

【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30年 6月11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 グローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）

【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、平成29年12月8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】

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

（1）ファンドの目的及び基本的性格

（二）ファンドの特色

マザーファンドの特色

< 訂正前 >

（略）

**G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド**

（a）（略）

（b）主要投資対象は、新興国\*1の現地通貨建てのソブリン債券です。

\*1 「新興国」とは、運用委託先が、国内経済が成長過程にあると判断する国をいいます。例えば、当マザーファンドの参考指標（J PモルガンG B I - エマージング・マーケット・グローバル\*2（円ベース））の構成国（平成29年9月末現在、ブラジル、ハンガリー、マレーシア、メキシコ、ポーランド、南アフリカ、トルコ、インドネシア、ペルー、ロシア、コロンビア、タイ、フィリピン、チリ、アルゼンチン、ルーマニア、チェコおよびウルグアイ）が該当します。

（以下略）

< 訂正後 >

（略）

**G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド**

（a）（略）

（b）主要投資対象は、新興国\*1の現地通貨建てのソブリン債券です。

\*1 「新興国」とは、運用委託先が、国内経済が成長過程にあると判断する国をいいます。例えば、当マザーファンドの参考指標（J PモルガンG B I - エマージング・マーケット・グローバル\*2（円ベース））の構成国（平成30年3月末現在、ブラジル、ハンガリー、マレーシア、メキシコ、ポーランド、南アフリカ、トルコ、インドネシア、ペルー、ロシア、コロンビア、タイ、フィリピン、チリ、アルゼンチン、ルーマニア、チェコおよびウルグアイ）が該当します。

（以下略）

（3）ファンドの仕組み

（八）委託会社の概況

< 訂正前 >

資本金 2,218百万円（平成29年10月末現在）

～（略）

大株主の状況（平成29年10月末現在）

（以下略）

< 訂正後 >

資本金 2,218百万円（平成30年4月末現在）

～（略）

大株主の状況（平成30年4月末現在）

（以下略）

## 2【投資方針】

## ( 1 ) 投資方針

## ( 口 ) 投資態度

## &lt; 訂正前 &gt;

当ファンドの投資プロセス

( 略 )

**当ファンドにおける為替ヘッジについて**

当ファンドにおいては、為替ヘッジは原則として行いませんが、経済事情や投資環境の急変等が起きた場合、委託会社の運用商品管理部門に所属するポートフォリオ・マネジャーが J . P . モルガン・アセット・マネジメントの為替部門からの情報を参考に当ファンドにおける為替ヘッジのための投資判断を行い、委託会社の債券運用部門に所属する為替取引担当者または J F アセット・マネジメント・リミテッド\*の為替取引担当部門に所属する為替取引担当者が為替ヘッジのための外国為替予約取引を執行します。

\* J F アセット・マネジメント・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。

マザーファンドの投資プロセス

( 略 )

< 当ファンドまたはマザーファンドにおいて行われることがある、投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引の内容、および当該取引が投資者の利益を害しないことを確保するための措置 >

委託会社および運用委託先（以下「委託会社等」といいます。）は、当ファンドまたはマザーファンドにおいて、自己または第三者の利益を図るために投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引を行うことがあり、それらの内容は後記のとおりです。委託会社等は、当該取引が投資者の利益を害しないことを確保するための措置として、社内規程等を制定してそれにしたがった管理を行うとともに、社内規程等の遵守状況についてモニタリングを必要に応じて行っています。当該措置の詳細については、後記「3 投資リスク（2）投資リスクに関する管理体制」をご参照ください。

( 以下略 )

## &lt; 訂正後 &gt;

当ファンドの投資プロセス

( 略 )

**当ファンドにおける為替ヘッジについて**

当ファンドにおいては、為替ヘッジは原則として行いませんが、経済事情や投資環境の急変等が起きた場合、委託会社の運用商品管理部門に所属するポートフォリオ・マネジャーが J . P . モルガン・アセット・マネジメントの為替部門からの情報を参考に当ファンドにおける為替ヘッジのための投資判断を行い、J F アセット・マネジメント・リミテッド\*（香港法人）または 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）の為替取引担当部門に所属する為替取引担当者が為替ヘッジのための外国為替予約取引を執行します。

\* 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（UK）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。

マザーファンドの投資プロセス

( 略 )

< 当ファンドまたはマザーファンドにおいて行われることがある、投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引の内容、および当該取引が投資者の利益を害しないことを確保するための措置 >

委託会社および運用委託先（以下「委託会社等」という場合があります。）は、当ファンドまたはマザーファンドにおいて、自己または第三者の利益を図るために投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引を行うことがあり、それらの内容は後記のとおりです。委託会社等は、当該取引が

投資者の利益を害しないことを確保するための措置として、社内規程等を制定してそれにしたがった管理を行うとともに、社内規程等の遵守状況についてモニタリングを必要に応じて行っています。当該措置の詳細については、後記「3投資リスク(2)投資リスクに関する管理体制」をご参照ください。

(以下略)

### (3) 運用体制

<訂正前>

#### (イ) 当ファンドの運用体制

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、平成29年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

委託会社では社内規程を定め、運用等にかかわる組織およびその組織の権限と責任を明らかにするとともに、当ファンド固有の運用に関する社内ルールを定めています。

#### ・為替ヘッジにかかる運用体制

当ファンドにおいては、為替ヘッジは原則として行いませんが、経済事情や投資環境の急変等により必要な場合、委託会社の運用商品管理部門が為替ヘッジのための投資判断を行い、委託会社の債券運用部門またはJFアセット・マネジメント・リミテッドの為替取引担当部門に所属する為替取引担当者が外国為替予約取引を執行します。その場合は、委託会社のリスク管理部門が日々為替に対するヘッジ状況をモニターします。

#### (ロ) マザーファンドの運用体制

(略)

#### **G I M世界投資適格債券マザーファンド**

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、平成29年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### **G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド**

(略)

当マザーファンドは、JPMIM社のグローバル債券運用グループに所属するエマージング債券運用チーム(約50名)のポートフォリオ・マネジャーにより運用されます。同チームはエマージング調査チームと運用チームにより構成されています。

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、平成29年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### **G I M米国高利回り社債マザーファンド**

(略)

当マザーファンドは、JPMIM社のグローバル債券運用グループに所属する高利回り社債運用チーム(22名)が運用を担当します。同チームは運用チームと調査チームにより構成されています。

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、平成29年9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) 当ファンドの運用体制

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、平成30年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

委託会社では社内規程を定め、運用等にかかわる組織およびその組織の権限と責任を明らかにするとともに、当ファンド固有の運用に関する社内ルールを定めています。

・為替ヘッジにかかる運用体制

当ファンドにおいては、為替ヘッジは原則として行いませんが、経済事情や投資環境の急変等により必要な場合、委託会社の運用商品管理部門が為替ヘッジのための投資判断を行い、JFアセット・マネジメント・リミテッドまたはJPモルガン・アセット・マネジメント(UK)リミテッドの為替取引担当部門に所属する為替取引担当者が外国為替予約取引を執行します。その場合は、委託会社のリスク管理部門が日々為替に対するヘッジ状況をモニターします。

(ロ) マザーファンドの運用体制

(略)

**GIM世界投資適格債券マザーファンド**

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、平成30年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

**GIM新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド**

(略)

当マザーファンドは、JP MIM社のグローバル債券運用グループに所属するエマージング債券運用チーム(約40名)のポートフォリオ・マネジャーにより運用されます。同チームはエマージング調査チームと運用チームにより構成されています。

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、平成30年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

**GIM米国高利回り社債マザーファンド**

(略)

当マザーファンドは、JP MIM社のグローバル債券運用グループに所属する高利回り社債運用チーム(21名)が運用を担当します。同チームは運用チームと調査チームにより構成されています。

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、平成30年3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)

(5) 投資制限

<訂正前>

(イ) 信託約款は、委託会社による当ファンドの運用に関して以下のような一定の制限および限度を定めています。

株式への投資制限

- A 委託会社は、信託財産に属する全ての株式の時価総額と、各マザーファンドそれぞれの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額(信託約款第8条第2項に規定するものをいいます。以下、およびにおいて同じ。)の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(略)

~ (略)

（参考）マザーファンドの投資制限

マザーファンド信託約款は、委託会社（運用委託先を含みます。）によるマザーファンドの運用に関して以下のような一定の制限および限度を定めています。

株式への投資制限

委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額が、信託財産の純資産総額（各マザーファンドの信託約款第8条に規定するものをいいます。以下 および において同じ。）の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

～（略）

（ロ）投資信託及び投資法人に関する法律ならびに金融商品取引業等に関する内閣府令には以下のような投資制限があります。（マザーファンドにも同様の投資制限があります。）

、（略）

<訂正後>

（イ）信託約款は、委託会社による当ファンドの運用に関して以下のような一定の制限および限度を定めています。

株式への投資制限

A 委託会社は、信託財産に属する全ての株式の時価総額と、各マザーファンドそれぞれの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額（信託約款第8条第2項に規定するものをいいます。以下 、 および において同じ。）の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

（略）

～（略）

分散投資規制の管理

一般社団法人投資信託協会規則に定める、一の者に対する「株式等エクスポージャー」、「債券等エクスポージャー」および「デリバティブ等エクスポージャー」それぞれの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれで10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整するものとします。

（参考）マザーファンドの投資制限

マザーファンド信託約款は、委託会社（運用委託先を含みます。）によるマザーファンドの運用に関して以下のような一定の制限および限度を定めています。

株式への投資制限

委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額が、信託財産の純資産総額（各マザーファンドの信託約款第8条に規定するものをいいます。以下 、 および において同じ。）の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

～（略）

分散投資規制の管理

一般社団法人投資信託協会規則に定める、一の者に対する「株式等エクスポージャー」、「債券等エクスポージャー」および「デリバティブ等エクスポージャー」それぞれの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれで10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整するものとします。

（ロ）投資信託及び投資法人に関する法律ならびに金融商品取引業等に関する内閣府令には以下のような投資制限があります。（マザーファンドにも同様の投資制限があります。）

、（略）

一般社団法人投資信託協会規則に定める、一の者に対する「株式等エクスポージャー」、「債券等エクスポージャー」および「デリバティブ等エクスポージャー」それぞれの当ファンドの純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれで10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整するものとします。

### 3【投資リスク】

#### (1) リスク要因

<訂正前>

(略)

当ファンドおよびマザーファンド共通

(略)

予測不可能な事態が起きた場合等について

その他予測不可能な事態(天変地異、クーデター等)が起きたとき等、市場が混乱することが考えられます。このような場合に、有価証券が取引される市場の取引停止等やむを得ない事情があるときは、一時的に当ファンドの受益権およびマザーファンドの受益証券が換金できないこともあります。また、これらの事情や有価証券の売買にかかる代金の受渡しに関する障害が起きた場合等には、当ファンドの受益権の換金代金の支払いが遅延することや、一時的に当ファンドの基準価額およびマザーファンドの運用方針に基づいた運用ができなくなるリスクがあります。

(略)

<訂正後>

(略)

当ファンドおよびマザーファンド共通

(略)

予測不可能な事態が起きた場合等について

その他予測不可能な事態(天変地異、クーデター等)が起きたとき等、市場が混乱することが考えられます。このような場合に、有価証券が取引される市場の取引停止等やむを得ない事情があるときは、一時的に当ファンドの受益権およびマザーファンドの受益証券が換金できないこともあります。また、これらの事情や有価証券の売買にかかる代金の受渡しに関する障害が起きた場合等には、当ファンドの受益権の換金代金の支払いが遅延することや、一時的に当ファンドおよびマザーファンドの運用方針に基づいた運用ができなくなるリスクがあります。

(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」末尾に記載される参考情報について、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。

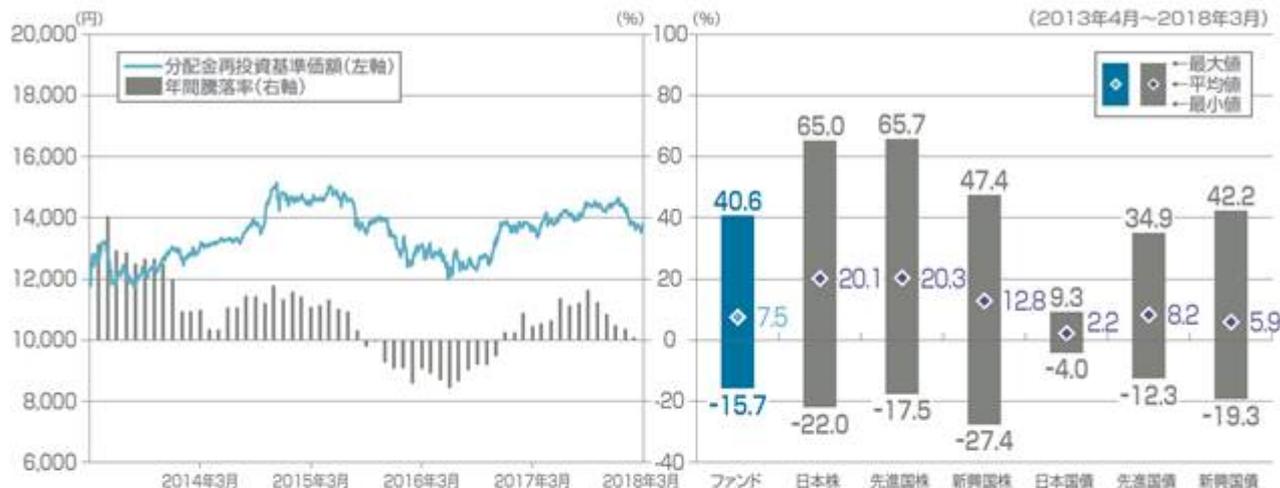
### <ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移>

2013年4月～2018年3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、責任を有しません。

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、野村證券株式会社が、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>

### （イ）当ファンドにおけるリスク管理

（略）

#### 為替ヘッジについてのリスク管理

円貨に対する為替ヘッジは、原則として行いませんが、経済事情や投資環境の急変等が起きた場合、委託会社は当ファンドにおいて、円貨に対する為替ヘッジを行うことがあります。その場合は、委託会社のリスク管理部門が日々為替に対するヘッジ状況をモニターします。

### （ロ）マザーファンドにおけるリスク管理

#### 運用委託先におけるリスク管理

（略）

（平成29年9月末現在）

（以下略）

<訂正後>

### （イ）当ファンドにおけるリスク管理

（略）

#### 為替ヘッジについてのリスク管理

円貨に対する為替ヘッジは、原則として行いませんが、経済事情や投資環境の急変等が起きた場合、当ファンドにおいて、円貨に対する為替ヘッジを行うことがあります。その場合は、委託会社のリスク管理部門が日々為替に対するヘッジ状況をモニターします。

### （ロ）マザーファンドにおけるリスク管理

#### 運用委託先におけるリスク管理

（略）

（平成30年3月末現在）

（以下略）

## 4【手数料等及び税金】

### （５）課税上の取扱い

<訂正前>

日本の居住者（法人を含みます。）である受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

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29年10月末現在適用されるものです。

（以下略）

<訂正後>

日本の居住者（法人を含みます。）である受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

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4月末現在適用されるものです。

(以下略)

## 5【運用状況】

原届出書の「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

(平成30年4月10日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
G I M世界投資適格債券マザーファンド (適格機関投資家専用)	日本	821,535,226	33.44
G I M新興国現地通貨ソブリン・マザー ファンド(適格機関投資家専用)	日本	823,164,248	33.51
G I M米国高利回り社債マザーファンド (適格機関投資家専用)	日本	822,144,624	33.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	10,222,309	0.42
合計(純資産総額)		2,456,621,789	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。

## (参考)G I M世界投資適格債券マザーファンド(適格機関投資家専用)

(平成30年4月10日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	1,693,753,180	15.72
	カナダ	194,436,385	1.80
	メキシコ	36,808,939	0.34
	ドイツ	144,377,721	1.34
	イタリア	346,991,029	3.22
	フランス	110,657,074	1.03
	オランダ	11,233,336	0.10
	スペイン	330,477,144	3.07
	ベルギー	16,776,555	0.16
	アイルランド	44,629,021	0.41
	ポルトガル	240,580,214	2.23
	イギリス	447,241,598	4.15
	デンマーク	20,755,800	0.19
	ポーランド	23,488,369	0.22
	ロシア	7,714,697	0.07
	スロバキア	17,250,054	0.16
	オーストラリア	141,821,877	1.32
ニュージーランド	31,323,717	0.29	
小計		3,860,316,710	35.82
地方債証券	カナダ	130,913,251	1.21
特殊債券	アメリカ	1,874,538,416	17.39
	フランス	132,016,846	1.22

	ルクセンブルク	138,257,158	1.28
	イギリス	118,282,652	1.10
	小計	2,263,095,072	21.00
社債券	アメリカ	1,988,067,574	18.45
	カナダ	80,050,904	0.74
	ドイツ	8,548,095	0.08
	イタリア	137,240,168	1.27
	フランス	112,521,254	1.04
	オランダ	101,249,627	0.94
	アイルランド	54,744,177	0.51
	イギリス	1,187,235,728	11.02
	スイス	6,673,273	0.06
		小計	3,676,330,800
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	846,297,859	7.85
合計(純資産総額)		10,776,953,692	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。

(参考) G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)

(平成30年4月10日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	370,065,034	3.13
	アルゼンチン	52,669,444	0.45
	メキシコ	1,260,588,643	10.66
	ブラジル	2,507,627,605	21.20
	チリ	203,059,699	1.72
	コロンビア	509,523,556	4.31
	ペルー	20,335,609	0.17
	トルコ	810,754,325	6.86
	ハンガリー	844,201,552	7.14
	ポーランド	487,518,453	4.12
	ロシア	704,852,124	5.96
	ルーマニア	60,872,107	0.51
	マレーシア	448,070,796	3.79
	タイ	5,465,140	0.05
	フィリピン	68,698,624	0.58
	インドネシア	1,144,342,990	9.68
	エジプト	192,863,830	1.63
	南アフリカ	1,461,192,732	12.36
	ナイジェリア	72,408,676	0.61
	セルビア	91,596,749	0.77
	小計	11,316,707,688	95.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	509,654,081	4.31
合計(純資産総額)		11,826,361,769	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）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。  
 具体的な投資対象については、「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（2）ファンドの特色」をご参照ください。

（参考）G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）

（平成30年4月10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	437,519	0.05
新株予約権付社債券等	アメリカ	1,475,814	0.16
特殊債券	アメリカ	1,013,778	0.11
社債券	アメリカ	864,084,654	94.09
	カナダ	1,147,536	0.12
	ドイツ	5,082,496	0.55
	ルクセンブルク	2,022,552	0.22
	小計	872,337,238	94.99
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	43,057,002	4.69
合計（純資産総額）		918,321,351	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）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。具体的な投資対象については、「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（2）ファンドの特色」をご参照ください。

（2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成30年4月10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新興国現地通貨ソブリン・マザー ファンド（適格機関投資家専用）	537,910,376	1.5446	830,856,427	1.5303	823,164,248	33.51
2	日本	親投資信託 受益証券	G I M米国高利回り社債マザーファンド （適格機関投資家専用）	405,837,015	2.0327	824,985,404	2.0258	822,144,624	33.47
3	日本	親投資信託 受益証券	G I M世界投資適格債券マザーファンド （適格機関投資家専用）	579,035,260	1.4091	815,918,677	1.4188	821,535,226	33.44

（参考）G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）

（平成30年4月10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	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	FNCL 4.0% MAY48 TBA	3,750,000	10,926.86	409,757,372	10,933.95	410,023,200	4	2048/5/1	3.80
2	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	FREDDIE MAC 3.75%	3,700,000	10,847.18	401,345,947	10,833.52	400,840,379	3.75	2019/3/27	3.72
3	アメリカ	アメリカ	国債 証券	US T-NOTE 1.75% MAY22	3,430,000	10,316.00	353,838,887	10,342.24	354,738,840	1.75	2022/5/31	3.29
4	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	FGLMC 3.5% MAY48 TBA	3,230,000	10,671.66	344,694,749	10,677.08	344,869,839	3.5	2048/5/1	3.20
5	アメリカ	アメリカ	国債 証券	US T-NOTE 1.125% FEB19	2,910,000	10,576.17	307,766,630	10,584.92	308,021,453	1.125	2019/2/28	2.86
6	ポルトガル	ポルトガル	国債 証券	PORTUGAL OT 4.125% APR27	1,500,000	15,835.78	237,536,769	16,038.68	240,580,214	4.125	2027/4/14	2.23
7	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	FNCL 3.0% MAY48 TBA	2,100,000	10,371.42	217,800,024	10,382.27	218,027,696	3	2048/5/1	2.02

8	イギリス	イギリス	国債証券	UK GOVT 4.25% DEC40	840,000	21,558.93	181,095,035	22,015.90	184,933,625	4.25	2040/12/7	1.72
9	アメリカ	アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.75% FEB28	1,705,000	10,633.89	181,307,901	10,646.64	181,525,287	2.75	2028/2/15	1.68
10	アメリカ	アメリカ	国債証券	US T-NOTE 1.75% DEC20	1,455,000	10,483.18	152,530,320	10,491.52	152,651,665	1.75	2020/12/31	1.42
11	アメリカ	アメリカ	特殊債券	G2SF 3.5% MAY48 TBA	1,400,000	10,753.39	150,547,523	10,762.56	150,675,953	3.5	2048/5/1	1.40
12	イタリア	イタリア	国債証券	ITALY BTP 5.5% NOV22	930,000	16,005.91	148,855,033	16,093.94	149,673,684	5.5	2022/11/1	1.39
13	フランス	フランス	特殊債券	UNEDIC 0.25% EMTN	1,000,000	13,105.76	131,057,628	13,201.68	132,016,846	0.25	2023/11/24	1.22
14	イギリス	オーストラリア	社債券	WESTPAC 0.625% EMTN	984,000	13,372.34	131,583,864	13,398.13	131,837,634	0.625	2022/1/14	1.22
15	イタリア	イタリア	社債券	INTESA SANPAOLO 0.5%	800,000	13,281.15	106,249,271	13,299.97	106,399,799	0.5	2020/2/3	0.99
16	アメリカ	アメリカ	特殊債券	FNCL 4.5% MAY48 TBA	950,000	11,153.70	105,960,218	11,160.37	106,023,605	4.5	2048/5/1	0.98
17	アメリカ	アメリカ	特殊債券	FNCI 4.5% MAY33 TBA	985,000	10,740.05	105,789,500	10,755.22	105,938,953	4.5	2033/5/1	0.98
18	カナダ	カナダ	国債証券	CANADA GOVT 3.25% JUN21	1,200,000	8,739.06	104,868,810	8,736.46	104,837,547	3.25	2021/6/1	0.97
19	スペイン	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT 1.5% APR27	750,000	13,397.73	100,483,040	13,619.18	102,143,909	1.5	2027/4/30	0.95
20	スペイン	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT 2.7% OCT48	702,000	13,502.73	94,789,231	14,273.92	100,202,988	2.7	2048/10/31	0.93
21	アメリカ	アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.375% MAR21	935,000	10,658.01	99,652,459	10,663.32	99,702,080	2.375	2021/3/15	0.93
22	フランス	フランス	国債証券	FRANCE OAT 1% MAY27	710,000	13,503.93	95,877,937	13,616.42	96,676,615	1	2027/5/25	0.90
23	イギリス	カナダ	社債券	RBC 0.875% REGS	700,000	13,504.05	94,528,388	13,528.66	94,700,626	0.875	2022/6/17	0.88
24	カナダ	カナダ	地方債証券	ONTARIO 2.6%	1,090,000	8,316.85	90,653,670	8,344.07	90,950,466	2.6	2025/6/2	0.84
25	アメリカ	アメリカ	国債証券	US T-BOND 3% FEB47	845,000	10,346.41	87,427,165	10,643.30	89,935,957	3	2047/2/15	0.83
26	イタリア	イタリア	国債証券	ITALY BTP 2.2% JUN27	650,000	13,509.05	87,808,861	13,773.39	89,527,098	2.2	2027/6/1	0.83
27	イタリア	イタリア	国債証券	ITALY BTP 4.75% SEP44	495,000	17,493.03	86,590,522	17,988.30	89,042,094	4.75	2044/9/1	0.83
28	オーストラリア	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA 5.75% MAY21 124	950,000	9,124.03	86,678,338	9,104.14	86,489,360	5.75	2021/5/15	0.80
29	イギリス	イギリス	国債証券	UK GOVT 4.25% DEC55	320,000	25,326.48	81,044,764	26,016.34	83,252,301	4.25	2055/12/7	0.77
30	カナダ	カナダ	社債券	NATL BK OF CANADA 0.5%	600,000	13,313.26	79,879,587	13,341.81	80,050,904	0.5	2022/1/26	0.74

## （参考）G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）

（平成30年4月10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	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN21 NTNF	30,750,000	3,320.28	1,020,986,237	3,341.18	1,027,413,454	10	2021/1/1	8.69
2	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN23 NTNF	15,808,000	3,294.57	520,805,883	3,312.42	523,628,603	10	2023/1/1	4.43
3	インドネシア	インドネシア	国債証券	INDON 9% MAR29 FR71	46,542,000,000	0.88	411,709,601	0.90	420,197,186	9	2029/3/15	3.55
4	コロンビア	コロンビア	国債証券	COLOMBIA TES 6% APR28	11,000,000,000	3.60	396,749,129	3.71	408,283,392	6	2028/4/28	3.45
5	南アフリカ	南アフリカ	国債証券	S. AFRICA 10.5% DEC26 R186	39,456,829	1,016.06	400,908,252	1,014.60	400,329,902	10.5	2026/12/21	3.39
6	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 6.5% JUN22	63,980,000	562.09	359,628,765	567.97	363,393,361	6.5	2022/6/9	3.07
7	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN27 NTNF	10,035,000	3,253.81	326,520,714	3,251.07	326,245,281	10	2027/1/1	2.76
8	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL I/L 6% AUG22 NTNB	2,960,000	10,211.60	302,263,538	10,337.13	305,979,330	6	2022/8/15	2.59
9	ロシア	ロシア	国債証券	RUSSIA 8.15% FEB27 6207	156,400,000	190.93	298,622,353	188.16	294,287,495	8.15	2027/2/3	2.49
10	ポーランド	ポーランド	国債証券	POLAND 2.5% JUL26 0726	9,417,000	2,993.65	281,912,208	3,051.04	287,317,003	2.5	2026/7/25	2.43
11	インドネシア	インドネシア	国債証券	INDON 8.25% MAY36 FR72	33,238,000,000	0.83	279,136,181	0.84	281,894,669	8.25	2036/5/15	2.38
12	ハンガリー	ハンガリー	国債証券	HUNGARY 7% JUN22 22/A	503,150,000	52.12	262,257,495	52.30	263,192,187	7	2022/6/24	2.23
13	ハンガリー	ハンガリー	国債証券	HUNGARY 1% SEP20 20/C	516,630,000	42.70	220,624,057	42.70	220,623,035	1	2020/9/23	1.87
14	南アフリカ	南アフリカ	国債証券	S. AFRICA 8.75% FEB48 2048	23,415,031	861.33	201,681,060	861.43	201,705,774	8.75	2048/2/28	1.71
15	ポーランド	ポーランド	国債証券	POLAND GOVT 4% OCT23	5,900,000	3,355.24	197,959,381	3,393.24	200,201,450	4	2023/10/25	1.69
16	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 7.75% MAY31	31,800,000	583.89	185,677,497	599.57	190,665,295	7.75	2031/5/29	1.61
17	トルコ	トルコ	国債証券	TURKEY GOVT 10.5% JAN20	7,600,000	2,509.55	190,725,909	2,478.54	188,369,270	10.5	2020/1/15	1.59
18	南アフリカ	南アフリカ	国債証券	S. AFRICA 7% FEB31 R213	23,210,000	778.48	180,685,465	777.87	180,543,631	7	2031/2/28	1.53
19	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 10% DEC24	26,836,600	660.38	177,226,110	669.25	179,604,869	10	2024/12/5	1.52
20	ロシア	ロシア	国債証券	RUSSIA 7.75% SEP26 6219	95,358,000	186.14	177,505,484	183.58	175,066,913	7.75	2026/9/16	1.48
21	南アフリカ	南アフリカ	国債証券	S. AFRICA 8.875% FEB35 2035	19,086,398	881.00	168,152,010	887.45	169,383,985	8.875	2035/2/28	1.43
22	インドネシア	インドネシア	国債証券	INDON 7% MAY27 FR59	21,046,000,000	0.78	165,105,662	0.80	168,742,113	7	2027/5/15	1.43
23	トルコ	トルコ	国債証券	TURKEY GOVT 7.1% MAR23	7,600,000	2,112.09	160,519,033	2,049.18	155,737,997	7.1	2023/3/8	1.32
24	インドネシア	インドネシア	国債証券	INDON 8.75% MAY31 FR73	17,416,000,000	0.87	151,935,245	0.88	154,924,202	8.75	2031/5/15	1.31
25	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN25 NTNF	4,610,000	3,266.84	150,601,351	3,279.48	151,184,403	10	2025/1/1	1.28
26	チリ	チリ	国債証券	CHILE GOVT 4.5% MAR26	790,000,000	17.69	139,803,785	17.85	141,088,041	4.5	2026/3/1	1.19
27	南アフリカ	南アフリカ	国債証券	S. AFRICA 8.25% MAR32 2032	16,400,872	850.67	139,517,850	854.97	140,223,122	8.25	2032/3/31	1.19
28	アメリカ	ペルー	国債証券	PERU GOVT 6.95% AUG31 GDN	3,355,000	3,869.32	129,815,895	3,851.65	129,223,002	6.95	2031/8/12	1.09
29	ロシア	ロシア	国債証券	RUSSIA 7.05% JAN28 6212	70,100,000	177.66	124,543,137	174.49	122,323,603	7.05	2028/1/19	1.03
30	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 10% NOV36	16,607,300	706.29	117,296,018	729.65	121,175,729	10	2036/11/20	1.02

（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、「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（2）ファンドの特色」の記載に基づき、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。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。

（参考）G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）

（平成30年4月10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	アメリカ	アメリカ	社債券	ANTERO RESCS 5.125%	109,000	10,891.26	11,871,478	10,805.44	11,777,938	5.125	2022/12/1	1.28
2	アメリカ	アメリカ	社債券	ILFC E-CAP VAR 65 REGS N	100,000	10,368.09	10,368,094	10,464.59	10,464,596	4.89	2065/12/21	1.14
3	アメリカ	アメリカ	社債券	LEVEL 3 5.375% 24	97,000	10,795.62	10,471,758	10,397.02	10,085,112	5.375	2024/1/15	1.10
4	アメリカ	アメリカ	社債券	SPRINT 7.625% 26	72,000	10,704.09	7,706,949	10,587.46	7,622,974	7.625	2026/3/1	0.83
5	アメリカ	カナダ	社債券	GW HONOS 8.75% REGS	65,000	11,475.69	7,459,204	11,219.63	7,292,765	8.75	2025/5/15	0.79
6	アメリカ	アメリカ	社債券	SUMMIT MATE 5.125% REGS	67,000	10,903.23	7,305,165	10,372.15	6,949,341	5.125	2025/6/1	0.76
7	アメリカ	アメリカ	社債券	US CONCRETE 6.375%	61,000	11,473.06	6,998,569	11,008.27	6,715,047	6.375	2024/6/1	0.73
8	アメリカ	アメリカ	社債券	CVR PARTNERS 9.25% REGS	56,000	11,622.51	6,508,608	11,360.86	6,362,087	9.25	2023/6/15	0.69
9	アメリカ	イギリス	社債券	RBS 6.1%	55,000	11,709.94	6,440,468	11,350.40	6,242,724	6.1	2023/6/10	0.68
10	アメリカ	アメリカ	社債券	CNG HOLDINGS 9.375% REGS	57,000	10,452.00	5,957,640	10,503.55	5,987,029	9.375	2020/5/15	0.65
11	アメリカ	アメリカ	社債券	ALBERTSONS 6.625%	60,000	10,347.27	6,208,367	9,920.81	5,952,487	6.625	2024/6/15	0.65
12	アメリカ	アメリカ	社債券	SUPERVALU INC 7.75%	55,000	10,721.97	5,897,084	10,397.02	5,718,363	7.75	2022/11/15	0.62
13	アメリカ	アメリカ	社債券	DISH DBS 6.75%	49,000	11,258.81	5,516,820	10,826.69	5,305,079	6.75	2021/6/1	0.58
14	アメリカ	アメリカ	社債券	DYNEGY 5.875%	48,000	10,899.38	5,231,706	10,960.66	5,261,118	5.875	2023/6/1	0.57
15	アメリカ	アメリカ	社債券	CORTES NP 9.25% REGS	45,000	11,545.01	5,195,256	11,049.58	4,972,314	9.25	2024/10/15	0.54
16	アメリカ	アメリカ	社債券	ARCH MERGER 8.5% REGS	49,000	9,927.75	4,864,598	9,929.24	4,865,330	8.5	2025/9/15	0.53
17	アメリカ	アメリカ	社債券	JBS USA 5.75% REGS	47,000	10,442.60	4,908,024	10,091.07	4,742,806	5.75	2025/6/15	0.52
18	アメリカ	アメリカ	社債券	ULTRA RESCS 6.875% REGS	53,000	10,881.02	5,766,944	8,681.97	4,601,448	6.875	2022/4/15	0.50
19	アメリカ	カナダ	社債券	VALEANT 5.875% REGS	48,000	9,883.38	4,744,024	9,572.70	4,594,896	5.875	2023/5/15	0.50
20	アメリカ	アメリカ	社債券	HILCORP NRG 5% REGS	43,000	10,754.44	4,624,412	10,542.52	4,533,285	5	2024/12/1	0.49
21	アメリカ	アメリカ	社債券	SPRINT 7.25%	40,000	11,341.97	4,536,789	11,131.78	4,452,713	7.25	2021/9/15	0.48
22	アメリカ	アメリカ	社債券	PRIME SECSRVC 9.25% REGS	38,000	11,872.86	4,511,687	11,559.10	4,392,459	9.25	2023/5/15	0.48
23	アメリカ	アメリカ	社債券	CIT GROUP 5% 22	40,000	11,300.55	4,520,222	10,960.23	4,384,094	5	2022/8/15	0.48
24	ドイツ	アメリカ	社債券	CCO HOLDINGS 5.75% REGS	40,000	11,232.98	4,493,193	10,719.19	4,287,678	5.75	2026/2/15	0.47
25	アメリカ	アメリカ	社債券	FREEPORT-MC 3.875%	40,000	10,562.87	4,225,149	10,328.91	4,131,567	3.875	2023/3/15	0.45
26	アメリカ	アメリカ	社債券	HCA INC 7.5%	35,000	12,094.77	4,233,171	11,718.48	4,101,468	7.5	2022/2/15	0.45
27	アメリカ	アメリカ	社債券	SPRINT 6% 22	38,000	10,706.81	4,068,588	10,655.14	4,048,955	6	2022/11/15	0.44
28	アメリカ	アメリカ	社債券	ENDO 5.75% REGS	45,000	9,322.69	4,195,211	8,836.87	3,976,592	5.75	2022/1/15	0.43
29	アメリカ	イギリス	社債券	RBS 6.125%	35,000	11,642.47	4,074,867	11,328.09	3,964,834	6.125	2022/12/15	0.43
30	アメリカ	アメリカ	社債券	JBS USA 7.25% REGS C	36,000	10,862.23	3,910,406	10,785.80	3,882,890	7.25	2021/6/1	0.42

（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、「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（2）ファンドの特色」の記載に基づき、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。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30年4月10日現在）

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	100.42

## (参考) G I M世界投資適格債券マザーファンド(適格機関投資家専用)

(平成30年4月10日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	35.82
地方債証券	1.21
特殊債券	21.00
社債券	34.11

## (参考) G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)

(平成30年4月10日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	95.69

## (参考) G I M米国高利回り社債マザーファンド(適格機関投資家専用)

(平成30年4月10日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	商業・専門サービス	0.01
		電気通信サービス	0.04
小計			0.05
新株予約権付社債券等	-		0.16
特殊債券	-		0.11
社債券	-		94.99

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30年4月10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4特定期間末	(平成20年9月10日)	11,574	11,659	0.8911	0.8976
第5特定期間末	(平成21年3月10日)	7,493	7,572	0.6164	0.6229
第6特定期間末	(平成21年9月10日)	8,847	8,930	0.6909	0.6974
第7特定期間末	(平成22年3月10日)	10,184	10,281	0.6840	0.6905
第8特定期間末	(平成22年9月10日)	10,410	10,518	0.6308	0.6373
第9特定期間末	(平成23年3月10日)	10,629	10,742	0.6123	0.6188
第10特定期間末	(平成23年9月12日)	7,812	7,860	0.5617	0.5652
第11特定期間末	(平成24年3月12日)	7,029	7,053	0.6008	0.6028
第12特定期間末	(平成24年9月10日)	6,343	6,365	0.5752	0.5772
第13特定期間末	(平成25年3月11日)	6,902	6,921	0.7210	0.7230
第14特定期間末	(平成25年9月10日)	5,897	5,914	0.7028	0.7048
第15特定期間末	(平成26年3月10日)	5,381	5,395	0.7456	0.7476
第16特定期間末	(平成26年9月10日)	4,844	4,857	0.7728	0.7748
第17特定期間末	(平成27年3月10日)	4,607	4,618	0.8115	0.8135
第18特定期間末	(平成27年9月10日)	3,852	3,862	0.7529	0.7549
第19特定期間末	(平成28年3月10日)	3,178	3,187	0.6947	0.6967
第20特定期間末	(平成28年9月12日)	2,860	2,868	0.6627	0.6647
第21特定期間末	(平成29年3月10日)	2,843	2,851	0.7196	0.7216
第22特定期間末	(平成29年9月11日)	2,681	2,688	0.7183	0.7203
第23特定期間末	(平成30年3月12日)	2,474	2,481	0.6943	0.6963
	平成29年4月末日	2,793	-	0.7128	-
	平成29年5月末日	2,755	-	0.7156	-
	平成29年6月末日	2,768	-	0.7238	-
	平成29年7月末日	2,731	-	0.7234	-
	平成29年8月末日	2,728	-	0.7255	-
	平成29年9月末日	2,749	-	0.7379	-
	平成29年10月末日	2,679	-	0.7311	-
	平成29年11月末日	2,634	-	0.7263	-
	平成29年12月末日	2,633	-	0.7345	-
	平成30年1月末日	2,571	-	0.7173	-
	平成30年2月末日	2,497	-	0.6990	-
	平成30年3月末日	2,462	-	0.6913	-
	平成30年4月10日	2,456	2,463	0.6898	0.6918

(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、平成30年4月10日の純資産総額(分配付)および1口当たり純資産額(分配付)は第138期計算期間末日のもので、

## 分配の推移

期	1口当たり分配金(円)
---	-------------

第4特定期間	0.0350
第5特定期間	0.0390
第6特定期間	0.0390
第7特定期間	0.0390
第8特定期間	0.0390
第9特定期間	0.0390
第10特定期間	0.0240
第11特定期間	0.0120
第12特定期間	0.0120
第13特定期間	0.0120
第14特定期間	0.0120
第15特定期間	0.0120
第16特定期間	0.0120
第17特定期間	0.0120
第18特定期間	0.0120
第19特定期間	0.0120
第20特定期間	0.0120
第21特定期間	0.0120
第22特定期間	0.0120
第23特定期間	0.0120

## 収益率の推移

期	収益率(%)
第4特定期間	3.5
第5特定期間	26.5
第6特定期間	18.4
第7特定期間	4.6
第8特定期間	2.1
第9特定期間	3.2
第10特定期間	4.3
第11特定期間	9.1
第12特定期間	2.3
第13特定期間	27.4
第14特定期間	0.9
第15特定期間	7.8
第16特定期間	5.3
第17特定期間	6.6
第18特定期間	5.7
第19特定期間	6.1

第20特定期間	2.9
第21特定期間	10.4
第22特定期間	1.5
第23特定期間	1.7

（注）収益率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4特定期間	369,366,919	1,231,076,120	12,989,311,018
第5特定期間	365,095,238	1,198,325,427	12,156,080,829
第6特定期間	1,333,909,796	684,578,041	12,805,412,584
第7特定期間	3,431,488,657	1,346,889,150	14,890,012,091
第8特定期間	3,748,350,254	2,134,077,668	16,504,284,677
第9特定期間	2,895,786,444	2,039,714,921	17,360,356,200
第10特定期間	1,401,999,188	4,853,363,384	13,908,992,004
第11特定期間	47,666,654	2,255,716,601	11,700,942,057
第12特定期間	54,040,516	728,123,682	11,026,858,891
第13特定期間	109,259,367	1,562,903,338	9,573,214,920
第14特定期間	191,750,829	1,373,783,379	8,391,182,370
第15特定期間	125,699,489	1,299,132,088	7,217,749,771
第16特定期間	113,447,876	1,061,668,357	6,269,529,290
第17特定期間	85,112,953	677,213,634	5,677,428,609
第18特定期間	60,027,255	620,984,481	5,116,471,383
第19特定期間	22,070,652	564,106,057	4,574,435,978
第20特定期間	18,742,534	277,109,214	4,316,069,298
第21特定期間	19,852,796	383,972,572	3,951,949,522
第22特定期間	25,207,680	244,519,523	3,732,637,679
第23特定期間	25,781,939	193,753,834	3,564,665,784

（注）設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

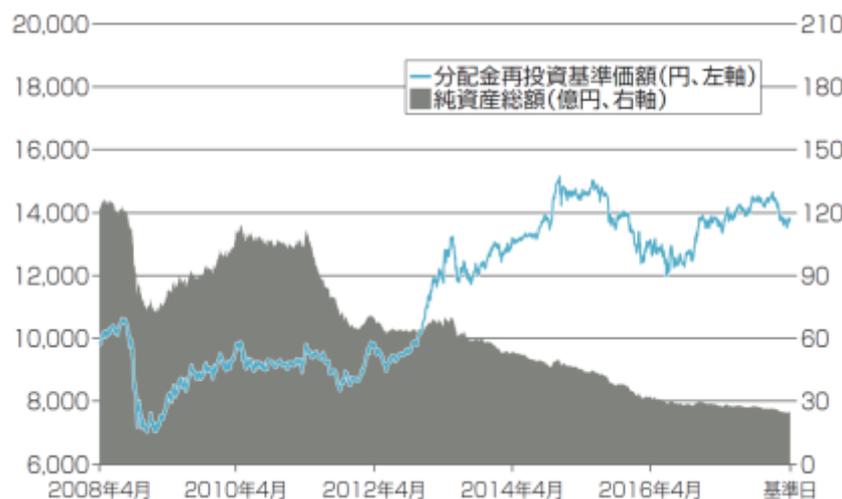
## &lt;参考情報&gt;

最新の運用実績は、委託会社ホームページ（<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	2018年4月10日	設定日	2006年9月29日
純資産総額	24億円	決算回数	年12回

## J P Mグローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）

## 基準価額・純資産の推移



\* 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。

## 分配の推移

期	年月	円
134期	2017年12月	20
135期	2018年1月	20
136期	2018年2月	20
137期	2018年3月	20
138期	2018年4月	20
	設定来累計	5,035

\* 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

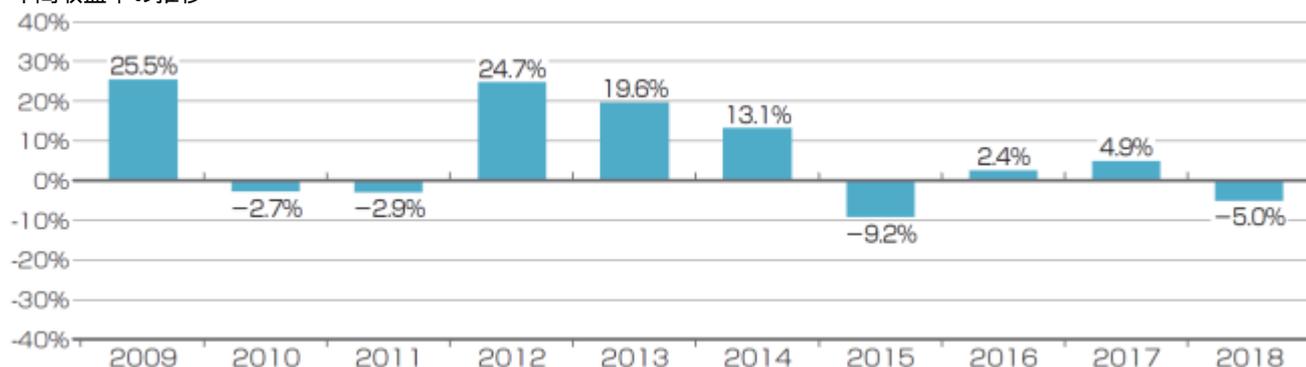
資産の種類	投資比率
G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）	33.5%
G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）	33.5%
G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）	33.4%
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-0.4%
合計（純資産総額）	100.0%

\* 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。

## 通貨別構成状況

通貨	投資比率
米ドル	48.8%
ユーロ	10.0%
ブラジルリアル	7.1%
南アフリカランド	4.1%
メキシコペソ	3.7%
その他	21.0%

## 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

\* 2018年の年間収益率は前年末営業日から2018年4月10日までのものです。

\* ベンチマークは設定していません。

\* 当ページおよび次ページにおける「ファンド」は、J P Mグローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）です。

上記において、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。

ファンドは各マザーファンドを通じて投資を行うため、各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。

## 組入上位銘柄

## G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）

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	ファニーメイ	特殊債券	4.000	2048/ 5 / 1	アメリカ	米ドル	1.3%
2	フレディマック	特殊債券	3.750	2019/ 3 /27	アメリカ	米ドル	1.2%
3	アメリカ国債	国債証券	1.750	2022/ 5 /31	アメリカ	米ドル	1.1%
4	フレディマック	特殊債券	3.500	2048/ 5 / 1	アメリカ	米ドル	1.1%
5	アメリカ国債	国債証券	1.125	2019/ 2 /28	アメリカ	米ドル	1.0%
6	ポルトガル国債	国債証券	4.125	2027/ 4 /14	ポルトガル	ユーロ	0.7%
7	ファニーメイ	特殊債券	3.000	2048/ 5 / 1	アメリカ	米ドル	0.7%
8	イギリス国債	国債証券	4.250	2040/12/ 7	イギリス	英ポンド	0.6%
9	アメリカ国債	国債証券	2.750	2028/ 2 /15	アメリカ	米ドル	0.6%
10	アメリカ国債	国債証券	1.750	2020/12/31	アメリカ	米ドル	0.5%

## G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）

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	ブラジル国債	国債証券	10.00	2021/ 1 / 1	ブラジル	ブラジルリアル	2.9%
2	ブラジル国債	国債証券	10.00	2023/ 1 / 1	ブラジル	ブラジルリアル	1.5%
3	インドネシア国債	国債証券	9.00	2029/ 3 /15	インドネシア	インドネシアルピア	1.2%
4	コロンビア国債	国債証券	6.00	2028/ 4 /28	コロンビア	コロンビアペソ	1.2%
5	南アフリカ国債	国債証券	10.50	2026/12/21	南アフリカ	南アフリカランド	1.1%
6	メキシコ国債	国債証券	6.50	2022/ 6 / 9	メキシコ	メキシコペソ	1.0%
7	ブラジル国債	国債証券	10.00	2027/ 1 / 1	ブラジル	ブラジルリアル	0.9%
8	ブラジル国債	国債証券	6.00	2022/ 8 /15	ブラジル	ブラジルリアル	0.9%
9	ロシア国債	国債証券	8.15	2027/ 2 / 3	ロシア	ロシアルーブル	0.8%
10	ポーランド国債	国債証券	2.50	2026/ 7 /25	ポーランド	ポーランドズロチ	0.8%

## G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）

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	アンテロ・リソーシズ	社債券	5.125	2022/12/ 1	アメリカ	米ドル	0.4%
2	I L F C Eーキャピタル トラストII	社債券	4.890	2065/12/21	アメリカ	米ドル	0.4%
3	レベル3ファイナンス	社債券	5.375	2024/ 1 /15	アメリカ	米ドル	0.4%
4	スプリント	社債券	7.625	2026/ 3 / 1	アメリカ	米ドル	0.3%
5	GW ホノース・セキュリティー	社債券	8.750	2025/ 5 /15	カナダ	米ドル	0.3%
6	サミット・マテリアルズ	社債券	5.125	2025/ 6 / 1	アメリカ	米ドル	0.3%
7	USコンクリート	社債券	6.375	2024/ 6 / 1	アメリカ	米ドル	0.2%
8	CVRパートナーズ	社債券	9.250	2023/ 6 /15	アメリカ	米ドル	0.2%
9	ロイヤルバンクスコットランドグループ	社債券	6.100	2023/ 6 /10	イギリス	米ドル	0.2%
10	CNGホールディングス	社債券	9.375	2020/ 5 /15	アメリカ	米ドル	0.2%

上記において、投資比率は表示単位以下を四捨五入して記載しています。

- 1 ファンドは各マザーファンドを通じて投資を行うため、各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、「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（2）ファンドの特色」の記載に基づき、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23特定期間（平成29年9月12日から平成30年3月12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グローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 (平成29年9月11日現在)	当期 (平成30年3月12日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	2,692,556,564	2,484,851,750
未収入金	6,065,373	708,219
流動資産合計	2,698,621,937	2,485,559,969
資産合計	2,698,621,937	2,485,559,969
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	7,465,275	7,129,331
未払解約金	6,065,373	708,219
未払受託者報酬	127,956	99,243
未払委託者報酬	3,582,813	2,778,762
その他未払費用	51,171	39,687
流動負債合計	17,292,588	10,755,242
負債合計	17,292,588	10,755,242
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,732,637,679	1 3,564,665,784
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 1,051,308,330	2 1,089,861,057
（分配準備積立金）	279,252,828	273,337,775
元本等合計	2,681,329,349	2,474,804,727
純資産合計	2,681,329,349	2,474,804,727
負債純資産合計	2,698,621,937	2,485,559,969

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	前期 (自 平成29年 3月11日 至 平成29年 9月11日)	当期 (自 平成29年 9月12日 至 平成30年 3月12日)
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	63,992,701	19,800,933
<b>営業収益合計</b>	<b>63,992,701</b>	<b>19,800,933</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	756,323	710,572
委託者報酬	1 21,177,111	1 19,895,828
その他費用	302,472	284,167
<b>営業費用合計</b>	<b>22,235,906</b>	<b>20,890,567</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>41,756,795</b>	<b>40,691,500</b>
<b>経常利益又は経常損失( )</b>	<b>41,756,795</b>	<b>40,691,500</b>
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>41,756,795</b>	<b>40,691,500</b>
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( )	120,617	18,078
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>1,108,080,875</b>	<b>1,051,308,330</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>68,032,550</b>	<b>52,549,022</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	68,032,550	52,549,022
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,140,811	6,970,939
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,140,811	6,970,939
<b>分配金</b>	<b>2 45,996,606</b>	<b>2 43,457,388</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>1,051,308,330</b>	<b>1,089,861,057</b>

## ( 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本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 平成29年9月10日が休日のため、信託約款第41条により、第22特定期間末日を平成29年9月11日としております。また、平成30年3月10日および平成30年3月11日が休日のため、第23特定期間末日を平成30年3月12日としております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

区分	前期 (平成29年9月11日現在)	当期 (平成30年3月12日現在)
1 期首元本額	3,951,949,522円	3,732,637,679円
期中追加設定元本額	25,207,680円	25,781,939円
期中一部解約元本額	244,519,523円	193,753,834円
2 元本の欠損	1,051,308,330円	1,089,861,057円
受益権の総数	3,732,637,679口	3,564,665,784口
1 口当たりの純資産額	0.7183円	0.6943円
( 1 万口当たりの純資産額 )	( 7,183円 )	( 6,943円 )

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

区分	前期 (自 平成29年3月11日 至 平成29年9月11日)	当期 (自 平成29年9月12日 至 平成30年3月12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	G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用） 報酬対象期間の毎月末時点におけるベビーファンドの信託財産に属する当該マザーファンド受益証券の時価総額を平均した額に年率0.25%を乗じ、当該報酬対象期間の日数に応じて実日数に基づき日割り計算して得た金額	G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用） 同左

	<p>G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)</p> <p>報酬対象期間の毎月末時点におけるベビーファンドの信託財産に属する当該マザーファンド受益証券の時価総額を平均した額に年率0.35%を乗じ、当該報酬対象期間の日数に応じて実日数に基づき日割り計算して得た金額</p> <p>G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）</p> <p>報酬対象期間の毎月末時点におけるベビーファンドの信託財産に属する当該マザーファンド受益証券の時価総額を平均した額に年率0.35%を乗じ、当該報酬対象期間の日数に応じて実日数に基づき日割り計算して得た金額</p> <p>上記それぞれに算出した額の合計額</p>	<p>G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)</p> <p>同左</p> <p>G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）</p> <p>同左</p> <p>上記それぞれに算出した額の合計額</p>
<p>2 分配金の計算過程</p>	<p>(自 平成29年 3月11日 至 平成29年 4月10日)</p> <p>費用控除後の配当等収益額 7,328,787円</p> <p>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</p> <p>収益調整金額 35,426,540円</p> <p>分配準備積立金額 285,191,641円</p> <p>当ファンドの分配対象収益額 327,946,968円</p> <p>当ファンドの期末残存口数 3,920,791,747口</p> <p>1万口当たり収益分配対象額 836.43円</p> <p>1万口当たり分配金額 20.00円</p> <p>収益分配金金額 7,841,583円</p> <p>(自 平成29年 4月11日 至 平成29年 5月10日)</p> <p>費用控除後の配当等収益額 9,902,828円</p> <p>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</p> <p>収益調整金額 35,594,649円</p> <p>分配準備積立金額 284,397,240円</p> <p>当ファンドの分配対象収益額 329,894,717円</p> <p>当ファンドの期末残存口数 3,919,340,316口</p> <p>1万口当たり収益分配対象額 841.70円</p>	<p>(自 平成29年 9月12日 至 平成29年10月10日)</p> <p>費用控除後の配当等収益額 9,721,841円</p> <p>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</p> <p>収益調整金額 35,669,506円</p> <p>分配準備積立金額 278,439,145円</p> <p>当ファンドの分配対象収益額 323,830,492円</p> <p>当ファンドの期末残存口数 3,728,100,122口</p> <p>1万口当たり収益分配対象額 868.62円</p> <p>1万口当たり分配金額 20.00円</p> <p>収益分配金金額 7,456,200円</p> <p>(自 平成29年10月11日 至 平成29年11月10日)</p> <p>費用控除後の配当等収益額 6,532,321円</p> <p>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</p> <p>収益調整金額 35,226,715円</p> <p>分配準備積立金額 275,140,918円</p> <p>当ファンドの分配対象収益額 316,899,954円</p> <p>当ファンドの期末残存口数 3,656,693,617口</p> <p>1万口当たり収益分配対象額 866.62円</p>

1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	7,838,680円	7,313,387円
	(自 平成29年5月11日 至 平成29年6月12日)	(自 平成29年11月11日 至 平成29年12月11日)
費用控除後の配当等収益額	7,119,947円	7,967,949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	35,550,245円	35,037,462円
分配準備積立金額	280,036,908円	270,777,349円
当ファンドの分配対象収益額	322,707,100円	313,782,760円
当ファンドの期末残存口数	3,839,748,234口	3,611,699,353口
1万口当たり収益分配対象額	840.43円	868.79円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	7,679,496円	7,223,398円
	(自 平成29年6月13日 至 平成29年7月10日)	(自 平成29年12月12日 至 平成30年1月10日)
費用控除後の配当等収益額	17,015,940円	14,203,639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	35,604,728円	35,227,809円
分配準備積立金額	277,185,150円	269,244,221円
当ファンドの分配対象収益額	329,805,818円	318,675,669円
当ファンドの期末残存口数	3,812,145,127口	3,586,719,118口
1万口当たり収益分配対象額	865.14円	888.48円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	7,624,290円	7,173,438円
	(自 平成29年7月11日 至 平成29年8月10日)	(自 平成30年1月11日 至 平成30年2月13日)
費用控除後の配当等収益額	6,326,265円	6,665,090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	35,425,669円	35,585,368円
分配準備積立金額	283,532,881円	275,418,159円
当ファンドの分配対象収益額	325,284,815円	317,668,617円
当ファンドの期末残存口数	3,773,641,003口	3,580,817,246口
1万口当たり収益分配対象額	861.99円	887.13円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	7,547,282円	7,161,634円
	(自 平成29年8月11日 至 平成29年9月11日)	(自 平成30年2月14日 至 平成30年3月12日)
費用控除後の配当等収益額	7,623,998円	6,926,058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	35,222,813円	35,579,847円
分配準備積立金額	279,094,105円	273,541,048円

当ファンドの分配対象収益額	321,940,916円	316,046,953円
当ファンドの期末残存口数	3,732,637,679口	3,564,665,784口
1万口当たり収益分配対象額	862.50円	886.61円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	7,465,275円	7,129,331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、以下に記載される各親投資信託受益証券であります。 G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用） G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用) G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用） 各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、各親投資信託受益証券と同様のリスクを伴います。各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。
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、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）のモニターおよび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。更に、投資制限の管理を行います。 (2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っています。

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	前期 (平成29年9月11日現在)	当期 (平成30年3月12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	12,948,159	24,678,636

合計	12,948,159	24,678,636
----	------------	------------

(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(平成30年3月12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世界投資適格債券マザーファンド (適格機関投資家専用)	581,937,531	820,299,143	
		G I M新興国現地通貨ソブリン・マザー ファンド(適格機関投資家専用)	540,561,027	835,220,842	
		G I M米国高利回り社債マザーファンド (適格機関投資家専用)	407,854,709	829,331,765	
合計			1,530,353,267	2,484,851,750	

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世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）」受益証券、「G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）」受益証券および「G I M米国高利回り社債マザーファンド（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。

「G I M世界投資適格債券マザーファンド（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	(平成29年9月11日現在)	(平成30年3月12日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		1,582,695,543	2,139,045,636
コール・ローン		27,644,754	25,480,294
国債証券		4,771,382,970	3,701,155,581
地方債証券		139,421,990	129,100,937
特殊債券		3,356,302,611	2,554,060,063
社債券		4,350,361,846	4,131,241,387
派生商品評価勘定		67,588,935	41,999,980
未収入金		1,706,533,231	1,605,364,246
未収利息		89,449,384	70,177,711
前払費用		8,931,566	15,692,104
流動資産合計		16,100,312,830	14,413,317,939
資産合計		16,100,312,830	14,413,317,939
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		62,994,123	45,433,939
未払金		3,537,327,391	3,185,813,316
未払解約金		2,021,790	236,073
未払利息		75	74
流動負債合計		3,602,343,379	3,231,483,402
負債合計		3,602,343,379	3,231,483,402
純資産の部			
元本等			
元本	1	8,679,933,823	7,932,507,382
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,818,035,628	3,249,327,155
元本等合計		12,497,969,451	11,181,834,537
純資産合計		12,497,969,451	11,181,834,537
負債純資産合計		16,100,312,830	14,413,317,939

## ( 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>国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券 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。</p> <p>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。</p> <p>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29年9月11日現在)	(平成30年3月12日現在)
1期首元本額	10,080,170,113円	8,679,933,823円
期中追加設定元本額	34,119,147円	4,823,418円
期中解約元本額	1,434,355,437円	752,249,859円
元本の内訳（注）		
JPMグローバル債券3分散ファンド （毎月決算型）	626,657,113円	581,937,531円
GIM世界投資適格債券ファンドF （適格機関投資家専用）	7,977,963,759円	7,282,779,084円
GIM世界投資適格債券ファンドF1 （適格機関投資家専用）	75,312,951円	67,790,767円
合 計	8,679,933,823円	7,932,507,382円
受益権の総数	8,679,933,823口	7,932,507,382口
1口当たりの純資産額	1.4399円	1.4096円
（1万口当たりの純資産額）	（14,399円）	（14,096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、地方債証券、特殊債券、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、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	(平成29年9月11日現在)	(平成30年3月12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	77,840,206	55,667,089
地方債証券	126,414	1,396,170
特殊債券	2,391,809	19,264,611
社債券	107,151,757	111,074,740
合計	182,726,568	187,402,610

## (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29年9月11日現在)				(平成30年3月12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	2,094,666,325	-	2,060,428,588	34,237,737	1,966,861,935	-	1,968,980,253	2,118,318
	カナダドル	754,850,442	-	769,537,392	14,686,950	1,236,798,417	-	1,228,172,373	8,626,044
	メキシコペソ	66,449,806	-	66,360,378	89,428	-	-	-	-
	ユーロ	2,023,398,187	-	2,027,303,723	3,905,536	1,332,693,682	-	1,328,092,015	4,601,667
	英ポンド	587,974,924	-	589,410,994	1,436,070	325,230,215	-	324,356,959	873,256
	スイスフラン	-	-	-	-	10,640,647	-	10,462,571	178,076
	スウェーデンクロー ネ	-	-	-	-	88,615,383	-	85,203,290	3,412,093
	ノルウェークローネ	-	-	-	-	33,452,471	-	33,726,600	274,129
	デンマーククローネ	29,298,972	-	29,358,718	59,746	29,713,952	-	29,643,754	70,198
	チェココルナ	-	-	-	-	13,089,694	-	12,976,379	113,315
	ポーランドズロチ	-	-	-	-	16,860,872	-	16,651,381	209,491
	オーストラリアドル	521,993,815	-	522,076,537	82,722	145,289,854	-	145,644,157	354,303
	シンガポールドル	-	-	-	-	25,671,756	-	25,757,078	85,322
	タイバーツ	52,779,748	-	52,061,528	718,220	37,362,873	-	37,455,573	92,700
	イスラエル・シケル	25,655,159	-	25,719,525	64,366	25,436,034	-	25,852,873	416,839
	売建								
	アメリカドル	2,726,868,661	-	2,692,618,455	34,250,206	2,044,398,065	-	2,046,161,919	1,763,854
	カナダドル	402,554,572	-	409,671,532	7,116,960	1,341,974,227	-	1,332,232,914	9,741,313
	メキシコペソ	65,966,569	-	65,644,257	322,312	-	-	-	-
	ユーロ	1,346,063,772	-	1,348,970,632	2,906,860	834,981,371	-	838,351,693	3,370,322
	英ポンド	819,076,304	-	823,281,979	4,205,675	601,980,636	-	598,301,436	3,679,200
	スイスフラン	-	-	-	-	10,683,834	-	10,462,571	221,263
	スウェーデンクロー ネ	37,354,024	-	37,853,187	499,163	133,013,671	-	129,012,489	4,001,182
	ノルウェークローネ	-	-	-	-	33,346,708	-	33,726,601	379,893
	ポーランドズロチ	37,910,951	-	38,335,653	424,702	-	-	-	-
オーストラリアドル	566,551,454	-	568,380,881	1,829,427	287,339,273	-	288,159,592	820,319	
ニュージーランドド ル	90,985,068	-	88,006,926	2,978,142	-	-	-	-	
南アフリカランド	63,736,003	-	64,899,069	1,163,066	-	-	-	-	
合計		12,314,134,756	-	12,279,919,954	4,594,812	10,575,435,570	-	10,549,384,471	3,433,959

## (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の仲値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の仲値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30年3月12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	アメリカドル	ABU DHABI 3.125%OCT27REGS		550,000.00	518,237.50	
		HUNGARY USD 5.375% MAR24		100,000.00	109,111.00	
		INDNSA 5.375% OCT23 REGS		400,000.00	429,268.00	
		KUWAIT 2.75% MAR22 REGS		280,000.00	273,938.00	
		MEXICO USD 4.15% MAR27		210,000.00	209,947.50	
		OMAN USD4.75% JUN26 REGS		340,000.00	326,192.60	
		POLAND USD 3% MAR23		650,000.00	642,557.50	
		QATAR 2.375% JUN21 REGS		250,000.00	242,175.00	
		RUSSIA 4.875% SEP23 REGS		200,000.00	211,490.00	
		SLOVENIA5.25% FEB24 REGS		350,000.00	383,852.00	
		US T-BOND 2.25% AUG46		18,500.00	15,337.65	
		US T-BOND 2.5% MAY46		375,700.00	329,089.71	
		US T-BOND 2.75% NOV47		120,000.00	110,474.99	
		US T-BOND 3% FEB47		845,000.00	818,989.84	
		US T-BOND 3% MAY47		490,000.00	474,687.50	
		US T-NOTE 1.125% FEB19		2,910,000.00	2,883,059.77	
		US T-NOTE 1.125% FEB21		580,000.00	558,114.06	
		US T-NOTE 1.375% OCT20		365,000.00	355,475.78	
		US T-NOTE 1.75% DEC20		1,455,000.00	1,428,855.46	
		US T-NOTE 1.75% MAY22		4,550,000.00	4,396,082.04	
		US T-NOTE 2.125% DEC22		640,000.00	624,849.99	
	計	銘柄数：	21	15,679,200.00	15,341,785.89	
					(1,640,804,000)	
		組入時価比率：	14.7%		15.6%	
	カナダドル	CANADA GOVT 3.25% JUN21		1,200,000.00	1,247,844.00	
		CANADA GOVT 5% JUN37		525,000.00	731,314.50	
		CANADA GOVT 8% JUN27		315,000.00	464,527.35	
	計	銘柄数：	3	2,040,000.00	2,443,685.85	
					(204,023,331)	
		組入時価比率：	1.8%		1.9%	
	メキシコペソ	MEXICO GOVT 10% DEC24		5,500,000.00	6,240,795.00	
	計	銘柄数：	1	5,500,000.00	6,240,795.00	
					(35,822,163)	
		組入時価比率：	0.3%		0.3%	
	ユーロ	BELGIUM GOVT 5% MAR35 44		80,000.00	125,535.20	
		CHILE EUR 1.44% FEB29		225,000.00	222,390.00	
		FRANCE OAT 1% MAY27		450,000.00	459,436.50	
		FRANCE OAT 2% MAY48		40,047.00	42,609.20	
		FRANCE OAT 3.25% MAY45		44,800.00	60,665.47	
		GERMANY BUND 1.25% AUG48		75,881.00	74,987.88	
		GERMANY BUND 1.5% SEP22		150,000.00	160,870.50	
		GERMANY BUND 4% JAN37		200,000.00	300,068.00	
		IRELAND GOVT 1% MAY26		177,000.00	180,017.85	
		IRELAND GOVT 3.4% MAR24		132,300.00	155,975.08	

		ITALY BTP 2.2% JUN27		650,000.00	667,342.00	
		ITALY BTP 2.7% MAR47		50,000.00	47,606.50	
		ITALY BTP 2.8% MAR67		148,000.00	133,836.40	
		ITALY BTP 4.75% SEP44		495,000.00	658,082.70	
		ITALY BTP 5.5% NOV22		930,000.00	1,131,289.20	
		MEXICO 1.625% MAR24 EMTN		226,000.00	228,147.00	
		MEXICO EUR 2.375% APR21		446,000.00	472,983.00	
		NETHERLANDS 2.75% JAN47		61,600.00	83,426.11	
		POLAND EUR1.5%SEP25 EMTN		100,000.00	103,710.00	
		PORTUGAL OT 4.125% APR27		1,500,000.00	1,805,265.00	
		SLOVAKIA EUR 2% OCT47		125,609.00	128,039.53	
		SLOVENIA 1.25% MAR27		261,000.00	263,393.37	
		SPAIN GOVT 0.4% APR22		400,000.00	402,792.00	
		SPAIN GOVT 1.5% APR27		750,000.00	763,665.00	
		SPAIN GOVT 2.7% OCT48		802,000.00	823,012.40	
		SPAIN GOVT 2.9% OCT46		315,000.00	341,778.15	
		SPAIN GOVT 3.8% APR24		140,000.00	166,040.00	
		SPAIN GOVT 5.15% OCT44		26,000.00	39,957.58	
	計	銘柄数 :	28	9,001,237.00	10,042,921.62	
					(1,322,552,348)	
		組入時価比率 :	11.8%		12.6%	
	英ポンド	UK GOVT 2% SEP25		150,000.00	157,515.00	
		UK GOVT 4.25% DEC40		900,000.00	1,285,668.00	
		UK GOVT 4.25% DEC55		320,000.00	537,004.80	
	計	銘柄数 :	3	1,370,000.00	1,980,187.80	
					(293,523,237)	
		組入時価比率 :	2.6%		2.8%	
	デンマーククローネ	DENMARK GOVT 4.5% NOV39		700,000.00	1,149,295.00	
	計	銘柄数 :	1	700,000.00	1,149,295.00	
					(20,319,535)	
		組入時価比率 :	0.2%		0.2%	
	ポーランドズロチ	POLAND GOVT 5.75% SEP22		650,000.00	744,081.00	
	計	銘柄数 :	1	650,000.00	744,081.00	
					(23,364,143)	
		組入時価比率 :	0.2%		0.2%	
	ロシアルーブル	RUSSIA 8.15% FEB27 6207		4,100,000.00	4,447,917.80	
	計	銘柄数 :	1	4,100,000.00	4,447,917.80	
					(8,362,085)	
		組入時価比率 :	0.1%		0.1%	
	オーストラリアドル	AUSTRALIA 3% MAR47 150		383,000.00	355,546.56	
		AUSTRALIA4.25% APR26 142		320,000.00	356,332.80	
		AUSTRALIA5.75% MAY21 124		950,000.00	1,054,481.00	
	計	銘柄数 :	3	1,653,000.00	1,766,360.36	
					(148,444,924)	
		組入時価比率 :	1.3%		1.4%	
	ニュージーランドドル	NEW ZEALAND GOV2.75%0437		56,000.00	50,484.56	
	計	銘柄数 :	1	56,000.00	50,484.56	
					(3,939,815)	
		組入時価比率 :	0.0%		0.0%	
	小計				3,701,155,581	
					(3,701,155,581)	
地方債証券	カナダドル	HYDRO QUEBEC 6.5% 19		100,000.00	143,315.00	

		ONTARIO 2.6%		1,090,000.00	1,078,696.70
		QUEBEC 5%		250,000.00	324,292.50
	計	銘柄数：	3	1,440,000.00	1,546,304.20
					(129,100,937)
		組入時価比率：	1.2%		1.2%
	小計				129,100,937
					(129,100,937)
特殊債券	アメリカドル	FGLMC 3.5% APR48 TBA		3,600,000.00	3,582,000.00
		FNCI 3.0% APR33 TBA		2,620,000.00	2,607,718.75
		FNCI 4.5% APR33 TBA		985,000.00	991,771.90
		FNCL 3.0% ARR48 TBA		2,100,000.00	2,027,812.50
		FNCL 4.0% APR48 TBA		2,250,000.00	2,297,812.56
		FNCL 4.5% APR48 TBA		950,000.00	992,156.27
		FREDDIE MAC 3.75%		3,700,000.00	3,759,681.00
		G2SF 3.0% APR48 TBA		1,000,000.00	976,250.00
		G2SF 3.5% APR48 TBA		1,400,000.00	1,405,250.04
		PEMEX 4.25%		700,000.00	675,696.00
		PEMEX 5.35% REGS		240,000.00	234,900.00
		PEMEX 6.35% REGS		120,000.00	115,992.00
	計	銘柄数：	12	19,665,000.00	19,667,041.02
					(2,103,390,037)
		組入時価比率：	18.8%		20.1%
	ユーロ	DEXIA CREDIT 1.25%		500,000.00	517,750.00
		EFSF 0.75% EMTN		1,030,000.00	1,020,307.70
		EIB 0.875% EMTN		500,000.00	513,450.00
		ESM 1.125% EMTN		150,000.00	149,362.50
		EUROPEAN UNION3.375%EMTN		50,000.00	64,202.00
		UNEDIC 0.25% EMTN		1,000,000.00	996,030.00
	計	銘柄数：	6	3,230,000.00	3,261,102.20
					(429,454,548)
		組入時価比率：	3.8%		4.1%
	スウェーデンクローネ	EIB 1.25% EMTN		1,610,000.00	1,633,216.20
	計	銘柄数：	1	1,610,000.00	1,633,216.20
					(21,215,478)
		組入時価比率：	0.2%		0.2%
	小計				2,554,060,063
					(2,554,060,063)
社債券	アメリカドル	AB INBEV 3.65%		480,000.00	472,953.60
		ABBVIE 4.5%		100,000.00	102,074.00
		ACTAVIS 3.25%		250,000.00	245,642.50
		ACTAVIS 4.55%		30,000.00	29,064.00
		AERCAP 3.3%		180,000.00	175,644.00
		AERCAP 3.65%		150,000.00	140,310.00
		AIG 3.3%		240,000.00	239,949.60
		AIG 3.9%		110,000.00	108,860.40
		ALTRIA GROUP 2.85%		218,000.00	213,572.42
		ALTRIA GROUP 4.25%		145,000.00	141,218.40
		AMAZON.COM 2.8% 144A		90,000.00	86,827.50
		AMAZON.COM 4.05% 144A		65,000.00	63,872.90
		AMER AIRLINE 3.2% AA		170,640.00	163,338.31
		AMERICAN TOWER 3.375%		70,000.00	65,939.30
		AMERICAN TOWER 4.4%		80,000.00	81,394.40

	AMERICAN TOWER 4%		20,000.00	19,945.80
	ANTHEM 5.1%		60,000.00	63,678.00
	APPLE 3.35%		225,000.00	220,527.00
	AT&T 3.9%		105,000.00	104,068.65
	AT&T 4.9%		180,000.00	179,258.40
	AT&T INC 3.4%		25,000.00	23,852.75
	AT&T INC 4.3%		285,000.00	256,762.20
	BALTIMORE GAS&ELEC 2.8%		100,000.00	97,905.00
	BANK OF MONTREAL2.35%MTN		240,000.00	230,908.80
	BARCLAYS BK 2.65%		655,000.00	645,129.15
	BAT 3.557% 144A		380,000.00	361,091.20
	BBCMS 2017-C1 A4		250,000.00	251,175.00
	BERKSHIRE HATHAWAY3.125%		135,000.00	130,238.55
	BK OF AMERICA 2.151% MTN		140,000.00	136,922.80
	BK OF AMERICA 2.625% MTN		215,000.00	212,884.40
	BK OF AMERICA 4.25% S.L		145,000.00	145,123.25
	BK OF AMERICA 5% MTN		25,000.00	27,429.00
	BNSF 4.9%		100,000.00	110,849.00
	BOARDWALK PIPELINE 5.95%		121,000.00	130,361.77
	BPCE 4%		250,000.00	254,397.50
	BUCKEYE PARTNERS 5.85%		95,000.00	97,223.95
	CAPITAL ONE 4.2%		405,000.00	399,475.80
	CARDINAL HEALTH 3.41%		35,000.00	32,840.85
	CENTURY FOX 4.75%		35,000.00	37,264.85
	CGCMT 2016-P6 A5		250,000.00	252,455.00
	CITIGROUP 1.75%		720,000.00	719,056.80
	CITIGROUP 2.65%		380,000.00	375,656.60
	CITIGROUP 4.45%		110,000.00	111,028.50
	CITIGROUP FLT		250,000.00	246,545.00
	CITIGROUP FLT V		80,000.00	79,079.20
	CMS ENERGY 2.95%		35,000.00	32,429.60
	COMCAST 3.9%		45,000.00	42,495.75
	COMCAST CORP 4.45%		110,000.00	109,594.10
	COMCAST CORP 4.6%		50,000.00	51,213.00
	CON EDISON 3.125% B		125,000.00	120,675.00
	CON EDISON 4.625%		70,000.00	75,001.50
	CONSTELLATION BR 4.5%		25,000.00	24,662.75
	CROWN CASTLE 3.8%		150,000.00	143,926.50
	CSFB 2004-3 2A1		21,316.84	21,316.84
	CSX 3.25%		45,000.00	42,767.55
	CVS HEALTH 4.3%		159,000.00	157,362.30
	CVS HEALTH 4.78%		90,000.00	89,098.20
	DARDEN RESTAURANTS 3.85%		80,000.00	78,203.20
	DISCOVERY COMMS 3.95%		95,000.00	90,292.75
	DOMINION RESOURCES 4.7%		130,000.00	135,844.80
	DUKE ENERGY 4.15%		170,000.00	172,006.00
	ENTERGY 2.95%		45,000.00	42,024.60
	ENTERGY MISSISSIPPI2.85%		70,000.00	64,790.60
	EPPLP 3.75%		160,000.00	159,420.80
	EPPLP 4.9%		135,000.00	140,516.10
	EQABS 2004-3 AF4		95,002.59	94,910.43

	EXELON 3.4%		325,000.00	325,071.50
	FEDEX 4.4%		25,000.00	24,566.75
	FORTIS 3.055%		35,000.00	32,498.55
	GE 4.5%		155,000.00	150,935.90
	GE CAPITAL 4.418%		210,000.00	203,689.50
	GILEAD 4.5%		40,000.00	40,334.00
	GM 3.95%		260,000.00	257,337.60
	GM 5.15%		30,000.00	29,316.30
	GOLDMAN SACHS 2.75%		70,000.00	69,431.60
	GOLDMAN SACHS 4.25%		155,000.00	155,316.20
	GOLDMAN SACHS 4.75%		215,000.00	224,816.90
	GSMS 2017-GS5 A4		125,000.00	125,782.49
	HALLIBURTON 5%		105,000.00	111,672.75
	HARRIS CORP 5.054%		105,000.00	114,240.00
	HSBC HLDGS VAR		270,000.00	263,954.70
	HSBC USA 2.375%		610,000.00	605,235.90
	INTESA SANPAOLO 5.25%		400,000.00	425,240.00
	JOHN DEERE 3.05% MTN		160,000.00	152,915.20
	KIMCO REALITY 3.125%		265,000.00	258,414.75
	KIMCO REALITY 3.4%		45,000.00	45,012.15
	KRAFT HEINZ FOOD 4.375%		125,000.00	113,058.75
	KROGER 2.65%		165,000.00	147,529.80
	LOWES 4.05%		45,000.00	43,431.30
	M STANLEY 2.375% MTN		345,000.00	342,902.40
	M STANLEY 4.3%		195,000.00	192,227.10
	MARTIN MARIETTA 3.5%		55,000.00	52,542.60
	MCDONALD'S 3.7% MTN		60,000.00	59,669.40
	METLIFE INC 2.3% 144A		510,000.00	507,669.30
	MICROSOFT 3.75%		205,000.00	199,050.90
	MPLX 4.5%		90,000.00	86,617.80
	MSAC 2004-SD2 A		298,251.79	296,659.12
	MYLAN 3.95%		25,000.00	24,215.50
	NISOURCE 5.65%		80,000.00	93,934.40
	ORACLE 3.25%		10,000.00	9,667.40
	ORACLE CORP 4.5%		130,000.00	137,416.50
	ORANGE 5.5%		40,000.00	46,320.80
	PHILIP MORRIS 4.5%		105,000.00	106,725.15
	PHILLIPS 66 4.875%		10,000.00	10,369.10
	REALTY INCOME 3.65%		95,000.00	92,049.30
	REYNOLDS AMERICAN 5.7%		150,000.00	168,678.00
	ROCKWELL COLLINS 3.2%		135,000.00	131,534.55
	S CALIF EDISON 3.6% C		50,000.00	45,557.50
	S CALIF EDISON 3.65% B		65,000.00	64,630.15
	SEMPRA ENERGY 3.4%		140,000.00	132,414.80
	SEMPRA ENERGY 3.8%		50,000.00	46,466.00
	SEMPRA ENERGY 4%		40,000.00	36,485.60
	SHELL 3.75%		115,000.00	107,705.55
	SHERWIN-WILLIAMS 4.5%		25,000.00	24,592.50
	SIMON PROPERTY 3.375%		160,000.00	152,612.80
	SUNOCO LOGISTICS 5.3%		235,000.00	222,864.60
	SWEPCO 3.9% J		125,000.00	118,862.50

		SYNCHRONY FIN 4.25%		280,000.00	281,120.00
		UNITED AIR 3.1% AA		175,250.54	168,014.44
		UNITED TECH 4.5%		45,000.00	45,219.60
		UNITEDHEALTH GROUP 3.75%		165,000.00	166,471.80
		VENTAS 4.375%		24,000.00	22,976.88
		VERIZON 3.5%		90,000.00	88,805.70
		VERIZON 3.85%		72,000.00	61,526.16
		VERIZON 4.272%		65,000.00	61,398.35
		VERIZON 4.862%		13,000.00	12,745.85
		WALGREENS BOOTS 3.45%		15,000.00	14,116.95
		WALGREENS BOOTS 3.8%		40,000.00	39,533.20
		WELLS FARGO 5.375%		215,000.00	236,839.70
		WESTPAC VAR EMTN		90,000.00	89,643.60
		WFCM 2017-RC1 A4		250,000.00	250,365.01
		WFMB 2005-2 2A1		48,176.47	48,176.47
	計	銘柄数：	132	19,370,638.23	19,189,546.09
					(2,052,321,954)
		組入時価比率：	18.4%		19.5%
	ユーロ	ABN AMRO 6.375% EMTN		200,000.00	235,910.00
		ABN AMRO BANK VAR EMTN		200,000.00	210,876.00
		ANZ BANK 0.625%		146,000.00	148,182.70
		ASB BANK 0.25% EMTN		292,000.00	293,427.88
		ASB FIN 0.125% EMTN		474,000.00	462,405.96
		ASB FIN 0.625% EMTN		100,000.00	99,243.00
		AXA SA FLT		200,000.00	219,840.00
		AXA SA FLT EMTN		300,000.00	355,491.00
		BK OF AMERICA FLT EMTN		249,000.00	253,016.37
		BPM 2 A2		235,354.60	234,020.13
		CIBC 0.25% EMTN		372,000.00	369,715.92
		CR AGRICOLE 0.875% EMTN		200,000.00	204,174.00
		DANSKE BANK VAR 23		300,000.00	306,243.00
		EDP FIN 1.5% EMTN		161,000.00	157,751.02
		ENEL 1.125% EMTN		136,000.00	132,575.52
		ENGIE 1.5% EMTN		200,000.00	191,292.00
		ENI SPA 3.25% EMTN		110,000.00	125,208.60
		GOLDMAN SACHS 2.625% EMTN		147,000.00	155,924.37
		HAMMERSON 2% EMTN		258,000.00	271,692.06
		HANDELSBANKEN VAR 24		331,000.00	337,907.97
		HEATHROW 1.5% EMTN		154,000.00	152,338.34
		IMERYSA SA 1.875% EMTN		100,000.00	102,377.00
		ING GRP VAR EMTN		300,000.00	325,035.00
		INTESA SANPAOLO 0.5%		800,000.00	807,488.00
		JOHNSON CONTROLS 1%		175,000.00	176,260.00
		LIB MUTUAL 1.75% REGS		114,000.00	117,755.16
		M STANLEY 1.875% GMTN		300,000.00	304,632.00
		MOTABILITY 0.875% EMTN		122,000.00	121,390.00
		NATIONWIDE 0.625% EMTN		300,000.00	289,881.00
		NATIONWIDE 0.75% EMTN		282,000.00	287,462.34
		NATL BK OF CANADA 0.5%		997,000.00	1,008,854.33
		NATL BK OF CANADA 1.5%		140,000.00	146,301.40
		NORTEGAS 2.065% EMTN		100,000.00	99,907.00

		PARKER-HANNIFI 1.125%		300,000.00	301,842.00
		RBC 0.875% REGS		700,000.00	718,410.00
		RCI BANQUE 0.625% EMTN		138,000.00	139,497.30
		SANTANDER UK 0.375% EMTN		619,000.00	625,579.97
		SCENTRE GROUP 1.5% EMTN		272,000.00	279,790.08
		SEB VAR 26 S.289		355,000.00	375,653.90
		SKY 2.25% GMTN		100,000.00	107,129.00
		TOTAL 0.75% EMTN		100,000.00	95,516.00
		TOTAL 1.375% EMTN		100,000.00	100,828.00
		VOLKSWAGEN 2.625%		60,000.00	65,195.40
		WESTPAC 0.625% EMTN		984,000.00	1,000,029.36
	計	銘柄数 :	44	12,223,354.60	12,514,050.08
					(1,647,975,255)
		組入時価比率 :	14.7%		15.7%
	英債券	CENTRICA 4.375% EMTN		100,000.00	113,365.00
		ENEL 5.75% EMTN		100,000.00	133,707.00
		EVERSHOLT 6.359% EMTN		100,000.00	124,502.00
		GATWICK ARPT 5.25% EMTN		200,000.00	230,312.00
		HEATHROW 6.75% EMTN		215,000.00	282,677.70
		LLOYDS BK 9.625%		200,000.00	264,430.00
		LONDON & QUADRANT 3.125%		140,000.00	136,504.20
		NAB 1.125% EMTN		500,000.00	494,605.00
		PRUDENTIAL VAR 39 EMTN		200,000.00	223,266.00
		ST GOBAIN 5.625% 24 EMTN		150,000.00	179,866.50
		SWEDBANK AB FLT 18 EMTN		434,000.00	434,043.40
		WSTRN PWR 3.875% EMTN		100,000.00	109,341.00
	計	銘柄数 :	12	2,439,000.00	2,726,619.80
					(404,166,852)
		組入時価比率 :	3.6%		3.8%
	スウェーデンクローネ	STADSHYPOTEK 1.5% 1587		2,000,000.00	2,061,380.00
	計	銘柄数 :	1	2,000,000.00	2,061,380.00
					(26,777,326)
		組入時価比率 :	0.2%		0.3%
	小計				4,131,241,387
					(4,131,241,387)
	合計				10,515,557,968
					(10,515,557,968)

(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。

「G I M新興国現地通貨ソブリン・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	(平成29年 9 月11日現在)	(平成30年 3 月12日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		296,348,183	242,696,969
コール・ローン		4,329,526	3,183,696
国債証券		8,661,705,355	10,989,182,553
派生商品評価勘定		44,867,209	45,354,959
未収入金		110,863,749	144,110,490
未収利息		81,748,574	117,636,853
前払費用		25,774,643	32,017,209
差入委託証拠金		12,994,180	5,278,025
流動資産合計		9,238,631,419	11,579,460,754
資産合計		9,238,631,419	11,579,460,754
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		54,825,004	45,435,145
未払金		239,869,732	194,893,594
未払解約金		34,640,481	12,190,383
未払利息		11	9
流動負債合計		329,335,228	252,519,131
負債合計		329,335,228	252,519,131
純資産の部			
元本等			
元本	1	5,755,202,927	7,330,844,314
剰余金			
剰余金又は欠損金 ( )		3,154,093,264	3,996,097,309
元本等合計		8,909,296,191	11,326,941,623
純資産合計		8,909,296,191	11,326,941,623
負債純資産合計		9,238,631,419	11,579,460,754

## ( 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>国債証券および特殊債券 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>(1)デリバティブ取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)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29年 9月11日現在)	(平成30年 3月12日現在)
1期首元本額	5,109,172,314円	5,755,202,927円
期中追加設定元本額	2,166,522,207円	5,997,328,111円
期中解約元本額	1,520,491,594円	4,421,686,724円
元本の内訳（注）		
JPMグローバル債券3分散ファンド （毎月決算型）	601,910,320円	540,561,027円
GIM新興国現地通貨ソブリン・ファン ドF（適格機関投資家専用）	3,085,742,375円	2,714,067,644円
JPM新興国毎月決算ファンド	2,067,550,232円	4,076,215,643円
合 計	5,755,202,927円	7,330,844,314円
受益権の総数	5,755,202,927口	7,330,844,314口
1口当たりの純資産額	1.5480円	1.5451円
（1万口当たりの純資産額）	（15,480円）	（15,451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、特殊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、債券関連では債券先物取引、通貨関連では為替予約取引、金利関連では金利先物取引であります。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、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、債券関連では将来の債券の価格変動リスクを回避し、通貨関連では信託財産の効率的な運用に資する目的、金利関連では金利変動リスクを回避し、効率的な運用に資することを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
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。 (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	(平成29年9月11日現在)	(平成30年3月12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	203,023,267	11,563,792
合計	203,023,267	11,563,792

## (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

## (債券関連)

区分	種類	(平成29年9月11日現在)				(平成30年3月12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	債券先物取引 売建	315,318,955	-	318,000,300	2,681,345	-	-	-	-
合計		315,318,955	-	318,000,300	2,681,345	-	-	-	-

## (注) 1. 先物取引の時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

- 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 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。

## （通貨関連）

区分	種類	（平成29年9月11日現在）				（平成30年3月12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	1,291,969,127	-	1,254,077,861	37,891,266	1,507,884,965	-	1,480,453,634	27,431,331
	メキシコペソ	231,242,762	-	228,158,864	3,083,898	22,985,125	-	22,964,846	20,279
	トルコリラ	90,151,656	-	89,760,352	391,304	24,492,471	-	24,546,640	54,169
	チェココルナ	241,497,295	-	239,848,603	1,648,692	557,372,630	-	554,154,807	3,217,823
	ハンガリーフォリント	43,571,473	-	43,306,752	264,721	-	-	-	-
	ポーランドズロチ	369,050,479	-	367,377,297	1,673,182	487,950,436	-	485,792,062	2,158,374
	ロシアルーブル	-	-	-	-	39,314,118	-	39,654,292	340,174
	タイバーツ	178,462,284	-	174,990,305	3,471,979	240,236,460	-	239,132,019	1,104,441
	南アフリカランド	15,440,735	-	15,162,611	278,124	117,659,374	-	115,894,847	1,764,527
	売建								
	アメリカドル	1,040,587,067	-	1,023,290,297	17,296,770	1,529,010,614	-	1,518,477,368	10,533,246
	メキシコペソ	443,470,460	-	433,588,038	9,882,422	50,662,888	-	50,157,081	505,807
	トルコリラ	344,736,654	-	338,605,609	6,131,045	425,707,499	-	411,868,144	13,839,355
	チェココルナ	-	-	-	-	62,658,508	-	62,215,264	443,244
	ハンガリーフォリント	132,344,003	-	131,269,864	1,074,139	345,972,080	-	350,144,161	4,172,081
	ポーランドズロチ	177,534,840	-	176,611,082	923,758	-	-	-	-
	タイバーツ	124,696,947	-	122,443,388	2,253,559	99,153,879	-	99,219,588	65,709
南アフリカランド	246,721,063	-	239,738,391	6,982,672	523,730,111	-	511,228,062	12,502,049	
合計		4,971,476,845	-	4,878,229,314	4,158,801	6,034,791,158	-	5,965,902,815	1,716,521

## （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。

## （金利関連）

区分	種類	（平成29年9月11日現在）				（平成30年3月12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	金利先物取引								
	買建	-	-	-	-	1,775,696,198	-	1,772,332,620	3,363,578
	売建	663,890,013	663,890,013	667,007,662	3,117,649	1,770,696,285	1,770,696,285	1,765,696,372	4,999,913
合計		663,890,013	663,890,013	667,007,662	3,117,649	3,546,392,483	1,770,696,285	3,538,028,992	1,636,335

（注）1．先物取引の時価の算定方法

金利先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

- 2．金利先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 4．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30年3月12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	アルゼンチンペソ	ARGENTINE GOVT15.5%OCT26		4,300,000.00	4,510,614.00	
		ARGENTINE GOVT18.2%OCT21		5,443,586.00	5,844,887.15	
	計	銘柄数：	2	9,743,586.00	10,355,501.15	
					(54,677,046)	
		組入時価比率：	0.5%		0.5%	
	メキシコペソ	MEXICO GOVT 10% DEC24		26,836,600.00	30,451,221.65	
		MEXICO GOVT 10% NOV36		16,607,300.00	20,153,954.98	
		MEXICO GOVT 5% DEC19		6,000,000.00	5,753,400.00	
		MEXICO GOVT 6.5% JUN22		63,980,000.00	61,791,884.00	
		MEXICO GOVT 7.5% JUN27		7,400,000.00	7,373,804.00	
		MEXICO GOVT 7.75% MAY31		31,800,000.00	31,903,350.00	
		MEXICO GOVT 8.5% MAY29		15,710,000.00	16,738,219.50	
		MEXICO GOVT 8.5% NOV38		13,600,000.00	14,529,016.00	
		MEXICO GOVT 8% DEC23		7,000,000.00	7,178,430.00	
		MEXICO I/L 4% NOV40		530,000.00	3,264,431.22	
		計	銘柄数：	10	189,463,900.00	199,137,711.35
					(1,143,050,463)	
		組入時価比率：	10.1%		10.5%	
	ブラジルリアル	BRAZIL 10% JAN21 NTFN		24,870,000.00	26,426,613.30	
		BRAZIL 10% JAN23 NTFN		15,808,000.00	16,697,848.12	
		BRAZIL 10% JAN25 NTFN		4,610,000.00	4,828,514.00	
		BRAZIL 10% JAN27 NTFN		10,035,000.00	10,468,762.87	
		BRAZIL I/L 6% AUG22 NTFN		4,080,000.00	13,358,209.68	
		BRAZIL I/L 6% AUG26 NTFN		760,000.00	2,535,648.80	
		BRAZIL I/L 6% AUG50 NTFN		870,000.00	3,048,720.99	
計	銘柄数：	7	61,033,000.00	77,364,317.76		
					(2,541,417,838)	
		組入時価比率：	22.4%		23.2%	
	チリペソ	CHILE GOVT 4.5% FEB21		340,000,000.00	348,700,600.00	
		CHILE GOVT 4.5% MAR26		790,000,000.00	791,192,900.00	

	計	銘柄数:	2	1,130,000,000.00	1,139,893,500.00
					(202,217,106)
		組入時価比率:	1.8%		1.8%
	コロンビアペソ	COLOMBIA 6% APR28 GDN		150,000,000.00	138,979,500.00
		COLOMBIA GOVT 9.85%JUN27		1,292,000,000.00	1,603,811,280.00
		COLOMBIA GOVT4.375%MAR23		475,000,000.00	444,467,000.00
		COLOMBIA GOVT7.75% APR21		520,000,000.00	547,196,000.00
		COLOMBIA TES 10% JUL24		2,191,300,000.00	2,604,447,702.00
		COLOMBIA TES 5% NOV18		3,930,000,000.00	3,943,479,900.00
		COLOMBIA TES 6% APR28		5,680,000,000.00	5,310,743,200.00
	計	銘柄数:	7	14,238,300,000.00	14,593,124,582.00
					(544,323,546)
		組入時価比率:	4.8%		5.0%
	ペルーヌエボソル	PERU GOVT 6.15% AUG32		570,000.00	624,275.40
		PERU GOVT 6.9% AUG37 GDN		800,000.00	927,184.00
		PERU GOVT6.95% AUG31 GDN		3,355,000.00	3,937,394.45
	計	銘柄数:	3	4,725,000.00	5,488,853.85
					(180,089,294)
		組入時価比率:	1.6%		1.6%
	ウルグアイペソ	URUGUAY9.875% JUN22 REGS		9,310,000.00	9,453,374.00
	計	銘柄数:	1	9,310,000.00	9,453,374.00
					(35,639,219)
		組入時価比率:	0.3%		0.3%
	ドミニカペソ	DOMINICA 8.9% FEB23 REGS		31,000,000.00	31,769,730.00
	計	銘柄数:	1	31,000,000.00	31,769,730.00
					(68,304,919)
		組入時価比率:	0.6%		0.6%
	ディナール	SERBIA 5.875% FEB28 10Y		40,000,000.00	41,642,800.00
	計	銘柄数:	1	40,000,000.00	41,642,800.00
					(46,515,007)
		組入時価比率:	0.4%		0.4%
	トルコリラ	TURKEY GOVT 10.5% JAN20		9,250,000.00	8,863,627.50
		TURKEY GOVT 10.7% AUG17		2,655,273.00	2,477,635.23
		TURKEY GOVT 10.7% FEB21		3,400,000.00	3,209,906.00
		TURKEY GOVT 11% FEB27		800,000.00	753,264.00
		TURKEY GOVT 11% MAR22		4,700,000.00	4,454,519.00
		TURKEY GOVT 7.1% MAR23		7,600,000.00	6,129,019.98
		TURKEY GOVT 8.5% SEP22		121,507.00	104,809.50
		TURKEY GOVT 8.8% SEP23		1,530,000.00	1,320,145.20
		TURKEY GOVT 8% MAR25		82,194.00	66,569.74
		TURKEY GOVT 9.2% SEP21		4,164,426.00	3,736,572.87
		TURKEY I/L 3% FEB22		940,200.00	1,529,793.87
	計	銘柄数:	11	35,243,600.00	32,645,862.89
					(917,022,288)
		組入時価比率:	8.1%		8.3%
	ハンガリーフォリント	HUNGARY 1.75% OCT22 22/B		97,000,000.00	98,069,910.00
		HUNGARY 1% SEP20 20/C		216,630,000.00	218,791,967.40
		HUNGARY 2.75% DEC26 26/D		34,100,000.00	34,642,531.00
		HUNGARY 3.5% JUN20 20/B		193,650,000.00	207,724,482.00
		HUNGARY 3% JUN24 24/B		116,900,000.00	124,087,012.00
		HUNGARY 3% OCT27 27/A		234,000,000.00	239,494,320.00
		HUNGARY 5.5% JUN25 25/B		45,430,000.00	55,356,000.70
		HUNGARY 6% NOV23 23/A		70,000,000.00	85,865,500.00
		HUNGARY 7% JUN22 22/A		503,150,000.00	621,168,864.00
	計	銘柄数:	9	1,510,860,000.00	1,685,200,587.10
					(711,997,248)
		組入時価比率:	6.3%		6.5%
	ポーランドズロチ	POLAND 2.5% JUL26 0726		11,247,000.00	10,730,537.76

	POLAND GOVT 4% OCT23		5,900,000.00	6,308,457.00
計	銘柄数:	2	17,147,000.00	17,038,994.76
				(535,024,435)
	組入時価比率:	4.7%		4.9%
ロシアルーブル	RUSSIA 7.05% JAN28 6212		70,100,000.00	70,763,146.00
	RUSSIA 7.7% MAR33 6221		27,630,000.00	28,975,719.15
	RUSSIA 7.75% SEP26 6219		95,358,000.00	100,855,388.70
	RUSSIA 8.15% FEB27 6207		156,400,000.00	169,671,791.20
計	銘柄数:	4	349,488,000.00	370,266,045.05
				(696,100,164)
	組入時価比率:	6.1%		6.3%
ルーマニアレイ	ROMANIA GOVT 3.25% APR24		2,265,000.00	2,123,029.80
	ROMANIA GOVT 5.8% JUL27		840,000.00	912,156.00
計	銘柄数:	2	3,105,000.00	3,035,185.80
				(85,986,813)
	組入時価比率:	0.8%		0.8%
マレーシアリングgit	MALAYSIA 3.48% MAR23		402,000.00	396,504.66
	MALAYSIA 3.492% MAR20		1,900,000.00	1,903,553.00
	MALAYSIA 3.8% AUG23		2,500,000.00	2,500,325.00
	MALAYSIA 3.844% APR33		100,000.00	93,597.00
	MALAYSIA 3.882% MAR22		2,353,000.00	2,377,777.09
	MALAYSIA 4.048% SEP21		62,000.00	63,001.92
	MALAYSIA 4.059% SEP24		4,100,000.00	4,140,508.00
	MALAYSIA 4.07% SEP26		869,000.00	856,243.08
	MALAYSIA 4.16% JUL21		633,000.00	647,172.87
	MALAYSIA 4.232% JUN31		2,872,000.00	2,811,199.76
	MALAYSIA 4.786% OCT35		400,000.00	400,456.00
計	銘柄数:	11	16,191,000.00	16,190,338.38
				(443,777,174)
	組入時価比率:	3.9%		4.0%
タイパーツ	THAI GOVT 3.58% DEC27		834,000.00	899,610.78
	THAI GOVT 4.875% JUN29		579,000.00	701,012.67
計	銘柄数:	2	1,413,000.00	1,600,623.45
				(5,458,125)
	組入時価比率:	0.0%		0.0%
フィリピンペソ	PHIL GOVT 8% JUL31 2017		5,600,000.00	6,515,768.00
	PHIL GOVT4.625%DEC22R511		27,500,000.00	26,537,500.00
計	銘柄数:	2	33,100,000.00	33,053,268.00
				(67,759,199)
	組入時価比率:	0.6%		0.6%
インドネシアルピア	INDON 10.5% AUG30 FR52		1,370,000,000.00	1,726,967,200.00
	INDON 7.5% MAY38 FR75		4,087,000,000.00	4,106,208,900.00
	INDON 7% MAY27 FR59		16,046,000,000.00	16,057,392,660.00
	INDON 8.25% MAY36 FR72		33,238,000,000.00	35,786,689,840.00
	INDON 8.375% MAR34 FR68		4,241,000,000.00	4,579,177,340.00
	INDON 8.75% MAY31 FR73		19,916,000,000.00	22,275,249,360.00
	INDON 9% MAR29 FR71		46,542,000,000.00	52,783,282,200.00
計	銘柄数:	7	125,440,000,000.00	137,314,967,500.00
				(1,071,056,746)
	組入時価比率:	9.5%		9.7%
エジプトポンド	EGYPT T-BILL0%AUG18 364D		13,200,000.00	12,172,313.23
	EGYPT T-BILL0%JUL18 364D		6,250,000.00	5,742,756.96
	EGYPT T-BILL0%JUN18 364D		4,000,000.00	3,733,068.15
	EGYPT T-BILL0%MAY18 364D		3,850,000.00	3,610,110.45
	EGYPT T-BILL0%SEP18 364D		7,000,000.00	6,317,774.16
計	銘柄数:	5	34,300,000.00	31,576,022.95
				(191,666,459)
	組入時価比率:	1.7%		1.7%

	南アフリカランド	S.AFRICA 7% FEB31 R213		16,210,000.00	14,211,307.00	
		S.AFRICA 8.5% JAN37 2037		8,445,658.00	8,073,542.30	
		S.AFRICA 8% JAN30 2030		6,005,571.00	5,781,503.14	
		S.AFRICA 9% JAN40 2040		5,595,390.00	5,566,293.95	
		S.AFRICA10.5% DEC26 R186		39,456,829.00	45,402,973.13	
		S.AFRICA6.25% MAR36 R209		8,441,256.00	6,447,684.57	
		S.AFRICA7.25% JAN20 R207		12,003,000.00	12,122,309.82	
		S.AFRICA8.25% MAR32 2032		16,400,872.00	15,800,436.07	
		S.AFRICA8.75% FEB48 2048		16,415,031.00	15,874,976.48	
		S.AFRICA8.75% JAN44 2044		3,805,030.00	3,671,853.95	
		S.AFRICA8.875%FEB35 2035		19,086,398.00	19,043,262.74	
	計	銘柄数 :	11	151,865,035.00	151,996,143.15	
					(1,375,565,095)	
		組入時価比率 :	12.1%		12.6%	
	ナイジェリアナイラ	NIGERIA T-BILL 0% JUN18		252,000,000.00	240,856,461.76	
	計	銘柄数 :	1	252,000,000.00	240,856,461.76	
					(71,534,369)	
		組入時価比率 :	0.6%		0.7%	
	小計				10,989,182,553	
					(10,989,182,553)	
	合計				10,989,182,553	
					(10,989,182,553)	

(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。

[次へ](#)

「G I M米国高利回り社債マザーファンド（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	(平成29年 9月11日現在)	(平成30年 3月12日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		23,280,156	19,839,736
コール・ローン		1,408,005	5,639,407
株式		556,368	330,271
特殊債券		1,100,188	1,033,730
社債券		927,343,714	896,018,626
未収入金		5,527,383	1,632,144
未収利息		15,376,130	14,378,965
前払費用		951,491	654,407
流動資産合計		975,543,435	939,527,286
資産合計		975,543,435	939,527,286
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		53,143	-
未払金		7,460,536	13,823,095
未払解約金		2,023,755	236,073
未払利息		3	16
流動負債合計		9,537,437	14,059,184
負債合計		9,537,437	14,059,184
純資産の部			
元本等			
元本	1	472,685,199	455,133,294
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		493,320,799	470,334,808
元本等合計		966,005,998	925,468,102
純資産合計		966,005,998	925,468,102
負債純資産合計		975,543,435	939,527,286

(注) 「G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）」の計算期間は、毎年1月9日から7月8日および7月9日から翌年1月8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
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>特殊債券および社債券 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。</p> <p>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。</p> <p>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29年9月11日現在)	(平成30年3月12日現在)
1期首元本額	511,189,092円	472,685,199円
期中追加設定元本額	5,567,997円	23,152,758円
期中解約元本額	44,071,890円	40,704,663円
元本の内訳（注）		
JPM米国高利回り社債ファンド	52,625,595円	47,278,585円
JPMグローバル債券3分散ファンド （毎月決算型）	420,059,604円	407,854,709円
合 計	472,685,199円	455,133,294円
受益権の総数	472,685,199口	455,133,294口
1口当たりの純資産額	2.0437円	2.0334円
（1万口当たりの純資産額）	(20,437円)	(20,334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、株式、新株予約権証券、特殊債券、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・監督を行っております。 (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。 (2)デリバティブ取引 平成29年9月11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。 平成30年3月12日現在、該当事項はありません。 (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	(平成29年9月11日現在)	(平成30年3月12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	12,838	211,374
特殊債券	15,789	20,422
社債券	3,564,713	21,676,405
合計	3,593,340	21,485,453

(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)

## 取引の時価等に関する事項

## (通貨関連)

区分	種類	(平成29年9月11日現在)				(平成30年3月12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	7,000,000	-	7,053,143	53,143	-	-	-	-
合計		7,000,000	-	7,053,143	53,143	-	-	-	-

## (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30年3月12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	QUAD GRAPHICS INC	26	26.63	692.38	
	NII HOLDINGS INC	1,401	1.71	2,395.71	
小計	銘柄数：	2		3,088.09	
				(330,271)	
	組入時価比率：	0.0%		100.0%	
合計				330,271	
				(330,271)	

(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。

## (口) 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
特殊債券	アメリカドル	DAE FUNDING 4.5% REGS		5,000.00	4,830.20	
		DAE FUNDING 5% REGS		5,000.00	4,835.35	
	計	銘柄数：	2	10,000.00	9,665.55	
					(1,033,730)	
		組入時価比率：	0.1%		0.1%	
	小計				1,033,730	
					(1,033,730)	
社債券	アメリカドル	1011778 BC 4.25% REGS		23,000.00	22,035.15	
		ACADIA HLTH 5.125%		15,000.00	15,131.25	
		ACADIA HLTH 5.625%		7,000.00	7,181.02	
		ACADIA HLTH 6.125%		19,000.00	19,026.79	
		ACADIA HLTH 6.5%		5,000.00	5,179.05	
		ACCO BRANDS 5.25% REGS		5,000.00	5,038.80	
		ACE CASH EXP 12% REGS		16,000.00	17,614.24	
		ACTIVISION 6.125% REGS		5,000.00	5,214.95	
		ADT CORP 4.125% 23		31,000.00	29,707.92	
		AECOM 5.125%		32,000.00	30,855.04	
		AECOM 5.875%		8,000.00	8,355.12	
		AES CORP 5.5% 24		32,000.00	33,608.64	
		AHERN RENTALS7.375% REGS		25,000.00	24,303.00	
		AIRCASTLE 6.25%		20,000.00	20,786.60	
		AK STEEL 7.5%		6,000.00	6,391.38	
		AK STEEL 7%		9,000.00	9,048.69	
		ALBERTSONS 5.75%		20,000.00	17,423.40	
		ALBERTSONS 6.625%		60,000.00	54,813.60	
		ALERIS 9.5% REGS		10,000.00	10,481.80	
		ALLIANCE DATA5.375% REGS		20,000.00	20,026.40	
		ALLIANCE DATA5.875% REGS		5,000.00	5,130.20	
		ALLISON 4.75% REGS		17,000.00	16,402.28	
		ALLY FINANCIAL 5.75%		28,000.00	29,193.08	
		ALLY FINANCIAL 8% 31		12,000.00	14,881.56	
		AMC ENTERTAINMENT 5.75%		7,000.00	6,895.49	
		AMC ENTERTAINMENT 6.125%		6,000.00	5,928.66	
		AMC NETWORKS 4.75%		3,000.00	2,882.46	
		AMC NETWORKS 5%		25,000.00	24,854.75	
		AMD 7%		11,000.00	11,538.34	
		AMERICAN AXLE 6.25%		23,000.00	23,408.02	
		AMERICAN AXLE 6.5%		28,000.00	28,522.48	
		AMERICAN AXLE 6.625%		2,000.00	2,061.62	
		AMERICAN WOOD4.875% REGS		15,000.00	14,797.05	
		AMERIGAS 5.625%		15,000.00	14,922.15	
		AMERIGAS 5.75%		6,000.00	5,870.58	
		AMERIGAS 5.875%		5,000.00	4,957.35	
		AMR GREETINGS7.875% REGS		3,000.00	3,058.65	
		ANTERO RESCS 5.125%		59,000.00	59,958.75	
		ANTERO RESCS 5.375%		31,000.00	31,700.91	
ANTERO RESCS 5%		6,000.00	6,066.06			
ARAMARK 5% REGS		11,000.00	10,810.14			
ARCELORMITTAL 6.125%		13,000.00	14,149.72			
ARCELORMITTAL MLT 21		2,000.00	2,095.18			
ARCELORMITTAL MLT 22		14,000.00	15,138.34			
ARCELORMITTAL MLT 39		7,000.00	8,450.26			

	ARCELORMITTAL MLT 41		4,000.00	4,768.88
	ARCH MERGER 8.5% REGS		49,000.00	46,535.79
	ARCONIC 5.125%		19,000.00	19,433.39
	ARCONIC 5.9%		7,000.00	7,484.26
	ARCONIC 6.15%		2,000.00	2,110.06
	ARCONIC 6.75%		3,000.00	3,386.85
	AUTOMATION 6.5% REGS		16,000.00	16,775.68
	AVIS BUDGET 5.25% REGS		5,000.00	4,824.20
	AVOLON HLDGS 5.5% REGS		11,000.00	11,000.00
	BALL CORP 4.875%		3,000.00	3,003.03
	BALL CORP 5.25%		12,000.00	12,445.08
	BELDEN INC 5.25% REGS		7,000.00	7,405.02
	BERRY GLOBAL 4.5% REGS		8,000.00	7,637.28
	BERRY PLSTCS 5.125%		10,000.00	10,164.80
	BERRY PLSTCS 5.5%		20,000.00	20,572.60
	BLUE CUBE 10%		27,000.00	31,494.15
	BLUE CUBE 9.75%		6,000.00	6,829.98
	BLUE RACER 6.125% REGS		5,000.00	5,108.30
	BOMBARDIER 7.5% 24 REGS		10,000.00	10,414.30
	BOMBARDIER 7.5% 25 REGS		22,000.00	22,662.42
	BOMBARDIER 8.75% REGS		20,000.00	21,960.20
	BOOZ ALLEN 5.125% REGS		4,000.00	3,969.12
	BOYD GAMING 6.375%		10,000.00	10,542.40
	BOYD GAMING 6.875%		12,000.00	12,660.00
	BRISTOW GROUP 6.25%		6,000.00	4,974.18
	BRISTOW GROUP 8.75% REGS		7,000.00	7,090.02
	BUCKEYE PARTNERS FLT		5,000.00	4,987.85
	CABLEVISION 5.875%		5,000.00	4,979.35
	CABLEVISION 8%		19,000.00	20,067.42
	CALERES 6.25%		10,000.00	10,433.40
	CALIF RESCS 8% REGS		21,000.00	16,710.96
	CALPINE 5.375%		16,000.00	15,511.04
	CALPINE 5.5%		20,000.00	18,658.60
	CALPINE 5.75%		16,000.00	14,911.84
	CALPINE 8.5% ESCROW		200,000.00	-
	CAMELOT FIN 7.875% REGS		18,000.00	18,945.00
	CARRIZO OIL&GAS 6.25%		31,000.00	30,761.30
	CASCADES INC 5.5% REGS		5,000.00	5,065.90
	CB ESCROW 8% REGS		7,000.00	6,773.13
	CBS OUTDOOR 5.625%		20,000.00	20,153.40
	CCM MERGER 6% REGS		7,000.00	7,072.73
	CCO HLDGS 5% REGS V		15,000.00	14,076.00
	CCO HLDGS 5% REGS X		8,000.00	7,614.00
	CCO HOLDINGS 5.125%		12,000.00	12,087.12
	CCO HOLDINGS 5.5% REGS		20,000.00	19,905.80
	CCO HOLDINGS 5.75%		20,000.00	20,319.40
	CCO HOLDINGS 5.75% E		20,000.00	20,313.80
	CCO HOLDINGS 5.75% REGS		40,000.00	40,426.40
	CCO HOLDINGS5.125%REGS R		5,000.00	4,813.80
	CCO HOLDINGS5.125%REGS T		5,000.00	4,813.80
	CDW 5.5%		10,000.00	10,396.00
	CDW 5%		5,000.00	5,084.75
	CEDAR FAIR 5.375%		5,000.00	5,107.35
	CEDAR FAIR 5.375% REGS		5,000.00	4,970.15
	CENTENE CORP 4.75%		5,000.00	5,080.55
	CENTENE CORP 5.625%		15,000.00	15,373.50

	CENTENE CORP 6.125%		21,000.00	21,970.83
	CENTRAL GARDEN 6.125%		10,000.00	10,422.60
	CENTURYLINK 5.8% T		5,000.00	4,934.40
	CENTURYLINK 6.45% S		5,000.00	5,120.85
	CENTURYLINK 6.75% W		3,000.00	2,958.72
	CENTURYLINK 7.5% Y		2,000.00	2,013.84
	CF INDUSTRIES 5.15%		16,000.00	15,538.08
	CHARTER COMM 4.464%		16,000.00	16,311.52
	CHARTER COMM 4.908%		6,000.00	6,126.12
	CHEMOURS 7%		15,000.00	16,149.30
	CHENIERE 5.875%		20,000.00	21,097.60
	CHENIERE ENERGY5.25%REGS		4,000.00	4,007.16
	CHESAPEAKE NRG 5.75%		2,000.00	1,802.06
	CHESAPEAKE NRG8% 25 REGS		12,000.00	11,715.48
	CHESAPEAKE NRG8% REGS 27		10,000.00	9,595.10
	CHUKCHANSI 9.75% REGS		20,875.04	13,151.48
	CINCINNATI BELL 7% REGS		20,000.00	18,600.60
	CINEMARK 4.875%		10,000.00	9,902.10
	CIT GROUP 5.25%		6,000.00	6,119.28
	CIT GROUP 5% 22		40,000.00	41,071.60
	CIT GROUP 6.125%		4,000.00	4,130.48
	CITGO 6.25% REGS		9,000.00	8,999.82
	CLAIRE'S 9% REGS E		30,000.00	20,482.80
	CLEAR CHNL 6.5% L		15,000.00	15,232.50
	CLEAR CHNL 6.5% M		25,000.00	25,486.00
	CLEAR CHNL 7.625% A		10,000.00	9,886.00
	CLEAR CHNL 7.625% H		19,000.00	18,799.55
	CLW PAPER 4.5%		15,000.00	14,420.85
	CMTY HLTH SYS 5.125% 21		18,000.00	16,415.82
	CMTY HLTH SYS 6.25%		12,000.00	10,562.40
	CMTY HLTH SYS 6.875%		22,000.00	13,125.20
	CMTY HLTH SYS 7.125%		13,000.00	10,590.58
	CNG HOLDINGS 9.375% REGS		57,000.00	56,262.99
	CNX MIDSTREAM 6.5% REGS		3,000.00	3,033.75
	COMMERCIAL METALS 4.875%		5,000.00	5,065.60
	COMMERCIAL METALS 5.375%		4,000.00	4,012.60
	COMMSCOPE TECH 5% REGS		7,000.00	6,759.69
	COMMSCOPE TECH 6% REGS		11,000.00	11,377.41
	COMPRESSCO 7.25%		7,000.00	6,635.23
	CONRES 3.8%		4,000.00	3,848.52
	CONRES 4.375% REGS		10,000.00	9,716.20
	CONRES 4.5%		9,000.00	9,006.30
	CONRES 4.9%		22,000.00	21,285.00
	CONRES 5%		19,000.00	19,231.61
	CONSOL ENERGY 5.875%		8,000.00	8,028.16
	CORTES NP 9.25% REGS		45,000.00	47,482.65
	COTT 5.5% REGS		10,000.00	9,888.50
	COVANTA 5.875%		10,000.00	9,876.90
	COVANTA 5.875% 25		2,000.00	1,970.50
	CRESTWOOD 5.75%		9,000.00	9,054.45
	CROWN AMER/CAP 4.25%		8,000.00	7,467.04
	CROWN AMER/CAP4.75% REGS		8,000.00	7,762.32
	CSC HOLDINGS 5.25%		35,000.00	33,249.30
	CSC HOLDINGS 6.75%		5,000.00	5,257.35
	CSC HOLDINGS 8.625%		10,000.00	10,424.40
	CSI COMPRESSCO 7.5% REGS		5,000.00	5,028.85

	CSTN MERGER 6.75% REGS	5,000.00	5,037.15
	CUMBERLAND 6.75% REGS	4,000.00	4,203.28
	CURO FIN 12% REGS	5,000.00	5,540.35
	CVR PARTNERS 9.25% REGS	56,000.00	59,539.76
	CYRUSONE 5.375%	5,000.00	4,938.80
	CYRUSONE 5%	2,000.00	1,984.60
	DANA FIN 5.75% REGS	7,000.00	7,130.20
	DAVITA HEALTHCARE 5.125%	20,000.00	19,728.20
	DAVITA HEALTHCARE 5%	25,000.00	24,328.25
	DCP MIDSTREAM 3.875%	12,000.00	11,539.92
	DCP MIDSTREAM 4.95%	3,000.00	3,040.62
	DEAN FOODS 6.5% REGS	9,000.00	8,703.63
	DELEK LOGISTICS6.75%REGS	16,000.00	16,294.56
	DIAMOND 1 FIN5.875% REGS	35,000.00	35,631.75
	DIAMOND 1 FIN7.125% REGS	30,000.00	32,018.40
	DIAMOND OFFSHORE 7.875%	5,000.00	5,034.85
	DIAMONDBACK 4.75%	3,000.00	2,938.92
	DIEBOLD 8.5%	9,000.00	9,442.35
	DISH DBS 5.875% 22	7,000.00	6,712.51
	DISH DBS 5.875% 24	6,000.00	5,474.94
	DISH DBS 5% 23	18,000.00	16,267.68
	DISH DBS 6.75%	49,000.00	49,786.94
	DISH DBS 7.75%	20,000.00	19,526.20
	DOLE FOOD 7.25% REGS	12,000.00	12,540.84
	DOLLAR TREE 5.75%	7,000.00	7,306.18
	DOWNSTREAM DE10.5%REGS E	25,000.00	25,633.50
	DYNEGY 5.875%	48,000.00	49,072.80
	DYNEGY 7.625%	10,000.00	10,793.70
	DYNEGY 8.125% REGS	13,000.00	14,255.28
	DYNEGY 8% REGS	10,000.00	10,899.40
	ELDORADO RESORTS 6%	20,000.00	20,413.00
	EMC 2.65%	6,000.00	5,777.82
	EMI MUSIC 7.625% REGS	10,000.00	10,837.00
	ENDO 5.75% REGS	45,000.00	37,159.20
	ENERSYS 5% REGS	5,000.00	5,113.30
	ENSCO 4.5%	4,000.00	3,188.16
	ENSCO 5.2%	14,000.00	11,389.98
	ENSCO 7.75%	4,000.00	3,686.44
	ENVISION HLTH5.125% REGS	18,000.00	18,213.30
	EP NRG/EVRST 8% REGS C	12,000.00	12,275.88
	EP NRG/EVRST 8% REGS D	20,000.00	14,088.00
	EP NRG/EVRST 9.375% REGS	23,000.00	17,107.86
	EQUINIX INC 5.375% 22	8,000.00	8,263.20
	EQUINIX INC 5.375% 23	18,000.00	18,304.74
	EQUINIX INC 5.75%	6,000.00	6,213.90
	EQUINIX INC 5.875%	4,000.00	4,132.16
	ESH HOSPITALITY5.25%REGS	20,000.00	19,747.20
	EW SCRIPPS 5.125% REGS	3,000.00	2,874.45
	EXELA INTERMED 10% REGS	27,000.00	26,859.60
	FG LIFE 6.375% REGS	21,000.00	21,314.58
	FIRST DATA 5.375% REGS	15,000.00	15,285.45
	FIRST DATA 5.75% REGS	29,000.00	29,424.56
	FIRST DATA 5% A REGS	9,000.00	9,038.52
	FIRST DATA 5% C REGS	15,000.00	15,048.00
	FIRST DATA 7% REGS	30,000.00	31,494.60
	FLEX ACQUISITI6.875%REGS	3,000.00	3,004.14

		FMG RESCS 4.75% REGS		6,000.00	5,986.92	
		FMG RESCS 5.125% REGS		12,000.00	11,976.24	
		FREEMPORT-MC 3.55%		5,000.00	4,840.25	
		FREEMPORT-MC 3.875%		35,000.00	33,800.55	
		FREEMPORT-MC 4.55%		5,000.00	4,877.60	
		FREEMPORT-MC 4%		2,000.00	1,986.02	
		FREEMPORT-MC 5.4%		3,000.00	2,907.06	
		FREEMPORT-MC 5.45%		12,000.00	11,293.92	
		FRONTIER COMMS 10.5%		13,000.00	11,407.24	
		FRONTIER COMMS 11%		23,000.00	18,515.00	
		FRONTIER COMMS 6.25%		4,000.00	3,583.52	
		FRONTIER COMMS 8.5% REGS		5,000.00	4,937.50	
		FRONTIER COMMS 9.25%		18,000.00	17,567.10	
		G&L PROP 5.375%		20,000.00	20,825.80	
		G&L PROP 5.375% 26		5,000.00	5,148.50	
		GARTNER 5.125% REGS		9,000.00	9,204.39	
		GATES GLOBAL 6% REGS		4,000.00	4,076.16	
		GATEWAY 8.25% REGS		10,000.00	10,676.30	
		GENESIS NRG 5.625%		14,000.00	13,337.10	
		GENESIS NRG 6.75%		5,000.00	5,129.25	
		GENESYS 10% REGS		16,000.00	17,761.28	
		GENON ENERGY 9.5%		10,000.00	8,298.90	
		GENON ENERGY 9.875%		45,000.00	37,226.25	
		GLOBAL PRN LP 6.25%		12,000.00	12,030.96	
		GM 6.75% ESCROW		25,000.00	-	
		GM 8.1% ESCROW		200,000.00	-	
		GM 8.375% ESCROW		265,000.00	-	
		GM MLT ESCROW		35,000.00	-	
		GOLDEN NUGGET 6.75% REGS		22,000.00	22,421.74	
		GOODYEAR TIRE 4.875%		26,000.00	25,317.50	
		GOODYEAR TIRE 5.125%		10,000.00	10,105.10	
		GOODYEAR TIRE 5%		10,000.00	9,840.00	
		GRAY TV 5.125% REGS		10,000.00	9,837.50	
		GRAY TV 5.875% REGS		5,000.00	4,945.75	
		GULFPORT ENERG6.375%REGS		9,000.00	8,781.66	
		GULFPORT ENERGY 6%		22,000.00	21,513.14	
		GW HONOS 8.75% REGS		65,000.00	68,938.35	
		H&E EQUIP 5.625% REGS D		7,000.00	7,134.33	
		H&E EQUIP 5.625% REGS E		3,000.00	3,052.11	
		HANESBRANDS 4.625% REGS		5,000.00	4,958.35	
		HANESBRANDS 4.875% REGS		5,000.00	4,886.10	
		HCA HEALTHCARE 6.25%		30,000.00	31,541.40	
		HCA INC 4.25%		15,000.00	15,166.95	
		HCA INC 5.375%		33,000.00	33,241.56	
		HCA INC 5.5%		15,000.00	14,627.55	
		HCA INC 5.875% 26		15,000.00	15,381.30	
		HCA INC 5%		8,000.00	8,124.16	
		HCA INC 7.5%		35,000.00	38,611.65	
		HECLA MINING 6.875%		14,000.00	14,216.72	
		HERTZ 5.5% REGS		5,000.00	4,340.70	
		HERTZ 7.375%		5,000.00	4,996.65	
		HEXION 6.625%		29,000.00	27,429.65	
		HILCORP NRG 5% REGS		43,000.00	43,012.90	
		HILL-ROM 5.75% REGS		10,000.00	10,406.70	
		HILTON 4.625%		7,000.00	6,977.67	
		HILTON 4.875%		4,000.00	3,973.72	

	HILTON DOMESTIC 4.25%		10,000.00	9,793.20
	HILTON GRAND 6.125%		4,000.00	4,310.36
	HOLLY ENERGY 6% REGS		9,000.00	9,292.23
	HUBBAY MINERALS7.25%REGS		10,000.00	10,625.00
	HUGHES SAT 5.25%		17,000.00	16,665.27
	HUGHES SAT 6.625%		11,000.00	11,229.46
	ICAHN ENTERPRI 6.375% WI		30,000.00	30,355.80
	ICAHN ENTERPRI 6.25% WI		14,000.00	14,190.54
	ICAHN ENTERPRI 6.75% WI		4,000.00	4,097.16
	IHS MARKIT 4% REGS		6,000.00	5,773.62
	IHS MARKIT 5% REGS		10,000.00	10,368.50
	ILFC E-CAP VAR 65 REGS N		100,000.00	98,765.00
	INCEPTION 8.625% REGS		2,000.00	2,060.44
	INFOR 5.75% REGS		15,000.00	15,336.15
	INFOR 6.5%		21,000.00	21,358.47
	INGEVITY 4.5% REGS		7,000.00	6,783.91
	INTELSAT 5.5%		39,000.00	32,142.63
	INTELSAT 7.25% 20		10,000.00	9,358.60
	INTELSAT 7.5%		30,000.00	27,720.00
	INTELSAT 8% REGS		18,000.00	18,875.70
	IRB HLDG 6.75 REGS		5,000.00	4,959.90
	IRON MOUNTAIN 5.25% REGS		9,000.00	8,460.00
	IRON MOUNTAIN 5.75%		22,000.00	21,732.26
	IRON MOUNTAIN4.875% REGS		8,000.00	7,440.88
	ITRON 5% REGS		3,000.00	2,991.18
	ITRON 5% REGS F		5,000.00	4,940.40
	J2 CLOUD LLC 6% REGS		4,000.00	4,147.96
	JBS USA 5.75% REGS		47,000.00	44,783.01
	JBS USA 6.75% REGS		16,000.00	15,741.92
	JBS USA 7.25% REGS C		36,000.00	36,424.08
	JC PENNEY 8.625% REGS		2,000.00	2,005.04
	JELD-WEN 4.625% REGS		5,000.00	4,773.25
	JELD-WEN 4.875% REGS		3,000.00	2,839.17
	KAISER ALUM 5.875%		4,000.00	4,166.12
	KENNEDY WILSON5.875%REGS		7,000.00	6,977.81
	KFC HLD 4.75% REGS		23,000.00	22,191.78
	L BRANDS 5.25%		10,000.00	9,490.00
	L BRANDS 6.75%		10,000.00	9,731.00
	LADDER CAP 5.25% REGS		7,000.00	6,989.08
	LADDER CAP 5.25% REGS D		4,000.00	3,839.00
	LAMAR MEDIA 5.375%		2,000.00	2,053.32
	LAMAR MEDIA 5.75%		8,000.00	8,317.44
	LENNAR 4.5%		10,000.00	9,802.80
	LENNAR 4.75% REGS		25,000.00	24,009.75
	LENNAR 5.25% REGS		5,000.00	5,021.50
	LENNAR 5.875% REGS		15,000.00	15,627.75
	LEVEL 3 5.125%		4,000.00	3,976.44
	LEVEL 3 5.25%		5,000.00	4,766.80
	LEVEL 3 5.375%		16,000.00	15,760.00
	LEVEL 3 5.375% 24		97,000.00	95,642.00
	LEVEL 3 5.625%		17,000.00	17,037.57
	LEVI STRAUSS 5%		10,000.00	10,162.00
	LIB MED IT 4% EB		12,000.00	8,400.00
	LIBERTY INTERACTI3.75%EB		8,000.00	5,520.00
	LIFEPOINT 5.375%		5,000.00	4,843.90
	LIN TELEVISION 5.875%		10,000.00	10,300.80

	LIVE NATION 4.875% REGS	5,000.00	4,953.55
	LIVE NATION 5.375% REGS	10,000.00	10,274.90
	LPL HLDGS 5.75% REGS	8,000.00	8,047.76
	LPL HLDGS 5.75% REGS C	5,000.00	4,987.50
	LUNDIN MINING7.875% REGS	10,000.00	10,594.80
	MALLINCKRODT 5.5% REGS	10,000.00	8,001.20
	MALLINCKRODT 5.75% REGS	32,000.00	28,138.56
	MASTEC INC 4.875%	35,000.00	34,793.50
	MATCH GROUP 6.375%	5,000.00	5,352.50
	MATTAMY 6.5% REGS E	21,000.00	21,523.74
	MATTEL 3.15%	5,000.00	4,318.70
	MATTEL 6.75% REGS	4,000.00	3,935.64
	MEDIACOM 6.375%	5,000.00	5,165.90
	MGM GROWTH 5.625%	5,000.00	5,140.40
	MGM RESORTS 4.625%	11,000.00	10,618.19
	MGM RESORTS 6.625%	7,000.00	7,501.90
	MICRON TECH5.25% 24 REGS	14,000.00	14,426.44
	MMLP 7.25%	12,000.00	11,959.92
	MPH ACQUISIT 7.125% REGS	24,000.00	25,092.72
	MSCI INC 5.25% REGS	3,000.00	3,055.41
	NABORS 5.5%	9,000.00	8,843.94
	NABORS 5.75% REGS	7,000.00	6,646.43
	NATIONSTAR 6.5% 21	20,000.00	20,356.60
	NAVISTAR INTL6.625% REGS	13,000.00	13,312.52
	NCR CORP 5.875%	5,000.00	5,072.40
	NCR CORP 5%	4,000.00	3,979.36
	NCR CORP 6.375%	5,000.00	5,190.45
	NEIMAN MARCUS 8% REGS	50,000.00	34,031.00
	NETFLIX 4.875% REGS	10,000.00	9,716.70
	NETFLIX INC 5.5%	5,000.00	5,186.95
	NETFLIX INC 5.75%	15,000.00	15,766.95
	NEW ALBERTSONS 7.45%	27,000.00	22,207.50
	NEW ALBERTSONS 7.75%	5,000.00	4,380.65
	NEW ALBERTSONS 8.7%	23,000.00	20,409.51
	NEW ALBERTSONS 8%	2,000.00	1,691.36
	NEW HOME 7.25%	15,000.00	15,493.35
	NEXSTAR ESCROW5.625%REGS	10,000.00	9,999.80
	NEXSTAR TV 6.125% REGS	10,000.00	10,283.00
	NEXTERA ENERGY 4.5% REGS	6,000.00	5,717.82
	NEXTERA ENERGY4.25% REGS	8,000.00	7,848.56
	NGL ENERGY 5.125%	6,000.00	6,015.00
	NGPL PIPECO 4.875% REGS	6,000.00	6,001.86
	NIELSEN 5% REGS M	22,000.00	22,146.96
	NOBLE HLDG INT7.875%REGS	13,000.00	12,889.76
	NOBLE HLDG INTL 6.2%	5,000.00	3,277.30
	NOBLE HLDG INTL 7.75%	3,000.00	2,709.15
	NOKIA 3.375%	5,000.00	4,857.80
	NOKIA 4.375%	5,000.00	4,789.35
	NOVA CHEMICALS4.875%REGS	8,000.00	7,719.84
	NOVA CHEMICALS5.25% REGS	4,000.00	3,850.00
	NOVELIS 5.875% REGS	20,000.00	19,808.40
	NOVELIS 6.25% REGS	15,000.00	15,232.65
	NRG ENERGY 5.75% REGS	8,000.00	7,899.28
	NRG ENERGY 7.25%	10,000.00	10,655.80
	NRG TRANSFER E 4.25%	7,000.00	6,854.75
	NRG TRANSFER E 5.875%	25,000.00	26,420.00

	NUANCE COMMS 5.375% REGS		6,000.00	6,054.90
	NUANCE COMMS 5.625%		11,000.00	11,071.17
	NUSTAR LOGISTICS 5.625%		10,000.00	9,846.30
	NW HARDWOODS 7.5% REGS		17,000.00	15,747.78
	NW HARDWOODS 7.5% REGS A		30,000.00	27,330.00
	OASIS PETRO 6.5%		12,000.00	12,105.60
	OI EUROPEAN 4% REGS		6,000.00	5,801.04
	OI INC/OBGC 5.375% REGS		5,000.00	5,091.65
	OI INC/OBGC 5.875% REGS		13,000.00	13,465.79
	OI INC/OBGC 5% REGS		10,000.00	10,213.60
	OI INC/OBGC 6.375% REGS		3,000.00	3,209.97
	OPEN TEXT 5.875% REGS		9,000.00	9,298.17
	OUTFRONT MEDIA 5.25%		5,000.00	5,102.30
	OUTFRONT MEDIA 5.875%		20,000.00	20,274.20
	PARK AEROSPACE 4.5% REGS		12,000.00	11,485.92
	PARK AEROSPACE 5.5% REGS		6,000.00	5,936.25
	PARK AEROSPACE5.25% REGS		5,000.00	4,979.50
	PARKER DRIL 6.75%		6,000.00	4,656.66
	PBF HLDG 7.25%		15,000.00	15,660.45
	PBF HOLDING 7%		8,000.00	8,308.96
	PBF LOGISTICS 6.875%		8,000.00	8,186.32
	PEABODY SEC FIN 6% REGS		8,000.00	8,238.88
	PENSKE AUTO 5.5%		12,000.00	11,886.84
	PETM/ARGOS 7.125% REGS		29,000.00	17,654.04
	PETSMART 5.875% REGS		3,000.00	2,307.63
	PETSMART 8.875% REGS		5,000.00	3,089.30
	PILGRIM'S 5.75% MAR		4,000.00	3,960.44
	PILGRIM'S 5.75% REGS		21,000.00	20,505.03
	PILGRIM'S 5.75% REGS C		3,000.00	2,948.70
	PILGRIM'S 5.875% MAR		5,000.00	4,718.00
	PILGRIM'S 5.875% REGS		6,000.00	5,712.48
	PINNACLE ENTMNT 5.625%		5,000.00	5,247.65
	PLANTRONICS 5.5% REGS		14,000.00	14,005.60
	POLYONE CORP 5.25%		8,000.00	8,134.88
	POST HOLDINGS 5.5% REGS		8,000.00	7,986.40
	POST HOLDINGS 5.75% REGS		7,000.00	6,891.71
	POST HOLDINGS 5% REGS		30,000.00	28,323.00
	POST HOLDINGS5.75%REGS M		15,000.00	14,694.75
	PPD/JAGUAR 6.375% REGS		20,000.00	20,334.60
	PQ 5.75% REGS		3,000.00	3,007.50
	PRECIS DRILL 6.5%		3,000.00	3,031.14
	PRECIS DRILL 7.125% REGS		6,000.00	6,014.82
	PRESTIGE BRND5.375% REGS		15,000.00	14,966.70
	PRIME SECSRVC 9.25% REGS		38,000.00	41,266.10
	QEP RESOURCES 5.25%		2,000.00	1,950.20
	QEP RESOURCES 5.375%		18,000.00	18,095.40
	QEP RESOURCES 5.625%		5,000.00	4,852.60
	QEP RESOURCES 6.875%		6,000.00	6,358.08
	QORVO 6.75%		9,000.00	9,632.79
	QUICKEN LOANS 5.25% REGS		23,000.00	21,907.50
	QUICKEN LOANS 5.75% REGS		11,000.00	11,101.09
	RADIAN GRP 4.5%		8,000.00	7,929.44
	RANGE RESOURCES 4.875%		2,000.00	1,858.16
	RANGE RESOURCES 5% *		4,000.00	3,881.80
	RBS 6.1%		55,000.00	58,455.10
	RBS 6.125%		35,000.00	37,118.20

	RBS GLOBAL 4.875% REGS	4,000.00	3,937.92
	REGAL ENTMNT 5.75% 25	8,000.00	8,234.32
	REYNOLDS GP 5.125% REGS	30,000.00	30,381.90
	REYNOLDS GP 7% REGS	10,000.00	10,482.10
	RHP HOTEL PRTY 5%	10,000.00	10,005.60
	ROSE ROCK 5.625%	14,000.00	13,864.76
	ROWAN COMPANIES 4.875%	4,000.00	3,680.44
	ROWAN COMPANIES 7.375%	4,000.00	3,854.76
	RR DONNELLEY 7%	2,000.00	2,054.32
	RSP PERMIAN 6.625%	6,000.00	6,248.10
	S HARDROCK 5.875% REGS	23,000.00	23,057.50
	SABRE 5.25% REGS	3,000.00	3,030.54
	SABRE 5.375% REGS	11,000.00	11,148.72
	SAFEWAY INC 5%	2,000.00	1,989.80
	SANCHEZ NRG 7.75%	5,000.00	4,740.50
	SBA COMMS 4.875% 24	10,000.00	9,791.70
	SCIENTIFIC GAMES 10%	25,000.00	26,973.00
	SCIENTIFIC GAMES 5% REGS	2,000.00	1,969.28
	SCIENTIFIC GAMES5%REGS L	6,000.00	5,984.40
	SCOTTS MIRACLE 5.25% WI	5,000.00	5,020.75
	SEALED AIR 4.875% REGS	10,000.00	10,277.20
	SEALED AIR 5.25% REGS	8,000.00	8,231.76
	SEALED AIR 6.5% REGS	25,000.00	26,754.25
	SEMGROUP 7.25%	9,000.00	9,187.47
	SENSATA TECH 5.625% REGS	7,000.00	7,412.79
	SENSATA TECH 5% REGS	13,000.00	12,998.18
	SESI LLC 7.125%	2,000.00	2,037.58
	SEVEN GENERA 5.375% REGS	4,000.00	3,895.16
	SHEARER'S FOOD 9% REGS	27,000.00	27,344.52
	SHELF DRILL 8.25% REGS	14,000.00	14,079.10
	SINCLAIR TV 5.125% REGS	8,000.00	7,636.40
	SINCLAIR TV 5.625% REGS	15,000.00	15,063.00
	SIRIUS XM 4.625% REGS	12,000.00	11,949.72
	SIRIUS XM 5.375% 26 REGS	12,000.00	12,040.80
	SIRIUS XM 5% REGS	10,000.00	9,573.00
	SIRIUS XM 6% REGS	25,000.00	26,067.75
	SIX FLAGS 4.875% REGS	14,000.00	13,819.26
	SM ENERGY 5%	7,000.00	6,520.22
	SOLERA 10.5% REGS	10,000.00	11,208.70
	SONIC AUTOMOTIVE 6.125%	5,000.00	4,897.65
	SOTHEBY'S 4.875% REGS	15,000.00	14,338.80
	SPDWY MOTORS 5.125%	5,000.00	5,004.75
	SPRINGLEAF FIN 5.625%	22,000.00	21,490.26
	SPRINGLEAF FIN 6.875%	10,000.00	10,128.20
	SPRINGLEAF FIN 7.75%	10,000.00	10,871.70
	SPRINGLEAF FIN 8.25%	6,000.00	6,513.66
	SPRINT 11.5%	25,000.00	29,370.25
	SPRINT 6% 22	38,000.00	37,328.92
	SPRINT 7.125%	11,000.00	10,668.79
	SPRINT 7.25%	40,000.00	41,356.40
	SPRINT 7.625%	23,000.00	22,797.14
	SPRINT 7.625% 26	72,000.00	71,180.64
	SPRINT 7.875%	10,000.00	10,244.00
	SPRINT 8.75%	31,000.00	32,947.73
	SPRINT 9% REGS	16,000.00	16,575.36
	SS&C TECH 5.875%	9,000.00	9,442.98

	STANDARD INDUST4.75% JAN		3,000.00	2,838.39
	STANDARD INDUST4.75%REGS		15,000.00	14,455.95
	STATION CASINOS 5% REGS		7,000.00	6,751.78
	STEEL DYNAMICS 5.5%		15,000.00	15,629.55
	STEEL DYNAMICS 5%		10,000.00	10,136.90
	STONE ENERGY 7.5%		1,903.00	1,936.30
	SUMMIT MATE 5.125% REGS		67,000.00	66,015.77
	SUMMIT MATERIALS 6.125%		31,000.00	31,709.59
	SUMMIT MID 5.75%		13,000.00	12,899.64
	SUNOCO LP 4.875% REGS		4,000.00	3,946.92
	SUNOCO LP 5.5% REGS		5,000.00	4,892.25
	SUNOCO LP 5.875% REGS		3,000.00	2,968.98
	SUPERVALU INC 6.75%		29,000.00	28,698.98
	SUPERVALU INC 7.75%		55,000.00	53,373.65
	SW ENERGY MLT		22,000.00	21,630.62
	SYMANTEC 5% REGS		12,000.00	12,201.12
	SYNIVERSE HLDGS 9.125%		2,000.00	2,005.68
	T-MOBILE USA 4.5%		11,000.00	10,673.08
	T-MOBILE USA 4.75%		11,000.00	10,607.30
	T-MOBILE USA 6.375%		12,000.00	12,605.64
	T-MOBILE USA 6.5% 24		5,000.00	5,237.25
	T-MOBILE USA 6.5% 26		13,000.00	13,892.19
	T-MOBILE USA 6.625%		34,000.00	35,119.62
	T-MOBILE USA 6.836%		10,000.00	10,317.30
	T-MOBILE USA 6%		19,000.00	19,681.34
	T-MOBILE USA 6% 24		4,000.00	4,156.92
	TALEN ENERGY SUPPLY 6.5%		20,000.00	15,418.00
	TALLGRASS NRG 5.5% REGS		10,000.00	10,221.20
	TARGA RESCS 4.25%		31,000.00	29,997.46
	TARGA RESCS 5% REGS		5,000.00	4,845.70
	TECK RESOURCES 4.75%		5,000.00	5,078.00
	TECK RESOURCES 5.4%		5,000.00	4,786.35
	TECK RESOURCES 6.125%		5,000.00	5,323.90
	TECK RESOURCES 6%		10,000.00	10,448.90
	TEGNA 4.875% REGS		10,000.00	10,161.00
	TEGNA 5.5% REGS		10,000.00	10,278.10
	TELECOM ITALIA 6.375%		15,000.00	16,432.95
	TELECOM ITALIA 6%		11,000.00	11,678.59
	TELECOM ITALIA 7.2%		2,000.00	2,350.34
	TELECOM ITALIA 7.721%		2,000.00	2,446.72
	TELEFLEX 4.875%		2,000.00	1,981.00
	TELEFLEX INC 5.25%		15,000.00	15,397.05
	TENET HEALTH 4.5%		12,000.00	11,905.44
	TENET HEALTH 4.625% REGS		18,000.00	17,358.48
	TENET HEALTH 4.75%		15,000.00	15,151.20
	TENET HEALTH 5.5%		15,000.00	15,195.15
	TENET HEALTH 6.75%		24,000.00	24,040.80
	TENET HEALTH 6%		25,000.00	25,798.00
	TENET HEALTH 8.125%		4,000.00	4,223.48
	TERRAFORM 4.25% REGS		9,000.00	8,800.92
	TERRAFORM 5% REGS		11,000.00	10,660.32
	TERRAFORM 6.125% REGS		4,000.00	4,057.16
	TERRAFORM MLT REGS		4,000.00	4,328.20
	TESLA 5.3% REGS		18,000.00	16,881.84
	THC ESCROW 5.125% REGS		20,000.00	19,390.40
	THC ESCROW 7% REGS		6,000.00	6,015.00

	THHH 11.5% REGS ESCROW		215,000.00	2,150.00	
	TOLL BROS FIN 4.35% 10YR		10,000.00	9,356.70	
	TOLL BROTHERS 5.625%		6,000.00	6,307.80	
	TRANSDIGM 6.375%		24,000.00	24,366.72	
	TRANSDIGM 6.5%		8,000.00	8,164.64	
	TRANSDIGM INC 6.5%		11,000.00	11,269.17	
	TRANSDIGM INC 6%		11,000.00	11,203.28	
	TRANSMONTAIGE 6.125%		6,000.00	6,031.68	
	TRANSOCEAN 6.25% REGS		8,100.00	8,264.67	
	TRANSOCEAN 7.5% REGS		4,000.00	3,988.76	
	TRANSOCEAN INC 6.8%		21,000.00	16,578.24	
	TRANSOCEAN INC 7.5%		10,000.00	8,930.60	
	TRANSOCEAN INC 9% REGS		18,000.00	19,106.82	
	TRANSOCEAN INC MLT		2,000.00	1,928.40	
	TRANSOCEAN INC MLT 41		8,000.00	7,946.16	
	TRAVELPORT 6%		5,000.00	5,000.00	
	TRINIDAD DRILL6.625%REGS		9,000.00	8,552.88	
	TRINSEO 5.375% REGS		4,000.00	4,045.00	
	TRONOX FIN 5.75% REGS		5,000.00	4,988.60	
	TUTOR PERINI 6.875% REGS		20,000.00	20,843.60	
	ULTRA RESCS 6.875% REGS		53,000.00	47,766.25	
	ULTRA RESCS 7.125% REGS		18,000.00	15,299.64	
	UNIT CORP 6.625%		22,000.00	21,843.80	
	UNITED CONTINENTAL 5%		17,000.00	16,865.87	
	UNITED RENTALS 4.625%		20,000.00	19,420.00	
	UNITED RENTALS 4.875%		13,000.00	12,617.93	
	UNITED RENTALS 5.5% D		31,000.00	31,894.97	
	UNITED RENTALS 5.5% F		5,000.00	5,108.65	
	UNITED RENTALS 5.875%		20,000.00	20,902.40	
	UNIV HEALTH 3.75% REGS		3,000.00	3,018.00	
	UNIV HEALTH 4.75% REGS		5,000.00	5,070.20	
	UNIVAR INC 6.75% REGS		20,000.00	20,801.80	
	UNIVISION 6.75% REGS G		10,000.00	10,335.20	
	UNIVISION 6.75% REGS H		13,000.00	13,435.76	
	US CONCRETE 6.375%		61,000.00	63,379.61	
	US STEEL 6.875%		5,000.00	5,242.20	
	US STEEL 8.375% REGS		10,000.00	10,693.90	
	USA COM PART 6.875% REGS		5,000.00	5,075.00	
	USIS MERGER 6.875% REGS		13,000.00	13,178.23	
	VALEANT 5.375% REGS		15,000.00	14,926.65	
	VALEANT 5.5% REGS		11,000.00	10,781.10	
	VALEANT 5.875% REGS		48,000.00	42,895.68	
	VALEANT 6.75% REGS		30,000.00	29,419.80	
	VALEANT 7.5% REGS		25,000.00	25,146.50	
	VALEANT 9% REGS		25,000.00	25,114.00	
	VALVOLINE 4.375% WI		18,000.00	17,458.56	
	VALVOLINE 5.5%		5,000.00	5,132.35	
	VERISIGN 4.75%		2,000.00	1,927.36	
	VERISIGN INC 5.25%		4,000.00	4,088.76	
	VERSUM MATERIALS5.5%REGS		10,000.00	10,429.60	
	VIACOM FLT		5,000.00	4,996.95	
	VIACOM FLT C		5,000.00	5,081.00	
	VIASAT 5.625% REGS		5,000.00	4,889.10	
	VIDEOTRON 5.125% REGS		28,000.00	27,869.52	
	VIDEOTRON 5.375% REGS		27,000.00	28,054.35	
	VOC ESCROW 5% REGS		12,000.00	11,562.24	

		WABASH NATL 5.5% REGS		5,000.00	4,956.60	
		WARNER MUSIC 6.75% REGS		20,000.00	20,771.60	
		WEATHERFORD 4.5%		10,000.00	8,520.20	
		WEATHERFORD 6.5%		12,000.00	8,772.48	
		WEATHERFORD 6.75%		1,000.00	738.34	
		WEATHERFORD 7%		5,000.00	3,746.85	
		WELLCARE HEALTH 5.25%		10,000.00	10,046.60	
		WESCO 5.375%		20,000.00	20,010.20	
		WESTERN DIGI 4.75%		16,000.00	16,052.64	
		WHITING PETRO 5.75%		14,000.00	14,233.10	
		WHITING PETRO6.625% REGS		8,000.00	7,953.28	
		WILLIAMS COMPANIES 3.7%		10,000.00	9,596.60	
		WILLIAMS COMPANIES 4.55%		2,000.00	1,981.84	
		WILLIAMS COMPANIES 5.75%		5,000.00	5,191.35	
		WILLIAMS COMPANIES 7.75%		7,000.00	8,491.28	
		WINDSTREAM 6.375% REGS		11,000.00	6,140.64	
		WINDSTREAM 8.75% REGS		12,000.00	7,410.72	
		WMG ACQUISITION 5% REGS		10,000.00	10,067.80	
		WMG ACQUISITION5.5% REGS		4,000.00	4,031.76	
		ZAYO 5.75% REGS		32,000.00	31,909.76	
	計	銘柄数 :	625	9,425,878.04	8,377,920.77	
					(896,018,626)	
		組入時価比率 :	96.8%		99.9%	
	小計				896,018,626	
					(896,018,626)	
	合計				897,052,356	
					(897,052,356)	

(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

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

(平成30年4月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	2,466,844,098	円
負債総額	10,222,309	円
純資産総額( - )	2,456,621,789	円
発行済口数	3,561,428,837	口
1口当たり純資産額( / )	0.6898	円

(参考) G I M世界投資適格債券マザーファンド(適格機関投資家専用)

(平成30年4月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	14,069,310,642	円
負債総額	3,292,356,950	円
純資産総額( - )	10,776,953,692	円
発行済口数	7,595,872,375	口
1口当たり純資産額( / )	1.4188	円

(参考) G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)

(平成30年4月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	11,894,950,432	円
負債総額	68,588,663	円
純資産総額( - )	11,826,361,769	円
発行済口数	7,727,976,634	口
1口当たり純資産額( / )	1.5303	円

(参考) G I M米国高利回り社債マザーファンド(適格機関投資家専用)

(平成30年4月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	920,252,459	円
負債総額	1,931,108	円
純資産総額( - )	918,321,351	円
発行済口数	453,310,258	口
1口当たり純資産額( / )	2.0258	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】

原届出書の「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」について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

資本金の額（平成30年4月末現在）

資本金の額	2,218百万円
会社が発行する株式の総数	70,000株
発行済株式総数	56,265株

会社の意思決定機構

取締役会は、会社の業務執行上重要な事項を決定し、その決議は、取締役の過半数が出席し、その出席取締役の過半数をもって行われます。

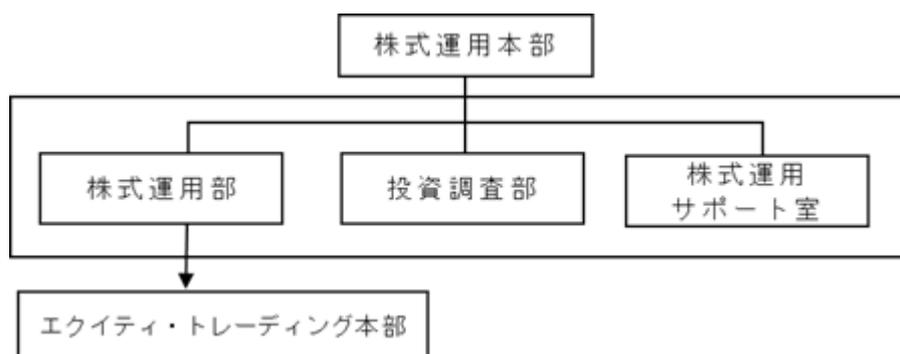
取締役は、株主総会において選任され、任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。増員により、または補欠として選任された取締役の任期は、他の在任取締役の任期の満了する時までとします。

また、取締役会は以下の事項（法令上取締役会の決議事項とされているものを除きます。）を決議または審議することを以下の機関に委任しています。

- （イ）業務執行にかかる重要な事項（リスク管理に関する事項を除きます。）：経営委員会
- （ロ）リスク管理上の重要な事項：ビジネス・コントロール・コミッティ

投資運用の意思決定機構

（イ）株式運用本部



- （a）株式運用本部は、株式運用部、投資調査部および株式運用サポート室で構成されます。
- （b）株式運用部では、運用業務遂行上必要と認められる諸会議の開催による運用戦略の方向性の決定等により投資判断を行います。なお、投資調査部のアナリストとの議論を通じ投資判断の際の参考とします。また、同部が行う国内外の株式の運用や海外関係会社に運用を委託している株式の運用等について、関係各部署と連携し、顧客、投資家、販売会社およびコンサルタント会社への商品内容説明、販売支援、新商品の企画立案等に関する事項を行います。
- （c）投資調査部に所属するアナリストは主に国内株式の分析を行い、その結果に基づき各銘柄に評価を付します。
- （d）株式運用サポート室は、運用実績の分析を行い、前記（b）の株式運用部にその結果を提供します。

(e) エクイティ・トレーディング本部は、株式運用部所属のポートフォリオ・マネジャーの投資判断を受け、主に国内株式の売買を執行します。

(ロ) 債券運用部

債券運用部は、国内外の債券の運用業務遂行上必要と認められる諸会議を開催し、運用戦略の方向性を決定します。その決定内容を自らの投資判断に利用し、国内外の債券のポートフォリオを決定します。また国内外の債券の売買を執行します。さらに、同部が行う国内外の債券の運用について、関係各部署と連携し、顧客、投資家、販売会社およびコンサルタント会社への商品内容説明、販売支援、新商品の企画立案等に関する事項を行います。

(ハ) 前記(イ)および(ロ)以外に為替ヘッジを行う場合は、クライアント・ビジネス本部のグローバル運用商品部およびグローバル債券商品部が為替ヘッジのための投資判断を行います。

(注) 前記(イ)、(ロ)および(ハ)の意思決定機構、組織名称等は、平成30年4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】

<訂正前>

(略)

委託会社が設定・運用している投資信託は、平成29年10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	76	834,520
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	61	3,207,809
総合計	137	4,042,329
親投資信託	53	-

(注) 百万円未満は四捨五入

<訂正後>

(略)

委託会社が設定・運用している投資信託は、平成30年4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	74	1,012,498
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	3,561,902
総合計	134	4,574,400
親投資信託	52	-

(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27期事業年度（平成28年4月1日から平成29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27期事業年度（平成28年4月1日から平成29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28期中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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28期中間会計期間末 (平成29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			9,581,999	
前払費用			62,102	
未収入金			22,393	
未収委託者報酬			2,227,564	
未収収益			1,319,520	
関係会社短期貸付金			3,753,000	
その他			7,722	
流動資産計			16,974,304	84.8
固定資産				
投資その他の資産			3,049,544	
関係会社株式		60,000		
投資有価証券		2,345,886		
敷金保証金		568,627		
前払年金費用		55,530		
その他		19,500		
固定資産計			3,049,544	15.2
資産合計			20,023,848	100.0

		第28期中間会計期間末 (平成29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			89,221	
未払金			1,693,404	
未払手数料		1,077,792		
その他未払金	1	615,612		
未払費用			579,092	
未払法人税等			415,840	
賞与引当金			1,174,284	
役員賞与引当金			29,581	
流動負債計			3,981,424	19.9
固定負債				
長期未払金			287,017	
賞与引当金			516,368	
役員賞与引当金			262,942	
繰延税金負債			5,701	
固定負債計			1,072,029	5.3
負債合計			5,053,454	25.2

		第28期中間会計期間末 (平成29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			11,739,480	
利益準備金		33,676		
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		11,705,803		
株主資本計			14,957,480	74.7
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金			12,914	
評価・換算差額等計			12,914	0.1
純資産合計			14,970,394	74.8
負債・純資産合計			20,023,848	100.0

## (2) 中間損益計算書

		第28期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29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			5,647,543	
運用受託報酬			2,797,697	
業務受託報酬			483,755	
その他			204,119	
営業収益計			9,133,115	100.0
営業費用・一般管理費				
営業費用			4,053,570	
支払手数料		2,731,918		
調査費		970,987		
その他営業費用		350,664		
一般管理費			4,920,250	
営業費用・一般管理費計			8,973,821	98.3
営業利益			159,294	1.7
営業外収益	1	23,965		
営業外収益計			23,965	0.3
営業外費用	2	25,163		
営業外費用計			25,163	0.3
経常利益			158,096	1.7
税引前中間純利益			158,096	1.7
法人税、住民税及び事業税			506,933	5.5
中間純損失			348,837	3.8

## 重要な会計方針

項目	第28期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29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) 役員賞与引当金 役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>(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. 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28期中間会計期間末 (平成29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28期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29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 7,003
2	営業外費用のうち主要なもの (千円) 為替差損 21,098

## （リース取引関係）

第28期中間会計期間末 (平成29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	672,813 千円
1年超	1,682,788 千円
合計	2,355,602 千円

## （金融商品関係）

第28期中間会計期間末（平成29年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成29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	9,581,999	9,581,999	-
(2) 未収委託者報酬	2,227,564	2,227,564	-
(3) 未収収益	1,319,520	1,319,520	-
(4) 関係会社短期貸付金	3,753,000	3,753,000	-
(5) 投資有価証券	2,345,886	2,345,886	-
(6) 敷金保証金	568,627	567,508	1,118
資産計	19,796,599	19,795,480	1,118
(1) 未払手数料	1,077,792	1,077,792	-
(2) その他未払金	615,612	615,612	-
(3) 未払費用	579,092	579,092	-
(4) 長期未払金	287,017	286,416	600
負債計	2,559,513	2,558,913	600

## （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。

## (6) 敷金保証金

敷金保証金の時価については、当該保証金の返還時期を基に、日本国債の利回りで割り引いた現在価値により算定しております。

## 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、日本国債の利回りで割り引いた現在価値により算定しております。

## (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)

	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28期中間会計期間末（平成29年9月30日）

## 1 . 関係会社株式

関係会社株式（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	2,345,868	2,327,250	18,618
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	18	20	1
合計		2,345,886	2,327,270	18,616

(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28期中間会計期間（自 平成29年 4 月 1 日 至 平成29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	5,647,543	2,797,697	483,755	204,119	9,133,115

## 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
6,755,530	958,767	1,418,817	9,133,115

(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	958,767	資産運用業

## (1株当たり情報)

第28期中間会計期間 (自平成29年 4 月 1 日 至平成29年 9 月30日)	
1株当たり純資産額	266,069円39銭
1株当たり中間純損失( )	6,199円89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、1株当たり中間純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たりの中間純損失の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純損失 ( )	348,837千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純損失 ( )	348,837千円
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】

&lt;訂正前&gt;

## (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(平成29年3月末現在)

(略)

## (2) 販売会社

	名 称	資本金の額 (平成29年3月末現在)	事業の内容
(略)			

## (3) 運用委託先の会社

名 称	資本金の額 (平成29年3月末現在)	事業の内容
J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク	450万米ドル	投資運用業務および投資顧問業務を行っています。

&lt;訂正後&gt;

## (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(平成29年9月末現在)

(略)

## (2) 販売会社

	名 称	資本金の額 (平成29年9月末現在)	事業の内容
(略)			

## (3) 運用委託先の会社

名 称	資本金の額 (平成29年9月末現在)	事業の内容
J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク	450万米ドル	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

平成30年4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

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グローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）の平成29年9月12日から平成30年3月12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。

### 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グローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）の平成30年3月12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

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29年12月8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29年4月1日から平成30年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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29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29年4月1日から平成29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。