

【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】 2021年6月9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、2020年12月9日付で提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また記載事項の一部訂正を行うため、訂正届出書を提出いたします。

## ・【訂正の内容】

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

(1) ファンドの目的及び基本的性格

(二) ファンドの特色

マザーファンドの特色

< 訂正前 >

(略)

**G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド**

(a) (略)

(b) 主要投資対象は、新興国\*1の現地通貨建てのソブリン債券です。

\*1 「新興国」とは、運用委託先が、国内経済が成長過程にあると判断する国をいいます。例えば、当マザーファンドの参考指標（J P モルガン G B I - エマージング・マーケット・グローバル\*2（円ベース））の構成国（2020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、ベルー、ロシア、コロンビア、タイ、フィリピン、チリ、ルーマニア、チェコ、ウルグアイ、ドミニカ共和国および中国）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（2021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、ベルー、ロシア、コロンビア、タイ、フィリピン、チリ、ルーマニア、チェコ、ウルグアイ、ドミニカ共和国および中国）が該当します。

(以下略)

(3) ファンドの仕組み

(八) 委託会社の概況

< 訂正前 >

資本金 2,218百万円（2020年10月末現在）

(略)

大株主の状況（2020年10月末現在）

(以下略)

< 訂正後 >

資本金 2,218百万円（2021年4月末現在）

(略)

大株主の状況（2021年4月末現在）

(以下略)

## 2【投資方針】

### (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、2020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)

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属するインターナショナル債券運用チーム(約40名)の担当ポートフォリオ・マネジャーにより運用されます。同チームは、運用チームと運用戦略チームで構成されます。

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、2020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、2020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)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、2020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、2021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)

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属するインターナショナル債券運用チーム(約60名)の担当ポートフォリオ・マネジャーにより運用されます。同チームは、運用チームと運用戦略チームで構成されます。

(略)

(注)前記の運用体制、組織名称等は、2021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、2021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）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2021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

<訂正前>

（略）

マザーファンド共通

（略）

LIBORの公表停止または利用できない場合のリスクおよび留意点

（略）

当ファンドおよびマザーファンド共通

（略）

<訂正後>

（略）

マザーファンド共通

（略）

LIBORの公表停止または利用できない場合のリスクおよび留意点

（略）

法律、税制および規制に関するリスク

法律、税制および規制の変更が当ファンドの信託期間中に生じ、それが当ファンドおよびマザーファンドに悪影響を及ぼすことがあります。現在施行されている法律および規制が変更された場合、または新しい法律および規制が制定された場合、当ファンド、マザーファンドおよび投資者に対する法的要件は現在求められているものと大幅に異なる可能性があり、当ファンド、マザーファンドおよび投資者に重大かつ悪い影響を及ぼすことがあります。

当ファンドおよびマザーファンド共通

（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

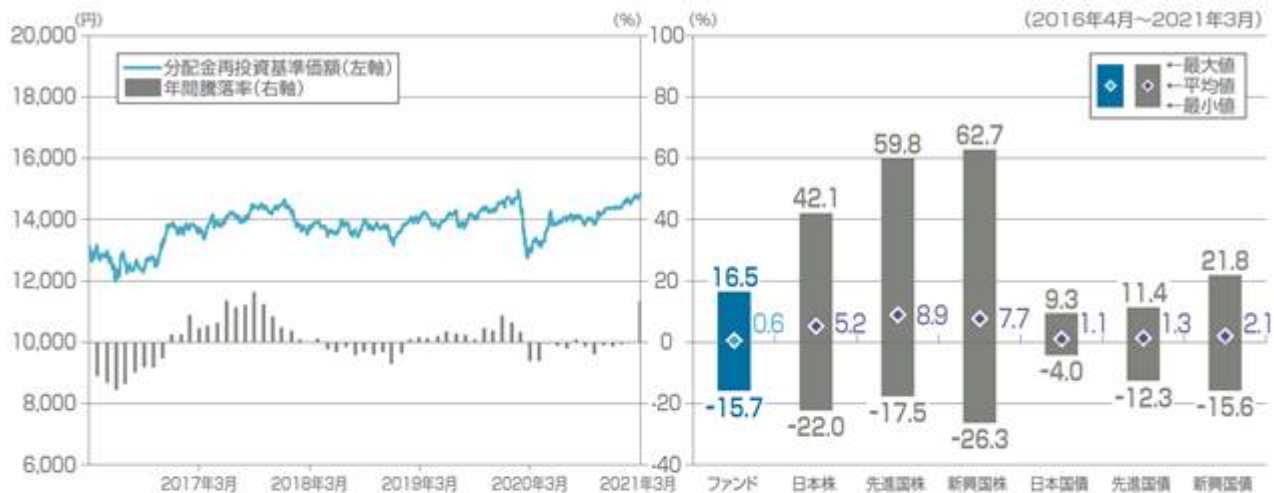
下記グラフは、ファンドの投資リスクをご理解いただくための情報の一つとしてご利用ください。

### <ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移>

2016年4月～2021年3月の5年間における、ファンドの分配金再投資基準価額(日次)と、年間騰落率(毎月末時点)の推移を示したものです。

### <ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較>

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



#### (ご注意)

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

#### ○代表的な資産クラスを表す指数

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

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

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

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

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

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

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

## (2) 投資リスクに関する管理体制

### (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)

(2020年9月末現在)

(以下略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

(2021年3月末現在)

(以下略)

## 4【手数料等及び税金】

(5)課税上の取扱い

&lt;訂正前&gt;

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2020年10月末現在適用されるものです。

(以下略)

&lt;訂正後&gt;

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2021年4月末現在適用されるものです。

(以下略)

## 5【運用状況】

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

&lt;更新・訂正後&gt;

(1)投資状況

(2021年4月9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	624,703,956	33.18
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	632,299,651	33.58
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	628,546,978	33.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,504,262	0.13
合計(純資産総額)		1,883,046,323	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)

(2021年4月9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	1,554,692,996	19.38
	ドイツ	471,351,989	5.88

	イタリア	119,951,295	1.50
	フランス	62,057,049	0.77
	スペイン	183,308,907	2.28
	フィンランド	9,765,183	0.12
	イギリス	430,392,756	5.36
	オーストラリア	53,673,611	0.67
	香港	256,573,424	3.20
	中国	499,504,500	6.23
	小計	3,641,271,710	45.39
地方債証券	カナダ	48,193,195	0.60
	ドイツ	18,766,593	0.23
	オーストラリア	15,426,817	0.19
	小計	82,386,605	1.03
特殊債券	アメリカ	470,202,849	5.86
	フランス	40,943,242	0.51
	ルクセンブルク	17,759,531	0.22
	イギリス	140,511,283	1.75
	シンガポール	49,916,184	0.62
	小計	719,333,089	8.97
社債券	アメリカ	1,787,385,350	22.28
	カナダ	13,227,823	0.16
	ドイツ	121,792,389	1.52
	イタリア	13,636,542	0.17
	フランス	173,852,983	2.17
	オランダ	67,865,195	0.85
	アイルランド	44,157,407	0.55
	イギリス	821,745,538	10.24
	スイス	61,285,712	0.76
	オーストラリア	25,439,578	0.32
	小計	3,130,388,517	39.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	449,033,722	5.60
合計(純資産総額)		8,022,413,643	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)

(2021年4月9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	115,424,462	1.43
	メキシコ	973,245,759	12.03
	ブラジル	648,510,966	8.02
	チリ	129,138,839	1.60
	コロンビア	186,944,458	2.31
	ペルー	54,244,406	0.67
	イギリス	11,926,876	0.15

	チェコ	26,602,472	0.33
	ハンガリー	357,734,798	4.42
	ロシア	469,424,174	5.80
	ルーマニア	102,542,043	1.27
	マレーシア	337,073,119	4.17
	タイ	313,986,872	3.88
	フィリピン	10,034,921	0.12
	インドネシア	541,432,690	6.69
	中国	1,550,416,490	19.17
	カザフスタン	43,543,549	0.54
	エジプト	132,970,748	1.64
	南アフリカ	807,936,559	9.99
	セルビア	54,092,257	0.67
	小計	6,867,226,458	84.91
特殊債券	ポーランド	54,990,244	0.68
	中国	572,906,499	7.08
	小計	627,896,743	7.76
社債券	アメリカ	45,281,535	0.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	547,487,184	6.77
合計(純資産総額)		8,087,891,920	100.00

(注1) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。投資比率は四捨五入です。

(注2) 上記の「国/地域」は、マザーファンドが保有する有価証券の発行地または上場取引所の国/地域を表しています。

具体的な投資対象については、「第1ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 (2) ファンドの特色」をご参照ください。

(参考) G I M米国高利回り社債マザーファンド(適格機関投資家専用)

(2021年4月9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	4,289,379	0.68
新株予約権証券	アメリカ	81	0.00
新株予約権付社債券等	アメリカ	1,699,363	0.27
特殊債券	アメリカ	1,109,736	0.18
社債券	アメリカ	572,412,215	91.07
	カナダ	3,269,274	0.52
	ドイツ	3,472,387	0.55
	ルクセンブルク	2,037,016	0.32
	小計	581,190,892	92.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	40,246,032	6.40
合計(純資産総額)		628,535,483	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

(2021年4月9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）	399,204,275	1.5551	620,802,687	1.5839	632,299,651	33.58
2	日本	親投資信託 受益証券	G I M米国高利回り社債マザーファンド （適格機関投資家専用）	256,623,108	2.4021	616,434,530	2.4493	628,546,978	33.38
3	日本	親投資信託 受益証券	G I M世界投資適格債券マザーファンド （適格機関投資家専用）	381,568,505	1.6226	619,133,128	1.6372	624,703,956	33.18

## (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）

(2021年4月9日現在)

順位	国/ 地域	投資国/ 地域	種類	銘柄名	券面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	アメリカ	国債 証券	US T-NOTE 0.25% JUN25	5,827,700	10,735.43	625,629,099	10,743.97	626,126,775	0.25	2025/6/30	7.80
2	中国	中国	国債 証券	CHINA GOVT 3.02%OCT25INBK	30,000,000	1,663.91	499,173,167	1,665.01	499,504,500	3.02	2025/10/22	6.23
3	アメリカ	アメリカ	国債 証券	US T-NOTE 0.125% JUL22	2,385,000	10,929.29	260,663,614	10,933.98	260,775,636	0.125	2022/7/31	3.25
4	アメリカ	アメリカ	国債 証券	US T-BOND 1.875% FEB51	2,130,000	9,995.63	212,907,003	9,911.34	211,111,595	1.875	2051/2/15	2.63
5	ドイツ	カナダ	国債 証券	CANADA GOVT 1% SEP22	2,016,000	8,802.35	177,455,480	8,803.39	177,476,537	1	2022/9/1	2.21
6	アメリカ	アメリカ	国債 証券	US T-NOTE 0.125% JAN24	1,540,000	10,873.78	167,456,260	10,882.32	167,587,773	0.125	2024/1/15	2.09
7	香港	中国	国債 証券	CHINA GOVT 3.48% JUN27	8,000,000	1,736.32	138,905,989	1,733.80	138,704,453	3.48	2027/6/29	1.73
8	アメリカ	アメリカ	国債 証券	US T-NOTE 0.125% NOV22	1,250,000	10,924.59	136,557,438	10,930.57	136,632,162	0.125	2022/11/30	1.70
9	イギリス	イギリス	国債 証券	UK GOVT 4.25% DEC40	582,541.22	23,225.47	135,297,955	23,062.56	134,348,975	4.25	2040/12/7	1.67
10	ドイツ	ドイツ	国債 証券	GERMANY BUND 0% AUG30	810,002	13,446.22	108,914,669	13,495.56	109,314,374	0	2030/8/15	1.36
11	スペイン	スペイン	国債 証券	SPAIN GOVT 1% OCT50	740,000	12,286.73	90,921,860	12,161.65	89,996,280	1	2050/10/31	1.12
12	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	FN FM2399	715,161.01	11,812.03	84,475,093	11,815.67	84,501,119	3.5	2032/9/1	1.05
13	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	FN FM1747	688,151.53	11,962.88	82,322,785	11,867.72	81,667,935	3.5	2047/8/1	1.02
14	イギリス	オースト ラリア	社債 券	CBA 0.5% EMTN	550,000	13,527.61	74,401,909	13,558.75	74,573,175	0.5	2026/7/27	0.93
15	イタリア	イタリア	国債 証券	ITALY BTP 0.95% MAR37	563,000	12,661.06	71,281,774	12,635.13	71,135,801	0.95	2037/3/1	0.89
16	ドイツ	ドイツ	国債 証券	GERMANY BUND 0% AUG50	548,919	12,267.97	67,341,251	12,201.78	66,977,936	0	2050/8/15	0.83
17	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	FN BF0263	548,478.12	12,096.24	66,345,255	11,995.66	65,793,614	3.5	2058/5/1	0.82
18	イギリス	中国	国債 証券	CHINA EUR 0.25% NOV30	500,000	12,911.21	64,556,090	12,899.75	64,498,762	0.25	2030/11/25	0.80
19	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	FN BF0381	517,182.67	12,350.93	63,876,904	12,322.74	63,731,099	4	2059/4/1	0.79
20	アメリカ	アメリカ	特殊 債券	FG G18592	547,694.79	11,579.20	63,418,720	11,597.36	63,518,151	3	2031/3/1	0.79
21	イギリス	ニュー ジーラ ンド	社債 券	ASB FIN 0.75% EMTN	430,000	13,602.01	58,488,667	13,624.42	58,585,029	0.75	2025/10/9	0.73
22	イギリス	イギリス	国債 証券	UK GOVT 4.75% DEC30	280,000	20,498.49	57,395,779	20,621.87	57,741,243	4.75	2030/12/7	0.72
23	香港	中国	国債 証券	CHINA GOVT 4.29% MAY29	3,000,000	1,842.43	55,272,938	1,839.61	55,188,353	4.29	2029/5/22	0.69
24	アメリカ	スイス	社債 券	CREDIT SUISSE 2.8%	490,000	11,215.64	54,956,652	11,172.02	54,742,940	2.8	2022/4/8	0.68

25	アメリカ	イタリア	国債証券	ITALY 2.375% OCT24	480,000	11,406.60	54,751,718	11,401.25	54,726,008	2.375	2024/10/17	0.68
26	ドイツ	カナダ	国債証券	CANADA GOVT 5% JUN37	410,000	12,876.52	52,793,747	12,785.21	52,419,396	5	2037/6/1	0.65
27	ドイツ	カナダ	国債証券	CANADA GOVT 0.5% DEC30	650,000	7,959.11	51,734,226	7,953.28	51,696,320	0.5	2030/12/1	0.64
28	アメリカ	アメリカ	社債証券	WELLS FARGO FLT MTN	400,000	12,622.90	50,491,600	12,665.96	50,663,873	4.478	2031/4/4	0.63
29	イギリス	イギリス	国債証券	UK GOVT 0.625% OCT50	400,000	12,465.12	49,860,499	12,599.47	50,397,900	0.625	2050/10/22	0.63
30	シンガポール	韓国	特殊債券	KOREA HOUSING 0.01% REGS	380,000	13,123.85	49,870,635	13,135.83	49,916,184	0.01	2025/2/5	0.62

## （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）

（2021年4月9日現在）

順位	国/地域	投資国/地域	種類	銘柄名	券面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	中国	中国	国債証券	CHINA GOVT 2.68%MAY301NBK	29,500,000	1,586.80	468,107,441	1,589.98	469,045,006	2.68	2030/5/21	5.80
2	南アフリカ	南アフリカ	国債証券	S. AFRICA10.5% DEC26 R186	49,914,951	849.76	424,158,893	860.72	429,630,053	10.5	2026/12/21	5.31
3	中国	中国	国債証券	CHINA GOVT 2.85%JUN271NBK	25,500,000	1,627.87	415,107,975	1,633.36	416,509,331	2.85	2027/6/4	5.15
4	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 6.5% JUN22	68,880,000	558.79	384,900,530	556.00	382,979,622	6.5	2022/6/9	4.74
5	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN23 NTNF	14,228,000	2,125.67	302,440,948	2,117.59	301,291,466	10	2023/1/1	3.73
6	中国	中国	国債証券	CHINA GOVT 3.27%NOV301NBK	16,500,000	1,669.66	275,494,670	1,672.74	276,003,655	3.27	2030/11/19	3.41
7	中国	中国	特殊債券	CHINA DEV BK 3.07% 2005	15,000,000	1,584.84	237,726,688	1,593.29	238,994,460	3.07	2030/3/10	2.95
8	インドネシア	インドネシア	国債証券	INDON 8.25% MAY36 FR72	25,005,000,000	0.80	200,965,185	0.83	209,072,207	8.25	2036/5/15	2.59
9	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 8.5% MAY29	32,410,000	634.33	205,588,233	624.75	202,483,630	8.5	2029/5/31	2.50
10	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 8% DEC23	31,754,000	591.21	187,733,868	585.04	185,775,732	8	2023/12/7	2.30
11	ハンガリー	ハンガリー	国債証券	HUNGARY 1.5% APR26 26/E	490,000,000	35.62	174,555,921	35.68	174,874,750	1.5	2026/4/22	2.16
12	中国	中国	国債証券	CHINA GOVT 3.02%OCT251NBK	9,500,000	1,663.91	158,071,503	1,665.01	158,176,425	3.02	2025/10/22	1.96
13	ロシア	ロシア	国債証券	RUSSIA 7.15% NOV25 6229	106,000,000	147.79	156,658,205	144.15	152,801,883	7.15	2025/11/12	1.89
14	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN25 NTNF	6,940,000	2,149.92	149,204,968	2,120.80	147,184,075	10	2025/1/1	1.82
15	中国	中国	国債証券	CHINA GOVT 3.81%SEP501NBK	8,000,000	1,694.71	135,577,450	1,684.56	134,765,169	3.81	2050/9/14	1.67
16	中国	中国	特殊債券	CHINA DEV BK 3.23% 2003	8,000,000	1,658.17	132,653,717	1,661.65	132,932,263	3.23	2025/1/10	1.64
17	チリ	チリ	国債証券	CHILE GOVT 4.5% MAR26	745,000,000	17.50	130,413,459	17.33	129,138,839	4.5	2026/3/1	1.60
18	ハンガリー	ハンガリー	国債証券	HUNGARY 1% NOV25 25/C	351,970,000	35.01	123,244,115	35.25	124,073,180	1	2025/11/26	1.53
19	ブラジル	ブラジル	国債証券	BRAZIL 10% JAN27 NTNF	5,380,000	2,158.86	116,146,676	2,109.27	113,478,767	10	2027/1/1	1.40
20	タイ	タイ	国債証券	THAI GOVT 3.775% JUN32	26,842,000	402.14	107,944,781	407.88	109,484,180	3.775	2032/6/25	1.35
21	インドネシア	インドネシア	国債証券	INDON 8.75% MAY31 FR73	11,305,000,000	0.85	96,656,891	0.87	98,417,351	8.75	2031/5/15	1.22
22	ロシア	ロシア	国債証券	RUSSIA 8.15% FEB27 6207	64,550,000	154.68	99,846,327	150.13	96,911,342	8.15	2027/2/3	1.20
23	中国	中国	国債証券	CHINA GOVT 1.99%APR251NBK	6,000,000	1,596.77	95,806,293	1,598.61	95,916,904	1.99	2025/4/9	1.19
24	南アフリカ	南アフリカ	国債証券	S. AFRICA8.875% FEB35 2035	13,986,398	645.28	90,251,897	657.15	91,911,702	8.875	2035/2/28	1.14
25	タイ	タイ	国債証券	THAI GOVT 3.3% JUN38	23,000,000	381.19	87,675,016	387.25	89,067,712	3.3	2038/6/17	1.10
26	コロンビア	コロンビア	国債証券	COLOMBIA TES 6% APR28	2,902,500,000	3.01	87,492,251	2.99	86,918,343	6	2028/4/28	1.07
27	中国	中国	特殊債券	CHINA DEV BK 3% 2007	5,000,000	1,661.58	83,079,245	1,663.73	83,186,936	3	2023/8/7	1.03
28	ロシア	ロシア	国債証券	RUSSIA 7.65% APR30 6228	56,605,000	152.43	86,286,160	146.44	82,893,358	7.65	2030/4/10	1.02
29	メキシコ	メキシコ	国債証券	MEXICO GOVT 5.75% MAR26	15,000,000	554.88	83,233,306	549.15	82,373,632	5.75	2026/3/5	1.02
30	マレーシア	マレーシア	国債証券	MALAYSIA 4.232% JUN31	2,872,000	2,791.98	80,185,849	2,853.46	81,951,649	4.232	2031/6/30	1.01

（注）上記の「国/地域」は、マザーファンドが保有する有価証券の発行地または上場取引所の国/地域を表しています。なお、「投資国/地域」は、「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、どこへの投資であるかを委託会社が分類し、記載したものです。その

ため、有価証券の発行地と実質的な事業活動が行われている地域が異なる場合等には、上記の「国/地域」と「投資国/地域」における国/地域名が異なる場合があります。

（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）

（2021年4月9日現在）

順位	国/ 地域	投資国/ 地域	種類	銘柄名	券面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	アメリカ	社債券	FORD MOTOR 9%	140,000	13,341.28	18,677,800	13,322.15	18,651,019	9	2025/4/22	2.97
2	アメリカ	アメリカ	社債券	HCA 5.625%	112,000	12,831.90	14,371,729	12,670.45	14,190,904	5.625	2028/9/1	2.26
3	アメリカ	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS 5.25%	110,000	11,814.55	12,996,008	11,867.02	13,053,724	5.25	2024/6/1	2.08
4	アメリカ	アメリカ	社債券	NEWELL BRANDS MLT	85,000	12,000.37	10,200,322	12,157.45	10,333,839	4.7	2026/4/1	1.64
5	アメリカ	アメリカ	社債券	SPRINT 7.625%	75,000	13,075.55	9,806,665	13,110.31	9,832,735	7.625	2025/2/15	1.56
6	アメリカ	アメリカ	社債券	SPRINT 7.625% 26	72,000	13,525.47	9,738,340	13,514.54	9,730,470	7.625	2026/3/1	1.55
7	アメリカ	アメリカ	社債券	ALLY FINANCIAL 5.75%	78,000	12,675.15	9,886,617	12,441.66	9,704,498	5.75	2025/11/20	1.54
8	アメリカ	アメリカ	社債券	DISH DBS 5.875% 24	80,000	11,399.83	9,119,864	11,556.69	9,245,352	5.875	2024/11/15	1.47
9	アメリカ	アメリカ	社債券	MGM RESORTS 5.75%	70,000	12,013.17	8,409,219	11,976.87	8,383,815	5.75	2025/6/15	1.33
10	アメリカ	アメリカ	社債券	CIT GROUP 4.75%	70,000	11,878.82	8,315,178	11,953.37	8,367,363	4.75	2024/2/16	1.33
11	アメリカ	アメリカ	社債券	FREEMPORT-MC 5%	70,000	11,617.03	8,131,921	11,637.36	8,146,153	5	2027/9/1	1.30
12	アメリカ	アメリカ	社債券	ICAHN ENTERPRIS 6.25%	66,000	10,957.73	7,232,103	10,930.56	7,214,172	6.25	2022/2/1	1.15
13	アメリカ	アメリカ	社債券	CDW 4.25%	62,000	11,384.41	7,058,339	11,364.63	7,046,072	4.25	2028/4/1	1.12
14	アメリカ	アメリカ	社債券	TENET HEALTH 5.125%	60,000	11,060.86	6,636,516	11,050.36	6,630,220	5.125	2025/5/1	1.05
15	アメリカ	アメリカ	社債券	CENTENE 4.625%	55,000	12,008.25	6,604,538	11,910.30	6,550,670	4.625	2029/12/15	1.04
16	アメリカ	アメリカ	社債券	L BRANDS 5.625%	55,000	11,822.86	6,502,573	11,802.85	6,491,571	5.625	2023/10/15	1.03
17	アメリカ	アメリカ	社債券	SPRINGLEAF FIN 7.125%	51,000	12,859.77	6,558,486	12,718.54	6,486,459	7.125	2026/3/15	1.03
18	アメリカ	アメリカ	社債券	UNITED RENTALS 5.5% F	55,000	11,681.30	6,424,717	11,643.92	6,404,156	5.5	2027/5/15	1.02
19	アメリカ	アメリカ	社債券	APACHE 4.875%	55,000	11,549.36	6,352,152	11,167.65	6,142,211	4.875	2027/11/15	0.98
20	アメリカ	アメリカ	社債券	TEAM HEALTH 6.375% REGS	62,000	9,670.21	5,995,536	9,699.29	6,013,563	6.375	2025/2/1	0.96
21	アメリカ	アメリカ	社債券	CLEAR CHNL 5.125% REGS	53,000	11,186.56	5,928,881	11,061.07	5,862,372	5.125	2027/8/15	0.93
22	アメリカ	アメリカ	社債券	SUMMIT MATE 5.125% REGS	52,000	11,135.84	5,790,640	11,102.94	5,773,531	5.125	2025/6/1	0.92
23	アメリカ	アメリカ	社債券	SCOTTS MIRACLE 5.25%	50,000	11,470.71	5,735,359	11,409.77	5,704,889	5.25	2026/12/15	0.91
24	アメリカ	アメリカ	社債券	CVR PARTNERS 9.25% REGS	49,000	11,064.46	5,421,589	11,022.27	5,400,914	9.25	2023/6/15	0.86
25	アメリカ	アメリカ	社債券	OCCIDENTAL PETRO 8.5%	40,000	12,689.90	5,075,963	13,112.93	5,245,175	8.5	2027/7/15	0.83
26	アメリカ	アメリカ	社債券	UNITED RENTALS 4.875%	45,000	11,636.05	5,236,223	11,574.50	5,208,529	4.875	2028/1/15	0.83
27	アメリカ	アメリカ	社債券	HUGHES SAT 6.625%	36,000	12,330.27	4,438,900	12,201.40	4,392,504	6.625	2026/8/1	0.70
28	アメリカ	アメリカ	社債券	MATTEL 6.75% MAY	38,000	11,490.66	4,366,453	11,499.73	4,369,901	6.75	2025/12/31	0.70
29	アメリカ	アメリカ	社債券	TEMPUR SEALY INTL 5.5%	38,000	11,289.53	4,290,024	11,302.87	4,295,092	5.5	2026/6/15	0.68
30	アメリカ	アメリカ	社債券	DISH DBS 6.75%	39,000	11,094.31	4,326,781	11,011.34	4,294,424	6.75	2021/6/1	0.68

（注）上記の「国/地域」は、マザーファンドが保有する有価証券の発行地または上場取引所の国/地域を表しています。なお、「投資国/地域」は、「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/地域」における国/地域名が異なる場合があります。

種類別および業種別投資比率

（2021年4月9日現在）

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	100.13

## (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)

(2021年4月9日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	45.39
地方債証券	1.03
特殊債券	8.97
社債券	39.02

## (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)

(2021年4月9日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	84.91
特殊債券	7.76
社債券	0.56

## (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)

(2021年4月9日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	小売	0.47
		金融	0.16
		エネルギー	0.05
小計			0.68
新株予約権証券	-		0.00
新株予約権付社債券等	-		0.27
特殊債券	-		0.18
社債券	-		92.47

(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。

## (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)

(2021年4月9日現在)

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額	評価額金額	評価額金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	10TNOTE 2106	売建	11	米ドル	1,443,385.9	1,452,000	158,718,120	1.96

(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銘柄の評価額金額の比率をいいます。

(注2) 評価額については、原則として上記に記載の日に知りうる直近の日に主たる取引所の発表する清算値段また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、同日に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。

## ( 3 ) 運用実績

## 純資産の推移

2021年4月9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10特定期間末	(2011年9月12日)	7,812	7,860	0.5617	0.5652
第11特定期間末	(2012年3月12日)	7,029	7,053	0.6008	0.6028
第12特定期間末	(2012年9月10日)	6,343	6,365	0.5752	0.5772
第13特定期間末	(2013年3月11日)	6,902	6,921	0.7210	0.7230
第14特定期間末	(2013年9月10日)	5,897	5,914	0.7028	0.7048
第15特定期間末	(2014年3月10日)	5,381	5,395	0.7456	0.7476
第16特定期間末	(2014年9月10日)	4,844	4,857	0.7728	0.7748
第17特定期間末	(2015年3月10日)	4,607	4,618	0.8115	0.8135
第18特定期間末	(2015年9月10日)	3,852	3,862	0.7529	0.7549
第19特定期間末	(2016年3月10日)	3,178	3,187	0.6947	0.6967
第20特定期間末	(2016年9月12日)	2,860	2,868	0.6627	0.6647
第21特定期間末	(2017年3月10日)	2,843	2,851	0.7196	0.7216
第22特定期間末	(2017年9月11日)	2,681	2,688	0.7183	0.7203
第23特定期間末	(2018年3月12日)	2,474	2,481	0.6943	0.6963
第24特定期間末	(2018年9月10日)	2,314	2,321	0.6652	0.6672
第25特定期間末	(2019年3月11日)	2,252	2,258	0.6737	0.6757
第26特定期間末	(2019年9月10日)	2,138	2,144	0.6720	0.6740
第27特定期間末	(2020年3月10日)	1,950	1,956	0.6360	0.6380
第28特定期間末	(2020年9月10日)	1,925	1,931	0.6499	0.6519
第29特定期間末	(2021年3月10日)	1,871	1,877	0.6624	0.6644
	2020年4月末日	1,877	-	0.6185	-
	2020年5月末日	1,931	-	0.6398	-
	2020年6月末日	1,937	-	0.6444	-
	2020年7月末日	1,935	-	0.6453	-
	2020年8月末日	1,927	-	0.6471	-
	2020年9月末日	1,875	-	0.6395	-
	2020年10月末日	1,837	-	0.6344	-
	2020年11月末日	1,874	-	0.6492	-
	2020年12月末日	1,894	-	0.6567	-
	2021年1月末日	1,881	-	0.6567	-
	2021年2月末日	1,860	-	0.6573	-
	2021年3月末日	1,890	-	0.6722	-
	2021年4月9日	1,883	-	0.6718	-

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

## 分配の推移

期	1口当たり分配金（円）
第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
第26特定期間	0.0120
第27特定期間	0.0120
第28特定期間	0.0120
第29特定期間	0.0120

## 収益率の推移

期	収益率（％）
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
第26特定期間	1.5
第27特定期間	3.6
第28特定期間	4.1
第29特定期間	3.8

（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
第26特定期間	23,037,099	183,783,766	3,182,411,294
第27特定期間	33,966,307	149,265,456	3,067,112,145
第28特定期間	24,500,532	129,073,677	2,962,539,000
第29特定期間	21,262,840	157,709,341	2,826,092,499

(注) 設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

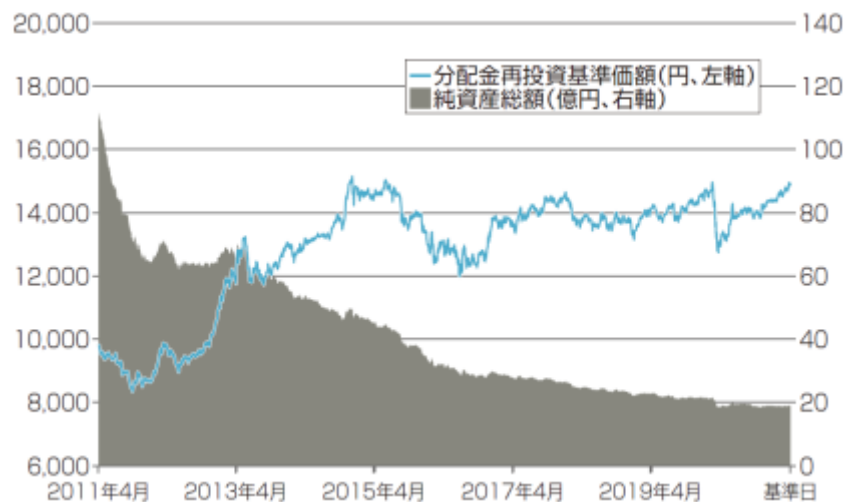
## &lt;参考情報&gt;

最新の運用実績は、委託会社ホームページ（<https://www.jpmorgan.com/jp/am/>）、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	2021年4月9日	設定日	2006年9月29日
純資産総額	18億円	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
169期	2020年11月	20
170期	2020年12月	20
171期	2021年1月	20
172期	2021年2月	20
173期	2021年3月	20
	設定来累計	5,735

\* 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

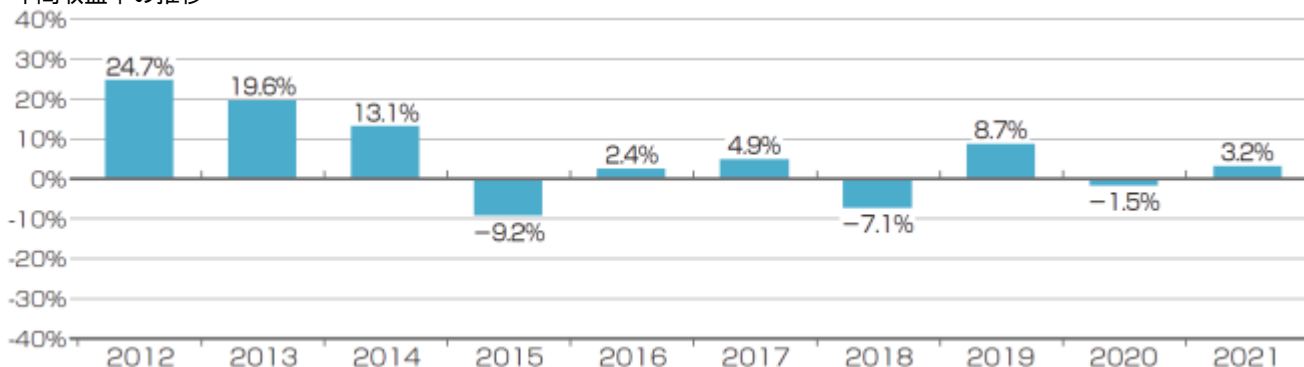
資産の種類	投資比率
GIM世界投資適格債券マザーファンド（適格機関投資家専用）	33.6%
GIM米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）	33.4%
GIM新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド（適格機関投資家専用）	33.2%
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-0.2%
合計（純資産総額）	100.0%

\* 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	47.8%
オフショア元	11.9%
ユーロ	8.0%
メキシコペソ	4.0%
南アフリカランド	3.4%
その他	18.5%

## 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

\* 2021年の年間収益率は前年末営業日から2021年4月9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/地域 <sup>*2</sup>	通貨	投資比率 <sup>*1</sup>
1	アメリカ国債	国債証券	0.250	2025/ 6 /30	アメリカ	米ドル	2.6%
2	中国国債	国債証券	3.020	2025/10/22	中国	オフショア元	2.1%
3	アメリカ国債	国債証券	0.125	2022/ 7 /31	アメリカ	米ドル	1.1%
4	アメリカ国債	国債証券	1.875	2051/ 2 /15	アメリカ	米ドル	0.9%
5	カナダ国債	国債証券	1.000	2022/ 9 / 1	カナダ	カナダドル	0.7%
6	アメリカ国債	国債証券	0.125	2024/ 1 /15	アメリカ	米ドル	0.7%
7	中国国債	国債証券	3.480	2027/ 6 /29	中国	オフショア元	0.6%
8	アメリカ国債	国債証券	0.125	2022/11/30	アメリカ	米ドル	0.6%
9	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%
10	ドイツ国債	国債証券	0.000	2030/ 8 /15	ドイツ	ユーロ	0.5%

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

順位	銘柄名	種類	クーポン(%)	償還日	投資国/地域 <sup>*2</sup>	通貨	投資比率 <sup>*1</sup>
1	中国国債	国債証券	2.680	2030/ 5 /21	中国	オフショア元	1.9%
2	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	1.8%
3	中国国債	国債証券	2.850	2027/ 6 / 4	中国	オフショア元	1.7%
4	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	1.6%
5	ブラジル国債	国債証券	10.000	2023/ 1 / 1	ブラジル	ブラジルレアル	1.3%
6	中国国債	国債証券	3.270	2030/11/19	中国	オフショア元	1.1%
7	国家開発銀行	特殊債券	3.070	2030/ 3 /10	中国	オフショア元	1.0%
8	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	0.9%
9	メキシコ国債	国債証券	8.500	2029/ 5 /31	メキシコ	メキシコペソ	0.8%
10	メキシコ国債	国債証券	8.000	2023/12/ 7	メキシコ	メキシコペソ	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/地域 <sup>*2</sup>	通貨	投資比率 <sup>*1</sup>
1	フォード・モーター	社債券	9.000	2025/ 4 /22	アメリカ	米ドル	1.0%
2	HCA	社債券	5.625	2028/ 9 / 1	アメリカ	米ドル	0.8%
3	CSCホールディングス	社債券	5.250	2024/ 6 / 1	アメリカ	米ドル	0.7%
4	ニューウェル・ブランズ	社債券	4.700	2026/ 4 / 1	アメリカ	米ドル	0.5%
5	スプリント	社債券	7.625	2025/ 2 /15	アメリカ	米ドル	0.5%
6	スプリント	社債券	7.625	2026/ 3 / 1	アメリカ	米ドル	0.5%
7	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	0.5%
8	DISH DBS	社債券	5.875	2024/11/15	アメリカ	米ドル	0.5%
9	MGMリゾーツ・インターナショナル	社債券	5.750	2025/ 6 /15	アメリカ	米ドル	0.4%
10	CITグループ	社債券	4.750	2024/ 2 /16	アメリカ	米ドル	0.4%

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/地域」は、「第1ファンドの状況 1 ファンドの性格（1）ファンドの目的及び基本的性格（2）ファンドの特色」の記載に基づき、どこの国への投資であるかを委託会社が分類し、記載したものです。

### 第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況」について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
3. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第29特定期間（2020年9月11日から2021年3月10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 (2020年9月10日現在)	当期 (2021年3月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,933,772,216	1,879,840,845
未収入金	2,498,837	3,235,647
流動資産合計	1,936,271,053	1,883,076,492
資産合計	1,936,271,053	1,883,076,492
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	5,925,078	5,652,184
未払解約金	2,498,837	3,235,647
未払受託者報酬	87,801	78,998
未払委託者報酬	2,458,422	2,211,946
その他未払費用	35,111	31,590
流動負債合計	11,005,249	11,210,365
負債合計	11,005,249	11,210,365
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,962,539,000	1 2,826,092,499
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2 1,037,273,196	2 954,226,372
(分配準備積立金)	224,127,372	209,279,299
元本等合計	1,925,265,804	1,871,866,127
純資産合計	1,925,265,804	1,871,866,127
負債純資産合計	1,936,271,053	1,883,076,492

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	前期 (自 2020年 3月11日 至 2020年 9月10日)	当期 (自 2020年 9月11日 至 2021年 3月10日)
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	92,757,269	84,864,587
<b>営業収益合計</b>	<b>92,757,269</b>	<b>84,864,587</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	531,673	512,276
委託者報酬	<sup>1</sup> 14,886,681	<sup>1</sup> 14,343,559
その他費用	212,607	204,847
<b>営業費用合計</b>	<b>15,630,961</b>	<b>15,060,682</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>77,126,308</b>	<b>69,803,905</b>
<b>経常利益又は経常損失( )</b>	<b>77,126,308</b>	<b>69,803,905</b>
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>77,126,308</b>	<b>69,803,905</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	127,940	48,561
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>1,116,297,377</b>	<b>1,037,273,196</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>46,845,151</b>	<b>55,003,131</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	46,845,151	55,003,131
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>8,993,937</b>	<b>7,352,927</b>
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,993,937	7,352,927
<b>分配金</b>	<b><sup>2</sup> 36,081,281</b>	<b><sup>2</sup> 34,455,846</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>1,037,273,196</b>	<b>954,226,372</b>

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	当財務諸表対象期間
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。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	前期 (2020年9月10日現在)	当期 (2021年3月10日現在)
1 期首元本額	3,067,112,145円	2,962,539,000円
期中追加設定元本額	24,500,532円	21,262,840円
期中一部解約元本額	129,073,677円	157,709,341円
2 元本の欠損	1,037,273,196円	954,226,372円
受益権の総数	2,962,539,000口	2,826,092,499口
1 口当たりの純資産額	0.6499円	0.6624円
(1 万口当たりの純資産額)	(6,499円)	(6,624円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

区分	前期 (自 2020年3月11日 至 2020年9月10日)	当期 (自 2020年9月11日 至 2021年3月10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 2020年3月11日 至 2020年4月10日)</p> <p>費用控除後の配当等収益額 4,441,413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 39,059,258円</p> <p>分配準備積立金額 236,684,701円</p> <p>当ファンドの分配対象収益額 280,185,372円</p> <p>当ファンドの期末残存口数 3,040,433,410口</p>	<p>(自 2020年9月11日 至 2020年10月12日)</p> <p>3,724,763円</p> <p>- 円</p> <p>38,894,444円</p> <p>219,839,730円</p> <p>262,458,937円</p> <p>2,907,565,196口</p>



1万口当たり収益分配対象額	921.53円	902.67円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	6,080,866円	5,815,130円
	(自 2020年4月11日 至 2020年5月11日)	(自 2020年10月13日 至 2020年11月10日)
費用控除後の配当等収益額	3,569,429円	5,894,516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	39,344,647円	38,935,725円
分配準備積立金額	233,760,331円	216,436,618円
当ファンドの分配対象収益額	276,674,407円	261,266,859円
当ファンドの期末残存口数	3,029,186,085口	2,892,992,572口
1万口当たり収益分配対象額	913.36円	903.10円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	6,058,372円	5,785,985円
	(自 2020年5月12日 至 2020年6月10日)	(自 2020年11月11日 至 2020年12月10日)
費用控除後の配当等収益額	6,296,360円	5,266,822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	39,292,567円	39,211,628円
分配準備積立金額	229,590,721円	215,820,699円
当ファンドの分配対象収益額	275,179,648円	260,299,149円
当ファンドの期末残存口数	3,009,643,709口	2,887,807,942口
1万口当たり収益分配対象額	914.32円	901.37円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	6,019,287円	5,775,615円
	(自 2020年6月11日 至 2020年7月10日)	(自 2020年12月11日 至 2021年1月12日)
費用控除後の配当等収益額	6,252,040円	6,064,410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	39,340,160円	39,282,376円
分配準備積立金額	228,937,848円	214,736,110円
当ファンドの分配対象収益額	274,530,048円	260,082,896円
当ファンドの期末残存口数	2,999,670,666口	2,882,002,599口
1万口当たり収益分配対象額	915.20円	902.43円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	5,999,341円	5,764,005円
	(自 2020年7月11日 至 2020年8月11日)	(自 2021年1月13日 至 2021年2月10日)
費用控除後の配当等収益額	5,933,852円	5,254,966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	39,762,209円	38,789,495円

分配準備積立金額	228,733,447円	211,102,240円
当ファンドの分配対象収益額	274,429,508円	255,146,701円
当ファンドの期末残存口数	2,999,168,837口	2,831,463,898口
1万口当たり収益分配対象額	915.01円	901.11円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	5,998,337円	5,662,927円
	(自 2020年8月12日 至 2020年9月10日)	(自 2021年2月11日 至 2021年3月10日)
費用控除後の配当等収益額	4,335,933円	5,133,642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	39,462,057円	39,226,210円
分配準備積立金額	225,716,517円	209,797,841円
当ファンドの分配対象収益額	269,514,507円	254,157,693円
当ファンドの期末残存口数	2,962,539,000口	2,826,092,499口
1万口当たり収益分配対象額	909.74円	899.32円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	5,925,078円	5,652,184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 (2020年9月10日現在)	当期 (2021年3月10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	8,655,118	18,885,472
合計	8,655,118	18,885,472

（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（2021年3月10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)	384,893,233	624,643,227	
		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)	393,210,690	611,285,338	
		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)	268,051,070	643,912,280	
合計			1,046,154,993	1,879,840,845	

## 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	(2020年9月10日現在)	(2021年3月10日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		319,385,055	300,171,291
金銭信託		12,734,201	26,869,580
国債証券		4,134,569,975	3,677,106,218
地方債証券		131,509,156	82,341,243
特殊債券		1,144,167,551	700,196,733
社債券		3,099,332,609	3,019,284,945
派生商品評価勘定		23,751,935	90,173,028
未収入金		555,361,821	642,259,379
未収利息		38,638,773	35,081,950
前払費用		8,473,168	6,267,066
流動資産合計		9,467,924,244	8,579,751,433
資産合計		9,467,924,244	8,579,751,433
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		23,641,394	93,729,144
未払金		781,322,330	467,456,318
未払解約金		832,945	1,078,548
流動負債合計		805,796,669	562,264,010
負債合計		805,796,669	562,264,010
純資産の部			
元本等			
元本	1	5,468,176,470	4,940,095,575
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,193,951,105	3,077,391,848
元本等合計		8,662,127,575	8,017,487,423
純資産合計		8,662,127,575	8,017,487,423
負債純資産合計		9,467,924,244	8,579,751,433

## ( 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	(2020年9月10日現在)	(2021年3月10日現在)
1期首元本額	5,732,555,250円	5,468,176,470円
期中追加設定元本額	199,732,689円	15,666,632円
期中解約元本額	464,111,469円	543,747,527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）	414,058,725円	384,893,233円
GIM世界投資適格債券ファンドF （適格機関投資家専用）	5,054,117,745円	4,555,202,342円
合 計	5,468,176,470円	4,940,095,575円
受益権の総数	5,468,176,470口	4,940,095,575口
1口当たりの純資産額	1.5841円	1.6229円
（1万口当たりの純資産額）	(15,841円)	(16,229円)

（注）当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する注記

	当財務諸表対象期間
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容およびそのリスク	当ファンドが保有した主な金融商品は、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券およびデリバティブ取引であり、当ファンドで利用しているデリバティブ取引は、通貨関連では為替予約取引であります。当ファンドが保有した金融商品およびデリバティブ取引には、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。 なお、デリバティブ取引は、通貨関連では信託財産の効率的な運用に資する目的として利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドは運用を外部委託しておりますが、投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。 (1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターおよび外部委託先において運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果（パフォーマンス）のモニターを行います。さらに外部委託先のインベストメント・ダイレクターは、リスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。 (2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っています。 (3)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。



## 金融商品の時価等に関する事項

	各期末
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	(2020年9月10日現在)	(2021年3月10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	16,608,837	55,194,743
地方債証券	5,258,882	6,811,430
特殊債券	6,574,386	5,758,038
社債券	56,493,628	43,646,024
合計	41,200,295	111,410,235

## (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	(2020年9月10日現在)				(2021年3月10日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場 取引 以外 の取 引	為替予約取引 買建								
	アメリカドル	1,184,025,945	-	1,182,598,807	1,427,138	1,629,155,348	-	1,667,280,498	38,125,150
	カナダドル	373,067,082	-	371,904,374	1,162,708	549,950,507	-	566,416,255	16,465,748
	メキシコペソ	23,862,014	-	24,609,030	747,016	26,714,648	-	26,257,162	457,486
	ユーロ	1,226,349,177	-	1,218,022,457	8,326,720	1,163,507,425	-	1,169,595,946	6,088,521
	英ポンド	201,093,397	-	201,068,828	24,569	381,447,815	-	391,269,972	9,822,157
	スイスフラン	151,602,164	-	151,016,607	585,557	276,014,596	-	274,711,636	1,302,960
	スウェーデンクロー ネ	136,999,470	-	136,667,192	332,278	29,838,610	-	30,088,702	250,092
	ノルウェークローネ	10,465,761	-	10,281,892	183,869	10,756,834	-	11,163,447	406,613
	デンマーククローネ	23,305,146	-	23,155,374	149,772	23,421,752	-	23,842,070	420,318
	チェココルナ	8,926,489	-	8,731,304	195,185	9,088,206	-	9,100,492	12,286
	ハンガリーフォリン ト	8,644,070	-	8,318,344	325,726	8,344,581	-	8,337,298	7,283
	ポーランドズロチ	23,432,517	-	23,012,210	420,307	22,997,166	-	23,020,365	23,199
	オーストラリアドル	157,846,421	-	157,649,786	196,635	422,279,755	-	432,422,509	10,142,754
	ニュージーランドド ル	-	-	-	-	163,447,964	-	163,162,169	285,795
	シンガポールドル	27,230,770	-	27,144,492	86,278	18,914,265	-	19,146,178	231,913
	タイバーツ	36,749,439	-	36,414,695	334,744	37,758,822	-	37,807,022	48,200
	イスラエル・シェケ ル	14,387,532	-	14,306,663	80,869	14,742,401	-	14,924,316	181,915
	オフショア元	52,054,281	-	52,816,422	762,141	36,652,335	-	37,495,127	842,792
	売建								
	アメリカドル	1,900,493,681	-	1,889,703,067	10,790,614	1,975,112,571	-	2,025,329,300	50,216,729
	カナダドル	90,194,725	-	90,060,273	134,452	530,107,189	-	538,524,012	8,416,823
	メキシコペソ	20,737,913	-	21,165,499	427,586	-	-	-	-
	ユーロ	633,929,926	-	632,154,147	1,775,779	1,388,558,144	-	1,401,663,451	13,105,307
	英ポンド	332,177,354	-	327,842,956	4,334,398	247,506,198	-	256,355,333	8,849,135
	スイスフラン	96,573,658	-	97,206,431	632,773	229,828,637	-	228,647,227	1,181,410
スウェーデンクロー ネ	60,910,342	-	60,961,092	50,750	17,975,510	-	18,247,216	271,706	
オーストラリアドル	323,409,949	-	325,577,019	2,167,070	357,618,639	-	362,579,215	4,960,576	
ニュージーランドド ル	148,697,690	-	149,608,679	910,989	58,789,376	-	58,661,213	128,163	
タイバーツ	-	-	-	-	8,071,007	-	8,048,208	22,799	
オフショア元	52,916,437	-	53,328,773	412,336	11,465,759	-	11,542,105	76,346	
合計		7,320,083,350	-	7,295,326,413	110,541	9,650,066,060	-	9,815,638,444	3,556,116

## (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（2021年3月10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	BERMUDA 4.75% FEB29 REGS		210,000.00	244,805.40	
		ITALY 2.375% OCT24		480,000.00	500,884.80	
		SHARJAH 4% JUL50 REGS		400,000.00	350,132.00	
		US T-BOND 1.875% FEB51		1,920,000.00	1,769,099.98	
		US T-NOTE 0.125% FEB24		250,000.00	248,574.22	
		US T-NOTE 0.125% JAN24		1,540,000.00	1,531,939.07	
		US T-NOTE 0.125% JUL22		2,385,000.00	2,384,627.34	
		US T-NOTE 0.125% NOV22		1,250,000.00	1,249,267.57	
		US T-NOTE 0.25% JUN25		5,827,700.00	5,723,438.83	
		US T-NOTE 0.75% JAN28		110,000.00	106,631.25	
		US T-NOTE 0.875% NOV30		80,000.00	75,387.50	
	計	銘柄数：	11	14,452,700.00	14,184,787.96	
					(1,540,042,428)	
		組入時価比率：	19.2%		20.6%	
	カナダドル	CANADA GOVT 0.5% DEC30		650,000.00	594,373.00	
		CANADA GOVT 1% SEP22		2,016,000.00	2,038,780.80	
		CANADA GOVT 5% JUN37		410,000.00	606,545.80	
	計	銘柄数：	3	3,076,000.00	3,239,699.60	
					(278,063,416)	
		組入時価比率：	3.5%		3.7%	
	ユーロ	CHINA EUR 0.25% NOV30		500,000.00	495,480.00	
		FINLAND 1.375% APR47 30Y		60,000.00	75,449.40	
		FRANCE OAT 1% NOV25		303,000.00	324,876.60	
		FRANCE OAT 3.25% MAY45		94,530.00	152,332.25	
		GERMANY BUND 0% AUG30		2,260,002.00	2,332,389.86	
		GERMANY BUND 0% AUG50		548,919.00	516,856.64	
		GERMANY BUND 0% FEB31		100,000.00	103,035.00	
		HUNGARY EUR 1.5% NOV50		180,000.00	164,710.80	
		INDNSA 1.45% SEP26		100,000.00	102,023.00	
		ITALY BTP 0.95% MAR37		563,000.00	547,100.88	
		ITALY BTP 1.35% APR30		350,000.00	373,828.00	
		SAUDI USD0% MAR24 REGS		253,000.00	251,428.87	
		SPAIN GOVT 0% APR23		50,000.00	50,498.00	
		SPAIN GOVT 1.2% OCT40		333,000.00	347,522.13	
		SPAIN GOVT 1.6% APR25		301,000.00	325,209.43	
		SPAIN GOVT 1% OCT50		740,000.00	697,842.20	
	計	銘柄数：	16	6,736,451.00	6,860,583.06	
					(885,975,696)	
		組入時価比率：	11.1%		11.8%	
	英ポンド	UK GOVT 4.25% DEC40		582,541.22	900,305.80	
		UK GOVT 4.25% DEC55		105,000.00	196,239.75	
	計	銘柄数：	2	687,541.22	1,096,545.55	

					(165,359,068)
		組入時価比率：	2.1%		2.2%
	オーストラリアドル	AUSTRALIA 1.5% JUN31 157		490,000.00	476,750.40
		AUSTRALIA 1.75%JUN51 162		197,000.00	156,882.92
	計	銘柄数：	2	687,000.00	633,633.32
					(53,016,099)
		組入時価比率：	0.7%		0.7%
	オフショア元	CHINA GOVT 3.16% JUN23		500,000.00	506,690.00
		CHINA GOVT 3.38% NOV24		500,000.00	513,210.00
		CHINA GOVT 3.48% JUN27		8,000,000.00	8,326,000.00
		CHINA GOVT 4.1% DEC22		1,000,000.00	1,025,980.00
		CHINA GOVT 4.29% MAY29		3,000,000.00	3,313,050.00
		CHINA GOVT 4.5% MAY34		1,500,000.00	1,719,015.00
		CHINA GOVT3.02%OCT25INBK		30,000,000.00	29,920,350.00
	計	銘柄数：	7	44,500,000.00	45,324,295.00
					(754,649,511)
		組入時価比率：	9.4%		10.1%
	小計				3,677,106,218
					(3,677,106,218)
地方債証券	カナダドル	HYDRO QUEBEC 6.5% 19		100,000.00	149,029.00
		PROV BRCOL 2.8%		60,000.00	62,588.40
		QUEBEC 5%		250,000.00	348,482.50
	計	銘柄数：	3	410,000.00	560,099.90
					(48,073,374)
		組入時価比率：	0.6%		0.6%
	ユーロ	LAND NORDRHEIN2.15% EMTN		95,000.00	147,218.65
	計	銘柄数：	1	95,000.00	147,218.65
					(19,011,816)
		組入時価比率：	0.2%		0.3%
	オーストラリアドル	QUEENSLAND 3.5%		160,000.00	182,336.00
	計	銘柄数：	1	160,000.00	182,336.00
					(15,256,053)
		組入時価比率：	0.2%		0.2%
	小計				82,341,243
					(82,341,243)
特殊債券	アメリカドル	CDBL FUNDING 1.375% EMTN		200,000.00	198,646.00
		ECOPETROL SA 6.875%		271,000.00	324,151.23
		EXIM BK KOREA 1.25%		325,000.00	304,707.00
		FG G18592		570,078.67	603,940.63
		FN BF0263		556,989.81	616,400.33
		FN BF0381		527,803.40	596,417.74
		FN FM1747		705,363.00	772,000.86
		FN FM2399		737,212.02	796,703.57
		G2 MA6089 3% AUG49		137,432.47	144,371.45
		HUARONG FIN 4.25% EMTN		200,000.00	214,952.00
		ISRAEL ELEC 5% 6		220,000.00	248,036.80
	計	銘柄数：	11	4,450,879.37	4,820,327.61
					(523,342,968)
		組入時価比率：	6.5%		7.0%
	ユーロ	BPIFRANCE 0.625%		300,000.00	313,257.00
		EUROPEAN UNION 0% EMTN		133,000.00	135,911.37
		KOREA HOUSING 0.01% REGS		380,000.00	382,766.40

		KOREA HOUSING 0.1% REGS		181,000.00	182,802.76
		TEMASEK FIN 0.5% GMTN		190,000.00	189,737.80
	計	銘柄数：	5	1,184,000.00	1,204,475.33
					(155,545,944)
		組入時価比率：	1.9%		2.1%
	スウェーデンクローネ	EIB 1.25% EMTN		1,610,000.00	1,669,892.00
	計	銘柄数：	1	1,610,000.00	1,669,892.00
					(21,307,821)
		組入時価比率：	0.3%		0.3%
	小計				700,196,733
					(700,196,733)
社債券	アメリカドル	AB INBEV 4.439%		60,000.00	65,595.60
		AB INBEV 4.6%		40,000.00	44,502.40
		AB INBEV 4.7%		80,000.00	93,296.80
		AB INBEV 4.75%		145,000.00	167,912.90
		ABBVIE 4.875%		135,000.00	162,499.50
		ALTRIA GROUP 2.35%		30,000.00	31,099.50
		ALTRIA GROUP 3.4%		30,000.00	31,409.10
		AMERICAN TOWER 2.1%		40,000.00	38,249.60
		AMERICAN TOWER 3.1%		45,000.00	40,659.30
		AMERICAN TOWER 3.95%		30,000.00	33,093.90
		AMERICAN WATER 2.8%		60,000.00	61,760.40
		ANTHEM 5.1%		60,000.00	74,967.00
		APPLE 0.7%		240,000.00	235,358.40
		APPLE 2.55%		95,000.00	80,849.75
		APPLE 4.65%		50,000.00	62,487.00
		APT PIPELINES3.875% REGS		150,000.00	156,573.00
		ASTRAZENECA 4%		130,000.00	144,337.70
		AT&T 2.25%		120,000.00	113,086.80
		AT&T 2.75%		100,000.00	99,642.00
		AT&T 3.5%		60,000.00	58,448.40
		AT&T INC 4.3%		25,000.00	26,905.25
		AVOLON HLDGS 3.25% REGS		110,000.00	109,661.20
		BALTIMORE GAS&ELEC 2.8%		100,000.00	102,657.00
		BANK NOVA 1.05%		220,000.00	216,396.40
		BANK OF MONTREAL 3.3% E		120,000.00	128,546.40
		BAT 3.462%		160,000.00	167,156.80
		BAT 4.54%		60,000.00	58,998.60
		BECTON DICKINSON 2.823%		170,000.00	174,744.70
		BERKSHIRE 4.45% WI		65,000.00	76,254.10
		BIOGEN 2.25%		40,000.00	39,090.80
		BK OF AMERICA 3.248% MTN		140,000.00	150,141.60
		BK OF AMERICA FLT MTN R		95,000.00	101,745.95
		BK OF AMERICA FLT MTN T		90,000.00	98,085.60
		BK OF AMERICA FLT MTN X		315,000.00	325,035.90
		BK OF AMERICA FLT MTN Z		220,000.00	219,126.60
		BNSF 4.15%		3,000.00	3,461.25
		BOEING 5.04%		130,000.00	147,552.60
		BOEING 5.705%		60,000.00	73,125.00
		BOEING CO 3.5%		25,000.00	24,030.75
		BOSTON SCIENTIFIC 4.7%		5,000.00	6,059.15

	BPCE 2.75% REGS		250,000.00	260,015.00
	BRISTOL-MYERS 2.9%		81,000.00	86,706.45
	BX 2020-BXLX A		184,625.76	184,788.23
	CCUBS 2017-C1 C		90,000.00	98,432.10
	CGCMT 2014-GC23 C		150,000.00	162,345.00
	CGCMT 2015-GC33 B		110,000.00	123,131.80
	CHEVRON 1.554%		140,000.00	142,409.40
	CHEVRON 3.9%		42,000.00	46,286.10
	CIBC 3.1%		135,000.00	143,905.95
	CITIGROUP 4.65%		30,000.00	36,504.60
	CITIGROUP FLT		240,000.00	265,776.00
	CITIGROUP FLT Q		250,000.00	266,435.00
	CITIGROUP FLT S		265,000.00	264,830.40
	CITIGROUP FLT V		340,000.00	347,255.60
	CLEVELAND 3.5% REGS		160,000.00	164,948.80
	COMCAST 3.9%		45,000.00	50,314.95
	COMCAST CORP 4.45%		110,000.00	130,523.80
	COMCAST CORP 4.6%		50,000.00	60,556.50
	COMM 2015-CR25 B		130,000.00	145,291.90
	CONSTELLATION BR 4.5%		25,000.00	28,485.50
	COSTCO WHOLESALE 1.75%		60,000.00	57,256.80
	COX COMMS 3.35% REGS		170,000.00	184,227.30
	CREDIT SUISSE 2.8%		490,000.00	502,759.60
	CREDIT SUISSE 2.95%		300,000.00	320,199.00
	CROWN CASTLE 3.3%		190,000.00	199,270.10
	DAIMLER 0.75% REGS		180,000.00	179,121.60
	DBS GRP HLDGS VAR REGS		200,000.00	217,192.00
	DNB BANK VAR REGS		290,000.00	285,638.40
	EMERA US FIN 4.75%		65,000.00	73,520.20
	ENTERGY LOUISIANA 4.95%		49,000.00	53,290.93
	EXXON MOBIL 2.992%		350,000.00	374,965.50
	GE 4.125%		2,000.00	2,145.96
	GOHL CAPITAL 4.25%		200,000.00	211,370.00
	GOLDMAN SACHS 3.5%		270,000.00	292,850.10
	GOLDMAN SACHS 3.5% J		350,000.00	378,731.50
	GOLDMAN SACHS 3.85%		175,000.00	191,822.75
	GOLDMAN SACHS FLT		45,000.00	46,223.55
	GOLDMAN SACHS FLT 24		220,000.00	219,443.40
	GSK 3%		105,000.00	112,008.75
	GSMS 2017-GS6 C		80,000.00	87,288.80
	HALLIBURTON 5%		45,000.00	50,164.20
	HSBC HLDGS VAR		270,000.00	280,759.50
	JPMBD 2017-C7 C		70,000.00	74,978.40
	KROGER 3.875%		75,000.00	78,598.50
	M STANLEY FLT		330,000.00	350,661.30
	MIDAMERICAN 4.25%		40,000.00	46,135.60
	MPLX 2.65%		138,000.00	134,647.98
	MPLX 4.5%		35,000.00	37,501.10
	MSAC 2004-SD2 A		66,626.42	66,741.01
	MSC 2020-L4 C		180,000.00	184,960.80
	NATL RURAL UTIL 4.3%		10,000.00	11,710.90

		NEXTERA ENERGY 3.15%		40,000.00	42,595.20	
		NISOURCE 5.65%		20,000.00	25,758.20	
		NORFOLK SOUTHERN 3.05%		40,000.00	37,991.60	
		NORFOLK SOUTHERN 3.942%		75,000.00	81,739.50	
		OVERSEA-CHINESE VAR REGS		420,000.00	417,673.20	
		PACIFICORP 2.7%		70,000.00	72,615.90	
		PACIFICORP 3.3%		15,000.00	15,044.25	
		PHILIP MORRIS 3.875%		30,000.00	31,665.90	
		PHILLIPS 66 4.875%		2,000.00	2,344.50	
		RBS FLT		250,000.00	257,935.00	
		RBS FLT 25		200,000.00	217,266.00	
		S CALIF EDISON 3.6% C		50,000.00	48,987.50	
		SCHLUMBERGER 3.9% REGS		175,000.00	192,277.75	
		SEMPRA ENERGY 3.8%		20,000.00	21,524.20	
		SHELL 2.375%		190,000.00	199,072.50	
		ST ENGINEERING 1.5% EMTN		200,000.00	201,514.00	
		SUNOCO LOGISTICS 5.3%		110,000.00	114,386.80	
		SUZANO AUSTRIA 5%		200,000.00	217,342.00	
		SWEPCO 3.9% J		15,000.00	15,622.95	
		TORONTO-DOMI 0.55%		220,000.00	219,036.40	
		UBS FLT REGS		200,000.00	206,200.00	
		UBSCM 2018-C11 B		100,000.00	112,813.00	
		UNION ELECTRIC 3.5%		15,000.00	16,510.65	
		UNION PACIFIC 3.15%		55,000.00	58,831.30	
		UNITED AIR 3.1% AA		146,757.32	150,460.00	
		UNITED TECH 3.95%		4,000.00	4,445.16	
		UNITED TECH 4.125%		80,000.00	90,429.60	
		VENTAS 4.375%		24,000.00	25,008.96	
		VERIZON 4.272%		195,000.00	219,995.10	
		VODAFONE 4.25%		20,000.00	21,638.20	
		VODAFONE 5%		75,000.00	90,989.25	
		WELLS FARGO 3.75% MTN		40,000.00	43,212.00	
		WELLS FARGO 4.75% MTN		200,000.00	234,642.00	
		WELLS FARGO FLT MTN		400,000.00	461,912.00	
		WESTPAC VAR EMTN		63,000.00	69,752.34	
		ZOETIS 3%		25,000.00	23,320.25	
		ZURICH FIN VAR EMTN		200,000.00	194,242.00	
	計	銘柄数：	128	15,916,009.50	16,816,528.47	
					(1,825,770,495)	
		組入時価比率：	22.8%		24.5%	
	ユ-口	AIB GRP VAR EMTN		215,000.00	217,272.55	
		ALTRIA GROUP 2.2%		150,000.00	162,352.50	
		ASB FIN 0.75% EMTN		430,000.00	448,911.40	
		BAT INTL 2.25% EMTN		200,000.00	218,522.00	
		BERTELSMANN 1.5% EMTN		100,000.00	108,154.00	
		BP CAPITAL 2.972% EMTN		100,000.00	113,985.00	
		BPCE FLT DMTN		200,000.00	201,088.00	
		CBA 0.5% EMTN		550,000.00	571,048.50	
		CHORUS 0.875% EMTN		200,000.00	205,414.00	
		CIBC 0.04%		100,000.00	101,200.00	
		COMCAST 1.25%		100,000.00	102,735.00	

		CR AGRICOLE 0.125% EMTN		300,000.00	306,081.00	
		CR AGRICOLE 2% EMTN		200,000.00	215,566.00	
		CREDIT MUTUELO.125% EMTN		300,000.00	306,303.00	
		CREDIT SUISSE FLT EMTN		100,000.00	112,044.00	
		DBS BANK 0.375%		350,000.00	358,193.50	
		DEUTSCHE BANK FLT EMTN		100,000.00	99,635.00	
		EDP FIN 1.5% EMTN		161,000.00	173,303.62	
		ENEL VAR 6.5Y		135,000.00	132,642.90	
		ENGIE VAR		200,000.00	216,354.00	
		GE 1.875%		100,000.00	108,887.00	
		HEATHROW 1.5% EMTN		154,000.00	159,145.14	
		IBERDROLA INTL VAR NC6		100,000.00	99,485.00	
		IBERDROLA VAR EMTN		200,000.00	210,252.00	
		ING GRP VAR EMTN		200,000.00	210,714.00	
		ING GRP VAR EMTN 29		300,000.00	309,702.00	
		KBC GRP VAR EMTN		200,000.00	199,166.00	
		LIB MUTUAL 1.75% REGS		114,000.00	119,546.10	
		LLOYDS BK 0.125% EMTN		100,000.00	100,708.00	
		M STANLEY 1.875% GMTN		200,000.00	218,754.00	
		MEDTRONIC 1%		100,000.00	104,817.00	
		MONTE DEI PASCHI 0.875%		100,000.00	104,485.00	
		MOTABILITY 0.875% EMTN		122,000.00	126,771.42	
		NATIONWIDE 0.625% EMTN		180,000.00	189,153.00	
		ORANGE VAR EMTN		100,000.00	101,445.00	
		SANTANDER UK 0.05% GMTN		143,000.00	144,621.62	
		SEB VAR 26 S.289		105,000.00	105,490.35	
		TOTAL VAR		170,000.00	170,632.40	
		VCL 32 A		100,000.00	100,685.00	
		VOLKSWAGEN 2.625%		60,000.00	64,167.60	
		VOLKSWAGEN VAR		200,000.00	223,922.00	
		WESTPAC 0.5% GMTN		190,000.00	195,131.90	
		WPC EUROBOND 1.35%		100,000.00	103,452.00	
	計	銘柄数：	43	7,529,000.00	7,841,939.50	
					(1,012,708,067)	
		組入時価比率：	12.6%		13.5%	
	英ポンド	BSKY UK2 A		9,475.08	9,478.04	
		BUMP 2021-1 A		100,000.00	100,000.00	
		CENTRICA 4.375% EMTN		100,000.00	119,399.00	
		DB FLT EMTN		100,000.00	98,529.00	
		EVERSHOLT 6.359% EMTN		100,000.00	123,591.00	
		FSQ 2020-1X A		104,057.02	104,615.59	
		GMG 2021-1X A		143,000.00	143,413.69	
		HEATHROW 6.75% EMTN		100,000.00	126,476.00	
		LAN 2020-1X 2A		131,400.00	132,305.60	
		LLOYDS BK VAR		140,000.00	140,869.40	
		VERIZON COMMS 1.875%		100,000.00	100,304.00	
	計	銘柄数：	11	1,127,932.10	1,198,981.32	
					(180,806,383)	
		組入時価比率：	2.3%		2.4%	
	小計				3,019,284,945	
					(3,019,284,945)	



	合計					7,478,929,139
						(7,478,929,139)

(注)各通貨計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表  
当表に記載すべき内容は、「デリバティブ取引等に関する注記 取引の時価等に関する事項」に開示しておりますので、記載を省略しております。

「G I M新興国現地通貨ソブリン・マザーファンド(適格機関投資家専用)」の状況  
尚、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## ( 1 ) 貸借対照表

( 単位：円 )

区分	注記 番号	(2020年9月10日現在)	(2021年3月10日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		240,700,466	650,288,249
金銭信託		104,650	289,782
国債証券		7,596,035,381	6,903,433,774
特殊債券		452,934,662	540,771,531
社債券		43,613,743	45,973,166
派生商品評価勘定		12,510,933	67,622,182
未収入金		-	560,220
未収利息		94,848,357	88,920,343
前払費用		20,849,906	18,327,267
差入委託証拠金		3,192,990	4,154,247
流動資産合計		8,464,791,088	8,320,340,761
資産合計		8,464,791,088	8,320,340,761
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		32,794,004	61,274,300
未払解約金		3,882,330	19,345,467
流動負債合計		36,676,334	80,619,767
負債合計		36,676,334	80,619,767
純資産の部			
元本等			
元本	1	5,664,611,193	5,300,246,920
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		2,763,503,561	2,939,474,074
元本等合計		8,428,114,754	8,239,720,994
純資産合計		8,428,114,754	8,239,720,994
負債純資産合計		8,464,791,088	8,320,340,761

## ( 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、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>(1)デリバティブ取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 為替予約の評価は、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条および第61条に従って処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区分	(2020年9月10日現在)	(2021年3月10日現在)
1期首元本額	6,048,635,455円	5,664,611,193円
期中追加設定元本額	562,424,253円	511,613,140円
期中解約元本額	946,448,515円	875,977,413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）	423,641,609円	393,210,690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）	2,217,149,821円	2,189,176,593円
JPM新興国毎月決算ファンド	2,943,150,304円	2,627,679,668円
JPM新興国年1回決算ファンド	80,669,459円	90,179,969円
合 計	5,664,611,193円	5,300,246,920円
受益権の総数	5,664,611,193口	5,300,246,920口
1口当たりの純資産額 （1万口当たりの純資産額）	1.4879円 (14,879円)	1.5546円 (15,546円)

（注）当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する注記

	当財務諸表対象期間
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容およびそのリスク	当ファンドが保有した主な金融商品は、国債証券、特殊債券、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、債券関連では債券先物取引、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、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として利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドは運用を外部委託しておりますが、投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。 (1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターおよび外部委託先において運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果（パフォーマンス）のモニターを行います。さらに外部委託先のインベストメント・ダイレクターは、リスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。 (2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っています。 (3)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。

## 金融商品の時価等に関する事項

	各期末
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	(2020年9月10日現在)	(2021年3月10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	65,950,316	168,694,573
特殊債券	26,959,118	269,122
社債券	1,049,391	80,507
合計	37,941,807	168,505,958

## (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	(2020年9月10日現在)				(2021年3月10日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場 取引	債券先物取引 売建	-	-	-	-	101,161,798	-	100,544,305	617,493
合計		-	-	-	-	101,161,798	-	100,544,305	617,493

## (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	(2020年9月10日現在)				(2021年3月10日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場 取引 以外 の取 引	為替予約取引 買建								
	アメリカドル	1,014,136,781	-	1,010,910,366	3,226,415	1,472,481,496	-	1,510,783,133	38,301,637
	メキシコペソ	-	-	-	-	110,771,849	-	109,997,082	774,767
	トルコリラ	9,138,261	-	9,120,375	17,886	115,772,380	-	111,647,171	4,125,209
	チェココルナ	210,555,951	-	206,101,633	4,454,318	138,501,807	-	138,823,859	322,052
	ハンガリーフォリント	48,471,109	-	47,844,488	626,621	109,871,959	-	109,133,096	738,863
	ポーランドズロチ	238,064,476	-	236,464,881	1,599,595	464,264,319	-	464,457,847	193,528
	タイバーツ	146,724,443	-	146,043,937	680,506	41,274,996	-	41,622,893	347,897
	南アフリカランド	17,393,082	-	17,479,512	86,430	-	-	-	-
	オフショア元	578,300,157	-	581,654,363	3,354,206	578,753,982	-	591,643,378	12,889,396
	売建								
	アメリカドル	1,251,447,479	-	1,248,779,302	2,668,177	1,571,211,292	-	1,622,670,211	51,458,919
	メキシコペソ	374,680,365	-	385,936,818	11,256,453	354,786,861	-	348,618,500	6,168,361
	トルコリラ	9,411,244	-	9,120,375	290,869	-	-	-	-
	ハンガリーフォリント	43,718,856	-	41,961,975	1,756,881	307,312,489	-	304,626,458	2,686,031
	ポーランドズロチ	33,235,000	-	32,700,669	534,331	73,547,186	-	73,034,491	512,695
	タイバーツ	58,314,653	-	58,290,089	24,564	178,269,582	-	178,269,582	-
南アフリカランド	190,160,263	-	197,100,598	6,940,335	368,997,146	-	364,226,166	4,770,980	
オフショア元	304,616,400	-	304,812,800	196,400	189,568,232	-	192,932,662	3,364,430	
合計		4,528,368,520	-	4,534,322,181	20,283,071	6,075,385,576	-	6,162,486,529	5,730,389

## (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。

- 換算において円未満の端数は切り捨てております。
- 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 ( 2021年 3 月10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	メキシコペソ	MEXICO GOVT 10% DEC24		1,036,600.00	1,212,853.09	
		MEXICO GOVT 10% NOV36		2,307,300.00	3,025,077.95	
		MEXICO GOVT 5.75% MAR26		15,000,000.00	15,292,650.00	
		MEXICO GOVT 6.5% JUN22		61,480,000.00	63,130,738.00	
		MEXICO GOVT 8.5% MAY29		32,410,000.00	37,773,206.80	
		MEXICO GOVT 8.5% NOV38		12,200,000.00	14,075,628.00	
		MEXICO GOVT 8% DEC23		31,754,000.00	34,492,782.50	
		MEXICO I/L 4% NOV40		530,000.00	4,101,734.13	
	計	銘柄数 :	8	156,717,900.00	173,104,670.47	
					(886,295,912)	
		組入時価比率 :	10.8%		11.8%	
ブラジルリアル	ブラジルリアル	BRAZIL 10% JAN23 NTN		14,228,000.00	15,419,253.52	
		BRAZIL 10% JAN25 NTN		6,940,000.00	7,606,870.84	
		BRAZIL 10% JAN27 NTN		5,380,000.00	5,921,470.10	
		BRAZIL 10% JAN29 NTN		1,460,000.00	1,612,695.70	
		BRAZIL I/L 6% AUG26 NTN		420,000.00	1,673,826.71	
		BRAZIL I/L 6% AUG50 NTN		270,000.00	1,207,830.23	
			計	銘柄数 :	6	28,698,000.00
					(625,364,410)	
		組入時価比率 :	7.6%		8.3%	
チリペソ	チリペソ	CHILE GOVT 4.5% MAR26		745,000,000.00	845,336,600.00	
	計	銘柄数 :	1	745,000,000.00	845,336,600.00	
					(124,856,215)	
		組入時価比率 :	1.5%		1.7%	
コロンビアペソ	コロンビアペソ	COLOMBIA 6% APR28 GDN		150,000,000.00	151,218,000.00	
		COLOMBIA GOVT 9.85% JUN27		92,000,000.00	114,967,800.00	
		COLOMBIA TES 10% JUL24		1,200,000,000.00	1,428,816,000.00	
		COLOMBIA TES 6% APR28		2,902,500,000.00	2,911,555,800.00	
		COLOMBIA TES 5.75% NOV27		1,926,200,000.00	1,928,781,108.00	
			計	銘柄数 :	5	6,270,700,000.00
					(197,367,228)	
		組入時価比率 :	2.4%		2.6%	
ペルーソル	ペルーソル	PERU GOVT 6.35% AUG28		1,510,000.00	1,767,017.10	
		PERU GOVT 6.9% AUG37 GDN		2,270,000.00	2,497,158.90	
		PERU GOVT 6.35% AUG28 GDN		429,000.00	501,561.06	
	計	銘柄数 :	3	4,209,000.00	4,765,737.06	
					(139,826,725)	
		組入時価比率 :	1.7%		1.9%	
ウルグアイペソ	ウルグアイペソ	URUGUAY 9.875% JUN22 REGS		3,280,000.00	3,410,839.20	
	計	銘柄数 :	1	3,280,000.00	3,410,839.20	
					(8,288,339)	
		組入時価比率 :	0.1%		0.1%	
ドミニカペソ	ドミニカペソ	DOMINICA 8.9% FEB23 REGS		17,000,000.00	17,460,870.00	
	計	銘柄数 :	1	17,000,000.00	17,460,870.00	
					(32,826,435)	
		組入時価比率 :	0.4%		0.4%	
ディナール	ディナール	SERBIA 4.5% JAN26 7Y		19,060,000.00	20,910,916.60	

	SERBIA 5.875% FEB28 10Y		23,330,000.00	27,865,352.00
計	銘柄数:	2	42,390,000.00	48,776,268.60
				(53,556,342)
	組入時価比率:	0.6%		0.7%
ユーロ	BQ TUNISIE 6.375% REGS		100,000.00	87,396.00
計	銘柄数:	1	100,000.00	87,396.00
				(11,286,319)
	組入時価比率:	0.1%		0.2%
チェココルナ	CZECH REPUBLIC 4.85% 53		9,220,000.00	13,595,627.60
計	銘柄数:	1	9,220,000.00	13,595,627.60
				(67,026,444)
	組入時価比率:	0.8%		0.9%
ハンガリーフォリント	HUNGARY 1.5% APR26 26/E		490,000,000.00	480,204,900.00
	HUNGARY 1.5% AUG22 22/C		50,000,000.00	50,417,500.00
	HUNGARY 1.5% AUG23 23/C		110,000,000.00	110,844,800.00
	HUNGARY 1% NOV25 25/C		351,970,000.00	339,045,661.60
	HUNGARY 2% MAY29 29/A		20,000,000.00	19,485,600.00
	HUNGARY 3% AUG30 30/A		97,140,000.00	101,374,332.60
計	銘柄数:	6	1,119,110,000.00	1,101,372,794.20
				(387,793,360)
	組入時価比率:	4.7%		5.2%
ロシアルーブル	RUSSIA 7.15% NOV25 6229		106,000,000.00	110,322,680.00
	RUSSIA 7.25% MAY34 6225		8,156,000.00	8,454,672.72
	RUSSIA 7.65% APR30 6228		56,605,000.00	60,764,901.45
	RUSSIA 7.7% MAR39 6230		11,600,000.00	12,586,000.00
	RUSSIA 7.75% SEP26 6219		4,358,000.00	4,658,353.36
	RUSSIA 7.95% OCT26 6226		46,000,000.00	49,610,080.00
	RUSSIA 7% AUG23 6215		23,000,000.00	23,860,660.00
	RUSSIA 8.15% FEB27 6207		64,550,000.00	70,314,315.00
計	銘柄数:	8	320,269,000.00	340,571,662.53
				(500,640,343)
	組入時価比率:	6.1%		6.7%
ルーマニアレイ	ROMANIA GOVT 3.65% SEP31		1,095,000.00	1,108,665.60
	ROMANIA GOVT 4.15% OCT30		1,260,000.00	1,351,249.20
	ROMANIA GOVT 4.75% OCT34		780,000.00	838,866.60
	ROMANIA GOVT 5% FEB29		470,000.00	534,573.30
計	銘柄数:	4	3,605,000.00	3,833,354.70
				(101,277,231)
	組入時価比率:	1.2%		1.4%
マレーシアリングgit	MALAYSIA 3.502% MAY27		1,900,000.00	1,949,970.00
	MALAYSIA 3.828% JUL34		700,000.00	682,430.00
	MALAYSIA 4.07% SEP26		869,000.00	914,396.56
	MALAYSIA 4.181% JUL24		700,000.00	735,924.00
	MALAYSIA 4.232% JUN31		2,872,000.00	3,030,936.48
	MALAYSIA 4.498% APR30		2,080,000.00	2,236,520.00
	MALAYSIA 4.642% NOV33		2,400,000.00	2,556,312.00
	MALAYSIA 4.786% OCT35		400,000.00	424,072.00
計	銘柄数:	8	11,921,000.00	12,530,561.04
				(330,305,589)
	組入時価比率:	4.0%		4.4%
タイバーツ	THAI GOVT 1.6% JUN35		8,700,000.00	7,776,669.00
	THAI GOVT 2.125% DEC26		4,200,000.00	4,362,204.00
	THAI GOVT 2.875% DEC28		6,572,000.00	7,127,202.56
	THAI GOVT 3.3% JUN38		23,000,000.00	25,193,970.00
	THAI GOVT 3.4% JUN36		2,200,000.00	2,436,236.00
	THAI GOVT 3.58% DEC27		834,000.00	936,707.10
	THAI GOVT 3.65% JUN31		8,200,000.00	9,362,104.00



		THAI GOVT 3.775% JUN32		26,842,000.00	31,018,615.20
		THAI GOVT 4.875% JUN29		579,000.00	706,107.87
	計	銘柄数 :	9	81,127,000.00	88,919,815.73
					(313,886,949)
		組入時価比率 :	3.8%		4.2%
	フィリピンペソ	PHIL GOVT 8% JUL31 2017		2,600,000.00	3,486,418.00
		PHIL GOVT5.75%APR25 7-61		963,554.00	1,077,012.48
	計	銘柄数 :	2	3,563,554.00	4,563,430.48
					(10,222,084)
		組入時価比率 :	0.1%		0.1%
	インドネシアルピア	INDON 10.5% AUG30 FR52		6,191,000,000.00	7,712,252,520.00
		INDON 7.375% MAY48 FR76		7,651,000,000.00	7,546,334,320.00
		INDON 7.5% AUG32 FR74		2,480,000,000.00	2,509,735,200.00
		INDON 7.5% JUN35 FR80		2,180,000,000.00	2,158,374,400.00
		INDON 7.5% MAY38 FR75		2,937,000,000.00	2,896,410,660.00
		INDON 7% SEP30 FR82		2,127,000,000.00	2,142,378,210.00
		INDON 8.25% MAY29 FR78		3,240,000,000.00	3,513,488,400.00
		INDON 8.25% MAY36 FR72		25,005,000,000.00	26,442,787,500.00
		INDON 8.375% MAR34 FR68		1,391,000,000.00	1,484,178,498.00
		INDON 8.75% MAY31 FR73		11,305,000,000.00	12,718,011,950.00
		INDON 9% MAR29 FR71		15,142,000,000.00	17,191,923,960.00
	計	銘柄数 :	11	79,649,000,000.00	86,315,875,618.00
					(656,000,654)
		組入時価比率 :	8.0%		8.8%
	カザフスタンテング	KAZAKH 0% JAN22 REGS GDN		185,009,200.00	171,437,623.68
	計	銘柄数 :	1	185,009,200.00	171,437,623.68
					(44,333,769)
		組入時価比率 :	0.5%		0.6%
	ウクライナフリブナ	UKRAIN15.84%FEB25REGSGDN		4,000,000.00	4,506,814.80
	計	銘柄数 :	1	4,000,000.00	4,506,814.80
					(17,621,645)
		組入時価比率 :	0.2%		0.2%
	エジプトポンド	EGYPT GOVT 14.313% OCT23		2,500,000.00	2,499,375.00
		EGYPT T-BILL01FEB22 364D		6,400,000.00	5,717,635.80
		EGYPT T-BILL16NOV21 273D		4,400,000.00	4,032,904.92
		EGYPT T-BILL31AUG21 364D		7,200,000.00	6,708,447.26
	計	銘柄数 :	4	20,500,000.00	18,958,362.98
					(130,812,704)
		組入時価比率 :	1.6%		1.7%
	南アフリカランド	S.AFRICA 7% FEB31 R213		12,110,000.00	9,987,117.00
		S.AFRICA 8.5% JAN37 2037		8,445,658.00	6,811,254.26
		S.AFRICA 8% JAN30 2030		38,251.00	34,858.90
		S.AFRICA 9% JAN40 2040		5,595,390.00	4,617,539.64
		S.AFRICA10.5% DEC26 R186		62,914,951.00	71,002,038.80
		S.AFRICA6.25% MAR36 R209		8,441,256.00	5,606,766.64
		S.AFRICA8.75% FEB48 2048		9,168,708.00	7,239,336.77
		S.AFRICA8.75% JAN44 2044		3,805,030.00	3,009,131.87
		S.AFRICA8.875%FEB35 2035		13,986,398.00	11,985,643.76
	計	銘柄数 :	9	124,505,642.00	120,293,687.64
					(854,085,182)
		組入時価比率 :	10.4%		11.4%
	オフショア元	CHINA GOVT1.99%APR25INBK		6,000,000.00	5,742,612.00
		CHINA GOVT2.68%MAY30INBK		29,500,000.00	28,058,276.00
		CHINA GOVT2.85%JUN27INBK		25,500,000.00	24,881,497.50
		CHINA GOVT3.02%OCT25INBK		9,500,000.00	9,474,777.50
		CHINA GOVT3.27%NOV30INBK		16,500,000.00	16,513,101.00
	計	銘柄数 :	5	87,000,000.00	84,670,264.00
					(1,409,759,895)

		組入時価比率：	17.1%		18.9%
	小計				6,903,433,774
					(6,903,433,774)
特殊債券	ポーランドズロチ	BGK 2.125%		1,915,000.00	1,918,619.35
	計	銘柄数：	1	1,915,000.00	1,918,619.35
					(54,181,810)
		組入時価比率：	0.7%		0.7%
	オフショア元	CHINA DEV BK 3.07% 2005		15,000,000.00	14,249,295.00
		CHINA DEV BK 3.23% 2003		8,000,000.00	7,951,240.00
		CHINA DEV BK 3.42% 1908		3,400,000.00	3,406,409.00
		CHINA DEV BK 3.45% 1915		3,700,000.00	3,617,663.90
	計	銘柄数：	4	30,100,000.00	29,224,607.90
					(486,589,721)
		組入時価比率：	5.9%		6.5%
	小計				540,771,531
					(540,771,531)
社債券	コロンビアペソ	EPM 8.375% REGS		1,481,000,000.00	1,522,290,280.00
	計	銘柄数：	1	1,481,000,000.00	1,522,290,280.00
					(45,973,166)
		組入時価比率：	0.6%		0.6%
	小計				45,973,166
					(45,973,166)
	合計				7,490,178,471
					(7,490,178,471)

(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	(2020年9月10日現在)	(2021年3月10日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		57,149,965	41,068,675
金銭信託		1,177,710	1,913,128
株式		3,244,874	3,929,558
新株予約権証券		-	81
特殊債券		1,050,839	1,103,966
社債券		576,168,707	594,944,124
派生商品評価勘定		414	13,587
未収入金		1,099,511	-
未収配当金		-	1,616
未収利息		8,450,408	8,388,567
前払費用		28,746	153,720
流動資産合計		648,371,174	651,517,022
資産合計		648,371,174	651,517,022
負債の部			
流動負債			
未払金		-	6,530,486
未払解約金		832,947	1,078,551
流動負債合計		832,947	7,609,037
負債合計		832,947	7,609,037
純資産の部			
元本等			
元本	1	288,352,975	268,051,070
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		359,185,252	375,856,915
元本等合計		647,538,227	643,907,985
純資産合計		647,538,227	643,907,985
負債純資産合計		648,371,174	651,517,022

（注）「G I M米国高利回り社債マザーファンド（適格機関投資家専用）」の計算期間は、毎年1月9日から7月8日および7月9日から翌年1月8日まで（計算期間終了日が休業日の場合は、その翌営業日まで）であり、当ファンドの特定期間と異なります。

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	当財務諸表対象期間
1. 有価証券の評価基準および評価方法	<p>株式および新株予約権証券 移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>特殊債券および社債券 個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1)金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の最終相場）で評価しております。</p> <p>当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該金融商品取引所等における気配相場で評価しております。</p> <p>(2)金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3)時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準および評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>為替予約の評価は、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条および第61条に従って処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区分	(2020年9月10日現在)	(2021年3月10日現在)
1期首元本額	304,900,341円	288,352,975円
期中追加設定元本額	6,829,031円	2,021,723円
期中解約元本額	23,376,397円	22,323,628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）	288,352,975円	268,051,070円
合 計	288,352,975円	268,051,070円
受益権の総数	288,352,975口	268,051,070口
1口当たりの純資産額	2.2456円	2.4022円
（1万口当たりの純資産額）	（22,456円）	（24,022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・監督を行っています。 (3)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。

## 金融商品の時価等に関する事項

	各期間末
1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませ
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。一部の債券時価に関しては合理的に算定された価額を採用する場合があります。合理的に算定された価額は発行体の格付けや債券の償還年限を基にした国債に対する上乗せ金利、取引業者からの提示価格、流動性、将来発生しうるキャッシュフロー、その他個々の債券の特性等を考慮して価格提供会社が算出した価格を利用しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「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	(2020年9月10日現在)	(2021年3月10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	77,451	209,956
新株予約権証券	-	-
特殊債券	49,153	4,104
社債券	15,600,095	4,776,678
合計	15,726,699	4,570,826

(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	(2020年9月10日現在)				(2021年3月10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	4,000,000	-	3,999,586	414	4,000,000	-	3,986,413	13,587
合計		4,000,000	-	3,999,586	414	4,000,000	-	3,986,413	13,587

## (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（2021年3月10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	9	1,975.00	17,775.00	*
	CLAIRE'S STORES INC	17	212.50	3,612.50	
	EDTECHX HLDGS II-A	121	60.25	7,290.25	
	MYT HOLDING LLC PFD	4,227	1.17	4,945.59	*
	NEIMAN MARCUS GRP LT	1	62.00	62.00	
	OASIS PETROLEUM INC	44	57.01	2,508.44	
小計	銘柄数：	6		36,193.78	
				(3,929,558)	
	組入時価比率：	0.6%		100.0%	
合計				3,929,558	
				(3,929,558)	

(注) 各通貨計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

(注) 備考欄の\*の銘柄は優先証券であることを表しております。

## (ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	アメリカドル	NEIMAN MARCUS GRP LT WRT		75.00	0.75	
	計	銘柄数：	1	75.00	0.75	
					(81)	

		組入時価比率：	0.0%		0.0%
	小計				81
					(81)
特殊債券	アメリカドル	DAE FUNDING 4.5% REGS		5,000.00	5,024.35
		DAE FUNDING 5% REGS		5,000.00	5,143.90
	計	銘柄数：	2	10,000.00	10,168.25
					(1,103,966)
		組入時価比率：	0.2%		0.2%
	小計				1,103,966
					(1,103,966)
社債券	アメリカドル	ACADIA HLTH 5.625%		10,000.00	9,999.20
		ADT 4.125%		21,000.00	21,661.50
		ADT 4.875% REGS		10,000.00	10,044.20
		ADVANCED DRAINAGE5% REGS		2,000.00	2,099.50
		AECOM 5.125%		20,000.00	21,570.80
		ALBERTSONS 5.875% REGS		2,000.00	2,131.58
		ALBERTSONS 7.5% REGS		8,000.00	8,763.84
		ALLIED UNIVERS6.625%REGS		3,000.00	3,149.13
		ALLY FINANCIAL 4.625%		15,000.00	16,708.65
		ALLY FINANCIAL 5.75%		78,000.00	87,742.98
		ALLY FINANCIAL 8% 31		12,000.00	16,465.08
		AMC NETWORKS 4.75%		3,000.00	3,048.00
		AMER AIRLINE 5% REGS		6,000.00	5,822.88
		AMERICAN AXLE 6.25%		34,000.00	34,765.34
		AMERICAN AXLE 6.25% Y		8,000.00	8,154.64
		AMERICAN AXLE 6.5%		8,000.00	8,336.48
		AMERIGAS 5.625%		10,000.00	11,048.70
		AMERIGAS 5.875%		5,000.00	5,464.50
		AMKOR TECH 6.625% REGS		5,000.00	5,416.25
		AMSTED IND 5.625% REGS		7,000.00	7,400.82
		ANTERO RESCS 5.625%		2,000.00	2,007.50
		APACHE 4.875%		55,000.00	57,252.80
		ARCONIC 5.9%		32,000.00	36,100.16
		ARCONIC 5.95%		5,000.00	5,912.50
		ARCONIC 6.75%		7,000.00	8,206.24
		AVIS BUDGET 5.25% REGS		14,000.00	14,207.20
		AVIS BUDGET 5.75% REGS		8,000.00	8,307.12
		AVOLON HLDGS 5.25% REGS		6,000.00	6,503.28
		AVOLON HLDGS 5.5% REGS		7,000.00	7,410.48
		B&G FOODS 5.25%		33,000.00	33,825.00
		BALL 5.25%		25,000.00	27,980.75
		BAUSCH HEALTH 7% REGS		7,000.00	7,516.88
		BAUSCH HEALTH 8.5% REGS		10,000.00	11,000.70
		BAUSCH HEALTH 9.25% REGS		15,000.00	16,501.80
		BAUSCH HEALTH6.125% REGS		26,000.00	26,261.82
		BAUSCH HEALTH7.25% REGS		7,000.00	7,691.18
		BERRY GLOBAL 4.5% REGS		8,000.00	8,153.44
		BERRY GLOBAL 5.125%		9,000.00	9,074.25
		BOMBARDIER 7.5% 24 REGS		26,000.00	25,762.36
		BOMBARDIER 7.5% 25 REGS		10,000.00	9,750.00
		BOYD GAMING 6.375%		10,000.00	10,272.60
		BOYD GAMING 6% WI		6,000.00	6,192.30
		BOYNE USA 7.25% REGS		19,000.00	19,769.88
		BRINK'S 4.625% REGS		20,000.00	20,403.80
		BROOKFIELD 5.75% REGS		16,000.00	16,403.36



	BUCKEYE PARTNERS 3.95%	15,000.00	14,862.15
	CALLON PETRO 6.125%	7,000.00	6,294.96
	CALLON PETRO 6.375%	2,000.00	1,719.70
	CALPINE 8.5% ESCROW	200,000.00	-
	CATALENT PHARMA 5% REGS	2,000.00	2,096.06
	CB ESCROW 8% REGS	7,000.00	7,452.97
	CCO HLDGS 4.75% REGS	16,000.00	16,518.40
	CCO HLDGS 5.125% REGS R	5,000.00	5,213.00
	CCO HOLDINGS 5.75% REGS	25,000.00	25,816.00
	CDK GLOBAL 5.25% REGS	5,000.00	5,305.50
	CDW 4.25%	62,000.00	64,317.56
	CDW 5.5%	5,000.00	5,484.60
	CEDAR FAIR 5.25%	2,000.00	2,031.34
	CEDAR FAIR 5.375%	3,000.00	3,063.36
	CENTENE 4.625%	55,000.00	59,236.10
	CENTENE 4.75%	85,000.00	87,018.75
	CENTURYLINK 5.625%	11,000.00	11,782.10
	CENTURYLINK 5.8% T	20,000.00	20,636.00
	CENTURYLINK 6.875% G	3,000.00	3,332.88
	CENTURYLINK 7.5% Y	5,000.00	5,567.75
	CHARTER COMM 4.908%	11,000.00	12,404.37
	CHEMOURS 5.375%	4,000.00	4,165.84
	CHEMOURS 7%	17,000.00	17,525.13
	CHENIERE ENERGY 5.25%	4,000.00	4,110.52
	CHENIERE ENERGY 5.625%	7,000.00	7,240.87
	CHUKCHANSI 9.75% REGS	20,875.04	10,394.72
	CINCINNATI BELL 7% REGS	15,000.00	15,538.50
	CINEMARK 4.875%	11,000.00	10,907.71
	CIT GROUP 4.75%	70,000.00	75,854.10
	CIT GROUP 5.25%	9,000.00	10,112.22
	CIT GROUP 6.125%	11,000.00	13,273.26
	CLEAR CHNL 5.125% REGS	53,000.00	53,550.67
	CLEAR CHNL 9.25%	12,000.00	12,510.72
	CMTY HLTH SYS 8% REGS	13,000.00	13,865.41
	COLFAX 6.375% REGS	4,000.00	4,271.96
	COLFAX 6% REGS	2,000.00	2,063.56
	COMMERCIAL METALS 5.375%	9,000.00	9,508.14
	COMMSCOPE FIN 5.5% REGS	5,000.00	5,148.40
	COMMSCOPE FIN 6% REGS	22,000.00	23,237.28
	COMMSCOPE FIN 8.25% REGS	9,000.00	9,503.91
	COMMSCOPE TECH 5% REGS	7,000.00	6,861.19
	COMMSCOPE TECH 6% REGS	9,000.00	9,111.87
	CONCORDIA INTL 8%	15,000.00	15,322.50
	CONSTELLATION 8.5% REGS	11,000.00	10,341.98
	COVANTA 5.875% 25	2,000.00	2,071.24
	CRESTWOOD 5.625% REGS	5,000.00	4,906.75
	CRESTWOOD 5.75%	14,000.00	13,905.36
	CROWN AMER/CAP 4.25%	8,000.00	8,494.48
	CROWN AMER/CAP 4.75%	8,000.00	8,267.84
	CSC HOLDINGS 5.25%	110,000.00	118,297.30
	CSC HOLDINGS 6.75%	10,000.00	10,264.00
	CURO GRP 8.25% REGS	24,000.00	24,234.00
	CVR PARTNERS 9.25% REGS	49,000.00	49,620.83
	DCP MIDSTREAM 3.875%	19,000.00	19,551.19
	DCP MIDSTREAM 4.95%	3,000.00	3,076.17

	DCP MIDSTREAM 5.375%	5,000.00	5,347.45
	DELEK LOGISTICS 6.75% WI	16,000.00	16,043.20
	DELL INTL 7.125% REGS	30,000.00	30,913.20
	DISH DBS 5.875% 22	7,000.00	7,241.99
	DISH DBS 5.875% 24	80,000.00	82,952.00
	DISH DBS 6.75%	39,000.00	39,318.63
	DOLE FOOD 7.25% REGS	19,000.00	19,492.48
	DOWNSTREAM DE10.5%REGS E	25,000.00	25,534.25
	EMBARQ CORP 7.995%	30,000.00	34,803.90
	EMC 3.375%	6,000.00	6,168.24
	ENLINK MIDSTREAM 4.15%	6,000.00	5,835.42
	ENLINK MIDSTREAM 4.4%	15,000.00	15,017.10
	ENLINK MIDSTREAM 4.85%	4,000.00	3,965.08
	ENLINK MIDSTREAM 5.6%	3,000.00	2,541.18
	ENTERCON MEDIA 6.5% REGS	8,000.00	8,005.84
	ENTERPRISE 12% REGS	30,000.00	33,696.90
	EQT 3.9%	30,000.00	29,904.60
	ESH HOSPITALIT4.625%REGS	9,000.00	9,093.60
	ESH HOSPITALITY5.25%REGS	12,000.00	12,226.92
	FMG RESCS 5.125% REGS	12,000.00	12,890.64
	FORD MOTOR 9%	140,000.00	167,979.00
	FREEPORT-MC 5.4%	3,000.00	3,649.41
	FREEPORT-MC 5%	70,000.00	74,309.90
	GENESIS NRG 6.25%	8,000.00	7,635.96
	GLOBAL AIR 6.5% REGS	10,363.00	9,461.72
	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%	4,000.00	4,178.88
	GOODYEAR TIRE 5.125%	10,000.00	10,028.60
	GOODYEAR TIRE 5%	28,000.00	28,661.36
	GRAY ESCROW 7% REGS	7,000.00	7,612.50
	GRAY TV 5.875% REGS	5,000.00	5,180.40
	GREIF 6.5% REGS	6,000.00	6,313.74
	HANESBRANDS 4.625% REGS	5,000.00	5,284.35
	HANESBRANDS 4.875% REGS	5,000.00	5,402.60
	HARSCO 5.75% REGS	3,000.00	3,093.66
	HAT HLDGS 5.25% REGS	4,000.00	4,144.16
	HCA 5.625%	112,000.00	128,304.96
	HCA INC 5.375%	33,000.00	36,324.09
	HCA INC 5.875% 26	15,000.00	17,037.00
	HERC HLDGS 5.5% REGS	9,000.00	9,402.30
	HILCORP NRG 6.25% REGS	6,000.00	6,142.44
	HILTON 4.875%	12,000.00	12,489.24
	HILTON DOMESTIC 4.875%	3,000.00	3,153.06
	HILTON GRAND 6.125%	10,000.00	10,461.40
	HOWMET AEROSPACE 5.125%	30,000.00	32,370.90
	HUGHES SAT 6.625%	36,000.00	40,077.00
	ICAHN ENTERPRI 6.375% WI	5,000.00	5,158.00
	ICAHN ENTERPRIS 6.25%	66,000.00	65,838.30
	ICAHN ENTERPRIS 6.75% WI	4,000.00	4,077.44
	ICAHN ENTERPRISES 4.75%	15,000.00	15,476.10
	ICAHN ENTERPRISES 6.25%	8,000.00	8,312.32
	IHEARTCOMMS 5.25% REGS	6,000.00	6,087.60

	IHEARTCOMMS 6.375%		30,000.00	31,689.60
	IHEARTCOMMS 8.375%		10,000.00	10,646.80
	INTELSAT 5.5%		44,000.00	27,452.48
	INTELSAT 8.5% REGS		12,000.00	7,713.84
	INTELSAT 8% REGS		18,000.00	18,598.86
	INTERTAPE POLYMER7% REGS		3,000.00	3,156.06
	IRON MOUNTAIN 5.25% REGS		9,000.00	9,426.06
	IRON MOUNTAIN4.875% REGS		13,000.00	13,390.13
	JBS USA 6.5% REGS		17,000.00	18,933.75
	JBS USA 6.5% REGS D		4,000.00	4,453.92
	L BRANDS 5.625%		55,000.00	59,573.25
	LENNAR 4.5%		10,000.00	10,896.80
	LENNAR 5.25%		5,000.00	5,763.80
	LENNAR 5.875%		15,000.00	17,076.30
	LEVEL 3 5.25%		35,000.00	36,045.80
	LEVEL 3 5.375%		5,000.00	5,102.00
	LIB MED IT 4% EB		12,000.00	9,480.00
	LIBERTY INTERACT13.75%EB		8,000.00	6,170.00
	LIVE NATION 5.625% REGS		9,000.00	9,262.80
	LPL HLDGS 5.75% REGS		8,000.00	8,230.64
	LPL HLDGS 5.75% REGS C		5,000.00	5,143.50
	MALLINCKRODT 5.5% REGS		10,000.00	5,422.30
	MARRIOTT 6.5%		15,000.00	15,555.45
	MATADOR 5.875%		6,000.00	5,880.48
	MATTEL 3.15%		12,000.00	12,146.16
	MATTEL 6.75% MAY		38,000.00	39,152.54
	MATTEL 6.75% REGS		11,000.00	11,489.94
	MGM GROWTH 5.75%		31,000.00	34,401.63
	MGM RESORTS 5.75%		70,000.00	76,129.20
	MIDCONTINENT 5.375% REGS		4,000.00	4,176.92
	MTS SYSTEMS 5.75% REGS		6,000.00	6,596.16
	NAVIENT 5.875%		10,000.00	10,408.60
	NCR 5.75% REGS		5,000.00	5,235.15
	NCR 6.125% REGS		5,000.00	5,337.55
	NETFLIX 4.375%		10,000.00	11,005.80
	NETFLIX 4.875%		10,000.00	11,214.30
	NETFLIX 5.375% REGS		6,000.00	6,986.82
	NETFLIX 5.875%		2,000.00	2,267.84
	NETFLIX 5.875% T		29,000.00	34,358.91
	NEW ALBERTSONS 7.45%		27,000.00	32,076.00
	NEWELL BRANDS MLT		85,000.00	91,273.85
	NEXSTAR ESCR5.625%REGS27		6,000.00	6,343.92
	NEXTERA ENERGY4.25%REGSF		4,000.00	4,228.72
	NIELSEN 5% REGS M		23,000.00	23,056.12
	NOKIA 3.375%		5,000.00	5,127.40
	NOVA CHEMICALS4.875%REGS		8,000.00	8,165.92
	NOVELIS 5.875% REGS		20,000.00	20,769.20
	NRG ENERGY 5.25% REGS		2,000.00	2,167.50
	NRG ENERGY 5.75% WI		8,000.00	8,505.84
	NRG ENERGY 7.25%		10,000.00	10,427.20
	NUANCE COMMS 5.625%		11,000.00	11,529.37
	NUSTAR LOGISTICS 5.625%		10,000.00	10,255.90
	NUSTAR LOGISTICS 6%		3,000.00	3,189.48
	OCCIDENTAL PETRO 8.5%		40,000.00	47,523.20
	OCEANEERING INTL 6%		4,000.00	3,852.88

	OI EUROPEAN 4% REGS	6,000.00	6,138.48
	OI INC/OBGC 5.375% REGS	5,000.00	5,368.55
	OI INC/OBGC 6.375% REGS	3,000.00	3,330.69
	OPEN TEXT 5.875% REGS	9,000.00	9,300.87
	OUTFRONT MEDIA 5% REGS	5,000.00	5,102.20
	PARK AEROSPACE 4.5% REGS	12,000.00	12,534.48
	PARK AEROSPACE 5.5% REGS	6,000.00	6,491.10
	PBF HLDG 7.25%	6,000.00	4,718.04
	PBF LOGISTICS 6.875%	8,000.00	7,834.32
	PENSKE AUTO 5.5%	29,000.00	29,769.08
	PERFORMANCE FOOD5.5%REGS	5,000.00	5,218.75
	PILGRIM'S 5.75% MAR	4,000.00	4,073.64
	PILGRIM'S 5.75% REGS	21,000.00	21,385.56
	PILGRIM'S 5.75% REGS C	3,000.00	3,058.05
	PLANTRONICS 5.5% REGS	14,000.00	14,071.40
	POST HOLDINGS 5.5% REGS	7,000.00	7,405.51
	POST HOLDINGS 5% REGS	22,000.00	22,969.32
	PRECIS DRILL 5.25%	2,000.00	1,858.30
	PRECIS DRILL 7.125% REGS	6,000.00	5,876.58
	PRIME SECSRVC 5.25% REGS	8,000.00	8,422.08
	PRIME SECSRVC 5.75% REGS	17,000.00	17,957.78
	QEP RESOURCES 5.25%	2,000.00	2,129.88
	QEP RESOURCES 5.375%	14,000.00	14,656.74
	QUICKEN LOANS 5.25% REGS	23,000.00	24,066.05
	RADIAN GRP 4.5%	8,000.00	8,304.64
	RADIAN GRP 4.875%	3,000.00	3,133.17
	RHP HOTEL 4.75%	5,000.00	5,064.50
	SCIENTIFIC GAMES 5% REGS	33,000.00	33,940.83
	SEALED AIR 4.875% REGS	10,000.00	10,428.20
	SEALED AIR 5.25% REGS	8,000.00	8,451.04
	SEALED AIR 5.5% REGS	35,000.00	38,543.05
	SINCLAIR TV 5.125% REGS	8,000.00	7,901.68
	SIRIUS XM 4.625% REGS 24	17,000.00	17,509.15
	SIRIUS XM 5.375% 26 REGS	12,000.00	12,399.12
	SIRIUS XM 5.5% REGS	8,000.00	8,565.44
	SIX FLAGS 4.875% REGS	3,000.00	3,013.23
	SIX FLAGS 5.5% REGS	3,000.00	3,077.13
	SM ENERGY 6.625%	7,000.00	6,729.87
	SM ENERGY 6.75%	4,000.00	3,861.48
	SPECTRUM BR 5.75%	2,000.00	2,059.96
	SPECTRUM BR 5% REGS	2,000.00	2,105.34
	SPRINGLEAF FIN 5.625%	22,000.00	23,154.34
	SPRINGLEAF FIN 6.125% 22	5,000.00	5,190.95
	SPRINGLEAF FIN 6.125% 24	5,000.00	5,338.40
	SPRINGLEAF FIN 7.125%	51,000.00	58,504.65
	SPRINT 7.125%	7,000.00	7,954.94
	SPRINT 7.25%	16,000.00	16,417.76
	SPRINT 7.625%	75,000.00	88,522.50
	SPRINT 7.625% 26	72,000.00	87,041.52
	SPRINT 7.875%	10,000.00	11,302.50
	SPRINT 8.75%	19,000.00	27,894.09
	SS&C TECH 5.5% REGS	10,000.00	10,466.50
	STANDARD INDUST4.75%REGS	15,000.00	15,209.70
	STANDARD INDUSTRIE5%REGS	5,000.00	5,170.25
	STAPLES 10.75% REGS	7,000.00	6,617.24

	STAPLES 7.5% REGS	15,000.00	15,260.55
	STARS GRP 7% REGS	10,000.00	10,456.00
	STATION CASINOS 5% REGS	10,000.00	10,088.30
	STEEL DYNAMICS 5%	10,000.00	10,519.80
	SUMMIT MATE 5.125% REGS	52,000.00	52,845.00
	SUMMIT MID 5.75%	15,000.00	12,315.15
	SUNOCO LP 5.5%	5,000.00	5,124.10
	SUNOCO LP 5.875%	3,000.00	3,159.78
	SUNOCO LP 6%	13,000.00	13,545.74
	SYMANTEC 5% REGS	12,000.00	12,168.48
	T-MOBILE USA 4.5%	26,000.00	26,433.94
	T-MOBILE USA 4.75%	11,000.00	11,554.40
	T-MOBILE USA 6.5% 26	13,000.00	13,349.57
	T-MOBILE USA 6%	9,000.00	9,011.34
	T-MOBILE USA 6% 24	4,000.00	4,000.96
	TALLGRASS NRG 5.5% REGS	7,000.00	7,043.12
	TARGA RESCS 4.25%	26,000.00	26,033.54
	TARGA RESCS 5.875%	10,000.00	10,343.80
	TEAM HEALTH 6.375% REGS	62,000.00	55,475.12
	TEGNA 5.5% REGS	10,000.00	10,180.70
	TELECOM ITALIA 6.375%	15,000.00	17,630.55
	TELECOM ITALIA 6%	6,000.00	6,859.14
	TELEFLEX 4.875%	2,000.00	2,050.78
	TEMPUR SEALY INTL 5.5%	38,000.00	39,223.22
	TENET HEALTH 4.625%	18,000.00	18,207.54
	TENET HEALTH 4.625% REGS	3,000.00	3,078.90
	TENET HEALTH 4.875% REGS	13,000.00	13,317.33
	TENET HEALTH 5.125%	60,000.00	60,286.20
	TENET HEALTH 5.125% REGS	11,000.00	11,381.70
	TENET HEALTH 6.25% REGS	13,000.00	13,655.46
	TENNANT 5.625%	15,000.00	15,470.55
	TERRAFORM 4.25% REGS	9,000.00	9,264.78
	TERRAFORM 5% REGS	11,000.00	11,863.28
	THHH 11.5% REGS ESCROW	215,000.00	172.00
	TRANSDIGM 6.25% REGS	13,000.00	13,651.04
	TRANSDIGM 6.5%	8,000.00	8,156.96
	TRANSOCEAN 5.875% REGS	4,350.00	3,916.39
	TRANSOCEAN 6.125% REGS	6,525.00	6,307.45
	TRANSOCEAN 6.25% REGS	5,400.00	5,240.59
	TRANSOCEAN 6.875% REGS	3,000.00	2,841.90
	TRINSEO 5.375% REGS	19,000.00	19,290.51
	TRONOX 6.5% REGS	12,000.00	12,418.44
	UNITED CONTINENTAL 5%	17,000.00	17,246.16
	UNITED RENTALS 4.875%	45,000.00	47,235.15
	UNITED RENTALS 5.5% F	55,000.00	57,811.05
	VALEANT 5.5% REGS	29,000.00	29,792.57
	VALEANT 9% REGS	25,000.00	27,098.25
	VIACOM FLT	3,000.00	3,038.37
	VIDEOTRON 5.125% REGS	28,000.00	29,423.52
	VIDEOTRON 5.375% REGS	27,000.00	29,444.31
	W&T OFFSHORE 9.75% REGS	7,000.00	6,068.93
	WESCO 5.375%	10,000.00	10,202.00
	WESTERN DIGI 4.75%	17,000.00	18,538.16
	WILLIAM CARTER5.625%REGS	5,000.00	5,251.25
	WMG ACQUISITION5.5% REGS	4,000.00	4,119.60

		WYNDHAM DESTINATI MLT 24		8,000.00	8,542.08	
		WYNDHAM DESTINATI MLT 25		2,000.00	2,247.29	
		WYNDHAM DESTINATI MLT 27		26,000.00	28,549.56	
		WYNN RESORTS 5.125% REGS		6,000.00	6,278.34	
		XPO LOGISTICS 6.75% REGS		22,000.00	23,116.06	
		XPO LOGISTICS6.125% REGS		9,000.00	9,152.10	
		YUM! BRANDS 4.75% REGS		7,000.00	7,230.86	
	計	銘柄数 :	327	6,149,513.04	5,479,820.62	
					(594,944,124)	
		組入時価比率 :	92.4%		99.8%	
	小計				594,944,124	
					(594,944,124)	
	合計				596,048,171	
					(596,048,171)	

(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】

(2021年4月9日現在)

種類	金額	単位
資産総額	1,891,647,596	円
負債総額	8,601,273	円
純資産総額( - )	1,883,046,323	円
発行済口数	2,802,952,367	口
1口当たり純資産額( / )	0.6718	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)

(2021年4月9日現在)

種類	金額	単位
資産総額	8,126,386,780	円
負債総額	103,973,137	円
純資産総額( - )	8,022,413,643	円
発行済口数	4,899,982,275	口
1口当たり純資産額( / )	1.6372	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)

(2021年4月9日現在)

種類	金額	単位
資産総額	8,282,880,660	円
負債総額	194,988,740	円
純資産総額( - )	8,087,891,920	円
発行済口数	5,106,414,002	口
1口当たり純資産額( / )	1.5839	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)

(2021年4月9日現在)

種類	金額	単位
資産総額	630,567,822	円
負債総額	2,032,339	円
純資産総額( - )	628,535,483	円
発行済口数	256,623,108	口
1口当たり純資産額( / )	2.4493	円

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

<訂正前>

資本金の額（2020年10月末現在）

（略）

（注）前記（イ）、（ロ）および（ハ）の意思決定機構、組織名称等は、2020年10月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

資本金の額（2021年4月末現在）

（略）

（注）前記（イ）、（ロ）および（ハ）の意思決定機構、組織名称等は、2021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、2021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	73	830,484
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	63	4,969,007
総合計	136	5,799,491
親投資信託	55	-

（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30期事業年度（2019年4月1日から2020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る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30期事業年度（2019年4月1日から2020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る監査を受けております。

また、第31期中間会計期間（2020年4月1日から2020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る中間監査を受けております。

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

#### <追加>

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第31期中間会計期間末

(2020年9月30日)

## 資産の部

## 流動資産

現金及び預金	15,365,301
前払費用	54,588
未収入金	37,247
未収委託者報酬	1,909,054
未収収益	1,751,605
関係会社短期貸付金	2,100,000
その他	953
流動資産計	21,218,750

## 固定資産

## 有形固定資産

器具備品	22,517
器具備品減価償却累計額	10,085
有形固定資産計	12,432

## 投資その他の資産

関係会社株式	60,000
投資有価証券	96,172
敷金保証金	98,724
前払年金費用	132,991
繰延税金資産	333,793
その他	9,508

投資その他の資産計	731,190
-----------	---------

固定資産計	743,622
-------	---------

資産合計	21,962,373
------	------------

(単位：千円)

第31期中間会計期間末

(2020年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

預り金 57,823

未払金 1,484,275

未払手数料 895,243

その他未払金 1 589,031

未払費用 801,853

未払法人税等 847,017

賞与引当金 1,180,180

役員賞与引当金 46,164

流動負債計 4,417,314

## 固定負債

長期未払金 241,143

賞与引当金 630,148

役員賞与引当金 174,888

固定負債計 1,046,180

## 負債合計 5,463,495

## 純資産の部

## 株主資本

資本金 2,218,000

## 資本剰余金

資本準備金 1,000,000

資本剰余金合計 1,000,000

## 利益剰余金

利益準備金 33,676

## その他利益剰余金

繰越利益剰余金 13,246,944

利益剰余金合計 13,280,621

株主資本合計 16,498,621

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金 257

評価・換算差額等合計 257

純資産合計 16,498,878

負債・純資産合計 21,962,373

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

		第31期中間会計期間 (自2020年4月1日 至2020年9月30日)
<hr/>		
営業収益		
委託者報酬		5,359,891
運用受託報酬		3,526,872
業務受託報酬		892,348
その他		47,855
営業収益計		<hr/> 9,826,967
営業費用		
支払手数料		2,767,399
調査費		843,858
その他営業費用		274,153
営業費用計		<hr/> 3,885,412
一般管理費	1	<hr/> 4,851,527
営業利益		<hr/> 1,090,027
営業外収益	2	<hr/> 7,304
営業外費用	3	<hr/> 9,973
経常利益		<hr/> 1,087,359
税引前中間純利益		<hr/> 1,087,359
法人税、住民税及び事業税		791,620
法人税等調整額		<hr/> (367,953)
法人税等合計		<hr/> 423,667
中間純利益		<hr/> <hr/> 663,691

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 関係会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

#### (2) その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

### 2．引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支給に備えるため、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。

#### (2) 役員賞与引当金

役員に対する賞与の支給に備えるため、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。

#### (3) 退職給付引当金

従業員に対する退職給付に備えるため、当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。

### 3．固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

器具備品 5年

### 4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

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。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

第31期中間会計期間末 (2020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31期中間会計期間 (自2020年4月1日 至2020年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 3,003千円
2	営業外収益のうち主要なもの 受取配当金 2,422千円 受取利息 4,882千円
3	営業外費用のうち主要なもの 為替差損 9,415千円

## （金融商品関係）

第31期中間会計期間末（2020年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

2020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	15,365,301	15,365,301	-
(2) 未収委託者報酬	1,909,054	1,909,054	-
(3) 未収収益	1,751,605	1,751,605	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,100,000	2,100,000	-
資産計	21,125,960	21,125,960	-
(1) 未払手数料	895,243	895,243	-
(2) その他未払金	589,031	589,031	-
(3) 未払費用	801,853	801,853	-
(4) 長期未払金	241,143	241,143	-
負債計	2,527,271	2,527,271	-

（注）1．金融商品の時価算定方法

資産

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

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

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、及び(3) 未払費用

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

(4) 長期未払金

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

## （注）２．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額
関係会社株式	60,000
投資有価証券（合同会社出資金）	88,395

上記の関係会社株式及び投資有価証券（合同会社出資金）については、市場価格がなく、かつ、将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、上表に含めておりません。

## 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## （有価証券関係）

第31期中間会計期間末（2020年9月30日）

## １．関係会社株式

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

## ２．その他有価証券

投資有価証券（合同会社出資金）（中間貸借対照表計上額 88,395千円）については市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、記載しておりません。



## （セグメント情報等）

## セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 関連情報

第31期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

## 1．サービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	業務受託報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	5,359,891	3,526,872	892,348	47,855	9,826,967

## 2．地域ごとの情報

## 営業収益

（単位：千円）

日本	香港	英国	その他	合計
6,128,504	1,470,144	1,290,541	937,777	9,826,967

（注）営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

## 3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益	関連するセグメント
JPMorgan Asset Management (Asia Pacific) Limited	1,424,439	資産運用業
JPMorgan Asset Management (UK) Limited	1,285,716	資産運用業

## （1株当たり情報）

第31期中間会計期間 （自2020年4月1日 至2020年9月30日）	
1株当たり純資産額	293,235.19円
1株当たり中間純利益金額	11,795.80円
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たりの中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	663,691千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	663,691千円
普通株式の期中平均株式数	56,265株

独立監査人の監査報告書

2021年4月14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  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	鶴 田 光 夫
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山 口 健 志

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているJPMグローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）の2020年9月11日から2021年3月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、JPMグローバル債券3分散ファンド（毎月決算型）の2021年3月10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。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

(注) 1 . 上記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

2020年12月7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  
東京事務所指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鶴田光夫指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 山口健志

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているJ P モルガン・アセット・マネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020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。

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2020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（2020年4月1日から2020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。

## 中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

## 中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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。

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記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。