance LLC, 144A 1.625% 24/11/2027	USD	1,760,000	1,502,997	0.04	
						Walt Disney Co. (The) 8.875% 04/04/2022	USD	300,000	315,510	0.01	

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022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(%)	
Walt Disney Co. (The) 9.5% 15/07/2024	USD	480,000	532,749	0.02		Wells Fargo & Co., FNN 3.196% 17/06/2027	USD	3,599,000	3,410,833	0.10	
Walt Disney Co. (The) 7.7% 30/30/2025	USD	170,000	189,999	0.01		Workday, Inc. 3.5% 01/04/2027	USD	2,123,000	2,029,876	0.06	
Walt Disney Co. (The) 7.625% 30/11/2028	USD	300,000	335,608	0.01		WYCO, Inc. 3.75% 15/03/2025	USD	800,000	793,029	0.02	
Walt Disney Co. (The) 6.4% 15/12/2035	USD	382,000	445,298	0.01		Xilinx, Inc. 3.375% 01/06/2030	USD	1,700,000	1,501,705	0.04	
Wells Fargo Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-53 '14' 5.5% 25/06/2033	USD	45,547	43,890	0.00		Yale-New Haven Health Services Corp. 2.49% 01/01/2030	USD	1,710,000	1,187,799	0.03	
									1,698,153,370	47.48	
Wells Fargo Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-53 '16' 5% 25/07/2034	USD	13,807	13,542	0.00		債券合計			1,906,268,003	53.30	
Wells Fargo Backed Pass-Through Certificates Trust, FNN, Series 2003-489 '16' 2.52% 25/09/2033	USD	95,933	91,882	0.00		コマーシャル・ペーパー アメリカ					
Wells Fargo Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-53 '14' 5.5% 25/06/2034	USD	48,727	47,215	0.00		Tennessee Valley Authority 0% 01/11/2025	USD	1,150,000	1,028,561	0.03	
Wells Fargo Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-53 '16' 5% 25/07/2034	USD	108,587	105,130	0.00		Tennessee Valley Authority 0% 15/03/2032	USD	800,000	559,523	0.02	
Wells Fargo Backed Pass-Through Certificates Trust, FNN, Series 2003-489 'A' 2.741% 25/03/2033	USD	7,601	7,472	0.00		Tennessee Valley Authority 0% 15/06/2035	USD	2,000,000	1,203,871	0.03	
Wells Fargo Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-532 'M' 5% 25/11/2033	USD	99,134	95,271	0.00					2,791,835	0.08	
Wells Fargo Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-51 '16' 5.5% 25/04/2033	USD	61,379	60,371	0.00		コマーシャル・ペーパー合計			2,791,835	0.08	
Wells Fargo Backed Pass-Through Certificates Trust, FNN, Series 2003-4811 '16' 2.51% 25/10/2033	USD	133,593	127,972	0.00		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			1,909,659,968	53.38	
Wells Fargo Backed Pass-Through Certificates Trust, FNN, Series 2003-485 'A1' 3.18% 24/06/2033	USD	79,839	76,989	0.00		UCITSと認められたユニットまたは他の集団投資事業 集団投資スキーム - UCITS ルクセンブルク					
Wells Fargo Backed Pass-Through Certificates Trust, FNN, Series 2003-487 'A1' 2.394% 25/08/2033	USD	13,149	12,468	0.00		JPMorgan USD Liquidity LPMF Fund - PM USD Liquidity LPMF 1 (dist.) †	USD	230,749,404	230,749,404	6.45	
Washington Mutual Mortgage-Backed Pass-Through Certificates VMML7 Trust, Series 2005-4 'C21' 5.5% 25/06/2035	USD	80,625	75,606	0.00					230,749,404	6.45	
Washington Mutual Mortgage-Backed Pass-Through Certificates VMML7 Trust, 10, Series 2005-3 'C3' 5.5% 25/05/2035	USD	299,806	50,945	0.00		集団投資スキーム - UCITS合計			230,749,404	6.45	
						UCITSと認められたユニットまたは他の集団投資事業合計			230,749,404	6.45	
						投資有価証券合計			3,586,792,084	100.57	
						現金			5,699,023	0.14	
						その他の資産 / (負債)			(25,564,373)	(0.71)	
						純資産合計			3,576,326,744	100.00	
						† 利害関係人のファンド					
						* 有価証券は取締役会の指示により公正価値で評価されている。					

## JPMorgan Funds – US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022年6月30日現在

2022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	83.98
ルクセンブルク	6.57
イギリス	1.79
フランス	1.33
日本	0.99
ケイマン諸島	0.94
カナダ	0.82
オーストラリア	0.69
アイルランド	0.68
メキシコ	0.53
スイス	0.47
オランダ	0.24
スペイン	0.20
フィンランド	0.19
ドイツ	0.18
イタリア	0.14
デンマーク	0.14
国際機関	0.13
ニュージーランド	0.09
パナマ	0.08
イスラエル	0.06
ジャージー	0.05
バミューダ	0.05
香港	0.05
英ヴァージン諸島	0.05
シンガポール	0.04
チリ	0.03
サウジアラビア	0.03
コロンビア	0.02
南アフリカ	0.01
投資有価証券合計	100.57
現金およびその他資産／(負債)	(0.57)
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, 3.50%, 25/07/2052	USD	46,865,000	44,836,624	(852,860)	1.25
アメリカ	UMBS, 4.00%, 25/07/2052	USD	42,605,000	41,844,434	(647,991)	1.17
アメリカ	UMBS, 4.50%, 25/07/2052	USD	6,105,000	6,105,954	(45,788)	0.17
TBA契約買建合計				92,787,012	(1,546,639)	2.59
TBA契約純益				92,787,012	(1,546,639)	2.59

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022年6月30日現在

先渡為替契約明細表

買建通貨	買建額	売建通貨	売建額	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(%)
AUD	1,426	USD	963	03/08/2022	Barclays	2	—
AUD	565,818	USD	389,900	03/08/2022	BNP Paribas	730	—
AUD	1,596	USD	1,100	03/08/2022	HSBC	4	—
CHF	2,310	USD	2,394	05/07/2022	Barclays	23	—
CHF	335,493	USD	350,702	05/07/2022	BNP Paribas	432	—
CHF	1,806	USD	1,884	05/07/2022	Goldman Sachs	6	—
CHF	1,381	USD	1,444	05/07/2022	RBC	2	—
CHF	2,921	USD	3,065	03/08/2022	Barclays	8	—
EUR	1,989	USD	2,068	05/07/2022	RBC	4	—
GBP	2,946,253	USD	3,575,530	03/08/2022	Barclays	6,981	—
JPY	786,540,362	USD	5,781,284	03/08/2022	Barclays	17,153	—
USD	5,746	AUD	8,205	05/07/2022	Barclays	83	—
USD	1,284	AUD	1,836	05/07/2022	BNP Paribas	16	—
USD	1,292	AUD	1,788	05/07/2022	Citibank	68	—
USD	2,632	AUD	3,800	05/07/2022	Goldman Sachs	9	—
USD	1,474	AUD	2,061	05/07/2022	RBC	59	—
USD	1,361	AUD	1,949	05/07/2022	State Street	15	—
USD	1,628	AUD	2,342	03/08/2022	RBC	11	—
USD	1,132	CHF	1,079	03/08/2022	BNP Paribas	—	—
USD	1,375	CHF	1,310	03/08/2022	Merrill Lynch	1	—
USD	17,296,720	EUR	16,346,798	05/07/2022	Barclays	267,683	0.01
USD	194,967	EUR	187,043	05/07/2022	BNP Paribas	118	—
USD	3,564,044	EUR	3,322,007	05/07/2022	Citibank	93,393	—
USD	6,637,313	EUR	6,184,470	05/07/2022	RBC	194,732	0.01
USD	42,710,447	EUR	40,772,973	05/07/2022	Standard Chartered	236,801	0.01
USD	9,172,757	EUR	8,679,229	05/07/2022	State Street	131,297	—
USD	6,915	EUR	6,563	03/08/2022	Barclays	75	—
USD	3,292,107	EUR	3,125,796	03/08/2022	Citibank	29,386	—
USD	91,266	EUR	86,102	03/08/2022	Merrill Lynch	1,392	—
USD	4,666	EUR	4,459	03/08/2022	RBC	12	—
USD	754,688	EUR	713,916	03/08/2022	Standard Chartered	9,500	—
USD	7,014,660	EUR	6,638,591	03/08/2022	State Street	85,266	—
USD	13,395	GBP	10,962	05/07/2022	BNP Paribas	66	—
USD	62,351	GBP	50,576	05/07/2022	Citibank	851	—
USD	12,499	GBP	9,965	05/07/2022	HSBC	393	—
USD	18,620	GBP	14,810	05/07/2022	RBC	611	—
USD	46,518	GBP	36,889	05/07/2022	State Street	1,662	—
USD	12,241	GBP	10,060	03/08/2022	BNP Paribas	14	—
USD	14,862	GBP	12,106	03/08/2022	State Street	134	—
USD	49,230	JPY	6,618,424	05/07/2022	Goldman Sachs	526	—
USD	57,526	JPY	7,701,978	05/07/2022	HSBC	849	—
USD	60,233	JPY	7,879,301	05/07/2022	Merrill Lynch	2,250	—
USD	174,341	JPY	22,798,228	05/07/2022	RBC	6,572	—
USD	24,707	JPY	3,345,769	03/08/2022	HSBC	42	—
USD	21,254	SGD	29,537	05/07/2022	Citibank	48	—
USD	96,475	SGD	133,967	05/07/2022	Goldman Sachs	297	—

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022年6月30日現在

先渡為替契約明細表

買建通貨	買建額	売建通貨	売建額	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(%)
USD	66,564	SGD	92,138	05/07/2022	HSBC	411	—
USD	141,348	SGD	196,092	05/07/2022	Merrill Lynch	598	—
USD	64,078	SGD	87,960	05/07/2022	RBC	925	—
USD	16,802	SGD	23,313	05/07/2022	Standard Chartered	63	—
USD	46,193	SGD	64,085	03/08/2022	BNP Paribas	181	—
先渡為替契約未実現利益合計						1,092,704	0.03
AUD	371,090	USD	267,145	05/07/2022	BNP Paribas	(11,006)	—
AUD	853	USD	607	05/07/2022	Merrill Lynch	(18)	—
AUD	1,187	USD	842	05/07/2022	RBC	(23)	—
AUD	208,196	USD	148,308	05/07/2022	Standard Chartered	(4,605)	—
AUD	4,121	USD	2,878	05/07/2022	State Street	(33)	—
AUD	3,596	USD	2,486	03/08/2022	State Street	(3)	—
EUR	790,146	USD	830,541	01/07/2022	State Street	(7,470)	—
EUR	2,101,255	USD	2,250,022	05/07/2022	Barclays	(61,071)	—
EUR	968,525,293	USD	1,030,282,030	05/07/2022	BNP Paribas	(31,752,375)	(0.89)
EUR	6,701,877	USD	7,066,104	05/07/2022	Citibank	(74,523)	—
EUR	2,641	USD	2,769	05/07/2022	Merrill Lynch	(19)	—
EUR	5,790,422	USD	6,192,784	05/07/2022	RBC	(160,696)	(0.01)
EUR	5,034,319	USD	5,388,964	05/07/2022	Standard Chartered	(144,536)	(0.01)
EUR	29,068,400	USD	31,170,026	05/07/2022	State Street	(898,865)	(0.03)
EUR	2,315,491	USD	2,419,028	03/08/2022	Barclays	(2,107)	—
EUR	926,362,945	USD	969,234,641	03/08/2022	BNP Paribas	(2,271,522)	(0.06)
EUR	8,623,498	USD	9,101,475	03/08/2022	HSBC	(100,225)	—
EUR	3,178	USD	3,344	03/08/2022	RBC	(27)	—
EUR	1,459	USD	1,547	03/08/2022	Standard Chartered	(25)	—
EUR	806,890	USD	851,659	03/08/2022	State Street	(9,424)	—
GBP	3,041,623	USD	3,828,456	05/07/2022	Barclays	(129,864)	—
GBP	9,650	USD	12,127	05/07/2022	BNP Paribas	(393)	—
GBP	21,249	USD	26,012	05/07/2022	Merrill Lynch	(174)	—
GBP	12,603	USD	15,916	05/07/2022	RBC	(591)	—
GBP	6,932	USD	8,696	05/07/2022	Toronto-Dominion Bank	(267)	—
GBP	8,360	USD	10,192	03/08/2022	Barclays	(21)	—
GBP	18,476	USD	22,716	03/08/2022	HSBC	(238)	—
JPY	819,250,841	USD	6,421,468	05/07/2022	Barclays	(392,718)	(0.01)
JPY	1,963,218	USD	15,391	05/07/2022	BNP Paribas	(1,017)	—
JPY	5,789,009	USD	43,018	05/07/2022	HSBC	(417)	—
JPY	2,507,887	USD	19,827	05/07/2022	Standard Chartered	(1,372)	—
JPY	5,065,435	USD	37,567	03/08/2022	Goldman Sachs	(298)	—
JPY	2,344,721	USD	17,332	03/08/2022	State Street	(46)	—
SGD	21,877	USD	15,972	05/07/2022	BNP Paribas	(265)	—
SGD	66,535	USD	48,417	05/07/2022	Citibank	(646)	—
SGD	9,018,225	USD	6,585,189	05/07/2022	Goldman Sachs	(110,312)	—
SGD	17,649	USD	12,783	05/07/2022	HSBC	(111)	—
SGD	16,971	USD	12,379	05/07/2022	Merrill Lynch	(195)	—
SGD	61,109	USD	44,083	05/07/2022	State Street	(208)	—
SGD	8,660,769	USD	6,226,732	03/08/2022	Goldman Sachs	(8,435)	—

## JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

## 投資有価証券明細表(続き)

2022年6月30日現在

先渡し替契約明細表

買建通貨	買建額	売建通貨	売建額	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(%)
SGD	53,446	USD	38,503	03/08/2022	HSBC	(129)	—
SGD	24,709	USD	17,768	03/08/2022	State Street	(27)	—
USD	1,334	AUD	1,939	03/08/2022	BNP Paribas	(4)	—
USD	3,366	CHF	3,336	05/07/2022	BNP Paribas	(126)	—
USD	2,348	CHF	2,251	05/07/2022	Citibank	(8)	—
USD	3,423	CHF	3,378	05/07/2022	Goldman Sachs	(113)	—
USD	1,776	CHF	1,760	05/07/2022	HSBC	(66)	—
USD	2,863	CHF	2,764	05/07/2022	RBC	(30)	—
USD	3,425,283	EUR	3,293,022	05/07/2022	HSBC	(5,174)	—
USD	12,349	GBP	10,213	05/07/2022	Goldman Sachs	(69)	—
USD	23,920	GBP	19,812	05/07/2022	HSBC	(171)	—
USD	20,349	JPY	2,766,815	03/08/2022	BNP Paribas	(41)	—
先渡し替契約未実現損失合計						(36,152,119)	(1.01)
先渡し替契約未実現純損失						(35,059,415)	(0.98)



JPM US Aggregate Bond X (mth) - JPY (hedged)

直近計算期間におけるTER(総費用率)

2022年6月30日現在

0.10%

(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) 1万円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】

(2023年6月1日現在)

種類	金額	単位
資産総額	183,139,884	円
負債総額	82,453	円
純資産総額( - )	183,057,431	円
発行済口数	210,870,125	口
1口当たり純資産額( / )	0.8681	円

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

(2023年6月1日現在)

種類	金額	単位
資産総額	694,782,443	円
負債総額	1,302,138	円
純資産総額( - )	693,480,305	円
発行済口数	769,563,912	口
1口当たり純資産額( / )	0.9011	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（2022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。

< 訂正後 >

資本金の額（2023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、2023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、2023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	54	763,305
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	72	4,809,614
総合計	126	5,572,919
親投資信託	47	-

(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33期事業年度（2022年4月1日から2023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32期 ( 2022年 3 月31日 )	第33期 ( 2023年 3 月31日 )
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	18,159,513	17,854,232
前払費用	14,017	10,057
未収入金	18,237	1,077
未収委託者報酬	1,938,156	1,906,906
未収収益	956,791	1,148,869
関係会社短期貸付金	1,000,000	100,000
その他	14,727	280
流動資産合計	22,101,444	21,021,423
固定資産		
有形固定資産		
器具備品	21,892	-
器具備品減価償却累計額	16,377	-
有形固定資産計	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	2,343,640	548,702
敷金保証金	76,522	33,657
前払年金費用	189,042	212,429
繰延税金資産	891,939	877,589
その他	5,500	5,500
投資その他の資産合計	3,566,646	1,737,878
固定資産合計	3,572,160	1,737,878
資産合計	25,673,604	22,759,301

（単位：千円）

	第32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	172,706	172,530
未払金	3,043,065	1,496,536
未払手数料	900,327	859,337
その他未払金	2,142,738	637,198
未払費用	154,360	159,983
未払法人税等	582,160	331,240
賞与引当金	924,994	867,476
役員賞与引当金	54,793	53,851
流動負債合計	4,932,080	3,081,619
<b>固定負債</b>		
長期未払金	259,178	234,648
賞与引当金	743,912	729,216
役員賞与引当金	128,761	114,927
固定負債合計	1,131,851	1,078,793
負債合計	6,063,932	4,160,412
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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	16,475,344	15,347,039
利益剰余金合計	16,509,020	15,380,716
株主資本合計	19,727,020	18,598,716
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	117,348	173
評価・換算差額等合計	117,348	173
純資産合計	19,609,672	18,598,889
負債・純資産合計	25,673,604	22,759,301

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	11,638,721	10,324,813
運用受託報酬	7,817,385	7,542,468
業務受託報酬	2,379,908	2,566,610
その他営業収益	132,493	240,482
営業収益合計	21,968,508	20,674,375
営業費用		
支払手数料	5,885,809	5,189,809
広告宣伝費	105,330	146,804
調査費	1,887,761	1,909,927
委託調査費	1,597,303	1,562,850
調査費	273,818	333,567
図書費	16,638	13,508
委託計算費	263,612	256,679
営業雑経費	182,365	161,211
通信費	8,534	12,491
印刷費	138,892	109,847
協会費	34,938	38,873
営業費用合計	8,324,879	7,664,433
一般管理費		
給料	5,437,200	5,188,544
役員報酬及び賞与	325,451	321,404
給料・手当	2,845,134	3,037,732
賞与	1,166,857	1,012,802
賞与引当金繰入額	1,021,409	750,056
役員賞与引当金繰入額	78,348	66,548
福利厚生費	373,895	376,603
交際費	12,247	7,936
寄付金	10,608	10,261
旅費交通費	3,585	96,976
租税公課	152,691	135,661
不動産関連費用	1,074,147	1,097,659
退職給付費用	179,059	202,450
退職金	48,776	133,286
消耗器具備品費	10,588	19,816
事務委託費	214,091	183,364
関係会社等配賦経費	2,065,052	2,394,646
減価償却費	3,532	294
諸経費	89,441	79,798
一般管理費合計	9,674,918	9,927,302
営業利益	3,968,710	3,082,640



(単位：千円)

	第32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	24	25
投資有価証券売却益	0	33
受取利息	5,171	2,269
その他営業外収益	11,371	29,202
営業外収益合計	16,567	31,530
営業外費用		
投資有価証券売却損	-	284,331
為替差損	128,721	179,805
その他営業外費用	-	187
営業外費用合計	128,721	464,324
経常利益	3,856,556	2,649,846
税引前当期純利益	3,856,556	2,649,846
法人税、住民税及び事業税	1,474,283	1,015,667
法人税等調整額	447,028	37,516
法人税等合計	1,027,254	978,151
当期純利益	2,829,301	1,671,695

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

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

第33期（自2022年4月1日 至2023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	16,475,344	16,509,020	19,727,020
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	-	2,800,000	2,800,000	2,800,000
当期純利益	-	-	-	-	1,671,695	1,671,695	1,671,695
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	1,128,304	1,128,304	1,128,304
当期末残高	2,218,000	1,000,000	1,000,000	33,676	15,347,039	15,380,716	18,598,716

	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	117,348	117,348	19,609,672
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	2,800,000
当期純利益	-	-	1,671,695
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	117,521	117,521	117,521
当期変動額合計	117,521	117,521	1,010,782
当期末残高	173	173	18,598,889

## 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。

#### （会計方針の変更に関する注記）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号2021年6月17日）を当期首から適用しております。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32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023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32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
関係会社からの受取利息	5,171千円	2,269千円

## （株主資本等変動計算書関係）

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

## 第33期（自2022年4月1日 至2023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
2022年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,800,000	49,764	2022年3月31日	2022年6月28日

## （リース取引関係）

第32期 （自2021年4月1日 至2022年3月31日）		第33期 （自2022年4月1日 至2023年3月31日）	
オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料は以下のとおりであります。		オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料は以下のとおりであります。	
1年以内	2,087千円	1年以内	1,859千円
1年超	7,133千円	1年超	4,493千円
合計	9,221千円	合計	6,352千円

## （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

第33期（2023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	234,648	234,648	-
負債計	234,648	234,648	-

（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）	544,463

（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

第33期（2023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	-	234,648	-	234,648
負債計	-	234,648	-	234,648

（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。

## 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	-	-	-

第33期（2023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	17,854,232	-	-	-
未収委託者報酬	1,906,906	-	-	-
未収収益	1,148,869	-	-	-
関係会社短期貸付金	100,000	-	-	-
合計	21,010,008	-	-	-

## （有価証券関係）

## 1．関係会社株式

関係会社株式（第32期の貸借対照表計上額は60,000千円、第33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、記載していません。

## 2．その他有価証券

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、次表には記載していません。

（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

第33期（2023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 544,463千円）については市場価格のない株式等と認められるため、次表には記載していません。

（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	2,405	2,000	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	1,833	1,989	155
合計		4,239	3,989	250

## 3．当事業年度中に売却したその他有価証券

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	-

第33期（自2022年4月1日 至2023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	2,200,000	33	284,331

## （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32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
	(千円)	(千円)
退職給付債務の期首残高	1,464,414	1,561,511
勤務費用	161,163	156,871
利息費用	7,322	7,808
数理計算上の差異の発生額	13,354	786
退職給付の支払額	84,742	172,850
退職給付債務の期末残高	1,561,511	1,552,554

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
	(千円)	(千円)
年金資産の期首残高	1,776,761	1,780,406
期待運用収益	5,330	5,341
数理計算上の差異の発生額	78,815	33,342
事業主からの拠出額	161,872	166,877
退職給付の支払額	84,742	172,850
年金資産の期末残高	1,780,406	1,813,116

## (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32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
	(千円)	(千円)
積立型制度の退職給付債務	1,561,511	1,552,554
年金資産	1,780,406	1,813,116
	218,895	260,562
未認識数理計算上の差異	29,853	48,133
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	189,042	212,429
前払年金費用	189,042	212,429
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	189,042	212,429

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
	(千円)	(千円)
勤務費用	161,163	156,871
利息費用	7,322	7,808
期待運用収益	5,330	5,341
数理計算上の差異の費用処理額	39,380	15,657
過去勤務債務の費用処理額	-	-
その他(注1)	1,758	5,425
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)	125,533	149,106

(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32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
債券	30%	29%
現金及び預金	70%	71%
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32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023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	0.3%	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32期事業年度53,526千円、第33期事業年度53,343千円であります。

## （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32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
繰延税金資産	(千円)	(千円)
賞与引当金	494,974	473,755
未払費用	92,420	119,056
未払事業税	43,648	25,819
長期前払費用	108,639	119,205
減価償却超過額	156,941	204,658
その他有価証券評価差額金	51,790	-
その他	6,965	5,772
繰延税金資産小計	955,380	948,268
評価性引当額	5,556	5,556
繰延税金資産合計	949,824	942,712
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	57,884	65,122
繰延税金資産又は繰延税金負債( )の純額	891,939	877,589

## 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32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023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	5.45%	6.20%
評価性引当額	9.56%	0.00%
住民税等均等割	0.09%	0.09%
過年度法人税等	0.03%	0.01%
その他	0.00%	0.00%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.63%	36.90%



## （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

第33期（自2022年4月1日 至2023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	10,324,813	7,511,402	2,566,610	240,482	20,643,309
成功報酬	-	31,066	-	-	31,066
合計	10,324,813	7,542,468	2,566,610	240,482	20,674,375

## （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

第33期（自2022年4月1日 至2023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	10,324,813	7,542,468	2,566,610	240,482	20,674,375

## 2．地域ごとの情報

営業収益

(単位：千円)

日本	英国	その他	合計
11,669,935	3,217,990	5,786,449	20,674,375

(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	3,196,350	資産運用業

## （関連当事者情報）

## 1. 関連当事者との取引

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)	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。

第33期（自2022年4月1日 至2023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	215,530 百万米ドル	持株会社	被所有 間接 100%	人件費の立替	-	-	未払金	438,743

（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）	1,600,000	関係会社 短期貸付金	100,000
							資金の回収	2,500,000		
							受取利息	2,269	未収収益	1
							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	2,818,164	未収収益	239,199
							調査費	1,228,359	未払費用	71,549

（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32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
1株当たり純資産額	348,523.46円	330,558.77円
1株当たり当期純利益	50,285.28円	29,711.10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32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
損益計算書上の当期純利益	2,829,301千円	1,671,695千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	2,829,301千円	1,671,695千円
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

2023年7月26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（為替ヘッジあり、隔月決算型）の2022年11月16日から2023年5月15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（為替ヘッジあり、隔月決算型）の2023年5月15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

2023年6月5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、「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2022年4月1日から2023年3月31日までの第33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2023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、継続企業的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。