

【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】 平成31年 4 月26日

【発行者名】 J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 大越 昇一

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内二丁目7番3号 東京ビルディング

【事務連絡者氏名】 内藤 敏信
(連絡場所)
東京都千代田区丸の内二丁目7番3号 東京ビルディング

【電話番号】 03 - 6736 - 2000

【届出の対象とした募集（売出）内国投資
信託受益証券に係るファンドの名称】 J P Mワールド・C B・オープン

【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】 2,000億円を上限とします。

【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、平成30年10月26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】

第一部【証券情報】

(5) 申込手数料

< 訂正前 >

発行価格に販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。ただし、有価証券届出書提出日現在、販売会社における手数料率*は、3.24%（税抜3.0%）が上限となっています。

* 当該手数料率は、消費税および地方消費税相当額（以下「消費税等」または「税」といいます。）を含みます。また、本書において記載されている報酬率、費用等も同様です。

（以下略）

< 訂正後 >

発行価格に販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。ただし、有価証券届出書提出日現在、販売会社における手数料率*は、3.24%*（税抜3.0%）が上限となっています。

* 当該手数料率は、消費税および地方消費税相当額（以下「消費税等」または「税」といいます。）を含みます。また、本書において記載されている報酬率、費用等も同様です。なお、2019年10月1日より消費税率（地方消費税率を含みます。）が10%に引上げられる予定です。その場合、手数料率は3.3%が上限となります。

（以下略）

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】

(3) ファンドの仕組み

< 訂正前 >

（略）

(八) 委託会社の概況

資本金 2,218百万円（平成30年8月末現在）

（略）

大株主の状況（平成30年8月末現在）

（以下略）

< 訂正後 >

（略）

(八) 委託会社の概況

資本金 2,218百万円（平成31年2月末現在）

（略）

大株主の状況（平成31年2月末現在）

（以下略）

2【投資方針】

（3）運用体制

<訂正前>

- ・ 当ファンドの主要投資先であるマザーファンドにおける運用体制

（略）

、（略）

J Pモルガン・アセット・マネジメント（UK）リミテッドは、前記のとおり行われたマザーファンドにかかる投資判断に基づいて、有価証券の売買を執行します。なお、同社は、当該有価証券の売買執行に関し、北米および南米の取引所において取引される有価証券については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）に、台湾および日本を除くアジア・オセアニアの取引所において取引される有価証券についてはJ Fアセット・マネジメント・リミテッド*（香港法人）に、また、台湾の取引所において取引される有価証券についてはJ Pモルガン・アセット・マネジメント（台湾）リミテッド*（台湾法人）に、日本の取引所において取引される有価証券については委託会社に、それぞれその業務を委託する場合があります。

* J．P．モルガン・インベストメント・マネージメント・インク、J Fアセット・マネジメント・リミテッドおよびJ Pモルガン・アセット・マネジメント（台湾）リミテッドは、J．P．モルガン・アセット・マネジメントの一員です。

（略）

（注1）（略）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、平成30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）

<訂正後>

- ・ 当ファンドの主要投資先であるマザーファンドにおける運用体制

（略）

、（略）

有価証券等の売買執行業務は、運用部門から独立しているトレーディング部門で行われます。なお、当該執行業務は、当該運用部門の拠点以外のJ．P．モルガン・アセット・マネジメントに所属する他の拠点で行われる場合があります。

（略）

（注1）（略）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、平成30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）

3【投資リスク】

（1）リスク要因

<訂正前>

（略）

流動性リスク

C Bは市場での売買高が少ない場合があり、注文が成立しないこと、売買が成立しても注文時に想定していた価格と大きく異なる場合があります。特に、急激かつ大量の売買により市場が大きな影響を受

けた場合、または市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合には、そのような状況に陥る可能性が高まります。この場合には、当該C Bの価格の下落により、マザーファンドの信託財産の価値が影響を受けることがあります。

- __ (略)

<訂正後>

(略)

流動性リスク

ある種の有価証券、特に市場での取引頻度が少なかったり、比較的小規模な市場で取引されているものは、特に取引金額が大きいと、望ましい時点と価格で売買することが難しくなる場合があります。市場が極端な状況にあるときは、買い手が減って望ましい時点または価格で有価証券をすぐに売却できず、マザーファンドが低い価格で有価証券を売却することを余儀なくされるか、あるいはまったく売却できない可能性があります。特定の有価証券またはその他の金融商品は、取扱う取引所または政府もしくは監督当局により取引を停止または制限される場合があります、その結果マザーファンドに損失が生じる可能性があります。有価証券を売却できないことにより、マザーファンドはその信託財産の価値が下がったり、他の投資機会を活用できなくなる可能性があります。流動性リスクには、通常とは異なる市場環境や通常以上に多額の換金申込み、あるいはその他の制御不能な要因によって、マザーファンドが所定の期間内に換金代金の支払いに応じられないリスクも含まれます。換金申込みに応えるため、マザーファンドは不利な時点や条件で有価証券の売却を余儀なくされることがあります。特に、債券、中小型株式または新興市場で発行される有価証券に投資している場合、特定の期間において、経済状況、市況もしくは政情の悪材料、またはそれが正確か否かにかかわらず投資家による市場見通しの悪化により、特定の発行会社もしくは業種、または特定の投資分野のすべての有価証券の流動性が前触れなく突然低下もしくは消滅するリスクがあります。

当ファンドに特有の流動性リスクに関する留意事項

C Bは市場での売買高が少ない場合があります、注文が成立しないこと、売買が成立しても注文時に想定していた価格と大きく異なることがあります。特に、急激かつ大量の売買により市場が大きな影響を受けた場合、または市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合には、そのような状況に陥る可能性が高まります。この場合には、当該C Bの価格の下落により、マザーファンドの信託財産の価値が影響を受けることがあります。

- __ (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

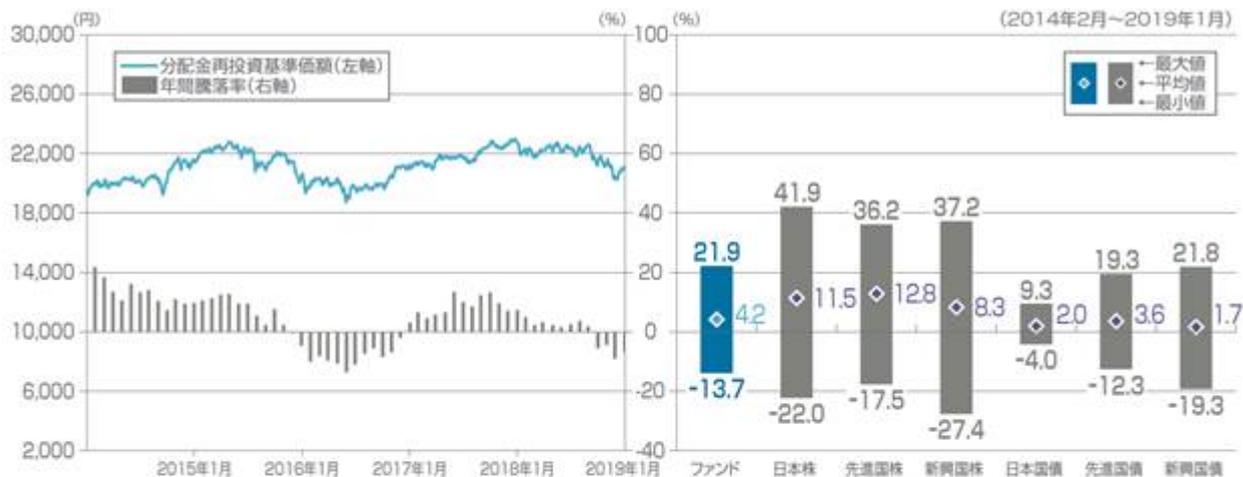
下記グラフは、ファンドの投資リスクをご理解いただくための情報の一つとしてご利用ください。

<ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移>

2014年2月～2019年1月の5年間における、ファンドの分配金再投資基準価額(日次)と、年間騰落率(毎月末時点)の推移を示したものです。

<ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較>

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



(ご注意)

- 分配金再投資基準価額は、信託報酬控除後のもので、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。
- ファンドの年間騰落率(毎月末時点)は、毎月末とその1年前における分配金再投資基準価額を対比して、その騰落率を算出したものです。(月末が休日の場合は直前の営業日を月末とみなします。設定から1年未満の時点では算出されません。)
- 代表的な資産クラスの年間騰落率(毎月末時点)は、毎月末とその1年前における下記の指数の値を対比して、その騰落率を算出したものです。(月末が休日の場合は直前の営業日を月末とみなします。)
- ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較は、上記の5年間の毎月末時点における年間騰落率を用いて、それらの平均・最大・最小をグラフにして比較したものです。
- 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、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、ファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

MSCIコクサイ指数およびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が発表しています。同インデックスに関する情報の確実性および完結性をMSCI Inc.は何ら保証するものではありません。著作権はMSCI Inc.に帰属しています。MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、同社が発表したMSCIコクサイ指数(配当込み、米ドルベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)を委託会社にて円ベースに換算したものです。

NOMURA-BPI(国債)は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

JPモルガンGBI-エマージング・マーケット・グローバルは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが発表しており、著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しています。

(2) 投資リスクに関する管理体制

< 訂正前 >

運用委託先におけるリスク管理

(略)

(平成30年6月末現在)

(以下略)

< 訂正後 >

運用委託先におけるリスク管理

(略)

(平成30年12月末現在)

(以下略)

4 【手数料等及び税金】

(1) 申込手数料

< 訂正前 >

発行価格に販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。ただし、有価証券届出書提出日現在、販売会社における手数料率は、3.24%（税抜3.0%）が上限となっています。

(以下略)

< 訂正後 >

発行価格に販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。ただし、有価証券届出書提出日現在、販売会社における手数料率は、3.24%*（税抜3.0%）が上限となっています。

* 2019年10月1日より消費税率（以下、地方消費税率を含みます。）が10%に上げられる予定です。その場合、手数料率は3.3%が上限となります。

(以下略)

(3) 信託報酬等

< 訂正前 >

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、前営業日の信託財産の純資産総額に対し年率1.62%（税抜1.50%）を乗じて得た額とします。

委託会社は、收受した信託報酬から販売会社に対し、委託会社が販売会社に委託した業務に対する報酬を支払います。その結果、実質的な信託報酬の配分は、次のとおりとなります。

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0.756% (税抜0.70%)	年率0.756% (税抜0.70%)	年率0.108% (税抜0.10%)
	(略)	(略)	(略)

委託会社の受ける報酬には、運用委託先への報酬*（信託財産の純資産総額に対し年率0.35%）が含まれています。

(以下略)

< 訂正後 >

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、前営業日の信託財産の純資産総額に対し年率1.62%*（税抜1.50%）を乗じて得た額とします。

* 2019年10月1日より消費税率が10%に引上げられる予定です。その場合、年率1.65%となります。

委託会社は、收受した信託報酬から販売会社に対し、委託会社が販売会社に委託した業務に対する報酬を支払います。その結果、実質的な信託報酬の配分は、次のとおりとなります*。

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0.756% (税抜0.70%)	年率0.756% (税抜0.70%)	年率0.108% (税抜0.10%)
	(略)		

* 2019年10月1日より消費税率が10%に引上げられる予定です。その場合、実質的な信託報酬の配分は、次のとおりとなります。

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0.77% (税抜0.70%)	年率0.77% (税抜0.70%)	年率0.11% (税抜0.10%)

委託会社の受ける報酬には、運用委託先への報酬*（信託財産の純資産総額に対し年率0.35%）が含まれています。

（以下略）

（４）その他の手数料等

<訂正前>

（略）

２．監査費用*を信託財産で負担します。

* 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。

委託会社は、当ファンドの監査費用の支払いを信託財産のために行うことができます。この場合、委託会社が支払った実額に代えて、信託財産の純資産総額に年率0.0216%（税抜0.02%）を乗じて得た額（ただし、年間324万円（税抜300万円）を上限とします。）を当該監査費用とみなし、委託会社は、そのみなし額の支弁を、毎計算期間終了日および信託終了日の翌営業日以降に、信託財産中から受けるものとします。委託会社が信託財産から支弁を受ける金額については、計算期間を通じて毎日費用計上するものとします。

<訂正後>

（略）

２．監査費用*を信託財産で負担します。

* 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。

委託会社は、当ファンドの監査費用の支払いを信託財産のために行うことができます。この場合、委託会社が支払った実額に代えて、信託財産の純資産総額に年率0.0216%*（税抜0.02%）を乗じて得た額（ただし、年間324万円*（税抜300万円）を上限とします。）を当該監査費用とみなし、委託会社は、そのみなし額の支弁を、毎計算期間終了日および信託終了日の翌営業日以降に、信託財産中から受けるものとします。委託会社が信託財産から支弁を受ける金額については、計算期間を通じて毎日費用計上するものとします。

* 2019年10月1日より消費税率が10%に引上げられる予定です。その場合、信託財産の純資産総額に年率0.022%を乗じて得た額（ただし、年間330万円を上限とします。）を当該監査費用とみなします。

（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。以下の税制は平成30年8月末現在適用されるものです。

(以下略)

<訂正後>

(略)

なお、税法が改正された場合には、以下の内容が変更になることがあります。以下の税制は平成31年2月末現在適用されるものです。

(以下略)

5【運用状況】

原届出書「第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況」について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

(1)投資状況

(平成31年2月20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	15,770,240,613	100.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	61,362,151	0.39
合計(純資産総額)		15,708,878,462	100.00

(注)投資比率とは、当ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。投資比率は四捨五入です。親投資信託は、全て「GIMワールド・CB・オープン・マザーファンド」です(以下同じ)。

(参考)GIMワールド・CB・オープン・マザーファンド

(平成31年2月20日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	493,151,039	3.12
	イギリス	36,154,808	0.23
	小計	529,305,847	3.35
新株予約権証券	ドイツ	14,709,240	0.09
	イギリス	2,247,447	0.01
	小計	16,956,687	0.11
新株予約権付社債券等	日本	272,330,000	1.72
	アメリカ	6,312,520,638	39.93
	ドイツ	1,387,085,610	8.77
	フランス	687,904,574	4.35
	イギリス	5,634,496,362	35.64
	スイス	279,502,726	1.77
	小計	14,573,839,910	92.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	690,298,705	4.37
合計(純資産総額)		15,810,401,149	100.00

(注1)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。

(注2)株式には優先証券を含みます。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成31年2月20日現在）

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	GIMワールド・CB・オープン・マザーファンド	5,349,289,581	2.8551	15,272,924,297	2.9481	15,770,240,613	100.39

（参考）GIMワールド・CB・オープン・マザーファンド

（平成31年2月20日現在）

順位	国/地域	投資国	種類	銘柄名	券面総額	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)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	イギリス	フランス	新株予約権 付社債券等	AIRBUS 0% AIR CB	2,800,000	14,702.32	411,665,109	15,425.59	431,916,592	0	2022/7/1	2.73
2	アメリカ	アメリカ	新株予約権 付社債券等	ON SEMICOND 1.625% CB	2,206,000	13,068.16	288,283,781	14,537.82	320,704,315	1.625	2023/10/15	2.03
3	イギリス	フランス	新株予約権 付社債券等	STMICRO 0% A CB	2,600,000	11,639.04	302,615,293	11,846.04	307,997,079	0	2022/7/3	1.95
4	アメリカ	中国	新株予約権 付社債券等	WEIBO 1.25% 144A CB	2,910,000	9,890.63	287,817,609	10,334.52	300,734,692	1.25	2022/11/15	1.90
5	フランス	フランス	新株予約権 付社債券等	SAFRAN 0% SAF 23 CB	2,141,428.5	13,611.50	291,480,549	13,605.39	291,349,879	0	2023/6/21	1.84
6	アメリカ	アメリカ	新株予約権 付社債券等	MICROCHIP 1.625% CB	2,195,000	11,771.72	258,389,435	13,091.53	287,359,215	1.625	2027/2/15	1.82
7	アメリカ	中国	新株予約権 付社債券等	CTRIIP.COM 1% CB	2,681,000	10,585.15	283,787,945	10,668.32	286,017,820	1	2020/7/1	1.81
8	アメリカ	ドイツ	新株予約権 付社債券等	QIAGEN 1% CB	2,400,000	11,531.62	276,758,935	11,826.99	283,847,820	1	2024/11/13	1.80
9	ドイツ	ドイツ	新株予約権 付社債券等	DEUTSCHE WOHNEN 0.325%CB	2,000,000	13,843.78	276,875,671	13,713.41	274,268,238	0.325	2024/7/26	1.73
10	日本	日本	新株予約権 付社債券等	ソニー130% コールオプション 条項付第6回無担 保転換社債	226,000,000	121.25	274,043,000	120.50	272,330,000	0	2022/9/30	1.72
11	イギリス	アメリカ	新株予約権 付社債券等	TECHNIPFMC 0.875% CB	2,000,000	13,140.50	262,810,117	13,312.49	266,249,816	0.875	2021/1/25	1.68
12	ドイツ	ドイツ	新株予約権 付社債券等	ADIDAS AG 0.05% ADS CB	2,000,000	13,211.03	264,220,695	13,165.77	263,315,511	0.05	2023/9/12	1.67
13	アメリカ	アメリカ	新株予約権 付社債券等	VISHAY 2.25% CB	2,216,000	10,150.37	224,932,208	10,913.52	241,843,747	2.25	2025/6/15	1.53
14	イギリス	フランス	新株予約権 付社債券等	TOTAL 0.5% FP CB	2,000,000	11,537.04	230,740,980	11,726.09	234,521,985	0.5	2022/12/2	1.48
15	アメリカ	アメリカ	新株予約権 付社債券等	BOOKING HLDGS 0.9% CB	1,808,000	12,404.00	224,264,320	12,849.76	232,323,819	0.9	2021/9/15	1.47
16	アメリカ	アメリカ	新株予約権 付社債券等	DISH NETWORK 2.375% CB	2,531,000	9,141.74	231,377,642	9,078.17	229,768,673	2.375	2024/3/15	1.45
17	イギリス	中国	新株予約権 付社債券等	CRRC CORP LTD 0% CB	2,000,000	11,245.99	224,919,960	11,361.95	227,239,064	0	2021/2/5	1.44
18	ドイツ	ドイツ	新株予約権 付社債券等	RAG-STIFTUNG 0% EVK REB	1,700,000	12,561.30	213,542,209	12,680.37	215,566,300	0	2021/2/18	1.36
19	フランス	フランス	新株予約権 付社債券等	ARCHER 0% KER EB	1,300,000	15,393.73	200,118,581	16,363.08	212,720,125	0	2023/3/31	1.35
20	イギリス	アラブ 首長国 連邦	新株予約権 付社債券等	DP WORLD 1.75% CB	2,000,000	10,531.99	210,639,855	10,574.63	211,492,630	1.75	2024/6/19	1.34
21	アメリカ	アメリカ	新株予約権 付社債券等	LIVE NATION 2.5% CB	1,702,000	11,893.47	202,427,004	12,421.16	211,408,249	2.5	2023/3/15	1.34
22	イギリス	中国	新株予約権 付社債券等	SHANGHAI PORT 0% 21 EB	1,831,000	11,066.14	202,621,024	11,260.83	206,185,953	0	2021/8/9	1.30
23	イギリス	イギリス	新株予約権 付社債券等	BP CAPITAL 1% BP CB	1,100,000	17,658.06	194,238,743	18,521.10	203,732,200	1	2023/4/28	1.29
24	アメリカ	台湾	新株予約権 付社債券等	ZHEN DING TECH 0% CB	1,800,000	11,133.58	200,404,563	11,314.55	203,661,940	0	2019/6/26	1.29

25	イギリス	日本	新株予約権付社債券等	三菱ケミカルホールディングス 0% MAR 2 2 CB	200,000,000	102.00	204,007,000	100.37	200,752,000	0	2022/3/30	1.27
26	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	PALO ALTO 0.75% CB	1,696,000	11,386.53	193,115,714	11,783.35	199,845,735	0.75	2023/7/1	1.26
27	イギリス	香港	新株予約権付社債券等	ASM PACIFIC TECH 2% CB	14,000,000	1,413.68	197,915,326	1,416.31	198,284,726	2	2019/3/28	1.25
28	イギリス	中国	新株予約権付社債券等	HARVEST INTL 0% EB	14,000,000	1,376.95	192,773,360	1,415.27	198,138,546	0	2022/11/21	1.25
29	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	LIB MED IT 1.75% 144A EB	1,524,000	11,523.53	175,618,712	12,847.11	195,789,968	1.75	2046/9/30	1.24
30	イギリス	中国	新株予約権付社債券等	CHINA O/S L&I 0% CB	1,600,000	11,914.81	190,637,075	11,978.49	191,655,976	0	2023/1/5	1.21

(注)上記の「国/地域」は、マザーファンドが保有する有価証券の発行地または上場取引所の国/地域を表しています。なお、「投資国」は、どこへの投資であるかを委託会社が分類し、記載したものです。そのため、有価証券の発行地と実質的な事業活動が行われている地域が異なる場合等には、上記の「国/地域」と「投資国」における国/地域名が異なる場合があります。

種類別および業種別投資比率

(平成31年2月20日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.39

(参考) G I Mワールド・C B・オープン・マザーファンド

(平成31年2月20日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	0.55
		資本財	1.77
		ヘルスケア機器・サービス	0.50
		ソフトウェア・サービス	0.53
小計			3.35
新株予約権証券	-		0.11
新株予約権付社債券等	-		92.18

(注)株式には優先証券を含みます。

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

平成31年2月20日および同日前1年以内における各月末ならびに下記計算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)
16期	(平成21年7月30日)	15,368	15,456	0.8761	0.8811
17期	(平成22年2月1日)	14,779	14,858	0.9303	0.9353

18期	(平成22年7月30日)	13,921	13,998	0.9008	0.9058
19期	(平成23年1月31日)	11,249	11,309	0.9418	0.9468
20期	(平成23年8月1日)	10,950	11,023	0.9001	0.9061
21期	(平成24年1月30日)	10,016	10,075	0.8395	0.8445
22期	(平成24年7月30日)	9,616	9,673	0.8513	0.8563
23期	(平成25年1月30日)	10,026	10,276	1.0027	1.0277
24期	(平成25年7月30日)	9,407	10,048	1.0262	1.0962
25期	(平成26年1月30日)	9,593	10,531	1.0218	1.1218
26期	(平成26年7月30日)	11,885	12,352	1.0196	1.0596
27期	(平成27年1月30日)	13,779	14,445	1.0346	1.0846
28期	(平成27年7月30日)	17,322	18,174	1.0162	1.0662
29期	(平成28年2月1日)	20,253	20,339	0.9439	0.9479
30期	(平成28年8月1日)	19,810	19,899	0.8927	0.8967
31期	(平成29年1月30日)	20,036	20,140	0.9622	0.9672
32期	(平成29年7月31日)	19,719	19,800	0.9802	0.9842
33期	(平成30年1月30日)	18,667	18,850	1.0186	1.0286
34期	(平成30年7月30日)	16,851	16,902	0.9970	1.0000
35期	(平成31年1月30日)	15,328	15,378	0.9348	0.9378
	平成30年2月末日	18,233	-	0.9974	-
	平成30年3月末日	17,321	-	0.9756	-
	平成30年4月末日	16,978	-	0.9927	-
	平成30年5月末日	16,893	-	0.9925	-
	平成30年6月末日	16,669	-	0.9858	-
	平成30年7月末日	16,790	-	0.9925	-
	平成30年8月末日	16,846	-	0.9963	-
	平成30年9月末日	16,763	-	1.0056	-
	平成30年10月末日	15,712	-	0.9497	-
	平成30年11月末日	15,714	-	0.9537	-
	平成30年12月末日	14,967	-	0.9122	-
	平成31年1月末日	15,364	-	0.9359	-
	平成31年2月20日	15,708	-	0.9595	-

分配の推移

期	1口当たり分配金(円)
16期	0.0050
17期	0.0050
18期	0.0050
19期	0.0050
20期	0.0060
21期	0.0050
22期	0.0050
23期	0.0250
24期	0.0700

25期	0.1000
26期	0.0400
27期	0.0500
28期	0.0500
29期	0.0040
30期	0.0040
31期	0.0050
32期	0.0040
33期	0.0100
34期	0.0030
35期	0.0030

収益率の推移

期	収益率（％）
16期	25.5
17期	6.8
18期	2.6
19期	5.1
20期	3.8
21期	6.2
22期	2.0
23期	20.7
24期	9.3
25期	9.3
26期	3.7
27期	6.4
28期	3.1
29期	6.7
30期	5.0
31期	8.3
32期	2.3
33期	4.9
34期	1.8
35期	5.9

（注）収益率とは計算期間末の基準価額（分配付）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落）（以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除したものです。

（４）設定及び解約の実績

下記計算期間中の設定および解約の実績ならびに当該計算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）
16期	430,350,823	1,274,055,645	17,542,465,003
17期	737,789,966	2,392,991,127	15,887,263,842

18期	620,204,664	1,053,496,676	15,453,971,830
19期	221,616,571	3,731,243,595	11,944,344,806
20期	1,405,455,201	1,183,877,232	12,165,922,775
21期	332,592,618	567,925,464	11,930,589,929
22期	124,714,798	759,053,392	11,296,251,335
23期	171,511,237	1,468,666,241	9,999,096,331
24期	551,562,028	1,383,404,854	9,167,253,505
25期	1,316,321,491	1,095,254,478	9,388,320,518
26期	2,952,001,407	682,657,498	11,657,664,427
27期	3,079,005,319	1,417,914,449	13,318,755,297
28期	4,941,915,491	1,213,720,820	17,046,949,968
29期	5,422,604,425	1,011,769,845	21,457,784,548
30期	1,837,424,549	1,103,941,157	22,191,267,940
31期	902,314,885	2,268,944,720	20,824,638,105
32期	2,652,475,817	3,358,340,803	20,118,773,119
33期	1,640,315,256	3,432,561,099	18,326,527,276
34期	655,828,938	2,081,062,289	16,901,293,925
35期	437,873,216	940,634,647	16,398,532,494

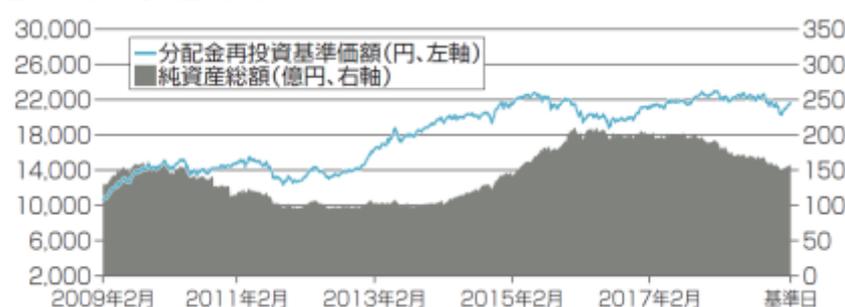
（注）設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

<参考情報>

最新の運用実績は、委託会社ホームページ（<http://www.jpmorganasset.co.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	2019年2月20日	設定日	2001年9月28日
純資産総額	157億円	決算回数	年2回

基準価額・純資産の推移



分配の推移

期	年月	円
31期	2017年1月	50
32期	2017年7月	40
33期	2018年1月	100
34期	2018年7月	30
35期	2019年1月	30
	設定来累計	8,430

* 分配金は税引前1万口当たりの金額です。

* 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。

通貨別構成状況

通貨	投資比率 1
米ドル	58.8%
ユーロ	18.7%
日本円	11.5%
香港ドル	3.7%
スイスフラン	1.8%
英ポンド	1.5%

国別構成状況

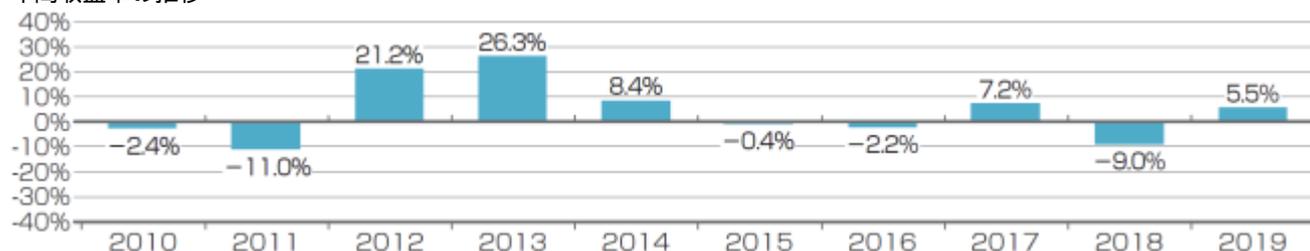
投資国 2	投資比率 1
アメリカ	33.9%
中国	14.9%
日本	12.4%
ドイツ	10.7%
フランス	10.6%
その他	13.5%

* ベビーファンドにおいて、為替ヘッジを行っています。

組入上位銘柄

順位	銘柄名	種類	クーポン(%)	償還日	投資国 ^{※2}	通貨	投資比率 ^{※1}
1	エアバス	CB	0.000	2022/7/1	フランス	ユーロ	2.7%
2	オン・セミコンダクター	CB	1.625	2023/10/15	アメリカ	米ドル	2.0%
3	STマイクロエレクトロニクス	CB	0.000	2022/7/3	フランス	米ドル	2.0%
4	微博	CB	1.250	2022/11/15	中国	米ドル	1.9%
5	サフラン	CB	0.000	2023/6/21	フランス	ユーロ	1.8%
6	マイクロチップ・テクノロジー	CB	1.625	2027/2/15	アメリカ	米ドル	1.8%
7	携程旅行網	CB	1.000	2020/7/1	中国	米ドル	1.8%
8	キアゲン	CB	1.000	2024/11/13	ドイツ	米ドル	1.8%
9	ドイチェ・ヴォーネン	CB	0.325	2024/7/26	ドイツ	ユーロ	1.7%
10	ソニー	CB	0.000	2022/9/30	日本	日本円	1.7%

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年の年間収益率は前年末営業日から2019年2月20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、「JPMワールド・CB・オープン」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。
- ・ CBとは新株予約権付社債券等のことです。

- 1 ファンドはマザーファンドを通じて投資を行うため、マザー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。
- 2 「投資国」は、どこの国への投資であるかを委託会社が分類し、記載したものです。

第3【ファンドの経理状況】

原届出書「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35期計算期間（平成30年7月31日から平成31年1月30日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【JPMワールド・CB・オープン】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第34期 (平成30年7月30日現在)	第35期 (平成31年1月30日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	17,064,611,189	15,477,853,689
派生商品評価勘定	367,792	42,094,740
未収入金	24,158,412	6,156,276
流動資産合計	17,089,137,393	15,526,104,705
資産合計		
17,089,137,393		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	21,995,647	9,779,778
未払収益分配金	50,703,881	49,195,597
未払解約金	24,158,412	6,156,276
未払受託者報酬	9,289,645	8,700,879
未払委託者報酬	130,054,970	121,812,208
その他未払費用	1,620,000	1,620,000
流動負債合計	237,822,555	197,264,738
負債合計		
237,822,555		
純資産の部		
元本等		
元本	1 16,901,293,925	1 16,398,532,494
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 49,979,087	2 1,069,692,527
（分配準備積立金）	409,872,836	338,183,888
元本等合計	16,851,314,838	15,328,839,967
純資産合計		
16,851,314,838		
負債純資産合計		
17,089,137,393		
15,526,104,705		

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第34期 (自 平成30年1月31日 至 平成30年7月30日)	第35期 (自 平成30年7月31日 至 平成31年1月30日)
営業収益		
有価証券売買等損益	212,402,430	931,185,955
為替差損益	21,915	80,803,536
営業収益合計	212,424,345	850,382,419
営業費用		
受託者報酬	9,289,645	8,700,879
委託者報酬	1 130,054,970	1 121,812,208
その他費用	1,620,000	1,630,800
営業費用合計	140,964,615	132,143,887
営業利益又は営業損失()	353,388,960	982,526,306
経常利益又は経常損失()	353,388,960	982,526,306
当期純利益又は当期純損失()	353,388,960	982,526,306
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()	52,231,797	21,406,352
期首剰余金又は期首欠損金()	340,785,882	49,979,087
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	2,926,540
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	2,926,540
剰余金減少額又は欠損金増加額	38,903,925	12,324,429
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	38,063,700	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	840,225	12,324,429
分配金	2 50,703,881	2 49,195,597
期末剰余金又は期末欠損金()	49,979,087	1,069,692,527

(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. デリバティブ等の評価基準および評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 為替予約の評価は、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第34期 (平成30年7月30日現在)	第35期 (平成31年1月30日現在)
1 期首元本額	18,326,527,276円	16,901,293,925円
期中追加設定元本額	655,828,938円	437,873,216円
期中一部解約元本額	2,081,062,289円	940,634,647円
2 元本の欠損	49,979,087円	1,069,692,527円
受益権の総数	16,901,293,925口	16,398,532,494口
1 口当たりの純資産額 (1万口当たりの純資産額)	0.9970円 (9,970円)	0.9348円 (9,348円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第34期 (自 平成30年1月31日 至 平成30年7月30日)	第35期 (自 平成30年7月31日 至 平成31年1月30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10,000分の35の率を乗じて得た額	同左
2 分配金の計算過程		
費用控除後の配当等収益額	- 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	90,226,763円	98,118,967円
分配準備積立金額	460,576,717円	387,379,485円
当ファンドの分配対象収益額	550,803,480円	485,498,452円
当ファンドの期末残存口数	16,901,293,925口	16,398,532,494口
1万口当たり収益分配対象額	325.89円	296.06円
1万口当たり分配金額	30.00円	30.00円
収益分配金金額	50,703,881円	49,195,597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. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>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およびデリバティブ取引であります。</p> <p>G I Mワールド・C B・オープン・マザーファンド</p> <p>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、株価変動リスク、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。</p> <p>なお、デリバティブ取引は、通貨関連では信託財産の効率的な運用に資する目的ならびに外貨建資産の為替変動リスクを回避し、安定的な利益の確保を目的として利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>当ファンドは運用を外部委託しておりますが、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・ダイレクターおよび外部委託先において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、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果（パフォーマンス）のモニターを行います。さらに外部委託先のインベストメント・ダイレクターは、リスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。</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)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。</p>

金融商品の時価等に関する事項

	各計算期間末
1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第34期 (平成30年7月30日現在)	第35期 (平成31年1月30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	103,116,848	869,328,082

合計	103,116,848	869,328,082
----	-------------	-------------

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

区分	種類	第34期(平成30年7月30日現在)				第35期(平成31年1月30日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場 取引 以外 の取 引	為替予約取引 買建								
	アメリカドル	-	-	-	-	156,083,992	-	157,250,219	1,166,227
	売建								
	アメリカドル	3,738,641,208	-	3,751,213,959	12,572,751	4,909,799,218	-	4,887,818,171	21,981,047
	ユーロ	1,752,855,269	-	1,762,278,165	9,422,896	1,441,295,628	-	1,424,686,320	16,609,308
	英ポンド	361,951,985	-	361,584,193	367,792	303,419,186	-	310,860,806	7,441,620
合計		5,853,448,462	-	5,875,076,317	21,627,855	6,810,598,024	-	6,780,615,516	32,314,962

(注) 1. 為替予約の時価の算定方法

- (1) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
為替予約の受渡日(以下「当該日」という。)の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は当該為替予約は当該仲値で評価しております。
当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・当該日を越える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。
・当該日を越える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値により評価しております。
- (2) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値により評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等および時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(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(平成31年1月30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ワールド・C B・オープン・マザーファンド	5,420,745,172	15,477,853,689	
合計			5,420,745,172	15,477,853,689	

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

当表に記載すべき内容は、「デリバティブ取引等に関する注記 取引の時価等に関する事項」に開示しておりますので、記載を省略しております。

(参考)

当ファンドは「GIMワールド・CB・オープン・マザーファンド」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ワールド・CB・オープン・マザーファンド」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	(平成30年7月30日現在)	(平成31年1月30日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		783,505,753	963,230,787
金銭信託		395,419,076	-
コール・ローン		-	202,591,300
株式		544,762,135	515,863,391
新株予約権証券		113,240,485	25,384,436
社債券		15,485,558,794	14,449,924,777
派生商品評価勘定		-	519,908
未収入金		79,976,873	-
未収配当金		2,151,924	2,342,725
未収利息		29,949,396	25,205,742
前払費用		718,876	1,715,334
流動資産合計		17,435,283,312	16,186,778,400
資産合計		17,435,283,312	16,186,778,400
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	4,875
未払金		293,270,103	657,610,571
未払解約金		24,158,412	6,156,276
未払利息		-	593
流動負債合計		317,428,515	663,772,315
負債合計		317,428,515	663,772,315
純資産の部			
元本等			
元本	1	5,652,988,840	5,436,586,151
剰余金			
剰余金又は欠損金()		11,464,865,957	10,086,419,934
元本等合計		17,117,854,797	15,523,006,085
純資産合計		17,117,854,797	15,523,006,085
負債純資産合計		17,435,283,312	16,186,778,400

(注) 「GIMワールド・CB・オープン・マザーファンド」の計算期間は、毎年1月31日から翌年1月30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、当ファンドの計算期間と異なります。

(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
--	-----------

1. 有価証券の評価基準および評価方法	<p>株式および新株予約権証券 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>社債券 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>
2. デリバティブ等の評価基準および評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 為替予約の評価は、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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）第60条および第61条に従って処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	(平成30年7月30日現在)	(平成31年1月30日現在)
1期首元本額	6,217,373,090円	5,652,988,840円
期中追加設定元本額	301,943,364円	217,397,028円
期中解約元本額	866,327,614円	433,799,717円
元本の内訳（注）		
JPMワールド・CB・オープン	5,635,418,642円	5,420,745,172円
GIMワールド・CB・オープンVA	17,570,198円	15,840,979円
（適格機関投資家専用）		
合計	5,652,988,840円	5,436,586,151円
受益権の総数	5,652,988,840口	5,436,586,151口
1口当たりの純資産額	3.0281円	2.8553円
（1万口当たりの純資産額）	(30,281円)	(28,553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. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有した主な金融商品は、株式、新株予約権証券、社債券およびデリバティブ取引であり、当ファンドで利用しているデリバティブ取引は、通貨関連では為替予約取引であります。当ファンドが保有した金融商品およびデリバティブ取引には、株価変動リスク、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。</p> <p>なお、デリバティブ取引は、通貨関連では信託財産の効率的な運用に資する目的として利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>当ファンドは運用を外部委託しておりますが、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・ダイレクターおよび外部委託先において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、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果（パフォーマンス）のモニターを行います。さらに外部委託先のインベストメント・ダイレクターは、リスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。</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)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。</p>

金融商品の時価等に関する事項

	各期間末
1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。一部の債券時価に関しては合理的に算定された価額を採用する場合があります。合理的に算定された価額は発行体の格付けや債券の償還年限を基にした国債に対する上乗せ金利、取引業者からの提示価格、流動性、将来発生しうるキャッシュフロー、その他個々の債券の特性等を考慮して価格提供会社が算出した価格を利用しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 平成30年7月30日現在、該当事項はありません。 平成31年1月30日現在、「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件による場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(平成30年7月30日現在)	(平成31年1月30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)
株式	15,664,920	65,362,447

新株予約権証券	966,740	83,113,869
社債券	424,989,754	690,818,624
合計	408,358,094	839,294,940

(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計算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)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

区分	種類	(平成30年7月30日現在)				(平成31年1月30日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場 取引 以外 の取 引	為替予約取引 買建								
	アメリカドル	-	-	-	-	21,906,516	-	21,906,516	0
	売建								
	英ポンド	-	-	-	-	95,136,562	-	94,643,654	492,908
	香港ドル	-	-	-	-	83,667,000	-	83,640,000	27,000
	シンガポールドル	-	-	-	-	19,727,325	-	19,732,200	4,875
合計		-	-	-	-	220,437,403	-	219,922,370	515,033

(注) 1. 為替予約の時価の算定方法

- (1) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は当該為替予約は当該仲値で評価しております。
当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・当該日を越える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。
 - ・当該日を越える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値により評価しております。
 - (2) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値により評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
 3. 契約額等および時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(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（平成31年1月30日現在）

(イ) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額単価	評価額金額	備考
アメリカドル	NABORS INDUSTRIES LTD 6% PFD	17,981	23.27	418,417.87	*
	COLFAX 5.75% PFD	10,691	115.47	1,234,489.77	*
	STANLEY BLACK & DECKER INC 5.375% PFD	12,332	93.45	1,152,487.06	*
	BECTON DICKINSON AND CO 6.125% A PFD	11,501	60.65	697,535.65	*
	MANDATORY EXCH TRUST 5.75% 144A PFD	5,146	176.51	908,366.77	*
小計	銘柄数：	5		4,411,297.12	
				(482,684,130)	
	組入時価比率：	3.1%		93.6%	
英ポンド	PREMIER OIL PLC	329,940	0.70	231,617.88	
小計	銘柄数：	1		231,617.88	
				(33,179,261)	
	組入時価比率：	0.2%		6.4%	

合計				515,863,391	
				(515,863,391)	

(注) 各通貨計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(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) 備考欄の*の銘柄は優先証券であることを表しております。

(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
新株予約権証券	ユーロ	SIEMENS AG-CW19 15 WRT		18.00	188,100.00	
	計	銘柄数 :	1	18.00	188,100.00	
					(23,533,191)	
		組入時価比率 :	0.2%		0.2%	
英ポンド		PREMIER OIL PLC-CW22 WRT		47,079.00	12,923.18	
	計	銘柄数 :	1	47,079.00	12,923.18	
					(1,851,245)	
		組入時価比率 :	0.0%		0.0%	
	小計				25,384,436	
					(25,384,436)	
社債券	日本円	清水建設 0% OCT 2 0 CB		140,000,000	140,345,800	
		関電工 0% MAR 2 1 CB		70,000,000	74,072,600	
		江崎グリコ 0% JAN 2 4 CB		110,000,000	111,740,200	
		エディオン 0% JUN 2 5 CB		110,000,000	118,297,300	
		飯田グループホールディング ス 0% JUN 2 0 CB		70,000,000	69,738,900	
		東レ 0% AUG 1 9 C B		90,000,000	91,274,400	
		大王製紙 0% SEP 2 0 CB		90,000,000	91,275,300	
		LINE 0% SEP 2 3 CB		90,000,000	85,335,300	
		三菱ケミカルホールディング ス 0% MAR 2 2 CB		270,000,000	275,413,500	
		サイバーエージェント 0% FEB 2 3 CB		40,000,000	42,371,600	
		サイバーエージェント 0% FEB 2 5 CB		30,000,000	31,983,000	
		SANKYO 0% JUL 2 0 CB		90,000,000	90,011,700	
		ミネベアミツミ 0% AU G 2 2 CB		30,000,000	34,125,000	
		ソニー 1 3 0% コールオブ ション条項付第 6 回無担保転 換社債		183,000,000	223,260,000	
		凸版印刷 0% DEC 1 9 CB		170,000,000	170,035,700	
		SBIホールディングス 0% SEP 2 3 CB		150,000,000	155,593,500	
		ANAホールディングス 0% SEP 2 2 CB		350,000,000	353,269,000	
		九州電力 0% MAR 2 2 CB		170,000,000	179,572,700	
計	銘柄数 :	18	2,253,000,000	2,337,715,500		

		組入時価比率：	15.1%		16.1%	
	アメリカドル	ABIGROVE 0% SVST EB		1,800,000.00	1,854,360.00	
		ARCONIC 1.625% CB		735,000.00	724,893.75	
		BIOMARIN PHARM 0.599% CB		793,000.00	821,912.78	
		BOOKING HLDGS 0.9% CB		1,808,000.00	2,024,960.00	
		CHINA O/S L&I 0% CB		1,600,000.00	1,721,328.00	
		CHINA YANGTZE 0% EB		1,296,000.00	1,414,558.08	
		CRRC CORP LTD 0% CB		2,000,000.00	2,030,880.00	
		CTRIP.COM 1.99% CB		1,144,000.00	1,146,070.64	
		CTRIP.COM 1% CB		2,681,000.00	2,562,419.37	
		DEUTSCHE BK LDN 1% EB		940,000.00	867,150.00	
		DISH NETWORK 2.375% CB		2,531,000.00	2,089,188.64	
		DP WORLD 1.75% CB		2,000,000.00	1,901,940.00	
		ENSCO 3% CB		1,176,000.00	905,520.00	
		EXACT SCIENCES 1% CB		485,000.00	649,085.20	
		GLENCORE 0% EMTN CB		1,800,000.00	1,574,100.00	
		GOLAR LNG 2.75% CB		1,024,000.00	962,836.48	
		GREENBRIER 2.875% CB		928,000.00	948,100.48	
		IAC FIN 0.875% CB		733,000.00	1,058,591.27	
		ILLUMINA 0% CB		678,000.00	788,859.78	
		ILLUMINA 0% J CB		1,521,000.00	1,544,970.96	
		LIB MED IT 1.75% 144A EB		1,524,000.00	1,585,722.00	
		LIBERTY EXPEDIA 1% EB		1,672,000.00	1,606,758.56	
		LIBERTY MEDIA 1% CB		1,349,000.00	1,408,396.47	
		LIVE NATION 2.5% CB		1,295,000.00	1,384,432.70	
		LVMH MOET 0% MCFP CB		848,000.00	1,094,669.61	
		MICROCHIP 1.625% CB		2,195,000.00	2,333,087.45	
		MOMO 1.25% 144A CB		1,201,000.00	1,003,555.60	
		NEW RELIC 0.5% CB		1,205,000.00	1,339,104.45	
		NXP SEMICOND 1% CB		1,248,000.00	1,277,465.28	
		ON SEMICOND 1.625% CB		2,206,000.00	2,603,013.82	
		PALO ALTO 0.75% CB		1,696,000.00	1,743,708.48	
		PRICELINE 0.35% CB		1,113,000.00	1,561,416.57	
		QIAGEN 1% CB		2,400,000.00	2,498,952.00	
		SHANGHAI PORT 0% 21 EB		1,831,000.00	1,829,535.20	
		SIEMENS 1.65%		750,000.00	782,767.50	
		SILICON LABO 1.375% CB		1,466,000.00	1,665,815.80	
		SPLUNK 0.5% CB		1,426,000.00	1,480,387.64	
		SPLUNK 1.125% CB		425,000.00	443,780.75	
		SQUARE 0.5% CB		814,000.00	940,845.62	
		STMICRO 0% A CB		2,600,000.00	2,732,418.00	
		SUPERNUS 0.625% 144A CB		1,054,000.00	1,027,787.02	
		TAIWAN CEMENT 0% CB		300,000.00	314,034.00	
		TOTAL 0.5% FP CB		2,000,000.00	2,083,440.00	
		TRANSOCEAN 0.5% CB		658,000.00	718,318.86	
		TWITTER 0.25% E CB		655,000.00	595,663.55	
		TWLO 0.25% CB		560,000.00	885,057.60	
		VISHAY 2.25% CB		2,216,000.00	2,030,990.59	
		WEIBO 1.25% 144A CB		2,910,000.00	2,598,804.60	
		WORKDAY 0.25% CB		1,214,000.00	1,552,900.24	
		YAMAGUCHI FIN FLT CB		1,300,000.00	1,276,951.00	
		YUE XIU ENT 1.5% EB		250,000.00	300,587.50	
		ZHEN DING TECH 0% CB		1,800,000.00	1,809,522.00	
	計	銘柄数：	52	71,854,000.00	74,101,615.89	
					(8,108,198,810)	

		組入時価比率：	52.2%		56.0%
	ユーロ	AABAR INVEST 0.5% UCG EB		1,600,000.00	1,504,880.00
		ADIDAS AG 0.05% ADS CB		2,000,000.00	2,101,660.00
		AIRBUS 0% AIR CB		2,800,000.00	3,274,460.00
		ARCHER 0% KER EB		1,000,000.00	1,214,180.00
		BAYER 5.625% REGS CB		600,000.00	481,704.00
		BEKAERT 0% BEKB CB		700,000.00	608,706.00
		BUZZI UNICEM1.375%BZU CB		800,000.00	870,224.00
		DEUTSCHE WOHNEN 0.325%CB		2,000,000.00	2,202,320.00
		FRESENIUS 0% FRE CB		600,000.00	624,654.00
		FRESENIUS 1.125% FME CB		900,000.00	943,110.00
		LEG IMMO 0.5% LEG CB		500,000.00	949,655.00
		LEG IMMO 0.875% LEG CB		1,200,000.00	1,309,296.00
		RAG-STIFTUNG 0% EVK R EB		2,400,000.00	2,397,984.00
		SAFRAN 0% SAF 23 CB		2,141,428.50	2,318,489.89
		TECHNIPFMC 0.875% CB		2,000,000.00	2,090,440.00
		ZHEJIANG EXPRESSWAY0% CB		800,000.00	772,016.00
	計	銘柄数：	16	22,041,428.50	23,663,778.89
					(2,960,575,376)
		組入時価比率：	19.1%		20.5%
	英ポンド	BP CAPITAL 1% BP CB		1,100,000.00	1,342,726.00
	計	銘柄数：	1	1,100,000.00	1,342,726.00
					(192,345,499)
		組入時価比率：	1.2%		1.3%
	スイスフラン	SIKA 0.15% CB		1,460,000.00	1,500,150.00
		SIKA 3.75% CB		1,000,000.00	1,035,920.00
	計	銘柄数：	2	2,460,000.00	2,536,070.00
					(278,942,339)
		組入時価比率：	1.8%		1.9%
	香港ドル	ASM PACIFIC TECH 2% CB		14,000,000.00	14,026,600.00
		CHINA CONCH 0% CB		8,000,000.00	7,818,080.00
		HARVEST INTL 0% EB		14,000,000.00	13,662,180.00
		ZHONGSHENG GRP 0% CB		6,000,000.00	5,507,280.00
	計	銘柄数：	4	42,000,000.00	41,014,140.00
					(572,147,253)
		組入時価比率：	3.7%		4.0%
	小計				14,449,924,777
					(12,112,209,277)
	合計				14,475,309,213
					(12,137,593,713)

(注) 各通貨計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注) 小計・合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(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

当表に記載すべき内容は、「デリバティブ取引等に関する注記 取引の時価等に関する事項」に開示しておりますので、記載を省略しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(平成31年2月20日現在)

種類	金額	単位
資産総額	15,784,657,671	円
負債総額	75,779,209	円
純資産総額(-)	15,708,878,462	円
発行済口数	16,372,791,863	口
1口当たり純資産額(/)	0.9595	円

(参考) G I Mワールド・C B・オープン・マザーファンド

(平成31年2月20日現在)

種類	金額	単位
資産総額	15,870,395,225	円
負債総額	59,994,076	円
純資産総額(-)	15,810,401,149	円
発行済口数	5,362,877,324	口
1口当たり純資産額(/)	2.9481	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（平成30年 8 月末現在）

（略）

（略）

投資運用の意思決定機構

（イ）、（ロ）（略）

（注）前記（イ）および（ロ）の意思決定機構、組織名称等は、平成30年 8 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（平成31年 2 月末現在）

（略）

（略）

投資運用の意思決定機構

（イ）、（ロ）（略）

（注）前記（イ）および（ロ）の意思決定機構、組織名称等は、平成31年 2 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】

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 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、平成31年 2 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	67	914,205
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	57	2,897,740
総合計	124	3,811,945
親投資信託	51	-

（注）百万円未満は四捨五入

3【委託会社等の経理状況】

<訂正前>

1．委託会社であるJ Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号。以下「金融商品取引業等に関する内閣府令」という。）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表について、P w Cあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

<訂正後>

1．委託会社であるJ Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号。以下「金融商品取引業等に関する内閣府令」という。）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表及び中間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28期事業年度（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表について、P w Cあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

また、第29期中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、P w Cあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

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、以下の中間財務諸表が追加されます。

<追加>

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

		第29期中間会計期間末 (平成30年9月30日)		
資産の部				
区分	注記 番号	内訳	金額	構成比
		(千円)	(千円)	(%)
流動資産				
現金及び預金			13,960,009	
前払費用			57,090	
未収入金			7,626	
未収委託者報酬			2,373,381	
未収収益			1,396,871	
関係会社短期貸付金			4,551,000	
その他			2,991	
流動資産計			22,348,971	98.6
固定資産				
投資その他の資産			306,156	
関係会社株式		60,000		
投資有価証券		28		
敷金保証金		98,261		
前払年金費用		76,691		
その他		71,174		
固定資産計			306,156	1.4
資産合計			22,655,127	100.0

		第29期中間会計期間末 (平成30年9月30日)		
負債の部				
区分	注記 番号	内訳	金額	構成比
		(千円)	(千円)	(%)
流動負債				
預り金			89,656	
未払金			1,686,357	
未払手数料		1,172,882		
その他未払金	1	513,475		
未払費用			564,065	
未払法人税等			972,219	
賞与引当金			1,204,583	
流動負債計			4,516,881	20.0
固定負債				
長期未払金			314,355	
賞与引当金			605,290	
固定負債計			919,646	4.0
負債合計			5,436,528	24.0

		第29期中間会計期間末 (平成30年9月30日)		
純資産の部				
区分	注記 番号	内訳	金額	構成比
		(千円)	(千円)	(%)
株主資本				
資本金			2,218,000	
資本剰余金			1,000,000	
資本準備金		1,000,000		
利益剰余金			14,000,600	
利益準備金		33,676		
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		13,966,924		
株主資本計			17,218,600	76.0
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金			1	
評価・換算差額等計			1	0.0
純資産合計			17,218,598	76.0
負債・純資産合計			22,655,127	100.0

(2) 中間損益計算書

		第29期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)		
区分	注記 番号	内訳	金額	百分比
		(千円)	(千円)	(%)
営業収益				
委託者報酬			7,396,730	
運用受託報酬			3,040,765	
業務受託報酬			1,035,075	
その他			148,503	
営業収益計			11,621,075	100.0
営業費用・一般管理費				
営業費用			5,137,042	
支払手数料		3,918,792		
調査費		890,010		
その他営業費用		328,239		
一般管理費			4,719,652	
営業費用・一般管理費計			9,856,695	84.8
営業利益			1,764,379	15.2
営業外収益	1	32,802		
営業外収益計			32,802	0.3
営業外費用	2	17,858		
営業外費用計			17,858	0.2
経常利益			1,779,322	15.3
税引前中間純利益			1,779,322	15.3
法人税、住民税及び事業税			914,180	7.9
中間純利益			865,142	7.4

重要な会計方針

項目	第29期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
1. 有価証券の評価基準 及び評価方法	<p>(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。</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの 中間決算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。</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対する賞与の支給、及び親会社の運営する株式報酬制度に係る将来の費用負担に備えるため、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員に対する退職給付に備えるため、当中間期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、当中間期末においては、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中間期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。 過去勤務債務については、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。</p>
3. その他中間財務諸表 作成のための基本と なる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第29期中間会計期間末 （平成30年9月30日）	
1	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第29期中間会計期間 （自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）	
1	営業外収益のうち主要なもの（千円） 受取利息 8,785
2	営業外費用のうち主要なもの（千円） 為替差損 17,727

（リース取引関係）

第29期中間会計期間末 （平成30年9月30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。	
1年以内	48,482 千円
1年超	44,442 千円
合計	92,924 千円

（金融商品関係）

第29期中間会計期間末（平成30年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成30年9月30日における中間貸借対照表計上額、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、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません（注）2．参照）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	13,960,009	13,960,009	-
(2) 未収委託者報酬	2,373,381	2,373,381	-
(3) 未収収益	1,396,871	1,396,871	-
(4) 関係会社短期貸付金	4,551,000	4,551,000	-
(5) 投資有価証券	28	28	-
資産計	22,281,290	22,281,290	-
(1) 未払手数料	1,172,882	1,172,882	-
(2) その他未払金	513,475	513,475	-
(3) 未払費用	564,065	564,065	-
(4) 長期未払金	314,355	314,355	-
負債計	2,564,778	2,564,778	-

（注）1．金融商品の時価算定方法

資産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益、及び(4) 関係会社短期貸付金

これらは短期間で決済されるため、時価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。

(5) 投資有価証券

これらは投資信託であり、時価は市場価格に準ずるものとして合理的に算定された価額によっております。

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、及び(3) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、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。

(4) 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リスクフリーレート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。

（注）２．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額
関係会社株式	60,000

関係会社株式については、市場価格がなく、かつ、将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、上表に含めておりません。

金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては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があります。

（有価証券関係）

第29期中間会計期間末（平成30年9月30日）

１．関係会社株式

関係会社株式（中間貸借対照表計上額 60,000千円）については市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、記載しておりません。

２．その他有価証券

（単位：千円）

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間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	-	-	-
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他投資信託	28	30	1
合計		28	30	1

（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29期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

1．サービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	業務受託報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	7,396,730	3,040,765	1,035,075	148,503	11,621,075

2．地域ごとの情報

営業収益

（単位：千円）

日本	香港	英国	その他	合計
8,019,379	1,366,327	1,218,668	1,016,699	11,621,075

（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
Jardine Fleming Asset Management Ltd	1,320,915	資産運用業
JPMorgan Asset Management (UK) Limited	1,209,785	資産運用業

（1株当たり情報）

第29期中間会計期間 （自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）	
1株当たり純資産額	306,026円81銭
1株当たり中間純利益金額	15,376円20銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たりの中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	865,142千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	865,142千円
普通株式の期中平均株式数	56,265株

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 三井住友信託銀行株式会社
 資本金の額 342,037百万円（平成30年3月末現在）

(略)

(2) 販売会社

	名 称	資本金の額 (平成30年3月末現在)	事業の内容
		(略)	
5	九州FG証券株式会社*	3,000百万円)	同 上
		(略)	
11	野村証券株式会社	10,000百万円 (平成30年7月末現在)	同 上
		(略)	
14	フィデリティ証券株式会社	8,557百万円	同 上
		(略)	

(3) 運用委託先の会社

名 称	資本金の額 (平成30年3月末現在)	事業の内容

(以下略)

<訂正後>

(1) 受託会社

名 称 三井住友信託銀行株式会社
 資本金の額 342,037百万円（平成30年9月末現在）

(略)

(2) 販売会社

	名 称	資本金の額 (平成30年9月末現在)	事業の内容
		(略)	
5	九州FG証券株式会社*	3,000百万円	同 上
		(略)	
11	野村証券株式会社	10,000百万円 (平成31年1月末現在)	同 上
		(略)	
14	フィデリティ証券株式会社	9,257百万円 (平成31年1月23日現在)	同 上

(略)

(3) 運用委託先の会社

名 称	資本金の額 (平成30年9月末現在)	事業の内容
-----	-----------------------	-------

(以下略)

独立監査人の監査報告書

平成31年3月13日

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会御中

P w C あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	荒川 進
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山口 健志

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ワールド・CB・オープンの平成30年7月31日から平成31年1月30日までの計算期間の財務諸表、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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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ワールド・CB・オープンの平成31年1月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

利害関係

JPMorgan・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. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、そ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](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成30年12月10日

J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	荒川	進
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山口	健志

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平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社の平成30年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。