

【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】 2019年6月10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、2018年12月7日付で提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また記載事項の一部訂正を行うため、訂正届出書を提出いたします。

．【訂正の内容】

第一部【証券情報】**（４）発行（売出）価格**

<訂正前>

（略）

販売会社に関しては、以下の照会先までお問い合わせください。

照会先：

J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社

TEL：03 - 6736 - 2350（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

HPアドレス：<http://www.jpmorganasset.co.jp/>

<訂正後>

（略）

販売会社に関しては、以下の照会先までお問い合わせください。

照会先：

J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社

TEL：03 - 6736 - 2350（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

HPアドレス：<https://www.jpmorganasset.co.jp/>**（５）申込手数料**

<訂正前>

発行価格に販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。ただし、有価証券届出書提出日現在、販売会社における手数料率*は、3.78%（税抜3.50%）が上限となっています。

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

手数料率は、販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

販売会社に関しては、前記「（４）発行（売出）価格」の照会先までお問い合わせください。

（以下略）

<訂正後>

発行価格に販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。ただし、有価証券届出書提出日現在、販売会社における手数料率*は、3.78%*（税抜3.50%）が上限となっています。

* 当該手数料率は、消費税および地方消費税相当額（以下「消費税等」または「税」といいます。）を含みます。また、本書において記載されている報酬率、費用等も同様です。なお、2019年10月1日より消費税率（地方消費税率を含みます。）が10%に引上げられる予定です。その場合、手数料率は3.85%が上限となります。

手数料率は、販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

販売会社に関しては、前記「（４）発行（売出）価格」の照会先までお問い合わせください。

（以下略）

第二部【ファンド情報】**第1【ファンドの状況】****1【ファンドの性格】****（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30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、ウルグアイおよびドミニカ共和国）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（2019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、ウルグアイおよびドミニカ共和国）が該当します。

(以下略)

(2) ファンドの沿革

< 訂正前 >

平成18年 8月7日 J P 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）の信託契約締結、および設定・運用開始

平成18年 9月21日 J P 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）およびJ P 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）の信託契約締結、ならびに設定・運用開始

平成18年 9月29日 当ファンドの信託契約締結、および設定・運用開始

平成27年 5月29日 マザーファンドの名称変更

< 訂正後 >

2006年 8月7日 J P 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）の信託契約締結、および設定・運用開始

2006年 9月21日 J P 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）およびJ P 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）の信託契約締結、ならびに設定・運用開始

2006年 9月29日 当ファンドの信託契約締結、および設定・運用開始

2015年 5月29日 マザーファンドの名称変更

(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30年10月末現在）

(略)

設立年月日 平成2年10月18日

会社の沿革

昭和46年 ジャーディン・フレミング、日本市場の成長性に着目し東京に駐在員事務所を開設

昭和60年 ジャーディン・フレミング投資顧問株式会社設立、有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律施行に伴い、同社は昭和62年に投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。

平成2年 ジャーディン・フレミング投信株式会社（委託会社）設立

平成7年 ジャーディン・フレミング投資顧問株式会社とジャーディン・フレミング投信株式会社が合併し、ジャーディン・フレミング投信・投資顧問株式会社となる。

平成13年 ジェー・ピー・モルガン・フレミング・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社に商号変更

平成18年 J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社に商号変更

平成20年 J P モルガン信託銀行株式会社より資産運用部門の事業を譲受

大株主の状況（平成30年10月末現在）

（以下略）

<訂正後>

資本金 2,218百万円（2019年4月末現在）

（略）

設立年月日 1990年10月18日

会社の沿革

1971年 ジャーディン・フレミング、日本市場の成長性に着目し東京に駐在員事務所を開設

1985年 ジャーディン・フレミング投資顧問株式会社設立、有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律施行に伴い、同社は1987年に投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。

1990年 ジャーディン・フレミング投信株式会社（委託会社）設立

1995年 ジャーディン・フレミング投資顧問株式会社とジャーディン・フレミング投信株式会社が合併し、ジャーディン・フレミング投信・投資顧問株式会社となる。

2001年 ジェー・ピー・モルガン・フレミング・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社に商号変更

2006年 J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社に商号変更

2008年 J P モルガン信託銀行株式会社より資産運用部門の事業を譲受

大株主の状況（2019年4月末現在）

（以下略）

2【投資方針】

（1）投資方針

（ロ）投資態度

マザーファンドの投資プロセス

<訂正前>

J P M I M社にマザーファンドの運用の指図に関する権限を委託し、J . P . モルガン・アセット・マネジメントの債券運用ノウハウとリスク管理手法を活用します。

（略）

なお、資金動向や市況動向により、マザーファンドにおいて、前記のような運用ができない場合があります。

（以下略）

<訂正後>

J P M I M社にマザーファンドの運用の指図に関する権限を委託し、J . P . モルガン・アセット・マネジメントの債券運用ノウハウとリスク管理手法を活用します。

(略)

(E S G *投資について)

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

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

なお、資金動向や市況動向により、マザーファンドにおいて、前記のような運用ができない場合もあります。

(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30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。

(略)

(ロ) マザーファンドの運用体制

マザーファンドの運用体制は以下のとおりです。

(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30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)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、平成30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、J P M I M社のグローバル債券運用グループに所属する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、2019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。

(略)

(ロ) マザーファンドの運用体制

マザーファンドの運用体制は以下のとおりです。

(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、2019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。**G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド**

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、2019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。**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、J P M I M社のグローバル債券運用グループに所属する高利回り社債運用チーム(20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、2019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)

3【投資リスク】

(1) リスク要因

マザーファンド共通

<訂正前>

(略)

__ (略)

__ (略)

<訂正後>

(略)

ボンドコネクトを通じた投資にかかるリスクおよび留意点

マザーファンド(この項において、「G I M世界投資適格債券マザーファンド」と「G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド」をいいます。)は「中国・香港債券相互取引制度」(以下「ボンドコネクト」といいます。)を通じて、中国本土で発行された債券に投資する場合があります。当該債券にボンドコネクトを通じて投資する場合、法規制の変更や取引上の制約により、取引相手方にかかるリスクが増大する可能性があります。

ボンドコネクトは、香港から中国本土の債券市場へ、あるいは中国本土から香港の債券市場への投資を行う制度です。この制度により、外国の投資家は、中国本土の銀行間債券市場における取引を、香港の証券会社を通じて行うことができます。マザーファンドがボンドコネクトを通じて投資する場合のリスクおよび留意点は以下のとおりです。

- ・法規制に関するリスク

現時点の規則や法規制が変更される可能性や、その変更が過去に遡って適用される可能性があり、これによりマザーファンドの信託財産の価値が影響を受けることがあります。

- ・投資家保護制度に関する留意点

マザーファンドは、中国本土および香港の投資家保護制度のいずれにおいても保護されません。

- ・取引時間に関する留意点

ボンドコネクトは、中国・香港双方の債券市場の営業日であって、かつ取引の決済日が中国・香港双方の銀行の営業日となる場合のみ運営されます。その結果として、マザーファンドは、希望する時点や価格で債券の売買ができないことがあります。

__ (略)

__ (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

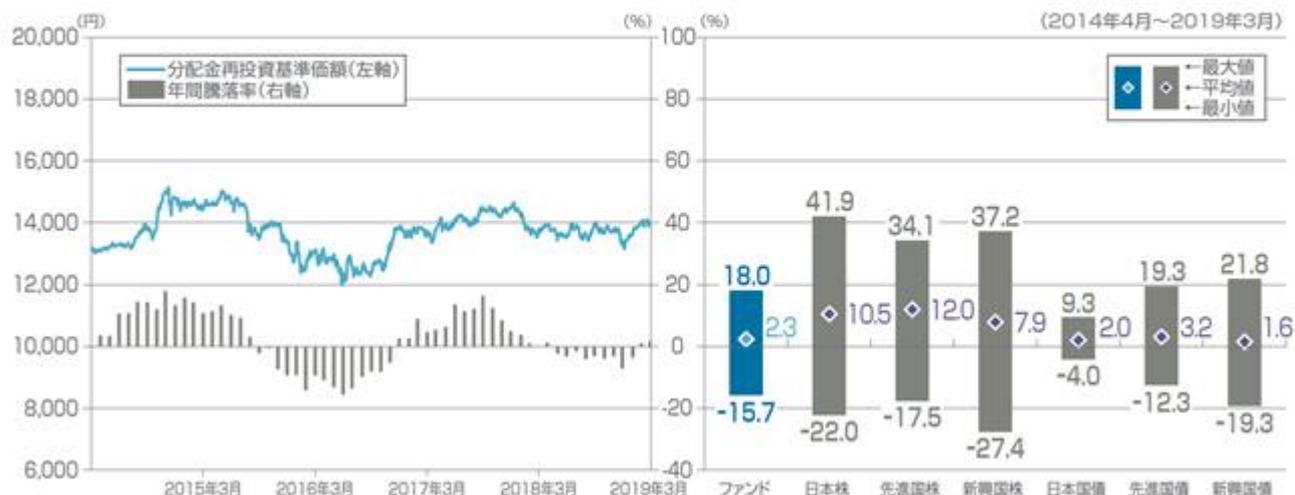
下記グラフは、ファンドの投資リスクをご理解いただくための情報の一つとしてご利用ください。

<ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移>

2014年4月～2019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・・・J.P.モルガンGBI-エマージング・マーケット・グローバル(円ベース)

(注)海外の指数は、為替ヘッジを行わないものとして算出されたものです。なお、MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、委託会社で円換算しています。

TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、ファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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

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

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

J.P.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
 (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

< 訂正前 >

(略)

(平成30年9月末現在)

(以下略)

< 訂正後 >

(略)

(2019年3月末現在)

(以下略)

4【手数料等及び税金】

< 訂正前 >

- (1) 申込手数料

発行価格に販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。ただし、有価証券届出書提出日現在、販売会社における手数料率は、3.78%（税抜3.50%）が上限となっています。

(略)

自動けいぞく投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

販売会社に関しては、以下の照会先までお問い合わせください。

照会先：

J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社

TEL：03-6736-2350（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

HPアドレス：<http://www.jpmorganasset.co.jp/>

(略)

- (3) 信託報酬等

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、前営業日の信託財産の純資産総額に対し年率1.566%（税抜1.45%）を乗じて得た額とします。

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

	委託会社	販売会社	受託会社
	年率0.756% (税抜0.70%)	年率0.756% (税抜0.70%)	年率0.054% (税抜0.05%)
信託報酬の配分 (純資産総額に対し)	投資判断、受託会社に対する指図等の運用業務、目論見書、運用報告書等の開示資料作成業務、基準価額の計算業務、およびこれらに付随する業務の対価	受益者の口座管理業務、収益分配金・換金代金・償還金の支払い業務、交付運用報告書の交付業務、購入後の投資環境等の情報提供業務、およびこれらに付随する業務の対価	信託財産の記帳・保管・管理業務、委託会社からの指図の執行業務、信託財産の計算業務、およびこれらに付随する業務の対価

委託会社の受ける報酬には、運用委託先への報酬*が含まれています。

* 投資判断等の運用業務およびこれに付随する業務の対価として支払われます。

（略）

（４）その他の手数料等

（略）

２．監査費用*を信託財産で負担します。

* 信託財産の財務諸表の監査業務の対価として監査法人に支払われます。

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

委託会社が信託財産から支弁を受ける金額については、計算期間を通じて毎日費用計上するものとします。

（５）課税上の取扱い

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10月末現在適用されるものです。

（以下略）

<訂正後>

（１）申込手数料

発行価格に販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。ただし、有価証券届出書提出日現在、販売会社における手数料率は、3.78%*（税抜3.50%）が上限となっています。

* 2019年10月1日より消費税率（以下、地方消費税率を含みます。）が10%に引き上げられる予定です。その場合、手数料率は3.85%が上限となります。

（略）

自動けいぞく投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

販売会社に関しては、以下の照会先までお問い合わせください。

照会先：

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

TEL：03-6736-2350（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

HPアドレス：<https://www.jpmorganasset.co.jp/>

（略）

（３）信託報酬等

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、前営業日の信託財産の純資産総額に対し年率1.566%*（税抜1.45%）を乗じて得た額とします。

* 2019年10月1日より消費税率が10%に引き上げられる予定です。その場合、年率1.595%となります。

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

信託報酬の配分 (純資産総額に対し)	委託会社	販売会社	受託会社
	年率0.756% (税抜0.70%)	年率0.756% (税抜0.70%)	年率0.054% (税抜0.05%)
	投資判断、受託会社に対する指図等の運用業務、目論見書、運用報告書等の開示資料作成業務、基準価額の計算業務、およびこれらに付随する業務の対価	受益者の口座管理業務、収益分配金・換金代金・償還金の支払い業務、交付運用報告書の交付業務、購入後の投資環境等の情報提供業務、およびこれらに付随する業務の対価	信託財産の記帳・保管・管理業務、委託会社からの指図の執行業務、信託財産の計算業務、およびこれらに付随する業務の対価

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

信託報酬の配分 (純資産総額に対し)	委託会社	販売会社	受託会社
	年率0.77% (税抜0.70%)	年率0.77% (税抜0.70%)	年率0.055% (税抜0.05%)

委託会社の受ける報酬には、運用委託先への報酬*が含まれています。

* 投資判断等の運用業務およびこれに付随する業務の対価として支払われます。

(略)

(4) その他の手数料等

(略)

2. 監査費用*を信託財産で負担します。

* 信託財産の財務諸表の監査業務の対価として監査法人に支払われます。

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

委託会社が信託財産から支弁を受ける金額については、計算期間を通じて毎日費用計上するものとします。

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

(5) 課税上の取扱い

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2019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。

<更新・訂正後>

(1) 投資状況

(平成31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	757,903,533	33.36

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	772,407,568	34.00
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	751,406,570	33.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	9,605,187	0.42
合計(純資産総額)		2,272,112,484	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31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	1,994,275,560	20.36
	カナダ	133,733,693	1.37
	メキシコ	35,433,110	0.36
	ドイツ	98,048,249	1.00
	イタリア	263,899,132	2.69
	フランス	198,974,285	2.03
	オランダ	30,810,990	0.31
	スペイン	313,540,676	3.20
	ベルギー	47,870,312	0.49
	オーストリア	24,652,747	0.25
	フィンランド	8,378,659	0.09
	アイルランド	28,365,864	0.29
	ポルトガル	34,281,820	0.35
	スロベニア	54,981,267	0.56
	イギリス	482,691,723	4.93
	デンマーク	21,245,359	0.22
	ポーランド	21,405,190	0.22
	ロシア	7,082,652	0.07
	スロバキア	38,531,084	0.39
	オーストラリア	341,223,757	3.48
ニュージーランド	4,421,262	0.05	
	香港	42,158,392	0.43
	タイ	40,380,796	0.41
	小計	4,266,386,579	43.56
地方債証券	カナダ	138,695,375	1.42
特殊債券	アメリカ	1,094,522,502	11.17
	フランス	165,162,212	1.69
	ルクセンブルク	74,374,503	0.76
	イギリス	127,304,191	1.30
	小計	1,461,363,408	14.92
社債券	アメリカ	1,760,338,487	17.97
	カナダ	12,833,501	0.13
	ドイツ	35,441,301	0.36

	イタリア	122,133,779	1.25
	フランス	30,574,601	0.31
	オランダ	131,370,608	1.34
	アイルランド	14,797,611	0.15
	ポルトガル	25,054,022	0.26
	イギリス	968,384,215	9.89
	スイス	29,220,981	0.30
	シンガポール	44,955,936	0.46
	小計	3,175,105,042	32.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	753,037,594	7.69
合計(純資産総額)		9,794,587,998	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31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	390,170,070	3.77
	アルゼンチン	39,588,376	0.38
	メキシコ	1,740,318,022	16.83
	ブラジル	2,085,748,729	20.17
	チリ	207,578,628	2.01
	コロンビア	577,869,235	5.59
	ペルー	155,320,620	1.50
	ドイツ	127,890,093	1.24
	トルコ	185,788,924	1.80
	チェコ	50,594,961	0.49
	ポーランド	629,531,741	6.09
	ロシア	324,413,211	3.14
	ルーマニア	114,778,862	1.11
	マレーシア	573,607,426	5.55
	タイ	419,197,118	4.05
	フィリピン	20,437,066	0.20
	インドネシア	1,035,687,952	10.01
	エジプト	49,647,664	0.48
	南アフリカ	1,124,092,001	10.87
	ナイジェリア	51,420,032	0.50
セルビア	26,461,462	0.26	
	小計	9,930,142,193	96.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	412,572,436	3.99
合計(純資産総額)		10,342,714,629	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 (二) 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31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	3,442,604	0.46
新株予約権付社債券等	アメリカ	2,298,782	0.31
特殊債券	アメリカ	1,128,507	0.15
社債券	アメリカ	683,070,825	90.90
	カナダ	3,304,163	0.44
	ドイツ	2,324,280	0.31
	ルクセンブルク	2,086,268	0.28
	小計	690,785,536	91.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	53,767,107	7.16
合計(純資産総額)		751,422,536	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。

（注3）株式には優先証券を含みます。

（2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成31年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）	510,986,748	1.4789	755,699,251	1.5116	772,407,568	34.00
2	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）	513,310,893	1.4526	745,636,097	1.4765	757,903,533	33.36
3	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）	337,104,787	2.1852	736,642,245	2.2290	751,406,570	33.07

（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31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	国債 証券	US T-NOTE 2.875% OCT23	3,058,700	11,327.12	346,462,743	11,390.18	348,391,474	2.875	2023/10/31	3.56
2	アメリカ	アメリカ	国債 証券	US T-NOTE 2.375% FEB24	2,940,000	11,114.96	326,779,904	11,157.35	328,026,273	2.375	2024/2/29	3.35
3	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	FNCL 3.5% MAY49 TBA	2,050,000	11,236.41	230,346,457	11,227.72	230,168,362	3.5	2049/5/1	2.35
4	オーストラリア	オーストラリア	国債 証券	AUSTRALIA2.75% NOV28 152	2,000,000	8,420.81	168,416,302	8,511.58	170,231,795	2.75	2028/11/21	1.74
5	イギリス	イギリス	国債 証券	UK GOVT 4.25% DEC40	780,000	21,347.11	166,507,473	21,597.11	168,457,530	4.25	2040/12/7	1.72
6	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	G2SF 4.5% MAY49 TBA	1,350,000	11,507.46	155,350,743	11,523.10	155,561,850	4.5	2049/5/1	1.59
7	アメリカ	アメリカ	国債 証券	US T-NOTE 2.375% MAR21	1,210,000	11,096.54	134,268,180	11,121.73	134,573,024	2.375	2021/3/15	1.37
8	カナダ	カナダ	国債 証券	CANADA GOVT 3.25% JUN21	1,550,000	8,629.14	133,751,791	8,627.98	133,733,693	3.25	2021/6/1	1.37
9	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	FGLMC 3.5% MAY49 TBA	1,180,000	11,236.41	132,589,667	11,234.67	132,569,165	3.5	2049/5/1	1.35
10	フランス	フランス	特殊 債券	UNEDIC 0.25% EMTN	1,000,000	12,663.47	126,634,792	12,708.92	127,089,268	0.25	2023/11/24	1.30

11	イタリア	イタリア	国債証券	ITALY BTP 0.05% OCT19	1,000,000	12,526.88	125,268,860	12,524.75	125,247,576	0.05	2019/10/15	1.28
12	イタリア	イタリア	国債証券	ITALY BTP 3.85% SEP49	916,000	12,929.15	118,431,047	13,323.90	122,047,008	3.85	2049/9/1	1.25
13	アメリカ	アメリカ	特殊債券	FNCL 4.0% MAY49 TBA	1,050,000	11,404.95	119,751,975	11,408.42	119,788,462	4	2049/5/1	1.22
14	アメリカ	アメリカ	国債証券	US T-NOTE 1.75% DEC20	1,045,000	10,973.18	114,669,744	10,999.24	114,942,097	1.75	2020/12/31	1.17
15	アメリカ	アメリカ	特殊債券	FNCL 4.5% MAY49 TBA	900,000	11,552.63	103,973,737	11,561.32	104,051,925	4.5	2049/5/1	1.06
16	アメリカ	アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.875% NOV21	905,000	11,239.71	101,719,401	11,273.76	102,027,607	2.875	2021/11/15	1.04
17	イギリス	イギリス	国債証券	UK GOVT 2% SEP25	650,000	15,474.76	100,586,004	15,535.42	100,980,241	2	2025/9/7	1.03
18	イタリア	イタリア	社債券	INTESA SANPAOLO 0.5%	800,000	12,536.27	100,290,208	12,539.53	100,316,250	0.5	2020/2/3	1.02
19	アメリカ	アメリカ	特殊債券	FNCL 3.0% MAY34 TBA	880,000	11,173.86	98,329,990	11,182.55	98,406,440	3	2034/5/1	1.00
20	アメリカ	アメリカ	特殊債券	FGLMC 4.0% MAY49 TBA	840,000	11,413.63	95,874,555	11,418.85	95,918,340	4	2049/5/1	0.98
21	カナダ	カナダ	地方債証券	ONTARIO 2.6%	1,090,000	8,476.19	92,390,494	8,521.39	92,883,205	2.6	2025/6/2	0.95
22	アメリカ	アメリカ	国債証券	US T-BOND 3% FEB47	813,100	11,111.31	90,346,082	11,331.97	92,140,288	3	2047/2/15	0.94
23	フランス	フランス	国債証券	FRANCE OAT 0.75% MAY28	679,900	12,985.11	88,285,817	13,114.19	89,163,440	0.75	2028/5/25	0.91
24	スペイン	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT 1.5% APR27	660,000	13,150.75	86,795,001	13,225.37	87,287,487	1.5	2027/4/30	0.89
25	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	8,610.91	81,803,731	8,614.16	81,834,584	5.75	2021/5/15	0.84
26	フランス	フランス	国債証券	FRANCE OAT 3.25% MAY45	424,800	17,806.29	75,641,153	18,278.07	77,645,254	3.25	2045/5/25	0.79
27	オーストラリア	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA 4.25% APR26 142	840,000	9,182.49	77,132,987	9,242.77	77,639,329	4.25	2026/4/21	0.79
28	イギリス	イギリス	国債証券	UK GOVT 4.25% DEC55	300,000	24,957.25	74,871,774	25,444.88	76,334,643	4.25	2055/12/7	0.78
29	アメリカ	アメリカ	国債証券	US T-NOTE 2.875% AUG28	650,000	11,350.18	73,776,196	11,470.97	74,561,337	2.875	2028/8/15	0.76
30	アメリカ	ポーランド	国債証券	POLAND USD 3% MAR23	650,000	11,093.86	72,110,142	11,180.60	72,673,926	3	2023/3/17	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31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	24,430,000	3,068.59	749,657,912	3,090.21	754,939,725	10	2021/1/1	7.30
2	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN23 NTNF	17,458,000	3,097.16	540,702,195	3,122.66	545,154,579	10	2023/1/1	5.27
3	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 7.25% DEC21	74,000,000	575.88	426,157,186	578.18	427,859,956	7.25	2021/12/9	4.14
4	インドネシア	インドネシア	国債証券	INDON 9% MAR29 FR71	46,542,000,000	0.83	389,555,189	0.85	397,721,402	9	2029/3/15	3.85
5	コロンビア	コロンビア	国債証券	COLOMBIA TES 6% APR28	11,222,500,000	3.42	384,895,367	3.49	392,725,776	6	2028/4/28	3.80
6	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 6.5% JUN22	63,980,000	561.85	359,473,498	564.75	361,328,777	6.5	2022/6/9	3.49
7	南アフリカ	南アフリカ	国債証券	S.AFRICA 10.5% DEC26 R186	39,456,829	869.37	343,027,977	877.07	346,066,405	10.5	2026/12/21	3.35
8	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL I/L 6% AUG22 NTNB	3,166,000	9,872.68	312,569,068	9,958.07	315,272,513	6	2022/8/15	3.05
9	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 7.5% JUN27	50,600,000	565.18	285,984,662	570.25	288,547,962	7.5	2027/6/3	2.79
10	インドネシア	インドネシア	国債証券	INDON 8.25% MAY36 FR72	29,435,000,000	0.77	229,427,487	0.80	235,494,363	8.25	2036/5/15	2.28
11	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN25 NTNF	6,940,000	3,101.72	215,259,451	3,133.12	217,439,035	10	2025/1/1	2.10
12	南アフリカ	南アフリカ	国債証券	S.AFRICA 8.75% FEB48 2048	28,920,711	714.99	206,780,712	723.22	209,162,957	8.75	2048/2/28	2.02

13	チリ	チリ	国債証券	CHILE GOVT 4.5% MAR26	1,190,000,000	17.21	204,855,482	17.44	207,578,628	4.5	2026/3/1	2.01
14	ロシア	ロシア	国債証券	RUSSIA 8.15% FEB27 6207	116,550,000	171.55	199,942,247	172.74	201,337,351	8.15	2027/2/3	1.95
15	ポーランド	ポーランド	国債証券	POLAND 2.5% JUL26 0726	6,317,000	2,901.25	183,272,217	2,899.88	183,185,493	2.5	2026/7/25	1.77
16	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 10% DEC24	26,836,600	640.74	171,954,365	644.23	172,891,674	10	2024/12/5	1.67
17	インドネシア	インドネシア	国債証券	INDON 7% MAY27 FR59	21,302,000,000	0.73	157,550,849	0.76	162,471,526	7	2027/5/15	1.57
18	ポーランド	ポーランド	国債証券	POLAND 2.75% APR28 0428	5,569,000	2,911.09	162,119,037	2,901.66	161,593,611	2.75	2028/4/25	1.56
19	南アフリカ	南アフリカ	国債証券	S.AFRICA 7% FEB31 R213	23,210,000	659.57	153,086,764	666.76	154,756,881	7	2031/2/28	1.50
20	ポーランド	ポーランド	国債証券	POLAND GOVT 4% OCT23	4,840,000	3,163.53	153,114,882	3,155.87	152,744,476	4	2023/10/25	1.48
21	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN27 NTNF	4,690,000	3,101.88	145,478,437	3,128.53	146,728,398	10	2027/1/1	1.42
22	タイ	タイ	国債証券	THAI GOVT 3.775% JUN32	37,900,000	383.85	145,479,582	386.88	146,627,694	3.775	2032/6/25	1.42
23	コロンビア	コロンビア	国債証券	COLOMBIA TES 7.25% OCT34	3,630,000,000	3.62	131,458,663	3.71	134,793,487	7.25	2034/10/18	1.30
24	ドイツ	ロシア	国債証券	RUSSIA 7.6% APR21 6205	74,800,000	171.31	128,147,188	170.97	127,890,093	7.6	2021/4/14	1.24
25	南アフリカ	南アフリカ	国債証券	S.AFRICA 8.25% MAR32 2032	16,400,872	720.88	118,231,529	728.72	119,516,500	8.25	2032/3/31	1.16
26	アメリカ	ペルー	国債証券	PERU GOVT 6.95% AUG31 GDN	3,025,000	3,731.94	112,891,417	3,811.40	115,295,012	6.95	2031/8/12	1.11
27	マレーシア	マレーシア	国債証券	MALAYSIA 4.059% SEP24	4,100,000	2,752.02	112,832,949	2,760.13	113,165,658	4.059	2024/9/30	1.09
28	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 10% NOV36	16,607,300	669.87	111,247,763	676.60	112,365,914	10	2036/11/20	1.09
29	マレーシア	マレーシア	国債証券	MALAYSIA 4.642% NOV33	3,900,000	2,823.21	110,105,244	2,873.90	112,082,447	4.642	2033/11/7	1.08
30	ポーランド	ポーランド	国債証券	POLAND 2.75% OCT29 1029	3,860,000	2,892.72	111,659,023	2,875.92	111,010,859	2.75	2029/10/25	1.07

(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31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	SPRINT 7.625% 26	72,000	11,356.41	8,176,616	11,269.00	8,113,686	7.625	2026/3/1	1.08
2	アメリカ	アメリカ	社債券	JBS USA 5.75% REGS	67,000	10,844.12	7,265,561	11,317.93	7,583,017	5.75	2025/6/15	1.01
3	アメリカ	アメリカ	社債券	ALLY FINANCIAL 5.75%	63,000	11,583.29	7,297,477	11,852.36	7,466,989	5.75	2025/11/20	0.99
4	アメリカ	アメリカ	社債券	ALBERTSONS 6.625%	60,000	10,627.82	6,376,697	11,332.72	6,799,635	6.625	2024/6/15	0.90
5	アメリカ	アメリカ	社債券	SUMMIT MATE 5.125% REGS	62,000	10,102.52	6,263,563	10,842.44	6,722,316	5.125	2025/6/1	0.89
6	アメリカ	アメリカ	社債券	EMBARQ CORP 7.995%	60,000	10,347.93	6,208,763	10,842.77	6,505,667	7.995	2036/6/1	0.87
7	アメリカ	アメリカ	社債券	CCO HOLDINGS 5.125%	57,000	11,133.23	6,345,942	11,280.57	6,429,927	5.125	2023/2/15	0.86
8	アメリカ	カナダ	社債券	GW HONOS 8.75% REGS	60,000	10,130.20	6,078,125	10,646.84	6,388,106	8.75	2025/5/15	0.85
9	アメリカ	アメリカ	社債券	CVR PARTNERS 9.25% REGS	49,000	11,604.99	5,686,448	11,713.47	5,739,603	9.25	2023/6/15	0.76
10	アメリカ	アメリカ	社債券	DYNEGY 5.875%	48,000	11,243.09	5,396,687	11,334.50	5,440,562	5.875	2023/6/1	0.72
11	アメリカ	アメリカ	社債券	DISH DBS 6.75%	44,000	11,142.24	4,902,586	11,440.14	5,033,664	6.75	2021/6/1	0.67
12	アメリカ	アメリカ	社債券	CORTES NP 9.25% REGS	45,000	10,226.28	4,601,828	10,820.42	4,869,192	9.25	2024/10/15	0.65
13	アメリカ	アメリカ	社債券	SPRINT 7.25%	40,000	11,423.24	4,569,297	11,605.94	4,642,378	7.25	2021/9/15	0.62
14	アメリカ	アメリカ	社債券	FREEMPORT-MC 3.875%	38,000	10,493.94	3,987,699	11,014.91	4,185,668	3.875	2023/3/15	0.56
15	アメリカ	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS 5.25%	35,000	10,430.56	3,650,696	11,307.37	3,957,580	5.25	2024/6/1	0.53
16	アメリカ	アメリカ	社債券	INTELSAT 5.5%	39,000	9,993.75	3,897,564	10,105.30	3,941,067	5.5	2023/8/1	0.52
17	アメリカ	アメリカ	社債券	HCA INC 5.375%	33,000	11,195.83	3,694,627	11,741.94	3,874,841	5.375	2025/2/1	0.52
18	アメリカ	アメリカ	社債券	AMERICAN AXLE 6.25%	34,000	10,459.23	3,556,139	11,035.26	3,751,990	6.25	2025/4/1	0.50
19	アメリカ	アメリカ	社債券	BAUSCH HEALTH 5.875% REGS	33,000	10,606.25	3,500,064	11,208.06	3,698,663	5.875	2023/5/15	0.49

20	アメリカ	カナダ	社債券	BOMBARDIER 7.5% 24 REGS	32,000	11,293.90	3,614,052	11,463.83	3,668,426	7.5	2024/12/1	0.49
21	アメリカ	アメリカ	社債券	SCIENTIFIC GAMES 5% REGS	33,000	10,488.54	3,461,221	10,985.56	3,625,235	5	2025/10/15	0.48
22	アメリカ	アメリカ	社債券	SPRINGLEAF FIN 7.125%	31,000	10,735.94	3,328,144	11,489.29	3,561,682	7.125	2026/3/15	0.47
23	アメリカ	アメリカ	社債券	INTELSAT 8.5% REGS	32,000	11,120.22	3,558,471	11,009.13	3,522,923	8.5	2024/10/15	0.47
24	アメリカ	アメリカ	社債券	DELL INTL 7.125% REGS	30,000	11,298.59	3,389,577	11,727.15	3,518,146	7.125	2024/6/15	0.47
25	アメリカ	アメリカ	社債券	HCA HEALTHCARE 6.25%	30,000	11,425.02	3,427,506	11,647.42	3,494,226	6.25	2021/2/15	0.47
26	アメリカ	アメリカ	社債券	HILCORP NRG 5% REGS	32,000	10,144.44	3,246,222	10,877.91	3,480,934	5	2024/12/1	0.46
27	アメリカ	アメリカ	社債券	ANTERO RESCS 5.125%	31,000	11,001.87	3,410,581	11,139.01	3,453,094	5.125	2022/12/1	0.46
28	アメリカ	アメリカ	社債券	ENTERPRISE 12% REGS	30,000	10,366.89	3,110,070	11,351.52	3,405,456	12	2024/7/15	0.45
29	アメリカ	アメリカ	社債券	REYNOLDS GP 5.125% REGS	30,000	10,848.23	3,254,469	11,271.23	3,381,370	5.125	2023/7/15	0.45
30	アメリカ	アメリカ	社債券	ADT 4.125%	31,000	10,522.30	3,261,913	10,738.58	3,328,961	4.125	2023/6/15	0.44

(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 (二) ファンドの特色」の記載に基づき、どこか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31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31年4月10日現在）

種類	投資比率（％）
国債証券	43.56
地方債証券	1.42
特殊債券	14.92
社債券	32.42

（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31年4月10日現在）

種類	投資比率（％）
国債証券	96.01

（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31年4月10日現在）

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（％）
株式	外国	小売	0.42
		電気通信サービス	0.04
小計			0.46
新株予約権付社債券等	-		0.31
特殊債券	-		0.15
社債券	-		91.93

（注）株式には優先証券を含みます。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（3）運用実績

純資産の推移

平成31年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
第24特定期間末	(平成30年 9月10日)	2,314	2,321	0.6652	0.6672
第25特定期間末	(平成31年 3月11日)	2,252	2,258	0.6737	0.6757
	平成30年 4月末日	2,479	-	0.6985	-
	平成30年 5月末日	2,386	-	0.6754	-
	平成30年 6月末日	2,388	-	0.6767	-
	平成30年 7月末日	2,426	-	0.6879	-
	平成30年 8月末日	2,340	-	0.6716	-
	平成30年 9月末日	2,401	-	0.6901	-
	平成30年10月末日	2,352	-	0.6776	-
	平成30年11月末日	2,337	-	0.6786	-
	平成30年12月末日	2,230	-	0.6583	-
	平成31年 1月末日	2,253	-	0.6672	-
	平成31年 2月末日	2,282	-	0.6819	-
	平成31年 3月末日	2,264	-	0.6794	-
	平成31年 4月10日	2,272	2,278	0.6839	0.6859

(注) 純資産総額(分配付)および1口当たり純資産額(分配付)は特定期間末日のものです。なお、平成31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150期計算期間末日のものです。

分配の推移

期	1口当たり分配金(円)
第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
第24特定期間	0.0120
第25特定期間	0.0120

収益率の推移

期	収益率（％）
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
第24特定期間	2.5
第25特定期間	3.1

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

（４）設定及び解約の実績

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

期	設定口数（口）	解約口数（口）	残存口数（口）
第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
第24特定期間	32,228,730	116,723,306	3,480,171,208
第25特定期間	25,645,789	162,659,036	3,343,157,961

(注) 設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

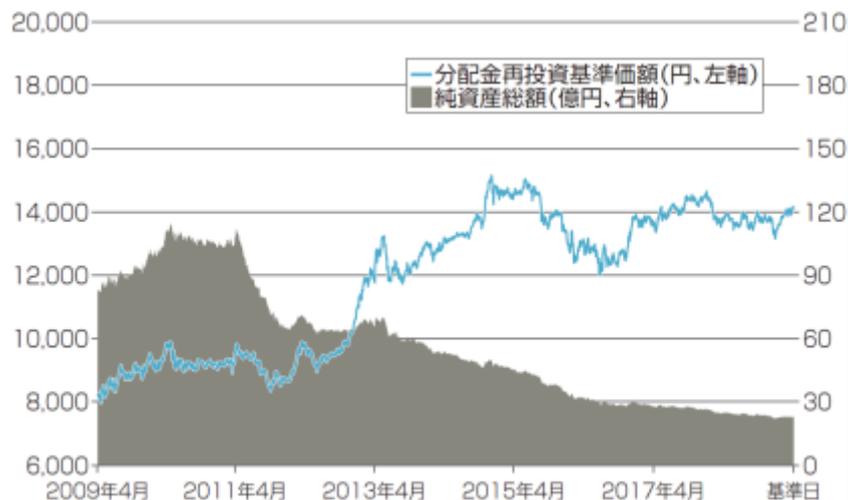
<参考情報>

最新の運用実績は、委託会社ホームページ（<https://www.jpmorganasset.co.jp/>）、または販売会社でご確認いただけます。
過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準日	2019年4月10日	設定日	2006年9月29日
純資産総額	22億円	決算回数	年12回

JPM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
146期	2018年12月	20
147期	2019年1月	20
148期	2019年2月	20
149期	2019年3月	20
150期	2019年4月	20
	設定来累計	5,275

* 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

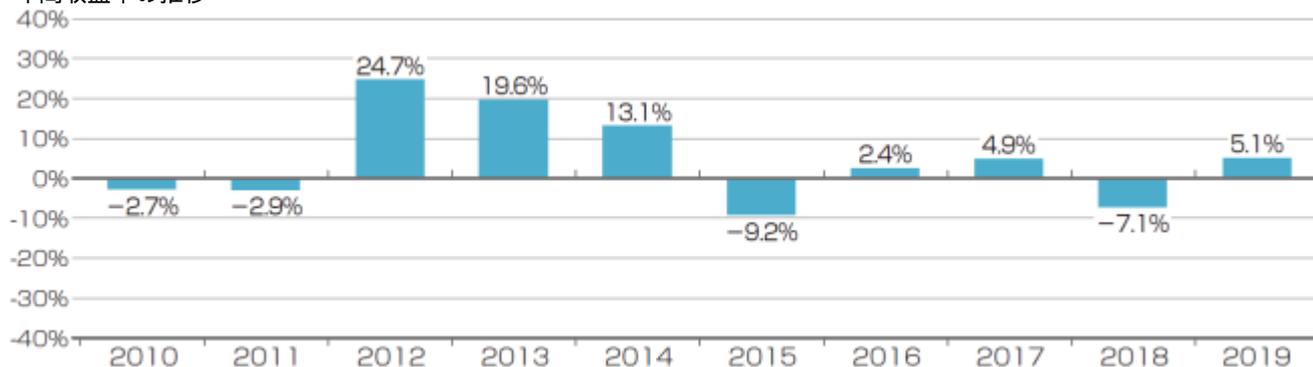
資産の種類	投資比率
G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）	34.0%
G I M世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）	33.4%
G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）	33.1%
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-0.5%
合計（純資産総額）	100.0%

* 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	47.7%
ユーロ	9.1%
ブラジルリアル	6.9%
メキシコペソ	5.8%
南アフリカランド	3.7%
その他	21.3%

年間収益率の推移



* 年間収益率(%) = { (年末営業日の基準価額 + その年に支払われた税引前の分配金) ÷ 前年末営業日の基準価額 - 1 } × 100

* 2019年の年間収益率は前年末営業日から2019年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、JPM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	アメリカ国債	国債証券	2.875	2023/10/31	アメリカ	米ドル	1.2%
2	アメリカ国債	国債証券	2.375	2024/ 2 /29	アメリカ	米ドル	1.1%
3	ファニーメイ	特殊債券	3.500	2049/ 5 / 1	アメリカ	米ドル	0.8%
4	オーストラリア国債	国債証券	2.750	2028/11/21	オーストラリア	オーストラリアドル	0.6%
5	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%
6	ジニーメイ	特殊債券	4.500	2049/ 5 / 1	アメリカ	米ドル	0.5%
7	アメリカ国債	国債証券	2.375	2021/ 3 /15	アメリカ	米ドル	0.5%
8	カナダ国債	国債証券	3.250	2021/ 6 / 1	カナダ	カナダドル	0.5%
9	フレディマック	特殊債券	3.500	2049/ 5 / 1	アメリカ	米ドル	0.5%
10	フランス全国商工業雇用連合	特殊債券	0.250	2023/11/24	フランス	ユーロ	0.4%

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	10.000	2021/ 1 / 1	ブラジル	ブラジルリアル	2.5%
2	ブラジル国債	国債証券	10.000	2023/ 1 / 1	ブラジル	ブラジルリアル	1.8%
3	メキシコ国債	国債証券	7.250	2021/12/ 9	メキシコ	メキシコペソ	1.4%
4	インドネシア国債	国債証券	9.000	2029/ 3 /15	インドネシア	インドネシアルピア	1.3%
5	コロンビア国債	国債証券	6.000	2028/ 4 /28	コロンビア	コロンビアペソ	1.3%
6	メキシコ国債	国債証券	6.500	2022/ 6 / 9	メキシコ	メキシコペソ	1.2%
7	南アフリカ国債	国債証券	10.500	2026/12/21	南アフリカ	南アフリカランド	1.1%
8	ブラジル国債	国債証券	6.000	2022/ 8 /15	ブラジル	ブラジルリアル	1.0%
9	メキシコ国債	国債証券	7.500	2027/ 6 / 3	メキシコ	メキシコペソ	0.9%
10	インドネシア国債	国債証券	8.250	2036/ 5 /15	インドネシア	インドネシアルピア	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	スプリント	社債券	7.625	2026/ 3 / 1	アメリカ	米ドル	0.4%
2	JBS USA LUX/JBS USAファイナンス	社債券	5.750	2025/ 6 /15	アメリカ	米ドル	0.3%
3	アライ・ファイナンシャル	社債券	5.750	2025/11/20	アメリカ	米ドル	0.3%
4	アルパートソンズ/セーフウェイ/ニューAbs	社債券	6.625	2024/ 6 /15	アメリカ	米ドル	0.3%
5	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%
6	エンパーク	社債券	7.995	2036/ 6 / 1	アメリカ	米ドル	0.3%
7	CCOホールディングス/キャピタル	社債券	5.125	2023/ 2 /15	アメリカ	米ドル	0.3%
8	ガルダ・ワールド・セキュリティ	社債券	8.750	2025/ 5 /15	カナダ	米ドル	0.3%
9	CVRパートナーズ/CVRナイトロジェン・ファイナンス	社債券	9.250	2023/ 6 /15	アメリカ	米ドル	0.3%
10	ピストラ・エナジー	社債券	5.875	2023/ 6 / 1	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 2 【管理及び運営】

1 【申込（販売）手続等】

申込取扱場所

< 訂正前 >

申込期間中、販売会社において申込みを取扱います。

販売会社に関しては、以下の照会先までお問い合わせください。

照会先：

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

TEL：03 - 6736 - 2350（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

HPアドレス：<http://www.jpmorganasset.co.jp/>

< 訂正後 >

申込期間中、販売会社において申込みを取扱います。

販売会社に関しては、以下の照会先までお問い合わせください。

照会先：

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

TEL：03 - 6736 - 2350（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

HPアドレス：<https://www.jpmorganasset.co.jp/>

3 【資産管理等の概要】

< 訂正前 >

(1) 資産の評価

(略)

販売会社に関しては、以下の照会先までお問い合わせください。

照会先：

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

TEL：03 - 6736 - 2350（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

HPアドレス：<http://www.jpmorganasset.co.jp/>

(略)

(5) その他

(略)

運用報告書

委託会社は、当ファンドについて、3月、9月の計算期間終了日毎および償還時に、運用経過、信託財産の内容、有価証券の売買状況等を記載した運用報告書および運用報告書に記載すべき事項のうち重要な事項のみを記載した交付運用報告書を作成します。そのうえで、委託会社は交付運用報告書を知れている受益者に対して販売会社を通して交付します。また、運用報告書のすべての内容を委託会社のホームページに掲載します。これにより、委託会社は運用報告書を知れている受益者に対して交付したものとみなされますが、受益者から書面による運用報告書の交付の請求があった場合には、販売会社を通して交付します。

HPアドレス：<http://www.jpmorganasset.co.jp/>

(以下略)

< 訂正後 >

(1) 資産の評価

(略)

販売会社に関しては、以下の照会先までお問い合わせください。

照会先：

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

TEL：03 - 6736 - 2350（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

HPアドレス：<https://www.jpmorganasset.co.jp/>

（略）

（5）その他

（略）

運用報告書

委託会社は、当ファンドについて、3月、9月の計算期間終了日毎および償還時に、運用経過、信託財産の内容、有価証券の売買状況等を記載した運用報告書および運用報告書に記載すべき事項のうち重要な事項のみを記載した交付運用報告書を作成します。そのうえで、委託会社は交付運用報告書を知れている受益者に対して販売会社を通して交付します。また、運用報告書のすべての内容を委託会社のホームページに掲載します。これにより、委託会社は運用報告書を知れている受益者に対して交付したものとみなされますが、受益者から書面による運用報告書の交付の請求があった場合には、販売会社を通して交付します。

HPアドレス：<https://www.jpmorganasset.co.jp/>

（以下略）

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25特定期間（平成30年9月11日から平成31年3月11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30年9月10日現在)	当期 (平成31年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	2,325,004,678	2,261,664,268
未収入金	1,337,521	169
流動資産合計	2,326,342,199	2,261,664,437
資産合計	2,326,342,199	2,261,664,437
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	6,960,342	6,686,315
未払解約金	1,337,521	169
未払受託者報酬	107,726	91,075
未払委託者報酬	3,016,296	2,550,123
その他未払費用	43,080	36,420
流動負債合計	11,464,965	9,364,102
負債合計	11,464,965	9,364,102
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,480,171,208	1 3,343,157,961
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 1,165,293,974	2 1,090,857,626
（分配準備積立金）	266,276,972	258,780,004
元本等合計	2,314,877,234	2,252,300,335
純資産合計	2,314,877,234	2,252,300,335
負債純資産合計	2,326,342,199	2,261,664,437

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 (自 平成30年 3月13日 至 平成30年 9月10日)	当期 (自 平成30年 9月11日 至 平成31年 3月11日)
営業収益		
有価証券売買等損益	40,634,096	89,204,586
営業収益合計	40,634,096	89,204,586
営業費用		
受託者報酬	651,570	620,910
委託者報酬	¹ 18,243,936	¹ 17,385,456
その他費用	260,564	248,304
営業費用合計	19,156,070	18,254,670
営業利益又は営業損失()	59,790,166	70,949,916
経常利益又は経常損失()	59,790,166	70,949,916
当期純利益又は当期純損失()	59,790,166	70,949,916
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()	89,162	183,734
期首剰余金又は期首欠損金()	1,089,861,057	1,165,293,974
剰余金増加額又は欠損金減少額	36,867,723	52,865,520
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	36,867,723	52,865,520
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,295,913	8,318,313
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,295,913	8,318,313
分配金	² 42,303,723	² 40,877,041
期末剰余金又は期末欠損金()	1,165,293,974	1,090,857,626

(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31年3月10日が休日のため、信託約款第41条により、第25特定期間末日を平成31年3月11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30年9月10日現在)	当期 (平成31年3月11日現在)
1 期首元本額	3,564,665,784円	3,480,171,208円
期中追加設定元本額	32,228,730円	25,645,789円
期中一部解約元本額	116,723,306円	162,659,036円
2 元本の欠損	1,165,293,974円	1,090,857,626円
受益権の総数	3,480,171,208口	3,343,157,961口
1 口当たりの純資産額	0.6652円	0.6737円
(1 万口当たりの純資産額)	(6,652円)	(6,737円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	前期 (自 平成30年 3月13日 至 平成30年 9月10日)	当期 (自 平成30年 9月11日 至 平成31年 3月11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	<p>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</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) 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） 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> <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) 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） 同左</p> <p>上記それぞれに算出した額の合計額</p>
2 分配金の計算過程	<p>(自 平成30年 3月13日 至 平成30年 4月10日)</p> <p>費用控除後の配当等収益額 5,857,531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 35,694,371円</p> <p>分配準備積立金額 272,948,724円</p> <p>当ファンドの分配対象収益額 314,500,626円</p> <p>当ファンドの期末残存口数 3,561,428,837口</p>	<p>(自 平成30年 9月11日 至 平成30年10月10日)</p> <p>8,423,842円</p> <p>- 円</p> <p>37,301,200円</p> <p>265,488,626円</p> <p>311,213,668円</p> <p>3,472,286,523口</p>

1万口当たり収益分配対象額	883.07円	896.27円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	7,122,857円	6,944,573円
	(自 平成30年4月11日 至 平成30年5月10日)	(自 平成30年10月11日 至 平成30年11月12日)
費用控除後の配当等収益額	6,037,112円	6,103,597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	35,742,110円	38,116,310円
分配準備積立金額	270,086,374円	265,930,141円
当ファンドの分配対象収益額	311,865,596円	310,150,048円
当ファンドの期末残存口数	3,543,309,382口	3,469,469,808口
1万口当たり収益分配対象額	880.15円	893.94円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	7,086,618円	6,938,939円
	(自 平成30年5月11日 至 平成30年6月11日)	(自 平成30年11月13日 至 平成30年12月10日)
費用控除後の配当等収益額	6,291,964円	4,851,882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	35,763,251円	37,602,147円
分配準備積立金額	267,189,897円	259,380,437円
当ファンドの分配対象収益額	309,245,112円	301,834,466円
当ファンドの期末残存口数	3,521,859,240口	3,397,629,630口
1万口当たり収益分配対象額	878.07円	888.36円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	7,043,718円	6,795,259円
	(自 平成30年6月12日 至 平成30年7月10日)	(自 平成30年12月11日 至 平成31年1月10日)
費用控除後の配当等収益額	13,620,146円	11,143,497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	37,245,277円	37,629,073円
分配準備積立金額	265,575,717円	256,275,681円
当ファンドの分配対象収益額	316,441,140円	305,048,251円
当ファンドの期末残存口数	3,528,678,091口	3,384,433,435口
1万口当たり収益分配対象額	896.76円	901.32円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	7,057,356円	6,768,866円
	(自 平成30年7月11日 至 平成30年8月10日)	(自 平成31年1月11日 至 平成31年2月12日)
費用控除後の配当等収益額	5,898,755円	8,736,564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	37,387,278円	37,669,927円

分配準備積立金額	270,935,037円	259,484,029円
当ファンドの分配対象収益額	314,221,070円	305,890,520円
当ファンドの期末残存口数	3,516,416,127口	3,371,544,998口
1万口当たり収益分配対象額	893.58円	907.27円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	7,032,832円	6,743,089円
	(自 平成30年8月11日 至 平成30年9月10日)	(自 平成31年2月13日 至 平成31年3月11日)
費用控除後の配当等収益額	6,382,545円	6,489,519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	37,193,023円	37,674,922円
分配準備積立金額	266,854,769円	258,976,800円
当ファンドの分配対象収益額	310,430,337円	303,141,241円
当ファンドの期末残存口数	3,480,171,208口	3,343,157,961口
1万口当たり収益分配対象額	891.99円	906.75円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	6,960,342円	6,686,315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30年9月10日現在)	当期 (平成31年3月11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	40,868,802	10,120,559
合計	40,868,802	10,120,559

（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31年 3月11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)	518,699,377	753,462,715	
		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)	516,268,546	763,664,433	
		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)	340,686,886	744,537,120	
合計			1,375,654,809	2,261,664,268	

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30年9月10日現在)	(平成31年3月11日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		1,395,098,892	1,396,197,110
コール・ローン		28,760,839	25,528,535
国債証券		4,511,838,987	4,485,650,116
地方債証券		130,381,317	136,433,578
特殊債券		2,224,565,072	785,002,532
社債券		3,429,974,452	3,264,429,274
派生商品評価勘定		48,711,416	33,380,729
未収入金		1,439,095,029	1,234,634,898
未収利息		66,373,972	62,692,241
前払費用		9,592,878	11,060,896
流動資産合計		13,284,392,854	11,435,009,909
資産合計		13,284,392,854	11,435,009,909
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		61,442,301	35,919,286
未払金		2,975,507,493	1,647,268,551
未払解約金		905,840	56
未払利息		73	32
流動負債合計		3,037,855,707	1,683,187,925
負債合計		3,037,855,707	1,683,187,925
純資産の部			
元本等			
元本	1	7,165,665,362	6,713,371,944
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,080,871,785	3,038,450,040
元本等合計		10,246,537,147	9,751,821,984
純資産合計		10,246,537,147	9,751,821,984
負債純資産合計		13,284,392,854	11,435,009,909

(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30年9月10日現在)	(平成31年3月11日現在)
1期首元本額	7,932,507,382円	7,165,665,362円
期中追加設定元本額	61,560,627円	70,917,082円
期中解約元本額	828,402,647円	523,210,500円
元本の内訳（注）		
JP Mグローバル債券3分散ファンド （毎月決算型）	549,183,943円	518,699,377円
G I M世界投資適格債券ファンドF （適格機関投資家専用）	6,563,137,658円	6,194,672,567円
G I M世界投資適格債券ファンドF 1 （適格機関投資家専用）	53,343,761円	- 円
合計	7,165,665,362円	6,713,371,944円
受益権の総数	7,165,665,362口	6,713,371,944口
1口当たりの純資産額	1.4299円	1.4526円
（1万口当たりの純資産額）	（14,299円）	（14,526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30年 9月10日現在)	(平成31年 3月11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	35,543,638	65,259,814
地方債証券	182,504	3,811,219
特殊債券	3,284,062	402,576
社債券	26,197,418	28,704,788
合計	64,842,614	98,178,397

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

区分	種類	（平成30年9月10日現在）				（平成31年3月11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	2,442,573,721	-	2,445,452,052	2,878,331	1,977,507,826	-	1,983,492,303	5,984,477
	カナダドル	573,852,226	-	569,713,310	4,138,916	580,461,822	-	575,020,656	5,441,166
	ユーロ	856,030,032	-	857,318,621	1,288,589	651,050,972	-	645,946,384	5,104,588
	英ポンド	625,843,641	-	629,781,365	3,937,724	280,314,200	-	280,332,854	18,654
	スウェーデンクロー ネ	-	-	-	-	5,865,159	-	5,702,292	162,867
	ノルウェークローネ	576,184,176	-	571,930,015	4,254,161	614,575,936	-	608,868,840	5,707,096
	デンマーククローネ	12,985,079	-	13,191,005	205,926	-	-	-	-
	チェココルナ	12,336,202	-	12,548,863	212,661	12,136,281	-	12,196,791	60,510
	ハンガリーフォリン ト	9,292,814	-	9,348,956	56,142	9,302,877	-	9,348,956	46,079
	ポーランドズロチ	15,736,005	-	15,765,218	29,213	-	-	-	-
	オーストラリアドル	730,848,250	-	718,639,391	12,208,859	395,684,249	-	392,711,860	2,972,389
	ニュージーランドド ル	8,923,697	-	8,886,297	37,400	316,472,204	-	316,371,035	101,169
	香港ドル	-	-	-	-	32,864,046	-	32,902,684	38,638
	シンガポールドル	25,474,560	-	25,484,483	9,923	25,805,371	-	25,849,000	43,629
	タイバーツ	36,759,704	-	37,235,246	475,542	38,879,356	-	38,447,044	432,312
	イスラエル・シケ ル	24,909,465	-	25,736,194	826,729	13,903,861	-	13,968,098	64,237
	売建								
	アメリカドル	2,021,988,801	-	2,020,853,360	1,135,441	2,364,363,912	-	2,367,825,029	3,461,117
	カナダドル	544,452,508	-	539,048,681	5,403,827	357,303,177	-	352,645,806	4,657,371
	ユーロ	1,739,232,739	-	1,756,456,783	17,224,044	910,540,943	-	907,796,753	2,744,190
	英ポンド	558,313,847	-	558,960,887	647,040	371,530,747	-	375,976,016	4,445,269
	スウェーデンクロー ネ	40,773,921	-	41,347,252	573,331	46,933,552	-	46,435,733	497,819
	ノルウェークローネ	436,150,457	-	437,084,633	934,176	338,304,125	-	334,086,422	4,217,703
	ポーランドズロチ	11,329,535	-	11,448,996	119,461	-	-	-	-
	オーストラリアドル	588,208,044	-	576,953,346	11,254,698	296,316,975	-	291,553,491	4,763,484
ニュージーランドド ル	-	-	-	-	269,530,729	-	267,378,104	2,152,625	
イスラエル・シケ ル	11,299,720	-	11,607,963	308,243	-	-	-	-	
合計		11,903,499,144	-	11,894,792,917	12,730,885	9,909,648,320	-	9,884,856,151	2,538,557

（注）1．為替予約の時価の算定方法

（1）対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は当該為替予約は当該仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・当該日を越える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。
- ・当該日を越える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値により評価しております。

（2）対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値により評価しております。

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等および時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表（平成31年3月11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 4.125%OCT47REGS		200,000.00	195,700.00	
		BERMUDA 4.75% FEB29 REGS		210,000.00	219,962.40	
		HUNGARY USD 5.375% MAR24		100,000.00	108,325.00	
		INDNSA 5.375% OCT23 REGS		400,000.00	428,500.00	
		KUWAIT 2.75% MAR22 REGS		280,000.00	277,502.40	
		MEXICO USD 4.15% MAR27		210,000.00	207,473.70	
		POLAND USD 3% MAR23		650,000.00	648,472.50	
		QATAR USD4.5% APR28 REGS		200,000.00	209,310.00	
		QATAR USD4.817%MAR49REGS		200,000.00	200,140.00	
		SAUDI USD4.375%APR29REGS		200,000.00	202,900.00	
		US T-BOND 2.75% NOV47		690,000.00	654,314.06	
		US T-BOND 3.125% MAY48		606,000.00	618,688.12	
		US T-BOND 3% AUG48		130,000.00	129,573.43	
		US T-BOND 3% FEB47		813,100.00	812,464.76	
		US T-BOND 3% FEB48		617,500.00	615,377.34	
		US T-BOND 3% MAY47		577,500.00	576,507.42	
		US T-BOND 6.375% AUG27		200,000.00	256,906.25	
		US T-NOTE 1.125% FEB21		580,000.00	564,888.27	
		US T-NOTE 1.375% OCT20		365,000.00	358,327.34	
		US T-NOTE 1.75% DEC20		1,045,000.00	1,031,202.73	
		US T-NOTE 2.375% FEB24		4,340,000.00	4,328,471.87	
		US T-NOTE 2.375% MAR21		1,210,000.00	1,207,447.66	
		US T-NOTE 2.75% FEB28		231,500.00	234,068.20	
		US T-NOTE 2.875% AUG28		750,000.00	765,585.93	
		US T-NOTE 2.875% MAY28		515,000.00	525,702.34	
		US T-NOTE 2.875% NOV21		1,150,000.00	1,162,398.42	
		US T-NOTE 2.875% OCT23		3,013,700.00	3,069,735.98	
		US T-NOTE 3.125% NOV28		645,900.00	672,947.05	
	計	銘柄数：	28	20,130,200.00	20,282,893.17	
					(2,250,386,997)	
		組入時価比率：	23.1%		25.9%	
	カナダドル	CANADA GOVT 2% JUN28		310,000.00	316,156.60	
		CANADA GOVT 3.25% JUN21		1,550,000.00	1,603,738.50	
		CANADA GOVT 5% JUN37		460,000.00	670,059.00	
	計	銘柄数：	3	2,320,000.00	2,589,954.10	
					(213,982,007)	
		組入時価比率：	2.2%		2.5%	
	メキシコペソ	MEXICO GOVT 10% DEC24		5,500,000.00	6,003,580.00	
	計	銘柄数：	1	5,500,000.00	6,003,580.00	
					(34,160,370)	
		組入時価比率：	0.4%		0.4%	
	ユーロ	AUSTRIA GOVT 1.5% FEB47		111,000.00	120,179.70	
		BELGIUM GOVT 5% MAR35 44		160,800.00	255,496.72	

		BELGIUM GOVT5.5%MAR28 31		30,000.00	43,710.00
		CYPRUS 2.375% SEP28 EMTN		344,000.00	359,397.44
		FINLAND 1.375% APR47 30Y		60,000.00	65,667.00
		FRANCE OAT 0.75% MAY28		679,900.00	705,158.28
		FRANCE OAT 2% MAY48		220,047.00	249,355.05
		FRANCE OAT 3.25% MAY45		464,800.00	661,075.74
		GERMANY BUND 0.25% AUG28		880,000.00	899,456.80
		GERMANY BUND 1.25% AUG48		53,600.00	61,216.02
		IRELAND GOVT 1.3% MAY33		37,457.00	38,429.00
		IRELAND GOVT 1% MAY26		177,000.00	186,381.00
		ITALY BTP 0.05% OCT19		1,000,000.00	1,000,550.00
		ITALY BTP 2.7% MAR47		4,000.00	3,494.92
		ITALY BTP 3.85% SEP49		916,000.00	945,934.88
		ITALY BTP 4.75% SEP44		105,000.00	125,417.25
		MEXICO EUR 2.375% APR21		446,000.00	466,765.76
		NETHERLANDS 2.75% JAN47		161,600.00	241,328.59
		POLAND EUR1.5%SEP25 EMTN		100,000.00	106,450.00
		PORTUGAL OT 2.25% APR34		55,000.00	57,824.80
		PORTUGAL OT 4.125% APR27		165,000.00	205,005.90
		SLOVAKIA 2.25% JUN68 235		7,977.00	8,232.18
		SLOVENIA 1.1875% MAR29		330,000.00	342,771.00
		SLOVENIA 1% MAR28		90,000.00	93,013.20
		SPAIN GOVT 0.4% APR22		400,000.00	406,704.00
		SPAIN GOVT 1.5% APR27		660,000.00	693,250.80
		SPAIN GOVT 1.85% JUL35		253,000.00	255,631.20
		SPAIN GOVT 2.7% OCT48		52,000.00	56,257.76
		SPAIN GOVT 2.9% OCT46		475,000.00	538,626.25
		SPAIN GOVT 4% APR20		540,000.00	566,649.00
	計	銘柄数：	30	8,979,181.00	9,759,430.24
					(1,215,927,413)
		組入時価比率：	12.5%		14.0%
	英ポンド	UK GOVT 2% SEP25		650,000.00	693,218.50
		UK GOVT 4.25% DEC40		780,000.00	1,147,536.00
		UK GOVT 4.25% DEC55		320,000.00	550,419.20
	計	銘柄数：	3	1,750,000.00	2,391,173.70
					(344,065,983)
		組入時価比率：	3.5%		4.0%
	デンマーククローネ	DENMARK GOVT 4.5% NOV39		700,000.00	1,246,098.00
	計	銘柄数：	1	700,000.00	1,246,098.00
					(20,809,836)
		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	734,740.50
	計	銘柄数：	1	650,000.00	734,740.50
					(21,278,084)
		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	4,113,202.00
	計	銘柄数：	1	4,100,000.00	4,113,202.00
					(6,869,047)
		組入時価比率：	0.1%		0.1%
	オーストラリアドル	AUSTRALIA 3% MAR47 150		133,000.00	143,057.46
		AUSTRALIA 2.75% NOV28 152		2,000,000.00	2,126,200.00

		AUSTRALIA4.25% APR26 142		840,000.00	973,778.40
		AUSTRALIA5.75% MAY21 124		950,000.00	1,032,745.00
	計	銘柄数：	4	3,923,000.00	4,275,780.86
					(333,339,875)
		組入時価比率：	3.4%		3.8%
	ニュージーランドドル	NEW ZEALAND GOV2.75%0437		56,000.00	58,794.96
	計	銘柄数：	1	56,000.00	58,794.96
					(4,431,964)
		組入時価比率：	0.0%		0.1%
	タイバーツ	THAI GOVT 2.125% DEC26		11,760,000.00	11,542,440.00
	計	銘柄数：	1	11,760,000.00	11,542,440.00
					(40,398,540)
		組入時価比率：	0.4%		0.5%
	小計				4,485,650,116
					(4,485,650,116)
地方債証券	カナダドル	HYDRO QUEBEC 6.5% 19		100,000.00	146,858.00
		ONTARIO 2.6%		1,090,000.00	1,107,799.70
		PROV BRCOL 2.8%		60,000.00	59,503.20
		QUEBEC 5%		250,000.00	337,177.50
	計	銘柄数：	4	1,500,000.00	1,651,338.40
					(136,433,578)
		組入時価比率：	1.4%		1.6%
	小計				136,433,578
					(136,433,578)
特殊債券	アメリカドル	FREDDIE MAC 3.75%		3,700,000.00	3,701,924.00
		PEMEX 4.25%		110,000.00	99,897.60
	計	銘柄数：	2	3,810,000.00	3,801,821.60
					(421,812,106)
		組入時価比率：	4.3%		4.9%
	ユーロ	AG FRANCAISE 0.375% FEB		200,000.00	202,126.00
		CA FRANCAISE 0.5% EMTN		100,000.00	100,271.00
		DEXIA CREDIT 1.25%		500,000.00	525,605.00
		EFSF 0.75% EMTN		65,000.00	67,340.00
		EIB 0.875% EMTN		500,000.00	525,040.00
		ESM 1.125% EMTN		150,000.00	157,315.50
		EUROPEAN UNION3.375%EMTN		50,000.00	66,413.00
		KOREA HOUSING 0.75% REGS		100,000.00	101,366.00
		UNEDIC 0.25% EMTN		1,000,000.00	1,011,460.00
	計	銘柄数：	9	2,665,000.00	2,756,936.50
					(343,486,718)
		組入時価比率：	3.5%		4.0%
	スウェーデンクローネ	EIB 1.25% EMTN		1,610,000.00	1,674,061.90
	計	銘柄数：	1	1,610,000.00	1,674,061.90
					(19,703,708)
		組入時価比率：	0.2%		0.2%
	小計				785,002,532
					(785,002,532)
社債券	アメリカドル	AB INBEV 3.65% 144A		125,000.00	123,995.00
		AB INBEV 4.7% 144A		80,000.00	77,336.00
		AB INBEV 4.75%		110,000.00	115,068.80
		AB INBEV 5.55%		55,000.00	57,849.55
		ACTAVIS 3.25%		90,000.00	88,949.70

	AIG 3.9%		110,000.00	108,519.40
	ALTRIA GROUP 2.85%		48,000.00	47,334.72
	AMER AIRLINE 3.2% AA		161,910.00	155,668.36
	AMERICAN TOWER 4%		20,000.00	20,256.00
	ANTHEM 5.1%		60,000.00	63,116.40
	ARGENTUM VAR		200,000.00	198,690.00
	AT&T 4.5%		10,000.00	8,949.50
	AT&T INC 4.3%		205,000.00	180,857.15
	BALTIMORE GAS&ELEC 2.8%		100,000.00	98,893.00
	BANK NOVA 3.125% BKNT		455,000.00	456,665.30
	BANK OF MONTREAL 3.3% E		120,000.00	119,970.00
	BARCLAYS BK 2.65%		655,000.00	648,469.65
	BAT 3.557%		250,000.00	230,295.00
	BAT 4.39%		70,000.00	59,425.10
	BBCMS 2017-C1 A4		250,000.00	254,992.50
	BCARD 2018-1X A		334,000.00	333,968.93
	BERKSHIRE 4.45% WI		65,000.00	65,897.65
	BK OF AMERICA 3.248% MTN		140,000.00	134,498.00
	BK OF AMERICA FLT		65,000.00	65,319.80
	BK OF AMERICA FLT MTN		150,000.00	149,439.00
	BK OF AMERICA FLT MTN Q		95,000.00	95,532.00
	BNSF 4.15%		85,000.00	85,719.10
	BOSTON SCIENTIFIC 4.7%		70,000.00	70,584.50
	BOSTON SCIENTIFIC 4%		100,000.00	100,189.00
	BP CAPITAL 3.79%		225,000.00	231,633.00
	BPCE 4%		250,000.00	255,355.00
	CAPITAL ONE 3.75%		215,000.00	207,178.30
	CGCMT 2016-P6 A5		250,000.00	255,217.50
	CITIGROUP 4.65%		30,000.00	31,105.50
	CITIGROUP FLT		240,000.00	239,160.00
	CITIGROUP FLT V		340,000.00	338,966.40
	CLEVELAND 3.5% 144A		160,000.00	152,009.60
	CMS ENERGY 2.95%		35,000.00	32,690.35
	COMCAST 2.35%		25,000.00	22,987.75
	COMCAST 3.9%		45,000.00	42,869.70
	COMCAST 3.95%		50,000.00	51,755.50
	COMCAST 4.7%		50,000.00	52,449.50
	COMCAST CORP 4.45%		110,000.00	110,594.00
	COMCAST CORP 4.6%		50,000.00	51,456.00
	CONSTELLATION BR 4.5%		25,000.00	23,085.25
	COX COMMS 3.35% 144A		170,000.00	161,736.30
	CSX 3.25%		45,000.00	43,401.60
	CSX 4.25%		150,000.00	154,705.50
	CVS HEALTH 4.3%		159,000.00	158,624.76
	CVS HEALTH 4.78%		90,000.00	86,936.40
	DBS BANK 3.3% REGS		400,000.00	402,944.00
	DOMINION RESOURCES 4.7%		130,000.00	132,713.10
	DUKE ENERGY 3.45%		60,000.00	59,862.60
	DUKE ENERGY 3.75%		180,000.00	183,308.40
	ELI LILLY 3.375%		60,000.00	60,130.80
	ELI LILLY 3.875%		35,000.00	34,531.70

	ELI LILLY 3.95%		40,000.00	39,312.80
	EMERA US FIN 4.75%		65,000.00	63,940.50
	ENERGY 2.95%		45,000.00	42,340.05
	ENERGY MISSISSIPPI 2.85%		190,000.00	178,778.60
	EPPLP 4.9%		95,000.00	96,935.15
	EXELON 3.4%		325,000.00	326,690.00
	FIFTH THIRD BANCOPR 3.65%		20,000.00	20,217.60
	FORTIS 3.055%		155,000.00	145,837.95
	GE 3.1% GMTN		168,000.00	163,504.32
	GE 4.125%		25,000.00	20,663.00
	GE CAPITAL 4.418%		210,000.00	185,999.10
	GM 3.95%		30,000.00	29,310.00
	GM 5.15%		30,000.00	26,815.80
	GOLDMAN SACHS 3.5%		270,000.00	260,909.10
	GOLDMAN SACHS 3.85%		315,000.00	309,991.50
	GOLDMAN SACHS FLT		45,000.00	44,135.10
	GSMS 2017-GS5 A4		125,000.00	127,425.00
	HALLIBURTON 5%		105,000.00	108,251.85
	HSBC HLDGS FLT		235,000.00	235,669.75
	HSBC HLDGS VAR		270,000.00	265,366.80
	INDIANA MICHIGAN PW 4.25%		30,000.00	29,789.10
	JOHN DEERE 2.8% MTN		310,000.00	308,177.20
	KEURIG DR PEPPER 2.55%		51,000.00	45,338.49
	KEURIG DR PEPPER 3.43%		90,000.00	84,186.90
	KIMCO REALITY 3.125%		265,000.00	259,758.30
	KIMCO REALITY 3.4%		45,000.00	44,832.15
	KRAFT HEINZ FOOD 4.375%		65,000.00	54,167.75
	KROGER 2.65%		165,000.00	148,288.80
	M STANLEY FLT		330,000.00	333,171.30
	MAPLE ESCROW 4.417% 144A		109,000.00	111,394.73
	MARTIN MARIETTA 4.25%		70,000.00	58,877.70
	METLIFE INC 2.3% 144A		510,000.00	509,816.40
	MPLX 4.5%		35,000.00	32,174.45
	MSAC 2004-SD2 A		190,391.86	190,159.58
	NATL RURAL UTIL 4.3%		10,000.00	10,232.20
	NISOURCE 5.65%		20,000.00	22,526.40
	NORFOLK SOUTHERN 3.942%		75,000.00	70,174.50
	NORTHROP GRUMMAN 3.25%		150,000.00	143,914.50
	ORACLE CORP 4.5%		130,000.00	134,748.90
	PACIFICORP 4.15%		45,000.00	44,876.25
	PENAR 2018-2X A1		333,000.00	332,172.82
	PFIZER 4%		30,000.00	29,597.70
	PHILIP MORRIS 2.5%		114,000.00	111,822.60
	PHILLIPS 66 4.875%		10,000.00	10,471.20
	RBS FLT		250,000.00	246,610.00
	REALTY INCOME 3.65%		95,000.00	93,941.70
	ROCKWELL COLLINS 3.5%		215,000.00	207,909.30
	S CALIF EDISON 3.6% C		50,000.00	41,474.50
	S CALIF EDISON 3.65% B		65,000.00	62,254.40
	SEMPRA ENERGY 3.8%		50,000.00	44,478.50
	SHERWIN-WILLIAMS 4.5%		25,000.00	23,429.00

		SHIRE ACQ 2.875%		212,000.00	206,358.68	
		SIERRA PACIFIC 2.6%		75,000.00	70,629.75	
		SUNOCO LOGISTICS 5.3%		110,000.00	102,645.40	
		SWEPCO 3.9% J		15,000.00	13,634.85	
		TRANSCANADA 4.25% 10YR		165,000.00	168,290.10	
		UBS FLT 144A		200,000.00	195,646.00	
		UNION ELECTRIC 3.5%		15,000.00	15,043.95	
		UNION PACIFIC 3.15%		55,000.00	55,024.20	
		UNION PACIFIC 4.3%		25,000.00	24,527.50	
		UNITED AIR 3.1% AA		165,752.72	158,212.62	
		UNITED TECH 3.95%		35,000.00	35,826.00	
		UNITED TECH 4.125%		80,000.00	81,356.00	
		UNITED TECH 4.45%		40,000.00	39,840.40	
		VENTAS 4.375%		24,000.00	22,234.08	
		VERIZON 2.625%		80,000.00	75,086.40	
		VERIZON 3.85%		72,000.00	65,036.88	
		VERIZON 4.272%		65,000.00	63,935.30	
		VERIZON COMMS 4.329%		75,000.00	77,764.50	
		VODAFONE 4.125%		35,000.00	35,316.05	
		VODAFONE 4.375%		70,000.00	69,514.20	
		VODAFONE 5%		75,000.00	71,738.25	
		WELLS FARGO 3.75% MTN		40,000.00	40,766.80	
		WELLS FARGO 4.15% MTN		45,000.00	46,162.80	
		WELLS FARGO 5.375%		125,000.00	136,365.00	
		WELLS FARGO FLT BKNT		490,000.00	491,519.00	
		WESTPAC VAR EMTN		90,000.00	87,762.60	
		WFCM 2017-RC1 A4		250,000.00	253,192.50	
		WFMS 2005-2 2A1		19,255.67	19,255.67	
	計	銘柄数 :	135	17,301,310.25	17,049,404.39	
					(1,891,631,417)	
		組入時価比率 :	19.4%		21.8%	
	ユ-口	ABN AMRO 6.375% EMTN		200,000.00	225,112.00	
		ABN AMRO BANK VAR EMTN		200,000.00	205,648.00	
		AMERICAN TOWER 1.375%		240,000.00	238,324.80	
		ANZ BANK 0.45% EMTN		500,000.00	505,145.00	
		APPLE 1.375%		100,000.00	104,438.00	
		ASB FIN 0.125% EMTN		170,000.00	168,988.50	
		ASB FIN 0.625% EMTN		150,000.00	152,119.50	
		ASB FIN 0.75% EMTN		240,000.00	243,885.60	
		BANK NOVA 0.375% EMTN		150,000.00	151,756.50	
		BK OF AMERICA FLT EMTN		249,000.00	254,450.61	
		BP CAPITAL 0.9% EMTN		100,000.00	101,746.00	
		BP CAPITAL 2.972% EMTN		100,000.00	114,230.00	
		BPM 2 A2		175,947.52	174,076.67	
		CBA 0.375% EMTN		891,000.00	899,384.31	
		CBA 0.5% EMTN		550,000.00	548,388.50	
		CIBC 0.25% EMTN		372,000.00	374,719.32	
		EDP FIN 1.5% EMTN		161,000.00	159,222.56	
		ENEL 1.125% EMTN		136,000.00	133,779.12	
		FERROVIAL EMISIONES 2.5%		100,000.00	108,142.00	
		GE 1.875%		100,000.00	98,802.00	

		GOLDMAN SACHS 2.625%EMTN		147,000.00	152,371.38
		HAMMERSON 2% EMTN		258,000.00	263,160.00
		HEATHROW 1.5% EMTN		154,000.00	153,810.58
		IMERYSA 1.875% EMTN		100,000.00	99,134.00
		ING GRP VAR EMTN		300,000.00	315,795.00
		INTESA SANPAOLO 0.5%		800,000.00	801,040.00
		LIB MUTUAL 1.75% REGS		114,000.00	116,943.48
		M STANLEY 1.875% GMTN		300,000.00	309,768.00
		MEDTRONIC 1.125%		100,000.00	100,361.00
		MOTABILITY 0.875% EMTN		122,000.00	122,666.12
		NATIONWIDE 0.625% EMTN		300,000.00	301,233.00
		NORTEGAS 2.065% EMTN		100,000.00	99,245.00
		RCI BANQUE 0.625% EMTN		138,000.00	138,828.00
		SCENTRE GROUP 1.5% EMTN		272,000.00	276,371.04
		SEB VAR 26 S.289		105,000.00	108,547.95
		SIEMENS 1.375% EMTN		70,000.00	71,684.20
		SKY 2.25% GMTN		100,000.00	107,901.00
		TORONTO-DOMI 0.625% EMTN		100,000.00	102,010.00
		TOTAL 1.375% EMTN		100,000.00	104,392.00
		TRANSURBAN FIN 2% EMTN		100,000.00	105,156.00
		VINCI 1.75% EMTN		100,000.00	103,256.00
		VOLKSWAGEN 2.625%		60,000.00	63,361.80
	計	銘柄数 :	42	8,824,947.52	8,979,394.54
					(1,118,742,765)
		組入時価比率 :	11.5%		12.9%
	英ポンド	BSKY UK2 A		280,000.00	279,921.04
		CENTRICA 4.375% EMTN		100,000.00	112,639.00
		EVERSHOLT 6.359% EMTN		100,000.00	121,422.00
		HEATHROW 6.75% EMTN		150,000.00	196,077.00
		LLOYDS BK 9.625%		200,000.00	252,998.00
		LONDON & QUADRANT 3.125%		140,000.00	135,010.40
		NAB 1.125% EMTN		500,000.00	496,880.00
	計	銘柄数 :	7	1,470,000.00	1,594,947.44
					(229,496,987)
		組入時価比率 :	2.4%		2.6%
	スウェーデンクローネ	STADSHYPOTEK 1.5% 1587		2,000,000.00	2,086,500.00
	計	銘柄数 :	1	2,000,000.00	2,086,500.00
					(24,558,105)
		組入時価比率 :	0.3%		0.3%
	小計				3,264,429,274
					(3,264,429,274)
	合計				8,671,515,500
					(8,671,515,500)

(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30年 9月10日現在)	(平成31年 3月11日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		648,784,295	383,613,227
コール・ローン		34,963,551	55,638,630
国債証券		9,156,028,835	9,606,633,187
派生商品評価勘定		428,824,959	87,081,097
未収入金		-	130,685,279
未収利息		103,009,332	118,791,221
前払費用		18,520,998	21,695,002
差入委託証拠金		7,666,206	10,882,069
流動資産合計		10,397,798,176	10,415,019,712
資産合計		10,397,798,176	10,415,019,712
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		319,178,698	82,861,624
未払金		97,576,455	164,631,957
未払解約金		3,140,734	3,828,491
未払利息		89	71
流動負債合計		419,895,976	251,322,143
負債合計		419,895,976	251,322,143
純資産の部			
元本等			
元本	1	7,326,947,038	6,871,292,248
剰余金			
剰余金又は欠損金()		2,650,955,162	3,292,405,321
元本等合計		9,977,902,200	10,163,697,569
純資産合計		9,977,902,200	10,163,697,569
負債純資産合計		10,397,798,176	10,415,019,712

(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 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>(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。</p> <p>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。</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30年9月10日現在)	(平成31年3月11日現在)
1期首元本額	7,330,844,314円	7,326,947,038円
期中追加設定元本額	1,086,386,630円	519,216,173円
期中解約元本額	1,090,283,906円	974,870,963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）	544,218,228円	516,268,546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）	2,747,718,040円	2,459,036,412円
JPM新興国毎月決算ファンド	4,019,359,890円	3,857,506,167円
JPM新興国年1回決算ファンド	15,650,880円	38,481,123円
合 計	7,326,947,038円	6,871,292,248円
受益権の総数	7,326,947,038口	6,871,292,248口
1口当たりの純資産額 （1万口当たりの純資産額）	1.3618円 (13,618円)	1.4792円 (14,792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	<p>当ファンドが保有した主な金融商品は、国債証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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>当ファンドは運用を外部委託しておりますが、投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。</p> <p>(1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターおよび外部委託先において運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果（パフォーマンス）のモニターを行います。さらに外部委託先のインベストメント・ダイレクターは、リスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。</p> <p>(2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っております。</p> <p>(3)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。</p>

金融商品の時価等に関する事項

	各期間末
1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませ
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。一部の債券時価に関しては合理的に算定された価額を採用する場合があります。合理的に算定された価額は発行体の格付けや債券の償還年限を基にした国債に対する上乘せ金利、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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(平成30年9月10日現在)	(平成31年3月11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	416,384,364	291,093,534
合計	416,384,364	291,093,534

(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30年9月10日現在)				(平成31年3月11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 買建	307,382,690	-	305,249,906	2,132,784	-	-	-	-
合計		307,382,690	-	305,249,906	2,132,784	-	-	-	-

(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30年9月10日現在）				（平成31年3月11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	4,776,767,678	-	4,791,239,321	14,471,643	3,111,383,108	-	3,092,633,980	18,749,128
	メキシコペソ	828,200,215	-	860,698,902	32,498,687	404,104,015	-	396,629,310	7,474,705
	トルコリラ	851,817,883	-	700,201,715	151,616,168	288,314,553	-	285,377,143	2,937,410
	チェココルナ	760,551,669	-	765,365,417	4,813,748	466,132,724	-	460,248,324	5,884,400
	ハンガリーフォリント	448,414,110	-	447,746,464	667,646	368,396,753	-	369,178,632	781,879
	ポーランドズロチ	761,584,395	-	763,884,310	2,299,915	1,413,303,203	-	1,399,434,794	13,868,409
	タイバーツ	726,562,713	-	726,642,611	79,898	157,753,404	-	155,925,321	1,828,083
	南アフリカランド	519,373,453	-	470,130,345	49,243,108	359,941,181	-	350,960,158	8,981,023
	売建								
	アメリカドル	4,896,504,438	-	4,930,522,527	34,018,089	3,457,945,833	-	3,454,383,629	3,562,204
	メキシコペソ	1,049,601,443	-	1,050,927,135	1,325,692	842,992,142	-	824,118,015	18,874,127
	トルコリラ	724,506,482	-	541,275,380	183,231,102	224,900,687	-	219,978,763	4,921,924
	チェココルナ	330,585,615	-	334,930,398	4,344,783	256,351,771	-	252,725,946	3,625,825
	ハンガリーフォリント	874,023,223	-	873,332,695	690,528	367,564,262	-	369,355,284	1,791,022
	ポーランドズロチ	454,382,993	-	451,486,671	2,896,322	655,359,646	-	645,347,509	10,012,137
タイバーツ	458,449,969	-	459,227,757	777,788	300,318,153	-	298,312,225	2,005,928	
南アフリカランド	885,217,953	-	772,427,477	112,790,476	463,896,447	-	437,726,558	26,169,889	
合計		19,346,544,232	-	18,940,039,125	111,779,045	13,138,657,882	-	13,012,335,591	8,439,733

（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30年9月10日現在）				（平成31年3月11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 売建	-	-	-	-	1,967,667,739	-	1,971,887,999	4,220,260
合計		-	-	-	-	1,967,667,739	-	1,971,887,999	4,220,260

（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31年3月11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	US T-NOTE 2.5% DEC20		960,000.00	960,075.00	
	計	銘柄数：	1	960,000.00	960,075.00	
					(106,520,321)	
		組入時価比率：	1.0%		1.1%	
	アルゼンチンペソ	ARGENTINE GOVT15.5%OCT26		4,300,000.00	3,837,750.00	
		ARGENTINE GOVT18.2%OCT21		14,643,586.00	12,717,954.44	
	計	銘柄数：	2	18,943,586.00	16,555,704.44	
					(44,534,844)	
		組入時価比率：	0.4%		0.5%	
	メキシコペソ	MEXICO GOVT 10% DEC24		26,836,600.00	29,293,759.09	
		MEXICO GOVT 10% NOV36		16,607,300.00	18,951,918.61	
		MEXICO GOVT 5.75% MAR26		15,000,000.00	13,170,900.00	
		MEXICO GOVT 6.5% JUN21		3,200,000.00	3,100,960.00	
		MEXICO GOVT 6.5% JUN22		63,980,000.00	61,239,096.80	
		MEXICO GOVT 7.25% DEC21		74,000,000.00	72,599,180.00	
		MEXICO GOVT 7.5% JUN27		50,600,000.00	48,719,704.00	
		MEXICO GOVT 7.75% MAY31		7,800,000.00	7,477,548.00	
		MEXICO GOVT 8.5% MAY29		15,710,000.00	16,043,837.50	
		MEXICO GOVT 8.5% NOV38		13,600,000.00	13,580,960.00	
		MEXICO GOVT 8% DEC23		7,000,000.00	7,000,070.00	
		MEXICO I/L 4% NOV40		530,000.00	3,243,349.57	
	計	銘柄数：	12	294,863,900.00	294,421,283.57	
					(1,675,257,103)	
		組入時価比率：	16.5%		17.4%	
	ブラジルリアル	BRAZIL 10% JAN21 NTFN		24,430,000.00	25,984,676.34	
		BRAZIL 10% JAN23 NTFN		17,458,000.00	18,741,843.86	
		BRAZIL 10% JAN25 NTFN		6,940,000.00	7,461,332.80	
		BRAZIL 10% JAN27 NTFN		4,690,000.00	5,042,580.13	
		BRAZIL I/L 6% AUG22 NTNB		3,166,000.00	10,834,283.11	
		BRAZIL I/L 6% AUG26 NTNB		420,000.00	1,491,323.82	
		BRAZIL I/L 6% AUG50 NTNB		550,000.00	2,182,022.15	
	計	銘柄数：	7	57,654,000.00	71,738,062.21	
					(2,058,165,004)	
		組入時価比率：	20.3%		21.3%	
	チリペソ	CHILE GOVT 4.5% MAR26		1,190,000,000.00	1,223,748,400.00	
	計	銘柄数：	1	1,190,000,000.00	1,223,748,400.00	
					(202,163,235)	
		組入時価比率：	2.0%		2.1%	
	コロンビアペソ	COLOMBIA 6% APR28 GDN		150,000,000.00	144,073,500.00	
		COLOMBIA GOVT 9.85%JUN27		1,292,000,000.00	1,598,191,080.00	
		COLOMBIA GOVT4.375%MAR23		475,000,000.00	455,805,250.00	
		COLOMBIA TES 10% JUL24		2,191,300,000.00	2,594,981,286.00	
		COLOMBIA TES 6% APR28		11,222,500,000.00	10,751,267,225.00	
		COLOMBIA TES 7.25% OCT34		850,000,000.00	854,666,500.00	
		COLOMBIA TES 7% MAY22		1,340,000,000.00	1,403,891,200.00	
	計	銘柄数：	7	17,520,800,000.00	17,802,876,041.00	
					(621,320,373)	

		組入時価比率：	6.1%		6.5%
	ペルーソル	PERU GOVT 5.94% FEB29		520,000.00	540,051.20
		PERU GOVT 5.94%FEB29 GDN		180,000.00	186,949.80
		PERU GOVT 6.15% AUG32		1,564,000.00	1,612,061.72
		PERU GOVT 6.35% AUG28		2,210,000.00	2,362,246.90
		PERU GOVT 6.9% AUG37 GDN		800,000.00	875,088.00
		PERU GOVT6.95% AUG31 GDN		3,025,000.00	3,345,922.25
	計	銘柄数：	6	8,299,000.00	8,922,319.87
					(298,630,046)
		組入時価比率：	2.9%		3.1%
	ウルグアイペソ	URUGUAY9.875% JUN22 REGS		4,880,000.00	4,849,451.20
	計	銘柄数：	1	4,880,000.00	4,849,451.20
					(16,294,156)
		組入時価比率：	0.2%		0.2%
	ドミニカペソ	DOMINICA 8.9% FEB23 REGS		17,000,000.00	16,715,080.00
	計	銘柄数：	1	17,000,000.00	16,715,080.00
					(36,606,025)
		組入時価比率：	0.4%		0.4%
	ディナール	SERBIA 5.875% FEB28 10Y		23,330,000.00	24,921,339.30
	計	銘柄数：	1	23,330,000.00	24,921,339.30
					(26,277,060)
		組入時価比率：	0.3%		0.3%
	トルコリラ	TURKEY GOVT 10.6% FEB26		5,850,000.00	4,710,186.00
		TURKEY GOVT 11% MAR22		2,186,046.00	1,869,069.33
		TURKEY GOVT 12.4% MAR28		994,183.00	869,104.83
		TURKEY GOVT 23% AUG20		2,211,461.00	2,337,691.19
		TURKEY GOVT 7.1% MAR23		219,389.00	162,102.14
		TURKEY GOVT 8.5% SEP22		121,507.00	95,824.06
		TURKEY GOVT 8.8% SEP23		1,530,000.00	1,175,162.40
		TURKEY GOVT 9.2% SEP21		2,052,812.00	1,704,839.83
	計	銘柄数：	8	15,165,398.00	12,923,979.78
					(264,553,866)
		組入時価比率：	2.6%		2.8%
	ポーランドズロチ	POLAND 2.25% APR22 0422		710,000.00	719,144.80
		POLAND 2.5% JUL26 0726		6,317,000.00	6,274,297.08
		POLAND 2.75% APR28 0428		5,569,000.00	5,550,121.09
		POLAND GOVT 4% OCT23		4,840,000.00	5,241,865.20
	計	銘柄数：	4	17,436,000.00	17,785,428.17
					(515,065,999)
		組入時価比率：	5.1%		5.4%
	ロシアルーブル	RUSSIA 7.6% APR21 6205		74,800,000.00	74,939,876.00
		RUSSIA 7.75% SEP26 6219		43,358,000.00	42,626,116.96
		RUSSIA 7% JAN23 6211		30,000,000.00	29,076,000.00
		RUSSIA 8.15% FEB27 6207		116,550,000.00	116,925,291.00
	計	銘柄数：	4	264,708,000.00	263,567,283.96
					(440,157,364)
		組入時価比率：	4.3%		4.6%
	ルーマニアレイ	ROMANIA GOVT 3.25% APR24		585,000.00	559,921.05
		ROMANIA GOVT 4.75% FEB25		2,110,000.00	2,150,891.80
		ROMANIA GOVT 5% FEB29		1,670,000.00	1,703,683.90
	計	銘柄数：	3	4,365,000.00	4,414,496.75
					(115,836,394)
		組入時価比率：	1.1%		1.2%
	マレーシアリングgit	MALAYSIA 3.48% MAR23		402,000.00	399,865.38
		MALAYSIA 3.8% AUG23		2,500,000.00	2,510,000.00
		MALAYSIA 3.844% APR33		100,000.00	95,003.00
		MALAYSIA 3.882% MAR22		1,963,000.00	1,985,947.47
		MALAYSIA 4.048% SEP21		62,000.00	62,861.80

		MALAYSIA 4.059% SEP24		4,100,000.00	4,157,441.00
		MALAYSIA 4.07% SEP26		869,000.00	871,667.83
		MALAYSIA 4.16% JUL21		633,000.00	642,653.25
		MALAYSIA 4.181% JUL24		700,000.00	714,021.00
		MALAYSIA 4.232% JUN31		2,872,000.00	2,875,819.76
		MALAYSIA 4.642% NOV33		3,900,000.00	4,056,936.00
		MALAYSIA 4.786% OCT35		400,000.00	409,632.00
	計	銘柄数:	12	18,501,000.00	18,781,848.49
					(509,551,549)
		組入時価比率:	5.0%		5.3%
	タイバーツ	THAI GOVT 2.125% DEC26		4,200,000.00	4,122,300.00
		THAI GOVT 2.4% DEC23 0		14,800,000.00	14,961,764.00
		THAI GOVT 2.875% DEC28		13,092,000.00	13,510,420.32
		THAI GOVT 2% DEC22		29,000,000.00	28,984,920.00
		THAI GOVT 3.4% JUN36		2,200,000.00	2,325,862.00
		THAI GOVT 3.58% DEC27		834,000.00	901,111.98
		THAI GOVT 3.625% JUN23		3,176,000.00	3,375,071.68
		THAI GOVT 3.65% JUN31		8,200,000.00	8,946,364.00
		THAI GOVT 3.775% JUN32		37,900,000.00	41,684,694.00
		THAI GOVT 4.875% JUN29		579,000.00	695,106.87
	計	銘柄数:	10	113,981,000.00	119,507,614.85
					(418,276,651)
		組入時価比率:	4.1%		4.4%
	フィリピンペソ	PHIL GOVT 8% JUL31 2017		5,600,000.00	6,487,096.00
		PHIL GOVT5.75%APR25 7-61		2,963,554.00	2,913,203.21
	計	銘柄数:	2	8,563,554.00	9,400,299.21
					(19,928,634)
		組入時価比率:	0.2%		0.2%
	インドネシアルピア	INDON 10.5% AUG30 FR52		6,191,000,000.00	7,268,234,000.00
		INDON 6.625% MAY33 FR65		4,960,000,000.00	4,223,936,000.00
		INDON 7.5% MAY38 FR75		2,937,000,000.00	2,712,113,910.00
		INDON 7% MAY27 FR59		21,302,000,000.00	19,943,145,420.00
		INDON 8.25% MAY36 FR72		29,435,000,000.00	29,041,454,050.00
		INDON 8.375% MAR34 FR68		3,838,000,000.00	3,847,595,000.00
		INDON 8.75% MAY31 FR73		11,305,000,000.00	11,814,290,250.00
		INDON 9% MAR29 FR71		46,542,000,000.00	49,310,783,580.00
	計	銘柄数:	8	126,510,000,000.00	128,161,552,210.00
					(999,660,107)
		組入時価比率:	9.8%		10.4%
	エジプトポンド	EGYPT T-BILL0%APR19 273D		4,400,000.00	4,288,781.44
		EGYPT T-BILL0%APR19 364D		3,450,000.00	3,354,282.70
	計	銘柄数:	2	7,850,000.00	7,643,064.14
					(48,686,318)
		組入時価比率:	0.5%		0.5%
	南アフリカランド	S.AFRICA 7% FEB31 R213		23,210,000.00	19,402,631.60
		S.AFRICA 8.5% JAN37 2037		8,445,658.00	7,612,324.92
		S.AFRICA 8% JAN30 2030		7,838,441.00	7,205,408.50
		S.AFRICA 9% JAN40 2040		5,595,390.00	5,221,002.45
		S.AFRICA10.5% DEC26 R186		39,456,829.00	43,476,296.17
		S.AFRICA6.25% MAR36 R209		8,441,256.00	6,124,553.29
		S.AFRICA8.25% MAR32 2032		16,400,872.00	14,984,984.72
		S.AFRICA8.75% FEB48 2048		36,635,031.00	33,199,764.14
		S.AFRICA8.75% JAN44 2044		3,805,030.00	3,450,895.85
		S.AFRICA8.875%FEB35 2035		7,786,398.00	7,338,913.70
	計	銘柄数:	10	157,614,905.00	148,016,775.34
					(1,136,768,834)
		組入時価比率:	11.2%		11.8%

	ナイジェリアナイラ	NIGERIA GOVT13.98% FEB28		173,000,000.00	169,732,030.00	
	計	銘柄数:	1	173,000,000.00	169,732,030.00	
					(52,379,304)	
		組入時価比率:	0.5%		0.5%	
	小計				9,606,633,187	
					(9,606,633,187)	
	合計				9,606,633,187	
					(9,606,633,187)	

(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30年 9月10日現在)	(平成31年 3月11日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		119,704,736	36,599,123
コール・ローン		4,540,331	1,287,658
株式		899,772	3,761,582
特殊債券		1,087,590	1,089,129
社債券		738,889,341	694,096,359
未収入金		5,176,419	-
未収利息		12,393,335	11,224,259
前払費用		416,791	786,043
流動資産合計		883,108,315	748,844,153
資産合計		883,108,315	748,844,153
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	2,029
未払金		5,370,399	4,314,850
未払解約金		463,491	57
未払利息		11	1
流動負債合計		5,833,901	4,316,937
負債合計		5,833,901	4,316,937
純資産の部			
元本等			
元本	1	407,960,919	340,686,886
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		469,313,495	403,840,330
元本等合計		877,274,414	744,527,216
純資産合計		877,274,414	744,527,216
負債純資産合計		883,108,315	748,844,153

（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。 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もの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30年 9月10日現在)	(平成31年 3月11日現在)
1 期首元本額	455,133,294円	407,960,919円
期中追加設定元本額	4,683,046円	6,104,244円
期中解約元本額	51,855,421円	73,378,277円
元本の内訳（注）		
JPM米国高利回り社債ファンド	36,583,419円	- 円
JPMグローバル債券3分散ファンド （毎月決算型）	371,377,500円	340,686,886円
合 計	407,960,919円	340,686,886円
受益権の総数	407,960,919口	340,686,886口
1 口当たりの純資産額	2.1504円	2.1854円
（1万口当たりの純資産額）	(21,504円)	(21,854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
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。一部の債券時価に関しては合理的に算定された価額を採用する場合があります。合理的に算定された価額は発行体の格付けや債券の償還年限を基にした国債に対する上乘せ金利、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。</p> <p>(2) デリバティブ取引 平成30年9月10日現在、該当事項はありません。 平成31年3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。</p> <p>(3) 有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(平成30年9月10日現在)	(平成31年3月11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	168,134	242,103
特殊債券	17,832	9,791
社債券	2,886,170	18,132,120
合計	3,072,136	17,899,808

(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30年9月10日現在)				(平成31年3月11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	-	-	-	-	5,000,000	-	5,002,029	2,029
合計		-	-	-	-	5,000,000	-	5,002,029	2,029

(注) 1. 為替予約の時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表（平成31年3月11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	CLAIRE'S STORES 14% PFD	10	1,562.50	15,625.00	*
	CLAIRE'S STORES INC	17	795.00	13,515.00	
	NII HOLDINGS INC	1,401	3.40	4,763.40	
小計	銘柄数：	3		33,903.40	
				(3,761,582)	
	組入時価比率：	0.5%		100.0%	
合計				3,761,582	
				(3,761,582)	

(注) 各通貨計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

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

(注) 備考欄の*の銘柄は優先証券であることを表しております。

(ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
特殊債券	アメリカドル	DAE FUNDING 4.5% REGS		5,000.00	4,935.10	
		DAE FUNDING 5% REGS		5,000.00	4,881.30	
	計	銘柄数：	2	10,000.00	9,816.40	
					(1,089,129)	
		組入時価比率：	0.1%		0.2%	
	小計				1,089,129	
					(1,089,129)	
社債券	アメリカドル	ACADIA HLTH 5.125%		10,000.00	9,890.60	

	ACADIA HLTH 5.625%		7,000.00	7,008.33	
	ACADIA HLTH 6.5%		5,000.00	5,053.85	
	ACE CASH EXP 12% REGS		14,000.00	13,310.36	
	ADT CORP 4.125% 23		31,000.00	29,990.64	
	AECOM 5.125%		22,000.00	20,798.14	
	AHERN RENTALS7.375% REGS		20,000.00	18,356.60	
	AK STEEL 6.375%		10,000.00	8,191.90	
	AK STEEL 7%		9,000.00	7,447.59	
	ALBERTSONS 6.625%		60,000.00	58,936.20	
	ALBERTSONS 7.5% REGS		3,000.00	2,999.67	
	ALLEGHENY TECH 5.95%		2,000.00	2,049.92	
	ALLIANCE DATA5.375% REGS		20,000.00	20,193.60	
	ALLIANCE DATA5.875% REGS		5,000.00	5,099.75	
	ALLY FINANCIAL 5.75%		63,000.00	65,807.91	
	ALLY FINANCIAL 8% 31		12,000.00	14,619.00	
	AMC ENTERTAIN 5.875% 22		5,000.00	5,094.50	
	AMC ENTERTAIN 5.875% 26		3,000.00	2,698.92	
	AMC ENTERTAINMENT 5.75%		11,000.00	10,150.69	
	AMC ENTERTAINMENT 6.125%		12,000.00	10,743.84	
	AMC NETWORKS 4.75%		3,000.00	2,902.50	
	AMERICAN AXLE 6.25%		34,000.00	33,185.02	
	AMERICAN AXLE 6.25% Y		8,000.00	7,672.32	
	AMERICAN AXLE 6.5%		28,000.00	26,878.32	
	AMERICAN AXLE 6.625%		1,000.00	1,016.80	
	AMERIGAS 5.625%		10,000.00	10,055.20	
	AMERIGAS 5.75%		6,000.00	5,818.50	
	AMERIGAS 5.875%		5,000.00	4,931.05	
	AMWINS GRP 7.75% REGS		14,000.00	14,251.16	
	ANTERO RESCS 5.125%		31,000.00	30,858.02	
	ANTERO RESCS 5.625%		2,000.00	1,995.58	
	APERGY 6.375%		2,000.00	2,022.48	
	ARCH MERGER 8.5% REGS		25,000.00	24,266.25	
	ARCONIC 5.9%		17,000.00	17,017.17	
	ARCONIC 5.95%		5,000.00	4,758.90	
	ARCONIC 6.15%		2,000.00	2,062.46	
	ARCONIC 6.75%		7,000.00	7,082.74	
	AUTOMATION 6.5% REGS		7,000.00	7,244.72	
	AVIS BUDGET 5.25% REGS		14,000.00	13,210.82	
	AVIS BUDGET 6.375% REGS		6,000.00	6,088.26	
	AVOLON HLDGS 5.25% REGS		6,000.00	6,104.70	
	AVOLON HLDGS 5.5% REGS		11,000.00	11,214.72	
	B&G FOODS 5.25%		11,000.00	10,473.54	
	BALL CORP 4.875%		3,000.00	3,024.93	
	BALL CORP 5.25%		12,000.00	12,482.16	
	BANFF MERGER 9.75% REGS		17,000.00	16,214.43	
	BAUSCH HEALTH 8.5% REGS		10,000.00	10,290.50	
	BAUSCH HEALTH 9.25% REGS		15,000.00	15,893.25	
	BERRY GLOBAL 4.5% REGS		8,000.00	7,485.20	
	BERRY PLSTCS 5.5%		20,000.00	20,227.00	
	BIG RIVER 7.25% REGS		10,000.00	10,300.00	
	BOMBARDIER 7.5% 24 REGS		10,000.00	10,163.60	
	BOMBARDIER 7.5% 25 REGS		15,000.00	15,090.15	
	BOMBARDIER 7.875% REGS		18,000.00	18,099.90	
	BOMBARDIER 8.75% REGS		50,000.00	54,732.00	
	BOOZ ALLEN 5.125% REGS		9,000.00	9,032.85	
	BOYD GAMING 6.375%		10,000.00	10,298.00	

	BOYD GAMING 6% WI		6,000.00	6,104.40
	BOYNE USA 7.25% REGS		16,000.00	17,009.76
	BRISTOW GROUP 6.25%		2,000.00	500.92
	BUCKEYE PARTNERS FLT		15,000.00	12,929.85
	CABLEVISION 8%		19,000.00	19,737.96
	CALERES 6.25%		10,000.00	10,383.90
	CALIF RESCS 5.5%		2,000.00	1,585.24
	CALIF RESCS 8% REGS		21,000.00	15,448.65
	CALLON PETRO 6.125%		7,000.00	6,962.76
	CALPINE 5.375%		16,000.00	15,785.92
	CALPINE 5.5%		20,000.00	19,173.80
	CALPINE 8.5% ESCROW		200,000.00	-
	CAMELOT FIN 7.875% REGS		18,000.00	18,834.12
	CARRIZO OIL&GAS 6.25%		17,000.00	16,508.02
	CB ESCROW 8% REGS		7,000.00	6,300.63
	CBS OUTDOOR 5.625%		20,000.00	20,485.60
	CCM MERGER 6% REGS		7,000.00	7,141.89
	CCO HOLDINGS 5.125%		57,000.00	57,706.80
	CCO HOLDINGS 5.75%		20,000.00	20,328.60
	CCO HOLDINGS 5.75% E		20,000.00	20,384.00
	CCO HOLDINGS 5.75% REGS		20,000.00	20,467.60
	CCO HOLDINGS5.125%REGS T		5,000.00	4,855.85
	CDW 5.5%		5,000.00	5,188.95
	CDW 5%		5,000.00	5,046.85
	CENTENE CORP 4.75%		5,000.00	5,057.20
	CENTENE CORP 6.125%		21,000.00	21,900.27
	CENTURYLINK 5.8% T		20,000.00	20,257.60
	CENTURYLINK 7.5% Y		5,000.00	5,186.40
	CHARTER COMM 4.464%		16,000.00	16,407.84
	CHARTER COMM 4.908%		6,000.00	6,213.42
	CHEMOURS 7%		12,000.00	12,479.04
	CHENIERE 5.875%		20,000.00	21,216.40
	CHENIERE ENERG5.625%REGS		7,000.00	7,055.72
	CHENIERE ENERGY 5.25%		4,000.00	4,020.76
	CHESAPEAKE NRG 6.625%		6,000.00	6,177.42
	CHESAPEAKE NRG 7%		6,000.00	5,851.14
	CHESAPEAKE NRG 8%		18,000.00	17,921.16
	CHESAPEAKE NRG FLT		2,000.00	1,993.90
	CHESAPEAKE NRG8% REGS 27		16,000.00	15,382.88
	CHUKCHANSI 9.75% REGS		20,875.04	11,481.27
	CINCINNATI BELL 7% REGS		15,000.00	13,385.55
	CINEMARK 4.875%		11,000.00	10,980.97
	CITGO 6.25% REGS		9,000.00	8,955.99
	CLEAR CHNL 6.5% L		15,000.00	15,281.85
	CLEAR CHNL 6.5% M		25,000.00	25,508.00
	CLEAR CHNL 9.25% REGS		27,000.00	28,265.49
	CLEVELAND 5.75% WI		10,000.00	9,581.00
	CLW PAPER 4.5%		15,000.00	14,569.20
	CMTY HLTH SYS 5.125% 21		13,000.00	12,645.10
	CMTY HLTH SYS 6.25%		12,000.00	11,254.68
	CMTY HLTH SYS 8% REGS		13,000.00	12,642.50
	CMTY HLTH SYS8.125% REGS		13,000.00	10,246.86
	CMTY HLTH SYS8.625% REGS		16,000.00	16,179.04
	CNX MIDSTREAM 6.5% REGS		3,000.00	2,942.43
	COEUR MINING 5.875%		4,000.00	3,811.56
	COLFAX 6% REGS		2,000.00	2,057.34

	COMMERCIAL METALS 5.375%		9,000.00	8,447.04
	COMMSCOPE FIN 5.5% REGS		5,000.00	5,073.90
	COMMSCOPE FIN 6% REGS		7,000.00	7,161.77
	COMMSCOPE FIN 8.25% REGS		9,000.00	9,270.27
	COMMSCOPE TECH 5% REGS		7,000.00	6,143.83
	COMMSCOPE TECH 6% REGS		11,000.00	10,419.42
	CONCORDIA INTL 8%		15,000.00	14,295.30
	CONSTELLATION 8.5% REGS		11,000.00	10,492.02
	CORTES NP 9.25% REGS		45,000.00	44,516.70
	COVANTA 5.875%		10,000.00	10,168.60
	COVANTA 5.875% 25		2,000.00	1,981.82
	CRESTWOOD 5.75%		14,000.00	13,989.36
	CROWN AMER/CAP 4.25%		8,000.00	7,617.52
	CROWN AMER/CAP 4.75%		8,000.00	7,939.52
	CSC HOLDINGS 5.25%		35,000.00	34,755.35
	CSC HOLDINGS 6.75%		5,000.00	5,299.80
	CSI COMPRESSCO 7.5% REGS		5,000.00	4,886.15
	CUMBERLAND 6.75% REGS		4,000.00	4,147.00
	CURO GRP 8.25% REGS		14,000.00	11,898.74
	CVR PARTNERS 9.25% REGS		49,000.00	51,621.50
	CYRUSONE 5.375%		5,000.00	5,054.25
	CYRUSONE 5%		2,000.00	2,019.14
	DAVITA HEALTHCARE 5.125%		14,000.00	13,566.14
	DAVITA HEALTHCARE 5%		25,000.00	23,457.50
	DCP MIDSTREAM 3.875%		19,000.00	18,795.18
	DCP MIDSTREAM 4.95%		3,000.00	3,074.49
	DCP MIDSTREAM 5.375%		5,000.00	5,163.90
	DELEK LOGISTICS 6.75% WI		16,000.00	15,441.12
	DENBURY RESCS 7.5% REGS		7,000.00	6,107.85
	DIAMOND 1 FIN7.125% REGS		30,000.00	31,677.00
	DIAMOND OFFSHORE 7.875%		9,000.00	8,353.98
	DIAMONDBACK 4.75% REGS		4,000.00	4,033.56
	DIEBOLD 8.5%		24,000.00	20,694.72
	DISH DBS 5.875% 22		7,000.00	6,633.13
	DISH DBS 6.75%		49,000.00	49,852.60
	DISH DBS 7.75%		5,000.00	4,265.95
	DOLE FOOD 7.25% REGS		12,000.00	10,701.36
	DOWNSTREAM DE10.5%REGS E		25,000.00	25,618.75
	DYNEGY 5.875%		48,000.00	49,013.76
	ELDORADO RESORTS 6%		17,000.00	17,074.12
	ELDORADO RESORTS 6% REGS		4,000.00	4,030.36
	EMBARQ CORP 7.995%		60,000.00	57,460.80
	EMC 3.375%		6,000.00	5,700.96
	ENDO 5.75% REGS		37,000.00	33,415.81
	ENLINK MIDSTREAM 4.15%		6,000.00	5,724.84
	ENLINK MIDSTREAM 4.4%		15,000.00	14,568.15
	ENLINK MIDSTREAM 4.85%		4,000.00	3,915.92
	ENLINK MIDSTREAM 5.6%		5,000.00	4,462.10
	ENSCO 5.2%		13,000.00	9,617.79
	ENSCO 5.75%		3,000.00	1,833.96
	ENSCO 7.75%		4,000.00	3,246.32
	ENSCO 8%		3,000.00	2,639.91
	ENTERPRISE 12% REGS		30,000.00	30,407.40
	ENVISION 8.75% REGS		27,000.00	23,417.37
	EP NRG/EVRST 7.75% REGS		16,000.00	13,796.80
	EP NRG/EVRST 8% REGS C		17,000.00	11,179.88

	EP NRG/EVRST 9.375% REGS		23,000.00	10,319.18
	EQUINIX INC 5.375% 22		8,000.00	8,184.88
	EQUINIX INC 5.375% 23		18,000.00	18,271.44
	EQUINIX INC 5.75%		6,000.00	6,187.68
	ESH HOSPITALITY5.25%REGS		12,000.00	11,973.96
	EW SCRIPPS 5.125% REGS		3,000.00	2,883.09
	EXELA INTERMED 10% REGS		27,000.00	27,328.86
	FIRST DATA 5.375% REGS		15,000.00	15,339.45
	FIRST DATA 5.75% REGS		29,000.00	29,914.08
	FLEX ACQUISITI6.875%REGS		3,000.00	2,857.41
	FMG RESCS 5.125% REGS		12,000.00	11,890.56
	FREEPORT-MC 3.55%		5,000.00	4,878.25
	FREEPORT-MC 3.875%		38,000.00	36,682.16
	FREEPORT-MC 4.55%		5,000.00	4,831.45
	FREEPORT-MC 5.4%		3,000.00	2,679.78
	FREEPORT-MC 5.45%		12,000.00	10,265.04
	FRONTIER COMMS 10.5%		13,000.00	9,268.48
	FRONTIER COMMS 11%		18,000.00	11,495.16
	FRONTIER COMMS 8.5% REGS		5,000.00	4,617.55
	GATES GLOBAL 6% REGS		19,000.00	19,023.18
	GATEWAY 8.25% REGS		25,000.00	26,076.00
	GENESIS NRG 5.625%		8,000.00	7,510.08
	GENESIS NRG 6.75%		10,000.00	10,157.40
	GENESYS 10% REGS		16,000.00	17,491.20
	GLOBAL PRN LP 6.25%		17,000.00	16,777.64
	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	-
	GOODYEAR TIRE 4.875%		26,000.00	23,501.92
	GOODYEAR TIRE 5.125%		10,000.00	9,881.20
	GOODYEAR TIRE 5%		10,000.00	9,249.80
	GRAHAM HLDGS 5.75% REGS		5,000.00	5,170.45
	GRAY ESCROW 7% REGS		7,000.00	7,433.93
	GRAY TV 5.125% REGS		10,000.00	9,950.10
	GRAY TV 5.875% REGS		5,000.00	5,075.10
	GREIF 6.5% REGS		6,000.00	6,096.84
	GW HONOS 8.75% REGS		60,000.00	57,923.40
	H&E EQUIP 5.625%		15,000.00	14,775.90
	HANESBRANDS 4.625% REGS		5,000.00	4,961.55
	HANESBRANDS 4.875% REGS		5,000.00	4,849.10
	HCA 5.625%		2,000.00	2,050.18
	HCA 5.875%		5,000.00	5,176.65
	HCA HEALTHCARE 6.25%		30,000.00	31,282.80
	HCA INC 4.25%		15,000.00	15,080.10
	HCA INC 5.375%		33,000.00	33,912.45
	HCA INC 5.5%		5,000.00	5,139.35
	HCA INC 5.875% 26		15,000.00	15,691.35
	HCA INC 5%		8,000.00	8,386.64
	HCA INC 7.5%		10,000.00	10,911.60
	HECLA MINING 6.875%		14,000.00	13,990.62
	HERTZ 5.5% REGS		7,000.00	5,706.82
	HERTZ 7.375%		7,000.00	6,963.67
	HERTZ 7.625% REGS		2,000.00	2,004.14
	HILCORP NRG 5% REGS		32,000.00	30,758.40
	HILCORP NRG 6.25% REGS		14,000.00	13,765.36

	HILTON GRAND 6.125%		10,000.00	10,255.50	
	HOLLY ENERGY 6% REGS		9,000.00	9,225.00	
	HUDBAY MINERALS7.25%REGS		10,000.00	10,319.70	
	HUGHES SAT 5.25%		17,000.00	16,709.13	
	HUGHES SAT 6.625%		11,000.00	10,649.98	
	ICAHN ENTERPRI 6.375% WI		20,000.00	20,461.00	
	ICAHN ENTERPRI 6.25% WI		14,000.00	14,302.82	
	ICAHN ENTERPRI 6.75% WI		4,000.00	4,140.80	
	IHS MARKIT 4% REGS		6,000.00	5,875.56	
	INCEPTION 8.625% REGS		22,000.00	19,573.84	
	INFOR 6.5%		21,000.00	21,244.44	
	INFORMATICA 7.125% REGS		7,000.00	7,109.90	
	INTELSAT 5.5%		39,000.00	34,961.16	
	INTELSAT 8.5% REGS		32,000.00	31,573.76	
	INTELSAT 8% REGS		18,000.00	18,721.44	
	INTELSAT 9.5% REGS		27,000.00	24,250.86	
	INTERTAPE POLYMER7% REGS		3,000.00	3,033.24	
	IRB HLDG 6.75 REGS		15,000.00	14,145.45	
	IRON MOUNTAIN 5.25% REGS		9,000.00	8,658.36	
	IRON MOUNTAIN 5.75%		22,000.00	21,924.76	
	IRON MOUNTAIN4.875% REGS		8,000.00	7,586.08	
	JBS USA 5.75% REGS		67,000.00	67,610.37	
	JBS USA 7.25% REGS C		36,000.00	36,149.40	
	KAISER ALUM 5.875%		4,000.00	4,087.44	
	KOPPERS HLDGS 6% REGS		7,000.00	6,492.64	
	KRONOS ACQUISITI 9% REGS		9,000.00	7,646.67	
	L BRANDS 5.25%		5,000.00	4,267.05	
	L BRANDS 6.75%		5,000.00	4,178.35	
	LAMAR MEDIA 5.375%		2,000.00	2,039.56	
	LAMAR MEDIA 5.75%		8,000.00	8,362.16	
	LENNAR 4.5%		10,000.00	9,851.60	
	LENNAR 5.25%		5,000.00	4,975.60	
	LENNAR 5.875%		15,000.00	15,619.65	
	LEVEL 3 5.375% 24		17,000.00	17,011.56	
	LEVEL 3 5.625%		17,000.00	17,121.21	
	LIB MED IT 4% EB		12,000.00	8,175.00	
	LIBERTY INTERACTI3.75%EB		8,000.00	5,320.00	
	LIN TELEVISION 5.875%		10,000.00	10,220.30	
	LIONS GATE 6.375% REGS		5,000.00	5,139.65	
	LPL HLDGS 5.75% REGS		8,000.00	8,040.16	
	LPL HLDGS 5.75% REGS C		5,000.00	5,009.30	
	MALLINCKRODT 5.5% REGS		10,000.00	7,795.20	
	MARRIOTT 6.5% REGS		13,000.00	13,512.46	
	MASTEC INC 4.875%		15,000.00	14,913.90	
	MATADOR 5.875%		13,000.00	12,865.06	
	MATCH GROUP 6.375%		5,000.00	5,262.40	
	MATTAMY 6.5% REGS E		5,000.00	4,838.75	
	MATTEL 3.15%		5,000.00	4,370.20	
	MATTEL 6.75% MAY		10,000.00	9,663.80	
	MATTEL 6.75% REGS		4,000.00	3,920.20	
	MGM GROWTH 5.75% REGS		3,000.00	3,037.50	
	MGM RESORTS 5.75%		15,000.00	15,209.40	
	MGM RESORTS 6%		5,000.00	5,192.60	
	MMLP 7.25%		17,000.00	16,536.07	
	MPH ACQUISIT 7.125% REGS		24,000.00	23,559.12	
	NABORS 5.75%		7,000.00	6,154.54	

	NATIONSTAR 6.5% 21		20,000.00	19,932.00
	NEIMAN MARCUS 8% REGS		25,000.00	14,110.50
	NETFLIX 4.875%		10,000.00	9,646.50
	NETFLIX 5.875%		2,000.00	2,106.60
	NETFLIX 5.875% REGS		9,000.00	9,291.51
	NETFLIX INC 5.5%		5,000.00	5,208.25
	NETFLIX INC 5.75%		15,000.00	15,799.35
	NEW ALBERTSONS 7.45%		27,000.00	23,490.00
	NEW ALBERTSONS 8.7%		18,000.00	16,807.50
	NEW HOME 7.25%		10,000.00	8,677.40
	NEXSTAR ESCROW5.625%REGS		10,000.00	9,991.90
	NEXSTAR TV 6.125% REGS		10,000.00	10,152.00
	NEXTERA ENERGY4.25% REGS		8,000.00	7,903.52
	NGPL PIPECO 4.875% REGS		6,000.00	6,023.22
	NIELSEN 5% REGS M		22,000.00	21,860.96
	NOBLE HLDG INT7.875%REGS		13,000.00	11,691.42
	NOBLE HLDG INTL 6.2%		5,000.00	3,175.00
	NOKIA 3.375%		5,000.00	4,906.30
	NORTHERN OIL 9.5%		20,007.00	20,149.81
	NORTHWEST ACQ7.125% REGS		5,000.00	4,505.50
	NOVA CHEMICALS4.875%REGS		8,000.00	7,735.92
	NOVA CHEMICALS5.25% REGS		4,000.00	3,819.80
	NOVELIS 5.875% REGS		20,000.00	19,309.60
	NOVELIS 6.25% REGS		5,000.00	5,018.35
	NRG ENERGY 5.75% WI		8,000.00	8,322.08
	NRG ENERGY 6.25%		10,000.00	10,353.10
	NRG ENERGY 7.25%		10,000.00	10,866.30
	NRG TRANSFER E 5.875%		25,000.00	26,710.00
	NUANCE COMMS 5.625%		11,000.00	11,205.37
	NUSTAR LOGISTICS 5.625%		10,000.00	9,986.40
	NVA HLDGS 6.875% REGS		11,000.00	10,650.64
	OASIS PETRO 6.875%		12,000.00	11,856.24
	OI EUROPEAN 4% REGS		6,000.00	5,879.28
	OI INC/OBGC 5.375% REGS		5,000.00	5,078.10
	OI INC/OBGC 5.875% REGS		13,000.00	13,650.91
	OI INC/OBGC 5% REGS		10,000.00	10,238.20
	OI INC/OBGC 6.375% REGS		3,000.00	3,150.15
	OPEN TEXT 5.875% REGS		9,000.00	9,416.88
	OUTFRONT MEDIA 5.25%		5,000.00	5,043.70
	PARK AEROSPACE 4.5% REGS		12,000.00	11,819.64
	PARK AEROSPACE 5.5% REGS		6,000.00	6,150.48
	PARK AEROSPACE5.25% REGS		5,000.00	5,093.15
	PARTY CITY 6.625% REGS		8,000.00	7,843.76
	PBF HLDG 7.25%		11,000.00	11,158.73
	PBF HOLDING 7%		8,000.00	8,161.68
	PBF LOGISTICS 6.875%		8,000.00	8,107.52
	PEABODY SEC FIN 6% REGS		10,000.00	10,052.10
	PENSKE AUTO 5.5%		18,000.00	17,463.42
	PETSMART 5.875% REGS		3,000.00	2,389.14
	PGT ESCROW 6.75% REGS		10,000.00	10,320.90
	PILGRIM'S 5.75% MAR		4,000.00	3,958.24
	PILGRIM'S 5.75% REGS		21,000.00	20,987.40
	PILGRIM'S 5.75% REGS C		3,000.00	2,983.74
	PLANTRONICS 5.5% REGS		14,000.00	14,005.18
	POST HOLDINGS 5% REGS		20,000.00	19,072.40
	PPD/JAGUAR 6.375% REGS		12,000.00	12,056.40

	PRECIS DRILL 5.25%		2,000.00	1,833.16
	PRECIS DRILL 7.125% REGS		6,000.00	5,849.58
	PRIME SECSRVC 9.25% REGS		28,000.00	29,403.92
	QEP RESOURCES 5.25%		2,000.00	1,910.20
	QEP RESOURCES 5.375%		27,000.00	26,494.83
	QORVO 5.5% REGS		7,000.00	7,102.83
	QUICKEN LOANS 5.25% REGS		23,000.00	20,930.00
	QUICKEN LOANS 5.75% REGS		11,000.00	10,932.57
	RADIAN GRP 4.5%		8,000.00	7,709.20
	REVLON 6.25%		14,000.00	6,997.06
	REYNOLDS GP 5.125% REGS		30,000.00	30,035.70
	REYNOLDS GP 7% REGS		10,000.00	10,202.90
	ROSE ROCK 5.625%		14,000.00	13,655.60
	RR DONNELLEY 7%		2,000.00	2,046.26
	SBA COMMS 4.875%		10,000.00	10,096.10
	SBA COMMS 4.875% 24		10,000.00	9,939.20
	SCIENTIFIC GAMES 10%		29,000.00	30,315.44
	SCIENTIFIC GAMES 5% REGS		33,000.00	31,824.21
	SEALED AIR 4.875% REGS		10,000.00	10,199.60
	SEALED AIR 5.25% REGS		8,000.00	8,259.20
	SEMGROUP 7.25%		9,000.00	8,684.46
	SESI 7.75%		2,000.00	1,700.68
	SEVEN GENERA 5.375% REGS		4,000.00	3,843.20
	SHELF DRILL 8.25% REGS		21,000.00	19,871.25
	SINCLAIR TV 5.125% REGS		8,000.00	7,511.28
	SINCLAIR TV 5.625% REGS		15,000.00	15,097.35
	SIRIUS XM 4.625% REGS		12,000.00	12,082.32
	SIRIUS XM 5.375% 26 REGS		12,000.00	12,024.84
	SIRIUS XM 6% REGS		25,000.00	25,801.00
	SM ENERGY 6.625%		7,000.00	6,486.69
	SM ENERGY 6.75%		7,000.00	6,518.05
	SOLERA 10.5% REGS		15,000.00	16,229.70
	SOTHEBY'S 4.875% REGS		10,000.00	9,741.90
	SPECTRUM BR 5.75%		20,000.00	19,485.00
	SPECTRUM BR 6.125%		10,000.00	9,910.90
	SPRINGLEAF FIN 5.625%		22,000.00	22,070.40
	SPRINGLEAF FIN 6.125% 22		5,000.00	5,154.15
	SPRINGLEAF FIN 6.125% 24		5,000.00	5,014.85
	SPRINGLEAF FIN 7.125%		31,000.00	31,207.70
	SPRINT 7.125%		7,000.00	7,064.96
	SPRINT 7.25%		40,000.00	41,890.80
	SPRINT 7.625% 26		72,000.00	72,820.80
	SPRINT 7.875%		10,000.00	10,493.50
	SPRINT 8.75%		26,000.00	27,347.06
	STANDARD INDUST4.75%REGS		15,000.00	13,736.10
	STARS GRP 7% REGS		10,000.00	10,209.10
	STATION CASINOS 5% REGS		7,000.00	6,733.30
	STEEL DYNAMICS 5.5%		10,000.00	10,246.00
	STEEL DYNAMICS 5%		10,000.00	10,101.00
	STEVENS 6.125% REGS		3,000.00	3,065.61
	SUMMIT MATE 5.125% REGS		62,000.00	59,449.94
	SUMMIT MID 5.75%		15,000.00	14,119.35
	SUNOCO LP 4.875%		4,000.00	4,028.88
	SUNOCO LP 5.5%		5,000.00	4,975.00
	SUNOCO LP 5.875%		3,000.00	2,916.51
	SW ENERGY 7.5%		7,000.00	7,011.20

	SW ENERGY MLT		5,000.00	4,822.90	
	SYMANTEC 5% REGS		12,000.00	11,853.24	
	T-MOBILE USA 4.5%		26,000.00	25,469.34	
	T-MOBILE USA 4.75%		11,000.00	10,601.80	
	T-MOBILE USA 6.5% 24		5,000.00	5,171.30	
	T-MOBILE USA 6.5% 26		13,000.00	13,815.23	
	T-MOBILE USA 6%		9,000.00	9,222.39	
	T-MOBILE USA 6% 24		4,000.00	4,130.72	
	TALEN ENERGY SUPPLY 6.5%		20,000.00	17,458.60	
	TALLGRASS NRG 5.5% REGS		10,000.00	10,176.80	
	TARGA RESCS 4.25%		26,000.00	25,532.52	
	TARGA RESCS 5%		5,000.00	4,796.50	
	TARGA RESCS 6.5% REGS		4,000.00	4,212.96	
	TEAM HEALTH 6.375% REGS		35,000.00	27,050.80	
	TECK RESOURCES 6.125%		11,000.00	11,332.09	
	TECK RESOURCES 6%		7,000.00	6,999.51	
	TEGNA 4.875% REGS		10,000.00	10,053.50	
	TEGNA 5.5% REGS		10,000.00	9,955.50	
	TELECOM ITALIA 6.375%		15,000.00	14,021.70	
	TELECOM ITALIA 6%		11,000.00	10,001.20	
	TELEFLEX 4.875%		2,000.00	2,015.24	
	TELEFLEX INC 5.25%		15,000.00	15,283.65	
	TEMPUR SEALY INTL 5.5%		16,000.00	15,822.08	
	TENET HEALTH 4.5%		12,000.00	12,121.08	
	TENET HEALTH 4.625%		18,000.00	17,820.18	
	TENET HEALTH 4.75%		15,000.00	15,132.45	
	TENET HEALTH 5.125%		20,000.00	19,768.00	
	TENET HEALTH 6.25% REGS		13,000.00	13,345.80	
	TENET HEALTH 8.125%		4,000.00	4,253.60	
	TERRAFORM 4.25% REGS		9,000.00	8,870.76	
	TERRAFORM 5% REGS		11,000.00	10,422.50	
	TERRAFORM 6.125% REGS		4,000.00	3,854.96	
	TERRAFORM MLT REGS		4,000.00	4,189.44	
	THHH 11.5% REGS ESCROW		215,000.00	1,397.50	
	TOLL BROTHERS 5.625%		6,000.00	6,198.66	
	TRANSDIGM 6.25% REGS		13,000.00	13,225.29	
	TRANSDIGM 6.5%		8,000.00	7,916.88	
	TRANSDIGM INC 6.5%		11,000.00	11,043.67	
	TRANSDIGM INC 6%		6,000.00	6,052.08	
	TRANSMONTAIGE 6.125%		6,000.00	5,516.52	
	TRANSOCEAN 5.875% REGS		5,670.00	5,728.57	
	TRANSOCEAN 6.125% REGS		8,505.00	8,546.41	
	TRANSOCEAN 6.25% REGS		7,200.00	7,354.00	
	TRANSOCEAN 6.875% REGS		3,000.00	3,075.48	
	TRANSOCEAN 7.25% REGS		5,000.00	4,720.40	
	TRANSOCEAN 7.5% REGS		8,000.00	7,592.24	
	TRANSOCEAN INC 6.8%		14,000.00	10,622.50	
	TRANSOCEAN INC 7.5%		10,000.00	8,244.60	
	TRANSOCEAN INC 9% REGS		15,000.00	15,732.30	
	TRANSOCEAN INC MLT 41		10,000.00	9,110.00	
	TRAVELPORT 6% REGS		10,000.00	10,861.30	
	TRINSEO 5.375% REGS		12,000.00	11,249.64	
	TRONOX 6.5% REGS		10,000.00	9,398.10	
	TRONOX FIN 5.75% REGS		10,000.00	9,147.90	
	TUTOR PERINI 6.875% REGS		25,000.00	24,853.25	
	ULTRA RESCS 11%		42,000.00	25,396.56	

	UNIT CORP 6.625%		10,000.00	9,632.10	
	UNITED CONTINENTAL 5%		17,000.00	16,973.99	
	UNITED RENTALS 4.625%		15,000.00	14,502.60	
	UNITED RENTALS 5.5% D		21,000.00	21,278.46	
	UNITED RENTALS 6.5%		10,000.00	10,375.90	
	UNIVISION 6.75% REGS G		10,000.00	10,068.60	
	UNIVISION 6.75% REGS H		13,000.00	12,996.10	
	US CONCRETE 6.375%		21,000.00	20,936.79	
	US STEEL 6.25%		12,000.00	11,042.16	
	US STEEL 6.875%		3,000.00	2,897.94	
	USA COM PART 6.875%		5,000.00	5,111.20	
	VALEANT 5.5% REGS		29,000.00	29,015.95	
	VALEANT 5.875% REGS		58,000.00	57,860.22	
	VALEANT 9% REGS		25,000.00	26,531.25	
	VERSCEND HLDG 9.75% REGS		2,000.00	2,007.22	
	VIACOM FLT		5,000.00	4,907.40	
	VIACOM FLT C		5,000.00	4,926.15	
	VIDEOTRON 5.125% REGS		28,000.00	28,215.60	
	VIDEOTRON 5.375% REGS		27,000.00	28,098.90	
	VIKING CRUISES5.875%REGS		3,000.00	2,881.80	
	VOC ESCROW 5% REGS		7,000.00	6,764.52	
	W&T OFFSHORE 9.75% REGS		13,000.00	12,673.31	
	WAND MERGER 8.125% REGS		6,000.00	6,103.68	
	WAND MERGER 9.125% REGS		8,000.00	8,140.72	
	WEATHERFORD 4.5%		4,000.00	2,634.72	
	WEATHERFORD 6.5%		9,000.00	5,285.70	
	WEATHERFORD 6.75%		3,000.00	1,718.70	
	WEATHERFORD 7%		5,000.00	2,876.20	
	WEATHERFORD 9.875%		2,000.00	1,335.38	
	WELLCARE HEALTH 5.25%		10,000.00	10,129.20	
	WESCO 5.375%		7,000.00	7,058.80	
	WESTERN DIGI 4.75%		17,000.00	15,823.94	
	WHITING PETRO 5.75%		14,000.00	13,985.02	
	WHITING PETRO 6.625%		20,000.00	18,866.60	
	WILLIAM CARTER5.625%REGS		5,000.00	5,105.70	
	WMG ACQUISITION 5% REGS		10,000.00	10,063.10	
	WMG ACQUISITION5.5% REGS		4,000.00	4,087.08	
	WPX ENERGY 5.75%		20,000.00	19,694.60	
	WYNDHAM DESTINATI MLT 24		6,000.00	5,971.38	
	WYNDHAM DESTINATI MLT 25		2,000.00	2,073.90	
	WYNDHAM DESTINATI MLT 27		4,000.00	3,920.80	
	WYNDHAM HOTELS5.375%REGS		3,000.00	3,041.64	
	XPO LOGISTICS 6.5% REGS		7,000.00	7,109.27	
	XPO LOGISTICS 6.75% REGS		12,000.00	11,997.24	
	XPO LOGISTICS6.125% REGS		9,000.00	8,941.23	
	ZAYO 5.75% REGS		22,000.00	21,615.00	
	ZAYO GRP 6%		10,000.00	10,095.10	
	計	銘柄数 :	496	7,369,257.04	6,255,938.35
					(694,096,359)
		組入時価比率 :	93.2%		99.8%
	小計				694,096,359
					(694,096,359)
	合計				695,185,488
					(695,185,488)

(注) 各通貨計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

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

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(平成31年4月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	2,282,339,444	円
負債総額	10,226,960	円
純資産総額(-)	2,272,112,484	円
発行済口数	3,322,185,444	口
1口当たり純資産額(/)	0.6839	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31年4月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	11,824,908,744	円
負債総額	2,030,320,746	円
純資産総額(-)	9,794,587,998	円
発行済口数	6,633,732,694	口
1口当たり純資産額(/)	1.4765	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31年4月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	10,421,754,592	円
負債総額	79,039,963	円
純資産総額(-)	10,342,714,629	円
発行済口数	6,842,214,387	口
1口当たり純資産額(/)	1.5116	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31年4月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	763,824,506	円
負債総額	12,401,970	円
純資産総額(-)	751,422,536	円
発行済口数	337,104,787	口
1口当たり純資産額(/)	2.2290	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（2019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。

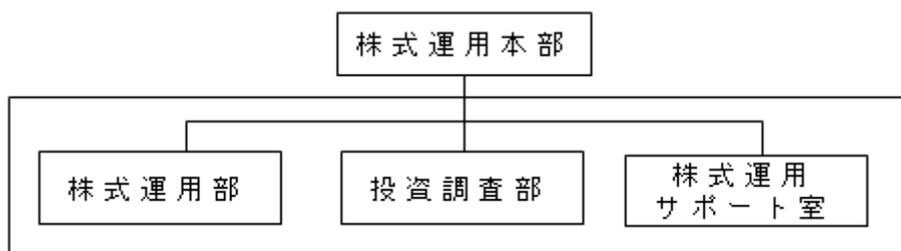
取締役は、株主総会において選任され、任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。増員により、または補欠として選任された取締役の任期は、他の在任取締役の任期の満了する時までとします。

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。
- （ロ）前記（イ）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）および（ロ）の意思決定機構、組織名称等は、2019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】

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 2 事業の内容及び営業の概況」について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行うとともに、金融商品取引法に定める金融商品取引業者として当該証券投資信託および投資一任契約に基づき委託された資産の運用（投資運用業）を行っています。また金融商品取引法に定める以下の業務を行っています。

- ・投資助言・代理業
- ・有価証券の募集もしくは売出しの取扱いまたは私募の取扱いに関する第一種金融商品取引業
- ・有価証券の募集もしくは売出しの取扱いまたは私募の取扱い、および証券投資信託の募集または私募に関する第二種金融商品取引業

委託会社が設定・運用している投資信託は、2019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	66	902,493
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	56	3,112,649
総合計	122	4,015,142
親投資信託	51	-

（注）百万円未満は四捨五入

3【委託会社等の経理状況】

<訂正前>

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

なお、財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

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

<訂正後>

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

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

なお、財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

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

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

原届出書「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」について、以下の中間財務諸表が追加されます。

<追加>

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

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

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

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

(2) 中間損益計算書

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

重要な会計方針

項目	第29期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
1. 有価証券の評価基準 及び評価方法	<p>(1) 関係会社株式 移動平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対する賞与の支給、及び親会社の運営する株式報酬制度に係る将来の費用負担に備えるため、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員に対する退職給付に備えるため、当中間期末における退職給付債務と年金資産の見込額に基づき退職給付引当金を計上しております。ただし、当中間期末においては、年金資産の額が、退職給付債務に未認識数理計算上の差異等を加減した額を超過するため、資産の部に前払年金費用を計上しております。 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間期末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 過去勤務債務については、その発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（8年）による定額法により、発生した事業年度から費用処理しております。 数理計算上の差異は、その発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（8年）による定額法により按分額を、それぞれ発生した翌事業年度から費用処理することとしております。</p>
3. その他中間財務諸表 作成のための基本と なる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

（リース取引関係）

第29期中間会計期間末 (平成30年9月30日)	
オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料は以下のとおりであります。	
1年以内	48,482 千円
1年超	44,442 千円
合計	92,924 千円

（金融商品関係）

第29期中間会計期間末（平成30年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成30年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、金額的重要性が低いと判断するものは次表には含めておりません。また、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません（注）2．参照）。

（単位：千円）

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

（注）1．金融商品の時価算定方法

資産

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

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(5) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、及び(3) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(4) 長期未払金

長期未払金の時価については、当該未払金の支払までの期間を基にリスクフリーレートで割り引いた現在価値により算定しており、時価は帳簿価額と近似していることから当該帳簿価額によっております。

（注）２．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額
関係会社株式	60,000

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

金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

（有価証券関係）

第29期中間会計期間末（平成30年9月30日）

１．関係会社株式

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

２．その他有価証券

（単位：千円）

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

（セグメント情報等）

セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第29期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

1．サービスごとの情報

（単位：千円）

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

2．地域ごとの情報

営業収益

（単位：千円）

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

（注）営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益	関連するセグメント
Jardine Fleming Asset Management Ltd	1,320,915	資産運用業
JPMorgan Asset Management (UK) Limited	1,209,785	資産運用業

（1株当たり情報）

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1) 受託会社

名 称 三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額 324,279百万円（平成30年3月末現在）

(略)

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成30年3月末現在)	事業の内容
(略)		

(3) 運用委託先の会社

名 称	資本金の額 (平成30年3月末現在)	事業の内容
(略)		

<訂正後>

(1) 受託会社

名 称 三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額 324,279百万円（2018年9月末現在）

(略)

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2018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 (2018年9月末現在)	事業の内容
(略)		

独立監査人の監査報告書

平成31年4月17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30年9月11日から平成31年3月11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31年3月11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30年12月10日

J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているJ Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

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

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。