

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 平成30年11月26日

【発行者名】 J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 大越 昇一

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内二丁目7番3号 東京ビルディング

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

【電話番号】 03 - 6736 - 2000

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）
J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）
J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年2回決算型）
J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型）

【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】 J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）につき、2兆円を上限とします。
J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）につき、2兆円を上限とします。
J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年2回決算型）につき、2兆円を上限とします。
J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型）につき、2兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

・【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、平成30年5月24日付で提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また記載事項の一部訂正を行うため、訂正届出書を提出いたします。

・【訂正の内容】

第一部【証券情報】

（7）申込期間

<訂正前>

平成30年5月25日から平成31年5月23日までとします。

申込期間は、前記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

<訂正後>

2018年5月25日から2019年5月23日までとします。

申込期間は、前記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（3）ファンドの仕組み

<訂正前>

（略）

（八）委託会社の概況

資本金 2,218百万円（平成30年3月末現在）

（略）

大株主の状況（平成30年3月末現在）

（以下略）

<訂正後>

（略）

（八）委託会社の概況

資本金 2,218百万円（平成30年9月末現在）

（略）

大株主の状況（平成30年9月末現在）

（以下略）

2【投資方針】

（3）運用体制

<訂正前>

- ・ 当ファンドの主要投資先であるマザーファンドにおける運用体制

（略）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、平成30年3月末現在ののものであり、今後変更となる場合があります。

（以下略）

<訂正後>

- ・ 当ファンドの主要投資先であるマザーファンドにおける運用体制
（略）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、平成30年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。
（以下略）

3【投資リスク】

（1）リスク要因

<訂正前>

（略）

流動性リスク

急激かつ大量の売買により市場が大きな影響を受けた場合、または市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合には、注文が成立しないこと、売買が成立しても注文時に想定していた価格と大きく異なることがあります。このような場合には、有価証券の価格の下落により、マザーファンドの信託財産の価値が影響を受けることがあります。

（略）

繰上げ償還等について

当ファンドのいずれかの信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなった場合、委託会社が受益者のため有利であると認める場合、またはやむを得ない事情が発生した場合には、該当する当ファンドは信託期間の途中であっても繰上げ償還することがあります。また、投資環境の変化等により、委託会社が当ファンドの申込期間を更新しないことや申込みの受付を停止することがあります。この場合は新たに当ファンドを購入することはできなくなります。

（略）

<訂正後>

（略）

流動性リスク

ある種の有価証券、特に市場での取引頻度が少なかったり、比較的小規模な市場で取引されているものは、特に取引金額が大きいと、望ましい時点と価格で売買することが難しくなる場合があります。

市場が極端な状況にあるときは、買い手が減って望ましい時点または価格で有価証券をすぐに売却できず、マザーファンドが低い価格で有価証券を売却することを余儀なくされるか、あるいはまったく売却できない可能性があります。特定の有価証券またはその他の金融商品は、取扱う取引所または政府もしくは監督当局により取引を停止または制限される場合があり、その結果マザーファンドに損失が生じる可能性があります。有価証券を売却できないことにより、マザーファンドはその信託財産の価値が下がったり、他の投資機会を活用できなくなる可能性があります。

流動性リスクには、通常とは異なる市場環境や通常以上に多額の換金申込み、あるいはその他の制御不能な要因によって、マザーファンドが所定の期間内に換金代金の支払いに応じられないリスクも含まれます。換金申込みに応えるため、マザーファンドは不利な時点や条件で有価証券の売却を余儀なくされることがあります。

特に、債券、中小型株式または新興市場で発行される有価証券に投資している場合、特定の期間において、経済状況、市況もしくは政情の悪材料、またはそれが正確か否かにかかわらず投資家による市場見通しの悪化により、特定の発行会社もしくは業種、または特定の投資分野のすべての有価証券の流動性が前触れなく突然低下もしくは消滅するリスクがあります。

（略）

繰上償還等について

当ファンドのいずれかの信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなった場合、委託会社が受益者のため有利であると認める場合、またはやむを得ない事情が発生した場合には、該当する当ファンドは信託期間の途中であっても繰上償還することがあります。また、投資環境の変化等により、委託会社

が当ファンドの申込期間を更新しないことや申込みの受付を停止することがあります。この場合は新たに当ファンドを購入することはできなくなります。

(略)

原届出書の「第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 3 投資リスク(1) リスク要因」末尾の参考情報について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

参考情報

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

JPM北米高配当・成長株ファンド(為替ヘッジなし、3ヵ月決算型)

＜ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移＞

2013年10月～2018年9月の5年間に於ける、ファンドの分配金再投資基準価額(日次)、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。



JPM北米高配当・成長株ファンド(米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型)

＜ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移＞

2013年10月～2018年9月の5年間に於ける、ファンドの分配金再投資基準価額(日次)、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。ただし、ファンドは設定から6年未満で、設定日から2014年3月末までは年間騰落率が算出されないことから、それ以降の毎月末時点における年間騰落率を用いています。
- 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(東証)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、東証に帰属しています。なお、ファンドは、東証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、東証証券取引所は、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。同指数に関する情報の確実性および完全性をMSCI Inc.は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、当該指数の正確性、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。

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。

JPM北米高配当・成長株ファンド(為替ヘッジなし、年2回決算型)

<ファンドの基準価額・年間騰落率の推移>

2013年10月～2018年9月の5年間に於ける、ファンドの基準価額(円)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。



JPM北米高配当・成長株ファンド(米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型)

<ファンドの基準価額・年間騰落率の推移>

2013年10月～2018年9月の5年間に於ける、ファンドの基準価額(円)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)

- 基準価額は、信託報酬控除後です。
- 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。設定日から1年末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。ただし、ファンドは設定日から6年末まで、設定日から2014年3月末までは年間騰落率が算出されないことから、それ以降の毎月末時点における年間騰落率を用いています。
- 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

<訂正前>

運用委託先におけるリスク管理

(略)

(平成30年3月末現在)

(以下略)

< 訂正後 >

運用委託先におけるリスク管理

（略）

（平成30年9月末現在）

（以下略）

4【手数料等及び税金】

（5）課税上の取扱い

< 訂正前 >

（略）

なお、税法が改正された場合には、以下の内容が変更になることがあります。以下の税制は平成30年3月末現在適用されるものです。

、（略）

法人、個人別の課税の取扱いについて

（a）個人の受益者に対する課税

（イ）収益分配金

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得となり、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）*となり。なお、収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

原則として、源泉徴収による申告不要制度が適用されます。また、確定申告を行い、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。

* 平成49年12月31日までの税率です。

（ロ）一部解約時・償還時

解約価額および償還価額から取得費*1を控除した差益は譲渡所得等として、申告分離課税となり、確定申告を行うことが必要となります。税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）*2となります。当該控除結果がマイナスの場合は「差損」となり、損益通算の対象となります。（損益通算については後記（八）損益通算についてをご参照ください。）

前記にかかわらず、販売会社において源泉徴収ありの特定口座をご利用の場合確定申告は不要となり、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）*2の税率で源泉徴収されます。

（略）

* 2 平成49年12月31日までの税率です。

（略）

（b）法人の受益者に対する課税

法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）*の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。なお、地方税の源泉徴収はありません。また、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。益金不算入制度は適用されません。

* 平成49年12月31日までの税率です。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家（税務署等）に確認することをお勧めします。

< 訂正後 >

（略）

なお、税法が改正された場合には、以下の内容が変更になることがあります。以下の税制は平成30年9月末現在適用されるものです。

、 (略)

法人、個人別の課税の取扱について

(a) 個人の受益者に対する課税

(イ) 収益分配金

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得となり、税率は20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%) * となります。なお、収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金(特別分配金)は課税されません。

原則として、源泉徴収による申告不要制度が適用されます。また、確定申告を行い、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。

* 2037年12月31日までの税率です。

(ロ) 一部解約時・償還時

解約価額および償還価額から取得費*1を控除した差益は譲渡所得等として、申告分離課税となり、確定申告を行うことが必要となります。税率は20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%) *2 となります。当該控除結果がマイナスの場合は「差損」となり、損益通算の対象となります。(損益通算については後記(八) 損益通算についてをご参照ください。)

前記にかかわらず、販売会社において源泉徴収ありの特定口座をご利用の場合確定申告は不要となり、20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%) *2の税率で源泉徴収されます。

(略)

*2 2037年12月31日までの税率です。

(略)

(b) 法人の受益者に対する課税

法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315% (所得税15%および復興特別所得税0.315%) *の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。なお、地方税の源泉徴収はありません。また、元本払戻金(特別分配金)は課税されません。益金不算入制度は適用されません。

* 2037年12月31日までの税率です。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家(税務署等)に確認することをお勧めします。

5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

(1) 投資状況

< JPM北米高配当・成長株ファンド(為替ヘッジなし、3ヵ月決算型) >

(平成30年9月28日現在)

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 5,072,695,347 | 100.15 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 7,539,515 | 0.15 |
| 合計(純資産総額) | | 5,065,155,832 | 100.00 |

(注) 投資比率とは、当ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。投資比率は四捨五入です。親投資信託は、全て「GIM北米高配当株式マザーファンド(適格機関投資家専用)」です(以下同じ)。

< JPM北米高配当・成長株ファンド(米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型) >

(平成30年9月28日現在)

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 604,579,205 | 102.22 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 13,113,341 | 2.22 |
| 合計(純資産総額) | | 591,465,864 | 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。

< J P M北米高配当・成長株ファンド(為替ヘッジなし、年2回決算型) >

(平成30年9月28日現在)

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 4,066,144,383 | 100.15 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 6,030,476 | 0.15 |
| 合計(純資産総額) | | 4,060,113,907 | 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。

< J P M北米高配当・成長株ファンド(米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型) >

(平成30年9月28日現在)

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 374,569,666 | 102.21 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 8,104,288 | 2.21 |
| 合計(純資産総額) | | 366,465,378 | 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北米高配当株式マザーファンド(適格機関投資家専用)

(平成30年9月28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 | 10,336,249,619 | 96.16 |
| 投資証券 | アメリカ | 305,938,329 | 2.85 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 107,276,340 | 1.00 |
| 合計(純資産総額) | | 10,749,464,288 | 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 (イ)ファンドの目的」をご参照ください。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

< J P M北米高配当・成長株ファンド(為替ヘッジなし、3ヵ月決算型) >

(平成30年9月28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北米高配当株式マザーファンド (適格機関投資家専用) | 2,032,004,225 | 2.4265 | 4,930,726,864 | 2.4964 | 5,072,695,347 | 100.15 |

< J P M北米高配当・成長株ファンド(米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型) >

(平成30年9月28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北米高配当株式マザーファンド (適格機関投資家専用) | 242,180,422 | 2.4265 | 587,655,709 | 2.4964 | 604,579,205 | 102.22 |

< J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年2回決算型）>

（平成30年9月28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北米高配当株式マザーファンド (適格機関投資家専用) | 1,628,803,230 | 2.4262 | 3,951,818,680 | 2.4964 | 4,066,144,383 | 100.15 |

< J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型）>

（平成30年9月28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北米高配当株式マザーファンド (適格機関投資家専用) | 150,043,930 | 2.4266 | 364,098,529 | 2.4964 | 374,569,666 | 102.21 |

（参考）G I M北米高配当株式マザーファンド（適格機関投資家専用）

（平成30年9月28日現在）

| 順位 | 国/ 地域 | 投資国 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 株式数 | 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 | アメリカ | アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 26,420 | 12,310.98 | 325,256,303 | 12,993.54 | 343,289,425 | 3.19 |
| 2 | アメリカ | アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 24,030 | 13,504.60 | 324,515,747 | 13,908.91 | 334,231,297 | 3.11 |
| 3 | アメリカ | アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 96,120 | 3,508.17 | 337,206,002 | 3,400.28 | 326,835,471 | 3.04 |
| 4 | アメリカ | アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハード ウェアおよび機器 | 11,050 | 24,549.29 | 271,269,668 | 25,547.57 | 282,300,665 | 2.63 |
| 5 | アメリカ | アメリカ | 株式 | MERCK & CO INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス | 34,310 | 7,840.87 | 269,020,345 | 8,031.67 | 275,566,611 | 2.56 |
| 6 | アメリカ | アメリカ | 株式 | CONOCOPHILLIPS | エネルギー | 30,110 | 8,246.31 | 248,296,626 | 8,803.94 | 265,086,826 | 2.47 |
| 7 | アメリカ | アメリカ | 株式 | CME GROUP INC | 各種金融 | 12,700 | 19,229.67 | 244,216,839 | 19,526.09 | 247,981,344 | 2.31 |
| 8 | アメリカ | アメリカ | 株式 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | エネルギー | 25,780 | 9,010.64 | 232,294,397 | 9,218.47 | 237,652,334 | 2.21 |
| 9 | アメリカ | アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON | 医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス | 14,360 | 15,439.84 | 221,716,124 | 15,697.64 | 225,418,188 | 2.10 |
| 10 | アメリカ | アメリカ | 株式 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC | 銀行 | 14,400 | 16,232.56 | 233,748,866 | 15,597.70 | 224,606,935 | 2.09 |
| 11 | アメリカ | アメリカ | 株式 | BLACKROCK INC | 各種金融 | 4,040 | 54,230.81 | 219,092,475 | 54,273.96 | 219,266,828 | 2.04 |
| 12 | アメリカ | アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC | 小売 | 9,300 | 22,861.64 | 212,613,261 | 23,490.81 | 218,464,615 | 2.03 |
| 13 | アメリカ | アメリカ | 株式 | PFIZER INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス | 39,738 | 4,815.36 | 191,353,094 | 4,985.72 | 198,122,661 | 1.84 |
| 14 | アメリカ | アメリカ | 株式 | TEXAS INSTRUMENTS INC | 半導体・半導体製造装置 | 15,870 | 12,906.09 | 204,819,724 | 12,184.92 | 193,374,764 | 1.80 |
| 15 | アメリカ | アメリカ | 株式 | THE TRAVELERS COS INC | 保険 | 13,130 | 14,822.02 | 194,613,132 | 14,664.15 | 192,540,400 | 1.79 |
| 16 | アメリカ | アメリカ | 株式 | GENERAL DYNAMICS CORP | 資本財 | 8,320 | 21,872.44 | 181,978,753 | 22,950.22 | 190,945,877 | 1.78 |
| 17 | アメリカ | アメリカ | 株式 | ELI LILLY AND COMPANY | 医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス | 14,790 | 12,012.29 | 177,661,901 | 12,116.78 | 179,207,225 | 1.67 |
| 18 | アメリカ | アメリカ | 株式 | DOVER CORPORATION | 資本財 | 17,510 | 9,569.40 | 167,560,337 | 10,105.45 | 176,946,580 | 1.65 |
| 19 | アメリカ | アメリカ | 株式 | COMCAST CORP-CL A | メディア | 43,320 | 4,135.08 | 179,131,826 | 3,999.93 | 173,277,202 | 1.61 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|------|------|----|---------------------------------------|------------------------|--------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| 20 | アメリカ | アメリカ | 株式 | MCDONALD'S CORPORATION | 消費者サービス | 9,100 | 18,100.78 | 164,717,158 | 18,912.81 | 172,106,590 | 1.60 |
| 21 | アメリカ | アメリカ | 株式 | AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC | 素材 | 8,990 | 18,849.21 | 169,454,424 | 19,138.81 | 172,057,959 | 1.60 |
| 22 | アメリカ | アメリカ | 株式 | DOWDUPONT INC | 素材 | 22,573 | 7,860.17 | 177,427,837 | 7,419.52 | 167,481,008 | 1.56 |
| 23 | アメリカ | アメリカ | 株式 | ILLINOIS TOOL WORKS INC | 資本財 | 10,080 | 15,394.41 | 155,175,688 | 16,124.66 | 162,536,659 | 1.51 |
| 24 | アメリカ | アメリカ | 株式 | ANALOG DEVICES INC | 半導体・半導体製造装置 | 15,240 | 11,218.44 | 170,969,096 | 10,468.88 | 159,545,771 | 1.48 |
| 25 | アメリカ | アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS | 電気通信サービス | 25,900 | 6,221.36 | 161,133,343 | 6,086.21 | 157,633,002 | 1.47 |
| 26 | アメリカ | アメリカ | 株式 | ALTRIA GROUP INC | 食品・飲料・タバコ | 22,050 | 6,675.64 | 147,197,963 | 6,901.64 | 152,181,358 | 1.42 |
| 27 | アメリカ | アメリカ | 株式 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC | 保険 | 26,100 | 5,678.49 | 148,208,849 | 5,636.47 | 147,112,104 | 1.37 |
| 28 | アメリカ | アメリカ | 株式 | WELLS FARGO COMPANY | 銀行 | 23,900 | 6,665.42 | 159,303,617 | 5,998.76 | 143,370,541 | 1.33 |
| 29 | アメリカ | アメリカ | 株式 | BRISTOL-MYERS SQUIBB COMPANY | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 19,570 | 6,816.47 | 133,398,346 | 7,035.66 | 137,687,896 | 1.28 |
| 30 | アメリカ | アメリカ | 株式 | PPG INDUSTRIES INC | 素材 | 10,780 | 12,563.11 | 135,430,363 | 12,377.99 | 133,434,779 | 1.24 |

(注) 上記の「国/地域」は、マザーファンドが保有する有価証券の発行地または上場取引所の国/地域を表しています。なお、「投資国」は、「第1ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 (イ) ファンドの目的」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」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

< JPM北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）>

（平成30年9月28日現在）

| 種類 | 投資比率（%） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 100.15 |

< JPM北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）>

（平成30年9月28日現在）

| 種類 | 投資比率（%） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 102.22 |

< JPM北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年2回決算型）>

（平成30年9月28日現在）

| 種類 | 投資比率（%） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 100.15 |

< JPM北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型）>

（平成30年9月28日現在）

| 種類 | 投資比率（%） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 102.21 |

(参考) GIM北米高配当株式マザーファンド（適格機関投資家専用）

（平成30年9月28日現在）

| 種類 | 国内/外国 | 業種 | 投資比率（%） |
|----|-------|----|---------|
|----|-------|----|---------|

| | | | |
|------|----|------------------------|-------|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 9.43 |
| | | 素材 | 4.90 |
| | | 資本財 | 8.05 |
| | | 商業・専門サービス | 1.16 |
| | | 運輸 | 1.23 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 1.03 |
| | | 消費者サービス | 2.60 |
| | | メディア | 1.61 |
| | | 小売 | 3.53 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 5.76 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 4.28 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 10.28 |
| | | 銀行 | 9.52 |
| | | 各種金融 | 7.90 |
| | | 保険 | 7.94 |
| | | ソフトウェア・サービス | 5.55 |
| | | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2.63 |
| | | 電気通信サービス | 1.47 |
| | | 公益事業 | 4.01 |
| | | 半導体・半導体製造装置 | 3.28 |
| 小計 | | 96.16 | |
| 投資証券 | - | 2.85 | |

投資不動産物件

< J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）>
該当事項はありません。

< J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）>
該当事項はありません。

< J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年2回決算型）>
該当事項はありません。

< J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型）>
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

< J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）>
該当事項はありません。

< J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）>
該当事項はありません。

< J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年2回決算型）>
該当事項はありません。

< J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型） >

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

平成30年9月末日および同日前1年以内における各月末ならびに下記特定期間末または計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

< J P M 北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型） >

| 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1特定期間末 | (平成25年8月26日) | 14,242 | 14,950 | 1.0055 | 1.0555 |
| 第2特定期間末 | (平成26年2月26日) | 14,873 | 15,593 | 1.0326 | 1.0826 |
| 第3特定期間末 | (平成26年8月26日) | 11,012 | 11,434 | 1.0435 | 1.0835 |
| 第4特定期間末 | (平成27年2月26日) | 11,065 | 12,103 | 1.0660 | 1.1660 |
| 第5特定期間末 | (平成27年8月26日) | 9,031 | 9,031 | 0.8912 | 0.8912 |
| 第6特定期間末 | (平成28年2月26日) | 7,096 | 7,096 | 0.8855 | 0.8855 |
| 第7特定期間末 | (平成28年8月26日) | 4,898 | 4,898 | 0.8723 | 0.8723 |
| 第8特定期間末 | (平成29年2月27日) | 6,104 | 6,467 | 1.0093 | 1.0693 |
| 第9特定期間末 | (平成29年8月28日) | 6,486 | 6,486 | 0.9883 | 0.9883 |
| 第10特定期間末 | (平成30年2月26日) | 5,742 | 5,799 | 1.0114 | 1.0214 |
| 第11特定期間末 | (平成30年8月27日) | 5,086 | 5,333 | 1.0322 | 1.0822 |
| | 平成29年9月末日 | 6,800 | - | 1.0592 | - |
| | 平成29年10月末日 | 6,760 | - | 1.0862 | - |
| | 平成29年11月末日 | 6,293 | - | 1.0406 | - |
| | 平成29年12月末日 | 6,350 | - | 1.0769 | - |
| | 平成30年1月末日 | 6,222 | - | 1.0786 | - |
| | 平成30年2月末日 | 5,753 | - | 1.0139 | - |
| | 平成30年3月末日 | 5,378 | - | 0.9726 | - |
| | 平成30年4月末日 | 5,448 | - | 1.0039 | - |
| | 平成30年5月末日 | 5,407 | - | 1.0077 | - |
| | 平成30年6月末日 | 5,273 | - | 1.0157 | - |
| | 平成30年7月末日 | 5,299 | - | 1.0619 | - |
| | 平成30年8月末日 | 5,051 | - | 1.0360 | - |
| | 平成30年9月末日 | 5,065 | - | 1.0604 | - |

(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あります。

< J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型） >

| 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1特定期間末 | (平成25年8月26日) | 262 | 275 | 1.0099 | 1.0599 |
| 第2特定期間末 | (平成26年2月26日) | 239 | 244 | 1.0260 | 1.0460 |
| 第3特定期間末 | (平成26年8月26日) | 195 | 201 | 1.0239 | 1.0539 |
| 第4特定期間末 | (平成27年2月26日) | 137 | 139 | 1.0198 | 1.0298 |
| 第5特定期間末 | (平成27年8月26日) | 95 | 95 | 0.8945 | 0.8945 |
| 第6特定期間末 | (平成28年2月26日) | 69 | 69 | 0.9372 | 0.9372 |
| 第7特定期間末 | (平成28年8月26日) | 113 | 115 | 1.0100 | 1.0300 |
| 第8特定期間末 | (平成29年2月27日) | 953 | 1,019 | 1.0100 | 1.0800 |
| 第9特定期間末 | (平成29年8月28日) | 1,076 | 1,076 | 1.0082 | 1.0082 |
| 第10特定期間末 | (平成30年2月26日) | 847 | 889 | 1.0158 | 1.0658 |
| 第11特定期間末 | (平成30年8月27日) | 620 | 629 | 1.0241 | 1.0391 |
| | 平成29年9月末日 | 1,095 | - | 1.0454 | - |
| | 平成29年10月末日 | 1,081 | - | 1.0672 | - |
| | 平成29年11月末日 | 1,001 | - | 1.0417 | - |
| | 平成29年12月末日 | 1,003 | - | 1.0670 | - |
| | 平成30年1月末日 | 945 | - | 1.1071 | - |
| | 平成30年2月末日 | 843 | - | 1.0140 | - |
| | 平成30年3月末日 | 776 | - | 0.9811 | - |
| | 平成30年4月末日 | 751 | - | 0.9824 | - |
| | 平成30年5月末日 | 724 | - | 0.9958 | - |
| | 平成30年6月末日 | 681 | - | 0.9848 | - |
| | 平成30年7月末日 | 606 | - | 1.0231 | - |
| | 平成30年8月末日 | 625 | - | 1.0289 | - |
| | 平成30年9月末日 | 591 | - | 1.0278 | - |

（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。

< J P M北米高配当・成長株ファンド(為替ヘッジなし、年2回決算型) >

| 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) |
|-----|--------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| 1期 | (平成25年8月26日) | 21,575 | 21,575 | 1.0555 | 1.0555 |
| 2期 | (平成26年2月26日) | 17,968 | 17,968 | 1.1899 | 1.1899 |
| 3期 | (平成26年8月26日) | 10,779 | 10,779 | 1.3101 | 1.3101 |
| 4期 | (平成27年2月26日) | 11,350 | 11,350 | 1.5939 | 1.5939 |
| 5期 | (平成27年8月26日) | 7,838 | 7,838 | 1.3960 | 1.3960 |
| 6期 | (平成28年2月26日) | 6,302 | 6,302 | 1.3931 | 1.3931 |
| 7期 | (平成28年8月26日) | 5,148 | 5,148 | 1.3721 | 1.3721 |
| 8期 | (平成29年2月27日) | 5,492 | 5,492 | 1.6823 | 1.6823 |
| 9期 | (平成29年8月28日) | 4,652 | 4,652 | 1.6471 | 1.6471 |
| 10期 | (平成30年2月26日) | 4,182 | 4,182 | 1.8029 | 1.8029 |
| 11期 | (平成30年8月27日) | 4,054 | 4,054 | 1.9392 | 1.9392 |
| | 平成29年9月末日 | 4,839 | - | 1.7653 | - |
| | 平成29年10月末日 | 4,580 | - | 1.8103 | - |
| | 平成29年11月末日 | 4,531 | - | 1.8369 | - |
| | 平成29年12月末日 | 4,489 | - | 1.9013 | - |
| | 平成30年1月末日 | 4,439 | - | 1.9043 | - |
| | 平成30年2月末日 | 4,188 | - | 1.8074 | - |
| | 平成30年3月末日 | 4,013 | - | 1.7337 | - |
| | 平成30年4月末日 | 4,094 | - | 1.7895 | - |
| | 平成30年5月末日 | 4,042 | - | 1.8052 | - |
| | 平成30年6月末日 | 4,017 | - | 1.8196 | - |
| | 平成30年7月末日 | 4,064 | - | 1.9027 | - |
| | 平成30年8月末日 | 4,031 | - | 1.9464 | - |
| | 平成30年9月末日 | 4,060 | - | 1.9921 | - |

< J P M北米高配当・成長株ファンド(米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型) >

| 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) |
|-----|--------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| 1期 | (平成25年8月26日) | 297 | 297 | 1.0629 | 1.0629 |
| 2期 | (平成26年2月26日) | 237 | 237 | 1.1543 | 1.1543 |
| 3期 | (平成26年8月26日) | 178 | 178 | 1.2479 | 1.2479 |
| 4期 | (平成27年2月26日) | 178 | 178 | 1.3215 | 1.3215 |
| 5期 | (平成27年8月26日) | 127 | 127 | 1.1585 | 1.1585 |
| 6期 | (平成28年2月26日) | 120 | 120 | 1.2155 | 1.2155 |
| 7期 | (平成28年8月26日) | 170 | 170 | 1.3330 | 1.3330 |
| 8期 | (平成29年2月27日) | 708 | 708 | 1.4673 | 1.4673 |
| 9期 | (平成29年8月28日) | 698 | 698 | 1.4665 | 1.4665 |
| 10期 | (平成30年2月26日) | 515 | 515 | 1.6272 | 1.6272 |
| 11期 | (平成30年8月27日) | 382 | 382 | 1.6637 | 1.6637 |
| | 平成29年9月末日 | 709 | - | 1.5206 | - |
| | 平成29年10月末日 | 678 | - | 1.5524 | - |
| | 平成29年11月末日 | 650 | - | 1.5895 | - |
| | 平成29年12月末日 | 613 | - | 1.6280 | - |
| | 平成30年1月末日 | 563 | - | 1.6901 | - |
| | 平成30年2月末日 | 502 | - | 1.6245 | - |
| | 平成30年3月末日 | 447 | - | 1.5708 | - |
| | 平成30年4月末日 | 416 | - | 1.5728 | - |
| | 平成30年5月末日 | 404 | - | 1.5945 | - |
| | 平成30年6月末日 | 396 | - | 1.5768 | - |
| | 平成30年7月末日 | 387 | - | 1.6385 | - |
| | 平成30年8月末日 | 381 | - | 1.6714 | - |
| | 平成30年9月末日 | 366 | - | 1.6697 | - |

分配の推移

< J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）>

| 期 | 1口当たり分配金（円） |
|---------|-------------|
| 第1特定期間 | 0.0500 |
| 第2特定期間 | 0.1000 |
| 第3特定期間 | 0.0900 |
| 第4特定期間 | 0.2000 |
| 第5特定期間 | 0.0500 |
| 第6特定期間 | 0.0050 |
| 第7特定期間 | 0.0000 |
| 第8特定期間 | 0.0600 |
| 第9特定期間 | 0.0000 |
| 第10特定期間 | 0.0700 |
| 第11特定期間 | 0.0550 |

< J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）>

| 期 | 1口当たり分配金（円） |
|---------|-------------|
| 第1特定期間 | 0.0500 |
| 第2特定期間 | 0.0700 |
| 第3特定期間 | 0.0800 |
| 第4特定期間 | 0.0600 |
| 第5特定期間 | 0.0000 |
| 第6特定期間 | 0.0000 |
| 第7特定期間 | 0.0200 |
| 第8特定期間 | 0.1100 |
| 第9特定期間 | 0.0000 |
| 第10特定期間 | 0.1000 |
| 第11特定期間 | 0.0150 |

< J P M北米高配当・成長株ファンド(為替ヘッジなし、年2回決算型) >

| 期 | 1口当たり分配金(円) |
|-----|-------------|
| 1期 | 0.0000 |
| 2期 | 0.0000 |
| 3期 | 0.0000 |
| 4期 | 0.0000 |
| 5期 | 0.0000 |
| 6期 | 0.0000 |
| 7期 | 0.0000 |
| 8期 | 0.0000 |
| 9期 | 0.0000 |
| 10期 | 0.0000 |
| 11期 | 0.0000 |

< J P M北米高配当・成長株ファンド(米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型) >

| 期 | 1口当たり分配金(円) |
|-----|-------------|
| 1期 | 0.0000 |
| 2期 | 0.0000 |
| 3期 | 0.0000 |
| 4期 | 0.0000 |
| 5期 | 0.0000 |
| 6期 | 0.0000 |
| 7期 | 0.0000 |
| 8期 | 0.0000 |
| 9期 | 0.0000 |
| 10期 | 0.0000 |
| 11期 | 0.0000 |

収益率の推移

< J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）>

| 期 | 収益率（％） |
|---------|--------|
| 第1特定期間 | 5.55 |
| 第2特定期間 | 12.64 |
| 第3特定期間 | 9.77 |
| 第4特定期間 | 21.32 |
| 第5特定期間 | 11.71 |
| 第6特定期間 | 0.08 |
| 第7特定期間 | 1.49 |
| 第8特定期間 | 22.58 |
| 第9特定期間 | 2.08 |
| 第10特定期間 | 9.42 |
| 第11特定期間 | 7.49 |

（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。

< J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）>

| 期 | 収益率（％） |
|---------|--------|
| 第1特定期間 | 5.99 |
| 第2特定期間 | 8.53 |
| 第3特定期間 | 7.59 |
| 第4特定期間 | 5.46 |
| 第5特定期間 | 12.29 |
| 第6特定期間 | 4.77 |
| 第7特定期間 | 9.90 |
| 第8特定期間 | 10.89 |
| 第9特定期間 | 0.18 |
| 第10特定期間 | 10.67 |
| 第11特定期間 | 2.29 |

（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。

< J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年2回決算型）>

| 期 | 収益率（％） |
|-----|--------|
| 1期 | 5.55 |
| 2期 | 12.73 |
| 3期 | 10.10 |
| 4期 | 21.66 |
| 5期 | 12.42 |
| 6期 | 0.21 |
| 7期 | 1.51 |
| 8期 | 22.61 |
| 9期 | 2.09 |
| 10期 | 9.46 |
| 11期 | 7.56 |

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

< J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型）>

| 期 | 収益率（％） |
|-----|--------|
| 1期 | 6.29 |
| 2期 | 8.60 |
| 3期 | 8.11 |
| 4期 | 5.90 |
| 5期 | 12.33 |
| 6期 | 4.92 |
| 7期 | 9.67 |
| 8期 | 10.08 |
| 9期 | 0.05 |
| 10期 | 10.96 |
| 11期 | 2.24 |

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

(4) 設定及び解約の実績

下記特定期間中または計算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または計算期間末の残存口数は次の通りです。

< J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）>

| 期 | 設定口数（口） | 解約口数（口） | 残存口数（口） |
|---------|----------------|---------------|----------------|
| 第1特定期間 | 14,648,905,402 | 484,696,773 | 14,164,208,629 |
| 第2特定期間 | 6,366,724,550 | 6,127,131,476 | 14,403,801,703 |
| 第3特定期間 | 2,228,832,466 | 6,078,934,039 | 10,553,700,130 |
| 第4特定期間 | 2,395,462,288 | 2,569,046,412 | 10,380,116,006 |
| 第5特定期間 | 1,429,344,412 | 1,674,852,048 | 10,134,608,370 |
| 第6特定期間 | 204,169,836 | 2,324,538,631 | 8,014,239,575 |
| 第7特定期間 | 205,642,581 | 2,603,883,391 | 5,615,998,765 |
| 第8特定期間 | 1,783,788,956 | 1,351,528,799 | 6,048,258,922 |
| 第9特定期間 | 1,279,805,522 | 764,156,202 | 6,563,908,242 |
| 第10特定期間 | 151,558,374 | 1,037,228,122 | 5,678,238,494 |
| 第11特定期間 | 25,591,540 | 775,471,893 | 4,928,358,141 |

（注1）第1特定期間の設定口数には、当初申込期間中の設定口数を含みます。

（注2）設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

< J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）>

| 期 | 設定口数（口） | 解約口数（口） | 残存口数（口） |
|---------|-------------|-------------|---------------|
| 第1特定期間 | 261,691,836 | 1,500,000 | 260,191,836 |
| 第2特定期間 | 92,721,236 | 119,178,237 | 233,734,835 |
| 第3特定期間 | 27,864,903 | 70,323,335 | 191,276,403 |
| 第4特定期間 | 2,603,344 | 58,585,623 | 135,294,124 |
| 第5特定期間 | 905,897 | 28,913,681 | 107,286,340 |
| 第6特定期間 | 950,220 | 33,831,074 | 74,405,486 |
| 第7特定期間 | 52,806,265 | 15,133,785 | 112,077,966 |
| 第8特定期間 | 874,789,625 | 42,604,114 | 944,263,477 |
| 第9特定期間 | 287,402,891 | 163,743,900 | 1,067,922,468 |
| 第10特定期間 | 45,797,555 | 279,306,994 | 834,413,029 |
| 第11特定期間 | 39,603,406 | 268,248,546 | 605,767,889 |

（注1）第1特定期間の設定口数には、当初申込期間中の設定口数を含みます。

（注2）設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

< J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年2回決算型） >

| 期 | 設定口数（口） | 解約口数（口） | 残存口数（口） |
|-----|----------------|---------------|----------------|
| 1期 | 21,062,691,555 | 621,270,207 | 20,441,421,348 |
| 2期 | 4,332,658,966 | 9,672,859,116 | 15,101,221,198 |
| 3期 | 1,125,185,325 | 7,998,362,110 | 8,228,044,413 |
| 4期 | 2,292,697,093 | 3,399,130,091 | 7,121,611,415 |
| 5期 | 458,057,996 | 1,964,518,963 | 5,615,150,448 |
| 6期 | 152,211,093 | 1,242,932,592 | 4,524,428,949 |
| 7期 | 78,270,241 | 850,078,306 | 3,752,620,884 |
| 8期 | 668,836,469 | 1,156,767,644 | 3,264,689,709 |
| 9期 | 329,909,413 | 769,765,987 | 2,824,833,135 |
| 10期 | 141,105,632 | 646,173,202 | 2,319,765,565 |
| 11期 | 44,075,463 | 272,746,334 | 2,091,094,694 |

（注1）第1期の設定口数には、当初申込期間中の設定口数を含みます。

（注2）設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

< J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型） >

| 期 | 設定口数（口） | 解約口数（口） | 残存口数（口） |
|-----|-------------|-------------|-------------|
| 1期 | 283,087,701 | 3,200,000 | 279,887,701 |
| 2期 | 85,230,311 | 159,716,154 | 205,401,858 |
| 3期 | 33,557,667 | 96,154,840 | 142,804,685 |
| 4期 | 37,511,341 | 45,377,321 | 134,938,705 |
| 5期 | 9,742,807 | 34,960,093 | 109,721,419 |
| 6期 | 1,602,675 | 12,587,876 | 98,736,218 |
| 7期 | 59,581,859 | 30,210,856 | 128,107,221 |
| 8期 | 405,402,690 | 50,647,362 | 482,862,549 |
| 9期 | 101,555,386 | 108,149,296 | 476,268,639 |
| 10期 | 24,809,086 | 184,515,172 | 316,562,553 |
| 11期 | 4,964,002 | 91,558,663 | 229,967,892 |

（注1）第1期の設定口数には、当初申込期間中の設定口数を含みます。

（注2）設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

<参考情報>

最新の運用実績は、委託会社ホームページ（<http://www.jpmorganasset.co.jp/>）、または販売会社でご確認いただけます。

過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）

| | | | |
|-------|------------|------|------------|
| 基準日 | 2018年9月28日 | 設定日 | 2013年4月11日 |
| 純資産総額 | 50億円 | 決算回数 | 年4回 |

基準価額・純資産の推移



分配の推移

| 期 | 年月 | 円 |
|-----|----------|-------|
| 18期 | 2017年8月 | 0 |
| 19期 | 2017年11月 | 600 |
| 20期 | 2018年2月 | 100 |
| 21期 | 2018年5月 | 50 |
| 22期 | 2018年8月 | 500 |
| | 設定来累計 | 6,800 |

* 分配金は税引前1万口当たりの金額です。

* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。

* 分配金再投資基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

国別構成状況

| 投資国 1 | 投資比率 2 |
|-------|--------|
| アメリカ | 99.1% |

通貨別構成状況

| 通貨 | 投資比率 2 |
|-----|--------|
| 米ドル | 99.1% |

業種別構成状況

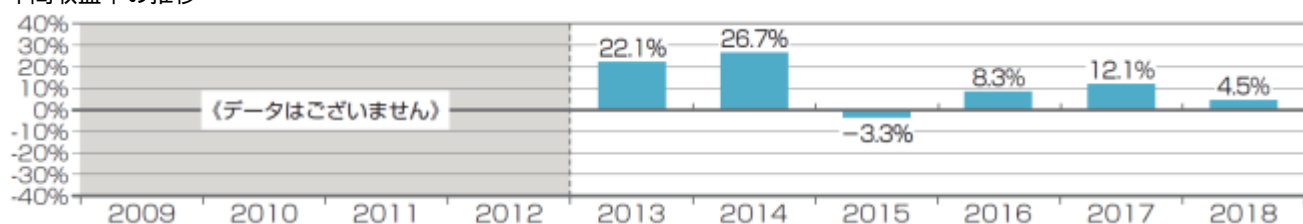
| 業種 | 投資比率 2 |
|------------------------|--------|
| 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 10.3% |
| 銀行 | 9.5% |
| エネルギー | 9.4% |
| 資本財 | 8.1% |
| 保険 | 8.0% |
| その他 | 51.0% |

* 上記比率にファンドで保有する投資信託証券は含んでいません。

組入上位銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 投資国 ^{*1} | 通貨 | 業種 | 投資比率 ^{*2} |
|----|------------------------|-------------------|-----|------------------------|--------------------|
| 1 | マイクロソフト | アメリカ | 米ドル | ソフトウェア・サービス | 3.2% |
| 2 | シェブロン | アメリカ | 米ドル | エネルギー | 3.1% |
| 3 | バンク・オブ・アメリカ | アメリカ | 米ドル | 銀行 | 3.0% |
| 4 | アップル | アメリカ | 米ドル | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2.6% |
| 5 | メルク | アメリカ | 米ドル | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.6% |
| 6 | コノコフィリップス | アメリカ | 米ドル | エネルギー | 2.5% |
| 7 | CMEグループ | アメリカ | 米ドル | 各種金融 | 2.3% |
| 8 | オキシデンタル・ペトロリアム | アメリカ | 米ドル | エネルギー | 2.2% |
| 9 | ジョンソン・エンド・ジョンソン | アメリカ | 米ドル | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.1% |
| 10 | PNCファイナンシャル・サービスズ・グループ | アメリカ | 米ドル | 銀行 | 2.1% |

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

* 2013年の年間収益率は設定日から年末営業日、2018年の年間収益率は前年末営業日から2018年9月28日までのものです。

* ベンチマークは設定していません。

* 投資信託証券とは、投資信託もしくは外国投資信託の受益証券、投資証券、または外国投資証券の総称です。

* 当ページにおける「ファンド」は、J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）です。

運用実績において、金額は表示単位以下を切捨て、投資比率および収益率は表示単位以下を四捨五入して記載しています。

- 「投資国」は、「第1ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 (イ) ファンドの目的」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。
- ファンドはマザーファンドを通じて投資を行うため、マザーファンドの投資銘柄をファンドが直接保有しているものとみなし、ファンドの純資産総額に対する投資比率として計算しています。

<参考情報>

最新の運用実績は、委託会社ホームページ（<http://www.jpmorganasset.co.jp/>）、または販売会社でご確認いただけます。

過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）

| | | | |
|-------|------------|------|------------|
| 基準日 | 2018年9月28日 | 設定日 | 2013年4月11日 |
| 純資産総額 | 591百万円 | 決算回数 | 年4回 |

基準価額・純資産の推移



分配の推移

| 期 | 年月 | 円 |
|-----|----------|-------|
| 18期 | 2017年8月 | 0 |
| 19期 | 2017年11月 | 500 |
| 20期 | 2018年2月 | 500 |
| 21期 | 2018年5月 | 0 |
| 22期 | 2018年8月 | 150 |
| | 設定来累計 | 5,050 |

* 分配金は税引前1万口当たりの金額です。

* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。

* 分配金再投資基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

国別構成状況

| 投資国 1 | 投資比率 2 |
|-------|--------|
| アメリカ | 101.2% |

通貨別構成状況

| 通貨 | 投資比率 2 |
|-----|--------|
| 米ドル | 101.2% |

* ファンドにおいて、為替ヘッジを行っています。

業種別構成状況

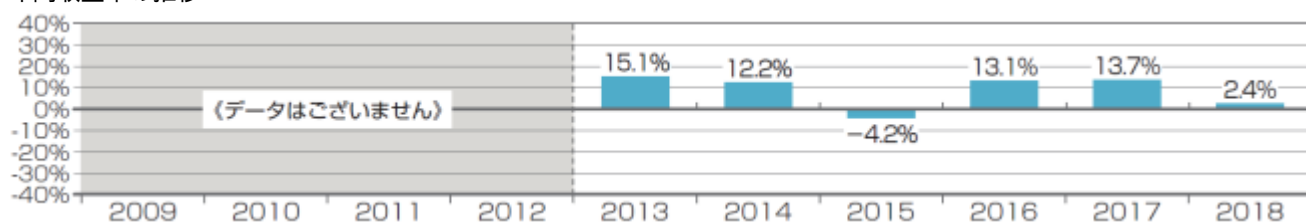
| 業種 | 投資比率 2 |
|------------------------|--------|
| 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 10.5% |
| 銀行 | 9.7% |
| エネルギー | 9.6% |
| 資本財 | 8.2% |
| 保険 | 8.1% |
| その他 | 52.2% |

* 上記比率にファンドで保有する投資信託証券は含んでいません。

組入上位銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 投資国 ^{#1} | 通貨 | 業種 | 投資比率 ^{#2} |
|----|------------------------|-------------------|-----|------------------------|--------------------|
| 1 | マイクロソフト | アメリカ | 米ドル | ソフトウェア・サービス | 3.3% |
| 2 | シェブロン | アメリカ | 米ドル | エネルギー | 3.2% |
| 3 | バンク・オブ・アメリカ | アメリカ | 米ドル | 銀行 | 3.1% |
| 4 | アップル | アメリカ | 米ドル | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2.7% |
| 5 | メルク | アメリカ | 米ドル | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.6% |
| 6 | コノコフィリップス | アメリカ | 米ドル | エネルギー | 2.5% |
| 7 | CMEグループ | アメリカ | 米ドル | 各種金融 | 2.4% |
| 8 | オキシデンタル・ペトロリアム | アメリカ | 米ドル | エネルギー | 2.3% |
| 9 | ジョンソン・エンド・ジョンソン | アメリカ | 米ドル | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.1% |
| 10 | PNCファイナンシャル・サービスズ・グループ | アメリカ | 米ドル | 銀行 | 2.1% |

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

* 2013年の年間収益率は設定日から年末営業日、2018年の年間収益率は前年末営業日から2018年9月28日までのものです。

* ベンチマークは設定していません。

* 投資信託証券とは、投資信託もしくは外国投資信託の受益証券、投資証券、または外国投資証券の総称です。

* 当ページにおける「ファンド」は、J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）です。

運用実績において、金額は表示単位以下を切捨て、投資比率および収益率は表示単位以下を四捨五入して記載しています。

- 「投資国」は、「第1ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 (イ) ファンドの目的」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。
- ファンドはマザーファンドを通じて投資を行うため、マザーファンドの投資銘柄をファンドが直接保有しているものとみなし、ファンドの純資産総額に対する投資比率として計算しています。

<参考情報>

最新の運用実績は、委託会社ホームページ（<http://www.jpmorganasset.co.jp/>）、または販売会社でご確認いただけます。

過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

JPM北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年2回決算型）

| | | | |
|-------|------------|------|------------|
| 基準日 | 2018年9月28日 | 設定日 | 2013年4月11日 |
| 純資産総額 | 40億円 | 決算回数 | 年2回 |

基準価額・純資産の推移



分配の推移

| 期 | 年月 | 円 |
|-----|---------|---|
| 7期 | 2016年8月 | 0 |
| 8期 | 2017年2月 | 0 |
| 9期 | 2017年8月 | 0 |
| 10期 | 2018年2月 | 0 |
| 11期 | 2018年8月 | 0 |
| | 設定来累計 | 0 |

*分配金は税引前1万口当たりの金額です。

*基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

国別構成状況

| 投資国 1 | 投資比率 2 |
|-------|--------|
| アメリカ | 99.1% |

通貨別構成状況

| 通貨 | 投資比率 2 |
|-----|--------|
| 米ドル | 99.1% |

業種別構成状況

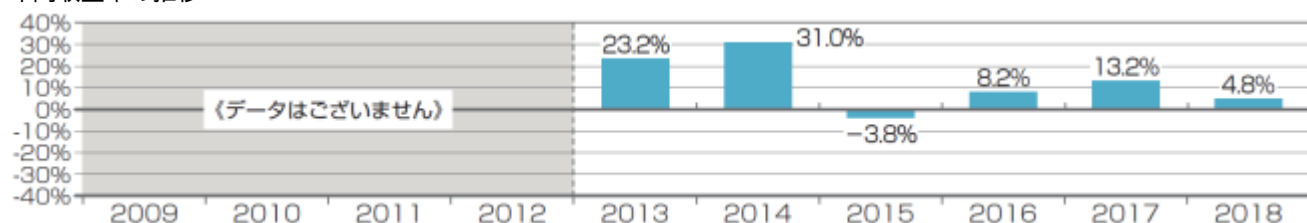
| 業種 | 投資比率 2 |
|------------------------|--------|
| 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 10.3% |
| 銀行 | 9.5% |
| エネルギー | 9.4% |
| 資本財 | 8.1% |
| 保険 | 8.0% |
| その他 | 51.0% |

*上記比率にファンドで保有する投資信託証券は含んでいません。

組入上位銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 投資国*1 | 通貨 | 業種 | 投資比率*2 |
|----|-----------------------|-------|-----|------------------------|--------|
| 1 | マイクロソフト | アメリカ | 米ドル | ソフトウェア・サービス | 3.2% |
| 2 | シェブロン | アメリカ | 米ドル | エネルギー | 3.1% |
| 3 | バンク・オブ・アメリカ | アメリカ | 米ドル | 銀行 | 3.0% |
| 4 | アップル | アメリカ | 米ドル | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2.6% |
| 5 | メルク | アメリカ | 米ドル | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.6% |
| 6 | コノコフィリップス | アメリカ | 米ドル | エネルギー | 2.5% |
| 7 | CMEグループ | アメリカ | 米ドル | 各種金融 | 2.3% |
| 8 | オキシデンタル・ペトロリアム | アメリカ | 米ドル | エネルギー | 2.2% |
| 9 | ジョンソン・エンド・ジョンソン | アメリカ | 米ドル | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.1% |
| 10 | PNCファイナンシャル・サービス・グループ | アメリカ | 米ドル | 銀行 | 2.1% |

年間収益率の推移



*年間収益率(%) = (年末営業日の基準価額 ÷ 前年末営業日の基準価額 - 1) × 100

*2013年の年間収益率は設定日から年末営業日、2018年の年間収益率は前年末営業日から2018年9月28日までのものです。

*ベンチマークは設定していません。

*投資信託証券とは、投資信託もしくは外国投資信託の受益証券、投資証券、または外国投資証券の総称です。

*当ページにおける「ファンド」は、JPM北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年2回決算型）です。

運用実績において、金額は表示単位以下を切捨て、投資比率および収益率は表示単位以下を四捨五入して記載しています。

- 「投資国」は、「第1ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 (イ) ファンドの目的」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。
- ファンドはマザーファンドを通じて投資を行うため、マザーファンドの投資銘柄をファンドが直接保有しているものとみなし、ファンドの純資産総額に対する投資比率として計算しています。

<参考情報>

最新の運用実績は、委託会社ホームページ（<http://www.jpmorganasset.co.jp/>）、または販売会社でご確認いただけます。

過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

JPM北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型）

| | | | |
|-------|------------|------|------------|
| 基準日 | 2018年9月28日 | 設定日 | 2013年4月11日 |
| 純資産総額 | 366百万円 | 決算回数 | 年2回 |

基準価額・純資産の推移



分配の推移

| 期 | 年月 | 円 |
|-----|---------|---|
| 7期 | 2016年8月 | 0 |
| 8期 | 2017年2月 | 0 |
| 9期 | 2017年8月 | 0 |
| 10期 | 2018年2月 | 0 |
| 11期 | 2018年8月 | 0 |
| | 設定来累計 | 0 |

* 分配金は税引前1万口当たりの金額です。

* 基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

国別構成状況

| 投資国 1 | 投資比率 2 |
|-------|--------|
| アメリカ | 101.2% |

通貨別構成状況

| 通貨 | 投資比率 2 |
|-----|--------|
| 米ドル | 101.2% |

* ファンドにおいて、為替ヘッジを行っています。

業種別構成状況

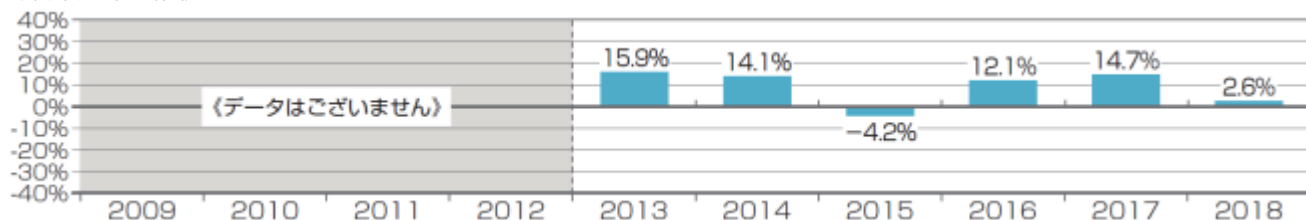
| 業種 | 投資比率 2 |
|------------------------|--------|
| 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 10.5% |
| 銀行 | 9.7% |
| エネルギー | 9.6% |
| 資本財 | 8.2% |
| 保険 | 8.1% |
| その他 | 52.2% |

* 上記比率にファンドで保有する投資信託証券は含んでいません。

組入上位銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 投資国 ¹ | 通貨 | 業種 | 投資比率 ² |
|----|------------------------|------------------|-----|------------------------|-------------------|
| 1 | マイクロソフト | アメリカ | 米ドル | ソフトウェア・サービス | 3.3% |
| 2 | シェブロン | アメリカ | 米ドル | エネルギー | 3.2% |
| 3 | バンク・オブ・アメリカ | アメリカ | 米ドル | 銀行 | 3.1% |
| 4 | アップル | アメリカ | 米ドル | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2.7% |
| 5 | メルク | アメリカ | 米ドル | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.6% |
| 6 | コノコフィリップス | アメリカ | 米ドル | エネルギー | 2.5% |
| 7 | CMEグループ | アメリカ | 米ドル | 各種金融 | 2.4% |
| 8 | オキシデンタル・ペトロリアム | アメリカ | 米ドル | エネルギー | 2.3% |
| 9 | ジョンソン・エンド・ジョンソン | アメリカ | 米ドル | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.1% |
| 10 | PNCファイナンシャル・サービスズ・グループ | アメリカ | 米ドル | 銀行 | 2.1% |

年間収益率の推移



* 年間収益率(%) = (年末営業日の基準価額 ÷ 前年末営業日の基準価額 - 1) × 100

* 2013年の年間収益率は設定日から年末営業日、2018年の年間収益率は前年末営業日から2018年9月28日までのものです。

* ベンチマークは設定していません。

* 投資信託証券とは、投資信託もしくは外国投資信託の受益証券、投資証券、または外国投資証券の総称です。

* 当ページにおける「ファンド」は、「JPM北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型）」です。

運用実績において、金額は表示単位以下を切捨て、投資比率および収益率は表示単位以下を四捨五入して記載しています。

- 「投資国」は、「第1ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 (イ) ファンドの目的」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。
- ファンドはマザーファンドを通じて投資を行うため、マザーファンドの投資銘柄をファンドが直接保有しているものとみなし、ファンドの純資産総額に対する投資比率として計算しています。

第 2 【管理及び運営】

3 【資産管理等の概要】

(3) 信託期間

< 訂正前 >

平成25年 4 月11日から平成35年 4 月10日（休業日の場合は翌営業日）までです。

（以下略）

< 訂正後 >

2013年 4 月11日から2023年 4 月10日（休業日の場合は翌営業日）までです。

（以下略）

第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

JPM北米高配当・成長株ファンド(為替ヘッジなし、3ヵ月決算型)

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11特定期間(平成30年2月27日から平成30年8月27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北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| | 前期 (平成30年2月26日現在) | 当期 (平成30年8月27日現在) |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 5,826,116,077 | 5,356,166,001 |
| 未収入金 | 43,889,206 | 2,357,181 |
| 流動資産合計 | 5,870,005,283 | 5,358,523,182 |
| 資産合計 | 5,870,005,283 | 5,358,523,182 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 56,782,384 | 246,417,907 |
| 未払解約金 | 43,889,206 | 2,357,181 |
| 未払受託者報酬 | 838,338 | 723,954 |
| 未払委託者報酬 | 25,150,051 | 21,718,643 |
| その他未払費用 | 378,618 | 321,128 |
| 流動負債合計 | 127,038,597 | 271,538,813 |
| 負債合計 | 127,038,597 | 271,538,813 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 5,678,238,494 | 1 4,928,358,141 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 64,728,192 | 158,626,228 |
| （分配準備積立金） | 8,502,152 | 109,554,529 |
| 元本等合計 | 5,742,966,686 | 5,086,984,369 |
| 純資産合計 | 5,742,966,686 | 5,086,984,369 |
| 負債純資産合計 | 5,870,005,283 | 5,358,523,182 |

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

| | 前期 (自 平成29年 8月29日 至 平成30年 2月26日) | 当期 (自 平成30年 2月27日 至 平成30年 8月27日) |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 674,348,902 | 430,521,505 |
| 営業収益合計 | 674,348,902 | 430,521,505 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 1,742,661 | 1,460,759 |
| 委託者報酬 | 1 52,279,739 | 1 43,822,719 |
| その他費用 | 783,630 | 658,616 |
| 営業費用合計 | 54,806,030 | 45,942,094 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 619,542,872 | 384,579,411 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 619,542,872 | 384,579,411 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 619,542,872 | 384,579,411 |
| 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（ ） | 63,143,410 | 7,504,743 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 76,923,939 | 64,728,192 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 15,896,894 | 519,574 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 5,869,615 | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 10,027,279 | 519,574 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 8,475,567 | 10,392,211 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 8,475,567 | 10,392,211 |
| 分配金 | 2 422,168,658 | 2 273,303,995 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 64,728,192 | 158,626,228 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 当財務諸表対象期間 |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準および評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 特定期間末日の取扱い 平成30年8月26日が休日のため、信託約款第34条により、第11特定期間末日を平成30年8月27日としております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 前期 (平成30年2月26日現在) | 当期 (平成30年8月27日現在) |
|------------------|----------------------|----------------------|
| 1 期首元本額 | 6,563,908,242円 | 5,678,238,494円 |
| 期中追加設定元本額 | 151,558,374円 | 25,591,540円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,037,228,122円 | 775,471,893円 |
| 受益権の総数 | 5,678,238,494口 | 4,928,358,141口 |
| 1 口当たりの純資産額 | 1.0114円 | 1.0322円 |
| (1 万口当たりの純資産額) | (10,114円) | (10,322円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区分 | 前期 (自 平成29年 8 月29日 至 平成30年 2 月26日) | 当期 (自 平成30年 2 月27日 至 平成30年 8 月27日) |
|--|--|--|
| 1 信託財産の運用の指図に関する権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 | 純資産総額に年率0.5%を乗じて得た額 | 同左 |
| 2 分配金の計算過程 | (自 平成29年 8 月29日 至 平成29年11月27日) | (自 平成30年 2 月27日 至 平成30年 5 月28日) |
| 費用控除後の配当等収益額 | 35,480,184円 | 20,404,735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 | 353,656,256円 | 24,743,811円 |
| 収益調整金額 | 53,516,368円 | 53,178,529円 |
| 分配準備積立金額 | 17,630,323円 | 8,029,972円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 460,283,131円 | 106,357,047円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | 6,089,771,247口 | 5,377,217,717口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 755.82円 | 197.79円 |
| 1万口当たり分配金額 | 600.00円 | 50.00円 |
| 収益分配金金額 | 365,386,274円 | 26,886,088円 |
| | (自 平成29年11月28日 至 平成30年 2 月26日) | (自 平成30年 5 月29日 至 平成30年 8 月27日) |
| 費用控除後の配当等収益額 | 18,373,797円 | 56,483,544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 | 9,076,056円 | 275,442,578円 |
| 収益調整金額 | 56,226,040円 | 49,071,699円 |
| 分配準備積立金額 | 37,834,683円 | 24,046,314円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 121,510,576円 | 405,044,135円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | 5,678,238,494口 | 4,928,358,141口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 213.99円 | 821.86円 |
| 1万口当たり分配金額 | 100.00円 | 500.00円 |
| 収益分配金金額 | 56,782,384円 | 246,417,907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、以下に記載される親投資信託受益証券であります。 G I M北米高配当株式マザーファンド（適格機関投資家専用） 親投資信託の受益証券を主要投資対象として運用を行うため、親投資信託受益証券と同様のリスクを伴います。親投資信託受益証券には、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。当該リスクは結果的に当ファンドに影響を及ぼします。 |
| 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ぬ。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2)有価証券以外の金融商品 有価証券以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 前期 (平成30年2月26日現在) | 当期 (平成30年8月27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 | 57,266,802 | 355,606,145 |
| 合計 | 57,266,802 | 355,606,145 |

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表（平成30年 8月27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北米高配当株式マザーファンド（適 格機関投資家専用） | 2,207,362,869 | 5,356,166,001 | |
| 合計 | | | 2,207,362,869 | 5,356,166,001 | |

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。

J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）

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11特定期間（平成30年2月27日から平成30年8月27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。

【 J P M 北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3 ヶ月決算型）】

（ 1 ） 【 貸借対照表】

（ 単位：円 ）

| | 前期 (平成30年2月26日現在) | 当期 (平成30年8月27日現在) |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 870,479,094 | 630,290,462 |
| 派生商品評価勘定 | 24,863,460 | 2,201,067 |
| 未収入金 | 9,791,514 | 410 |
| 流動資産合計 | 905,134,068 | 632,491,939 |
| 資産合計 | 905,134,068 | 632,491,939 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 1,984,689 | 216,141 |
| 未払収益分配金 | 41,720,651 | 9,086,518 |
| 未払解約金 | 9,791,514 | 410 |
| 未払受託者報酬 | 128,926 | 90,701 |
| 未払委託者報酬 | 3,867,753 | 2,721,029 |
| その他未払費用 | 51,541 | 36,250 |
| 流動負債合計 | 57,545,074 | 12,151,049 |
| 負債合計 | 57,545,074 | 12,151,049 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,834,413,029 | 1,605,767,889 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 13,175,965 | 14,573,001 |
| （ 分配準備積立金 ） | 3,229,036 | 6,790,156 |
| 元本等合計 | 847,588,994 | 620,340,890 |
| 純資産合計 | 847,588,994 | 620,340,890 |
| 負債純資産合計 | 905,134,068 | 632,491,939 |

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

| | 前期 (自 平成29年 8月29日 至 平成30年 2月26日) | 当期 (自 平成30年 2月27日 至 平成30年 8月27日) |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 113,814,263 | 55,224,285 |
| 為替差損益 | 3,943,925 | 37,631,239 |
| 営業収益合計 | 117,758,188 | 17,593,046 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 274,160 | 195,094 |
| 委託者報酬 | 1 8,224,664 | 1 5,852,778 |
| その他費用 | 109,604 | 88,777 |
| 営業費用合計 | 8,608,428 | 6,136,649 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 109,149,760 | 11,456,397 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 109,149,760 | 11,456,397 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 109,149,760 | 11,456,397 |
| 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（ ） | 11,025,881 | 1,130,772 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 8,746,310 | 13,175,965 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 3,001,410 | 1,845,141 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 804,491 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 3,001,410 | 1,040,650 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 4,948,978 | 1,687,212 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 4,948,978 | 1,638,562 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 48,650 |
| 分配金 | 2 91,746,656 | 2 9,086,518 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 13,175,965 | 14,573,001 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 当財務諸表対象期間 |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準および評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準および評価方法 | 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 為替予約の評価は、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 特定期間末日の取扱い 平成30年8月26日が休日のため、信託約款第34条により、第11特定期間末日を平成30年8月27日としております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 前期 (平成30年2月26日現在) | 当期 (平成30年8月27日現在) |
|---------------|----------------------|----------------------|
| 1期首元本額 | 1,067,922,468円 | 834,413,029円 |
| 期中追加設定元本額 | 45,797,555円 | 39,603,406円 |
| 期中一部解約元本額 | 279,306,994円 | 268,248,546円 |
| 受益権の総数 | 834,413,029口 | 605,767,889口 |
| 1口当たりの純資産額 | 1.0158円 | 1.0241円 |
| (1万口当たりの純資産額) | (10,158円) | (10,241円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区分 | 前期 (自 平成29年 8 月29日 至 平成30年 2 月26日) | 当期 (自 平成30年 2 月27日 至 平成30年 8 月27日) |
|--|--|--|
| 1 信託財産の運用の指図に関する権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 | 純資産総額に年率 0.5075%を乗じて得た額 | 同左 |
| 2 分配金の計算過程 | (自 平成29年 8 月29日 至 平成29年11月27日) | (自 平成30年 2 月27日 至 平成30年 5 月28日) |
| 費用控除後の配当等収益額 | 5,787,637円 | 952,022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 | 51,475,535円 | - 円 |
| 収益調整金額 | 9,489,976円 | 1,268,417円 |
| 分配準備積立金額 | 3,539,969円 | 2,827,146円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 70,293,117円 | 5,047,585円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | 1,000,520,117口 | 736,481,816口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 702.56円 | 68.53円 |
| 1万口当たり分配金額 | 500.00円 | - 円 |
| 収益分配金金額 | 50,026,005円 | - 円 |
| | (自 平成29年11月28日 至 平成30年 2 月26日) | (自 平成30年 5 月29日 至 平成30年 8 月27日) |
| 費用控除後の配当等収益額 | 4,782,621円 | 6,265,904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 | 31,554,765円 | 6,670,073円 |
| 収益調整金額 | 9,946,929円 | 7,782,845円 |
| 分配準備積立金額 | 8,612,301円 | 2,940,697円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 54,896,616円 | 23,659,519円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | 834,413,029口 | 605,767,889口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 657.90円 | 390.57円 |
| 1万口当たり分配金額 | 500.00円 | 150.00円 |
| 収益分配金金額 | 41,720,651円 | 9,086,518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 | <p>当ファンドが保有した主な金融商品は、以下に記載される親投資信託受益証券およびデリバティブ取引であります。</p> <p>G I M北米高配当株式マザーファンド（適格機関投資家専用）</p> <p>親投資信託の受益証券を主要投資対象として運用を行うため、親投資信託受益証券と同様のリスクを伴います。親投資信託受益証券には、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。当該リスクは結果的に当ファンドに影響を及ぼします。</p> <p>なお、デリバティブ取引は、通貨関連では信託財産の効率的な運用に資する目的ならびに外貨建資産の為替変動リスクの回避を目的として利用しております。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>当ファンドは運用を外部委託しておりますが、投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。</p> <p>(1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターおよび外部委託先において運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果（パフォーマンス）のモニターを行います。さらに外部委託先のインベストメント・ダイレクターは、リスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。</p> <p>(2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っております。</p> <p>(3)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。</p> |

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 前期 (平成30年 2月26日現在) | 当期 (平成30年 8月27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 | 6,417,167 | 39,948,817 |
| 合計 | 6,417,167 | 39,948,817 |

（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 | 前期(平成30年 2月26日現在) | | | | 当期(平成30年 8月27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 | 105,299,392 | - | 103,398,461 | 1,900,931 | 41,308,011 | - | 41,397,845 | 89,834 |
| | 売建 | | | | | | | | |
| | アメリカドル | 1,001,845,149 | - | 977,065,447 | 24,779,702 | 677,535,111 | - | 675,640,019 | 1,895,092 |
| 合計 | | 1,107,144,541 | - | 1,080,463,908 | 22,878,771 | 718,843,122 | - | 717,037,864 | 1,984,926 |

（注）1．為替予約の時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表（平成30年8月27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北米高配当株式マザーファンド（適 格機関投資家専用） | 259,752,921 | 630,290,462 | |
| 合計 | | | 259,752,921 | 630,290,462 | |

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。

J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年2回決算型）

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

3. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期計算期間（平成30年2月27日から平成30年8月27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。

【JPM北米高配当・成長株ファンド(為替ヘッジなし、年2回決算型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

| | 第10期 (平成30年2月26日現在) | 第11期 (平成30年8月27日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 4,220,958,014 | 4,089,477,468 |
| 未収入金 | 11,903,144 | 3,986,502 |
| 流動資産合計 | 4,232,861,158 | 4,093,463,970 |
| 資産合計 | 4,232,861,158 | 4,093,463,970 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 11,903,144 | 3,986,502 |
| 未払受託者報酬 | 1,227,211 | 1,097,224 |
| 未払委託者報酬 | 36,816,333 | 32,916,641 |
| その他未払費用 | 577,455 | 480,237 |
| 流動負債合計 | 50,524,143 | 38,480,604 |
| 負債合計 | 50,524,143 | 38,480,604 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,231,765,565 | 1,209,094,694 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 1,862,571,450 | 1,963,888,672 |
| (分配準備積立金) | 1,022,220,062 | 1,187,746,008 |
| 元本等合計 | 4,182,337,015 | 4,054,983,366 |
| 純資産合計 | 4,182,337,015 | 4,054,983,366 |
| 負債純資産合計 | 4,232,861,158 | 4,093,463,970 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第10期 (自 平成29年 8 月29日 至 平成30年 2 月26日) | 第11期 (自 平成30年 2 月27日 至 平成30年 8 月27日) |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 482,344,251 | 331,690,528 |
| 営業収益合計 | 482,344,251 | 331,690,528 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 1,227,211 | 1,097,224 |
| 委託者報酬 | 1 36,816,333 | 1 32,916,641 |
| その他費用 | 577,455 | 480,237 |
| 営業費用合計 | 38,620,999 | 34,494,102 |
| 営業利益又は営業損失() | 443,723,252 | 297,196,426 |
| 経常利益又は経常損失() | 443,723,252 | 297,196,426 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 443,723,252 | 297,196,426 |
| 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() | 111,736,613 | 12,904,969 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 1,827,964,869 | 1,862,571,450 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 122,489,190 | 35,956,731 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 122,489,190 | 35,956,731 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 419,869,248 | 218,930,966 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 419,869,248 | 218,930,966 |
| 分配金 | 2 - | 2 - |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 1,862,571,450 | 1,963,888,672 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 当財務諸表対象期間 |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準および評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日の取扱い 平成30年8月26日が休日のため、信託約款第34条により、第11期計算期間末日を平成30年8月27日としております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 第10期 (平成30年2月26日現在) | 第11期 (平成30年8月27日現在) |
|-----------------------------|------------------------|------------------------|
| 1 期首元本額 | 2,824,833,135円 | 2,319,765,565円 |
| 期中追加設定元本額 | 141,105,632円 | 44,075,463円 |
| 期中一部解約元本額 | 646,173,202円 | 272,746,334円 |
| 受益権の総数 | 2,319,765,565口 | 2,091,094,694口 |
| 1口当たりの純資産額 (1万口当たりの純資産額) | 1.8029円 (18,029円) | 1.9392円 (19,392円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区分 | 第10期 (自平成29年8月29日 至平成30年2月26日) | 第11期 (自平成30年2月27日 至平成30年8月27日) |
|--|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 1 信託財産の運用の指図に関する権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 | 純資産総額に年率0.5%を乗じて得た額 | 同左 |
| 2 分配金の計算過程 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | 44,712,844円 | 59,729,987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 | 200,512,974円 | 224,561,470円 |
| 収益調整金額 | 840,351,388円 | 776,142,664円 |
| 分配準備積立金額 | 776,994,244円 | 903,454,551円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 1,862,571,450円 | 1,963,888,672円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | 2,319,765,565口 | 2,091,094,694口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 8,029.13円 | 9,391.67円 |
| 1万口当たり分配金額 | - 円 | - 円 |
| 収益分配金金額 | - 円 | - 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、以下に記載される親投資信託受益証券であります。 G I M北米高配当株式マザーファンド（適格機関投資家専用） 親投資信託の受益証券を主要投資対象として運用を行うため、親投資信託受益証券と同様のリスクを伴います。親投資信託受益証券には、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。当該リスクは結果的に当ファンドに影響を及ぼします。 |
| 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

| | 各計算期間末 |
|----------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額 | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。 |
| 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 | 第10期 (平成30年2月26日現在) | 第11期 (平成30年8月27日現在) |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
| | 当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円） | 当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 372,948,548 | 324,369,405 |
| 合計 | 372,948,548 | 324,369,405 |

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表（平成30年８月27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北米高配当株式マザーファンド（適 格機関投資家専用） | 1,685,339,983 | 4,089,477,468 | |
| 合計 | | | 1,685,339,983 | 4,089,477,468 | |

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。

J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年２回決算型）

１．当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第２条の２の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

２．当ファンドの計算期間は６ヵ月であるため、財務諸表は６ヵ月毎に作成しております。

３．当ファンドは、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第11期計算期間（平成30年２月27日から平成30年８月27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。

【JPM北米高配当・成長株ファンド(米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

| | 第10期 (平成30年2月26日現在) | 第11期 (平成30年8月27日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 507,164,432 | 384,799,434 |
| 派生商品評価勘定 | 15,043,911 | 1,477,284 |
| 未収入金 | 1,749 | 2,099 |
| 流動資産合計 | 522,210,092 | 386,278,817 |
| 資産合計 | 522,210,092 | 386,278,817 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 1,683,944 | 139,076 |
| 未払解約金 | 1,749 | 2,099 |
| 未払受託者報酬 | 172,634 | 112,790 |
| 未払委託者報酬 | 5,178,842 | 3,383,644 |
| その他未払費用 | 69,000 | 45,052 |
| 流動負債合計 | 7,106,169 | 3,682,661 |
| 負債合計 | 7,106,169 | 3,682,661 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,316,562,553 | 1,229,967,892 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 198,541,370 | 152,628,264 |
| (分配準備積立金) | 71,350,479 | 59,329,191 |
| 元本等合計 | 515,103,923 | 382,596,156 |
| 純資産合計 | 515,103,923 | 382,596,156 |
| 負債純資産合計 | 522,210,092 | 386,278,817 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第10期 (自 平成29年 8月29日 至 平成30年 2月26日) | 第11期 (自 平成30年 2月27日 至 平成30年 8月27日) |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 77,154,319 | 31,616,211 |
| 為替差損益 | 530,981 | 21,295,694 |
| 営業収益合計 | 77,685,300 | 10,320,517 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 172,634 | 112,790 |
| 委託者報酬 | 1 5,178,842 | 1 3,383,644 |
| その他費用 | 69,000 | 55,852 |
| 営業費用合計 | 5,420,476 | 3,552,286 |
| 営業利益又は営業損失() | 72,264,824 | 6,768,231 |
| 経常利益又は経常損失() | 72,264,824 | 6,768,231 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 72,264,824 | 6,768,231 |
| 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() | 24,896,663 | 1,731,039 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 222,168,607 | 198,541,370 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 15,587,984 | 2,991,464 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 15,587,984 | 2,991,464 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 86,583,382 | 57,403,840 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 86,583,382 | 57,403,840 |
| 分配金 | 2 - | 2 - |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 198,541,370 | 152,628,264 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 当財務諸表対象期間 |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準および評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準および評価方法 | 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 為替予約の評価は、原則として、わが国における対顧客先物売買取相場の仲値によって計算しております。 |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日の取扱い 平成30年8月26日が休日のため、信託約款第34条により、第11期計算期間末日を平成30年8月27日としております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 第10期 (平成30年2月26日現在) | 第11期 (平成30年8月27日現在) |
|-----------------------------|------------------------|------------------------|
| 1期首元本額 | 476,268,639円 | 316,562,553円 |
| 期中追加設定元本額 | 24,809,086円 | 4,964,002円 |
| 期中一部解約元本額 | 184,515,172円 | 91,558,663円 |
| 受益権の総数 | 316,562,553口 | 229,967,892口 |
| 1口当たりの純資産額 (1万口当たりの純資産額) | 1.6272円 (16,272円) | 1.6637円 (16,637円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区分 | 第10期 (自平成29年8月29日 至平成30年2月26日) | 第11期 (自平成30年2月27日 至平成30年8月27日) |
|--|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 1 信託財産の運用の指図に関する権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 | 純資産総額に年率 0.5075%を乗じて得た額 | 同左 |
| 2 分配金の計算過程 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | 5,361,705円 | 4,485,610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 | 40,898,430円 | 4,013,660円 |
| 収益調整金額 | 127,190,891円 | 93,299,073円 |
| 分配準備積立金額 | 25,090,344円 | 50,829,921円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 198,541,370円 | 152,628,264円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | 316,562,553口 | 229,967,892口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 6,271.78円 | 6,636.93円 |
| 1万口当たり分配金額 | - 円 | - 円 |
| 収益分配金額 | - 円 | - 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 | <p>当ファンドが保有した主な金融商品は、以下に記載される親投資信託受益証券およびデリバティブ取引であります。</p> <p>G I M北米高配当株式マザーファンド（適格機関投資家専用）</p> <p>親投資信託の受益証券を主要投資対象として運用を行うため、親投資信託受益証券と同様のリスクを伴います。親投資信託受益証券には、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。当該リスクは結果的に当ファンドに影響を及ぼします。</p> <p>なお、デリバティブ取引は、通貨関連では信託財産の効率的な運用に資する目的ならびに外貨建資産の為替変動リスクの回避を目的として利用しております。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>当ファンドは運用を外部委託しておりますが、投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。</p> <p>(1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターおよび外部委託先において運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果（パフォーマンス）のモニターを行います。さらに外部委託先のインベストメント・ダイレクターは、リスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば正を求めます。</p> <p>(2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っています。</p> <p>(3)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。</p> |

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 第10期 (平成30年 2月26日現在) | 第11期 (平成30年 8月27日現在) |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
| | 当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円） | 当計算期間の損益に含まれた 評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 41,555,780 | 30,114,103 |
| 合計 | 41,555,780 | 30,114,103 |

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

| 区分 | 種類 | 第10期(平成30年 2月26日現在) | | | | 第11期(平成30年 8月27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 | 79,077,475 | - | 77,506,181 | 1,571,294 | 35,467,535 | - | 35,558,111 | 90,576 |
| | 売建 | | | | | | | | |
| | アメリカドル | 602,593,656 | - | 587,662,395 | 14,931,261 | 429,769,364 | - | 428,521,732 | 1,247,632 |
| 合計 | | 681,671,131 | - | 665,168,576 | 13,359,967 | 465,236,899 | - | 464,079,843 | 1,338,208 |

（注）1．為替予約の時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表（平成30年8月27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北米高配当株式マザーファンド（適 格機関投資家専用） | 158,582,087 | 384,799,434 | |
| 合計 | | | 158,582,087 | 384,799,434 | |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

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

（参考）

当ファンドは「G I M北米高配当株式マザーファンド（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北米高配当株式マザーファンド（適格機関投資家専用）」の状況

尚、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（１）貸借対照表

（単位：円）

| 区分 | 注記 番号 | (平成30年 2月26日現在) | (平成30年 8月27日現在) |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| | | 金額 | 金額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 131,992,139 | 36,677,068 |
| 金銭信託 | | - | 4,944,906 |
| コール・ローン | | 1,664,122 | - |
| 株式 | | 11,428,629,627 | 10,368,344,896 |
| 投資証券 | | 328,120,191 | 319,256,656 |
| 派生商品評価勘定 | | - | 694,704 |
| 未収入金 | | 209,023,985 | 392,328,228 |
| 未収配当金 | | 21,312,121 | 18,039,043 |
| 流動資産合計 | | 12,120,742,185 | 11,140,285,501 |
| 資産合計 | | 12,120,742,185 | 11,140,285,501 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 151,891 | - |
| 未払金 | | - | 23,006,307 |
| 未払解約金 | | 65,585,613 | 6,346,192 |
| 未払利息 | | 4 | - |
| 流動負債合計 | | 65,737,508 | 29,352,499 |
| 負債合計 | | 65,737,508 | 29,352,499 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 5,386,008,954 | 4,579,000,182 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 6,668,995,723 | 6,531,932,820 |
| 元本等合計 | | 12,055,004,677 | 11,110,933,002 |
| 純資産合計 | | 12,055,004,677 | 11,110,933,002 |
| 負債純資産合計 | | 12,120,742,185 | 11,140,285,501 |

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

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | (平成30年 2月26日現在) | (平成30年 8月27日現在) |
|---|-----------------|-----------------|
| 1期首元本額 | 6,742,061,620円 | 5,386,008,954円 |
| 期中追加設定元本額 | 270,364,497円 | 98,824,556円 |
| 期中解約元本額 | 1,626,417,163円 | 905,833,328円 |
| 元本の内訳(注) | | |
| G I M F O F s用北米高配当株ファン ドF(適格機関投資家専用) | 265,424,806円 | 249,867,933円 |
| J P M北米高配当・成長株ファンド (為替ヘッジなし、3ヵ月決算型) | 2,603,036,403円 | 2,207,362,869円 |
| J P M北米高配当・成長株ファンド (米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算 型) | 388,919,263円 | 259,752,921円 |
| J P M北米高配当・成長株ファンド (為替ヘッジなし、年2回決算型) | 1,885,871,689円 | 1,685,339,983円 |
| J P M北米高配当・成長株ファンド (米ドル対円ヘッジあり、年2回決算 型) | 226,594,778円 | 158,582,087円 |
| J P M北米高配当株プライム | 16,162,015円 | 18,094,389円 |
| 合 計 | 5,386,008,954円 | 4,579,000,182円 |
| 受益権の総数 | 5,386,008,954口 | 4,579,000,182口 |
| 1口当たりの純資産額 | 2.2382円 | 2.4265円 |
| (1万口当たりの純資産額) | (22,382円) | (24,265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、投資証券およびデリバティブ取引であり、当ファンドで利用しているデリバティブ取引は、通貨関連では為替予約取引であります。当ファンドが保有した金融商品およびデリバティブ取引には、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。 なお、デリバティブ取引は、通貨関連では信託財産の効率的な運用に資する目的として利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 当ファンドは運用を外部委託しておりますが、投資対象とする金融商品に係るリスク管理体制は次のとおりです。 (1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターおよび外部委託先において運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、パフォーマンス評価担当部署から報告を受け、運用成果（パフォーマンス）のモニターを行います。さらに外部委託先のインベストメント・ダイレクターは、リスク指標やリスク水準のチェックを行い、必要があれば是正を求めます。 (2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っております。 (3)運用商品部門は外部委託先のリスク管理体制に変更がないか継続的にモニタリングします。運用商品部門の部長はその結果をリスク・コミッティーに報告し、当該報告内容に問題点があった際には、必要に応じてリスク・コミッティーより勧告を受けます。また運用商品部門の部長は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、業務改善指導、委託解消等の対応策を実施します。 |

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | (平成30年 2月26日現在) | (平成30年 8月27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 | 1,204,484,231 | 307,389,219 |
| 投資証券 | 17,857,265 | 32,651,878 |
| 合計 | 1,186,626,966 | 340,041,097 |

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

| 区分 | 種類 | (平成30年 2月26日現在) | | | | (平成30年 8月27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 | 223,000,000 | - | 223,151,891 | 151,891 | 328,000,000 | - | 327,305,296 | 694,704 |
| 合計 | | 223,000,000 | - | 223,151,891 | 151,891 | 328,000,000 | - | 327,305,296 | 694,704 |

（注）1．為替予約の時価の算定方法

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

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

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

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等および時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表（平成30年8月27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 | CHEVRON CORP | 23,750 | 119.01 | 2,826,487.50 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 30,820 | 72.61 | 2,237,840.20 | |
| | EXXON MOBIL CORPORATION | 7,410 | 79.62 | 589,984.20 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 26,380 | 79.34 | 2,092,989.20 | |
| | SCHLUMBERGER LIMITED | 5,700 | 65.25 | 371,925.00 | |
| | VALERO ENERGY CORPORATION | 4,930 | 120.55 | 594,311.50 | |
| | AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC | 9,200 | 165.97 | 1,526,924.00 | |
| | DOWDUPONT INC | 23,103 | 69.21 | 1,598,958.63 | |
| | PPG INDUSTRIES INC | 11,030 | 110.62 | 1,220,138.60 | |
| | RPM INTERNATIONAL INC | 8,080 | 66.81 | 539,824.80 | |
| | 3M CO | 4,640 | 205.29 | 952,545.60 | |
| | DOVER CORPORATION | 17,920 | 84.26 | 1,509,939.20 | |
| | GENERAL DYNAMICS CORP | 8,510 | 192.59 | 1,638,940.90 | |
| | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 4,320 | 157.51 | 680,443.20 | |
| | ILLINOIS TOOL WORKS INC | 10,310 | 135.55 | 1,397,520.50 | |
| | SNAP-ON INC | 1,150 | 176.09 | 202,503.50 | |
| | STANLEY BLACK & DECKER INC | 7,560 | 140.97 | 1,065,733.20 | |
| | REPUBLIC SERVICES INC | 16,380 | 73.22 | 1,199,343.60 | |
| | NORFOLK SOUTHERN CORP | 4,750 | 174.86 | 830,585.00 | |
| | UNION PACIFIC CORP | 2,610 | 150.13 | 391,839.30 | 備考 |
| | HASBRO INC | 6,680 | 100.99 | 674,613.20 | |
| | VF CORP | 3,070 | 91.77 | 281,733.90 | |
| | MCDONALD'S CORPORATION | 9,310 | 159.38 | 1,483,827.80 | |
| | STARBUCKS CORPORATION | 9,870 | 52.75 | 520,642.50 | |
| | WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC | 7,120 | 55.60 | 395,872.00 | |
| | COMCAST CORP-CL A | 41,530 | 36.50 | 1,515,845.00 | |
| | GENUINE PARTS CO | 8,190 | 99.13 | 811,874.70 | |
| | HOME DEPOT INC | 9,520 | 201.30 | 1,916,376.00 | |
| | TARGET CORPORATION | 7,250 | 87.31 | 632,997.50 | |
| | ALTRIA GROUP INC | 22,570 | 58.78 | 1,326,664.60 | |
| | COCA-COLA COMPANY | 16,430 | 45.63 | 749,700.90 | |
| | MOLSON COORS BREWING COMPANY-B | 3,550 | 68.03 | 241,506.50 | |
| | MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 23,920 | 42.39 | 1,013,968.80 | |
| | PEPSICO INC | 6,400 | 112.15 | 717,760.00 | |
| | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 11,870 | 79.69 | 945,920.30 | |
| | THE KRAFT HEINZ COMPANY | 9,530 | 59.03 | 562,555.90 | |
| | ABBOTT LABORATORIES | 10,740 | 66.10 | 709,914.00 | |
| | BECTON DICKINSON AND COMPANY | 4,560 | 255.40 | 1,164,624.00 | |
| | CVS HEALTH CORPORATION | 12,990 | 74.08 | 962,299.20 | |
| | MEDTRONIC PLC | 11,760 | 95.55 | 1,123,668.00 | |
| | BRISTOL-MYERS SQUIBB COMPANY | 18,430 | 59.97 | 1,105,247.10 | |
| | ELI LILLY AND COMPANY | 15,140 | 105.77 | 1,601,357.80 | |
| | GILEAD SCIENCES INC | 10,520 | 73.59 | 774,166.80 | |
| | JOHNSON & JOHNSON | 14,690 | 135.95 | 1,997,105.50 | |
| | MERCK & CO INC | 35,120 | 69.04 | 2,424,684.80 | |

| | | | | | |
|----|--|--------|--------|------------------|--|
| | PFIZER INC | 40,668 | 42.40 | 1,724,323.20 | |
| | BANK OF AMERICA CORP | 98,370 | 30.89 | 3,038,649.30 | |
| | BB&T CORPORATION | 19,450 | 51.71 | 1,005,759.50 | |
| | CULLEN/FROST BANKERS INC | 5,461 | 112.73 | 615,618.53 | |
| | M & T BANK CORP | 2,430 | 176.31 | 428,433.30 | |
| | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC | 14,730 | 142.93 | 2,105,358.90 | |
| | US BANCORP | 19,590 | 54.01 | 1,058,055.90 | |
| | WELLS FARGO COMPANY | 24,460 | 58.69 | 1,435,557.40 | |
| | BLACKROCK INC | 4,140 | 477.51 | 1,976,891.40 | |
| | CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 8,340 | 99.46 | 829,496.40 | |
| | CME GROUP INC | 12,990 | 169.32 | 2,199,466.80 | |
| | DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 9,740 | 78.27 | 762,349.80 | |
| | NORTHERN TRUST CORPORATION | 7,280 | 107.55 | 782,964.00 | |
| | T ROWE PRICE GROUP INC | 10,440 | 115.41 | 1,204,880.40 | |
| | ARTHUR J GALLAGHER & CO | 8,880 | 72.15 | 640,692.00 | |
| | CHUBB LIMITED | 6,390 | 135.12 | 863,416.80 | |
| | CINCINNATI FINANCIAL CORPORATION | 5,370 | 76.49 | 410,751.30 | |
| | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC | 26,720 | 50.00 | 1,336,000.00 | |
| | METLIFE INC | 23,060 | 46.42 | 1,070,445.20 | |
| | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 11,160 | 98.54 | 1,099,706.40 | |
| | THE PROGRESSIVE CORPORATION | 7,110 | 66.92 | 475,801.20 | |
| | THE TRAVELERS COS INC | 13,440 | 130.51 | 1,754,054.40 | |
| | ACCENTURE PLC-CL A | 3,130 | 165.88 | 519,204.40 | |
| | AUTOMATIC DATA PROCESSING INC | 4,560 | 143.59 | 654,770.40 | |
| | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 9,860 | 108.87 | 1,073,458.20 | |
| | MICROSOFT CORP | 27,040 | 108.40 | 2,931,136.00 | |
| | APPLE INC | 12,400 | 216.16 | 2,680,384.00 | |
| | VERIZON COMMUNICATIONS | 26,500 | 54.78 | 1,451,670.00 | |
| | CMS ENERGY CORP | 15,330 | 49.36 | 756,688.80 | |
| | DTE ENERGY COMPANY | 1,370 | 111.90 | 153,303.00 | |
| | NEXTERA ENERGY INC | 7,110 | 172.70 | 1,227,897.00 | |
| | NISOURCE INC | 19,550 | 27.06 | 529,023.00 | |
| | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP | 9,260 | 52.75 | 488,465.00 | |
| | XCEL ENERGY INC | 18,470 | 47.95 | 885,636.50 | |
| | ANALOG DEVICES INC | 15,600 | 98.78 | 1,540,968.00 | |
| | KLA-TENCOR CORPORATION | 3,030 | 115.44 | 349,783.20 | |
| | TEXAS INSTRUMENTS INC | 18,090 | 113.64 | 2,055,747.60 | |
| 小計 | 銘柄数 : | 82 | | 93,240,511.66 | |
| | | | | (10,368,344,896) | |
| | 組入時価比率 : | 93.3% | | 100.0% | |
| 合計 | | | | 10,368,344,896 | |
| | | | | (10,368,344,896) | |

(注) 各通貨計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

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

(口) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 銘柄数 比率 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|--------|--|-----------|--------|---------------|----|
| 投資証券 | アメリカドル | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC-REIT | | 1,890 | 239,330.70 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC-REIT | | 5,050 | 923,140.00 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC-REIT | | 3,490 | 450,349.60 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT | | 4,680 | 846,705.60 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST-REIT | | 5,360 | 411,487.20 | |
| | 計 | 銘柄数： | 5 | 20,470 | 2,871,013.10 | |
| | | | | | (319,256,656) | |
| | | 組入時価比率： | 2.9% | | 100.0% | |
| | 小計 | | | | 319,256,656 | |
| | | | | | (319,256,656) | |
| | 合計 | | | | 319,256,656 | |
| | | | | | (319,256,656) | |

(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。

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

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】

< J P M北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）>

（平成30年9月28日現在）

| 種類 | 金額 | 単位 |
|----------------|---------------|----|
| 資産総額 | 5,105,163,226 | 円 |
| 負債総額 | 40,007,394 | 円 |
| 純資産総額(-) | 5,065,155,832 | 円 |
| 発行済口数 | 4,776,815,163 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.0604 | 円 |

< J P M北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）>

（平成30年9月28日現在）

| 種類 | 金額 | 単位 |
|------------|-------------|----|
| 資産総額 | 605,061,413 | 円 |
| 負債総額 | 13,595,549 | 円 |
| 純資産総額(-) | 591,465,864 | 円 |

| | | |
|----------------|-------------|---|
| 発行済口数 | 575,466,703 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.0278 | 円 |

< J P M北米高配当・成長株ファンド(為替ヘッジなし、年2回決算型) >

(平成30年9月28日現在)

| 種類 | 金額 | 単位 |
|----------------|---------------|----|
| 資産総額 | 4,086,461,914 | 円 |
| 負債総額 | 26,348,007 | 円 |
| 純資産総額(-) | 4,060,113,907 | 円 |
| 発行済口数 | 2,038,099,186 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.9921 | 円 |

< J P M北米高配当・成長株ファンド(米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型) >

(平成30年9月28日現在)

| 種類 | 金額 | 単位 |
|----------------|-------------|----|
| 資産総額 | 375,407,413 | 円 |
| 負債総額 | 8,942,035 | 円 |
| 純資産総額(-) | 366,465,378 | 円 |
| 発行済口数 | 219,482,284 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.6697 | 円 |

(参考) G I M北米高配当株式マザーファンド(適格機関投資家専用)

(平成30年9月28日現在)

| 種類 | 金額 | 単位 |
|----------------|----------------|----|
| 資産総額 | 10,805,807,464 | 円 |
| 負債総額 | 56,343,176 | 円 |
| 純資産総額(-) | 10,749,464,288 | 円 |
| 発行済口数 | 4,305,993,979 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 2.4964 | 円 |

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

資本金の額（平成30年3月末現在）

（略）

（略）

投資運用の意思決定機構

（イ）（略）

（ロ）債券運用部

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

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

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

<訂正後>

資本金の額（平成30年9月末現在）

（略）

（略）

投資運用の意思決定機構

（イ）（略）

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

（注）前記（イ）および（ロ）の意思決定機構、組織名称等は、平成30年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

（略）

委託会社が設定・運用している投資信託は、平成30年3月末現在以下のとおりです（親投資信託は本数のみ。）。

| | | |
|--|----|-----------|
| | 本数 | 純資産額（百万円） |
|--|----|-----------|

| | | |
|-------------|-----|-----------|
| 公募追加型株式投資信託 | 74 | 989,787 |
| 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 | 59 | 3,523,158 |
| 総合計 | 133 | 4,512,945 |
| 親投資信託 | 52 | - |

（注）百万円未満は四捨五入

< 訂正後 >

（略）

委託会社が設定・運用している投資信託は、平成30年9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 | 70 | 1,014,687 |
| 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 | 59 | 3,111,726 |
| 総合計 | 129 | 4,126,413 |
| 親投資信託 | 51 | - |

（注）百万円未満は四捨五入

3【委託会社等の経理状況】

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、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・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。

なお、財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

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

(1) 【貸借対照表】

千円単位未満切捨て

| | | 第27期 (平成29年3月31日) | | | 第28期 (平成30年3月31日) | | |
|-----------|----------|----------------------|------------|-------|----------------------|------------|-------|
| 資産の部 | | | | | | | |
| 区分 | 注記 番号 | 内訳 | 金額 | 構成比 | 内訳 | 金額 | 構成比 |
| | | (千円) | (千円) | (%) | (千円) | (千円) | (%) |
| 流動資産 | | | | | | | |
| 現金及び預金 | | | 7,919,624 | | | 11,797,632 | |
| 前払費用 | | | 81,921 | | | 24,288 | |
| 未収入金 | | | 94,878 | | | 36,147 | |
| 未収委託者報酬 | | | 2,164,813 | | | 2,408,280 | |
| 未収収益 | | | 1,516,624 | | | 1,464,696 | |
| 関係会社短期貸付金 | | | 4,010,000 | | | 4,751,000 | |
| その他 | | | 14,622 | | | 14,055 | |
| 流動資産計 | | | 15,802,485 | 82.1 | | 20,496,100 | 98.6 |
| 固定資産 | | | | | | | |
| 投資その他の資産 | | | 3,452,553 | | | 294,112 | |
| 関係会社株式 | | 60,000 | | | 60,000 | | |
| 投資有価証券 | | 2,759,853 | | | 27 | | |
| 敷金保証金 | | 566,849 | | | 97,612 | | |
| 前払年金費用 | | 46,350 | | | 60,699 | | |
| その他 | | 19,500 | | | 75,773 | | |
| 固定資産計 | | | 3,452,553 | 17.9 | | 294,112 | 1.4 |
| 資産合計 | | | 19,255,038 | 100.0 | | 20,790,213 | 100.0 |

千円単位未満切捨て

| | | 第27期 (平成29年3月31日) | | | 第28期 (平成30年3月31日) | | |
|---------|----------|----------------------|-----------|------|----------------------|-----------|------|
| 負債の部 | | | | | | | |
| 区分 | 注記 番号 | 内訳 | 金額 | 構成比 | 内訳 | 金額 | 構成比 |
| | | (千円) | (千円) | (%) | (千円) | (千円) | (%) |
| 流動負債 | | | | | | | |
| 預り金 | | | 175,021 | | | 219,484 | |
| 未払金 | | | 1,701,719 | | | 1,762,101 | |
| 未払手数料 | | 1,022,204 | | | 1,193,819 | | |
| その他未払金 | | 679,514 | | | 568,282 | | |
| 未払費用 | | | 519,313 | | | 539,165 | |
| 未払法人税等 | | | 171,122 | | | 624,002 | |
| 賞与引当金 | | | 564,151 | | | 634,004 | |
| 役員賞与引当金 | | | 29,369 | | | - | |
| 流動負債計 | | | 3,160,696 | 16.4 | | 3,778,757 | 18.2 |
| 固定負債 | | | | | | | |
| 長期未払金 | | | 270,047 | | | 349,014 | |
| 賞与引当金 | | | 343,597 | | | 308,985 | |
| 役員賞与引当金 | | | 215,556 | | | - | |
| 固定負債計 | | | 829,201 | 4.3 | | 658,000 | 3.1 |
| 負債合計 | | | 3,989,897 | 20.7 | | 4,436,757 | 21.3 |

千円単位未満切捨て

| | | 第27期 (平成29年3月31日) | | | 第28期 (平成30年3月31日) | | |
|--------------|----------|----------------------|------------|-------|----------------------|------------|-------|
| 純資産の部 | | | | | | | |
| 区分 | 注記 番号 | 内訳 | 金額 | 構成比 | 内訳 | 金額 | 構成比 |
| | | (千円) | (千円) | (%) | (千円) | (千円) | (%) |
| 株主資本 | | | | | | | |
| 資本金 | | | 2,218,000 | 11.5 | | 2,218,000 | 10.7 |
| 資本剰余金 | | | 1,000,000 | 5.2 | | 1,000,000 | 4.8 |
| 資本準備金 | | 1,000,000 | | | 1,000,000 | | |
| 利益剰余金 | | | 12,088,317 | 62.8 | | 13,135,458 | 63.2 |
| 利益準備金 | | 33,676 | | | 33,676 | | |
| その他利益剰余金 | | | | | | | |
| 繰越利益剰余金 | | 12,054,640 | | | 13,101,782 | | |
| 株主資本計 | | | 15,306,317 | 79.5 | | 16,353,458 | 78.7 |
| 評価・換算差額等 | | | | | | | |
| その他有価証券評価差額金 | | | 41,176 | 0.2 | | 2 | 0.0 |
| 評価・換算差額等計 | | | 41,176 | 0.2 | | 2 | 0.0 |
| 純資産合計 | | | 15,265,140 | 79.3 | | 16,353,456 | 78.7 |
| 負債・純資産合計 | | | 19,255,038 | 100.0 | | 20,790,213 | 100.0 |

(2) 【損益計算書】

| 区分 | 注記 番号 | 第27期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) | | | 第28期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日) | | |
|---------|----------|-------------------------------------|------------|-------|-------------------------------------|------------|-------|
| | | 内訳 | 金額 | 百分比 | 内訳 | 金額 | 百分比 |
| | | (千円) | (千円) | (%) | (千円) | (千円) | (%) |
| 営業収益 | | | | | | | |
| 委託者報酬 | | | 10,502,704 | | | 12,446,131 | |
| 運用受託報酬 | | | 6,255,461 | | | 5,788,387 | |
| 業務受託報酬 | | | 930,841 | | | 1,430,987 | |
| その他営業収益 | | | 233,636 | | | 348,871 | |
| 営業収益計 | | | 17,922,643 | 100.0 | | 20,014,377 | 100.0 |
| 営業費用 | | | | | | | |
| 支払手数料 | | | 4,853,805 | | | 6,209,103 | |
| 広告宣伝費 | | | 206,076 | | | 153,740 | |
| 調査費 | | | 1,932,704 | | | 1,897,150 | |
| 委託調査費 | | 1,557,743 | | | 1,555,380 | | |
| 調査費 | | 367,964 | | | 324,761 | | |
| 図書費 | | 6,996 | | | 17,007 | | |
| 委託計算費 | | | 259,648 | | | 303,836 | |
| 営業雑経費 | | | 275,317 | | | 286,552 | |
| 通信費 | | 18,593 | | | 13,917 | | |
| 印刷費 | | 224,875 | | | 241,049 | | |
| 協会費 | | 27,416 | | | 28,217 | | |
| 諸会費 | | 4,432 | | | 3,369 | | |
| 営業費用計 | | | 7,527,551 | 42.0 | | 8,850,383 | 44.2 |

| 区分 | 注記 番号 | 第27期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) | | | 第28期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日) | | |
|---------------|----------|-------------------------------------|------------|------|-------------------------------------|-----------|------|
| | | 内訳 | 金額 | 百分比 | 内訳 | 金額 | 百分比 |
| | | (千円) | (千円) | (%) | (千円) | (千円) | (%) |
| 一般管理費 | | | | | | | |
| 給料 | | | 5,191,023 | | | 5,064,982 | |
| 役員報酬 | | 98,502 | | | - | | |
| 役員報酬及び賞与 | | - | | | 302,393 | | |
| 給料・手当 | | 3,482,336 | | | 3,186,497 | | |
| 賞与 | | 761,594 | | | 905,378 | | |
| 賞与引当金繰入額 | | 564,129 | | | 670,712 | | |
| 役員賞与 | | 142,286 | | | - | | |
| 役員賞与引当金繰入額 | | 142,172 | | | - | | |
| 福利厚生費 | | | 425,804 | | | 393,358 | |
| 交際費 | | | 21,435 | | | 17,403 | |
| 寄付金 | | | 12,137 | | | 11,544 | |
| 旅費交通費 | | | 175,300 | | | 149,516 | |
| 租税公課 | | | 120,270 | | | 140,135 | |
| 不動産関連費 | | | 1,157,897 | | | 1,114,905 | |
| 退職給付費用 | | | 280,167 | | | 248,750 | |
| 退職金 | | | 452,126 | | | 154,442 | |
| 役員退職慰労金 | | | 37,000 | | | - | |
| 消耗器具備品費 | | | 53,010 | | | 50,426 | |
| 事務委託費 | | | 344,828 | | | 331,399 | |
| 関係会社等配賦経費 | | | 2,369,810 | | | 2,062,711 | |
| 諸経費 | | | 96,976 | | | 96,551 | |
| 一般管理費計 | | | 10,737,789 | 59.9 | | 9,836,127 | 49.2 |
| 営業利益又は営業損失() | | | 342,697 | 1.9 | | 1,327,866 | 6.6 |

| 区分 | 注記 番号 | 第27期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) | | | 第28期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日) | | |
|---------------------|----------|-------------------------------------|---------|-----|-------------------------------------|-----------|-----|
| | | 内訳 | 金額 | 百分比 | 内訳 | 金額 | 百分比 |
| | | (千円) | (千円) | (%) | (千円) | (千円) | (%) |
| 営業外収益 | | | | | | | |
| 受取配当金 | 1 | 465,000 | | | 454,000 | | |
| 投資有価証券売却益 | | 25,787 | | | 86,573 | | |
| 受取利息 | 1 | 17,222 | | | 14,113 | | |
| 為替差益 | | 42,082 | | | - | | |
| その他営業外収益 | | 36,197 | | | 34,949 | | |
| 営業外収益計 | | | 586,291 | 3.3 | | 589,637 | 2.9 |
| 営業外費用 | | | | | | | |
| 投資有価証券売却損 | | 39,665 | | | 1,447 | | |
| 為替差損 | | - | | | 25,196 | | |
| その他営業外費用 | | 18 | | | 4,484 | | |
| 営業外費用計 | | | 39,684 | 0.2 | | 31,128 | 0.1 |
| 経常利益 | | | 203,909 | 1.2 | | 1,886,375 | 9.4 |
| 税引前当期純利益 | | | 203,909 | 1.2 | | 1,886,375 | 9.4 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | | 214,690 | 1.2 | | 839,234 | 4.2 |
| 法人税等調整額 | | | 301,667 | 1.7 | | - | - |
| 当期純利益又は当期純損失 () | | | 312,448 | 1.7 | | 1,047,141 | 5.2 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

第27期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | | |
|-----------------------------|-----------|-----------|-----------|--------|------------|---------------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益剰余金 | 利益剰余金 | | 株主資本合計 |
| | | 資本準備金 | 資本剰余金合計 | | 利益準備金 | その他利益剰余金 繰越利益剰余金 | |
| 当期首残高 | 2,218,000 | 1,000,000 | 1,000,000 | 33,676 | 12,367,089 | 12,400,766 | 15,618,766 |
| 当期変動額 | | | | | | | |
| 当期純損失 （ ） | - | - | - | - | 312,448 | 312,448 | 312,448 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額） | - | - | - | - | - | - | - |
| 当期変動額合計 | - | - | - | - | 312,448 | 312,448 | 312,448 |
| 当期末残高 | 2,218,000 | 1,000,000 | 1,000,000 | 33,676 | 12,054,640 | 12,088,317 | 15,306,317 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-----------------------------|----------------------|--------------------|------------|
| | その他有 価証券評 価差額金 | 評価・換 算差額等 合計 | |
| 当期首残高 | 33,579 | 33,579 | 15,585,186 |
| 当期変動額 | | | |
| 当期純損失 （ ） | - | - | 312,448 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額） | 7,597 | 7,597 | 7,597 |
| 当期変動額合計 | 7,597 | 7,597 | 320,046 |
| 当期末残高 | 41,176 | 41,176 | 15,265,140 |

第28期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | | |
|-----------------------------|-----------|-----------|-------------|--------|-----------------------------|-------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益剰余金 | | | 株主資本 合計 |
| | | 資本準備金 | 資本剰余金 合計 | 利益準備金 | その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金 | 利益剰余金 合計 | |
| 当期首残高 | 2,218,000 | 1,000,000 | 1,000,000 | 33,676 | 12,054,640 | 12,088,317 | 15,306,317 |
| 当期変動額 | | | | | | | |
| 当期純利益 | - | - | - | - | 1,047,141 | 1,047,141 | 1,047,141 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額） | - | - | - | - | - | - | - |
| 当期変動額合計 | - | - | - | - | 1,047,141 | 1,047,141 | 1,047,141 |
| 当期末残高 | 2,218,000 | 1,000,000 | 1,000,000 | 33,676 | 13,101,782 | 13,135,458 | 16,353,458 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-----------------------------|----------------------|--------------------|------------|
| | その他有 価証券評 価差額金 | 評価・換 算差額等 合計 | |
| 当期首残高 | 41,176 | 41,176 | 15,265,140 |
| 当期変動額 | | | |
| 当期純利益 | - | - | 1,047,141 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額） | 41,174 | 41,174 | 41,174 |
| 当期変動額合計 | 41,174 | 41,174 | 1,088,315 |
| 当期末残高 | 2 | 2 | 16,353,456 |

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

期末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。

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、当事業年度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、及び親会社の運営する株式報酬制度に係る将来の費用負担に備えるため、当事業年度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、当事業年度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、当事業年度末においては、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事業年度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。

過去勤務費用については、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．その他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。

未適用の会計基準等

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）

「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

平成34年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

| 第27期 （平成29年3月31日） | 第28期 （平成30年3月31日） |
|---|---|
| 関係会社項目 関係会社に対する資産および負債には区分掲記されたもの以外に注記すべき事項はありません。 | 関係会社項目 関係会社に対する資産および負債には区分掲記されたもの以外に注記すべき事項はありません。 |

（損益計算書関係）

| 第27期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日） | 第28期 （自平成29年4月1日 至平成30年3月31日） |
|--|--|
| 1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。 関係会社からの受取利息 17,222千円 関係会社からの受取配当金 465,000千円 | 1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。 関係会社からの受取利息 14,112千円 関係会社からの受取配当金 454,000千円 |

（株主資本等変動計算書関係）

第27期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

発行済株式の種類及び総数に関する事項

| | 当事業年度期首 株式数（株） | 当事業年度 増加株式数（株） | 当事業年度 減少株式数（株） | 当事業年度末 株式数（株） |
|-------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 発行済株式 | | | | |
| 普通株式 | 56,265 | - | - | 56,265 |
| 合計 | 56,265 | - | - | 56,265 |

第28期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

発行済株式の種類及び総数に関する事項

| | 当事業年度期首 株式数（株） | 当事業年度 増加株式数（株） | 当事業年度 減少株式数（株） | 当事業年度末 株式数（株） |
|-------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 発行済株式 | | | | |
| 普通株式 | 56,265 | - | - | 56,265 |
| 合計 | 56,265 | - | - | 56,265 |

（リース取引関係）

| 第27期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) | 第28期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日) |
|---|-------------------------------------|
| オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料は以下のとおりであります。 | 該当事項はありません。 |
| 1年以内 | 672,813千円 |
| 1年超 | 2,019,195千円 |
| 合計 | 2,692,009千円 |

（金融商品関係）

(1) 金融商品の状況に関する事項

金融商品に対する取組方針

自社が設定する投資信託やグループ会社が運用する投資信託について、その設定時に運用上十分な信託財産があることが見込めない場合に、「シードキャピタル」として当該投資信託を自己資金により取得することがあります。

当社は、営業活動援助のため、子会社であるJPMAMジャパン・ケイマン・ファンド・リミテッドへの短期貸付を行っております。

金融商品の内容及びそのリスク

営業債権のうち、自社が設定・運用する投資信託から受領する未収委託者報酬、及び未収収益のうち国内年金基金等から受領する債権については信託銀行により分別管理されている信託財産から回収され、一般債権とは異なり、信用リスクは極めて低いと認識しております。海外グループ会社に対する未収収益は未払費用と部分的に相殺され、信用リスクが軽減されております。また、外貨建て債権の未収収益については為替の変動リスクに晒されておりますが、外貨建て債務と部分的に相殺され、為替変動リスクが軽減されております。

営業債務である未払金は基本的に3ヶ月以内の支払い期日であり、未払手数料、及び未払費用についてはそのほとんどが6ヶ月以内の支払い期日であります。一部外貨建てのものについては、為替の変動リスクに晒されておりますが、上述の通り外貨建て債権と部分的に相殺され、リスクが軽減されております。

関係会社に対し短期貸付を行っており、関係会社短期貸付金は貸出先の信用リスクに晒されております。関係会社短期貸付金は、3ヶ月の期日であり、金利の変動リスクは僅少です。

投資有価証券は、上述のシードキャピタルであり、市場価格の変動リスクに晒されております。

敷金保証金は建物等の賃貸契約に関連する保証金であり、差入先の信用リスクに晒されております。

金融商品に係るリスク管理体制

() 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権のうち、海外グループ会社に対する未収収益は担当部署が各関係会社ごとに期日及び残高を定期的に管理し、回収懸念の早期把握を図っております。

関係会社短期貸付金は、子会社であるJPMAMジャパン・ケイマン・ファンド・リミテッドの営業活動から得られるキャッシュ・フローをモニタリングしており、貸倒や回収遅延の懸念はほぼないと認識しております。

() 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

外貨建ての営業債権債務のうち、大半を占める米国ドル建ての債権債務に対しての為替変動リスクについては担当部署が月次でモニタリングしており、債権もしくは債務の超過に対して米国ドル建て預金と円建て預金との間で資金移動をして為替変動リスクの軽減に努めております。

() 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

各部署からの報告に基づき担当部署が適宜資金繰計画を作成・更新するとともに、手許流動性の維持などにより流動性リスクを管理しております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

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）。

第27期（平成29年3月31日）

（単位：千円）

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|---------------|------------|------------|-----|
| (1) 現金及び預金 | 7,919,624 | 7,919,624 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 2,164,813 | 2,164,813 | - |
| (3) 未収収益 | 1,516,624 | 1,516,624 | - |
| (4) 関係会社短期貸付金 | 4,010,000 | 4,010,000 | - |
| (5) 投資有価証券 | 2,759,853 | 2,759,853 | - |
| (6) 敷金保証金 | 566,849 | 565,851 | 998 |
| 資産計 | 18,937,765 | 18,936,766 | 998 |
| (1) 未払手数料 | 1,022,204 | 1,022,204 | - |
| (2) その他未払金 | 679,514 | 679,514 | - |
| (3) 未払費用 | 519,313 | 519,313 | - |
| (4) 長期未払金 | 270,047 | 269,540 | 506 |
| 負債計 | 2,491,079 | 2,490,573 | 506 |

(注) 1 . 金融商品の時価算定方法

資産

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

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

(5) 投資有価証券

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

(6) 敷金保証金

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

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、及び(3) 未払費用

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

(4) 長期未払金

長期未払金の時価については、当該未払金の支払までの期間を基に、日本国債の利回りで割り引いた現在価値により算定しております。

(注) 2 . 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

| | 貸借対照表計上額 |
|--------|----------|
| 関係会社株式 | 60,000 |

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

第28期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|---------------|------------|------------|----|
| (1) 現金及び預金 | 11,797,632 | 11,797,632 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 2,408,280 | 2,408,280 | - |
| (3) 未収収益 | 1,464,696 | 1,464,696 | - |
| (4) 関係会社短期貸付金 | 4,751,000 | 4,751,000 | - |
| 資産計 | 20,421,609 | 20,421,609 | - |
| (1) 未払手数料 | 1,193,819 | 1,193,819 | - |
| (2) その他未払金 | 568,282 | 568,282 | - |
| (3) 未払費用 | 539,165 | 539,165 | - |
| (4) 長期未払金 | 349,014 | 349,014 | - |
| 負債計 | 2,650,281 | 2,650,281 | - |

(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)

| | 貸借対照表計上額 |
|--------|----------|
| 関係会社株式 | 60,000 |

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

金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第27期（平成29年3月31日）

（単位：千円）

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|-----------|------------|-------------|--------------|------|
| 現金及び預金 | 7,919,624 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 2,164,813 | - | - | - |
| 未収収益 | 1,516,624 | - | - | - |
| 関係会社短期貸付金 | 4,010,000 | - | - | - |
| 敷金保証金 | - | 521,736 | 45,113 | - |
| 合計 | 15,611,062 | 521,736 | 45,113 | - |

第28期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|-----------|------------|-------------|--------------|------|
| 現金及び預金 | 11,797,632 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 2,408,280 | - | - | - |
| 未収収益 | 1,464,696 | - | - | - |
| 関係会社短期貸付金 | 4,751,000 | - | - | - |
| 合計 | 20,421,609 | - | - | - |

(有価証券関係)

1. 関係会社株式

関係会社株式(第27期の貸借対照表計上額は60,000千円、第28期の貸借対照表計上額は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

第27期(平成29年3月31日)

(単位:千円)

| | 種類 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|----------------------|---------|-----------|-----------|--------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | その他投資信託 | - | - | - |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | その他投資信託 | 2,759,853 | 2,801,030 | 41,176 |
| 合計 | | 2,759,853 | 2,801,030 | 41,176 |

第28期(平成30年3月31日)

(単位:千円)

| | 種類 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|----------------------|---------|----------|------|----|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | その他投資信託 | - | - | - |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | その他投資信託 | 27 | 30 | 2 |
| 合計 | | 27 | 30 | 2 |

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第27期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

(単位:千円)

| 種類 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|---------|---------|---------|---------|
| その他投資信託 | 786,122 | 25,787 | 39,665 |

第28期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

(単位:千円)

| 種類 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|---------|-----------|---------|---------|
| その他投資信託 | 2,886,126 | 86,573 | 1,447 |

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は確定拠出型年金制度、及びキャッシュバランス型年金制度を採用しております。

2．キャッシュバランス型年金制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

| | 第27期 (平成29年3月31日) | 第28期 (平成30年3月31日) |
|--------------|----------------------|----------------------|
| | (千円) | (千円) |
| 退職給付債務の期首残高 | 1,410,557 | 1,438,648 |
| 勤務費用 | 193,312 | 185,799 |
| 利息費用 | 5,642 | 5,755 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 13,617 | 12,545 |
| 退職給付の支払額 | 157,246 | 240,916 |
| 退職給付債務の期末残高 | 1,438,648 | 1,376,741 |

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

| | 第27期 (平成29年3月31日) | 第28期 (平成30年3月31日) |
|--------------|----------------------|----------------------|
| | (千円) | (千円) |
| 年金資産の期首残高 | 1,506,662 | 1,596,600 |
| 期待運用収益 | 12,053 | 11,176 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 43,384 | 58,590 |
| 事業主からの拠出額 | 191,747 | 175,947 |
| 退職給付の支払額 | 157,246 | 240,916 |
| 年金資産の期末残高 | 1,596,600 | 1,601,397 |

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

| | 第27期 (平成29年3月31日) | 第28期 (平成30年3月31日) |
|---------------------|----------------------|----------------------|
| | (千円) | (千円) |
| 積立型制度の退職給付債務 | 1,438,648 | 1,376,741 |
| 年金資産 | 1,596,600 | 1,601,397 |
| | 157,952 | 224,656 |
| 未認識数理計算上の差異 | 111,084 | 163,853 |
| 未認識過去勤務費用 | 518 | 104 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 46,350 | 60,699 |
| 前払年金費用 | 46,350 | 60,699 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 46,350 | 60,699 |

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

| | 第27期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) | 第28期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日) |
|-----------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| | (千円) | (千円) |
| 勤務費用 | 193,312 | 185,799 |
| 利息費用 | 5,642 | 5,755 |
| 期待運用収益 | 12,053 | 11,176 |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 5,775 | 18,366 |
| 過去勤務債務の費用処理額 | 414 | 414 |
| その他(注1) | 18,916 | 13,607 |
| キャッシュバランス型年金制度に係る退職給付費用(注2) | 199,628 | 175,205 |

(注1) その他の金額は、主に当社への出向者分の退職給付費用であります。

(注2) 当社からの出向者分の退職給付費用は、上記金額に含まれておりません。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

| | 第27期 (平成29年3月31日) | 第28期 (平成30年3月31日) |
|--------|----------------------|----------------------|
| 債券 | 51% | 49% |
| 株式 | 21% | - |
| 現金及び預金 | 28% | 51% |
| 合計 | 100% | 100% |

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

| | 第27期 (平成29年3月31日) | 第28期 (平成30年3月31日) |
|---------------|----------------------|----------------------|
| 主要な数理計算上の計算基礎 | | |
| 割引率 | 0.4% | 0.4% |
| 長期期待運用収益率 | 0.8% | 0.7% |

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第27期事業年度80,539千円、第28期事業年度73,544千円でありませ

ず。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

| （流動） | 第27期 | 第28期 |
|----------------------|--------------|--------------|
| | （平成29年3月31日） | （平成30年3月31日） |
| | （千円） | （千円） |
| 繰延税金資産 | | |
| 未払費用 | 19,008 | 29,529 |
| 未払事業税 | 10,802 | 40,523 |
| 賞与引当金 | 174,097 | 160,384 |
| その他 | 2,084 | 37 |
| 繰延税金資産小計 | 205,992 | 230,473 |
| 評価性引当額 | 205,992 | 230,473 |
| 繰延税金資産合計 | - | - |
| 繰延税金資産又は繰延税金負債（ ）の純額 | - | - |

| （固定） | （千円） | |
|----------------------|---------|---------|
| | 繰延税金資産 | |
| 賞与引当金 | 105,620 | 80,244 |
| 長期未払費用 | 106,580 | 94,199 |
| 長期前払費用 | - | 76,161 |
| 減価償却超過額 | 9,292 | 113,576 |
| その他 | 5,764 | 12,728 |
| 繰延税金資産小計 | 227,256 | 351,452 |
| 評価性引当額 | 227,256 | 351,452 |
| 繰延税金資産合計 | - | - |
| 繰延税金資産又は繰延税金負債（ ）の純額 | - | - |

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

| 法定実効税率 | 第27期 | 第28期 |
|--------------------|--------------|--------------|
| | （平成29年3月31日） | （平成30年3月31日） |
| | 30.86% | 30.86% |
| （調整） | | |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 68.83% | 4.40% |
| 評価性引当額 | 153.24% | 3.16% |
| 住民税等均等割 | 2.84% | 0.31% |
| 過年度法人税等 | - | 5.67% |
| その他 | 2.54% | 0.09% |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 253.23% | 44.49% |

（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27期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1．サービスごとの情報

（単位：千円）

| | 投資信託委託業務 | 投資一任及び 投資助言業務 | 業務受託報酬 | その他 | 合計 |
|-----------|------------|------------------|---------|---------|------------|
| 外部顧客への売上高 | 10,502,704 | 6,255,461 | 930,841 | 233,636 | 17,922,643 |

2．地域ごとの情報

営業収益

（単位：千円）

| 日本 | その他 | 合計 |
|------------|-----------|------------|
| 13,233,778 | 4,688,865 | 17,922,643 |

（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。

第28期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

1．サービスごとの情報

（単位：千円）

| | 投資信託委託業務 | 投資一任及び 投資助言業務 | 業務受託報酬 | その他 | 合計 |
|-----------|------------|------------------|-----------|---------|------------|
| 外部顧客への売上高 | 12,446,131 | 5,788,387 | 1,430,987 | 348,871 | 20,014,377 |

2．地域ごとの情報

営業収益

（単位：千円）

| 日本 | 英国 | その他 | 合計 |
|------------|-----------|-----------|------------|
| 14,455,359 | 2,072,302 | 3,486,715 | 20,014,377 |

（注）営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

| 顧客の名称 | 営業収益 | 関連するセグメント |
|--|-----------|-----------|
| JPMorgan Asset Management (UK) Limited | 2,062,917 | 資産運用業 |

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

第27期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

子会社

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金 | 事業の内容 | 議決権等の所有（被所有）割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|-----|----------------------------|-----------------------|----------|-------------------|----------------|---------------|----------|------------|---------------|-----------|
| 子会社 | JPMAMジャパン・ケイマン・ファン・ド・リミテッド | 英国領ケイマン諸島 グランドケイマン | 3,500千円 | 外国投資信託の管理会社としての業務 | 所有直接100% | 資金の貸借等及び役員の兼任 | 資金の貸付（注） | 17,226,000 | 関係会社 短期貸付金 | 4,010,000 |
| | | | | | | | 資金の回収 | 18,785,000 | | |
| | | | | | | | 受取利息 | 17,222 | 未収収益 | 2,403 |
| | | | | | | | 配当の受取 | 465,000 | - | - |

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

資金の貸付については、貸付利率は市場金利を勘案して利率を合理的に決定しており、返済条件は期間3ヶ月であります。なお、担保は受け入れておりません。

兄弟会社等

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金 | 事業の内容 | 議決権等の所有（被所有）割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|-------------------------|--|-------------|--------------|----------------------|----------------|--------------|--------|-----------|-------|----------|
| 最終的な親会社 が同一である 会社 | JPMorgan Asset Management (UK) Limited | 英国 ロンドン | 24百万 ポンド | 投資運用業 | なし | 投資の助言または投資一任 | 運用受託報酬 | 1,436,993 | 未収収益 | 475,203 |
| | | | | | | | 調査費 | 1,090,963 | 未払費用 | 314,255 |
| 最終的な親会社 が同一である 会社 | JF Asset Management Limited | 香港 セントラル | 60百万 香港ドル | 投資運用業 | なし | 投資の助言または投資一任 | 運用受託報酬 | 529,053 | 未収収益 | 346,130 |
| 最終的な親会社 が同一である 会社 | ジェー・ピー・モルガン・サービス・ジャパン・リミテッド 東京支店 | 東京都 千代田区 | 1千米ドル | 不動産の売買・賃貸借および総務の代行業等 | なし | 総務の代行 | 不動産賃借料 | 26,070 | 敷金保証金 | 532,670 |

（注1）ジェー・ピー・モルガン・サービス・ジャパン・リミテッド東京支店に関するものを除き、取引金額および期末残高には、消費税等は含まれておりません。

（注2）取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬及び調査費に関しては、運用の再委託の一般的な手数料率を勘案し、協議の上、再委託契約を結んで行っております。

第28期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

親会社

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金 | 事業の内容 | 議決権等の所有（被所有）割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|-----|-----------------------------|--------------|------------------|-------|-------------------|-----------|-------|----------|-----|----------|
| 親会社 | JPMorgan Chase Holdings LLC | 米国 ニューヨーク | 222,090 百万米ドル | 持株会社 | 被所有 間接 100% | 人件費の立替 | - | - | 未払金 | 450,778 |

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

当社の役職員への賞与の支払いの一部はJPMorgan Chase Holdings LLC（以下、「親会社」という。）により行われております。これらの費用は親会社より当社に請求されるものであり、未払いの金額については親会社に対する債務として処理しております。

子会社

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金 | 事業の内容 | 議決権等の所有（被所有）割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|-----|----------------------------|---------------------------|----------|-------------------------------|------------------|-----------------------|--------------|------------|---------------|-----------|
| 子会社 | JPMAMジャパン・ケイマン・ファン・ド・リミテッド | 英国領 ケイマン諸島 グランドケイマン | 3,500千円 | 外国投資 信託の管理 会社としての業 務 | 所有 直接 100% | 資金の貸借等 及び役員の兼 任 | 資金の貸付 (注) | 17,069,000 | 関係会社 短期貸付金 | 4,751,000 |
| | | | | | | | 資金の回収 | 16,328,000 | | |
| | | | | | | | 受取利息 | 14,112 | 未収収益 | 96 |
| | | | | | | | 配当の受取 | 454,000 | - | - |

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

資金の貸付については、貸付利率は市場金利を勘案して利率を合理的に決定しており、返済条件は期間3ヶ月であります。なお、担保は受け入れておりません。

兄弟会社等

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金 | 事業の内容 | 議決権等の所有（被所有）割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|-------------------------|--|-------------|------------------|-------------|----------------|------------------|------------|-----------|------|----------|
| 最終的な親会社 が同一である 会社 | JPMorgan Asset Management (UK) Limited | 英国 ロンドン | 24百万 ポンド | 投資運用業 | なし | 投資の助言 または投資一任 | 調査費 | 1,077,595 | 未払費用 | 291,063 |
| 最終的な親会社 が同一である 会社 | JF Asset Management Limited | 香港 セントラル | 60百万 香港ドル | 投資運用業 | なし | 投資の助言 または投資一任 | 運用受託 報酬 | 1,708,734 | 未収収益 | 511,882 |
| 最終的な親会社 が同一である 会社 | J Pモルガン証券株式会社 | 東京都 千代田区 | 73,272,250 千円 | 金融商品 取引業 | なし | 職員の兼職 | 一般管理 費 | 1,409,458 | 未払金 | 116,223 |

(注1) 取引金額および期末残高には、消費税等は含まれておりません。

(注2) 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬及び調査費に関しては、運用の再委託の一般的な手数料率を勘案し、協議の上、再委託契約を結んで行っております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

直接親会社 J Pモルガン・アセット・マネジメント（アジア）インク（非上場）

最終的な親会社 J Pモルガン・チェース・アンド・カンパニー（ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所に上場）

（ 1 株当たり情報）

| | 第27期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) | 第28期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日) |
|---------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 1株当たり純資産額 | 271,307.93円 | 290,650.60円 |
| 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失() | 5,553.17円 | 18,610.88円 |

なお、当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。また、前事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、1株当たり当期純損失金額であり、また潜在株式が存在していないため記載しておりません。

1株当たりの当期純利益の算定上の基礎

| | 第27期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) | 第28期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日) |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 損益計算書上の当期純利益又は当期純損失() | 312,448千円 | 1,047,141千円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益又は当期純損失() | 312,448千円 | 1,047,141千円 |
| 普通株式の期中平均株式数 | 56,265株 | 56,265株 |

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1) 受託会社

名 称 三井住友信託銀行株式会社
 資本金の額 342,037百万円（平成29年9月末現在）
 （略）

(2) 販売会社

| | 名 称 | 資本金の額 (平成29年9月末現在) | 事業の内容 |
|-----|--------------|-----------------------|-------|
| (略) | | | |
| 6 | フィデリティ証券株式会社 | 8,157百万円 | 同 上 |
| 7 | 松井証券株式会社*4 | 11,945百万円 | 同 上 |
| (略) | | | |

(略)

*4 平成30年5月28日より「3ヵ月決算型」の取扱いを開始する予定です。

(3) 運用委託先の会社

| | 名 称 | 資本金の額 (平成29年9月末現在) | 事業の内容 |
|-----|-----|-----------------------|-------|
| (略) | | | |

<訂正後>

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

| | 名 称 | 資本金の額 (平成30年3月末現在) | 事業の内容 |
|-----|--------------|-----------------------|-------|
| (略) | | | |
| 6 | フィデリティ証券株式会社 | 8,557百万円 | 同 上 |
| 7 | 松井証券株式会社*4 | 11,945百万円 | 同 上 |
| (略) | | | |

(略)

*4 「3ヵ月決算型」を取扱います。

(3) 運用委託先の会社

| 名 称 | 資本金の額 (平成30年3月末現在) | 事業の内容 |
|-----|-----------------------|-------|
| (略) | | |

独立監査人の監査報告書

平成30年10月17日

J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会御中

P w C あらた有限責任監査法人

| | | |
|--------------------|-------|------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 荒川進 |
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 山口健志 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているJPM北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）の平成30年2月27日から平成30年8月27日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、JPM北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3ヵ月決算型）の平成30年8月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成30年10月17日

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会御中

P w C あらた有限責任監査法人

| | | |
|--------------------|-------|------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 荒川進 |
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 山口健志 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているJPM北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）の平成30年2月27日から平成30年8月27日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、JPM北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3ヵ月決算型）の平成30年8月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

JPMオルガン・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](#)

独立監査人の監査報告書

平成30年10月17日

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御 中

P w C あらた有限責任監査法人

| | | |
|--------------------|-------|---------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 荒 川 進 |
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 山 口 健 志 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているJPM北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年2回決算型）の平成30年2月27日から平成30年8月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、JPM北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年2回決算型）の平成30年8月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

JPMオルガン・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](#)

独立監査人の監査報告書

平成30年10月17日

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御 中

P w C あらた有限責任監査法人

| | | |
|--------------------|-------|---------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 荒 川 進 |
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 山 口 健 志 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているJPM北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型）の平成30年2月27日から平成30年8月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、JPM北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年2回決算型）の平成30年8月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

JPMオルガン・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](#)

独立監査人の監査報告書

平成30年6月15日

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会御中

P w C あらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているJ P モルガン・アセット・マネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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。