

【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】 2025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 小松 薫夜

【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】 笹倉 里奈
(連絡場所)
東京都千代田区丸の内二丁目7番3号 東京ビルディング

【電話番号】 03 - 6736 - 2000

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 J P M U S コア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）

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

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

・【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2025年2月13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

（ハ）基本的性格

<訂正前>

（略）

当ファンドを含むすべての商品分類、属性区分の定義については、
一般社団法人投資信託協会のホームページをご覧ください。
HPアドレス：<http://www.toushin.or.jp/>

<訂正後>

（略）

当ファンドを含むすべての商品分類、属性区分の定義については、
一般社団法人投資信託協会のホームページをご覧ください。
HPアドレス：<https://www.toushin.or.jp/>

（ニ）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*2（米国法人）（以下「JPIM社」という場合があります。） 2024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*2(委託会社) マネープール・マザーファンドの運用の指図の権限をJ Pモルガン・アセット・マネジメント(UK)リミテッド*2(英国法人)に委託します(以下「運用委託先」という場合があります。) 2024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。
------	---

*1(略)

*2(略)

(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*2(米国法人)(以下「JPMIM社」という場合があります。) 2025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	J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社*2(委託会社) マネープール・マザーファンドの運用の指図の権限をJ Pモルガン・アセット・マネジメント(UK)リミテッド*2(英国法人)に委託します(以下「運用委託先」という場合があります。) 2025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。

*1(略)

*2(略)

(以下略)

(3) ファンドの仕組み

<訂正前>

(略)

(ロ) 当ファンドおよびマザーファンドの委託会社および関係法人の名称、役割、委託会社等が締結している契約等の概要

J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社(委託会社)

当ファンドおよびマザーファンドの委託会社として、受益権の発行、信託財産の運用指図、目論見書および運用報告書の作成等を行います。

(略)

販売会社

委託会社との契約により、当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、目論見書の交付、運用報告書に記載すべき事項のうち重要な事項のみを記載した交付運用報告書の交付代行、収益分配金の再投資に関する事務、収益分配金・一部解約金・償還金の支払い等を行います。

(八) 委託会社の概況

資本金 2,218百万円（2024年12月末現在）

（略）

大株主の状況（2024年12月末現在）

（以下略）

<訂正後>

（略）

（ロ）当ファンドおよびマザーファンドの委託会社および関係法人の名称、役割、委託会社等が締結している契約等の概要

J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社（委託会社）

当ファンドおよびマザーファンドの委託会社として、受益権の発行、信託財産の運用指図、目論見書および運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に規定する事項を記載した書面（以下「運用報告書（全体版）」といいます。）および同法同条第2項に規定する事項を記載した書面（以下「交付運用報告書」といいます。）をいいます。以下同じ。）の作成等を行います。

（略）

販売会社

委託会社との契約により、当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、目論見書の交付、運用報告書（全体版）に記載すべき事項のうち重要な事項のみを記載した交付運用報告書の交付代行、収益分配金の再投資に関する事務、収益分配金・一部解約金・償還金の支払い等を行います。

（ハ）委託会社の概況

資本金 2,218百万円（2025年6月末現在）

（略）

大株主の状況（2025年6月末現在）

（以下略）

2【投資方針】

（2）投資対象

<訂正前>

（略）

（参考）マザーファンドの投資対象

（略）

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

米国総合債券ファンド

（略）	（略）
運用会社	J . P . モルガン・インベストメント・マネージメント・インク（米国法人） 2024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。

マネーボール・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。 2024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。
------	--

< 訂正後 >

（略）

（参考）マザーファンドの投資対象

（略）

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

米国総合債券ファンド

（略）	（略）
運用会社	J . P . モルガン・インベストメント・マネージメント・インク（米国法人） 2025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。 2025年6月末時点では運用委託先が実際に運用を行っていますが、今後変更される場合があります。

（3）運用体制

< 訂正前 >

（イ）マザーファンドの運用体制

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2024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（2024年6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、2024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(2024年9月末現在))に所属するJ Pモルガン・アセット・マネジメント(U K)リミテッドのポートフォリオ・マネジャーが行います。

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、2024年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(以下略)

<訂正後>

(イ)マザーファンドの運用体制

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、2025年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(略)

(ハ)投資先ファンドの運用体制

以下は、投資先ファンドにおける運用体制です。

米国総合債券ファンド

当該投資先ファンドの運用は、J P M I M社のグローバル債券運用グループに所属する米国コア債券運用チーム(約10名(2024年12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、2025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(2025年3月末現在))に所属するJ Pモルガン・アセット・マネジメント(U K)リミテッドのポートフォリオ・マネジャーが行います。

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、2025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

投資先ファンドのリスク

<訂正前>

米国総合債券ファンド

(略)

市場に関する留意点

(略)

LIBORの公表停止または利用できない場合のリスクおよび留意点

LIBOR（ロンドン銀行間取引金利）とは、英国ロンドンの銀行間市場において、参加する銀行が相互に短期資金を借り入れる際の金利指標のことをいいます。英国金融行為規制機構（FCA）は、LIBORの特定のテナー（期間）と通貨が、特定の将来の日付においてその公表が停止されること、また、測定対象の市場および経済の実態を示すものではなくなることを発表しています（この特定の将来の日付に関する情報は、https://www.jpmorgan.com/disclosures/interbank_offered_rates（英文）に掲載されています）。FCAより発表された日程は変更される可能性があり、また、LIBORの運営機関や規制当局がLIBORの算出、構成、特性のほか、算出対象の通貨および期間に影響を与える可能性のある措置を取る可能性もあります。そのような進展について常に情報を入手するために委託会社に問い合わせることを推奨します（後記「第2 管理及び運営 1 申込（販売）手続等 申込取扱場所」の照会先までお問い合わせください）。現在、LIBORに代わる新しい金利指標または代替金利指標を策定するため、業界において公的および民間の取り組みが進行しています。しかし、そのような代替金利指標が、LIBORと類似するまたは同等の価値もしくは経済的同等性をもたらすことや、公表が停止されたまたは利用が不可能となる以前のLIBORと同等の取引量または流動性を有することは保証されません。これにより投資先ファンドの投資対象の一部または全部を構成する投資先ファンドの特定のデリバティブ取引および他の金融商品または投資対象にかかる価格、流動性または投資結果に影響を与える可能性があり、結果として反対売買および新しい取引の開始に関連して費用が発生する可能性があります。これらのリスクは、他の銀行間取引金利（Euriborなど）や、ベンチマークとして扱われ、最近の規制改革の対象となっているその他のさまざまな指標、金利、価格に関連する変更に関する生じる可能性があります。

外国為替取引の決済リスク

(略)

マネープール・ファンド

(略)

市場に関する留意点

(略)

LIBORの公表停止または利用できない場合のリスクおよび留意点

LIBOR（ロンドン銀行間取引金利）とは、英国ロンドンの銀行間市場において、参加する銀行が相互に短期資金を借り入れる際の金利指標のことをいいます。英国金融行為規制機構（FCA）は、LIBORの特定のテナー（期間）と通貨が、特定の将来の日付においてその公表が停止されること、また、測定対象の市場および経済の実態を示すものではなくなることを発表しています（この特定の将来の日付に関する情報は、https://www.jpmorgan.com/disclosures/interbank_offered_rates（英文）に掲載されています）。FCAより発表された日程は変更される可能性があり、また、LIBORの運営機関や規制当局がLIBORの算出、構成、特性のほか、算出対象の通貨および期間に影響を与える可能性のある措置を取る可能性もあります。そのような進展について常に情報を入手するために委託会社に問い合わせることを推奨します（後記「第2 管理及び運営 1 申込（販売）手続等 申込取扱場所」の照会先までお問い合わせください）。現在、LIBORに代わる新しい金利指標または代替金利指標を策定するため、業界において公的および民間の取り組みが進行しています。しかし、そのような代替金利指標が、LIBORと類似するまたは同等の価値もしくは経済的同等性をもたらすことや、公表が停止されたまたは利用が不可能となる以前のLIBORと同等の取引量または流動性を有することは保証されません。これによりマネープール・マザーファンドの投資対象の一部または全部を構成するマネープール・マザーファンドの特定のデリバティブ取引および他の金融商品または投資対象にかかる価格、流動性または投資結果に影響を与える可能性があり、結果として反対売買および新しい取引の開始に関連して費用が発生する可能性があります。これらのリスクは、他の銀行間取引金利（Euriborなど）や、ベン

チマークとして扱われ、最近の規制改革の対象となっているその他のさまざまな指標、金利、価格に
関連する変更に関しても生じる可能性があります。

当ファンド・マザーファンドのリスク

(略)

<訂正後>

米国総合債券ファンド

(略)

市場に関する留意点

(略)

— 外国為替取引の決済リスク

(略)

マネープール・ファンド

(略)

市場に関する留意点

(略)

当ファンド・マザーファンドのリスク

(略)

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

<更新・訂正後>

参考情報

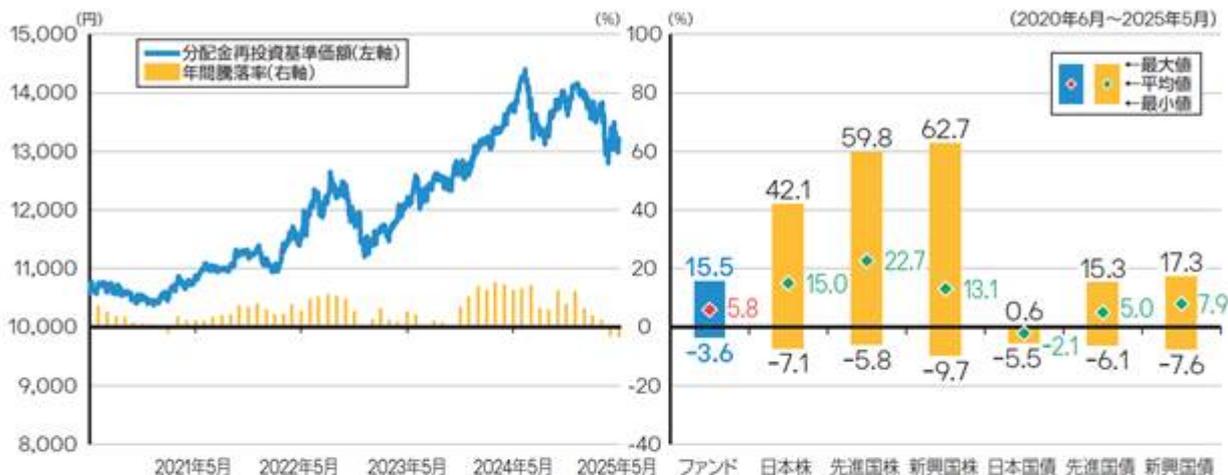
下記グラフは、ファンドの投資リスクをご理解いただくための情報の一つとしてご利用ください。

<ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移>

2020年6月～2025年5月の5年間に於ける、ファンドの分配金再投資基準価額(円)と、年間騰落率(毎月末時点)の推移を示したものです。

<ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較>

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



(ご注意)

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

○代表的な資産クラスを表す指数

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

(注)海外の指数は、為替ヘッジを行わないものとして算出されたものです。なお、MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、委託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・グローバルは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが発表しており、著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しています。

(2) 投資リスクに関する管理体制

<訂正前>

(略)

(ロ) 投資先ファンドにおけるリスク管理

米国総合債券ファンド

(略)

(2024年12月末現在)

(略)

マネープール・ファンド

(略)

(2024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)

(2025年6月末現在)

(略)

マネープール・ファンド

(略)

(2025年6月末現在)

(以下略)

4【手数料等及び税金】

(3) 信託報酬等

<訂正前>

(略)

	委託会社	販売会社	受託会社
信託報酬の配分 (純資産総額に対し)	年率0.165% (税抜0.15%)	年率0.66% (税抜0.60%)	年率0.033% (税抜0.03%)
	投資判断、受託会社に対する指図等の運用業務、目論見書、運用報告書等の開示資料作成業務、基準価額の計算業務、およびこれらに付随する業務の対価	受益者の口座管理業務、収益分配金・換金代金・償還金の支払い業務、交付運用報告書の交付業務、購入後の投資環境等の情報提供業務、およびこれらに付随する業務の対価	信託財産の記帳・保管・管理業務、委託会社からの指図の執行業務、信託財産の計算業務、およびこれらに付随する業務の対価

(略)

<ご参考：投資先ファンドの運用管理費用等>

投資先ファンド	運用管理費用または信託報酬の率 (投資先ファンドの日々の純資産総額に対し)	
米国総合債券ファンド	運用管理費用の率：年率0.45% (消費税等はかかりません。)	同ファンドの運用会社等が提供する、同ファンドの運用業務、同ファンドに関する情報提供業務、およびこれらに付随する業務の対価

マネープール・ ファンド	信託報酬率：年率0.1045% (税抜0.095%)	委託会社	投資判断、受託会社に対する指図等の運用業務（運用委託先が行う業務を含みます。）、基準価額の計算業務、およびこれらに付随する業務の対価
		販売会社	当ファンドの口座管理業務、収益分配金・換金代金・償還金の支払い業務、およびこれらに付随する業務の対価
		受託会社	信託財産の記帳・保管・管理業務、委託会社からの指図の執行業務、信託財産の計算業務、およびこれらに付随する業務の対価

(以下略)

<訂正後>

(略)

信託報酬の 配分 (純資産総 額に対し)	委託会社	販売会社	受託会社
	年率0.165% (税抜0.15%)	年率0.66% (税抜0.60%)	年率0.033% (税抜0.03%)
	投資判断、受託会社に対する指図等の運用業務、目論見書、運用報告書等の開示資料作成業務、基準価額の計算業務等の対価	受益者の口座管理業務、収益分配金・換金代金・償還金の支払い業務、交付運用報告書の交付業務、購入後の投資環境等の情報提供業務等の対価	信託財産の記帳・保管・管理業務、委託会社からの指図の執行業務、信託財産の計算業務等の対価

(略)

<ご参考：投資先ファンドの運用管理費用等>

投資先 ファンド	運用管理費用または信託報酬の率 (投資先ファンドの日々の純資産総額に対し)		
米国総合債券 ファンド	運用管理費用の率：年率0.45% (消費税等はありません。)	同ファンドの運用会社等が提供する、同ファンドの運用業務、同ファンドに関する情報提供業務等の対価	
マネープール・ ファンド	信託報酬率：年率0.1045% (税抜0.095%)	委託会社	投資判断、受託会社に対する指図等の運用業務（運用委託先が行う業務を含みます。）、基準価額の計算業務等の対価
		販売会社	当ファンドの口座管理業務、収益分配金・換金代金・償還金の支払い業務等の対価
		受託会社	信託財産の記帳・保管・管理業務、委託会社からの指図の執行業務、信託財産の計算業務等の対価

(以下略)

(4) その他の手数料等

<訂正前>

(略)

(八) 当ファンドにおいて、委託会社は、委託会社事務費用のうち監査費用*については、その支払いを信託財産のために行い、当該支払いに対し実費相当額の支弁を信託財産から受ける方法に代えて、信託財産の純資産総額に年率0.022%（税抜0.02%）を乗じて得た額（ただし、年間330万円（税抜300万円）を上限とします。）を監査費用とみなし、その支弁を信託財産中から受けるものとします。

* 信託財産の財務諸表の監査業務の対価として監査法人に支払われます。

(以下略)

<訂正後>

（略）

（八）当ファンドにおいて、委託会社は、委託会社事務費用のうち監査費用*については、その支払いを信託財産のために行い、当該支払いに対し実費相当額の支弁を信託財産から受ける方法に代えて、信託財産の純資産総額に年率0.022%（税抜0.02%）（上限）を乗じて得た額、または年間330万円（税抜300万円）のうちいずれか少ない額を監査費用とみなし、その支弁を信託財産中から受けるものとします。

* 信託財産の財務諸表の監査業務の対価として監査法人に支払われます。

（以下略）

（5）課税上の取扱い

<訂正前>

（略）

なお、税法が改正された場合には、以下の内容が変更になることがあります。以下の税制は2024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

（略）

上記は2024年12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。

（b）法人の受益者に対する課税

（略）

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

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

（参考情報） ファンドの総経費率

ファンドの直近の運用報告書対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率（+）	運用管理費用の比率（）	その他費用の比率（）
年率1.51%	年率1.30%	年率0.21%

対象期間：2024年5月16日～2024年11月15日

総経費率は、期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した数値です。

各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

の運用管理費用には投資先ファンドの運用管理費用を含みます。

これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

<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2025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

(略)

上記は2025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。

(b) 法人の受益者に対する課税

(略)

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

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

(参考情報) ファンドの総経費率

ファンドの直近の運用報告書対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(+)	運用管理費用の比率()	その他費用の比率()
年率1.52%	年率1.31%	年率0.21%

対象期間：2024年11月16日～2025年5月15日

総経費率は、期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した数値です。

各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

の運用管理費用には投資先ファンドの運用管理費用を含みます。

これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

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

(2025年6月2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	1,152,823,817	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	550,369	0.05
合計(純資産総額)		1,152,273,448	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「G I M U Sコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)」です(以下同じ)。

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

(2025年6月2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	984,491	0.02
投資証券	ルクセンブルク	4,151,670,540	99.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	7,156,906	0.17
合計(純資産総額)		4,159,811,937	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

(2025年6月2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 (為替ヘッジなし)(適格機関投資家 専用)	826,278,539	1.4051	1,161,076,877	1.3952	1,152,823,817	100.05

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

(2025年6月2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	350,056.538	12,745.24	4,461,554,590	11,860	4,151,670,540	99.80
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	0.9873	983,594	0.9882	984,491	0.02

種類別投資比率

(2025年6月2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(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)

(2025年6月2日現在)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.02
投資証券	99.80

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

2025年6月2日および同日前1年以内における各月末ならびに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額 (円) (分配落)	1口当たり 純資産額 (円) (分配付)
第1特定期間末	(2019年11月15日)	328	329	1.0229	1.0244
第2特定期間末	(2020年5月15日)	410	411	1.0420	1.0435
第3特定期間末	(2020年11月16日)	803	805	1.0392	1.0407
第4特定期間末	(2021年5月17日)	743	744	1.0606	1.0621
第5特定期間末	(2021年11月15日)	512	513	1.1058	1.1073
第6特定期間末	(2022年5月16日)	462	463	1.1311	1.1326
第7特定期間末	(2022年11月15日)	479	479	1.1563	1.1578
第8特定期間末	(2023年5月15日)	532	537	1.1320	1.1420
第9特定期間末	(2023年11月15日)	695	701	1.1787	1.1887
第10特定期間末	(2024年5月15日)	1,015	1,023	1.2350	1.2450
第11特定期間末	(2024年11月15日)	1,178	1,187	1.2321	1.2421
第12特定期間末	(2025年5月15日)	1,169	1,179	1.1378	1.1478
	2024年6月末日	1,149	-	1.2839	-
	2024年7月末日	1,150	-	1.2408	-
	2024年8月末日	1,100	-	1.1936	-
	2024年9月末日	1,121	-	1.1733	-
	2024年10月末日	1,181	-	1.2294	-
	2024年11月末日	1,158	-	1.2065	-
	2024年12月末日	1,212	-	1.2426	-
	2025年1月末日	1,215	-	1.2124	-
	2025年2月末日	1,211	-	1.1970	-
	2025年3月末日	1,210	-	1.1886	-
	2025年4月末日	1,155	-	1.1337	-
	2025年5月末日	1,152	-	1.1292	-
	2025年6月2日	1,152	-	1.1291	-

(注) 純資産総額(分配付)および1口当たり純資産額(分配付)は特定期間末日のものです。

分配の推移

期	1口当たり分配金（円）
第1特定期間	0.0030
第2特定期間	0.0045
第3特定期間	0.0045
第4特定期間	0.0045
第5特定期間	0.0045
第6特定期間	0.0045
第7特定期間	0.0045
第8特定期間	0.0300
第9特定期間	0.0300
第10特定期間	0.0300
第11特定期間	0.0300
第12特定期間	0.0300

収益率の推移

期	収益率（％）
第1特定期間	2.59
第2特定期間	2.31
第3特定期間	0.16
第4特定期間	2.49
第5特定期間	4.69
第6特定期間	2.69
第7特定期間	2.63
第8特定期間	0.49
第9特定期間	6.78
第10特定期間	7.32
第11特定期間	2.19
第12特定期間	5.22

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

(4) 設定及び解約の実績

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

期	設定口数（口）	解約口数（口）	残存口数（口）
第1特定期間	351,295,968	29,886,039	321,409,929
第2特定期間	170,696,051	97,765,443	394,340,537
第3特定期間	428,408,150	49,127,746	773,620,941
第4特定期間	102,127,267	174,592,904	701,155,304
第5特定期間	33,289,341	270,985,938	463,458,707
第6特定期間	13,921,841	68,215,762	409,164,786
第7特定期間	65,070,657	59,961,382	414,274,061
第8特定期間	68,623,221	12,344,341	470,552,941
第9特定期間	159,079,580	39,606,519	590,026,002
第10特定期間	303,480,550	71,572,299	821,934,253
第11特定期間	161,551,017	27,343,719	956,141,551
第12特定期間	83,374,060	11,714,969	1,027,800,642

(注1) 第1特定期間の設定口数には、当初申込期間中の設定口数を含みます。

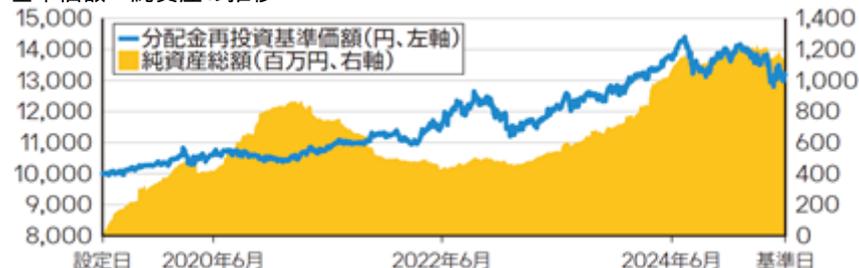
(注2) 設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

<参考情報>

最新の運用実績は、委託会社ホームページ（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	2025年6月2日	設定日	2019年6月10日
純資産総額	1,152百万円	決算回数	年6回

基準価額・純資産の推移



分配の推移

期	年月	円
32期	2024年9月	100
33期	2024年11月	100
34期	2025年1月	100
35期	2025年3月	100
36期	2025年5月	100
	設定来累計	1,800

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

* 分配金再投資基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

* 分配金は税引前1万口当たりの金額です。

ポートフォリオの構成状況

資産の種類	投資比率 1
J P M USアグリゲート・ボンド（Xクラス）（円建て）	99.8%
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）	0.0%
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	0.2%
合計（純資産総額）	100.0%

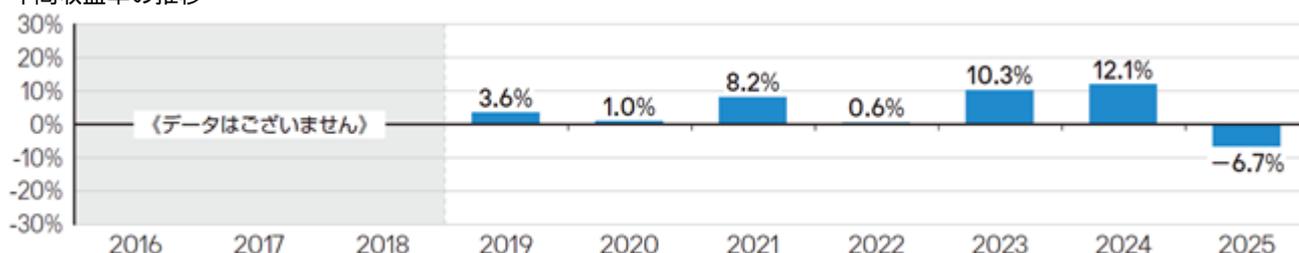
種類別構成状況

種類	投資比率 2
社債	31.7%
住宅ローン担保証券等	29.8%
国債・政府機関債等	25.5%
商業用不動産担保証券	9.7%
資産担保証券	1.1%
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 ^{※2}
1	米国国債	国債・政府機関債等	4.625%	2035/2/15	2.0%
2	米国国債	国債・政府機関債等	2.750%	2027/7/31	1.8%
3	米国国債	国債・政府機関債等	4.500%	2033/11/15	1.5%
4	米国国債	国債・政府機関債等	1.250%	2028/4/30	1.1%
5	米国国債	国債・政府機関債等	2.750%	2032/8/15	1.0%
6	ファニーメイ	住宅ローン担保証券等	2.500%	2055/7/1	1.0%
7	ジニーメイ	住宅ローン担保証券等	2.500%	2051/8/20	0.9%
8	米国国債（ストリップス債）	国債・政府機関債等	-	2030/5/15	0.8%
9	ファニーメイ	住宅ローン担保証券等	3.000%	2055/7/1	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 + その年に支払われた税引前の分配金) ÷ 前年末営業日の基準価額 - 1 } × 100

* 2019年の年間収益率は設定日から年末営業日、2025年の年間収益率は前年末営業日から2025年6月2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 USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）です。

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

- 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 USアグリゲート・ボンド（Xクラス）（円建て）およびG I Mジャパン・マネー・プール・ファンドF（適格機関投資家専用）は2025年5月最終営業日のもの）を使用しています。

第2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

(5) その他

運用報告書

<訂正前>

委託会社は、当ファンドについて、計算期間終了日毎および償還時に、運用経過、信託財産の内容、有価証券の売買状況等を記載した運用報告書および運用報告書に記載すべき事項のうち重要な事項のみを記載した交付運用報告書を作成します。そのうえで、委託会社は交付運用報告書を知れている受益者に対して販売会社を通して交付します。また、運用報告書のすべての内容を委託会社のホームページに掲載します。これにより、委託会社は運用報告書を知れている受益者に対して交付したものとみなされますが、受益者から書面による運用報告書の交付の請求があった場合には、販売会社を通して交付します。

HPアドレス：am.jpmorgan.com/jp

<訂正後>

委託会社は、当ファンドについて、計算期間終了日毎および償還時に、運用経過、信託財産の内容、有価証券の売買状況等を記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）に記載すべき事項のうち重要な事項のみを記載した交付運用報告書を作成します。そのうえで、委託会社は交付運用報告書を知れている受益者に対して販売会社を通して交付等を行います。また、運用報告書（全体版）のすべての内容を委託会社のホームページに掲載することで、委託会社は運用報告書（全体版）にかかる情報を電磁的方法により提供します。ただし、受益者から書面による運用報告書（全体版）にかかる情報の提供の請求があった場合には、販売会社を通して交付します。

HPアドレス：am.jpmorgan.com/jp

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12特定期間（2024年11月16日から2025年5月15日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【JPM USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 (2024年11月15日現在)	当期 (2025年5月15日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,189,415,309	1,181,519,900
未収入金	7,395,172	-
流動資産合計	1,196,810,481	1,181,519,900
資産合計	1,196,810,481	1,181,519,900
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	9,561,415	10,278,006
未払解約金	7,395,172	-
未払受託者報酬	61,575	62,813
未払委託者報酬	1,539,325	1,570,365
その他未払費用	205,203	209,346
流動負債合計	18,762,690	12,120,530
負債合計	18,762,690	12,120,530
純資産の部		
元本等		
元本	1,956,141,551	1,1,027,800,642
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	221,906,240	141,598,728
（分配準備積立金）	98,874,843	83,481,669
元本等合計	1,178,047,791	1,169,399,370
純資産合計	1,178,047,791	1,169,399,370
負債純資産合計	1,196,810,481	1,181,519,900

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	前期 (自 2024年 5月16日 至 2024年11月15日)	当期 (自 2024年11月16日 至 2025年 5月15日)
営業収益		
有価証券売買等損益	30,649,043	59,186,904
営業収益合計	30,649,043	59,186,904
営業費用		
受託者報酬	186,908	195,093
委託者報酬	4,672,550	4,877,389
その他費用	2,622,881	2,650,204
営業費用合計	5,482,339	5,722,686
営業利益又は営業損失 ()	25,166,704	64,909,590
経常利益又は経常損失 ()	25,166,704	64,909,590
当期純利益又は当期純損失 ()	25,166,704	64,909,590
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 ()	98,636	193,656
期首剰余金又は期首欠損金 ()	193,135,019	221,906,240
剰余金増加額又は欠損金減少額	37,566,141	17,263,130
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	37,566,141	17,263,130
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,041,099	2,520,246
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,041,099	2,520,246
分配金	1,280,191,161	1,303,334,462
期末剰余金又は期末欠損金 ()	221,906,240	141,598,728

(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 (2024年11月15日現在)	当期 (2025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 (2024年11月15日現在)	当期 (2025年5月15日現在)
1期首元本額	821,934,253円	956,141,551円
期中追加設定元本額	161,551,017円	83,374,060円
期中一部解約元本額	27,343,719円	11,714,969円
受益権の総数	956,141,551口	1,027,800,642口
1口当たりの純資産額 (1万口当たりの純資産額)	1.2321円 (12,321円)	1.1378円 (11,378円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	前期	当期
	(自 2024年 5月16日 至 2024年11月15日)	(自 2024年11月16日 至 2025年 5月15日)
1 分配金の計算過程	(自 2024年 5月16日 至 2024年 7月16日)	(自 2024年11月16日 至 2025年 1月15日)
費用控除後の配当等収益額	5,929,914円	5,044,729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	28,330,565円	- 円
収益調整金額	137,761,763円	164,098,126円
分配準備積立金額	83,529,724円	98,760,639円
当ファンドの分配対象収益額	255,551,966円	267,903,494円
当ファンドの期末残存口数	902,334,978口	989,071,641口
1万口当たり収益分配対象額	2,832.11円	2,708.63円
1万口当たり分配金額	100.00円	100.00円
収益分配金金額	9,023,349円	9,890,716円
	(自 2024年 7月17日 至 2024年 9月17日)	(自 2025年 1月16日 至 2025年 3月17日)
費用控除後の配当等収益額	4,967,203円	5,392,308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	150,575,812円	172,199,148円
分配準備積立金額	107,289,940円	93,064,079円
当ファンドの分配対象収益額	262,832,955円	270,655,535円
当ファンドの期末残存口数	943,439,773口	1,016,574,095口
1万口当たり収益分配対象額	2,785.90円	2,662.42円
1万口当たり分配金額	100.00円	100.00円
収益分配金金額	9,434,397円	10,165,740円
	(自 2024年 9月18日 至 2024年11月15日)	(自 2025年 3月18日 至 2025年 5月15日)
費用控除後の配当等収益額	6,717,204円	5,592,942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	155,129,607円	175,237,987円
分配準備積立金額	101,719,054円	88,166,733円
当ファンドの分配対象収益額	263,565,865円	268,997,662円
当ファンドの期末残存口数	956,141,551口	1,027,800,642口
1万口当たり収益分配対象額	2,756.55円	2,617.21円
1万口当たり分配金額	100.00円	100.00円
収益分配金金額	9,561,415円	10,278,006円
2 その他費用の内訳	監査費用 124,538円 その他 498,343円	監査費用 130,003円 その他 520,201円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する注記

	当財務諸表対象期間
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容およびそのリスク	当ファンドが保有した主な金融商品は、以下に記載される親投資信託受益証券であります。 G I M U Sコア債券マザーファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用） 親投資信託の受益証券を主要投資対象として運用を行うため、親投資信託受益証券と同様のリスクを伴います。親投資信託受益証券には、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。当該リスクは結果的に当ファンドに影響を及ぼします。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドで投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。 (1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、運用成果やリスク水準のチェック等を行います。 (2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っています。

金融商品の時価等に関する事項

	前期 (2024年11月15日現在)	当期 (2025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 (2024年11月15日現在)	当期 (2025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	77,919,368	25,494,219
合計	77,919,368	25,494,219

(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(2025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 (為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)	840,759,909	1,181,519,900	
合計			840,759,909	1,181,519,900	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「G I M USコア債券マザーファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、全て同親投資信託の受益証券であります。

尚、同親投資信託の状況は以下の通りであります。

「G I M USコア債券マザーファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）」の状況

尚、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（1）貸借対照表

（単位：円）

区分	注記 番号	(2024年11月15日現在)	(2025年5月15日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		67,439,257	-
コール・ローン		-	38,893,617
投資信託受益証券		983,594	984,391
投資証券		4,299,570,575	4,181,075,289
未収配当金		-	13,335,353
未収利息		-	372
流動資産合計		4,367,993,426	4,234,289,022
資産合計		4,367,993,426	4,234,289,022
負債の部			
流動負債			
未払解約金		7,395,172	182,123
その他未払費用		6,772,519	2,174,103
流動負債合計		14,167,691	2,356,226
負債合計		14,167,691	2,356,226
純資産の部			
元本等			
元本	1	2,948,699,758	3,011,398,661
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		1,405,125,977	1,220,534,135
元本等合計		4,353,825,735	4,231,932,796
純資産合計		4,353,825,735	4,231,932,796
負債純資産合計		4,367,993,426	4,234,289,022

（注）「G I M USコア債券マザーファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）」の計算期間は、毎年11月16日から翌年11月15日まで（計算期間終了日が休業日の場合は、その翌営業日まで）であり、当ファンドの特定期間と異なります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	当財務諸表対象期間
有価証券の評価基準および評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1)金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の最終相場）で評価しております。 当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によるのが適当でないとい認められた場合は、当該金融商品取引所等における気配相場で評価しております。</p> <p>(2)金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3)時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

(2024年11月15日現在)	(2025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	(2024年11月15日現在)	(2025年5月15日現在)
1期首元本額	2,472,163,789円	2,948,699,758円
期中追加設定元本額	592,276,897円	216,164,528円
期中解約元本額	115,740,928円	153,465,625円
元本の内訳（注）		
JPM USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、年1回決算型）	2,143,135,715円	2,170,638,752円
JPM USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）	805,564,043円	840,759,909円
合 計	2,948,699,758円	3,011,398,661円
受益権の総数	2,948,699,758口	3,011,398,661口
1口当たりの純資産額 （1万口当たりの純資産額）	1.4765円 (14,765円)	1.4053円 (14,053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

	(2024年11月15日現在)	(2025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	(2024年11月15日現在)	(2025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	4,184	797
投資証券	246,375,268	280,479,301
合計	246,371,084	280,478,504

(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（2025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	984,391	
	計	銘柄数：	1	996,247	984,391	
		組入時価比率：	0.0%		0.0%	
	小計				984,391	
投資証券	日本円	JPM US AGGR BOND X(MTH) JPY		350,056.538	4,181,075,289	
	計	銘柄数：	1	350,056.538	4,181,075,289	
		組入時価比率：	98.8%		100.0%	
	小計				4,181,075,289	
	合計				4,182,059,680	

(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12期 (2024年1月15日現在)	第13期 (2025年1月14日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
親投資信託受益証券		6,155,179	5,140,381
流動資産合計		6,155,179	5,140,381
資産合計		6,155,179	5,140,381
負債の部			
流動負債			
未払受託者報酬		696	547
未払委託者報酬		2,427	2,053
その他未払費用		598	546
流動負債合計		3,721	3,146
負債合計		3,721	3,146
純資産の部			
元本等			
元本	1	6,203,111	5,203,710
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	51,653	66,475
（分配準備積立金）		114,234	95,830
元本等合計		6,151,458	5,137,235
純資産合計		6,151,458	5,137,235
負債純資産合計		6,155,179	5,140,381

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位 : 円)

区分	注記 番号	第12期	第13期
		(自 2023年 1月17日 至 2024年 1月15日)	(自 2024年 1月16日 至 2025年 1月14日)
		金額	金額
営業収益			
有価証券売買等損益		1,812	18,426
営業収益合計		1,812	18,426
営業費用			
受託者報酬		1,399	1,224
委託者報酬	1	4,891	4,427
その他費用	3	1,203	1,139
営業費用合計		7,493	6,790
営業利益又は営業損失 ()		9,305	25,216
経常利益又は経常損失 ()		9,305	25,216
当期純利益又は当期純損失 ()		9,305	25,216
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 ()		12	2,071
期首剰余金又は期首欠損金 ()		42,496	51,653
剰余金増加額又は欠損金減少額		136	8,323
当期一部解約に伴う剰余金増加額又 は欠損金減少額		136	8,323
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 ()		51,653	66,475

(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 2024年1月14日が休日のため、信託約款第29条により、第12期計算期間末日を2024年1月15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12期 (2024年1月15日現在)	第13期 (2025年1月14日現在)
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当計算期間の翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第12期 (2024年1月15日現在)	第13期 (2025年1月14日現在)
1 期首元本額	6,223,017円	6,203,111円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	19,906円	999,401円
2 元本の欠損	51,653円	66,475円
受益権の総数	6,203,111口	5,203,710口
1 口当たりの純資産額	0.9917円	0.9872円
(1 万口当たりの純資産額)	(9,917円)	(9,872円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第12期 (自 2023年1月17日 至 2024年1月15日)	第13期 (自 2024年1月16日 至 2025年1月14日)
1 信託財産の運用の指図に関する権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	純資産総額に年率0.049%を乗じて得た額	同左
2 分配金の計算過程		
費用控除後の配当等収益額	1,789円	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	204,482円	171,538円
分配準備積立金額	112,445円	95,830円
当ファンドの分配対象収益額	318,716円	267,368円
当ファンドの期末残存口数	6,203,111口	5,203,710口
1万口当たり収益分配対象額	513.80円	513.80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 1,203円	監査費用 1,139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12期 (2024年1月15日現在)	第13期 (2025年1月14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	第12期 (2024年1月15日現在)	第13期 (2025年1月14日現在)
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	1,830	16,853
合計	1,830	16,853

(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（2025年1月14日現在）

(イ) 株式

該当事項はありません。

(ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託 受益証券	日本円	G I M マネープール・マザーファンド (適格機関投資家専用)	5,106,677	5,140,381	
合計			5,106,677	5,140,381	

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	(2024年1月15日現在)	(2025年1月14日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		1,392,806	1,150,056
国債証券		4,759,913	3,989,032
未収利息		1,609	1,301
前払費用		872	124
流動資産合計		6,155,200	5,140,513
資産合計		6,155,200	5,140,513
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	6,094,841	5,106,677
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		60,359	33,836
元本等合計		6,155,200	5,140,513
純資産合計		6,155,200	5,140,513
負債純資産合計		6,155,200	5,140,513

(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)

(2024年1月15日現在)	(2025年1月14日現在)
当期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当期間の翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	(2024年1月15日現在)	(2025年1月14日現在)
1期首元本額	6,121,918円	6,094,841円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中解約元本額	27,077円	988,164円
元本の内訳（注）		
G I M ジャパン・マネープール・ファンド F（適格機関投資家専用）	6,094,841円	5,106,677円
合 計	6,094,841円	5,106,677円
受益権の総数	6,094,841口	5,106,677口
1口当たりの純資産額	1.0099円	1.0066円
（1万口当たりの純資産額）	(10,099円)	(10,066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

	(2024年1月15日現在)	(2025年1月14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 同左</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	(2024年1月15日現在)	(2025年1月14日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	663	14,257
合計	663	14,257

(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(2025年1月14日現在)

(イ) 株式

該当事項はありません。

(ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	第454回利付国債(2年)		400,000	399,016	
		第457回利付国債(2年)		300,000	298,827	
		第458回利付国債(2年)		200,000	199,328	
		第146回利付国債(5年)		400,000	398,648	
		第149回利付国債(5年)		600,000	593,718	
		第340回利付国債(10年)		850,000	850,136	
		第341回利付国債(10年)		400,000	399,388	
		第1207回国庫短期証券		850,000	849,971	
	計	銘柄数:	8	4,000,000	3,989,032	
		組入時価比率:	77.6%		100.0%	
	小計				3,989,032	
	合計				3,989,032	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「JPM US AGGR BOND X(MTH) JPY」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資証券」は、同投資証券であります。

同投資証券の状況は以下の通りであります。

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

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund
純資産計算書
2024年6月30日現在

	米ドル
資産	
投資有価証券取得原価	4,939,789,413
未実現利益／(損失)	(339,416,176)
投資有価証券一時価	4,600,373,237
TBA証券への投資一時価	47,064,064
現金預金およびブローカー預託金	4,758,410
定期預金	—
証券発行未収入金	3,533,298
投資有価証券売却未収入金	29,085
TBA証券売却未収入金	—
未収入配当金	317,653
未収入利息	31,796,346
未収入還付税額	—
未収入報酬免除額	126,433
未買建オプション契約公正価値	—
金融先物契約未実現利益	3,783,531
先渡為替契約未実現利益	1,037,581
スワップ契約の公正価値	—
その他の資産	571
資産合計	4,692,819,209
負債	
TBA契約にかかるオープン・ショート・ポジションの時価	—
当座借越	741
ブローカーに対する債権	—
証券買戻未払金	8,093,089
投資有価証券購入未払金	—
TBA証券購入未払金	46,360,175
未払払戻利息	—
未払販売用報酬	37,943
未払運用報酬	1,908,227
未払ファンド・サービス報酬	379,474
未買建オプション契約公正価値	—
金融先物契約未実現損失	—
先渡為替契約未実現損失	—
スワップ契約未実現損失	12,928,654
為替差未実現損失	—
その他の負債*	122,723
負債合計	69,831,026
純資産額合計	4,622,988,183

*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、金銭、発行、発送、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
2024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	4,853,089,988
収益	
受取配当金、源泉徴収税控除後	3,279,303
投資有価証券からの受取利息、源泉徴収税控除後	179,245,809
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	303,119
その他の収益	—
収益合計	182,828,231
費用	
運用報酬	23,203,323
ファンド・サービス報酬	4,665,891
業績報酬	—
保管、支払代行、事務および所在地代行報酬	891,998
販売用報酬	577,763
登録および名義書換代行報酬	430,897
税金	1,532,442
銀行およびその他の支払利息	2,886
スワップ契約にかかる支払利息	—
その他の費用*	738,527
控除：報酬免除額	(1,579,056)
費用合計	30,464,671
投資純利益(損失)	152,363,560
投資有価証券売却実現純利益(損失)	(79,086,595)
TBA証券実現純利益(損失)	(292,078)
オプション契約実現純利益(損失)	—
金融先物契約実現純利益(損失)	(20,228,873)
先渡為替契約実現純利益(損失)	(27,826,592)
スワップ契約実現純利益(損失)	—
為替差実現純利益(損失)	20,206,863
当期実現純利益(損失)	(107,227,275)
投資有価証券未実現評価益(損)純増減	93,789,361
TBA証券未実現評価益(損)純増減	703,889
オプション契約未実現評価益(損)純増減	—
金融先物契約未実現評価益(損)純増減	8,769,098
先渡為替契約未実現評価益(損)純増減	(43,089,933)
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	7,462,013
当期末実現評価益(損)純増減	67,634,428
事業活動による純資産増減	112,770,713
設	
解	定約
資本の増減による純資産増減	1,522,287,224
支	(1,843,497,813)
払	
配	
当	
金	(321,210,589)
支	
払	
配	
当	
金	(21,661,929)
期	
末	
現	
在	
純	
資	
産	
額	4,622,988,183

*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、金銭、発行、発送、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

2024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						Grupo Televisa SAB 8.75% 11/03/2032	USD	263,000	299,634	0.00	
債券						Mexico Government Bond 4.75% 08/03/2044	USD	648,000	524,954	0.01	
カナダ						Mexico Government Bond 4.35% 15/01/2047	USD	36,000	27,239	0.00	
Barrick Gold Corp. 6.45% 15/10/2016	USD	709,000	767,907	0.02		Mexico Government Bond 5.75% 12/10/2110	USD	566,000	472,639	0.01	
Canadian Pacific Railway Co. 5.75% 15/03/2033	USD	305,000	317,948	0.01					3,458,687	0.07	
Fortis, Inc. 3.055% 04/10/2026	USD	280,000	266,058	0.01		オランダ					
Nutrien Ltd. 4.9% 27/03/2028	USD	2,000,000	1,983,053	0.04		ING Group NV, FRN 6.083% 11/09/2027	USD	846,000	856,619	0.02	
Nutrien Ltd. 4.2% 01/04/2029	USD	275,000	264,258	0.01					856,619	0.02	
Suncor Energy, Inc. 7.15% 01/01/2032	USD	150,000	165,229	0.00		シンガポール					
Suncor Energy, Inc. 6.8% 15/09/2038	USD	550,000	593,228	0.01		Fluor Investment Enterprises Re. Ltd. 5.5% 09/06/2063	USD	4,270,000	4,178,182	0.09	
TransCanada Pipelines Ltd. 6.2% 15/10/2037	USD	540,000	563,272	0.01					4,178,182	0.09	
			4,920,353	0.11		スペイン					
コロンビア						Banco Santander SA 2.746% 28/05/2025	USD	2,000,000	1,948,772	0.04	
Ecopetrol SA 5.375% 26/06/2026	USD	464,000	456,113	0.01		Banco Santander SA 5.147% 18/08/2025	USD	600,000	596,085	0.01	
			456,113	0.01		Banco Santander SA, FRN 1.722% 14/09/2027	USD	800,000	734,686	0.02	
									3,279,543	0.07	
フランス						イギリス					
Credit Agricole SA, 144A 4.375% 17/09/2025	USD	400,000	395,475	0.01		Barclays plc, FRN 5.823% 09/06/2027	USD	1,500,000	1,504,634	0.03	
TotalEnergies Capital International SA 3.82% 29/09/2030	USD	2,555,000	1,755,654	0.04		Barclays plc, FRN 6.224% 09/06/2024	USD	3,000,000	3,096,407	0.07	
			2,151,129	0.05		HSBC Holdings plc 6.1% 14/01/2042	USD	3,155,000	3,393,355	0.07	
アイルランド						HSBC Holdings plc, FRN 7.39% 03/11/2028	USD	2,460,000	2,607,255	0.06	
AerCap Ireland Capital DAC 1.65% 29/10/2034	USD	210,000	207,125	0.00		Lloyds Banking Group plc 4.582% 10/12/2025	USD	600,000	589,729	0.01	
AerCap Ireland Capital DAC 6.5% 15/07/2025	USD	743,000	748,799	0.02		Lloyds Banking Group plc, FRN 1.622% 11/09/2027	USD	2,085,000	1,939,272	0.04	
AerCap Ireland Capital DAC 4.45% 01/10/2025	USD	958,000	945,673	0.02		Bank of Ireland Group plc 4.2% 05/04/2026	USD	1,275,000	1,261,185	0.03	
AerCap Ireland Capital DAC 2.45% 29/10/2026	USD	2,500,000	2,335,387	0.05		NatWest Group plc, FRN 4.892% 18/05/2029	USD	667,000	653,976	0.01	
AerCap Ireland Capital DAC 3% 29/10/2028	USD	975,000	889,219	0.02		NatWest Group plc, FRN 5.808% 13/09/2029	USD	7,540,000	7,665,001	0.17	
Bank of Ireland Group plc, FRN, 144A 2.029% 30/09/2027	USD	1,132,000	1,042,773	0.02		NatWest Group plc, FRN 5.076% 27/01/2030	USD	1,750,000	1,725,680	0.04	
			6,168,976	0.13		NatWest Group plc, FRN 4.445% 06/05/2030	USD	3,048,000	2,925,496	0.06	
メキシコ											
America Movil SAB de CV 3.625% 22/04/2029	USD	1,405,000	1,314,860	0.03							
America Movil SAB de CV 4.375% 22/04/2049	USD	966,000	819,361	0.02							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)	
Prudential Funding Asia plc 3.12% 14/04/2030	USD	2,000,000	1,801,911	0.04		AT&T, Inc. 1.65% 01/02/2028	USD	485,000	431,948	0.01	
Santander UK Group Holdings plc, FRN 6.83% 21/11/2026	USD	3,771,000	3,825,101	0.08		AT&T, Inc. 2.75% 01/06/2031	USD	2,320,000	1,999,478	0.04	
Santander UK Group Holdings plc, FRN 6.53% 10/01/2029	USD	3,000,000	3,091,208	0.07		AT&T, Inc. 2.35% 01/02/2032	USD	3,220,000	2,631,106	0.06	
						AT&T, Inc. 3.5% 01/06/2041	USD	1,382,000	1,069,429	0.02	
						AT&T, Inc. 3.65% 01/06/2051	USD	3,168,000	2,273,807	0.05	
						Atmos Energy Corp. 4.1% 15/01/2043	USD	690,000	587,727	0.01	
						Bank of America NA 6% 15/10/2036	USD	1,800,000	1,909,479	0.04	
						Bedshire Hathaway Energy Co. 6.12% 01/04/2036	USD	1,437,000	1,517,523	0.03	
アメリカ						Berkshire Hathaway Finance Corp. 4.2% 15/05/2043	USD	312,000	277,260	0.01	
AbbVie, Inc. 4.5% 14/05/2035	USD	1,624,000	1,545,721	0.03		Berkshire Hathaway Finance Corp. 3.85% 15/03/2032	USD	2,640,000	2,074,764	0.04	
AbbVie, Inc. 4.05% 21/11/2039	USD	4,929,000	4,325,898	0.09		Boston Scientific Corp. 4.55% 01/03/2039	USD	721,000	678,998	0.01	
AbbVie, Inc. 4.4% 06/11/2042	USD	1,200,000	1,067,497	0.02		BP Capital Markets America, Inc. 4.89% 11/09/2033	USD	1,565,000	1,534,675	0.03	
AbbVie, Inc. 4.25% 21/11/2049	USD	1,580,000	1,320,261	0.03		Bristol-Myers Squibb Co. 5.5% 22/02/2054	USD	1,620,000	1,621,627	0.03	
Aetna, Inc. 6.75% 15/12/2037	USD	300,000	323,128	0.01		Bristol-Myers Squibb Co. 5.8% 22/02/2064	USD	2,440,000	2,421,682	0.05	
Aetna, Inc. 4.5% 15/05/2042	USD	147,000	124,252	0.00		Brimor Operating Partnership LP, REIT 3.85% 01/02/2025	USD	900,000	890,388	0.02	
Alameda Real Estate Equities, Inc., REIT 3.8% 15/04/2026	USD	214,000	208,217	0.00		Brookfield Finance LLC 3.45% 15/04/2050	USD	1,080,000	754,089	0.02	
Alameda Real Estate Equities, Inc., REIT 3.9% 15/01/2028	USD	1,347,000	1,294,067	0.03		Burlington Northern Santa Fe LLC 7.95% 15/08/2030	USD	250,000	289,996	0.01	
Alameda Real Estate Equities, Inc., REIT 4.9% 15/12/2030	USD	2,000,000	1,969,329	0.04		Burlington Northern Santa Fe LLC 6.1% 01/05/2037	USD	870,000	947,323	0.02	
Alameda Real Estate Equities, Inc., REIT 4% 01/02/2030	USD	1,016,000	766,711	0.02		Burlington Northern Santa Fe LLC 5.75% 01/05/2040	USD	700,000	727,230	0.02	
Allstate Corp. (The) 5.1% 01/06/2033	USD	805,000	813,587	0.02		Campbell Soup Co. 3.12% 24/04/2060	USD	470,000	310,647	0.01	
Ameren Illinois Co. 5.5% 01/01/2064	USD	3,250,000	3,225,230	0.07		Capital One Financial Corp. 4.2% 29/10/2025	USD	350,000	343,103	0.01	
American Tower Corp., REIT 3.37% 15/10/2036	USD	437,000	417,949	0.01		CenterPoint Energy Resources Corp. 5.8% 15/01/2041	USD	250,000	257,787	0.01	
American Tower Corp., REIT 3.1% 15/06/2030	USD	1,231,000	808,822	0.02		Cleveland Electric Illuminating Co. (The) 5.9% 15/12/2036	USD	425,000	436,010	0.01	
American Tower Corp., REIT 2.95% 15/01/2031	USD	804,000	511,181	0.01		CMS Energy Corp. 2% 15/05/2026	USD	219,000	209,800	0.00	
American Water Capital Corp. 3.4% 01/06/2029	USD	365,000	340,513	0.01		CMS Energy Corp. 2.95% 15/02/2027	USD	387,000	363,711	0.01	
American Water Capital Corp. 6.59% 15/10/2037	USD	125,000	140,343	0.00		Columbia Pipeline Group, Inc. 5.8% 01/06/2045	USD	1,550,000	1,534,738	0.03	
American Water Capital Corp. 4% 01/12/2046	USD	375,000	300,057	0.01		Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 5.7% 15/06/2040	USD	173,000	174,543	0.00	
Anheuser-Busch Cos. LLC 4.7% 01/02/2036	USD	3,903,000	3,753,720	0.08		Constellation Brands, Inc. 4.75% 09/05/2032	USD	390,000	376,985	0.01	
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. 4.62% 01/02/2044	USD	150,000	136,020	0.00							
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4.37% 15/04/2028	USD	1,000,000	920,271	0.02							
Arrow Electronics, Inc. 3.25% 08/09/2024	USD	469,000	466,332	0.01							
AT&T, Inc. 2.3% 01/06/2027	USD	5,180,000	4,798,324	0.10							

JPMorgan Funds – US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表（続き）

2024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(%)	
Constellation Brands, Inc. 4.5% 03/05/2041	USD	490,000	417,173	0.01		Entergy Louisiana LLC 3.12% 01/09/2027	USD	320,000	302,995	0.01	
CRF Defense Properties LP, REIT 2% 15/01/2029	USD	660,000	561,913	0.01		Entergy Louisiana LLC 3.05% 01/06/2031	USD	314,000	275,804	0.01	
CRF Defense Properties LP, REIT 2.75% 15/04/2031	USD	3,203,000	2,667,861	0.06		Entergy Louisiana LLC 15/03/2033	USD	330,000	298,904	0.01	
Corning, Inc. 3.9% 15/11/2049	USD	2,044,000	1,568,349	0.03		Entergy Louisiana LLC 2.9% 15/02/2051	USD	1,040,000	641,623	0.01	
Crown Castle, Inc., REIT 4% 01/02/2027	USD	228,000	220,836	0.00		Entergy Mississippi LLC 5.85% 01/06/2054	USD	1,010,000	1,021,810	0.02	
Crown Castle, Inc., REIT 5.8% 01/03/2034	USD	1,455,000	1,480,962	0.03		Enterprise Products Operating LLC 7.5% 15/04/2038	USD	847,000	1,014,417	0.02	
CYS Health Corp. 4.2% 25/03/2038	USD	285,000	276,079	0.01		Enterprise Products Operating LLC 5.75% 01/03/2035	USD	1,245,000	1,287,128	0.03	
CYS Health Corp. 5.12% 21/02/2030	USD	818,000	812,917	0.02		Essex Portfolio LP, REIT 2.6% 15/03/2032	USD	4,000,000	3,338,162	0.07	
CYS Health Corp. 5.25% 21/02/2033	USD	2,600,000	2,556,984	0.06		Fidelity National Information Services, Inc. 4.5% 15/08/2046	USD	2,360,000	1,975,061	0.04	
CYS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	USD	4,205,000	3,668,576	0.08		Florida Power & Light Co. 3.3% 30/05/2027	USD	670,000	639,629	0.01	
Dominion Energy, Inc. 2.85% 15/08/2026	USD	183,000	174,060	0.00		Florida Power & Light Co. 5.4% 01/09/2035	USD	700,000	710,223	0.02	
Dominion Energy, Inc. 4.9% 01/08/2041	USD	111,000	98,907	0.00		General Motors Financial Co., Inc. 3% 03/04/2027	USD	1,900,000	1,885,142	0.04	
Dominion Energy, Inc. 5.25% 01/08/2033	USD	785,000	772,925	0.02		General Motors Financial Co., Inc. 5.2% 23/09/2028	USD	7,850,000	7,967,962	0.17	
Duke Energy Carolinas LLC 6.45% 15/10/2032	USD	100,000	107,879	0.00		General Motors Financial Co., Inc. 2.35% 08/01/2031	USD	1,197,000	988,212	0.02	
Duke Energy Corp. 2.6% 01/09/2036	USD	810,000	766,705	0.02		General Motors Financial Co., Inc. 5.75% 06/02/2031	USD	1,225,000	1,234,234	0.03	
Duke Energy Progress LLC 4.1% 15/05/2042	USD	189,000	156,696	0.00		General Motors Financial Co., Inc. 2.3% 10/06/2031	USD	2,615,000	2,177,181	0.05	
Duke Energy Progress LLC 2.9% 15/08/2051	USD	1,255,000	793,701	0.02		General Motors Financial Co., Inc. 5.8% 10/06/2031	USD	4,500,000	4,488,749	0.10	
DuPont de Nemours, Inc. 5.319% 15/11/2038	USD	843,000	877,672	0.02		Global Payments, Inc. 4.8% 01/04/2026	USD	1,880,000	1,858,748	0.04	
Eaton Corp. 4.15% 15/03/2033	USD	146,000	137,740	0.00		Global Payments, Inc. 3.2% 15/08/2029	USD	4,145,000	3,732,477	0.08	
Eaton Corp. 5.8% 15/03/2037	USD	100,000	104,162	0.00		Global Payments, Inc. 5.3% 15/08/2029	USD	710,000	707,780	0.02	
Edison International 5.2% 15/11/2028	USD	2,225,000	2,212,508	0.05		Global Payments, Inc. 2.9% 15/02/2030	USD	488,000	426,994	0.01	
Elevance Health, Inc. 4.101% 01/03/2028	USD	885,000	858,323	0.02		Global Payments, Inc. 2.9% 15/11/2031	USD	937,000	789,746	0.02	
Elevance Health, Inc. 4.625% 15/05/2042	USD	344,000	306,692	0.01		Halliburton Co. 4.75% 01/08/2043	USD	430,000	383,655	0.01	
Elevance Health, Inc. 4.375% 01/12/2047	USD	201,000	169,375	0.00		Hartford Financial Services Group, Inc. (The) 6.1% 01/08/2041	USD	600,000	629,611	0.01	
Eli Lilly & Co. 5% 09/02/2054	USD	1,800,000	1,748,831	0.04		Hartford Financial Services Group, Inc. (The) 4.2% 15/04/2040	USD	500,000	427,792	0.01	
Eli Lilly & Co. 4.9% 21/02/2063	USD	1,720,000	1,626,597	0.04		HCA, Inc. 5.375% 01/02/2025	USD	1,880,000	1,874,159	0.04	
Energy Transfer LP 6.2% 15/02/2040	USD	800,000	794,117	0.02		HCA, Inc. 5.625% 01/09/2028	USD	7,000,000	7,085,778	0.15	
Energy Transfer LP 6% 15/06/2048	USD	650,000	635,870	0.01		HCA, Inc. 5.6% 01/04/2034	USD	2,000,000	2,004,072	0.04	
Eni USA, Inc. 7.3% 15/11/2027	USD	1,030,000	1,096,114	0.02							
Entergy Corp. 2.95% 01/09/2026	USD	220,000	209,019	0.00							
Entergy Louisiana LLC 2.4% 01/10/2026	USD	532,000	501,014	0.01							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)	割合(%)						
HCA, Inc. 5.125% 15/06/2039	USD	2,000,000	1,872,372	0.04		Pacific Gas and Electric Co. 5.8%	USD	387,000	387,566	0.01	
HCA, Inc. 5.5% 15/06/2047	USD	190,000	178,939	0.00		15/05/2034					
HCA, Inc. 3.5% 15/07/2051	USD	170,000	115,511	0.00		Pacific Gas and Electric Co. 3.75%	USD	451,000	328,543	0.01	
Home Depot, Inc. (The) 3.625% 15/04/2052	USD	1,945,000	1,462,934	0.03		15/02/2042					
J W Sausser Co. (The) 6.2% 15/11/2033	USD	1,180,000	1,247,881	0.03		Pacific Gas and Electric Co. 4.3%	USD	770,000	600,150	0.01	
Jersey Central Power & Light Co. 6.15% 01/06/2037	USD	320,000	334,124	0.01		15/02/2045					
Kellanova 5.25% 01/03/2033	USD	2,219,000	2,221,817	0.05		Pacific Gas and Electric Co. 4%	USD	1,500,000	1,097,639	0.02	
Kinder Morgan, Inc. 7.8% 01/09/2031	USD	2,400,000	2,727,911	0.06		01/12/2046					
Kroger Co. (The) 5.4% 15/01/2040	USD	114,000	111,968	0.00		Pacific Gas and Electric Co. 6.75%	USD	1,000,000	1,054,947	0.02	
Kroger Co. (The) 4.45% 01/02/2047	USD	1,220,000	1,022,787	0.02		15/01/2053					
Lear Corp. 2.6% 15/01/2032	USD	885,000	714,770	0.02		Packer-Berfin Corp. 4.1% 01/02/2047	USD	416,000	336,978	0.01	
LYB International Finance III LLC 3.625% 01/04/2051	USD	2,705,000	1,894,076	0.04		Phillips 66 4.875% 15/11/2044	USD	85,000	76,626	0.00	
Marathon Oil Corp. 6.2% 15/02/2032	USD	341,000	264,095	0.01		PL Electric Utilities Corp. 5.25% 15/02/2033	USD	1,785,000	1,729,039	0.04	
Market Group, Inc. 5% 05/04/2046	USD	1,000,000	897,924	0.02		Precision Castparts Corp. 4.375%	USD	250,000	222,506	0.00	
Martin Marietta Materials, Inc. 3.4% 01/06/2027	USD	666,000	638,274	0.01		15/06/2045					
Masco Corp. 6.5% 15/08/2032	USD	1,000,000	1,072,668	0.02		Progress Energy, Inc. 5% 30/10/2001	USD	300,000	327,749	0.01	
McDonald's Corp. 4.7% 09/12/2035	USD	547,000	523,922	0.01		Prologis LP, REIT 2.12% 15/10/2060	USD	525,000	282,657	0.01	
McDonald's Corp. 6.2% 15/10/2037	USD	179,000	193,562	0.00		Public Storage Operating Co., REIT 2.25% 09/11/2031	USD	1,062,000	882,679	0.02	
MetLife, Inc. 6.5% 15/12/2032	USD	616,000	676,215	0.01		Qumba Services, Inc. 2.35% 15/01/2032	USD	2,295,000	1,881,128	0.04	
Molson Coors Beverage Co. 4.2% 15/07/2046	USD	930,000	755,091	0.02		Quest Diagnostics, Inc. 6.4% 30/11/2033	USD	1,300,000	1,399,841	0.03	
Morgan Stanley 4.3% 27/01/2045	USD	1,125,000	965,414	0.02		Realty Income Corp., REIT 3.25% 15/01/2031	USD	1,480,000	1,317,263	0.03	
Morgan Stanley, FRN 1.794% 13/02/2032	USD	2,080,000	1,679,693	0.04		Resolution Funding Corp. 0% 15/01/2030	USD	4,000,000	3,107,671	0.07	
MPLX LP 5.5% 01/06/2034	USD	3,650,000	3,623,954	0.08		Resolution Funding Corp. 0% 15/04/2030	USD	200,000	153,612	0.00	
Nevada Power Co. 6.65% 01/04/2036	USD	200,000	217,267	0.00		Safelord Oil Holdings LLC, REIT 2.8% 15/06/2031	USD	5,000,000	4,212,139	0.09	
Nevada Power Co. 5.37% 15/09/2040	USD	365,000	354,293	0.01		San Diego Gas & Electric Co. 6.125% 15/09/2037	USD	150,000	152,612	0.00	
NiSource, Inc. 5.8% 01/02/2042	USD	628,000	621,380	0.01		San Diego Gas & Electric Co. 1.95% 15/11/2041	USD	218,000	177,206	0.00	
NNN REIT, Inc. 5.8% 15/10/2033	USD	950,000	952,954	0.02		Sempra 5.4% 01/08/2026	USD	2,220,000	2,220,321	0.05	
NNN REIT, Inc., REIT 3.8% 15/12/2036	USD	1,000,000	961,435	0.02		Sherwin-Williams Co. (The) 4.55% 01/02/2045	USD	1,821,000	1,558,543	0.03	
Occidental Petroleum Corp. 3% 15/02/2027	USD	2,000,000	1,873,247	0.04		SITE Centers Corp., REIT 3.625% 01/02/2025	USD	345,000	340,548	0.01	
Occidental Petroleum Corp. 4.2% 15/02/2029	USD	1,074,000	881,114	0.02		Southern California Edison Co. 3.6% 01/02/2028	USD	800,000	761,057	0.02	
Ohio Edison Co. 6.875% 15/01/2036	USD	350,000	395,621	0.01		Southern California Edison Co. 6% 15/01/2034	USD	150,000	156,699	0.00	
ONB Partners LP 6.6% 01/10/2036	USD	910,000	972,375	0.02		Southern California Edison Co. 5.2% 15/01/2036	USD	530,000	530,752	0.01	
Oracle Corp. 3.6% 01/04/2040	USD	1,800,000	1,400,802	0.03							
Oracle Corp. 4% 15/07/2046	USD	1,070,000	828,109	0.02							
Oracle Corp. 4.375% 15/05/2055	USD	940,000	745,494	0.02							
Pacific Gas and Electric Co. 2.95% 01/02/2036	USD	4,765,000	4,564,762	0.10							

JPMorgan Funds – US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表（続き）

2024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(%)	
Southern California Edison Co. 4.0%	USD	900,000	731,420	0.02		US Treasury 1.25% 30/04/2028	USD	92,170,000	82,142,912	1.78	
15/01/2042						US Treasury 2.875% 15/05/2028	USD	7,360,400	6,974,266	0.15	
Southern California Edison Co. 5.875%	USD	2,797,000	2,838,333	0.06		US Treasury 1.25% 30/06/2028	USD	24,971,500	22,185,620	0.48	
01/02/2033						US Treasury 3.75% 31/12/2028	USD	25,000,000	24,448,242	0.53	
Southern Co. (The) 5.7% 15/02/2034	USD	1,155,000	1,181,937	0.03		US Treasury 2.5% 15/01/2029	USD	1,000,000	1,489,008	0.03	
Southern Co. Gas Capital Corp. 5.875%	USD	550,000	558,290	0.01		US Treasury 2.75% 31/05/2029	USD	775,000	722,809	0.02	
15/01/2041						US Treasury 3.25% 30/06/2029	USD	23,000,000	21,938,945	0.47	
Southern Co. Gas Capital Corp. 4.4%	USD	167,000	140,017	0.00		US Treasury 2.625% 31/07/2029	USD	12,035,000	11,135,666	0.24	
01/06/2043						US Treasury 3.125% 31/08/2029	USD	13,645,000	12,922,241	0.28	
Southern Co. Gas Capital Corp. 3.9%	USD	188,000	143,321	0.00		US Treasury 4% 31/10/2029	USD	19,645,000	19,392,531	0.42	
01/10/2046						US Treasury 3.875% 30/11/2029	USD	22,250,000	21,818,906	0.47	
Southern Power Co. 5.15% 15/09/2041	USD	871,000	819,734	0.02		US Treasury 1.5% 15/02/2030	USD	27,330,000	23,573,193	0.51	
Tennessee Valley Authority 5.88%	USD	2,548,000	2,830,164	0.06		US Treasury 0.625% 15/08/2030	USD	2,715,000	2,187,696	0.05	
01/04/2036						US Treasury 1.625% 15/05/2031	USD	12,825,000	10,832,115	0.23	
Tennessee Valley Authority 4.625%	USD	433,000	408,689	0.01		US Treasury 1.25% 15/08/2031	USD	11,390,000	9,304,429	0.20	
15/09/2060						US Treasury 1.375% 15/11/2031	USD	11,322,000	9,273,426	0.20	
Tennessee Valley Authority 4.25%	USD	438,000	382,548	0.01		US Treasury 1.875% 15/02/2032	USD	35,900,000	30,350,926	0.66	
15/09/2065						US Treasury 2.875% 15/05/2032	USD	53,995,000	48,994,135	1.06	
Toledo Edison Co. (The) 6.15%	USD	600,000	636,899	0.01		US Treasury 2.75% 15/08/2032	USD	51,170,000	45,887,109	0.99	
15/05/2037						US Treasury 3.5% 15/02/2033	USD	21,880,000	20,665,062	0.45	
Tyson Foods, Inc. 5.7% 15/01/2034	USD	1,880,000	1,886,405	0.04		US Treasury 4.5% 15/11/2033	USD	86,940,000	88,488,243	1.91	
UDR, Inc., REIT 2.9% 01/09/2036	USD	276,000	262,111	0.01		US Treasury 4% 15/02/2034	USD	9,565,000	9,366,227	0.20	
UDR, Inc., REIT 3.5% 15/01/2028	USD	1,380,000	1,303,849	0.03		US Treasury 1.125% 15/05/2040	USD	11,045,000	6,912,833	0.15	
Unilever PLC 7.7% 01/10/2036	USD	650,000	802,896	0.02		US Treasury 3.875% 15/08/2040	USD	1,250,000	1,175,488	0.03	
UnitedHealth Group, Inc. 5.875%	USD	1,095,000	1,156,240	0.02		US Treasury 4.25% 15/11/2040	USD	6,500,000	6,388,789	0.14	
15/02/2033						US Treasury 4.75% 15/02/2041	USD	3,000,000	3,124,102	0.07	
UnitedHealth Group, Inc. 5.05%	USD	2,890,000	2,720,405	0.06		US Treasury 2.25% 15/05/2041	USD	14,800,000	10,882,625	0.24	
15/04/2033						US Treasury 3.75% 15/08/2041	USD	10,000,000	9,167,187	0.20	
US Treasury 2% 30/06/2024	USD	1,068,000	1,068,000	0.02		US Treasury 2.375% 15/02/2042	USD	30,660,000	22,677,022	0.49	
US Treasury 4.25% 31/12/2024	USD	10,000,000	9,945,944	0.22		US Treasury 3.25% 15/05/2042	USD	12,000,000	10,131,094	0.22	
US Treasury 2.125% 15/05/2025	USD	24,685,000	24,053,145	0.52		US Treasury 3.375% 15/08/2042	USD	12,000,000	10,288,125	0.22	
US Treasury 1.625% 15/02/2026	USD	639,100	607,632	0.01		US Treasury 2.75% 15/11/2042	USD	34,895,000	27,173,800	0.59	
US Treasury 0.5% 28/02/2026	USD	56,800,000	52,751,863	1.14		US Treasury 3.125% 15/02/2043	USD	31,010,000	25,500,880	0.55	
US Treasury 2.5% 28/02/2026	USD	1,565,000	1,508,146	0.03		US Treasury 3.625% 15/08/2043	USD	45,890,000	40,505,095	0.88	
US Treasury 0.75% 30/04/2026	USD	980,000	912,434	0.02		US Treasury 3.625% 15/02/2044	USD	9,348,000	8,223,684	0.18	
US Treasury 4.625% 15/09/2026	USD	1,720,000	1,720,067	0.04		US Treasury 3% 15/11/2044	USD	634,000	503,262	0.01	
US Treasury 1.75% 31/12/2026	USD	18,861,000	17,632,088	0.38		US Treasury 2.875% 15/08/2045	USD	495,000	382,378	0.01	
US Treasury 2.25% 15/02/2027	USD	1,460,000	1,379,016	0.03		US Treasury 2.25% 15/08/2046	USD	2,450,000	1,663,464	0.04	
US Treasury 0.5% 30/04/2027	USD	22,000,000	19,700,312	0.43		US Treasury 3% 15/02/2047	USD	488,000	380,526	0.01	
US Treasury 2.75% 31/07/2027	USD	86,658,000	82,465,580	1.78		US Treasury 3% 15/02/2048	USD	1,330,000	1,029,971	0.02	
US Treasury 3.125% 31/08/2027	USD	13,825,000	13,294,682	0.29		US Treasury 2.875% 15/05/2049	USD	22,296,000	16,775,998	0.36	
US Treasury 2.25% 15/11/2027	USD	40,000,000	37,306,250	0.81		US Treasury 2.25% 15/08/2049	USD	1,880,000	1,239,074	0.03	
US Treasury 3.875% 30/11/2027	USD	15,000,000	14,752,148	0.32		US Treasury 2.375% 15/11/2049	USD	19,005,000	12,870,691	0.28	
US Treasury 3.875% 31/12/2027	USD	30,000,000	29,503,711	0.64		US Treasury 2% 15/02/2050	USD	12,454,000	7,721,237	0.17	
US Treasury 1.75% 15/01/2028	USD	1,500,000	2,212,095	0.05		US Treasury 1.375% 15/08/2050	USD	2,615,000	1,368,278	0.03	
US Treasury 1.25% 31/03/2028	USD	20,065,000	17,920,553	0.39		US Treasury 1.625% 15/11/2050	USD	14,815,000	8,292,060	0.18	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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% 15/02/2051	USD	30,489,000	18,187,999	0.39		Macquarie Group Ltd., FRN, 144A	USD	4,000,000	3,952,541	0.09	
US Treasury 2.375% 15/05/2051	USD	8,480,000	5,699,984	0.12		5.00% 15/01/2030					
US Treasury 2% 15/08/2051	USD	9,200,000	5,643,445	0.12		Sentra Group Trust 1, REIT, 144A 3.5%	USD	1,700,000	1,676,998	0.04	
US Treasury 2.25% 15/02/2052	USD	51,870,000	33,735,762	0.73		12/02/2025					
US Treasury 2.875% 15/05/2052	USD	4,445,000	3,323,072	0.07		Sentra Group Trust 2, REIT, FRN, 144A	USD	1,951,000	1,885,561	0.04	
US Treasury 3% 15/08/2052	USD	24,065,000	18,457,514	0.40		4.75% 24/09/2080					
US Treasury 3.625% 15/02/2053	USD	10,000,000	8,673,047	0.19		Spirey Airport Finance Co. Pty. Ltd.,	USD	1,200,000	1,177,643	0.02	
Valero Energy Corp. 7.5% 15/04/2032	USD	251,000	285,140	0.01		144A 3.375% 30/06/2025					
Ventas Realty LP, REIT 4.125% 15/01/2026	USD	43,000	42,076	0.00					13,751,128	0.30	
Ventas Realty LP, REIT 3.25% 15/10/2026	USD	108,000	102,815	0.00		カナダ					
Verizon Communications, Inc. 2.1% 22/02/2028	USD	367,000	331,263	0.01		Air Canada Pass-Through Trust, 144A	USD	2,853,481	2,800,521	0.06	
Verizon Communications, Inc. 3.1% 22/03/2030	USD	2,915,000	2,640,831	0.06		4.12% 15/11/2026					
Verizon Communications, Inc. 5.0% 09/05/2033	USD	4,185,000	4,155,569	0.09		Air Canada Pass-Through Trust, 144A	USD	8,556,772	8,137,134	0.18	
Verizon Communications, Inc. 2.6% 20/11/2040	USD	2,481,000	1,731,139	0.04		3.6% 15/09/2028					
Virginia Electric and Power Co. 6% 15/05/2037	USD	200,000	208,605	0.00		Air Canada Pass-Through Trust, Series	USD	1,801,747	1,617,720	0.03	
Welltower OP LLC, REIT 2.7% 15/02/2027	USD	2,050,000	1,936,126	0.04		2017-1, 144A 3.5% 15/07/2031					
Welltower OP LLC, REIT 4.95% 01/09/2048	USD	1,372,000	1,263,985	0.03		Air Canada Pass-Through Trust, Series	USD	588,370	539,330	0.01	
Williams Cos., Inc. (The) 2.6% 15/03/2031	USD	1,140,000	969,232	0.02		2017-2, 144A 3.5% 15/07/2031					
W Care, Inc., REIT 4.2% 01/30/2026	USD	4,400,000	4,293,144	0.09		Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A	USD	1,190,000	912,544	0.02	
Xylem, Inc. 3.25% 01/11/2026	USD	166,000	158,979	0.00		3.43% 12/05/2041					
			1,419,801,135	30.71		Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A	USD	2,525,000	1,920,057	0.04	
債券合計			1,481,350,947	32.04		3.8% 25/01/2030					
証券取引所に上場を承認されている譲渡性						Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A	USD	1,325,000	973,420	0.02	
有価証券および短期金融市場商品合計			1,481,350,947	32.04		Bank of Nova Scotia (The) 4.8% 01/02/2030	USD	3,064,000	3,024,884	0.07	
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						Brookfield Finance, Inc. 3.9% 25/01/2028	USD	422,000	403,899	0.01	
債券						Brookfield Finance, Inc. 4.8% 29/03/2029	USD	1,089,000	1,073,717	0.02	
オーストラリア						Brookfield Finance, Inc. 4.7% 20/09/2047	USD	69,000	59,408	0.00	
APX Infrastructure Ltd., 144A 4.2% 15/01/2027	USD	895,000	873,535	0.02		CGI, Inc. 2.3% 14/09/2031	USD	3,025,000	2,426,838	0.05	
Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 144A 4.4% 19/05/2026	USD	2,130,000	2,087,149	0.04		Element Fleet Management Corp., 144A	USD	6,745,000	6,825,259	0.15	
GF Bond Issue Pty. Ltd., REIT, 144A 3.4% 30/09/2026	USD	826,000	791,283	0.02		6.27% 26/06/2026					
Macquarie Bank Ltd., FRN, 144A 3.05% 03/05/2036	USD	1,565,000	1,306,418	0.03		Element Fleet Management Corp., 144A	USD	2,000,000	2,074,966	0.04	
						6.31% 04/12/2028					
						Enbridge, Inc. 5.7% 08/03/2033	USD	2,120,000	2,151,775	0.05	
						Enbridge, Inc. 5.625% 05/04/2034	USD	2,605,000	2,621,296	0.06	
						Enbridge, Inc. 5.95% 05/04/2034	USD	2,140,000	2,154,489	0.05	
						Federation des Caisses Desjardins du	USD	1,900,000	1,927,800	0.04	
						Quebec, 144A 5.7% 14/02/2028					
						Fortis, Inc. 3.055% 04/10/2026	USD	1,126,000	1,069,593	0.02	
						National Bank of Canada 5.6% 18/12/2028	USD	3,490,000	3,537,790	0.08	

JPMorgan Funds – US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)	
Nutrien Ltd. 4% 15/12/2026	USD	850,000	824,451	0.02		フィンランド					
Nutrien Ltd. 4.125% 15/03/2035	USD	500,000	450,359	0.01		Nordea Bank Abp, 144A 5.375%	USD	3,587,000	3,613,261	0.08	
Nutrien Ltd. 5% 01/04/2049	USD	400,000	358,043	0.01		22/09/2027					
Ontario Teachers' Capital Fairview Properties Trust, 144A 1.875% 30/03/2027	USD	804,000	778,944	0.02					3,613,261	0.08	
TransCanada Pipelines Ltd. 4.75% 15/05/2038	USD	1,150,000	1,066,943	0.02		フランス					
			49,732,310	1.08		Banque Federative du Credit Mutuel SA, 144A 1.60% 04/10/2026	USD	2,845,000	2,821,524	0.06	
						Banque Federative du Credit Mutuel SA, 144A 5.75% 13/07/2038	USD	2,830,000	2,895,751	0.06	
ケイマン諸島						BNP Paribas SA, FRN, 144A 1.125%	USD	848,000	792,453	0.02	
Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 5.3% 15/01/2036	USD	13,086,000	12,995,995	0.28		13/01/2027	USD	2,500,000	2,504,811	0.05	
Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 2.125% 21/02/2026	USD	1,380,000	1,299,752	0.03		12/06/2029	USD	3,415,000	2,991,760	0.06	
Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 4.25% 15/04/2026	USD	1,830,000	1,779,839	0.04		BNP Paribas SA, FRN, 144A 2.159%	USD	1,870,000	1,856,613	0.04	
Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 4.375% 01/05/2026	USD	4,814,000	4,689,627	0.10		15/09/2029	USD	1,438,000	1,219,485	0.03	
Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 2.525% 18/11/2027	USD	13,361,000	12,047,054	0.26		BNP Paribas SA, FRN, 144A 3.125%	USD	2,650,000	2,738,075	0.06	
Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 5.75% 01/03/2029	USD	2,300,000	2,295,387	0.05		20/01/2032	USD	1,100,000	1,099,214	0.02	
Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 5.75% 15/11/2029	USD	1,295,000	1,291,183	0.03		BNP Paribas SA, FRN, 144A 5.894%	USD	1,734,000	1,641,924	0.04	
CR Hutchison International B Ltd., 144A 2.75% 03/10/2026	USD	1,050,000	996,386	0.02		05/12/2024	USD	3,000,000	3,120,758	0.07	
BBDO Funding Trust, Series 2017-M 'Q', 144A 4.485% 20/09/2047	USD	1,408,704	1,283,626	0.03		BPCE SA, 144A 4.625% 11/07/2024	USD	2,495,000	2,827,192	0.04	
Brow, Series 2017-M 'K', 144A 3.675% 30/09/2032	USD	696,388	638,448	0.01		BPCE SA, FRN, 144A 1.652%	USD	2,705,000	2,716,015	0.06	
			39,316,297	0.85		06/10/2026	USD	1,920,000	1,898,281	0.04	
						BPCE SA, FRN, 144A 5.975%	USD	6,207,000	5,794,244	0.12	
チリ						18/01/2027	USD	1,790,000	1,844,198	0.04	
Chile Government Bond 2.55% 27/01/2032	USD	1,272,000	1,072,484	0.03		BPCE SA, FRN, 144A 6.714%	USD	9,442,000	8,836,305	0.19	
Corp. Nacional del Cobre de Chile, 144A 6.4% 26/01/2036	USD	1,880,000	1,951,085	0.04		19/10/2029					
			3,024,340	0.07		20/01/2032					
デンマーク						BPCE SA, FRN, 144A 5.936%	USD	364,000	315,400	0.01	
Danske Bank A/S, FRN, 144A 4.238% 01/04/2028	USD	3,240,000	3,143,495	0.07		30/05/2035	USD	9,442,000	8,836,305	0.19	
Danske Bank A/S, FRN, 144A 5.705% 01/02/2029	USD	4,100,000	4,126,605	0.09		Credit Agricole SA, 144A 4.375%	USD	1,985,000	2,013,096	0.04	
			7,270,100	0.16		Credit Agricole SA, FRN, 144A 1.247%	USD	2,013,096	2,013,096	0.04	
						26/01/2027					
						Credit Agricole SA, FRN, 144A 6.385%	USD	315,400	315,400	0.01	
						07/10/2029					
						Electricite de France SA, 144A 5.95%	USD	8,836,305	8,836,305	0.19	
						22/04/2024					
						Societe Generale SA, 144A 3%	USD				
						22/01/2030					
						Societe Generale SA, FRN, 144A 1.685%	USD				
						14/12/2026					

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)
Societe Generale SA, FRN, 144A 1.75% 09/06/2027	USD	865,000	798,997	0.02	AIB Group plc, FRN, 144A 5.371% 28/03/2035	USD	2,000,000	2,000,822	0.04
Societe Generale SA, FRN, 144A 5.634% 23/01/2030	USD	4,000,000	3,959,426	0.09	Bank of Ireland Group plc, FRN, 144A 6.25% 16/09/2026	USD	4,618,000	4,641,547	0.10
Societe Generale SA, FRN, 144A 2.88% 09/06/2032	USD	2,085,000	1,712,201	0.04	Bank of Ireland Group plc, FRN, 144A 5.60% 20/03/2030	USD	5,000,000	4,990,920	0.11
Societe Generale SA, FRN, 144A 6.06% 19/01/2035	USD	1,865,000	1,860,220	0.04				22,883,244	0.49
TotalEnergies Capital International SA 2.98% 29/06/2041	USD	2,750,000	2,022,733	0.04	イスラエル				
TotalEnergies Capital International SA 3.46% 12/07/2049	USD	1,450,000	1,072,816	0.02	Israel Government Bond 5.5% 18/09/2033	USD	1,680,000	1,799,061	0.04
			68,466,798	1.48				1,799,061	0.04
ドイツ					イタリア				
Deutsche Bank AG 5.41% 10/09/2029	USD	2,235,000	2,240,107	0.05	UniCredito SpA, FRN, 144A 2.58% 22/09/2026	USD	2,800,000	2,688,603	0.06
Deutsche Bank AG, FRN 2.12% 24/11/2026	USD	1,940,000	1,842,948	0.04	UniCredito SpA, FRN, 144A 1.98% 03/04/2027	USD	510,000	476,195	0.01
Deutsche Bank AG, FRN 7.14% 13/07/2027	USD	2,865,000	2,938,417	0.07				3,164,798	0.07
Deutsche Bank AG, FRN 6.72% 18/01/2029	USD	1,050,000	1,086,780	0.02	日本				
Deutsche Bank AG, FRN 6.81% 20/11/2029	USD	1,880,000	1,961,539	0.04	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2.04% 17/07/2030	USD	3,120,000	2,620,123	0.06
Deutsche Telekom AG, 144A 3.62% 21/01/2030	USD	799,000	597,151	0.01	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3.75% 18/07/2030	USD	1,280,000	1,082,139	0.02
			10,666,942	0.23	Mizuho Financial Group, Inc., FRN 1.11% 12/05/2027	USD	2,291,000	2,120,665	0.05
香港					Mizuho Financial Group, Inc., FRN 5.17% 06/07/2029	USD	1,640,000	1,667,377	0.04
AIA Group Ltd., 144A 3.2% 16/09/2040	USD	1,475,000	1,091,980	0.02	Mizuho Financial Group, Inc., FRN 2.86% 11/09/2030	USD	1,872,000	1,662,080	0.04
			1,091,980	0.02	Mizuho Financial Group, Inc., FRN 5.19% 17/05/2031	USD	3,210,000	3,273,273	0.07
アイルランド					Nomura Holdings, Inc. 2.64% 16/01/2025	USD	2,072,000	2,036,968	0.04
AerCap Ireland Capital DAC 2.45% 29/10/2026	USD	790,000	737,982	0.01	Nomura Holdings, Inc. 6.07% 12/07/2028	USD	7,000,000	7,186,517	0.16
AerCap Ireland Capital DAC 6.1% 15/01/2027	USD	3,610,000	3,670,253	0.08	Nomura Holdings, Inc. 2.67% 16/07/2030	USD	1,640,000	1,482,265	0.03
AerCap Ireland Capital DAC 5.75% 06/06/2028	USD	2,800,000	2,838,136	0.06	ORIX Corp. 3.7% 18/07/2027	USD	500,000	479,763	0.01
AerCap Ireland Capital DAC 5.1% 19/01/2029	USD	765,000	760,002	0.02	Sumitomo Life Insurance Co., FRN, 144A 4% 14/03/2077	USD	1,000,000	945,427	0.02
AerCap Ireland Capital DAC 3.3% 30/01/2032	USD	920,000	795,254	0.02	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5.71% 14/09/2028	USD	4,605,000	4,711,306	0.10
AIB Group plc, FRN, 144A 7.58% 14/10/2026	USD	2,375,000	2,428,328	0.05	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 3.04% 16/07/2029	USD	2,290,000	2,073,680	0.04

JPMorgan Funds – US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)	
Suntou Mitsui Financial Group, Inc. 5.75% 11/01/2030	USD	3,105,000	3,179,736	0.07		AGF AMRO Bank NV, FOM, 144A 6.125% 18/09/2027	USD	2,000,000	2,029,036	0.04	
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.025% 09/07/2040	USD	3,175,000	2,331,057	0.05		AGF AMRO Bank NV, FOM, 144A 3.475% 13/12/2029	USD	2,200,000	1,943,004	0.04	
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.175% 09/07/2030	USD	1,490,000	1,004,921	0.02		Airbus SE, 144A 3.95% 10/04/2047	USD	210,000	173,092	0.00	
			<u>37,777,297</u>	<u>0.82</u>		Cooperatieve Rabobank UA, FOM, 144A 5.964% 28/02/2029	USD	6,500,000	6,548,487	0.14	
ジャージー						Cooperatieve Rabobank UA 4.375% 04/02/2025	USD	501,000	493,540	0.01	
Galaxy Pipeline Assets Sido Ltd., 144A 2.94% 30/09/2040	USD	2,197,872	1,765,591	0.04		Cooperatieve Rabobank UA 3.75% 21/07/2026	USD	1,257,000	1,211,832	0.03	
			<u>1,765,591</u>	<u>0.04</u>		Enel Finance International NV, 144A 3.5% 06/04/2028	USD	745,000	699,184	0.02	
ルクセンブルク						ING Groep NV 3.95% 29/03/2027	USD	650,000	628,869	0.01	
DH Europe Finance II SARL 3.25% 15/11/2039	USD	2,600,000	2,083,699	0.04		ING Groep NV, FOM 1.725% 01/04/2027	USD	695,000	650,839	0.01	
JBS USA Holding Lux Sarl, 144A 6.75% 15/03/2034	USD	3,400,000	3,622,952	0.08		ING Groep NV, FOM 6.114% 11/09/2034	USD	1,600,000	1,662,477	0.04	
JBS USA Holding Lux Sarl 3.75% 01/12/2031	USD	1,575,000	1,385,126	0.03		Simons Financieringsmaatschappij NV, 144A 4.4% 21/05/2045	USD	250,000	223,259	0.01	
enent Finance SARL 4.55% 15/04/2028	USD	900,000	878,262	0.02				<u>20,509,570</u>	<u>0.44</u>		
Swiss Re Finance Luxembourg SA, FOM, 144A 5% 02/04/2049	USD	400,000	386,211	0.01		ニューージーランド					
			<u>8,356,250</u>	<u>0.18</u>		ANZ New Zealand Int'l Ltd., 144A 5.355% 14/09/2028	USD	2,600,000	2,636,100	0.06	
メキシコ						ANZ New Zealand Int'l Ltd., 144A 2.55% 12/02/2030	USD	3,246,000	2,855,532	0.06	
Coca-Cola Femsa SAB de CV 2.75% 22/01/2030	USD	673,000	599,555	0.01				<u>5,491,632</u>	<u>0.12</u>		
Coca-Cola Femsa SAB de CV 1.85% 01/09/2032	USD	1,500,000	1,171,991	0.03		ノルウェー					
Mexico Government Bond 3.75% 11/01/2028	USD	2,317,000	2,197,388	0.05		Aker BP ASA, 144A 2% 15/07/2026	USD	701,000	652,995	0.01	
Mexico Government Bond 2.659% 24/05/2031	USD	2,763,000	2,287,626	0.05				<u>652,995</u>	<u>0.01</u>		
Mexico Government Bond 4.6% 10/02/2048	USD	1,282,000	989,643	0.02		パナマ					
Mexico Government Bond 4.4% 12/02/2052	USD	3,900,000	2,876,255	0.06		Banco Nacional de Panama, 144A 2.5% 11/09/2030	USD	3,050,000	2,357,003	0.05	
Mexico Government Bond 6.338% 04/05/2053	USD	389,000	370,729	0.01				<u>2,357,003</u>	<u>0.05</u>		
Mexico Government Bond 3.771% 24/05/2061	USD	1,811,000	1,128,977	0.02		ポーランド					
			<u>11,622,164</u>	<u>0.25</u>		Poland Government Bond 5.5% 18/03/2054	USD	1,902,000	1,859,062	0.04	
オランダ								<u>1,859,062</u>	<u>0.04</u>		
AGF AMRO Bank NV, FOM, 144A 6.575% 11/10/2026	USD	4,200,000	4,245,951	0.09		サウジアラビア					
						Saudi Arabian Oil Co., 144A 1.625% 24/11/2025	USD	691,000	656,048	0.01	
								<u>656,048</u>	<u>0.01</u>		

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)
シンガポール					HSBC Holdings plc, FRN 2.357%				
BOC Aviation Ltd., 144A 3.5%	USD	790,000	784,940	0.02	18/08/2031	USD	2,870,000	2,408,457	0.05
10/10/2024					HSBC Holdings plc, FRN 6.254%	USD	1,300,000	1,362,568	0.03
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.	USD	2,305,000	2,264,394	0.05	09/03/2034				
4.75% 15/06/2033			<u>3,049,334</u>	<u>0.07</u>	Lloyds Banking Group plc 4.375%	USD	633,000	614,539	0.01
					22/03/2028				
					Lloyds Banking Group plc, FRN 5.465%	USD	1,455,000	1,454,636	0.03
					05/01/2038				
スペイン					Lloyds Banking Group plc, FRN 5.675%				
Banco Santander SA 2.740%	USD	1,400,000	1,364,140	0.03	05/01/2035	USD	1,580,000	1,586,649	0.04
28/05/2025					LSEGA Financing plc, 144A 2%	USD	3,975,000	3,571,703	0.08
Banco Santander SA 5.580%	USD	6,000,000	6,069,748	0.13	06/04/2028				
08/06/2028					Wacoria Airfinance Holdings Ltd.,	USD	5,923,000	6,029,768	0.13
Banco Santander SA 6.607%	USD	2,800,000	2,950,522	0.06	144A 6.4% 26/01/2029				
07/11/2028					Wacoria Airfinance Holdings Ltd.,	USD	1,320,000	1,359,248	0.03
CaixaBank SA, FRN 144A 6.684%	USD	3,195,000	3,260,076	0.07	144A 6.5% 26/01/2031				
13/09/2027			<u>13,644,486</u>	<u>0.29</u>	Nationwide Building Society, FRN 144A	USD	1,910,000	1,951,585	0.04
					6.55% 18/03/2027				
					NetWest Group plc, FRN 7.472%	USD	2,510,000	2,567,156	0.06
国際機関					10/11/2026				
NXP BV 2.5% 11/05/2031	USD	2,975,000	2,510,869	0.06	NetWest Group plc, FRN 5.847%	USD	1,265,000	1,269,532	0.03
NXP BV 3.25% 11/05/2041	USD	3,060,000	2,261,651	0.05	02/03/2027				
NXP BV 3.25% 30/11/2051	USD	1,565,000	1,047,837	0.02	NetWest Markets plc, 144A 1.8%	USD	1,420,000	1,305,916	0.03
			<u>5,820,357</u>	<u>0.13</u>	29/09/2026				
					NetWest Markets plc, 144A 5.41%	USD	2,750,000	2,767,499	0.06
					17/05/2029				
					Royalty Pharma plc 1.2% 02/09/2025	USD	1,057,000	1,004,809	0.02
スウェーデン					Santander UK Group Holdings plc, FRN				
Svenska Handelsbanken AB 5.5%	USD	2,000,000	2,019,390	0.04	1.67% 14/06/2027	USD	1,485,000	1,374,653	0.03
15/06/2028			<u>2,019,390</u>	<u>0.04</u>	Santander UK Group Holdings plc, FRN	USD	4,200,000	4,327,692	0.09
					6.534% 10/01/2029				
					Standard Chartered plc, FRN 144A	USD	1,770,000	1,739,462	0.04
					2.819% 30/01/2026				
スイス					Standard Chartered plc, FRN 144A				
UBS Group AG, FRN 144A 2.193%	USD	1,070,000	1,035,043	0.02	1.456% 14/01/2027	USD	3,601,000	3,374,317	0.07
05/06/2026					Standard Chartered plc, FRN 144A	USD	2,895,000	2,926,560	0.06
UBS Group AG, FRN 144A 1.305%	USD	2,000,000	1,865,322	0.04	6.187% 06/01/2027				
02/02/2027					Standard Chartered plc, FRN 144A	USD	3,180,000	3,186,155	0.07
UBS Group AG, FRN 144A 5.617%	USD	5,280,000	5,321,734	0.12	5.682% 14/05/2028				
13/09/2030			<u>8,222,060</u>	<u>0.18</u>	Standard Chartered plc, FRN 144A	USD	6,265,000	6,260,723	0.14
					5.903% 14/05/2025				
					Vodafone Group plc 4.875%	USD	2,550,000	2,241,878	0.05
					19/06/2049				
					Vodafone Group plc 5.625%	USD	345,000	335,536	0.01
					10/02/2053				
							<u>62,311,213</u>	<u>1.35</u>	
イギリス									
AstraZeneca plc 6.4% 15/09/2037	USD	520,000	585,166	0.01					
Barclays plc, FRN 6.496% 11/09/2027	USD	1,045,000	1,063,780	0.02					
Barclays plc, FRN 2.894% 26/11/2032	USD	1,171,000	975,589	0.02					
HSBC Holdings plc 6.5% 15/09/2037	USD	3,140,000	3,250,021	0.07					
HSBC Holdings plc, FRN 2.206%	USD	1,605,000	1,415,626	0.03					
17/08/2029									

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)
アメリカ					American Boves 4 Rent Trust, Series				
7-Eleven, Inc. 144A 1.8% 10/02/2001	USD	1,230,000	991,843	0.02	2015-SFR2 'A', 144A 3.725% 17/10/2052	USD	1,337,414	1,305,603	0.03
7-Eleven, Inc. 144A 2.3% 10/02/2001	USD	1,258,000	832,461	0.02	American Boves 4 Rent Trust, Series				
AbbVie, Inc. 5.05% 15/03/2034	USD	3,005,000	3,019,215	0.07	2014-SFR3 'B', 144A 4.201% 17/12/2036	USD	750,000	743,219	0.02
AbbVie, Inc. 4.55% 15/03/2035	USD	500,000	478,398	0.01	American Boves 4 Rent Trust 'B', 144A 3.81% 17/04/2032	USD	3,000,000	2,948,048	0.06
AEP Transmission Co. LLC 4% 01/12/2046	USD	467,000	377,528	0.01	American Boves 4 Rent Trust, Series				
AEP Transmission Co. LLC 3.8% 15/06/2049	USD	615,000	461,613	0.01	2014-SFR3 'C', 144A 4.59% 17/12/2036	USD	500,000	495,787	0.01
AIG SmlAmerica Global Financing 1, 144A 6.9% 15/09/2032	USD	650,000	711,035	0.02	American Boves 4 Rent Trust, Series				
Alexander Funding Trust II, 144A 7.46% 11/01/2028	USD	5,120,000	5,426,621	0.12	2015-SFR2 'C', 144A 4.69% 17/10/2052	USD	1,893,000	1,859,002	0.04
Alexandria Real Estate Equities, Inc. REIT 1.87% 01/02/2033	USD	2,690,000	2,039,774	0.04	American Boves 4 Rent Trust, Series				
Alternative Loan Trust, Series 2005-94CB 'A11' 5.3% 25/11/2035	USD	90,198	68,460	0.00	2014-SFR3 'D', 144A 5.04% 17/12/2036	USD	523,000	519,188	0.01
Alternative Loan Trust, Series 2005-29CB 'A4' 5.5% 25/08/2035	USD	77,050	64,731	0.00	American Boves 4 Rent Trust, Series				
Alternative Loan Trust, Series 2004-2CB 'A9' 5.75% 25/01/2034	USD	212,374	211,068	0.00	2015-SFR1 'D', 144A 4.401% 17/04/2032	USD	7,618,000	7,513,909	0.16
Alternative Loan Trust, Series 2004-29CB 'A1' 6% 25/01/2035	USD	18,794	16,284	0.00	American Boves 4 Rent Trust, Series				
Alternative Loan Trust, IO, FPA, Series 2005-20CB 'A8' 6% 25/07/2035	USD	366,656	9,103	0.00	2015-SFR2 'D', 144A 5.03% 17/10/2032	USD	4,103,000	4,039,139	0.09
Amazon.com, Inc. 3.87% 22/09/2037	USD	1,000,000	892,333	0.02	American Boves 4 Rent Trust, Series				
American Airlines Pass-Through Trust 3.5% 22/03/2029	USD	5,563,632	5,285,729	0.11	2015-SFR2 'E', 144A 6.01% 17/10/2052	USD	2,800,000	2,788,712	0.06
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-1 3% 15/04/2030	USD	684,491	630,936	0.01	American Municipal Power, Inc. 7.49% 15/02/2050	USD	705,000	850,287	0.02
American Airlines Pass-Through Trust, Series A 3.7% 01/04/2028	USD	3,500,005	3,364,380	0.07	American Tower Corp., REIT 1.5% 31/01/2028	USD	2,820,000	2,480,443	0.05
American Airlines Pass-Through Trust, Series A 4.1% 15/01/2029	USD	994,228	934,575	0.02	American Tower Corp., REIT 2.1% 15/06/2030	USD	1,440,000	1,212,409	0.03
American Airlines Pass-Through Trust 3.5% 15/06/2033	USD	2,026,400	1,788,522	0.04	American Tower Corp., REIT 1.815% 15/10/2030	USD	2,740,000	2,241,972	0.05
American Airlines Pass-Through Trust, Series AA 3.2% 15/12/2029	USD	5,607,200	5,189,576	0.11	American Tower Corp., REIT 3.7% 15/10/2049	USD	1,995,000	1,475,316	0.03
American Electric Power Co., Inc. 2.3% 01/03/2030	USD	2,140,000	1,833,150	0.04	American Water Capital Corp. 3.45% 01/09/2030	USD	2,181,000	1,568,216	0.03
American Boves 4 Rent Trust, Series 2014-SFR3 'A', 144A 3.67% 17/12/2036	USD	11,934,802	11,812,028	0.26	Angen, Inc. 3.15% 21/02/2040	USD	625,000	472,920	0.01
American Boves 4 Rent Trust, Series 2015-SFR1 'A', 144A 3.461% 17/04/2032	USD	5,953,271	5,842,293	0.13	Angen, Inc. 5.6% 02/03/2043	USD	3,000,000	2,994,413	0.07
					Angen, Inc. 4.663% 15/06/2051	USD	2,350,000	2,038,511	0.04
					Angen, Inc. 5.65% 02/03/2053	USD	1,550,000	1,549,445	0.03
					Analog Devices, Inc. 2.8% 01/10/2041	USD	1,854,000	1,325,854	0.03
					AT&T, Inc. 5.4% 15/02/2034	USD	1,840,000	1,853,015	0.04

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)	
AT&T, Inc. 3.55% 15/09/2055	USD	1,332,000	912,689	0.02		Bank of America Corp., FNM 5.302%	USD	3,640,000	3,644,690	0.08	
AT&T, Inc. 3.8% 01/12/2057	USD	246,000	174,535	0.00		25/04/2029					
Athene Global Funding, 144A 2.5% 14/01/2025	USD	767,000	753,292	0.02		Bank of America Corp., FNM 2.081%	USD	1,091,000	970,798	0.02	
Athene Global Funding, 144A 1.45% 02/01/2026	USD	2,770,000	2,603,338	0.06		14/06/2029					
Athene Global Funding, 144A 2.95% 12/11/2026	USD	5,285,000	4,990,121	0.11		Bank of America Corp., FNM 5.819%	USD	5,800,000	5,937,748	0.13	
Atmos Energy Corp. 4.125% 15/03/2049	USD	780,000	624,399	0.01		15/09/2029					
AutoZone, Inc. 1.65% 15/01/2031	USD	1,740,000	1,404,286	0.03		Bank of America Corp., FNM 2.992%	USD	3,045,000	2,645,396	0.06	
Aviation Capital Corp LLC, 144A 5.5% 15/02/2034	USD	2,094,000	2,090,098	0.05		29/04/2031					
Baltimore Gas and Electric Co. 3.5% 15/08/2046	USD	385,000	282,493	0.01		Bank of America Corp., FNM 1.898%	USD	1,675,000	1,385,573	0.03	
Baltimore Gas and Electric Co. 3.2% 15/09/2049	USD	885,000	590,301	0.01		22/07/2031					
Baltimore Gas and Electric Co. 2.5% 15/06/2050	USD	1,000,000	640,652	0.01		Bank of America Corp., FNM 2.681%	USD	2,635,000	2,241,729	0.05	
Baltimore Gas and Electric Co. 5.4% 01/06/2053	USD	3,020,000	2,933,430	0.06		22/04/2032					
BAML Commercial Mortgage Securities Trust, FNM 'A', 144A 4.225% 10/08/2038	USD	5,275,000	4,893,723	0.11		Bank of America Corp., FNM 2.512%	USD	1,190,000	992,733	0.02	
BAML Commercial Mortgage Securities Trust 'B', 144A 3.4% 10/04/2033	USD	9,676,000	9,323,247	0.20		20/10/2032					
Bank of America Funding Trust, Series 2004-2 'A20' 5.15% 20/09/2004	USD	16,457	15,274	0.00		Bank of America Corp., FNM 5.388%	USD	4,000,000	3,984,901	0.09	
Bank of America Funding Trust, Series 2005-6 'A1' 5.9% 25/10/2005	USD	65,905	54,898	0.00		19/06/2041					
Bank of America Funding Trust, PO, Series 2004-2 '30' 6% 20/09/2004	USD	6,405	4,721	0.00		Bank of New York Mellon Corp. (The), FNM 6.474% 25/10/2004	USD	2,220,000	2,412,348	0.05	
Bank of America Funding Trust, PO, Series 2005-7 '30' 6% 25/11/2005	USD	7,783	8,043	0.00		BBUS Trust, Series 2002-30W 'A', 144A 3.43% 09/11/2006	USD	9,000,000	8,790,113	0.19	
Bank of America Corp., FNM 1.698% 11/02/2021	USD	2,510,000	2,355,447	0.05		Bear Stearns ABX Trust, FNM, Series 2004-2 '1A' 4.98% 25/03/2004	USD	15,794	14,395	0.00	
Bank of America Corp., FNM 1.734% 22/07/2021	USD	705,000	654,043	0.01		Bear Stearns ABX Trust, FNM, Series 2003-7 '3A' 7.04% 25/10/2003	USD	2,212	2,148	0.00	
Bank of America Corp., FNM 3.705% 24/04/2023	USD	3,600,000	3,455,509	0.08		Bear Stearns ABX Trust, FNM, Series 2003-4 '3A1' 7.04% 25/01/2003	USD	24,566	23,086	0.00	
Bank of America Corp., FNM 4.376% 27/04/2023	USD	2,700,000	2,640,130	0.06		Bear Stearns ABX Trust, FNM, Series 2006-1 'A1' 7.68% 25/02/2006	USD	27,447	25,300	0.00	
Bank of America Corp., FNM 3.419% 20/12/2023	USD	66,000	62,226	0.00		Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust, 10, FNM, Series 2007-08 '11', 144A 1.89% 12/01/2006	USD	31,806	3	0.00	
Bank of America Corp., FNM 2.91% 05/02/2029	USD	409,000	392,235	0.01		Bimbo Bakeries USA, Inc., 144A 6.05% 15/01/2029	USD	221,000	228,403	0.01	
						Bimbo Bakeries USA, Inc., 144A 5.17% 09/01/2026	USD	486,000	476,623	0.01	
						Boardwalk Pipelines LP 3.4% 15/02/2031	USD	1,610,000	1,420,837	0.03	
						Bin Secours Mercy Health, Inc. 3.20% 02/06/2050	USD	1,980,000	1,367,796	0.03	
						Boston Gas Co., 144A 4.487% 15/02/2042	USD	149,000	123,822	0.00	
						BP Capital Markets America, Inc. 2.11% 10/11/2050	USD	2,000,000	1,254,300	0.03	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)	
EP Capital Markets America, Inc. 2.93% 04/06/2051	USD	2,200,000	1,421,109	0.03		Charter Communications Operating LLC 3.3% 01/09/2041	USD	1,345,000	916,492	0.02	
Bristol-Myers Squibb Co. 4.12% 15/06/2039	USD	936,000	821,292	0.02		Charter Communications Operating LLC 4.8% 01/02/2050	USD	2,585,000	1,923,575	0.04	
Bristol-Myers Squibb Co. 4.55% 20/02/2048	USD	777,000	676,907	0.01		Charter Communications Operating LLC 3.7% 01/04/2051	USD	2,570,000	1,590,713	0.03	
British Airways Pass-Through Trust, 144A 3.9% 15/03/2033	USD	2,435,175	2,259,148	0.05		Charter Communications Operating LLC 6.80% 23/03/2055	USD	350,000	336,232	0.01	
British Airways Pass-Through Trust, Series 2013-1, 144A 4.12% 20/02/2033	USD	1,118,877	1,046,372	0.02		Chase Funding Trust, STEP, Series 2002-4 '1A5' 5.916% 25/05/2032	USD	77,327	74,460	0.00	
British Airways Pass-Through Trust, Series 2018-1, 144A 3.8% 20/02/2033	USD	479,559	453,588	0.01		Chase Funding Trust, STEP, Series 2002-6 '1A1' 5.271% 25/11/2034	USD	46,507	45,121	0.00	
British Airways Pass-Through Trust, Series 2019-1, 144A 3.3% 15/06/2034	USD	982,093	880,535	0.02		Chase Mortgage Finance Trust, FNM, Series 2001-A1 '1A3' 6.181% 25/02/2037	USD	102,077	99,132	0.00	
Brimer Operating Partnership LP, REIT 2.5% 16/09/2031	USD	765,000	634,168	0.01		Chase Mortgage Finance Trust, FNM, Series 2001-A1 '2A1' 6.620% 25/02/2037	USD	10,158	9,474	0.00	
Broadcom, Inc., 144A 2.45% 15/02/2031	USD	4,373,000	3,705,934	0.08		Chase Mortgage Finance Trust, FNM, Series 2001-A2 '2A1' 5.782% 25/06/2035	USD	44,730	43,481	0.00	
Broadcom, Inc., 144A 3.137% 15/11/2035	USD	3,709,000	3,000,275	0.07		Chase Mortgage Finance Trust, FNM, Series 2001-A1 '1A1' 7.161% 25/02/2037	USD	2,798	2,834	0.00	
Broadcom, Inc., 144A 3.187% 15/11/2036	USD	77,000	61,556	0.00		Chase Mortgage Finance Trust, FNM, Series 2001-A1 '2A1' 6.214% 25/02/2037	USD	9,121	8,701	0.00	
Brooklyn Union Gas Co. (The), 144A 3.86% 04/03/2029	USD	785,000	736,788	0.02		Cheniere Energy, Inc., 144A 5.65% 15/04/2034	USD	1,430,000	1,434,373	0.03	
Brooklyn Union Gas Co. (The), 144A 4.21% 15/03/2048	USD	760,000	583,535	0.01		Children's Health System of Texas 2.51% 15/08/2050	USD	2,430,000	1,519,495	0.03	
Brown & Brown, Inc. 2.37% 15/03/2031	USD	4,620,000	3,834,120	0.08		Children's Hospital Corp. (The) 3.88% 01/02/2050	USD	1,387,000	880,914	0.02	
Bunge Ltd. Finance Corp. 2.75% 14/05/2031	USD	3,310,000	2,850,633	0.06		Children's National Medical Center 2.92% 15/07/2050	USD	1,580,000	1,037,224	0.02	
Burlington Northern Santa Fe LLC 3.55% 15/02/2050	USD	1,397,000	1,043,420	0.02		COL Mortgage Pass-Through Trust 4.5% 25/06/2049	USD	2,072	1,038	0.00	
BP Trust, Series 2017-GM 'A', 144A 3.37% 13/06/2039	USD	14,000,000	13,029,463	0.28		COL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-5 '1A' 5.5% 25/06/2034	USD	54,205	53,125	0.00	
Cameron LNG LLC, 144A 3.302% 15/01/2035	USD	2,200,000	1,826,885	0.04		COL Mortgage Pass-Through Trust, FNM, Series 2004-7 '2A1' 5.98% 25/06/2034	USD	13,132	11,916	0.00	
Campbell Soup Co. 2.37% 24/04/2030	USD	955,000	825,647	0.02		COL Mortgage Pass-Through Trust, FNM, Series 2005-22 '2A1' 4.88% 25/11/2036	USD	101,008	80,161	0.00	
Capital One Financial Corp., FNM 6.32% 03/06/2029	USD	2,480,000	2,544,868	0.06		COL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-3 '1A3' 5.5% 25/04/2034	USD	81,421	77,598	0.00	
Capital One Financial Corp., FNM 2.61% 02/11/2032	USD	1,365,000	1,117,538	0.02							
Charter Communications Operating LLC 6.30% 23/10/2035	USD	275,000	270,319	0.01							
Charter Communications Operating LLC 5.37% 01/04/2038	USD	400,000	351,250	0.01							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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 Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-3 'M' 5.75% 25/04/2004	USD	40,710	38,683	0.00		Colonia Pipelines Operating Co. LLC, 144A 5.925% 15/09/2000	USD	1,570,000	1,610,759	0.04	
Cigna Group (The) 4.25% 15/01/2046	USD	156,000	139,486	0.00		Comcast Cable Communications LLC 8.5% 01/05/2027	USD	394,000	438,493	0.01	
Cincinnati Financial Corp. 6.925% 15/05/2028	USD	290,000	308,338	0.01		Comcast Corp. 4.25% 15/01/2033	USD	2,133,000	2,009,631	0.04	
Cincinnati Financial Corp. 6.125% 01/11/2024	USD	1,000,000	1,049,138	0.02		Comcast Corp. 5.25% 01/06/2034	USD	2,500,000	2,534,117	0.05	
Citibank NA 5.575% 30/04/2034	USD	2,090,000	2,136,592	0.05		Comcast Corp. 4.25% 15/08/2034	USD	676,000	624,567	0.01	
Citicorp Mortgage Securities Trust, Series 2006-4 'M2' 6% 25/08/2036	USD	36,297	31,930	0.00		Comcast Corp. 3.25% 15/07/2036	USD	850,000	694,202	0.02	
Citicorp Mortgage Securities Trust 'M3' 5% 25/04/2040	USD	2,591	2,410	0.00		Comcast Corp. 3.95% 01/03/2038	USD	2,000,000	1,713,669	0.04	
Citicorp Mortgage Securities, Inc., Series 2004-3 'M5' 5.25% 25/05/2034	USD	128,302	121,678	0.00		Comcast Corp. 3.25% 01/11/2039	USD	1,260,000	980,439	0.02	
Citigroup Global Markets Mortgage Securities VII, Inc., F0, Series 2003-002 'I' 6% 25/06/2033	USD	51	49	0.00		Comcast Corp. 3.75% 01/04/2040	USD	2,155,000	1,774,252	0.04	
Citigroup Global Markets Mortgage Securities VII, Inc., F0N, Series 2003-002 'K' 6.25% 25/09/2033	USD	11,726	11,573	0.00		Comcast Corp. 2.875% 01/11/2051	USD	1,439,000	913,661	0.02	
Citigroup Mortgage Loan Trust, F0N, Series 2004-031 'M3' 6.05% 25/08/2034	USD	7,423	7,075	0.00		Comcast Corp. 5.25% 15/05/2053	USD	4,355,000	4,241,676	0.09	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2005-2 'M11' 5.5% 25/05/2035	USD	40,110	38,787	0.00		COMM Mortgage Trust, F0N, Series 2018-006 'A', 144A 3.942% 10/04/2033	USD	13,940,000	12,650,001	0.27	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2005-1 'M5' 5.25% 25/10/2033	USD	3,615	3,342	0.00		COMM Mortgage Trust, Series 2015-0225 'M' 3.75% 10/08/2048	USD	1,250,000	1,220,948	0.03	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2005-1 'M4' 5.25% 25/09/2033	USD	12,129	11,368	0.00		CommonSpirit Health 1.547% 01/10/2025	USD	1,385,000	1,316,750	0.03	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2005-0P3 'M3' 5% 25/09/2033	USD	324	320	0.00		CommonSpirit Health 2.782% 01/10/2030	USD	1,385,000	1,206,206	0.03	
Citigroup, Inc., F0N 3.887% 10/01/2028	USD	4,700,000	4,544,591	0.10		CommonSpirit Health 3.91% 01/10/2050	USD	1,365,000	1,055,882	0.02	
Citigroup, Inc., F0N 3.668% 24/07/2028	USD	4,305,000	4,112,986	0.09		Commonwealth Edison Co. 5.875% 01/02/2033	USD	1,000,000	1,031,360	0.02	
Citigroup, Inc., F0N 3.52% 27/10/2028	USD	750,000	710,421	0.02		Conagra Brands, Inc. 5.1% 01/11/2038	USD	330,000	313,742	0.01	
Citigroup, Inc., F0N 4.075% 23/04/2029	USD	2,226,000	2,140,348	0.05		ConocoPhillips Co. 5.2% 15/05/2053	USD	1,470,000	1,419,508	0.03	
Citigroup, Inc., F0N 2.52% 09/11/2032	USD	1,740,000	1,439,766	0.03		Constellation Brands, Inc. 3.6% 15/02/2038	USD	1,500,000	1,427,169	0.03	
Citigroup, Inc., F0N 3.057% 25/01/2033	USD	569,000	486,063	0.01		Constellation Brands, Inc. 5.25% 15/11/2048	USD	260,000	245,691	0.01	
Citigroup, Inc., F0N 3.875% 24/01/2039	USD	300,000	169,255	0.00		Constellation Energy Generation LLC 3.25% 01/06/2025	USD	1,230,000	1,202,730	0.03	
City of Los Angeles Department of Airports 6.982% 15/05/2029	USD	250,000	271,317	0.01		Constellation Energy Generation LLC 5.8% 01/03/2033	USD	2,417,000	2,484,636	0.05	
Cleveland Electric Illuminating Co. (The), 144A 3.5% 01/04/2028	USD	857,000	804,740	0.02		Constellation Energy Generation LLC 6.25% 01/10/2039	USD	1,000,000	1,044,088	0.02	
CNO Global Funding, 144A 5.875% 04/06/2027	USD	2,030,000	2,041,891	0.04		Constellation Energy Generation LLC 5.75% 01/10/2041	USD	5,786,000	5,752,829	0.12	
						Constellation Energy Generation LLC 6.5% 01/10/2053	USD	334,000	359,625	0.01	
						Consumers Energy Co. 3.25% 15/08/2046	USD	190,000	140,183	0.00	
						Continental Airlines Pass-Through Trust, Series 2-A 4% 29/04/2026	USD	7,735,154	7,701,816	0.17	

JPMorgan Funds – US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表（続き）

2024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(%)
Corbridge Financial, Inc. 2.85% 05/04/2023	USD	985,000	926,918	0.02	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, PO, Series 2005-10 'A2' 05/25/2025	USD	14,597	9,656	0.00
Corbridge Global Funding, HMA 5.5% 01/09/2028	USD	2,170,000	2,225,234	0.05	CSMC 0A LLC 'A2', 144A 3.95% 15/09/2037	USD	13,925,000	12,410,996	0.27
Cottage Health Obligated Group 3.304% 01/11/2049	USD	1,220,000	889,719	0.02	CSMC 0A LLC, Series 2014-USA '0', 144A 4.375% 15/09/2037	USD	6,000,000	4,581,625	0.10
Cox Communications, Inc., HMA 3.35% 15/05/2026	USD	503,000	481,494	0.01	CSX Corp. 6% 01/10/2036	USD	500,000	533,341	0.01
Cox Communications, Inc., 144A 3.5% 15/08/2027	USD	162,000	153,562	0.00	CSX Corp. 4.3% 15/08/2044	USD	165,000	137,710	0.00
Cox Communications, Inc., HMA 2.95% 01/10/2030	USD	1,485,000	898,557	0.02	CSX Corp. 4.75% 15/11/2048	USD	910,000	825,137	0.02
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 5% 25/09/2042	USD	6,563	4,087	0.00	CSX Corp. 3.95% 15/09/2049	USD	230,000	165,586	0.00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., Series 2003-31 '1A' 5.25% 25/09/2033	USD	31,259	29,708	0.00	CS Pass-Through Trust, 144A 5.25% 11/01/2027	USD	61,450	60,879	0.00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., PO, Series 2003-21 'A2' 05/25/09/2033	USD	8,404	5,718	0.00	CS Pass-Through Trust, 144A 7.50% 10/01/2032	USD	784,226	818,393	0.02
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., PO, Series 2004-3 'A2' 05/25/09/2034	USD	10,983	6,854	0.00	CS Pass-Through Trust, 144A 5.775% 10/01/2033	USD	433,690	427,231	0.01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., 2005-1 'A2' 05/25/09/2035	USD	19,268	18,869	0.00	CS Pass-Through Trust, 144A 5.925% 10/01/2034	USD	445,530	441,507	0.01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., 2005-1 'A2' 05/25/09/2035	USD	19,268	18,869	0.00	CS Pass-Through Trust, Series 2005, 144A 8.35% 10/01/2031	USD	208,573	219,127	0.01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., 2005-1 'A2' 05/25/09/2035	USD	19,268	18,869	0.00	CS Pass-Through Trust, Series 2014, 144A 4.15% 11/09/2036	USD	331,170	312,134	0.01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., 2005-1 'A2' 05/25/09/2035	USD	19,268	18,869	0.00	Danaher Corp. 2.6% 01/10/2050	USD	932,000	577,248	0.01
CRI America Finance, Inc., 144A 3.4% 09/05/2027	USD	298,000	285,121	0.01	Dell International LLC 6.02% 15/06/2026	USD	1,388,000	1,404,190	0.03
CRI America, Inc., 144A 3.875% 12/05/2025	USD	1,700,000	1,671,678	0.04	Delmarva Power & Light Co. 4% 01/06/2042	USD	141,000	112,819	0.00
CRI America, Inc., 144A 5.125% 12/05/2045	USD	200,000	184,862	0.00	Delmarva Power & Light Co. 4.15% 15/05/2045	USD	1,000,000	812,276	0.02
Crown Castle Towers LLC, 144A 3.66% 15/05/2045	USD	900,000	879,806	0.02	Delta Air Lines Pass-Through Trust, Series AA 2% 10/12/2029	USD	982,985	897,475	0.02
Crown Castle, Inc., REIT 5.6% 01/06/2029	USD	1,785,000	1,786,355	0.04	Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust, ST2, Series 2004-1 'A6' 5.34% 25/12/2033	USD	369	367	0.00
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-8 '1A' 5.5% 25/12/2034	USD	86,646	64,315	0.00	Doc Dr LLC, REIT 2.615% 01/11/2031	USD	1,050,000	876,274	0.02
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-4 '2A' 5.5% 25/09/2034	USD	39,031	36,927	0.00	DTB Electric Co. 3.7% 15/01/2045	USD	308,000	242,606	0.01
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, PO, Series 2003-27 'A2' 05/25/11/2033	USD	7,639	5,496	0.00	DTB Electric Securitization Funding II LLC 5.9% 01/01/2033	USD	5,055,000	5,225,838	0.11
					DTB Electric Securitization Funding II LLC 6.9% 01/01/2038	USD	2,150,000	2,335,417	0.05
					Duke Energy Carolinas LLC 5.4% 15/01/2034	USD	1,135,000	1,102,440	0.02
					Duke Energy Corp. 6.1% 15/09/2052	USD	3,190,000	3,286,003	0.07
					Duke Energy Corp. 5.2% 15/06/2054	USD	2,150,000	2,120,354	0.05

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)	
Duke Energy Ohio, Inc. 3.7% 15/06/2046	USD	265,000	198,730	0.00		F&G Global Funding, 144A 1.75% 20/06/2026	USD	1,575,000	1,450,341	0.03	
Duke Energy Progress LLC 3.7% 15/10/2046	USD	431,000	326,217	0.01		F&G Global Funding, 144A 5.875% 10/06/2027	USD	2,300,000	2,293,556	0.05	
DuPont de Nemours, Inc. 5.319% 15/11/2038	USD	505,000	525,770	0.01		Falls Point Funding Trust, 144A 3.04% 10/01/2027	USD	6,870,000	6,482,899	0.14	
Duquesne Light Holdings, Inc., 144A 3.61% 01/08/2027	USD	1,350,000	1,273,153	0.03		FHLBNC 4% 01/07/2048	USD	3,666,195	3,440,913	0.07	
Duquesne Light Holdings, Inc., 144A 2.53% 01/10/2030	USD	2,320,000	1,959,968	0.04		FHLBNC, IO, Series 233 '11' 5% 15/09/2035	USD	22,081	3,903	0.00	
Eastern Gas Transmission & Storage, Inc. 4.6% 15/12/2044	USD	900,000	771,727	0.02		FHLBNC, IO, Series 233 '13' 5% 15/09/2035	USD	56,421	8,981	0.00	
Eastern Gas Transmission & Storage, Inc. 3.5% 15/11/2049	USD	1,119,000	804,872	0.02		FHLBNC, Series T-54 '2A' 6.5% 25/02/2043	USD	13,590	13,742	0.00	
Emera US Finance LP 4.75% 15/06/2046	USD	1,200,000	1,002,008	0.02		FHLBNC, FRN, Series T-16 '2A' 2.1% 25/10/2037	USD	217,955	196,628	0.00	
Energy Transfer LP 5.25% 01/01/2029	USD	2,900,000	2,889,448	0.06		FHLBNC, Series 262 '35' 3.5% 15/01/2042	USD	1,111,355	1,029,556	0.02	
Energy Transfer LP 4.15% 15/09/2029	USD	1,068,000	1,015,329	0.02		FHLBNC, FRN, Series T-41 '2A' 4.1% 25/07/2032	USD	8,369	7,834	0.00	
Entergy Louisiana LLC 3.25% 01/04/2028	USD	188,000	176,524	0.00		FHLBNC, Series T-54 '3A' 7% 25/02/2043	USD	17,244	17,969	0.00	
Entergy Mississippi LLC 3.85% 01/06/2049	USD	1,640,000	1,231,477	0.03		FHLBNC, Series 1065 'A2' 3.24% 25/07/2050	USD	2,983,000	2,853,875	0.06	
Enterprise Products Operating LLC 3.2% 15/02/2052	USD	3,000,000	2,030,324	0.04		FHLBNC, Series 1038 'A2' 3.8% 25/02/2052	USD	1,156,000	1,106,436	0.02	
Equinix, Inc., REIT 1.4% 15/06/2036	USD	2,120,000	1,970,906	0.04		FHLBNC, FRN 'A2' 3.71% 25/09/2032	USD	7,960,000	7,411,519	0.16	
Equinix, Inc., REIT 2.9% 15/11/2036	USD	2,850,000	2,695,846	0.06		FHLBNC, FRN 'A2' 3.2% 25/10/2032	USD	9,600,000	8,990,719	0.19	
ERAC USA Finance LLC, 144A 7% 15/10/2037	USD	510,000	582,678	0.01		FHLBNC, Series X152 'A2' 3.88% 25/01/2031	USD	3,761,000	3,423,318	0.07	
ERAC USA Finance LLC, 144A 5.625% 15/02/2042	USD	96,000	97,601	0.00		FHLBNC, Series KJ36 'A2' 2.69% 25/07/2027	USD	7,541,669	7,224,195	0.16	
Eversky Metro, Inc. 4.2% 15/02/2048	USD	670,000	538,254	0.01		FHLBNC, Series T-42 'A5' 7.5% 25/02/2042	USD	167,487	168,135	0.00	
Eversky, Inc. 2.9% 15/09/2029	USD	1,775,000	1,592,278	0.03		FHLBNC, Series T-56 'A5' 5.22% 25/05/2043	USD	499,547	481,382	0.01	
Exelon Corp. 5.3% 15/03/2033	USD	1,500,000	1,501,045	0.03		FHLBNC, FRN, Series 1921 'A1' 3.13% 25/04/2028	USD	2,228,000	2,095,215	0.05	
Extra Space Storage LP, REIT 4% 15/06/2029	USD	1,373,000	1,293,999	0.03		FHLBNC, FRN, Series 284 'F1' 5.98% 15/07/2042	USD	704,754	696,160	0.02	
Extra Space Storage LP, REIT 2.2% 15/10/2030	USD	2,940,000	2,453,400	0.05		FHLBNC, FRN, Series 270 'F1' 5.94% 15/08/2042	USD	207,944	204,866	0.00	
Extra Space Storage LP, REIT 5.9% 15/01/2031	USD	2,320,000	2,383,683	0.05		FHLBNC, IO, FRN, Series 1302 'H1' 1.30% 15/08/2036	USD	164,760	13,297	0.00	
Exxon Mobil Corp. 2.99% 16/08/2039	USD	1,615,000	1,242,999	0.03		FHLBNC 'XT' 1.5% 25/06/2050	USD	5,065,797	3,387,007	0.08	
Exxon Mobil Corp. 3.09% 16/08/2049	USD	2,010,000	1,386,357	0.03		FHLBNC 'NE' 1.5% 25/10/2051	USD	3,158,376	2,564,681	0.06	
F&G Annuities & Life, Inc. 7.4% 13/01/2023	USD	1,198,000	1,241,523	0.03							
F&G Annuities & Life, Inc. 8.5% 04/06/2029	USD	305,000	304,692	0.01							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)	
FHLMC, IO, FRN, Series 239 '330' 2.35% 15/08/2036	USD	101,943	11,999	0.00		FHLMC, FRN B48699 6.42% 01/07/2040	USD	30,826	31,811	0.00	
FHLMC, Series 2945 'ZB' 5.5% 15/02/2035	USD	802,544	811,061	0.02		FHLMC, FRN 972300 6.27% 01/01/2036	USD	6,844	6,865	0.00	
FHLMC, Series 2779 '2C' 6% 15/04/2034	USD	1,355,771	1,393,770	0.03		FHLMC A61376 6.5% 01/07/2032	USD	45,829	46,784	0.00	
FHLMC, FRN 1A1082 7.588% 01/07/2036	USD	13,683	13,980	0.00		FHLMC A88871 7% 01/01/2031	USD	30,971	31,897	0.00	
FHLMC, FRN 1A1085 7.441% 01/08/2036	USD	22,674	23,164	0.00		FHLMC B00491 7.5% 01/01/2032	USD	30,205	30,603	0.00	
FHLMC, FRN 1A1096 7.408% 01/10/2036	USD	35,941	36,631	0.00		FHLMC C75791 5.5% 01/01/2033	USD	11,062	11,137	0.00	
FHLMC, FRN 1A1097 7.481% 01/10/2036	USD	33,217	33,352	0.00		FHLMC C90985 6.5% 01/08/2026	USD	3,839	3,845	0.00	
FHLMC, FRN 1B1665 6.782% 01/04/2034	USD	5,248	5,240	0.00		FHLMC G01448 7% 01/08/2032	USD	3,451	3,555	0.00	
FHLMC, FRN 1G2557 7.258% 01/06/2036	USD	58,301	60,083	0.00		FHLMC G02436 6.5% 01/09/2036	USD	47,984	49,524	0.00	
FHLMC, FRN 1J1399 6.375% 01/12/2036	USD	3,393	3,418	0.00		FHLMC G04077 6.5% 01/03/2038	USD	35,995	37,626	0.00	
FHLMC, FRN 1J1418 5.9% 01/12/2036	USD	16,734	16,806	0.00		FHLMC G06024 7.5% 01/01/2038	USD	22,146	22,824	0.00	
FHLMC, FRN 1J1516 6.875% 01/02/2037	USD	17,599	18,054	0.00		FHLMC G05671 5.5% 01/08/2038	USD	60,937	61,459	0.00	
FHLMC, FRN 1J2945 6% 01/11/2037	USD	8,936	8,964	0.00		FHLMC G06493 4.5% 01/05/2041	USD	800,763	783,116	0.02	
FHLMC, FRN 1K0046 6.48% 01/10/2036	USD	31,905	31,973	0.00		FHLMC G31099 4% 01/01/2038	USD	2,574,046	2,478,561	0.05	
FHLMC, FRN 1L0286 7.125% 01/09/2036	USD	18,276	18,598	0.00		FHLMC G60214 5% 01/07/2035	USD	3,077,234	3,053,751	0.07	
FHLMC, FRN 1N0353 7.787% 01/02/2037	USD	28,322	28,643	0.00		FHLMC L10224 6% 01/12/2034	USD	95,497	95,623	0.00	
FHLMC, FRN 1N1463 6.9% 01/09/2037	USD	5,204	5,143	0.00		FHLMC Q42657 3.5% 01/08/2046	USD	1,833,326	1,671,840	0.04	
FHLMC, FRN 1Q0007 8.015% 01/12/2035	USD	4,411	4,403	0.00		FHLMC Q49329 4.5% 01/07/2047	USD	370,715	358,871	0.01	
FHLMC, FRN 1Q0739 7.493% 01/03/2037	USD	40,406	41,063	0.00		FHLMC Q62834 4% 01/12/2047	USD	1,869,470	1,749,318	0.04	
FHLMC, FRN 782760 6.294% 01/11/2036	USD	18,321	18,889	0.00		FHLMC RE0011 2.5% 01/12/2049	USD	3,762,947	3,319,970	0.07	
FHLMC, FRN 782870 6.556% 01/09/2034	USD	56,626	57,658	0.00		FHLMC U63546 5% 01/11/2043	USD	39,880	39,280	0.00	
FHLMC, FRN 782979 6.375% 01/01/2035	USD	100,297	102,869	0.00		FHLMC U69030 4.5% 01/01/2046	USD	1,599,906	1,559,133	0.03	
FHLMC, FRN 782980 6.375% 01/01/2035	USD	46,411	46,994	0.00		FHLMC U90673 4% 01/01/2043	USD	291,638	275,833	0.01	
FHLMC, FRN 847621 6.609% 01/05/2033	USD	20,604	20,873	0.00		FHLMC U90690 3.5% 01/06/2042	USD	746,560	681,496	0.02	
FHLMC, FRN 848365 6.383% 01/07/2036	USD	92,212	93,883	0.00		FHLMC U90975 4% 01/06/2042	USD	695,311	657,782	0.01	
FHLMC, FRN 848431 6.358% 01/02/2036	USD	48,001	48,794	0.00		FHLMC U91253 4% 01/04/2043	USD	1,891,549	1,789,400	0.04	
						FHLMC U91305 3.5% 01/04/2043	USD	375,627	346,585	0.01	
						FHLMC U91484 4% 01/05/2043	USD	1,979,370	1,872,474	0.04	
						FHLMC U93007 3.5% 01/07/2045	USD	599,169	552,862	0.01	
						FHLMC U93024 3.5% 01/08/2045	USD	404,845	373,565	0.01	
						FHLMC U93089 3.5% 01/12/2035	USD	358,559	335,884	0.01	
						FHLMC U93090 3.5% 01/11/2045	USD	454,619	419,484	0.01	
						FHLMC U93143 3.5% 01/04/2046	USD	502,801	463,922	0.01	
						FHLMC U93154 3.5% 01/05/2046	USD	48,053	44,337	0.00	
						FHLMC U99051 3.5% 01/06/2043	USD	907,996	837,816	0.02	
						FHLMC U99134 4% 01/01/2046	USD	975,067	922,415	0.02	
						FHLMC Y85515 4% 01/03/2049	USD	290,502	271,227	0.01	
						FHLMC Z40024 5.5% 01/04/2036	USD	20,404	20,579	0.00	
						FHLMC REMICS (Interd), Series 343 'M' 6.2% 15/01/2038	USD	132,285	1,259	0.00	
						FHLMC REMICS, PO, Series 3807 'AO' 6% 15/04/2036	USD	17,962	14,960	0.00	
						FHLMC REMICS, Series 3811 'AZ' 6.3% 15/07/2036	USD	101,144	104,591	0.00	
						FHLMC REMICS, Series 3453 'B' 5.5% 15/09/2038	USD	8,892	8,911	0.00	

JPMorgan Funds – US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)						
FPMG BONDICS, Series 2951 'B' 4%	USD	43,826	41,972	0.00		FPMG BONDICS, Series 2483 'W' 4.5%	USD	247,672	242,602	0.01	
15/11/2041						15/09/2032					
FPMG BONDICS, Series 2694 'B4' 4%	USD	501	497	0.00		FPMG BONDICS, IO, Series 374 'B' 5%	USD	44,281	2,499	0.00	
15/06/2031						15/09/2040					
FPMG BONDICS, Series 3043 'B3' 5.5%	USD	69,391	71,007	0.00		FPMG BONDICS, PO, Series 3336 'J0' 0%	USD	5,714	4,564	0.00	
15/02/2036						15/04/2037					
FPMG BONDICS, PO, Series 3607 'B0' 0%	USD	13,472	11,463	0.00		FPMG BONDICS, PO, Series 3393 'J0' 0%	USD	191,403	166,443	0.00	
15/04/2036						15/09/2032					
FPMG BONDICS, PO, Series 3621 'B0' 0%	USD	33,008	27,921	0.00		FPMG BONDICS, PO, Series 3388 'L0' 0%	USD	31,375	26,510	0.00	
15/01/2040						0% 15/03/2037					
FPMG BONDICS, FBN, Series 3632 'B5' 0%	USD	73,435	69,633	0.00		FPMG BONDICS, IO, FBN, Series 3802 'L5' 0.154%	USD	120,704	7,912	0.00	
15/02/2040						15/01/2040					
FPMG BONDICS, Series 3001 'B3' 5.5%	USD	103,266	105,175	0.00		FPMG BONDICS, Series 2484 'L2' 6.5%	USD	6,683	6,891	0.00	
15/01/2039						15/07/2032					
FPMG BONDICS, IO, FBN, Series 3390 'C5' 0.692%	USD	16,118	1,301	0.00		FPMG BONDICS, Series 2461 'L2' 6%	USD	14,971	15,264	0.00	
15/01/2037						15/06/2038					
FPMG BONDICS, Series 3084 'C3' 4.5%	USD	22,832	22,700	0.00		FPMG BONDICS, Series 2575 'M5' 6%	USD	18,208	18,643	0.00	
15/06/2025						15/02/2033					
FPMG BONDICS, Series 2928 'D' 4%	USD	2,112,489	1,900,546	0.04		FPMG BONDICS, PO, Series 3152 'N0' 0%	USD	78,921	67,349	0.00	
15/09/2041						0% 15/03/2036					
FPMG BONDICS, Series 4900 'D' 2%	USD	1,572,082	1,378,400	0.03		FPMG BONDICS, PO, Series 3171 'N0' 0%	USD	9,633	8,593	0.00	
25/07/2049						0% 15/06/2036					
FPMG BONDICS, FBN, Series 3051 'D0' 4.055%	USD	1,682	1,632	0.00		FPMG BONDICS, Series 2986 'M' 4%	USD	478,862	458,447	0.01	
15/10/2025						15/12/2041					
FPMG BONDICS, Series 3094 'D7' 7.5%	USD	93,082	90,082	0.00		FPMG BONDICS, Series 2430 'M' 6.5%	USD	3,331	3,421	0.00	
15/11/2036						15/02/2032					
FPMG BONDICS, PO, Series 3117 'B0' 0%	USD	7,497	6,428	0.00		FPMG BONDICS, IO, Series 3219 6%	USD	17,284	3,044	0.00	
15/02/2036						15/04/2036					
FPMG BONDICS, PO, Series 3153 'B0' 0%	USD	39,434	33,411	0.00		FPMG BONDICS, PO, Series 3134 0%	USD	2,034	1,618	0.00	
15/05/2036						15/02/2036					
FPMG BONDICS, PO, Series 4280 'B0' 0%	USD	371,924	277,063	0.01		FPMG BONDICS, PO, Series 3128 0%	USD	8,995	7,607	0.00	
15/12/2043						15/04/2036					
FPMG BONDICS, Series 3094 'E7' 7.5%	USD	83,999	90,470	0.00		FPMG BONDICS, PO, Series 3151 0%	USD	41,325	33,831	0.00	
15/02/2036						15/05/2036					
FPMG BONDICS, Series 2288 'E2' 8.5%	USD	7,503	7,960	0.00		FPMG BONDICS, PO, Series 3300 0%	USD	39,504	32,763	0.00	
15/06/2031						15/02/2036					
FPMG BONDICS, FBN, Series 3349 'E4' 6.646%	USD	6,232	6,245	0.00		FPMG BONDICS, PO, Series 2607 0%	USD	94,681	76,688	0.00	
15/07/2039						15/05/2037					
FPMG BONDICS, FBN, Series 2388 'E8' 6.646%	USD	8,401	8,395	0.00		FPMG BONDICS, PO, Series 3611 0%	USD	10,588	9,111	0.00	
15/01/2029						15/07/2034					
FPMG BONDICS, FBN, Series 4049 'EJ' 5.843%	USD	432,441	425,876	0.01		FPMG BONDICS, PO, Series 3621 0%	USD	53,684	43,229	0.00	
15/07/2037						15/01/2040					
FPMG BONDICS, FBN, Series 3275 'E6' 5.888%	USD	5,467	5,382	0.00		FPMG BONDICS, Series 3047 'U' 5.5%	USD	54,555	54,937	0.00	
15/02/2037						15/10/2035					
FPMG BONDICS, Series 2544 'E6' 6%	USD	14,913	15,270	0.00		FPMG BONDICS, Series 3084 'U6' 5.5%	USD	151,334	154,816	0.00	
15/12/2032						15/11/2035					

JPMorgan Funds – US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)	
PRIMIC REMICS, 00, Series 3117 '06' 0%	USD	16,877	14,400	0.00		PRIMIC REMICS, FPN, Series 2436 '30'	USD	352	342	0.00	
PRIMIC REMICS, 00, Series 3122 '08' 0%	USD	17,534	14,999	0.00		PRIMIC REMICS, 00, FPN, Series 2461 '31'	USD	31,974	2,366	0.00	
PRIMIC REMICS, 00, Series 3117 '06' 0%	USD	9,085	7,688	0.00		PRIMIC REMICS, 00, FPN, Series 2385 '30'	USD	12,983	731	0.00	
PRIMIC REMICS, Series 2165 '08' 6%	USD	52,614	52,625	0.00		PRIMIC REMICS, FPN, Series 2029 '30'	USD	46,505	48,635	0.00	
PRIMIC REMICS, Series 2110 '06' 6%	USD	11,408	11,416	0.00		PRIMIC REMICS, 00, FPN, Series 2232 '31'	USD	31,319	2,209	0.00	
PRIMIC REMICS, Series 2075 '09' 6.5%	USD	2,930	2,950	0.00		PRIMIC REMICS, FPN, Series 2571 '31'	USD	38,271	38,874	0.00	
PRIMIC REMICS, 00, FPN, Series 2424 '01'	USD	38,257	3,558	0.00		PRIMIC REMICS, FPN, Series 2022 '31'	USD	2,495	2,384	0.00	
PRIMIC REMICS, Series 2614 '08' 4%	USD	36,935	36,758	0.00		PRIMIC REMICS, Series 2369 '05' 7%	USD	3,793	3,874	0.00	
PRIMIC REMICS, Series 2172 '06' 7%	USD	23,762	24,310	0.00		PRIMIC REMICS, Series 2423 '05' 6.5%	USD	29,733	30,210	0.00	
PRIMIC REMICS, FPN, Series 2382 '01'	USD	96,609	91,460	0.00		PRIMIC REMICS, Series 2434 '06' 7%	USD	3,602	3,715	0.00	
PRIMIC REMICS, 00, Series 2671 '00' 0%	USD	87,059	71,027	0.00		PRIMIC REMICS, 00, Series 2077 '00' 0%	USD	6,839	6,749	0.00	
PRIMIC REMICS, FPN, Series 2671 '05'	USD	6,048	6,248	0.00		PRIMIC REMICS, FPN, Series 2832 '07'	USD	106,031	105,851	0.00	
PRIMIC REMICS, FPN, Series 2967 '05'	USD	381	372	0.00		PRIMIC REMICS, Series 2578 '02' 5.5%	USD	75,433	77,245	0.00	
PRIMIC REMICS, 00, FPN, Series 2194 '04'	USD	4,896	507	0.00		PRIMIC REMICS, FPN, Series 2085 '06'	USD	106,201	106,875	0.00	
PRIMIC REMICS, 00, FPN, Series 2387 '04'	USD	77,016	4,980	0.00		PRIMIC REMICS, FPN, Series 2390 '06'	USD	460	466	0.00	
PRIMIC REMICS, 00, FPN, Series 2511 '04'	USD	41,195	2,735	0.00		PRIMIC REMICS, Series 1863 '02' 6.5%	USD	30	30	0.00	
PRIMIC REMICS, FPN, Series 2631 '04'	USD	10,743	11,275	0.00		PRIMIC REMICS, Series 2061 '02' 6.5%	USD	1,533	1,544	0.00	
PRIMIC REMICS, FPN, Series 2733 '05'	USD	183,378	172,930	0.00		PRIMIC REMICS, Series 2035 '02' 5.8%	USD	276,529	282,477	0.01	
PRIMIC REMICS, 00, FPN, Series 2404 '05'	USD	122,648	9,306	0.00		PRIMIC REMICS, Series 2220 '02' 6%	USD	5,851	5,736	0.00	
PRIMIC REMICS, 00, FPN, Series 2140 '05'	USD	99,566	8,473	0.00		PRIMIC REMICS, Series 2461 '02' 6%	USD	232,375	239,083	0.01	
PRIMIC REMICS, 00, FPN, Series 2455 '05'	USD	153,690	14,677	0.00		PRIMIC REMICS, Series 1927 '02' 6.5%	USD	6,902	6,940	0.00	
PRIMIC REMICS, 00, FPN, Series 4321 '05'	USD	1,911,014	249,288	0.01		PRIMIC REMICS, Series 2263 '02' 6%	USD	2,198,394	2,258,194	0.05	
PRIMIC REMICS, FPN, Series 2004 '05'	USD	43,497	42,392	0.00		PRIMIC REMICS, Series 2394 '02' 6.5%	USD	12,773	13,106	0.00	

JPMorgan Funds – US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)	
FIDUC BONDS, Series 2019 'D' 7.5 15/10/2030	USD	3,635	3,721	0.00		FRMA 3.51% 01/09/2032	USD	5,272,000	4,841,228	0.10	
FIDUC BONDS, Series 2011 'D' 5.5% 15/09/2033	USD	708,065	719,513	0.02		FRMA 3.8% 01/09/2032	USD	7,687,167	7,211,783	0.16	
FIDUC Seasoned Credit Risk Transfer Trust, Series 2018-4 'M' 3.5% 25/03/2038	USD	4,948,610	4,617,917	0.10		FRMA 3.54% 01/10/2032	USD	3,835,990	3,550,875	0.08	
FIDUC Seasoned Credit Risk Transfer Trust 'WU' 3.25% 25/11/2061	USD	5,723,609	4,952,209	0.11		FRMA 3.73% 01/10/2032	USD	9,832,813	9,172,058	0.20	
FIDUC Seasoned Credit Risk Transfer Trust, Series 2018-4 'M' 3.5% 25/03/2038	USD	8,167,413	5,905,901	0.13		FRMA 3.81% 01/10/2032	USD	10,307,000	9,651,223	0.21	
Fidelity & Guaranty Life Holdings, Inc., 1444 5.5% 01/06/2025	USD	4,133,000	4,112,653	0.09		FRMA 4.55% 01/10/2032	USD	4,845,000	4,793,842	0.10	
Fifth Third Bancorp, FRN 4.772% 28/07/2030	USD	5,000,000	4,826,087	0.10		FRMA 4.6% 01/10/2032	USD	7,700,000	7,594,472	0.16	
Fifth Third Bank NA 3.8% 15/02/2035	USD	200,000	194,296	0.00		FRMA 4.7% 01/10/2032	USD	6,909,826	6,947,440	0.15	
FirstEnergy Pennsylvania Electric Co., 1444 3.2% 15/09/2038	USD	75,000	70,412	0.00		FRMA 1.4% 01/11/2032	USD	12,000,000	9,321,433	0.20	
Fiserv, Inc. 3.2% 01/07/2026	USD	690,000	662,838	0.01		FRMA 3.54% 01/11/2032	USD	10,771,000	9,901,860	0.21	
Fiserv, Inc. 4.4% 01/07/2049	USD	660,000	544,631	0.01		FRMA 5.23% 01/12/2032	USD	7,800,000	8,041,034	0.17	
Flex Intermediate Holdings LLC, 1444 3.95% 30/06/2031	USD	2,255,000	1,889,203	0.04		FRMA 4.2% 01/12/2032	USD	7,433,523	7,455,744	0.17	
Flex Intermediate Holdings LLC, 1444 4.31% 30/12/2039	USD	1,145,000	842,149	0.02		FRMA 3.895% 01/02/2033	USD	9,850,000	9,257,670	0.20	
Florida Power & Light Co. 5.3% 01/04/2053	USD	1,540,000	1,513,570	0.03		FRMA 4.15% 01/03/2033	USD	6,900,000	6,630,921	0.14	
FNCGRR Issuer Trust, Reg. S, FRN 'K' 6.5% 26/09/2027	USD	15,000,000	14,710,774	0.32		FRMA 4.19% 01/04/2033	USD	7,766,000	7,479,799	0.16	
FRMA 4.56% 01/05/2028	USD	9,070,000	8,956,281	0.19		FRMA 4.5% 01/04/2033	USD	4,830,000	4,826,087	0.09	
FRMA 4.62% 01/11/2028	USD	2,763,000	2,751,492	0.06		FRMA 4.37% 01/05/2033	USD	10,090,000	9,846,575	0.21	
FRMA 4.62% 01/11/2028	USD	5,057,000	5,035,937	0.11		FRMA 4.24% 01/06/2033	USD	5,627,000	5,439,381	0.12	
FRMA 4.62% 01/11/2028	USD	6,141,000	6,115,422	0.13		FRMA 4.5% 01/07/2033	USD	5,000,000	4,926,526	0.11	
FRMA 3.515% 01/07/2029	USD	11,000,000	10,445,660	0.23		FRMA 4.5% 01/09/2033	USD	11,734,032	11,633,315	0.25	
FRMA 1.27% 01/12/2029	USD	4,514,765	3,779,091	0.08		FRMA 4% 01/11/2050	USD	7,538,527	6,986,664	0.15	
FRMA 4.41% 01/04/2030	USD	10,360,000	10,156,666	0.22		FRMA 5% 01/07/2053	USD	10,103,546	9,821,959	0.21	
FRMA 3.46% 01/08/2030	USD	4,798,749	4,497,117	0.10		FRMA 5% 01/07/2053	USD	11,749,239	11,414,443	0.25	
FRMA 4.24% 01/12/2030	USD	5,437,000	5,308,604	0.12		FRMA 5% 01/08/2053	USD	9,853,779	9,790,705	0.21	
FRMA 1.5% 01/01/2031	USD	10,500,000	8,626,092	0.19		FRMA 5% 01/08/2053	USD	3,960,490	3,935,139	0.09	
FRMA 3.99% 01/06/2031	USD	2,285,000	2,168,610	0.05		FRMA 6% 01/09/2053	USD	3,263,658	3,307,564	0.07	
FRMA 1.77% 01/11/2031	USD	8,700,000	7,098,526	0.15		FRMA 5.5% 01/09/2053	USD	5,156,267	5,225,633	0.11	
FRMA 3.54% 01/06/2032	USD	10,297,000	9,510,171	0.21		FRMA 5.5% 01/01/2058	USD	4,755,189	4,880,922	0.11	
FRMA 3.765% 01/07/2032	USD	5,122,000	4,799,611	0.10		FRMA 3.5% 01/03/2061	USD	5,109,509	4,524,288	0.10	
FRMA 3.84% 01/07/2032	USD	2,430,244	2,298,322	0.05		FRMA 2.5% 01/07/2061	USD	6,399,895	5,177,768	0.11	
FRMA 3.7% 01/08/2032	USD	9,020,000	8,405,008	0.18		FRMA 2.5% 01/09/2061	USD	9,877,716	7,991,409	0.17	
FRMA 3.41% 01/09/2032	USD	21,006,714	19,293,533	0.42		FRMA 3% 01/12/2061	USD	7,524,491	6,266,649	0.14	
						FRMA 4% 01/12/2061	USD	6,658,481	6,063,312	0.13	
						FRMA 6% 01/12/2061	USD	8,572,398	8,965,216	0.19	
						FRMA 2.5% 01/03/2062	USD	12,099,441	9,593,958	0.21	
						FRMA 3% 01/06/2062	USD	9,453,675	7,962,476	0.17	
						FRMA 3.5% 01/06/2062	USD	8,502,987	7,455,108	0.16	
						FRMA 4% 01/09/2062	USD	8,995,513	8,208,438	0.18	
						FRMA, FRN 1.754% 01/03/2032	USD	9,988,963	8,165,624	0.18	
						FRMA, Series 2004-W11 '1A1' 6% 25/05/2044	USD	212,797	216,689	0.00	
						FRMA, Series 2021-W3 '1A1' 1% 25/11/2033	USD	354,487	345,858	0.01	
						FRMA, Series 2005-W1 '1A2' 6.5% 25/10/2044	USD	201,998	205,371	0.00	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)	
				株数/額面金額	時価(米ドル)					株数/額面金額	時価(米ドル)
FNMA, Series 2004-72 '1A4' 7.5%	USD	108,792	110,019	0.00		FNMA, FDN, Series 2017-W3 'A2' 2.54%	USD	927,577	875,090	0.02	
25/11/2043						25/12/2026					
FNMA, FDN, Series 2007-W1 '1A4' 6.40%	USD	3,747	4,456	0.00		FNMA, FDN, Series 2017-W4 'A2' 2.63%	USD	5,351,929	5,060,299	0.11	
25/01/2037						25/12/2026					
FNMA, FDN, Series 2009-W4 '2A' 5.35%	USD	2,913	2,877	0.00		FNMA, FDN, Series 2017-W5 'A2' 3.09%	USD	2,626,535	2,447,246	0.05	
25/10/2042						25/04/2029					
FNMA, Series 2006-W3 '2A' 6%	USD	57,674	58,690	0.00		FNMA, FDN, Series 2017-W6 'A2' 3.06%	USD	3,851,113	3,668,313	0.08	
25/09/2046						25/05/2027					
FNMA, FDN, Series 2002-W5 '2A1' 7%	USD	36,588	35,396	0.00		FNMA, FDN, Series 2018-W10 'A2' 3.46%	USD	4,658,051	4,437,944	0.10	
25/06/2042						25/01/2028					
FNMA, Series 2004-W1 '2A2' 7%	USD	25,815	26,558	0.00		FNMA, FDN, Series 2018-W4 'A2' 3.16%	USD	1,879,091	1,775,402	0.04	
25/12/2033						25/01/2028					
FNMA, Series 2004-W2 '2A2' 7%	USD	5,493	5,621	0.00		FNMA, Series 2020-W9 'A2' 1.2%	USD	3,484,611	3,154,641	0.07	
25/02/2044						25/10/2030					
FNMA, FDN, Series 2005-W3 '2A2' 5.61%	USD	229,175	227,143	0.01		FNMA, FDN 'A2' 1.76%	USD	7,400,000	6,013,039	0.13	
25/02/2045						25/11/2001					
FNMA, IO, Series 2003 '32' 6%	USD	22,473	4,215	0.00		FNMA, FDN, Series 2007-106 'A1' 6.02%	USD	36,436	37,646	0.00	
25/01/2038						25/10/2027					
FNMA, FDN, Series 2003-W8 '3F1' 5.85%	USD	30,891	30,822	0.00		FNMA, Series 2008-56 'AC' 5%	USD	51,093	49,994	0.00	
25/05/2042						25/01/2028					
FNMA, IO, FDN, Series 2003-W5 '41' 0.55%	USD	1,344,530	20,115	0.00		FNMA, STEP, Series 2001-W 'A6' 5.11%	USD	2,050	2,025	0.00	
25/09/2042						25/01/2032					
FNMA, Series 2009-W1 'A' 6%	USD	116,631	118,578	0.00		FNMA, Series 2010-111 'AM' 5.5%	USD	380,678	390,148	0.01	
25/12/2049						25/10/2040					
FNMA, Series 2000-76 'A1' 7.5%	USD	79,067	78,116	0.00		FNMA, PO, Series 2006-22 'A0' 6%	USD	13,192	11,344	0.00	
25/11/2040						25/04/2036					
FNMA, Series 2001-77 'A1' 7.5%	USD	73,445	76,844	0.00		FNMA, PO, Series 2001-42 'A0' 6%	USD	3,085	2,664	0.00	
25/02/2041						25/05/2027					
FNMA, Series 2002-T16 'A2' 7%	USD	10,309	10,643	0.00		FNMA, PO, Series 2009-113 'A0' 6%	USD	35,775	29,125	0.00	
25/07/2042						25/01/2040					
FNMA, FDN, Series 2007-101 'A2' 4.84%	USD	47,621	47,722	0.00		FNMA, PO, Series 2006-58 'AP' 6%	USD	10,943	9,310	0.00	
25/06/2026						25/01/2036					
FNMA, Series 2015-W1 'A2' 2.52%	USD	1,326,500	1,316,092	0.03		FNMA, IO, FDN, Series 2007-60 'A1' 1.7%	USD	152,106	18,571	0.00	
25/09/2024						25/01/2027					
FNMA, FDN, Series 2015-W10 'A2' 3.09%	USD	2,284,943	2,188,285	0.05		FNMA, Series 2003-105 'A2' 5.5%	USD	332,568	337,485	0.01	
25/04/2027						25/10/2032					
FNMA, Series 2015-W7 'A2' 2.93%	USD	1,886,451	1,859,273	0.04		FNMA, Series 2007-76 'A2' 5.5%	USD	36,796	36,049	0.00	
25/12/2034						25/02/2027					
FNMA, Series 2006-W5 'A2' 2.48%	USD	3,632,481	3,464,389	0.08		FNMA, Series 2004-97 'B' 5.5%	USD	2,232,786	2,273,970	0.05	
25/05/2026						25/01/2035					
FNMA, Series 2006-W7 'A2' 2.49%	USD	1,833,426	1,744,402	0.04		FNMA, Series 2007-42 'B' 6%	USD	89,881	91,442	0.00	
25/09/2026						25/05/2037					
FNMA, FDN, Series 2017-W1 'A2' 2.46%	USD	3,029,770	2,865,725	0.06		FNMA, Series 2001-79 'BA' 7%	USD	33,286	33,519	0.00	
25/10/2026						25/03/2045					
FNMA, FDN, Series 2017-W12 'A2' 3.16%	USD	3,249,521	3,095,479	0.07		FNMA, IO, FDN, Series 2008-1 'B1' 0.46%	USD	51,984	3,693	0.00	
25/06/2027						25/02/2038					
						FNMA, FDN, Series 2012-137 '12' 5.7%	USD	121,922	121,477	0.00	
						25/09/2041					

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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, 10, FRN, Series 2008-53 'CI' 1.75% 25/07/2038	USD	21,565	2,092	0.00		FNMA, Series 2009-59 'IB' 5% 25/08/2039	USD	120,765	120,722	0.00	
FNMA, FRN, Series 2005-74 'CS' 5.00% 25/06/2035	USD	6,259	6,285	0.00		FNMA, Series 2001-81 'IE' 6.5% 25/01/2032	USD	109,967	112,927	0.00	
FNMA, FRN, Series 2005-45 'DC' 4.32% 25/06/2035	USD	31,678	31,791	0.00		FNMA, 10, FRN, Series 2007-136 'II' 1.48% 25/01/2038	USD	53,571	2,677	0.00	
FNMA, FRN, Series 2006-79 'DE' 5.8% 25/02/2036	USD	15,712	15,617	0.00		FNMA, 10, FRN, Series 2008-46 'II' 2.37% 25/06/2038	USD	18,763	1,092	0.00	
FNMA 'DN' 2.5% 25/10/2049	USD	2,588,552	2,187,266	0.05		FNMA, 10, Series 2009-33 'IA' 6.5% 25/04/2033	USD	40,238	6,327	0.00	
FNMA, PO, Series 2006-79 'DO' 0% 25/02/2036	USD	11,368	9,447	0.00		FNMA, 10, Series 2009-36 'IP' 5.5% 25/10/2039	USD	35,250	6,245	0.00	
FNMA, 10, FRN, Series 2007-72 'EX' 0.95% 25/07/2037	USD	206,606	18,251	0.00		FNMA, 10, FRN, Series 2008-16 'IS' 0.75% 25/03/2038	USD	20,728	1,359	0.00	
FNMA, PO, Series 2006-111 'EO' 0% 25/11/2036	USD	4,604	3,880	0.00		FNMA, 10, Series 2002-35 'IU' 6% 25/05/2033	USD	36,917	5,829	0.00	
FNMA, PO, Series 2004-46 'EP' 0% 25/02/2034	USD	12,300	11,878	0.00		FNMA, 10, Series 2002-44 'IU' 7% 25/06/2033	USD	12,428	1,690	0.00	
FNMA, FRN, Series 2005-90 'ES' 3.25% 25/10/2035	USD	18,728	19,132	0.00		FNMA, 10, FRN, Series 2007-65 'II' 1.17% 25/07/2037	USD	48,665	4,404	0.00	
FNMA, Series 2005-67 'ET' 5.5% 25/02/2035	USD	8,461	8,402	0.00		FNMA, 10, FRN, Series 2010-23 'IS' 1.65% 25/02/2040	USD	45,299	3,127	0.00	
FNMA, FRN, Series 412 'FZ' 5.95% 25/02/2042	USD	278,102	273,564	0.01		FNMA, Series 2011-118 'LB' 7% 25/11/2041	USD	324,569	338,481	0.01	
FNMA, FRN, Series 2007-94 'YA' 5.85% 25/06/2037	USD	14,853	14,696	0.00		FNMA, 10, FRN, Series 2011-30 'LS' 0.55% 25/04/2041	USD	87,358	3,919	0.00	
FNMA, FRN, Series 2007-16 'YC' 6.2% 25/03/2037	USD	3,132	3,129	0.00		FNMA, FRN, Series 2006-33 'LS' 5.63% 25/06/2036	USD	21,766	24,454	0.00	
FNMA, FRN, Series 2010-43 'YU' 6.05% 25/05/2040	USD	87,392	87,186	0.00		FNMA, Series 2005-84 'MD' 5.75% 25/10/2035	USD	15,888	16,000	0.00	
FNMA, FRN, Series 2003-119 'YB' 5.95% 25/12/2035	USD	57,603	57,557	0.00		FNMA, FRN, Series 2009-103 'MD' 6.89% 25/12/2039	USD	26,446	26,500	0.00	
FNMA, FRN, Series 2004-61 'YF' 6.25% 25/11/2032	USD	80,199	80,813	0.00		FNMA, Series 2011-118 'MT' 7% 25/11/2041	USD	299,210	310,378	0.01	
FNMA, FRN, Series 2010-40 'YJ' 6.05% 25/04/2040	USD	28,262	28,266	0.00		FNMA, Series 2006-85 'MC' 6.5% 25/09/2036	USD	14,757	15,279	0.00	
FNMA, Series 2007-71 'GB' 0% 25/07/2037	USD	57,092	59,252	0.00		FNMA, Series 2016-38 'NA' 3% 25/01/2046	USD	1,457,697	1,322,662	0.03	
FNMA, 10, FRN, Series 2006-94 'GI' 1.3% 25/10/2036	USD	25,806	445	0.00		FNMA, 10, FRN, Series 2002-110 0.89% 25/08/2042	USD	399,496	12,687	0.00	
FNMA, Series 2009-89 'GL' 5% 25/09/2039	USD	281,251	281,438	0.01		FNMA, Series 1998-58 6.5% 25/10/2028	USD	14,991	15,053	0.00	
FNMA, PO, Series 2006-44 'OO' 0% 25/06/2036	USD	7,877	6,749	0.00		FNMA, Series 2005-109 5% 25/12/2035	USD	29,005	28,974	0.00	
FNMA, 10, FRN, Series 2009-6 'OS' 1.1% 25/02/2039	USD	34,429	2,873	0.00		FNMA, Series 2006-77 6.5% 25/08/2036	USD	26,811	27,172	0.00	
FNMA, FRN, Series 2006-124 'OB' 5.95% 25/11/2036	USD	32,377	34,184	0.00		FNMA, PO, Series 2005-90 0% 25/09/2035	USD	1,653	1,614	0.00	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に
				占める					占める
				割合(%)					割合(%)
FNMA, PO, Series 2006-110 0% 25/11/2006	USD	8,625	7,250	0.00	FNMA, 10, FPN, Series 2009-17 '05' 1.2% 25/09/2009	USD	23,134	1,553	0.00
FNMA, PO, Series 2006-36 0% 25/05/2006	USD	128,569	108,036	0.00	FNMA, FPN, Series 2009-28 '05' 4.351% 25/04/2008	USD	21,842	22,945	0.00
FNMA, PO, Series 2006-58 0% 25/07/2006	USD	34,889	21,001	0.00	FNMA, 10, FPN, Series 2005-56 'S' 1.20% 25/07/2005	USD	30,731	2,369	0.00
FNMA, PO, Series 2007-48 0% 25/05/2007	USD	49,295	42,176	0.00	FNMA, 10, FPN, Series 2007-108 'SA' 0.91% 25/12/2007	USD	7,293	418	0.00
FNMA, PO, Series 2009-69 0% 25/09/2009	USD	44,471	34,995	0.00	FNMA, 10, FPN, Series 2008-80 'SA' 0.4% 25/09/2008	USD	26,792	1,928	0.00
FNMA, PO, Series 2013-92 0% 25/09/2013	USD	185,057	138,910	0.00	FNMA, 10, FPN, Series 2014-125 'SA' 0% 25/11/2014	USD	135,626	3,763	0.00
FNMA, Series 2011-118 'NT' 7% 25/11/2011	USD	344,838	359,296	0.01	FNMA, 10, FPN, Series 2010-68 'SA' 0% 25/07/2010	USD	139,262	7,309	0.00
FNMA, PO, Series 2006-21 '01' 0% 25/04/2006	USD	11,304	9,749	0.00	FNMA, FPN, Series 2004-25 'SA' 4.538% 25/04/2004	USD	1,615	1,689	0.00
FNMA, PO, Series 2006-15 '02' 0% 25/02/2006	USD	46,305	38,241	0.00	FNMA, 10, FPN, Series 2003-116 '38' 2.1% 25/12/2003	USD	9,675	711	0.00
FNMA, PO, Series 2009-06 '07' 0% 25/10/2007	USD	103,264	85,241	0.00	FNMA, 10, FPN, Series 2008-81 '38' 0.4% 25/09/2008	USD	63,138	3,177	0.00
FNMA, Series 2009-63 'P' 5% 25/03/2007	USD	4,476	4,299	0.00	FNMA, 10, FPN, Series 2010-35 '38' 0.91% 25/04/2010	USD	37,443	2,253	0.00
FNMA, PO, Series 2006-44 'P' 0% 25/12/2006	USD	22,906	19,353	0.00	FNMA, FPN, Series 2010-49 '3C' 1.70% 25/02/2010	USD	81,298	73,671	0.00
FNMA, Series 1997-29 'P0' 1.5% 30/05/2007	USD	2,185	2,118	0.00	FNMA, FPN, Series 2007-1 '30' 6.30% 25/02/2007	USD	20,326	31,496	0.00
FNMA, Series 2001-44 'P0' 7% 25/09/2001	USD	923	945	0.00	FNMA, FPN, Series 2002-5 '3E' 5.10% 25/02/2002	USD	5,403	5,408	0.00
FNMA, Series 2001-7 'PF' 7% 25/03/2001	USD	259	268	0.00	FNMA, 10, FPN, Series 2007-7 '3E' 1.0% 25/08/2006	USD	84,673	9,151	0.00
FNMA, Series 2011-52 'P0' 5% 25/08/2011	USD	1,224,055	1,220,931	0.03	FNMA, FPN, Series 2006-95 '30' 4.401% 25/10/2006	USD	11,655	13,109	0.00
FNMA, 10, FPN, Series 2007-109 'P1' 0.9% 25/12/2007	USD	74,472	3,718	0.00	FNMA, FPN, Series 2007-29 '30' 4.50% 25/04/2007	USD	14,438	15,504	0.00
FNMA, 10, Series 2009-52 'P1' 5% 25/01/2009	USD	25,076	4,108	0.00	FNMA, 10, FPN, Series 2007-53 '38' 0.6% 25/06/2007	USD	49,349	3,342	0.00
FNMA, FPN, Series 2006-11 'P5' 4.90% 25/01/2006	USD	32,704	37,802	0.00	FNMA, FPN, Series 2004-61 '3E' 2.2% 25/11/2002	USD	10,025	9,988	0.00
FNMA, FPN, Series 2006-02 'P5' 7.20% 25/07/2006	USD	5,384	6,886	0.00	FNMA, FPN, Series 2004-46 '3E' 1.51% 25/06/2004	USD	17,592	17,340	0.00
FNMA, FPN, Series 2004-73 'P11' 9.12% 25/01/2014	USD	73,184	75,608	0.00	FNMA, FPN, Series 2005-14 '3E' 5.14% 25/06/2005	USD	6,259	6,285	0.00
FNMA, Series 2005-36 'P2' 5.5% 25/09/2005	USD	289,338	293,490	0.01	FNMA, FPN, Series 2007-65 '3E' 2.52% 25/09/2007	USD	9,346	9,187	0.00
FNMA, PO, Series 2006-65 'Q0' 0% 25/01/2006	USD	7,258	6,014	0.00	FNMA, FPN, Series 2008-18 '3E' 1.1% 25/02/2008	USD	10,852	9,842	0.00

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
FNMA, 10, FVN, Series 2009-12 '3T' 0.35% 25/01/2040	USD	59,014	4,794	0.00		FNMA, 10, FVN, Series 2007-02 '1S' 0.33% 25/06/2037	USD	88,873	7,382	0.00	
FNMA, FVN, Series 2005-15 '3T' 2.400% 25/09/2035	USD	20,154	20,145	0.00		FNMA, Series 1996-48 '2' 7% 25/11/2026	USD	4,256	4,239	0.00	
FNMA, FVN, Series 2004-14 '5W' 4.600% 25/11/2021	USD	13,673	14,371	0.00		FNMA, Series 2002-30 '2' 6% 25/05/2032	USD	52,186	53,202	0.00	
FNMA, FVN, Series 2003-02 '3T' 6.000% 25/10/2031	USD	3,124	3,426	0.00		FNMA, Series 1998-44 '2A' 6.5% 20/01/2038	USD	125,200	125,489	0.00	
FNMA, FO, Series 2006-12 '10' 0% 25/02/2036	USD	8,257	7,003	0.00		FNMA, Series 2000-50 '2A' 0% 25/05/2031	USD	63,458	64,162	0.00	
FNMA, FVN, Series 2005-06 '2T' 1.800% 25/09/2033	USD	5,307	5,208	0.00		FNMA, Series 2011-39 '2A' 0% 25/11/2032	USD	158,651	162,118	0.00	
FNMA, Series 2009-79 '0A' 7% 25/02/2038	USD	6,167	6,267	0.00		FNMA, Series 2011-47 '2A' 5.5% 25/01/2038	USD	135,484	135,864	0.00	
FNMA, 10, FVN, Series 2006-03 '1S' 1.13% 25/06/2036	USD	57,840	4,981	0.00		FNMA, Series 1998-36 '2B' 0% 18/07/2028	USD	453	454	0.00	
FNMA, 10, FVN, Series 2012-14 '1S' 0.73% 25/01/2042	USD	1,021,472	42,575	0.00		FNMA, Series 2007-76 '2C' 0% 25/08/2037	USD	54,853	55,802	0.00	
FNMA, 10, FVN, Series 2007-08 '1I' 1.05% 25/09/2037	USD	112,491	9,770	0.00		FNMA 252409 6.5% 01/03/2029	USD	1,484	1,492	0.00	
FNMA, Series 2004-50 '1Z' 5.5% 25/01/2034	USD	392,936	399,380	0.01		FNMA 257172 5.5% 01/04/2038	USD	8,927	8,809	0.00	
FNMA, FVN, Series 2010-1 '1A' 6.200% 25/02/2040	USD	44,696	45,010	0.00		FNMA 257183 7% 01/03/2038	USD	61,751	61,850	0.00	
FNMA, FVN, Series 2010-61 '1A' 5.930% 25/06/2040	USD	45,922	46,152	0.00		FNMA 257209 5.5% 01/05/2038	USD	13,080	13,105	0.00	
FNMA, FVN, Series 2011-43 '1A' 5.740% 25/06/2031	USD	45,416	46,187	0.00		FNMA 468571 4.45% 01/07/2026	USD	775,858	767,511	0.02	
FNMA, Series 2006-53 '1E' 0% 25/06/2036	USD	294,813	303,096	0.01		FNMA 650236 5% 01/12/2032	USD	906	979	0.00	
FNMA, 10, FVN, Series 2006-0 '1W' 1.25% 25/09/2036	USD	471,764	40,780	0.00		FNMA, FVN 722985 7.27% 01/07/2033	USD	3,570	3,627	0.00	
FNMA, FO, Series 2006-0 '1W2' 0% 25/02/2036	USD	128,663	103,501	0.00		FNMA, FVN 735320 6.61% 01/08/2034	USD	10,917	11,091	0.00	
FNMA, 10, FVN, Series 2009-04 '1S' 0.45% 25/10/2039	USD	15,211	939	0.00		FNMA, FVN 745445 6.50% 01/01/2036	USD	26,919	27,611	0.00	
FNMA, 10, FVN, Series 2000-050 '1I' 1.920% 25/10/2030	USD	53,058,649	2,508,664	0.06		FNMA, FVN 745445 6.61% 01/04/2033	USD	7,465	7,591	0.00	
FNMA, 10, FVN, Series 2021-03 '1I' 2.030% 25/11/2033	USD	11,576,104	859,229	0.02		FNMA 754922 5.5% 01/09/2033	USD	4,833	4,891	0.00	
FNMA, Series 2005-04 '1X1' 5.15% 25/10/2035	USD	199,798	202,268	0.00		FNMA, FVN 766810 5.92% 01/01/2034	USD	2,848	2,860	0.00	
FNMA, 10, FVN, Series 2008-10 '1I' 0.70% 25/09/2038	USD	18,386	1,350	0.00		FNMA 771959 5.5% 01/02/2034	USD	12,811	12,700	0.00	
FNMA, Series 2005-04 '1X2' 5.15% 25/10/2035	USD	13,750	13,920	0.00		FNMA, FVN 77112 7.29% 01/06/2034	USD	38,837	39,872	0.00	
						FNMA, FVN 781209 6.31% 01/01/2034	USD	10,170	10,375	0.00	
						FNMA, FVN 790235 5.80% 01/08/2034	USD	10,349	10,375	0.00	
						FNMA, FVN 791961 5.68% 01/09/2034	USD	5,880	5,947	0.00	
						FNMA, FVN 801342 5.855% 01/09/2034	USD	29,534	29,560	0.00	
						FNMA, FVN 80896 7.16% 01/01/2035	USD	15,848	16,067	0.00	
						FNMA, FVN 80659 6.04% 01/02/2035	USD	8,970	9,000	0.00	
						FNMA, FVN 82360 7.10% 01/05/2035	USD	13,441	13,461	0.00	
						FNMA, FVN 843036 7.07% 01/09/2035	USD	13,561	13,700	0.00	
						FNMA, FVN 843038 7.11% 01/09/2035	USD	7,525	7,619	0.00	
						FNMA 847108 6.5% 01/10/2035	USD	47,444	47,586	0.00	
						FNMA, FVN 869251 7.08% 01/01/2036	USD	39,698	40,525	0.00	
						FNMA, FVN 881432 7.30% 01/10/2035	USD	87,701	89,356	0.00	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
FNMA FRN 82502 7.39% 01/06/2036	USD	26,267	26,995	0.00		FNMA ANQ005 2.73% 01/07/2028	USD	1,854,059	1,714,854	0.04	
FNMA FRN 884066 7.657% 01/06/2036	USD	14,491	14,635	0.00		FNMA ANQ009 2.7% 01/07/2026	USD	4,568,439	4,352,086	0.09	
FNMA FRN 886558 6.022% 01/08/2036	USD	14,720	14,916	0.00		FNMA ANQ124 2.85% 01/01/2029	USD	1,984,649	1,835,794	0.04	
FNMA 888406 6% 01/03/2037	USD	12,974	12,906	0.00		FNMA ANQ370 2.44% 01/08/2026	USD	2,872,366	2,727,730	0.06	
FNMA FRN 888606 6.441% 01/07/2035	USD	522	518	0.00		FNMA ANQ388 2.64% 01/08/2028	USD	2,357,171	2,178,342	0.05	
FNMA 888796 6% 01/09/2037	USD	43,644	43,671	0.00		FNMA ANQ429 2.45% 01/12/2026	USD	3,582,363	3,379,791	0.07	
FNMA FRN 888829 5.888% 01/06/2037	USD	416,670	415,183	0.01		FNMA ANQ444 2.43% 01/08/2026	USD	6,164,470	5,853,119	0.13	
FNMA 896463 6.637% 01/10/2034	USD	15,894	16,390	0.00		FNMA ANQ487 2.86% 01/08/2028	USD	874,625	814,878	0.02	
FNMA 908177 7.5% 01/08/2036	USD	18,492	18,946	0.00		FNMA ANQ906 2.63% 01/10/2031	USD	5,249,069	4,638,885	0.10	
FNMA FRN 908197 6.32% 01/10/2036	USD	15,767	16,088	0.00		FNMA ANQ134 2.58% 01/10/2028	USD	1,605,344	1,477,113	0.03	
FNMA FRN 906694 6.076% 01/12/2036	USD	8,615	8,832	0.00		FNMA ANQ354 2.8% 01/11/2031	USD	1,465,915	1,331,577	0.03	
FNMA FRN 928843 7.13% 01/09/2036	USD	73,878	76,468	0.00		FNMA ANQ431 2.6% 01/11/2028	USD	3,869,306	3,558,192	0.08	
FNMA FRN 928954 7.14% 01/01/2037	USD	40,999	41,883	0.00		FNMA ANQ565 2.94% 01/12/2028	USD	8,496,434	7,927,360	0.17	
FNMA 932355 6% 01/12/2039	USD	482,341	484,114	0.01		FNMA ANQ685 2.69% 01/12/2028	USD	9,548,000	8,776,123	0.19	
FNMA 933032 6% 01/10/2037	USD	7,470	7,318	0.00		FNMA ANQ788 2.79% 01/02/2027	USD	1,971,530	1,871,285	0.04	
FNMA 961192 7% 01/01/2038	USD	23,397	23,509	0.00		FNMA ANQ844 2.94% 01/12/2026	USD	3,412,838	3,257,444	0.07	
FNMA FRN 966946 6.285% 01/01/2038	USD	1,870	1,867	0.00		FNMA ANH154 3.17% 01/01/2029	USD	7,560,000	7,056,804	0.15	
FNMA 995783 8% 01/11/2037	USD	10,526	10,801	0.00		FNMA ANQ527 3.02% 01/07/2029	USD	9,700,758	9,007,458	0.20	
FNMA AD7270 4.125% 01/07/2040	USD	109,515	105,366	0.00		FNMA ANQ935 3.13% 01/07/2027	USD	1,006,921	959,713	0.02	
FNMA AD8548 5.5% 01/01/2033	USD	55,189	54,611	0.00		FNMA ANQ341 3.09% 01/09/2029	USD	7,788,000	7,214,177	0.16	
FNMA AED346 6% 01/05/2037	USD	49,029	49,008	0.00		FNMA AOR952 4% 01/07/2042	USD	198,785	187,818	0.00	
FNMA AE4168 4.25% 01/07/2040	USD	99,551	97,003	0.00		FNMA AQR999 3% 01/02/2043	USD	779,853	696,497	0.02	
FNMA AE4183 4.125% 01/09/2040	USD	86,749	84,364	0.00		FNMA A57212 3.5% 01/04/2036	USD	866,628	812,918	0.02	
FNMA AL2606 4% 01/03/2042	USD	47,361	44,137	0.00		FNMA BFD464 3.5% 01/03/2060	USD	6,202,991	5,485,238	0.12	
FNMA AL6167 3.5% 01/01/2044	USD	1,169,409	1,077,686	0.02		FNMA BL2595 3.34% 01/07/2028	USD	2,838,033	2,688,806	0.06	
FNMA AL6985 3.81% 01/01/2036	USD	932,910	914,160	0.02		FNMA BL2905 3.07% 01/08/2031	USD	6,208,000	5,600,796	0.12	
FNMA AL7395 5.555% 01/03/2038	USD	1,424,741	1,443,405	0.03		FNMA BL3616 2.88% 01/07/2028	USD	11,102,775	10,335,467	0.22	
FNMA AM4660 3.765% 01/12/2025	USD	929,635	909,170	0.02		FNMA BL4070 2.37% 01/08/2030	USD	9,142,359	8,103,876	0.18	
FNMA AM5940 3.24% 01/06/2026	USD	810,798	783,521	0.02		FNMA BL4118 2.42% 01/09/2028	USD	4,520,201	4,125,643	0.09	
FNMA AM6448 3.25% 01/09/2026	USD	2,678,564	2,583,610	0.06		FNMA BL4398 2.59% 01/10/2031	USD	1,800,000	1,579,902	0.03	
FNMA AM7785 3.17% 01/02/2030	USD	1,765,272	1,640,387	0.04		FNMA BL4411 2.47% 01/10/2031	USD	5,348,614	4,667,341	0.10	
FNMA AM8544 3.08% 01/04/2030	USD	1,765,728	1,630,512	0.04		FNMA BL4435 2.42% 01/10/2029	USD	5,456,632	4,888,450	0.11	
FNMA AM8846 2.68% 01/05/2025	USD	3,289,411	3,206,785	0.07		FNMA MA1463 3.5% 01/06/2043	USD	388,262	357,792	0.01	
FNMA AM9188 3.12% 01/06/2035	USD	4,827,484	4,200,056	0.09		FNMA MA2592 3.5% 01/04/2046	USD	1,543,188	1,422,085	0.03	
FNMA AM9548 3.17% 01/08/2025	USD	2,962,920	2,888,643	0.06		FNMA MA2633 3.5% 01/04/2046	USD	810,952	747,300	0.02	
FNMA AN1243 2.64% 01/06/2026	USD	2,999,000	2,859,511	0.06		FNMA MA2734 3.5% 01/08/2046	USD	2,057,998	1,896,483	0.04	
FNMA AN1247 2.64% 01/06/2026	USD	2,462,000	2,346,597	0.05		FNMA ACES, FRN 'A2' 1.583% 25/09/2031	USD	10,000,000	8,151,283	0.18	
FNMA AN1583 3.04% 01/05/2031	USD	1,347,485	1,225,255	0.03		FNMA ACES, FRN 'PT' 3.238% 25/04/2031	USD	8,438,259	7,738,826	0.17	
FNMA AN1590 2.4% 01/05/2026	USD	2,490,174	2,372,886	0.05		FNMA Grantor Trst, Series 2017-1 'A' 2.89% 26/06/2037	USD	4,282,479	4,041,273	0.09	
						Ford Foundation (The) 2.815% 01/06/2070	USD	825,000	489,644	0.01	
						Foadry JV Holdco LLC, 1444 6.15% 25/01/2032	USD	7,640,000	7,841,635	0.17	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
Foundry JV Holdings LLC, 144A 6.25% 25/01/2025	USD	5,060,000	5,212,395	0.11		FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2010-K151 'B', 144A 4.44% 25/02/2022	USD	5,150,000	4,465,593	0.10	
FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2015-044 'B', 144A 3.84% 25/01/2048	USD	13,563,000	13,363,547	0.29		FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2010-K150 'B', 144A 4.41% 25/10/2022	USD	1,545,000	1,324,304	0.03	
FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2015-045 'B', 144A 3.72% 25/04/2048	USD	8,250,000	8,121,567	0.18		FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2010-K150 'B', 144A 4.12% 25/02/2020	USD	1,933,000	1,838,228	0.04	
FREM Mortgage Trust, FRM 'B', 144A 3.75% 25/06/2048	USD	2,825,000	2,775,446	0.06		FREM Mortgage Trust, FRM 'B', 144A 3.92% 25/02/2021	USD	1,515,000	1,432,765	0.03	
FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2015-048 'B', 144A 3.77% 25/09/2048	USD	14,935,000	14,593,953	0.32		FREM Mortgage Trust, FRM 'B', 144A 3.92% 25/02/2020	USD	10,000,000	9,849,435	0.21	
FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2015-049 'B', 144A 3.84% 25/10/2048	USD	13,165,000	12,864,190	0.28		FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2010-K1712 'B', 144A 4.19% 25/05/2025	USD	4,910,000	4,813,789	0.10	
FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2015-051 'B', 144A 4.08% 25/10/2048	USD	7,149,000	6,980,407	0.15		FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2010-K1712 'B', 144A 4.19% 25/05/2025	USD	5,660,000	5,393,955	0.12	
FREM Mortgage Trust, FRM 'B', 144A 4.25% 25/04/2048	USD	6,830,000	6,645,298	0.14		FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2010-K1712 'B', 144A 4.19% 25/05/2025	USD	3,000,000	2,833,682	0.06	
FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2010-K355 'B', 144A 4.20% 25/04/2049	USD	19,796,000	19,224,466	0.42		FREM Mortgage Trust, FRM 'B', 144A 4.35% 25/06/2021	USD	2,500,000	2,388,855	0.05	
FREM Mortgage Trust, FRM 'B', 144A 4.08% 25/06/2049	USD	1,085,000	1,051,293	0.02		FREM Mortgage Trust, FRM 'B', 144A 4.35% 25/06/2021	USD	3,040,000	2,901,987	0.06	
FREM Mortgage Trust, FRM 'B', 144A 4.05% 25/08/2049	USD	3,500,000	3,375,330	0.07		FREM Mortgage Trust, FRM 'B', 144A 4.35% 25/06/2021	USD	6,526,000	6,212,920	0.13	
FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2015-058 'B', 144A 3.86% 25/09/2049	USD	14,440,608	13,879,665	0.30		FREM Mortgage Trust, FRM 'B', 144A 4.35% 25/06/2021	USD	12,000,000	11,417,042	0.25	
FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2015-059 'B', 144A 3.7% 25/11/2049	USD	6,179,000	5,916,726	0.13		FREM Mortgage Trust, FRM 'B', 144A 4.35% 25/06/2021	USD	2,000,000	1,914,670	0.04	
FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2015-060 'B', 144A 3.66% 25/12/2049	USD	2,582,000	2,450,203	0.05		FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2010-K2752 'B', 1.28% 25/09/2028	USD	2,058,209	1,893,995	0.04	
FREM Mortgage Trust, FRM 'B', 144A 4.05% 25/01/2030	USD	11,050,000	10,614,300	0.23		FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2010-K2752 'B', 1.28% 25/09/2028	USD	10,000,000	9,679,574	0.21	
FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2015-070 'B', 144A 3.94% 25/12/2049	USD	2,500,000	2,366,523	0.05		FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2010-K311 'B', 144A 3.98% 25/11/2025	USD	5,516,000	4,712,784	0.10	
FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2015-071 'B', 144A 3.82% 25/11/2050	USD	1,935,000	1,831,296	0.04		FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2010-K301 'B', 144A 4.22% 25/10/2021	USD	5,252,052	5,082,456	0.11	
FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2011-K128 'B', 144A 3.82% 25/11/2030	USD	6,000,000	5,957,282	0.13		FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2011-K321 'BPL', 144A 7.92% 25/10/2027	USD	5,300,000	4,771,063	0.10	
FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2011-K129 'B', 144A 3.78% 25/11/2049	USD	11,768,052	11,625,789	0.25		FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2014-K129 'C', 144A 4.33% 25/08/2047	USD	2,500,000	2,486,152	0.05	
FREM Mortgage Trust, FRM 'B', 144A 4.36% 25/11/2022	USD	4,830,000	4,117,196	0.09		FREM Mortgage Trust, FRM, Series 2014-K40 'C', 144A 4.28% 25/11/2047	USD	3,521,000	3,492,342	0.08	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2015-045 'C', 144A 1.72% 25/04/2048	USD	8,598,000	8,446,633	0.18		General Motors Financial Co., Inc. 5.4% 08/09/2027	USD	1,100,000	1,101,631	0.02	
FPMF Mortgage Trust, FPN 'C', 144A 4.02% 25/01/2049	USD	1,000,000	969,946	0.02		Gilead Sciences, Inc. 2.6% 01/10/2040	USD	3,070,000	2,147,052	0.05	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2015-054 'C', 144A 4.12% 25/04/2048	USD	3,000,000	2,898,663	0.06		Glenscore Funding LLC, 144A 2.5% 01/09/2030	USD	5,585,000	4,745,795	0.10	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2017-022 'C', 144A 4.01% 25/01/2050	USD	8,016,355	7,633,745	0.17		Glenscore Funding LLC, 144A 5.624% 04/04/2034	USD	2,130,000	2,114,147	0.05	
FPMF Mortgage Trust, FPN 'C', 144A 4.01% 25/02/2050	USD	1,700,000	1,614,995	0.04		GMAC Mortgage Loan Trust, FPN, Series 2005-AR3 '3M' 4.387% 19/06/2035	USD	30,891	28,493	0.00	
FPMF Mortgage Trust, FPN 'C', 144A 4.12% 25/01/2050	USD	6,885,000	6,553,902	0.14		GMAC, FI, FPN, Series 2019-017 1.72% 20/11/2029	USD	10,862,336	368,287	0.01	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2017-025 'C', 144A 4.22% 25/07/2050	USD	3,500,000	3,357,345	0.07		GRMA 2.5% 20/08/2051	USD	56,974,936	48,250,527	1.04	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2017-027 'C', 144A 4.01% 25/09/2049	USD	3,810,000	3,603,050	0.08		GRMA 2.5% 20/10/2051	USD	10,905,685	9,233,168	0.20	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2017-028 'C', 144A 3.97% 25/10/2049	USD	2,500,000	2,357,957	0.05		GRMA 5% 20/06/2052	USD	2,641,283	2,582,475	0.06	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2017-029 'C', 144A 3.85% 25/10/2049	USD	1,500,000	1,406,048	0.03		GRMA 5% 20/07/2052	USD	1,261,726	1,243,732	0.03	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2017-070 'C', 144A 3.94% 25/12/2049	USD	3,000,000	2,825,133	0.06		GRMA 5% 20/07/2052	USD	1,258,926	1,250,275	0.03	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2017-078 'C', 144A 3.85% 25/11/2050	USD	5,540,000	5,490,047	0.12		GRMA 5% 20/07/2052	USD	3,761,324	3,709,999	0.08	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2018-0711 'C', 144A 4.05% 25/02/2025	USD	14,725,000	14,459,523	0.31		GRMA 5% 20/07/2052	USD	5,106,144	5,017,604	0.11	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2018-0712 'C', 144A 4.20% 25/09/2025	USD	2,083,000	2,023,782	0.04		GRMA 5% 20/08/2052	USD	16,672,461	15,503,542	0.34	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2018-076 'C', 144A 4.35% 25/09/2051	USD	4,061,000	3,835,148	0.08		GRMA 4.5% 20/09/2052	USD	2,207,920	2,108,650	0.05	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2018-078 'C', 144A 4.26% 25/09/2051	USD	7,058,000	6,636,162	0.14		GRMA 4.5% 20/10/2052	USD	3,318,357	3,126,452	0.07	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2018-080 'C', 144A 4.37% 25/09/2050	USD	1,985,000	1,877,068	0.04		GRMA 5.5% 20/10/2052	USD	957,118	957,935	0.02	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2018-086 'C', 144A 4.43% 25/11/2051	USD	8,236,000	7,800,836	0.17		GRMA 5.5% 20/10/2052	USD	1,333,692	1,332,125	0.03	
FPMF Mortgage Trust, FPN, Series 2018-0311 'C', 144A 3.98% 25/11/2025	USD	8,000,000	7,750,173	0.17		GRMA 5.5% 20/10/2052	USD	1,340,351	1,342,483	0.03	
FPMF Trust, FPN, Series 2018-0004 'B', 144A 4.05% 25/09/2038	USD	6,775,000	5,939,394	0.13		GRMA 5.5% 20/10/2052	USD	1,615,021	1,623,545	0.04	
General Motors Financial Co., Inc. 1.2% 07/04/2025	USD	565,000	556,722	0.01		GRMA 5.5% 20/10/2052	USD	2,990,375	3,000,645	0.07	
General Motors Financial Co., Inc. 1.2% 06/01/2026	USD	2,119,000	1,965,978	0.04		GRMA 5.5% 20/01/2053	USD	5,428,099	5,430,073	0.12	
						GRMA 6% 20/01/2053	USD	1,035,617	1,056,515	0.02	
						GRMA 6% 20/01/2053	USD	2,117,155	2,161,814	0.05	
						GRMA 6% 20/02/2053	USD	3,354,109	3,375,543	0.07	
						GRMA 6% 20/05/2053	USD	1,056,117	1,075,811	0.02	
						GRMA 6% 20/05/2053	USD	3,146,167	3,166,273	0.07	
						GRMA 6.5% 20/05/2053	USD	1,782,499	1,844,555	0.04	
						GRMA 5.5% 20/06/2053	USD	2,589,419	2,593,547	0.06	
						GRMA 5.5% 20/06/2053	USD	3,791,342	3,773,955	0.08	
						GRMA 5.5% 20/06/2053	USD	12,034,336	11,979,465	0.26	
						GRMA 6% 20/06/2053	USD	2,209,189	2,250,387	0.05	
						GRMA 6.5% 20/06/2053	USD	2,086,766	2,159,414	0.05	
						GRMA 5.5% 20/07/2053	USD	9,739,193	9,694,786	0.21	
						GRMA 6% 20/08/2053	USD	4,471,508	4,500,288	0.10	
						GRMA, FPN 7.106% 20/03/2072	USD	6,389,825	6,708,225	0.15	
						GRMA, FPN 6.838% 20/04/2072	USD	8,632,621	8,986,268	0.19	
						GRMA, FPN 6.877% 20/04/2072	USD	7,472,864	7,780,346	0.17	
						GRMA, FPN 6.803% 20/05/2072	USD	7,152,992	7,439,409	0.16	
						GRMA, FPN 6.979% 20/07/2072	USD	8,509,159	8,948,571	0.19	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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, Series 2019-44 'A' 3.5% 20/04/2049	USD	2,941,659	2,680,076	0.06		GNMA, FDN, Series 2012-104 'FX' 5.5% 20/02/2060	USD	17,463	17,229	0.00	
GNMA, Series 2009-104 'AB' 7% 18/08/2039	USD	4,670	4,656	0.00		GNMA, FDN, Series 2012-103 'FA' 6.01% 20/09/2062	USD	4,401	4,379	0.00	
GNMA, FDN, Series 2011-109 'AF' 5.93% 20/02/2061	USD	159,361	159,206	0.00		GNMA, FDN, Series 2012-102 'FA' 5.95% 20/10/2062	USD	263,681	263,485	0.01	
GNMA, FO, Series 2006-22 'AO' 0% 20/05/2036	USD	22,263	20,603	0.00		GNMA, Series 2013-101 'FA' 1.65% 20/01/2063	USD	191	170	0.00	
GNMA, FO, Series 2007-28 'AO' 0% 16/06/2037	USD	314,606	295,465	0.01		GNMA, FDN, Series 2012-101 'FA' 5.9% 20/02/2060	USD	114	113	0.00	
GNMA, FO, FDN, Series 2008-35 'AS' 0.24% 20/12/2038	USD	48,796	3,462	0.00		GNMA, FDN, Series 2015-106 'FA' 5.91% 20/02/2065	USD	563,759	563,105	0.01	
GNMA, FO, FDN, Series 2009-106 'AS' 0.95% 16/11/2039	USD	123,279	9,688	0.00		GNMA, FDN, Series 2015-112 'FA' 5.91% 20/05/2065	USD	1,738,612	1,736,950	0.04	
GNMA, FDN, Series 2010-129 'AW' 5.09% 20/04/2037	USD	99,272	100,576	0.00		GNMA, FDN, Series 2015-123 'FB' 5.95% 20/09/2065	USD	928,284	927,730	0.02	
GNMA, Series 2005-12 'AZ' 5.5% 20/09/2035	USD	217,310	217,540	0.00		GNMA, FDN, Series 2014-117 'FC' 5.93% 20/07/2064	USD	289,915	290,041	0.01	
GNMA, FDN, Series 2012-108 'BF' 5.81% 20/02/2063	USD	494,713	491,735	0.01		GNMA, FDN, Series 2015-105 'FC' 5.91% 20/02/2065	USD	1,117,969	1,111,651	0.02	
GNMA, FO, Series 2010-14 'BO' 0% 20/11/2035	USD	54,459	45,891	0.00		GNMA, FDN, Series 2015-103 'FC' 5.91% 20/02/2065	USD	1,899,413	1,897,624	0.04	
GNMA, FDN, Series 2012-121 'CF' 6.13% 20/05/2061	USD	4,541	4,512	0.00		GNMA, FDN, Series 2015-110 'FC' 5.91% 20/04/2065	USD	1,181,896	1,182,494	0.03	
GNMA, FDN 'CF' 6.73% 20/09/2071	USD	5,639,922	5,762,324	0.12		GNMA, FDN, Series 2016-126 'FC' 6.43% 20/12/2066	USD	940,378	941,437	0.02	
GNMA, FO, Series 2010-14 'CO' 0% 20/02/2035	USD	38,372	33,823	0.00		GNMA, FDN, Series 2012-121 'FD' 5.77% 20/12/2062	USD	397,055	395,761	0.01	
GNMA, Series 2010-130 'CP' 7% 16/10/2040	USD	66,525	69,379	0.00		GNMA, FDN, Series 2016-111 'FD' 6.14% 20/05/2066	USD	802,626	802,729	0.02	
GNMA, FDN, Series 2012-121 'DF' 6.03% 20/05/2061	USD	8,098	8,046	0.00		GNMA, FDN, Series 2010-122 'FE' 5.78% 20/05/2059	USD	18,219	18,106	0.00	
GNMA, FDN, Series 2011-109 'DF' 5.99% 20/02/2067	USD	2,715,586	2,715,128	0.06		GNMA, FDN, Series 2012-124 'FG' 5.9% 20/04/2060	USD	2,033	2,008	0.00	
GNMA, FDN, Series 2005-68 'DF' 2.31% 17/06/2025	USD	28,279	28,748	0.00		GNMA, FDN, Series 2015-126 'FG' 5.95% 20/10/2065	USD	599,907	596,701	0.01	
GNMA, FO, FDN, Series 2008-35 'DS' 1.84% 20/12/2038	USD	106,117	2,667	0.00		GNMA, FDN, Series 2015-122 'FH' 6.09% 20/12/2065	USD	634,231	634,952	0.01	
GNMA, FO, FDN, Series 2007-50 'DS' 1.05% 20/09/2037	USD	83,412	8,513	0.00		GNMA, FDN, Series 2016-121 'FH' 6.28% 20/09/2066	USD	3,692,602	3,688,610	0.08	
GNMA, FDN, Series 2015-107 'ES' 5.90% 20/02/2065	USD	473,245	471,753	0.01		GNMA, FDN, Series 2015-115 'FJ' 5.87% 20/06/2065	USD	748,648	747,604	0.02	
GNMA, FDN, Series 2016-123 'F' 6.18% 20/10/2066	USD	1,712,482	1,719,189	0.04		GNMA, FDN, Series 2020-105 'FK' 6.04% 20/03/2070	USD	4,308,546	4,311,060	0.09	
GNMA, FDN, Series 2012-110 'FX' 5.93% 20/12/2061	USD	370,534	370,409	0.01		GNMA, FDN, Series 2015-116 'FL' 5.87% 20/07/2065	USD	1,265,791	1,263,956	0.03	
GNMA, FDN, Series 2012-105 'FX' 5.5% 20/05/2062	USD	26	26	0.00							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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 2016-001 'PQ' 6.12% 20/01/2066	USD	1,788,207	1,791,121	0.04		GNMA, Series 2006-57 'PZ' 5.95% 20/10/2036	USD	388,291	386,592	0.01	
GNMA, FNM, Series 2012-008 'PS' 6.12% 20/04/2062	USD	406,856	407,611	0.01		GNMA, 10, FNM, Series 2006-65 'SK' 1.34% 20/11/2036	USD	52,377	45	0.00	
GNMA, FNM, Series 2011-014 'PV' 5.92% 20/06/2067	USD	2,397,859	2,395,170	0.05		GNMA, 10, FNM, Series 2007-21 'SL' 0.74% 20/05/2037	USD	53,074	1,684	0.00	
GNMA, 10, FNM, Series 2000-000 'UI' 0.54% 20/06/2070	USD	20,580,556	874,777	0.02		GNMA, 10, FNM, Series 2007-16 'SM' 1.07% 20/11/2037	USD	47,159	949	0.00	
GNMA, Series 2017-112 'GZ' 20/07/2047	USD	2,674,520	2,106,029	0.05		GNMA, 10, FNM, Series 2008-40 'SN' 0.95% 16/05/2038	USD	39,846	2,151	0.00	
GNMA, FNM, Series 2012-001 'UA' 5.84% 20/01/2062	USD	166,929	166,574	0.00		GNMA, 10, FNM, Series 2009-10 'SO' 0.45% 20/02/2039	USD	71,675	3,301	0.00	
GNMA, 10, Series 2000-104 'UJ' 20/09/2030	USD	5,194,623	821,896	0.02		GNMA, 10, FNM, Series 2009-22 'SP' 0.81% 20/04/2039	USD	83,446	4,252	0.00	
GNMA, FNM, Series 2012-026 'UJ' 5.93% 20/01/2061	USD	2,517	2,508	0.00		GNMA, 10, FNM, Series 2009-6 'SQ' 0.65% 16/02/2039	USD	30,907	11	0.00	
GNMA, FNM, Series 2012-001 'UJ' 5.75% 20/01/2062	USD	209,008	208,050	0.00		GNMA, 10, FNM, Series 2007-40 'SR' 1.29% 20/01/2037	USD	72,944	3,081	0.00	
GNMA, FNM 'UJ' 6.83% 20/01/2071	USD	5,496,817	5,613,302	0.12		GNMA, 10, FNM, Series 2007-42 'SS' 1.29% 20/01/2037	USD	43,047	4,561	0.00	
GNMA, 10, FNM, Series 2001-11 'UJ' 1.36% 16/04/2037	USD	87,112	6,772	0.00		GNMA, 10, FNM, Series 2007-81 'ST' 1.19% 20/12/2037	USD	121,366	14,161	0.00	
GNMA, FNM, Series 2005-7 'UJ' 4.74% 16/05/2034	USD	209	209	0.00		GNMA, 10, FNM, Series 2009-42 'SU' 0.62% 20/06/2039	USD	73,232	6,181	0.00	
GNMA, 10, FNM, Series 2005-88 'UI' 0.84% 20/09/2035	USD	148,501	11,044	0.00		GNMA, 10, FNM, Series 2006-99 'SV' 1.24% 20/10/2036	USD	55,059	4,835	0.00	
GNMA, Series 2003-70 'UG' 20/08/2033	USD	293,152	289,735	0.01		GNMA, 10, FNM, Series 2007-16 'SW' 0.34% 20/11/2037	USD	122,900	7,860	0.00	
GNMA, FNM, Series 2012-026 'UJ' 5.93% 20/01/2062	USD	2,918	2,899	0.00		GNMA, FNM, Series 2002-61 'SU' 4.61% 16/08/2033	USD	28,735	28,715	0.00	
GNMA, 10, FNM, Series 2001-73 'UI' 0.54% 20/11/2037	USD	95,290	1,432	0.00		GNMA, 10, FNM, Series 2007-36 'SX' 1.02% 16/06/2037	USD	24,828	555	0.00	
GNMA 'UT' 4.5% 20/04/2053	USD	4,837,898	4,622,171	0.10		GNMA, 10, FNM, Series 2004-90 'SI' 0.64% 20/10/2034	USD	101,213	4,598	0.00	
GNMA, 10, Series 2009-14 'UI' 6.5% 20/03/2039	USD	34,354	3,879	0.00		GNMA, 10, FNM, Series 2007-61 'SJ' 1.05% 20/11/2037	USD	49,160	1,081	0.00	
GNMA, 10, FNM, Series 2020-005 2.82% 20/01/2070	USD	10,886,792	321,634	0.01		GNMA, 10, FNM, Series 2007-14 'SL' 1.09% 16/11/2037	USD	83,372	7,090	0.00	
GNMA, FNM, Series 2007-16 'US' 4.18% 20/04/2037	USD	40,282	42,885	0.00		GNMA, 10, FNM, Series 2007-40 'SN' 1.22% 20/01/2037	USD	96,740	10,637	0.00	
GNMA, FO, Series 2009-79 'UK' 16/11/2037	USD	39,469	33,767	0.00		GNMA, 10, FNM, Series 2009-64 'SO' 0.65% 16/01/2039	USD	58,416	2,204	0.00	
GNMA, FO, Series 2010-151 'UQ' 20/12/2040	USD	83,969	70,284	0.00		GNMA, FNM, Series 2005-66 'SQ' 2.68% 16/08/2035	USD	27,554	26,924	0.00	
GNMA, FNM, Series 2012-120 'UT' 1.93% 16/11/2042	USD	253,420	238,131	0.01		GNMA, FNM, Series 2001-53 'SW' 1.84% 16/09/2037	USD	17,822	18,289	0.00	
GNMA, FNM, Series 2000-30 'UT' 4.76% 20/01/2048	USD	4,775,286	4,725,108	0.10							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
GNMA, 10, FOM, Series 2007-19 '51'	USD	63,214	1,398	0.00		GNMA 742178 4.25% 20/07/2040	USD	126,367	119,725	0.00	
1.051% 20/12/2037						GNMA 742196 4.4% 20/07/2040	USD	179,536	170,228	0.00	
GNMA, FOM, Series 2011-001 '1A'	USD	6,675	6,607	0.00		GNMA 742197 4.25% 20/08/2040	USD	1,525,164	1,494,798	0.03	
5.911% 20/01/2063						GNMA 742203 4.25% 20/08/2040	USD	492,340	487,992	0.01	
GNMA, 10, Series 2009-22 '11' 6%	USD	23,046	5,217	0.00		GNMA 742310 4.25% 20/06/2040	USD	331,606	313,517	0.01	
20/05/2039						GNMA 745389 4.25% 20/06/2040	USD	702,325	695,980	0.02	
GNMA, 10, FOM, Series 2009-31 '15'	USD	38,958	517	0.00		GNMA 745410 4.25% 20/08/2040	USD	352,674	331,742	0.01	
0.841% 20/03/2039						GNMA 748766 6.5% 20/01/2039	USD	44,283	45,365	0.00	
GNMA, FOM, Series 2004-94 '15'	USD	42,153	41,848	0.00		GNMA 748803 4.4% 20/06/2040	USD	77,632	73,292	0.00	
1.429% 20/06/2034						GNMA 748951 4.4% 20/06/2040	USD	78,593	74,581	0.00	
GNMA, 10, FOM, Series 2008-76 '15'	USD	135,144	3,354	0.00		GNMA 748952 4.25% 20/09/2040	USD	647,688	630,976	0.01	
0.441% 20/09/2038						GNMA 752636 4.25% 20/09/2040	USD	422,037	399,845	0.01	
GNMA, Series 2018-138 '102' 1.5%	USD	1,504,267	1,386,035	0.03		GNMA 752521 4.25% 20/09/2040	USD	786,067	770,632	0.02	
20/10/2048						GNMA 752597 4% 15/10/2040	USD	356,323	338,951	0.01	
GNMA, FOM, Series 2015-137 'V' 5.375%	USD	449,296	453,544	0.01		GNMA 752598 4.25% 20/09/2040	USD	103,825	98,365	0.00	
20/10/2040						GNMA 752636 4.25% 20/10/2040	USD	187,684	176,883	0.00	
GNMA, FOM, Series 2011-137 'W' 5.5%	USD	591,007	599,084	0.02		GNMA 752667 4.25% 20/09/2040	USD	103,136	97,204	0.00	
20/07/2040						GNMA 752668 4% 15/10/2040	USD	316,079	300,670	0.01	
GNMA, FOM, Series 2011-163 'W'	USD	212,366	215,851	0.00		GNMA 752721 4.25% 20/09/2040	USD	224,869	211,946	0.00	
5.896% 20/12/2038						GNMA 752722 4% 15/11/2040	USD	389,586	370,588	0.01	
GNMA, FOM, Series 2012-023 'W'	USD	126,091	126,000	0.00		GNMA 757076 4.25% 20/10/2040	USD	158,787	149,367	0.00	
5.951% 20/06/2062						GNMA 757125 4.25% 15/09/2040	USD	124,667	118,395	0.00	
GNMA, FOM, Series 2012-141 'W'	USD	407,098	377,890	0.01		GNMA 781328 7% 15/09/2031	USD	37,615	38,965	0.00	
1.722% 20/01/2042						GNMA 781614 7% 15/06/2033	USD	1,741	1,809	0.00	
GNMA, FOM, Series 2015-151 'W'	USD	645,693	639,065	0.01		GNMA 781648 6% 15/06/2033	USD	7,607	7,821	0.00	
4.749% 20/06/2043						GNMA 782615 7% 15/06/2035	USD	41,641	42,982	0.00	
GNMA, 10, FOM, Series 2017-094 '11'	USD	5,267,231	162,397	0.00		GNMA 783123 5.5% 15/04/2033	USD	109,345	113,809	0.00	
1.2% 20/06/2067						GNMA 785389 6% 20/06/2039	USD	109,699	114,238	0.00	
GNMA, FOM, Series 2010-011 '10'	USD	2,196	2,290	0.00		GNMA 783444 5.5% 20/09/2039	USD	91,094	92,535	0.00	
5.144% 20/01/2060						GNMA 784045 4.5% 20/07/2045	USD	400,710	387,777	0.01	
GNMA, Series 2008-33 '2' 6.5%	USD	267,806	274,073	0.01		GNMA AT7628 4% 15/07/2046	USD	2,459,689	2,315,388	0.05	
20/07/2036						GNMA AV7478 4% 15/09/2046	USD	1,295,367	1,219,388	0.03	
GNMA, Series 2003-75 '2A' 6%	USD	511,669	514,067	0.01		GNMA AX6215 4% 15/04/2047	USD	739,672	696,258	0.02	
16/09/2033						GNMA AX6607 4% 15/06/2047	USD	405,921	382,095	0.01	
GNMA 4285 6% 20/11/2038	USD	7,552	7,648	0.00		GNMA AX8715 4% 15/12/2046	USD	1,476,448	1,389,787	0.03	
GNMA 465505 7.5% 15/06/2028	USD	4,852	4,892	0.00		GNMA BA7567 4.5% 20/05/2048	USD	1,544,306	1,471,199	0.03	
GNMA 569568 6.5% 15/01/2032	USD	25,240	25,710	0.00		GNMA BE1604 4.5% 20/09/2048	USD	1,051,384	1,007,813	0.02	
GNMA 591882 6.5% 15/07/2032	USD	2,301	2,367	0.00		GNMA BJ1314 5% 20/06/2049	USD	1,046,711	1,044,887	0.02	
GNMA 607645 6.5% 15/02/2033	USD	2,330	2,392	0.00		GNMA BK7198 4.5% 20/03/2049	USD	1,105,213	1,057,137	0.02	
GNMA 607728 6% 15/03/2033	USD	877	898	0.00		GNMA BM2163 5% 15/07/2049	USD	2,887,234	2,881,763	0.06	
GNMA 611453 7% 15/04/2032	USD	2,779	2,787	0.00		GNMA BM2262 4.5% 20/07/2049	USD	408,858	399,085	0.01	
GNMA 621970 6% 15/02/2034	USD	2,424	2,482	0.00		GNMA BM9691 4.5% 15/07/2049	USD	3,212,624	3,097,817	0.07	
GNMA 742051 4.25% 20/07/2040	USD	500,493	474,181	0.01		GNMA BM9692 4.5% 20/07/2049	USD	3,146,354	3,015,262	0.07	
GNMA 742052 4.4% 20/06/2040	USD	262,915	247,702	0.01		GNMA BM9701 4.5% 20/08/2049	USD	2,790,331	2,665,100	0.06	
GNMA 742147 4.25% 20/07/2040	USD	635,529	626,360	0.01		GNMA BM9713 4.5% 20/09/2049	USD	2,037,204	1,954,065	0.04	
GNMA 742155 4.25% 20/07/2040	USD	608,346	570,979	0.01		GNMA BM9734 4% 20/10/2049	USD	2,520,897	2,372,739	0.05	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
GNMA BX3949 5.5% 20/07/2049	USD	1,787,945	1,806,208	0.04		GSX Mortgage Loan Trust, Series 2004-0F '2A4' 6.5% 25/05/2024	USD	44,531	44,434	0.00	
GNMA B03248 4.5% 20/08/2049	USD	4,452,269	4,317,597	0.09		GP Acquisition Partners LLC, 144A 3.48% 15/06/2050	USD	225,000	220,505	0.01	
GNMA B08204 4.5% 20/09/2049	USD	2,778,716	2,653,948	0.06		Guardian Life Insurance Co. of America (The), 144A 4.8% 26/01/2027	USD	250,000	213,715	0.00	
GNMA BP7143 4.5% 20/09/2049	USD	1,540,635	1,477,398	0.03		Hakensack Meridian Health, Inc. 2.875% 01/09/2050	USD	2,000,000	1,336,268	0.03	
GNMA BS7412 4.5% 15/04/2050	USD	2,128,169	2,070,496	0.05		Haleon US Capital LLC 3.375% 24/03/2029	USD	1,970,000	1,836,769	0.04	
GNMA BS7592 4.5% 20/03/2050	USD	666,523	640,299	0.01		Harover Insurance Group, Inc. (The) 2.5% 01/09/2050	USD	1,420,000	1,202,904	0.03	
GNMA BT0093 3.5% 20/04/2050	USD	11,306,158	10,182,005	0.22		Hartford HealthCare Corp. 3.441% 01/07/2054	USD	2,680,000	1,954,810	0.04	
GNMA BU7638 2.5% 20/09/2050	USD	5,395,787	4,621,005	0.10		HCA, Inc. 4.125% 15/06/2029	USD	380,000	361,305	0.01	
GNMA BU7669 3% 20/07/2050	USD	5,173,745	4,536,673	0.10		HCA, Inc. 5.125% 15/06/2039	USD	1,095,000	1,025,124	0.02	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FPN 1.431% 09/01/2027	USD	5,790,000	5,409,528	0.12		Healthcare Realty Holdings LP, REIT 3.1% 15/02/2030	USD	1,161,000	1,020,126	0.02	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FPN 1.948% 21/10/2027	USD	1,365,000	1,262,198	0.03		Healthcare Realty Holdings LP, REIT 2% 15/02/2031	USD	1,540,000	1,221,682	0.03	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FPN 2.04% 24/02/2028	USD	2,292,000	2,141,509	0.05		Healthpeak CP, LLC, REIT 3.5% 15/07/2029	USD	1,334,000	1,238,205	0.03	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FPN 3.051% 05/06/2028	USD	4,090,000	3,920,733	0.09		HECO Funding Trust, Series 2016-2A 'A1', 144A 3.08% 20/09/2042	USD	175,054	157,073	0.00	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FPN 6.404% 24/10/2029	USD	3,000,000	3,142,540	0.07		HECO Funding Trust, Series 2016-4A 'A1', 144A 3.57% 20/09/2047	USD	833,041	756,070	0.02	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FPN 2.303% 21/07/2032	USD	975,000	805,855	0.02		HF Sinclair Corp. 5.875% 01/04/2026	USD	1,960,000	1,966,380	0.04	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FPN 4.411% 23/04/2039	USD	2,300,000	2,055,705	0.04		Hilton Grand Vacations Trust 'B', 144A 3.7% 24/02/2032	USD	1,085,792	1,066,230	0.02	
Goodwin Trust, Series 2007-1A 'K', 144A 3.74% 15/10/2052	USD	534,704	484,097	0.01		Honeywell International, Inc. 5.25% 01/01/2034	USD	2,420,000	2,382,404	0.05	
Goodwin Trust, Series 2007-2A 'K', 144A 3.26% 15/10/2053	USD	1,582,365	1,415,861	0.03		Huntington Bank Auto Credit-Linked Notes 'B1', 144A 6.15% 20/05/2032	USD	10,500,000	10,538,603	0.23	
Goodman US Finance Trust LLC, REIT, 144A 3.7% 15/05/2028	USD	431,000	405,417	0.01		Hyundai Capital America, 144A 5.8% 25/06/2025	USD	12,200,000	12,222,697	0.26	
Graphic Packaging International LLC, 144A 1.52% 15/04/2026	USD	2,710,000	2,514,179	0.05		Hyundai Capital America, 144A 1.8% 15/10/2025	USD	1,340,000	1,277,871	0.03	
Gray Oak Pipeline LLC, 144A 2.6% 15/10/2025	USD	3,150,000	3,026,924	0.07		Hyundai Capital America, 144A 1.3% 09/01/2026	USD	1,005,000	944,134	0.02	
GSMS Mortgage Loan Trust, FPN, Series 2004-4 '1AF', 144A 5.86% 25/06/2024	USD	52,051	45,793	0.00		Hyundai Capital America, 144A 1.5% 15/09/2026	USD	1,005,000	932,391	0.02	
GSMS Mortgage Loan Trust, FPN, Series 2005-021 '1AF', 144A 5.81% 25/01/2035	USD	20,994	17,777	0.00		Hyundai Capital America, 144A 5.6% 26/09/2026	USD	11,187,000	11,227,860	0.24	
GSMS Mortgage Loan Trust, FPN, Series 2005-022 '1AF', 144A 5.81% 25/03/2035	USD	82,705	75,219	0.00		Hyundai Capital America, 144A 3% 10/02/2027	USD	605,000	571,921	0.01	
GSMS Mortgage Loan Trust, II, FPN, Series 2006-020 '1G2', 144A 0.96% 25/04/2036	USD	372,962	17,193	0.00		Hyundai Capital America, 144A 2.37% 15/10/2027	USD	1,330,000	1,216,497	0.03	
GSX Mortgage Loan Trust, Series 2002-7F '1A4' 5.2% 25/06/2032	USD	84,623	83,106	0.00							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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(%)	
Hyundai Capital America, 144A 1.25% 10/01/2028	USD	1,940,000	1,724,627	0.04		Liberty Mutual Group, Inc., 144A 2.951% 15/10/2050	USD	1,120,000	826,622	0.02	
Impac Secured Assets OREX Owner Trust, Series 2003-2 'A1' 5.5% 25/02/2031	USD	19,891	15,157	0.00		Liberty Mutual Insurance Co., 144A 8.5% 15/06/2025	USD	400,000	408,041	0.01	
Independence Plaza Trust, Series 2018-INDP 'A', 144A 2.762% 10/01/2035	USD	3,660,000	3,498,065	0.08		US International Finance III LLC 1.25% 01/10/2025	USD	766,000	725,595	0.02	
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust, FNM, Series 2004-AXI 'A1' 6.34% 25/09/2034	USD	1,885	1,598	0.00		Manco Corp. 2% 01/10/2030	USD	840,000	695,650	0.02	
Intel Corp. 5.7% 10/02/2053	USD	2,941,000	2,932,575	0.06		Massachusetts Electric Co., 144A 4.04% 15/08/2046	USD	483,000	373,605	0.01	
ITC Holdings Corp., 144A 4.95% 22/09/2027	USD	2,715,000	2,696,432	0.06		WSTR Adjustable Rate Mortgages Trust, FNM, Series 2004-13 'M1' 6.41% 21/04/2024	USD	37,552	35,527	0.00	
ITC Holdings Corp., 144A 2.95% 14/05/2030	USD	910,000	895,476	0.02		WSTR Adjustable Rate Mortgages Trust, FNM, Series 2004-13 'M1' 5.99% 21/11/2034	USD	108,470	100,846	0.00	
ITC Holdings Corp., 144A 5.85% 09/05/2034	USD	1,310,000	1,321,571	0.03		WSTR Adjustable Rate Mortgages Trust, FNM, Series 2004-3 'M1' 4.57% 26/04/2024	USD	6,264	5,500	0.00	
J.P. Morgan Mortgage Trust, FNM, Series 2004-M 'M1' 7.86% 25/09/2024	USD	2,979	2,761	0.00		WSTR Alternative Loan Trust 'M1' 4.5% 25/09/2022	USD	236	226	0.00	
J.P. Morgan Mortgage Trust, FNM, Series 2004-A3 'M1' 7.63% 25/07/2024	USD	1,325	1,290	0.00		WSTR Alternative Loan Trust, Series 2004-4 'M1' 5.5% 25/09/2024	USD	37,386	35,670	0.00	
J.P. Morgan Mortgage Trust, FNM, Series 2005-K2 'M1' 6.99% 25/09/2024	USD	12,651	12,599	0.00		WSTR Alternative Loan Trust, Series 2005-6 'M1' 5.5% 25/12/2025	USD	13,385	9,465	0.00	
J.P. Morgan Mortgage Trust, FNM, Series 2005-K2 'M1' 6.88% 25/11/2023	USD	21,286	20,349	0.00		WSTR Alternative Loan Trust, Series 2004-6 'M1' 6% 25/07/2024	USD	22,416	21,294	0.00	
Jersey Central Power & Light Co., 144A 4.2% 15/01/2026	USD	460,000	452,220	0.01		WSTR Alternative Loan Trust 'M1' 5.5% 25/04/2026	USD	26,534	11,985	0.00	
Keurig Dr Pepper, Inc. 3.43% 15/06/2027	USD	450,000	430,067	0.01		WSTR Asset Securitisation Trust, Series 2004-4 'M6' 5.25% 25/12/2023	USD	23,678	22,079	0.00	
Keurig Dr. Pepper, Inc. 3.2% 01/05/2030	USD	1,500,000	1,368,278	0.03		WSTR Reperting Loan Trust, FNM, Series 2005-2 'M1F', 144A 5.81% 25/05/2035	USD	262,840	133,801	0.00	
KeyCorp, FNM 4.78% 01/06/2023	USD	400,000	367,411	0.01		WSTR Seasoned Securitisation Trust, FNM, Series 2004-2 'M1' 6.5% 25/09/2022	USD	22,933	21,798	0.00	
KeySpan Gas East Corp., 144A 2.74% 15/08/2026	USD	448,000	423,093	0.01		WSTR Seasoned Securitisation Trust, FNM, Series 2004-2 'M2' 6.5% 25/09/2022	USD	74,149	70,902	0.00	
Kinder Morgan, Inc. 5% 01/02/2029	USD	2,524,000	2,504,594	0.05		McKesson Corp. 5.1% 15/07/2033	USD	1,540,000	1,547,492	0.03	
KLA Corp. 3.3% 01/03/2050	USD	1,000,000	716,885	0.02		Mead Johnson Nutrition Co. 5.9% 01/11/2039	USD	50,000	51,693	0.00	
Kraft Heinz Foods Co. 4.625% 01/10/2029	USD	1,600,000	1,433,617	0.03		Mead Johnson Nutrition Co. 4.8% 01/06/2044	USD	500,000	440,695	0.01	
Kraft Heinz Foods Co. 4.375% 01/06/2046	USD	1,158,000	960,612	0.02		Memorial Health Services 1.447% 01/11/2048	USD	2,440,000	1,843,252	0.04	
Kroger Co. (The) 2.2% 01/05/2030	USD	3,500,000	2,992,526	0.06							
Lahara Mortgage Trust, Series 2002-2 'M6' 6% 25/01/2028	USD	211,111	63,557	0.00							
Liberty Mutual Group, Inc., 144A 4.56% 01/02/2029	USD	258,000	252,293	0.01							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
Memorial Sloan-Kettering Cancer Center 4.2% 01/01/2055	USD	394,000	282,221	0.01		Nasdaq, Inc. 5.35% 28/06/2028	USD	4,920,000	4,979,854	0.11	
Merck & Co., Inc. 5.15% 11/05/2063	USD	1,370,000	1,323,888	0.03		Nasdaq, Inc. 5.55% 15/02/2034	USD	1,095,000	1,104,592	0.02	
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust, FIM, Series 2004-04 '31' 7.32% 26/07/2033	USD	15,531	14,359	0.00		Netowide Children's Hospital, Inc. 4.59% 01/11/2032	USD	451,000	413,171	0.01	
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust, FIM, Series 2004-1 '31' 5.37% 26/12/2034	USD	55,665	51,413	0.00		Nevada Power Co. 3.7% 01/05/2019	USD	1,600,000	1,514,525	0.03	
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust, FIM, Series 2004-04 '32' 5.50% 26/08/2034	USD	28,131	26,052	0.00		New York and Presbyterian Hospital (The) 2.00% 01/08/2030	USD	1,330,000	772,861	0.02	
Meta Platforms, Inc. 5.8% 19/09/2033	USD	3,000,000	3,110,473	0.07		New York Life Global Funding, 144A 2.35% 14/07/2036	USD	503,000	476,694	0.01	
Metropolitan Life Global Funding I, 144A 3% 19/09/2027	USD	1,100,000	1,032,934	0.02		New York Life Insurance Co., 144A 4.45% 15/05/2039	USD	1,040,000	850,311	0.02	
Microsoft Corp. 3.041% 11/01/2062	USD	536,000	361,321	0.01		New York State Dormitory Authority 5.6% 15/02/2040	USD	175,000	177,978	0.00	
Mid-America Apartments LP, REIT 1.7% 15/02/2031	USD	1,470,000	1,187,807	0.03		Newsom Corp., 144A 3.25% 13/05/2030	USD	955,000	866,924	0.02	
Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC, 144A 4.2% 15/05/2033	USD	410,000	395,262	0.01		NGPL PipeCo LLC, 144A 3.25% 15/07/2031	USD	1,755,000	1,508,490	0.03	
Mitsubishi BC Finance America LLC, 144A 5.80% 12/09/2033	USD	595,000	606,615	0.01		Niagara Mohawk Power Corp., 144A 1.96% 27/06/2030	USD	2,250,000	1,880,979	0.04	
Morgan Stanley, FRN 2.475% 21/01/2028	USD	364,000	346,622	0.01		NiSource, Inc. 2.93% 01/09/2029	USD	615,000	555,027	0.01	
Morgan Stanley, FRN 5.123% 01/02/2029	USD	1,710,000	1,708,074	0.04		NiSource, Inc. 1.7% 15/02/2031	USD	1,830,000	1,465,942	0.03	
Morgan Stanley, FRN 5.164% 30/04/2029	USD	3,860,000	3,859,552	0.08		NN REIT, Inc., REIT 4% 15/11/2015	USD	583,000	571,538	0.01	
Morgan Stanley, FRN 5.449% 30/07/2029	USD	2,630,000	2,654,542	0.06		Nowva Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2000-A1 'A1' 5.5% 25/05/2033	USD	304	196	0.00	
Morgan Stanley, FRN 5.424% 21/07/2034	USD	1,795,000	1,801,059	0.04		Nowva Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2000-A1 'A2' 6% 25/09/2033	USD	701	681	0.00	
Morgan Stanley, FRN 3.971% 22/07/2038	USD	1,000,000	854,947	0.02		Nowva Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2000-A1 'A5' 7% 25/04/2033	USD	1,667	1,626	0.00	
Morgan Stanley, FRN 3.217% 22/04/2042	USD	2,000,000	1,518,964	0.03		Norfolk Southern Corp. 4.05% 15/08/2052	USD	1,273,000	995,176	0.02	
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, FIM, Series 2004-3 '4A' 5.64% 25/04/2034	USD	77,743	75,854	0.00		Northern States Power Co. 5.1% 15/05/2053	USD	1,690,000	1,582,864	0.03	
Mount Sinai Hospital (The) 3.981% 01/01/2048	USD	366,000	288,133	0.01		Northern Trust Corp., FRN 3.375% 02/05/2012	USD	823,000	778,695	0.02	
MultiCare Health System 2.800% 15/08/2050	USD	1,115,000	689,299	0.02		Northwestern Mutual Global Funding, 144A 1.7% 01/05/2038	USD	1,685,000	1,490,475	0.03	
Mutual of Omaha Cos. Global Funding, 144A 5.8% 27/07/2035	USD	2,400,000	2,416,602	0.05		Northwestern Mutual Global Funding, 144A 5.16% 29/05/2031	USD	4,000,000	4,029,992	0.09	
MyMichigan Health 3.409% 01/06/2050	USD	780,000	558,529	0.01		NRG Energy, Inc., 144A 2% 02/12/2025	USD	1,770,000	1,676,783	0.04	
						NRG Energy, Inc., 144A 2.45% 02/12/2027	USD	1,975,000	1,787,289	0.04	
						NRG Energy, Inc., 144A 4.45% 15/06/2029	USD	1,880,000	1,023,607	0.02	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
NEZ Excess Spread-Collateralized Notes, Series 2021-FN2 'A' 3.22% 25/05/2026	USD	3,234,693	3,063,288	0.07		PECO Energy Co. 2.8% 15/08/2050	USD	900,000	573,855	0.01	
NEZ Excess Spread-Collateralized Notes, Series 2021-ONT1 'A', 144A 3.47% 25/11/2026	USD	2,259,657	2,111,039	0.05		Penske Truck Leasing Co. LP, 144A 5.75% 24/05/2036	USD	11,500,000	11,545,191	0.25	
NYU Langone Hospitals 3.38% 01/07/2055	USD	1,010,000	714,837	0.02		Penske Truck Leasing Co. LP, 144A 3.4% 15/11/2036	USD	177,000	169,222	0.00	
OGE Energy Corp. 5.45% 15/05/2029	USD	720,000	727,986	0.02		Penske Truck Leasing Co. LP, 144A 6.05% 01/08/2038	USD	3,300,000	3,390,746	0.07	
Ohio Power Co. 6.8% 01/03/2033	USD	340,000	256,407	0.01		Pepco Holdings LLC 7.4% 15/08/2032	USD	174,000	188,956	0.00	
Ohio State University (The) 4.8% 01/06/2111	USD	716,000	656,159	0.01		Pepperdine University 3.301% 01/12/2059	USD	1,170,000	764,677	0.02	
Omex Electric Delivery Co. LLC 5.75% 15/02/2029	USD	150,000	155,153	0.00		PNE Wildfire Recovery Funding LLC 4.26% 01/06/2038	USD	815,000	759,669	0.02	
Omex Electric Delivery Co. LLC 3.5% 15/09/2049	USD	1,990,000	1,347,952	0.03		PNE Wildfire Recovery Funding LLC 4.37% 03/06/2041	USD	465,000	432,387	0.01	
Omex Electric Delivery Co. LLC 5.35% 01/10/2032	USD	295,000	287,771	0.01		PNE Wildfire Recovery Funding LLC 5.21% 01/12/2049	USD	10,000,000	9,836,465	0.21	
ONE Gas, Inc. 2% 15/05/2030	USD	2,060,000	1,753,677	0.04		Phillips 66 Co. 1.55% 01/10/2036	USD	147,000	142,113	0.00	
Oracle Corp. 4.9% 06/02/2033	USD	2,450,000	2,394,008	0.05		Phillips 66 Co. 1.15% 15/12/2039	USD	1,130,000	1,027,200	0.02	
Oracle Corp. 5.55% 06/02/2053	USD	1,730,000	1,663,776	0.04		Phillips 66 Co. 4.9% 01/10/2046	USD	1,006,000	902,342	0.02	
O'Reilly Automotive, Inc. 1.6% 01/09/2037	USD	556,000	531,316	0.01		Piedmont Natural Gas Co., Inc. 3.5% 01/06/2029	USD	1,550,000	1,440,354	0.03	
Otis Worldwide Corp. 2.56% 15/02/2030	USD	2,750,000	2,424,827	0.05		Pioneer Natural Resources Co. 1.5% 15/09/2030	USD	2,580,000	2,170,968	0.05	
Pacific Gas and Electric Co. 3.45% 01/07/2025	USD	1,535,000	1,501,543	0.03		PNC Financial Services Group, Inc. (The), FNM 5.06% 24/01/2034	USD	2,879,000	2,802,973	0.06	
Pacific Gas and Electric Co. 6.1% 15/01/2029	USD	6,560,000	6,738,066	0.15		Port Authority of New York & New Jersey 5.64% 01/11/2040	USD	285,000	298,772	0.01	
Pacific Gas and Electric Co. 6.4% 15/06/2031	USD	2,766,000	2,878,956	0.06		Port Authority of New York & New Jersey 5.64% 01/11/2040	USD	650,000	681,409	0.01	
Pacific Gas and Electric Co. 5.8% 15/05/2034	USD	3,740,000	3,745,469	0.08		Port Authority of New York & New Jersey 4.45% 01/10/2062	USD	1,330,000	1,175,046	0.03	
Pacific Life Global Funding II, 144A 5.5% 28/09/2036	USD	2,325,000	2,342,181	0.05		Potomac Electric Power Co. 6.5% 15/11/2037	USD	200,000	222,342	0.01	
Pacific Life Global Funding II, 144A 5.5% 28/01/2038	USD	3,700,000	3,763,349	0.08		Precision Castparts Corp. 4.2% 15/08/2035	USD	250,000	239,082	0.01	
Pacific Life Insurance Co., FNM, 144A 4.5% 24/10/2067	USD	637,000	490,227	0.01		Principal Life Global Funding II, 144A 1.2% 23/09/2025	USD	1,100,000	1,056,285	0.02	
Packaging Corp. of America 4.05% 15/12/2049	USD	1,585,000	1,251,798	0.03		Principal Life Global Funding II, 144A 5.5% 28/06/2038	USD	8,500,000	8,559,983	0.19	
Paramount Global 2.9% 15/01/2027	USD	394,000	364,383	0.01		Prologis LP, REIT 2.87% 15/11/2029	USD	830,000	749,882	0.02	
Paramount Global 4.85% 01/07/2042	USD	150,000	108,756	0.00		Providence St. Joseph Health Obligated Group 2.74% 01/10/2036	USD	280,000	264,008	0.01	
Pedtree Commers Funding Trust, 144A 3.9% 15/02/2025	USD	2,203,000	2,171,633	0.05		Prudential Insurance Co. of America (The), 144A 8.3% 01/07/2025	USD	1,350,000	1,379,963	0.03	
						Public Service Co. of Colorado 6.5% 01/09/2038	USD	135,000	147,523	0.00	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)	割合(%)					割合(%)	割合(%)
Public Service Co. of Oklahoma 6.625% 15/11/2037	USD	300,000	325,883	0.01		Sigco Securitization I LLC 5.00% 15/11/2038	USD	2,128,362	2,120,437	0.05	
Puget Sound Energy, Inc. 5.449% 01/06/2052	USD	1,235,000	1,206,209	0.03		Sigco Securitization I LLC 5.17% 15/09/2043	USD	354,000	352,419	0.01	
RMP Trust, Series 2004-32 'A' 7% 25/10/2031	USD	71,209	70,416	0.00		Simon Property Group LP, REIT 3.25% 12/09/2049	USD	1,518,000	1,033,942	0.02	
Raycom Country Securitization LLC, 144A 3.35% 01/12/2031	USD	5,905,000	4,301,767	0.09		Smithfield Foods, Inc., 144A 5.2% 01/04/2029	USD	1,600,000	1,558,065	0.03	
Realty Income Corp., REIT 4.85% 15/03/2030	USD	2,160,000	2,126,806	0.05		Southern California Edison Co. 5.7% 15/04/2054	USD	3,510,000	3,497,622	0.08	
Regency Centers LP, REIT 2.95% 15/09/2029	USD	1,305,000	1,176,202	0.03		Southern California Gas Co. 2.55% 01/02/2030	USD	2,260,000	1,977,272	0.04	
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 1.7% 15/09/2030	USD	3,100,000	2,565,233	0.06		Southern Co. (The) 5.5% 15/01/2029	USD	4,440,000	4,514,534	0.10	
Regents of the University of California Medical Center Pooled 3.70% 15/05/2120	USD	2,540,000	1,718,173	0.04		Southern Co. (The) 5.7% 15/01/2034	USD	1,690,000	1,729,414	0.04	
Reliance, Inc. 2.1% 15/01/2030	USD	3,330,000	2,805,556	0.06		Southwest Gas Corp. 3.7% 29/09/2046	USD	442,000	331,137	0.01	
Roper Technologies, Inc. 4.2% 15/09/2028	USD	450,000	436,748	0.01		Southwestern Electric Power Co. 2.7% 09/10/2026	USD	500,000	472,850	0.01	
RRE Finance US LLC, 144A 5.875% 16/04/2034	USD	2,865,000	2,889,279	0.06		Spirit Airlines Pass-Through Trust, Series AA 3.37% 15/03/2031	USD	514,694	456,825	0.01	
S&P Global, Inc. 2.9% 01/01/2032	USD	1,450,000	1,262,633	0.03		Sprint Capital Corp. 6.87% 15/11/2028	USD	6,743,000	7,170,547	0.16	
Sabra Real Estate Care LP, REIT 3.2% 01/12/2031	USD	1,685,000	1,410,065	0.03		Steel Dynamics, Inc. 1.6% 15/10/2027	USD	1,519,000	1,357,726	0.03	
Santander Bank Auto Credit-Linked Notes 'C', 144A 5.31% 15/09/2032	USD	1,250,000	1,252,427	0.03		Stellantis Finance US, Inc., 144A 2.69% 15/09/2031	USD	1,547,000	1,287,813	0.03	
Santander Bank Auto Credit-Linked Notes 'U', 144A 6.1% 15/09/2032	USD	1,000,000	1,001,053	0.02		Structured Asset Mortgage Investments II Trust, RM, Series 2004-405 'M1' 6.11% 19/10/2034	USD	62,572	57,833	0.00	
Santander Holdings USA, Inc., FOM 6.11% 09/01/2030	USD	3,170,000	3,203,970	0.07		Structured Asset Mortgage Investments II Trust, RM, Series 2005-425 'A1' 5.93% 19/07/2035	USD	128,712	119,973	0.00	
SCE Recovery Funding LLC 2.51% 15/11/2043	USD	1,140,000	784,427	0.02		Structured Asset Securities Corp., FOM, Series 2007-040 '30' 5.91% 26/11/2031	USD	43,494	42,609	0.00	
Schlumberger Holdings Corp., 144A 2.9% 17/05/2030	USD	455,000	435,855	0.01		Structured Asset Securities Corp., Series 2008-461 '30' 3.4% 25/02/2032	USD	18,351	6,606	0.00	
Seasoned Loans Structured Transaction, Series 2009-1 'A1' 3.5% 25/06/2038	USD	2,085,309	1,964,973	0.04		Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A 4.9% 15/09/2044	USD	400,000	358,947	0.01	
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust, STP, Series 2006-021 'B1' 5.79% 26/01/2036	USD	25,773	20,829	0.00		Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A 4.2% 15/09/2047	USD	800,000	647,480	0.01	
Sequoia Mortgage Trust, FOM, Series 10 'M' 6.25% 20/10/2027	USD	22,065	21,263	0.00		Tennessee Valley Authority 0% 01/11/2025	USD	1,150,000	1,079,115	0.02	
Sequoia Mortgage Trust, FOM, Series 2003-1 'M' 6.21% 20/04/2033	USD	37,249	34,940	0.00		Tennessee Valley Authority 0% 15/03/2032	USD	800,000	556,145	0.01	
Sequoia Mortgage Trust, FOM, Series 2004-12 'A1' 6.03% 20/01/2035	USD	26,771	25,633	0.00		Tennessee Valley Authority 0% 15/06/2035	USD	2,800,000	1,161,340	0.03	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
Texas Eastern Transmission LP, 144A 3.3% 15/01/2038	USD	90,000	85,207	0.00		UMBS 5% 01/06/2053	USD	1,308,095	1,277,362	0.03	
Texas Health Resources 2.328% 15/11/2050	USD	1,260,000	744,431	0.02		UMBS 5% 01/06/2053	USD	4,368,183	4,250,537	0.09	
Texas Health Resources 4.33% 15/11/2055	USD	700,000	603,329	0.01		UMBS 5% 01/06/2053	USD	6,431,330	6,264,387	0.14	
Texas Instruments, Inc. 5.05% 18/05/2063	USD	2,280,000	2,146,059	0.05		UMBS 5% 01/06/2053	USD	13,887,042	13,490,304	0.29	
Thermo Fisher Scientific, Inc. 2.3% 15/10/2041	USD	805,000	580,846	0.01		UMBS 5.5% 01/06/2053	USD	3,280,434	3,254,693	0.07	
Time Warner Cable LLC 6.55% 01/05/2037	USD	400,000	382,139	0.01		UMBS 255843 5.5% 01/09/2035	USD	28,199	28,405	0.00	
Time Warner Cable LLC 6.75% 15/06/2039	USD	1,560,000	1,521,889	0.03		UMBS 257055 6.5% 01/12/2027	USD	9,423	9,609	0.00	
T-Mobile USA, Inc. 3.75% 15/04/2027	USD	2,000,000	1,925,416	0.04		UMBS 257510 7% 01/12/2038	USD	48,274	50,433	0.00	
T-Mobile USA, Inc. 3.8% 15/04/2030	USD	8,485,000	7,964,180	0.17		UMBS 357639 5.5% 01/11/2034	USD	1,075	1,083	0.00	
T-Mobile USA, Inc. 5.15% 15/04/2034	USD	1,755,000	1,738,090	0.04		UMBS 598559 6.5% 01/08/2031	USD	2,894	2,951	0.00	
T-Mobile USA, Inc. 5.3% 15/04/2035	USD	1,345,000	1,319,158	0.03		UMBS 602589 7% 01/09/2031	USD	10,514	10,817	0.00	
Trust Financial Corp., FOM 6.04% 08/06/2027	USD	1,935,000	1,951,396	0.04		UMBS 622543 5.5% 01/09/2031	USD	73,759	68,022	0.00	
Trust Financial Corp., FOM 7.16% 30/10/2029	USD	2,660,000	2,833,774	0.06		UMBS 674349 6% 01/03/2033	USD	72,471	73,190	0.00	
Trust Financial Corp., FOM 5.122% 26/01/2034	USD	1,450,000	1,397,800	0.03		UMBS 689977 6% 01/03/2027	USD	854	865	0.00	
UDR, Inc., REIT 3% 15/08/2031	USD	460,000	400,630	0.01		UMBS 689977 6% 01/03/2027	USD	3,230	3,252	0.00	
UDR, Inc., REIT 2.1% 01/08/2032	USD	1,520,000	1,200,497	0.03		UMBS 695533 6% 01/06/2027	USD	2,014	2,032	0.00	
UMBS 4% 01/06/2048	USD	3,079,149	2,877,091	0.06		UMBS 725704 6% 01/06/2034	USD	1,857	1,894	0.00	
UMBS 2.5% 01/05/2050	USD	7,368,778	6,887,791	0.13		UMBS 745148 5% 01/01/2036	USD	23,114	22,960	0.00	
UMBS 2.5% 01/07/2050	USD	13,149,845	10,839,180	0.23		UMBS 745418 5.5% 01/04/2036	USD	29,955	30,174	0.00	
UMBS 2.5% 01/10/2051	USD	7,740,024	6,394,878	0.14		UMBS 755973 6% 01/11/2028	USD	7,201	7,340	0.00	
UMBS 2.5% 01/10/2051	USD	11,783,678	9,913,711	0.21		UMBS 755994 6% 01/10/2028	USD	743	742	0.00	
UMBS 2.5% 01/11/2051	USD	3,239,461	2,692,158	0.06		UMBS 775902 8.5% 01/04/2030	USD	16,425	16,882	0.00	
UMBS 3% 01/11/2051	USD	8,768,265	7,574,315	0.16		UMBS 788150 6% 01/03/2032	USD	8,529	8,669	0.00	
UMBS 2.5% 01/12/2051	USD	16,786,811	13,966,450	0.30		UMBS 870770 6.5% 01/07/2036	USD	15,874	16,560	0.00	
UMBS 2.5% 01/01/2052	USD	6,747,248	5,581,876	0.12		UMBS 888892 7.5% 01/11/2037	USD	44,176	47,137	0.00	
UMBS 3% 01/01/2052	USD	6,368,247	5,467,657	0.12		UMBS 889519 5.5% 01/12/2035	USD	36,784	37,054	0.00	
UMBS 2.5% 01/02/2052	USD	18,180,373	15,041,660	0.33		UMBS 889757 5% 01/02/2038	USD	25,939	26,372	0.00	
UMBS 3% 01/04/2052	USD	12,867,721	11,064,933	0.24		UMBS 929560 7% 01/06/2038	USD	27,462	28,261	0.00	
UMBS 4% 01/05/2052	USD	6,227,459	5,745,031	0.12		UMBS 945870 6.5% 01/08/2037	USD	23,462	24,230	0.00	
UMBS 5% 01/07/2052	USD	7,402,214	7,208,815	0.16		UMBS 946338 7% 01/09/2037	USD	41,942	43,163	0.00	
UMBS 4% 01/09/2052	USD	10,944,122	10,095,092	0.22		UMBS 960150 6% 01/11/2037	USD	8,077	8,221	0.00	
UMBS 4% 01/10/2052	USD	10,044,707	9,265,595	0.20		UMBS 976871 6.5% 01/08/2036	USD	87,157	88,891	0.00	
UMBS 4% 01/12/2052	USD	2,171,055	2,004,880	0.04		UMBS 995149 6.5% 01/10/2038	USD	50,456	51,459	0.00	
UMBS 4.5% 01/12/2052	USD	7,257,816	6,909,277	0.15		UMBS 995505 6% 01/01/2038	USD	15,567	15,900	0.00	
UMBS 5% 01/03/2053	USD	7,229,305	7,052,675	0.15		UMBS AA0922 6% 01/09/2036	USD	57,009	58,263	0.00	
						UMBS AA1019 6% 01/11/2036	USD	38,348	39,305	0.00	
						UMBS AB9551 3% 01/06/2043	USD	1,380,902	1,226,254	0.03	
						UMBS AC3407 5.5% 01/10/2039	USD	25,345	25,469	0.00	
						UMBS AD0133 5% 01/06/2024	USD	22	22	0.00	
						UMBS AD0753 7% 01/01/2039	USD	45,732	47,475	0.00	
						UMBS AD0755 7% 01/06/2035	USD	2,288,013	2,356,046	0.05	
						UMBS B3H683 4% 01/06/2047	USD	993,983	936,759	0.02	
						UMBS B3H684 4% 01/06/2047	USD	1,516,449	1,425,564	0.03	
						UMBS B3H685 4% 01/06/2047	USD	1,708,349	1,628,889	0.04	
						UMBS B3H663 4% 01/10/2047	USD	2,859,381	2,705,478	0.06	
						UMBS BX0319 4.5% 01/03/2049	USD	467,254	451,363	0.01	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/償面金額	時価(米ドル)	純資産に占める	
				割合(%)						割合(%)	
UMBS BX8753 4.5% 01/06/2049	USD	1,217,434	1,166,281	0.03		United Airlines Pass-Through Trust, Series A 3.7% 01/09/2031	USD	2,623,114	2,382,981	0.05	
UMBS BX9929 4.5% 01/09/2048	USD	3,515,934	3,362,082	0.07		United Airlines Pass-Through Trust, Series A 4.5% 25/02/2033	USD	1,057,350	956,902	0.02	
UMBS BM1213 4% 01/04/2047	USD	3,149,437	2,979,097	0.06		United Airlines Pass-Through Trust, Series AA 2.87% 07/04/2030	USD	893,031	817,089	0.02	
UMBS BM3254 4% 01/01/2038	USD	1,928,547	1,853,227	0.04		United Airlines Pass-Through Trust, Series AA 3.9% 01/09/2031	USD	2,049,262	1,897,350	0.04	
UMBS BM3566 4% 01/02/2038	USD	2,440,049	2,353,426	0.05		United Airlines Pass-Through Trust, Series AA 4.15% 25/02/2033	USD	1,182,440	1,108,159	0.02	
UMBS BM4430 5% 01/01/2049	USD	2,895,542	2,671,471	0.06		United Airlines Pass-Through Trust, Series AA 2.7% 01/11/2033	USD	1,885,740	1,632,410	0.04	
UMBS BM5889 5% 01/02/2049	USD	762,792	749,954	0.02		United Airlines Pass-Through Trust, Series B 4.6% 01/09/2027	USD	687,092	671,358	0.01	
UMBS BM9169 4.5% 01/04/2049	USD	667,001	639,923	0.01		UnitedHealthGroup, Inc. 3.5% 15/08/2039	USD	1,495,000	1,222,863	0.03	
UMBS BQ2504 5% 01/08/2049	USD	605,259	600,788	0.01		University of Miami 4.063% 01/04/2052	USD	880,000	720,607	0.02	
UMBS BQ3950 5% 01/08/2049	USD	732,393	720,205	0.02		University of Southern California 2.126% 01/10/2120	USD	1,090,000	667,228	0.01	
UMBS BQ4194 5% 01/09/2049	USD	340,955	344,482	0.01		US Bank NA 'B', 144A 6.789% 25/08/2032	USD	8,126,764	8,169,525	0.18	
UMBS BQ4199 5% 01/08/2049	USD	371,447	367,265	0.01		US Treasury 0% 15/05/2026	USD	1,000,000	916,906	0.02	
UMBS BQ4200 5% 01/08/2049	USD	1,357,262	1,327,758	0.03		US Treasury 0% 15/08/2026	USD	100,000	90,900	0.00	
UMBS BQ4201 5% 01/08/2049	USD	2,354,480	2,322,106	0.05		US Treasury 0% 15/06/2033	USD	1,600,000	1,079,588	0.02	
UMBS BQ4202 5% 01/08/2049	USD	1,335,212	1,329,778	0.03		US Treasury 0% 15/11/2033	USD	3,920,000	2,613,061	0.06	
UMBS BQ4203 5% 01/08/2049	USD	1,622,886	1,642,961	0.04		US Treasury 0% 15/11/2034	USD	3,600,000	2,292,343	0.05	
UMBS BQ5594 4% 01/09/2049	USD	1,793,583	1,675,452	0.04		US Treasury 0% 15/02/2035	USD	1,515,000	953,529	0.02	
UMBS BQ5625 3.5% 01/08/2049	USD	5,512,439	5,082,757	0.11		US Treasury 0% 15/05/2035	USD	2,600,000	1,617,235	0.04	
UMBS BQ6078 3.5% 01/10/2049	USD	2,045,674	1,845,206	0.04		US Treasury 0% 15/11/2040	USD	25,570,000	12,005,504	0.26	
UMBS BQ6817 3.5% 01/10/2049	USD	1,208,619	1,090,320	0.02		US Treasury 0% 15/02/2041	USD	16,412,846	7,614,948	0.16	
UMBS BQ1623 3% 01/08/2050	USD	3,620,752	2,620,825	0.06		US Treasury 0% 15/11/2043	USD	10,000,000	4,021,191	0.09	
UMBS CA1234 4% 01/02/2038	USD	771,727	739,261	0.02		US Treasury 2.375% 15/05/2051	USD	510,000	342,806	0.01	
UMBS CA1238 4% 01/02/2038	USD	857,120	821,849	0.02		Utah Acquisition Sub, Inc. 2.95% 15/06/2026	USD	1,215,000	1,179,362	0.03	
UMBS CA5729 3% 01/05/2050	USD	5,469,856	4,740,242	0.10		Valero Energy Corp. 2.15% 15/09/2027	USD	1,277,000	1,167,653	0.03	
UMBS FM1219 4% 01/07/2049	USD	688,899	640,518	0.01		Yielder Mortgage Trust, Series E59-2 'G' 6.7% 15/06/2028	USD	61,354	62,311	0.00	
UMBS FM1758 3.5% 01/09/2049	USD	2,062,148	1,868,233	0.04		Yielder Mortgage Trust, Series E59-1 'E' 7% 15/06/2028	USD	7,217	7,205	0.00	
UMBS MA0406 4.5% 01/05/2030	USD	50,758	49,969	0.00		Ventas Realty LP, REIT 3.85% 01/04/2027	USD	369,000	355,601	0.01	
UMBS MA0948 5% 01/11/2031	USD	80,894	80,286	0.00		Verik Analytics, Inc. 5.7% 01/04/2023	USD	1,980,000	2,048,185	0.04	
UMBS QA9332 2.5% 01/05/2050	USD	3,557,580	2,964,419	0.06		Verizon Communications, Inc. 1.6% 20/10/2030	USD	585,000	477,902	0.01	
UMBS QB1061 3.5% 01/06/2050	USD	697,387	631,936	0.01							
UMBS RA2008 4% 01/01/2050	USD	2,830,036	2,641,500	0.06							
UMBS SD8089 2.5% 01/07/2050	USD	20,797,946	17,282,589	0.37							
United Pacific Corp. 1.9% 15/08/2029	USD	900,000	686,972	0.02							
United Airlines Pass-Through Trust 3.45% 01/06/2029	USD	1,718,121	1,620,792	0.04							
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-1 3.65% 07/07/2027	USD	975,139	943,642	0.02							
United Airlines Pass-Through Trust, Series A 4.3% 15/02/2027	USD	4,251,404	4,189,503	0.09							
United Airlines Pass-Through Trust, Series A 4% 11/10/2027	USD	494,657	480,559	0.01							
United Airlines Pass-Through Trust, Series A 3.75% 03/01/2028	USD	368,321	355,563	0.01							
United Airlines Pass-Through Trust, Series A 3.1% 07/04/2030	USD	1,926,015	1,724,497	0.04							

JPMorgan Funds – US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表（続き）

2024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(%)
Virginia Electric and Power Co. 3.25 15/09/2047	USD	700,000	528,193	0.01	Wells Fargo Pass-Through Certificates Trust, Series 2005-3 'G' 5.5% 25/09/2055	USD	238,238	37,916	0.00
Vistra Operations Co. LLC, 144A 6% 15/04/2024	USD	307,000	309,365	0.01	Wells Fargo & Co., FFM 5.574% 25/07/2029	USD	6,695,000	6,775,573	0.15
VMware LLC 1.8% 15/08/2028	USD	1,512,000	1,328,978	0.03	Wells Fargo & Co., FFM 6.303% 23/10/2029	USD	4,705,000	4,897,540	0.11
VNO Trust, Series 2016-20P 'X', 144A 3.80% 10/01/2035	USD	5,294,000	4,960,887	0.11	Wells Fargo & Co., FFM 5.557% 25/07/2034	USD	2,295,000	2,311,149	0.05
Yodanis Group of America Finance LLC, 144A 1.625% 24/11/2027	USD	945,000	839,665	0.02	Wells Fargo & Co., FFM 6.491% 23/10/2034	USD	3,215,000	3,453,992	0.07
Wells Fargo Pass-Through Certificates Trust, Series 2003-53 '1M' 5.5% 25/09/2033	USD	40,855	38,483	0.00	Welltower OP LLC, REIT 2.7% 15/02/2027	USD	412,000	389,114	0.01
Wells Fargo Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-53 '1G' 5% 25/07/2034	USD	11,561	11,239	0.00	W Carey, Inc., REIT 2.4% 01/02/2031	USD	1,975,000	1,649,585	0.04
Wells Fargo Pass-Through Certificates Trust, FFM, Series 2003-409 '1A5' 5.67% 25/09/2033	USD	88,190	82,931	0.00	W Carey, Inc., REIT 2.2% 01/04/2033	USD	3,000,000	2,336,577	0.05
Wells Fargo Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-52 '3M' 5.5% 25/06/2034	USD	37,451	36,377	0.00	WEC Co., Inc. 3.9% 01/06/2028	USD	315,000	300,785	0.01
Wells Fargo Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-53 '3D' 5% 25/07/2034	USD	105,005	104,434	0.00	Walsh Eye Health Services Corp. 2.49% 01/07/2030	USD	1,710,000	1,041,389	0.02
Wells Fargo Pass-Through Certificates Trust, FFM, Series 2003-433 'A' 5.99% 25/08/2033	USD	5,284	4,970	0.00	Zoetis, Inc. 2% 15/05/2030	USD	1,630,000	1,380,503	0.03
Wells Fargo Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-53 '4' 5% 25/11/2033	USD	74,334	69,577	0.00	債券合計			2,632,867,586	56.95
Wells Fargo Pass-Through Certificates Trust, Series 2003-51 '5' 5.5% 25/04/2033	USD	46,015	45,081	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			3,043,742,335	65.84
Wells Fargo Pass-Through Certificates Trust, FFM, Series 2003-4211 'A5' 5.84% 25/10/2033	USD	103,716	95,662	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 Pass-Through Certificates Trust, FFM, Series 2003-405 'M' 6.20% 25/06/2033	USD	83,198	82,018	0.00	JPMorgan USD Liquidity LTMV Fund - JPM USD Liquidity LTMV I (Inst.) †	USD	75,279,955	75,279,955	1.63
Wells Fargo Pass-Through Certificates Trust, FFM, Series 2003-407 'M' 5.67% 25/08/2033	USD	9,539	8,783	0.00	集団投資スキーム - UCITS合計			75,279,955	1.63
Wells Fargo Pass-Through Certificates Trust, Series 2005-4 '3Z' 5.5% 25/06/2035	USD	83,359	53,800	0.00	UCITSと認められたユニットまたは他の集団投資事業合計			75,279,955	1.63
					投資有価証券合計			4,600,373,237	99.51
					現金			4,757,689	0.10
					その他の資産 / (負債)			17,857,277	0.39
					純資産合計			4,622,988,183	100.00
					† 利害関係人のファンド				

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024年6月30日現在

2024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	87.66
イギリス	2.13
ルクセンブルク	1.81
フランス	1.53
カナダ	1.19
ケイマン諸島	0.85
日本	0.82
アイルランド	0.62
オランダ	0.46
スペイン	0.36
メキシコ	0.32
オーストラリア	0.30
ドイツ	0.23
スイス	0.18
デンマーク	0.16
シンガポール	0.16
国際機関	0.13
ニュージーランド	0.12
フィンランド	0.08
イタリア	0.07
チリ	0.07
パナマ	0.06
スウェーデン	0.04
ポーランド	0.04
イスラエル	0.04
ジャージー	0.04
香港	0.02
サウジアラビア	0.01
ノルウェー	0.01
コロンビア	0.01
投資有価証券合計	99.51
現金およびその他資産／(負債)	0.49
合計	100.00

TBA契約

国名	証券名	通貨	想定元本	時価 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)	純資産に 占める割合(%)
アメリカ	UMBS, 2.50%, 25/07/2054	USD	57,225,000	47,064,064	703,889	1.02
TBA契約買建合計				47,064,064	703,889	1.02
TBA契約純値				47,064,064	703,889	1.02

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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	1,242,470	USD	825,076	03/07/2024	Barclays	3,608	—
AUD	7,349	USD	4,897	03/07/2024	BNP Paribas	5	—
AUD	3,692	USD	2,456	03/07/2024	Citibank	6	—
AUD	4,338	USD	2,882	03/07/2024	HSBC	12	—
AUD	15,773	USD	10,489	03/07/2024	Morgan Stanley	32	—
AUD	4,601	USD	3,038	03/07/2024	RBC	30	—
AUD	1,256,661	USD	834,432	06/08/2024	Morgan Stanley	4,504	—
CHF	14,055,801	USD	15,569,154	03/07/2024	HSBC	68,504	—
EUR	245,103	USD	261,906	01/07/2024	State Street	342	—
EUR	911,201,757	USD	976,090,804	06/08/2024	HSBC	469,822	0.01
GBP	7,805	USD	9,855	06/08/2024	Standard Chartered	8	—
JPY	628,586,871	USD	3,926,913	06/08/2024	Morgan Stanley	11,827	—
SGD	9,420,480	USD	6,952,851	06/08/2024	HSBC	8,642	—
SGD	1,873	USD	1,383	06/08/2024	State Street	1	—
USD	55,202	CHF	49,415	03/07/2024	Barclays	226	—
USD	59,622	CHF	53,346	03/07/2024	Citibank	273	—
USD	1,294	CHF	1,151	03/07/2024	Merrill Lynch	13	—
USD	59,145	CHF	52,539	03/07/2024	Morgan Stanley	694	—
USD	2,464	CHF	2,197	03/07/2024	RBC	19	—
USD	36,515	CHF	32,390	06/08/2024	Morgan Stanley	331	—
USD	3,046,313	EUR	2,840,905	03/07/2024	Barclays	6,548	—
USD	9,373,200	EUR	8,680,038	03/07/2024	BNP Paribas	85,570	—
USD	29,216,910	EUR	27,177,408	03/07/2024	Citibank	137,114	0.01
USD	5,867,221	EUR	5,417,333	03/07/2024	Goldman Sachs	70,681	—
USD	4,285,858	EUR	3,973,398	03/07/2024	HSBC	34,327	—
USD	2,026,555	EUR	1,860,248	03/07/2024	Merrill Lynch	36,092	—
USD	5,202,000	EUR	4,826,512	03/07/2024	Morgan Stanley	37,638	—
USD	1,724,347	EUR	1,582,816	03/07/2024	Standard Chartered	30,736	—
USD	892,079	EUR	821,139	03/07/2024	State Street	13,461	—
USD	70,271	EUR	65,512	06/08/2024	HSBC	59	—
USD	50,724	EUR	47,274	06/08/2024	State Street	60	—
USD	86,111	GBP	88,047	02/07/2024	State Street	137	—
USD	18,132	GBP	14,192	03/07/2024	BNP Paribas	200	—
USD	10,831,933	GBP	8,568,942	03/07/2024	Citibank	5,441	—
USD	72,574	GBP	57,101	03/07/2024	Goldman Sachs	429	—
USD	16,303	GBP	12,756	03/07/2024	Morgan Stanley	186	—
USD	153,796	GBP	120,879	03/07/2024	State Street	1,070	—
USD	24,689	GBP	19,510	06/08/2024	Goldman Sachs	33	—
USD	53,183	JPY	8,312,922	03/07/2024	Citibank	1,364	—
USD	25,269	JPY	3,900,000	03/07/2024	HSBC	959	—
USD	29,928	JPY	4,674,811	03/07/2024	Merrill Lynch	788	—
USD	12,035	JPY	1,896,655	03/07/2024	Morgan Stanley	213	—
USD	15,245	JPY	2,384,066	03/07/2024	RBC	384	—
USD	173,727	JPY	27,145,258	03/07/2024	State Street	4,518	—
USD	9,223	JPY	1,454,880	06/08/2024	Barclays	106	—
USD	25,404	SGD	34,330	03/07/2024	Barclays	76	—

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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	76,379	SGD	103,050	03/07/2024	Merrill Lynch	352	-
USD	20,398	SGD	27,588	03/07/2024	Morgan Stanley	45	-
USD	26,547	SGD	35,887	03/07/2024	RBC	71	-
USD	23,949	SGD	32,377	06/08/2024	Morgan Stanley	24	-
先渡為替契約未実現利益合計 - 資産						1,037,581	0.02
AUD	3,549	USD	2,367	03/07/2024	HSBC	(1)	-
CHF	124,212	USD	139,069	03/07/2024	Barclays	(878)	-
CHF	124,234	USD	139,629	03/07/2024	Goldman Sachs	(1,414)	-
CHF	147,689	USD	165,815	03/07/2024	HSBC	(1,505)	-
CHF	25,896	USD	29,126	03/07/2024	Merrill Lynch	(316)	-
CHF	117,834	USD	133,111	03/07/2024	Morgan Stanley	(2,015)	-
CHF	18,375	USD	20,549	03/07/2024	RBC	(106)	-
CHF	7,239	USD	8,086	03/07/2024	State Street	(32)	-
CHF	9,986	USD	11,219	06/08/2024	Morgan Stanley	(63)	-
EUR	47,274	USD	50,643	02/07/2024	State Street	(62)	-
EUR	20,948,867	USD	22,719,424	03/07/2024	Barclays	(304,159)	(0.01)
EUR	4,798,737	USD	5,139,226	03/07/2024	BNP Paribas	(49,523)	-
EUR	286,591	USD	306,702	03/07/2024	Citibank	(49)	-
EUR	1,285	USD	1,393	03/07/2024	Goldman Sachs	(19)	-
EUR	2,967	USD	3,204	03/07/2024	HSBC	(29)	-
EUR	942,382,878	USD	1,020,263,534	03/07/2024	Morgan Stanley	(11,914,928)	(0.26)
EUR	2,231	USD	2,393	03/07/2024	Standard Chartered	(7)	-
EUR	1,021,238	USD	1,098,066	06/08/2024	Morgan Stanley	(3,567)	-
GBP	49,231	USD	62,897	03/07/2024	Barclays	(695)	-
GBP	24,144	USD	30,764	03/07/2024	Citibank	(259)	-
GBP	8,448,995	USD	10,748,481	03/07/2024	HSBC	(73,536)	-
GBP	182,635	USD	232,783	03/07/2024	Morgan Stanley	(2,031)	-
GBP	68,866	USD	87,729	03/07/2024	Standard Chartered	(720)	-
GBP	38,571	USD	48,908	06/08/2024	Barclays	(164)	-
GBP	8,489,525	USD	10,733,063	06/08/2024	Citibank	(4,637)	-
GBP	68,047	USD	86,128	06/08/2024	State Street	(135)	-
JPY	1,781,186	USD	11,261	03/07/2024	Barclays	(158)	-
JPY	1,269,552	USD	8,056	03/07/2024	Citibank	(142)	-
JPY	3,661,413	USD	23,539	03/07/2024	Goldman Sachs	(716)	-
JPY	660,712,236	USD	4,218,472	03/07/2024	HSBC	(99,976)	-
JPY	5,242,486	USD	33,415	03/07/2024	Merrill Lynch	(736)	-
JPY	4,233,710	USD	27,057	03/07/2024	Morgan Stanley	(666)	-
SGD	96,962	USD	71,871	03/07/2024	Barclays	(335)	-
SGD	34,398	USD	25,429	03/07/2024	BNP Paribas	(51)	-
SGD	27,535	USD	20,399	03/07/2024	Goldman Sachs	(85)	-
SGD	9,324,723	USD	6,905,578	03/07/2024	HSBC	(26,069)	-
SGD	5,500	USD	4,081	03/07/2024	Merrill Lynch	(23)	-
SGD	28,791	USD	21,395	03/07/2024	Morgan Stanley	(154)	-
SGD	103,427	USD	76,785	03/07/2024	State Street	(480)	-
USD	16,631	AUD	25,110	03/07/2024	HSBC	(117)	-
USD	833,636	AUD	1,256,661	03/07/2024	Morgan Stanley	(4,512)	-

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2024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	32,936	CHF	29,833	03/07/2024	HSBC	(254)	—
USD	112,547	CHF	101,738	03/07/2024	Morgan Stanley	(640)	—
USD	974,574,564	EUR	911,201,757	03/07/2024	HSBC	(410,279)	(0.01)
USD	2,257,469	EUR	2,107,994	06/08/2024	HSBC	(1,728)	—
USD	1,166,849	EUR	1,089,874	06/08/2024	Morgan Stanley	(1,200)	—
USD	262,340	EUR	245,103	06/08/2024	State Street	(344)	—
USD	9,853	GEP	7,806	01/07/2024	Standard Chartered	(8)	—
USD	17,140	GEP	13,568	06/08/2024	Morgan Stanley	(6)	—
USD	3,907,262	JFY	628,586,871	03/07/2024	Morgan Stanley	(10,984)	—
USD	6,942,014	SGD	9,420,480	03/07/2024	HSBC	(8,141)	—
先渡為替契約未実現損失合計 - 負債						(12,928,654)	(0.28)
先渡為替契約未実現純損失 - 負債						(11,891,073)	(0.26)

金融先物契約

証券名	契約数	通貨	グローバルエクスポージャー (米ドル)	未実現損益 (米ドル)	純資産に 占める割合(%)
US 2 Year Note, 30/09/2024	339	USD	69,296,043	258,816	—
US 5 Year Note, 30/09/2024	1,697	USD	181,346,989	1,783,176	0.04
US 10 Year Note, 19/09/2024	817	USD	90,221,056	1,201,328	0.03
US 10 Year Ultra Bond, 19/09/2024	66	USD	7,536,859	92,813	—
US Ultra Bond, 19/09/2024	189	USD	23,982,328	447,398	0.01
金融先物契約未実現利益合計				3,783,531	0.08
金融先物契約未実現純利益				3,783,531	0.08

JPM US Aggregate Bond X (mth) - JPY

直近計算期間におけるTER(総費用率)

2024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常平均に対する比率で表したものです。

運用にかかる費用の合計には、保管報酬、税金、その他費用が含まれております。

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

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

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(2025年6月2日現在)

種類	金額	単位
資産総額	1,154,601,153	円
負債総額	2,327,705	円
純資産総額(-)	1,152,273,448	円
発行済口数	1,020,565,707	口
1口当たり純資産額(/)	1.1291	円

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

(2025年6月2日現在)

種類	金額	単位
資産総額	4,170,487,977	円
負債総額	10,676,040	円
純資産総額(-)	4,159,811,937	円
発行済口数	2,981,621,686	口
1口当たり純資産額(/)	1.3952	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（2024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、2024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（2025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、2025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、2025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	52	834,645
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	74	5,196,912
総合計	126	6,031,557
親投資信託	43	-

(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JP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35期事業年度（2024年4月1日から2025年3月31日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第34期 (2024年 3 月31日)	第35期 (2025年 3 月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	16,673,933	17,458,418
前払費用	10,082	10,644
未収入金	1,603	2,574
未収委託者報酬	1,987,338	2,336,203
未収収益	3,061,883	2,760,032
その他	15,682	121
流動資産合計	21,750,524	22,567,995
固定資産		
投資その他の資産		
関係会社株式	60,000	60,000
投資有価証券	681,717	564,022
敷金保証金	37,171	33,029
前払年金費用	228,037	271,593
繰延税金資産	1,039,201	1,027,949
その他	5,500	5,500
投資その他の資産合計	2,051,627	1,962,094
固定資産合計	2,051,627	1,962,094
資産合計	23,802,152	24,530,090
負債の部		
流動負債		
預り金	213,331	318,901
未払金	2,978,383	1,767,556
未払手数料	906,271	1,023,384
その他未払金	2,072,111	744,172
未払費用	132,370	337,070
未払法人税等	1,292,546	1,326,824
賞与引当金	1,173,672	1,227,784
役員賞与引当金	97,026	93,007
流動負債合計	5,887,331	5,071,146
固定負債		
長期未払金	242,772	271,705
賞与引当金	789,791	781,573
役員賞与引当金	140,155	127,648
固定負債合計	1,172,719	1,180,926
負債合計	7,060,050	6,252,073

(単位：千円)

	第34期 (2024年3月31日)	第35期 (2025年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,218,000	2,218,000
資本剰余金		
資本準備金	1,000,000	1,000,000
資本剰余金合計	1,000,000	1,000,000
利益剰余金		
利益準備金	33,676	33,676
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,490,425	15,026,340
利益剰余金合計	13,524,101	15,060,016
株主資本合計	16,742,101	18,278,016
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	-	0
評価・換算差額等合計	-	0
純資産合計	16,742,101	18,278,017
負債・純資産合計	23,802,152	24,530,090

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第34期 （ 自2023年 4 月 1 日 至2024年 3 月31日 ）	第35期 （ 自2024年 4 月 1 日 至2025年 3 月31日 ）
営業収益		
委託者報酬	10,499,412	11,322,859
運用受託報酬	9,557,667	10,527,583
投資助言報酬	813,173	2,431,087
業務受託報酬	2,744,580	3,080,877
その他営業収益	277,179	322,864
営業収益合計	23,892,013	27,685,272
営業費用		
支払手数料	5,192,430	5,572,838
広告宣伝費	102,192	143,966
調査費	3,404,975	3,411,811
委託調査費	3,023,575	2,892,042
調査費	377,411	516,298
図書費	3,988	3,470
委託計算費	269,987	289,112
営業雑経費	133,374	131,943
通信費	6,615	7,350
印刷費	96,034	93,620
協会費	30,724	30,972
営業費用合計	9,102,961	9,549,672
一般管理費		
給料	5,707,205	6,706,266
役員報酬及び賞与	338,638	321,547
給料・手当	2,999,251	3,239,271
賞与	1,127,025	1,899,386
賞与引当金繰入額	1,172,792	1,169,682
役員賞与引当金繰入額	69,497	76,377
福利厚生費	387,162	430,971
交際費	9,346	12,728
寄付金	456	670
旅費交通費	140,310	198,018
租税公課	171,364	220,229
不動産関連費用	879,560	921,620
退職給付費用	215,497	210,077
退職金	91,987	131,143
消耗器具備品費	7,934	11,337
事務委託費	221,828	199,208
関係会社等配賦経費	2,431,843	2,979,703
諸経費	71,029	94,517
一般管理費合計	10,335,527	12,116,492
営業利益	4,453,525	6,019,106

(単位:千円)

	第34期 (自2023年4月1日 至2024年3月31日)	第35期 (自2024年4月1日 至2025年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	1 250,008	310,792
投資有価証券売却益	544	43
受取利息	1 92	0
その他営業外収益	32,909	49,578
営業外収益合計	283,554	360,414
営業外費用		
投資有価証券売却損	178	5
為替差損	57,620	33,267
その他営業外費用	89	11,658
営業外費用合計	57,887	44,931
経常利益	4,679,192	6,334,590
税引前当期純利益	4,679,192	6,334,590
法人税、住民税及び事業税	1,697,341	2,087,423
法人税等調整額	161,534	11,251
法人税等合計	1,535,806	2,098,675
当期純利益	3,143,385	4,235,915

(3) 【株主資本等変動計算書】

第34期（自2023年4月1日 至2024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	15,347,039	15,380,716	18,598,716
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	-	5,000,000	5,000,000	5,000,000
当期純利益	-	-	-	-	3,143,385	3,143,385	3,143,385
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	1,856,614	1,856,614	1,856,614
当期末残高	2,218,000	1,000,000	1,000,000	33,676	13,490,425	13,524,101	16,742,101

	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	173	173	18,598,889
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	5,000,000
当期純利益	-	-	3,143,385
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	173	173	173
当期変動額合計	173	173	1,856,787
当期末残高	-	-	16,742,101

第35期（自2024年4月1日 至2025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	13,490,425	13,524,101	16,742,101
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	-	2,700,000	2,700,000	2,700,000
当期純利益	-	-	-	-	4,235,915	4,235,915	4,235,915
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	1,535,915	1,535,915	1,535,915
当期末残高	2,218,000	1,000,000	1,000,000	33,676	15,026,340	15,060,016	18,278,016

	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	-	-	16,742,101
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	2,700,000
当期純利益	-	-	4,235,915
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	1,535,915
当期末残高	0	0	18,278,017

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. 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、投資助言報酬、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。

投資助言報酬：当該報酬は、対象顧客との契約に基づき、提供する投資アドバイスに対する固定報酬または運用資産に対する一定割合として算定し、契約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：投資一任および投資助言に関する成功報酬は、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や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。いずれの報酬も、契約に基づき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。

（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。

（未適用の会計基準等）

「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）

「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）等

(1) 概要

企業会計基準委員会において、日本基準を国際的に整合性のあるものとする取組みの一環として、借手の全てのリースについて資産及び負債を認識するリースに関する会計基準の開発に向けて、国際的な会計基準を踏まえた検討が行われ、基本的な方針として、IFRS第16号の単一の会計処理モデルを基礎とするものの、IFRS第16号の全ての定めを採り入れるのではなく、主要な定めのみを採り入れることにより、簡素で利便性が高く、かつ、IFRS第16号の定めを個別財務諸表に用いても、基本的に修正が不要となることを目指したリース会計基準等が公表されました。借手の会計処理として、借手のリースの費用配分の方法については、IFRS第16号と同様に、リースがファイナンス・リースであるかオペレーティング・リースであるかにかかわらず、全てのリースについて使用権資産に係る減価償却費およびリース負債に係る利息相当額を計上する単一の会計処理モデルが適用されます。

(2) 適用予定日

2028年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「リースに関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）

損益計算書関係

前事業年度において、「営業収益」の「運用受託報酬」に含まれていた投資助言報酬は、金額的重要性が増したため、当事業年度より「投資助言報酬」として掲記することとしております。この表示方法を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業収益」の「運用受託報酬」に表示していた813,173千円は、「投資助言報酬」として組替えております。

（貸借対照表関係）

関係会社に対する資産及び負債

第34期 (2024年3月31日)	第35期 (2025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34期 (自2023年4月1日 至2024年3月31日)	第35期 (自2024年4月1日 至2025年3月31日)
関係会社からの受取利息	92千円	- 千円
関係会社からの受取配当金	250,000千円	260,000千円

（株主資本等変動計算書関係）

第34期（自2023年4月1日 至2024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
2023年6月27日 定時株主総会	普通株式	5,000,000	88,865	2023年3月31日	2023年6月28日

第35期（自2024年4月1日 至2025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
2024年6月24日 定時株主総会	普通株式	2,700,000	47,987	2024年3月31日	2024年6月25日

（リース取引関係）

第34期 （自2023年4月1日 至2024年3月31日）		第35期 （自2024年4月1日 至2025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	1,651千円	1年以内	1,646千円
1年超	2,340千円	1年超	685千円
合計	3,991千円	合計	2,332千円

（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。

（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。

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。

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34期（2024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	242,772	242,772	-
負債計	242,772	242,772	-

（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」

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）	681,717

第35期（2025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	271,705	271,705	-
負債計	271,705	271,705	-

（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」

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）	564,012

（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34期（2024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	-	242,772	-	242,772
負債計	-	242,772	-	242,772

第35期（2025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	-	271,705	-	271,705
負債計	-	271,705	-	271,705

（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34期（2024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	16,673,933	-	-	-
未収委託者報酬	1,987,338	-	-	-
未収収益	3,061,883	-	-	-
合計	21,723,155	-	-	-

第35期（2025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	17,458,418	-	-	-
未収委託者報酬	2,336,203	-	-	-
未収収益	2,760,032	-	-	-
合計	22,554,655	-	-	-

（有価証券関係）

1．関係会社株式

関係会社株式（第34期の貸借対照表計上額は60,000千円、第35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34期（2024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 681,717千円）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。

第35期（2025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 564,012千円）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。

（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	10	10	0
合計		10	10	0

3．当事業年度中に売却したその他有価証券

第34期（自2023年4月1日 至2024年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他 投資信託	3,985	544	178

第35期（自2024年4月1日 至2025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	2,100	43	5

（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34期 (2024年3月31日)	第35期 (2025年3月31日)
	(千円)	(千円)
退職給付債務の期首残高	1,552,554	1,729,556
勤務費用	152,793	168,347
利息費用	17,854	25,078
数理計算上の差異の発生額	101,633	114,945
退職給付の支払額	95,278	124,168
過去勤務費用の当期発生額	-	20,293
退職給付債務の期末残高	1,729,556	1,704,161

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第34期 (2024年3月31日)	第35期 (2025年3月31日)
	(千円)	(千円)
年金資産の期首残高	1,813,116	2,046,891
期待運用収益	9,972	14,328
数理計算上の差異の発生額	151,080	22,434
事業主からの拠出額	168,000	196,976
退職給付の支払額	95,278	124,168
年金資産の期末残高	2,046,891	2,111,592

(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34期 (2024年3月31日)	第35期 (2025年3月31日)
	(千円)	(千円)
積立型制度の退職給付債務	1,729,556	1,704,161
年金資産	2,046,891	2,111,592
	317,334	407,430
未認識数理計算上の差異	89,297	135,837
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	228,037	271,593
前払年金費用	228,037	271,593
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	228,037	271,593

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第34期 (自2023年4月1日 至2024年3月31日)	第35期 (自2024年4月1日 至2025年3月31日)
	(千円)	(千円)
勤務費用	152,793	168,347
利息費用	17,854	25,078
期待運用収益	9,972	14,328
数理計算上の差異の費用処理額	8,283	25,676
過去勤務債務の費用処理額	-	-
その他(注1)	7,313	187
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)	159,705	153,234

(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34期 (2024年3月31日)	第35期 (2025年3月31日)
債券	31%	25%
現金及び預金等	69%	75%
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34期 (2024年3月31日)	第35期 (2025年3月31日)
主要な数理計算上の計算基礎		
割引率	1.15%	1.45%
長期期待運用収益率	0.55%	0.70%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第34期事業年度55,792千円、第35期事業年度56,842千円であります。

（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34期 (2024年3月31日)	第35期 (2025年3月31日)
繰延税金資産	(千円)	(千円)
賞与引当金	585,906	576,669
未払費用	110,803	121,567
未払事業税	72,564	74,447
長期前払費用	119,206	122,709
減価償却超過額	220,363	215,581
その他	5,741	5,692
繰延税金資産小計	1,114,582	1,116,667
評価性引当額	5,556	5,556
繰延税金資産合計	1,109,026	1,111,111
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	69,825	83,161
繰延税金資産又は繰延税金負債（ ）の純額	1,039,201	1,027,949

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34期 (2024年3月31日)	第35期 (2025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	3.89%	4.17%
外国子会社配当等永久に益金に算入されない項目	1.64%	1.50%
住民税等均等割	0.05%	0.03%
税率変更による期末繰延税金資産の増額修正	-	0.24%
過年度法人税等	0.12%	0.06%
その他	0.02%	0.02%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.82%	33.12%

3．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

税法の改正に伴い、2026年4月開始事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等に係る繰延税金資産及び繰延税金負債については、法定実効税率を30.62%から31.52%に変更し計算しています。この変更により、当事業年度の繰延税金資産（繰延税金負債の金額を控除した金額）の金額は15百万円増加し、法人税等調整額は15百万円減少しました。

（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34期（自2023年4月1日 至2024年3月31日）

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	業務受託報酬	その他	合計
残高報酬	10,499,412	8,325,288	813,173	2,744,580	277,179	22,659,635
成功報酬	-	1,232,378	-	-	-	1,232,378
合計	10,499,412	9,557,667	813,173	2,744,580	277,179	23,892,013

第35期（自2024年4月1日 至2025年3月31日）

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	業務受託報酬	その他	合計
残高報酬	11,322,859	10,162,792	1,045,379	3,080,877	322,864	25,934,773
成功報酬	-	364,790	1,385,708	-	-	1,750,499
合計	11,322,859	10,527,583	2,431,087	3,080,877	322,864	27,685,272

（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34期（自2023年4月1日 至2024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	投資助言報酬	業務受託報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	10,499,412	9,557,667	813,173	2,744,580	277,179	23,892,013

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
13,679,111	3,389,037	6,823,865	23,892,013

（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	3,364,483	資産運用業

第35期（自2024年4月1日 至2025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	投資助言報酬	業務受託報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	11,322,859	10,527,583	2,431,087	3,080,877	322,864	27,685,272

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
16,011,271	3,228,011	2,862,604	5,583,384	27,685,272

(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	3,206,630	資産運用業
JPMorgan Asset Management (Asia Pacific) Limited	2,774,619	資産運用業

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

第34期（自2023年4月1日 至2024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	240,253 百万米ドル	持株会社	被所有 間接 100%	人件費の立替	-	-	未払金	469,971

（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。

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	投資運用再委託等	運用受託報酬	2,902,015	未収収益	276,530
							調査費	1,900,307	未払金	468,034
最終的な親会社 が同一である 会社	J.P. Morgan Investment Management Inc.	米国 ニューヨーク	4.5百万 米ドル	投資運用業	なし	投資運用再委託等	業務受託報酬	1,613,740	未収収益	172,783
							調査費	1,030,619	未払金	732,524

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

第35期（自2024年4月1日 至2025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	240,964 百万米ドル	持株会社	被所有 間接 100%	人件費の立替	-	-	未払金	485,685

（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。

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	投資運用再委託等	運用受託報酬	2,638,154	未収収益	288,008
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	投資運用再委託等	運用受託報酬	2,468,598	未収収益	215,435

（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34期 （自2023年4月1日 至2024年3月31日）	第35期 （自2024年4月1日 至2025年3月31日）
1株当たり純資産額	297,558.01円	324,855.90円
1株当たり当期純利益	55,867.51円	75,285.08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34期 （自2023年4月1日 至2024年3月31日）	第35期 （自2024年4月1日 至2025年3月31日）
損益計算書上の当期純利益	3,143,385千円	4,235,915千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,143,385千円	4,235,915千円
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。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1) 受託会社

名 称 三菱UFJ信託銀行株式会社
 資本金の額 324,279百万円（2024年3月末現在）
 事業の内容
 （略）

(2) 販売会社

	名 称	資本金の額 (2024年3月末現在)	事業の内容
1	三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<訂正後>

(1) 受託会社

名 称 三菱UFJ信託銀行株式会社
 資本金の額 324,279百万円（2025年3月末現在）
 事業の内容
 （略）

(2) 販売会社

	名 称	資本金の額 (2025年3月末現在)	事業の内容
1	三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(2) 販売会社

<訂正前>

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、目論見書の交付、運用報告書に記載すべき事項のうち重要な事項のみを記載した交付運用報告書の交付代行、収益分配金の再投資に関する事務、収益分配金・一部解約金・償還金の支払い等を行います。

<訂正後>

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、目論見書の交付、運用報告書（全体版）に記載すべき事項のうち重要な事項のみを記載した交付運用報告書の交付代行、収益分配金の再投資に関する事務、収益分配金・一部解約金・償還金の支払い等を行います。

独立監査人の監査報告書

2025年7月25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

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鶴田光夫指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 高見昂平**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JPM USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）の2024年11月16日から2025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、JPM USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）の2025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、JPMモルガン・アセット・マネジメント株式会社及びファンドから独立しており、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

2025年6月6日

J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会御中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鶴田光夫指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 高見昂平

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2024年4月1日から2025年3月31日までの第35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2025年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査役への責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。