

【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】 2020年4月24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、2019年10月29日付で提出した有価証券届出書(2020年1月9日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。以下「原届出書」といいます。)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)

(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

(略)

三井住友信託銀行株式会社(受託会社)

(再信託受託会社: 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

委託会社との契約により、当ファンドおよびマザーファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理業務および信託財産の計算等を行います。

(略)

## (ハ) 委託会社の概況

資本金 2,218百万円(2019年8月末現在)

(略)

大株主の状況(2019年8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

(略)

三井住友信託銀行株式会社(受託会社)

(再信託受託会社: 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社\*)

委託会社との契約により、当ファンドおよびマザーファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理業務および信託財産の計算等を行います。

\* 関係当局の認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

(略)

## (ハ) 委託会社の概況

資本金 2,218百万円(2020年2月末現在)

(略)

大株主の状況(2020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）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、2019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）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、2019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

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

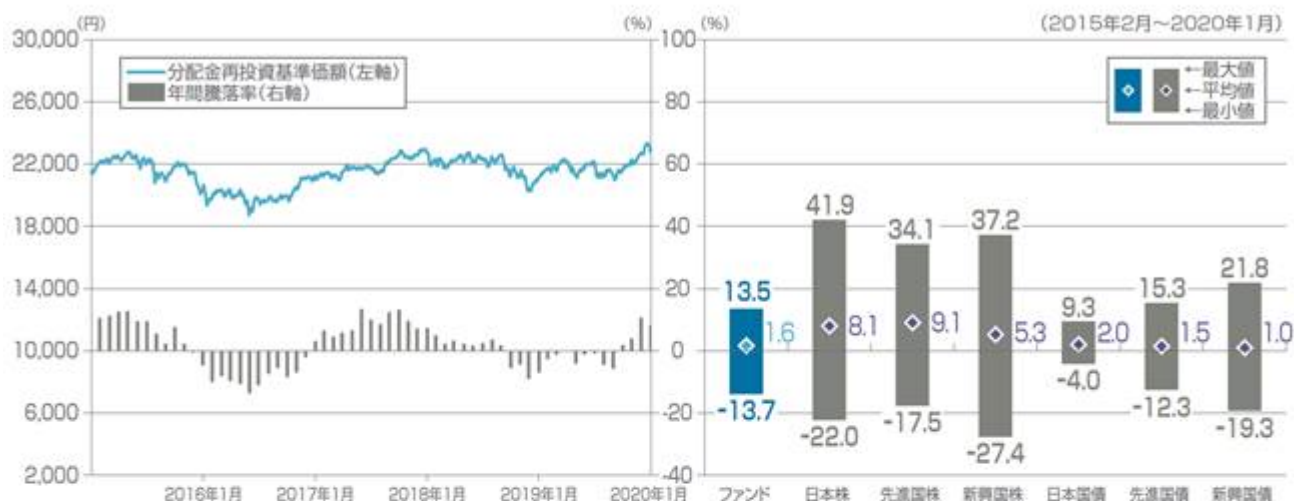
下記グラフは、ファンドの投資リスクをご理解いただくための情報の一つとしてご利用ください。

### <ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移>

2015年2月～2020年1月の5年間に於ける、ファンドの分配金再投資基準価額(日次)と、年間騰落率(毎月末時点)の推移を示したものです。

### <ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較>

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



#### (ご注意)

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

&lt; 訂正前 &gt;

運用委託先におけるリスク管理

( 略 )

( 2019年6月末現在 )

( 以下略 )

&lt; 訂正後 &gt;

運用委託先におけるリスク管理

( 略 )

( 2019年12月末現在 )

( 以下略 )

## 4 【手数料等及び税金】

## ( 5 ) 課税上の取扱い

&lt; 訂正前 &gt;

( 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2019年8月末現在適用されるものです。

( 略 )

2020年1月1日以降の収益分配時において、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。

( 以下略 )

&lt; 訂正後 &gt;

( 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2020年2月末現在適用されるものです。

( 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。

( 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。

&lt; 更新・訂正後 &gt;

## ( 1 ) 投資状況

( 2020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	14,311,187,869	100.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	98,082,536	0.69
合計(純資産総額)		14,213,105,333	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

(2020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	266,245,891	1.86
新株予約権付社債券等	日本	340,130,000	2.37
	アメリカ	8,115,887,100	56.56
	ドイツ	918,096,025	6.40
	フランス	1,546,508,749	10.78
	イギリス	2,633,792,811	18.36
	スイス	321,473,140	2.24
	小計	13,875,887,825	96.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	206,664,975	1.44
合計(純資産総額)		14,348,798,691	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

(2020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	4,322,707,545	3.1689	13,698,472,557	3.3107	14,311,187,869	100.69

(参考) GIMワールド・CB・オープン・マザーファンド

(2020年2月20日現在)

順位	国/地域	投資国/地域	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	STMICRO 0% A CB	2,800,000	16,224.51	454,286,355	17,091.49	478,561,865	0	2022/7/3	3.34
2	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	MICROCHIP 1.625% CB	2,557,000	15,468.25	395,523,251	16,452.63	420,693,921	1.625	2027/2/15	2.93
3	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	ON SEMI COND 1.625% CB	2,826,000	15,109.82	427,003,540	14,093.50	398,282,330	1.625	2023/10/15	2.78
4	フランス	フランス	新株予約権付社債券等	SAFRAN 0% SAF 23 CB	2,425,551.3	14,481.42	351,254,314	14,358.55	348,274,138	0	2023/6/21	2.43
5	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	152.00	343,520,000	150.50	340,130,000	0	2022/9/30	2.37
6	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	PALO ALTO 0.75% CB	2,677,000	12,421.74	332,530,014	12,676.23	339,342,908	0.75	2023/7/1	2.36
7	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	SQUARE 0.5% CB	2,121,000	13,610.65	288,682,031	14,549.41	308,593,089	0.5	2023/5/15	2.15
8	イギリス	スペイン	新株予約権付社債券等	CELLNEX 1.5% CLNX CB	1,600,000	17,571.48	281,143,712	18,982.36	303,717,815	1.5	2026/1/16	2.12

9	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	14,823.09	296,461,923	14,685.84	293,716,905	0.05	2023/9/12	2.05
10	ドイツ	ドイツ	新株予約権付社債券等	SYMRISE 0.2375% CB	1,900,000	14,552.44	276,496,428	15,061.75	286,173,278	0.2375	2024/6/20	1.99
11	フランス	フランス	新株予約権付社債券等	ARCHER 0% KER EB	1,600,000	17,405.96	278,495,408	17,783.31	284,533,003	0	2023/3/31	1.98
12	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	EXACT SCIENCES 0.375% CB	2,142,000	12,325.03	264,002,334	13,214.38	283,052,206	0.375	2027/3/15	1.97
13	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	LIVE NATION 2.5% CB	1,991,000	13,490.80	268,601,992	14,157.93	281,884,423	2.5	2023/3/15	1.96
14	フランス	フランス	新株予約権付社債券等	LVHM MOET 0% MCFP CB	1,254,500	21,651.66	271,620,080	22,050.48	276,623,371	0	2021/2/16	1.93
15	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	COUPA SOFTWARE 0.125% CB	1,890,000	14,155.26	267,534,435	14,602.49	275,987,164	0.125	2025/6/15	1.92
16	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	SPLUNK 0.5% CB	1,810,000	13,568.59	245,591,533	14,622.41	264,665,704	0.5	2023/9/15	1.84
17	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	DEXCOM 0.75% CB	1,178,000	17,527.82	206,477,768	20,558.42	242,178,230	0.75	2023/12/1	1.69
18	アメリカ	ドイツ	新株予約権付社債券等	QIAGEN 1% CB	2,000,000	11,508.35	230,167,100	12,079.33	241,586,654	1	2024/11/13	1.68
19	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	BOOKING HLDGS 0.9% CB	1,893,000	12,378.42	234,323,612	12,617.81	238,855,269	0.9	2021/9/15	1.66
20	イギリス	中国	新株予約権付社債券等	HARVEST INTL 0% EB	16,000,000	1,486.87	237,899,879	1,491.07	238,571,200	0	2022/11/21	1.66
21	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	SNAP 0.75% CB	1,913,000	12,566.47	240,396,757	12,126.07	231,971,725	0.75	2026/8/1	1.62
22	フランス	フランス	新株予約権付社債券等	ORPEA 0.375% CB	1,620,876	13,498.91	218,800,735	14,008.48	227,060,231	0.375	2027/5/17	1.58
23	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	WORKDAY 0.25% CB	1,415,000	15,168.13	214,629,063	15,987.59	226,224,506	0.25	2022/10/1	1.58
24	イギリス	ニュージーランド	新株予約権付社債券等	XERO 2.375% CB	1,404,000	15,647.08	219,685,014	16,022.42	224,954,892	2.375	2023/10/4	1.57
25	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	RINGCENTRAL 0% CB	649,000	27,806.09	180,461,523	33,900.78	220,016,090	0	2023/3/15	1.53
26	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	ENVESTNET 1.75% CB	1,412,000	13,748.42	194,127,711	15,196.17	214,569,980	1.75	2023/6/1	1.50
27	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	BARCLAYS BK 0% FOTR EB	1,820,000	11,573.12	210,630,784	11,655.13	212,123,427	0	2025/2/18	1.48
28	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	DEUTSCHE BK LDN 1% EB	1,703,000	11,764.29	200,346,013	11,893.38	202,544,327	1	2023/5/1	1.41
29	スイス	スイス	新株予約権付社債券等	SIKA 0.15% CB	1,460,000	13,034.03	190,296,943	13,314.30	194,388,871	0.15	2025/6/5	1.35
30	アメリカ	アメリカ	新株予約権付社債券等	FIVE9 0.125% CB	849,000	20,252.96	171,947,631	22,118.01	187,781,929	0.125	2023/5/1	1.31

(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/地域」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/地域」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

(2020年2月20日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.69

(参考) G I Mワールド・C B・オープン・マザーファンド

(2020年2月20日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	素材	0.52
		資本財	0.80
		ヘルスケア機器・サービス	0.54

小計		1.86
新株予約権付社債券等	-	96.70

(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

2020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)
18期	(2010年7月30日)	13,921	13,998	0.9008	0.9058
19期	(2011年1月31日)	11,249	11,309	0.9418	0.9468
20期	(2011年8月1日)	10,950	11,023	0.9001	0.9061
21期	(2012年1月30日)	10,016	10,075	0.8395	0.8445
22期	(2012年7月30日)	9,616	9,673	0.8513	0.8563
23期	(2013年1月30日)	10,026	10,276	1.0027	1.0277
24期	(2013年7月30日)	9,407	10,048	1.0262	1.0962
25期	(2014年1月30日)	9,593	10,531	1.0218	1.1218
26期	(2014年7月30日)	11,885	12,352	1.0196	1.0596
27期	(2015年1月30日)	13,779	14,445	1.0346	1.0846
28期	(2015年7月30日)	17,322	18,174	1.0162	1.0662
29期	(2016年2月1日)	20,253	20,339	0.9439	0.9479
30期	(2016年8月1日)	19,810	19,899	0.8927	0.8967
31期	(2017年1月30日)	20,036	20,140	0.9622	0.9672
32期	(2017年7月31日)	19,719	19,800	0.9802	0.9842
33期	(2018年1月30日)	18,667	18,850	1.0186	1.0286
34期	(2018年7月30日)	16,851	16,902	0.9970	1.0000
35期	(2019年1月30日)	15,328	15,378	0.9348	0.9378
36期	(2019年7月30日)	15,143	15,189	0.9791	0.9821
37期	(2020年1月30日)	13,878	14,115	0.9974	1.0144
	2019年2月末日	15,755	-	0.9638	-
	2019年3月末日	15,653	-	0.9570	-
	2019年4月末日	16,064	-	0.9861	-
	2019年5月末日	15,336	-	0.9445	-
	2019年6月末日	15,074	-	0.9670	-
	2019年7月末日	15,137	-	0.9781	-
	2019年8月末日	14,432	-	0.9447	-
	2019年9月末日	14,270	-	0.9408	-



2019年10月末日	14,509	-	0.9620	-
2019年11月末日	14,692	-	0.9859	-
2019年12月末日	14,707	-	1.0043	-
2020年1月末日	13,845	-	0.9950	-
2020年2月20日	14,213	-	1.0310	-

## 分配の推移

期	1口当たり分配金（円）
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
36期	0.0030
37期	0.0170

## 収益率の推移

期	収益率（％）
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
36期	5.1
37期	3.6

(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）
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
36期	561,864,877	1,493,851,656	15,466,545,715
37期	528,148,826	2,079,897,662	13,914,796,879

(注) 設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

## &lt;参考情報&gt;

最新の運用実績は、委託会社ホームページ（<https://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	2020年2月20日	設定日	2001年9月28日
純資産総額	142億円	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
33期	2018年1月	100
34期	2018年7月	30
35期	2019年1月	30
36期	2019年7月	30
37期	2020年1月	170
	設定来累計	8,630

\* 分配金は税引前1万円当たりの金額です。

\* 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、1万円当たり、信託報酬控除後です。

## 通貨別構成状況

通貨	投資比率 <sup>1</sup>
米ドル	69.3%
ユーロ	17.9%
香港ドル	5.2%
日本円	3.4%
スイスフラン	2.3%
英ポンド	1.1%

\* ベビーファンドにおいて、為替ヘッジを行っています。

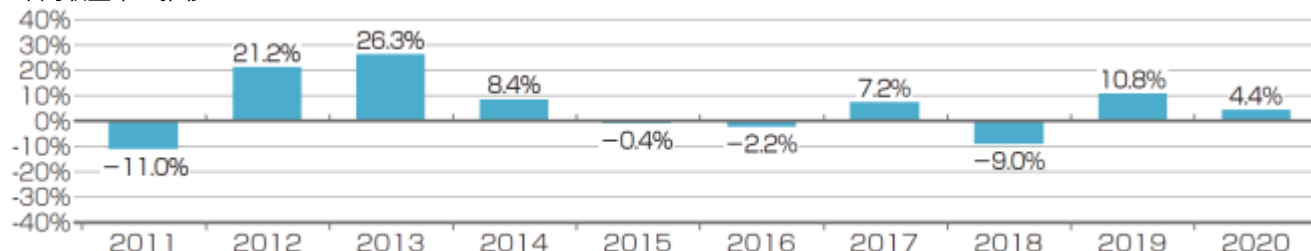
## 国（地域）別構成状況

投資国/地域 <sup>2</sup>	投資比率 <sup>1</sup>
アメリカ	53.7%
フランス	14.6%
中国	9.1%
ドイツ	8.4%
日本	3.4%
その他	10.0%

## 組入上位銘柄

順位	銘柄名	種類	クーポン(%)	償還日	投資国/地域 <sup>2</sup>	通貨	投資比率 <sup>1</sup>
1	STマイクロエレクトロニクス	CB	0.0000	2022/7/3	フランス	米ドル	3.4%
2	マイクロチップ・テクノロジー	CB	1.6250	2027/2/15	アメリカ	米ドル	3.0%
3	オン・セミコンダクター	CB	1.6250	2023/10/15	アメリカ	米ドル	2.8%
4	サフラン	CB	0.0000	2023/6/21	フランス	ユーロ	2.4%
5	ソニー	CB	0.0000	2022/9/30	日本	日本円	2.4%
6	パロアルトネットワークス	CB	0.7500	2023/7/1	アメリカ	米ドル	2.4%
7	スクエア	CB	0.5000	2023/5/15	アメリカ	米ドル	2.2%
8	セルネックス・テレコム	CB	1.5000	2026/1/16	スペイン	ユーロ	2.1%
9	アディダス	CB	0.0500	2023/9/12	ドイツ	ユーロ	2.1%
10	シムライズ	CB	0.2375	2024/6/20	ドイツ	ユーロ	2.0%

## 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

\* 2020年の年間収益率は前年末営業日から2020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/地域」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37期計算期間（2019年7月31日から2020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36期 (2019年7月30日現在)	第37期 (2020年1月30日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	15,369,681,457	14,262,021,049
派生商品評価勘定	9,125,496	17,373,305
未収入金	9,107,790	130,643,048
流動資産合計	15,387,914,743	14,410,037,402
<b>資産合計</b>		
15,387,914,743		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	61,946,789	42,928,980
未払収益分配金	46,399,637	236,551,546
未払解約金	9,107,790	130,643,048
未払受託者報酬	8,364,097	7,987,985
未払委託者報酬	117,097,299	111,831,670
その他未払費用	1,620,000	1,597,539
流動負債合計	244,535,612	531,540,768
<b>負債合計</b>		
244,535,612		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 15,466,545,715	1 13,914,796,879
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 323,166,584	2 36,300,245
（分配準備積立金）	310,596,048	118,735,899
元本等合計	15,143,379,131	13,878,496,634
<b>純資産合計</b>		
15,143,379,131		
<b>負債純資産合計</b>		
15,387,914,743		
14,410,037,402		

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第36期 (自 2019年 1月31日 至 2019年 7月30日)	第37期 (自 2019年 7月31日 至 2020年 1月30日)
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	867,086,726	712,582,412
為替差損益	22,902,950	76,497,206
営業収益合計	889,989,676	636,085,206
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	8,364,097	7,987,985
委託者報酬	1 117,097,299	1 111,831,670
その他費用	1,620,000	1,608,339
営業費用合計	127,081,396	121,427,994
営業利益又は営業損失( )	762,908,280	514,657,212
経常利益又は経常損失( )	762,908,280	514,657,212
当期純利益又は当期純損失( )	762,908,280	514,657,212
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( )	47,344,923	22,507,410
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,069,692,527	323,166,584
剰余金増加額又は欠損金減少額	96,396,458	43,941,243
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	96,396,458	43,941,243
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,034,235	12,673,160
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,034,235	12,673,160
分配金	2 46,399,637	2 236,551,546
期末剰余金又は期末欠損金( )	323,166,584	36,300,245

## (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取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36期 (2019年7月30日現在)	第37期 (2020年1月30日現在)
1 期首元本額	16,398,532,494円	15,466,545,715円
期中追加設定元本額	561,864,877円	528,148,826円
期中一部解約元本額	1,493,851,656円	2,079,897,662円
2 元本の欠損	323,166,584円	36,300,245円
受益権の総数	15,466,545,715口	13,914,796,879口
1 口当たりの純資産額	0.9791円	0.9974円
(1万口当たりの純資産額)	(9,791円)	(9,974円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第36期 (自 2019年1月31日 至 2019年7月30日)	第37期 (自 2019年7月31日 至 2020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	48,913,533円	35,582,606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	50,012,376円
収益調整金額	103,765,022円	103,358,977円
分配準備積立金額	308,082,152円	269,692,463円
当ファンドの分配対象収益額	460,760,707円	458,646,422円
当ファンドの期末残存口数	15,466,545,715口	13,914,796,879口
1万口当たり収益分配対象額	297.90円	329.61円
1万口当たり分配金額	30.00円	170.00円
収益分配金金額	46,399,637円	236,551,546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36期 (2019年7月30日現在)	第37期 (2020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	822,168,176	704,195,707
合計	822,168,176	704,195,707

## (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36期(2019年7月30日現在)				第37期(2020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								
	ユーロ	-	-	-	-	182,313,596	-	178,861,536	3,452,060
	英ポンド	62,915,030	-	62,153,474	761,556	157,602,469	-	157,731,913	129,444
	売建								
	アメリカドル	6,438,964,339	-	6,500,149,572	61,185,233	6,515,384,560	-	6,553,520,790	38,136,230
	ユーロ	1,596,419,275	-	1,591,097,689	5,321,586	1,333,510,829	-	1,319,616,388	13,894,441
	英ポンド	206,957,546	-	203,153,636	3,803,910	323,455,377	-	321,446,647	2,008,730
合計		8,305,256,190	-	8,356,554,371	52,821,293	8,512,266,831	-	8,531,177,274	25,555,675

## (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（2020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	4,500,195,964	14,262,021,049	
合計			4,500,195,964	14,262,021,049	

## 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	(2019年7月30日現在)	(2020年1月30日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		458,458,392	533,499,812
コール・ローン		32,231,710	105,673,166
株式		256,328,463	309,383,609
社債券		14,645,990,696	13,389,624,088
派生商品評価勘定		-	262,700
未収入金		120,189,631	238,362,599
未収配当金		1,212,852	1,632,563
未収利息		23,865,686	19,796,670
前払費用		2,565,842	1,310,240
流動資産合計		15,540,843,272	14,599,545,447
資産合計		15,540,843,272	14,599,545,447
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		587,600	-
未払金		120,099,562	169,828,859
未払解約金		9,107,790	130,643,048
未払利息		83	312
流動負債合計		129,795,035	300,472,219
負債合計		129,795,035	300,472,219
純資産の部			
元本等			
元本	1	5,102,304,729	4,511,891,855
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		10,308,743,508	9,787,181,373
元本等合計		15,411,048,237	14,299,073,228
純資産合計		15,411,048,237	14,299,073,228
負債純資産合計		15,540,843,272	14,599,545,447

（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	(2019年7月30日現在)	(2020年1月30日現在)
1 期首元本額	5,436,586,151円	5,102,304,729円
期中追加設定元本額	265,428,728円	225,043,876円
期中解約元本額	599,710,150円	815,456,750円
元本の内訳（注）		
JPMワールド・CB・オープン	5,088,624,506円	4,500,195,964円
GIMワールド・CB・オープンVA （適格機関投資家専用）	13,680,223円	11,695,891円
合 計	5,102,304,729円	4,511,891,855円
受益権の総数	5,102,304,729口	4,511,891,855口
1 口当たりの純資産額	3.0204円	3.1692円
（1万口当たりの純資産額）	(30,204円)	(31,692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	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。 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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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。 (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。 (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。 (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。

## 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	(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乘せ金利、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。 (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。 (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。
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	(2019年7月30日現在)	(2020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	14,747,115	43,790,034
社債券	870,301,830	1,373,856,450
合計	885,048,945	1,417,646,484

(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	(2019年7月30日現在)				(2020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 売建								
	アメリカドル	119,541,400	-	119,768,000	226,600	403,562,700	-	403,300,000	262,700
	ユーロ	120,939,000	-	121,300,000	361,000	-	-	-	-
合計		240,480,400	-	241,068,000	587,600	403,562,700	-	403,300,000	262,700

(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(2020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	INTL FLAVORS & FRAGRANCES 6% PFD	13,490	49.51	667,889.90	*
	COLFAX 5.75% PFD	6,512	160.38	1,044,394.56	*
	BECTON DICKINSON AND CO 6.125% A PFD	16,766	67.15	1,125,836.90	*
小計	銘柄数:	3		2,838,121.36	
				(309,383,609)	
	組入時価比率:	2.2%		100.0%	
合計				309,383,609	
				(309,383,609)	

(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
社債券	日本円	東レ 0% AUG 21 CB		70,000,000	74,825,100	
		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	343,520,000	
		SBIホールディングス 0% SEP 22 CB		30,000,000	44,480,100	
		SBIホールディングス 0% SEP 23 CB		100,000,000	104,512,000	
	計	銘柄数:	4	426,000,000	567,337,200	
		組入時価比率:	4.0%		4.2%	
	アメリカドル	AKAMAI TECH 0.125% CB		910,000.00	1,059,176.30	
		BAOZUN 1.625% 144A CB		1,148,000.00	1,066,182.04	
		BARCLAYS BK 0% EB		1,498,000.00	1,557,920.00	
		BIOMARIN PHARM 0.599% CB		793,000.00	850,230.81	
		BOOKING HLDGS 0.9% CB		1,333,000.00	1,482,056.06	
		CHEGG 0.125% CB		350,000.00	375,620.00	
		CHEGG 0.25% CB		720,000.00	1,165,206.66	
		CHINA RAILWAY 0% CB		1,250,000.00	1,277,012.50	
		COUPA SOFTWARE 0.125% CB		1,890,000.00	2,404,155.60	
		CYBERARK 0% CB		1,225,000.00	1,374,842.00	
		DEUTSCHE BK LDN 1% EB		1,703,000.00	1,800,377.54	
		DEXCOM 0.75% CB		1,178,000.00	1,855,479.58	
		DOCUSIGN 0.5% CB		830,000.00	1,053,460.90	
		ENVESTNET 1.75% CB		1,412,000.00	1,744,497.76	
		EURONET WORLDWIDE 0.75% CB		878,000.00	1,063,653.10	
		EXACT SCIENCES 0.375% CB		2,142,000.00	2,372,414.94	
		FIVE9 0.125% CB		849,000.00	1,545,180.00	
		GOLAR LNG 2.75% CB		923,000.00	804,366.81	
		HUAZHU GRP 0.375% CB		1,383,000.00	1,457,654.34	
		IAC FIN 0.875% CB		733,000.00	1,266,821.91	
	IAC FIN 2% CB		1,000,000.00	1,172,330.00		
	ILLUMINA 0.5% CB		272,000.00	356,706.24		
	ILLUMINA 0% CB		1,188,000.00	1,285,178.40		

		INSULET 0.375% CB		1,282,000.00	1,440,711.60
		LIB MED IT 1.75% 144A EB		1,400,000.00	2,075,682.00
		LIBERTY MEDIA 1% CB		679,000.00	914,375.35
		LIVE NATION 2.5% CB		1,991,000.00	2,413,749.03
		LVMH MOET 0% MCFP CB		1,254,500.00	2,440,870.59
		MICROCHIP 1.625% CB		2,557,000.00	3,554,306.71
		MONGODB 0.25% CB		640,000.00	680,224.00
		OKTA 0.125% CB		1,420,000.00	1,444,168.40
		ON SEMI COND 1.625% CB		2,826,000.00	3,837,199.32
		PALO ALTO 0.75% CB		2,677,000.00	2,988,228.02
		PRICELINE 0.35% CB		870,000.00	1,249,972.50
		PROOFPOINT 0.25% CB		1,000,000.00	1,080,730.00
		QIAGEN 1% CB		2,000,000.00	2,068,360.00
		REPLIGEN 0.375% CB		666,000.00	743,808.78
		RINGCENTRAL 0% CB		649,000.00	1,621,688.75
		SHANGHAI PORT 0% 21 EB		1,329,000.00	1,350,410.19
		SILICON LABO 1.375% CB		1,206,000.00	1,480,811.22
		SNAP 0.75% CB		1,673,000.00	1,899,959.18
		SPLUNK 0.5% CB		1,810,000.00	2,206,969.20
		SPLUNK 1.125% CB		425,000.00	534,858.25
		SQUARE 0.5% CB		2,121,000.00	2,594,195.10
		STMICRO 0% A CB		2,800,000.00	4,082,372.00
		TAIWAN CEMENT 0% CB		1,300,000.00	1,681,810.00
		TOTAL 0.5% FP CB		1,600,000.00	1,644,944.00
		TWLO 0.25% CB		765,000.00	1,396,576.35
		WORKDAY 0.25% CB		1,415,000.00	1,928,729.90
		WUXI APTEC 0% CB		700,000.00	833,560.00
		XERO 2.375% CB		1,404,000.00	1,974,164.40
		ZILLOW GRP 0.75% CB		1,017,000.00	1,278,358.83
		ZYNGA 0.25% CB		1,177,000.00	1,206,872.26
	計	銘柄数 :	53	68,261,500.00	85,039,189.42
					(9,270,122,038)
		組入時価比率 :	64.8%		69.3%
	ユーロ	ADIDAS AG 0.05% ADS CB		2,000,000.00	2,464,560.00
		ARCHER 0% KER EB		1,600,000.00	2,315,200.00
		ATOS 0% EB		600,000.00	721,980.00
		CELLNEX 1.5% CLNX CB		1,600,000.00	2,337,216.00
		EDENRED 0% EDEN CB		568,509.00	637,803.29
		KERING 0% PUM EB		800,000.00	879,880.00
		LEG IMMO 0.875% LEG CB		800,000.00	947,432.00
		MTU AERO 0.125% MTX CB		600,000.00	1,364,094.00
		ORPEA 0.375% CB		1,620,876.00	1,818,943.67
		SAFRAN 0% SAF 23 CB		2,425,551.30	2,920,062.47
		STRATEGIC INTL 0% EB		912,000.00	1,042,634.88
		SYMRISE 0.2375% CB		1,900,000.00	2,298,582.00
	計	銘柄数 :	12	15,426,936.30	19,748,388.31
					(2,370,794,016)
		組入時価比率 :	16.6%		17.7%
	英ポンド	OCADO GRP 0.875% CB		1,100,000.00	1,138,104.00
	計	銘柄数 :	1	1,100,000.00	1,138,104.00
					(161,576,624)
		組入時価比率 :	1.1%		1.2%
	スイスフラン	SIKA 0.15% CB		1,460,000.00	1,680,474.60
		SIKA 3.75% CB		800,000.00	1,074,672.00
	計	銘柄数 :	2	2,260,000.00	2,755,146.60



					(308,603,970)
		組入時価比率：	2.2%		2.3%
	香港ドル	CHINA CONCH 0% CB		10,000,000.00	11,200,700.00
		CHINA EDUCATION 2% CB		11,000,000.00	11,247,060.00
		HARVEST INTL 0% EB		16,000,000.00	16,613,120.00
		ZHONGSHENG GRP 0% CB		10,000,000.00	11,629,800.00
	計	銘柄数：	4	47,000,000.00	50,690,680.00
					(711,190,240)
		組入時価比率：	5.0%		5.3%
	小計				13,389,624,088
					(12,822,286,888)
	合計				13,389,624,088
					(12,822,286,888)

(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】

(2020年2月20日現在)

種類	金額	単位
資産総額	14,347,000,580	円
負債総額	133,895,247	円
純資産総額( - )	14,213,105,333	円
発行済口数	13,786,396,429	口
1口当たり純資産額( / )	1.0310	円

### (参考) G I Mワールド・C B・オープン・マザーファンド

(2020年2月20日現在)

種類	金額	単位
資産総額	14,594,395,774	円
負債総額	245,597,083	円
純資産総額( - )	14,348,798,691	円
発行済口数	4,334,041,083	口
1口当たり純資産額( / )	3.3107	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（2019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、2019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（2020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、2020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、2020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	751,561
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	60	3,822,714
総合計	127	4,574,275
親投資信託	54	-

（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29期事業年度(2018年4月1日から2019年3月31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。

3. 第29期事業年度より、日付の表示を和暦から西暦に変更しております。

#### <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29期事業年度(2018年4月1日から2019年3月31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。

また、第30期中間会計期間(2019年4月1日から2019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、PwCあらた有限責任監査法人による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

(単位：千円)

		第30期中間会計期間末 (2019年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		14,207,037
前払費用		56,845
未収入金		8,784
未収委託者報酬		1,928,542
未収収益		1,337,970
関係会社短期貸付金		3,300,000
その他		14,087
流動資産計		20,853,269
固定資産		
有形固定資産		
器具備品	1	23,160
有形固定資産計		23,160
投資その他の資産		
関係会社株式		60,000
投資有価証券		48,828
敷金保証金		98,745
前払年金費用		100,492
その他		55,013
投資その他の資産計		363,080
固定資産計		386,240
資産合計		21,239,510

(単位：千円)

第30期中間会計期間末

(2019年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

預り金		56,117
未払金		1,262,410
未払手数料		927,050
その他未払金	2	335,360
未払費用		645,623
未払法人税等		823,266
賞与引当金		1,193,264
役員賞与引当金		21,439
流動負債計		4,002,121

## 固定負債

長期未払金		285,932
賞与引当金		537,942
役員賞与引当金		194,404
繰延税金負債		30,770
固定負債計		1,049,049

## 負債合計

5,051,170

## 純資産の部

## 株主資本

資本金		2,218,000
資本剰余金		
資本準備金		1,000,000
資本剰余金合計		1,000,000

## 利益剰余金

利益準備金		33,676
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		12,936,665
利益剰余金合計		12,970,341

## 株主資本合計

16,188,341

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		1
評価・換算差額等合計		1

## 純資産合計

16,188,339

## 負債・純資産合計

21,239,510

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

		第30期中間会計期間 (自2019年4月1日 至2019年9月30日)
<b>営業収益</b>		
委託者報酬		6,233,722
運用受託報酬		3,083,049
業務受託報酬		980,490
その他		52,983
営業収益計		10,350,245
<b>営業費用</b>		
支払手数料		3,313,168
調査費		844,332
その他営業費用		322,860
営業費用計		4,480,360
一般管理費		4,609,712
営業利益		1,260,173
営業外収益	1	30,880
営業外費用		4
経常利益		1,291,049
税引前中間純利益		1,291,049
法人税、住民税及び事業税		691,553
法人税等調整額		30,770
法人税等合計		722,324
中間純利益		568,725

## 重要な会計方針

項目	第30期中間会計期間 (自2019年4月1日 至2019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。 時価のないもの 移動平均法による原価法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) 役員賞与引当金 役員に対する賞与の支給に備えるため、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。</p> <p>(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. 固定資産の減価償却 方法	<p>有形固定資産 定率法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <p>器具備品 5年</p>
4. 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30期中間会計期間末 (2019年9月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	
器具備品	5,790千円
2 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30期中間会計期間 (自2019年4月1日 至2019年9月30日)	
1 営業外収益のうち主要なもの	
為替差益	9,871千円
受取利息	7,098千円

## （リース取引関係）

第30期中間会計期間末 (2019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	44,442 千円
1年超	- 千円
合計	44,442 千円

## （金融商品関係）

第30期中間会計期間末（2019年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

2019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	14,207,037	14,207,037	-
(2) 未収委託者報酬	1,928,542	1,928,542	-
(3) 未収収益	1,337,970	1,337,970	-
(4) 関係会社短期貸付金	3,300,000	3,300,000	-
資産計	20,773,551	20,773,551	-
(1) 未払手数料	927,050	927,050	-
(2) その他未払金	335,360	335,360	-
(3) 未払費用	645,623	645,623	-
(4) 長期未払金	285,932	285,932	-
負債計	2,193,965	2,193,965	-

（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。

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
投資有価証券（合同会社出資金）	48,810

上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30期中間会計期間末（2019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

投資有価証券（合同会社出資金）（中間貸借対照表計上額 48,810千円）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。

## （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30期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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	6,233,722	3,083,049	980,490	52,983	10,350,245

## 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
6,775,574	1,340,502	1,188,597	1,045,571	10,350,245

（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 (Asia Pacific) Limited	1,285,827	資産運用業
JPMorgan Asset Management (UK) Limited	1,187,009	資産運用業

## （1株当たり情報）

第30期中間会計期間 （自2019年4月1日 至2019年9月30日）	
1株当たり純資産額	287,715.98円
1株当たり中間純利益金額	10,107.97円
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	568,725千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	568,725千円
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】

原届出書の「第三部委託会社等の情報 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」について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・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（2019年3月末現在）  
 事業の内容

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。

<再信託受託会社の概要>

名 称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社\*

\* 関係当局の認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です（以下同じ）。

事業の内容 : 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。

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## (2) 販売会社

	名 称	資本金の額 (2019年3月末現在)	事業の内容
1	今村証券株式会社	857百万円 (2019年9月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
2	a uカブコム証券株式会社	7,196百万円 (2019年9月末現在)	同 上
3	株式会社SBI証券	48,323百万円 (2019年9月末現在)	同 上
4	エース証券株式会社	8,831百万円	同 上
5	OKB証券株式会社	1,500百万円 (2019年10月7日現在)	同 上
6	九州FG証券株式会社*	3,000百万円	同 上
7	クレディ・スイス証券株式会社	78,100百万円	同 上
8	ぐんぎん証券株式会社	3,000百万円 (2019年9月末現在)	同 上
9	楽天証券株式会社	7,495百万円 (2019年9月末現在)	同 上
10	SMB C日興証券株式会社	10,000百万円 (2019年9月末現在)	同 上
11	野村證券株式会社	10,000百万円 (2019年12月末現在)	同 上

12	浜銀 T T 証券株式会社	3,307百万円	同 上
13	百五証券株式会社	3,000百万円	同 上
14	フィデリティ証券株式会社	9,257百万円	同 上
15	F F G 証券株式会社	3,000百万円	同 上
16	ほくほく T T 証券株式会社	1,250百万円	同 上
17	松井証券株式会社	11,945百万円 (2019年9月末現在)	同 上
18	みずほ証券株式会社	125,167百万円 (2019年9月末現在)	同 上
19	三菱 U F J モルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	同 上
20	株式会社三菱 U F J 銀行	1,711,958百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
21	株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	同 上
22	株式会社あおぞら銀行	100,000百万円	同 上
23	株式会社イオン銀行	51,250百万円	同 上
24	株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	同 上
25	株式会社鹿児島銀行	18,130百万円 (2019年9月末現在)	同 上
26	株式会社香川銀行	12,014百万円	同 上
27	株式会社新生銀行	512,204百万円	同 上
28	株式会社池田泉州銀行	61,385百万円 (2019年9月末現在)	同 上
29	株式会社千葉銀行	145,069百万円	同 上
30	株式会社中京銀行	31,844百万円	同 上
31	株式会社南都銀行	37,924百万円	同 上
32	株式会社福岡銀行	82,329百万円	同 上
33	株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	同 上
34	株式会社百五銀行	20,000百万円	同 上
35	株式会社広島銀行	54,573百万円	同 上
36	株式会社北海道銀行	93,524百万円	同 上

37	ザ・ホンコン・アンド・ シャンハイ・バンキング・ コーポレーション・リミ テッド(香港上海銀行)*	116,102百万香港ドル 7,198百万米ドル (2019年9月末現在)	同 上
38	株式会社S M B C 信託銀行	87,550百万円	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。
39	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	同 上
40	三菱UFJ信託銀行株式会 社	324,279百万円	同 上

\* 募集の取扱い以外の業務を行っています。なお、香港上海銀行の資本金の額はHSBC Holdings plcの資本金の額を記載  
しています。

(3) 運用委託先の会社

名 称	資本金の額 (2019年3月末現在)	事業の内容
J Pモルガン・アセット・マネジメ ント(UK)リミテッド	24百万ポンド	投資運用業務および投資顧問業 務を行っています。

## 独立監査人の監査報告書

2020年3月11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	鶴田光夫
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山口健志

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2019年7月31日から2020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2020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

2019年12月9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	鶴田光夫
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山口健志

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019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2019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（2019年4月1日から2019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。